◇MUZ-261525-0000-20221213◇

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合
信託期間	2027年３月12日まで（2017年２月７日設定）
運用方針	利子収益および配当収益の確保ならびに値上がり益の獲得をめざして運用を行います。
主要運用対象	投資信託証券
運用方法	・日本を含む世界各国の株式、債券、リートおよび金に分散投資を行います。 ・目標リスク水準を年率標準偏差8.0%とします。（目標リスク水準は、当ファンドの変動リスクの目処を表示したもので、当ファンドのポートフォリオを構築する際の目標値として使用します。） ・三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社 投資顧問部からアドバイスを受け、運用を行います。 ・金の投資信託証券の組入部分については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をはかります。
主な組入制限	・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・株式への直接投資は行いません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。原則として、決算日の基準価額水準が当初元本額10,000円（10,000口当たり）を超えている場合には、当該超えている部分について、分配対象額の範囲内で、全額分配を行います。（資金動向や市況動向等により変更する場合があります。）

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

運用報告書（全体版）

スマート・クオリティ・オープン・ゴールド（安定成長型）

愛称：スマラップ・ゴールド

第23期（決算日：2022年９月13日）
第24期（決算日：2022年12月13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「スマート・クオリティ・オープン・ゴールド（安定成長型）」は、去る12月13日に第24期の決算を行いましたので、法令に基づいて第23期～第24期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG
三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先	
お客さま専用フリーダイヤル	０１２０－１５１０３４ （受付時間：営業日の9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～１月３日を除く）
お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。	

本資料の表記にあたって

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

○最近10期の運用実績

決算期	基準価額			投資信託証券組入比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率		
	円	円	%	%	百万円
15期(2020年９月14日)	9,932	0	4.5	94.4	401
16期(2020年12月14日)	10,000	157	2.3	94.8	376
17期(2021年３月15日)	10,000	318	3.2	96.3	377
18期(2021年６月14日)	10,000	441	4.4	93.7	368
19期(2021年９月13日)	10,000	211	2.1	92.4	382
20期(2021年12月13日)	9,979	0	△0.2	95.9	378
21期(2022年３月14日)	9,694	0	△2.9	96.2	354
22期(2022年６月13日)	10,000	76	3.9	93.9	365
23期(2022年９月13日)	10,000	78	0.8	95.3	347
24期(2022年12月13日)	9,773	0	△2.3	96.9	340

（注）基準価額の騰落率は分配金込み。
（注）当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年月日	基準価額	騰落率	投資信託証券組入比率
		円	%	%
第23期	（期　首） 2022年６月13日	10,000	－	93.9
	６月末	9,820	△1.8	97.3
	７月末	9,934	△0.7	97.7
	８月末	9,923	△0.8	98.5
	（期　末） 2022年９月13日	10,078	0.8	95.3
第24期	（期　首） 2022年９月13日	10,000	－	95.3
	９月末	9,533	△4.7	97.6
	10月末	9,688	△3.1	97.6
	11月末	9,829	△1.7	98.0
	（期　末） 2022年12月13日	9,773	△2.3	96.9

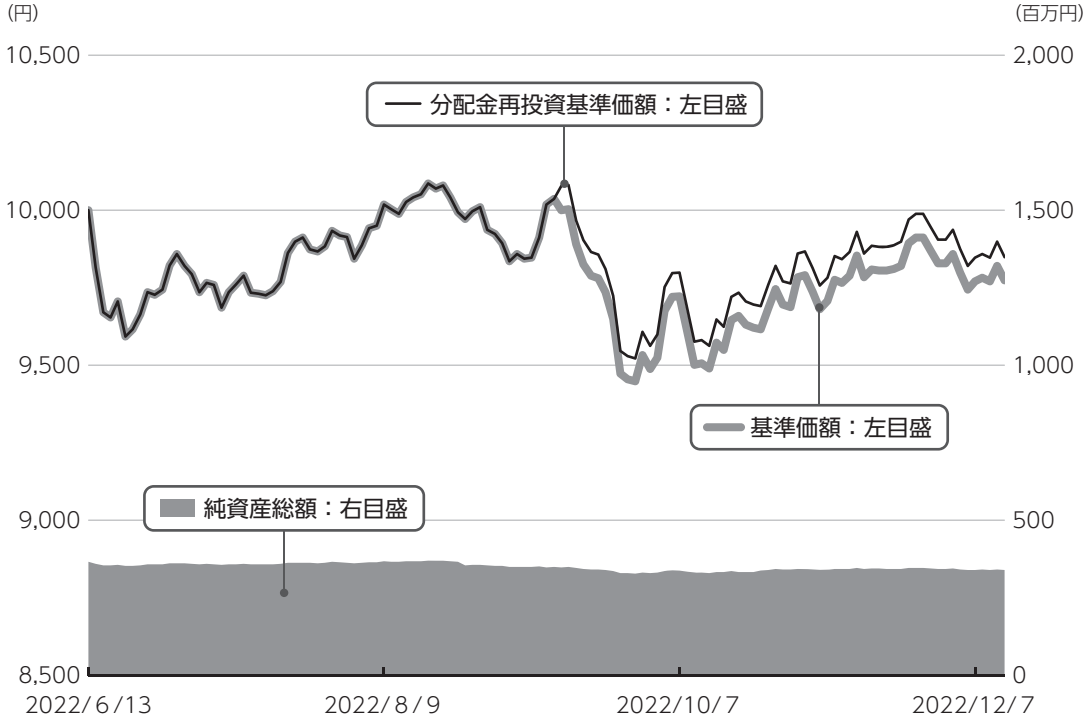
（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

運用経過

第23期～第24期：2022年６月14日～2022年12月13日

当作成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第２３期首	10,000円
第２４期末	9,773円
既払分配金	78円
騰　落　率	－1.5％
	（分配金再投資ベース）

※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

基準価額は当作成期首に比べ1.5％（分配金再投資ベース）の下落となりました。

基準価額の主な変動要因

下落要因

金が下落したことなどがマイナスに影響しました。

第23期～第24期：2022年６月14日～2022年12月13日

投資環境について

▶国内株式市況

当作成期を通してみると、国内株式市況は上昇しました。

堅調な企業決算や参議院選挙における与党勝利などを受けた政権基盤の安定化などが好感され、上昇しました。

▶国内債券市況

当作成期を通してみると、国内の債券利回りはほぼ横ばいとなりました。

主要中央銀行における金融引き締めへの過度な懸念の後退などを背景に一時低下しましたが、再度金融引き締めへの警戒感が高まったことなどから上昇しました。

▶国内リート市況

当作成期を通してみると、国内リート市況は下落しました。

米国長期金利が上昇したことなどから下落しました。

▶先進国株式市況

当作成期を通してみると、先進国株式市況は概ね上昇しました。

堅調な企業決算や米連邦準備制度理事会（ＦＲＢ）による利上げペースの減速期待が高まったことなどが好感され、上昇しました。

▶先進国債券市況

当作成期を通してみると、先進国の債券利回りは概ね上昇しました。

主要中央銀行の大幅な利上げ実施や米金融当局よりインフレ鎮静化に向けた金融引き締めの継続姿勢が明確に示されたなどから、上昇しました。

▶先進国リート市況

当作成期を通してみると、先進国リート市況は概ね下落しました。

米国長期金利が上昇したことなどから下落しました。

▶新興国株式市況

当作成期を通してみると、新興国株式市況はまちまちな動きとなりました。

▶新興国債券市況

当作成期を通してみると、新興国の債券利回りはまちまちな動きとなりました。

▶金市況

当作成期を通してみると、金は下落しました。

金価格は、米国長期金利が上昇したことなどから下落しました。

▶ 為替市況

当作成期を通してみると、米ドル、ユーロは円に対して上昇しました。

米ドルおよびユーロは欧米と日本の金利差拡大などから円に対して上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

投資信託証券への投資を通じて、主として「国内株式」、「国内債券」、「国内リート」、「先進国株式」、「先進国債券」、「先進国リート」、「新興国株式」、「新興国債券」、「金」の９資産（以下「９資産」ということがあります。）に分散投資を行いました。９資産への投資にあたっては、三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社 投資顧問部からのアドバイスを基に、当ファンドの目標リスク水準（年率標準偏差8.0％）に応じた９資産の基本資産配分比率を決定し、この比率に基づき、指定投資信託証券の中から選定した投資信託証券に投資を行いました。

「金」の投資信託証券の組入部分については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかりました。

2022年６月および2022年９月に原則年４回行う基本資産比率の見直しを行いました。リバランスを通じ、主に「先進国債券」などの配分比率を引き上げる一方、「国内債券」などの配分比率を引き下げました。

※指定投資信託証券の決定や投資する投資信託証券の選定等についても、三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社　投資顧問部からアドバイスを受けます。

（ご参考）

■ポートフォリオの状況

資産区分	選定した投資信託証券の名称	作成期首(2022年6月13日)比率	作成期末(2022年12月13日)比率
国内株式	MUAM インデックスファンドＴＯＰＩＸｉ（適格機関投資家限定）	11.9%	12.6%
	日本株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）	11.6%	12.4%
国内債券	MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	8.6%	4.5%
	国内物価連動国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）	2.9%	1.7%
	MUKAM 日本超長期国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）	3.4%	2.0%
国内リート	国内リートインデックス・ファンド（適格機関投資家限定）	1.3%	1.4%
先進国株式	MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	12.9%	9.8%
	先進国株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）	6.6%	5.1%
	先進国株式クオリティ・インデックスファンド（適格機関投資家限定）	6.4%	5.0%
先進国債券	MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	3.1%	21.6%
先進国リート	iシェアーズ グローバル・リート ETF	0.4%	0.4%
新興国株式	iシェアーズ MSCI エマージング・マーケット・ミニマム・ボラティリティ・ファクター ETF	0.9%	0.9%
	iシェアーズ MSCI エマージング・マーケット ETF	0.8%	0.9%
新興国債券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 UCITS ETF	5.9%	3.6%
金	iシェアーズ ゴールド・トラスト	17.0%	15.0%

（注）比率は当ファンドの純資産総額に対する割合です。
（注）上記は指定投資信託証券の中から選定した投資信託証券を記載しています。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

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

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向等を勘案し、分配金額を決定します。原則として、決算日の基準価額水準が当初元本額10,000円（10,000口当たり）を超えている場合には、当該超えている部分について、分配対象額の範囲内で、全額分配を行います。（資金動向や市況動向等により変更する場合があります。）この結果、次表の通りとさせていただきました。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

（単位：円、１万口当たり、税込み）

項　目	第23期 2022年６月14日～2022年９月13日	第24期 2022年９月14日～2022年12月13日
当期分配金（対基準価額比率）	**78**（0.774%）	**－**（－%）
当期の収益	78	－
当期の収益以外	－	－
翌期繰越分配対象額	4	4

（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。）

経済・金融市場を注視し、適切な基本資産配分比率の管理を通じて目標リスク水準（年率標準偏差8.0％程度）を目指した運用を行う方針です。

「金」の投資信託証券の組入部分については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。

2022年６月14日～2022年12月13日

１万口当たりの費用明細

項目	第23期～第24期 金額（円）	第23期～第24期 比率（%）	項目の概要
(ａ)信託報酬	54	0.551	(a)信託報酬＝作成期中の平均基準価額×信託報酬率×（作成期中の日数÷年間日数）
（投信会社）	(28)	(0.287)	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）	(24)	(0.248)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(2)	(0.017)	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	3	0.026	(b)売買委託手数料＝作成期中の売買委託手数料÷作成期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（投資信託証券）	(3)	(0.026)	
(c)有価証券取引税	0	0.000	(c)有価証券取引税＝作成期中の有価証券取引税÷作成期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d)その他費用	2	0.016	(d)その他費用＝作成期中のその他費用÷作成期中の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0.014)	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)	(0.002)	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
合計	59	0.593	

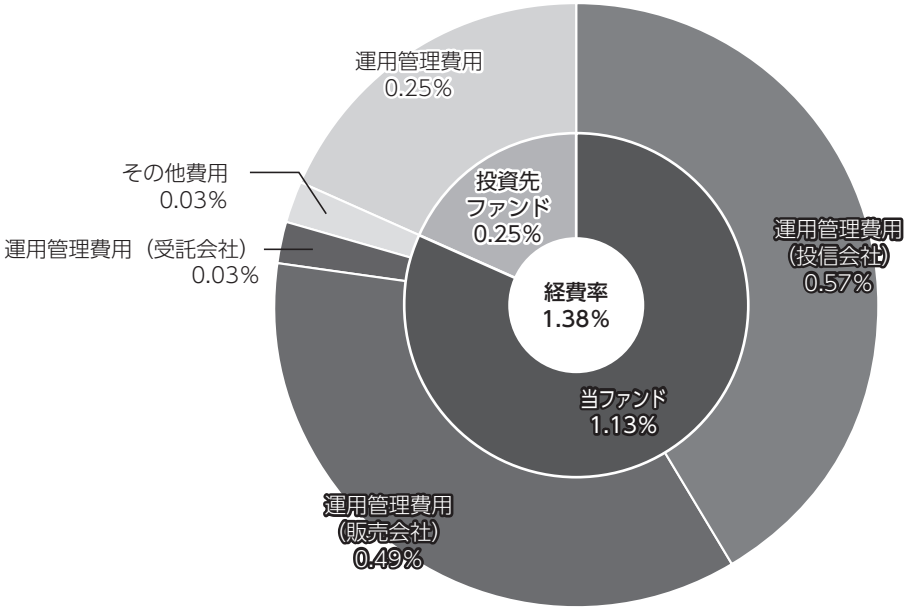
作成期中の平均基準価額は、9,794円です。

（注）作成期間の費用（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）各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。
（注）当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「１万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。
（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）を作成期間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）

■経費率

当作成対象期間の運用・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。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**経費率（年率）は1.38%**です。



経費率（①＋②）	（%）	1.38
①当ファンドの費用の比率	（%）	1.13
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	（%）	0.25

（注）①の費用は、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）投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
（注）①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
（注）①の費用と②の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
（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。
（注）投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、前記には含まれておりません。

○売買及び取引の状況

（2022年６月14日～2022年12月13日）

投資信託証券

銘柄		第23期～第24期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内		千口	千円	千口	千円
	MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	579	1,617	5,110	15,188
	MUAM インデックスファンドＴＯＰＩＸｉ（適格機関投資家限定）	1,263	2,112	1,713	2,890
	国内物価連動国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）	1,467	1,500	6,354	6,478
	MUKAM 日本超長期国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）	5,331	5,000	10,861	10,117
	日本株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）	980	1,386	1,985	2,826
	先進国株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）	－	－	3,792	7,453
	先進国株式クオリティ・インデックスファンド（適格機関投資家限定）	－	－	3,504	6,339
	MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	12,385	15,000	25,264	30,574
	MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	41,926	64,039	874	1,379
合計		63,933	90,656	59,461	83,248
外国	アメリカ		千アメリカドル		千アメリカドル
	ISHARES GOLD TRUST	0.9	29	2	93
	ISHARES JPM USD EM BND USD A	25	122	40	185
	小計	26	152	43	279

（注）金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

（2022年６月14日～2022年12月13日）

利害関係人との取引状況

区分	第23期～第24期					
	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	111	90	81.1	124	83	66.9
為替先物取引	351	164	46.7	338	157	46.4
為替直物取引	20	－	－	40	28	70.0

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

○組入資産の明細

（2022年12月13日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄	第22期末	第24期末		
	口数	口数	評価額	比率
	千口	千口	千円	%
MUAM 外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	15,331	10,800	33,385	9.8
MUAM インデックスファンドTOPIXi（適格機関投資家限定）	25,391	24,941	42,931	12.6
国内物価連動国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）	10,418	5,531	5,683	1.7
MUKAM 日本超長期国債インデックスファンド(適格機関投資家限定)	13,172	7,642	6,941	2.0
日本株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）	30,208	29,203	42,135	12.4
先進国株式最小分散インデックスファンド(適格機関投資家限定)	12,438	8,646	17,478	5.1
先進国株式クオリティ・インデックスファンド(適格機関投資家限定)	12,382	8,878	16,925	5.0
国内リートインデックス・ファンド(適格機関投資家限定)	3,256	3,256	4,755	1.4
MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	25,709	12,830	15,371	4.5
MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	7,521	48,573	73,442	21.6
合計	155,832	160,304	259,050	76.2

（注）比率はスマート・クオリティ・オープン・ゴールド（安定成長型）の純資産総額に対する比率。

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

銘柄	第22期末	第24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	%
ISHARES MSCI EMERGING MARKET	0.55	0.55	21	2,948	0.9
ISHARES MSCI EMG MKT MIN VOL	0.431	0.431	23	3,199	0.9
ISHARES GOLD TRUST	12	10	369	50,891	15.0
ISHARES GLOBAL REIT ETF	0.459	0.459	10	1,473	0.4
ISHARES JPM USD EM BND USD A	32	17	87	12,128	3.6
合計	47	30	512	70,641	20.8

（注）邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
（注）比率はスマート・クオリティ・オープン・ゴールド（安定成長型）の純資産総額に対する比率。

○投資信託財産の構成

（2022年12月13日現在）

項　　目	第24期末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
投資信託受益証券	259,050	75.9
投資証券	70,641	20.7
コール・ローン等、その他	11,684	3.4
投資信託財産総額	341,375	100.0

（注）作成期末における外貨建純資産（71,231千円）の投資信託財産総額（341,375千円）に対する比率は20.9％です。
（注）外貨建資産は、作成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、作成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＝137.83円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項　　目	第23期末	第24期末
	2022年９月13日現在	2022年12月13日現在
	円	円
(A) 資産	**414,695,316**	**391,454,417**
コール・ローン等	26,507,172	11,683,276
投資信託受益証券(評価額)	229,549,587	259,050,771
投資証券(評価額)	101,971,954	70,641,619
未収入金	56,666,603	50,078,751
(B) 負債	**66,927,498**	**51,321,428**
未払金	56,220,121	50,388,035
未払収益分配金	2,712,637	－
未払解約金	6,995,605	－
未払信託報酬	995,851	930,325
未払利息	28	26
その他未払費用	3,256	3,042
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	**347,767,818**	**340,132,989**
元本	347,774,068	348,020,967
次期繰越損益金	△　6,250	△　7,887,978
(D) 受益権総口数	**347,774,068口**	**348,020,967口**
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	**10,000円**	**9,773円**

○損益の状況

項　　目	第23期 2022年６月14日～ 2022年９月13日	第24期 2022年９月14日～ 2022年12月13日
	円	円
(A) 配当等収益	**541,206**	**17,403**
受取配当金	540,969	16,019
受取利息	902	2,822
支払利息	△ 665	△ 1,438
(B) 有価証券売買損益	**3,227,259**	**△ 6,706,557**
売買益	15,023,109	6,562,112
売買損	△11,795,850	△13,268,669
(C) 信託報酬等	**△ 1,023,804**	**△ 958,962**
(D) 当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	**2,744,661**	**△ 7,648,116**
(E) 前期繰越損益金	**114,339**	**143,285**
(F) 追加信託差損益金	**△ 152,613**	**△ 383,147**
（配当等相当額）	(2,525)	(5,704)
（売買損益相当額）	(△ 155,138)	(△ 388,851)
(G) 計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	**2,706,387**	**△ 7,887,978**
(H) 収益分配金	**△ 2,712,637**	**0**
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）	**△ 6,250**	**△ 7,887,978**
追加信託差損益金	△ 152,613	△ 383,147
（配当等相当額）	(2,525)	(5,704)
（売買損益相当額）	(△ 155,138)	(△ 388,851)
分配準備積立金	146,363	143,285
繰越損益金	－	△ 7,648,116

（注）**(B)有価証券売買損益**は各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。

＜注記事項＞
①作成期首（前作成期末）元本額　365,110,814円
　作成期中追加設定元本額　10,892,770円
　作成期中一部解約元本額　27,982,617円
　また、１口当たり純資産額は、作成期末0.9773円です。
②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は7,887,978円です。
③分配金の計算過程

項　　目	2022年６月14日～ 2022年９月13日	2022年９月14日～ 2022年12月13日
費用控除後の配当等収益額	394,188円	－円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	2,350,473円	－円
収益調整金額	2,525円	5,704円
分配準備積立金額	114,339円	143,285円
当ファンドの分配対象収益額	2,861,525円	148,989円
１万口当たり収益分配対象額	82円	4円
１万口当たり分配金額	78円	－円
収益分配金金額	2,712,637円	－円

○分配金のお知らせ

	第23期	第24期
１万口当たり分配金（税込み）	78円	0円

◆分配金は各決算日から起算して５営業日までにお支払いを開始しております。
◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。
◆課税上の取り扱い
・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、原則として、20.315％（所得税15％、復興特別所得税0.315％、地方税５％）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。
・分配時において、外国税控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※法人受益者に対する課税は異なります。
※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。
※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。
※NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

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

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／国内／株式／インデックス型	
信託期間	2023年８月14日まで（2013年７月11日設定）	
運用方針	東京証券取引所に上場されている株式、ＴＯＰＩＸマザーファンド受益証券および有価証券指数等先物取引等に投資を行い、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。	
主要運用対象	ベビーファンド	ＴＯＰＩＸマザーファンド受益証券またはわが国の株式を主要投資対象とします。
	マザーファンド	東京証券取引所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	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。 外貨建資産への投資は行いません。
	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。
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。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書（全体版）

ＭＵＡＭ インデックスファンドＴＯＰＩＸｉ（適格機関投資家限定）

第18期（決算日：2022年８月15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「ＭＵＡＭ インデックスファンドＴＯＰＩＸｉ（適格機関投資家限定）」は、去る８月15日に第18期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG
三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先
お客さま専用フリーダイヤル　０１２０－１５１０３４
（受付時間：営業日の9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～１月３日を除く）
お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額			東証株価指数		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ＴＯＰＩＸ)(配当込み)	期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
14期(2020年８月14日)	14,024	114	△ 3.3	2,511.36	△ 3.3	94.5	5.7	27,778
15期(2021年２月15日)	16,938	106	21.5	3,053.35	21.6	95.2	9.9	20,677
16期(2021年８月16日)	16,703	147	△ 0.5	3,041.68	△ 0.4	90.0	9.4	15,154
17期(2022年２月14日)	16,781	125	1.2	3,081.09	1.3	95.6	5.1	13,623
18期(2022年８月15日)	17,270	210	4.2	3,212.32	4.3	100.4	0.7	14,035

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注) 東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）(配当込み）とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。ＴＯＰＩＸの指数値及びＴＯＰＩＸに係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などＴＯＰＩＸに関するすべての権利・ノウハウ及びＴＯＰＩＸに係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸ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) 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」は実質比率を記載しております。
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証株価指数		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	(ＴＯＰＩＸ)(配当込み)	騰落率		
(期　首)	円	%		%	%	%
2022年２月14日	16,781	－	3,081.09	－	95.6	5.1
２月末	16,405	△2.2	3,012.57	△2.2	96.1	4.0
３月末	17,108	1.9	3,142.06	2.0	94.2	5.7
４月末	16,697	△0.5	3,066.68	△0.5	93.9	6.0
５月末	16,823	0.3	3,090.73	0.3	95.9	3.7
６月末	16,477	△1.8	3,027.34	△1.7	97.0	2.8
７月末	17,088	1.8	3,140.07	1.9	98.5	1.0
(期　末)						
2022年８月15日	17,480	4.2	3,212.32	4.3	100.4	0.7

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。
(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第18期：2022年２月15日～2022年８月15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 18 期 首	16,781円
第 18 期 末	17,270円
既払分配金	210円
騰　落　率	4.2%

（分配金再投資ベース）

※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、受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.2％（分配金再投資ベース）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（4.3％）を0.1％下回りました。

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。

第18期：2022年２月15日～2022年８月15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。

参議院選挙で勝利した岸田政権への期待や円安・米ドル高進行に伴う輸出企業の採算改善等を背景に、国内株式市況は上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

MUAM インデックスファンドTOPIXｉ（適格機関投資家限定）

ＴＯＰＩＸマザーファンド受益証券を含め、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。

なお、2022年５月18日より、当ファンドからの直接投資を主とする運用から、マザーファンド経由の投資を主とする運用に変更しました。

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。

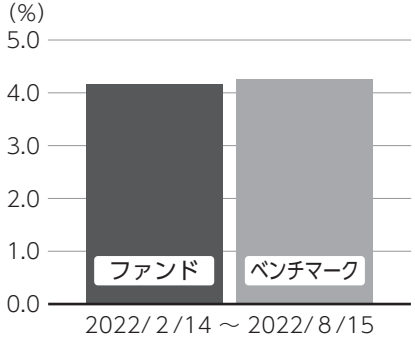
株式ポートフォリオはベンチマークである東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ＭＵＡＭ インデックスファンドＴＯＰＩＸｉ（適格機関投資家限定）

ベンチマークとのカイ離は△0.1％程度となりました。ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。ファンドの管理コスト等による影響は△0.1％程度でした。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



※ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

分配金について

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

分配原資の内訳

（単位：円、１万口当たり、税込み）

項　目	第18期 2022年２月15日～2022年８月15日
当期分配金（対基準価額比率）	**210**（1.201％）
当期の収益	210
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	9,220

（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。）

▶ＭＵＡＭ インデックスファンドＴＯＰＩＸｉ（適格機関投資家限定）

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶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。

2022年２月15日～2022年８月15日

１万口当たりの費用明細

項目	当期 金額（円）	当期 比率（%）	項目の概要
(a)信託報酬	13	0.077	(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）	(8)	(0.049)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（販売会社）	(3)	(0.016)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(2)	(0.011)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b)売買委託手数料	0	0.001	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(c)その他費用	0	0.001	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.001)	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
合計	13	0.079	

期中の平均基準価額は、16,660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。

○売買及び取引の状況

（2022年２月15日～2022年８月15日）

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	千株 258 (　6)	千円 618,370 (　　－)	千株 5,684	千円 13,196,762

（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。

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 1,184	百万円 1,875	百万円 －	百万円 －

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
ＴＯＰＩＸマザーファンド	千口 6,290,384	千円 13,714,881	千口 173,686	千円 396,363

○株式売買比率

（2022年２月15日～2022年８月15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	
	ＭＵＡＭ インデックスファンド ＴＯＰＩＸｉ（適格機関投資家限定）	ＴＯＰＩＸマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	13,815,133千円	225,602,130千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	12,867,754千円	740,614,287千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	1.07	0.30

（注）(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2022年２月15日～2022年８月15日）

利害関係人との取引状況

＜ＭＵＡＭ インデックスファンドＴＯＰＩＸｉ（適格機関投資家限定）＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	618	616	99.7	13,196	136	1.0
株式先物取引	1,184	1,184	100.0	1,875	1,875	100.0

＜ＴＯＰＩＸマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	150,800	82,411	54.6	74,801	16,666	22.3

平均保有割合　1.0%

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

利害関係人の発行する有価証券等

＜ＭＵＡＭ インデックスファンドＴＯＰＩＸｉ（適格機関投資家限定）＞

種類	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	9	243	－

＜ＴＯＰＩＸマザーファンド＞

種類	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	2,444	1,093	14,453

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

＜ＴＯＰＩＸマザーファンド＞

種類	買付額
	百万円
株式	0.77079

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）	142千円
うち利害関係人への支払額（B）	91千円
（B）／（A）	64.2%

（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を含みます。

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ＨＣキャピタル、アコム、ジャックス、モルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券です。

○組入資産の明細

（2022年８月15日現在）

国内株式

2022年８月15日現在の組入れはございません。

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
水産・農林業	
極洋	0.2
日本水産	6.7
マルハニチロ	1
雪国まいたけ	0.5
カネコ種苗	0.2
サカタのタネ	0.8
ホクト	0.6
ホクリヨウ	0.1
鉱業	
住石ホールディングス	1.2
日鉄鉱業	0.2
三井松島ホールディングス	0.3
ＩＮＰＥＸ	26.8
石油資源開発	0.8
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	0.3
建設業	
ヒノキヤグループ	0.1
ショーボンドホールディングス	1
ミライト・ワン	2.2
タマホーム	0.4
サンヨーホームズ	0.1
日本アクア	0.3
ファーストコーポレーション	0.2
ベステラ	0.1
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	1.1
キャンディル	0.1
スペースバリューホールディングス	0.2
ダイセキ環境ソリューション	0.1
第一カッター興業	0.2
安藤・間	3.3
東急建設	2
コムシスホールディングス	2.2
ビーアールホールディングス	0.9
高松コンストラクショングループ	0.4
東建コーポレーション	0.2
ソネック	0.1
ヤマウラ	0.3
オリエンタル白石	2.2
大成建設	4.5
大林組	15.5
清水建設	14.5
飛島建設	0.4
長谷工コーポレーション	4.6
松井建設	0.6
錢高組	0.1
鹿島建設	11.3
不動テトラ	0.3
大末建設	0.2
鉄建建設	0.3
西松建設	0.9
三井住友建設	3.5
大豊建設	0.2
佐田建設	0.3
ナカノフドー建設	0.4
奥村組	0.9
東鉄工業	0.7
イチケン	0.1
富士ピー・エス	0.2
淺沼組	0.2
戸田建設	6.4
熊谷組	0.8
北野建設	0.1
植木組	0.1
矢作建設工業	0.7
ピーエス三菱	0.5
日本ハウスホールディングス	1.1
大東建託	1.6

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
新日本建設	0.7
ＮＩＰＰＯ	0.4
東亜道路工業	0.1
日本道路	0.1
東亜建設工業	0.4
日本国土開発	1.5
若築建設	0.3
東洋建設	1.7
五洋建設	6.1
世紀東急工業	0.7
福田組	0.2
住友林業	4
日本基礎技術	0.4
巴コーポレーション	0.7
大和ハウス工業	14.3
ライト工業	1
積水ハウス	16.8
日特建設	0.3
北陸電気工事	0.3
ユアテック	0.9
日本リーテック	0.3
四電工	0.2
中電工	0.7
関電工	2.5
きんでん	3.5
東京エネシス	0.5
トーエネック	0.2
住友電設	0.4
日本電設工業	0.8
エクシオグループ	2.3
新日本空調	0.4
九電工	1.2
三機工業	1
日揮ホールディングス	4.8
中外炉工業	0.2
ヤマト	0.5
太平電業	0.3
高砂熱学工業	1.4
三晃金属工業	0.1

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
朝日工業社	0.1
明星工業	1
大氣社	0.8
ダイダン	0.3
日比谷総合設備	0.5
フィル・カンパニー	0.1
テスホールディングス	0.3
インフロニア・ホールディングス	6.6
東洋エンジニアリング	0.6
レイズネクスト	0.7
食料品	
ニップン	1.4
日清製粉グループ本社	5.6
日東富士製粉	0.1
昭和産業	0.5
鳥越製粉	0.4
中部飼料	0.6
フィード・ワン	0.7
東洋精糖	0.1
日本甜菜製糖	0.3
ＤＭ三井製糖ホールディングス	0.4
塩水港精糖	0.6
日新製糖	0.2
森永製菓	1.2
中村屋	0.1
江崎グリコ	1.4
名糖産業	0.2
井村屋グループ	0.3
不二家	0.3
山崎製パン	3.7
第一屋製パン	0.1
モロゾフ	0.2
亀田製菓	0.3
寿スピリッツ	0.5
カルビー	2.3
森永乳業	0.9
六甲バター	0.4
ヤクルト本社	3.7
明治ホールディングス	3.3

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
雪印メグミルク	1.2
プリマハム	0.6
日本ハム	1.9
林兼産業	0.1
丸大食品	0.5
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	0.4
柿安本店	0.2
伊藤ハム米久ホールディングス	3.2
サッポロホールディングス	1.7
アサヒグループホールディングス	11.6
キリンホールディングス	18.2
宝ホールディングス	3.4
オエノンホールディングス	1.4
養命酒製造	0.2
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールデ	3.5
サントリー食品インターナショナル	3.3
ダイドーグループホールディングス	0.3
伊藤園	1.5
キーコーヒー	0.5
ユニカフェ	0.1
ジャパンフーズ	0.1
日清オイリオグループ	0.6
不二製油グループ本社	1.1
かどや製油	0.1
Ｊ－オイルミルズ	0.5
キッコーマン	3.6
味の素	10.9
ブルドックソース	0.2
キユーピー	2.6
ハウス食品グループ本社	1.8
カゴメ	1.9
焼津水産化学工業	0.2
アリアケジャパン	0.5
ピエトロ	0.1
エバラ食品工業	0.1
ニチレイ	2.3
東洋水産	2.4
イートアンドホールディングス	0.2
大冷	0.1

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
ヨシムラ・フード・ホールディングス	0.3
日清食品ホールディングス	1.9
永谷園ホールディングス	0.2
一正蒲鉾	0.2
フジッコ	0.5
ロック・フィールド	0.5
日本たばこ産業	26.5
ケンコーマヨネーズ	0.3
わらべや日洋ホールディングス	0.3
なとり	0.3
イフジ産業	0.1
ピックルスコーポレーション	0.2
ファーマフーズ	0.5
ユーグレナ	2.5
紀文食品	0.3
ミヨシ油脂	0.2
理研ビタミン	0.5
繊維製品	
片倉工業	0.5
グンゼ	0.3
東洋紡	1.9
ユニチカ	1.3
富士紡ホールディングス	0.2
倉敷紡績	0.4
シキボウ	0.3
日本毛織	1.5
ダイトウボウ	0.8
トーア紡コーポレーション	0.2
ダイドーリミテッド	0.6
帝国繊維	0.5
帝人	4.5
東レ	34.9
住江織物	0.1
日本フエルト	0.3
イチカワ	0.1
日東製網	0.1
アツギ	0.4
ダイニック	0.2
セーレン	1

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
ソトー	0.2
東海染工	0.1
小松マテーレ	0.8
ワコールホールディングス	1.2
ホギメディカル	0.7
クラウディアホールディングス	0.1
ＴＳＩホールディングス	1.6
マツオカコーポレーション	0.2
ワールド	0.6
三陽商会	0.2
ナイガイ	0.2
オンワードホールディングス	2.9
ルックホールディングス	0.2
キムラタン	2.7
ゴールドウイン	0.9
デサント	0.9
キング	0.2
ヤマトインターナショナル	0.4
パルプ・紙	
特種東海製紙	0.3
王子ホールディングス	20.2
日本製紙	2.3
三菱製紙	0.7
北越コーポレーション	3.2
中越パルプ工業	0.2
巴川製紙所	0.1
大王製紙	2.3
阿波製紙	0.1
レンゴー	4.6
トーモク	0.3
ザ・パック	0.4
化学	
北の達人コーポレーション	1.7
クラレ	7.1
旭化成	32
共和レザー	0.3
昭和電工	4.2
住友化学	35.5
住友精化	0.2

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
日産化学	2.6
ラサ工業	0.2
クレハ	0.4
多木化学	0.2
テイカ	0.4
石原産業	0.8
片倉コープアグリ	0.1
日本曹達	0.6
東ソー	7
トクヤマ	1.5
セントラル硝子	0.8
東亜合成	2.7
大阪ソーダ	0.4
関東電化工業	1.1
デンカ	1.8
信越化学工業	8.3
日本カーバイド工業	0.2
堺化学工業	0.3
第一稀元素化学工業	0.4
エア・ウォーター	4.6
日本酸素ホールディングス	4.6
日本化学工業	0.2
東邦アセチレン	0.1
日本パーカライジング	2.4
高圧ガス工業	0.8
チタン工業	0.1
四国化成工業	0.6
戸田工業	0.1
ステラ　ケミファ	0.2
保土谷化学工業	0.2
日本触媒	0.8
大日精化工業	0.4
カネカ	1.2
三菱瓦斯化学	4.5
三井化学	4.4
ＪＳＲ	4.5
東京応化工業	0.8
大阪有機化学工業	0.4
三菱ケミカルグループ	32.3

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
ＫＨネオケム	0.8
ダイセル	7
住友ベークライト	0.8
積水化学工業	10.1
日本ゼオン	4.4
アイカ工業	1.3
ＵＢＥ	2.3
積水樹脂	0.7
タキロンシーアイ	1
旭有機材	0.3
ニチバン	0.3
リケンテクノス	1.2
大倉工業	0.2
積水化成品工業	0.6
群栄化学工業	0.1
タイガースポリマー	0.3
ミライアル	0.2
ダイキアクシス	0.2
ダイキョーニシカワ	1
竹本容器	0.2
森六ホールディングス	0.3
恵和	0.1
日本化薬	3.8
カーリットホールディングス	0.5
日本精化	0.4
扶桑化学工業	0.4
トリケミカル研究所	0.5
ＡＤＥＫＡ	2.2
日油	1.6
新日本理化	0.8
ハリマ化成グループ	0.4
花王	10.9
第一工業製薬	0.2
石原ケミカル	0.2
日華化学	0.2
ニイタカ	0.1
三洋化成工業	0.3
有機合成薬品工業	0.3
大日本塗料	0.6

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
日本ペイントホールディングス	18.1
関西ペイント	5
神東塗料	0.4
中国塗料	1.1
日本特殊塗料	0.4
藤倉化成	0.6
太陽ホールディングス	0.7
ＤＩＣ	2
サカタインクス	1
東洋インキＳＣホールディングス	1
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	0.4
富士フイルムホールディングス	8.7
資生堂	9.2
ライオン	5.9
高砂香料工業	0.3
マンダム	1
ミルボン	0.6
ファンケル	2
コーセー	0.9
コタ	0.3
シーボン	0.1
ポーラ・オルビスホールディングス	2.1
ノエビアホールディングス	0.4
アジュバンホールディングス	0.1
新日本製薬	0.1
エステー	0.3
アグロ　カネショウ	0.2
コニシ	0.8
長谷川香料	0.8
星光ＰＭＣ	0.3
小林製薬	1.4
荒川化学工業	0.4
メック	0.4
日本高純度化学	0.1
タカラバイオ	1.3
ＪＣＵ	0.6
新田ゼラチン	0.3
ＯＡＴアグリオ	0.1
デクセリアルズ	1.3

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
アース製薬	0.4
北興化学工業	0.5
大成ラミック	0.2
クミアイ化学工業	1.8
日本農薬	0.9
アキレス	0.3
有沢製作所	0.7
日東電工	3
レック	0.6
三光合成	0.6
きもと	0.8
藤森工業	0.4
前澤化成工業	0.3
未来工業	0.2
ウェーブロックホールディングス	0.2
ＪＳＰ	0.3
エフピコ	0.9
天馬	0.4
信越ポリマー	0.9
東リ	1.2
ニフコ	1.6
バルカー	0.4
ユニ・チャーム	9.5
ショーエイコーポレーション	0.1
医薬品	
協和キリン	5.8
武田薬品工業	38.7
アステラス製薬	42.7
住友ファーマ	3
塩野義製薬	6.2
わかもと製薬	0.6
日本新薬	1.3
中外製薬	15.4
科研製薬	0.8
エーザイ	5.9
ロート製薬	2.5
小野薬品工業	11.3
久光製薬	1.3
持田製薬	0.6

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
参天製薬	9.2
扶桑薬品工業	0.2
日本ケミファ	0.1
ツムラ	1.5
日医工	1.5
キッセイ薬品工業	0.9
生化学工業	0.9
栄研化学	0.9
日水製薬	0.2
鳥居薬品	0.3
ＪＣＲファーマ	1.4
東和薬品	0.7
富士製薬工業	0.3
ゼリア新薬工業	0.9
第一三共	38.7
キョーリン製薬ホールディングス	1
大幸薬品	0.7
ダイト	0.3
大塚ホールディングス	10.2
大正製薬ホールディングス	1.2
ペプチドリーム	2.6
あすか製薬ホールディングス	0.6
サワイグループホールディングス	1.1
石油・石炭製品	
日本コークス工業	4.2
ニチレキ	0.6
ユシロ化学工業	0.3
ビーピー・カストロール	0.2
富士石油	1.3
ＭＯＲＥＳＣＯ	0.2
出光興産	5.5
ＥＮＥＯＳホールディングス	74.1
コスモエネルギーホールディングス	1.4
ゴム製品	
横浜ゴム	2.9
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	2.6
ブリヂストン	14.2
住友ゴム工業	4.4
藤倉コンポジット	0.4

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
オカモト	0.3
フコク	0.2
ニッタ	0.5
住友理工	1
三ツ星ベルト	0.6
バンドー化学	0.8
ガラス・土石製品	
日東紡績	0.7
ＡＧＣ	4.5
日本板硝子	2.4
石塚硝子	0.1
日本山村硝子	0.2
日本電気硝子	2
オハラ	0.2
住友大阪セメント	0.9
太平洋セメント	2.8
日本ヒューム	0.5
日本コンクリート工業	1
三谷セキサン	0.2
アジアパイルホールディングス	0.8
東海カーボン	4.1
日本カーボン	0.3
東洋炭素	0.3
ノリタケカンパニーリミテド	0.3
ＴＯＴＯ	3.5
日本碍子	5.3
日本特殊陶業	3.7
ダントーホールディングス	0.3
ＭＡＲＵＷＡ	0.2
品川リフラクトリーズ	0.1
黒崎播磨	0.1
ヨータイ	0.3
イソライト工業	0.2
東京窯業	0.6
ニッカトー	0.2
フジミインコーポレーテッド	0.4
クニミネ工業	0.2
エーアンドエーマテリアル	0.1
ニチアス	1.1

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
ニチハ	0.7
鉄鋼	
日本製鉄	21.8
神戸製鋼所	9.1
中山製鋼所	0.8
合同製鐵	0.3
ＪＦＥホールディングス	13.2
東京製鐵	1.7
共英製鋼	0.5
大和工業	0.9
東京鐵鋼	0.2
大阪製鐵	0.3
淀川製鋼所	0.6
丸一鋼管	1.7
モリ工業	0.1
大同特殊鋼	0.8
日本高周波鋼業	0.2
日本冶金工業	0.4
山陽特殊製鋼	0.5
愛知製鋼	0.3
日立金属	5.2
日本金属	0.1
大平洋金属	0.3
新日本電工	3.1
栗本鐵工所	0.2
虹技	0.1
日本鋳鉄管	0.1
三菱製鋼	0.3
日亜鋼業	0.6
日本精線	0.1
エンビプロ・ホールディングス	0.2
シンニッタン	0.6
新家工業	0.1
非鉄金属	
大紀アルミニウム工業所	0.7
日本軽金属ホールディングス	1.2
三井金属鉱業	1.3
東邦亜鉛	0.3
三菱マテリアル	3.2

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
住友金属鉱山	6.2
ＤＯＷＡホールディングス	1.3
古河機械金属	0.8
エス・サイエンス	2.4
大阪チタニウムテクノロジーズ	0.6
東邦チタニウム	0.9
ＵＡＣＪ	0.7
ＣＫサンエツ	0.1
古河電気工業	1.5
住友電気工業	18.2
フジクラ	5.4
昭和電線ホールディングス	0.4
東京特殊電線	0.1
タツタ電線	0.9
カナレ電気	0.1
平河ヒューテック	0.3
リョービ	0.6
アーレスティ	0.5
アサヒホールディングス	2
金属製品	
稲葉製作所	0.3
宮地エンジニアリンググループ	0.1
トーカロ	1.3
アルファＣｏ	0.2
ＳＵＭＣＯ	7.5
川田テクノロジーズ	0.1
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	0.2
ジェイテックコーポレーション	0.1
信和	0.3
東洋製罐グループホールディングス	3.1
ホッカンホールディングス	0.3
コロナ	0.3
横河ブリッジホールディングス	0.8
駒井ハルテック	0.1
三和ホールディングス	4.6
文化シヤッター	1.5
三協立山	0.6
アルインコ	0.4
東洋シヤッター	0.1

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
ＬＩＸＩＬ	7.7
日本フイルコン	0.3
ノーリツ	0.9
長府製作所	0.5
リンナイ	0.9
ダイニチ工業	0.2
日東精工	0.6
三洋工業	0.1
岡部	0.9
ジーテクト	0.6
東プレ	0.9
高周波熱錬	0.9
東京製綱	0.3
サンコール	0.4
モリテック　スチール	0.4
パイオラックス	0.7
エイチワン	0.5
日本発條	4.5
中央発條	0.2
アドバネクス	0.1
立川ブラインド工業	0.2
三益半導体工業	0.4
機械	
日本ドライケミカル	0.1
日本製鋼所	1.5
三浦工業	2.1
タクマ	1.7
ツガミ	1.1
オークマ	0.6
芝浦機械	0.6
アマダ	7.7
アイダエンジニアリング	1.3
滝澤鉄工所	0.1
ＦＵＪＩ	2.2
牧野フライス製作所	0.5
オーエスジー	2.3
ダイジェット工業	0.1
旭ダイヤモンド工業	1.3
ＤＭＧ森精機	2.9

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
ソディック	1.1
ディスコ	0.7
日東工器	0.3
日進工具	0.4
パンチ工業	0.4
冨士ダイス	0.2
豊和工業	0.2
ニデックオーケーケー	0.2
石川製作所	0.1
東洋機械金属	0.3
津田駒工業	0.1
エンシュウ	0.1
島精機製作所	0.7
オプトラン	0.6
ＮＣホールディングス	0.1
イワキポンプ	0.3
フリュー	0.4
ヤマシンフィルタ	1
日阪製作所	0.6
やまびこ	0.9
野村マイクロ・サイエンス	0.1
平田機工	0.2
ペガサスミシン製造	0.5
マルマエ	0.2
タツモ	0.2
ナブテスコ	2.8
三井海洋開発	0.5
レオン自動機	0.5
ＳＭＣ	1.4
ホソカワミクロン	0.3
ユニオンツール	0.2
オイレス工業	0.7
日精エー・エス・ビー機械	0.2
サトーホールディングス	0.6
技研製作所	0.4
日本エアーテック	0.2
カワタ	0.2
日精樹脂工業	0.3
オカダアイヨン	0.2

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
ワイエイシイホールディングス	0.2
小松製作所	22.3
住友重機械工業	2.8
日立建機	2
日工	0.7
巴工業	0.2
井関農機	0.5
ＴＯＷＡ	0.4
丸山製作所	0.1
北川鉄工所	0.2
ローツェ	0.2
タカキタ	0.2
クボタ	23.9
荏原実業	0.2
三菱化工機	0.2
月島機械	0.9
帝国電機製作所	0.3
東京機械製作所	0.2
新東工業	1.1
澁谷工業	0.4
アイチ　コーポレーション	0.7
小森コーポレーション	1.2
鶴見製作所	0.4
住友精密工業	0.1
日本ギア工業	0.2
酒井重工業	0.1
荏原製作所	2
石井鐵工所	0.1
西島製作所	0.4
北越工業	0.5
ダイキン工業	6.3
オルガノ	0.1
トーヨーカネツ	0.2
栗田工業	2.7
椿本チエイン	0.6
大同工業	0.2
木村化工機	0.4
アネスト岩田	0.8
ダイフク	2.7

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
サムコ	0.1
加藤製作所	0.2
油研工業	0.1
タダノ	2.6
フジテック	1.8
ＣＫＤ	1.5
キトー	0.4
平和	1.4
理想科学工業	0.4
ＳＡＮＫＹＯ	1.1
日本金銭機械	0.5
マースグループホールディングス	0.3
フクシマガリレイ	0.3
オーイズミ	0.2
ダイコク電機	0.2
竹内製作所	0.7
アマノ	1.3
ＪＵＫＩ	0.7
サンデン	0.7
ジャノメ	0.4
マックス	0.7
グローリー	1.3
新晃工業	0.5
大和冷機工業	0.7
セガサミーホールディングス	4.9
日本ピストンリング	0.2
リケン	0.2
ＴＰＲ	0.7
ツバキ・ナカシマ	1.1
ホシザキ	1.4
大豊工業	0.4
日本精工	9.3
ＮＴＮ	10.6
ジェイテクト	4.7
不二越	0.4
日本トムソン	1.3
ＴＨＫ	2.8
ユーシン精機	0.4
前澤給装工業	0.4

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
イーグル工業	0.6
前澤工業	0.3
日本ピラー工業	0.5
キッツ	1.7
マキタ	6
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	1.8
日立造船	4.2
三菱重工業	7.7
ＩＨＩ	3.1
サノヤスホールディングス	0.6
スター精密	0.7
電気機器	
日清紡ホールディングス	3
イビデン	2.6
コニカミノルタ	10.8
ブラザー工業	6
ミネベアミツミ	8.5
日立製作所	23.7
東芝	8.6
三菱電機	49.3
富士電機	3
東洋電機製造	0.2
安川電機	5.3
シンフォニアテクノロジー	0.6
明電舎	0.8
オリジン	0.1
山洋電気	0.2
デンヨー	0.4
ＰＨＣホールディングス	0.6
東芝テック	0.5
芝浦メカトロニクス	0.1
マブチモーター	1.1
日本電産	12.8
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	0.2
トレックス・セミコンダクター	0.2
東光高岳	0.3
ダブル・スコープ	1.4
ダイヘン	0.5
ヤーマン	0.8

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
ＪＶＣケンウッド	4
ミマキエンジニアリング	0.4
Ｉ－ＰＥＸ	0.2
日新電機	1.2
大崎電気工業	0.9
オムロン	4.1
日東工業	0.7
ＩＤＥＣ	0.6
正興電機製作所	0.2
不二電機工業	0.1
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	1.6
サクサホールディングス	0.1
メルコホールディングス	0.1
テクノメディカ	0.1
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	0.1
日本電気	6.3
富士通	4.4
沖電気工業	2
岩崎通信機	0.2
電気興業	0.3
サンケン電気	0.5
ナカヨ	0.1
アイホン	0.3
ルネサスエレクトロニクス	26.7
セイコーエプソン	6.1
ワコム	3.8
アルバック	1
アクセル	0.2
ＥＩＺＯ	0.4
ジャパンディスプレイ	16.8
日本信号	1.3
京三製作所	1.1
能美防災	0.7
ホーチキ	0.4
星和電機	0.2
エレコム	1.1
パナソニック　ホールディングス	52.6
シャープ	5.6
アンリツ	3.2

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
富士通ゼネラル	1.3
ソニーグループ	30.9
ＴＤＫ	7.1
帝国通信工業	0.2
タムラ製作所	1.9
アルプスアルパイン	4.4
池上通信機	0.1
日本電波工業	0.4
鈴木	0.2
メイコー	0.4
日本トリム	0.1
ローランド　ディー．ジー．	0.3
フォスター電機	0.5
ＳＭＫ	0.1
ヨコオ	0.4
ティアック	0.8
ホシデン	1.2
ヒロセ電機	0.8
日本航空電子工業	1.1
ＴＯＡ	0.5
マクセル	1
古野電気	0.6
ユニデンホールディングス	0.1
スミダコーポレーション	0.5
アイコム	0.2
リオン	0.2
本多通信工業	0.4
横河電機	4.9
新電元工業	0.2
アズビル	2.9
東亜ディーケーケー	0.2
日本光電工業	2
チノー	0.2
共和電業	0.5
日本電子材料	0.3
堀場製作所	0.9
アドバンテスト	3.7
小野測器	0.2
エスペック	0.4

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
キーエンス	4.5
日置電機	0.2
シスメックス	4.2
日本マイクロニクス	0.9
メガチップス	0.5
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	0.2
澤藤電機	0.1
原田工業	0.2
コーセル	0.5
イリソ電子工業	0.4
オプテックスグループ	0.8
千代田インテグレ	0.2
アイ・オー・データ機器	0.2
レーザーテック	2.2
スタンレー電気	3.4
岩崎電気	0.2
ウシオ電機	2.5
岡谷電機産業	0.4
ヘリオス　テクノ　ホールディング	0.4
エノモト	0.1
日本セラミック	0.5
遠藤照明	0.2
古河電池	0.4
双信電機	0.2
山一電機	0.4
図研	0.3
日本電子	1
カシオ計算機	3.6
ファナック	4.3
日本シイエムケイ	1
エンプラス	0.1
大真空	0.7
ローム	2.2
浜松ホトニクス	3.5
三井ハイテック	0.5
新光電気工業	1.4
京セラ	6.9
太陽誘電	2.4
村田製作所	14.5

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
双葉電子工業	0.8
北陸電気工業	0.2
ニチコン	1.6
日本ケミコン	0.5
ＫＯＡ	0.7
市光工業	0.6
小糸製作所	2.7
ミツバ	0.9
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	0.9
キヤノン電子	0.5
キヤノン	24.5
リコー	13.7
象印マホービン	1.3
ＭＵＴＯＨホールディングス	0.1
東京エレクトロン	3.1
輸送用機器	
トヨタ紡織	2
芦森工業	0.1
ユニプレス	0.7
豊田自動織機	4
モリタホールディングス	0.8
三櫻工業	0.7
デンソー	10.8
東海理化電機製作所	1.3
川崎重工業	3.6
名村造船所	1.5
日本車輌製造	0.2
三菱ロジスネクスト	0.7
近畿車輛	0.1
日産自動車	58.1
いすゞ自動車	15.5
トヨタ自動車	249.6
日野自動車	6.2
三菱自動車工業	18.2
エフテック	0.3
レシップホールディングス	0.2
ＧＭＢ	0.1
ファルテック	0.1
武蔵精密工業	1.1

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
日産車体	0.7
新明和工業	1.4
極東開発工業	0.9
トピー工業	0.4
ティラド	0.1
曙ブレーキ工業	2.7
タチエス	0.9
ＮＯＫ	2.4
フタバ産業	1.2
ＫＹＢ	0.5
大同メタル工業	0.9
プレス工業	2.4
ミクニ	0.6
太平洋工業	1
河西工業	0.6
アイシン	3.6
マツダ	15.5
今仙電機製作所	0.3
本田技研工業	38.8
スズキ	11.3
ＳＵＢＡＲＵ	14.1
安永	0.2
ヤマハ発動機	6.4
ＴＢＫ	0.5
エクセディ	0.7
豊田合成	1.6
愛三工業	0.8
盟和産業	0.1
日本プラスト	0.4
ヨロズ	0.5
エフ・シー・シー	0.8
シマノ	2
テイ・エス　テック	2.1
ジャムコ	0.3
精密機器	
テルモ	13.9
クリエートメディック	0.1
日機装	1.5
日本エム・ディ・エム	0.3

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
島津製作所	6.3
ＪＭＳ	0.4
クボテック	0.1
長野計器	0.4
ブイ・テクノロジー	0.2
東京計器	0.3
愛知時計電機	0.3
インターアクション	0.2
オーバル	0.4
東京精密	0.8
マニー	2
ニコン	7.5
トプコン	2.3
オリンパス	25.8
理研計器	0.4
タムロン	0.4
ＨＯＹＡ	9.6
シード	0.2
ノーリツ鋼機	0.4
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	0.4
朝日インテック	5.4
シチズン時計	5.8
リズム	0.2
大研医器	0.4
メニコン	1.6
シンシア	0.1
松風	0.2
セイコーホールディングス	0.7
ニプロ	3.7
その他製品	
中本パックス	0.1
スノーピーク	0.6
パラマウントベッドホールディングス	0.9
トランザクション	0.3
粧美堂	0.1
ニホンフラッシュ	0.4
前田工繊	0.5
永大産業	0.6
アートネイチャー	0.4

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
バンダイナムコホールディングス	4.4
アイフィスジャパン	0.1
共立印刷	0.8
ＳＨＯＥＩ	0.5
フランスベッドホールディングス	0.6
パイロットコーポレーション	0.8
萩原工業	0.3
フジシールインターナショナル	1.2
タカラトミー	2.1
広済堂ホールディングス	0.3
エステールホールディングス	0.1
タカノ	0.2
プロネクサス	0.4
ホクシン	0.3
ウッドワン	0.2
大建工業	0.3
凸版印刷	7.5
大日本印刷	5.8
共同印刷	0.1
ＮＩＳＳＨＡ	1
ＴＡＫＡＲＡ ＆ ＣＯＭＰＡＮＹ	0.3
アシックス	4.4
ツツミ	0.1
ローランド	0.3
小松ウオール工業	0.2
ヤマハ	2.9
河合楽器製作所	0.1
クリナップ	0.5
ピジョン	3
キングジム	0.4
リンテック	1.1
イトーキ	0.9
任天堂	2.8
三菱鉛筆	0.8
タカラスタンダード	1
コクヨ	2.4
ナカバヤシ	0.4
グローブライド	0.4
オカムラ	1.7

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
美津濃	0.5
電気・ガス業	
東京電力ホールディングス	36.9
中部電力	15.1
関西電力	18.7
中国電力	7.7
北陸電力	4.5
東北電力	11.5
四国電力	4.4
九州電力	10.2
北海道電力	4.3
沖縄電力	1
電源開発	4.2
エフオン	0.3
イーレックス	0.7
レノバ	1
東京瓦斯	9.4
大阪瓦斯	8.9
東邦瓦斯	2.3
北海道瓦斯	0.2
広島ガス	0.9
西部ガスホールディングス	0.6
静岡ガス	1.3
メタウォーター	0.5
陸運業	
ＳＢＳホールディングス	0.4
東武鉄道	4.8
相鉄ホールディングス	1.6
東急	12.4
京浜急行電鉄	6.3
小田急電鉄	7.3
京王電鉄	2.6
京成電鉄	3.4
富士急行	0.6
新京成電鉄	0.1
東日本旅客鉄道	8.7
西日本旅客鉄道	6
東海旅客鉄道	4.1
西武ホールディングス	6.4

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
鴻池運輸	0.8
西日本鉄道	1.4
ハマキョウレックス	0.3
サカイ引越センター	0.2
近鉄グループホールディングス	4.7
阪急阪神ホールディングス	5.8
南海電気鉄道	2.1
京阪ホールディングス	2.1
神戸電鉄	0.1
名古屋鉄道	3.8
山陽電気鉄道	0.4
アルプス物流	0.3
ヤマトホールディングス	6.5
山九	1.2
丸運	0.3
丸全昭和運輸	0.4
センコーグループホールディングス	2.3
トナミホールディングス	0.1
ニッコンホールディングス	1.6
日本石油輸送	0.1
福山通運	0.8
セイノーホールディングス	3.2
エスライン	0.1
神奈川中央交通	0.1
日立物流	0.9
丸和運輸機関	1
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	0.5
九州旅客鉄道	3.6
ＳＧホールディングス	8.8
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディン	1.5
海運業	
日本郵船	3.9
商船三井	2.6
川崎汽船	1.4
ＮＳユナイテッド海運	0.3
明治海運	0.6
飯野海運	2.2
共栄タンカー	0.1
乾汽船	0.3

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
空運業	
日本航空	10.7
ＡＮＡホールディングス	11.9
パスコ	0.1
倉庫・運輸関連業	
トランコム	0.1
日新	0.4
三菱倉庫	1.5
三井倉庫ホールディングス	0.5
住友倉庫	1.6
澁澤倉庫	0.3
東陽倉庫	0.8
日本トランスシティ	1
ケイヒン	0.1
中央倉庫	0.3
川西倉庫	0.1
安田倉庫	0.4
ファイズホールディングス	0.1
東洋埠頭	0.1
上組	2.6
サンリツ	0.1
キムラユニティー	0.1
キユーソー流通システム	0.2
近鉄エクスプレス	0.9
東海運	0.3
エーアイテイー	0.3
内外トランスライン	0.2
日本コンセプト	0.1
情報・通信業	
ＮＥＣネッツエスアイ	1.6
クロスキャット	0.1
システナ	6.9
デジタルアーツ	0.3
日鉄ソリューションズ	0.7
キューブシステム	0.2
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	0.1
コア	0.2
ラクーンホールディングス	0.4
ソリトンシステムズ	0.2

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
ソフトクリエイトホールディングス	0.2
ＴＩＳ	4.6
ＪＮＳホールディングス	0.2
グリー	2.2
ＧＭＯペパボ	0.1
コーエーテクモホールディングス	1.5
三菱総合研究所	0.2
ボルテージ	0.1
電算	0.1
ＡＧＳ	0.2
ファインデックス	0.4
ブレインパッド	0.4
ＫＬａｂ	0.9
ポールトゥウィンホールディングス	0.7
ネクソン	10.9
アイスタイル	1.2
エムアップホールディングス	0.6
エイチーム	0.3
エニグモ	0.5
テクノスジャパン	0.4
ｅｎｉｓｈ	0.3
コロプラ	1.6
オルトプラス	0.4
ブロードリーフ	2.4
クロス・マーケティンググループ	0.2
デジタルハーツホールディングス	0.2
システム情報	0.4
メディアドゥ	0.2
じげん	1.4
ブイキューブ	0.5
エンカレッジ・テクノロジ	0.1
サイバーリンクス	0.2
ディー・エル・イー	0.3
フィックスターズ	0.5
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	0.2
オプティム	0.3
セレス	0.2
ＳＨＩＦＴ	0.2
ティーガイア	0.4

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
セック	0.1
テクマトリックス	0.8
プロシップ	0.2
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1.3
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	0.9
ザッパラス	0.2
システムリサーチ	0.1
インターネットイニシアティブ	1.3
さくらインターネット	0.5
ヴィンクス	0.1
ＧＭＯグローバルサイン・ホールディングス	0.1
ＳＲＡホールディングス	0.2
システムインテグレータ	0.2
朝日ネット	0.4
ｅＢＡＳＥ	0.6
アバント	0.5
アドソル日進	0.2
ＯＤＫソリューションズ	0.1
フリービット	0.3
コムチュア	0.5
サイバーコム	0.1
アステリア	0.3
アイル	0.3
マークラインズ	0.2
メディカル・データ・ビジョン	0.6
ｇｕｍｉ	0.7
ショーケース	0.1
モバイルファクトリー	0.1
テラスカイ	0.2
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	0.2
ＰＣＩホールディングス	0.2
パイプドＨＤ	0.1
アイビーシー	0.1
ネオジャパン	0.1
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	0.1
ラクス	1.7
ランドコンピュータ	0.1
ダブルスタンダード	0.1
オープンドア	0.3

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
マイネット	0.2
アカツキ	0.2
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	0.1
カナミックネットワーク	0.5
ノムラシステムコーポレーション	0.2
チェンジ	0.9
シンクロ・フード	0.2
オークネット	0.3
キャピタル・アセット・プランニング	0.1
セグエグループ	0.1
エイトレッド	0.1
マクロミル	1
ビーグリー	0.1
オロ	0.2
ユーザーローカル	0.1
テモナ	0.1
ニーズウェル	0.1
マネーフォワード	0.7
サインポスト	0.2
電算システムホールディングス	0.2
ソルクシーズ	0.4
フェイス	0.1
プロトコーポレーション	0.5
ハイマックス	0.1
野村総合研究所	9.3
サイバネットシステム	0.3
ＣＥホールディングス	0.3
日本システム技術	0.1
インテージホールディングス	0.6
東邦システムサイエンス	0.1
ソースネクスト	2.1
インフォコム	0.5
シンプレクス・ホールディングス	0.6
ＨＥＲＯＺ	0.1
ラクスル	0.5
ＩＰＳ	0.1
ＦＩＧ	0.5
システムサポート	0.2
イーソル	0.3

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
アルテリア・ネットワークス	0.6
東海ソフト	0.1
ウイングアーク１ｓｔ	0.3
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン	0.1
サーバーワークス	0.1
トビラシステムズ	0.1
Ｓａｎｓａｎ	1.7
Ｌｉｎｋ－Ｕ	0.1
ギフティ	0.4
ベース	0.1
ＪＭＤＣ	0.5
フォーカスシステムズ	0.3
クレスコ	0.4
フジ・メディア・ホールディングス	4.7
オービック	1.5
ジャストシステム	0.7
ＴＤＣソフト	0.4
Ｚホールディングス	70.3
トレンドマイクロ	2.6
ＩＤホールディングス	0.3
日本オラクル	0.8
アルファシステムズ	0.1
フューチャー	1
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	0.3
ＳＢテクノロジー	0.2
トーセ	0.1
オービックビジネスコンサルタント	0.5
伊藤忠テクノソリューションズ	2.2
アイティフォー	0.6
東計電算	0.1
エックスネット	0.1
大塚商会	2.6
サイボウズ	0.6
電通国際情報サービス	0.7
ＡＣＣＥＳＳ	0.5
デジタルガレージ	0.8
ＥＭシステムズ	0.8
ウェザーニューズ	0.2
ＣＩＪ	0.3

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
ビジネスエンジニアリング	0.1
日本エンタープライズ	0.5
WOWOW	0.2
スカラ	0.4
インテリジェント　ウェイブ	0.2
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	0.4
ネットワンシステムズ	1.8
システムソフト	1
アルゴグラフィックス	0.4
マーベラス	0.8
エイベックス	0.8
ＢＩＰＲＯＧＹ	1.5
兼松エレクトロニクス	0.3
都築電気	0.2
ＴＢＳホールディングス	2.9
日本テレビホールディングス	4
朝日放送グループホールディングス	0.5
テレビ朝日ホールディングス	1.2
スカパーＪＳＡＴホールディングス	4.1
テレビ東京ホールディングス	0.3
日本ＢＳ放送	0.2
ビジョン	0.8
スマートバリュー	0.1
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	0.5
ワイヤレスゲート	0.2
コネクシオ	0.3
日本通信	4
クロップス	0.1
日本電信電話	50.6
ＫＤＤＩ	35.3
ソフトバンク	73.2
光通信	0.6
エムティーアイ	0.5
GMOインターネット	1.7
ファイバーゲート	0.2
アイドママーケティングコミュニケーション	0.1
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	2.6
学研ホールディングス	0.7
ゼンリン	0.8

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
昭文社ホールディングス	0.2
インプレスホールディングス	0.4
アイネット	0.2
松竹	0.3
東宝	2.9
東映	0.2
エヌ・ティ・ティ・データ	12.9
ピー・シー・エー	0.3
ビジネスブレイン太田昭和	0.2
ＤＴＳ	0.9
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2.2
シーイーシー	0.5
カプコン	4.6
アイ・エス・ビー	0.2
ジャステック	0.3
ＳＣＳＫ	3.3
ＮＳＷ	0.2
アイネス	0.4
ＴＫＣ	0.8
富士ソフト	0.5
ＮＳＤ	1.6
コナミグループ	1.8
福井コンピュータホールディングス	0.2
ＪＢＣＣホールディングス	0.3
ミロク情報サービス	0.4
ソフトバンクグループ	29
卸売業	
高千穂交易	0.2
オルバヘルスケアホールディングス	0.1
伊藤忠食品	0.1
エレマテック	0.4
ＪＡＬＵＸ	0.1
あらた	0.4
トーメンデバイス	0.1
東京エレクトロン　デバイス	0.1
フィールズ	0.4
双日	5.4
アルフレッサ　ホールディングス	5.4
横浜冷凍	1.4

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
神栄	0.1
ラサ商事	0.3
アルコニックス	0.6
神戸物産	3.8
ハイパー	0.1
あい　ホールディングス	0.7
ディーブイエックス	0.2
ダイワボウホールディングス	2.4
マクニカホールディングス	1.2
ラクト・ジャパン	0.2
グリムス	0.2
バイタルケーエスケー・ホールディングス	0.8
八洲電機	0.3
メディアスホールディングス	0.3
レスターホールディングス	0.5
ジューテックホールディングス	0.1
大光	0.2
ＯＣＨＩホールディングス	0.1
ＴＯＫＡＩホールディングス	2.4
黒谷	0.1
Ｃｏｍｉｎｉｘ	0.1
三洋貿易	0.5
ビューティガレージ	0.1
ウイン・パートナーズ	0.4
ミタチ産業	0.1
シップヘルスケアホールディングス	1.6
明治電機工業	0.2
デリカフーズホールディングス	0.2
スターティアホールディングス	0.1
コメダホールディングス	1.1
ピーバンドットコム	0.1
アセンテック	0.2
富士興産	0.1
フルサト・マルカホールディングス	0.5
ヤマエグループホールディングス	0.3
小野建	0.5
南陽	0.1
佐鳥電機	0.3
エコートレーディング	0.1

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
伯東	0.3
コンドーテック	0.4
中山福	0.3
ナガイレーベン	0.6
三菱食品	0.5
松田産業	0.4
第一興商	0.9
メディパルホールディングス	5.2
ＳＰＫ	0.2
萩原電気ホールディングス	0.2
アズワン	0.7
スズデン	0.2
尾家産業	0.1
シモジマ	0.3
ドウシシャ	0.5
小津産業	0.1
高速	0.3
たけびし	0.2
リックス	0.1
丸文	0.4
ハピネット	0.4
橋本総業ホールディングス	0.1
日本ライフライン	1.4
タカショー	0.4
ＩＤＯＭ	1.5
進和	0.3
エスケイジャパン	0.1
ダイトロン	0.2
シークス	0.7
田中商事	0.1
オーハシテクニカ	0.3
白銅	0.2
ダイコー通産	0.1
伊藤忠商事	33.9
丸紅	47.9
高島	0.1
長瀬産業	2.7
蝶理	0.3
豊田通商	4.9

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
三共生興	0.6
兼松	1.8
ツカモトコーポレーション	0.1
三井物産	37.7
日本紙パルプ商事	0.3
カメイ	0.6
ＯＵＧホールディングス	0.1
スターゼン	0.4
山善	2
椿本興業	0.1
住友商事	30.6
内田洋行	0.2
三菱商事	36.4
第一実業	0.2
キヤノンマーケティングジャパン	1.2
西華産業	0.3
佐藤商事	0.4
菱洋エレクトロ	0.3
東京産業	0.4
ユアサ商事	0.5
神鋼商事	0.1
トルク	0.3
阪和興業	1
正栄食品工業	0.3
カナデン	0.4
菱電商事	0.4
岩谷産業	1.2
ナイス	0.2
ニチモウ	0.1
極東貿易	0.1
アステナホールディングス	0.7
三愛オブリ	1.2
稲畑産業	1.1
ＧＳＩクレオス	0.2
明和産業	0.4
クワザワホールディングス	0.2
ワキタ	1
東邦ホールディングス	1.6
サンゲツ	1.3

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
ミツウロコグループホールディングス	0.7
シナネンホールディングス	0.2
伊藤忠エネクス	1.1
サンリオ	1.5
サンワテクノス	0.3
リョーサン	0.5
新光商事	0.7
トーホー	0.2
三信電気	0.2
東陽テクニカ	0.5
モスフードサービス	0.6
加賀電子	0.4
ソーダニッカ	0.5
立花エレテック	0.4
フォーバル	0.2
ＰＡＬＴＡＣ	0.7
三谷産業	0.6
太平洋興発	0.2
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	0.1
コーア商事ホールディングス	0.3
国際紙パルプ商事	1
ヤマタネ	0.2
日鉄物産	0.3
泉州電業	0.1
トラスコ中山	1
オートバックスセブン	1.6
モリト	0.4
加藤産業	0.7
北恵	0.1
イノテック	0.3
イエローハット	0.8
ＪＫホールディングス	0.4
日伝	0.4
北沢産業	0.3
杉本商事	0.2
因幡電機産業	1.3
東テク	0.2
ミスミグループ本社	6.1
アルテック	0.3

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
タキヒヨー	0.1
蔵王産業	0.1
スズケン	1.9
ジェコス	0.3
グローセル	0.6
小売業	
ローソン	1.1
サンエー	0.4
カワチ薬品	0.4
エービーシー・マート	0.8
ハードオフコーポレーション	0.2
アスクル	1.1
ゲオホールディングス	0.6
アダストリア	0.5
ジーフット	0.3
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	0.1
くら寿司	0.5
キャンドゥ	0.2
アイケイ	0.2
パルグループホールディングス	0.4
エディオン	2.2
サーラコーポレーション	1
ワッツ	0.2
ハローズ	0.2
フジオフードグループ本社	0.4
あみやき亭	0.1
ひらまつ	1
大黒天物産	0.2
ハニーズホールディングス	0.4
ファーマライズホールディングス	0.1
アルペン	0.4
ハブ	0.2
クオールホールディングス	0.6
ジンズホールディングス	0.3
ビックカメラ	2.9
ＤＣＭホールディングス	3
ペッパーフードサービス	0.7
ＭｏｎｏｔａＲＯ	6.1
東京一番フーズ	0.1

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
ＤＤホールディングス	0.3
きちりホールディングス	0.1
アークランドサービスホールディングス	0.4
Ｊ．フロント　リテイリング	5.8
ドトール・日レスホールディングス	0.8
マツキヨココカラ＆カンパニー	3
ブロンコビリー	0.3
ＺＯＺＯ	3.3
トレジャー・ファクトリー	0.1
物語コーポレーション	0.2
三越伊勢丹ホールディングス	8.5
Ｈａｍｅｅ	0.2
ウエルシアホールディングス	2.6
クリエイトＳＤホールディングス	0.7
丸善ＣＨＩホールディングス	0.6
ミサワ	0.1
ティーライフ	0.1
エー・ピーホールディングス	0.1
チムニー	0.1
シュッピン	0.4
オイシックス・ラ・大地	0.7
ネクステージ	1
ジョイフル本田	1.5
鳥貴族ホールディングス	0.2
ホットランド	0.4
すかいらーくホールディングス	6.3
ＳＦＰホールディングス	0.2
綿半ホールディングス	0.4
ヨシックスホールディングス	0.1
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	1.4
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.3
ＢＥＥＮＯＳ	0.2
あさひ	0.4
日本調剤	0.3
コスモス薬品	0.5
トーエル	0.2
セブン＆アイ・ホールディングス	19
クリエイト・レストランツ・ホールディング	2.6
ツルハホールディングス	1.1

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
サンマルクホールディングス	0.4
フェリシモ	0.1
トリドールホールディングス	1.2
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	0.4
ウイルプラスホールディングス	0.1
ＪＭホールディングス	0.3
サツドラホールディングス	0.2
アレンザホールディングス	0.4
串カツ田中ホールディングス	0.1
バロックジャパンリミテッド	0.3
クスリのアオキホールディングス	0.5
力の源ホールディングス	0.2
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥ	2.8
メディカルシステムネットワーク	0.5
一家ホールディングス	0.1
藤久ホールディングス	0.2
はるやまホールディングス	0.2
ノジマ	0.8
カッパ・クリエイト	0.7
ライトオン	0.4
良品計画	5.6
パリミキホールディングス	0.6
アドヴァングループ	0.5
アルビス	0.2
コナカ	0.6
ハウス　オブ　ローゼ	0.1
Ｇ－７ホールディングス	0.5
イオン北海道	0.9
コジマ	0.8
ヒマラヤ	0.2
コーナン商事	0.7
エコス	0.2
ワタミ	0.6
マルシェ	0.1
パン・パシフィック・インターナショナルホ	9.7
西松屋チェーン	1.1
ゼンショーホールディングス	2.4
幸楽苑ホールディングス	0.3
ハークスレイ	0.2

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
サイゼリヤ	0.7
ＶＴホールディングス	1.8
魚力	0.1
ポプラ	0.1
フジ・コーポレーション	0.3
ユナイテッドアローズ	0.5
ハイデイ日高	0.7
ＹＵ－ＷＡ　Ｃｒｅａｔｉｏｎ　Ｈｏｌｄｉ	0.3
コロワイド	2
ピーシーデポコーポレーション	0.6
壱番屋	0.3
トップカルチャー	0.2
ＰＬＡＮＴ	0.1
スギホールディングス	1
薬王堂ホールディングス	0.2
ヴィア・ホールディングス	0.6
スクロール	0.7
ヨンドシーホールディングス	0.4
木曽路	0.7
ＳＲＳホールディングス	0.7
千趣会	0.9
タカキュー	0.4
リテールパートナーズ	0.6
ケーヨー	0.9
上新電機	0.6
日本瓦斯	2.4
ロイヤルホールディングス	0.8
いなげや	0.6
チヨダ	0.5
ライフコーポレーション	0.5
リンガーハット	0.6
ＭｒＭａｘＨＤ	0.6
テンアライド	0.5
ＡＯＫＩホールディングス	0.9
オークワ	0.8
コメリ	0.7
青山商事	1
しまむら	0.6
はせがわ	0.3

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
高島屋	3.5
松屋	1
エイチ・ツー・オー　リテイリング	2.3
近鉄百貨店	0.2
丸井グループ	3.8
アクシアル　リテイリング	0.4
井筒屋	0.2
イオン	18.7
イズミ	0.9
平和堂	0.9
フジ	0.6
ヤオコー	0.6
ゼビオホールディングス	0.7
ケーズホールディングス	4.5
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	0.3
日産東京販売ホールディングス	0.7
シルバーライフ	0.1
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	0.2
ナルミヤ・インターナショナル	0.1
ブックオフグループホールディングス	0.3
ギフトホールディングス	0.1
アインホールディングス	0.7
元気寿司	0.1
ヤマダホールディングス	17.7
アークランドサカモト	0.8
ニトリホールディングス	1.9
グルメ杵屋	0.4
愛眼	0.4
ケーユーホールディングス	0.3
吉野家ホールディングス	1.7
松屋フーズホールディングス	0.2
サガミホールディングス	0.7
関西フードマーケット	0.4
王将フードサービス	0.3
プレナス	0.5
ミニストップ	0.4
アークス	0.9
バローホールディングス	1.1
ベルク	0.2

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
大庄	0.3
ファーストリテイリング	0.6
サンドラッグ	1.8
サックスバー　ホールディングス	0.5
ヤマザワ	0.1
やまや	0.1
ベルーナ	1
銀行業	
島根銀行	0.2
じもとホールディングス	0.3
めぶきフィナンシャルグループ	25.3
東京きらぼしフィナンシャルグループ	0.6
九州フィナンシャルグループ	9.9
ゆうちょ銀行	11.5
富山第一銀行	1.2
コンコルディア・フィナンシャルグループ	27.8
西日本フィナンシャルホールディングス	3.2
三十三フィナンシャルグループ	0.5
第四北越フィナンシャルグループ	0.8
ひろぎんホールディングス	7.2
おきなわフィナンシャルグループ	0.4
十六フィナンシャルグループ	0.7
北國フィナンシャルホールディングス	0.5
新生銀行	3.2
あおぞら銀行	2.7
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	304.8
りそなホールディングス	55.6
三井住友トラスト・ホールディングス	9.2
三井住友フィナンシャルグループ	33.6
千葉銀行	16.2
群馬銀行	9.3
武蔵野銀行	0.7
千葉興業銀行	1.1
筑波銀行	1.9
七十七銀行	1.5
青森銀行	0.4
秋田銀行	0.3
山形銀行	0.5
岩手銀行	0.3

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
東邦銀行	4.1
東北銀行	0.2
みちのく銀行	0.3
ふくおかフィナンシャルグループ	4.1
静岡銀行	11.8
スルガ銀行	4.3
八十二銀行	10.9
山梨中央銀行	0.5
大垣共立銀行	1
福井銀行	0.4
清水銀行	0.2
富山銀行	0.1
滋賀銀行	0.9
南都銀行	0.8
百五銀行	4.7
京都銀行	1.7
紀陽銀行	1.6
ほくほくフィナンシャルグループ	3
山陰合同銀行	2.9
中国銀行	3.9
鳥取銀行	0.2
伊予銀行	6.4
百十四銀行	0.5
四国銀行	0.7
阿波銀行	0.7
大分銀行	0.3
宮崎銀行	0.3
佐賀銀行	0.3
琉球銀行	1.1
セブン銀行	14.4
みずほフィナンシャルグループ	62.2
高知銀行	0.2
山口フィナンシャルグループ	5.7
長野銀行	0.2
名古屋銀行	0.4
北洋銀行	7.3
愛知銀行	0.2
中京銀行	0.2
大光銀行	0.2

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
愛媛銀行	0.7
トマト銀行	0.2
京葉銀行	2.1
栃木銀行	2.3
北日本銀行	0.2
東和銀行	0.9
福島銀行	0.6
大東銀行	0.2
トモニホールディングス	3.8
フィデアホールディングス	0.4
池田泉州ホールディングス	5.6
証券、商品先物取引業	
ＦＰＧ	1.6
ジャパンインベストメントアドバイザー	0.4
マーキュリアホールディングス	0.2
ＳＢＩホールディングス	6
日本アジア投資	0.4
ジャフコ　グループ	1.8
大和証券グループ本社	36.4
野村ホールディングス	74.2
岡三証券グループ	3.8
丸三証券	1.4
東洋証券	1.6
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	5.6
光世証券	0.1
水戸証券	1.3
いちよし証券	0.9
松井証券	2.4
マネックスグループ	4
極東証券	0.7
岩井コスモホールディングス	0.5
アイザワ証券グループ	0.8
マネーパートナーズグループ	0.5
スパークス・グループ	2.2
小林洋行	0.1
保険業	
かんぽ生命保険	4.9
ＳＯＭＰＯホールディングス	8
アニコム　ホールディングス	1.5

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホール	10.9
第一生命ホールディングス	23.9
東京海上ホールディングス	16
Ｔ＆Ｄホールディングス	12.6
アドバンスクリエイト	0.2
その他金融業	
全国保証	1.2
あんしん保証	0.1
ジェイリース	0.2
イントラスト	0.2
日本モーゲージサービス	0.3
Ｃａｓａ	0.2
アルヒ	0.7
プレミアグループ	0.2
ネットプロテクションズホールディングス	1.1
クレディセゾン	3.1
芙蓉総合リース	0.5
みずほリース	0.7
東京センチュリー	0.9
日本証券金融	1.9
アイフル	8.2
リコーリース	0.4
イオンフィナンシャルサービス	2.6
アコム	9.8
ジャックス	0.5
オリエントコーポレーション	13.1
オリックス	29.5
三菱ＨＣキャピタル	18
九州リースサービス	0.2
日本取引所グループ	12.3
イー・ギャランティ	0.7
アサックス	0.3
ＮＥＣキャピタルソリューション	0.2
不動産業	
いちご	5.4
日本駐車場開発	5.3
スター・マイカ・ホールディングス	0.3
ＳＲＥホールディングス	0.1
ＡＤワークスグループ	1

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
ヒューリック	11.6
三栄建築設計	0.2
野村不動産ホールディングス	2.5
三重交通グループホールディングス	1
サムティ	0.8
ディア・ライフ	0.6
コーセーアールイー	0.1
地主	0.3
プレサンスコーポレーション	0.6
ＴＨＥグローバル社	0.3
ハウスコム	0.1
ＪＰＭＣ	0.2
サンセイランディック	0.1
エストラスト	0.1
フージャースホールディングス	0.6
オープンハウスグループ	1.5
東急不動産ホールディングス	14.3
飯田グループホールディングス	4.1
イーグランド	0.1
ムゲンエステート	0.3
ビーロット	0.3
ファーストブラザーズ	0.1
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	0.2
シーアールイー	0.1
プロパティエージェント	0.1
ケイアイスター不動産	0.2
アグレ都市デザイン	0.1
グッドコムアセット	0.2
ジェイ・エス・ビー	0.1
テンポイノベーション	0.1
グローバル・リンク・マネジメント	0.1
パーク２４	2.6
パラカ	0.1
宮越ホールディングス	0.2
三井不動産	22.2
三菱地所	31.9
平和不動産	0.8
東京建物	4.8
ダイビル	1.2

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
京阪神ビルディング	0.8
住友不動産	10.2
テーオーシー	0.9
東京楽天地	0.1
レオパレス２１	5
スターツコーポレーション	0.7
フジ住宅	0.6
空港施設	0.5
明和地所	0.2
ゴールドクレスト	0.4
エスリード	0.2
日神グループホールディングス	0.8
日本エスコン	0.9
タカラレーベン	2
ＡＶＡＮＴＩＡ	0.3
イオンモール	2.4
毎日コムネット	0.2
ファースト住建	0.2
ランド	26.5
カチタス	1.2
トーセイ	0.7
穴吹興産	0.1
サンフロンティア不動産	0.7
ＦＪネクストホールディングス	0.5
インテリックス	0.1
ランドビジネス	0.2
サンネクスタグループ	0.2
グランディハウス	0.3
日本空港ビルデング	1.9
サービス業	
明豊ファシリティワークス	0.2
日本工営	0.3
ＬＩＦＵＬＬ	1.4
ミクシィ	1.1
ジェイエイシーリクルートメント	0.4
日本M&Aセンターホールディングス	7.7
メンバーズ	0.1
中広	0.1
ＵＴグループ	0.7

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
アイティメディア	0.2
Ｅ・Ｊホールディングス	0.3
夢真ビーネックスグループ	1.5
コシダカホールディングス	1.3
アルトナー	0.1
パソナグループ	0.5
ＣＤＳ	0.1
リンクアンドモチベーション	1
エス・エム・エス	1.6
サニーサイドアップグループ	0.2
パーソルホールディングス	4.7
リニカル	0.3
クックパッド	1.5
エスクリ	0.2
アイ・ケイ・ケイホールディングス	0.2
学情	0.2
スタジオアリス	0.2
シミックホールディングス	0.3
エプコ	0.1
ＮＪＳ	0.1
綜合警備保障	1.9
カカクコム	3.5
アイロムグループ	0.2
セントケア・ホールディング	0.3
サイネックス	0.1
ルネサンス	0.3
ディップ	0.8
デジタルホールディングス	0.3
新日本科学	0.6
キャリアデザインセンター	0.1
ベネフィット・ワン	1.7
エムスリー	8.3
ツカダ・グローバルホールディング	0.3
ブラス	0.1
アウトソーシング	2.7
ウェルネット	0.5
ワールドホールディングス	0.2
ディー・エヌ・エー	1.8
博報堂ＤＹホールディングス	6.6

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
ぐるなび	0.8
タカミヤ	0.6
ジャパンベストレスキューシステム	0.3
ファンコミュニケーションズ	1.2
ライク	0.2
ビジネス・ブレークスルー	0.2
エスプール	1.3
ＷＤＢホールディングス	0.2
手間いらず	0.1
ティア	0.3
ＣＤＧ	0.1
アドウェイズ	0.7
バリューコマース	0.4
インフォマート	5.2
ＪＰホールディングス	1.2
エコナックホールディングス	0.8
ＣＬホールディングス	0.1
プレステージ・インターナショナル	1.8
アミューズ	0.3
ドリームインキュベータ	0.1
クイック	0.3
ＴＡＣ	0.3
電通グループ	4.9
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.2
ぴあ	0.2
イオンファンタジー	0.2
シーティーエス	0.5
ネクシィーズグループ	0.2
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	1.2
アルプス技研	0.4
サニックス	0.8
ダイオーズ	0.1
日本空調サービス	0.5
オリエンタルランド	5.6
ダスキン	1.1
明光ネットワークジャパン	0.6
ファルコホールディングス	0.2
秀英予備校	0.1
田谷	0.1

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
ラウンドワン	1.3
リゾートトラスト	2.2
ビー・エム・エル	0.6
りらいあコミュニケーションズ	0.7
リソー教育	2.2
早稲田アカデミー	0.3
ユー・エス・エス	5.3
東京個別指導学院	0.4
サイバーエージェント	11.6
楽天グループ	24.2
クリーク・アンド・リバー社	0.2
モーニングスター	0.8
テー・オー・ダブリュー	0.9
山田コンサルティンググループ	0.2
セントラルスポーツ	0.2
フルキャストホールディングス	0.4
エン・ジャパン	0.8
リソルホールディングス	0.1
テクノプロ・ホールディングス	2.8
アトラグループ	0.1
インターワークス	0.1
アイ・アールジャパンホールディングス	0.2
ＫｅｅＰｅｒ技研	0.3
ファーストロジック	0.1
三機サービス	0.1
Ｇｕｎｏｓｙ	0.3
デザインワン・ジャパン	0.1
イー・ガーディアン	0.2
リブセンス	0.3
ジャパンマテリアル	1.4
ベクトル	0.7
ウチヤマホールディングス	0.2
チャーム・ケア・コーポレーション	0.4
キャリアリンク	0.2
ＩＢＪ	0.4
アサンテ	0.2
バリューＨＲ	0.2
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	0.4
ライドオンエクスプレスホールディングス	0.2

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
ＥＲＩホールディングス	0.1
アビスト	0.1
シグマクシス・ホールディングス	0.3
ウィルグループ	0.3
エスクロー・エージェント・ジャパン	0.6
メドピア	0.4
レアジョブ	0.1
リクルートホールディングス	36.3
エラン	0.6
土木管理総合試験所	0.2
ネットマーケティング	0.2
日本郵政	61.5
ベルシステム２４ホールディングス	0.7
鎌倉新書	0.5
ＳＭＮ	0.1
一蔵	0.1
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	0.1
エアトリ	0.3
アトラエ	0.3
ストライク	0.2
ソラスト	1.2
セラク	0.1
インソース	0.5
ベイカレント・コンサルティング	0.3
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	0.1
アイモバイル	0.1
キャリアインデックス	0.2
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	0.2
船場	0.1
ジャパンエレベーターサービスホールディン	1.5
フルテック	0.1
グリーンズ	0.2
ツナググループ・ホールディングス	0.1
ＧａｍｅＷｉｔｈ	0.1
ソウルドアウト	0.1
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	0.1
ウェルビー	0.3
エル・ティー・エス	0.1
ミダックホールディングス	0.2

銘柄	期首(前期末) 株数
	千株
日総工産	0.4
キュービーネットホールディングス	0.2
ＲＰＡホールディングス	0.7
スプリックス	0.1
マネジメントソリューションズ	0.2
プロレド・パートナーズ	0.1
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	0.1
テノ．ホールディングス	0.1
フロンティア・マネジメント	0.1
ピアラ	0.1
コプロ・ホールディングス	0.1
ギークス	0.1
カーブスホールディングス	1.3
フォーラムエンジニアリング	0.3
Ｆａｓｔ　Ｆｉｔｎｅｓｓ　Ｊａｐａｎ	0.1
ダイレクトマーケティングミックス	0.6
ポピンズ	0.1
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	0.4
アドバンテッジリスクマネジメント	0.2
リログループ	2.6
東祥	0.4
ＴＲＥホールディングス	0.6
人・夢・技術グループ	0.2
エイチ・アイ・エス	1
ラックランド	0.1
共立メンテナンス	0.8
イチネンホールディングス	0.5
建設技術研究所	0.3
スペース	0.3
燦ホールディングス	0.2
東京テアトル	0.2
タナベ経営	0.2
ナガワ	0.2
東京都競馬	0.4
常磐興産	0.2
カナモト	0.8
西尾レントオール	0.4
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	2.6
トランス・コスモス	0.6

銘柄	期首(前期末)
	株数
	千株
乃村工藝社	2
藤田観光	0.2
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	0.3
日本管財	0.5
トーカイ	0.4
白洋舎	0.1
セコム	4.6
セントラル警備保障	0.2
丹青社	1
メイテック	0.6
応用地質	0.5

銘柄		期首(前期末)
		株数
		千株
船井総研ホールディングス		1
進学会ホールディングス		0.2
オオバ		0.3
いであ		0.1
学究社		0.2
ベネッセホールディングス		1.6
イオンディライト		0.6
ナック		0.2
ダイセキ		0.9
ステップ		0.2
合計	株数	5,419
	銘柄数	2,162

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
ＴＯＰＩＸマザーファンド	8,726	6,125,424	14,204,860

○有価証券の貸付及び借入の状況

ＴＯＰＩＸマザーファンドにおいて、2022年８月15日現在における貸付株数の総株数は22,431,900株です。

○投資信託財産の構成

（2022年８月15日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ＴＯＰＩＸマザーファンド	14,204,860	99.9
コール・ローン等、その他	12,252	0.1
投資信託財産総額	14,217,112	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年８月15日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	14,217,112,758
コール・ローン等	11,678,446
ＴＯＰＩＸマザーファンド(評価額)	14,204,860,120
未収入金	574,192
(B) 負債	181,258,245
未払収益分配金	170,669,420
未払信託報酬	10,491,461
未払利息	2
その他未払費用	97,362
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	14,035,854,513
元本	8,127,115,267
次期繰越損益金	5,908,739,246
(D) 受益権総口数	8,127,115,267口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	17,270円

＜注記事項＞

①期首元本額　8,118,636,149円
　期中追加設定元本額　402,952,085円
　期中一部解約元本額　394,472,967円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.7270円です。

○損益の状況 (2022年２月15日～2022年８月15日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	158,384,537
受取配当金	158,352,242
受取利息	206
その他収益金	53,188
支払利息	△ 21,099
(B) 有価証券売買損益	433,183,232
売買益	1,281,721,822
売買損	△ 848,538,590
(C) 先物取引等取引損益	△ 4,936,343
取引益	55,959,038
取引損	△ 60,895,381
(D) 信託報酬等	△ 10,588,823
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	576,042,603
(F) 前期繰越損益金	1,430,269,682
(G) 追加信託差損益金	4,073,096,381
(配当等相当額)	(5,657,877,089)
(売買損益相当額)	(△1,584,780,708)
(H) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	6,079,408,666
(I) 収益分配金	△ 170,669,420
次期繰越損益金(Ｈ＋Ｉ)	5,908,739,246
追加信託差損益金	4,073,096,381
(配当等相当額)	(5,657,879,151)
(売買損益相当額)	(△1,584,782,770)
分配準備積立金	1,835,642,865

(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) **(D)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) **(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。

②分配金の計算過程

項　　目	2022年２月15日～ 2022年８月15日
費用控除後の配当等収益額	179,140,434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	184,412,790円
収益調整金額	5,657,879,151円
分配準備積立金額	1,642,759,061円
当ファンドの分配対象収益額	7,664,191,436円
１万口当たり収益分配対象額	9,430円
１万口当たり分配金額	210円
収益分配金金額	170,669,420円

○分配金のお知らせ

１万口当たり分配金（税込み）	210円

◆分配金は決算日から起算して５営業日までにお支払いを開始しております。
◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、2022年８月15日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

［ お 知 ら せ ］

①東京証券取引所の市場区分の見直しに対応するために、投資信託約款に記載している投資対象および投資態度の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
（2022年４月４日）

②株式への投資にあたり、当該ファンドからの直接投資を主とする運用から、マザーファンド経由の投資を主とする運用に運用手法の変更をするため、信託約款に所要の変更を行いました。
（2022年４月４日）

ＴＯＰＩＸマザーファンド

《第21期》決算日2022年３月25日

［計算期間：2021年３月26日～2022年３月25日］

「ＴＯＰＩＸマザーファンド」は、３月25日に第21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21期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）	期中騰落率	株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	円	%		%	%	%	百万円
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
20期(2021年３月25日)	22,066	40.6	3,057.07	40.6	98.8	0.8	506,225
21期(2022年３月25日)	22,839	3.5	3,163.63	3.5	99.1	0.9	739,823

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
（期　首）2021年３月25日	22,066	－	3,057.07	－	98.8	0.8
３月末	22,238	0.8	3,080.87	0.8	98.1	2.0
４月末	21,610	△2.1	2,993.46	△2.1	98.0	1.2
５月末	21,907	△0.7	3,034.76	△0.7	98.7	1.3
６月末	22,166	0.5	3,070.81	0.4	98.1	1.3
７月末	21,683	△1.7	3,003.91	△1.7	99.5	0.5
８月末	22,370	1.4	3,099.08	1.4	99.5	0.5
９月末	23,344	5.8	3,234.08	5.8	97.3	1.6
10月末	23,013	4.3	3,188.28	4.3	99.4	1.3
11月末	22,181	0.5	3,073.26	0.5	99.9	1.0
12月末	22,950	4.0	3,179.28	4.0	98.9	0.7
2022年１月末	21,842	△1.0	3,025.69	△1.0	99.7	0.8
２月末	21,748	△1.4	3,012.57	△1.5	99.0	1.0
（期　末）2022年３月25日	22,839	3.5	3,163.63	3.5	99.1	0.9

（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

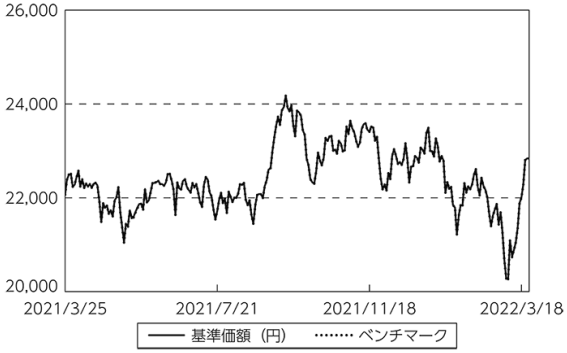
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ3.5%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（3.5%）と同程度となりました。

基準価額等の推移



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

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

●投資環境について
◎国内株式市況
・国内株式市況は上昇しました。
・米景気指標を受けた米金融引き締め観測に加え、ウクライナ情勢緊迫化を警戒し下落する局面もありましたが、円安・米ドル高が進行したことで輸出企業の業績改善に繋がるとの期待等から国内株式市況は上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて
・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
・株式ポートフォリオはベンチマークである東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）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3.5%の上昇になったため、カイ離は0.0%程度となりました。

　ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。
（主なプラス要因）
・その他の要因※によるものです。
　※貸株収入要因等が含まれます。

（主なマイナス要因）
・取引要因によるものです。

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

○１万口当たりの費用明細

（2021年３月26日～2022年３月25日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	0	0.001	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
合計	0	0.001	
期中の平均基準価額は、22,410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

（2021年３月26日～2022年３月25日）

株式

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
		千株	千円	千株	千円
国内	上場	248,637 (13,319)	640,027,454 (－)	160,575	394,647,862

（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 証券数	買付 金額	売付 証券数	売付 金額
	証券	千円	証券	千円
国内	－ (16,500)	－ (－)	5,200 (11,300)	－ (－)

（注）金額は受渡代金。
（注）（　）内は株主割当および権利行使等による増減分で、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	株式先物取引	百万円 120,970	百万円 118,473	百万円 －	百万円 －

○株式売買比率

(2021年３月26日～2022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	1,034,675,316千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	617,188,957千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	1.67

(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

(2021年３月26日～2022年３月25日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	640,027	56,166	8.8	394,647	59,457	15.1
貸付有価証券(株式)	909,575	286,661	31.5	907,773	297,466	32.8

利害関係人の発行する有価証券等

種類	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	10,120	7,127	14,175

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種類	買付額
	百万円
株式	1,168

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）	8,465千円
うち利害関係人への支払額（B）	121千円
（B）／（A）	1.4％

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ＨＣキャピタル、アコム、ジャックス、モルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券です。

○組入資産の明細

（2022年３月25日現在）

国内株式

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業（0.1%）			
極洋	8.2	12.9	45,601
日本水産	235.2	367.6	212,472
マルハニチロ	39.6	57.5	144,900
雪国まいたけ	15.6	26.8	31,865
カネコ種苗	7.7	10.4	16,889
サカタのタネ	30.2	43.8	164,031
ホクト	21.3	30.8	61,261
ホクリヨウ	3.9	5	3,540
鉱業（0.3%）			
住石ホールディングス	44.3	64.3	11,316
日鉄鉱業	5.8	8.4	60,816
三井松島ホールディングス	10.6	15.4	32,324
ＩＮＰＥＸ	931.6	1,474.7	2,194,353
石油資源開発	33.1	43.2	126,230
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	12.3	16.7	28,623
建設業（2.3%）			
ヒノキヤグループ	6.3	8	18,976
ショーボンドホールディングス	36.2	52.5	288,225
ミライト・ホールディングス	87.8	118.3	238,611
タマホーム	15.4	22.3	54,523
サンヨーホームズ	2.9	4.2	3,423
日本アクア	10.1	14.6	8,803
ファーストコーポレーション	7.7	9	7,011
ベステラ	4.8	7.4	8,680
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	47.5	61.3	12,689
キャンディル	4.3	6.3	3,219
スペースバリューホールディングス	30.9	－	－
ダイセキ環境ソリューション	4.9	7.1	8,740
第一カッター興業	6.3	9.1	12,503
安藤・間	162.4	182.5	158,045
東急建設	74.2	107.7	76,036
コムシスホールディングス	89.8	118.5	328,126
ビーアールホールディングス	33.9	50	16,500
高松コンストラクショングループ	15.8	22.9	48,044
東建コーポレーション	7.8	10.2	90,168
ソネック	2.6	3.8	4,043
ヤマウラ	11	17.7	17,770
オリエンタル白石	－	123.6	29,664
大成建設	182.1	245.3	927,234
大林組	585	848.9	805,606
清水建設	548	795.2	614,689
飛島建設	16.8	22.7	24,833
長谷工コーポレーション	191.6	252.8	375,408
松井建設	23	33.4	22,478
錢高組	2.6	3.7	15,928
鹿島建設	428.7	622	972,186
不動テトラ	14.3	18	28,170
大末建設	7.4	8.9	11,721
鉄建建設	11.8	18.4	36,174
西松建設	41.9	51.4	200,203
三井住友建設	141.3	191.4	84,216
大豊建設	12.8	12.4	53,258
前田建設工業	146.5	－	－
佐田建設	13.5	18.3	8,527
ナカノフドー建設	14	20.3	7,105
奥村組	32.2	50	157,500
東鉄工業	25.1	39.4	92,747
イチケン	4.2	6.1	11,956
富士ピー・エス	7.5	10.9	5,613
淺沼組	7	9.5	51,585
戸田建設	242.9	352.5	273,187
熊谷組	27.1	43.3	125,786
北野建設	3.6	5.2	11,674
植木組	2.6	7.5	11,310
矢作建設工業	25.8	37.5	30,600
ピーエス三菱	19.3	27.9	17,074
日本ハウスホールディングス	39.9	57.9	24,607

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大東建託	63.9	86.9	1,157,508
新日本建設	24.9	36.1	27,111
ＮＩＰＰＯ	48.4	－	－
東亜道路工業	3.6	4.4	22,176
前田道路	36.1	－	－
日本道路	5.7	8.2	74,210
東亜建設工業	15.6	20.8	54,600
日本国土開発	56.9	82.6	45,017
若築建設	10.5	14.2	28,712
東洋建設	65.6	95.2	75,874
五洋建設	248.5	336.5	214,350
世紀東急工業	28.1	40.8	32,232
福田組	6.8	9.1	40,859
住友林業	137.6	217.2	482,184
日本基礎技術	17.9	23.3	19,152
巴コーポレーション	26	37.7	19,264
大和ハウス工業	540.2	783.8	2,613,973
ライト工業	33.5	53.4	107,067
積水ハウス	634.5	920.6	2,260,993
日特建設	15.3	17.5	12,810
北陸電気工事	10.1	17.6	14,273
ユアテック	33.5	48.6	35,186
日本リーテック	12.2	17.8	24,581
四電工	3.2	9.2	16,790
中電工	26.9	39.1	84,690
関電工	95.1	138	120,474
きんでん	126.3	189.6	310,375
東京エネシス	19.4	28.2	30,004
トーエネック	5.9	8.5	29,282
住友電設	16.5	21	49,161
日本電設工業	32.1	46.5	78,120
エクシオグループ	88.7	127.6	299,094
新日本空調	15.5	22.4	45,852
九電工	41	65.5	199,775
三機工業	41.5	55.2	80,868
日揮ホールディングス	195.2	261.5	406,894
中外炉工業	6.3	8.5	14,135
ヤマト	18.7	24.9	19,048
太平電業	13	18.8	51,418

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
高砂熱学工業	52.9	76.7	141,741
三晃金属工業	2.3	3.3	8,603
朝日工業社	4.3	5.7	18,382
明星工業	37.8	54.9	39,582
大氣社	28.4	41.3	133,812
ダイダン	13	18.8	40,908
日比谷総合設備	18.8	27.3	51,706
フィル・カンパニー	3.3	4.9	6,066
テスホールディングス	－	17.7	27,771
インフロニア・ホールディングス	－	361.9	403,518
ＯＳＪＢホールディングス	85.1	－	－
東洋エンジニアリング	24.6	35.6	23,745
レイズネクスト	31.4	41	46,084
食料品（3.2%）			
ニップン	54.8	79.5	136,978
日清製粉グループ本社	211.5	306.9	547,202
日東富士製粉	1.4	3.9	18,271
昭和産業	15.8	25.7	70,058
鳥越製粉	16.6	24.1	16,291
中部飼料	22.9	30.6	31,487
フィード・ワン	25.2	36.5	24,929
東洋精糖	3.2	4.6	4,811
日本甜菜製糖	9.8	14.2	24,353
ＤＭ三井製糖ホールディングス	14.8	24.7	49,894
塩水港精糖	22.3	32.4	7,160
日新製糖	8.9	12.9	23,349
森永製菓	43.9	63.8	248,820
中村屋	4.5	6.5	20,670
江崎グリコ	51.6	74.8	283,866
名糖産業	8.2	12	19,644
井村屋グループ	10.6	15.4	35,697
不二家	11.9	15.2	37,620
山崎製パン	140.3	203.6	305,400
第一屋製パン	3.6	5.2	2,839
モロゾフ	3	8.6	26,058
亀田製菓	10.7	15.5	63,240
寿スピリッツ	18	26.2	178,422
カルビー	85.3	123.8	307,643
森永乳業	34.6	50.3	275,141

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
六甲バター	12.4	19.8	31,244
ヤクルト本社	128.8	201.2	1,331,944
明治ホールディングス	123.8	179.6	1,215,892
雪印メグミルク	45.1	65.4	135,835
プリマハム	26.3	34	77,894
日本ハム	71.6	103.8	442,707
林兼産業	6.2	8.2	4,329
丸大食品	18.4	26.7	40,904
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	16.8	24.4	83,448
柿安本店	6.5	9.4	22,757
伊藤ハム米久ホールディングス	120.6	174.9	120,156
サッポロホールディングス	63.9	92.7	217,566
アサヒグループホールディングス	409	639.1	2,840,799
キリンホールディングス	794	998.5	1,828,752
宝ホールディングス	138.8	184.6	215,982
オエノンホールディングス	53.2	77.2	25,321
養命酒製造	5.7	8.3	14,857
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールデ	143.4	190.7	282,426
サントリー食品インターナショナル	125.3	181.8	857,187
ダイドーグループホールディングス	10.6	13.9	66,442
伊藤園	56.8	82.5	524,700
キーコーヒー	18.4	26.7	54,254
ユニカフェ	5.6	8.2	8,109
ジャパンフーズ	2.7	3.9	4,746
日清オイリオグループ	24.1	34	100,980
不二製油グループ本社	45.6	58.9	118,565
かどや製油	2	3	11,565
Ｊ－オイルミルズ	8.7	25.3	43,060
キッコーマン	134.8	195.5	1,597,235
味の素	445.3	599.9	2,146,442
ブルドックソース	8.5	11.4	25,467
キユーピー	104.3	142.7	344,763
ハウス食品グループ本社	70	101.6	308,864
カゴメ	76.5	103.1	330,435
焼津水産化学工業	9.1	13.2	12,381
アリアケジャパン	17.1	24.8	130,944
ピエトロ	2.4	3.5	6,384
エバラ食品工業	4.1	5.9	16,679
やまみ	2	2.3	4,075

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	89.2	123.9	303,926
東洋水産	96.3	130.5	588,555
イートアンドホールディングス	6.5	10.2	21,379
大冷	2.1	3	5,751
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10.5	14	7,742
日清食品ホールディングス	73.5	106.6	933,816
永谷園ホールディングス	9.1	12.1	24,103
一正蒲鉾	7.3	11.7	9,945
フジッコ	20.3	25.3	50,625
ロック・フィールド	20.2	29.3	42,279
日本たばこ産業	1,003.9	1,456.6	3,045,750
ケンコーマヨネーズ	11.5	15.2	21,690
わらべや日洋ホールディングス	12.2	17.8	31,310
なとり	10.4	15.2	31,023
イフジ産業	2.9	4.7	4,742
ピックルスコーポレーション	4.5	13	20,124
ファーマフーズ	12.8	25.7	54,072
北の達人コーポレーション	65.4	－	－
ユーグレナ	80.9	138.4	113,764
紀文食品	－	15.8	17,632
ミヨシ油脂	6.6	10.4	12,168
理研ビタミン	17.7	28.2	48,898
繊維製品（0.4%）			
片倉工業	24.5	29.6	64,764
グンゼ	13.4	16.9	65,825
東洋紡	72.2	104.8	118,843
ユニチカ	53.5	72.8	21,403
富士紡ホールディングス	8.8	11.8	40,887
倉敷紡績	16.8	22.7	41,836
シキボウ	10.3	13.9	12,732
日本毛織	60.1	79.9	72,309
ダイトウボウ	29.5	42.9	3,903
トーア紡コーポレーション	7.2	9.8	3,871
ダイドーリミテッド	24	34.8	5,115
帝国繊維	20.6	29.9	53,371
帝人	172	249.5	350,048
東レ	1,322.9	1,919.5	1,257,272
サカイオーベックス	4.8	－	－
住江織物	4	5.2	9,318

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本フエルト	10.3	15	6,930
イチカワ	2.4	3.4	4,875
日東製網	2	2.8	4,597
アツギ	14	20.4	12,362
ダイニック	6.9	10	7,690
セーレン	44.9	54.3	123,858
ソトー	7.3	9.7	8,633
東海染工	2.3	3	3,594
小松マテーレ	30	43.5	62,988
ワコールホールディングス	45.6	66.1	126,779
ホギメディカル	24.6	35.7	119,952
クラウディアホールディングス	4.5	6.5	1,579
ＴＳＩホールディングス	55.5	88.5	29,736
マツオカコーポレーション	5.8	8.5	10,089
ワールド	23.9	34.7	42,091
三陽商会	9.5	12.7	9,245
ナイガイ	6.7	9	2,592
オンワードホールディングス	109.8	159.3	42,214
ルックホールディングス	6.2	8.4	13,070
キムラタン	102.1	148.7	2,676
ゴールドウイン	30.2	47.8	305,442
デサント	31.2	51.7	158,202
キング	9.7	12.5	6,700
ヤマトインターナショナル	16	23.3	6,920
パルプ・紙（0.2%）			
特種東海製紙	11.2	16.3	52,975
王子ホールディングス	822.5	1,108.2	667,136
日本製紙	80.8	127	136,779
三菱製紙	25.9	37.6	12,182
北越コーポレーション	130.7	173.8	124,614
中越パルプ工業	7	10.1	9,908
巴川製紙所	6	7.9	6,683
大王製紙	88.1	127.8	212,531
阿波製紙	4.7	6.8	2,366
レンゴー	188.4	250.6	198,976
トーモク	11.2	16.3	26,748
ザ・パック	13.8	20.1	53,224
化学（6.5%）			
北の達人コーポレーション	－	94.8	21,424

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
クラレ	287.7	387.7	412,125
旭化成	1,211	1,757.1	1,957,409
共和レザー	9.9	16.5	10,972
昭和電工	138.7	229.9	560,956
住友化学	1,438.2	1,947.6	1,151,031
住友精化	8.9	11.7	38,259
日産化学	100.8	144.2	1,065,638
ラサ工業	6	9.3	15,112
クレハ	15.7	21	202,860
多木化学	7.1	10.3	53,869
テイカ	13.4	19.4	26,364
石原産業	32.7	44.1	47,495
片倉コープアグリ	4.7	6	7,956
日本曹達	25.5	33.9	118,989
東ソー	282.4	382.5	728,280
トクヤマ	54.3	84.8	150,096
セントラル硝子	34.8	43.3	92,185
東亜合成	111.5	147.3	164,828
大阪ソーダ	18.6	24.7	78,299
関東電化工業	43.3	58	63,278
デンカ	66.7	96.7	343,285
信越化学工業	337.8	455.2	8,735,288
日本カーバイド工業	6.5	9.5	13,509
堺化学工業	12.8	18.6	36,214
第一稀元素化学工業	18.4	24.6	25,731
エア・ウォーター	186.3	251	440,003
日本酸素ホールディングス	150.5	254.8	609,226
日本化学工業	5.2	8.2	19,942
東邦アセチレン	2.7	4.4	5,249
日本パーカライジング	92.2	133.7	133,298
高圧ガス工業	29	42	28,686
チタン工業	2.3	3.1	5,663
四国化成工業	24.3	34.6	47,678
戸田工業	3.9	5.6	15,355
ステラ　ケミファ	9.9	13.3	35,923
保土谷化学工業	5.4	8.5	36,380
日本触媒	33.1	44.6	248,868
大日精化工業	15.1	21.9	46,887
カネカ	47.3	68.6	249,361

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三菱瓦斯化学	183	246.6	544,246
三井化学	157.7	240.8	769,356
ＪＳＲ	183.4	247	923,780
東京応化工業	31.3	43	319,060
大阪有機化学工業	16.9	22.6	68,930
三菱ケミカルホールディングス	1,221.4	1,772.2	1,499,635
ＫＨネオケム	30.1	43.7	122,534
ダイセル	245.6	381.9	329,197
住友ベークライト	28.7	41.7	213,087
積水化学工業	386.4	554.7	1,030,632
日本ゼオン	164.8	239.1	329,718
アイカ工業	50.9	73.8	228,780
宇部興産	92.3	124.9	259,417
積水樹脂	30.1	40	73,400
タキロンシーアイ	39.5	57.4	31,684
旭有機材	10.3	15	31,335
ニチバン	9.6	15.7	27,318
リケンテクノス	44.6	64.7	30,732
大倉工業	8.6	13.6	25,187
積水化成品工業	24.5	35.5	16,010
群栄化学工業	4.2	6	18,480
タイガースポリマー	9.6	13.9	6,435
ミライアル	5.9	8.5	14,968
ダイキアクシス	6.7	10.3	7,941
ダイキョーニシカワ	38.5	55.9	31,807
竹本容器	6.5	9.5	8,084
森六ホールディングス	9.8	14.3	26,640
恵和	2.7	7.2	35,820
日本化薬	113.1	208.8	247,219
カーリットホールディングス	18.1	26.3	18,120
日本精化	13.2	21.3	48,734
扶桑化学工業	14.4	23.9	101,933
トリケミカル研究所	16.9	27.3	76,521
ＡＤＥＫＡ	84.1	122.1	331,135
日油	68.8	90.5	469,695
新日本理化	30.2	43.9	10,667
ハリマ化成グループ	13.6	19.7	16,351
花王	446.7	598.8	3,016,754
第一工業製薬	6.2	9.9	27,442

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
石原ケミカル	4.6	13.4	18,130
日華化学	6.2	8.9	6,657
ニイタカ	3.8	5.5	13,739
三洋化成工業	10.9	15.8	82,002
有機合成薬品工業	14	18.5	5,106
大日本塗料	20.6	32.5	26,975
日本ペイントホールディングス	150.7	996	1,097,592
関西ペイント	205.3	274.9	570,967
神東塗料	14.4	20.8	3,265
中国塗料	44	62.5	58,187
日本特殊塗料	13.7	19.8	17,226
藤倉化成	24.6	33	15,939
太陽ホールディングス	13.4	39	130,455
ＤＩＣ	77.2	112	286,384
サカタインクス	39.9	52.6	49,496
東洋インキＳＣホールディングス	38.6	56	106,848
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	14.1	21.4	19,688
富士フイルムホールディングス	327.9	475.7	3,605,806
資生堂	370.7	504.2	3,110,914
ライオン	242.5	326.8	455,232
高砂香料工業	11.7	18.6	52,470
マンダム	39.1	56.8	73,840
ミルボン	24.9	33.4	179,692
ファンケル	67.9	109.5	308,023
コーセー	35.1	50.9	656,610
コタ	10.7	17.2	28,173
シーボン	2.4	3.5	6,405
ポーラ・オルビスホールディングス	79.6	115.5	186,648
ノエビアホールディングス	15.8	23	114,770
アジュバンホールディングス	4.2	6.1	6,764
新日本製薬	3.8	7.3	10,585
エステー	12	17.4	26,326
アグロ　カネショウ	7	9	10,845
コニシ	30.6	44.5	72,001
長谷川香料	32.2	46.7	121,420
星光ＰＭＣ	10.7	15.3	9,149
小林製薬	52.3	75.8	787,562
荒川化学工業	15.5	22.6	25,470
メック	12.8	20.2	70,902

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本高純度化学	5.1	7.4	18,507
タカラバイオ	48.8	70.8	165,105
ＪＣＵ	21	30.4	128,136
新田ゼラチン	11.7	17	11,560
ＯＡＴアグリオ	3.5	11.2	13,316
デクセリアルズ	52.1	70.4	230,912
アース製薬	14.1	22.3	123,096
北興化学工業	17.4	25.2	23,864
大成ラミック	5.7	8.3	22,916
クミアイ化学工業	77.1	100.7	89,824
日本農薬	33.2	48.2	29,932
アキレス	12.9	17.3	23,043
有沢製作所	25.9	39.5	40,329
日東電工	119.5	163.6	1,485,488
レック	22.1	35.3	32,793
三光合成	19.6	30.9	10,784
きもと	28.6	41.4	9,066
藤森工業	16.7	24.3	94,162
前澤化成工業	11.8	17.2	22,308
未来工業	6.7	9.7	15,355
ウェーブロックホールディングス	6.4	10.3	7,148
ＪＳＰ	10.9	15.8	25,153
エフピコ	34.3	49.7	151,088
天馬	14	21.3	52,717
信越ポリマー	28.7	48.6	54,432
東リ	46.4	67.4	15,973
ニフコ	68.5	90.3	259,612
バルカー	15.2	22	60,016
ユニ・チャーム	395.5	521.7	2,254,265
ショーエイコーポレーション	4.1	7.3	4,737
医薬品（5.0%）			
協和キリン	187.7	317.7	962,631
武田薬品工業	1,552.1	2,127.5	7,684,530
アステラス製薬	1,617.4	2,346.9	4,602,270
大日本住友製薬	138.3	167.2	214,350
塩野義製薬	234.6	340.4	2,690,521
わかもと製薬	22.2	32.2	9,370
あすか製薬	21.2	－	－
日本新薬	52.9	70.8	615,960

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	3.2	－	－
中外製薬	583.5	846.6	3,532,861
科研製薬	31.9	42.5	170,850
エーザイ	206.1	324	1,933,308
ロート製薬	88.9	138.9	541,015
小野薬品工業	428.4	621.6	1,966,120
久光製薬	54.3	71.6	276,376
持田製薬	25.9	34.1	134,183
参天製薬	324.6	504.9	673,031
扶桑薬品工業	6	9.5	21,337
日本ケミファ	2.2	3.2	6,947
ツムラ	62.2	83.9	287,357
日医工	52.8	84	68,292
キッセイ薬品工業	33	47.9	124,252
生化学工業	32.9	47.7	43,597
栄研化学	32.8	47.6	85,727
日水製薬	6.9	9.9	9,840
鳥居薬品	11.7	14.5	45,747
ＪＣＲファーマ	52.6	76.3	164,960
東和薬品	26.9	39	112,671
富士製薬工業	12.7	16.6	16,716
沢井製薬	40.9	－	－
ゼリア新薬工業	33.8	49.1	97,021
第一三共	1,601.5	2,127.1	5,743,170
キョーリン製薬ホールディングス	41.2	54.3	102,246
大幸薬品	22.9	40.8	23,949
ダイト	11.9	17.6	51,286
大塚ホールディングス	387.7	562.5	2,400,187
大正製薬ホールディングス	44.4	64.4	396,704
ペプチドリーム	96.2	142	302,460
あすか製薬ホールディングス	－	30.8	35,635
サワイグループホールディングス	－	59.3	273,669
石油・石炭製品（0.5%）			
日本コークス工業	157.6	228.7	35,905
ニチレキ	22	34.6	44,080
ユシロ化学工業	10.5	14	14,980
ビーピー・カストロール	6.7	9.7	11,843
富士石油	45.3	72.3	20,894
ＭＯＲＥＳＣＯ	6.7	9	10,386

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
出光興産	207	300.4	1,055,906
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,806.3	4,071.9	1,937,817
コスモエネルギーホールディングス	58.9	78.4	216,697
ゴム製品（0.6%）			
横浜ゴム	108	156.7	254,480
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	98.2	142.5	221,730
ブリヂストン	496	779.7	3,605,332
住友ゴム工業	167.6	243.2	270,681
藤倉コンポジット	16.3	21.7	15,949
オカモト	11.4	16.1	65,205
フコク	8.2	11.8	11,375
ニッタ	19.3	28	79,660
住友理工	36.2	52.5	32,445
三ツ星ベルト	22.7	32.9	67,642
バンドー化学	32.8	43.6	40,373
ガラス・土石製品（0.7%）			
日東紡績	27.8	40.3	117,152
ＡＧＣ	171.2	248.5	1,201,497
日本板硝子	94.7	129.9	56,246
石塚硝子	3.2	4.6	9,342
日本山村硝子	7.7	10.3	8,827
日本電気硝子	69.2	108.7	300,338
オハラ	7.4	10.7	14,231
住友大阪セメント	33.6	50.1	170,089
太平洋セメント	110.5	153.8	314,059
日本ヒューム	17	27.1	19,701
日本コンクリート工業	40.2	53.4	16,020
三谷セキサン	8.7	12.6	90,342
アジアパイルホールディングス	28.7	41.6	18,387
東海カーボン	182.4	226.8	262,861
日本カーボン	10.3	13.9	58,032
東洋炭素	10.9	17.6	55,264
ノリタケカンパニーリミテド	10.3	15	67,125
ＴＯＴＯ	133.3	193.3	976,165
日本碍子	205.3	293.2	518,377
日本特殊陶業	141.9	205.9	423,124
ダントーホールディングス	13.9	17.6	4,294
ＭＡＲＵＷＡ	6.4	9.4	154,254
品川リフラクトリーズ	4.4	6.3	24,633

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
黒崎播磨	3.2	4.6	19,320
ヨータイ	13.3	17.2	21,861
イソライト工業	8.2	－	－
東京窯業	23.7	34.4	10,388
ニッカトー	8.4	12.2	6,746
フジミインコーポレーテッド	15	21.7	150,815
クニミネ工業	5.9	8.5	8,627
エーアンドエーマテリアル	3.6	4.6	4,144
ニチアス	47.1	62.7	159,007
ニチハ	25.9	37.6	97,797
鉄鋼（0.9%）			
日本製鉄	880.6	1,197.9	2,735,404
神戸製鋼所	337.6	499.6	313,249
中山製鋼所	25.6	42.4	19,504
合同製鐵	9.9	14.4	19,382
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	533.8	722.9	1,334,473
東京製鐵	71.8	91.2	108,619
共英製鋼	20.8	30.2	42,884
大和工業	39.2	51.2	203,520
東京鐵鋼	7.1	11.8	16,708
大阪製鐵	9.8	14.2	22,421
淀川製鋼所	24.9	35.1	98,280
丸一鋼管	59.9	94.8	266,388
モリ工業	5.5	7.9	21,195
大同特殊鋼	30.2	43.8	170,382
日本高周波鋼業	6.8	9.9	3,465
日本冶金工業	14.4	19.5	57,993
山陽特殊製鋼	22.1	27.5	57,942
愛知製鋼	10.4	15	37,425
日立金属	173.9	288.3	577,464
日本金属	4.7	6.8	9,962
大平洋金属	12.5	16.5	75,735
新日本電工	119	172.8	61,171
栗本鐵工所	8.3	12.1	18,779
虹技	2.5	3.7	3,677
日本鋳鉄管	2.1	2.8	2,956
三菱製鋼	13.6	17.2	21,293
日亜鋼業	27	34.8	9,709
日本精線	2.6	4.4	19,492

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エンビプロ・ホールディングス	7.8	8.9	14,658
シンニッタン	22.3	32.4	7,776
新家工業	4.6	6.6	11,266
非鉄金属（0.8%）			
大紀アルミニウム工業所	27.8	40.3	68,630
日本軽金属ホールディングス	50.3	67.7	124,838
三井金属鉱業	49.8	72.2	259,920
東邦亜鉛	10.2	14.8	45,658
三菱マテリアル	121.8	176.8	412,828
住友金属鉱山	235.8	342.1	2,253,754
ＤＯＷＡホールディングス	46.7	72.9	444,690
古河機械金属	30.5	44.2	60,377
エス・サイエンス	81.6	132	5,412
大阪チタニウムテクノロジーズ	19.2	30.9	44,187
東邦チタニウム	33	47.9	71,897
ＵＡＣＪ	28	40.6	97,927
ＣＫサンエツ	3.9	5.6	22,260
古河電気工業	57.3	83.1	186,808
住友電気工業	643.8	1,000.8	1,503,702
フジクラ	222.8	298.4	179,935
昭和電線ホールディングス	17.9	23.3	44,176
東京特殊電線	2.4	4	11,520
タツタ電線	32.5	47.2	22,656
カナレ電気	3.1	4	6,216
平河ヒューテック	10.2	14.8	17,730
リョービ	22.7	32.9	35,137
アーレスティ	22.7	28.5	11,286
アサヒホールディングス	34.6	107.2	252,134
金属製品（0.6%）			
稲葉製作所	10.4	15.1	19,886
宮地エンジニアリンググループ	6	8.1	29,403
トーカロ	47.6	69	94,737
アルファＣｏ	6.5	10.3	10,825
ＳＵＭＣＯ	236.1	412	834,712
川田テクノロジーズ	3.8	5.5	20,515
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	6	8.7	55,332
ジェイテックコーポレーション	1.5	3.4	6,354
信和	9.8	16.6	13,612
東洋製罐グループホールディングス	117.5	170.5	249,271

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ホッカンホールディングス	9.4	14.7	20,212
コロナ	10.2	14.8	13,083
横河ブリッジホールディングス	31.7	45.9	90,652
駒井ハルテック	3.7	5	10,720
高田機工	1.7	2.4	7,224
三和ホールディングス	173.9	252.4	313,985
文化シヤッター	54.4	84.9	86,767
三協立山	23.8	34.5	22,287
アルインコ	12.2	19.4	17,052
東洋シヤッター	4.1	5.9	3,422
ＬＩＸＩＬ	254.1	421.3	1,009,856
日本フイルコン	12.8	18.6	9,895
ノーリツ	38.2	51.2	75,673
長府製作所	18.8	27.2	54,427
リンナイ	35.9	50.4	470,232
ダイニチ工業	8.8	12.8	8,947
日東精工	23.2	33.6	17,102
三洋工業	2.2	3.3	6,157
岡部	37.4	51.1	35,974
ジーテクト	22.9	33.2	45,185
東プレ	34.4	49.9	59,730
高周波熱錬	35.5	47.8	29,014
東京製綱	13.2	16.4	15,334
サンコール	15.8	22.9	11,541
モリテック　スチール	14.4	20.9	7,064
パイオラックス	27.3	38.4	62,169
エイチワン	18.1	26.2	16,584
日本発條	183.8	246.1	219,275
中央発條	2.2	12.9	10,049
アドバネクス	2.6	3.5	5,607
立川ブラインド工業	8.1	11.8	13,239
三益半導体工業	14.4	20.9	53,524
機械（5.3%）			
日本ドライケミカル	4.6	6.6	11,655
日本製鋼所	56	81.3	307,720
三浦工業	79.8	115.8	367,086
タクマ	62.5	90.7	139,678
ツガミ	38.2	58.8	79,380
オークマ	21.5	31.2	160,368

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
芝浦機械	19.1	30.2	101,472
アマダ	270.4	422.5	463,905
アイダエンジニアリング	48.3	70	75,810
滝澤鉄工所	5.3	7.7	9,286
ＦＵＪＩ	73.7	123.3	284,823
牧野フライス製作所	21.6	29.3	115,881
オーエスジー	91	123.9	240,737
ダイジェット工業	2.1	3	4,029
旭ダイヤモンド工業	48.4	70.2	42,822
ＤＭＧ森精機	116.7	158.8	263,608
ソディック	40.2	58.8	46,216
ディスコ	25	39.4	1,351,420
日東工器	8.8	14.7	23,946
日進工具	7.2	21	32,865
パンチ工業	15.4	22.4	11,424
冨士ダイス	9.3	13.4	9,112
豊和工業	10.2	13.7	11,521
ＯＫＫ	7.1	9.6	9,484
石川製作所	4.8	7	11,130
東洋機械金属	13.2	17.4	11,971
津田駒工業	3.5	5.1	2,973
エンシュウ	4.4	5.9	4,130
島精機製作所	27	39.1	72,843
オプトラン	23.1	33.5	70,752
ＮＣホールディングス	5.6	7.5	17,662
イワキポンプ	11.7	17	18,564
フリュー	18	23.8	26,537
ヤマシンフィルタ	37.2	54	19,656
日阪製作所	22.7	33	27,192
やまびこ	35.8	51.9	74,424
野村マイクロ・サイエンス	－	7	29,295
平田機工	8.7	12.7	69,850
ペガサスミシン製造	18.7	27.1	15,555
マルマエ	6.8	11	30,316
タツモ	7.8	12.5	19,962
ナブテスコ	108.7	152.6	488,320
三井海洋開発	19.6	28.4	37,090
レオン自動機	18.1	28.6	27,885
ＳＭＣ	54.6	79.3	5,539,105

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ホソカワミクロン	6.5	18.8	50,346
ユニオンツール	6.9	10	37,750
オイレス工業	25.8	37.5	59,662
日精エー・エス・ビー機械	5.3	9	29,205
サトーホールディングス	24.3	35.2	62,304
技研製作所	16.3	23.7	88,282
日本エアーテック	6	12.3	13,554
カワタ	5	8.5	9,095
日精樹脂工業	14.2	18.7	19,504
オカダアイヨン	5.8	8.4	12,474
ワイエイシイホールディングス	7.3	10.7	16,574
小松製作所	845.2	1,226.7	3,691,140
住友重機械工業	106.8	154.9	465,474
日立建機	87.2	108.5	346,657
日工	27.8	37	23,347
巴工業	7.3	10.6	25,577
井関農機	18.6	25.1	32,730
ＴＯＷＡ	17.4	23.1	59,205
丸山製作所	3.8	5.5	8,899
北川鉄工所	8.4	12.2	16,604
ローツェ	8.2	13.3	154,413
タカキタ	6.5	9.4	5,724
クボタ	980	1,311.2	3,060,996
荏原実業	4.7	12.4	30,528
三菱化工機	6	8.6	17,793
月島機械	34.4	49.8	54,381
帝国電機製作所	13	18.9	29,295
東京機械製作所	7.6	11	8,096
新東工業	44.3	59.6	42,256
澁谷工業	16.3	23.7	58,965
アイチ　コーポレーション	32.2	38.5	34,919
小森コーポレーション	47.3	68.6	53,645
鶴見製作所	14.3	20.8	39,020
住友精密工業	2.8	4	8,216
日本ギア工業	7.4	9.6	2,755
酒井重工業	3.3	4.8	15,816
荏原製作所	77.3	108.2	746,580
石井鐵工所	2.6	3.8	11,476
西島製作所	18.8	24.5	25,186

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
北越工業	19.2	25.3	22,643
ダイキン工業	237.7	344.9	7,949,945
オルガノ	6	7.8	79,404
トーヨーカネツ	7	10.2	26,112
栗田工業	101	146.5	692,945
椿本チエイン	26.6	35.4	112,926
大同工業	8.9	11.9	11,424
木村化工機	15.5	22.5	19,575
アネスト岩田	31.4	42.1	35,069
ダイフク	102.7	149	1,311,200
サムコ	4.7	6.8	17,741
加藤製作所	10.2	12.8	10,329
油研工業	3.1	4.5	8,154
タダノ	90	141.5	147,160
フジテック	64.2	100.4	314,754
ＣＫＤ	43.3	79.9	152,369
キトー	15.7	23	40,641
平和	52	75.5	144,809
理想科学工業	14.4	22.7	46,285
ＳＡＮＫＹＯ	44.3	58.5	205,042
日本金銭機械	20.6	27.4	18,632
マースグループホールディングス	11.8	17.2	30,203
フクシマガリレイ	12.8	18.5	73,907
オーイズミ	7.8	9.5	3,781
ダイコク電機	8.6	12.4	15,772
竹内製作所	31.2	41.2	106,955
アマノ	48.8	70.9	159,737
ＪＵＫＩ	26	37.7	30,725
サンデン	26	37.5	7,575
ジャノメ	17	23	17,526
マックス	25.6	36	61,560
グローリー	47.9	69.5	146,158
新晃工業	17.3	25.2	44,125
大和冷機工業	30	39.1	42,228
セガサミーホールディングス	169.6	268.5	590,700
日本ピストンリング	6.8	9.9	13,523
リケン	8.6	11.6	29,046
ＴＰＲ	25.1	36.4	49,285
ツバキ・ナカシマ	35.7	59.4	56,489

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ホシザキ	58.7	79.1	681,051
大豊工業	15.2	22.1	15,978
日本精工	383.1	509.6	387,296
ＮＴＮ	431.7	581.7	125,647
ジェイテクト	178.9	259.6	254,927
不二越	17.3	23	98,095
日本トムソン	51.1	74.1	39,865
ＴＨＫ	116.3	152.8	408,740
ユーシン精機	12.4	21	14,196
前澤給装工業	6.5	20.3	20,584
イーグル工業	23.1	33.5	34,304
前澤工業	11.2	18	12,096
日本ピラー工業	18.9	27.4	84,666
キッツ	57.6	91.2	63,110
マキタ	243.3	329.4	1,346,257
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	－	97.8	36,968
日立造船	147.9	228.9	171,446
三菱重工業	293.1	425.3	1,722,890
ＩＨＩ	125.4	169	506,324
サノヤスホールディングス	－	33.4	4,475
スター精密	28.7	40.8	61,689
電気機器（17.9%）			
日清紡ホールディングス	114	165.5	184,367
イビデン	89.7	142	883,240
コニカミノルタ	378.5	591.4	315,216
ブラザー工業	227.8	330.5	751,226
ミネベアミツミ	321.6	466.6	1,250,021
日立製作所	896.9	1,301.9	8,032,723
東芝	276.9	473	2,264,724
三菱電機	1,865.4	2,706.6	3,885,324
富士電機	112.4	163.1	1,014,482
東洋電機製造	7.3	9.8	9,878
安川電機	200.8	291.4	1,422,032
シンフォニアテクノロジー	24.2	32.5	43,615
明電舎	31.6	45.9	113,005
オリジン	5	6.8	8,398
山洋電気	9	12	59,580
デンヨー	15.9	23.1	40,009
ＰＨＣホールディングス	－	31.2	53,726

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東芝テック	20	29.1	144,481
芝浦メカトロニクス	3.3	4.8	42,000
マブチモーター	51.6	62.7	242,335
日本電産	449	701.5	6,923,805
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11.2	11.9	4,890
トレックス・セミコンダクター	10	13.6	38,311
東光高岳	9.4	15	22,500
ダブル・スコープ	36.9	77.8	63,873
宮越ホールディングス	7	－	－
ダイヘン	20.4	29.6	128,464
ヤーマン	30.4	44.1	52,302
ＪＶＣケンウッド	161.5	220.5	41,013
ミマキエンジニアリング	16.7	24.2	16,552
Ｉ－ＰＥＸ	8.7	12.6	18,358
日新電機	43.7	63.4	93,324
大崎電気工業	37.1	49.7	23,955
オムロン	155.3	225.3	1,897,927
日東工業	27.4	36.1	58,626
ＩＤＥＣ	25	33.5	88,038
正興電機製作所	4.4	8.5	10,761
不二電機工業	3.1	5	5,565
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	67.1	88.1	214,083
サクサホールディングス	4.3	6.3	9,613
メルコホールディングス	6.4	6	24,210
テクノメディカ	4.2	6.1	9,747
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	5.4	7.5	7,860
日本電気	237	343.9	1,784,841
富士通	167.8	243.5	4,486,487
沖電気工業	75.8	109.9	96,602
岩崎通信機	8.2	11	9,339
電気興業	9	14.2	33,824
サンケン電気	21.8	25.3	132,825
ナカヨ	3.6	4.8	5,520
アイホン	10.6	15.3	32,252
ルネサスエレクトロニクス	802.6	1,469	2,016,937
セイコーエプソン	231.5	335.8	637,012
ワコム	135	209.9	196,886
アルパック	34.3	53.9	349,272
アクセル	7.8	11.3	12,633

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＥＩＺＯ	15.8	21	78,330
ジャパンディスプレイ	637.1	924.4	39,749
日本信号	43.5	68.9	62,285
京三製作所	40	58.1	26,435
能美防災	24.7	35.8	71,063
ホーチキ	13.5	19.6	24,754
星和電機	9.2	12.2	6,429
エレコム	21.4	62	95,790
パナソニック	1,989.5	2,887	3,490,383
シャープ	215.9	308.6	361,987
アンリツ	112.1	174.3	274,348
富士通ゼネラル	57	73.5	178,237
ソニーグループ	1,168.6	1,695.6	21,796,938
ＴＤＫ	90.1	392.1	1,764,450
帝国通信工業	8.2	11.9	17,457
タムラ製作所	67.1	104.3	66,021
アルプスアルパイン	152.4	239.6	275,060
池上通信機	5.9	8	5,104
日本電波工業	18	24.4	28,645
鈴木	8.3	13.3	10,294
メイコー	－	22	87,670
日本トリム	4	5.1	13,566
ローランド　ディー．ジー．	11	16	53,360
フォスター電機	19.6	27.3	19,519
ＳＭＫ	4.8	6.3	14,319
ヨコオ	14	20	50,800
ティアック	11.7	43.8	5,124
ホシデン	51	65.3	79,992
ヒロセ電機	28.7	41.7	764,778
日本航空電子工業	42.8	62.1	125,814
ＴＯＡ	22	29	20,503
マクセル	37.1	53.8	66,604
古野電気	24	32.2	34,228
ユニデンホールディングス	4.8	5.9	22,184
スミダコーポレーション	15.9	25.4	23,698
アイコム	7.7	10	25,960
リオン	7.8	10.3	23,381
本多通信工業	14.5	21	10,143
船井電機	20.9	－	－

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
横河電機	186.7	270.9	598,418
新電元工業	7.2	10.4	32,968
アズビル	126.1	158.6	690,703
東亜ディーケーケー	9.2	13.4	12,435
日本光電工業	77.1	111.8	347,698
チノー	5.9	8.6	14,611
共和電業	19.5	25.9	9,531
日本電子材料	7.2	13.8	28,607
堀場製作所	37	50	338,000
アドバンテスト	138.7	201.2	1,937,556
小野測器	7.8	11.3	5,356
エスペック	16.5	22	44,462
キーエンス	183.1	245.3	13,874,168
日置電機	8.9	13	92,170
シスメックス	145.5	229	2,071,534
日本マイクロニクス	32.5	47.1	79,128
メガチップス	18.7	25.2	98,280
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	10.9	12.3	37,576
澤藤電機	2	3.3	5,718
原田工業	7.6	12.8	13,632
コーセル	22.8	30	24,540
イリソ電子工業	15.7	22.7	77,861
オプテックスグループ	30.6	44.4	78,721
千代田インテグレ	7.8	11.4	24,510
アイ・オー・データ機器	6.9	8.7	11,257
レーザーテック	81.9	118.9	2,442,206
スタンレー電気	130.6	189	462,672
岩崎電気	6.8	9.9	23,413
ウシオ電機	95.6	138.7	262,004
岡谷電機産業	13.3	19.3	5,925
ヘリオス　テクノ　ホールディング	17.2	23	6,992
エノモト	5.2	7.5	11,895
日本セラミック	18.9	25.2	62,496
遠藤照明	9.4	12.4	11,879
古河電池	13.3	19.3	25,302
双信電機	9	12.9	7,649
山一電機	12.2	19.6	38,043
図研	12.1	17.6	52,360
日本電子	34	56.3	390,722

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
カシオ計算機	150	195.9	286,993
ファナック	163.7	237.5	5,247,562
日本シイエムケイ	40.2	53	33,973
エンプラス	8.4	6.7	18,364
大真空	6.3	36.5	42,303
ローム	77.6	121.2	1,158,672
浜松ホトニクス	133.8	194.2	1,223,460
三井ハイテック	18.3	26.5	309,255
新光電気工業	62.6	79.5	460,305
京セラ	284.3	380.8	2,675,500
太陽誘電	83	131.3	752,349
村田製作所	548	795.1	6,708,258
双葉電子工業	31.9	46.4	31,784
北陸電気工業	7	10.1	12,726
ニチコン	58.7	85.2	103,177
日本ケミコン	18.8	25.6	47,232
ＫＯＡ	25.8	40.8	58,466
市光工業	27.9	32.4	12,798
小糸製作所	111.8	148.6	759,346
ミツバ	34.3	49.8	18,874
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	32.4	47	582,800
キヤノン電子	17.1	24.8	39,233
キヤノン	927	1,345	3,913,950
リコー	474.6	751.2	799,276
象印マホービン	50.5	73.2	110,532
ＭＵＴＯＨホールディングス	2.3	3.4	7,806
東京エレクトロン	109.3	171.7	10,901,233
輸送用機器（8.1%）			
トヨタ紡織	54.3	110.4	225,878
芦森工業	3.5	5.1	4,635
ユニプレス	30.6	40.3	28,492
豊田自動織機	151	219.1	1,864,541
モリタホールディングス	29.9	43.4	55,595
三櫻工業	25.8	37.4	26,628
デンソー	410.7	595.9	4,761,836
東海理化電機製作所	49.1	71.3	112,083
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	72.2	－	－
川崎重工業	145.2	197.6	448,156
名村造船所	56	81.3	27,560

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サノヤスホールディングス	22.8	－	－
日本車輌製造	6.8	9.9	21,681
三菱ロジスネクスト	24.7	35.8	33,580
近畿車輛	3.2	4.1	4,842
日産自動車	2,200.1	3,192.2	1,693,462
いすゞ自動車	540.5	849.3	1,353,784
トヨタ自動車	1,889.8	13,710.5	30,012,284
日野自動車	232.9	338	247,416
三菱自動車工業	690.5	1,001.9	321,609
エフテック	13	18.9	10,489
レシップホールディングス	7.4	10.7	6,120
ＧＭＢ	3.3	4.9	3,660
ファルテック	3.3	4.7	3,224
武蔵精密工業	41.6	60.4	93,499
日産車体	27.3	39.6	23,205
新明和工業	52.7	76.5	71,986
極東開発工業	32.2	50.3	72,482
トピー工業	15.3	22.3	23,861
ティラド	5.8	7.7	18,841
曙ブレーキ工業	102.4	148.6	23,033
タチエス	28.6	47.4	50,101
ＮＯＫ	90.2	130.9	156,294
フタバ産業	46.7	67.8	24,882
ＫＹＢ	20.9	28.1	85,424
大同メタル工業	38.5	51.9	30,776
プレス工業	92.4	134.1	52,164
ミクニ	23.7	34.3	14,028
太平洋工業	39.1	56.7	53,581
河西工業	25.2	33.2	9,262
アイシン	136.5	198.1	845,887
マツダ	585.5	849.5	761,152
今仙電機製作所	16.3	17.8	10,929
本田技研工業	1,468.8	2,131.2	7,365,427
スズキ	369.8	619.1	2,600,220
ＳＵＢＡＲＵ	534.6	775.7	1,503,306
安永	9	13	11,284
ヤマハ発動機	263.6	353.2	951,874
ＴＢＫ	22.2	29.7	11,256
エクセディ	25.3	40.8	65,892
豊田合成	60.2	87.4	176,810
愛三工業	29.2	42.4	31,121
盟和産業	2.8	3.8	3,982
日本プラスト	15.7	21.2	11,299
ヨロズ	16	25.3	23,073
エフ・シー・シー	30.5	44.2	60,554
シマノ	69.8	108.2	3,067,470
テイ・エス　テック	43.3	114.3	164,134
ジャムコ	10.9	15.8	12,671
精密機器（2.5%）			
テルモ	571.9	765.9	2,904,292
クリエートメディック	6.2	8.1	8,019
日機装	60.2	81.2	73,648
日本エム・ディ・エム	10.7	15.6	25,599
島津製作所	240.1	348.3	1,515,105
ＪＭＳ	15.8	22.9	14,175
クボテック	4.8	5.8	1,490
長野計器	13.5	19.6	25,656
ブイ・テクノロジー	8.7	11.8	40,356
東京計器	11.9	17.2	20,691
愛知時計電機	2.5	11.7	18,860
インターアクション	9.3	13.5	28,458
オーバル	16.7	24.2	6,969
東京精密	31.4	45.7	221,873
マニー	74.3	107.8	156,956
ニコン	284.9	413.3	541,836
トプコン	94	127.3	200,879
オリンパス	1,032.2	1,419.4	3,270,297
理研計器	16.4	21.9	114,099
タムロン	15	21	51,450
ＨＯＹＡ	370.1	528.2	7,500,440
シード	7.9	12.6	6,715
ノーリツ鋼機	16.8	24.3	54,383
エー・アンド・デイ	15.7	24.7	22,699
朝日インテック	196.3	296.8	699,854
シチズン時計	236.7	317	160,719
リズム	5.8	8.5	12,937
大研医器	14.8	21.4	11,320
メニコン	28.7	89.8	269,040

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
シンシア	2	2.9	1,400
松風	8.6	11.3	18,204
セイコーホールディングス	26.4	38.3	87,898
ニプロ	139	201.7	212,995
その他製品（2.5%）			
中本パックス	4.7	7.6	12,053
スノーピーク	11	35.3	120,549
パラマウントベッドホールディングス	17.9	51.9	105,876
トランザクション	10.2	14.8	14,193
粧美堂	5.4	7.9	3,231
ニホンフラッシュ	16	23.2	23,501
前田工繊	20.6	29.8	94,019
永大産業	24.4	35.4	10,372
アートネイチャー	17.9	23.1	16,793
バンダイナムコホールディングス	154.3	242.5	2,278,287
アイフィスジャパン	4.7	6.9	4,733
共立印刷	31.2	45.3	6,704
ＳＨＯＥＩ	16.3	25.4	111,252
フランスベッドホールディングス	24	34.8	31,494
パイロットコーポレーション	33	45.7	248,151
萩原工業	10.4	17.5	19,687
トッパン・フォームズ	33.3	－	－
フジシールインターナショナル	38.3	65.7	110,967
タカラトミー	83.7	113.3	141,171
広済堂ホールディングス	13	16.8	13,524
エステールホールディングス	5	6.5	4,381
タカノ	6.4	9.2	6,716
プロネクサス	16	21	23,331
ホクシン	11.5	19.1	3,781
ウッドワン	6.3	8.3	9,652
大建工業	12.5	15.9	36,442
凸版印刷	283.6	411.4	923,181
大日本印刷	225.3	319.9	956,820
共同印刷	5.7	7.7	23,038
ＮＩＳＳＨＡ	38.3	55.6	80,008
光村印刷	1.6	2.3	3,486
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	9.1	16.6	31,971
アシックス	165	239.3	547,757
ツツミ	4.7	6.7	12,709

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ローランド	10.8	18.8	79,054
小松ウオール工業	5.7	8.2	15,670
ヤマハ	110.9	157.4	851,534
河合楽器製作所	5.2	7.6	24,320
クリナップ	17.3	25.2	13,532
ピジョン	119.8	163.6	347,322
オリバー	3.9	－	－
兼松サステック	1.2	1.7	3,077
キングジム	15.5	23.8	21,896
リンテック	39.9	58	145,986
イトーキ	37	49.9	17,465
任天堂	106.8	152.8	10,051,184
三菱鉛筆	30.7	44.6	58,292
タカラスタンダード	38.5	55.9	73,955
コクヨ	89.5	129.8	210,276
ナカバヤシ	18.3	24.2	12,511
グローブライド	9	24.2	66,138
オカムラ	64.1	93	112,716
美津濃	18.5	26.8	58,718
電気・ガス業（1.1%）			
東京電力ホールディングス	1,582.3	2,025.7	771,791
中部電力	570.7	828.1	1,021,047
関西電力	706.8	1,025.5	1,219,319
中国電力	269.1	423	376,893
北陸電力	170.5	247.5	138,847
東北電力	436.9	633.9	475,425
四国電力	155	243.7	202,514
九州電力	412	557.9	484,257
北海道電力	174.6	235.2	119,246
沖縄電力	36.3	57.4	82,426
電源開発	148.4	230.7	419,412
エフオン	11.3	16.4	9,659
イーレックス	27.4	39.8	73,311
レノバ	31.6	53	91,478
東京瓦斯	358.7	518.8	1,207,766
大阪瓦斯	337.9	490.2	1,048,537
東邦瓦斯	91.7	123.8	355,058
北海道瓦斯	10	13.4	20,274
広島ガス	38.5	51.6	17,802

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
西部ガスホールディングス	21	30.5	63,897
静岡ガス	53	70.4	61,881
メタウォーター	21	28.1	58,026
陸運業（3.1%）			
ＳＢＳホールディングス	13.8	20	67,400
東武鉄道	194.4	264.5	802,757
相鉄ホールディングス	63.9	86.6	204,635
東急	470.5	682.7	1,147,618
京浜急行電鉄	239.6	347.6	445,623
小田急電鉄	298.8	402.6	853,109
京王電鉄	104.2	140.4	693,576
京成電鉄	139.8	188.4	665,052
富士急行	25.4	32.3	130,007
新京成電鉄	4.8	6.3	12,826
東日本旅客鉄道	328.3	476.4	3,472,956
西日本旅客鉄道	166.2	328.1	1,715,963
東海旅客鉄道	155.1	225	3,740,625
西武ホールディングス	224.8	353.4	467,194
鴻池運輸	29.7	43.1	50,987
西日本鉄道	51.7	75	205,275
ハマキョウレックス	14.3	19.2	55,468
サカイ引越センター	8.6	12.4	51,956
近鉄グループホールディングス	176.7	256.4	930,732
阪急阪神ホールディングス	235.6	320.5	1,189,055
南海電気鉄道	83.7	114.4	277,763
京阪ホールディングス	78.7	114.1	347,434
神戸電鉄	4.2	6.1	20,557
名古屋鉄道	145.3	210.8	464,181
山陽電気鉄道	12.6	19.7	40,700
アルプス物流	12.3	17.9	19,976
日本通運	61.2	－	－
ヤマトホールディングス	247.6	359.2	847,352
山九	45.3	67.5	271,012
丸運	10.1	14.6	3,679
丸全昭和運輸	14.3	20.8	66,976
センコーグループホールディングス	97.4	128.5	120,019
トナミホールディングス	4.2	6.2	24,056
ニッコンホールディングス	59.3	86	187,308
日本石油輸送	1.9	2.8	7,504

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
福山通運	22.6	42.2	163,314
セイノーホールディングス	132.3	174.5	206,084
エスライン	4.8	7.7	7,307
神奈川中央交通	4.4	6.4	22,848
日立物流	38.8	49.5	339,075
丸和運輸機関	37.3	54.1	59,996
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	17.9	25.9	31,287
九州旅客鉄道	136.7	198.3	526,684
ＳＧホールディングス	333.8	484.3	1,173,943
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディン	－	88.7	777,012
海運業（0.6%）			
日本郵船	147.7	214.4	2,373,408
商船三井	104.8	141.9	1,465,827
川崎汽船	54.4	78.9	614,631
ＮＳユナイテッド海運	8.3	14.1	58,867
明治海運	18.8	30.3	26,391
飯野海運	82	119	101,150
共栄タンカー	3.1	4.5	4,941
乾汽船	9.1	17.5	36,837
空運業（0.4%）			
日本航空	430.4	587.8	1,291,984
ＡＮＡホールディングス	476.8	651.2	1,631,581
パスコ	3.4	4.8	6,676
倉庫・運輸関連業（0.2%）			
トランコム	5.4	7.2	50,904
日新	14.1	20.4	33,476
三菱倉庫	61.1	81.3	242,030
三井倉庫ホールディングス	18.7	27.2	69,713
住友倉庫	63.5	90.6	213,816
澁澤倉庫	9.7	15.3	36,215
東陽倉庫	29.6	43	14,147
日本トランスシティ	38.9	56.4	35,080
ケイヒン	3.4	4.4	6,542
中央倉庫	10.8	15.6	15,834
川西倉庫	3.2	4.7	5,644
安田倉庫	14.5	21	20,622
ファイズホールディングス	3.1	5.5	4,130
東洋埠頭	5.4	7.8	12,035
宇徳	12.6	－	－

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
上組	98.6	141	317,391
サンリツ	4.5	7.1	5,964
キムラユニティー	4.7	6.7	9,239
キユーソー流通システム	4.4	12.8	12,531
近鉄エクスプレス	33.4	48.4	169,642
東海運	10.1	14.6	4,526
エーアイテイー	11.1	16.1	23,489
内外トランスライン	6.2	9.9	18,265
日本コンセプト	5.6	8.2	12,710
情報・通信業（8.2%）			
ＮＥＣネッツエスアイ	60.5	87.8	158,391
クロスキャット	4.8	7	16,730
システナ	65.3	378.9	171,641
デジタルアーツ	10.6	14.3	106,535
日鉄ソリューションズ	27.4	38.4	143,232
キューブシステム	9.7	13.4	12,448
WOW　WORLD	2.8	3.8	4,476
コア	7.7	11.2	17,897
ラクーンホールディングス	13	22.5	27,585
ソリトンシステムズ	9.1	13.3	21,000
ソフトクリエイトホールディングス	7.2	11.6	58,464
ＴＩＳ	183	253.3	740,902
ＪＮＳホールディングス	8.9	12.2	5,258
電算システム	6.9	－	－
グリー	112.2	120.8	120,316
ＧＭＯペパボ	1.2	2.8	6,336
コーエーテクモホールディングス	37.4	84.7	357,434
三菱総合研究所	7.8	11.4	45,600
ボルテージ	4.9	7.1	2,591
電算	2	2.9	6,690
ＡＧＳ	9.3	13.5	10,894
ファインデックス	15.4	22.4	15,859
ブレインパッド	4.7	22.5	28,372
ＫＬａｂ	33.4	48.7	21,768
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ	24.3	38.5	45,507
イーブックイニシアティブジャパン	3	－	－
ネクソン	462.4	599.3	1,759,544
アイスタイル	55.8	68.5	12,672
エムアップホールディングス	4.8	30.7	32,142

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エイチーム	12.6	18.3	14,054
エニグモ	17.3	28.7	18,999
テクノスジャパン	14.2	20.6	9,640
ｅｎｉｓｈ	9.5	16.6	5,245
コロプラ	60.1	87.3	56,221
オルトプラス	11.1	20.5	7,544
ブロードリーフ	90.7	131.6	48,034
クロス・マーケティンググループ	8.1	10.1	9,312
デジタルハーツホールディングス	8.3	12	21,144
システム情報	13.7	19.9	18,686
メディアドゥ	7.1	9.3	21,669
じげん	45.3	75.1	22,680
ブイキューブ	10	27	23,517
エンカレッジ・テクノロジ	3.2	5.8	3,282
サイバーリンクス	6	8.9	8,659
ディー・エル・イー	14.7	17.8	4,930
フィックスターズ	19.5	28.3	22,923
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	7.4	10.8	25,369
オプティム	12.8	18.5	18,074
セレス	6	9.9	15,335
ＳＨＩＦＴ	8.2	13.4	280,060
ティーガイア	19.5	23.6	39,884
セック	2.7	3.9	8,942
日本アジアグループ	17.7	－	－
テクマトリックス	28.4	44.9	93,975
プロシップ	5.3	8.8	12,804
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	44.1	69	182,850
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	39.1	51.5	633,965
ザッパラス	7.1	10.3	5,057
システムリサーチ	5.3	7.7	14,876
インターネットイニシアティブ	48.7	70.7	293,405
さくらインターネット	19.6	28.5	15,675
ヴィンクス	5.1	7.4	8,147
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4.1	5.9	34,751
ＳＲＡホールディングス	9.7	12.8	36,083
システムインテグレータ	5.1	8.4	4,603
朝日ネット	14.8	24.2	14,423
ｅＢＡＳＥ	21.9	31.7	18,069
アバント	19.6	28.5	37,791

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アドソル日進	6.5	9.5	16,178
ＯＤＫソリューションズ	2.8	5.5	3,569
フリービット	10.8	13.8	12,061
コムチュア	16.8	29.8	93,721
サイバーコム	3.3	4	4,568
アステリア	13.2	19.1	17,285
アイル	10.2	14.7	22,520
マークラインズ	7.6	13.3	35,271
メディカル・データ・ビジョン	20.9	33.6	39,244
ｇｕｍｉ	25.3	36.8	22,852
ショーケース	3.9	5.8	2,720
モバイルファクトリー	4.1	6	6,084
テラスカイ	5.9	9.7	14,947
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	8.1	11.7	15,315
ＰＣＩホールディングス	6.9	11.9	13,066
パイプドHD	3.8	4.8	12,710
アイビーシー	3	4.3	2,661
ネオジャパン	3.5	7.5	8,677
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3.9	5.7	17,470
ラクス	42.9	91.4	153,826
ランドコンピュータ	2.8	6	5,670
ダブルスタンダード	2.4	8	16,680
オープンドア	10.9	15.8	31,378
マイネット	6	9.5	4,959
アカツキ	7.3	11.8	33,641
ベネフィットジャパン	1.4	2	4,304
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4.8	7	17,661
カナミックネットワーク	16.7	28.3	14,348
ノムラシステムコーポレーション	8	13.6	3,291
チェンジ	25.6	49	88,592
シンクロ・フード	10.9	13.6	3,916
オークネット	9.7	14.1	22,743
キャピタル・アセット・プランニング	2.2	5.3	3,916
セグエグループ	4.7	6.8	4,080
エイトレッド	3.5	3.8	8,686
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	18.5	－	－
マクロミル	37.4	57.7	68,143
ビーグリー	3.6	6.3	9,676
オロ	5.8	8.4	21,042

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ユーザーローカル	2.7	8	14,160
テモナ	4	5.7	2,097
ニーズウェル	3.5	6	4,056
マネーフォワード	－	40.4	224,220
サインポスト	4.2	8.6	7,946
電算システムホールディングス	－	10.9	27,893
ソルクシーズ	7	22.5	9,157
フェイス	5.6	7	4,984
プロトコーポレーション	16.4	28.2	29,271
ハイマックス	5.2	7	9,254
野村総合研究所	334	513.2	2,101,554
サイバネットシステム	13	18.9	13,456
ＣＥホールディングス	9.6	14	6,762
日本システム技術	3.3	5.2	13,514
インテージホールディングス	22.8	30.6	55,600
東邦システムサイエンス	4.8	7	6,622
ソースネクスト	86.8	114.5	19,694
インフォコム	16.7	29	62,147
シンプレクス・ホールディングス	－	31.2	56,472
ＨＥＲＯＺ	5.2	7.6	7,858
ラクスル	14.8	29.1	82,702
ＩＰＳ	3.2	7.3	14,563
ＦＩＧ	19.8	28.8	8,524
システムサポート	5.4	9.6	10,636
イーソル	9.9	16.2	10,044
アルテリア・ネットワークス	20.3	33.6	45,024
ＥｄｕＬａｂ	1.7	－	－
東海ソフト	2.1	4.1	3,874
ウイングアーク１ｓｔ	－	15.2	20,261
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン	3.1	6	10,368
サーバーワークス	1.3	4.5	11,763
東名	0.9	2.5	1,975
ヴィッツ	0.7	2.4	3,067
トビラシステムズ	1.8	5.4	3,969
Ｓａｎｓａｎ	12.2	94.4	118,755
Ｌｉｎｋ－Ｕ	1.2	4.8	3,484
ギフティ	8.2	24.2	29,524
ベース	1.6	4.5	27,450
ＪＭＤＣ	－	24.9	156,621

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フォーカスシステムズ	12.3	17.8	17,105
クレスコ	12.5	19.3	35,975
フジ・メディア・ホールディングス	189.9	255.9	312,453
オービック	57.7	83.7	1,591,137
ジャストシステム	26	37.8	224,532
ＴＤＣソフト	16	23.2	28,373
Ｚホールディングス	2,514.8	3,860.5	2,103,972
トレンドマイクロ	97.8	141.9	1,034,451
ＩＤホールディングス	7	16.7	14,679
日本オラクル	37.1	43.1	387,900
アルファシステムズ	4.9	7.1	30,601
フューチャー	22.1	56.1	95,257
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	11.9	15.5	22,103
ＳＢテクノロジー	6.6	11.5	29,198
トーセ	4.9	7.2	5,205
オービックビジネスコンサルタント	18.7	25.3	111,067
伊藤忠テクノソリューションズ	83.4	121	374,495
アイティフォー	23.9	32.2	25,792
東計電算	2.7	3.1	15,469
エックスネット	2.9	4.2	4,212
大塚商会	99	143.7	630,843
サイボウズ	21.4	35.5	48,102
電通国際情報サービス	22.7	38.3	149,561
ＡＣＣＥＳＳ	17.2	30	17,070
デジタルガレージ	30.2	43.9	194,257
ＥＭシステムズ	30.2	43.8	33,901
ウェザーニューズ	5.5	9	83,070
ＣＩＪ	12.5	17.2	16,133
ビジネスエンジニアリング	1.8	3	11,685
日本エンタープライズ	18.6	27	4,671
WOWOW	8.8	12.7	21,120
スカラ	16.3	22.3	16,145
インテリジェント　ウェイブ	10.7	13.3	7,740
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	15.5	22.6	16,475
ネットワンシステムズ	74.7	101.2	291,152
システムソフト	39.4	57	5,871
アルゴグラフィックス	14.2	20.7	63,859
マーベラス	28.8	41.8	31,057
エイベックス	31.5	45.8	67,875

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本ユニシス	63.5	82.9	264,036
兼松エレクトロニクス	10	14.4	55,512
都築電気	6.7	13.6	20,141
ＴＢＳホールディングス	121.4	161.5	294,899
日本テレビホールディングス	152.8	221.7	290,648
朝日放送グループホールディングス	18.2	26.4	19,668
テレビ朝日ホールディングス	56.6	63.8	99,145
スカパーＪＳＡＴホールディングス	120.5	224.9	96,032
テレビ東京ホールディングス	13.3	19	38,950
日本ＢＳ放送	6.2	9	9,297
ビジョン	22.7	45.4	52,936
スマートバリュー	4.8	6	2,604
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	7	25.2	61,236
ワイヤレスゲート	7.5	10.9	3,346
コネクシオ	10.4	18.8	27,128
日本通信	161.7	220.9	43,075
クロップス	3.3	4.8	4,737
日本電信電話	2,141.1	2,778.6	10,000,181
ＫＤＤＩ	1,468	1,936.4	7,914,066
ソフトバンク	1,663.6	4,022.9	6,074,579
光通信	21.6	30.6	435,132
エムティーアイ	17.7	25.7	11,487
ＧＭＯインターネット	65.6	94	278,146
ファイバーゲート	5.9	12.1	14,604
アイドママーケティングコミュニケーション	4.7	5.7	1,710
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	49.3	145	471,975
学研ホールディングス	25.4	37.5	36,037
ゼンリン	33.2	43.3	43,949
昭文社ホールディングス	7.4	10.7	4,879
インプレスホールディングス	15.2	22	4,950
アイネット	9.4	13.6	17,544
松竹	12.1	17.6	228,096
東宝	108	156.7	752,943
東映	6	8.7	152,511
エヌ・ティ・ティ・データ	487.4	707.2	1,694,451
ピー・シー・エー	2.7	15.5	23,591
ビジネスブレイン太田昭和	6.3	9.1	13,640
ＤＴＳ	38	50.9	138,346
スクウェア・エニックス・ホールディングス	78.1	123.6	677,328

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
シーイーシー	19.6	28.4	36,692
カプコン	78.4	250.4	752,452
アイ・エス・ビー	8.4	12.4	13,888
ジャステック	11.7	15.4	16,786
ＳＣＳＫ	42.2	183.9	395,568
日本システムウエア	6	10	21,550
アイネス	18	24.1	38,921
ＴＫＣ	15.5	44.9	152,211
富士ソフト	19.5	28.3	171,781
ＮＳＤ	58.8	85.4	187,880
コナミホールディングス	66.5	96.5	745,945
福井コンピュータホールディングス	8.4	12.2	39,894
ＪＢＣＣホールディングス	12.4	17.9	27,834
ミロク情報サービス	18.1	23.4	34,398
ソフトバンクグループ	1,452.4	1,592.7	8,603,765
卸売業（6.2%）			
ホウスイ	1.5	2.1	2,559
高千穂交易	7.1	10.3	16,335
オルバヘルスケアホールディングス	3	4.3	6,841
伊藤忠食品	4.5	6.4	32,512
エレマテック	14.7	21.3	23,323
ＪＡＬＵＸ	5.2	7.5	19,125
あらた	14.6	21.2	79,712
トーメンデバイス	2.4	4	26,680
東京エレクトロン　デバイス	6	7.9	42,581
フィールズ	16.1	23.3	22,647
双日	1,014.8	294.5	619,039
アルフレッサ　ホールディングス	190.6	296.3	533,043
横浜冷凍	48.1	74.7	65,213
神栄	2.5	3.7	3,296
ラサ商事	9.7	13.1	13,270
アルコニックス	19.5	33.1	48,888
神戸物産	126.8	206.9	796,565
ハイパー	2.8	6.6	2,923
あい　ホールディングス	26.2	38	68,058
ディーブイエックス	5.9	9.1	10,146
ダイワボウホールディングス	16.7	129.6	228,614
マクニカ・富士エレホールディングス	43.8	63.6	170,066
ラクト・ジャパン	8	9.2	18,519

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
グリムス	4.1	11.8	25,617
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31.9	46.3	36,021
八洲電機	14.2	19.2	18,777
メディアスホールディングス	10.4	15.2	14,607
レスターホールディングス	19.2	25.3	52,573
ジューテックホールディングス	4.2	6.1	8,076
大光	7	11.3	8,023
ＯＣＨＩホールディングス	5.3	7.7	10,849
ＴＯＫＡＩホールディングス	89	129.1	114,253
黒谷	5	7.2	5,032
Ｃｏｍｉｎｉｘ	3.2	4.6	3,440
三洋貿易	18.5	26.8	26,773
ビューティガレージ	3	4.3	10,539
ウイン・パートナーズ	13.3	19.2	20,870
ミタチ産業	5	6.7	6,887
シップヘルスケアホールディングス	32.4	85.4	178,059
明治電機工業	6.3	8.7	9,335
デリカフーズホールディングス	7.1	10.3	5,695
スターティアホールディングス	3.6	6	3,714
コメダホールディングス	40.1	58.2	118,786
ピーバンドットコム	2.4	3.7	2,094
アセンテック	4.7	9.1	6,970
富士興産	5.6	6.6	5,900
協栄産業	2	2.7	4,271
フルサト・マルカホールディングス	－	25.6	71,731
ヤマエグループホールディングス	－	17.9	19,278
小野建	16.5	25.8	41,744
南陽	3.7	5.4	10,260
佐鳥電機	11.4	16.6	16,483
エコートレーディング	3.8	5.6	3,337
伯東	11.2	16.2	41,731
コンドーテック	14.2	19.9	20,715
中山福	10.5	14	5,502
ナガイレーベン	24.4	35.3	71,800
三菱食品	20.2	25.6	79,744
松田産業	13.4	19.4	48,888
第一興商	27.3	50.6	179,630
メディパルホールディングス	184.1	287.7	619,418
ＳＰＫ	7.9	10.5	14,185

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
萩原電気ホールディングス	6.8	9.9	21,285
アズワン	13.2	38.2	287,646
スズデン	6.4	9.2	21,233
尾家産業	5.4	7	7,126
シモジマ	11.2	16.3	15,974
ドウシシャ	17.3	25.1	38,628
小津産業	4	5.8	12,267
高速	9.7	15.9	25,805
たけびし	6.4	10	14,710
リックス	4.1	6	10,380
丸文	16.2	23.6	17,534
ハピネット	15.3	22.2	35,187
橋本総業ホールディングス	3.7	5.4	10,891
日本ライフライン	59.4	79	86,900
タカショー	11.9	20.2	13,534
マルカ	5.9	－	－
ＩＤＯＭ	61.9	80.8	57,448
進和	10.9	15.7	30,881
エスケイジャパン	4.4	6.4	2,809
ダイトロン	7.8	11.3	20,950
シークス	23.4	38.1	40,081
田中商事	5.6	8.2	5,420
オーハシテクニカ	9.4	14.3	19,019
白銅	6.6	8.6	23,374
ダイコー通産	1.6	3.1	3,782
伊藤忠商事	1,285.1	1,864.6	7,872,341
丸紅	1,811.8	2,629.7	3,907,734
高島	2.9	3.8	9,116
長瀬産業	103.3	146.4	277,867
蝶理	11.7	14.9	26,700
豊田通商	184.6	267.8	1,371,136
三共生興	27.8	35.3	18,779
兼松	73.4	99.4	139,259
ツカモトコーポレーション	3.1	4.4	5,975
三井物産	1,491.8	2,070.3	7,053,512
日本紙パルプ商事	9.6	13.9	56,712
カメイ	23.9	31.6	33,970
東都水産	2.1	1.4	6,650
ＯＵＧホールディングス	2.9	3.9	10,939

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
スターゼン	6.8	19.7	41,291
山善	71.8	112.1	111,875
椿本興業	3.4	5.5	21,010
住友商事	1,159.5	1,682.6	3,742,102
内田洋行	7.2	11.4	53,580
三菱商事	1,118.6	1,997.7	9,361,222
第一実業	8.3	12.1	53,966
キヤノンマーケティングジャパン	45.6	66.1	166,175
西華産業	9.7	14	23,408
佐藤商事	15.2	22	26,752
菱洋エレクトロ	14	15.8	30,067
東京産業	16.6	24.1	17,930
ユアサ商事	18.8	25.3	76,406
神鋼商事	4.1	6	23,010
トルク	10.9	14.1	3,158
阪和興業	36.8	53.4	175,953
正栄食品工業	11.9	17.2	71,810
カナデン	14.9	21.6	22,831
菱電商事	13.2	21.1	37,494
フルサト工業	9.3	－	－
岩谷産業	44.1	64	344,320
ナイス	7.3	9.2	18,915
昭光通商	5.9	－	－
ニチモウ	2.9	3.8	10,921
極東貿易	5.3	7.6	17,487
アステナホールディングス	24.5	37.6	16,619
三愛石油	45.2	65.6	63,500
稲畑産業	44.1	58.7	128,083
ＧＳＩクレオス	4.5	12.7	15,151
明和産業	16.9	24.6	29,151
クワザワホールディングス	6.5	10.5	6,111
ヤマエ久野	13.4	－	－
ワキタ	36.2	56.8	57,936
東邦ホールディングス	58.9	85.5	162,621
サンゲツ	49.6	70.5	110,614
ミツウロコグループホールディングス	27.1	39.3	43,662
シナネンホールディングス	6.8	9.9	34,798
伊藤忠エネクス	40.6	58.9	61,903
サンリオ	51.6	82.3	206,819

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サンワテクノス	12.1	16.2	21,756
リョーサン	20.3	29.4	67,384
新光商事	24.8	39.9	37,745
トーホー	8.3	12	13,992
三信電気	9.8	12.2	21,252
東陽テクニカ	19.6	26.3	29,061
モスフードサービス	26	35	101,220
加賀電子	16.6	24.1	79,650
ソーダニッカ	17.5	26.2	17,658
立花エレテック	13.6	21.3	36,018
フォーバル	6.4	11.7	10,085
ＰＡＬＴＡＣ	29.4	37.4	182,325
三谷産業	24.1	31.1	10,574
太平洋興発	7.2	9.8	6,732
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	4.2	6	16,878
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.6	2.4	4,845
コーア商事ホールディングス	5.2	16.6	13,329
国際紙パルプ商事	39.1	55.4	19,002
ヤマタネ	7.9	12.4	21,551
丸紅建材リース	1.8	2.3	4,234
日鉄物産	13.1	19	106,780
泉州電業	5.2	7.3	43,654
トラスコ中山	42.1	55.5	139,194
オートバックスセブン	68.2	89.6	124,185
モリト	13.4	19.4	15,035
加藤産業	26.5	38.5	126,087
北恵	4.6	6.7	6,344
イノテック	10.3	16.1	22,990
イエローハット	34.7	46.1	74,405
ＪＫホールディングス	16.6	21.4	27,648
日伝	15.2	22.1	50,277
北沢産業	12.4	18	4,284
杉本商事	9.2	12.5	27,950
因幡電機産業	49	71.1	185,926
東テク	6.1	8.8	21,199
ミスミグループ本社	230.4	334.6	1,268,134
アルテック	13.5	17.9	5,083
タキヒヨー	6.1	8	9,752
蔵王産業	3.5	5.1	10,143

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
スズケン	77.8	104.2	394,397
ジェコス	12.7	18.4	15,492
グローセル	19.9	31.1	13,715
小売業（4.2%）			
ローソン	46.5	59	284,970
サンエー	13.9	20.2	84,133
カワチ薬品	12.8	20.7	47,196
エービーシー・マート	28.7	41.6	195,728
ハードオフコーポレーション	8.1	11.7	9,605
アスクル	16	60.3	99,374
ゲオホールディングス	24.6	35.6	45,568
アダストリア	25.4	28.7	54,903
ジーフット	11.1	16.1	5,007
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	2.6	3.8	1,432
くら寿司	10.8	27.8	87,431
キャンドゥ	8.7	9.9	21,780
アイケイ	4	8.4	4,107
パルグループホールディングス	16.1	23.3	34,530
エディオン	77.8	122.4	144,309
サーラコーポレーション	37.3	54.1	34,948
ワッツ	8.1	12.9	9,507
ハローズ	7.4	12.2	37,271
フジオフードグループ本社	15.5	22.5	29,745
あみやき亭	4	6.3	18,994
ひらまつ	33.8	56.5	11,469
大黒天物産	4.4	8.5	43,945
ハニーズホールディングス	14.5	23.4	23,868
ファーマライズホールディングス	4.5	6.5	4,894
アルペン	14.1	19.8	41,104
ハブ	5.9	8.6	4,876
クオールホールディングス	24.8	32.7	39,109
ジンズホールディングス	9.7	18.1	106,790
ビックカメラ	109	158.1	170,115
ＤＣＭホールディングス	113.4	164.5	176,508
ペッパーフードサービス	21.9	36.4	13,213
ＭｏｎｏｔａＲＯ	130.6	337	950,340
東京一番フーズ	4.7	6.8	4,052
ＤＤホールディングス	8.6	13.9	7,144
きちりホールディングス	4.9	7.1	2,783

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アークランドサービスホールディングス	15.3	19.5	42,549
Ｊ．フロント　リテイリング	219.4	318.3	325,302
ドトール・日レスホールディングス	29.1	46	70,794
マツキヨココカラ＆カンパニー	75.9	163.9	729,355
ブロンコビリー	9.6	15.2	34,215
ＺＯＺＯ	108.3	183.3	603,057
トレジャー・ファクトリー	5.4	7.8	7,784
物語コーポレーション	9.8	13.2	74,976
ココカラファイン	16.4	－	－
三越伊勢丹ホールディングス	321.4	466.7	456,899
Ｈａｍｅｅ	4.7	9.6	11,193
マーケットエンタープライズ	－	2	1,610
ウエルシアホールディングス	97.1	140.9	436,790
クリエイトＳＤホールディングス	27.1	39.3	128,511
丸善ＣＨＩホールディングス	21.4	31.1	11,880
ミサワ	3.7	5.4	3,272
ティーライフ	2.7	3.6	4,755
エー・ピーホールディングス	3.4	5.2	2,464
チムニー	5.6	8.1	9,242
シュッピン	12.5	22.2	29,148
オイシックス・ラ・大地	18.2	38.3	117,581
ネクステージ	32	54	120,744
ジョイフル本田	53.8	80.1	123,514
鳥貴族ホールディングス	5.4	9.8	17,610
ホットランド	13.7	19.9	25,949
すかいらーくホールディングス	205.9	344.1	533,699
ＳＦＰホールディングス	9	13	17,212
綿半ホールディングス	13.8	20	27,500
ヨシックスホールディングス	3.6	5.2	11,486
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	53.4	77.5	81,452
ゴルフダイジェスト・オンライン	9.5	13.8	13,096
ＢＥＥＮＯＳ	8.5	13.4	27,403
あさひ	13.7	22.1	30,144
日本調剤	11.1	16.2	21,691
コスモス薬品	18.5	26.9	423,137
トーエル	8.9	13	11,986
オンリー	3.1	－	－
セブン＆アイ・ホールディングス	718.8	1,042.9	5,686,933
クリエイト・レストランツ・ホールディング	98.7	142	100,678

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ツルハホールディングス	40.1	58.2	489,462
サンマルクホールディングス	14.5	21.1	33,422
フェリシモ	4.1	5.9	7,723
トリドールホールディングス	45.4	66.3	155,473
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	16.6	24.5	10,265
ウイルプラスホールディングス	2.9	5	4,510
ＪＭホールディングス	13.9	17.9	31,468
サツドラホールディングス	2.7	12	8,268
アレンザホールディングス	10.5	20.3	19,427
串カツ田中ホールディングス	4.9	7.1	13,582
バロックジャパンリミテッド	12.7	18.5	14,596
クスリのアオキホールディングス	18.3	26.5	194,510
力の源ホールディングス	8.3	13.6	7,956
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥ	100.8	156.1	499,520
メディカルシステムネットワーク	16	25.8	13,854
一家ホールディングス	－	5.6	3,102
藤久ホールディングス	－	8.3	5,469
はるやまホールディングス	8.6	12.5	6,662
ノジマ	32.7	43.1	101,069
カッパ・クリエイト	25.8	37.4	51,125
ライトオン	13.7	19.9	14,427
ジーンズメイト	5.6	－	－
良品計画	243.9	306.7	461,583
三城ホールディングス	22.7	33	8,910
アドヴァングループ	18.7	27.1	25,799
アルビス	5.9	8.6	19,436
コナカ	21.6	31.4	10,927
ハウス　オブ　ローゼ	2.2	3.3	5,633
Ｇ－７ホールディングス	10.8	29.6	46,560
イオン北海道	24.2	46.9	56,795
コジマ	31.6	45.8	26,060
ヒマラヤ	6.4	9.3	8,862
コーナン商事	26.1	37.9	135,682
エコス	6.7	9.8	19,668
ワタミ	24.1	32.3	29,199
マルシェ	4.8	6.5	2,957
パン・パシフィック・インターナショナルホ	367.3	533.1	1,032,081
西松屋チェーン	40.3	58.5	83,479
ゼンショーホールディングス	98.7	130.1	362,848

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
幸楽苑ホールディングス	11.7	16.9	22,510
ハークスレイ	3.8	11.1	5,361
サイゼリヤ	27.2	39.5	104,872
ＶＴホールディングス	69.1	100.3	46,438
魚力	5.7	7.4	16,198
ポプラ	4.8	6.9	1,014
フジ・コーポレーション	4.9	14.1	16,215
ユナイテッドアローズ	21	27.9	51,894
ハイデイ日高	26.5	38.5	69,030
ＹＵ−ＷＡ Ｃｒｅａｔｉｏｎ Ｈｏｌｄｉ	11.7	15.6	3,120
コロワイド	61	109.5	189,435
ピーシーデポコーポレーション	21.3	31	9,548
壱番屋	12.9	18.8	86,292
トップカルチャー	6.6	9.6	2,803
ＰＬＡＮＴ	4.7	6.8	4,596
スギホールディングス	36.7	53.2	334,628
薬王堂ホールディングス	8	13.3	29,672
ヴィア・ホールディングス	22.5	34.6	5,328
スクロール	26.2	41	37,802
ヨンドシーホールディングス	16.9	24.5	39,886
木曽路	24	36.1	74,005
ＳＲＳホールディングス	23.1	37	30,451
千趣会	33.2	48.1	18,614
タカキュー	14.2	20.6	2,183
リテールパートナーズ	22.3	32.3	46,447
ケーヨー	34	49.3	44,863
上新電機	21.6	30.6	61,903
日本瓦斯	30.3	129.6	195,177
ロイヤルホールディングス	32.1	45.8	95,309
東天紅	1.3	1.9	1,871
いなげや	20.5	33	46,035
チヨダ	19.3	26	18,902
ライフコーポレーション	13.9	24.9	80,800
リンガーハット	22.6	32.9	73,992
ＭｒＭａｘＨＤ	25.2	33.3	19,413
テンアライド	16.9	25.8	8,643
ＡＯＫＩホールディングス	36.8	51.6	30,134
オークワ	28.8	41.8	38,874
コメリ	28.4	41.2	109,633

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
青山商事	40.9	55.1	36,200
しまむら	21.4	31	336,350
はせがわ	9.7	14.1	4,089
高島屋	133.8	194.2	226,243
松屋	40.1	53.7	41,563
エイチ・ツー・オー　リテイリング	87	126.3	111,522
近鉄百貨店	7	10.2	25,846
丸井グループ	155.4	210.4	490,021
アクシアル　リテイリング	15.2	20.6	68,907
井筒屋	9.3	12.5	4,950
イオン	707	1,025.8	2,729,140
イズミ	37.4	48.2	156,891
平和堂	33.9	49.2	95,202
フジ	22.2	73	168,630
ヤオコー	20.9	30.3	204,222
ゼビオホールディングス	22.2	36.2	34,679
ケーズホールディングス	163.6	245.8	314,132
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	9.5	13.7	9,959
日産東京販売ホールディングス	27	39.2	9,133
シルバーライフ	2.5	5.4	8,100
一家ダイニングプロジェクト	2.7	−	−
Ｇｅｎｋｙ ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	8.1	11.7	52,065
ナルミヤ・インターナショナル	3.5	6	5,580
ブックオフグループホールディングス	10.7	15.5	17,391
ギフトホールディングス	1.7	4.2	10,008
アインホールディングス	26.7	35.7	225,981
元気寿司	5.1	7.5	19,395
ヤマダホールディングス	615.8	974.8	394,794
アークランドサカモト	28.8	41.7	63,592
ニトリホールディングス	72.9	105.8	1,719,250
グルメ杵屋	13.1	21.2	22,366
愛眼	14.6	19.5	3,880
ケーユーホールディングス	9.6	13.9	15,679
吉野家ホールディングス	60.4	93	215,760
松屋フーズホールディングス	8.8	12.8	46,528
サガミホールディングス	24.9	40.7	50,183
関西フードマーケット	13.9	20.1	26,089
王将フードサービス	12.1	17.6	105,248
プレナス	20.6	29.8	59,778

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ミニストップ	13.6	19.7	28,880
アークス	35.1	50.9	109,078
バローホールディングス	37.5	59	128,797
藤久	4.3	－	－
ベルク	9.1	11.8	65,136
大庄	9.8	14.3	15,272
ファーストリテイリング	24.6	35.7	2,251,599
サンドラッグ	69.1	100.3	314,942
サックスバー　ホールディングス	15.6	25.1	13,052
ヤマザワ	4.3	6.2	10,106
やまや	3.8	5.5	14,179
ベルーナ	39.4	57.2	41,069
銀行業（5.5%）			
島根銀行	6.3	8.5	4,556
じもとホールディングス	12.4	19	12,293
めぶきフィナンシャルグループ	956	1,387.2	371,769
東京きらぼしフィナンシャルグループ	23.1	33.5	62,343
九州フィナンシャルグループ	375.7	545.2	226,803
ゆうちょ銀行	521.3	630.2	669,902
富山第一銀行	43.9	63.6	20,797
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,120.9	1,524.8	738,003
西日本フィナンシャルホールディングス	122.4	174.4	139,694
関西みらいフィナンシャルグループ	86.4	－	－
三十三フィナンシャルグループ	15.9	24.7	39,075
第四北越フィナンシャルグループ	29.9	43.4	116,529
ひろぎんホールディングス	271.4	393.8	274,084
おきなわフィナンシャルグループ	－	24.1	52,200
十六フィナンシャルグループ	－	35.9	82,605
北國フィナンシャルホールディングス	－	24.8	74,772
新生銀行	150	174.1	406,871
あおぞら銀行	109.6	149.1	398,246
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	12,586.1	16,742.6	13,313,715
りそなホールディングス	2,000.6	3,026.5	1,653,982
三井住友トラスト・ホールディングス	347.8	504.6	2,099,640
三井住友フィナンシャルグループ	1,273.3	1,847.9	7,711,286
千葉銀行	614	890.9	689,556
群馬銀行	378.7	501.1	188,413
武蔵野銀行	27.4	39.8	75,779
千葉興業銀行	46.8	62.7	17,305

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
筑波銀行	76.5	104.1	22,589
七十七銀行	57.7	83.7	137,435
青森銀行	14.3	20.7	39,454
秋田銀行	11	17.1	30,027
山形銀行	20.7	30	28,140
岩手銀行	12.1	17.5	33,985
東邦銀行	164.5	222.8	48,124
東北銀行	8.8	12.8	13,401
みちのく銀行	11.8	17.1	14,877
ふくおかフィナンシャルグループ	166.1	224.9	553,029
静岡銀行	448.1	650.2	590,381
十六銀行	23.1	－	－
スルガ銀行	161.3	234.1	101,365
八十二銀行	414.4	601.3	259,761
山梨中央銀行	21.4	28.9	28,350
大垣共立銀行	36.3	52.7	106,348
福井銀行	15.7	22.8	34,108
北國銀行	17.1	－	－
清水銀行	7.6	11	17,996
富山銀行	3.5	4.8	10,660
滋賀銀行	36.9	50.2	118,522
南都銀行	26.8	41.6	88,816
百五銀行	165.6	256.3	93,549
京都銀行	65.9	95.6	540,140
紀陽銀行	65.1	90.5	134,030
ほくほくフィナンシャルグループ	122.5	166.6	160,435
山陰合同銀行	115.9	158.3	107,802
中国銀行	158.3	213.3	198,155
鳥取銀行	5.9	8.5	10,625
伊予銀行	243.8	353.7	228,136
百十四銀行	19.5	28.4	49,614
四国銀行	26.1	40.6	32,155
阿波銀行	28.2	40.9	96,360
大分銀行	10.6	15.4	31,123
宮崎銀行	11.5	16.7	36,773
佐賀銀行	10.4	15.1	22,967
沖縄銀行	16.8	－	－
琉球銀行	39.9	58	48,894
セブン銀行	614.7	792.8	200,578

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
みずほフィナンシャルグループ	2,500.1	3,414.2	5,600,995
高知銀行	6.7	9.7	7,527
山口フィナンシャルグループ	229.7	311	227,341
長野銀行	6	8.8	11,739
名古屋銀行	14.8	19.9	58,605
北洋銀行	277.4	402.4	103,014
愛知銀行	6.2	9.7	46,851
中京銀行	6.6	9.6	15,878
大光銀行	6.3	9.1	12,967
愛媛銀行	25.7	37.3	36,628
トマト銀行	7.1	9.6	10,262
京葉銀行	78.5	113.8	58,834
栃木銀行	88.9	129	29,670
北日本銀行	5.7	8.3	13,993
東和銀行	32.3	46.9	26,826
福島銀行	21.1	30.6	7,252
大東銀行	8.8	12.8	9,484
トモニホールディングス	142.2	206.4	72,033
フィデアホールディングス	178.6	24.4	33,476
池田泉州ホールディングス	211.6	307	55,874
証券、商品先物取引業（0.8%）			
ＦＰＧ	56.7	89.8	67,439
ジャパンインベストメントアドバイザー	9.3	20.7	25,398
マーキュリアインベストメント	7.2	－	－
マーキュリアホールディングス	－	10.6	5,119
ＳＢＩホールディングス	225.6	329.4	1,088,667
日本アジア投資	15.5	21	4,557
ジャフコ　グループ	28.3	102	199,920
大和証券グループ本社	1,377.9	1,999.3	1,437,296
野村ホールディングス	2,809.2	4,076.1	2,214,137
岡三証券グループ	156.8	210	82,740
丸三証券	54.6	79.3	42,108
東洋証券	60.7	88.1	14,007
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	196.2	306.6	129,998
光世証券	4.4	5.6	2,783
水戸証券	49.1	71.3	20,534
いちよし証券	36.9	49.9	33,433
松井証券	90.1	130.7	110,310
マネックスグループ	165	217.7	152,825

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
極東証券	24.7	35.8	27,745
岩井コスモホールディングス	18.8	25.2	35,960
アイザワ証券グループ	33	43.9	35,559
マネーパートナーズグループ	19.6	28.4	8,207
スパークス・グループ	85	123.3	33,660
小林洋行	5.3	9.5	2,261
保険業（2.3%）			
かんぽ生命保険	228.1	268.7	593,827
ＳＯＭＰＯホールディングス	324.3	438.3	2,418,539
アニコム　ホールディングス	51.8	82	55,022
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホール	446.8	598.6	2,497,957
第一生命ホールディングス	972	1,314.1	3,454,111
東京海上ホールディングス	609.9	879.2	6,440,140
Ｔ＆Ｄホールディングス	549.9	693	1,182,951
アドバンスクリエイト	3.8	12.8	12,697
その他金融業（1.1%）			
全国保証	47.9	63.7	306,397
あんしん保証	－	7.9	2,212
ジェイリース	6.1	9	15,471
イントラスト	5.2	11.3	6,565
日本モーゲージサービス	9.3	14.8	14,711
Ｃａｓａ	5.1	9.4	7,576
アルヒ	27.2	39.4	40,306
プレミアグループ	8.5	13.5	52,245
ネットプロテクションズホールディングス	－	60.8	39,702
クレディセゾン	107.4	171.4	227,105
芙蓉総合リース	19.3	28	202,720
みずほリース	28.4	41.2	122,817
東京センチュリー	42.8	51.7	236,010
日本証券金融	77.8	104.9	103,536
アイフル	308.7	448	157,696
リコーリース	14.5	23.6	81,420
イオンフィナンシャルサービス	112.6	145.2	174,966
アコム	369.8	527.5	167,217
ジャックス	20.3	29.5	95,432
オリエントコーポレーション	497.7	722.2	91,719
日立キャピタル	43.4	－	－
オリックス	1,117	1,586.1	3,864,532
三菱ＨＣキャピタル	415.1	986.2	582,844

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
九州リースサービス	9	13.1	7,977
日本取引所グループ	497	676.1	1,629,739
イー・ギャランティ	21	39.3	75,927
アサックス	9.6	13.9	9,535
ＮＥＣキャピタルソリューション	7.5	10.9	23,358
不動産業（2.0%）			
いちご	204.9	297.3	97,217
日本駐車場開発	181.6	292.8	44,505
スター・マイカ・ホールディングス	9.5	14.4	18,532
ＳＲＥホールディングス	2	6.7	19,785
ＡＤワークスグループ	35.2	55.4	8,033
ヒューリック	390.3	637.6	706,460
三栄建築設計	7.4	10.7	17,098
野村不動産ホールディングス	111.8	138.1	417,752
三重交通グループホールディングス	37.3	54.1	26,292
サムティ	26.1	42.9	96,696
ディア・ライフ	26	34.4	18,300
コーセーアールイー	5.4	7.8	4,968
地主	11.6	16.9	31,265
プレサンスコーポレーション	30.3	34.9	68,718
ＴＨＥグローバル社	11.5	14.3	2,302
ハウスコム	3.2	4.6	5,888
日本管理センター	9.9	12.8	13,132
サンセイランディック	5.4	7.8	6,388
エストラスト	2.1	3.1	1,770
フージャースホールディングス	30	34.1	23,392
オープンハウスグループ	58	84.8	479,968
東急不動産ホールディングス	500.3	786.4	547,334
飯田グループホールディングス	153.5	222.7	494,394
イーグランド	3	4.3	6,063
ムゲンエステート	11.3	16.4	8,216
ビーロット	8.6	18.1	9,249
ファーストブラザーズ	3.3	6.1	5,178
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	9	13.1	12,340
シーアールイー	4.7	7.4	12,520
プロパティエージェント	2.9	3.1	5,031
ケイアイスター不動産	5.8	12	62,880
アグレ都市デザイン	3.3	4.3	7,946
グッドコムアセット	8.8	11.5	11,960

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・エス・ビー	3.4	5.4	17,874
ロードスターキャピタル	－	5.4	8,742
テンポイノベーション	5.2	7.4	6,526
グローバル・リンク・マネジメント	3.1	4.7	4,056
フェイスネットワーク	－	2.5	3,362
パーク２４	98.8	143.3	289,752
パラカ	4.8	6.9	11,633
宮越ホールディングス	－	10.1	9,120
三井不動産	838.6	1,217	3,295,027
三菱地所	1,208.7	1,754	3,243,146
平和不動産	31.5	45.7	188,055
東京建物	181.7	263.7	484,153
ダイビル	47.4	38.7	85,023
京阪神ビルディング	31.7	41.2	63,448
住友不動産	413.6	560.1	1,951,388
テーオーシー	36.1	48	34,032
東京楽天地	3	4.4	18,458
レオパレス２１	152.6	276.8	52,038
スターツコーポレーション	21.9	36.3	90,024
フジ住宅	21.3	31	19,809
空港施設	18.4	26.7	14,845
明和地所	8.7	12.6	8,278
ゴールドクレスト	16.6	21.1	36,819
エスリード	7.2	10.4	18,470
日神グループホールディングス	27.2	43.4	21,135
日本エスコン	33.3	49.7	39,809
タカラレーベン	77.1	111.9	34,577
ＡＶＡＮＴＩＡ	10.3	13.8	11,688
イオンモール	92.3	133.9	227,094
毎日コムネット	4.7	9.1	6,461
ファースト住建	7.8	9.9	11,771
ランド	1,001.5	1,453.1	14,531
カチタス	45.6	66.1	235,316
トーセイ	25.4	36.8	42,614
穴吹興産	4	5.8	12,458
サンフロンティア不動産	22.6	36.9	39,815
ＦＪネクストホールディングス	18.1	26.2	26,357
インテリックス	4.1	6	4,062
ランドビジネス	6.2	11.3	2,745

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サンネクスタグループ	5.8	8.5	9,341
グランディハウス	12.5	18.1	10,570
日本空港ビルデング	63.9	101.8	566,008
サービス業（5.9%）			
明豊ファシリティワークス	8.1	11.8	8,614
日本工営	11.1	16.5	49,467
ＬＩＦＵＬＬ	62.2	79	19,039
ミクシィ	34	59.2	135,449
ジェイエイシーリクルートメント	12	20.9	38,748
日本Ｍ＆Ａセンターホールディングス	146.1	424.2	733,866
メンバーズ	5.3	7.7	24,447
中広	2.4	4.1	1,644
ＵＴグループ	25.7	37.3	115,070
アイティメディア	5.9	12.3	21,389
タケエイ	19.9	－	－
Ｅ・Ｊホールディングス	7	14.9	18,207
夢真ビーネックスグループ	22.4	84.3	144,490
コシダカホールディングス	42.9	69.2	48,509
アルトナー	4.3	6.3	5,625
パソナグループ	19.3	28	67,956
ＣＤＳ	4.4	6.4	10,560
リンクアンドモチベーション	32.7	57	25,878
ＧＣＡ	23.3	－	－
エス・エム・エス	60.5	87.9	302,376
サニーサイドアップグループ	6.2	8.9	6,844
パーソルホールディングス	178.2	258.6	670,291
リニカル	10	14.6	12,351
クックパッド	56	81.3	23,007
エスクリ	5.6	11.6	4,779
アイ・ケイ・ケイホールディングス	8.7	12.6	7,396
学情	6.3	10.5	10,804
スタジオアリス	9	11.6	25,322
シミックホールディングス	8.8	14.3	22,865
エプコ	4.3	5.5	3,949
ＮＪＳ	4.4	5.7	11,519
綜合警備保障	70.9	102.9	439,897
カカクコム	131.7	189.8	541,499
アイロムグループ	6.4	9.3	18,321
セントケア・ホールディング	13	16.8	14,380

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サイネックス	3	4.4	2,670
ルネサンス	11.1	18	19,332
ディップ	27.9	45.5	149,695
デジタルホールディングス	12.4	18	24,048
新日本科学	21.7	31.5	51,943
ツクイホールディングス	42	－	－
キャリアデザインセンター	4.1	6.5	7,696
ベネフィット・ワン	64.9	94.1	255,669
エムスリー	314.5	456.4	2,024,134
ツカダ・グローバルホールディング	14.2	16.5	5,164
ブラス	2.3	3.4	2,781
アウトソーシング	102.1	148.2	188,806
ウェルネット	18	26.1	12,136
ワールドホールディングス	6.1	10.3	23,545
ディー・エヌ・エー	75.4	98.5	187,544
博報堂ＤＹホールディングス	248.1	360.1	574,359
ぐるなび	31	42.4	19,292
タカミヤ	21.6	31.3	11,831
ジャパンベストレスキューシステム	14.1	17.5	18,357
ファンコミュニケーションズ	49	64.6	28,488
ライク	4.7	8.6	17,122
ビジネス・ブレークスルー	7.4	9.6	4,147
エスプール	45.8	73	81,322
ＷＤＢホールディングス	8.1	11.8	31,659
手間いらず	1.7	3.8	18,487
ティア	10.4	15.1	6,870
ＣＤＧ	1.6	2.8	3,606
アドウェイズ	21.7	38.5	28,066
バリューコマース	12	20.3	71,862
インフォマート	180.3	283.4	202,347
ＪＰホールディングス	50.9	66.4	14,807
エコナックホールディングス	32.2	46.7	4,249
ＥＰＳホールディングス	24.1	－	－
ＣＬホールディングス	4.4	5.5	5,967
プレステージ・インターナショナル	66.8	97	71,780
アミューズ	9.7	14.1	28,482
ドリームインキュベータ	5.4	7	17,255
クイック	11.1	17.7	27,966
ＴＡＣ	9.6	14	3,122

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
電通グループ	200.4	266.6	1,309,006
テイクアンドギヴ・ニーズ	8.3	12.1	15,197
ぴあ	5.1	9	29,970
イオンファンタジー	6.9	10	19,660
シーティーエス	20.1	29.2	23,914
ネクシィーズグループ	5.4	9.1	5,177
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	49.9	67.6	204,152
アルプス技研	15.8	22.9	42,250
サニックス	28.3	45.2	10,893
ダイオーズ	3.5	5.1	5,268
日本空調サービス	18.7	27.1	22,303
オリエンタルランド	189.6	305.6	7,326,760
ダスキン	41.3	60	166,740
明光ネットワークジャパン	22.5	30.4	17,540
ファルコホールディングス	8.5	12.3	25,251
秀英予備校	3.9	5.6	2,503
田谷	3.2	4.7	2,674
ラウンドワン	60.8	72.2	102,740
リゾートトラスト	81.7	118.6	256,057
ビー・エム・エル	22.9	33.3	108,558
ワタベウェディング	2.3	－	－
りらいあコミュニケーションズ	27.1	38.1	41,033
リソー教育	90.5	118.1	42,870
早稲田アカデミー	7.5	14.4	15,192
ユー・エス・エス	199.6	289.6	593,100
東京個別指導学院	15.7	22.8	14,022
サイバーエージェント	109.8	637.5	986,850
楽天グループ	830.9	1,329.5	1,306,898
クリーク・アンド・リバー社	9.3	13.5	25,582
モーニングスター	19.5	45.2	26,984
テー・オー・ダブリュー	31.2	49.4	15,659
山田コンサルティンググループ	10.4	13.4	15,678
セントラルスポーツ	6.6	9.6	23,596
フルキャストホールディングス	15.6	22.1	54,520
エン・ジャパン	31.7	41.8	116,872
リソルホールディングス	1.9	2.8	12,796
テクノプロ・ホールディングス	35.6	154.9	539,052
アトラグループ	4.1	5.7	1,476
インターワークス	5.1	7.4	2,893

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アイ・アールジャパンホールディングス	7.2	12	55,500
ＫｅｅＰｅｒ技研	11.5	16.6	38,246
ファーストロジック	3.4	5	4,665
三機サービス	3.4	4.5	4,644
Ｇｕｎｏｓｙ	11.1	14.2	12,183
デザインワン・ジャパン	5.3	6.4	1,209
イー・ガーディアン	7.8	10.5	31,248
リブセンス	9.8	14.2	2,414
ジャパンマテリアル	54.8	79.5	141,589
ベクトル	22.2	36.3	43,269
ウチヤマホールディングス	8.8	12.7	4,495
チャーム・ケア・コーポレーション	13.3	19.2	20,160
キャリアリンク	5.8	9.5	13,252
ＩＢＪ	14.6	21.2	16,642
アサンテ	6.4	11.4	17,179
Ｎ・フィールド	12.2	－	－
バリューＨＲ	7.1	10.3	31,209
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	14.6	21.3	94,039
ライドオンエクスプレスホールディングス	6.9	10	12,930
ＥＲＩホールディングス	5	7.2	9,612
アビスト	2.8	4	11,712
シグマクシス・ホールディングス	9.8	15.6	36,020
ウィルグループ	13	19	23,427
エスクロー・エージェント・ジャパン	26.4	34.6	6,401
メドピア	8.4	19.9	68,655
レアジョブ	2.5	4.9	4,478
リクルートホールディングス	1,276.9	1,995.3	10,980,135
エラン	24.6	35.6	38,341
土木管理総合試験所	8.7	12	4,080
ネットマーケティング	8.6	12.6	6,350
日本郵政	1,348.6	3,377.5	3,295,089
ベルシステム２４ホールディングス	29.9	37.2	50,220
鎌倉新書	18	29.4	18,933
ＳＭＮ	3.8	5.6	3,404
一蔵	2.2	3.2	1,244
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	7.2	－	－
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	3.2	4.7	3,525
エアトリ	9.6	16.7	51,352
アトラエ	5.4	18	33,462

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ストライク	6.7	9.8	45,227
ソラスト	43.7	63.5	60,198
セラク	5.6	8.2	11,496
インソース	14.8	25.1	56,023
ベイカレント・コンサルティング	11.7	18.3	841,800
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	4	4.9	14,136
アイモバイル	6.3	7.3	9,395
キャリアインデックス	7.3	8.8	5,297
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	7.2	10.5	9,198
船場	3.5	5.2	3,988
グレイステクノロジー	9	－	－
ジャパンエレベーターサービスホールディン	51.3	82	139,892
フルテック	2.5	3.6	5,202
グリーンズ	6.7	9.7	5,626
ツナググループ・ホールディングス	3.1	5.8	1,624
ＧａｍｅＷｉｔｈ	5.3	7.7	3,657
ソウルドアウト	4.2	6.2	11,184
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	2.8	3.8	2,861
ウェルビー	4.9	16.9	17,390
エル・ティー・エス	1.3	3.3	8,903
ミダックホールディングス	3.9	11.7	29,952
日総工産	13.9	20.2	15,230
キュービーネットホールディングス	8.1	11.9	17,826
ＲＰＡホールディングス	20.4	36.4	12,667
スプリックス	5.1	7.3	10,117
マネジメントソリューションズ	8.7	12.7	45,466
プロレド・パートナーズ	2.4	5.6	4,261
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	1.7	5.8	2,656
テノ．ホールディングス	1.4	3.1	2,058
フロンティア・マネジメント	3	6.7	7,048
ピアラ	0.9	4.2	2,339
コプロ・ホールディングス	0.9	5	5,360
ギークス	2.3	4.4	5,684
カーブスホールディングス	48.9	71	51,049
フォーラムエンジニアリング	9.3	18	15,390
Ｆａｓｔ　Ｆｉｔｎｅｓｓ　Ｊａｐａｎ	－	3.5	6,583
ダイレクトマーケティングミックス	7	29.9	55,524
ポピンズホールディングス	3.5	6	12,354
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	－	20.9	51,664

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アドバンテッジリスクマネジメント	9	13.1	8,567
リログループ	97.4	141.4	260,034
東祥	11.1	19.3	35,068
ＴＲＥホールディングス	－	35.4	65,136
人・夢・技術グループ	－	10.3	21,362
エイチ・アイ・エス	25.9	57.4	124,558
ラックランド	5.1	7.5	22,020
共立メンテナンス	29.5	46.1	211,368
イチネンホールディングス	18.5	26.5	34,847
建設技術研究所	11.5	15.5	35,402
スペース	11.6	18.4	17,314
長大	7.1	－	－
燦ホールディングス	7.7	11.2	17,337
スバル興業	1.1	1.6	13,392
東京テアトル	7	10.1	12,897
タナベ経営	3.4	9.9	6,840
ナガワ	5.7	8.2	83,886
東京都競馬	11.7	19.3	84,534
常磐興産	7.1	10.4	14,549
カナモト	31.4	45.6	93,252
西尾レントオール	16.4	23.9	67,206
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	97.9	142	3,692
トランス・コスモス	17	32.8	107,584
乃村工藝社	76.4	110.8	104,152
藤田観光	7.1	11.3	26,882
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	9.5	16.1	25,470
日本管財	19.1	27.7	79,360
トーカイ	17.2	22.7	40,496
白洋舎	2	2.9	3,674
セコム	175.7	254.9	2,272,688
セントラル警備保障	8.6	12.5	31,025
丹青社	33.7	52.9	42,320
メイテック	21.8	31.2	213,408
応用地質	20.8	29.1	65,620
船井総研ホールディングス	36.5	52.9	119,448
進学会ホールディングス	7	8.4	3,158
オオバ	12.5	18.2	14,014
いであ	4.3	6.9	12,551
学究社	5.2	8.3	13,188

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ベネッセホールディングス	65.3	86.2	197,915
イオンディライト	22	31.9	98,252
ナック	8.4	12.3	12,287
ダイセキ	29.9	47.1	223,725

銘柄		期首(前期末)	当期末	
		株数	株数	評価額
		千株	千株	千円
ステップ		6.5	9.5	16,995
合計	株数・金額	196,035	297,416	732,980,729
	銘柄数＜比率＞	2,188	2,176	＜99.1％＞

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
国内	株式先物取引	ＴＯＰＩＸ	6,654	－

○有価証券の貸付及び借入の状況

（2022年３月25日現在）

区分	当期末
	数量
	株
貸付有価証券＜株式＞総株数	7,879,100

○投資信託財産の構成

（2022年３月25日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	％
株式	732,980,729	96.7
コール・ローン等、その他	24,852,394	3.3
投資信託財産総額	757,833,123	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年３月25日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	757,045,679,084
コール・ローン等	22,665,033,036
株式(評価額)	732,980,729,060
未収入金	802,829,550
未収配当金	1,036,555,168
その他未収収益	15,876,270
差入委託証拠金	△ 455,344,000
(B) 負債	17,221,711,633
未払解約金	2,686,865,686
未払利息	△ 263,196
受入担保金	14,535,109,143
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	739,823,967,451
元本	323,925,697,289
次期繰越損益金	415,898,270,162
(D) 受益権総口数	323,925,697,289口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	22,839円

○損益の状況 (2021年３月26日～2022年３月25日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	13,712,729,696
受取配当金	13,412,872,615
受取利息	286,570
その他収益金	297,316,786
支払利息	2,253,725
(B) 有価証券売買損益	△ 12,757,332,645
売買益	60,943,978,901
売買損	△ 73,701,311,546
(C) 先物取引等取引損益	△ 136,172,400
取引益	1,826,552,400
取引損	△ 1,962,724,800
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	819,224,651
(E) 前期繰越損益金	276,815,440,073
(F) 追加信託差損益金	424,370,602,402
(G) 解約差損益金	△286,106,996,964
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	415,898,270,162
次期繰越損益金(Ｈ)	415,898,270,162

(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。

＜注記事項＞

①期首元本額　229,410,107,801円
　期中追加設定元本額　327,037,089,764円
　期中一部解約元本額　232,521,500,276円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.2839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	52,810,604,615円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	39,252,787,441円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	37,989,399,040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）	33,944,715,365円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 国内株式（ＴＯＰＩＸ）	21,395,917,107円
国内株式インデックス・オープン（ラップ向け）	17,152,297,991円
三菱ＵＦＪ ＤＣトピックスオープン	8,950,943,499円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	7,679,908,171円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	7,551,945,344円
ｅＭＡＸＩＳ ＴＯＰＩＸインデックス	7,472,214,149円
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	6,811,785,880円
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスオープン	6,626,325,908円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,276,859,123円
つみたて日本株式（ＴＯＰＩＸ）	6,127,188,300円
三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ファンド	5,404,629,236円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	3,809,495,323円
ラップ向けインデックスｆ 国内株式	3,633,834,912円
三菱ＵＦＪ トピックスオープン（確定拠出年金）	3,592,758,918円
つみたて８資産均等バランス	3,445,707,353円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	3,407,583,661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）	2,849,999,030円
国内株式セレクション（ラップ向け）	2,602,555,962円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	2,546,980,075円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	2,195,076,058円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	1,916,649,476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）	1,729,464,382円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞ＴＯＰＩＸ・ファンド	1,621,488,028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）	1,571,045,378円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式65）	1,441,243,433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）	1,371,665,055円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス（国内株式）	1,186,416,421円
つみたて４資産均等バランス	1,059,688,814円
三菱ＵＦＪ トピックスオープン	1,021,130,854円
ＭＵＫＡＭ 日米コアバランス（除く米国株）2022-03（適格機関投資家限定）	1,002,058,697円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	985,513,911円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式40）	873,575,793円
ファンド・マネジャー（国内株式）	855,212,531円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	837,630,956円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 全世界株式（３地域均等型）	741,021,306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）	691,728,999円
三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ファンドＶＡ１	656,190,031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）	633,448,179円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	612,824,520円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	594,534,742円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	548,317,388円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	533,046,136円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	524,101,851円
ＭＵＫＡＭ 日米コアバランス 2021-07（適格機関投資家限定）	513,316,949円

三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	460,314,871円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	438,667,332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）	425,005,692円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	414,458,675円
ＭＵＦＧ ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）	370,403,983円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	346,806,753円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	311,660,218円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式15）	308,941,970円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	303,190,142円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	286,479,219円
ＭＵＦＧ ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）	228,173,832円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	217,070,213円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	200,384,194円
日米コアバランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	193,173,307円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	161,780,307円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	140,368,408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）	137,983,540円
三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ファンドＶＡ	137,032,047円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	132,841,270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）	132,502,514円
ＭＵＫＡＭ 米国国債プラス日本株式ファンド2020-07（適格機関投資家限定）	125,237,116円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	124,717,775円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	117,570,360円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式25）	102,685,085円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	86,117,941円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	82,839,831円
三菱ＵＦＪ トピックスオープンＶＡ（適格機関投資家限定）	82,388,733円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	71,741,381円
ＭＵＦＧ ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）	70,001,032円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）	60,616,892円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	45,277,979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）	43,640,133円
ＭＵＫＡＭ アセットアロケーションファンド2022-03（適格機関投資家限定）	42,857,545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）	42,011,017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）	41,969,101円
ＭＵＫＡＭ アセットアロケーションファンド2022-01（適格機関投資家限定）	41,396,338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）	40,655,690円
ＭＵＫＡＭ アセットアロケーションファンド2021-05（適格機関投資家限定）	40,141,981円
ＭＵＫＡＭ アセットアロケーションファンド2021-03（適格機関投資家限定）	39,905,941円
ＭＵＫＡＭ アセットアロケーションファンド2021-07（適格機関投資家限定）	39,760,908円
ＭＵＫＡＭ アセットアロケーションファンド2021-11（適格機関投資家限定）	38,804,680円
ＭＵＫＡＭ アセットアロケーションファンド2021-09（適格機関投資家限定）	38,386,516円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	21,158,245円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	20,539,362円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	12,161,841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
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	7,436,030円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	7,217,653円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	5,365,850円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	5,246,978円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	3,784,845円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	3,569,286円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	3,502,109円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,526,489円

ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	2,121,424円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	1,346,102円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式80）	1,107,825円
コアバランス	509,112円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	482,179円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）ＶＡ（適格機関投資家限定）	61,043円
マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）	45,509円
合計	323,925,697,289円

［お知らせ］

信託金限度額の増額を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。
（2021年７月30日）

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／国内／株式／インデックス型	
信託期間	2026年10月29日まで（2016年11月９日設定）	
運用方針	日本株式最小分散インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の金融商品取引所上場株式に投資を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100％を超える場合があります。株式以外の資産への実質投資割合（信託財産に属する株式以外の資産の時価総額と信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の総額に占める株式以外の資産の時価総額の割合を乗じて得た額との合計額が信託財産の総額に占める割合）は、原則として信託財産の総額の50％以下とします。	
主要運用対象	ベビーファンド	日本株式最小分散インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式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は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。
	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割合は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。
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。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告に係わる情報

日本株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）

第６期（決算日：2022年10月31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「日本株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）」は、去る10月31日に第６期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG
三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先
お客さま専用フリーダイヤル　０１２０－１５１０３４
（受付時間：営業日の9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～１月３日を除く）
お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額			ＭＳＣＩ日本株最小分散指数		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(配当込み)	期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2期(2018年10月29日)	12,500	0	△ 4.3	2,428.16	△ 4.0	98.9	1.6	11,059
3期(2019年10月29日)	13,238	0	5.9	2,577.88	6.2	96.9	1.5	7,787
4期(2020年10月29日)	12,261	0	△ 7.4	2,392.49	△ 7.2	99.0	1.0	8,811
5期(2021年10月29日)	14,139	0	15.3	2,763.13	15.5	98.9	1.1	11,070
6期(2022年10月31日)	14,372	0	1.6	2,817.87	2.0	99.0	1.4	9,842

(注) ＭＳＣＩ日本株最小分散指数（配当込み）とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、Ｊ－ＲＥＩＴを除いた日本株式を対象に、ボラティリティ（価格変動率）が最も小さくなるように各銘柄の構成比率を決定し算出した指数です。同指数に対する著作権およびその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
(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」は実質比率を記載しております。
(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日本株最小分散指数（配当込み）		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率		騰落率		
（期首）	円	%		%	%	%
2021年10月29日	14,139	－	2,763.13	－	98.9	1.1
11月末	13,696	△3.1	2,677.58	△3.1	98.9	1.1
12月末	14,109	△0.2	2,758.34	△0.2	99.5	0.7
2022年１月末	13,482	△4.6	2,636.29	△4.6	99.3	0.7
２月末	13,476	△4.7	2,635.84	△4.6	99.3	0.7
３月末	13,998	△1.0	2,738.48	△0.9	98.3	1.7
４月末	13,830	△2.2	2,706.57	△2.0	98.5	1.7
５月末	13,828	△2.2	2,706.57	△2.0	98.3	1.7
６月末	13,894	△1.7	2,721.57	△1.5	95.9	1.6
７月末	14,371	1.6	2,815.46	1.9	98.3	1.7
８月末	14,441	2.1	2,829.22	2.4	98.9	1.1
９月末	13,939	△1.4	2,733.06	△1.1	98.6	1.3
（期末）						
2022年10月31日	14,372	1.6	2,817.87	2.0	99.0	1.4

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

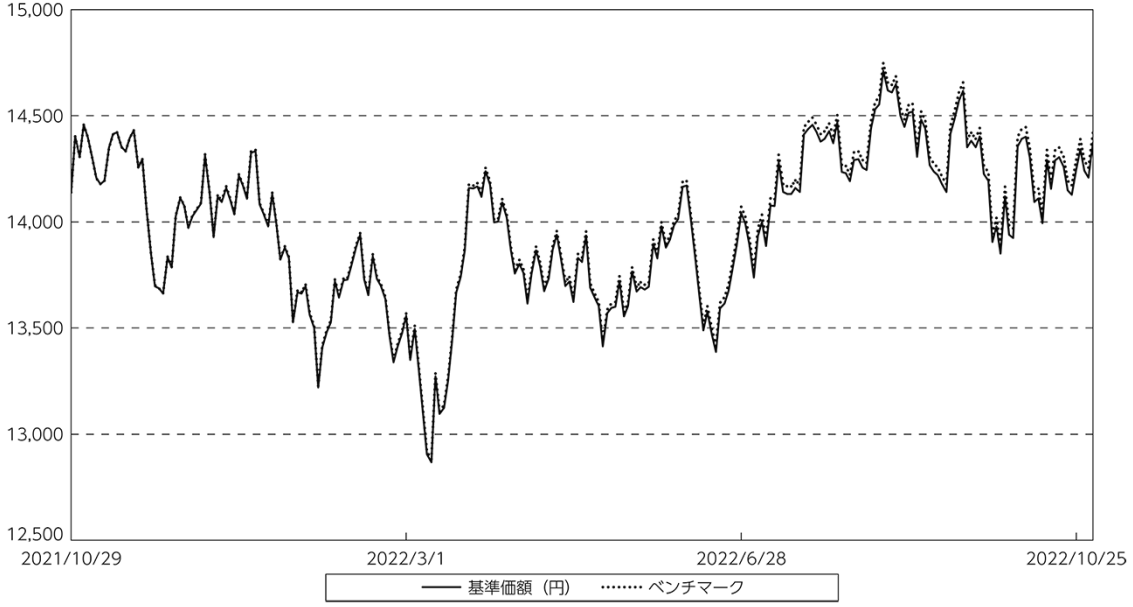
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.6%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（2.0%）を0.4%下回りました。

基準価額等の推移



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

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

●投資環境について
◎国内株式市況
・国内株式市況は上昇しました。
・円安・米ドル高進行に伴う輸出企業の採算改善等を背景に上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて
＜日本株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞
・資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

＜日本株式最小分散インデックスマザーファンド＞
・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
・株式ポートフォリオはベンチマークであるＭＳＣＩ日本株最小分散指数（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
＜日本株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞
　ベンチマークとのカイ離は△0.4%程度となりました。

・マザーファンド保有以外の要因
　ファンドの管理コスト等による影響は△0.3%程度でした。
・マザーファンド保有による要因
　マザーファンド保有による影響は△0.1%程度でした。

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

（主なマイナス要因）
・その他の要因※によるものです。
　※配当評価差異等が含まれます。

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

【分配原資の内訳】

（単位：円、１万口当たり、税込み）

項　　目	第６期 2021年10月30日～ 2022年10月31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	4,593

（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

＜日本株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞

・マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

＜日本株式最小分散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。

○１万口当たりの費用明細

（2021年10月30日～2022年10月31日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	36	0.260	(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）	(32)	(0.227)	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）	(0)	(0.001)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(4)	(0.032)	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	0.000	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	0	0.001	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.001)	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
合計	36	0.261	
期中の平均基準価額は、13,984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。

○売買及び取引の状況

（2021年10月30日～2022年10月31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
日本株式最小分散インデックスマザーファンド	83,919	117,206	1,070,216	1,496,916

○株式売買比率

（2021年10月30日～2022年10月31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
	日本株式最小分散インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	8,873,351千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	13,340,146千円
(c) 売買高比率（a）／（b）	0.66

(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

（2021年10月30日～2022年10月31日）

利害関係人との取引状況

＜日本株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞

該当事項はございません。

＜日本株式最小分散インデックスマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	4,492	491	10.9	4,380	229	5.2

平均保有割合　73.5%

※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

＜日本株式最小分散インデックスマザーファンド＞

種　　類	買　付　額	売　付　額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	167	18	185

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

＜日本株式最小分散インデックスマザーファンド＞

種　　類	買　付　額
	百万円
株式	0.5934

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、三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ、モルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券です。

○組入資産の明細

（2022年10月31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
日本株式最小分散インデックスマザーファンド	7,729,496	6,743,199	9,841,699

○投資信託財産の構成

（2022年10月31日現在）

項　　目	当期末	
	評価額	比　率
	千円	%
日本株式最小分散インデックスマザーファンド	9,841,699	99.9
コール・ローン等、その他	13,733	0.1
投資信託財産総額	9,855,432	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年10月31日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	9,855,432,161
コール・ローン等	13,172,794
日本株式最小分散インデックスマザーファンド(評価額)	9,841,699,670
未収入金	559,697
(B) 負債	12,961,325
未払信託報酬	12,890,053
未払利息	27
その他未払費用	71,245
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	9,842,470,836
元本	6,848,248,543
次期繰越損益金	2,994,222,293
(D) 受益権総口数	6,848,248,543口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	14,372円

＜注記事項＞

①期首元本額　7,829,410,512円
　期中追加設定元本額　85,753,650円
　期中一部解約元本額　1,066,915,619円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.4372円です。

○損益の状況 (2021年10月30日～2022年10月31日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,700
受取利息	10
支払利息	△ 1,710
(B) 有価証券売買損益	188,562,742
売買益	227,494,034
売買損	△ 38,931,292
(C) 信託報酬等	△ 26,110,908
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	162,450,134
(E) 前期繰越損益金	1,253,328,252
(F) 追加信託差損益金	1,578,443,907
(配当等相当額)	(1,682,741,166)
(売買損益相当額)	(△ 104,297,259)
(G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	2,994,222,293
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ)	2,994,222,293
追加信託差損益金	1,578,443,907
(配当等相当額)	(1,683,124,817)
(売買損益相当額)	(△ 104,680,910)
分配準備積立金	1,462,362,111
繰越損益金	△ 46,583,725

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

②分配金の計算過程

項　　目	2021年10月30日～2022年10月31日
費用控除後の配当等収益額	209,033,859円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	1,683,124,817円
分配準備積立金額	1,253,328,252円
当ファンドの分配対象収益額	3,145,486,928円
１万口当たり収益分配対象額	4,593円
１万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

《第６期》決算日2022年10月31日

［計算期間：2021年10月30日～2022年10月31日］

「日本株式最小分散インデックスマザーファンド」は、10月31日に第６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６期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主としてわが国の金融商品取引所上場株式に投資を行います。株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所上場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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＭＳＣＩ日本株最小分散指数（配当込み）		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
２期(2018年10月29日)	12,563	△ 4.1	2,428.16	△ 4.0	98.9	1.6	11,734
３期(2019年10月29日)	13,339	6.2	2,577.88	6.2	96.9	1.5	10,043
４期(2020年10月29日)	12,386	△ 7.1	2,392.49	△ 7.2	99.0	1.0	11,208
５期(2021年10月29日)	14,321	15.6	2,763.13	15.5	98.9	1.1	14,046
６期(2022年10月31日)	14,595	1.9	2,817.87	2.0	99.0	1.4	14,044

(注) ＭＳＣＩ日本株最小分散指数（配当込み）とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、Ｊ－ＲＥＩＴを除いた日本株式を対象に、ボラティリティ（価格変動率）が最も小さくなるように各銘柄の構成比率を決定し算出した指数です。同指数に対する著作権およびその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
(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日本株最小分散指数（配当込み）		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
（期　首） 2021年10月29日	14,321	－	2,763.13	－	98.9	1.1
11月末	13,875	△3.1	2,677.58	△3.1	98.9	1.1
12月末	14,297	△0.2	2,758.34	△0.2	99.5	0.7
2022年１月末	13,664	△4.6	2,636.29	△4.6	99.3	0.7
２月末	13,661	△4.6	2,635.84	△4.6	99.3	0.7
３月末	14,193	△0.9	2,738.48	△0.9	98.3	1.7
４月末	14,026	△2.1	2,706.57	△2.0	98.5	1.7
５月末	14,027	△2.1	2,706.57	△2.0	98.3	1.7
６月末	14,097	△1.6	2,721.57	△1.5	95.9	1.6
７月末	14,584	1.8	2,815.46	1.9	98.3	1.7
８月末	14,658	2.4	2,829.22	2.4	98.9	1.1
９月末	14,152	△1.2	2,733.06	△1.1	98.6	1.3
（期　末） 2022年10月31日	14,595	1.9	2,817.87	2.0	99.0	1.4

（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

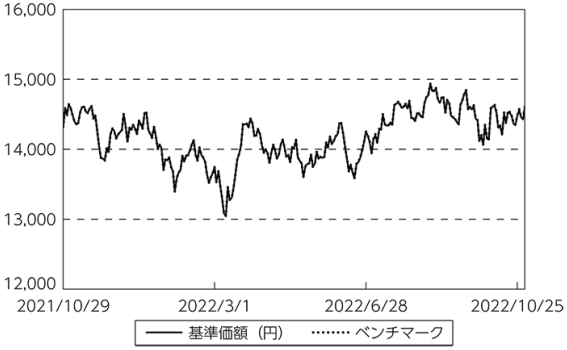
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.9%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（2.0%）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
◎国内株式市況
・国内株式市況は上昇しました。
・円安・米ドル高進行に伴う輸出企業の採算改善等を背景に上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて
・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
・株式ポートフォリオはベンチマークであるＭＳＣＩ日本株最小分散指数（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2.0%の上昇になったため、カイ離は△0.1%程度となりました。

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

（主なマイナス要因）
・その他の要因※によるものです。
※配当評価差異等が含まれます。

○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

（2021年10月30日～2022年10月31日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	0	0.000	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
合計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、14,183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

（2021年10月30日～2022年10月31日）

株式

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
		千株	千円	千株	千円
国内	上場	2,018 (87)	4,492,974 (－)	1,585	4,380,376

（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。

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建 新規買付額	買建 決済額	売建 新規売付額	売建 決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	株式先物取引	809	776	－	－

○株式売買比率

（2021年10月30日～2022年10月31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	8,873,351千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	13,340,146千円
(c) 売買高比率（a）／（b）	0.66

(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

（2021年10月30日～2022年10月31日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	4,492	491	10.9	4,380	229	5.2

利害関係人の発行する有価証券等

種　　類	買　付　額	売　付　額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	167	18	185

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種　　類	買　付　額
	百万円
株式	0.5934

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、三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ、モルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券です。

○組入資産の明細

（2022年10月31日現在）

国内株式

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
建設業（2.2%）			
大成建設	6.9	17.8	72,179
大林組	－	62.9	60,069
鹿島建設	－	6.3	8,826
大東建託	6	－	－
積水ハウス	60.9	64.3	159,142
食料品（7.4%）			
ヤクルト本社	4.6	17.8	146,672
明治ホールディングス	15.3	30.7	187,884
キリンホールディングス	25.8	26.4	57,802
サントリー食品インターナショナル	32.3	26.8	133,464
味の素	49.2	27.7	113,459
東洋水産	20.8	－	－
日清食品ホールディングス	5.6	18.2	175,266
日本たばこ産業	85.5	87.9	216,585
化学（4.6%）			
信越化学工業	4.1	4.2	65,268
ＪＳＲ	10.6	10.9	30,890
三菱ケミカルグループ	－	27.4	18,415
花王	21	28.2	157,638
日本ペイントホールディングス	17	－	－
関西ペイント	27.7	－	－
富士フイルムホールディングス	27.6	23.8	162,292
資生堂	2.5	－	－
ライオン	36.7	－	－
小林製薬	5.5	5.7	45,030
日東電工	3.7	3.8	29,754
ユニ・チャーム	28.4	29.1	131,881
医薬品（9.8%）			
協和キリン	21.2	21.7	76,058
武田薬品工業	34.5	54.9	215,098
アステラス製薬	98.9	103	210,789
塩野義製薬	22.5	18	124,020
日本新薬	－	6.9	56,856
中外製薬	43.2	44.2	152,490
エーザイ	4.3	4.4	39,485
小野薬品工業	45.1	58.2	203,467
参天製薬	7.8	－	－
第一三共	15.8	16.2	77,225
大塚ホールディングス	15.6	45.1	214,946
ペプチドリーム	11.1	－	－
石油・石炭製品（1.7%）			
出光興産	2.4	40.1	130,325
ＥＮＥＯＳホールディングス	－	219.5	107,511
ゴム製品（1.6%）			
ブリヂストン	42.3	41.5	222,523
金属製品（－%）			
リンナイ	8.2	－	－
機械（2.1%）			
ＳＭＣ	1.5	1.3	78,156
クボタ	22.2	22.7	47,136
ダイキン工業	6.7	5.6	125,356
ホシザキ	3.7	7.5	31,987
マキタ	4.9	2	5,440
電気機器（11.0%）			
日立製作所	－	5.8	39,208
東芝	12.9	15.3	79,269
三菱電機	67.1	84.5	110,695
日本電産	5.4	4.3	35,423
日本電気	26.7	12.6	62,055
富士通	11.7	6.6	113,025
ソニーグループ	11.6	11.9	118,857
ヒロセ電機	6.8	6.7	129,377
アズビル	13.8	14.1	57,034
キーエンス	3.8	2.9	163,328
シスメックス	11.6	1.4	11,239
ファナック	1.1	1.2	23,556
浜松ホトニクス	18.8	11.3	76,162

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
京セラ	17.5	18.2	135,426
村田製作所	24.1	24.5	178,850
キヤノン	67.8	62.9	198,386
東京エレクトロン	1.3	—	—
輸送用機器（2.3%）			
トヨタ自動車	113.8	100.8	207,597
シマノ	5.5	4.9	113,067
精密機器（3.2%）			
テルモ	31.7	32.4	146,577
島津製作所	4.9	5	19,625
オリンパス	36.2	26.7	83,838
ＨＯＹＡ	14.8	11.6	160,950
朝日インテック	27.3	14.6	36,996
その他製品（2.2%）			
バンダイナムコホールディングス	14.9	11	108,262
大日本印刷	—	2.6	7,755
任天堂	3	30.3	183,921
電気・ガス業（5.2%）			
中部電力	91.4	155.1	187,826
関西電力	—	160.1	180,432
東北電力	69	—	—
東京瓦斯	63.5	64.9	172,439
大阪瓦斯	66.7	81.3	179,022
東邦瓦斯	14	—	—
陸運業（5.9%）			
東武鉄道	11.4	11.7	40,248
東急	31.8	32.5	55,770
小田急電鉄	38.9	39.8	70,406
京王電鉄	7.3	7.5	39,150
京成電鉄	2.1	2.2	8,690
東日本旅客鉄道	21	21.5	172,860
東海旅客鉄道	8	8.2	141,573
近鉄グループホールディングス	12.8	13	65,390
阪急阪神ホールディングス	9.1	9.3	41,059
日本通運	1.6	—	—
ヤマトホールディングス	4.8	31.2	68,764
ＳＧホールディングス	56.5	53.4	105,304
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディン	—	1.6	11,952

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
情報・通信業（12.4%）			
ＴＩＳ	3.1	3.1	12,446
コーエーテクモホールディングス	17.7	8.6	19,332
ネクソン	28.5	7.7	19,226
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	1.6	—	—
野村総合研究所	16	16.4	54,202
オービック	9	9.2	205,804
Ｚホールディングス	191.4	112.7	43,344
トレンドマイクロ	—	15.7	117,907
日本オラクル	8.4	7.9	62,726
伊藤忠テクノソリューションズ	22.3	22.8	78,660
大塚商会	10.5	16.4	76,998
日本電信電話	69.1	52.1	213,297
ＫＤＤＩ	55.7	45	197,775
ソフトバンク	137.8	137.1	200,920
光通信	2	2	35,940
東宝	43.4	34.1	180,730
エヌ・ティ・ティ・データ	50.9	52	112,164
スクウェア・エニックス・ホールディングス	4.5	4.6	30,544
カプコン	17.7	15.8	65,491
コナミグループ	3	—	—
ソフトバンクグループ	0.9	—	—
卸売業（4.7%）			
メディパルホールディングス	9.3	—	—
伊藤忠商事	59.8	56.6	217,853
三井物産	41	41.9	137,976
住友商事	36.5	50.9	96,480
三菱商事	63	47.5	191,472
ミスミグループ本社	—	3.5	11,130
小売業（6.9%）			
ローソン	21.6	—	—
エービーシー・マート	20.7	—	—
日本マクドナルドホールディングス	39.1	39.3	202,788
ＭｏｎｏｔａＲＯ	27	27.6	62,596
ＺＯＺＯ	—	2.7	8,545
ウエルシアホールディングス	17.4	19.2	59,712
コスモス薬品	3.9	—	—
セブン＆アイ・ホールディングス	34.3	33.7	187,169
ツルハホールディングス	4.2	—	—

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
パン・パシフィック・インターナショナルホ	58.7	60	146,460
ヤマダホールディングス	220.7	－	－
ニトリホールディングス	10.2	12.2	165,127
ファーストリテイリング	1.5	1.6	132,784
銀行業（5.8%）			
ゆうちょ銀行	204.9	205.7	203,643
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	21.2	265.9	185,997
三井住友フィナンシャルグループ	21.9	52	216,996
みずほフィナンシャルグループ	118.6	121.3	194,807
保険業（3.0%）			
ＳＯＭＰＯホールディングス	－	10.3	63,787
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホール	23.1	32.2	126,900
東京海上ホールディングス	26.9	82.6	222,276
その他金融業（0.3%）			
日本取引所グループ	19	19.4	37,897
不動産業（2.0%）			
大東建託	－	5.8	85,318
ヒューリック	11.6	－	－
三菱地所	15.9	103.4	193,668
サービス業（5.7%）			
綜合警備保障	8.6	－	－
カカクコム	8.2	－	－
エムスリー	12.2	11.5	51,129
オリエンタルランド	11.3	9.7	193,515
ユー・エス・エス	24.5	57.1	128,303
サイバーエージェント	14	6.3	7,711
日本郵政	209.3	213.9	213,814
セコム	22.9	23.7	201,236
合計 株数・金額	4,110	4,630	13,907,373
合計 銘柄数＜比率＞	137	126	＜99.0%＞

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
国内	株式先物取引	ＴＯＰＩＸ	192	－

○投資信託財産の構成

（2022年10月31日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	13,907,373	97.1
コール・ローン等、その他	408,276	2.9
投資信託財産総額	14,315,649	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年10月31日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	14,315,519,399
コール・ローン等	61,998,272
株式(評価額)	13,907,373,300
未収入金	218,653,235
未収配当金	119,374,592
差入委託証拠金	8,120,000
(B) 負債	271,092,638
未払金	270,532,812
未払解約金	559,697
未払利息	129
(C) 純資産総額(A－B)	14,044,426,761
元本	9,622,469,147
次期繰越損益金	4,421,957,614
(D) 受益権総口数	9,622,469,147口
１万口当たり基準価額(C／D)	14,595円

＜注記事項＞

①期首元本額　9,808,302,507円
　期中追加設定元本額　899,236,936円
　期中一部解約元本額　1,085,070,296円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.4595円です。

○損益の状況 (2021年10月30日～2022年10月31日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	336,261,683
受取配当金	336,289,942
受取利息	364
その他収益金	2,002
支払利息	△ 30,625
(B) 有価証券売買損益	△ 92,318,165
売買益	1,141,577,523
売買損	△1,233,895,688
(C) 先物取引等取引損益	555,900
取引益	16,185,900
取引損	△ 15,630,000
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	244,499,418
(E) 前期繰越損益金	4,237,834,938
(F) 追加信託差損益金	371,569,275
(G) 解約差損益金	△ 431,946,017
(H) 計(D＋E＋F＋G)	4,421,957,614
次期繰越損益金(H)	4,421,957,614

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

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

日本株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）	6,743,199,500円
国内株式セレクション（ラップ向け）	1,744,905,805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）	538,130,278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）	530,139,253円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	58,298,699円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	7,795,612円
合計	9,622,469,147円

851468

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型株式投資信託／バランス型	
信託期間	無期限（2007年３月15日設定）	
運用方針	マザーファンドを通じて、わが国の公社債に投資することにより、ＮＯＭＵＲＡ−ＢＰＩ総合と連動する投資成果をめざします。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。	
主要運用対象	ベビーファンド	日本債券インデックス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。
	マザーファンド	ＮＯＭＵＲＡ−ＢＰＩ総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

運用報告書（全体版）

ＭＵＡＭ 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

第15期（決算日：2022年５月12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「ＭＵＡＭ 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）」は、去る５月12日に第15期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG
三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先
お客さま専用フリーダイヤル　０１２０−１５１０３４
（受付時間：営業日の9:00〜17:00、土・日・祝日・12月31日〜１月３日を除く）
お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額			ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
11期(2018年５月14日)	12,369	0	0.6	381.82	0.8	98.4	0.3	243,222
12期(2019年５月13日)	12,555	0	1.5	388.16	1.7	99.8	0.1	260,568
13期(2020年５月12日)	12,555	0	0.0	388.75	0.2	99.6	0.1	207,777
14期(2021年５月12日)	12,478	0	△0.6	386.93	△0.5	99.5	0.2	175,324
15期(2022年５月12日)	12,212	0	△2.1	379.29	△2.0	99.7	0.1	175,270

(注) ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
(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		ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
（期　首） 2021年５月12日	12,478	－	386.93	－	99.5	0.2
５月末	12,466	△0.1	386.62	△0.1	99.4	0.3
６月末	12,473	△0.0	386.90	△0.0	99.4	0.4
７月末	12,534	0.4	388.81	0.5	99.3	0.4
８月末	12,522	0.4	388.46	0.4	99.3	0.4
９月末	12,477	△0.0	387.12	0.0	99.4	0.4
10月末	12,462	△0.1	386.72	△0.1	99.3	0.4
11月末	12,490	0.1	387.65	0.2	99.2	0.2
12月末	12,461	△0.1	386.84	△0.0	100.5	0.1
2022年１月末	12,371	△0.9	384.06	△0.7	98.5	0.1
２月末	12,307	△1.4	382.13	△1.2	99.4	0.1
３月末	12,272	△1.7	381.04	△1.5	101.1	0.1
４月末	12,240	△1.9	380.12	△1.8	98.9	0.1
（期　末） 2022年５月12日	12,212	△2.1	379.29	△2.0	99.7	0.1

（注）騰落率は期首比。
（注）当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第15期：2021年５月13日～2022年５月12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 15 期 首	12,478円
第 15 期 末	12,212円
既払分配金	0円
騰　落　率	－2.1％

※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、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2.1％の下落となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－2.0％）を0.1％下回りました。

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。

第15期：2021年５月13日～2022年５月12日

投資環境について

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前半から2021年末にかけてはもみ合いで推移しました。その後、インフレ懸念や利上げ観測の高まりによる米金利の上昇などから国内債券市況は下落しました。期の終わりにかけてはウクライナ情勢緊迫化による上昇局面があったものの、米国の利上げへの積極的な姿勢などを受けて国内債券市況は反落し、期を通して見ても下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

ＭＵＡＭ 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

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。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ ＭＵＡＭ 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

ベンチマークとのカイ離は△0.1％程度となりました。

マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は△0.1％程度でした。

マザーファンド保有による要因

マザーファンド保有による影響は△0.0％程度でした。

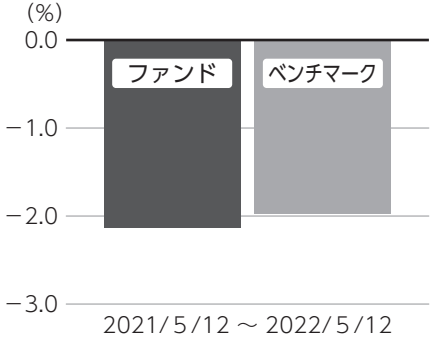
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：取引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が異なるため生じる要因です。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



分配金について

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

分配原資の内訳

（単位：円、１万口当たり、税込み）

項　目	第15期 2021年５月13日～2022年５月12日
当期分配金（対基準価額比率）	－（－％）
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	2,494

（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。）

▶ **ＭＵＡＭ 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）**

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ **日本債券インデックスマザーファンド**

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2021年５月13日～2022年５月12日

１万口当たりの費用明細

項目	当期 金額（円）	当期 比率（%）	項目の概要
(a)信託報酬	19	0.154	(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）	(11)	(0.088)	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）	(3)	(0.022)	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）	(5)	(0.044)	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	0.000	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
合計	19	0.154	

期中の平均基準価額は、12,424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。
（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

（2021年５月13日～2022年５月12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
日本債券インデックスマザーファンド	22,829,897	30,605,727	20,235,930	27,231,762

○利害関係人との取引状況等

（2021年５月13日～2022年５月12日）

利害関係人との取引状況

＜ＭＵＡＭ 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞

該当事項はございません。

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	522,104	72,698	13.9	151,987	40,900	26.9

平均保有割合　34.4%

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

（注）公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

種類	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
公社債	2,357	403	4,075

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

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

種類	買付額
	百万円
公社債	5,799

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

○組入資産の明細

（2022年５月12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
日本債券インデックスマザーファンド	130,227,934	132,821,900	175,258,498

○投資信託財産の構成

（2022年５月12日現在）

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
日本債券インデックスマザーファンド	175,258,498	99.9
コール・ローン等、その他	158,967	0.1
投資信託財産総額	175,417,465	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 （2022年５月12日現在）

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	175,417,465,713
コール・ローン等	139,357,330
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	175,258,498,302
未収入金	19,610,081
(B) 負債	147,123,058
未払解約金	15,065,225
未払信託報酬	132,057,814
未払利息	19
(C) 純資産総額（Ａ－Ｂ）	175,270,342,655
元本	143,522,198,778
次期繰越損益金	31,748,143,877
(D) 受益権総口数	143,522,198,778口
１万口当たり基準価額（Ｃ／Ｄ）	12,212円

＜注記事項＞

①期首元本額　140,502,164,864円
　期中追加設定元本額　25,805,725,416円
　期中一部解約元本額　22,785,691,502円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.2212円です。

○損益の状況 （2021年５月13日～2022年５月12日）

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	△ 39,537
受取利息	312
支払利息	△ 39,849
(B) 有価証券売買損益	△ 3,400,072,339
売買益	103,729,554
売買損	△ 3,503,801,893
(C) 信託報酬等	△ 269,765,387
(D) 当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	△ 3,669,877,263
(E) 前期繰越損益金	489,250,312
(F) 追加信託差損益金	34,928,770,828
（配当等相当額）	(31,685,338,172)
（売買損益相当額）	(3,243,432,656)
(G) 計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	31,748,143,877
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）	31,748,143,877
追加信託差損益金	34,928,770,828
（配当等相当額）	(31,692,725,037)
（売買損益相当額）	(3,236,045,791)
分配準備積立金	4,106,411,215
繰越損益金	△ 7,287,038,166

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

②分配金の計算過程

項　　目	2021年５月13日～2022年５月12日
費用控除後の配当等収益額	978,501,787円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	31,692,725,037円
分配準備積立金額	3,127,909,428円
当ファンドの分配対象収益額	35,799,136,252円
１万口当たり収益分配対象額	2,494円
１万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

日本債券インデックスマザーファンド

《第21期》決算日2022年５月12日

［計算期間：2021年５月13日～2022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21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21期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
20期(2021年５月12日)	13,462	△0.5	386.93	△0.5	99.5	0.2	314,171
21期(2022年５月12日)	13,195	△2.0	379.29	△2.0	99.7	0.1	666,754

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年　月　日	基準価額		NOMURA－BPI総合		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
（期　首） 2021年５月12日	13,462	－	386.93	－	99.5	0.2
５月末	13,450	△0.1	386.62	△0.1	99.4	0.3
６月末	13,459	△0.0	386.90	△0.0	99.4	0.4
７月末	13,526	0.5	388.81	0.5	99.3	0.4
８月末	13,515	0.4	388.46	0.4	99.3	0.4
９月末	13,469	0.1	387.12	0.0	99.4	0.4
10月末	13,454	△0.1	386.72	△0.1	99.3	0.4
11月末	13,486	0.2	387.65	0.2	99.2	0.2
12月末	13,456	△0.0	386.84	△0.0	100.5	0.1
2022年１月末	13,361	△0.8	384.06	△0.7	98.6	0.1
２月末	13,294	△1.2	382.13	△1.2	99.4	0.1
３月末	13,257	△1.5	381.04	△1.5	101.1	0.1
４月末	13,224	△1.8	380.12	△1.8	98.9	0.1
（期　末） 2022年５月12日	13,195	△2.0	379.29	△2.0	99.7	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

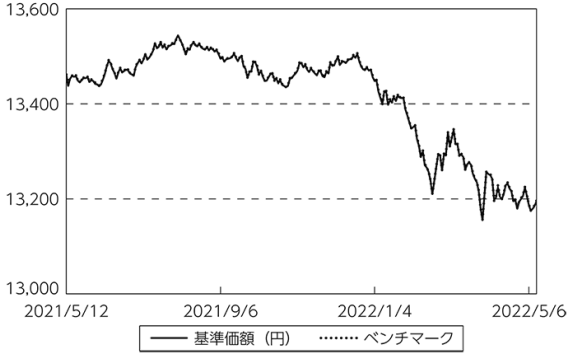
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.0%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（－2.0%）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
（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前半から2021年末にかけてはもみ合いで推移しました。その後、インフレ懸念や利上げ観測の高まりによる米金利の上昇などから国内債券市況は下落しました。期の終わりにかけてはウクライナ情勢緊迫化による上昇局面があったものの、米国の利上げへの積極的な姿勢などを受けて国内債券市況は反落し、期を通して見ても下落しました。

●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2.0%の下落になったため、カイ離は△0.0%程度となりました。

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

（2021年５月13日～2022年５月12日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	0	0.000	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
合計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,413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

（2021年５月13日～2022年５月12日）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	436,809,550	125,988,934
	地方債証券	32,246,481	8,383,812 (66,000)
	特殊債券	22,026,357	7,453,468 (610,844)
	社債券	31,022,353	10,161,510 (300,000)

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建 新規買付額	買建 決済額	売建 新規売付額	売建 決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	債券先物取引	5,757	5,911	－	－

○利害関係人との取引状況等

（2021年５月13日～2022年５月12日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	522,104	72,698	13.9	151,987	40,900	26.9

（注）公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種　　類	買　付　額	売　付　額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
公社債	2,357	403	4,075

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種　　類	買　付　額
	百万円
公社債	5,799

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

○組入資産の明細

（2022年５月12日現在）

国内公社債

（A）国内（邦貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					５年以上	２年以上	２年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	536,355,000	554,662,985	83.2	－	56.6	17.4	9.2
地方債証券	37,976,950	39,181,165	5.9	－	2.4	2.2	1.3
	(37,976,950)	(39,181,165)	(5.9)	(－)	(2.4)	(2.2)	(1.3)
特殊債券（除く金融債）	29,228,207	30,455,697	4.6	－	2.4	1.6	0.6
	(29,228,207)	(30,455,697)	(4.6)	(－)	(2.4)	(1.6)	(0.6)
金融債券	2,500,000	2,502,066	0.4	－	－	0.3	0.0
	(2,500,000)	(2,502,066)	(0.4)	(－)	(－)	(0.3)	(0.0)
普通社債券	37,600,000	37,849,909	5.7	0.0	1.8	3.4	0.5
	(37,600,000)	(37,849,909)	(5.7)	(0.0)	(1.8)	(3.4)	(0.5)
合計	643,660,157	664,651,823	99.7	0.0	63.1	24.9	11.7
	(107,305,157)	(109,988,838)	(16.5)	(0.0)	(6.5)	(7.5)	(2.5)

（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425回利付国債（２年）	0.005	1,300,000	1,301,222	2023/６/１
第426回利付国債（２年）	0.005	4,530,000	4,534,348	2023/７/１
第427回利付国債（２年）	0.005	4,860,000	4,864,714	2023/８/１
第428回利付国債（２年）	0.005	2,300,000	2,302,392	2023/９/１
第429回利付国債（２年）	0.005	1,770,000	1,771,964	2023/10/１
第430回利付国債（２年）	0.005	3,000,000	3,003,510	2023/11/１
第431回利付国債（２年）	0.005	550,000	550,682	2023/12/１
第432回利付国債（２年）	0.005	1,600,000	1,601,968	2024/１/１
第433回利付国債（２年）	0.005	850,000	851,020	2024/２/１
第434回利付国債（２年）	0.005	5,300,000	5,306,678	2024/３/１
第136回利付国債（５年）	0.1	2,520,000	2,524,989	2023/６/20
第137回利付国債（５年）	0.1	3,520,000	3,528,342	2023/９/20
第138回利付国債（５年）	0.1	6,250,000	6,267,062	2023/12/20
第139回利付国債（５年）	0.1	2,520,000	2,527,459	2024/３/20
第140回利付国債（５年）	0.1	3,470,000	3,480,930	2024/６/20
第141回利付国債（５年）	0.1	4,040,000	4,053,816	2024/９/20
第142回利付国債（５年）	0.1	310,000	311,171	2024/12/20
第143回利付国債（５年）	0.1	5,060,000	5,080,948	2025/３/20
第144回利付国債（５年）	0.1	7,360,000	7,392,016	2025/６/20
第145回利付国債（５年）	0.1	4,310,000	4,329,524	2025/９/20
第146回利付国債（５年）	0.1	5,760,000	5,787,014	2025/12/20
第147回利付国債（５年）	0.005	540,000	540,518	2026/３/20
第148回利付国債（５年）	0.005	1,750,000	1,751,435	2026/６/20
第149回利付国債（５年）	0.005	6,950,000	6,952,988	2026/９/20
第150回利付国債（５年）	0.005	6,280,000	6,281,444	2026/12/20
第151回利付国債（５年）	0.005	950,000	949,762	2027/３/20
第１回利付国債（40年）	2.4	675,000	903,447	2048/３/20
第２回利付国債（40年）	2.2	1,035,000	1,340,459	2049/３/20
第３回利付国債（40年）	2.2	718,000	934,182	2050/３/20
第４回利付国債（40年）	2.2	1,218,000	1,591,597	2051/３/20
第５回利付国債（40年）	2.0	1,065,000	1,337,501	2052/３/20
第６回利付国債（40年）	1.9	1,230,000	1,517,844	2053/３/20
第７回利付国債（40年）	1.7	1,310,000	1,550,240	2054/３/20
第８回利付国債（40年）	1.4	1,510,000	1,665,530	2055/３/20
第９回利付国債（40年）	0.4	2,430,000	1,990,753	2056/３/20
第10回利付国債（40年）	0.9	2,240,000	2,148,764	2057/３/20
第11回利付国債（40年）	0.8	1,850,000	1,716,115	2058/３/20
第12回利付国債（40年）	0.5	2,040,000	1,698,973	2059/３/20
第13回利付国債（40年）	0.5	2,320,000	1,922,305	2060/３/20
第14回利付国債（40年）	0.7	2,660,000	2,354,339	2061/３/20
第329回利付国債（10年）	0.8	4,690,000	4,735,586	2023/６/20
第330回利付国債（10年）	0.8	3,180,000	3,217,746	2023/９/20
第331回利付国債（10年）	0.6	1,400,000	1,412,824	2023/９/20
第332回利付国債（10年）	0.6	2,920,000	2,951,419	2023/12/20

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333回利付国債（10年）	0.6	3,950,000	3,998,308	2024/3/20
第334回利付国債（10年）	0.6	3,990,000	4,044,623	2024/6/20
第335回利付国債（10年）	0.5	3,890,000	3,939,986	2024/9/20
第336回利付国債（10年）	0.5	2,460,000	2,494,956	2024/12/20
第337回利付国債（10年）	0.3	1,620,000	1,634,563	2024/12/20
第338回利付国債（10年）	0.4	3,330,000	3,372,291	2025/3/20
第339回利付国債（10年）	0.4	4,020,000	4,074,953	2025/6/20
第340回利付国債（10年）	0.4	3,470,000	3,520,696	2025/9/20
第341回利付国債（10年）	0.3	3,320,000	3,359,541	2025/12/20
第342回利付国債（10年）	0.1	3,720,000	3,737,186	2026/3/20
第343回利付国債（10年）	0.1	4,870,000	4,892,986	2026/6/20
第344回利付国債（10年）	0.1	4,620,000	4,641,113	2026/9/20
第345回利付国債（10年）	0.1	6,340,000	6,369,164	2026/12/20
第346回利付国債（10年）	0.1	5,180,000	5,202,584	2027/3/20
第347回利付国債（10年）	0.1	5,700,000	5,723,199	2027/6/20
第348回利付国債（10年）	0.1	6,020,000	6,040,889	2027/9/20
第349回利付国債（10年）	0.1	5,490,000	5,505,317	2027/12/20
第350回利付国債（10年）	0.1	6,620,000	6,633,504	2028/3/20
第351回利付国債（10年）	0.1	4,700,000	4,705,687	2028/6/20
第352回利付国債（10年）	0.1	4,150,000	4,151,286	2028/9/20
第353回利付国債（10年）	0.1	5,050,000	5,046,667	2028/12/20
第354回利付国債（10年）	0.1	4,090,000	4,083,047	2029/3/20
第355回利付国債（10年）	0.1	4,580,000	4,567,084	2029/6/20
第356回利付国債（10年）	0.1	6,230,000	6,202,774	2029/9/20
第357回利付国債（10年）	0.1	5,100,000	5,071,287	2029/12/20
第358回利付国債（10年）	0.1	6,050,000	6,010,191	2030/3/20
第359回利付国債（10年）	0.1	7,170,000	7,112,783	2030/6/20
第360回利付国債（10年）	0.1	3,440,000	3,408,902	2030/9/20
第361回利付国債（10年）	0.1	4,130,000	4,088,121	2030/12/20
第362回利付国債（10年）	0.1	5,210,000	5,153,471	2031/3/20
第363回利付国債（10年）	0.1	5,430,000	5,364,622	2031/6/20
第364回利付国債（10年）	0.1	6,480,000	6,396,926	2031/9/20
第365回利付国債（10年）	0.1	6,460,000	6,375,051	2031/12/20
第１回利付国債（30年）	2.8	196,000	233,875	2029/9/20
第２回利付国債（30年）	2.4	268,000	313,980	2030/2/20
第３回利付国債（30年）	2.3	307,000	358,447	2030/5/20
第４回利付国債（30年）	2.9	252,000	309,148	2030/11/20
第５回利付国債（30年）	2.2	238,000	279,797	2031/5/20
第６回利付国債（30年）	2.4	339,000	407,932	2031/11/20
第７回利付国債（30年）	2.3	339,000	407,522	2032/5/20
第８回利付国債（30年）	1.8	302,000	349,124	2032/11/22
第９回利付国債（30年）	1.4	206,000	229,525	2032/12/20
第10回利付国債（30年）	1.1	398,000	431,233	2033/3/20
第11回利付国債（30年）	1.7	237,000	272,362	2033/6/20
第12回利付国債（30年）	2.1	325,000	388,391	2033/9/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第13回利付国債（30年）	2.0	595,000	705,664	2033/12/20
第14回利付国債（30年）	2.4	683,000	843,293	2034/3/20
第15回利付国債（30年）	2.5	686,000	857,266	2034/6/20
第16回利付国債（30年）	2.5	547,000	685,478	2034/9/20
第17回利付国債（30年）	2.4	577,000	717,632	2034/12/20
第18回利付国債（30年）	2.3	687,000	848,108	2035/3/20
第19回利付国債（30年）	2.3	593,000	733,742	2035/6/20
第20回利付国債（30年）	2.5	655,000	828,869	2035/9/20
第21回利付国債（30年）	2.3	529,000	657,414	2035/12/20
第22回利付国債（30年）	2.5	695,000	883,650	2036/3/20
第23回利付国債（30年）	2.5	194,000	247,235	2036/6/20
第24回利付国債（30年）	2.5	541,000	691,019	2036/9/20
第25回利付国債（30年）	2.3	647,000	809,927	2036/12/20
第26回利付国債（30年）	2.4	1,014,000	1,285,691	2037/3/20
第27回利付国債（30年）	2.5	460,000	592,043	2037/9/20
第28回利付国債（30年）	2.5	1,026,000	1,324,473	2038/3/20
第29回利付国債（30年）	2.4	530,000	678,150	2038/9/20
第30回利付国債（30年）	2.3	1,421,000	1,798,971	2039/3/20
第31回利付国債（30年）	2.2	1,923,000	2,408,538	2039/9/20
第32回利付国債（30年）	2.3	1,309,000	1,663,791	2040/3/20
第33回利付国債（30年）	2.0	1,317,000	1,609,887	2040/9/20
第34回利付国債（30年）	2.2	1,791,000	2,253,418	2041/3/20
第35回利付国債（30年）	2.0	2,029,000	2,489,238	2041/9/20
第36回利付国債（30年）	2.0	1,929,000	2,368,136	2042/3/20
第37回利付国債（30年）	1.9	2,037,000	2,465,931	2042/9/20
第38回利付国債（30年）	1.8	1,590,000	1,896,170	2043/3/20
第39回利付国債（30年）	1.9	1,270,000	1,538,909	2043/6/20
第40回利付国債（30年）	1.8	1,640,000	1,956,979	2043/9/20
第41回利付国債（30年）	1.7	780,000	916,063	2043/12/20
第42回利付国債（30年）	1.7	1,600,000	1,880,080	2044/3/20
第43回利付国債（30年）	1.7	1,400,000	1,645,924	2044/6/20
第44回利付国債（30年）	1.7	1,470,000	1,729,087	2044/9/20
第45回利付国債（30年）	1.5	1,530,000	1,736,687	2044/12/20
第46回利付国債（30年）	1.5	2,000,000	2,270,480	2045/3/20
第47回利付国債（30年）	1.6	1,680,000	1,942,063	2045/6/20
第48回利付国債（30年）	1.4	1,830,000	2,038,052	2045/9/20
第49回利付国債（30年）	1.4	1,540,000	1,714,944	2045/12/20
第50回利付国債（30年）	0.8	1,810,000	1,781,438	2046/3/20
第51回利付国債（30年）	0.3	1,970,000	1,722,233	2046/6/20
第52回利付国債（30年）	0.5	1,850,000	1,693,693	2046/9/20
第53回利付国債（30年）	0.6	1,580,000	1,478,548	2046/12/20
第54回利付国債（30年）	0.8	1,440,000	1,407,888	2047/3/20
第55回利付国債（30年）	0.8	1,410,000	1,376,893	2047/6/20
第56回利付国債（30年）	0.8	1,970,000	1,921,380	2047/9/20
第57回利付国債（30年）	0.8	1,310,000	1,274,774	2047/12/20

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58回利付国債（30年）	0.8	2,580,000	2,504,870	2048/3/20
第59回利付国債（30年）	0.7	1,440,000	1,361,836	2048/6/20
第60回利付国債（30年）	0.9	1,590,000	1,573,241	2048/9/20
第61回利付国債（30年）	0.7	1,320,000	1,242,001	2048/12/20
第62回利付国債（30年）	0.5	1,370,000	1,222,409	2049/3/20
第63回利付国債（30年）	0.4	1,760,000	1,523,438	2049/6/20
第64回利付国債（30年）	0.4	1,450,000	1,252,350	2049/9/20
第65回利付国債（30年）	0.4	1,330,000	1,148,654	2049/12/20
第66回利付国債（30年）	0.4	1,160,000	1,000,743	2050/3/20
第67回利付国債（30年）	0.6	2,500,000	2,270,650	2050/6/20
第68回利付国債（30年）	0.6	1,520,000	1,379,582	2050/9/20
第69回利付国債（30年）	0.7	1,720,000	1,601,664	2050/12/20
第70回利付国債（30年）	0.7	1,910,000	1,775,727	2051/3/20
第71回利付国債（30年）	0.7	1,860,000	1,726,414	2051/6/20
第72回利付国債（30年）	0.7	1,960,000	1,816,253	2051/9/20
第73回利付国債（30年）	0.7	2,030,000	1,878,013	2051/12/20
第74回利付国債（30年）	1.0	580,000	579,333	2052/3/20
第62回利付国債（20年）	0.8	560,000	565,443	2023/6/20
第63回利付国債（20年）	1.8	617,000	629,815	2023/6/20
第64回利付国債（20年）	1.9	821,000	843,011	2023/9/20
第65回利付国債（20年）	1.9	648,000	668,515	2023/12/20
第66回利付国債（20年）	1.8	240,000	247,212	2023/12/20
第67回利付国債（20年）	1.9	80,000	82,907	2024/3/20
第68回利付国債（20年）	2.2	1,041,000	1,084,617	2024/3/20
第69回利付国債（20年）	2.1	120,000	124,804	2024/3/20
第70回利付国債（20年）	2.4	732,000	769,771	2024/6/20
第71回利付国債（20年）	2.2	360,000	377,060	2024/6/20
第72回利付国債（20年）	2.1	1,079,000	1,133,586	2024/9/20
第73回利付国債（20年）	2.0	520,000	547,736	2024/12/20
第74回利付国債（20年）	2.1	698,000	737,053	2024/12/20
第75回利付国債（20年）	2.1	705,000	748,181	2025/3/20
第76回利付国債（20年）	1.9	410,000	432,771	2025/3/20
第77回利付国債（20年）	2.0	370,000	391,604	2025/3/20
第78回利付国債（20年）	1.9	310,000	328,689	2025/6/20
第79回利付国債（20年）	2.0	150,000	159,510	2025/6/20
第80回利付国債（20年）	2.1	585,000	623,908	2025/6/20
第81回利付国債（20年）	2.0	250,000	267,092	2025/9/20
第82回利付国債（20年）	2.1	1,082,000	1,159,611	2025/9/20
第83回利付国債（20年）	2.1	395,000	425,363	2025/12/20
第84回利付国債（20年）	2.0	880,000	944,477	2025/12/20
第85回利付国債（20年）	2.1	520,000	562,494	2026/3/20
第86回利付国債（20年）	2.3	1,047,000	1,140,633	2026/3/20
第87回利付国債（20年）	2.2	420,000	455,943	2026/3/20
第88回利付国債（20年）	2.3	1,264,000	1,384,155	2026/6/20
第89回利付国債（20年）	2.2	340,000	370,926	2026/6/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第90回利付国債（20年）	2.2	1,270,000	1,392,008	2026/9/20
第91回利付国債（20年）	2.3	548,000	603,035	2026/9/20
第92回利付国債（20年）	2.1	1,282,000	1,405,982	2026/12/20
第93回利付国債（20年）	2.0	190,000	208,335	2027/3/20
第94回利付国債（20年）	2.1	875,000	963,681	2027/3/20
第95回利付国債（20年）	2.3	1,107,000	1,235,688	2027/6/20
第96回利付国債（20年）	2.1	340,000	376,057	2027/6/20
第97回利付国債（20年）	2.2	573,000	639,319	2027/9/20
第98回利付国債（20年）	2.1	610,000	677,337	2027/9/20
第99回利付国債（20年）	2.1	1,480,000	1,649,593	2027/12/20
第100回利付国債（20年）	2.2	1,030,000	1,158,533	2028/3/20
第101回利付国債（20年）	2.4	723,000	821,653	2028/3/20
第102回利付国債（20年）	2.4	520,000	593,460	2028/6/20
第103回利付国債（20年）	2.3	760,000	862,744	2028/6/20
第104回利付国債（20年）	2.1	610,000	685,054	2028/6/20
第105回利付国債（20年）	2.1	920,000	1,036,867	2028/9/20
第106回利付国債（20年）	2.2	571,000	647,142	2028/9/20
第107回利付国債（20年）	2.1	607,000	686,438	2028/12/20
第108回利付国債（20年）	1.9	1,000,000	1,117,750	2028/12/20
第109回利付国債（20年）	1.9	560,000	627,956	2029/3/20
第110回利付国債（20年）	2.1	876,000	994,207	2029/3/20
第111回利付国債（20年）	2.2	861,000	986,447	2029/6/20
第112回利付国債（20年）	2.1	1,050,000	1,195,603	2029/6/20
第113回利付国債（20年）	2.1	922,000	1,052,804	2029/9/20
第114回利付国債（20年）	2.1	1,600,000	1,832,544	2029/12/20
第115回利付国債（20年）	2.2	944,000	1,088,290	2029/12/20
第116回利付国債（20年）	2.2	461,000	533,510	2030/3/20
第117回利付国債（20年）	2.1	1,320,000	1,517,392	2030/3/20
第118回利付国債（20年）	2.0	520,000	595,119	2030/6/20
第119回利付国債（20年）	1.8	400,000	451,396	2030/6/20
第120回利付国債（20年）	1.6	780,000	867,773	2030/6/20
第121回利付国債（20年）	1.9	1,299,000	1,481,093	2030/9/20
第122回利付国債（20年）	1.8	100,000	113,196	2030/9/20
第123回利付国債（20年）	2.1	1,318,000	1,529,196	2030/12/20
第124回利付国債（20年）	2.0	1,240,000	1,428,219	2030/12/20
第125回利付国債（20年）	2.2	1,844,000	2,162,901	2031/3/20
第126回利付国債（20年）	2.0	200,000	231,112	2031/3/20
第127回利付国債（20年）	1.9	440,000	504,618	2031/3/20
第128回利付国債（20年）	1.9	1,974,000	2,269,981	2031/6/20
第129回利付国債（20年）	1.8	280,000	319,485	2031/6/20
第130回利付国債（20年）	1.8	1,862,000	2,130,723	2031/9/20
第131回利付国債（20年）	1.7	420,000	476,763	2031/9/20
第132回利付国債（20年）	1.7	187,000	212,832	2031/12/20
第133回利付国債（20年）	1.8	2,320,000	2,662,292	2031/12/20
第134回利付国債（20年）	1.8	2,455,000	2,824,943	2032/3/20

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135回利付国債（20年）	1.7	50,000	57,053	2032/3/20
第136回利付国債（20年）	1.6	190,000	214,971	2032/3/20
第137回利付国債（20年）	1.7	5,542,000	6,333,896	2032/6/20
第138回利付国債（20年）	1.5	360,000	404,344	2032/6/20
第139回利付国債（20年）	1.6	310,000	351,242	2032/6/20
第140回利付国債（20年）	1.7	2,717,000	3,108,411	2032/9/20
第141回利付国債（20年）	1.7	1,120,000	1,283,139	2032/12/20
第142回利付国債（20年）	1.8	2,170,000	2,508,411	2032/12/20
第143回利付国債（20年）	1.6	1,840,000	2,091,380	2033/3/20
第144回利付国債（20年）	1.5	940,000	1,058,543	2033/3/20
第145回利付国債（20年）	1.7	2,890,000	3,321,216	2033/6/20
第146回利付国債（20年）	1.7	2,900,000	3,336,682	2033/9/20
第147回利付国債（20年）	1.6	3,060,000	3,490,450	2033/12/20
第148回利付国債（20年）	1.5	2,210,000	2,497,786	2034/3/20
第149回利付国債（20年）	1.5	3,190,000	3,609,676	2034/6/20
第150回利付国債（20年）	1.4	2,840,000	3,181,879	2034/9/20
第151回利付国債（20年）	1.2	3,390,000	3,717,677	2034/12/20
第152回利付国債（20年）	1.2	2,840,000	3,115,792	2035/3/20
第153回利付国債（20年）	1.3	2,520,000	2,797,149	2035/6/20
第154回利付国債（20年）	1.2	3,170,000	3,478,282	2035/9/20
第155回利付国債（20年）	1.0	2,810,000	3,010,043	2035/12/20
第156回利付国債（20年）	0.4	2,910,000	2,881,627	2036/3/20
第157回利付国債（20年）	0.2	3,060,000	2,940,966	2036/6/20
第158回利付国債（20年）	0.5	2,450,000	2,451,641	2036/9/20
第159回利付国債（20年）	0.6	3,020,000	3,059,018	2036/12/20
第160回利付国債（20年）	0.7	2,790,000	2,861,200	2037/3/20
第161回利付国債（20年）	0.6	2,170,000	2,191,222	2037/6/20
第162回利付国債（20年）	0.6	3,260,000	3,285,395	2037/9/20
第163回利付国債（20年）	0.6	2,310,000	2,323,259	2037/12/20
第164回利付国債（20年）	0.5	3,190,000	3,152,932	2038/3/20
第165回利付国債（20年）	0.5	2,570,000	2,534,097	2038/6/20
第166回利付国債（20年）	0.7	3,590,000	3,643,455	2038/9/20
第167回利付国債（20年）	0.5	2,270,000	2,227,301	2038/12/20
第168回利付国債（20年）	0.4	2,720,000	2,618,707	2039/3/20
第169回利付国債（20年）	0.3	1,890,000	1,784,046	2039/6/20
第170回利付国債（20年）	0.3	1,610,000	1,515,010	2039/9/20
第171回利付国債（20年）	0.3	2,150,000	2,016,764	2039/12/20
第172回利付国債（20年）	0.4	2,660,000	2,533,357	2040/3/20
第173回利付国債（20年）	0.4	2,530,000	2,404,157	2040/6/20
第174回利付国債（20年）	0.4	3,550,000	3,363,057	2040/9/20
第175回利付国債（20年）	0.5	2,460,000	2,367,307	2040/12/20
第176回利付国債（20年）	0.5	2,860,000	2,744,170	2041/3/20
第177回利付国債（20年）	0.4	2,470,000	2,321,651	2041/6/20
第178回利付国債（20年）	0.5	3,270,000	3,126,512	2041/9/20
第179回利付国債（20年）	0.5	2,900,000	2,766,600	2041/12/20

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180回利付国債（20年）	0.8	550,000	553,789	2042/３/20
小計		536,355,000	554,662,985	
地方債証券				
第１回東京都公募公債（20年）	1.54	20,000	20,340	2023/６/20
第４回東京都公募公債（20年）	2.22	200,000	210,298	2024/９/20
第５回東京都公募公債（20年）	2.11	100,000	105,909	2025/３/19
第７回東京都公募公債（20年）	2.16	100,000	107,090	2025/９/19
第７回東京都公募公債（30年）	2.51	80,000	102,650	2038/９/17
第10回東京都公募公債（30年）	2.31	100,000	125,864	2039/９/20
第20回東京都公募公債（20年）	2.09	80,000	90,632	2029/９/20
第21回東京都公募公債（20年）	2.19	80,000	91,513	2029/12/20
第28回東京都公募公債（20年）	1.59	100,000	112,670	2033/３/18
第33回東京都公募公債（20年）	0.18	100,000	94,973	2036/６/20
第722回東京都公募公債	0.8	100,000	100,881	2023/６/20
第724回東京都公募公債	0.7	800,000	807,504	2023/９/20
第728回東京都公募公債	0.65	900,000	909,261	2023/12/20
第729回東京都公募公債	0.69	200,000	202,476	2024/３/19
第730回東京都公募公債	0.664	100,000	101,190	2024/３/19
第733回東京都公募公債	0.581	700,000	708,120	2024/６/20
第738回東京都公募公債	0.426	100,000	101,007	2024/12/20
第782回東京都公募公債	0.23	100,000	100,362	2028/６/20
第809回東京都公募公債	0.105	100,000	98,363	2030/９/20
第３回東京都公募公債（20年）	2.26	400,000	416,580	2024/３/19
平成25年度第７回北海道公募公債	0.8	150,000	151,540	2023/８/30
平成26年度第９回北海道公募公債	0.52	100,000	101,198	2024/10/31
平成26年度第13回北海道公募公債	0.461	100,000	101,118	2024/12/26
平成27年度第５回北海道公募公債	0.583	100,000	101,686	2025/６/30
第29回１号宮城県公募公債	0.68	300,000	302,946	2023/10/25
第36回２号宮城県公募公債	0.135	342,000	337,041	2030/10/28
第２回神奈川県公募公債（20年）	2.23	680,000	715,176	2024/９/20
第２回神奈川県公募公債（30年）	2.87	180,000	236,201	2036/６/20
第４回神奈川県公募公債（30年）	2.62	100,000	129,695	2038/３/19
第27回神奈川県公募公債（20年）	1.398	100,000	111,097	2034/９/20
第234回神奈川県公募公債	0.254	100,000	100,507	2028/６/20
第243回神奈川県公募公債	0.075	100,000	98,548	2029/12/20
第11回大阪府公募公債（20年）	1.693	100,000	113,945	2033/９/27
第153回大阪府公募公債（５年）	0.001	300,000	299,982	2023/８/30
第184回大阪府公募公債（５年）	0.001	120,000	119,707	2026/６/29
第375回大阪府公募公債	0.835	100,000	101,078	2023/８/29
第376回大阪府公募公債	0.82	106,000	107,182	2023/９/27
第378回大阪府公募公債	0.7	100,000	101,076	2023/11/28
第385回大阪府公募公債	0.65	200,000	202,612	2024/６/27
第388回大阪府公募公債	0.54	200,000	202,374	2024/９/27
第391回大阪府公募公債	0.513	210,000	212,631	2024/12/25
第393回大阪府公募公債	0.468	110,000	111,327	2025/２/26

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426回大阪府公募公債	0.172	100,000	100,148	2027/11/29
第435回大阪府公募公債	0.2	130,000	130,000	2028/8/30
第439回大阪府公募公債	0.193	100,000	99,824	2028/12/27
第455回大阪府公募公債	0.116	148,000	145,919	2030/4/26
第460回大阪府公募公債	0.115	194,000	190,818	2030/9/27
第464回大阪府公募公債	0.072	800,000	783,152	2031/1/28
第465回大阪府公募公債	0.12	500,000	491,025	2031/2/25
第467回大阪府公募公債	0.164	500,000	492,905	2031/4/28
第471回大阪府公募公債	0.083	497,000	485,708	2031/8/29
平成26年度第２回京都府公募公債（15年）	1.071	200,000	211,546	2029/4/27
平成26年度第５回京都府公募公債（20年）	1.455	100,000	111,728	2034/8/10
第１回兵庫県公募公債（12年）	1.1	100,000	102,259	2024/6/26
第１回兵庫県公募公債（15年）	1.66	300,000	320,166	2026/7/29
第２回兵庫県公募公債（30年）	2.36	90,000	114,241	2040/3/19
第９回兵庫県公募公債（15年）	1.02	500,000	527,480	2029/7/13
平成25年度第４回兵庫県公募公債	0.82	100,000	101,035	2023/8/18
第27回兵庫県公募公債（20年）	0.387	200,000	195,640	2036/5/12
令和３年度第８回兵庫県公募公債	0.145	100,000	98,305	2031/10/24
第６回静岡県公募公債（15年）	1.062	300,000	317,367	2029/6/25
第11回静岡県公募公債（20年）	1.841	550,000	619,657	2030/10/18
第14回静岡県公募公債（20年）	1.736	100,000	114,078	2032/6/18
平成25年度第５回静岡県公募公債	0.926	290,000	293,210	2023/7/25
平成25年度第７回静岡県公募公債	0.801	100,000	101,075	2023/9/20
平成25年度第８回静岡県公募公債	0.699	159,800	161,410	2023/10/24
平成26年度第３回静岡県公募公債	0.679	800,000	810,584	2024/5/27
令和２年度第15回静岡県公募公債（５年）	0.01	120,000	119,768	2026/3/19
令和２年度第13回静岡県公募公債（５年）	0.01	120,000	119,768	2026/3/19
令和３年度第７回静岡県公募公債	0.065	100,000	97,701	2031/6/20
平成20年度第８回愛知県公募公債（20年）	2.04	200,000	223,994	2028/12/20
平成21年度第５回愛知県公募公債（20年）	2.28	700,000	800,296	2029/6/20
平成25年度第16回愛知県公募公債	0.665	700,000	707,154	2023/11/28
平成26年度第７回愛知県公募公債	0.591	600,000	607,374	2024/7/29
平成26年度第15回愛知県公募公債	0.48	200,000	202,294	2024/12/20
平成27年度第７回愛知県公募公債	0.548	100,000	101,615	2025/7/28
平成30年度第５回愛知県公募公債	0.195	100,000	100,121	2028/6/29
平成30年度第８回愛知県公募公債	0.255	200,000	200,872	2028/8/31
平成26年度第７回広島県公募公債	0.46	260,000	263,120	2025/3/25
平成28年度第１回広島県公募公債（20年）	0.414	100,000	97,984	2036/9/26
平成30年度第４回広島県公募公債	0.259	200,000	200,760	2028/11/22
第10回埼玉県公募公債（20年）	1.94	100,000	113,586	2030/11/12
第14回埼玉県公募公債（20年）	1.546	200,000	225,442	2034/5/8
第16回埼玉県公募公債（20年）	1.216	100,000	109,037	2035/8/14
平成26年度第８回埼玉県公募公債	0.335	100,000	100,813	2025/1/28
平成30年度第４回埼玉県公募公債	0.205	100,000	100,181	2028/6/26
令和２年度第１回埼玉県公募公債	0.131	100,000	98,835	2030/4/15

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	
令和３年度第２回埼玉県公募公債（５年）	0.01	110,000	109,805	2026/４/15
平成19年度第１回福岡県公募公債（30年）	2.62	70,000	90,429	2037/９/18
平成20年度第１回福岡県公募公債（30年）	2.28	80,000	99,840	2038/９/17
平成22年度第２回福岡県公募公債（20年）	2.116	800,000	923,832	2031/２/21
平成25年度第９回福岡県公募公債	0.728	100,000	101,166	2023/12/26
平成26年度第８回福岡県公募公債	0.441	200,000	202,128	2024/12/25
平成26年度第１回福岡県公募公債	0.654	100,000	101,313	2024/６/26
平成27年度第７回福岡県公募公債	0.464	100,000	101,481	2025/12/25
令和２年度第４回福岡県公募公債	0.14	200,000	197,296	2030/９/20
第９回千葉県公募公債（20年）	1.84	80,000	90,140	2030/10/11
平成25年度第１回千葉県公募公債	0.58	82,500	82,952	2023/４/25
平成25年度第８回千葉県公募公債	0.67	100,000	101,014	2023/11/24
平成27年度第３回千葉県公募公債	0.524	200,000	202,990	2025/６/25
平成28年度第３回千葉県公募公債	0.05	400,000	399,824	2026/７/24
令和元年度第６回千葉県公募公債	0.135	100,000	98,945	2030/１/25
平成27年度第２回新潟県公募公債	0.215	100,000	100,606	2026/２/26
平成30年度第３回茨城県公募公債（５年）	0.03	150,000	150,048	2023/８/25
第２回群馬県公募公債（20年）	2.019	100,000	115,309	2031/７/18
第７回群馬県公募公債（20年）	0.313	100,000	96,778	2036/６/13
平成27年度第１回岐阜県公募公債	0.515	300,000	304,725	2025/９/30
令和２年度第２回岐阜県公募公債（５年）	0.02	100,000	99,897	2025/11/25
平成25年度第１回大分県公募公債	0.68	103,250	104,275	2023/10/31
平成27年度第１回大分県公募公債	0.476	203,400	206,406	2025/10/30
第123回共同発行市場公募地方債	0.87	700,000	706,748	2023/６/23
第124回共同発行市場公募地方債	0.91	700,000	707,623	2023/７/25
第125回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	101,049	2023/８/25
第127回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	100,975	2023/10/25
第128回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	302,997	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	200,000	202,540	2024/１/25
第131回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	101,141	2024/２/23
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	101,184	2024/３/25
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	200,000	202,590	2024/４/25
第134回共同発行市場公募地方債	0.674	250,000	253,267	2024/５/24
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	200,000	202,664	2024/６/25
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	300,000	303,801	2024/７/25
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	200,000	202,360	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	400,000	403,292	2025/１/24
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	200,000	202,486	2025/３/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	101,078	2025/４/25
第151回共同発行市場公募地方債	0.466	200,000	202,872	2025/10/24
第158回共同発行市場公募地方債	0.08	200,000	200,200	2026/５/25
第185回共同発行市場公募地方債	0.245	300,000	301,119	2028/８/25
第193回共同発行市場公募地方債	0.1	100,000	99,158	2029/４/25
平成30年度第１回福島県公募公債	0.264	100,000	100,414	2028/11/30
平成25年度第１回栃木県公募公債	0.65	100,000	101,000	2023/11/29

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	
令和元年度第２回栃木県公募公債	0.09	100,000	98,706	2029/11/29
令和２年度第２回栃木県公募公債	0.135	100,000	98,536	2030/11/27
平成24年度第２回熊本県公募公債	0.8	50,000	50,182	2022/10/26
令和３年度第１回熊本県公募公債（５年）	0.005	200,000	199,532	2026/７/30
平成25年度第１回浜松市公募公債	0.761	161,000	163,044	2024/１/24
第５回大阪市公募公債（20年）	2.47	100,000	114,363	2028/９/21
第15回大阪市公募公債（20年）	2.12	100,000	115,476	2031/１/24
平成26年度第７回大阪市公募公債	0.535	100,000	101,273	2024/11/28
令和３年度第２回大阪市公募公債	0.16	100,000	98,611	2031/５/21
第１回名古屋市公募公債（20年）	1.99	200,000	206,390	2023/12/20
第１回名古屋市公募公債（30年）	2.53	100,000	125,194	2035/３/20
第９回名古屋市公募公債（20年）	2.07	100,000	112,192	2028/12/20
第９回名古屋市公募公債（30年）	2.095	90,000	111,076	2042/９/19
第28回名古屋市公募公債（５年）	0.01	500,000	499,205	2025/12/19
第491回名古屋市公募公債	0.587	400,000	406,792	2025/６/19
第511回名古屋市公募公債	0.075	100,000	98,419	2030/３/27
第１回京都市公募公債（15年）	0.781	100,000	103,896	2030/12/20
第３回京都市公募公債（20年）	2.09	100,000	107,345	2025/12/19
第５回京都市公募公債（20年）	2.36	50,000	55,265	2026/12/18
平成18年度第３回神戸市公募公債（20年）	2.54	110,000	121,192	2026/６/19
平成20年度第24回神戸市公募公債（20年）	2.08	200,000	224,516	2028/12/20
平成22年度第４回神戸市公募公債	1.895	100,000	113,011	2030/９/13
第５回横浜市公募公債（20年）	2.17	100,000	106,612	2025/６/20
第７回横浜市公募公債（20年）	2.06	450,000	482,566	2025/12/19
平成27年度第２回横浜市公募公債	0.568	200,000	203,270	2025/６/16
平成27年度第３回横浜市公募公債	0.524	400,000	406,264	2025/８/18
平成27年度第４回横浜市公募公債	0.486	300,000	304,503	2025/10/20
第27回横浜市公募公債（20年）	1.599	100,000	112,895	2033/５/20
第33回横浜市公募公債（20年）	0.323	100,000	96,996	2036/４/28
第35回横浜市公募公債（20年）	0.443	500,000	491,475	2036/10/28
第54回横浜市公募公債（５年）	0.02	300,000	299,691	2025/11/25
平成22年度第８回札幌市公募公債（30年）	2.277	80,000	100,581	2040/９/20
平成23年度第３回札幌市公募公債	1.944	100,000	114,634	2031/７/29
令和元年度第２回札幌市公募公債（５年）	0.01	600,000	599,682	2024/６/20
令和２年度第７回札幌市公募公債	0.115	200,000	196,634	2030/12/20
令和３年度第２回札幌市公募公債（５年）	0.01	100,000	99,795	2026/６/19
第７回川崎市公募公債（20年）	2.08	100,000	113,023	2029/７/17
第12回川崎市公募公債（20年）	2.04	100,000	115,236	2031/５/30
第62回川崎市公募公債（５年）	0.005	490,000	488,853	2026/７/30
第17回北九州市公募公債（20年）	1.529	100,000	112,451	2034/６/20
平成25年度第３回北九州市公募公債	0.728	100,000	101,166	2023/12/26
平成25年度第４回福岡市公募公債	0.68	50,000	50,490	2023/10/24
平成30年度第11回福岡市公募公債（５年）	0.02	100,000	99,988	2024/３/28
平成25年度第２回広島市公募公債	0.72	100,000	101,155	2023/12/27
令和３年度第４回千葉市公募公債	0.135	100,000	98,180	2031/12/24

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
平成26年度第４回福井県公募公債	0.425	100,000	101,133	2025/４/24
令和２年度第２回徳島県公募公債	0.135	100,000	98,536	2030/11/27
平成28年度第１回山梨県公募公債	0.06	200,000	199,950	2026/10/30
平成30年度第１回山梨県公募公債	0.289	100,000	100,600	2028/10/30
令和２年度第１回山梨県公募公債	0.135	700,000	689,843	2030/10/30
第96回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	2.34	100,000	112,631	2028/12/20
小計		37,976,950	39,181,165	
特殊債券（除く金融債）				
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	126,108	2040/２/29
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	124,514	2040/５/31
第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	117,825	2040/８/31
第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	113,446	2030/９/30
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	100,000	113,969	2031/10/31
第158回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	100,000	121,419	2042/２/28
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	114,042	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	100,000	118,394	2042/５/30
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.605	340,000	342,254	2023/５/31
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	101,028	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	323,000	326,685	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	308,000	311,517	2023/９/29
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.693	208,000	210,433	2023/12/28
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.645	100,000	101,229	2024/３/29
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.669	100,000	101,334	2024/４/30
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	100,000	101,360	2024/６/28
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	125,640	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	111,151	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	883,000	893,922	2024/11/29
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.466	100,000	101,198	2024/12/27
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.45	200,000	202,534	2025/３/31
第247回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.509	133,000	135,024	2025/５/30
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.484	101,000	102,486	2025/６/30
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.557	100,000	101,747	2025/７/31
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	100,000	101,098	2026/１/30
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	200,000	200,912	2026/２/27
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	17,000	17,099	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	36,229	2023/５/16
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	100,000	101,081	2023/８/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	465,000	470,347	2023/12/18
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.645	300,000	303,639	2024/３/15
第59回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.669	315,000	319,095	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	101,391	2024/６/14
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.544	240,000	242,997	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	306,424	2025/６/13
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.381	150,000	151,909	2025/11/18
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	674,000	673,871	2026/３/13

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83回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	102,000	101,959	2026/4/17
第100回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.09	225,000	224,939	2027/9/17
第16回政府保証民間都市開発債券	0.699	90,000	90,938	2023/10/20
第232回政府保証預金保険機構債券	0.1	400,000	400,984	2024/12/10
第4回政府保証新関西国際空港債券	0.484	104,000	105,523	2025/6/13
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	20,230	2023/12/18
第26回政府保証日本政策投資銀行	0.466	100,000	101,193	2024/12/12
第6回神奈川県住宅供給公社債券	0.215	100,000	98,563	2029/4/23
第36回日本政策投資銀行債券（財投機関債）	2.23	30,000	33,195	2027/5/28
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	2.99	100,000	140,728	2045/9/20
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	2.45	140,000	152,887	2026/3/19
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	2.35	300,000	329,670	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	41,935	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	200,000	274,512	2047/3/20
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	2.28	200,000	221,446	2027/4/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	2.67	110,000	149,048	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	300,000	335,283	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	223,814	2027/10/20
第28回道路債券（財投機関債）	2.83	100,000	126,529	2033/12/20
第33回道路債券（財投機関債）	2.91	300,000	384,714	2034/6/20
第38回道路債券（財投機関債）	2.26	200,000	210,438	2024/9/20
第42回道路債券（財投機関債）	2.22	200,000	212,408	2025/3/21
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	150,000	172,306	2032/3/19
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	1.773	100,000	113,870	2032/9/17
第110回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	0.94	100,000	101,018	2023/6/20
第121回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	0.689	100,000	101,067	2023/12/20
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	100,000	111,084	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	300,000	322,158	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	121,780	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	109,337	2035/9/20
第1回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	2.266	50,000	57,017	2029/6/28
第4回公営企業債券（30年）（財投機関債）	2.95	100,000	128,443	2034/3/24
第6回公営企業債券（20年）（財投機関債）	2.03	100,000	103,223	2023/12/20
第7回公営企業債券（20年）（財投機関債）	2.2	100,000	104,023	2024/3/22
第8回公営企業債券（20年）（財投機関債）	2.25	100,000	104,115	2024/3/22
第9回公営企業債券（20年）（財投機関債）	2.33	50,000	52,698	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	100,000	112,648	2030/10/28
第12回公営企業債券（20年）（財投機関債）	2.03	300,000	317,034	2025/3/24
第13回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	2.132	100,000	115,353	2031/1/28
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	92,991	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	90,936	2031/8/28
第17回公営企業債券（20年）（財投機関債）	2.39	150,000	163,509	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	100,000	113,167	2032/7/28
第24回公営企業債券（20年）（財投機関債）	2.29	100,000	112,392	2028/4/25
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	57,173	2033/1/28

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	109,627	2035/6/28
Ｆ54回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.588	200,000	205,744	2024/3/19
第54回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	0.73	200,000	202,180	2023/11/28
第60回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	0.729	200,000	202,792	2024/5/28
第77回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	0.491	300,000	304,530	2025/10/28
Ｆ90回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.609	100,000	108,234	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	103,570	2025/3/7
Ｆ131回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.546	70,000	77,577	2031/7/30
Ｆ151回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.348	100,000	106,631	2027/11/5
Ｆ203回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.063	200,000	210,254	2028/2/28
Ｆ234回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.605	100,000	113,446	2035/4/27
第27回首都高速道路	0.06	100,000	99,949	2025/12/19
第24回阪神高速道路	0.04	200,000	199,880	2025/3/19
第10回日本政策金融公庫（財投機関債）	2.167	80,000	91,487	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫（財投機関債）	1.911	80,000	90,517	2030/10/29
第５回本州四国連絡橋債券（財投機関債）	2.23	200,000	211,304	2024/12/20
第48回福祉医療機構債券（財投機関債）	0.175	400,000	401,832	2026/12/18
第54回福祉医療機構債券（財投機関債）	0.225	100,000	100,120	2028/6/20
第４回中部国際空港（財投機関債）	0.305	200,000	201,806	2027/2/22
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	30,735	30,957	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	10,648	10,778	2037/11/10
第２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	34,647	35,354	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	10,742	10,901	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	44,913	44,731	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	47,521	47,360	2033/1/10
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	10,702	10,847	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	56,412	56,097	2033/4/10
第６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	10,622	10,779	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	11,501	11,721	2038/11/10
第８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	22,158	22,498	2042/12/10
第８回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	0.13	76,698	76,224	2034/6/10
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.19	10,194	10,264	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	12,268	12,643	2039/5/10
第10回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.15	10,511	10,632	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	23,678	24,237	2043/5/10
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	21,818	23,148	2044/10/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	10,105	10,159	2040/6/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	22,275	23,592	2044/12/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	21,982	22,213	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	22,280	23,519	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	21,558	22,788	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	41,984	44,170	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	11,097	11,255	2040/12/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	43,200	45,433	2045/6/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61	23,428	24,594	2045/7/10

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39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	32,010	32,378	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.36	45,860	47,656	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	11,443	11,678	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	30,921	31,166	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	26,600	27,990	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3	20,956	21,292	2041/7/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	102,536	108,276	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	64,125	67,436	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.92	19,240	20,223	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	39,662	41,660	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	40,352	42,305	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	42,464	44,371	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21	10,410	10,545	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	44,622	46,679	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.18	23,530	24,206	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	47,910	50,057	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	49,926	52,163	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	28,330	29,591	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	28,630	29,928	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	61,884	64,772	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	64,376	67,144	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	65,142	67,750	2047/6/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	35,803	37,198	2047/7/10
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.11	35,721	36,965	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	114,477	118,613	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	35,047	36,495	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.32	39,401	41,223	2048/7/10
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	33,841	35,171	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	32,076	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	34,855	36,030	2048/11/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	38,865	40,185	2049/2/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	41,130	42,477	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	162,300	167,386	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	83,770	86,442	2049/6/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	1.863	100,000	114,042	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	44,974	46,253	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	139,185	142,574	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	48,841	49,683	2050/1/10
第93回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	1.557	200,000	213,592	2026/12/18
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.81	60,922	62,218	2050/4/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	58,033	59,032	2050/5/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	59,540	61,086	2050/7/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	1.892	200,000	229,844	2032/4/16
第102回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	1.441	100,000	106,551	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.86	62,732	64,202	2050/12/10

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106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.54	130,872	131,362	2051/3/10
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	286,276	284,254	2051/6/10
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.19	220,035	216,175	2051/8/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	152,052	151,747	2052/2/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	530,250	529,825	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	161,475	2042/9/19
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	233,616	232,952	2052/7/10
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	114,149	2032/9/17
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	78,131	77,764	2052/10/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	79,915	79,385	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	79,103	78,704	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	161,548	161,073	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	160,284	159,455	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	80,454	79,887	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	80,383	79,843	2053/5/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	244,374	243,039	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	81,800	81,204	2053/7/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	82,992	82,644	2053/9/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	166,816	166,385	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	165,850	165,777	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	100,000	106,171	2028/10/20
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	174,786	170,959	2054/8/10
第149回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	0.704	200,000	202,472	2024/3/19
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	267,348	261,348	2054/11/10
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.26	180,278	176,827	2054/12/10
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	90,157	88,917	2055/1/10
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	93,136	92,023	2055/9/10
第161回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	0.713	100,000	103,057	2027/6/18
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	188,534	186,024	2055/11/10
第164回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	0.514	100,000	101,519	2025/8/20
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	94,657	93,427	2056/2/10
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	287,736	285,215	2056/5/10
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	193,034	191,134	2056/6/10
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	193,626	191,223	2056/7/10
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	195,006	192,020	2056/8/10
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	97,462	95,954	2056/9/10
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	193,120	2035/11/20
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	98,602	97,544	2056/12/10
第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	197,794	194,898	2057/1/10
第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	198,310	196,743	2057/2/10
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	99,349	99,357	2057/3/10
第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	199,598	199,168	2057/4/10
第180回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	100,000	100,102	2057/5/10
第194回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	0.075	100,000	99,996	2026/10/20
第203回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	0.24	100,000	100,748	2027/3/19

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231回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	0.06	100,000	100,044	2023/6/20
第６回沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）	2.04	50,000	53,096	2025/6/20
第７回国際協力機構債券（財投機関債）	1.991	70,000	80,223	2031/6/13
第83回東日本高速道路	0.05	400,000	399,264	2026/6/19
第78回中日本高速道路	0.06	300,000	300,057	2024/5/29
第29回西日本高速道路	0.31	200,000	201,762	2026/2/12
第56回西日本高速道路	0.06	900,000	899,874	2025/9/19
第61回西日本高速道路	0.04	400,000	399,100	2026/6/19
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	100,000	104,539	2029/11/27
小計		29,228,207	30,455,697	
金融債券				
い第832号商工債券	0.06	100,000	99,905	2024/9/27
い第843号商工債券	0.12	200,000	199,972	2025/8/27
い第848号商工債券	0.1	100,000	99,872	2026/1/27
い第850号商工債券	0.1	300,000	299,421	2026/3/27
い第852号商工債券	0.09	100,000	99,759	2026/5/27
い第854号商工債券	0.08	400,000	398,736	2026/7/27
い第857号商工債券	0.09	100,000	99,665	2026/10/27
い第818号農林債券	0.08	200,000	200,108	2023/7/27
第376回信金中金債	0.05	100,000	99,768	2026/3/27
第11号商工債券（10年）	0.66	300,000	303,987	2024/9/20
第256号商工債券（３年）	0.04	300,000	299,691	2024/5/27
第257号商工債券（３年）	0.04	200,000	199,766	2024/6/27
第２回信金中金債（10年）	0.52	100,000	101,416	2025/9/26
小計		2,500,000	2,502,066	
普通社債券				
第548回東京電力	2.347	100,000	109,427	2028/9/29
第567回東京電力	1.958	100,000	107,594	2030/7/29
第499回中部電力	1.194	100,000	101,195	2023/6/23
第508回関西電力	0.455	200,000	200,892	2027/4/23
第510回関西電力	0.49	500,000	502,930	2027/7/23
第511回関西電力	0.41	100,000	100,131	2027/9/17
第518回関西電力	0.44	200,000	200,060	2028/6/20
第524回関西電力	0.514	200,000	200,740	2028/10/25
第532回関西電力	0.18	100,000	99,999	2024/7/25
第543回関西電力	0.001	200,000	199,100	2024/10/25
第381回中国電力	0.953	100,000	101,572	2024/4/25
第385回中国電力	0.728	100,000	101,699	2025/7/25
第393回中国電力	0.26	100,000	99,797	2026/11/25
第400回中国電力	0.34	200,000	199,894	2027/9/24
第409回中国電力	0.4	200,000	199,876	2028/9/25
第304回北陸電力	0.989	100,000	101,239	2023/10/25
第307回北陸電力	1.055	100,000	103,282	2026/6/25
第322回北陸電力	0.38	100,000	100,176	2027/6/25
第485回東北電力	0.25	100,000	99,977	2026/7/24

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494回東北電力	0.425	200,000	200,602	2027/6/25
第529回東北電力	0.07	500,000	496,575	2026/4/24
第449回九州電力	0.43	300,000	301,341	2027/4/23
第468回九州電力	0.435	100,000	99,939	2028/8/25
第471回九州電力	0.455	300,000	299,907	2028/11/24
第484回九州電力	0.375	400,000	395,660	2029/11/22
第493回九州電力	0.1	400,000	397,760	2026/5/25
第29回沖縄電力	0.001	200,000	199,558	2024/6/25
第12回新関西国際空港	1.067	100,000	105,596	2029/9/20
第27回新関西国際空港	0.05	100,000	99,846	2026/3/19
第32回成田国際空港	0.22	100,000	99,802	2029/1/29
第１回国際石油開発帝石	0.08	100,000	99,776	2026/3/16
第21回大和ハウス工業	0.001	300,000	299,658	2023/9/15
第10回明治ホールディングス（サステナビリティ）	0.05	200,000	198,800	2026/4/23
第16回アサヒグループホールディングス	0.08	100,000	99,549	2026/3/13
第５回サントリー食品インターナショナル	0.001	200,000	199,328	2024/7/8
第22回味の素	0.305	100,000	100,454	2026/3/2
第３回　キユーピー	0.23	100,000	99,856	2026/2/13
第13回日本たばこ産業	0.355	200,000	199,384	2028/9/8
第６回ヒューリック	0.494	400,000	399,068	2028/10/20
第４回トヨタ紡織	0.21	200,000	199,708	2024/12/20
第９回クラレ	0.34	100,000	100,256	2027/4/30
第16回旭化成	0.001	200,000	199,492	2024/12/9
第42回王子ホールディングス	0.08	300,000	298,809	2026/3/24
第11回イビデン	0.001	200,000	199,484	2024/9/9
第４回野村総合研究所	0.34	100,000	100,047	2028/3/23
第６回花王	0.13	200,000	199,702	2025/9/19
第19回オリエンタルランド	0.001	300,000	299,301	2024/9/2
第６回ヤフー	0.35	100,000	99,945	2024/12/6
第12回ヤフー	0.37	200,000	198,820	2026/7/31
第19回Ｚホールディングス	0.35	400,000	397,312	2026/7/28
第５回荒川化学工業（サステナビリティ）	0.18	100,000	99,606	2026/11/26
第11回ブリヂストン	0.295	300,000	299,961	2027/4/21
第12回日本電気硝子	0.26	100,000	99,366	2028/2/25
第４回新日本製鐵	0.375	200,000	200,122	2027/5/20
第19回日立製作所	0.16	100,000	99,380	2027/3/12
第22回パナソニック	0.29	100,000	99,384	2027/12/24
第18回デンソー	0.315	300,000	299,226	2028/3/17
第18回ＪＡ三井リース	0.16	100,000	99,494	2026/3/12
第10回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	0.03	100,000	99,498	2024/10/21
第26回トヨタ自動車（サステナビリティ）	0.05	800,000	797,848	2026/3/18
第１回明治安田生命2018基金	0.315	200,000	199,958	2023/9/25
第１回明治安田生命2019基金	0.29	200,000	199,726	2024/8/2
第63回三井物産	2.37	400,000	441,048	2027/4/23
第51回住友商事	1.241	100,000	105,178	2029/4/23

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券	%	千円	千円	
第１回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	0.94	100,000	101,228	2024/６/26
第３回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	0.724	300,000	302,529	2025/３/５
第17回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	0.535	500,000	497,910	2028/５/31
第23回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	2.91	200,000	232,026	2029/10/16
第26回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	1.95	200,000	210,282	2025/11/12
第29回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	2.16	200,000	212,312	2026/１/20
第30回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	2.46	100,000	113,946	2031/１/20
第88回三菱東京ＵＦＪ銀行	2.34	100,000	110,394	2027/４/20
第15回みずほフィナンシャルグループ劣後特約付	0.545	100,000	98,856	2028/６/12
第18回みずほ銀行（劣後特約付）	2.14	100,000	106,469	2026/９/11
第28回芙蓉総合リース	0.14	500,000	496,920	2026/４/21
第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.18	1,200,000	1,200,468	2025/12/19
第17回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.28	300,000	299,883	2027/12/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）	0.001	600,000	598,224	2024/10/28
第34回東京センチュリー	0.22	300,000	295,461	2028/７/21
第65回ホンダファイナンス	0.16	300,000	299,853	2025/９/19
第70回ホンダファイナンス	0.001	200,000	199,550	2024/９/19
第72回ホンダファイナンス	0.03	400,000	399,104	2024/12/19
第95回トヨタファイナンス	0.001	500,000	499,185	2024/４/15
第96回トヨタファイナンス	0.06	800,000	797,808	2026/４/15
第97回トヨタファイナンス	0.001	200,000	199,566	2024/７/22
第31回リコーリース	0.3	100,000	100,239	2025/１/23
第41回リコーリース	0.14	500,000	497,310	2026/４/17
第79回アコム	0.29	300,000	300,117	2025/２/28
第80回アコム	0.28	200,000	199,674	2026/２/26
第81回アコム	0.17	100,000	99,223	2026/９/３
第87回日立キャピタル	0.06	300,000	299,676	2024/１/19
第201回オリックス	0.07	500,000	496,230	2026/４/21
第21回三井住友ファイナンス＆リース	0.18	300,000	300,300	2023/11/27
第30回三井住友ファイナンス＆リース	0.01	200,000	199,748	2023/８/10
第１回三菱ＨＣキャピタル	0.05	900,000	896,877	2024/11/29
第69回三菱ＵＦＪリース	0.24	500,000	499,320	2026/７/10
第24回野村ホールディングス	2.329	100,000	106,102	2025/６/24
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	105,835	2025/９/24
第137回三菱地所	0.05	300,000	300,072	2025/２/７
第12回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.61	100,000	101,148	2024/９/20
第13回森トラスト総合リート投資法人	0.17	200,000	199,720	2024/２/22
第36回京王電鉄	0.325	200,000	200,292	2027/９/17
第34回東日本旅客鉄道	2.53	100,000	105,097	2024/６/20
第53回東日本旅客鉄道	2.35	300,000	336,681	2028/４/21
第100回東日本旅客鉄道	1.981	200,000	238,410	2044/１/29
第102回東日本旅客鉄道	0.63	100,000	101,142	2024/７/25
第163回東日本旅客鉄道	0.05	600,000	597,072	2026/４/15
第174回東日本旅客鉄道	0.001	700,000	697,935	2024/12/17
第73回西日本旅客鉄道	0.05	400,000	398,040	2026/４/22

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42回東海旅客鉄道	2.312	100,000	113,439	2029/4/24
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	111,367	2030/10/25
第83回東海旅客鉄道	0.001	400,000	399,516	2023/9/19
第２回東京地下鉄	2.36	500,000	523,700	2024/6/20
第28回東京地下鉄	0.25	300,000	299,466	2028/5/24
第50回阪急阪神ホールディングス	0.345	200,000	199,610	2028/9/13
第58回阪急阪神ホールディングス	0.09	200,000	199,182	2026/2/26
第64回名古屋鉄道	0.09	200,000	198,864	2026/3/23
第８回ニッコンホールディングス	0.23	100,000	99,820	2024/9/18
第１回横浜高速鉄道	0.62	300,000	303,501	2026/2/25
第９回九州旅客鉄道	0.001	200,000	199,612	2024/12/9
第９回ソフトバンク	0.48	300,000	298,512	2027/12/3
第16回ソフトバンク	0.52	300,000	291,765	2031/10/10
第50回電源開発	0.415	200,000	201,148	2027/7/20
第57回電源開発	0.355	100,000	99,509	2028/7/20
第59回電源開発	0.414	300,000	299,400	2028/9/20
第64回電源開発	0.405	600,000	596,940	2029/4/20
第67回電源開発	0.24	200,000	196,092	2029/9/20
第６回東京電力パワーグリッド	0.85	100,000	101,299	2027/8/31
第13回東京電力パワーグリッド	0.77	300,000	301,596	2028/4/19
第15回東京電力パワーグリッド	0.89	100,000	100,000	2030/7/24
第16回東京電力パワーグリッド	0.57	200,000	200,922	2025/9/12
第25回東京電力パワーグリッド	1.02	100,000	101,609	2029/4/24
第28回東京電力パワーグリッド	1.01	400,000	405,668	2029/7/10
第31回東京電力パワーグリッド	0.98	300,000	303,129	2029/10/9
第33回東京電力パワーグリッド	0.68	200,000	201,260	2027/1/27
第35回東京電力パワーグリッド	1.2	100,000	102,451	2030/4/23
第38回東京電力パワーグリッド	0.58	400,000	402,004	2025/7/16
第39回東京電力パワーグリッド	1.08	400,000	406,100	2030/7/16
第41回東京電力パワーグリッド	0.64	100,000	100,526	2026/10/8
第44回東京電力パワーグリッド	0.4	200,000	199,356	2026/4/22
第47回東京電力パワーグリッド	0.68	200,000	195,730	2031/8/29
第49回東京電力パワーグリッド	0.6	200,000	200,264	2027/4/26
第１回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）	0.18	200,000	199,298	2024/9/9
第13回広島ガス	0.405	200,000	199,122	2028/9/13
第７回ファーストリテイリング	0.405	100,000	100,347	2028/6/6
第19回フランス相互信用連合銀行	0.999	100,000	101,844	2025/10/15
第26回フランス相互信用連合銀行	0.443	100,000	100,201	2023/10/12
第29回フランス相互信用連合銀行	0.25	200,000	199,172	2024/10/10
第35回フランス相互信用連合銀行	0.279	500,000	494,090	2026/10/21
第６回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	1.258	200,000	202,646	2024/1/25
第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.217	200,000	199,912	2023/1/25
第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.302	100,000	98,391	2026/12/16
第１回サンタンデール銀行（2019）	0.463	500,000	498,485	2024/12/5

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17回ナショナル・オーストラリア銀行	0.44	100,000	100,100	2024/1/23
小計		37,600,000	37,849,909	
合計		643,660,157	664,651,823	

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 597	百万円 －

○投資信託財産の構成

（2022年５月12日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	664,651,823	99.4
コール・ローン等、その他	3,796,001	0.6
投資信託財産総額	668,447,824	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年５月12日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	668,447,824,593
コール・ローン等	1,826,580,669
公社債(評価額)	664,651,823,785
未収入金	774,297,500
未収利息	1,135,810,623
前払費用	51,352,016
差入委託証拠金	7,960,000
(B) 負債	1,693,617,081
未払金	4,964,400
未払解約金	1,688,652,428
未払利息	253
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	666,754,207,512
元本	505,301,120,122
次期繰越損益金	161,453,087,390
(D) 受益権総口数	505,301,120,122口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	13,195円

＜注記事項＞

①期首元本額　233,376,402,849円
　期中追加設定元本額　338,061,364,572円
　期中一部解約元本額　66,136,647,299円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.3195円です。

○損益の状況 (2021年５月13日～2022年５月12日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	3,558,039,908
受取利息	3,558,563,677
支払利息	△ 523,769
(B) 有価証券売買損益	△ 17,217,267,011
売買益	88,364,927
売買損	△ 17,305,631,938
(C) 先物取引等取引損益	△ 5,624,700
取引益	7,910,500
取引損	△ 13,535,200
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	△ 13,664,851,803
(E) 前期繰越損益金	80,795,488,319
(F) 追加信託差損益金	116,667,524,390
(G) 解約差損益金	△ 22,345,073,516
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	161,453,087,390
次期繰越損益金(Ｈ)	161,453,087,390

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

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

ＭＵＡＭ 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	132,821,900,949円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	80,608,730,907円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	49,039,170,647円
三菱ＵＦＪ 国内債券インデックスファンド（確定拠出年金）	37,303,791,268円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	22,488,923,721円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	12,587,972,410円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 国内債券インデックス	12,181,739,242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）	11,975,398,538円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	11,448,244,609円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,053,277,239円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	8,123,809,275円
三菱ＵＦＪ 日本債券ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	7,846,043,338円
ｅＭＡＸＩＳ 国内債券インデックス	6,744,612,215円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	6,405,791,117円
つみたて８資産均等バランス	5,712,464,887円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	4,692,511,185円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	4,602,602,433円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,419,966,792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）	4,300,357,035円
国内債券セレクション（ラップ向け）	4,297,241,132円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞日本債券インデックスファンド	4,267,658,124円
ラップ向けインデックスｆ 国内債券	4,199,720,600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）	4,129,355,212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）	4,058,372,038円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	3,468,061,838円
国内債券インデックスファンド（ラップ向け）	3,243,481,473円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式15）	3,014,921,473円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,899,656,932円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式40）	2,687,965,605円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	2,413,154,659円
三菱ＵＦＪ 国内債券インデックスファンド	2,240,064,768円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	2,109,627,765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）	2,012,122,340円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	1,927,858,584円
つみたて４資産均等バランス	1,825,124,141円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	1,815,785,887円
ＭＵＦＧ ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）	1,666,793,821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）	1,540,080,866円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	1,535,428,719円
ＭＵＦＧ ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）	1,449,641,249円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	1,383,210,986円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式65）	1,223,727,192円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	905,977,226円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	875,561,368円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	788,469,826円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式25）	732,480,950円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	708,480,827円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	701,866,500円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	481,939,883円
ＭＵＫＡＭ アセットアロケーションファンド2022-03（適格機関投資家限定）	470,894,297円
ＭＵＫＡＭ アセットアロケーションファンド2022-01（適格機関投資家限定）	465,944,536円
ＭＵＫＡＭ アセットアロケーションファンド2021-03（適格機関投資家限定）	464,649,283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）	464,386,656円
ＭＵＫＡＭ アセットアロケーションファンド2021-05（適格機関投資家限定）	464,386,656円
ＭＵＫＡＭ アセットアロケーションファンド2021-11（適格機関投資家限定）	464,041,874円
ＭＵＫＡＭ アセットアロケーションファンド2021-09（適格機関投資家限定）	459,282,676円
ＭＵＫＡＭ アセットアロケーションファンド2021-07（適格機関投資家限定）	459,088,162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）	436,099,602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）	432,299,569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）	426,375,402円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	390,689,148円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	257,816,621円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	233,069,692円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	212,736,610円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	194,552,846円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	193,760,387円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	158,782,787円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	105,076,539円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	89,536,855円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	80,245,393円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）	74,780,973円
ｅＭＡＸＩＳ 債券バランス（２資産均等型）	69,278,086円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	56,243,620円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	42,139,087円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	28,604,113円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	27,674,720円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	27,349,665円

三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	16,917,380円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	16,879,532円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,163,581円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	10,389,033円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	8,375,940円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	8,235,518円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	6,815,181円
マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）	3,352,099円
コアバランス	2,330,848円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	2,196,883円
ＭＵＦＧ ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）	2,007,378円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式80）	226,600円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	175,041円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）ＶＡ（適格機関投資家限定）	129,462円
合計	505,301,120,122円

852230

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／国内／債券／インデックス型
信託期間	2026年２月20日まで（2016年３月25日設定）
運用方針	主としてわが国の物価連動国債に投資を行い、NOMURA 物価連動国債インデックス（フロアあり）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 物価連動国債の組入比率は高位を維持することを基本とします。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し債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	わが国の物価連動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は行いません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告に係わる情報

国内物価連動国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）

第６期（決算日：2022年２月24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「国内物価連動国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）」は、去る２月24日に第６期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG
三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先
お客さま専用フリーダイヤル　０１２０－１５１０３４
（受付時間：営業日の9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～１月３日を除く）
お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA 物価連動国債インデックス（フロアあり）		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2期(2018年2月23日)	10,088	0	0.7	103.92	0.8	99.5	－	14,881
3期(2019年2月25日)	9,943	0	△1.4	102.63	△1.2	99.7	－	14,231
4期(2020年2月25日)	9,859	0	△0.8	101.98	△0.6	99.8	－	14,458
5期(2021年2月24日)	9,620	0	△2.4	100.06	△1.9	99.7	－	14,346
6期(2022年2月24日)	9,910	0	3.0	103.41	3.3	99.8	－	13,619

（注）NOMURA 物価連動国債インデックス（フロアあり）とは、野村證券株式会社が発表している日本国が発行したフロアありの物価連動国債のパフォーマンスインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		NOMURA 物価連動国債インデックス（フロアあり）		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
（期　首） 2021年２月24日	9,620	－	100.06	－	99.7	－
２月末	9,601	△0.2	99.84	△0.2	99.9	－
３月末	9,634	0.1	100.30	0.2	100.0	－
４月末	9,655	0.4	100.56	0.5	99.8	－
５月末	9,774	1.6	101.67	1.6	99.9	－
６月末	9,774	1.6	101.78	1.7	99.9	－
７月末	9,764	1.5	101.77	1.7	99.9	－
８月末	9,782	1.7	101.93	1.9	99.8	－
９月末	9,831	2.2	102.45	2.4	99.7	－
10月末	9,880	2.7	102.96	2.9	99.6	－
11月末	9,877	2.7	102.95	2.9	99.7	－
12月末	9,918	3.1	103.52	3.5	99.5	－
2022年１月末	9,906	3.0	103.24	3.2	99.8	－
（期　末） 2022年２月24日	9,910	3.0	103.41	3.3	99.8	－

（注）騰落率は期首比。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

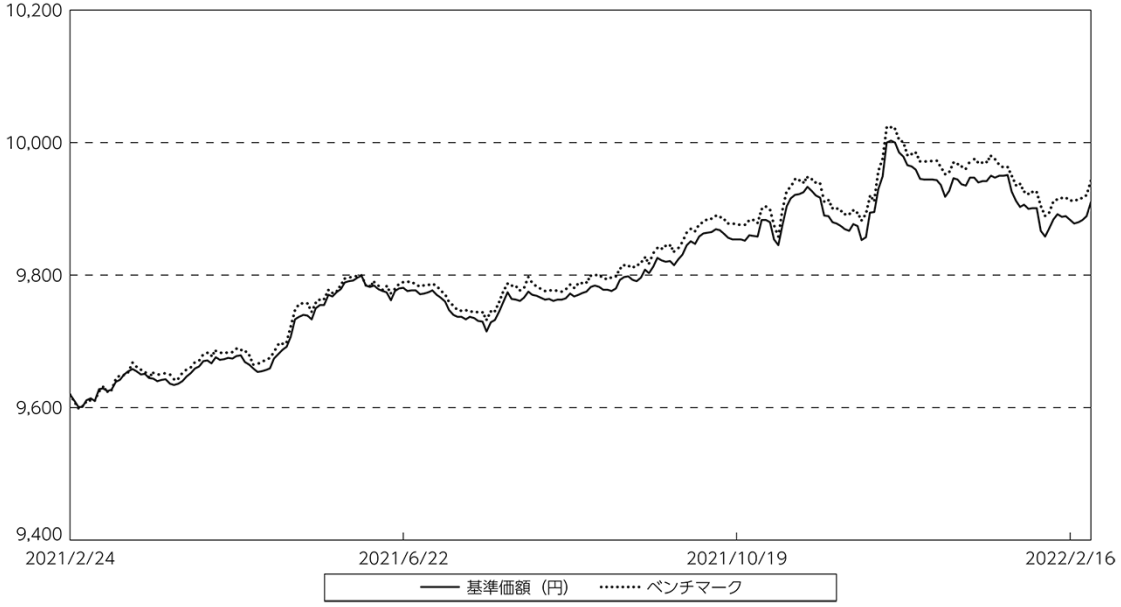
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ3.0%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（3.3%）を0.3%下回りました。

基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因

（上昇要因）

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

●投資環境について

◎物価連動国債市況

物価連動国債市況は上昇しました。

・物価連動国債市況は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に伴う供給不足や資源価格高騰などを背景に期待インフレ率が高まったことから上昇しました。

●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。

・ベンチマーク採用全銘柄に投資することで、指数を模倣しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは3.3%の上昇になったため、カイ離は△0.3%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

・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）

・信託報酬要因によるものです。

●分配金について

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

【分配原資の内訳】

（単位：円、１万口当たり、税込み）

項　　目	第６期 2021年２月25日～ 2022年２月24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	245

（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

・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

（2021年２月25日～2022年２月24日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	23	0.236	(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）	(19)	(0.192)	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）	(1)	(0.011)	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）	(3)	(0.033)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	0	0.003	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.003)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合計	23	0.239	
期中の平均基準価額は、9,798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）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

（2021年２月25日～2022年２月24日）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	2,549,558	3,701,175

（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

（2021年２月25日～2022年２月24日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	2,549	1,229	48.2	3,701	1,330	35.9

（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・スタンレー証券です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2021年２月25日～2022年２月24日）

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
350	－	－	350	当初設定時における取得

○組入資産の明細

（2022年２月24日現在）

国内公社債

（A）国内（邦貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					５年以上	２年以上	２年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	12,902,000	13,597,622	99.8	－	50.6	44.0	5.2
	(12,902,000)	(13,597,622)	(99.8)	(－)	(50.6)	(44.0)	(5.2)
合計	12,902,000	13,597,622	99.8	－	50.6	44.0	5.2
	(12,902,000)	(13,597,622)	(99.8)	(－)	(50.6)	(44.0)	(5.2)

（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17回利付国債（物価連動・10年）	0.1	656,000	702,461	2023/９/10
第18回利付国債（物価連動・10年）	0.1	790,000	844,041	2024/３/10
第19回利付国債（物価連動・10年）	0.1	1,112,000	1,159,194	2024/９/10
第20回利付国債（物価連動・10年）	0.1	2,096,000	2,184,947	2025/３/10
第21回利付国債（物価連動・10年）	0.1	1,725,000	1,809,136	2026/３/10
第22回利付国債（物価連動・10年）	0.1	1,753,000	1,869,892	2027/３/10
第23回利付国債（物価連動・10年）	0.1	1,730,000	1,820,956	2028/３/10
第24回利付国債（物価連動・10年）	0.1	1,620,000	1,697,487	2029/３/10
第25回利付国債（物価連動・10年）	0.2	800,000	855,721	2030/３/10
第26回利付国債（物価連動・10年）	0.005	620,000	653,783	2031/３/10
合計		12,902,000	13,597,622	

○投資信託財産の構成

（2022年２月24日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	13,597,622	99.7
コール・ローン等、その他	38,231	0.3
投資信託財産総額	13,635,853	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 （2022年２月24日現在）

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	13,635,853,943
コール・ローン等	32,112,760
公社債(評価額)	13,597,622,656
未収利息	5,801,857
前払費用	316,670
(B) 負債	16,745,777
未払信託報酬	16,545,741
未払利息	12
その他未払費用	200,024
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	13,619,108,166
元本	13,742,937,614
次期繰越損益金	△ 123,829,448
(D) 受益権総口数	13,742,937,614口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	9,910円

＜注記事項＞
①期首元本額　14,912,570,965円
　期中追加設定元本額　2,270,650,048円
　期中一部解約元本額　3,440,283,399円
　また、１口当たり純資産額は、期末0.9910円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は123,829,448円です。
③分配金の計算過程

項　　目	2021年２月25日～2022年２月24日
費用控除後の配当等収益額	11,924,329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	170,858,859円
収益調整金額	131,569,623円
分配準備積立金額	22,682,991円
当ファンドの分配対象収益額	337,035,802円
１万口当たり収益分配対象額	245円
１万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況 （2021年２月25日～2022年２月24日）

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	13,074,139
受取利息	13,086,578
支払利息	△ 12,439
(B) 有価証券売買損益	369,141,964
売買益	436,954,423
売買損	△ 67,812,459
(C) 信託報酬等	△ 33,620,188
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	348,595,915
(E) 前期繰越損益金	△143,129,736
(F) 追加信託差損益金	△329,295,627
(配当等相当額)	(131,569,623)
(売買損益相当額)	(△460,865,250)
(G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	△123,829,448
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ)	△123,829,448
追加信託差損益金	△329,295,627
(配当等相当額)	(131,569,623)
(売買損益相当額)	(△460,865,250)
分配準備積立金	205,466,179

(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。

852300

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／国内／債券／インデックス型	
信託期間	2026年５月12日まで（2016年４月11日設定）	
運用方針	日本超長期国債インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の国債に投資を行い、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ国債 超長期（11-）に連動する投資成果をめざして運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し債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	ベビーファンド	日本超長期国債インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	わが国の国債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告に係わる情報

ＭＵＫＡＭ
日本超長期国債インデックスファンド
（適格機関投資家限定）

第６期（決算日：2022年５月12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「ＭＵＫＡＭ 日本超長期国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）」は、去る５月12日に第６期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG
三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先
お客さま専用フリーダイヤル　０１２０－１５１０３４
（受付時間：営業日の9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～１月３日を除く）
お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額			ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ国債 超長期（11-）		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2期(2018年5月14日)	9,734	0	2.2	267.44	2.4	100.3	－	98,649
3期(2019年5月13日)	10,108	0	3.8	278.19	4.0	99.5	－	105,329
4期(2020年5月12日)	10,198	0	0.9	280.92	1.0	99.6	－	105,321
5期(2021年5月12日)	10,055	0	△1.4	277.41	△1.2	99.7	－	129,597
6期(2022年5月12日)	9,565	0	△4.9	264.34	△4.7	99.6	－	136,965

（注）ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ国債 超長期（11-）とは、野村證券株式会社が発表している日本国が発行した固定利付債（個人向けは対象外）の残存期間11年以上の債券のパフォーマンスインデックスで、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ国債のサブインデックスです。
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）当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
（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		ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ国債　超長期（１１－）		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
（期　首）	円	%		%	%	%
2021年５月12日	10,055	－	277.41	－	99.7	－
５月末	10,027	△0.3	276.67	△0.3	99.5	－
６月末	10,027	△0.3	276.81	△0.2	99.6	－
７月末	10,137	0.8	279.86	0.9	99.5	－
８月末	10,120	0.6	279.31	0.7	99.5	－
９月末	10,054	△0.0	277.55	0.1	99.8	－
10月末	10,032	△0.2	276.98	△0.2	99.7	－
11月末	10,066	0.1	277.97	0.2	99.7	－
12月末	10,022	△0.3	276.87	△0.2	99.7	－
2022年１月末	9,873	△1.8	272.74	△1.7	99.6	－
２月末	9,744	△3.1	269.19	△3.0	99.5	－
３月末	9,691	△3.6	267.72	△3.5	99.7	－
４月末	9,615	△4.4	265.70	△4.2	99.7	－
（期　末）						
2022年５月12日	9,565	△4.9	264.34	△4.7	99.6	－

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

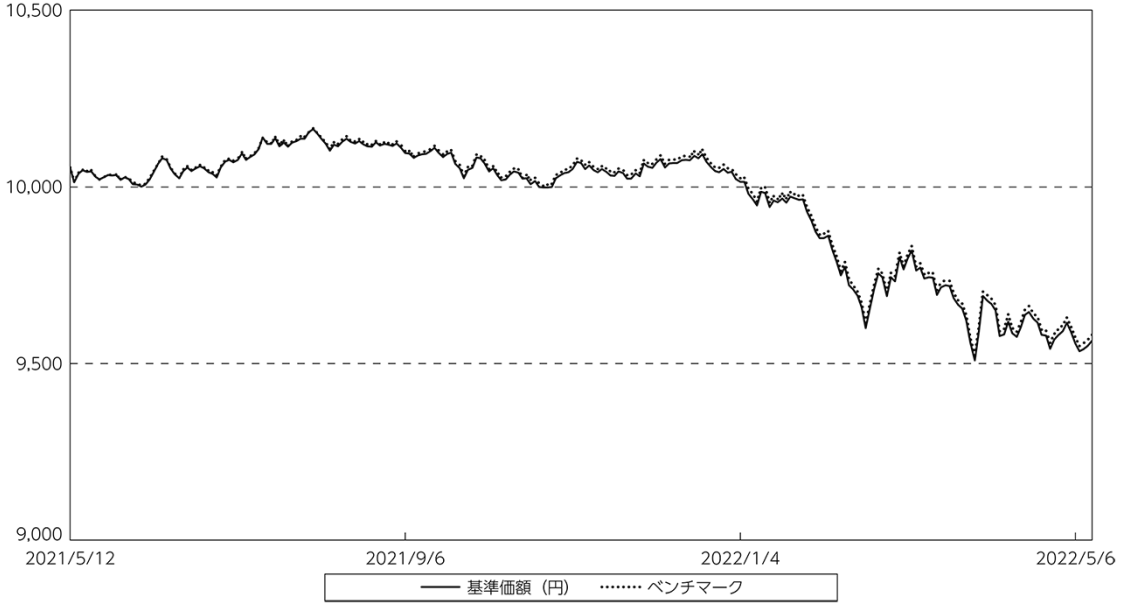
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.9%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（－4.7%）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
◎国内超長期国債市況
　国内債券市況は下落しました。
・国内債券市況は期の前半から2021年年末にかけてはもみ合いで推移しました。その後、インフレ懸念や利上げ観測の高まりによる米金利の上昇などから国内債券市況は下落しました。期の終わりにかけてはウクライナ情勢緊迫化による上昇局面があったものの、米国の利上げへの積極的な姿勢などを受けて国内債券市況は反落し、期を通して見ても下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて
＜ＭＵＫＡＭ 日本超長期国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞
・資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

＜日本超長期国債インデックスマザーファンド＞
・資産のほぼ全額を国債（先物を含む）に投資し、高い国債組入比率を維持しました。
・ベンチマークであるＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ国債超長期（11-）の構成銘柄を年限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
＜ＭＵＫＡＭ 日本超長期国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞
　ベンチマークとのカイ離は△0.2%程度となりました。

◎マザーファンド保有以外の要因
　ファンドの管理コスト等による影響は△0.2%程度でした。

◎マザーファンド保有による要因
　マザーファンド保有による影響は△0.0%程度でした。

　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が異なるため生じる要因です。

●分配金について

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

【分配原資の内訳】

（単位：円、１万口当たり、税込み）

項　　目	第６期 2021年５月13日～ 2022年５月12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	661

（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

＜ＭＵＫＡＭ 日本超長期国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞

・マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

＜日本超長期国債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。

○１万口当たりの費用明細

（2021年５月13日～2022年５月12日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	15	0.154	(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）	(9)	(0.088)	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）	(3)	(0.033)	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）	(3)	(0.033)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	0	0.001	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.001)	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
合計	15	0.155	
期中の平均基準価額は、9,952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）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。

○売買及び取引の状況

（2021年５月13日～2022年５月12日）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定 口数	設定 金額	解約 口数	解約 金額
	千口	千円	千口	千円
日本超長期国債インデックスマザーファンド	17,834,645	18,017,495	3,860,139	3,889,378

○利害関係人との取引状況等

（2021年５月13日～2022年５月12日）

利害関係人との取引状況

＜ＭＵＫＡＭ 日本超長期国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞

該当事項はございません。

＜日本超長期国債インデックスマザーファンド＞

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	41,843	9,921	23.7	20,924	5,651	27.0

平均保有割合　93.3%

※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。
（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・スタンレー証券です。

○組入資産の明細

（2022年５月12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
日本超長期国債インデックスマザーファンド	127,875,422	141,849,927	136,956,105

○投資信託財産の構成

（2022年５月12日現在）

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
日本超長期国債インデックスマザーファンド	136,956,105	99.9
コール・ローン等、その他	116,660	0.1
投資信託財産総額	137,072,765	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 （2022年５月12日現在）

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	137,072,765,958
コール・ローン等	113,089,590
日本超長期国債インデックスマザーファンド(評価額)	136,956,105,257
未収入金	3,571,111
(B) 負債	107,417,586
未払信託報酬	106,429,359
未払利息	15
その他未払費用	988,212
(C) 純資産総額（Ａ－Ｂ）	136,965,348,372
元本	143,195,917,921
次期繰越損益金	△ 6,230,569,549
(D) 受益権総口数	143,195,917,921口
１万口当たり基準価額（Ｃ／Ｄ）	9,565円

＜注記事項＞
①期首元本額　128,888,839,421円
　期中追加設定元本額　18,014,423,180円
　期中一部解約元本額　3,707,344,680円
　また、１口当たり純資産額は、期末0.9565円です。

○損益の状況 （2021年５月13日～2022年５月12日）

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	△ 10,260
受取利息	160
支払利息	△ 10,420
(B) 有価証券売買損益	△ 6,737,482,600
売買益	44,326,421
売買損	△ 6,781,809,021
(C) 信託報酬等	△ 211,707,018
(D) 当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	△ 6,949,199,878
(E) 前期繰越損益金	1,883,915,268
(F) 追加信託差損益金	△ 1,165,284,939
（配当等相当額）	(3,472,620,203)
（売買損益相当額）	(△ 4,637,905,142)
(G) 計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	△ 6,230,569,549
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）	△ 6,230,569,549
追加信託差損益金	△ 1,165,284,939
（配当等相当額）	(3,485,620,299)
（売買損益相当額）	(△ 4,650,905,238)
分配準備積立金	5,984,541,320
繰越損益金	△11,049,825,930

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

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は6,230,569,549円です。
③分配金の計算過程

項　　目	2021年５月13日～2022年５月12日
費用控除後の配当等収益額	1,176,467,339円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	3,485,620,299円
分配準備積立金額	4,808,073,981円
当ファンドの分配対象収益額	9,470,161,619円
１万口当たり収益分配対象額	661円
１万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

日本超長期国債インデックスマザーファンド

《第６期》決算日2022年５月12日

［計算期間：2021年５月13日～2022年５月12日］

「日本超長期国債インデックスマザーファンド」は、５月12日に第６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６期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主としてわが国の国債に投資を行い、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ国債 超長期（11-）に連動する投資成果をめざして運用を行います。国債の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し債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	わが国の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は行いません。

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ国債 超長期（11-）		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
2期(2018年5月14日)	9,765	2.4	267.44	2.4	100.3	－	99,360
3期(2019年5月13日)	10,156	4.0	278.19	4.0	99.6	－	107,167
4期(2020年5月12日)	10,262	1.0	280.92	1.0	99.6	－	105,311
5期(2021年5月12日)	10,134	△1.2	277.41	△1.2	99.7	－	133,560
6期(2022年5月12日)	9,655	△4.7	264.34	△4.7	99.6	－	145,964

(注) ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ国債 超長期（11-）とは、野村證券株式会社が発表している日本国が発行した固定利付債（個人向けは対象外）の残存期間11年以上の債券のパフォーマンスインデックスで、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ国債のサブインデックスです。
当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年　月　日	基準価額		NOMURA－BPI 国債 超長期（11－）		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
（期　首） 2021年５月12日	10,134	－	277.41	－	99.7	－
５月末	10,107	△0.3	276.67	△0.3	99.5	－
６月末	10,108	△0.3	276.81	△0.2	99.6	－
７月末	10,220	0.8	279.86	0.9	99.5	－
８月末	10,204	0.7	279.31	0.7	99.5	－
９月末	10,139	0.0	277.55	0.1	99.8	－
10月末	10,118	△0.2	276.98	△0.2	99.7	－
11月末	10,154	0.2	277.97	0.2	99.7	－
12月末	10,111	△0.2	276.87	△0.2	99.7	－
2022年１月末	9,962	△1.7	272.74	△1.7	99.6	－
２月末	9,833	△3.0	269.19	△3.0	99.5	－
３月末	9,781	△3.5	267.72	△3.5	99.8	－
４月末	9,705	△4.2	265.70	△4.2	99.7	－
（期　末） 2022年５月12日	9,655	△4.7	264.34	△4.7	99.6	－

（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

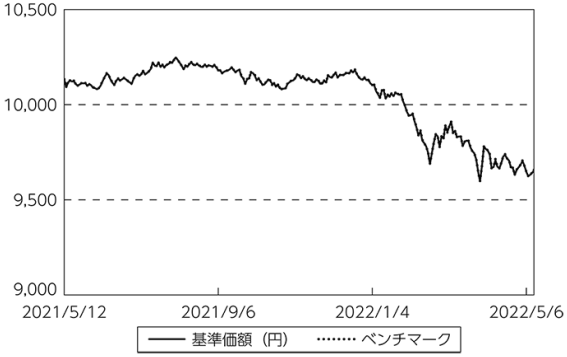
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.7%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－4.7%）と同程度となりました。

基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因
（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
◎国内超長期国債市況
　国内債券市況は下落しました。
・国内債券市況は期の前半から2021年年末にかけてはもみ合いで推移しました。その後、インフレ懸念や利上げ観測の高まりによる米金利の上昇などから国内債券市況は下落しました。期の終わりにかけてはウクライナ情勢緊迫化による上昇局面があったものの、米国の利上げへの積極的な姿勢などを受けて国内債券市況は反落し、期を通して見ても下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて
・資産のほぼ全額を国債（先物を含む）に投資し、高い国債組入比率を維持しました。
・ベンチマークの構成銘柄を年限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4.7%の下落になったため、カイ離は△0.0%程度となりました。

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

（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

（2021年５月13日～2022年５月12日）

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

（2021年５月13日～2022年５月12日）

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 41,843,400	千円 20,924,076

（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

（2021年５月13日～2022年５月12日）

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	41,843	9,921	23.7	20,924	5,651	27.0

（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・スタンレー証券です。

○組入資産の明細

（2022年５月12日現在）

国内公社債

（Ａ）国内（邦貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					５年以上	２年以上	２年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	138,060,000	145,359,633	99.6	－	99.6	－	－
合計	138,060,000	145,359,633	99.6	－	99.6	－	－

（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１回利付国債（40年）	2.4	240,000	321,225	2048/３/20
第２回利付国債（40年）	2.2	1,060,000	1,372,837	2049/３/20
第３回利付国債（40年）	2.2	520,000	676,566	2050/３/20
第４回利付国債（40年）	2.2	840,000	1,097,653	2051/３/20
第５回利付国債（40年）	2.0	830,000	1,042,372	2052/３/20
第６回利付国債（40年）	1.9	930,000	1,147,638	2053/３/20
第７回利付国債（40年）	1.7	960,000	1,136,054	2054/３/20
第８回利付国債（40年）	1.4	1,080,000	1,191,240	2055/３/20
第９回利付国債（40年）	0.4	1,630,000	1,335,361	2056/３/20
第10回利付国債（40年）	0.9	1,600,000	1,534,832	2057/３/20
第11回利付国債（40年）	0.8	1,150,000	1,066,774	2058/３/20
第12回利付国債（40年）	0.5	1,260,000	1,049,365	2059/３/20
第13回利付国債（40年）	0.5	1,540,000	1,276,013	2060/３/20
第14回利付国債（40年）	0.7	1,710,000	1,513,503	2061/３/20
第16回利付国債（30年）	2.5	600,000	751,896	2034/９/20
第17回利付国債（30年）	2.4	530,000	659,176	2034/12/20
第20回利付国債（30年）	2.5	400,000	506,180	2035/９/20
第22回利付国債（30年）	2.5	800,000	1,017,152	2036/３/20
第24回利付国債（30年）	2.5	900,000	1,149,570	2036/９/20
第25回利付国債（30年）	2.3	770,000	963,901	2036/12/20
第26回利付国債（30年）	2.4	590,000	748,084	2037/３/20
第27回利付国債（30年）	2.5	930,000	1,196,956	2037/９/20
第28回利付国債（30年）	2.5	1,030,000	1,329,637	2038/３/20
第29回利付国債（30年）	2.4	890,000	1,138,781	2038/９/20
第30回利付国債（30年）	2.3	1,380,000	1,747,066	2039/３/20
第31回利付国債（30年）	2.2	1,210,000	1,515,512	2039/９/20
第32回利付国債（30年）	2.3	1,320,000	1,677,772	2040/３/20
第33回利付国債（30年）	2.0	1,180,000	1,442,420	2040/９/20
第34回利付国債（30年）	2.2	1,480,000	1,862,121	2041/３/20
第35回利付国債（30年）	2.0	1,520,000	1,864,781	2041/９/20
第36回利付国債（30年）	2.0	1,710,000	2,099,281	2042/３/20
第37回利付国債（30年）	1.9	1,650,000	1,997,440	2042/９/20
第38回利付国債（30年）	1.8	1,130,000	1,347,592	2043/３/20
第39回利付国債（30年）	1.9	1,050,000	1,272,327	2043/６/20
第40回利付国債（30年）	1.8	970,000	1,157,481	2043/９/20
第41回利付国債（30年）	1.7	880,000	1,033,507	2043/12/20
第42回利付国債（30年）	1.7	910,000	1,069,295	2044/３/20
第43回利付国債（30年）	1.7	1,060,000	1,246,199	2044/６/20
第44回利付国債（30年）	1.7	980,000	1,152,725	2044/９/20
第45回利付国債（30年）	1.5	1,040,000	1,180,493	2044/12/20
第46回利付国債（30年）	1.5	1,310,000	1,487,164	2045/３/20
第47回利付国債（30年）	1.6	1,200,000	1,387,188	2045/６/20
第48回利付国債（30年）	1.4	1,160,000	1,291,880	2045/９/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第49回利付国債（30年）	1.4	1,280,000	1,425,408	2045/12/20
第50回利付国債（30年）	0.8	1,280,000	1,259,801	2046/3/20
第51回利付国債（30年）	0.3	1,120,000	979,137	2046/6/20
第52回利付国債（30年）	0.5	1,120,000	1,025,371	2046/9/20
第53回利付国債（30年）	0.6	1,070,000	1,001,295	2046/12/20
第54回利付国債（30年）	0.8	1,340,000	1,310,118	2047/3/20
第55回利付国債（30年）	0.8	890,000	869,102	2047/6/20
第56回利付国債（30年）	0.8	1,330,000	1,297,175	2047/9/20
第57回利付国債（30年）	0.8	1,000,000	973,110	2047/12/20
第58回利付国債（30年）	0.8	1,900,000	1,844,672	2048/3/20
第59回利付国債（30年）	0.7	920,000	870,062	2048/6/20
第60回利付国債（30年）	0.9	1,130,000	1,118,089	2048/9/20
第61回利付国債（30年）	0.7	770,000	724,500	2048/12/20
第62回利付国債（30年）	0.5	540,000	481,825	2049/3/20
第63回利付国債（30年）	0.4	1,040,000	900,213	2049/6/20
第64回利付国債（30年）	0.4	1,140,000	984,606	2049/9/20
第65回利付国債（30年）	0.4	820,000	708,193	2049/12/20
第66回利付国債（30年）	0.4	1,120,000	966,235	2050/3/20
第67回利付国債（30年）	0.6	1,320,000	1,198,903	2050/6/20
第68回利付国債（30年）	0.6	1,250,000	1,134,525	2050/9/20
第69回利付国債（30年）	0.7	1,270,000	1,182,624	2050/12/20
第70回利付国債（30年）	0.7	1,310,000	1,217,907	2051/3/20
第71回利付国債（30年）	0.7	1,280,000	1,188,070	2051/6/20
第72回利付国債（30年）	0.7	1,220,000	1,130,525	2051/9/20
第73回利付国債（30年）	0.7	1,340,000	1,239,674	2051/12/20
第74回利付国債（30年）	1.0	320,000	319,632	2052/3/20
第145回利付国債（20年）	1.7	2,190,000	2,516,769	2033/6/20
第146回利付国債（20年）	1.7	2,110,000	2,427,723	2033/9/20
第147回利付国債（20年）	1.6	2,230,000	2,543,694	2033/12/20
第148回利付国債（20年）	1.5	2,470,000	2,791,643	2034/3/20
第149回利付国債（20年）	1.5	2,590,000	2,930,740	2034/6/20
第150回利付国債（20年）	1.4	1,990,000	2,229,556	2034/9/20
第151回利付国債（20年）	1.2	1,780,000	1,952,054	2034/12/20
第152回利付国債（20年）	1.2	2,600,000	2,852,486	2035/3/20
第153回利付国債（20年）	1.3	2,830,000	3,141,243	2035/6/20
第154回利付国債（20年）	1.2	1,250,000	1,371,562	2035/9/20
第155回利付国債（20年）	1.0	2,740,000	2,935,060	2035/12/20
第156回利付国債（20年）	0.4	1,230,000	1,218,007	2036/3/20
第157回利付国債（20年）	0.2	2,230,000	2,143,253	2036/6/20
第158回利付国債（20年）	0.5	1,540,000	1,541,031	2036/9/20
第159回利付国債（20年）	0.6	1,390,000	1,407,958	2036/12/20
第160回利付国債（20年）	0.7	1,870,000	1,917,722	2037/3/20
第161回利付国債（20年）	0.6	1,580,000	1,595,452	2037/6/20
第162回利付国債（20年）	0.6	1,240,000	1,249,659	2037/9/20
第163回利付国債（20年）	0.6	1,240,000	1,247,117	2037/12/20
第164回利付国債（20年）	0.5	2,200,000	2,174,436	2038/3/20

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165回利付国債（20年）	0.5	1,190,000	1,173,375	2038/6/20
第166回利付国債（20年）	0.7	1,780,000	1,806,504	2038/9/20
第167回利付国債（20年）	0.5	1,420,000	1,393,289	2038/12/20
第168回利付国債（20年）	0.4	1,190,000	1,145,684	2039/3/20
第169回利付国債（20年）	0.3	1,540,000	1,453,667	2039/6/20
第170回利付国債（20年）	0.3	1,040,000	978,640	2039/9/20
第171回利付国債（20年）	0.3	1,390,000	1,303,861	2039/12/20
第172回利付国債（20年）	0.4	1,500,000	1,428,585	2040/3/20
第173回利付国債（20年）	0.4	1,690,000	1,605,939	2040/6/20
第174回利付国債（20年）	0.4	2,030,000	1,923,100	2040/9/20
第175回利付国債（20年）	0.5	1,700,000	1,635,944	2040/12/20
第176回利付国債（20年）	0.5	1,860,000	1,784,670	2041/3/20
第177回利付国債（20年）	0.4	1,460,000	1,372,312	2041/6/20
第178回利付国債（20年）	0.5	1,860,000	1,778,383	2041/9/20
第179回利付国債（20年）	0.5	1,730,000	1,650,420	2041/12/20
第180回利付国債（20年）	0.8	330,000	332,273	2042/3/20
合計		138,060,000	145,359,633	

○投資信託財産の構成

（2022年５月12日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	145,359,633	98.4
コール・ローン等、その他	2,359,478	1.6
投資信託財産総額	147,719,111	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年５月12日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	147,719,111,756
コール・ローン等	215,707,577
公社債(評価額)	145,359,633,200
未収入金	1,798,567,400
未収利息	336,124,752
前払費用	9,078,827
(B) 負債	1,754,541,140
未払解約金	1,754,541,111
未払利息	29
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	145,964,570,616
元本	151,173,140,557
次期繰越損益金	△ 5,208,569,941
(D) 受益権総口数	151,173,140,557口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	9,655円

＜注記事項＞

①期首元本額　131,790,093,212円
　期中追加設定元本額　26,458,141,031円
　期中一部解約元本額　7,075,093,686円
　また、１口当たり純資産額は、期末0.9655円です。

○損益の状況 (2021年５月13日～2022年５月12日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	1,488,215,872
受取利息	1,488,280,465
支払利息	△ 64,593
(B) 有価証券売買損益	△8,751,420,400
売買益	22,709,000
売買損	△8,774,129,400
(C) 当期損益金(Ａ＋Ｂ)	△7,263,204,528
(D) 前期繰越損益金	1,770,004,454
(E) 追加信託差損益金	265,884,683
(F) 解約差損益金	18,745,450
(G) 計(Ｃ＋Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	△5,208,569,941
次期繰越損益金(Ｇ)	△5,208,569,941

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

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

ＭＵＫＡＭ 日本超長期国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）	141,849,927,765円
国内債券セレクション（ラップ向け）	4,093,552,282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）	2,478,741,691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）	2,457,641,714円
アドバンスト・バランスⅣ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	156,392,156円
アドバンスト・バランスⅢ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	136,884,949円
合計	151,173,140,557円

③純資産総額が元本額を下回っており、その差額は5,208,569,941円です。

国内リートインデックス・ファンド（適格機関投資家限定）
損益の状況、組入資産の明細は「国内リートインデックス・ファンド（適格機関投資家限定）」の第７期（2020年11月３日～2021年11月２日）の決算資料から抜粋したものです。

■損益及び剰余金計算書

区　分	第７期 （自　2020年11月３日 至　2021年11月２日） 金　額（円）
営業収益	
有価証券売買等損益	926,350,916
営業収益合計	926,350,916
営業費用	
受託者報酬	1,132,809
委託者報酬	6,042,038
その他費用	264,000
営業費用合計	7,438,847
営業利益又は営業損失（△）	918,912,069
経常利益又は経常損失（△）	918,912,069
当期純利益又は当期純損失（△）	918,912,069
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	119,198,553
期首剰余金又は期首欠損金（△）	352,188,932
剰余金増加額又は欠損金減少額	109,428,354
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は 　欠損金減少額	109,428,354
剰余金減少額又は欠損金増加額	68,658,691
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は 　欠損金増加額	68,658,691
分配金	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,192,672,111

■組入資産の明細

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	国内リート・インデックス・マザーファンド	1,865,863,206	3,512,487,485	
親投資信託受益証券　合計		1,865,863,206	3,512,487,485	
合計		1,865,863,206	3,512,487,485	

（注）親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

運　用　報　告　書

－第８期－　　決算日　2021年11月２日
計算期間（2020年11月３日～2021年11月２日）

国内リート・インデックス・マザーファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

決　算　日	11月２日（原則）
運 用 方 針	①日本の不動産投資信託証券市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。対象指数の選定および変更に当たっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性等を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。 ②効率的な運用を目的として、不動産投資信託証券を主要投資対象とする上場投資信託証券（ＥＴＦ）への投資を行なう場合があります。 ③対象指数との連動を維持するため、先物取引等を利用することがあります。その際、不動産投資信託証券の実質投資比率（組入現物不動産投資信託証券の時価総額に指数先物取引等の買建額を加算し、または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。）が100％を超える場合があります。 ④ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ．エイ．（BlackRock Institutional Trust Company, N.A.）に有価証券の貸付の指図に関する権限の全部または一部を委託します。 ⑤資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。
主要運用対象	日本の不動産投資信託証券等を主要投資対象とします。
組 入 制 限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の50％以下とします。 上場投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

◇基準価額の推移

■最近５期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) S&P J-REIT指数(配当込み)		株式先物組入比率	投資証券組入比率	純資産
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
４期(2017年11月２日)	12,632	△ 4.2	365.12	△ 4.2	1.1	98.2	2,800
５期(2018年11月２日)	14,148	12.0	409.27	12.1	0.6	98.6	3,311
６期(2019年11月５日)	18,894	33.5	547.89	33.9	0.7	98.0	4,654
７期(2020年11月２日)	14,354	△24.0	418.38	△23.6	1.4	97.7	3,688
８期(2021年11月２日)	18,825	31.1	549.65	31.4	0.5	98.4	4,849

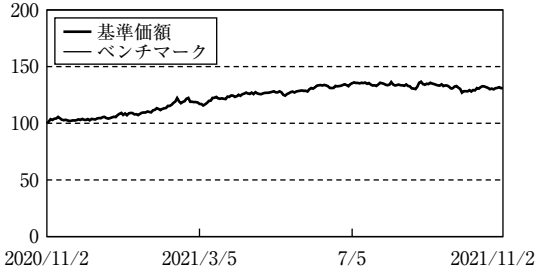
(注１) 基準価額は１万口当り。
(注２) S&P J-REIT指数は、スタンダード＆プアーズ　フィナンシャル　サービシーズ　エル　エル　シー(以下、同社)が開発、計算した指数です。同指数に関する著作権、知的財産その他の一切の権利は、同社に帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
(注３) 純資産総額の単位未満は切捨て。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		(ベンチマーク) S&P J-REIT指数(配当込み)		株式先物組入比率	投資証券組入比率
		騰落率		騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2020年11月２日	14,354	－	418.38	－	1.4	97.7
11月末	14,778	3.0	430.84	3.0	1.4	97.7
12月末	15,654	9.1	456.48	9.1	0.9	98.5
2021年１月末	16,257	13.3	474.31	13.4	0.9	97.6
２月末	17,081	19.0	498.17	19.1	0.9	98.4
３月末	17,854	24.4	521.03	24.5	0.9	98.3
４月末	18,336	27.7	535.17	27.9	0.9	98.5
５月末	18,459	28.6	538.81	28.8	1.0	97.8
６月末	19,190	33.7	560.34	33.9	0.5	99.1
７月末	19,345	34.8	564.89	35.0	0.5	98.5
８月末	19,310	34.5	563.82	34.8	0.5	98.2
９月末	18,710	30.3	546.10	30.5	0.5	97.8
10月末	18,926	31.9	552.63	32.1	0.5	98.4
(期末)						
2021年11月２日	18,825	31.1	549.65	31.4	0.5	98.4

(注１) 基準価額は１万口当り。騰落率は期首比。
(注２) S&P J-REIT指数は、スタンダード＆プアーズ　フィナンシャル　サービシーズ　エル　エル　シー(以下、同社)が開発、計算した指数です。同指数に関する著作権、知的財産その他の一切の権利は、同社に帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

■基準価額の推移
（2020年11月２日～2021年11月２日）



（注１）前期末を100とした指数値を使用しています。
（注２）ベンチマークはS&ＰＪ－REIT指数（配当込み）です。

◇ファンド状況

■１万口当りの費用明細

項　　目	当　　期
	円
（ａ）売買委託手数料	2
（先物・オプション）	（ 0）
（投資証券）	（ 2）
（ｂ）有価証券取引税	－
（ｃ）その他費用	0
（その他）	（ 0）
合　　計	2

（注１）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、下記の簡便法により算出した結果です。
（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
（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
（ｃ）その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
（注２）各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

◇運用内容

■売買及び取引の状況（2020年11月３日から2021年11月２日まで）

（１）投資証券

		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千円	千口	千円
国内	エスコンジャパンリート投資法人	0.037	4,823	0.014	1,829
	サンケイリアルエステート投資法人	0.019	1,941	0.017	1,999
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	0.06	8,078	0.027	3,826
	日本アコモデーションファンド投資法人	0.034	19,625	0.024	15,100
	ＭＣＵＢＳ ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	0.085 (△0.577)	7,531 (－)	0.014 (－)	1,406 (－)
	森ヒルズリート投資法人	0.106	14,916	0.083	12,698
	産業ファンド投資法人	0.123	22,122	0.104	20,027
	アドバンス・レジデンス投資法人	0.082	25,499	0.071	24,219
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	0.067	12,856	0.046	9,701
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.056	23,975	0.035	16,876
	ＧＬＰ投資法人	0.388	64,343	0.207	36,477
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.04	11,938	0.03	10,051
	日本プロロジスリート投資法人	0.175	57,197	0.121	41,284
	星野リゾート・リート投資法人	0.015	8,467	0.012	7,547
	Ｏｎｅリート投資法人	0.014	3,622	0.012	3,576
	イオンリート投資法人	0.138	18,973	0.075	11,150
	ヒューリックリート投資法人	0.076	11,913	0.056	9,609
	日本リート投資法人	0.028	10,554	0.025	10,332
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	0.453	6,833	2.978	66,019
	積水ハウス・リート投資法人	0.253	20,096	0.216	19,057
	トーセイ・リート投資法人	0.019	2,172	0.028	3,760
	ケネディクス商業リート投資法人	0.045	11,718	0.027	7,319
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	0.018	2,366	0.015	2,079
	サムティ・レジデンシャル投資法人	0.071	8,093	0.027	3,137
	野村不動産マスターファンド投資法人	0.278	40,300	0.239	40,626
	いちごホテルリート投資法人	0.013	988	0.012	1,039
	ラサールロジポート投資法人	0.142	23,873	0.082	13,897
	スターアジア不動産投資法人	0.128	6,651	0.08122	4,441
	マリモ地方創生リート投資法人	0.007	796	0.007	863
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.034	17,446	0.026	14,058
	大江戸温泉リート投資法人	0.012	883	0.01	822
	投資法人みらい	0.094	3,902	0.082	3,912
	森トラスト・ホテルリート投資法人	0.019	2,280	0.016	2,109
	三菱地所物流リート投資法人	0.034	13,932	0.018	7,827
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	0.057	10,042	0.018	3,088
	ザイマックス・リート投資法人	0.01	972	0.009	1,008
	タカラレーベン不動産投資法人	0.026	2,452	0.023	2,595

		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千円	千口	千円
国内	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.062	8,375	0.025	3,432
	日本ビルファンド投資法人	0.102	62,038	0.084	57,235
	ジャパンリアルエステイト投資法人	0.082	47,614	0.071	47,448
	日本都市ファンド投資法人	0.202 (1.419)	30,602 (－)	0.317 (－)	36,554 (－)
	オリックス不動産投資法人	0.164	27,531	0.141	26,750
	日本プライムリアルティ投資法人	0.056	19,315	0.048	19,779
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	0.077	9,838	0.066	10,172
	東急リアル・エステート投資法人	0.053	8,500	0.046	8,432
	グローバル・ワン不動産投資法人	0.057	5,964	0.049	6,000
	ユナイテッド・アーバン投資法人	0.183	23,323	0.158	24,406
	森トラスト総合リート投資法人	0.055	7,337	0.048	7,368
	インヴィンシブル投資法人	0.356	12,994	0.306	12,367
	フロンティア不動産投資法人	0.036	15,243	0.024	11,341
	平和不動産リート投資法人	0.066	9,015	0.046	7,034
	日本ロジスティクスファンド投資法人	0.053	16,033	0.046	14,387
	福岡リート投資法人	0.042	6,359	0.036	6,247
	ケネディクス・オフィス投資法人	0.024	16,242	0.021	16,124
	いちごオフィスリート投資法人	0.088	6,667	0.082	7,589
	大和証券オフィス投資法人	0.019	12,235	0.019	14,396
	阪急阪神リート投資法人	0.04	5,316	0.034	5,139
	スターツプロシード投資法人	0.013	2,689	0.011	2,449
	大和ハウスリート投資法人	0.149	41,221	0.102	29,903
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	0.261	14,967	0.223	13,761
	大和証券リビング投資法人	0.141	13,811	0.101	11,029
	ジャパンエクセレント投資法人	0.074	9,368	0.064	9,294

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）買付（　）内は分割割当、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。
（注３）売付（　）内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
（注４）金額の単位未満は切捨て。

（２）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 153	百万円 194	百万円 －	百万円 －

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄（2020年11月３日から2021年11月２日まで）

投資証券

買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
ＧＬＰ投資法人	0.388	64,343	165,834	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	2.978	66,019	22,169
日本ビルファンド投資法人	0.102	62,038	608,225	日本ビルファンド投資法人	0.084	57,235	681,376
日本プロロジスリート投資法人	0.175	57,197	326,842	ジャパンリアルエステイト投資法人	0.071	47,448	668,291
ジャパンリアルエステイト投資法人	0.082	47,614	580,662	日本プロロジスリート投資法人	0.121	41,284	341,190
大和ハウスリート投資法人	0.149	41,221	276,653	野村不動産マスターファンド投資法人	0.239	40,626	169,984
野村不動産マスターファンド投資法人	0.278	40,300	144,967	日本都市ファンド投資法人	0.317	36,554	115,313
日本都市ファンド投資法人	0.202	30,602	151,498	ＧＬＰ投資法人	0.207	36,477	176,221
オリックス不動産投資法人	0.164	27,531	167,874	大和ハウスリート投資法人	0.102	29,903	293,175
アドバンス・レジデンス投資法人	0.082	25,499	310,966	オリックス不動産投資法人	0.141	26,750	189,717
アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.056	23,975	428,141	ユナイテッド・アーバン投資法人	0.158	24,406	154,468

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

■組入資産の明細

（１）国内投資証券

銘柄	期首（前期末）	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
エスコンジャパンリート投資法人	0.08	0.103	14,389
サンケイリアルエステート投資法人	0.102	0.104	12,906
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	0.146	0.179	30,358
日本アコモデーションファンド投資法人	0.137	0.147	92,757
ＭＣＵＢＳ ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	0.506	－	－
森ヒルズリート投資法人	0.453	0.476	74,018
産業ファンド投資法人	0.585	0.604	126,054
アドバンス・レジデンス投資法人	0.393	0.404	149,076
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	0.27	0.291	64,165
アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.197	0.218	100,934
ＧＬＰ投資法人	1.13	1.311	243,846
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.174	0.184	59,984
日本プロロジスリート投資法人	0.7	0.754	285,012
星野リゾート・リート投資法人	0.063	0.066	48,642
Ｏｎｅリート投資法人	0.068	0.07	21,105
イオンリート投資法人	0.43	0.493	75,922
ヒューリックリート投資法人	0.332	0.352	61,248
日本リート投資法人	0.128	0.131	56,461
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	2.525	－	－
積水ハウス・リート投資法人	1.215	1.252	107,171
トーセイ・リート投資法人	0.097	0.088	11,528
ケネディクス商業リート投資法人	0.152	0.17	49,198
ヘルスケア＆メディカル投資法人	0.088	0.091	14,550
サムティ・レジデンシャル投資法人	0.163	0.207	24,840
野村不動産マスターファンド投資法人	1.338	1.377	233,263
いちごホテルリート投資法人	0.073	0.074	7,118
ラサールロジポート投資法人	0.461	0.521	98,260

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
スターアジア不動産投資法人	0.47522	0.522	31,685
マリモ地方創生リート投資法人	0.039	0.039	5,198
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.142	0.15	88,650
大江戸温泉リート投資法人	0.067	0.069	5,664
投資法人みらい	0.473	0.485	25,171
森トラスト・ホテルリート投資法人	0.089	0.092	12,889
三菱地所物流リート投資法人	0.098	0.114	55,917
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	0.107	0.146	31,813
ザイマックス・リート投資法人	0.06	0.061	7,094
タカラレーベン不動産投資法人	0.132	0.135	14,931
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.128	0.165	26,664
日本ビルファンド投資法人	0.465	0.483	356,454
ジャパンリアルエステイト投資法人	0.393	0.404	278,760
日本都市ファンド投資法人	0.737	2.041	213,896
オリックス不動産投資法人	0.783	0.806	152,011
日本プライムリアルティ投資法人	0.272	0.28	116,760
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	0.374	0.385	58,019
東急リアル・エステート投資法人	0.264	0.271	51,191
グローバル・ワン不動産投資法人	0.273	0.281	33,129
ユナイテッド・アーバン投資法人	0.885	0.91	129,493
森トラスト総合リート投資法人	0.274	0.281	41,054
インヴィンシブル投資法人	1.73	1.78	78,498
フロンティア不動産投資法人	0.136	0.148	75,332
平和不動産リート投資法人	0.251	0.271	42,845
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.257	0.264	88,836
福岡リート投資法人	0.206	0.212	35,997
ケネディクス・オフィス投資法人	0.122	0.125	88,875
いちごオフィスリート投資法人	0.436	0.442	38,100
大和証券オフィス投資法人	0.086	0.086	62,608
阪急阪神リート投資法人	0.197	0.203	34,307
スターツプロシード投資法人	0.063	0.065	15,691
大和ハウスリート投資法人	0.567	0.614	198,629
ジャパン・ホテル・リート投資法人	1.266	1.304	88,541
大和証券リビング投資法人	0.583	0.623	70,897
ジャパンエクセレント投資法人	0.365	0.375	51,712
合計　口数・金額	24.80122	24.299	4,770,131
合計　銘柄数・〈比率〉	62銘柄	60銘柄	〈98.4%〉

(注１) 合計欄の〈　〉内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注２) 評価額の単位未満は切捨て。

(２)先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
国内	東証ＲＥＩＴ	22	－

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

◇資産状況

■投資信託財産の構成

2021年11月２日現在

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
投資証券	4,770,131	98.3
コール・ローン等、その他	81,421	1.7
投資信託財産総額	4,851,552	100.0

（注）評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月２日現在

項目	当期末
（A）資産	**4,851,552,562円**
コール・ローン等	37,211,765
投資証券(評価額)	4,770,131,300
未収配当金	42,385,697
差入委託証拠金	1,823,800
（B）負債	**1,951,539**
未払金	714,560
未払解約金	1,236,979
（C）純資産総額(A－B)	**4,849,601,023**
元本	2,576,102,822
次期繰越損益金	2,273,498,201
（D）受益権総口数	**2,576,102,822口**
１万口当り基準価額(C／D)	**18,825円**

＜注記事項＞

期首元本額	2,569,415,985円
期中追加設定元本額	869,078,127円
期中一部解約元本額	862,391,290円

期末における元本の内訳

iシェアーズ　国内リートインデックス・ファンド	694,549,462円
国内リートインデックス・ファンド(適格機関投資家限定)	1,865,863,206円
ブラックロックLifePathファンド2055	4,202,374円
ブラックロックLifePathファンド2045	4,374,966円
ブラックロックLifePathファンド2040	3,653,914円
ブラックロックLifePathファンド2050	2,494,857円
ブラックロックLifePathファンド2060	238,053円
ブラックロックLifePathファンド2065	725,990円
合計	2,576,102,822円

■損益の状況

自2020年11月３日　至2021年11月２日

項目	当期
（A）配当等収益	**171,004,494円**
受取配当金	169,246,864
その他収益金	1,757,630
（B）有価証券売買損益	**1,074,386,126**
売買益	1,075,493,988
売買損	△ 1,107,862
（C）先物取引等損益	**12,193,200**
取引益	13,192,640
取引損	△ 999,440
（D）その他費用	**△ 51,944**
（E）当期損益金(A＋B＋C＋D)	**1,257,531,876**
（F）前期繰越損益金	**1,118,662,637**
（G）解約差損益金	**△ 651,497,537**
（H）追加信託差損益金	**548,801,225**
（I）合計(E＋F＋G＋H)	**2,273,498,201**
次期繰越損益金(I)	**2,273,498,201**

（注１）損益の状況の中で有価証券売買損益及び先物取引等損益は、期末の評価換えによるものを含みます。
（注２）損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。
（注３）損益の状況の中で解約差損益金とは中途解約の際、解約代金と元本の差額をいいます。

851473

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型株式投資信託／国際株式型（一般型）	
信託期間	無期限（2007年３月15日設定）	
運用方針	マザーファンドを通じて、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。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。	
主要運用対象	ベビーファンド	外国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、当ファンドで直接投資することがあります。
	マザーファンド	ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。
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。
	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。	

運用報告書（全体版）

ＭＵＡＭ 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）

第15期（決算日：2022年５月12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「ＭＵＡＭ 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）」は、去る５月12日に第15期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG
三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先
お客さま専用フリーダイヤル　０１２０－１５１０３４
（受付時間：営業日の9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～１月３日を除く）
お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○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		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(配当込み、円換算ベース)	期中騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
11期(2018年５月14日)	17,971	0	9.8	742,711.39	9.9	94.4	3.4	2.2	120,905
12期(2019年５月13日)	18,540	0	3.2	767,126.93	3.3	93.8	3.8	2.5	134,917
13期(2020年５月12日)	17,876	0	△ 3.6	740,810.97	△ 3.4	93.7	4.0	2.4	98,615
14期(2021年５月12日)	26,243	0	46.8	1,089,727.74	47.1	93.4	4.5	2.1	65,597
15期(2022年５月12日)	28,949	0	10.3	1,203,027.98	10.4	94.9	2.9	2.3	51,249

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率			
	円	%		%	%	%	%
（期　首） 2021年５月12日	26,243	－	1,089,727.74	－	93.4	4.5	2.1
５月末	26,991	2.9	1,120,295.08	2.8	94.5	3.2	2.1
６月末	27,655	5.4	1,148,321.00	5.4	93.4	4.5	2.1
７月末	28,044	6.9	1,164,636.70	6.9	95.3	2.5	2.2
８月末	28,729	9.5	1,193,049.12	9.5	95.3	2.4	2.2
９月末	28,054	6.9	1,165,043.55	6.9	94.6	3.3	2.2
10月末	30,099	14.7	1,250,124.47	14.7	95.6	1.7	2.2
11月末	29,976	14.2	1,244,334.35	14.2	94.6	2.9	2.2
12月末	31,194	18.9	1,295,472.56	18.9	93.5	4.3	2.2
2022年１月末	29,007	10.5	1,204,715.68	10.6	96.0	1.7	2.3
２月末	28,808	9.8	1,197,243.59	9.9	96.2	1.5	2.2
３月末	31,865	21.4	1,323,494.86	21.5	95.4	1.7	2.3
４月末	30,497	16.2	1,265,687.53	16.1	94.1	3.0	2.5
（期　末） 2022年５月12日	28,949	10.3	1,203,027.98	10.4	94.9	2.9	2.3

（注）騰落率は期首比。
（注）株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。
（注）当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「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」は買建比率－売建比率。

運用経過

第15期：2021年５月13日～2022年５月12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 15 期 首	26,243円
第 15 期 末	28,949円
既払分配金	0円
騰　落　率	10.3%

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまにより異なります。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、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10.3％の上昇となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（10.4％）を0.1％下回りました。

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。

第15期：2021年５月13日～2022年５月12日

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。

堅調な経済指標や企業決算等を受けて外国株式市況は上昇する局面もありましたが、世界的なインフレや金融引き締めへの警戒、ウクライナ情勢の緊迫化等を受けて外国株式市況は下落しました。

▶為替市況

米ドル、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19.3％の円安・米ドル高、3.4％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

▶ＭＵＡＭ 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）

資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

▶外国株式インデックスマザーファンド

ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式（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

▶ ＭＵＡＭ 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）

ベンチマークとのカイ離は△0.1％程度となりました。

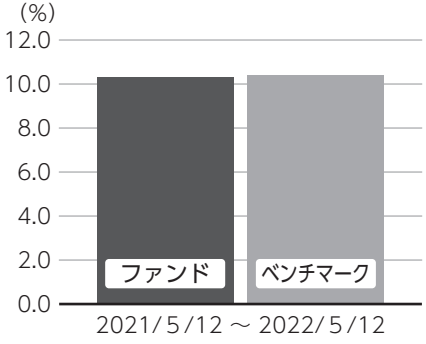
マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は△0.3％程度でした。

マザーファンド保有による要因

マザーファンド保有による影響は0.2％程度でした。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



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：為替評価差異要因※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為替レートが異なるため生じる要因です。

分配金について

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

分配原資の内訳

（単位：円、１万口当たり、税込み）

項　目	第15期 2021年５月13日～2022年５月12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	19,688

（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。）

▶ＭＵＡＭ 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2021年５月13日～2022年５月12日

１万口当たりの費用明細

項目	当期 金額（円）	当期 比率（%）	項目の概要
(a)信託報酬	74	0.253	(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）	(51)	(0.176)	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）	(6)	(0.022)	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）	(16)	(0.055)	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	1	0.003	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(0)	(0.001)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(c)有価証券取引税	3	0.011	(c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(3)	(0.011)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d)その他費用	7	0.025	(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）	(6)	(0.020)	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）	(1)	(0.005)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	85	0.292	

期中の平均基準価額は、29,071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です。
（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

（2021年５月13日～2022年５月12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
外国株式インデックスマザーファンド	470,894	2,022,058	5,339,963	22,727,420

○株式売買比率

（2021年５月13日～2022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
	外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	561,405,953千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,239,023,226千円
(c) 売買高比率（a）／（b）	0.45

(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

（2021年５月13日～2022年５月12日）

利害関係人との取引状況

＜ＭＵＡＭ 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞

該当事項はございません。

＜外国株式インデックスマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	707,260	680,861	96.3	314,672	298,244	94.8

平均保有割合　4.4%

※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。

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

○組入資産の明細

（2022年５月12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
外国株式インデックスマザーファンド	16,571,572	11,702,503	51,242,922

○投資信託財産の構成

（2022年５月12日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
外国株式インデックスマザーファンド	51,242,922	99.7
コール・ローン等、その他	131,158	0.3
投資信託財産総額	51,374,080	100.0

（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（1,458,398,210千円）の投資信託財産総額（1,506,538,279千円）に対する比率は96.8%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＝129.77円	１カナダドル＝99.93円	１ユーロ＝136.58円	１イギリスポンド＝158.93円
１スイスフラン＝130.55円	１スウェーデンクローネ＝12.89円	１ノルウェークローネ＝13.33円	１デンマーククローネ＝18.36円
１オーストラリアドル＝90.06円	１ニュージーランドドル＝81.68円	１香港ドル＝16.53円	１シンガポールドル＝93.41円
１イスラエルシェケル＝37.6208円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 （2022年５月12日現在）

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	51,374,080,763
コール・ローン等	128,803,257
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	51,242,922,614
未収入金	2,354,892
(B) 負債	124,500,781
未払解約金	54,474,271
未払信託報酬	70,026,493
未払利息	17
(C) 純資産総額（Ａ－Ｂ）	51,249,579,982
元本	17,703,227,831
次期繰越損益金	33,546,352,151
(D) 受益権総口数	17,703,227,831口
１万口当たり基準価額（Ｃ／Ｄ）	28,949円

＜注記事項＞

①期首元本額　24,995,902,281円
　期中追加設定元本額　910,658,503円
　期中一部解約元本額　8,203,332,953円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.8949円です。

○損益の状況 （2021年５月13日～2022年５月12日）

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	△ 24,311
受取利息	100
支払利息	△ 24,411
(B) 有価証券売買損益	4,778,272,302
売買益	6,258,756,518
売買損	△ 1,480,484,216
(C) 信託報酬等	△ 146,329,568
(D) 当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	4,631,918,423
(E) 前期繰越損益金	10,740,814,587
(F) 追加信託差損益金	18,173,619,141
（配当等相当額）	(19,480,293,620)
（売買損益相当額）	(△ 1,306,674,479)
(G) 計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	33,546,352,151
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）	33,546,352,151
追加信託差損益金	18,173,619,141
（配当等相当額）	(19,481,815,498)
（売買損益相当額）	(△ 1,308,196,357)
分配準備積立金	15,372,733,010

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

②分配金の計算過程

項　　目	2021年５月13日～2022年５月12日
費用控除後の配当等収益額	784,556,985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	3,847,361,438円
収益調整金額	19,481,815,498円
分配準備積立金額	10,740,814,587円
当ファンドの分配対象収益額	34,854,548,508円
１万口当たり収益分配対象額	19,688円
１万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

外国株式インデックスマザーファンド

《第21期》決算日2022年５月12日

［計算期間：2021年５月13日～2022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21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21期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
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
20期(2021年５月12日)	39,579	47.5	1,089,727.74	47.1	93.4	4.5	2.1	974,704
21期(2022年５月12日)	43,788	10.6	1,203,027.98	10.4	94.9	2.9	2.3	1,466,498

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率			
（期　首）	円	%		%	%	%	%
2021年５月12日	39,579	－	1,089,727.74	－	93.4	4.5	2.1
５月末	40,713	2.9	1,120,295.08	2.8	94.5	3.2	2.1
６月末	41,729	5.4	1,148,321.00	5.4	93.4	4.5	2.1
７月末	42,325	6.9	1,164,636.70	6.9	95.3	2.5	2.2
８月末	43,370	9.6	1,193,049.12	9.5	95.3	2.4	2.2
９月末	42,363	7.0	1,165,043.55	6.9	94.6	3.3	2.2
10月末	45,461	14.9	1,250,124.47	14.7	95.6	1.7	2.2
11月末	45,285	14.4	1,244,334.35	14.2	94.6	2.9	2.2
12月末	47,137	19.1	1,295,472.56	18.9	93.5	4.3	2.2
2022年１月末	43,842	10.8	1,204,715.68	10.6	96.0	1.7	2.3
２月末	43,550	10.0	1,197,243.59	9.9	96.2	1.5	2.2
３月末	48,183	21.7	1,323,494.86	21.5	95.4	1.7	2.3
４月末	46,125	16.5	1,265,687.53	16.1	94.1	3.0	2.5
（期　末）							
2022年５月12日	43,788	10.6	1,203,027.98	10.4	94.9	2.9	2.3

（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

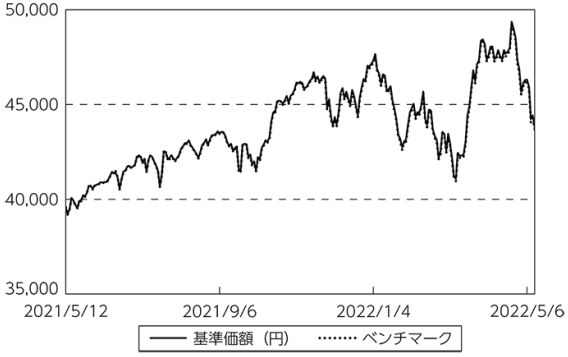
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ10.6%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（10.4%）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

（上昇要因）

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

●投資環境について

◎外国株式市況

外国株式市況は下落しました。

・堅調な経済指標や企業決算等を受けて外国株式市況は上昇する局面もありましたが、世界的なインフレや金融引き締めへの警戒、ウクライナ情勢の緊迫化等を受けて外国株式市況は下落しました。

◎為替市況

米ドル、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19.3%の円安・米ドル高、3.4%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

・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10.4%の上昇になったため、カイ離は0.2%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

・その他の要因※によるものです。

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

（主なマイナス要因）

・為替評価差異要因※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

（2021年５月13日～2022年５月12日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	1	0.003	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(1)	(0.001)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(1)	(0.002)	
(b) 有価証券取引税	5	0.011	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(5)	(0.011)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	11	0.026	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(9)	(0.021)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（その他）	(2)	(0.005)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	17	0.040	
期中の平均基準価額は、43,911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

（2021年５月13日～2022年５月12日）

株式

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
外国	アメリカ	百株 256,260 (8,040)	千アメリカドル 3,119,161 (26,808)	百株 38,644 (7,986)	千アメリカドル 479,698 (42,102)
	カナダ	33,562 (794)	千カナダドル 202,933 (△ 172)	9,439	千カナダドル 29,441
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	19,837 (2,818)	98,702 (△ 359)	6,255	17,845
	イタリア	41,537 (－)	19,945 (△ 8)	19,678	2,758
	フランス	19,486 (3,037)	107,834 (－)	6,489	12,097
	オランダ	18,184 (1,718)	73,657 (－)	4,283 (－)	9,324 (27)
	スペイン	32,841 (45,932)	26,845 (763)	47,515	4,188
	ベルギー	1,893	11,350	385	2,521
	オーストリア	789	3,260	142	675
	ルクセンブルク	1,632	3,101	937	1,094
	フィンランド	7,236	11,389	1,893	1,195
	アイルランド	1,047	6,746	70	322
	ポルトガル	2,387	1,496	－	－
	イギリス	176,276 (3,662)	千イギリスポンド 106,076 (2,297)	24,075 (6,452)	千イギリスポンド 21,148 (2,339)
	スイス	13,184 (257)	千スイスフラン 118,991 (△ 691)	1,974	千スイスフラン 18,074
	スウェーデン	29,131 (10,983)	千スウェーデンクローネ 534,726 (11,159)	4,370 (3,058)	千スウェーデンクローネ 85,716 (18,185)
	ノルウェー	5,133	千ノルウェークローネ 88,454	1,092	千ノルウェークローネ 14,932
	デンマーク	3,819	千デンマーククローネ 213,956	601	千デンマーククローネ 35,262
	オーストラリア	53,450 (5,433)	千オーストラリアドル 139,473 (1,221)	11,487 (10,478)	千オーストラリアドル 16,338 (4,086)
	ニュージーランド	3,366	千ニュージーランドドル 3,301	1,153	千ニュージーランドドル 704

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	香港	百株 58,203 (915)	千香港ドル 259,747 (△ 178)	百株 19,023	千香港ドル 34,071
	シンガポール	21,158 (9,367)	千シンガポールドル 16,564 (1,268)	4,244 (9,367)	千シンガポールドル 2,810 (1,914)
	イスラエル	3,822	千イスラエルシェケル 18,513	747	千イスラエルシェケル 3,188

(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 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	50	1,716	20	728
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13	2,666	1	285
	PROLOGIS INC	53	7,434	5	810
	CAMDEN PROPERTY TRUST	8	1,329	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	17	2,633	—	—
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	21	1,700	9	723
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5	1,593	—	—
	EXTRA SPACE STORAGE INC	11	2,107	1	353
	WELLTOWER INC	33	2,829	—	—
	BOSTON PROPERTIES INC	9	1,032	—	—
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	49	970	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9	1,867	1	352
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	9	313	47	1,317
	REALTY INCOME CORP	40 (34)	2,737 (2,275)	—	—
	REGENCY CENTERS CORP	9	683	4	318
	SUN COMMUNITIES INC	12	2,385	3	721
	UDR INC	20	1,153	—	—
	VENTAS INC	30	1,755	—	—
	WEYERHAEUSER CO	53	2,000	8	360
	AMERICAN TOWER CORP	34	9,083	3	820
	WP CAREY INC	12	999	—	—
	VEREIT INC	12 (△ 48)	621 (△ 2,275)	—	—
	DUKE REALTY CORP	28	1,510	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	27	1,296	6	306
	EQUINIX INC	6	4,914	0.498	356
	CROWN CASTLE INTL CORP	32	5,743	4	762
	EQUITY RESIDENTIAL	28	2,349	9	755
	INVITATION HOMES INC	57	2,227	8	353
	VICI PROPERTIES INC	122	3,722	—	—
	SBA COMMUNICATIONS CORP	7	2,535	0.996	347
	ORION OFFICE REIT INC	— (11)	— (—)	11	212
	HOST HOTELS & RESORTS INC	56	981	—	—
	PUBLIC STORAGE	11	3,902	2	688
	SIMON PROPERTY GROUP INC	21	3,033	2	306
	VORNADO REALTY TRUST	7	335	—	—
	KIMCO REALTY CORP	135	3,181	—	—
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	12	2,948	2	730
	小計	1,076 (△ 2)	88,298 (—)	156	11,615

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	8	456	—	—
	小計		8	456	—	—
	ユーロ			千ユーロ		千ユーロ
		フランス				
		GECINA SA	3	510	1	249
		KLEPIERRE	24 (—)	564 (△ 38)	—	—
		COVIVIO	4	302	—	—
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7	499	3	224
		小計	40 (—)	1,876 (△ 38)	5	474
	ユーロ計		40 (—)	1,876 (△ 38)	5	474
	イギリス			千イギリスポンド		千イギリスポンド
		BRITISH LAND CO PLC	42	217	—	—
		LAND SECURITIES GROUP PLC	34	244	—	—
		SEGRO PLC	73	904	—	—
	小計		150	1,365	—	—
	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	566	1,009	256	461
		SCENTRE GROUP	454	1,294	—	—
		DEXUS/AU	131 (172)	1,416 (1,802)	47	516
		GPT GROUP	90	459	—	—
		MIRVAC GROUP	290	836	—	—
		STOCKLAND	178	834	—	—
		DEXUS	— (△ 172)	— (△ 1,802)	—	—
		GOODMAN GROUP	96	2,125	—	—
	小計		1,806	7,976	303	978
	香港			千香港ドル		千香港ドル
		LINK REIT	127	8,981	—	—
	小計		127	8,981	—	—
	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	—	—	254	361
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	— (18)	— (22)	—	—
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	226 (—)	453 (△ 15)	—	—
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	— (—)	— (△ 2)	—	—
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	211 (79)	446 (132)	—	—

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
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	149 (－)	450 (△ 17)	－	－
	小計	587 (98)	1,350 (120)	254	361

(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 741,257	百万円 744,969	百万円 －	百万円 －

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

○株式売買比率

(2021年５月13日～2022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	561,405,953千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,239,023,226千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.45

(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

(2021年５月13日～2022年５月12日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	707,260	680,861	96.3	314,672	298,244	94.8

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

○組入資産の明細

（2022年５月12日現在）

外国株式

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
（アメリカ）	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AMERICAN EXPRESS CO	1,130	1,514	24,136	3,132,163	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	2,922	4,064	43,014	5,581,955	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	517	694	7,921	1,027,973	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	706	968	20,190	2,620,094	ソフトウェア・サービス
AES CORP	1,097	1,515	3,025	392,654	公益事業
AFLAC INC	1,119	1,420	8,081	1,048,774	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,449	1,909	11,192	1,452,422	保険
ADVANCED MICRO DEVICES	1,984	3,760	33,058	4,290,040	半導体・半導体製造装置
ACCENTURE PLC-CL A	1,043	1,452	40,804	5,295,135	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	365	510	11,890	1,543,021	素材
ANTHEM INC	409	558	27,216	3,531,900	ヘルスケア機器・サービス
BOSTON SCIENTIFIC CORP	2,356	3,272	12,676	1,645,024	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	845	1,167	8,405	1,090,734	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	883	1,285	16,635	2,158,760	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	479	651	16,230	2,106,188	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	380	521	4,366	566,603	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,726	5,098	38,826	5,038,557	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	251	349	20,958	2,719,825	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	6,821	9,501	45,490	5,903,339	電気通信サービス
BALL CORP	533	739	4,974	645,573	素材
ALLSTATE CORP	509	668	8,588	1,114,519	保険
AVERY DENNISON CORP	143	182	3,138	407,311	素材
CHUBB LTD	745	988	20,221	2,624,175	保険
ANALOG DEVICES INC	609	1,231	18,713	2,428,426	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	38	47	9,220	1,196,535	小売
CVS HEALTH CORP	2,155	3,034	29,732	3,858,337	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	1,242	1,834	6,398	830,327	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	5,022	6,790	80,228	10,411,270	銀行
CHARLES RIVER LABORATORIES	－	123	2,745	356,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	895	1,242	25,500	3,309,136	資本財
COCA-COLA CO/THE	6,726	9,426	60,623	7,867,127	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	757	979	11,709	1,519,530	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	300	442	2,181	283,069	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	1,259	5,096	16,903	2,193,597	運輸
CHEVRON CORP	3,168	4,427	72,242	9,374,911	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	2,223	3,023	29,945	3,885,993	エネルギー
CME GROUP INC	591	825	16,400	2,128,286	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	500	652	3,648	473,412	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,339	1,838	14,111	1,831,287	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC	1,346	1,855	15,407	1,999,390	公益事業
DEVON ENERGY CORP	997	1,492	9,652	1,252,649	エネルギー
DEERE & CO	491	676	24,633	3,196,695	資本財
DANAHER CORP	1,054	1,478	35,049	4,548,417	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WALT DISNEY CO/THE	2,986	4,178	43,965	5,705,371	メディア・娯楽
DARDEN RESTAURANTS INC	207	297	3,619	469,644	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	1,218	1,762	19,370	2,513,757	公益事業

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
DR HORTON INC	565	769	4,992	647,906	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	825	1,101	23,508	3,050,636	小売
DAVITA INC	128	162	1,660	215,496	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	234	336	4,381	568,635	資本財
DTE ENERGY COMPANY	314	448	5,836	757,416	公益事業
EXXON MOBIL CORP	6,962	9,724	84,397	10,952,269	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,027	1,433	13,374	1,735,638	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	948	1,339	16,249	2,108,677	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	987	1,373	11,417	1,481,636	資本財
EXELON CORP	1,623	2,274	10,830	1,405,437	公益事業
ECOLAB INC	423	599	9,602	1,246,116	素材
EQUIFAX INC	205	289	5,548	720,033	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	373	532	12,214	1,585,089	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	658	912	12,845	1,667,019	資本財
EDISON INTERNATIONAL	638	872	5,972	775,044	公益事業
ENTERGY CORP	341	468	5,510	715,033	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	65	88	2,468	320,313	保険
NEXTERA ENERGY INC	3,230	4,509	31,655	4,107,906	公益事業
FEDEX CORP	413	581	12,052	1,564,041	運輸
FORD MOTOR CO	6,466	9,033	11,589	1,504,013	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	466	654	1,562	202,739	各種金融
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	59	83	3,069	398,356	各種金融
FIRSTENERGY CORP	890	1,268	5,375	697,554	公益事業
FREEPORT-MCMORAN INC	2,410	3,379	12,136	1,575,005	素材
GENERAL MILLS INC	987	1,403	10,080	1,308,156	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	406	545	12,380	1,606,615	資本財
WW GRAINGER INC	74	103	4,766	618,521	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	14,448	2,526	18,298	2,374,632	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	493	681	7,987	1,036,576	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	231	317	4,106	532,945	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	538	773	23,331	3,027,732	各種金融
HALLIBURTON CO	1,513	2,048	7,107	922,335	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,155	1,581	30,362	3,940,177	資本財
HP INC	2,287	2,670	9,575	1,242,661	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	587	768	5,362	695,921	保険
HERSHEY CO/THE	250	330	7,434	964,756	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC	1,775	2,400	67,925	8,814,678	小売
HASBRO INC	204	309	2,710	351,681	耐久消費財・アパレル
TRANE TECHNOLOGIES PLC	403	552	7,245	940,189	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,467	2,060	26,944	3,496,613	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	611	885	4,219	547,559	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	524	719	14,668	1,903,547	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	646	918	2,844	369,152	メディア・娯楽
IDEX CORP	131	169	3,085	400,425	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	377	578	7,408	961,352	素材
JOHNSON & JOHNSON	4,339	6,050	106,560	13,828,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KANSAS CITY SOUTHERN	152	—	—	—	運輸
KELLOGG CO	442	570	4,127	535,574	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	566	781	10,850	1,408,128	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	2,354	3,201	20,989	2,723,849	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	1,292	1,657	9,003	1,168,421	食品・生活必需品小売り
ELI LILLY & CO	1,420	1,869	53,593	6,954,871	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	157	222	5,312	689,457	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	234	388	1,672	217,072	運輸
LENNAR CORP-A	452	633	4,516	586,161	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	1,208	1,548	29,076	3,773,265	小売
BATH & BODY WORKS INC	—	581	2,777	360,379	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	560	805	2,441	316,857	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	414	570	25,140	3,262,465	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	315	422	2,259	293,175	保険
LENNOX INTERNATIONAL INC	56	76	1,602	208,016	資本財
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	459	625	10,450	1,356,121	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	1,229	1,715	41,924	5,440,496	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	396	814	26,532	3,443,185	各種金融
MEDTRONIC PLC	2,215	3,088	31,082	4,033,593	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	4,171	5,806	51,788	6,720,539	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	1,836	2,570	17,212	2,233,627	半導体・半導体製造装置
3M CO	950	1,322	19,357	2,512,035	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	276	388	7,843	1,017,803	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	753	899	3,153	409,269	消費者サービス
MASCO CORP	427	535	2,802	363,689	資本財
M & T BANK CORP	211	420	6,917	897,622	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	835	1,158	18,101	2,349,089	保険
MOLINA HEALTHCARE INC	102	129	3,726	483,587	ヘルスケア機器・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	105	124	1,701	220,752	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	2,318	3,090	24,384	3,164,366	各種金融
MCKESSON CORP	269	347	11,537	1,497,260	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	1,277	1,614	10,349	1,343,027	保険
MOODY'S CORP	279	386	10,904	1,415,085	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	418	559	13,784	1,788,788	運輸
BANK OF AMERICA CORP	12,829	16,923	60,198	7,811,898	銀行
NISOURCE INC	601	840	2,494	323,746	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	261	346	15,470	2,007,610	資本財
NEWMONT CORP	1,331	1,839	12,587	1,633,524	素材
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	419	581	5,708	740,755	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	21	30	3,895	505,549	保険
NUCOR CORP	506	642	8,094	1,050,368	素材
NEWELL BRANDS INC	656	804	1,753	227,611	耐久消費財・アパレル
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,588	2,144	12,888	1,672,525	エネルギー
OMNICOM GROUP	346	473	3,539	459,354	メディア・娯楽
PEPSICO INC	2,274	3,175	54,200	7,033,588	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	165	217	3,450	447,720	素材
ALTRIA GROUP INC	3,065	4,215	21,789	2,827,577	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	185	—	—	—	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	4,086	5,557	84,812	11,006,065	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	696	967	15,469	2,007,451	銀行
PFIZER INC	9,166	12,903	63,808	8,280,416	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	667	855	8,814	1,143,895	保険
PULTEGROUP INC	462	610	2,471	320,738	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP	216	295	7,832	1,016,427	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	342	535	13,379	1,736,262	エネルギー
CITIGROUP INC	3,429	4,555	21,713	2,817,793	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	446	603	4,110	533,469	保険
PPG INDUSTRIES INC	383	550	6,841	887,850	素材

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
PENTAIR PLC	269	363	1,770	229,763	資本財
P G & E CORP	2,356	3,292	3,960	513,957	公益事業
PPL CORP	1,308	1,677	4,763	618,218	公益事業
PROGRESSIVE CORP	967	1,344	14,503	1,882,056	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	825	1,182	8,154	1,058,246	公益事業
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	368	549	3,291	427,104	消費者サービス
REPUBLIC SERVICES INC	380	503	6,501	843,740	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	1,636	2,263	4,531	588,090	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	82	—	—	—	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	174	244	10,492	1,361,613	ソフトウェア・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	884	1,428	4,343	563,599	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	178	274	2,567	333,140	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	189	272	5,417	703,064	資本財
SCHLUMBERGER LTD	2,323	3,232	12,402	1,609,525	エネルギー
STRYKER CORP	557	778	17,640	2,289,253	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	2,523	3,330	21,689	2,814,623	各種金融
SEMPRA ENERGY	468	741	11,777	1,528,339	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	404	572	15,165	1,967,970	素材
STANLEY BLACK & DECKER INC	261	367	4,366	566,688	資本財
TRAVELERS COS INC/THE	425	570	9,834	1,276,283	保険
SOUTHERN CO/THE	1,745	2,426	17,952	2,329,686	公益事業
AT&T INC	11,750	16,394	31,853	4,133,664	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	515	739	4,124	535,228	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	569	854	5,665	735,266	各種金融
SYSCO CORP	813	1,168	9,821	1,274,479	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	243	351	2,206	286,293	素材
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,513	2,121	34,939	4,534,160	半導体・半導体製造装置
TERADYNE INC	270	364	3,657	474,620	半導体・半導体製造装置
GLOBE LIFE INC	154	225	2,194	284,787	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1,207	1,642	8,383	1,087,981	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	653	905	47,109	6,113,454	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	362	500	3,113	404,006	資本財
UNION PACIFIC CORP	1,110	1,477	33,074	4,292,044	運輸
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	2,502	3,441	31,314	4,063,678	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,562	2,165	105,288	13,663,341	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	2,233	3,231	15,661	2,032,398	銀行
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,179	1,676	29,747	3,860,394	運輸
VALERO ENERGY CORP	689	942	11,344	1,472,194	エネルギー
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	916	1,404	3,748	486,432	メディア・娯楽
VF CORP	543	782	3,549	460,675	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	215	306	4,839	628,014	素材
WILLIAMS COS INC	1,968	2,803	9,660	1,253,707	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,238	1,653	7,169	930,428	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	512	712	7,252	941,214	公益事業
WALMART INC	2,335	3,526	52,059	6,755,821	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO	6,470	9,160	38,997	5,060,719	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	696	957	15,114	1,961,372	商業・専門サービス
WATERS CORP	98	145	4,532	588,178	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHIRLPOOL CORP	99	143	2,541	329,787	耐久消費財・アパレル
XCEL ENERGY INC	850	1,240	9,173	1,190,411	公益事業
KEYCORP	1,659	2,123	3,944	511,920	銀行
CARMAX INC	266	390	3,502	454,534	小売

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	335	473	5,366	696,406	ヘルスケア機器・サービス
YUM! BRANDS INC	491	659	7,185	932,525	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	1,977	2,763	15,198	1,972,290	小売
CLOROX COMPANY	203	293	4,548	590,265	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP	188	250	3,549	460,646	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	466	627	8,520	1,105,678	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	1,253	2,023	2,741	355,786	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	1,022	1,407	13,148	1,706,269	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	830	1,078	3,850	499,631	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	540	820	7,733	1,003,564	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	1,192	1,587	5,691	738,625	銀行
INTEL CORP	6,757	9,347	40,035	5,195,380	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	6,958	9,692	47,152	6,119,037	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	143	216	8,028	1,041,922	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	726	1,015	49,677	6,446,689	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	1,508	2,081	21,629	2,806,886	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	482	637	7,675	996,012	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	478	681	6,144	797,385	食品・飲料・タバコ
NORTONLIFELOCK INC	981	1,304	3,175	412,057	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	593	836	7,346	953,338	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	434	1,251	8,079	1,048,425	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	2,068	2,934	31,673	4,110,318	耐久消費財・アパレル
EXACT SCIENCES CORP	258	384	1,854	240,645	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	959	1,296	31,200	4,048,847	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NORTHERN TRUST CORP	322	457	4,661	604,892	各種金融
MICROSOFT CORP	11,841	16,399	427,284	55,448,681	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	139	195	4,672	606,391	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	943	1,345	10,851	1,408,204	ヘルスケア機器・サービス
STARBUCKS CORP	1,936	2,696	18,889	2,451,309	消費者サービス
ORACLE CORP	3,225	3,770	26,784	3,475,823	ソフトウェア・サービス
NETFLIX INC	728	1,019	16,964	2,201,537	メディア・娯楽
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	121	152	9,256	1,201,272	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,275	1,792	13,887	1,802,121	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	270	381	3,784	491,087	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	229	313	2,650	343,903	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	188	265	5,086	660,074	小売
POOL CORP	65	95	3,647	473,375	小売
LAM RESEARCH CORP	238	325	14,535	1,886,309	半導体・半導体製造装置
COPART INC	342	479	5,127	665,409	商業・専門サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	143	202	1,658	215,252	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WYNN RESORTS LTD	165	222	1,311	170,205	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	7,529	10,474	41,731	5,415,541	メディア・娯楽
XILINX INC	395	—	—	—	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	560	783	6,469	839,560	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	343	518	1,953	253,444	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	124	171	4,397	570,684	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	2,067	2,891	17,509	2,272,219	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	201	298	2,984	387,309	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	193	820	17,300	2,245,101	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	432	619	22,049	2,861,306	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	87	134	5,927	769,264	銀行
PAYCHEX INC	520	745	8,809	1,143,211	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ON SEMICONDUCTOR	675	980	5,078	659,034	半導体・半導体製造装置
SIGNATURE BANK	—	147	2,861	371,360	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	181	234	2,871	372,602	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	158	220	5,976	775,628	運輸
AUTODESK INC	363	510	9,217	1,196,211	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	237	344	756	98,118	電気通信サービス
SALESFORCE INC	1,500	2,253	36,334	4,715,184	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL A	668	691	157,141	20,392,290	メディア・娯楽
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	89	122	3,857	500,567	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MARKETAXESS HOLDINGS INC	61	85	2,168	281,466	各種金融
GARMIN LTD	235	362	3,554	461,230	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	425	599	3,690	478,965	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	1,865	2,574	34,061	4,420,151	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	421	563	4,143	537,646	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	253	355	9,262	1,202,040	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	437	—	—	—	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	703	1,049	221,167	28,700,893	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	380	520	5,974	775,344	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	231	287	3,815	495,185	ヘルスケア機器・サービス
KLA CORP	257	350	10,929	1,418,319	半導体・半導体製造装置
STEEL DYNAMICS INC	373	470	3,548	460,458	素材
CERNER CORP	498	655	6,156	798,908	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	165	239	3,991	518,024	ソフトウェア・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	439	607	7,457	967,724	商業・専門サービス
EBAY INC	1,138	1,417	6,602	856,840	小売
NVIDIA CORP	1,020	5,748	95,589	12,404,701	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	383	524	8,188	1,062,604	小売
BOOKING HOLDINGS INC	67	94	19,559	2,538,174	消費者サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	2,258	2,994	93,299	12,107,500	各種金融
TRUIST FINANCIAL CORP	2,223	3,071	14,388	1,867,168	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	1,296	1,840	7,807	1,013,168	各種金融
BORGWARNER INC	396	544	1,963	254,854	自動車・自動車部品
JM SMUCKER CO/THE	184	260	3,757	487,647	食品・飲料・タバコ
AMERISOURCEBERGEN CORP	262	345	5,574	723,343	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	106	126	2,290	297,300	保険
AMEREN CORPORATION	419	594	5,549	720,149	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	827	1,167	11,652	1,512,184	公益事業
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	905	1,283	10,824	1,404,638	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	474	631	6,930	899,405	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	554	777	2,376	308,384	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
F5 INC	96	149	2,451	318,187	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	405	578	1,010	131,111	メディア・娯楽
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	266	359	3,526	457,578	ソフトウェア・サービス
PLUG POWER INC	752	1,228	1,652	214,403	資本財
NETAPP INC	365	532	3,716	482,255	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	307	442	3,272	424,626	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENTEGRIS INC	—	298	3,026	392,777	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	256	334	6,387	828,877	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	241	337	7,184	932,273	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	790	1,094	41,535	5,390,061	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	431	586	13,779	1,788,161	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	1,722	2,741	2,023	262,535	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	882	1,220	8,837	1,146,779	ソフトウェア・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	280	400	4,325	561,353	運輸
FASTENAL CO	973	1,352	6,841	887,815	資本財
FISERV INC	943	1,371	12,695	1,647,530	ソフトウェア・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,738	2,289	1,378	178,850	メディア・娯楽
APPLE INC	28,033	37,718	552,580	71,708,380	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	250	364	4,561	591,909	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,676	3,444	4,402	571,331	銀行
COSTAR GROUP INC	66	881	4,779	620,194	商業・専門サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	355	—	—	—	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	217	285	3,088	400,781	運輸
LUMEN TECHNOLOGIES INC	1,510	1,975	2,095	271,958	電気通信サービス
ONEOK INC	726	1,004	6,204	805,158	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY	381	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	216	321	3,524	457,331	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	109	140	2,824	366,526	小売
CONSTELLATION BRANDS INC-A	281	374	9,219	1,196,454	食品・飲料・タバコ
NVR INC	6	7	3,165	410,782	耐久消費財・アパレル
COOPER COS INC/THE	86	117	3,709	481,383	ヘルスケア機器・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	998	1,347	9,213	1,195,579	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	232	479	3,196	414,867	保険
DISCOVERY INC - A	255	—	—	—	メディア・娯楽
MONSTER BEVERAGE CORP	665	927	7,877	1,022,255	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA GROUP INC	219	329	4,383	568,843	消費者サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	361	478	4,575	593,826	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	596	829	1,900	246,650	電気通信サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	189	257	6,602	856,780	各種金融
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	443	656	2,605	338,083	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	925	1,294	12,241	1,588,577	各種金融
NASDAQ INC	196	267	3,834	497,647	各種金融
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	270	371	3,127	405,881	メディア・娯楽
AUTOLIV INC	129	—	—	—	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	542	752	5,879	763,030	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	44	65	8,455	1,097,245	消費者サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	501	733	4,760	617,807	食品・飲料・タバコ
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	73	102	3,951	512,773	半導体・半導体製造装置
ARROW ELECTRONICS INC	122	150	1,860	241,414	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN & BROWN INC	383	547	3,070	398,477	保険
CUMMINS INC	248	327	6,417	832,842	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	211	286	3,745	486,025	商業・専門サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	105	144	4,649	603,357	素材
ALLIANT ENERGY CORP	415	585	3,409	442,447	公益事業
MASTERCARD INC - A	1,466	2,017	65,732	8,530,154	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	670	830	1,372	178,092	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	218	313	3,168	411,173	商業・専門サービス
AERCAP HOLDINGS NV	—	293	1,259	163,461	資本財
IPG PHOTONICS CORP	57	101	954	123,808	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	635	878	5,222	677,722	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	333	647	289	37,630	消費者サービス
HEICO CORP	72	96	1,285	166,870	資本財
TRANSDIGM GROUP INC	84	123	7,026	911,787	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	189	276	3,731	484,270	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
INSULET CORP	112	160	2,996	388,791	ヘルスケア機器・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	212	290	5,866	761,245	保険
BLACKSTONE INC	1,113	1,578	15,267	1,981,298	各種金融
TE CONNECTIVITY LTD	549	747	9,121	1,183,694	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	511	671	7,030	912,403	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	206	269	7,863	1,020,427	耐久消費財・アパレル
MERCADOLIBRE INC	74	105	7,163	929,561	小売
VMWARE INC-CLASS A	132	494	4,858	630,516	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	400	511	3,193	414,385	保険
SEAGEN INC	204	317	3,796	492,715	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MASIMO CORP	85	135	1,659	215,295	ヘルスケア機器・サービス
ULTA BEAUTY INC	91	122	4,586	595,201	小売
LKQ CORP	460	658	3,211	416,775	小売
HORMEL FOODS CORP	472	683	3,568	463,117	食品・飲料・タバコ
ESSENTIAL UTILITIES INC	370	576	2,488	322,964	公益事業
EASTMAN CHEMICAL CO	223	310	3,162	410,430	素材
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	350	454	10,833	1,405,854	資本財
HUMANA INC	218	296	12,786	1,659,254	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	395	549	2,297	298,155	公益事業
INVESCO LTD	622	733	1,250	162,268	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	288	410	3,105	403,043	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	198	253	1,356	176,011	各種金融
MSCI INC	137	185	7,197	934,070	各種金融
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	322	463	2,587	335,719	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,568	3,576	37,058	4,809,101	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	2,788	3,839	75,526	9,801,126	ソフトウェア・サービス
KEURIG DR PEPPER INC	905	1,622	6,072	788,054	食品・飲料・タバコ
COTERRA ENERGY INC	683	1,728	5,114	663,674	エネルギー
T-MOBILE US INC	924	1,435	17,692	2,296,007	電気通信サービス
DISCOVERY INC-C	496	—	—	—	メディア・娯楽
RESMED INC	241	338	6,474	840,209	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	144	183	4,493	583,088	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	374	520	6,269	813,656	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	653	895	4,094	531,364	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	422	576	5,630	730,729	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	132	188	3,202	415,573	運輸
FMC CORP	204	292	3,383	439,124	素材
WABTEC CORP	291	405	3,412	442,804	資本財
EVERSOURCE ENERGY	558	775	6,926	898,908	公益事業
CROWN HOLDINGS INC	224	287	2,908	377,421	素材
DELTA AIR LINES INC	253	329	1,248	162,029	運輸
AMERICAN WATER WORKS CO INC	292	409	5,893	764,842	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	252	343	5,998	778,401	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	411	537	12,275	1,593,030	小売
FORTINET INC	223	314	8,214	1,066,029	ソフトウェア・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	39	51	6,115	793,568	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENERAL MOTORS CO	2,130	3,009	11,215	1,455,398	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	461	621	10,615	1,377,591	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	431	606	6,512	845,102	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	64	97	2,007	260,493	資本財
NORDSON CORP	87	114	2,373	307,997	資本財
HCA HEALTHCARE INC	448	572	11,990	1,556,015	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
MARATHON PETROLEUM CORP	1,057	1,410	12,973	1,683,515	エネルギー
ZILLOW GROUP INC - A	98	118	411	53,443	不動産
ATMOS ENERGY CORP	204	304	3,434	445,660	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	240	318	2,118	274,888	資本財
DEXCOM INC	161	226	7,138	926,394	ヘルスケア機器・サービス
XYLEM INC	296	430	3,481	451,805	資本財
ABIOMED INC	74	105	2,453	318,392	ヘルスケア機器・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	90	152	2,184	283,486	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	280	397	5,541	719,057	銀行
ALLEGHANY CORP	23	32	2,716	352,471	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	173	243	14,940	1,938,767	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	736	1,117	10,191	1,322,611	エネルギー
META PLATFORMS INC-CLASS A	3,962	5,441	102,698	13,327,212	メディア・娯楽
CMS ENERGY CORP	492	657	4,510	585,319	公益事業
ALBEMARLE CORP	182	266	5,668	735,603	素材
KINDER MORGAN INC	3,387	4,746	8,790	1,140,747	エネルギー
APTIV PLC	451	620	5,625	730,082	自動車・自動車部品
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	258	378	1,624	210,845	資本財
SPLUNK INC	258	382	3,366	436,869	ソフトウェア・サービス
HEICO CORP-CLASS A	116	164	1,770	229,737	資本財
OGE ENERGY CORP	317	—	—	—	公益事業
ABBVIE INC	2,911	4,065	61,779	8,017,084	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	59	110	4,286	556,293	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAREPTA THERAPEUTICS INC	115	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC	1,250	1,962	144,069	18,695,901	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	364	543	7,210	935,694	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	211	419	3,902	506,452	各種金融
ZOETIS INC	784	1,088	17,397	2,257,665	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	126	166	4,840	628,172	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	617	871	1,472	191,077	メディア・娯楽
SNAP-ON INC	84	128	2,702	350,661	資本財
PERKINELMER INC	177	268	3,821	495,851	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIO-TECHNE CORP	—	94	3,191	414,177	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TWITTER INC	1,319	1,842	8,490	1,101,856	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	118	175	3,118	404,734	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	299	450	7,800	1,012,222	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	321	458	19,276	2,501,559	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	124	170	2,077	269,567	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	141	171	3,898	505,859	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC	146	192	2,092	271,586	資本財
ALPHABET INC-CL C	316	657	149,845	19,445,390	メディア・娯楽
UNITED RENTALS INC	118	166	4,663	605,192	資本財
VOYA FINANCIAL INC	195	—	—	—	各種金融
IQVIA HOLDINGS INC	321	432	8,692	1,128,028	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	616	809	3,132	406,522	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	462	637	8,581	1,113,634	消費者サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	403	5,052	655,681	エネルギー
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	310	413	5,412	702,425	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LIBERTY BROADBAND-C	267	301	3,378	438,447	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-A	45	72	773	100,348	メディア・娯楽
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	195	254	2,677	347,499	メディア・娯楽
OWENS CORNING	177	214	1,892	245,640	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
PALO ALTO NETWORKS INC	159	227	10,607	1,376,523	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	858	1,259	4,449	577,424	各種金融
QORVO INC	186	249	2,518	326,847	半導体・半導体製造装置
IONIS PHARMACEUTICALS INC	209	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	311	481	7,593	985,467	保険
ARAMARK	411	501	1,642	213,169	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	679	1,116	4,244	550,837	銀行
LEAR CORP	96	134	1,666	216,296	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	191	274	3,307	429,224	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	345	—	—	—	素材
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	62	82	889	115,395	ソフトウェア・サービス
WESTROCK CO	456	610	3,067	398,052	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	1,099	1,544	6,718	871,801	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	1,835	2,569	19,318	2,506,918	ソフトウェア・サービス
EPAM SYSTEMS INC	95	135	4,013	520,817	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	81	119	3,181	412,924	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	241	397	1,409	182,864	不動産
HORIZON THERAPEUTICS PLC	360	492	4,317	560,278	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	2,054	2,892	4,506	584,814	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERCO	14	23	1,190	154,523	運輸
CDW CORP/DE	239	320	5,273	684,352	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	82	115	2,510	325,793	半導体・半導体製造装置
ARISTA NETWORKS INC	90	533	5,485	711,881	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNEX CORP	280	406	1,897	246,190	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSUNION	311	454	3,693	479,319	商業・専門サービス
GODADDY INC - CLASS A	266	394	2,738	355,367	ソフトウェア・サービス
ZENDESK INC	188	272	2,696	349,935	ソフトウェア・サービス
WAYFAIR INC- CLASS A	111	162	855	111,071	小売
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	265	411	1,609	208,835	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	148	135	529	68,747	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	338	459	2,687	348,743	メディア・娯楽
VAIL RESORTS INC	63	93	2,159	280,199	消費者サービス
BIO-RAD LABORATORIES-A	37	52	2,483	322,283	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA INC	61	88	2,874	373,062	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	230	288	12,940	1,679,259	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	141	198	6,637	861,361	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP	227	336	1,929	250,387	資本財
UGI CORP	350	516	1,965	255,047	公益事業
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	328	506	2,472	320,899	食品・飲料・タバコ
FORTIVE CORP	514	802	4,618	599,289	資本財
IHS MARKIT LTD	635	—	—	—	商業・専門サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	397	508	3,018	391,711	ソフトウェア・サービス
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	132	199	1,439	186,786	ソフトウェア・サービス
COUPA SOFTWARE INC	110	168	1,088	141,276	ソフトウェア・サービス
HOWMET AEROSPACE INC	624	908	3,046	395,310	資本財
LAMB WESTON HOLDINGS INC	232	—	—	—	食品・飲料・タバコ
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	103	—	—	—	保険
TELEFLEX INC	74	104	2,793	362,510	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	227	322	5,159	669,594	ヘルスケア機器・サービス
TWILIO INC - A	232	405	3,751	486,793	ソフトウェア・サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC	175	256	2,786	361,557	各種金融
SNAP INC - A	1,530	2,428	5,304	688,333	メディア・娯楽

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	213	—	—	—	保険
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	122	172	2,459	319,218	保険
ROLLINS INC	362	554	1,841	238,963	商業・専門サービス
XPO LOGISTICS INC	144	—	—	—	運輸
FAIR ISAAC CORP	46	60	2,126	275,917	ソフトウェア・サービス
BAKER HUGHES CO	1,102	1,915	6,222	807,466	エネルギー
OKTA INC	194	355	2,998	389,148	ソフトウェア・サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	899	1,216	7,707	1,000,196	素材
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	217	341	1,648	213,909	運輸
BLACK KNIGHT INC	258	343	2,383	309,305	ソフトウェア・サービス
SEA LTD-ADR	—	724	4,139	537,205	メディア・娯楽
BLOCK INC	633	1,176	8,379	1,087,458	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	717	1,033	2,510	325,748	公益事業
INGERSOLL-RAND INC	614	961	4,102	532,412	資本財
NOVOCURE LTD	142	211	1,227	159,242	ヘルスケア機器・サービス
HUBSPOT INC	74	107	3,337	433,102	ソフトウェア・サービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	66	97	3,330	432,164	ソフトウェア・サービス
PTC INC	181	261	2,693	349,570	ソフトウェア・サービス
ZSCALER INC	119	188	2,574	334,054	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	667	945	53,628	6,959,330	半導体・半導体製造装置
EVERGY INC	392	515	3,455	448,364	公益事業
ALTICE USA INC- A	427	—	—	—	メディア・娯楽
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	67	1,001	4,339	563,092	ソフトウェア・サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	41	58	952	123,623	保険
DOCUSIGN INC	292	469	3,173	411,778	ソフトウェア・サービス
TELADOC HEALTH INC	186	306	879	114,196	ヘルスケア機器・サービス
LINDE PLC	866	1,177	35,371	4,590,104	素材
WIX.COM LTD	89	117	686	89,123	ソフトウェア・サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	647	859	2,338	303,524	各種金融
BURLINGTON STORES INC	108	147	2,561	332,358	小売
KKR & CO INC	841	1,216	6,101	791,759	各種金融
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	669	968	2,015	261,570	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIGNA CORP	595	762	19,837	2,574,297	ヘルスケア機器・サービス
DELL TECHNOLOGIES -C	398	649	2,882	374,081	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—	496	2,398	311,279	消費者サービス
MONGODB INC	84	136	3,295	427,634	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS A	536	710	2,361	306,404	メディア・娯楽
FOX CORP - CLASS B	273	357	1,093	141,958	メディア・娯楽
DOW INC	1,234	1,704	11,382	1,477,157	素材
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	321	490	4,156	539,396	ソフトウェア・サービス
AVALARA INC	142	180	1,288	167,165	ソフトウェア・サービス
DROPBOX INC-CLASS A	533	648	1,283	166,572	ソフトウェア・サービス
STERIS PLC	138	232	4,951	642,514	ヘルスケア機器・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	1,613	3,401	7,676	996,212	運輸
CORTEVA INC	1,213	1,694	9,084	1,178,916	素材
AMCOR PLC	2,577	3,406	4,261	553,044	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	294	453	6,224	807,717	ソフトウェア・サービス
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	738	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	140	252	1,593	206,791	各種金融
ROKU INC	182	272	2,141	277,912	メディア・娯楽
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	216	289	2,314	300,356	商業・専門サービス
DATADOG INC - CLASS A	284	498	4,881	633,429	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
LYFT INC-A	—	566	1,004	130,327	運輸
PINTEREST INC- CLASS A	851	1,279	2,417	313,744	メディア・娯楽
CABLE ONE INC	7	14	1,514	196,584	メディア・娯楽
CARVANA CO	102	234	703	91,293	小売
CHEWY INC - CLASS A	127	209	495	64,280	小売
PELOTON INTERACTIVE INC-A	390	641	791	102,733	耐久消費財・アパレル
ETSY INC	214	296	2,306	299,276	小売
AVANTOR INC	865	1,250	3,730	484,065	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MODERNA INC	460	795	9,820	1,274,449	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
10X GENOMICS INC-CLASS A	107	164	651	84,554	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CLARIVATE PLC	—	927	1,265	164,240	商業・専門サービス
CERIDIAN HCM HOLDING INC	219	324	1,631	211,715	ソフトウェア・サービス
DYNATRACE INC	288	387	1,167	151,559	ソフトウェア・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	319	600	3,290	427,010	ソフトウェア・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	121	171	1,056	137,045	ソフトウェア・サービス
RPM INTERNATIONAL INC	205	314	2,630	341,315	素材
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	2,322	3,087	2,016	261,656	各種金融
AGNC INVESTMENT CORP	974	1,191	1,446	187,657	各種金融
BILL.COM HOLDINGS INC	—	179	1,748	226,959	ソフトウェア・サービス
PPD INC	212	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENERAC HOLDINGS INC	102	146	2,990	388,026	資本財
AON PLC-CLASS A	376	506	13,923	1,806,863	保険
OTIS WORLDWIDE CORP	663	910	6,634	860,975	資本財
CARRIER GLOBAL CORP	1,344	1,903	7,155	928,605	資本財
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	285	—	—	—	各種金融
CARLYLE GROUP INC/THE	244	373	1,325	171,946	各種金融
CATALENT INC	265	404	3,732	484,415	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MATCH GROUP INC	407	608	4,245	550,944	メディア・娯楽
IAC/INTERACTIVECORP	129	176	1,368	177,624	メディア・娯楽
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	—	613	2,468	320,340	メディア・娯楽
SNOWFLAKE INC-CLASS A	40	493	6,558	851,035	ソフトウェア・サービス
SUNRUN INC	184	364	660	85,771	資本財
ASANA INC - CL A	—	146	273	35,505	ソフトウェア・サービス
FIVERR INTERNATIONAL LTD	—	64	194	25,239	小売
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	280	746	2,861	371,310	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITY SOFTWARE INC	—	119	361	46,865	ソフトウェア・サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	—	3,747	2,514	326,331	ソフトウェア・サービス
VIATRIS INC	2,012	2,698	2,804	363,890	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DRAFTKINGS INC - CL A	276	—	—	—	消費者サービス
ENPHASE ENERGY INC	197	299	4,125	535,335	半導体・半導体製造装置
DOORDASH INC - A	—	233	1,391	180,601	小売
KORNIT DIGITAL LTD	—	101	380	49,320	資本財
AIRBNB INC-CLASS A	84	686	7,977	1,035,289	消費者サービス
AFFIRM HOLDINGS INC	—	361	529	68,702	ソフトウェア・サービス
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	—	401	1,111	144,248	ソフトウェア・サービス
NOVAVAX INC	—	150	647	84,019	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UPSTART HOLDINGS INC	—	89	250	32,480	各種金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	1,317	1,900	9,982	1,295,476	半導体・半導体製造装置
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	—	447	3,455	448,390	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	—	120	352	45,720	各種金融
INMODE LTD	—	109	228	29,661	ヘルスケア機器・サービス
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	—	1,088	1,128	146,478	メディア・娯楽

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	－	367	756	98,108	自動車・自動車部品
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	－	82	440	57,164	各種金融
LUCID GROUP INC	－	882	1,222	158,637	自動車・自動車部品
ROBINHOOD MARKETS INC - A	－	397	323	41,987	各種金融
SOFI TECHNOLOGIES INC	－	1,130	620	80,505	各種金融
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	－	2,373	595	77,302	運輸
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	－	855	4,362	566,145	各種金融
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	－	26	1,648	213,953	銀行
WEBSTER FINANCIAL CORP	－	400	1,827	237,167	銀行
CONSTELLATION ENERGY	－	762	4,375	567,867	公益事業
WARNER BROS DISCOVERY INC	－	5,159	8,574	1,112,761	メディア・娯楽
DRAFTKINGS INC-CL A	－	749	769	99,826	消費者サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	2,004	2,711	1,274	165,349	不動産
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	345	516	2,732	354,560	資本財
小計 株数・金額	519,333	737,003	7,833,428	1,016,543,970	
小計 銘柄数＜比率＞	593	607	－	＜69.3%＞	
(カナダ)			千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA	2,338	3,270	41,329	4,130,059	銀行
IMPERIAL OIL LTD	480	570	3,547	354,519	エネルギー
THOMSON REUTERS CORP	281	377	4,541	453,786	商業・専門サービス
TC ENERGY CORP	1,572	2,256	15,753	1,574,262	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	589	792	5,106	510,324	電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	943	1,309	8,210	820,430	保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B	725	1,072	5,163	516,020	素材
BARRICK GOLD CORP	2,981	4,133	11,398	1,139,083	素材
BCE INC	247	154	1,050	104,969	電気通信サービス
BALLARD POWER SYSTEMS INC	362	584	459	45,928	資本財
BANK OF MONTREAL	1,061	1,481	19,463	1,944,967	銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	2,119	3,243	19,746	1,973,260	各種金融
BANK OF NOVA SCOTIA	2,004	2,785	22,441	2,242,582	銀行
BAUSCH HEALTH COS INC	513	631	831	83,044	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC	509	749	2,074	207,327	資本財
CAMECO CORP	665	944	2,550	254,890	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	720	1,004	13,688	1,367,895	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,982	2,696	20,500	2,048,603	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,172	1,628	23,540	2,352,440	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	89	129	2,119	211,785	小売
ENBRIDGE INC	3,347	4,632	25,966	2,594,881	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	41	55	3,670	366,835	保険
CGI INC	380	494	4,998	499,479	ソフトウェア・サービス
IGM FINANCIAL INC	188	207	743	74,323	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	277	370	4,117	411,484	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	3,146	4,446	10,826	1,081,843	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	461	679	4,979	497,562	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	551	766	6,809	680,497	銀行
ONEX CORPORATION	119	163	1,165	116,495	各種金融
POWER CORP OF CANADA	958	1,256	4,433	443,057	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	775	1,029	3,501	349,923	メディア・娯楽
SUNCOR ENERGY INC	2,581	3,391	15,683	1,567,239	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	125	185	2,755	275,361	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	225	2,139	19,094	1,908,148	運輸
AGNICO EAGLE MINES LTD	399	1,079	7,442	743,725	素材

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
KINROSS GOLD CORP	1,919	2,843	1,592	159,096	素材
GREAT-WEST LIFECO INC	445	684	2,260	225,903	保険
TMX GROUP LTD	94	125	1,656	165,559	各種金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	337	428	1,636	163,552	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	387	615	1,579	157,821	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	866	1,216	772	77,161	ソフトウェア・サービス
TELUS CORP	501	1,151	3,577	357,480	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	959	1,364	4,509	450,622	素材
YAMANA GOLD INC	1,646	—	—	—	素材
FORTIS INC	761	1,089	6,882	687,766	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	1,392	—	—	—	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	1,105	1,542	1,555	155,478	素材
PAN AMERICAN SILVER CORP	358	501	1,428	142,785	素材
TORONTO-DOMINION BANK	2,977	4,182	38,754	3,872,746	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	319	431	7,851	784,560	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	720	1,016	5,482	547,849	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	302	417	1,714	171,350	食品・生活必需品小売り
CANADIAN UTILITIES LTD-A	232	346	1,351	135,087	公益事業
METRO INC/CN	401	591	4,033	403,075	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	449	661	3,087	308,536	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	244	405	7,084	707,970	保険
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	168	270	2,046	204,489	商業・専門サービス
CENOVUS ENERGY INC	2,039	2,942	7,390	738,513	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	—	744	5,141	513,818	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	878	1,224	5,969	596,560	エネルギー
DOLLARAMA INC	464	669	4,557	455,403	小売
KEYERA CORP	319	565	1,837	183,609	エネルギー
ALTAGAS LTD	413	552	1,562	156,106	公益事業
ATCO LTD -CLASS I	170	—	—	—	公益事業
INTER PIPELINE LTD	729	—	—	—	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	34	47	9,093	908,691	ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN	478	643	4,175	417,272	消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	132	230	2,552	255,075	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	238	351	1,899	189,863	素材
HYDRO ONE LTD	555	691	2,392	239,125	公益事業
EMERA INC	396	605	3,791	378,888	公益事業
IVANHOE MINES LTD-CL A	—	1,429	1,407	140,657	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	182	264	10,940	1,093,276	ソフトウェア・サービス
NUTRIEN LTD	928	1,310	16,535	1,652,413	素材
WSP GLOBAL INC	202	261	3,535	353,303	資本財
CANOPY GROWTH CORP	365	365	235	23,489	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IA FINANCIAL CORP INC	159	265	1,738	173,744	保険
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	433	—	—	—	素材
QUEBECOR INC -CL B	259	393	1,104	110,394	メディア・娯楽
B2GOLD CORP	1,686	—	—	—	素材
AIR CANADA	345	345	725	72,502	運輸
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	952	1,618	2,829	282,790	公益事業
PARKLAND CORP	257	373	1,247	124,643	エネルギー
SSR MINING INC	402	—	—	—	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	208	294	1,330	132,932	公益事業
FIRSTSERVICE CORP	61	105	1,594	159,341	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	291	385	1,362	136,156	商業・専門サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
NORTHLAND POWER INC	328	519	1,983	198,171	公益事業
TOROMONT INDUSTRIES LTD	143	181	1,957	195,614	資本財
LIGHTSPEED COMMERCE INC	—	232	476	47,573	ソフトウェア・サービス
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	—	178	955	95,465	ソフトウェア・サービス
TFI INTERNATIONAL INC	—	185	1,860	185,942	運輸
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	—	1,930	10,599	1,059,214	食品・生活必需品小売り
小計 株数・金額	65,555	90,472	551,350	55,096,494	
小計 銘柄数<比率>	87	86	—	<3.8%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
COMMERZBANK AG	1,614	2,592	1,625	221,973	銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	3,332	4,709	4,386	599,114	各種金融
SIEMENS AG-REG	1,260	1,758	20,543	2,805,877	資本財
RWE AG	1,076	1,470	5,940	811,319	公益事業
BASF SE	1,514	2,121	10,524	1,437,392	素材
VOLKSWAGEN AG	59	70	1,386	189,307	自動車・自動車部品
MERCEDES-BENZ GROUP AG	1,414	1,972	12,599	1,720,806	自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	295	401	2,540	346,961	家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE	3,740	5,096	5,213	712,053	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	537	778	6,402	874,391	自動車・自動車部品
BAYER AG-REG	1,620	2,259	13,111	1,790,772	医薬品・ﾊﾞｲｵﾃｸﾉﾛｼﾞｰ・ﾗｲﾌｻｲｴﾝｽ
ALLIANZ SE-REG	678	937	19,237	2,627,461	保険
CONTINENTAL AG	174	268	1,717	234,553	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	2,155	3,041	8,139	1,111,660	半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	246	348	2,655	362,620	自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	499	1,203	831	113,611	運輸
DEUTSCHE POST AG-REG	1,635	2,303	8,710	1,189,627	運輸
SAP SE	1,719	2,405	22,390	3,058,158	ソフトウェア・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	306	445	7,219	986,098	各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	366	472	2,769	378,313	ヘルスケア機器・サービス
ADIDAS AG	313	445	8,093	1,105,385	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	5,491	7,428	13,007	1,776,573	電気通信サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	234	323	7,353	1,004,400	保険
BEIERSDORF AG	168	226	2,114	288,747	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	244	327	1,789	244,448	素材
MERCK KGAA	210	293	4,972	679,175	医薬品・ﾊﾞｲｵﾃｸﾉﾛｼﾞｰ・ﾗｲﾌｻｲｴﾝｽ
VOLKSWAGEN AG-PREF	297	426	6,257	854,647	自動車・自動車部品
PUMA SE	159	256	1,686	230,294	耐久消費財・アパレル
LANXESS AG	134	183	658	89,933	素材
FRESENIUS SE & CO KGAA	683	1,009	3,438	469,667	ヘルスケア機器・サービス
HOCHTIEF AG	31	—	—	—	資本財
DEUTSCHE WOHNEN SE	567	—	—	—	不動産
GEA GROUP AG	255	327	1,138	155,448	資本財
SYMRISE AG	213	316	3,197	436,653	素材
HENKEL AG & CO KGAA	186	225	1,411	192,825	家庭用品・パーソナル用品
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	188	188	585	80,005	電気通信サービス
RATIONAL AG	9	12	677	92,540	資本財
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	114	118	887	121,230	自動車・自動車部品
HANNOVER RUECK SE	97	133	1,926	263,149	保険
BRENNTAG SE	252	361	2,483	339,215	資本財
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	68	86	976	133,353	ヘルスケア機器・サービス
FUCHS PETROLUB SE-PREF	99	158	472	64,555	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	1,682	1,854	540	73,870	電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
LEG IMMOBILIEN SE	120	165	1,672	228,494	不動産
VONOVIA SE	902	1,677	5,731	782,808	不動産
EVONIK INDUSTRIES AG	332	551	1,398	191,053	素材
ZALANDO SE	267	483	1,554	212,272	小売
COVESTRO AG	297	443	1,732	236,565	素材
UNIPER SE	316	242	545	74,561	公益事業
KION GROUP AG	125	161	743	101,546	資本財
MTU AERO ENGINES AG	92	122	2,202	300,799	資本財
DELIVERY HERO SE	213	351	900	122,922	小売
SCOUT24 SE	178	194	1,166	159,266	メディア・娯楽
SARTORIUS AG-VORZUG	56	62	2,077	283,679	ヘルスケア機器・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	466	680	3,512	479,737	ヘルスケア機器・サービス
NEMETSCHEK SE	84	125	803	109,779	ソフトウェア・サービス
BECHTLE AG	41	165	672	91,817	ソフトウェア・サービス
KNORR-BREMSE AG	115	187	1,241	169,631	資本財
HELLOFRESH SE	234	343	1,198	163,633	食品・生活必需品小売り
TEAMVIEWER AG	254	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SIEMENS ENERGY AG	640	852	1,382	188,871	資本財
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	—	925	2,414	329,777	資本財
小計 株数・金額	40,697	57,097	252,565	34,495,419	
小計 銘柄数<比率>	61	59	—	<2.4%>	
(ユーロ…イタリア)					
ASSICURAZIONI GENERALI	1,803	2,564	4,554	622,082	保険
INTESA SANPAOLO	27,554	39,037	7,573	1,034,349	銀行
TELECOM ITALIA SPA	14,225	19,437	526	71,969	電気通信サービス
ENI SPA	4,086	5,871	7,996	1,092,205	エネルギー
UNICREDIT SPA	3,616	4,889	4,582	625,856	銀行
ENEL SPA	13,386	18,792	11,237	1,534,875	公益事業
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	172	230	966	131,984	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ATLANTIA SPA	821	1,186	2,710	370,204	運輸
MEDIOBANCA SPA	1,049	1,335	1,311	179,160	銀行
SNAM SPA	3,341	4,532	2,375	324,389	公益事業
TELECOM ITALIA-RSP	8,477	—	—	—	電気通信サービス
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	2,319	3,166	2,458	335,786	公益事業
PRYSMIAN SPA	395	571	1,624	221,865	資本財
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	478	716	740	101,146	電気通信サービス
POSTE ITALIANE SPA	877	1,111	1,020	139,367	保険
FINECOBANK SPA	982	1,339	1,641	224,135	銀行
MONCLER SPA	307	458	2,052	280,359	耐久消費財・アパレル
DIASORIN SPA	44	61	704	96,155	ヘルスケア機器・サービス
AMPLIFON SPA	211	281	967	132,091	ヘルスケア機器・サービス
NEXI SPA	745	1,171	1,097	149,955	ソフトウェア・サービス
小計 株数・金額	84,895	106,755	56,142	7,667,943	
小計 銘柄数<比率>	20	19	—	<0.5%>	
(ユーロ…フランス)					
MICHELIN (CGDE)	287	392	4,617	630,671	自動車・自動車部品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	457	637	36,520	4,987,922	耐久消費財・アパレル
AXA SA	3,202	4,483	10,293	1,405,948	保険
DANONE	1,031	1,501	8,254	1,127,376	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	998	1,503	3,078	420,477	食品・生活必需品小売り
VIVENDI SE	1,337	1,841	2,024	276,474	メディア・娯楽
SOCIETE GENERALE SA	1,374	1,919	4,343	593,201	銀行

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIR LIQUIDE SA	781	1,088	17,237	2,354,360	素材
TOTALENERGIES SE	4,144	5,744	28,925	3,950,654	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	849	1,184	6,263	855,425	資本財
VINCI SA	859	1,231	11,211	1,531,239	資本財
SANOFI	1,869	2,636	25,815	3,525,937	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	868	1,552	4,137	565,167	公益事業
L'OREAL	414	576	18,672	2,550,251	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA	307	405	1,240	169,369	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	885	1,239	15,810	2,159,385	資本財
BNP PARIBAS	1,850	2,580	13,456	1,837,820	銀行
ESSILORLUXOTTICA	472	663	9,736	1,329,832	耐久消費財・アパレル
CAPGEMINI SE	260	371	6,679	912,230	ソフトウェア・サービス
VALEO	378	485	864	118,007	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	51	72	7,653	1,045,259	耐久消費財・アパレル
SODEXO SA	142	179	1,248	170,510	消費者サービス
KERING	125	175	8,049	1,099,454	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SE	214	1,535	5,869	801,654	ソフトウェア・サービス
ATOS SE	164	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ORANGE	3,236	4,641	5,415	739,603	電気通信サービス
CNP ASSURANCES	312	312	652	89,083	保険
SAFRAN SA	535	788	7,555	1,031,863	資本財
RENAULT SA	294	455	1,045	142,861	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	385	500	2,692	367,773	メディア・娯楽
BOUYGUES SA	382	464	1,449	197,973	資本財
THALES SA	172	237	2,793	381,567	資本財
PERNOD RICARD SA	350	481	8,921	1,218,517	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	1,849	2,921	2,968	405,371	銀行
ENGIE	3,060	4,231	4,777	652,541	公益事業
ALSTOM	425	796	1,741	237,843	資本財
ARKEMA	115	142	1,644	224,538	素材
LEGRAND SA	433	608	4,854	663,040	資本財
SCOR SE	271	—	—	—	保険
ADP	51	75	976	133,354	運輸
EDF	999	1,427	1,221	166,841	公益事業
NATIXIS	1,392	—	—	—	各種金融
WENDEL	48	48	436	59,631	各種金融
BUREAU VERITAS SA	453	654	1,668	227,911	商業・専門サービス
EURAZEO SE	71	71	493	67,455	各種金融
SUEZ	550	—	—	—	公益事業
EIFFAGE	133	197	1,828	249,702	資本財
ILIAD SA	27	—	—	—	電気通信サービス
ORPEA	82	113	379	51,825	ヘルスケア機器・サービス
BIOMERIEUX	68	97	860	117,539	ヘルスケア機器・サービス
GETLINK SE	681	1,082	1,854	253,313	運輸
EDENRED	392	576	2,535	346,351	ソフトウェア・サービス
REMY COINTREAU	33	47	817	111,719	食品・飲料・タバコ
BOLLORE SE	1,373	1,928	906	123,875	メディア・娯楽
DASSAULT AVIATION SA	4	46	724	99,011	資本財
SEB SA	36	50	540	73,798	耐久消費財・アパレル
IPSEN	67	98	926	126,571	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA	105	145	803	109,735	各種金融
FAURECIA	199	264	566	77,432	自動車・自動車部品

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEPERFORMANCE		94	135	4,208	574,850	商業・専門サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT		149	209	871	118,998	メディア・娯楽
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		49	62	1,830	249,959	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WORLDLINE SA		379	561	1,995	272,525	ソフトウェア・サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		127	175	570	77,870	消費者サービス
EUROAPI SASU		—	110	151	20,722	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	42,733	58,768	325,686	44,482,214	
	銘柄数<比率>	64	60	—	<3.0%>	
(ユーロ…オランダ)						
QIAGEN N.V.		358	552	2,350	321,049	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV		1,759	2,369	3,194	436,318	資本財
STELLANTIS NV		3,363	4,721	6,246	853,210	自動車・自動車部品
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		920	1,149	1,140	155,775	食品・飲料・タバコ
FERRARI NV		204	286	5,273	720,235	自動車・自動車部品
EXOR NV		167	240	1,546	211,205	各種金融
AIRBUS SE		973	1,355	14,573	1,990,497	資本財
STMICROELECTRONICS NV		1,072	1,601	5,503	751,687	半導体・半導体製造装置
EURONEXT NV		—	186	1,337	182,637	各種金融
WOLTERS KLUWER		451	606	5,630	769,035	商業・専門サービス
KONINKLIJKE KPN NV		5,617	7,904	2,601	355,276	電気通信サービス
AKZO NOBEL N.V.		312	415	3,366	459,758	素材
HEINEKEN NV		433	594	5,557	759,025	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV		1,498	2,146	5,049	689,647	ヘルスケア機器・サービス
AEGON NV		2,833	4,201	2,029	277,211	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		1,785	2,359	6,194	846,005	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD NV		185	270	1,330	181,715	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV		210	249	1,821	248,779	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV		280	409	5,836	797,092	素材
ING GROEP NV		6,488	8,789	7,807	1,066,298	銀行
ASML HOLDING NV		702	951	48,937	6,683,910	半導体・半導体製造装置
VOPAK		123	—	—	—	エネルギー
NN GROUP NV		475	631	2,909	397,313	保険
ABN AMRO BANK NV-CVA		753	997	1,108	151,356	銀行
IMCD NV		—	124	1,617	220,858	資本財
ASM INTERNATIONAL NV		76	103	2,848	389,053	半導体・半導体製造装置
ADYEN NV		30	44	6,123	836,302	ソフトウェア・サービス
JUST EAT TAKEAWAY		204	386	688	94,075	小売
PROSUS NV		805	2,170	9,386	1,282,067	小売
JDE PEET'S NV		111	243	689	94,190	食品・飲料・タバコ
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV		—	1,730	3,399	464,254	メディア・娯楽
ARGENX SE		79	103	2,879	393,213	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	32,279	47,898	168,978	23,079,060	
	銘柄数<比率>	29	31	—	<1.6%>	
(ユーロ…スペイン)						
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		365	630	838	114,456	資本財
ENDESA SA		524	680	1,343	183,489	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		378	491	1,208	165,060	資本財
IBERDROLA SA		10,062	13,400	14,572	1,990,312	公益事業
TELEFONICA SA		8,525	12,354	5,753	785,824	電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA		28,504	40,011	10,775	1,471,671	銀行
REPSOL SA		2,439	3,395	4,839	661,041	エネルギー
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		11,254	15,366	7,295	996,400	銀行

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
NATURGY ENERGY GROUP SA		470	421	1,190	162,619	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		1,771	2,566	5,120	699,350	小売
FERROVIAL SA		786	1,125	2,631	359,366	資本財
FERROVIAL SA-RTS		—	1,125	30	4,170	資本財
ENAGAS SA		423	580	1,202	164,207	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		715	1,062	2,015	275,285	公益事業
CAIXABANK SA		7,152	9,891	2,922	399,210	銀行
GRIFOLS SA		493	636	1,226	167,505	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMADEUS IT GROUP SA		750	1,015	5,938	811,057	ソフトウェア・サービス
AENA SME SA		109	176	2,320	316,928	運輸
CELLNEX TELECOM SA		732	1,159	4,715	644,001	電気通信サービス
EDP RENOVAVEIS SA		—	625	1,309	178,846	公益事業
小計	株数・金額	75,459	106,718	77,250	10,550,807	
	銘柄数<比率>	18	20	—	<0.7%>	
(ユーロ…ベルギー)						
GALAPAGOS NV		73	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AGEAS		283	411	1,811	247,472	保険
UCB SA		201	291	2,983	407,462	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		176	263	2,231	304,722	各種金融
UMICORE		315	415	1,669	227,991	素材
COLRUYT SA		97	97	334	45,727	食品・生活必需品小売り
KBC GROUP NV		410	587	3,239	442,437	銀行
SOLVAY SA		133	160	1,486	202,988	素材
PROXIMUS		268	458	746	101,975	電気通信サービス
SOFINA		26	34	966	132,018	各種金融
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		1,262	2,014	10,629	1,451,793	食品・飲料・タバコ
ELIA GROUP SA/NV		56	78	1,182	161,445	公益事業
小計	株数・金額	3,305	4,813	27,280	3,726,036	
	銘柄数<比率>	12	11	—	<0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG		500	820	2,275	310,743	銀行
VERBUND AG		112	144	1,248	170,537	公益事業
OMV AG		241	363	1,703	232,691	エネルギー
VOESTALPINE AG		169	229	559	76,372	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		266	380	439	59,981	銀行
小計	株数・金額	1,290	1,937	6,225	850,325	
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
AROUNDTOWN SA		1,705	2,178	1,021	139,472	不動産
TENARIS SA		785	1,074	1,568	214,278	エネルギー
SES		684	—	—	—	メディア・娯楽
EUROFINS SCIENTIFIC		233	298	2,463	336,469	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCELORMITTAL		1,192	1,407	3,785	516,993	素材
INPOST SA		—	338	190	26,064	運輸
小計	株数・金額	4,601	5,296	9,029	1,233,277	
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ		9,635	12,156	5,608	766,062	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS		922	1,268	2,296	313,657	素材
UPM-KYMMENE OYJ		867	1,266	4,048	552,996	素材
FORTUM OYJ		704	1,090	1,761	240,620	公益事業
KESKO OYJ-B SHS		493	591	1,431	195,470	食品・生活必需品小売り

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
KONE OYJ-B		554	808	3,488	476,474	資本財
SAMPO OYJ-A SHS		761	1,139	5,057	690,761	保険
WARTSILA OYJ ABP		659	1,117	809	110,581	資本財
ELISA OYJ		237	350	1,881	257,010	電気通信サービス
NESTE OYJ		681	987	3,890	531,328	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		180	264	949	129,676	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	15,698	21,041	31,224	4,264,640	
	銘柄数<比率>	11	11	—	<0.3%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A		268	350	3,435	469,165	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC		242	341	2,640	360,632	資本財
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI		274	399	3,948	539,264	消費者サービス
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		404	604	2,276	310,863	素材
CRH PLC		1,277	1,749	6,434	878,787	素材
小計	株数・金額	2,468	3,445	18,734	2,558,714	
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		4,760	6,703	3,023	412,903	公益事業
JERONIMO MARTINS		425	587	1,154	157,726	食品・生活必需品小売り
GALP ENERGIA SGPS SA		840	1,122	1,196	163,484	エネルギー
小計	株数・金額	6,025	8,413	5,374	734,115	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>	
ユーロ計	株数・金額	309,456	422,186	978,492	133,642,554	
	銘柄数<比率>	233	229	—	<9.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC		27,987	36,130	5,322	845,838	銀行
BP PLC		32,582	42,664	17,914	2,847,218	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC		114,275	151,720	6,541	1,039,630	銀行
ASTRAZENECA PLC		2,114	3,342	33,516	5,326,764	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC		608	914	1,340	213,079	資本財
NEXT PLC		220	302	1,879	298,775	小売
DIAGEO PLC		3,765	5,011	18,841	2,994,489	食品・飲料・タバコ
BAE SYSTEMS PLC		5,182	6,993	5,208	827,843	資本財
UNILEVER PLC		4,231	5,543	20,457	3,251,271	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC		12,397	16,506	4,554	723,811	食品・生活必需品小売り
RELX PLC		3,119	4,139	9,517	1,512,552	商業・専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		1,145	1,528	9,757	1,550,810	家庭用品・パーソナル用品
HALMA PLC		631	849	1,862	295,940	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PRUDENTIAL PLC		4,201	5,929	5,586	887,909	保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		9,618	12,984	3,151	500,842	保険
SAGE GROUP PLC/THE		1,855	2,195	1,469	233,614	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC		32,804	43,951	21,951	3,488,783	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		3,697	4,687	15,770	2,506,373	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC		1,038	1,476	1,624	258,154	公益事業
SCHRODERS PLC		215	290	822	130,777	各種金融
NATWEST GROUP PLC		7,634	11,812	2,427	385,810	銀行
BHP GROUP PLC		3,399	—	—	—	素材
IMPERIAL BRANDS PLC		1,534	2,079	3,523	560,064	食品・飲料・タバコ
WPP PLC		2,004	2,502	2,403	381,993	メディア・娯楽
BT GROUP PLC		13,947	19,609	3,460	549,910	電気通信サービス
SSE PLC		1,681	2,262	4,164	661,850	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC		4,375	5,467	3,124	496,527	銀行

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	13,239	18,752	1,509	239,920	資本財
COMPASS GROUP PLC	2,872	3,812	6,458	1,026,426	消費者サービス
KINGFISHER PLC	3,237	4,503	1,111	176,628	小売
PEARSON PLC	1,243	1,566	1,190	189,256	メディア・娯楽
SEVERN TRENT PLC	379	555	1,696	269,564	公益事業
RIO TINTO PLC	1,810	2,408	12,902	2,050,661	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	8,078	10,971	19,090	3,034,016	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3I GROUP PLC	1,531	2,146	2,765	439,449	各種金融
VODAFONE GROUP PLC	43,207	59,203	7,036	1,118,377	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	3,561	—	—	—	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	2,645	3,513	812	129,203	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	6,357	8,022	3,298	524,183	保険
JOHNSON MATTHEY PLC	317	408	962	152,893	素材
RENTOKIL INITIAL PLC	3,071	4,170	2,118	336,717	商業・専門サービス
RSA INSURANCE GROUP LTD	1,542	—	—	—	保険
WHITBREAD PLC	338	412	1,075	170,870	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	5,676	7,884	9,454	1,502,540	公益事業
BUNZL PLC	530	710	2,063	328,013	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	1,981	2,780	9,446	1,501,301	素材
INTERTEK GROUP PLC	266	325	1,599	254,148	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	663	908	1,406	223,514	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	272	420	2,083	331,087	消費者サービス
PERSIMMON PLC	531	644	1,345	213,918	耐久消費財・アパレル
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	509	702	5,071	805,963	各種金融
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	208	250	982	156,133	耐久消費財・アパレル
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,578	2,200	1,054	167,614	耐久消費財・アパレル
SMITH & NEPHEW PLC	1,433	1,974	2,429	386,157	ヘルスケア機器・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	5,611	8,425	1,034	164,438	耐久消費財・アパレル
SHELL PLC	6,642	—	—	—	エネルギー
SHELL PLC	5,946	—	—	—	エネルギー
ABRDN PLC	3,508	4,461	824	131,095	各種金融
EXPERIAN PLC	1,481	1,973	5,252	834,825	商業・専門サービス
MONDI PLC	758	991	1,552	246,670	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	566	809	1,301	206,768	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC	621	789	1,106	175,887	素材
ADMIRAL GROUP PLC	303	466	1,043	165,846	保険
FRESNILLO PLC	281	—	—	—	素材
ST JAMES'S PLACE PLC	828	1,133	1,380	219,333	各種金融
GLENCORE PLC	16,142	21,484	10,226	1,625,330	素材
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	114	164	1,798	285,857	資本財
EVRAZ PLC	826	—	—	—	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	532	826	738	117,390	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC	221	307	2,090	332,204	素材
MELROSE INDUSTRIES PLC	7,647	9,717	1,095	174,135	資本財
COCA-COLA HBC AG-DI	342	444	709	112,785	食品・飲料・タバコ
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	2,009	—	—	—	保険
AVEVA GROUP PLC	196	266	560	89,015	ソフトウェア・サービス
ASHTEAD GROUP PLC	725	956	3,667	582,903	資本財
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	255	335	580	92,334	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OCADO GROUP PLC	794	1,062	811	129,030	食品・生活必需品小売り
AUTO TRADER GROUP PLC	1,594	2,010	1,120	178,057	メディア・娯楽
DCC PLC	151	232	1,419	225,660	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
ENTAIN PLC	961	1,191	1,531	243,454	消費者サービス
INFORMA PLC	2,340	3,092	1,667	265,093	メディア・娯楽
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	944	1,651	987	156,882	保険
FERGUSON PLC	361	475	4,466	709,878	資本財
M&G PLC	4,373	5,575	1,167	185,555	各種金融
JD SPORTS FASHION PLC	766	4,979	592	94,102	小売
SHELL PLC	—	16,646	38,562	6,128,741	エネルギー
小計 株数・金額	471,214	620,625	392,452	62,372,485	
小計 銘柄数<比率>	85	78	—	<4.3%>	
(スイス)			千スイスフラン		
NESTLE SA-REG	4,743	6,474	78,840	10,292,642	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	862	1,200	12,918	1,686,487	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	3,950	6,364	4,050	528,773	各種金融
HOLCIM LTD	870	1,204	5,580	728,497	素材
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,151	1,618	53,093	6,931,338	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GIVAUDAN-REG	15	21	7,425	969,432	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	89	118	3,920	511,790	ヘルスケア機器・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	247	345	15,369	2,006,477	保険
BACHEM HOLDING AG-REG B	—	68	480	62,738	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
STRAUMANN HOLDING AG-REG	16	225	2,530	330,307	ヘルスケア機器・サービス
LONZA GROUP AG-REG	124	172	9,123	1,191,058	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	70	116	543	70,916	耐久消費財・アパレル
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	64	87	1,586	207,087	資本財
GEBERIT AG-REG	60	85	4,384	572,361	資本財
SWISS RE AG	461	690	5,572	727,482	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR	50	63	1,550	202,404	耐久消費財・アパレル
NOVARTIS AG-REG	3,657	5,037	42,671	5,570,761	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	274	337	1,163	151,934	商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG	42	60	3,494	456,212	電気通信サービス
ABB LTD-REG	3,038	3,784	10,749	1,403,330	資本財
CLARIANT AG-REG	297	420	729	95,267	素材
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	265	401	2,344	306,026	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROCHE HOLDING AG-BR	59	72	2,607	340,409	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SGS SA-REG	9	13	3,210	419,118	商業・専門サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	42	51	924	120,755	資本財
TEMENOS AG - REG	108	154	1,540	201,134	ソフトウェア・サービス
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	93	124	3,066	400,314	運輸
BALOISE HOLDING AG - REG	84	107	1,735	226,565	保険
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	50	71	3,873	505,713	保険
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.17	0.23	2,373	309,873	食品・飲料・タバコ
JULIUS BAER GROUP LTD	388	514	2,398	313,142	各種金融
SIKA AG-REG	229	330	8,586	1,120,933	素材
SWISS PRIME SITE-REG	119	183	1,748	228,327	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	1	2	2,462	321,508	食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG	30	53	5,478	715,174	各種金融
BARRY CALLEBAUT AG-REG	4	8	1,926	251,537	食品・飲料・タバコ
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	45	—	—	—	銀行
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	13	17	1,435	187,350	素材
UBS GROUP AG-REG	6,035	8,080	13,708	1,789,655	各種金融
VIFOR PHARMA AG	72	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VAT GROUP AG	—	59	1,616	210,998	資本財
ALCON INC	796	1,150	8,058	1,052,096	ヘルスケア機器・サービス

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)		百株	百株	千スイスフラン	千円	
VIFOR PHARMA AG-NEW		—	112	1,977	258,227	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	28,541	40,008	336,853	43,976,165	
	銘柄数<比率>	40	41	—	<3.0%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-B		385	546	8,359	107,751	耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS		4,900	6,613	50,739	654,034	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS		669	855	32,430	418,028	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		2,669	3,830	40,751	525,288	銀行
INVESTOR AB-B SHS		734	4,159	71,998	928,056	各種金融
GETINGE AB-B SHS		—	498	14,468	186,493	ヘルスケア機器・サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		2,668	3,332	32,265	415,899	銀行
ATLAS COPCO AB-A SHS		1,084	1,504	65,730	847,266	資本財
SKF AB-B SHARES		610	872	14,792	190,674	資本財
ASSA ABLOY AB-B		1,631	2,258	52,175	672,548	資本財
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		1,376	1,550	18,783	242,115	小売
SANDVIK AB		1,884	2,578	48,462	624,677	資本財
SWEDBANK AB - A SHARES		1,557	1,987	29,526	380,593	銀行
SECURITAS AB-B SHS		461	638	6,690	86,234	商業・専門サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B		966	1,353	24,435	314,976	素材
SKANSKA AB-B SHS		554	805	13,505	174,084	資本財
SWEDISH MATCH AB		2,556	3,707	38,376	494,679	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS		796	1,262	16,599	213,962	電気通信サービス
TELIA CO AB		4,092	6,358	25,764	332,105	電気通信サービス
VOLVO AB-A SHS		—	603	9,971	128,528	資本財
VOLVO AB-B SHS		2,310	3,110	49,211	634,337	資本財
ALFA LAVAL AB		563	786	20,143	259,649	資本財
LUNDIN ENERGY AB		316	492	20,717	267,050	エネルギー
BOLIDEN AB		423	582	21,400	275,857	素材
BOLIDEN AB-RED SHS		423	582	902	11,630	素材
HUSQVARNA AB-B SHS		713	1,001	9,082	117,073	資本財
HEXAGON AB-B SHS		456	4,444	51,714	666,603	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINNEVIK AB - B		380	544	9,215	118,789	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		257	345	8,511	109,708	各種金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS		152	245	10,773	138,871	不動産
ICA GRUPPEN AB		172	—	—	—	食品・生活必需品小売り
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		499	3,100	26,412	340,460	資本財
LUNDBERGS AB-B SHS		153	151	6,857	88,395	各種金融
ESSITY AKTIEBOLAG-B		996	1,467	38,678	498,571	家庭用品・パーソナル用品
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS		175	332	8,324	107,301	各種金融
EPIROC AB-B		656	852	13,390	172,606	資本財
EPIROC AB-A		1,138	1,602	28,959	373,286	資本財
NORDEA BANK ABP		5,386	7,491	71,483	921,422	銀行
EQT AB		388	686	17,648	227,488	各種金融
EVOLUTION AB		260	392	35,675	459,850	消費者サービス
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		262	358	7,923	102,138	資本財
SINCH AB		—	1,110	4,557	58,741	ソフトウェア・サービス
EMBRACER GROUP AB		—	1,291	8,783	113,225	メディア・娯楽
INVESTOR AB-A SHS		—	1,222	22,771	293,530	各種金融
LIFCO AB-B SHS		—	514	9,218	118,827	資本財
SAGAX AB-B		—	347	7,772	100,191	不動産
小計	株数・金額	45,690	78,376	1,125,958	14,513,607	
	銘柄数<比率>	39	45	—	<1.0%>	

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	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェークローネ	千円	
DNB ASA	1,493	—	—	—	銀行
NORSK HYDRO ASA	2,203	3,117	21,190	282,467	素材
ORKLA ASA	1,212	1,570	11,681	155,715	食品・飲料・タバコ
EQUINOR ASA	1,561	2,283	75,323	1,004,055	エネルギー
TELENOR ASA	1,136	1,496	19,208	256,043	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	281	400	17,868	238,193	素材
MOWI ASA	712	942	22,775	303,599	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	350	501	9,769	130,226	保険
SCHIBSTED ASA-CL A	112	182	3,299	43,980	メディア・娯楽
SCHIBSTED ASA-B SHS	214	213	3,509	46,785	メディア・娯楽
AKER BP ASA	—	284	9,928	132,348	エネルギー
ADEVINTA ASA	415	558	3,334	44,451	メディア・娯楽
DNB BANK ASA	—	2,183	39,079	520,924	銀行
小計 株数・金額	9,693	13,735	236,968	3,158,791	
小計 銘柄数<比率>	11	12	—	<0.2%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
NOVO NORDISK A/S-B	2,839	3,871	289,225	5,310,183	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	343	487	21,106	387,524	素材
DANSKE BANK A/S	1,122	1,492	15,768	289,503	銀行
DEMANT A/S	211	211	6,000	110,166	ヘルスケア機器・サービス
H LUNDBECK A/S	129	—	—	—	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	1,661	2,378	36,852	676,619	資本財
GN STORE NORD A/S	207	316	7,079	129,983	ヘルスケア機器・サービス
CARLSBERG AS-B	177	223	19,375	355,742	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B	192	286	24,590	451,482	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S	336	480	50,094	919,729	運輸
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	10	13	26,277	482,451	運輸
TRYG A/S	541	802	12,377	227,253	保険
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	4	7	13,404	246,110	運輸
PANDORA A/S	160	251	13,555	248,888	耐久消費財・アパレル
CHR HANSEN HOLDING A/S	188	230	12,071	221,638	素材
GENMAB A/S	106	148	30,675	563,201	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ORSTED A/S	315	435	31,065	570,360	公益事業
ROCKWOOL A/S-B SHS	11	16	2,984	54,796	資本財
AMBU A/S-B	258	385	3,447	63,287	ヘルスケア機器・サービス
小計 株数・金額	8,820	12,038	615,954	11,308,924	
小計 銘柄数<比率>	19	18	—	<0.8%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
BHP GROUP LTD	4,856	11,658	53,230	4,793,948	素材
CSL LTD	750	1,105	30,540	2,750,456	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WOODSIDE PETROLEUM LTD	1,591	2,176	6,643	598,306	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	4,677	6,525	16,574	1,492,694	銀行
RIO TINTO LTD	617	836	8,839	796,059	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	2,391	3,535	4,373	393,876	保険
LENDLEASE GROUP	1,189	1,631	1,859	167,487	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	2,922	3,927	39,869	3,590,672	銀行
WESTPAC BANKING CORP	5,988	8,454	20,501	1,846,330	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	5,427	7,536	23,008	2,072,179	銀行
BRAMBLES LTD	2,625	3,525	3,687	332,120	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	1,577	2,406	1,277	115,087	運輸
WOOLWORTHS GROUP LTD	2,120	2,777	10,484	944,257	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	6,760	9,046	3,537	318,551	電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
AMP LTD	6,147	—	—	—	各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD	3,590	5,422	2,738	246,629	消費者サービス
COMPUTERSHARE LTD	1,041	1,257	2,993	269,572	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	929	1,318	4,195	377,809	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	578	785	14,309	1,288,749	各種金融
CIMIC GROUP LTD	123	—	—	—	資本財
ASX LTD	326	444	3,652	328,957	各種金融
COCHLEAR LTD	104	141	3,023	272,326	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	777	981	3,799	342,172	素材
NEWCREST MINING LTD	1,336	2,002	4,977	448,308	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	3,758	5,256	2,428	218,696	保険
ORIGIN ENERGY LTD	2,786	4,357	2,989	269,228	公益事業
ORICA LTD	814	814	1,275	114,896	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	715	1,069	3,769	339,466	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	2,990	7,522	5,995	539,946	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	2,150	3,025	3,473	312,799	保険
TRANSURBAN GROUP	4,582	7,186	10,061	906,124	運輸
WESFARMERS LTD	1,879	2,570	12,680	1,141,999	小売
BLUESCOPE STEEL LTD	800	1,216	2,154	194,004	素材
SYDNEY AIRPORT	2,125	—	—	—	運輸
AMPOL LTD	427	592	1,934	174,225	エネルギー
OIL SEARCH LTD	3,240	—	—	—	エネルギー
AGL ENERGY LTD	1,003	—	—	—	公益事業
FORTESCUE METALS GROUP LTD	2,729	3,979	7,779	700,652	素材
AUSNET SERVICES	3,608	—	—	—	公益事業
CROWN RESORTS LTD	681	681	866	78,050	消費者サービス
AURIZON HOLDINGS LTD	3,162	4,381	1,748	157,452	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	1,246	1,612	1,801	162,221	食品・飲料・タバコ
APA GROUP	1,938	2,448	2,725	245,423	公益事業
RAMSAY HEALTH CARE LTD	331	398	3,067	276,248	ヘルスケア機器・サービス
SEEK LTD	526	817	2,093	188,539	メディア・娯楽
REA GROUP LTD	86	114	1,269	114,356	メディア・娯楽
MEDIBANK PRIVATE LTD	4,446	5,712	1,816	163,611	保険
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	129	908	81,852	消費者サービス
SOUTH32 LTD	7,600	11,006	4,854	437,156	素材
EVOLUTION MINING LTD	2,710	3,768	1,345	121,159	素材
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	209	—	—	—	各種金融
IDP EDUCATION LTD	—	456	1,142	102,869	消費者サービス
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	1,707	2,518	2,200	198,201	素材
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	139	433	1,181	106,428	エネルギー
COLES GROUP LTD	2,190	3,220	5,990	539,512	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	214	306	1,257	113,226	ソフトウェア・サービス
MINERAL RESOURCES LTD	—	379	2,061	185,683	素材
AFTERPAY LTD	345	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TPG TELECOM LTD	479	—	—	—	電気通信サービス
XERO LTD	192	335	2,920	262,992	ソフトウェア・サービス
REECE LTD	—	536	903	81,386	資本財
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	—	2,846	2,203	198,426	食品・生活必需品小売り
小計 株数・金額	120,274	157,193	361,019	32,513,394	
小計 銘柄数<比率>	57	53	—	<2.2%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
SPARK NEW ZEALAND LTD	2,972	3,841	1,836	149,965	電気通信サービス

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ニュージーランド)		百株	百株	千ニュージーランドドル	千円	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		2,002	2,646	1,897	155,011	運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		924	1,407	2,940	240,217	ヘルスケア機器・サービス
RYMAN HEALTHCARE LTD		653	990	864	70,579	ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD		2,072	3,106	1,428	116,720	公益事業
MERCURY NZ LTD		1,230	1,230	705	57,601	公益事業
A2 MILK CO LTD		1,153	—	—	—	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	11,009	13,223	9,673	790,096	
	銘柄数<比率>	7	6	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		850	850	3,706	61,260	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		4,388	6,188	33,542	554,459	資本財
SUN HUNG KAI PROPERTIES		2,220	3,020	27,391	452,779	不動産
MTR CORP		2,535	3,765	16,245	268,545	運輸
HONG KONG & CHINA GAS		18,308	24,313	20,423	337,597	公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT		2,792	3,622	10,251	169,460	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		2,345	2,910	15,786	260,954	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		1,988	2,786	90,656	1,498,550	各種金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD		3,400	4,940	7,034	116,281	不動産
CLP HOLDINGS LTD		2,575	3,860	29,297	484,286	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		2,346	3,196	10,068	166,435	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD		2,088	—	—	—	銀行
HANG SENG BANK LTD		1,265	1,791	24,948	412,400	銀行
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		441	—	—	—	半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO		4,914	6,734	7,097	117,323	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		1,010	1,605	8,570	141,673	公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		5,830	8,080	23,674	391,337	銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		2,230	3,165	31,206	515,850	資本財
PCCW LTD		5,490	—	—	—	電気通信サービス
XINYI GLASS HOLDINGS LTD		3,040	4,280	7,361	121,687	資本財
SANDS CHINA LTD		4,332	5,032	7,900	130,590	消費者サービス
WYNN MACAU LTD		2,864	—	—	—	消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD		3,650	—	—	—	消費者サービス
AIA GROUP LTD		19,970	27,914	201,120	3,324,519	保険
SWIRE PROPERTIES LTD		1,740	3,056	5,671	93,757	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		3,550	5,210	21,908	362,140	消費者サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU		—	4,712	5,861	96,894	小売
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		6,340	8,910	10,014	165,545	電気通信サービス
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS		—	2,570	6,617	109,391	運輸
WH GROUP LTD		15,900	20,990	11,229	185,626	食品・飲料・タバコ
CK ASSET HOLDINGS LTD		4,178	4,698	24,996	413,200	不動産
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		5,015	5,015	3,891	64,328	公益事業
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		2,570	3,640	13,377	221,121	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT		2,855	4,244	8,471	140,026	食品・飲料・タバコ
ESR CAYMAN LTD		2,950	4,968	11,823	195,448	不動産
小計	株数・金額	145,971	186,066	700,149	11,573,475	
	銘柄数<比率>	33	30	—	<0.8%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		5,464	7,907	9,346	873,016	銀行
CAPITALAND LTD		4,156	—	—	—	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		1,012	1,181	932	87,150	不動産
DBS GROUP HOLDINGS LTD		2,919	4,083	13,032	1,217,406	銀行
KEPPEL CORP LTD		2,389	3,232	2,142	200,160	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	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD		1,924	2,688	7,655	715,093	銀行
VENTURE CORP LTD		461	769	1,341	125,347	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE TECH ENGINEERING		2,685	3,904	1,557	145,504	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		12,959	18,457	5,223	487,927	電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD		2,017	2,828	1,484	138,705	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD		1,336	1,805	1,694	158,320	各種金融
UOL GROUP LTD		1,040	1,040	733	68,488	不動産
WILMAR INTERNATIONAL LTD		3,069	4,043	1,698	158,615	食品・飲料・タバコ
GENTING SINGAPORE LTD		12,345	12,345	962	89,945	消費者サービス
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI		－	6,408	2,486	232,245	不動産
小計	株数・金額	53,777	70,691	50,293	4,697,927	
	銘柄数<比率>	14	14	－	<0.3%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
ICL GROUP LTD		1,300	1,691	6,681	251,348	素材
BANK HAPOALIM BM		1,757	2,511	7,586	285,397	銀行
NICE LTD		97	154	9,872	371,414	ソフトウェア・サービス
BANK LEUMI LE-ISRAEL		2,209	3,271	10,926	411,076	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD		34	55	3,890	146,368	資本財
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		2,044	2,647	5,029	189,209	銀行
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		182	369	4,117	154,917	銀行
AZRIELI GROUP LTD		91	92	2,400	90,290	不動産
小計	株数・金額	7,718	10,794	50,504	1,900,024	
	銘柄数<比率>	8	8	－	<0.1%>	
合計	株数・金額	1,797,058	2,452,415	－	1,392,087,914	
	銘柄数<比率>	1,226	1,227	－	<94.9%>	

(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	92	122	3,626	470,562	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21	33	5,424	703,946	0.0
PROLOGIS INC	122	170	21,048	2,731,405	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	15	24	3,526	457,691	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	46	64	8,160	1,059,006	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27	40	2,764	358,766	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10	15	4,430	574,916	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	20	30	5,357	695,281	0.0
WELLTOWER INC	67	101	8,800	1,141,986	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	23	32	3,568	463,090	0.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	94	144	2,530	328,431	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	18	26	4,675	606,754	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	37	—	—	—	—
REALTY INCOME CORP	56	131	8,376	1,087,025	0.1
REGENCY CENTERS CORP	30	34	2,256	292,771	0.0
SUN COMMUNITIES INC	17	26	4,125	535,415	0.0
UDR INC	51	72	3,429	445,062	0.0
VENTAS INC	60	91	4,845	628,858	0.0
WEYERHAEUSER CO	124	169	6,406	831,307	0.1
AMERICAN TOWER CORP	73	104	23,540	3,054,914	0.2
WP CAREY INC	28	41	3,194	414,536	0.0
VEREIT INC	36	—	—	—	—
DUKE REALTY CORP	59	88	4,711	611,402	0.0
IRON MOUNTAIN INC	48	69	3,493	453,379	0.0
EQUINIX INC	14	20	12,949	1,680,395	0.1
CROWN CASTLE INTL CORP	71	99	16,974	2,202,813	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	60	79	5,878	762,842	0.1
INVITATION HOMES INC	92	140	5,041	654,295	0.0
VICI PROPERTIES INC	92	214	5,871	761,938	0.1
SBA COMMUNICATIONS CORP	18	25	7,958	1,032,812	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	113	170	3,281	425,785	0.0
PUBLIC STORAGE	26	36	11,352	1,473,200	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	54	74	8,372	1,086,464	0.1
VORNADO REALTY TRUST	26	33	1,148	148,982	0.0
KIMCO REALTY CORP	—	135	2,999	389,283	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	22	32	6,668	865,390	0.1
小計 口数・金額	1,781	2,698	226,791	29,430,720	
小計 銘柄数<比率>	35	34	—	<2.0%>	
(カナダ)			千カナダドル		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14	23	1,075	107,477	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	30	30	652	65,188	0.0
小計 口数・金額	45	54	1,727	172,666	
小計 銘柄数<比率>	2	2	—	<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	
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
GECINA SA		7	9	942	128,753	0.0
KLEPIERRE		28	53	1,198	163,658	0.0
COVIVIO		9	13	865	118,272	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		—	27	1,922	262,516	0.0
小計	口数・金額	45	102	4,928	673,201	
	銘柄数<比率>	3	4	—	<0.0%>	
(ユーロ…オランダ)						
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		22	—	—	—	—
小計	口数・金額	22	—	—	—	
	銘柄数<比率>	1	—	—	<—%>	
ユーロ計	口数・金額	67	102	4,928	673,201	
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		132	174	852	135,544	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		120	155	1,112	176,754	0.0
SEGRO PLC		187	260	2,898	460,587	0.0
小計	口数・金額	439	590	4,863	772,886	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		685	995	1,782	160,562	0.0
SCENTRE GROUP		825	1,280	3,545	319,333	0.0
DEXUS/AU		—	256	2,732	246,123	0.0
GPT GROUP		311	401	1,919	172,845	0.0
MIRVAC GROUP		610	900	1,989	179,189	0.0
STOCKLAND		364	543	2,096	188,786	0.0
DEXUS		172	—	—	—	—
GOODMAN GROUP		281	377	7,359	662,777	0.0
小計	口数・金額	3,251	4,755	21,425	1,929,617	
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		335	462	30,762	508,510	0.0
小計	口数・金額	335	462	30,762	508,510	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		254	—	—	—	—
CDL HOSPITALITY TRUSTS		—	18	23	2,209	0.0
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		478	704	1,162	108,612	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		383	383	686	64,139	0.0
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		763	1,054	2,362	220,698	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		593	742	2,042	190,808	0.0
小計	口数・金額	2,473	2,904	6,278	586,469	
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.0%>	
合計	口数・金額	8,395	11,568	—	34,074,072	
	銘柄数<比率>	57	56	—	<2.3%>	

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
外国	株式先物取引	SP EMINI	28,255	－
		SP/TSE60	1,489	－
		SWISS IX	1,127	－
		EURO ST	4,502	－
		SPI 200	1,395	－
		FTSE100	5,848	－

（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

（2022年５月12日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	1,392,087,914	92.4
投資証券	34,074,072	2.3
コール・ローン等、その他	80,376,293	5.3
投資信託財産総額	1,506,538,279	100.0

（注）期末における外貨建純資産（1,458,398,210千円）の投資信託財産総額（1,506,538,279千円）に対する比率は96.8％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＝129.77円	１カナダドル＝99.93円	１ユーロ＝136.58円	１イギリスポンド＝158.93円
１スイスフラン＝130.55円	１スウェーデンクローネ＝12.89円	１ノルウェークローネ＝13.33円	１デンマーククローネ＝18.36円
１オーストラリアドル＝90.06円	１ニュージーランドドル＝81.68円	１香港ドル＝16.53円	１シンガポールドル＝93.41円
１イスラエルシェケル＝37.6208円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年５月12日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,517,229,422,256
コール・ローン等	70,030,049,068
株式(評価額)	1,392,087,914,213
投資証券(評価額)	34,074,072,939
未収入金	10,836,245,826
未収配当金	1,502,546,993
差入委託証拠金	8,698,593,217
(B) 負債	50,730,845,137
未払金	49,893,403,669
未払解約金	837,440,222
未払利息	1,246
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	1,466,498,577,119
元本	334,911,394,157
次期繰越損益金	1,131,587,182,962
(D) 受益権総口数	334,911,394,157口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	43,788円

＜注記事項＞

①期首元本額　246,268,186,550円
　期中追加設定元本額　199,211,865,714円
　期中一部解約元本額　110,568,658,107円
　また、１口当たり純資産額は、期末4.3788円です。

○損益の状況 (2021年５月13日～2022年５月12日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	22,159,905,235
受取配当金	22,172,235,907
受取利息	30,769
その他収益金	29,973,129
支払利息	△ 42,334,570
(B) 有価証券売買損益	80,201,678,804
売買益	279,588,654,169
売買損	△ 199,386,975,365
(C) 先物取引等取引損益	△ 1,248,529,460
取引益	13,190,364,923
取引損	△ 14,438,894,383
(D) 保管費用等	△ 336,579,796
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	100,776,474,783
(F) 前期繰越損益金	728,436,269,763
(G) 追加信託差損益金	681,567,944,290
(H) 解約差損益金	△ 379,193,505,874
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	1,131,587,182,962
次期繰越損益金(Ｉ)	1,131,587,182,962

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

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

ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 全世界株式（オール・カントリー）	94,233,926,773円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 先進国株式インデックス	70,746,294,503円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 全世界株式（除く日本）	26,498,007,853円
三菱ＵＦＪ ＤＣ海外株式インデックスファンド	25,312,656,195円
つみたて先進国株式	14,775,468,769円
ｅＭＡＸＩＳ 先進国株式インデックス	12,837,380,145円
ＭＵＡＭ 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	11,702,503,566円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	9,462,451,954円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	9,335,258,850円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞外国株式インデックスファンド	6,293,111,848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）	6,114,273,650円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,847,697,085円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	3,904,950,205円
ｅＭＡＸＩＳ 全世界株式インデックス	3,652,532,624円
ＭＡＸＩＳ 海外株式（ＭＳＣＩコクサイ）上場投信	3,076,596,742円
ラップ向けインデックスｆ 先進国株式	2,747,752,302円
ＭＡＸＩＳ全世界株式（オール・カントリー）上場投信	2,595,691,846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）	2,369,312,402円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンド	2,343,768,099円
三菱ＵＦＪ 外国株式ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	1,886,856,271円
つみたて８資産均等バランス	1,776,556,437円

三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	1,675,341,256円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス（先進国株式）	1,604,997,913円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	1,559,787,082円
海外株式セレクション（ラップ向け）	1,555,842,420円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,069,859,603円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	940,816,779円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	901,001,461円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	811,165,830円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	712,300,269円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式65）	556,087,445円
つみたて４資産均等バランス	548,574,630円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	529,836,115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）	460,879,156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）	424,905,172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）	423,165,268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）	414,396,998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）	406,215,898円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 全世界株式（３地域均等型）	376,429,787円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	348,429,134円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	275,930,411円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式40）	274,669,499円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	273,302,000円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	256,580,820円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	218,843,457円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	161,343,504円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	139,743,754円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	121,511,419円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	121,261,840円
先進国株式インデックスファンド（ラップ向け）	111,434,614円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	109,559,979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）	100,043,396円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	99,341,023円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	91,863,526円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	80,823,029円
つみたて全世界株式	75,451,183円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	64,872,362円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	61,668,365円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	59,426,073円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	58,184,228円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	53,230,144円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	52,697,288円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式15）	38,624,992円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式25）	33,090,986円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンドＶＡ	32,051,015円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	19,440,584円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）	19,223,316円
ファンド・マネジャー（海外株式）	16,714,109円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	15,995,017円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	10,457,821円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,114,249円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	3,399,876円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	2,912,794円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	2,607,408円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	2,245,227円

三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式80）	1,782,940円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	1,735,210円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	1,589,027円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	1,463,348円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	1,434,803円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	855,152円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	623,458円
コアバランス	135,443円
マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）	20,140円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,993円
合計	334,911,394,157円

［お知らせ］

信託金限度額の増額を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。
（2021年５月17日）

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／海外／株式／インデックス型	
信託期間	2026年10月29日まで（2016年11月９日設定）	
運用方針	先進国株式最小分散インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除く先進国の株式に投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ最小分散指数（ＪＰＹ）（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要運用対象	ベビーファンド	先進国株式最小分散インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	日本を除く先進国の株式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。
	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。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告に係わる情報

先進国株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）

第６期（決算日：2022年10月31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「先進国株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）」は、去る10月31日に第６期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG
三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先
お客さま専用フリーダイヤル　０１２０－１５１０３４
（受付時間：営業日の9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～１月３日を除く）
お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額			ＭＳＣＩコクサイ最小分散指数（ＪＰＹ）（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2期(2018年10月29日)	12,201	0	△ 0.8	12,234.43	△ 0.6	88.2	3.1	8.6	7,610
3期(2019年10月29日)	14,177	0	16.2	14,232.72	16.3	88.8	1.9	9.2	6,500
4期(2020年10月29日)	13,452	0	△ 5.1	13,507.78	△ 5.1	92.4	3.3	4.1	7,139
5期(2021年10月29日)	17,723	0	31.7	17,752.51	31.4	94.3	3.1	2.5	6,107
6期(2022年10月31日)	20,982	0	18.4	21,105.78	18.9	94.2	3.8	2.3	5,787

（注）ＭＳＣＩコクサイ最小分散指数（ＪＰＹ）（配当込み、円換算ベース）とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国を対象に、ボラティリティ（価格変動率）が最も小さくなるように各銘柄の構成比率を決定し算出した指数です。同指数に対する著作権およびその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
（注）ベンチマークは、設定日の翌営業日を10,000として指数化しています。
（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）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」、「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」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コクサイ最小分散指数（ＪＰＹ）（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率			
	円	%		%	%	%	%
（期　首） 2021年10月29日	17,723	－	17,752.51	－	94.3	3.1	2.5
11月末	17,730	0.0	17,751.71	△ 0.0	95.1	2.1	2.6
12月末	18,668	5.3	18,712.22	5.4	92.6	4.8	2.6
2022年１月末	17,456	△ 1.5	17,497.80	△ 1.4	92.4	4.9	2.6
２月末	17,371	△ 2.0	17,424.50	△ 1.8	92.4	4.9	2.5
３月末	19,499	10.0	19,578.32	10.3	91.0	2.3	2.6
４月末	19,641	10.8	19,723.90	11.1	95.6	1.9	2.8
５月末	19,356	9.2	19,452.01	9.6	93.6	3.7	2.6
６月末	19,580	10.5	19,705.84	11.0	95.0	2.4	2.6
７月末	19,718	11.3	19,802.54	11.5	94.3	2.8	2.7
８月末	19,883	12.2	19,977.64	12.5	94.9	2.3	2.7
９月末	19,392	9.4	19,482.52	9.7	94.6	2.9	2.4
（期　末） 2022年10月31日	20,982	18.4	21,105.78	18.9	94.2	3.8	2.3

（注）騰落率は期首比。
（注）当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「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」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

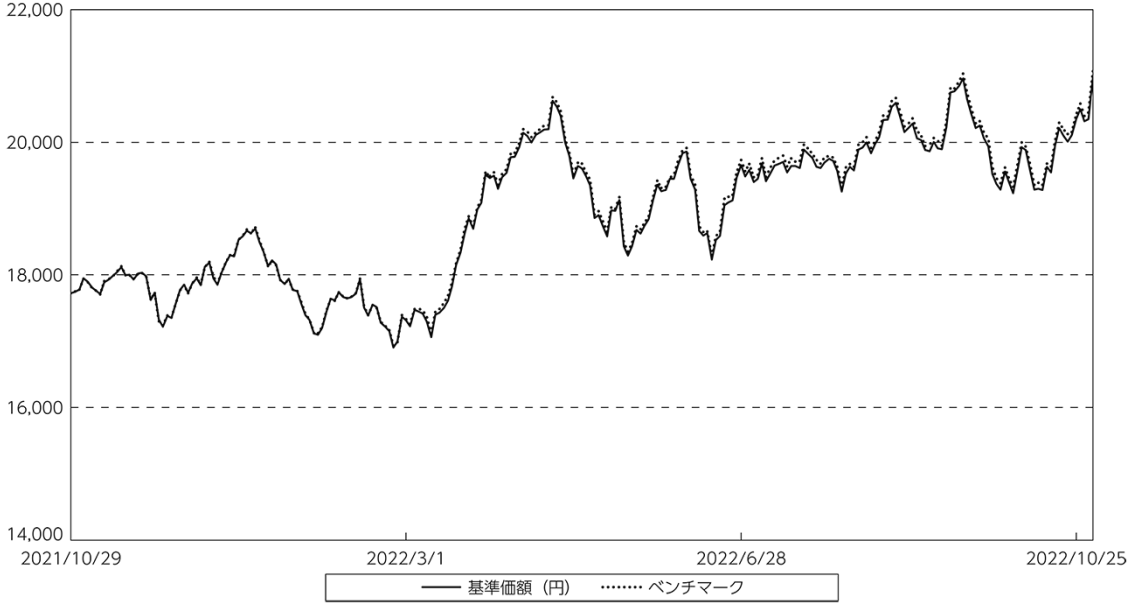
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ18.4%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（18.9%）を0.5%下回りました。

基準価額等の推移



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

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

●投資環境について
◎外国株式市況
・外国株式市況は下落しました。
・世界的なインフレや金融引き締めへの警戒、ウクライナ情勢の緊迫化等を受けて外国株式市況は下落しました。

◎為替市況
・米ドル、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30.4%の円安・米ドル高、11.2%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
＜先進国株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞
・資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

＜先進国株式最小分散インデックスマザーファンド＞
・ＭＳＣＩコクサイ最小分散指数（ＪＰＹ）（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
＜先進国株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞
　ベンチマークとのカイ離は△0.5%程度となりました。

・マザーファンド保有以外の要因
　ファンドの管理コスト等による影響は△0.4%程度でした。

・マザーファンド保有による要因
　マザーファンド保有による影響は△0.1%程度でした。

　ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）
・銘柄選択要因によるものです。

（主なマイナス要因）
・組入要因によるものです。

●分配金について

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

【分配原資の内訳】

（単位：円、１万口当たり、税込み）

項　　目	第６期 2021年10月30日～ 2022年10月31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	11,130

（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

＜先進国株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞

・マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

＜先進国株式最小分散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。

○１万口当たりの費用明細

（2021年10月30日～2022年10月31日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	63	0.332	(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）	(52)	(0.276)	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）	(0)	(0.001)	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）	(10)	(0.054)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	1	0.007	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(1)	(0.006)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	2	0.008	(c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(2)	(0.008)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	11	0.057	(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）	(10)	(0.055)	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)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	77	0.404	
期中の平均基準価額は、18,927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。

○売買及び取引の状況

（2021年10月30日～2022年10月31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
先進国株式最小分散インデックスマザーファンド	28,066	53,149	713,937	1,402,219

○株式売買比率

（2021年10月30日～2022年10月31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
	先進国株式最小分散インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	4,851,778千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	8,442,226千円
(c) 売買高比率（a）／（b）	0.57

(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

（2021年10月30日～2022年10月31日）

利害関係人との取引状況

＜先進国株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞

該当事項はございません。

＜先進国株式最小分散インデックスマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	1,329	1,072	80.7	2,003	1,897	94.7

平均保有割合　64.4%

※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。

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

○組入資産の明細

（2022年10月31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
先進国株式最小分散インデックスマザーファンド	3,390,221	2,704,350	5,786,498

○投資信託財産の構成

（2022年10月31日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
先進国株式最小分散インデックスマザーファンド	5,786,498	99.8
コール・ローン等、その他	10,493	0.2
投資信託財産総額	5,796,991	100.0

（注）先進国株式最小分散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（9,473,153千円）の投資信託財産総額（9,484,523千円）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＝148.26円	1カナダドル＝108.87円	1ユーロ＝147.59円	1イギリスポンド＝172.20円
1スイスフラン＝148.72円	1スウェーデンクローネ＝13.52円	1ノルウェークローネ＝14.32円	1デンマーククローネ＝19.83円
1オーストラリアドル＝95.05円	1ニュージーランドドル＝86.04円	1香港ドル＝18.89円	1シンガポールドル＝104.99円
1イスラエルシェケル＝42.0136円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年10月31日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,796,991,688
コール・ローン等	10,036,270
先進国株式最小分散インデックスマザーファンド(評価額)	5,786,498,968
未収入金	456,450
(B) 負債	9,539,773
未払信託報酬	9,490,772
未払利息	21
その他未払費用	48,980
(C) 純資産総額(A－B)	5,787,451,915
元本	2,758,250,445
次期繰越損益金	3,029,201,470
(D) 受益権総口数	2,758,250,445口
１万口当たり基準価額(C／D)	20,982円

＜注記事項＞

①期首元本額　3,446,191,222円
　期中追加設定元本額　28,431,205円
　期中一部解約元本額　716,371,982円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.0982円です。

○損益の状況 (2021年10月30日～2022年10月31日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,165
受取利息	6
支払利息	△ 1,171
(B) 有価証券売買損益	915,871,963
売買益	1,026,656,861
売買損	△ 110,784,898
(C) 信託報酬等	△ 19,253,970
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	896,616,828
(E) 前期繰越損益金	1,286,358,036
(F) 追加信託差損益金	846,226,606
(配当等相当額)	(887,146,275)
(売買損益相当額)	(△ 40,919,669)
(G) 計(D＋E＋F)	3,029,201,470
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G＋H)	3,029,201,470
追加信託差損益金	846,226,606
(配当等相当額)	(887,211,992)
(売買損益相当額)	(△ 40,985,386)
分配準備積立金	2,182,974,864

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

②分配金の計算過程

項　　目	2021年10月30日～2022年10月31日
費用控除後の配当等収益額	91,693,602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	804,923,226円
収益調整金額	887,211,992円
分配準備積立金額	1,286,358,036円
当ファンドの分配対象収益額	3,070,186,856円
１万口当たり収益分配対象額	11,130円
１万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

先進国株式最小分散インデックスマザーファンド

《第６期》決算日2022年10月31日

［計算期間：2021年10月30日～2022年10月31日］

「先進国株式最小分散インデックスマザーファンド」は、10月31日に第６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６期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として日本を除く先進国の株式に投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ最小分散指数（ＪＰＹ）（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100％を超える場合があります。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	日本を除く先進国の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合に制限を設けません。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コクサイ最小分散指数（ＪＰＹ）（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
2期(2018年10月29日)	12,279	△ 0.5	12,234.43	△ 0.6	88.2	3.1	8.6	8,100
3期(2019年10月29日)	14,315	16.6	14,232.72	16.3	88.9	1.9	9.2	8,080
4期(2020年10月29日)	13,627	△ 4.8	13,507.78	△ 5.1	92.4	3.3	4.1	9,711
5期(2021年10月29日)	18,013	32.2	17,752.51	31.4	94.3	3.1	2.5	8,562
6期(2022年10月31日)	21,397	18.8	21,105.78	18.9	94.2	3.8	2.3	9,474

(注) ＭＳＣＩコクサイ最小分散指数（ＪＰＹ）（配当込み、円換算ベース）とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国を対象に、ボラティリティ（価格変動率）が最も小さくなるように各銘柄の構成比率を決定し算出した指数です。同指数に対する著作権およびその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
(注) ベンチマークは、設定日の翌営業日を10,000として指数化しています。
(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コクサイ最小分散指数（JPY）（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率			
	円	%		%	%	%	%
（期首）2021年10月29日	18,013	－	17,752.51	－	94.3	3.1	2.5
11月末	18,025	0.1	17,751.71	△ 0.0	95.1	2.1	2.6
12月末	18,984	5.4	18,712.22	5.4	92.6	4.8	2.6
2022年１月末	17,757	△ 1.4	17,497.80	△ 1.4	92.4	4.9	2.6
２月末	17,675	△ 1.9	17,424.50	△ 1.8	92.4	4.9	2.5
３月末	19,846	10.2	19,578.32	10.3	91.0	2.3	2.6
４月末	19,995	11.0	19,723.90	11.1	95.6	1.9	2.8
５月末	19,711	9.4	19,452.01	9.6	93.6	3.7	2.6
６月末	19,945	10.7	19,705.84	11.0	95.0	2.4	2.6
７月末	20,090	11.5	19,802.54	11.5	94.3	2.8	2.7
８月末	20,265	12.5	19,977.64	12.5	94.9	2.3	2.7
９月末	19,770	9.8	19,482.52	9.7	94.6	2.9	2.4
（期末）2022年10月31日	21,397	18.8	21,105.78	18.9	94.2	3.8	2.3

（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

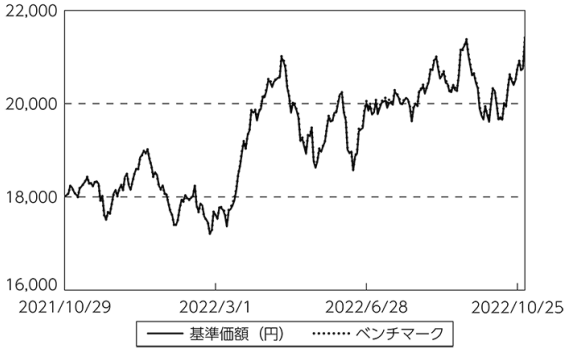
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ18.8%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（18.9%）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

◎外国株式市況

・外国株式市況は下落しました。

・世界的なインフレや金融引き締めへの警戒、ウクライナ情勢の緊迫化等を受けて外国株式市況は下落しました。

◎為替市況

・米ドル、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30.4%の円安・米ドル高、11.2%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

・ＭＳＣＩコクサイ最小分散指数（ＪＰＹ）（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18.9%の上昇になったため、カイ離は△0.1%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

・銘柄選択要因によるものです。

（主なマイナス要因）

・組入要因によるものです。

○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

（2021年10月30日～2022年10月31日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	1	0.007	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(1)	(0.006)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	2	0.008	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(2)	(0.008)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	11	0.056	(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）	(11)	(0.055)	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	14	0.071	
期中の平均基準価額は、19,267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

（2021年10月30日～2022年10月31日）

株式

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
外国	アメリカ	百株 1,126 (66)	千アメリカドル 10,756 (61)	百株 1,243 (69)	千アメリカドル 14,201 (431)
	カナダ	297 (－)	千カナダドル 1,873 (△3)	404	千カナダドル 1,198
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	83 (－)	389 (△32)	179	654
	イタリア	53 (－)	104 (△1)	6	49
	フランス	401	685	199	462
	オランダ	323	326	114	325
	スペイン	128 (－)	450 (△0.14526)	3	11
	ベルギー	16 (7)	211 (－)	29	64
	ルクセンブルク	0.58	6	23	263
	フィンランド	20	98	29	110
	アイルランド	1	13	1	20
	ポルトガル	58	112	3	7
	イギリス	84	千イギリスポンド 64	42	千イギリスポンド 80
	スイス	60 (－)	千スイスフラン 1,008 (△3)	46	千スイスフラン 1,031
	スウェーデン	20	千スウェーデンクローネ 104	274	千スウェーデンクローネ 4,659
	ノルウェー	15	千ノルウェークローネ 197	34	千ノルウェークローネ 441
	デンマーク	12	千デンマーククローネ 727	61	千デンマーククローネ 5,222
	オーストラリア	836 (4)	千オーストラリアドル 616 (△21)	349 (－)	千オーストラリアドル 733 (1)
	ニュージーランド	－	千ニュージーランドドル －	54	千ニュージーランドドル 57
	香港	2,994 (－)	千香港ドル 4,575 (△6)	1,220	千香港ドル 3,237

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	シンガポール	百株 427	千シンガポールドル 344	百株 542	千シンガポールドル 231
	イスラエル	5	千イスラエルシェケル 19	74	千イスラエルシェケル 254

(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
	EXTRA SPACE STORAGE INC	0.058	10	2	449
	EQUINIX INC	0.053	41	—	—
	CROWN CASTLE INC	0.145	25	0.369	67
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1	394	0.092	31
	PUBLIC STORAGE	0.188	59	0.302	106
	小計	1	531	3	654
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	0.7	46	1	99
	小計	0.7	46	1	99

(注) 金額は受渡代金。

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 2,773	百万円 2,718	百万円 —	百万円 —

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

○株式売買比率

（2021年10月30日～2022年10月31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	4,851,778千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	8,442,226千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.57

(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

（2021年10月30日～2022年10月31日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	1,329	1,072	80.7	2,003	1,897	94.7

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

○組入資産の明細

（2022年10月31日現在）

外国株式

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
（アメリカ）	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ABBOTT LABORATORIES	16	15	157	23,349	ヘルスケア機器・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	24	22	557	82,703	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	21	20	595	88,233	ソフトウェア・サービス
ELEVANCE HEALTH INC	1	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	30	29	162	24,104	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON AND CO	2	3	72	10,708	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	22	69	530	78,676	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	162	189	714	105,924	電気通信サービス
ALLSTATE CORP	47	3	38	5,640	保険
CHUBB LTD	9	9	196	29,194	保険
AUTOZONE INC	1	1	473	70,140	小売
CAMPBELL SOUP CO	27	26	138	20,529	食品・飲料・タバコ
CME GROUP INC	6	3	67	10,052	各種金融
COLGATE-PALMOLIVE CO	37	35	263	38,997	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC	39	37	258	38,353	公益事業
DANAHER CORP	17	13	345	51,219	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DUKE ENERGY CORP	52	59	555	82,350	公益事業
TARGET CORP	29	27	463	68,697	小売
NEXTERA ENERGY INC	129	—	—	—	公益事業
GENERAL MILLS INC	20	19	158	23,546	食品・飲料・タバコ
HERSHEY CO/THE	37	31	767	113,737	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC	3	3	104	15,497	小売
INTL BUSINESS MACHINES CORP	9	26	361	53,556	ソフトウェア・サービス
JOHNSON & JOHNSON	58	54	953	141,323	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KELLOGG CO	40	54	420	62,377	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	16	15	189	28,099	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	7	7	44	6,586	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	194	125	587	87,057	食品・生活必需品小売り
ELI LILLY & CO	41	17	612	90,816	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MCDONALD'S CORP	24	23	645	95,727	消費者サービス
MEDTRONIC PLC	31	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	80	76	774	114,874	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	29	28	715	106,130	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MARSH & MCLENNAN COS	41	39	646	95,866	保険
NEWMONT CORP	142	143	614	91,173	素材
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	36	34	271	40,287	食品・飲料・タバコ
PEPSICO INC	68	50	928	137,707	食品・飲料・タバコ
PROCTER & GAMBLE CO/THE	42	40	544	80,792	家庭用品・パーソナル用品
PFIZER INC	125	120	569	84,383	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PROGRESSIVE CORP	35	33	440	65,360	保険
REPUBLIC SERVICES INC	59	53	713	105,775	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	—	8	349	51,890	ソフトウェア・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	11	—	—	—	各種金融
TRAVELERS COS INC/THE	3	—	—	—	保険
SOUTHERN CO/THE	94	90	598	88,706	公益事業
AT&T INC	129	123	228	33,850	電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
TEXAS INSTRUMENTS INC	17	23	382	56,650	半導体・半導体製造装置
UNITEDHEALTH GROUP INC	6	6	354	52,550	ヘルスケア機器・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	4	3	64	9,517	運輸
WILLIAMS COS INC	—	67	219	32,471	エネルギー
WEC ENERGY GROUP INC	70	66	612	90,813	公益事業
WALMART INC	48	45	654	96,979	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	63	60	961	142,577	商業・専門サービス
XCEL ENERGY INC	105	100	659	97,847	公益事業
CLOROX COMPANY	12	14	213	31,583	家庭用品・パーソナル用品
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	10	3	25	3,851	ソフトウェア・サービス
CONSOLIDATED EDISON INC	89	84	750	111,295	公益事業
CISCO SYSTEMS INC	54	142	650	96,511	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ELECTRONIC ARTS INC	26	25	324	48,064	メディア・娯楽
NORTONLIFELOCK INC	39	102	230	34,139	ソフトウェア・サービス
AMGEN INC	2	3	88	13,112	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP	2	16	384	57,071	ソフトウェア・サービス
STARBUCKS CORP	19	—	—	—	消費者サービス
ORACLE CORP	71	67	524	77,796	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1	1	122	18,226	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	64	37	272	40,448	メディア・娯楽
POOL CORP	—	0.75	23	3,544	小売
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	13	160	23,833	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMCAST CORP-CLASS A	14	13	42	6,247	メディア・娯楽
GILEAD SCIENCES INC	101	96	768	113,917	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	33	—	—	—	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	72	68	823	122,082	ソフトウェア・サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	19	21	280	41,542	ソフトウェア・サービス
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1	1	42	6,236	各種金融
HOLOGIC INC	—	8	58	8,692	ヘルスケア機器・サービス
AMAZON.COM INC	0.67	2	28	4,292	小売
QUEST DIAGNOSTICS INC	—	3	57	8,531	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	7	18	366	54,272	ソフトウェア・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	59	56	752	111,543	商業・専門サービス
DOLLAR TREE INC	14	9	157	23,412	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	36	31	935	138,733	各種金融
JM SMUCKER CO/THE	19	18	285	42,303	食品・飲料・タバコ
AMERISOURCEBERGEN CORP	—	4	76	11,313	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	—	8	115	17,053	保険
AMEREN CORPORATION	30	29	239	35,520	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	29	27	250	37,072	公益事業
JUNIPER NETWORKS INC	28	27	83	12,451	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
F5 INC	2	2	36	5,448	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	37	35	317	47,098	ソフトウェア・サービス
INCYTE CORP	14	49	370	54,880	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	17	1	39	5,890	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	45	37	1,165	172,839	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	27	26	164	24,320	ソフトウェア・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	5	16	157	23,349	運輸
FISERV INC	25	24	251	37,237	ソフトウェア・サービス
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	22	21	212	31,522	運輸
AMPHENOL CORP-CL A	6	6	48	7,229	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	7	—	—	—	保険

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	11	10	106	15,738	各種金融
ARROW ELECTRONICS INC	—	3	38	5,642	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN & BROWN INC	8	—	—	—	保険
ALLIANT ENERGY CORP	16	14	78	11,631	公益事業
MASTERCARD INC - A	0.96	0.96	31	4,689	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	110	97	135	20,156	ソフトウェア・サービス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	26	25	379	56,293	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	—	1	34	5,087	保険
SEAGEN INC	4	24	312	46,319	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MASIMO CORP	5	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
HORMEL FOODS CORP	79	71	337	50,065	食品・飲料・タバコ
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	—	20	181	26,976	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VISA INC-CLASS A SHARES	27	15	319	47,331	ソフトウェア・サービス
KEURIG DR PEPPER INC	—	172	682	101,230	食品・飲料・タバコ
T-MOBILE US INC	49	47	712	105,645	電気通信サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	33	31	242	35,960	家庭用品・パーソナル用品
EVERSOURCE ENERGY	6	6	46	6,954	公益事業
DOLLAR GENERAL CORP	33	31	830	123,136	小売
REGENERON PHARMACEUTICALS	14	9	734	108,970	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CMS ENERGY CORP	24	23	137	20,394	公益事業
ABBVIE INC	—	4	69	10,307	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHENIERE ENERGY INC	6	5	100	14,951	エネルギー
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	1	27	4,012	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	105	—	—	—	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	19	18	381	56,497	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL C	2	—	—	—	メディア・娯楽
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	43	41	741	109,989	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LIBERTY BROADBAND-C	—	34	288	42,796	メディア・娯楽
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	21	2	31	4,651	メディア・娯楽
PALO ALTO NETWORKS INC	4	—	—	—	ソフトウェア・サービス
HORIZON THERAPEUTICS PLC	10	13	84	12,539	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERCO	2	2	135	20,096	運輸
BIO-RAD LABORATORIES-A	1	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA INC	6	6	217	32,264	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	—	1	69	10,318	メディア・娯楽
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	—	5	25	3,803	ソフトウェア・サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9	25	322	47,744	各種金融
ROLLINS INC	15	15	65	9,733	商業・専門サービス
BLACK KNIGHT INC	35	24	145	21,606	ソフトウェア・サービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	10	—	—	—	ソフトウェア・サービス
EVERGY INC	11	10	67	9,985	公益事業
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	6	6	151	22,510	保険
TELADOC HEALTH INC	2	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
DELL TECHNOLOGIES -C	—	7	30	4,534	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	5	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	27	25	141	20,972	各種金融
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	3	3	43	6,429	商業・専門サービス
PELOTON INTERACTIVE INC-A	15	—	—	—	耐久消費財・アパレル
MODERNA INC	8	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	5	—	—	—	ソフトウェア・サービス
AON PLC-CLASS A	11	11	325	48,193	保険
BOSTON BEER COMPANY INC-A	1	—	—	—	食品・飲料・タバコ

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		54	11	50	7,506	資本財
小計	株数・金額	4,361	4,241	42,503	6,301,600	
	銘柄数<比率>	133	130	—	<66.5%>	
(カナダ)				千カナダドル		
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B		62	31	176	19,223	電気通信サービス
BARRICK GOLD CORP		219	362	753	82,053	素材
BCE INC		19	17	105	11,452	電気通信サービス
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		4	—	—	—	保険
CGI INC		26	25	279	30,459	ソフトウェア・サービス
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		—	53	179	19,589	メディア・娯楽
AGNICO EAGLE MINES LTD		65	83	509	55,518	素材
KINROSS GOLD CORP		338	74	36	4,012	素材
TELUS CORP		118	118	339	36,972	電気通信サービス
FRANCO-NEVADA CORP		51	52	883	96,161	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		121	108	490	53,404	素材
OPEN TEXT CORP		8	8	32	3,549	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP		23	27	559	60,870	保険
CONSTELLATION SOFTWARE INC		—	3	666	72,555	ソフトウェア・サービス
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT		13	—	—	—	商業・専門サービス
小計	株数・金額	1,067	961	5,013	545,824	
	銘柄数<比率>	13	13	—	<5.8%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
SAP SE		13	12	123	18,233	ソフトウェア・サービス
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		503	434	837	123,638	電気通信サービス
BEIERSDORF AG		14	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
MERCK KGAA		9	5	91	13,442	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SYMRISE AG		—	22	230	34,020	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		279	273	59	8,707	電気通信サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG		24	22	106	15,678	ヘルスケア機器・サービス
HELLOFRESH SE		22	—	—	—	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	866	770	1,448	213,722	
	銘柄数<比率>	7	6	—	<2.3%>	
(ユーロ…イタリア)						
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		—	9	38	5,623	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		49	88	79	11,676	電気通信サービス
DIASORIN SPA		6	3	46	6,897	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	55	102	163	24,196	
	銘柄数<比率>	2	3	—	<0.3%>	
(ユーロ…フランス)						
VIVENDI SE		—	143	117	17,361	メディア・娯楽
SANOFI		—	22	194	28,650	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HERMES INTERNATIONAL		2	0.84	110	16,364	耐久消費財・アパレル
ORANGE		486	526	502	74,133	電気通信サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		1	—	—	—	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	490	693	924	136,509	
	銘柄数<比率>	3	4	—	<1.4%>	
(ユーロ…オランダ)						
QIAGEN N.V.		27	36	157	23,292	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FERRARI NV		—	2	59	8,777	自動車・自動車部品
KONINKLIJKE KPN NV		657	872	243	35,903	電気通信サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		83	79	222	32,869	食品・生活必需品小売り
VOPAK		11	—	—	—	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	
ADYEN NV		0.99	—	—	—	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	781	990	683	100,843	
	銘柄数<比率>	5	4	—	<1.1%>	
(ユーロ…スペイン)						
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		—	15	36	5,421	小売
RED ELECTRICA CORPORACION SA		—	26	43	6,365	公益事業
CELLNEX TELECOM SA		—	82	270	39,927	電気通信サービス
小計	株数・金額	—	124	350	51,714	
	銘柄数<比率>	—	3	—	<0.5%>	
(ユーロ…ベルギー)						
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV		9	9	67	10,010	各種金融
COLRUYT SA		14	—	—	—	食品・生活必需品小売り
PROXIMUS		41	38	39	5,872	電気通信サービス
SOFINA		1	4	81	12,001	各種金融
ELIA GROUP SA/NV		—	7	94	13,990	公益事業
小計	株数・金額	65	59	283	41,875	
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.4%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
EUROFINS SCIENTIFIC		34	11	75	11,134	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	34	11	75	11,134	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
KESKO OYJ-B SHS		17	—	—	—	食品・生活必需品小売り
KONE OYJ-B		53	51	212	31,334	資本財
SAMPO OYJ-A SHS		—	11	52	7,761	保険
ELISA OYJ		38	37	183	27,048	電気通信サービス
小計	株数・金額	108	100	448	66,144	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.7%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A		15	14	133	19,774	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	15	14	133	19,774	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
JERONIMO MARTINS		—	55	113	16,788	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	—	55	113	16,788	
	銘柄数<比率>	—	1	—	<0.2%>	
ユーロ計	株数・金額	2,420	2,923	4,625	682,704	
	銘柄数<比率>	26	30	—	<7.2%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
ASTRAZENECA PLC		12	12	123	21,199	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANTOFAGASTA PLC		15	—	—	—	素材
ADMIRAL GROUP PLC		51	46	92	15,995	保険
OCADO GROUP PLC		13	—	—	—	食品・生活必需品小売り
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC		—	75	40	7,024	保険
小計	株数・金額	93	134	256	44,219	
	銘柄数<比率>	4	3	—	<0.5%>	
(スイス)				千スイスフラン		
NESTLE SA-REG		82	79	853	126,926	食品・飲料・タバコ
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		28	26	875	130,182	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GIVAUDAN-REG		0.97	1	337	50,151	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG		2	1	69	10,397	保険
NOVARTIS AG-REG		88	100	806	119,892	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)		百株	百株	千スイスフラン	千円	
SWISSCOM AG-REG		6	6	333	49,562	電気通信サービス
LOGITECH INTERNATIONAL-REG		46	39	198	29,559	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROCHE HOLDING AG-BR		—	6	271	40,375	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SGS SA-REG		0.97	0.94	206	30,699	商業・専門サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		4	4	65	9,684	資本財
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		14	13	279	41,555	運輸
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.02	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SWISS PRIME SITE-REG		4	20	164	24,422	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.09	—	—	—	食品・飲料・タバコ
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.44	0.43	80	11,996	食品・飲料・タバコ
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG		5	—	—	—	銀行
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		1	1	111	16,644	素材
小計	株数・金額	288	302	4,653	692,051	
	銘柄数<比率>	16	14	—	<7.3%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローネ		
ERICSSON LM-B SHS		128	120	737	9,968	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA CO AB		290	272	791	10,704	電気通信サービス
ICA GRUPPEN AB		9	—	—	—	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS		28	—	—	—	各種金融
EPIROC AB-A		51	—	—	—	資本財
EQT AB		15	—	—	—	各種金融
EMBRACER GROUP AB		124	—	—	—	メディア・娯楽
小計	株数・金額	646	392	1,529	20,673	
	銘柄数<比率>	7	2	—	<0.2%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
TELENOR ASA		187	168	1,572	22,511	電気通信サービス
小計	株数・金額	187	168	1,572	22,511	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.2%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
NOVO NORDISK A/S-B		83	46	3,748	74,326	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		27	25	1,010	20,045	素材
COLOPLAST-B		31	27	2,301	45,632	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S		3	—	—	—	運輸
TRYG A/S		35	33	553	10,977	保険
AP MOLLER-MAERSK A/S-A		0.28	—	—	—	運輸
CHR HANSEN HOLDING A/S		4	4	176	3,499	素材
小計	株数・金額	186	137	7,790	154,482	
	銘柄数<比率>	7	5	—	<1.6%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
AUST AND NZ BANKING GROUP		64	61	154	14,652	銀行
WOOLWORTHS GROUP LTD		45	43	144	13,687	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD		650	—	—	—	電気通信サービス
NEWCREST MINING LTD		—	29	52	4,980	素材
SONIC HEALTHCARE LTD		121	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
WESFARMERS LTD		116	110	488	46,447	小売
MEDIBANK PRIVATE LTD		—	661	184	17,529	保険
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		28	28	81	7,702	エネルギー
XERO LTD		—	13	98	9,377	ソフトウェア・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI		48	—	—	—	食品・生活必需品小売り
TELSTRA GROUP LTD		—	620	239	22,767	電気通信サービス
小計	株数・金額	1,077	1,569	1,442	137,145	
	銘柄数<比率>	7	8	—	<1.4%>	

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	
(ニュージーランド)		百株	百株	千ニュージーランドドル	千円	
SPARK NEW ZEALAND LTD		271	227	116	9,990	電気通信サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		34	23	45	3,907	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	305	251	161	13,897	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
MTR CORP		415	410	1,412	26,681	運輸
HONG KONG & CHINA GAS		423	2,493	1,535	29,010	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		20	—	—	—	各種金融
HANG SENG BANK LTD		205	184	2,055	38,824	銀行
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		995	890	2,122	40,096	銀行
XINYI GLASS HOLDINGS LTD		480	—	—	—	資本財
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU		302	302	414	7,826	小売
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		1,010	990	902	17,055	電気通信サービス
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS		—	350	457	8,634	運輸
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		710	715	358	6,766	公益事業
小計	株数・金額	4,560	6,334	9,258	174,896	
	銘柄数<比率>	9	8	—	<1.8%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		87	310	371	39,023	銀行
SINGAPORE TECH ENGINEERING		127	127	41	4,320	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		2,154	1,984	486	51,033	電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD		161	—	—	—	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD		216	209	175	18,475	各種金融
小計	株数・金額	2,745	2,630	1,074	112,853	
	銘柄数<比率>	5	4	—	<1.2%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
ICL GROUP LTD		189	121	386	16,242	素材
NICE LTD		1	1	114	4,807	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	191	122	501	21,049	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.2%>	
合計	株数・金額	18,131	20,168	—	8,923,909	
	銘柄数<比率>	232	222	—	<94.2%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 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	%
EXTRA SPACE STORAGE INC		2	0.482	86	12,770	0.1
EQUINIX INC		—	0.053	30	4,463	0.0
CROWN CASTLE INC		2	1	250	37,088	0.4
SBA COMMUNICATIONS CORP		—	1	285	42,393	0.4
PUBLIC STORAGE		2	2	726	107,712	1.1
小計	口数・金額	7	5	1,378	204,429	
	銘柄数<比率>	3	5	—	<2.2%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		19	18	896	16,931	0.2
小計	口数・金額	19	18	896	16,931	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.2%>	
合計	口数・金額	26	24	—	221,360	
	銘柄数<比率>	4	6	—	<2.3%>	

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
外国	株式先物取引	SP EMINI	260	—
		SP/TSE60	25	—
		SWISS IX	32	—
		EURO ST	26	—
		FTSE100	12	—

(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

（2022年10月31日現在）

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
株式	8,923,909	94.1
投資証券	221,360	2.3
コール・ローン等、その他	339,254	3.6
投資信託財産総額	9,484,523	100.0

（注）期末における外貨建純資産（9,473,153千円）の投資信託財産総額（9,484,523千円）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＝148.26円	1カナダドル＝108.87円	1ユーロ＝147.59円	1イギリスポンド＝172.20円
1スイスフラン＝148.72円	1スウェーデンクローネ＝13.52円	1ノルウェークローネ＝14.32円	1デンマーククローネ＝19.83円
1オーストラリアドル＝95.05円	1ニュージーランドドル＝86.04円	1香港ドル＝18.89円	1シンガポールドル＝104.99円
1イスラエルシェケル＝42.0136円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年10月31日現在)

項　　目	当期末
	円
(A) 資産	9,509,179,500
コール・ローン等	213,286,830
株式(評価額)	8,923,909,102
投資証券(評価額)	221,360,879
未収入金	28,896,055
未収配当金	5,969,522
差入委託証拠金	115,757,112
(B) 負債	34,392,282
未払金	33,935,828
未払解約金	456,450
未払利息	4
(C) 純資産総額(A－B)	9,474,787,218
元本	4,428,028,025
次期繰越損益金	5,046,759,193
(D) 受益権総口数	4,428,028,025口
1万口当たり基準価額(C／D)	21,397円

＜注記事項＞

①期首元本額　4,753,464,200円
　期中追加設定元本額　540,714,890円
　期中一部解約元本額　866,151,065円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.1397円です。

○損益の状況 (2021年10月30日～2022年10月31日)

項　　目	当　期
	円
(A) 配当等収益	183,082,034
受取配当金	182,769,328
受取利息	677,907
その他収益金	51,834
支払利息	△ 417,035
(B) 有価証券売買損益	1,471,710,425
売買益	2,810,984,453
売買損	△1,339,274,028
(C) 先物取引等取引損益	△ 40,251,009
取引益	78,087,513
取引損	△ 118,338,522
(D) 保管費用等	△ 4,962,118
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	1,609,579,332
(F) 前期繰越損益金	3,808,713,951
(G) 追加信託差損益金	464,834,321
(H) 解約差損益金	△ 836,368,411
(I) 計(E＋F＋G＋H)	5,046,759,193
次期繰越損益金(I)	5,046,759,193

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

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

先進国株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）	2,704,350,595円
海外株式セレクション（ラップ向け）	688,578,757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）	514,589,267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）	490,931,463円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	25,455,291円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	4,122,652円
合計	4,428,028,025円

852775

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／海外／株式／インデックス型	
信託期間	2023年２月３日まで（2018年２月５日設定）	
運用方針	先進国株式クオリティ・インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除く先進国の株式に投資を行い、ＭＳＣＩ コクサイ・クオリティ指数（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要運用対象	ベビーファンド	先進国株式クオリティ・インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	日本を除く先進国の株式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。
	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。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告に係わる情報

先進国株式クオリティ・インデックスファンド（適格機関投資家限定）

第４期（決算日：2022年２月３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「先進国株式クオリティ・インデックスファンド（適格機関投資家限定）」は、去る２月３日に第４期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG
三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先
お客さま専用フリーダイヤル　０１２０－１５１０３４
（受付時間：営業日の9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～１月３日を除く）
お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCI コクサイ・クオリティ指数（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率				
（設定日）	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2018年2月5日	10,000	－	－	10,000.00	－	－	－	－	400
1期(2019年2月4日)	10,171	0	1.7	10,228.93	2.3	97.6	2.0	0.4	7,087
2期(2020年2月3日)	12,832	0	26.2	12,944.57	26.5	97.4	2.1	0.4	7,595
3期(2021年2月3日)	14,731	0	14.8	14,733.74	13.8	97.8	1.8	0.3	5,878
4期(2022年2月3日)	18,979	0	28.8	19,058.23	29.4	94.9	5.1	0.4	5,608

（注）設定日の基準価額は、設定時の価額です。
（注）ＭＳＣＩ コクサイ・クオリティ指数（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を対象に、ＲＯＥの高さ、利益成長の安定性、財務の健全性等に着目して選定した銘柄で構成されています。
ＭＳＣＩ コクサイ・クオリティ指数（出所：MSCI）。ここに掲載される全ての情報は、信頼の置ける情報源から得たものでありますが、その確実性及び完結性をMSCIは何ら保証するものではありません。またその著作権はMSCIに帰属しており、その許諾なしにコピーを含め電子的、機械的な一切の手段その他あらゆる形態を用い、またはあらゆる情報保存、検索システムを用いて出版物、資料、データ等の全部または一部を複製・頒布・使用等することは禁じられています。
ＭＳＣＩ コクサイ・クオリティ指数（配当込み、円換算ベース）とは、ＭＳＣＩ コクサイ・クオリティ指数（配当込み）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）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」、「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」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		MSCI コクサイ・クオリティ指数（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率			
（期首）	円	%		%	%	%	%
2021年２月３日	14,731	－	14,733.74	－	97.8	1.8	0.3
２月末	14,790	0.4	14,819.87	0.6	98.1	1.4	0.3
３月末	15,879	7.8	15,884.83	7.8	98.6	1.2	0.3
４月末	16,475	11.8	16,483.42	11.9	98.2	1.3	0.4
５月末	16,708	13.4	16,722.59	13.5	94.8	5.0	0.3
６月末	17,518	18.9	17,561.75	19.2	95.1	4.5	0.3
７月末	18,014	22.3	18,074.76	22.7	97.8	1.8	0.3
８月末	18,707	27.0	18,775.93	27.4	97.7	1.7	0.3
９月末	17,841	21.1	17,900.63	21.5	96.9	2.6	0.3
10月末	19,217	30.5	19,284.88	30.9	95.7	3.8	0.3
11月末	19,738	34.0	19,822.32	34.5	97.4	2.0	0.3
12月末	20,383	38.4	20,473.75	39.0	95.1	4.8	0.4
2022年１月末	18,301	24.2	18,370.40	24.7	95.6	4.7	0.4
（期末） 2022年２月３日	18,979	28.8	19,058.23	29.4	94.9	5.1	0.4

（注）騰落率は期首比。
（注）当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「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」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

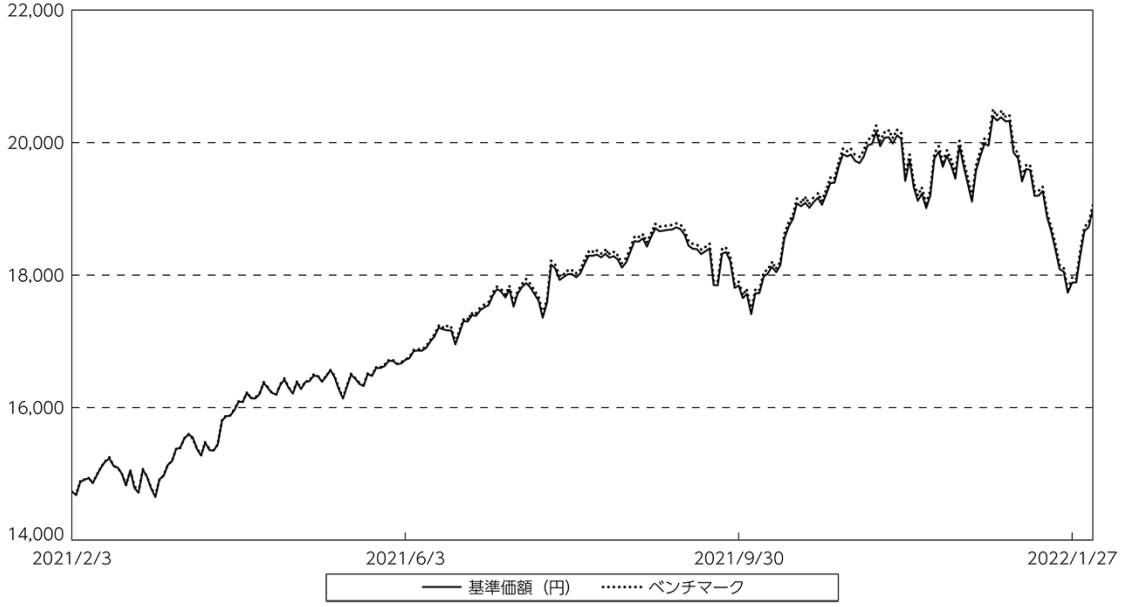
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ28.8%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（29.4%）を0.6%下回りました。

基準価額等の推移



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

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

●投資環境について
◎外国株式市況
外国株式市況は上昇しました。
・世界的なインフレや金融引締めへの警戒等を受けて外国株式市況は下落する局面もありましたが、期を通して堅調な経済指標や企業決算等が支援材料となり外国株式市況は上昇しました。

◎為替市況
米ドル、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9.0%の円安・米ドル高、2.2%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
＜先進国株式クオリティ・インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞
資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

＜先進国株式クオリティ・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・クオリティ指数（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
＜先進国株式クオリティ・インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞
ベンチマークとのカイ離は△0.6%程度となりました。

◎マザーファンド保有以外の要因
ファンドの管理コスト等による影響は△0.5%程度でした。

◎マザーファンド保有による要因
マザーファンド保有による影響は△0.1%程度でした。

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。

●分配金について

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

【分配原資の内訳】

（単位：円、１万口当たり、税込み）

項　　目	第４期 2021年２月４日～ 2022年２月３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	8,979

（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

＜先進国株式クオリティ・インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞

・マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

＜先進国株式クオリティ・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。

○１万口当たりの費用明細

（2021年２月４日～2022年２月３日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	58	0.327	(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）	(48)	(0.273)	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）	(2)	(0.011)	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）	(8)	(0.044)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	2	0.010	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(2)	(0.010)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	2	0.012	(c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(2)	(0.012)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	10	0.055	(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）	(9)	(0.053)	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)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	72	0.404	
期中の平均基準価額は、17,675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。

○売買及び取引の状況

（2021年２月４日～2022年２月３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
先進国株式クオリティ・インデックスマザーファンド	104,135	192,492	1,138,660	2,072,022

○株式売買比率

（2021年２月４日～2022年２月３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
	先進国株式クオリティ・インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	8,923,111千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	9,311,497千円
(c) 売買高比率（a）／（b）	0.95

(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

（2021年２月４日～2022年２月３日）

利害関係人との取引状況

＜先進国株式クオリティ・インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞

該当事項はございません。

＜先進国株式クオリティ・インデックスマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	1,778	1,724	97.0	3,322	3,238	97.5

平均保有割合　62.2%

※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。

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信託銀行です。

○組入資産の明細

（2022年２月３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
先進国株式クオリティ・インデックスマザーファンド	3,950,391	2,915,867	5,608,087

○投資信託財産の構成

（2022年２月３日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
先進国株式クオリティ・インデックスマザーファンド	5,608,087	99.8
コール・ローン等、その他	10,804	0.2
投資信託財産総額	5,618,891	100.0

（注）先進国株式クオリティ・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（9,903,668千円）の投資信託財産総額（9,910,497千円）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＝114.46円	１カナダドル＝90.25円	１ユーロ＝129.28円	１イギリスポンド＝155.20円
１スイスフラン＝124.43円	１スウェーデンクローネ＝12.43円	１ノルウェークローネ＝12.97円	１デンマーククローネ＝17.37円
１オーストラリアドル＝81.45円	１ニュージーランドドル＝75.78円	１香港ドル＝14.68円	１シンガポールドル＝84.92円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 （2022年２月３日現在）

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,618,891,224
コール・ローン等	10,437,301
先進国株式クオリティ・インデックスマザーファンド(評価額)	5,608,087,312
未収入金	366,611
(B) 負債	9,966,992
未払信託報酬	9,915,816
未払利息	4
その他未払費用	51,172
(C) 純資産総額（Ａ－Ｂ）	5,608,924,232
元本	2,955,266,617
次期繰越損益金	2,653,657,615
(D) 受益権総口数	2,955,266,617口
１万口当たり基準価額（Ｃ／Ｄ）	18,979円

＜注記事項＞

①期首元本額　3,990,437,738円
　期中追加設定元本額　105,337,183円
　期中一部解約元本額　1,140,508,304円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.8979円です。

○損益の状況 （2021年２月４日～2022年２月３日）

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	△ 813
受取利息	13
支払利息	△ 826
(B) 有価証券売買損益	1,239,809,746
売買益	1,577,729,861
売買損	△ 337,920,115
(C) 信託報酬等	△ 19,944,076
(D) 当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	1,219,864,857
(E) 前期繰越損益金	794,931,998
(F) 追加信託差損益金	638,860,760
（配当等相当額）	(530,092,997)
（売買損益相当額）	(108,767,763)
(G) 計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	2,653,657,615
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）	2,653,657,615
追加信託差損益金	638,860,760
（配当等相当額）	(530,183,556)
（売買損益相当額）	(108,677,204)
分配準備積立金	2,014,796,855

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

②分配金の計算過程

項　　目	2021年２月４日～2022年２月３日
費用控除後の配当等収益額	67,240,770円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	1,152,624,087円
収益調整金額	638,860,760円
分配準備積立金額	794,931,998円
当ファンドの分配対象収益額	2,653,657,615円
１万口当たり収益分配対象額	8,979円
１万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

先進国株式クオリティ・インデックスマザーファンド

《第４期》決算日2022年２月３日

［計算期間：2021年２月４日～2022年２月３日］

「先進国株式クオリティ・インデックスマザーファンド」は、２月３日に第４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４期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として日本を除く先進国の株式に投資を行い、ＭＳＣＩ コクサイ・クオリティ指数（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	日本を除く先進国の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		MSCI コクサイ・クオリティ指数		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	（配当込み、円換算ベース）	期中騰落率				
（設定日）	円	%		%	%	%	%	百万円
2018年2月5日	10,000	－	10,000.00	－	－	－	－	399
1期(2019年2月4日)	10,204	2.0	10,228.93	2.3	97.6	2.0	0.4	7,678
2期(2020年2月3日)	12,916	26.6	12,944.57	26.5	97.4	2.1	0.4	10,404
3期(2021年2月3日)	14,878	15.2	14,733.74	13.8	97.8	1.8	0.3	9,013
4期(2022年2月3日)	19,233	29.3	19,058.23	29.4	94.9	5.1	0.4	9,905

（注）設定日の基準価額は、設定時の価額です。
（注）ＭＳＣＩ コクサイ・クオリティ指数（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を対象に、ＲＯＥの高さ、利益成長の安定性、財務の健全性等に着目して選定した銘柄で構成されています。
ＭＳＣＩ コクサイ・クオリティ指数（出所：MSCI）。ここに掲載される全ての情報は、信頼の置ける情報源から得たものでありますが、その確実性及び完結性をMSCIは何ら保証するものではありません。またその著作権はMSCIに帰属しており、その許諾なしにコピーを含め電子的、機械的な一切の手段その他あらゆる形態を用い、またはあらゆる情報保存、検索システムを用いて出版物、資料、データ等の全部または一部を複製・頒布・使用等することは禁じられています。
ＭＳＣＩ コクサイ・クオリティ指数（配当込み、円換算ベース）とは、ＭＳＣＩ コクサイ・クオリティ指数（配当込み）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）「株式先物比率」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		MSCI コクサイ・クオリティ指数（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率			
（期　首）	円	%		%	%	%	%
2021年２月３日	14,878	－	14,733.74	－	97.8	1.8	0.3
２月末	14,941	0.4	14,819.87	0.6	98.1	1.4	0.3
３月末	16,046	7.9	15,884.83	7.8	98.6	1.2	0.3
４月末	16,653	11.9	16,483.42	11.9	98.2	1.3	0.4
５月末	16,893	13.5	16,722.59	13.5	94.8	5.0	0.3
６月末	17,717	19.1	17,561.75	19.2	95.1	4.5	0.3
７月末	18,223	22.5	18,074.76	22.7	97.8	1.8	0.3
８月末	18,930	27.2	18,775.93	27.4	97.7	1.7	0.3
９月末	18,059	21.4	17,900.63	21.5	96.9	2.6	0.3
10月末	19,457	30.8	19,284.88	30.9	95.7	3.8	0.3
11月末	19,990	34.4	19,822.32	34.5	97.5	2.0	0.3
12月末	20,649	38.8	20,473.75	39.0	95.1	4.8	0.4
2022年１月末	18,545	24.6	18,370.40	24.7	95.6	4.7	0.4
（期　末） 2022年２月３日	19,233	29.3	19,058.23	29.4	94.9	5.1	0.4

（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

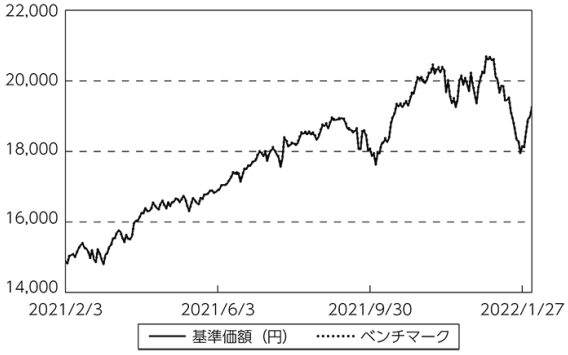
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ29.3%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ベンチマークは29.4%の上昇になったため、カイ離は△0.1%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
◎外国株式市況
　外国株式市況は上昇しました。
・世界的なインフレや金融引締めへの警戒等を受けて外国株式市況は下落する局面もありましたが、期を通して堅調な経済指標や企業決算等が支援材料となり外国株式市況は上昇しました。

◎為替市況
　米ドル、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9.0%の円安・米ドル高、2.2%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ＭＳＣＩ コクサイ・クオリティ指数（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29.4%の上昇になったため、カイ離は△0.1%程度となりました。
　ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）
・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

（2021年２月４日～2022年２月３日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	2	0.010	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(2)	(0.010)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	2	0.012	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(2)	(0.012)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	10	0.053	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(9)	(0.053)	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	14	0.075	
期中の平均基準価額は、17,883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

（2021年２月４日～2022年２月３日）

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 1,150 (178)	千アメリカドル 27,195 (103)	百株 2,753 (20)	千アメリカドル 37,406 (200)
	カナダ	18 (34)	千カナダドル 98 (－)	60	千カナダドル 372
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	0.39	4	21	173
	イタリア	－	－	59	159
	フランス	7	87	0.84	73
	オランダ	209	1,080	159	636
	ベルギー	1	42	0.65	3
	フィンランド	3	22	45	246
	イギリス	785	千イギリスポンド 1,370	1,124 (－)	千イギリスポンド 1,351 (8)
	スイス	15	千スイスフラン 544	273	千スイスフラン 4,007
	スウェーデン	32 (72)	千スウェーデンクローネ 840 (－)	49 (72)	千スウェーデンクローネ 3,432 (21)
	ノルウェー	－	千ノルウェークローネ －	3	千ノルウェークローネ 70
	デンマーク	22	千デンマーククローネ 1,390	58	千デンマーククローネ 4,239
	オーストラリア	241 (－)	千オーストラリアドル 866 (△14)	266	千オーストラリアドル 948
	ニュージーランド	－	千ニュージーランドドル －	67	千ニュージーランドドル 61
	香港	336	千香港ドル 2,325	39	千香港ドル 789
	シンガポール	－	千シンガポールドル －	37	千シンガポールドル 23

（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
	PUBLIC STORAGE	0.073	24	0.308	87

(注) 金額は受渡代金。

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 2,825	百万円 2,558	百万円 －	百万円 －

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

○株式売買比率

(2021年２月４日～2022年２月３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	8,923,111千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	9,311,497千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.95

(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

(2021年２月４日～2022年２月３日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	1,778	1,724	97.0	3,322	3,238	97.5

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

○組入資産の明細

（2022年２月３日現在）

外国株式

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
（アメリカ）	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	42	32	678	77,623	ソフトウェア・サービス
AFLAC INC	—	39	250	28,634	保険
ADVANCED MICRO DEVICES	—	78	965	110,483	半導体・半導体製造装置
ACCENTURE PLC-CL A	54	44	1,612	184,576	ソフトウェア・サービス
BEST BUY CO INC	22	18	186	21,302	小売
ALLSTATE CORP	—	18	220	25,244	保険
AVERY DENNISON CORP	6	5	105	12,129	素材
COCA-COLA CO/THE	308	—	—	—	食品・飲料・タバコ
DR HORTON INC	—	21	194	22,263	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	—	34	740	84,785	小売
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	51	41	466	53,341	ヘルスケア機器・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	43	35	341	39,128	資本財
ECOLAB INC	18	—	—	—	素材
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	17	17	548	62,798	家庭用品・パーソナル用品
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3	2	114	13,150	各種金融
WW GRAINGER INC	3	3	155	17,839	資本財
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	53	—	—	—	資本財
HERSHEY CO/THE	10	10	204	23,383	食品・飲料・タバコ
ILLINOIS TOOL WORKS	23	21	502	57,529	資本財
JOHNSON & JOHNSON	197	166	2,884	330,128	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KIMBERLY-CLARK CORP	37	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
ELI LILLY & CO	—	51	1,295	148,315	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOCKHEED MARTIN CORP	—	17	692	79,270	資本財
MERCK & CO. INC.	214	153	1,255	143,684	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	46	37	622	71,286	資本財
PEPSICO INC	101	—	—	—	食品・飲料・タバコ
PROCTER & GAMBLE CO/THE	181	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
PFIZER INC	414	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PROGRESSIVE CORP	45	39	436	49,973	保険
ROBERT HALF INTL INC	9	7	81	9,374	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	—	7	235	26,919	資本財
SCHLUMBERGER LTD	—	87	345	39,498	エネルギー
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5	16	480	55,045	素材
TEXAS INSTRUMENTS INC	88	77	1,459	167,056	半導体・半導体製造装置
TERADYNE INC	14	11	140	16,033	半導体・半導体製造装置
UNITEDHEALTH GROUP INC	68	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
WALMART INC	101	—	—	—	食品・生活必需品小売り
CELANESE CORP	—	6	108	12,472	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	20	18	282	32,285	ソフトウェア・サービス
INTEL CORP	342	253	1,252	143,372	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	346	277	1,559	178,487	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	—	6	236	27,062	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	31	28	1,468	168,137	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	69	66	939	107,575	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	20	—	—	—	メディア・娯楽

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NIKE INC -CL B	84	84	1,250	143,149	耐久消費財・アパレル
AMGEN INC	39	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP	190	127	3,997	457,560	ソフトウェア・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	12	11	169	19,373	半導体・半導体製造装置
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8	7	165	18,987	小売
POOL CORP	3	3	159	18,232	小売
LAM RESEARCH CORP	12	11	720	82,487	半導体・半導体製造装置
COPART INC	17	14	186	21,310	商業・専門サービス
XILINX INC	19	15	317	36,301	半導体・半導体製造装置
ALIGN TECHNOLOGY INC	—	5	289	33,103	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	22	16	943	107,997	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	29	24	298	34,218	ソフトウェア・サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	9	6	85	9,809	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6	6	206	23,602	運輸
AUTODESK INC	15	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL A	—	7	2,190	250,713	メディア・娯楽
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3	2	89	10,245	各種金融
GARMIN LTD	10	9	122	14,067	耐久消費財・アパレル
QUALCOMM INC	—	71	1,354	155,054	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23	—	—	—	半導体・半導体製造装置
T ROWE PRICE GROUP INC	19	17	276	31,633	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	—	8	113	12,958	ヘルスケア機器・サービス
KLA CORP	14	12	491	56,218	半導体・半導体製造装置
NVIDIA CORP	—	137	3,467	396,947	半導体・半導体製造装置
BOOKING HOLDINGS INC	3	—	—	—	消費者サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	—	15	210	24,048	ヘルスケア機器・サービス
BIOGEN INC	15	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	39	35	1,890	216,367	ソフトウェア・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	13	12	138	15,827	運輸
FASTENAL CO	48	38	222	25,468	資本財
APPLE INC	339	275	4,847	554,851	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9	8	77	8,844	運輸
SEAGATE TECHNOLOGY	15	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NVR INC	0.29	0.23	126	14,462	耐久消費財・アパレル
COOPER COS INC/THE	—	3	145	16,610	ヘルスケア機器・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	20	35	284	32,514	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MONSTER BEVERAGE CORP	32	26	229	26,312	食品・飲料・タバコ
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9	—	—	—	各種金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26	—	—	—	食品・飲料・タバコ
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	2	109	12,525	半導体・半導体製造装置
CUMMINS INC	11	8	201	23,070	資本財
MASTERCARD INC - A	77	62	2,496	285,777	ソフトウェア・サービス
HEICO CORP	2	—	—	—	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	8	—	—	—	ソフトウェア・サービス
BLACKSTONE INC	—	53	741	84,904	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	9	8	289	33,173	耐久消費財・アパレル
ULTA BEAUTY INC	—	3	123	14,124	小売
SEI INVESTMENTS COMPANY	10	7	46	5,293	各種金融
VISA INC-CLASS A SHARES	148	106	2,516	288,081	ソフトウェア・サービス
RESMED INC	10	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	—	14	150	17,197	家庭用品・パーソナル用品
DOLLAR GENERAL CORP	—	13	276	31,701	小売

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
FORTINET INC		12	9	302	34,617	ソフトウェア・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE		2	2	46	5,372	資本財
ABIOMED INC		—	2	85	9,834	ヘルスケア機器・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS		8	7	485	55,607	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
META PLATFORMS INC-CLASS A		—	128	4,151	475,145	メディア・娯楽
HEICO CORP-CLASS A		5	—	—	—	資本財
ABBVIE INC		202	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHENIERE ENERGY INC		22	—	—	—	エネルギー
ZOETIS INC		32	29	595	68,194	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES		—	4	197	22,549	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SNAP-ON INC		3	3	67	7,754	資本財
JACK HENRY & ASSOCIATES INC		5	4	80	9,213	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC		7	6	80	9,216	資本財
ALPHABET INC-CL C		—	7	2,096	239,930	メディア・娯楽
PAYCOM SOFTWARE INC		4	3	97	11,179	ソフトウェア・サービス
ARISTA NETWORKS INC		4	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IDEXX LABORATORIES INC		—	6	355	40,663	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP		9	8	66	7,608	資本財
ROLLINS INC		15	13	42	4,843	商業・専門サービス
FAIR ISAAC CORP		2	1	90	10,339	ソフトウェア・サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A		2	1	29	3,432	保険
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A		13	—	—	—	ソフトウェア・サービス
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS		—	8	67	7,779	商業・専門サービス
ETSY INC		—	8	115	13,272	小売
MODERNA INC		—	30	509	58,337	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENERAC HOLDINGS INC		—	4	115	13,184	資本財
AON PLC-CLASS A		16	13	367	42,097	保険
CARRIER GLOBAL CORP		70	—	—	—	資本財
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B		—	10	42	4,893	ソフトウェア・サービス
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A		—	3	73	8,406	各種金融
小計	株数・金額	4,859	3,415	65,252	7,468,803	
	銘柄数<比率>	94	100	—	<75.4%>	
(カナダ)				千カナダドル		
CI FINANCIAL CORP		15	—	—	—	各種金融
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		10	38	356	32,147	運輸
DOLLARAMA INC		35	—	—	—	小売
CONSTELLATION SOFTWARE INC		1	1	350	31,633	ソフトウェア・サービス
KIRKLAND LAKE GOLD LTD		—	16	78	7,053	素材
TOPICUS.COM INC-SUB VOTING		3	—	—	—	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	64	56	784	70,834	
	銘柄数<比率>	5	3	—	<0.7%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
RATIONAL AG		0.4	0.3	22	2,863	資本財
FUCHS PETROLUB SE-PREF		4	3	14	1,936	素材
NEMETSCHEK SE		4	3	28	3,708	ソフトウェア・サービス
KNORR-BREMSE AG		5	—	—	—	資本財
HELLOFRESH SE		13	—	—	—	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	28	7	65	8,507	
	銘柄数<比率>	5	3	—	<0.1%>	
(ユーロ…イタリア)						
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		7	6	32	4,198	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FINECOBANK SPA		44	—	—	—	銀行

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
MONCLER SPA		13	—	—	—	耐久消費財・アパレル
DIASORIN SPA		1	1	23	2,977	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	67	8	55	7,175	
	銘柄数<比率>	4	2	—	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)						
HERMES INTERNATIONAL		2	2	280	36,301	耐久消費財・アパレル
IPSEN		2	2	24	3,118	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		2	1	71	9,193	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		—	7	26	3,473	消費者サービス
小計	株数・金額	7	13	402	52,087	
	銘柄数<比率>	3	4	—	<0.5%>	
(ユーロ…オランダ)						
FERRARI NV		9	8	175	22,685	自動車・自動車部品
WOLTERS KLUWER		20	15	144	18,675	商業・専門サービス
ASML HOLDING NV		32	33	2,013	260,363	半導体・半導体製造装置
ADYEN NV		—	1	225	29,162	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV		—	53	121	15,724	メディア・娯楽
小計	株数・金額	62	112	2,681	346,611	
	銘柄数<比率>	3	5	—	<3.5%>	
(ユーロ…ベルギー)						
COLRUYT SA		4	3	12	1,588	食品・生活必需品小売り
SOFINA		—	1	36	4,767	各種金融
小計	株数・金額	4	4	49	6,355	
	銘柄数<比率>	1	2	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
KONE OYJ-B		31	26	152	19,664	資本財
ELISA OYJ		10	7	40	5,228	電気通信サービス
NESTE OYJ		32	—	—	—	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		9	7	26	3,384	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	83	41	218	28,277	
	銘柄数<比率>	4	3	—	<0.3%>	
ユーロ計	株数・金額	252	187	3,473	449,014	
	銘柄数<比率>	20	19	—	<4.5%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BAE SYSTEMS PLC		258	—	—	—	資本財
UNILEVER PLC		198	166	630	97,895	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC		135	—	—	—	商業・専門サービス
HALMA PLC		26	22	56	8,697	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PRUDENTIAL PLC		—	182	227	35,272	保険
SAGE GROUP PLC/THE		73	—	—	—	ソフトウェア・サービス
IMPERIAL BRANDS PLC		68	63	109	16,992	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC		122	—	—	—	消費者サービス
RIO TINTO PLC		85	77	413	64,143	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC		—	289	476	74,012	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANGLO AMERICAN PLC		—	81	271	42,059	素材
INTERTEK GROUP PLC		12	10	55	8,636	商業・専門サービス
PERSIMMON PLC		24	21	50	7,896	耐久消費財・アパレル
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		71	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TAYLOR WIMPEY PLC		239	—	—	—	耐久消費財・アパレル
ADMIRAL GROUP PLC		17	16	50	7,872	保険
ST JAMES'S PLACE PLC		39	—	—	—	各種金融
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		5	4	58	9,105	資本財

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		百株	百株	千イギリスポンド	千円	
HARGREAVES LANSDOWN PLC		35	29	40	6,218	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC		8	—	—	—	素材
AUTO TRADER GROUP PLC		74	62	43	6,699	メディア・娯楽
FERGUSON PLC		17	14	167	25,971	資本財
BHP GROUP LTD		—	135	325	50,591	素材
小計	株数・金額	1,515	1,176	2,977	462,065	
	銘柄数<比率>	19	15	—	<4.7%>	
(スイス)				千スイスフラン		
NESTLE SA-REG		239	—	—	—	食品・飲料・タバコ
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		72	51	1,839	228,923	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SONOVA HOLDING AG-REG		4	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG-REG		—	0.72	112	13,993	ヘルスケア機器・サービス
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		3	2	65	8,210	資本財
GEBERIT AG-REG		3	2	171	21,312	資本財
LOGITECH INTERNATIONAL-REG		14	13	99	12,356	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROCHE HOLDING AG-BR		—	2	87	10,835	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SGS SA-REG		0.5	—	—	—	商業・専門サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		1	1	28	3,601	資本財
TEMENOS AG - REG		—	4	49	6,184	ソフトウェア・サービス
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		4	4	121	15,178	運輸
PARTNERS GROUP HOLDING AG		1	1	263	32,734	各種金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		0.65	0.46	43	5,463	素材
VAT GROUP AG		—	1	64	7,970	資本財
小計	株数・金額	345	87	2,947	366,765	
	銘柄数<比率>	11	12	—	<3.7%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローネ		
ATLAS COPCO AB-B SHS		31	25	1,228	15,273	資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS		53	43	2,451	30,471	資本財
SKANSKA AB-B SHS		—	20	472	5,876	資本財
EPIROC AB-B		29	25	449	5,591	資本財
EPIROC AB-A		47	42	867	10,784	資本財
EVOLUTION AB		13	—	—	—	消費者サービス
小計	株数・金額	175	157	5,470	67,997	
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.7%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		14	11	246	3,194	保険
小計	株数・金額	14	11	246	3,194	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
NOVO NORDISK A/S-B		186	155	10,904	189,414	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		17	13	592	10,283	素材
GN STORE NORD A/S		—	7	303	5,274	ヘルスケア機器・サービス
COLOPLAST-B		12	10	1,061	18,431	ヘルスケア機器・サービス
PANDORA A/S		7	7	521	9,054	耐久消費財・アパレル
GENMAB A/S		5	—	—	—	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	229	194	13,382	232,457	
	銘柄数<比率>	5	5	—	<2.3%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
BHP GROUP LTD		—	185	847	69,065	素材
CSL LTD		36	29	771	62,861	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RIO TINTO LTD		26	26	295	24,087	素材
CIMIC GROUP LTD		7	—	—	—	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	
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
WESFARMERS LTD		91	—	—	—	小売
SYDNEY AIRPORT		100	—	—	—	運輸
FORTESCUE METALS GROUP LTD		122	134	274	22,377	素材
REA GROUP LTD		3	3	45	3,744	メディア・娯楽
MEDIBANK PRIVATE LTD		194	180	56	4,623	保険
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD		11	10	20	1,693	各種金融
小計	株数・金額	595	569	2,313	188,452	
	銘柄数<比率>	9	7	—	<1.9%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		48	40	121	9,225	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD		60	—	—	—	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	108	40	121	9,225	
	銘柄数<比率>	2	1	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		89	81	3,551	52,129	各種金融
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		—	85	1,088	15,971	資本財
XINYI GLASS HOLDINGS LTD		—	120	246	3,620	資本財
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS		—	100	295	4,330	運輸
小計	株数・金額	89	386	5,180	76,051	
	銘柄数<比率>	1	4	—	<0.8%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING		118	96	35	3,040	資本財
SINGAPORE EXCHANGE LTD		72	57	53	4,506	各種金融
小計	株数・金額	190	153	88	7,547	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.1%>	
合計	株数・金額	8,441	6,436	—	9,402,411	
	銘柄数<比率>	174	174	—	<94.9%>	

(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	%
PUBLIC STORAGE		1	0.971	359	41,162	0.4
合計	口数・金額	1	0.971	359	41,162	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.4%>	

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
外国	株式先物取引	SP EMINI	419	－
		SWISS IX	15	－
		EURO ST	38	－
		SPI 200	14	－
		FTSE100	23	－

（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

（2022年２月３日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	9,402,411	94.9
投資証券	41,162	0.4
コール・ローン等、その他	466,924	4.7
投資信託財産総額	9,910,497	100.0

（注）期末における外貨建純資産（9,903,668千円）の投資信託財産総額（9,910,497千円）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＝114.46円	１カナダドル＝90.25円	１ユーロ＝129.28円	１イギリスポンド＝155.20円
１スイスフラン＝124.43円	１スウェーデンクローネ＝12.43円	１ノルウェークローネ＝12.97円	１デンマーククローネ＝17.37円
１オーストラリアドル＝81.45円	１ニュージーランドドル＝75.78円	１香港ドル＝14.68円	１シンガポールドル＝84.92円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年２月３日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	9,956,235,052
コール・ローン等	358,915,879
株式(評価額)	9,402,411,302
投資証券(評価額)	41,162,054
未収入金	53,989,639
未収配当金	2,257,059
差入委託証拠金	97,499,119
(B) 負債	50,267,247
未払金	49,900,635
未払解約金	366,611
未払利息	1
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	9,905,967,805
元本	5,150,435,202
次期繰越損益金	4,755,532,603
(D) 受益権総口数	5,150,435,202口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	19,233円

＜注記事項＞

①期首元本額　6,058,095,585円
　期中追加設定元本額　759,458,957円
　期中一部解約元本額　1,667,119,340円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.9233円です。

○損益の状況 (2021年２月４日～2022年２月３日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	127,478,077
受取配当金	127,691,195
受取利息	210
支払利息	△ 213,328
(B) 有価証券売買損益	2,290,486,000
売買益	2,594,426,148
売買損	△ 303,940,148
(C) 先物取引等取引損益	69,294,835
取引益	77,285,530
取引損	△ 7,990,695
(D) 保管費用等	△ 5,154,160
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	2,482,104,752
(F) 前期繰越損益金	2,955,027,401
(G) 追加信託差損益金	628,573,733
(H) 解約差損益金	△1,310,173,283
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	4,755,532,603
次期繰越損益金(Ｉ)	4,755,532,603

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

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

先進国株式クオリティ・インデックスファンド（適格機関投資家限定）	2,915,867,162円
海外株式セレクション（ラップ向け）	1,144,784,758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）	516,477,229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）	510,457,110円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	53,245,963円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	9,602,980円
合計	5,150,435,202円

851487

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型株式投資信託／バランス型	
信託期間	無期限（2007年３月15日設定）	
運用方針	マザーファンドを通じて、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ます。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。	
主要運用対象	ベビーファンド	外国債券インデックス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。
	マザーファンド	ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	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。
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。	

運用報告書（全体版）

ＭＵＡＭ 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

第15期（決算日：2022年５月12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「ＭＵＡＭ 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）」は、去る５月12日に第15期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG
三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先
お客さま専用フリーダイヤル　０１２０－１５１０３４
（受付時間：営業日の9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～１月３日を除く）
お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額			ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
11期(2018年５月14日)	13,210	0	1.2	112,563.85	1.4	98.9	－	43,897
12期(2019年５月13日)	13,335	0	0.9	113,996.81	1.3	98.7	－	57,420
13期(2020年５月12日)	13,900	0	4.2	119,287.72	4.6	98.6	－	56,332
14期(2021年５月12日)	14,723	0	5.9	126,522.01	6.1	97.7	－	67,469
15期(2022年５月12日)	15,012	0	2.0	129,384.40	2.3	98.7	－	64,673

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
（期　首） 2021年５月12日	14,723	－	126,522.01	－	97.7	－
５月末	14,942	1.5	128,227.80	1.3	97.1	－
６月末	14,914	1.3	128,117.08	1.3	97.6	－
７月末	15,015	2.0	128,989.36	2.0	97.8	－
８月末	15,008	1.9	128,937.19	1.9	97.5	－
９月末	14,902	1.2	128,115.00	1.3	97.4	－
10月末	15,220	3.4	130,788.36	3.4	97.6	－
11月末	15,048	2.2	129,217.14	2.1	97.5	－
12月末	15,138	2.8	130,157.13	2.9	98.0	－
2022年１月末	14,874	1.0	128,015.91	1.2	97.3	－
２月末	14,603	△0.8	125,907.80	△0.5	98.0	－
３月末	15,079	2.4	129,775.21	2.6	97.8	－
４月末	15,110	2.6	129,955.37	2.7	97.7	－
（期　末） 2022年５月12日	15,012	2.0	129,384.40	2.3	98.7	－

（注）騰落率は期首比。
（注）当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第15期：2021年５月13日～2022年５月12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 15 期 首	14,723円
第 15 期 末	15,012円
既払分配金	0円
騰　落　率	2.0%

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまにより異なります。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、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2.0％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（2.3％）を0.3％下回りました。

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。

第15期：2021年５月13日～2022年５月12日

投資環境について

▶ 債券市況

先進国の債券市況は下落しました。

先進国の債券市況は、金融政策引き締め等を背景とした金利上昇により、期首との比較では下落しました。

▶ 為替市況

期首に比べて米ドル、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

▶ ＭＵＡＭ 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

▶ 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。

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

▶ＭＵＡＭ 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

ベンチマークとのカイ離は△0.3％程度となりました。

マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は△0.2％程度でした。

マザーファンド保有による要因

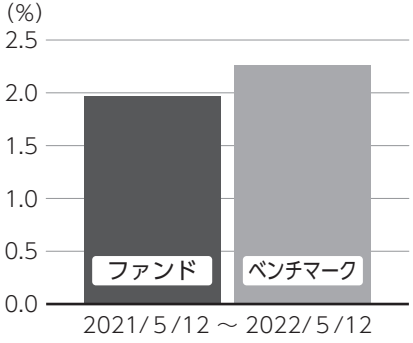
マザーファンド保有による影響は△0.1％程度でした。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ありません。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



分配金について

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

分配原資の内訳

（単位：円、１万口当たり、税込み）

項　目	第15期 2021年５月13日～2022年５月12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	6,270

（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。）

▶ ＭＵＡＭ 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ 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。

2021年５月13日～2022年５月12日

１万口当たりの費用明細

項目	当期 金額（円）	当期 比率（%）	項目の概要
(a)信託報酬	31	0.209	(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）	(20)	(0.132)	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）	(3)	(0.022)	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）	(8)	(0.055)	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)その他費用	2	0.011	(b)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	33	0.220	

期中の平均基準価額は、14,963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）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です。
（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

（2021年５月13日～2022年５月12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
外国債券インデックスマザーファンド	5,644,408	12,978,830	7,492,915	17,191,883

○利害関係人との取引状況等

（2021年５月13日～2022年５月12日）

利害関係人との取引状況

＜ＭＵＡＭ 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞

該当事項はございません。

＜外国債券インデックスマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	24,323	13,310	54.7	23,471	13,202	56.2
為替直物取引	144,540	91,369	63.2	44,380	39,543	89.1

平均保有割合　26.1%

※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。

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

○組入資産の明細

（2022年５月12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
外国債券インデックスマザーファンド	29,803,072	27,954,564	64,667,293

○投資信託財産の構成

（2022年５月12日現在）

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
外国債券インデックスマザーファンド	64,667,293	99.5
コール・ローン等、その他	293,212	0.5
投資信託財産総額	64,960,505	100.0

（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（301,284,927千円）の投資信託財産総額（303,546,959千円）に対する比率は99.3%です。

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

１アメリカドル＝129.77円	１カナダドル＝99.93円	１メキシコペソ＝6.3981円	１ユーロ＝136.58円
１イギリスポンド＝158.93円	１スウェーデンクローネ＝12.89円	１ノルウェークローネ＝13.33円	１デンマーククローネ＝18.36円
１ポーランドズロチ＝29.2119円	１オーストラリアドル＝90.06円	１シンガポールドル＝93.41円	１マレーシアリンギット＝29.6027円
１中国元＝19.3035円	１イスラエルシェケル＝37.6208円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年５月12日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	64,960,505,493
コール・ローン等	290,974,055
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	64,667,293,824
未収入金	2,237,614
(B) 負債	286,535,935
未払解約金	215,296,522
未払信託報酬	71,239,373
未払利息	40
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	64,673,969,558
元本	43,081,286,827
次期繰越損益金	21,592,682,731
(D) 受益権総口数	43,081,286,827口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	15,012円

＜注記事項＞

①期首元本額　45,824,227,338円
　期中追加設定元本額　8,815,085,726円
　期中一部解約元本額　11,558,026,237円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.5012円です。

○損益の状況 (2021年５月13日～2022年５月12日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	△ 8,078
受取利息	83
支払利息	△ 8,161
(B) 有価証券売買損益	1,214,244,567
売買益	1,448,819,220
売買損	△ 234,574,653
(C) 信託報酬等	△ 143,284,523
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	1,070,951,966
(E) 前期繰越損益金	5,020,117,479
(F) 追加信託差損益金	15,501,613,286
(配当等相当額)	(20,888,572,662)
(売買損益相当額)	(△ 5,386,959,376)
(G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	21,592,682,731
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ)	21,592,682,731
追加信託差損益金	15,501,613,286
(配当等相当額)	(20,895,023,275)
(売買損益相当額)	(△ 5,393,409,989)
分配準備積立金	6,120,512,409
繰越損益金	△ 29,442,964

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

②分配金の計算過程

項　　目	2021年５月13日～2022年５月12日
費用控除後の配当等収益額	1,100,394,930円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	20,895,023,275円
分配準備積立金額	5,020,117,479円
当ファンドの分配対象収益額	27,015,535,684円
１万口当たり収益分配対象額	6,270円
１万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

［お知らせ］

①対象インデックスとの連動性維持のために行う外国為替予約取引について明確化するため、外国為替予約取引にかかる記載を追加し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2021年９月30日)

②「ＦＴＳＥ世界国債インデックス」について、2021年10月末より中国国債の組み入れに伴い、当該指数を参照等する当ファンドにおいて、新たに中国国債の組み入れを適宜開始します。

外国債券インデックスマザーファンド

《第21期》決算日2022年５月12日

［計算期間：2021年５月13日～2022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21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21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。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。
主要運用対象	ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
20期(2021年５月12日)	22,636	6.2	126,522.01	6.1	97.7	－	197,147
21期(2022年５月12日)	23,133	2.2	129,384.40	2.3	98.8	－	302,225

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年　月　日	基準価額		ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
（期　首）	円	%		%	%	%
2021年５月12日	22,636	－	126,522.01	－	97.7	－
５月末	22,974	1.5	128,227.80	1.3	97.1	－
６月末	22,935	1.3	128,117.08	1.3	97.6	－
７月末	23,095	2.0	128,989.36	2.0	97.8	－
８月末	23,089	2.0	128,937.19	1.9	97.5	－
９月末	22,929	1.3	128,115.00	1.3	97.4	－
10月末	23,422	3.5	130,788.36	3.4	97.6	－
11月末	23,162	2.3	129,217.14	2.1	97.5	－
12月末	23,305	3.0	130,157.13	2.9	98.0	－
2022年１月末	22,902	1.2	128,015.91	1.2	97.3	－
２月末	22,489	△0.6	125,907.80	△0.5	98.0	－
３月末	23,230	2.6	129,775.21	2.6	97.9	－
４月末	23,282	2.9	129,955.37	2.7	97.7	－
（期　末）						
2022年５月12日	23,133	2.2	129,384.40	2.3	98.8	－

（注）騰落率は期首比。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

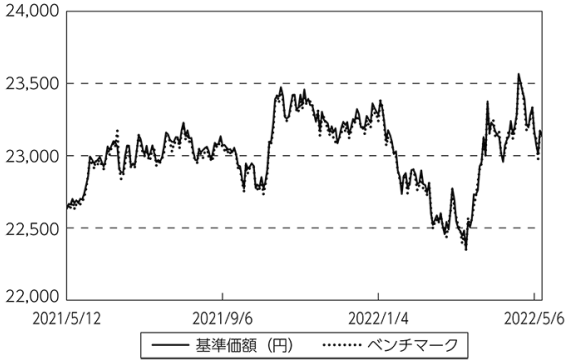
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ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（2.3%）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下落しました。
・先進国の債券市況は、金融政策引き締め等を背景とした金利上昇により、期首との比較では下落しました。

◎為替市況
・期首に比べて米ドル、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
・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。
・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2.3%の上昇になったため、カイ離は△0.1%程度となりました。

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

（主なマイナス要因）
・取引要因によるものです。

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

○１万口当たりの費用明細

（2021年５月13日～2022年５月12日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	3	0.012	(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）	(3)	(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	3	0.012	
期中の平均基準価額は、23,030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

（2021年５月13日～2022年５月12日）

公社債

			買　　付　　額	売　　付　　額
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 1,080,503	千アメリカドル 603,453
	カナダ	国債証券	千カナダドル 41,240	千カナダドル 18,848
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 168,111	千メキシコペソ 62,575
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	102,270	52,175
	イタリア	国債証券	104,166	41,376
	フランス	国債証券	117,831	48,235
	オランダ	国債証券	22,417	6,360
	スペイン	国債証券	170,793	114,710
	ベルギー	国債証券	23,802	6,642
	オーストリア	国債証券	18,798	6,534
	フィンランド	国債証券	6,257	1,742
	アイルランド	国債証券	8,466	3,398
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 57,910	千イギリスポンド 30,408
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 22,604	千スウェーデンクローネ 9,206
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 22,379	千ノルウェークローネ －
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 33,021	千デンマーククローネ 15,143
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 17,657	千ポーランドズロチ 7,509
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 36,009	千オーストラリアドル 29,412
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 12,607	千シンガポールドル 7,649
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 25,246	千マレーシアリンギット 7,760
	中国	国債証券	千中国元 274,306	千中国元 21,270
	イスラエル	国債証券	千イスラエルシェケル 13,565	千イスラエルシェケル 5,062

（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

（2021年５月13日～2022年５月12日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	24,323	13,310	54.7	23,471	13,202	56.2
為替直物取引	144,540	91,369	63.2	44,380	39,543	89.1

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

○組入資産の明細

（2022年５月12日現在）

外国公社債

（A）外国（外貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	1,229,120	1,153,690	149,714,391	49.5	－	21.9	18.2	9.5
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	64,130	60,134	6,009,246	2.0	－	1.0	0.6	0.4
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	362,770	344,969	2,207,147	0.7	－	0.4	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	130,360	139,363	19,034,225	6.3	－	4.1	2.0	0.2
イタリア	178,150	182,021	24,860,526	8.2	－	4.8	2.5	0.9
フランス	184,260	191,262	26,122,645	8.6	－	5.8	2.7	0.2
オランダ	36,440	38,314	5,232,948	1.7	－	1.2	0.5	0.1
スペイン	134,130	139,218	19,014,468	6.3	－	3.3	1.7	1.3
ベルギー	42,280	44,624	6,094,786	2.0	－	1.5	0.5	－
オーストリア	26,780	28,083	3,835,582	1.3	－	0.8	0.5	－
フィンランド	12,330	11,928	1,629,137	0.5	－	0.3	0.2	0.0
アイルランド	14,960	14,853	2,028,732	0.7	－	0.5	0.1	0.0
	千イギリスポンド	千イギリスポンド						
イギリス	90,640	98,303	15,623,414	5.2	－	4.1	0.9	0.2
	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ						
スウェーデン	59,530	58,748	757,265	0.3	－	0.1	0.1	0.0
	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
ノルウェー	56,670	54,119	721,417	0.2	－	0.1	0.1	0.1
	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
デンマーク	59,280	62,754	1,152,167	0.4	－	0.3	0.1	0.0
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	49,630	41,436	1,210,444	0.4	－	0.2	0.2	0.1
	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル						
オーストラリア	53,730	49,752	4,480,744	1.5	－	1.0	0.4	－
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	13,830	13,428	1,254,396	0.4	－	0.2	0.2	0.0
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	50,650	48,949	1,449,034	0.5	－	0.3	0.1	0.0
	千中国元	千中国元						
中国	248,000	253,388	4,891,287	1.6	－	0.8	0.7	0.2
	千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル						
イスラエル	28,510	29,965	1,127,330	0.4	－	0.2	0.1	0.1
合計	－	－	298,451,346	98.8	－	52.9	32.5	13.3

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

(B)外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	償還年月日
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	0.125 T-NOTE 230630	0.125	10,000	9,766	1,267,335	2023/6/30
		0.125 T-NOTE 230715	0.125	5,300	5,169	670,908	2023/7/15
		0.125 T-NOTE 230731	0.125	7,200	7,013	910,182	2023/7/31
		0.125 T-NOTE 230815	0.125	4,500	4,379	568,362	2023/8/15
		0.125 T-NOTE 230831	0.125	7,500	7,287	945,673	2023/8/31
		0.125 T-NOTE 230915	0.125	6,350	6,164	800,026	2023/9/15
		0.125 T-NOTE 231015	0.125	9,200	8,908	1,156,015	2023/10/15
		0.125 T-NOTE 231215	0.125	8,500	8,187	1,062,542	2023/12/15
		0.125 T-NOTE 240115	0.125	9,100	8,745	1,134,962	2024/1/15
		0.125 T-NOTE 240215	0.125	6,800	6,516	845,690	2024/2/15
		0.25 T-NOTE 230615	0.25	1,300	1,273	165,313	2023/6/15
		0.25 T-NOTE 231115	0.25	4,700	4,546	590,048	2023/11/15
		0.25 T-NOTE 250630	0.25	6,650	6,139	796,697	2025/6/30
		0.25 T-NOTE 250731	0.25	5,800	5,342	693,334	2025/7/31
		0.375 T-NOTE 240415	0.375	5,300	5,077	658,926	2024/4/15
		0.375 T-NOTE 240715	0.375	7,700	7,326	950,750	2024/7/15
		0.375 T-NOTE 240815	0.375	7,200	6,832	886,677	2024/8/15
		0.375 T-NOTE 240915	0.375	10,000	9,467	1,228,556	2024/9/15
		0.375 T-NOTE 250430	0.375	2,670	2,485	322,583	2025/4/30
		0.375 T-NOTE 251130	0.375	10,150	9,303	1,207,315	2025/11/30
		0.375 T-NOTE 260131	0.375	7,700	7,025	911,679	2026/1/31
		0.375 T-NOTE 270930	0.375	8,300	7,251	941,024	2027/9/30
		0.5 T-NOTE 250331	0.5	2,000	1,872	242,999	2025/3/31
		0.5 T-NOTE 270430	0.5	7,780	6,924	898,632	2027/4/30
		0.5 T-NOTE 270531	0.5	4,280	3,799	493,104	2027/5/31
		0.5 T-NOTE 270630	0.5	3,000	2,657	344,889	2027/6/30
		0.5 T-NOTE 270831	0.5	4,950	4,364	566,432	2027/8/31
		0.625 T-NOTE 241015	0.625	7,400	7,032	912,658	2024/10/15
		0.625 T-NOTE 260731	0.625	7,930	7,219	936,901	2026/7/31
		0.625 T-NOTE 270331	0.625	1,000	897	116,488	2027/3/31
		0.625 T-NOTE 271231	0.625	9,630	8,488	1,101,577	2027/12/31
		0.625 T-NOTE 300515	0.625	10,140	8,490	1,101,833	2030/5/15
		0.625 T-NOTE 300815	0.625	12,260	10,211	1,325,112	2030/8/15
		0.75 T-NOTE 241115	0.75	4,700	4,471	580,280	2024/11/15
		0.75 T-NOTE 260331	0.75	15,950	14,710	1,909,015	2026/3/31
		0.75 T-NOTE 260430	0.75	1,400	1,289	167,278	2026/4/30
		0.75 T-NOTE 260531	0.75	8,200	7,533	977,654	2026/5/31
		0.75 T-NOTE 260831	0.75	5,500	5,026	652,258	2026/8/31
		0.75 T-NOTE 280131	0.75	9,650	8,535	1,107,681	2028/1/31
		0.875 T-NOTE 260630	0.875	8,300	7,652	993,069	2026/6/30
		0.875 T-NOTE 260930	0.875	10,000	9,173	1,190,487	2026/9/30
		0.875 T-NOTE 301115	0.875	12,980	11,005	1,428,133	2030/11/15
		1 T-NOTE 241215	1.0	8,000	7,649	992,659	2024/12/15
		1 T-NOTE 280731	1.0	2,450	2,179	282,814	2028/7/31
		1.125 T-BOND 400515	1.125	770	548	71,187	2040/5/15
		1.125 T-BOND 400815	1.125	6,170	4,361	566,043	2040/8/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	1.125 T-NOTE 250115	1.125	6,000	5,744	745,467	2025/1/15
		1.125 T-NOTE 250228	1.125	4,150	3,966	514,731	2025/2/28
		1.125 T-NOTE 261031	1.125	5,900	5,465	709,206	2026/10/31
		1.125 T-NOTE 270228	1.125	2,950	2,719	352,853	2027/2/28
		1.125 T-NOTE 280229	1.125	6,200	5,603	727,133	2028/2/29
		1.125 T-NOTE 280831	1.125	5,400	4,834	627,342	2028/8/31
		1.125 T-NOTE 310215	1.125	11,420	9,860	1,279,591	2031/2/15
		1.25 T-BOND 500515	1.25	6,800	4,437	575,892	2050/5/15
		1.25 T-NOTE 230731	1.25	5,830	5,761	747,634	2023/7/31
		1.25 T-NOTE 261130	1.25	7,300	6,795	881,822	2026/11/30
		1.25 T-NOTE 261231	1.25	8,200	7,620	988,877	2026/12/31
		1.25 T-NOTE 280331	1.25	9,950	9,042	1,173,489	2028/3/31
		1.25 T-NOTE 280430	1.25	2,500	2,269	294,466	2028/4/30
		1.25 T-NOTE 280630	1.25	8,480	7,674	995,906	2028/6/30
		1.25 T-NOTE 280930	1.25	8,000	7,207	935,317	2028/9/30
		1.25 T-NOTE 310815	1.25	14,630	12,669	1,644,086	2031/8/15
		1.375 T-BOND 401115	1.375	6,700	4,953	642,788	2040/11/15
		1.375 T-BOND 500815	1.375	7,500	5,068	657,720	2050/8/15
		1.375 T-NOTE 230630	1.375	2,900	2,871	372,628	2023/6/30
		1.375 T-NOTE 230831	1.375	6,550	6,470	839,700	2023/8/31
		1.375 T-NOTE 230930	1.375	6,450	6,362	825,638	2023/9/30
		1.375 T-NOTE 250131	1.375	5,320	5,124	664,972	2025/1/31
		1.375 T-NOTE 281031	1.375	5,400	4,900	635,883	2028/10/31
		1.375 T-NOTE 281231	1.375	8,500	7,703	999,720	2028/12/31
		1.375 T-NOTE 311115	1.375	11,800	10,296	1,336,226	2031/11/15
		1.5 T-NOTE 240930	1.5	6,000	5,824	755,869	2024/9/30
		1.5 T-NOTE 241031	1.5	4,100	3,977	516,136	2024/10/31
		1.5 T-NOTE 241130	1.5	3,930	3,807	494,058	2024/11/30
		1.5 T-NOTE 250215	1.5	4,500	4,345	563,936	2025/2/15
		1.5 T-NOTE 260815	1.5	8,040	7,589	984,906	2026/8/15
		1.5 T-NOTE 270131	1.5	6,940	6,517	845,793	2027/1/31
		1.5 T-NOTE 281130	1.5	7,650	6,990	907,116	2028/11/30
		1.5 T-NOTE 300215	1.5	6,940	6,268	813,428	2030/2/15
		1.625 T-BOND 501115	1.625	8,170	5,907	766,589	2050/11/15
		1.625 T-NOTE 230430	1.625	1,050	1,045	135,651	2023/4/30
		1.625 T-NOTE 230531	1.625	9,650	9,595	1,245,187	2023/5/31
		1.625 T-NOTE 231031	1.625	5,470	5,407	701,745	2023/10/31
		1.625 T-NOTE 260215	1.625	7,260	6,939	900,507	2026/2/15
		1.625 T-NOTE 260515	1.625	6,970	6,638	861,497	2026/5/15
		1.625 T-NOTE 261031	1.625	2,450	2,319	301,046	2026/10/31
		1.625 T-NOTE 261130	1.625	3,400	3,219	417,778	2026/11/30
		1.625 T-NOTE 290815	1.625	9,550	8,754	1,136,092	2029/8/15
		1.625 T-NOTE 310515	1.625	13,750	12,358	1,603,812	2031/5/15
		1.75 T-BOND 410815	1.75	8,530	6,670	865,660	2041/8/15
		1.75 T-NOTE 240731	1.75	5,150	5,046	654,844	2024/7/31
		1.75 T-NOTE 241231	1.75	3,350	3,262	423,419	2024/12/31
		1.75 T-NOTE 250315	1.75	7,200	6,994	907,700	2025/3/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	1.75 T-NOTE 261231	1.75	4,300	4,088	530,502	2026/12/31
		1.75 T-NOTE 290131	1.75	6,000	5,566	722,352	2029/1/31
		1.875 T-BOND 410215	1.875	8,100	6,525	846,822	2041/2/15
		1.875 T-BOND 510215	1.875	9,010	6,944	901,127	2051/2/15
		1.875 T-BOND 511115	1.875	8,010	6,184	802,575	2051/11/15
		1.875 T-NOTE 270228	1.875	7,700	7,356	954,614	2027/2/28
		1.875 T-NOTE 290228	1.875	5,800	5,424	703,919	2029/2/28
		1.875 T-NOTE 320215	1.875	11,300	10,305	1,337,288	2032/2/15
		2 T-BOND 411115	2.0	7,320	5,974	775,295	2041/11/15
		2 T-BOND 500215	2.0	6,440	5,103	662,307	2050/2/15
		2 T-BOND 510815	2.0	8,850	7,036	913,119	2051/8/15
		2 T-NOTE 240430	2.0	3,600	3,557	461,624	2024/4/30
		2 T-NOTE 240531	2.0	11,730	11,577	1,502,461	2024/5/31
		2 T-NOTE 240630	2.0	7,000	6,901	895,615	2024/6/30
		2 T-NOTE 250215	2.0	8,110	7,940	1,030,481	2025/2/15
		2 T-NOTE 250815	2.0	3,790	3,690	478,956	2025/8/15
		2 T-NOTE 261115	2.0	4,100	3,944	511,917	2026/11/15
		2.125 T-NOTE 231130	2.125	3,300	3,283	426,066	2023/11/30
		2.125 T-NOTE 240229	2.125	7,550	7,490	972,032	2024/2/29
		2.125 T-NOTE 240331	2.125	10,160	10,073	1,307,235	2024/3/31
		2.125 T-NOTE 240731	2.125	3,450	3,407	442,145	2024/7/31
		2.125 T-NOTE 240930	2.125	3,300	3,254	422,285	2024/9/30
		2.125 T-NOTE 241130	2.125	1,900	1,870	242,710	2024/11/30
		2.125 T-NOTE 250515	2.125	7,770	7,615	988,304	2025/5/15
		2.125 T-NOTE 260531	2.125	5,000	4,855	630,119	2026/5/31
		2.25 T-BOND 410515	2.25	7,290	6,236	809,367	2041/5/15
		2.25 T-BOND 460815	2.25	3,930	3,259	423,017	2046/8/15
		2.25 T-BOND 490815	2.25	4,750	3,992	518,119	2049/8/15
		2.25 T-BOND 520215	2.25	6,990	5,914	767,485	2052/2/15
		2.25 T-NOTE 231231	2.25	4,190	4,171	541,272	2023/12/31
		2.25 T-NOTE 240131	2.25	8,750	8,704	1,129,543	2024/1/31
		2.25 T-NOTE 240430	2.25	7,600	7,546	979,317	2024/4/30
		2.25 T-NOTE 241031	2.25	4,800	4,742	615,450	2024/10/31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	3,550	3,504	454,816	2024/11/15
		2.25 T-NOTE 251115	2.25	7,390	7,244	940,119	2025/11/15
		2.25 T-NOTE 270215	2.25	7,890	7,664	994,568	2027/2/15
		2.25 T-NOTE 270815	2.25	4,690	4,539	589,126	2027/8/15
		2.25 T-NOTE 271115	2.25	8,090	7,820	1,014,817	2027/11/15
		2.375 T-BOND 420215	2.375	4,420	3,853	500,093	2042/2/15
		2.375 T-BOND 491115	2.375	4,650	4,024	522,250	2049/11/15
		2.375 T-BOND 510515	2.375	8,510	7,368	956,205	2051/5/15
		2.375 T-NOTE 240229	2.375	3,750	3,737	484,964	2024/2/29
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	6,390	6,342	823,011	2024/8/15
		2.375 T-NOTE 270515	2.375	3,410	3,326	431,712	2027/5/15
		2.375 T-NOTE 290331	2.375	3,800	3,666	475,847	2029/3/31
		2.375 T-NOTE 290515	2.375	5,000	4,824	626,089	2029/5/15
		2.5 T-BOND 460215	2.5	3,450	3,009	390,518	2046/2/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	2.5 T-BOND 460515	2.5	3,930	3,424	444,373	2046/5/15
		2.5 T-NOTE 230815	2.5	7,900	7,925	1,028,546	2023/8/15
		2.5 T-NOTE 240131	2.5	6,400	6,393	829,619	2024/1/31
		2.5 T-NOTE 240515	2.5	9,100	9,076	1,177,862	2024/5/15
		2.5 T-NOTE 250131	2.5	3,350	3,325	431,536	2025/1/31
		2.5 T-NOTE 260228	2.5	3,450	3,404	441,865	2026/2/28
		2.5 T-NOTE 270331	2.5	5,500	5,405	701,523	2027/3/31
		2.625 T-NOTE 230630	2.625	2,600	2,612	339,009	2023/6/30
		2.625 T-NOTE 250331	2.625	5,460	5,434	705,278	2025/3/31
		2.625 T-NOTE 250415	2.625	4,000	3,980	516,504	2025/4/15
		2.625 T-NOTE 251231	2.625	6,500	6,449	837,013	2025/12/31
		2.625 T-NOTE 260131	2.625	4,800	4,762	618,078	2026/1/31
		2.625 T-NOTE 290215	2.625	6,910	6,774	879,126	2029/2/15
		2.75 T-BOND 420815	2.75	1,320	1,214	157,619	2042/8/15
		2.75 T-BOND 421115	2.75	2,200	2,021	262,342	2042/11/15
		2.75 T-BOND 470815	2.75	3,210	2,948	382,618	2047/8/15
		2.75 T-BOND 471115	2.75	3,710	3,411	442,705	2047/11/15
		2.75 T-NOTE 230731	2.75	700	704	91,364	2023/7/31
		2.75 T-NOTE 231115	2.75	13,040	13,100	1,700,000	2023/11/15
		2.75 T-NOTE 240215	2.75	8,260	8,283	1,074,914	2024/2/15
		2.75 T-NOTE 250228	2.75	3,440	3,436	445,955	2025/2/28
		2.75 T-NOTE 250630	2.75	5,170	5,159	669,548	2025/6/30
		2.75 T-NOTE 250831	2.75	8,250	8,223	1,067,173	2025/8/31
		2.75 T-NOTE 280215	2.75	10,640	10,540	1,367,808	2028/2/15
		2.875 T-BOND 430515	2.875	3,430	3,209	416,561	2043/5/15
		2.875 T-BOND 450815	2.875	2,800	2,613	339,141	2045/8/15
		2.875 T-BOND 461115	2.875	1,820	1,704	221,161	2046/11/15
		2.875 T-BOND 490515	2.875	5,750	5,482	711,433	2049/5/15
		2.875 T-NOTE 230930	2.875	4,150	4,180	542,458	2023/9/30
		2.875 T-NOTE 231031	2.875	3,700	3,723	483,187	2023/10/31
		2.875 T-NOTE 250430	2.875	6,000	6,013	780,323	2025/4/30
		2.875 T-NOTE 250531	2.875	4,230	4,238	549,999	2025/5/31
		2.875 T-NOTE 251130	2.875	3,800	3,803	493,549	2025/11/30
		2.875 T-NOTE 280515	2.875	12,490	12,449	1,615,508	2028/5/15
		2.875 T-NOTE 280815	2.875	11,510	11,459	1,487,117	2028/8/15
		3 T-BOND 420515	3.0	2,570	2,472	320,819	2042/5/15
		3 T-BOND 441115	3.0	3,370	3,204	415,834	2044/11/15
		3 T-BOND 450515	3.0	2,990	2,846	369,399	2045/5/15
		3 T-BOND 451115	3.0	800	764	99,176	2045/11/15
		3 T-BOND 470215	3.0	4,490	4,300	558,131	2047/2/15
		3 T-BOND 470515	3.0	2,790	2,676	347,377	2047/5/15
		3 T-BOND 480215	3.0	4,680	4,525	587,253	2048/2/15
		3 T-BOND 480815	3.0	5,360	5,194	674,102	2048/8/15
		3 T-BOND 490215	3.0	5,790	5,647	732,936	2049/2/15
		3 T-NOTE 250930	3.0	4,600	4,621	599,786	2025/9/30
		3 T-NOTE 251031	3.0	8,300	8,344	1,082,897	2025/10/31
		3.125 T-BOND 411115	3.125	1,990	1,953	253,480	2041/11/15

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	3.125 T-BOND 420215	3.125	1,600	1,570	203,787	2042/2/15
		3.125 T-BOND 430215	3.125	1,310	1,277	165,788	2043/2/15
		3.125 T-BOND 440815	3.125	4,430	4,307	558,937	2044/8/15
		3.125 T-BOND 480515	3.125	4,410	4,376	567,904	2048/5/15
		3.125 T-NOTE 281115	3.125	9,940	10,038	1,302,712	2028/11/15
		3.375 T-BOND 440515	3.375	2,760	2,793	362,474	2044/5/15
		3.375 T-BOND 481115	3.375	5,430	5,659	734,433	2048/11/15
		3.5 T-BOND 390215	3.5	460	486	63,079	2039/2/15
		3.625 T-BOND 430815	3.625	3,100	3,262	423,312	2043/8/15
		3.625 T-BOND 440215	3.625	3,090	3,249	421,633	2044/2/15
		3.75 T-BOND 410815	3.75	2,010	2,155	279,748	2041/8/15
		3.75 T-BOND 431115	3.75	2,630	2,820	365,985	2043/11/15
		3.875 T-BOND 400815	3.875	2,560	2,808	364,446	2040/8/15
		4.25 T-BOND 390515	4.25	570	659	85,578	2039/5/15
		4.25 T-BOND 401115	4.25	2,200	2,522	327,336	2040/11/15
		4.375 T-BOND 391115	4.375	1,930	2,262	293,601	2039/11/15
		4.375 T-BOND 400515	4.375	1,630	1,908	247,666	2040/5/15
		4.375 T-BOND 410515	4.375	1,510	1,756	227,994	2041/5/15
		4.5 T-BOND 360215	4.5	1,000	1,187	154,112	2036/2/15
		4.5 T-BOND 380515	4.5	730	869	112,797	2038/5/15
		4.5 T-BOND 390815	4.5	1,630	1,941	252,012	2039/8/15
		4.625 T-BOND 400215	4.625	1,670	2,016	261,701	2040/2/15
		4.75 T-BOND 410215	4.75	1,600	1,955	253,700	2041/2/15
		5 T-BOND 370515	5.0	1,570	1,957	254,084	2037/5/15
		5.25 T-BOND 281115	5.25	1,530	1,739	225,755	2028/11/15
		5.375 T-BOND 310215	5.375	1,010	1,202	156,072	2031/2/15
		6 T-BOND 260215	6.0	1,900	2,114	274,397	2026/2/15
		6.125 T-BOND 271115	6.125	3,860	4,483	581,879	2027/11/15
		6.25 T-BOND 230815	6.25	4,530	4,757	617,342	2023/8/15
		6.25 T-BOND 300515	6.25	1,150	1,424	184,795	2030/5/15
小計						149,714,391	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	0.25 CAN GOVT 240401	0.25	3,850	3,678	367,583	2024/4/1
		0.25 CAN GOVT 260301	0.25	2,200	2,000	199,913	2026/3/1
		0.5 CAN GOVT 250901	0.5	800	743	74,253	2025/9/1
		0.5 CAN GOVT 301201	0.5	5,400	4,394	439,093	2030/12/1
		1 CAN GOVT 270601	1.0	1,930	1,767	176,624	2027/6/1
		1.25 CAN GOVT 250301	1.25	2,100	2,015	201,386	2025/3/1
		1.25 CAN GOVT 270301	1.25	2,500	2,324	232,278	2027/3/1
		1.25 CAN GOVT 300601	1.25	3,510	3,084	308,243	2030/6/1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	3,110	3,076	307,404	2023/6/1
		1.5 CAN GOVT 240901	1.5	2,000	1,945	194,438	2024/9/1
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	3,200	3,046	304,404	2026/6/1
		1.5 CAN GOVT 310601	1.5	2,900	2,560	255,869	2031/6/1
		1.5 CAN GOVT 311201	1.5	2,350	2,061	206,007	2031/12/1
		1.75 CAN GOVT 531201	1.75	2,100	1,586	158,528	2053/12/1
		2 CAN GOVT 230901	2.0	3,000	2,977	297,540	2023/9/1

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	2 CAN GOVT 320601	2.0	800	730	72,982	2032/6/1
		2 CAN GOVT 511201	2.0	4,660	3,792	378,977	2051/12/1
		2.25 CAN GOVT 240301	2.25	2,150	2,134	213,282	2024/3/1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	3,100	3,054	305,268	2025/6/1
		2.25 CAN GOVT 290601	2.25	2,210	2,120	211,933	2029/6/1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	2,700	2,688	268,624	2024/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	1,580	1,515	151,471	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	800	753	75,258	2064/12/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,110	1,199	119,851	2045/12/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	800	907	90,680	2041/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	770	947	94,728	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	1,450	1,712	171,154	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,050	1,315	131,461	2033/6/1
小計						6,009,246	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	47,950	49,189	314,717	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	11,150	12,078	77,278	2036/11/20
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	57,900	52,230	334,174	2026/3/5
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	40,250	38,166	244,190	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	39,350	36,558	233,905	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	11,200	10,177	65,114	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	23,890	20,908	133,776	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	28,430	28,103	179,810	2023/12/7
		8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	12,000	11,791	75,442	2024/9/5
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	29,900	26,652	170,525	2047/11/7
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	35,050	34,480	220,612	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	25,700	24,632	157,600	2038/11/18
小計						2,207,147	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	5,680	5,542	757,041	2026/8/15
		0 BUND 271115	—	2,500	2,404	328,392	2027/11/15
		0 BUND 290815	—	990	931	127,243	2029/8/15
		0 BUND 300215	—	2,120	1,982	270,719	2030/2/15
		0 BUND 300815	—	4,960	4,609	629,584	2030/8/15
		0 BUND 310815	—	5,200	4,758	649,885	2031/8/15
		0 BUND 320215	—	1,950	1,768	241,519	2032/2/15
		0 BUND 350515	—	4,580	3,958	540,667	2035/5/15
		0 BUND 360515	—	670	571	78,016	2036/5/15
		0 BUND 500815	—	3,750	2,730	372,904	2050/8/15
		0 BUND 500815	—	440	322	44,008	2050/8/15
		0 BUND 520815	—	1,550	1,095	149,613	2052/8/15
		0 OBL 241018	—	4,400	4,368	596,630	2024/10/18
		0 OBL 250411	—	1,100	1,087	148,566	2025/4/11
		0 OBL 261009	—	2,900	2,822	385,497	2026/10/9
		0.25 BUND 270215	0.25	4,390	4,313	589,120	2027/2/15
		0.25 BUND 280815	0.25	3,540	3,427	468,073	2028/8/15
		0.25 BUND 290215	0.25	4,600	4,433	605,483	2029/2/15

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	0.5 BUND 250215	0.5	6,860	6,889	940,956	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	5,820	5,815	794,320	2026/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	3,820	3,782	516,595	2027/8/15
		0.5 BUND 280215	0.5	3,230	3,186	435,228	2028/2/15
		1 BUND 240815	1.0	3,600	3,659	499,859	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	5,940	6,047	825,971	2025/8/15
		1.25 BUND 480815	1.25	3,600	3,715	507,492	2048/8/15
		1.5 BUND 240515	1.5	4,460	4,576	625,121	2024/5/15
		2 BUND 230815	2.0	3,500	3,594	490,926	2023/8/15
		2.5 BUND 440704	2.5	3,500	4,469	610,467	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	3,570	4,652	635,452	2046/8/15
		3.25 BUND 420704	3.25	2,230	3,090	422,071	2042/7/4
		4 BUND 370104	4.0	3,480	4,842	661,398	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	2,150	3,197	436,729	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	1,790	2,221	303,372	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	3,050	4,346	593,694	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	2,450	3,903	533,106	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	4,400	6,082	830,772	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,790	2,277	311,113	2028/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	3,550	4,971	678,953	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	2,250	2,911	397,652	2027/7/4
イタリア	国債証券	0 ITALY GOVT 240815	—	2,500	2,437	332,894	2024/8/15
		0 ITALY GOVT 260401	—	3,300	3,080	420,740	2026/4/1
		0.25 ITALY GOVT 280315	0.25	1,700	1,518	207,408	2028/3/15
		0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	3,060	2,980	407,074	2025/2/1
		0.45 ITALY GOVT 290215	0.45	1,700	1,491	203,669	2029/2/15
		0.5 ITALY GOVT 260201	0.5	2,450	2,346	320,468	2026/2/1
		0.5 ITALY GOVT 280715	0.5	2,000	1,797	245,457	2028/7/15
		0.6 ITALY GOVT 310801	0.6	3,100	2,543	347,450	2031/8/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	4,720	4,731	646,242	2023/10/15
		0.85 ITALY GOVT 270115	0.85	2,310	2,200	300,562	2027/1/15
		0.9 ITALY GOVT 310401	0.9	2,830	2,409	329,134	2031/4/1
		0.95 ITALY GOVT 311201	0.95	900	757	103,456	2031/12/1
		0.95 ITALY GOVT 320601	0.95	2,100	1,746	238,576	2032/6/1
		0.95 ITALY GOVT 370301	0.95	1,660	1,251	170,914	2037/3/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	2,680	2,608	356,279	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 300401	1.35	3,610	3,293	449,774	2030/4/1
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	2,400	2,408	328,937	2024/11/15
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	2,300	2,296	313,716	2025/5/15
		1.45 ITALY GOVT 360301	1.45	1,940	1,605	219,223	2036/3/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	2,500	2,504	341,997	2025/6/1
		1.5 ITALY GOVT 450430	1.5	650	478	65,321	2045/4/30
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	3,820	3,797	518,631	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 301201	1.65	3,470	3,186	435,219	2030/12/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	3,750	3,379	461,592	2032/3/1
		1.7 ITALY GOVT 510901	1.7	2,060	1,493	204,022	2051/9/1
		1.8 ITALY GOVT 410301	1.8	1,990	1,613	220,319	2041/3/1

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	1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	2,370	2,411	329,308	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	2,680	2,714	370,707	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	3,580	3,554	485,464	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	3,050	3,049	416,477	2027/8/1
		2.1 ITALY GOVT 260715	2.1	2,350	2,379	324,975	2026/7/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	2,500	2,525	344,925	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	1,840	1,680	229,476	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 231001	2.45	1,950	2,003	273,684	2023/10/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	2,470	2,362	322,606	2033/9/1
		2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	1,990	1,713	233,985	2050/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	3,830	3,950	539,550	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	2,330	2,399	327,677	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	2,260	2,104	287,425	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	2,880	2,968	405,380	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	2,380	2,127	290,558	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	1,780	1,754	239,566	2038/9/1
		3 ITALY GOVT 290801	3.0	2,800	2,900	396,156	2029/8/1
		3.1 ITALY GOVT 400301	3.1	1,640	1,638	223,785	2040/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	2,100	2,149	293,543	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	1,830	1,899	259,487	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,740	1,829	249,853	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	3,750	4,017	548,766	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	3,230	3,424	467,734	2024/9/1
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	1,640	1,833	250,357	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	3,460	3,862	527,526	2037/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	3,950	4,117	562,300	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	5,920	6,311	862,091	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	3,440	3,807	520,050	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	3,090	3,539	483,439	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	2,520	3,174	433,541	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	4,050	4,460	609,175	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,700	3,284	448,632	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	2,550	3,200	437,100	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	2,690	3,401	464,617	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	3,610	4,317	589,688	2029/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	2,660	3,366	459,779	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	3,440	4,354	594,707	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	3,950	4,869	665,008	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	2,300	2,841	388,148	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	3,350	3,764	514,177	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O.A.T 240225	—	2,000	1,994	272,405	2024/2/25
		0 O.A.T 240325	—	2,000	1,991	272,041	2024/3/25
		0 O.A.T 250225	—	3,200	3,150	430,325	2025/2/25
		0 O.A.T 250325	—	6,580	6,479	884,907	2025/3/25
		0 O.A.T 260225	—	4,600	4,474	611,136	2026/2/25
		0 O.A.T 270225	—	4,200	4,021	549,255	2027/2/25
		0 O.A.T 291125	—	4,730	4,313	589,113	2029/11/25

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	0 O.A.T 301125	—	6,190	5,519	753,794	2030/11/25
		0 O.A.T 311125	—	5,500	4,790	654,221	2031/11/25
		0 O.A.T 320525	—	1,500	1,289	176,064	2032/5/25
		0.25 O.A.T 261125	0.25	4,750	4,621	631,187	2026/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	5,840	5,827	795,912	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	5,300	5,241	715,863	2026/5/25
		0.5 O.A.T 290525	0.5	5,900	5,640	770,437	2029/5/25
		0.5 O.A.T 400525	0.5	2,630	2,089	285,325	2040/5/25
		0.5 O.A.T 440625	0.5	1,730	1,304	178,230	2044/6/25
		0.5 O.A.T 720525	0.5	1,100	591	80,734	2072/5/25
		0.75 O.A.T 280525	0.75	6,000	5,901	806,014	2028/5/25
		0.75 O.A.T 281125	0.75	5,960	5,835	796,990	2028/11/25
		0.75 O.A.T 520525	0.75	3,690	2,694	367,957	2052/5/25
		0.75 O.A.T 530525	0.75	1,740	1,246	170,251	2053/5/25
		1 O.A.T 251125	1.0	4,480	4,530	618,752	2025/11/25
		1 O.A.T 270525	1.0	4,550	4,568	623,999	2027/5/25
		1.25 O.A.T 340525	1.25	3,970	3,793	518,176	2034/5/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	5,000	4,698	641,751	2036/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	6,400	6,478	884,835	2031/5/25
		1.5 O.A.T 500525	1.5	3,890	3,545	484,277	2050/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	4,020	4,152	567,156	2024/11/25
		1.75 O.A.T 390625	1.75	3,750	3,761	513,683	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	1,750	1,651	225,612	2066/5/25
		2 O.A.T 480525	2.0	3,430	3,505	478,848	2048/5/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	6,190	6,436	879,076	2024/5/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	6,850	7,512	1,026,095	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	6,690	7,329	1,001,071	2027/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	3,610	4,536	619,571	2045/5/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	5,590	6,190	845,467	2026/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	3,190	4,215	575,773	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	2,500	3,743	511,278	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	1,840	2,849	389,125	2060/4/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	4,640	6,593	900,553	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	3,970	5,404	738,144	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	4,560	5,899	805,764	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	4,760	6,717	917,533	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	3,490	4,128	563,924	2025/10/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 240115	—	1,540	1,537	210,020	2024/1/15
		0 NETH GOVT 270115	—	1,350	1,302	177,936	2027/1/15
		0 NETH GOVT 290115	—	500	466	63,774	2029/1/15
		0 NETH GOVT 300715	—	2,650	2,420	330,587	2030/7/15
		0 NETH GOVT 380115	—	1,140	909	124,159	2038/1/15
		0 NETH GOVT 520115	—	1,300	884	120,788	2052/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,930	1,913	261,377	2025/7/15
		0.25 NETH GOVT 290715	0.25	2,300	2,175	297,151	2029/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	3,850	3,824	522,395	2026/7/15
		0.5 NETH GOVT 400115	0.5	1,170	1,002	136,879	2040/1/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	0.75 NETH GOVT 270715	0.75	2,670	2,660	363,318	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	2,150	2,127	290,573	2028/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	3,300	3,423	467,525	2024/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	2,010	2,249	307,182	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	2,490	3,253	444,301	2047/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	2,210	3,090	422,144	2042/1/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	2,400	3,213	438,926	2037/1/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,480	1,859	253,905	2028/1/15
スペイン	国債証券	0 SPAIN GOVT 240531	—	10,600	10,487	1,432,380	2024/5/31
		0 SPAIN GOVT 250131	—	2,930	2,870	392,033	2025/1/31
		0 SPAIN GOVT 250531	—	2,800	2,722	371,787	2025/5/31
		0 SPAIN GOVT 260131	—	4,300	4,133	564,560	2026/1/31
		0 SPAIN GOVT 270131	—	2,800	2,637	360,162	2027/1/31
		0 SPAIN GOVT 280131	—	2,800	2,584	352,963	2028/1/31
		0.1 SPAIN GOVT 310430	0.1	2,660	2,270	310,101	2031/4/30
		0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35	9,720	9,756	1,332,585	2023/7/30
		0.5 SPAIN GOVT 300430	0.5	2,230	2,033	277,760	2030/4/30
		0.5 SPAIN GOVT 311031	0.5	3,900	3,410	465,817	2031/10/31
		0.6 SPAIN GOVT 291031	0.6	1,300	1,207	164,933	2029/10/31
		0.8 SPAIN GOVT 270730	0.8	2,500	2,435	332,575	2027/7/30
		0.85 SPAIN GOVT 370730	0.85	250	201	27,531	2037/7/30
		1 SPAIN GOVT 501031	1.0	2,380	1,655	226,115	2050/10/31
		1.2 SPAIN GOVT 401031	1.2	2,330	1,906	260,359	2040/10/31
		1.25 SPAIN GOVT 301031	1.25	3,230	3,096	422,966	2030/10/31
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	1,250	1,259	172,002	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	2,540	2,537	346,603	2028/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	3,000	2,991	408,583	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	2,330	2,342	319,960	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	2,960	2,939	401,499	2029/4/30
		1.45 SPAIN GOVT 711031	1.45	620	400	54,658	2071/10/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	3,000	3,032	414,198	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	510	521	71,250	2025/4/30
		1.85 SPAIN GOVT 350730	1.85	2,500	2,385	325,819	2035/7/30
		1.9 SPAIN GOVT 521031	1.9	800	678	92,623	2052/10/31
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	4,570	4,723	645,130	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	2,590	2,633	359,695	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	3,180	3,313	452,605	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	2,610	2,677	365,706	2033/7/30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	1,920	2,003	273,698	2048/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	2,310	2,508	342,625	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	1,800	2,082	284,452	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	6,210	6,612	903,076	2024/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	2,950	3,679	502,522	2037/1/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	3,300	3,503	478,543	2023/10/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	2,310	2,583	352,908	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	2,620	3,574	488,253	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	7,790	8,392	1,146,271	2024/1/31

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	2,810	3,896	532,123	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	3,200	3,923	535,847	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	2,230	3,299	450,641	2044/10/31
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	3,790	5,118	699,113	2032/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,700	2,192	299,416	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0 BEL GOVT 311022	—	1,700	1,478	201,941	2031/10/22
		0.1 BEL GOVT 300622	0.1	1,500	1,362	186,114	2030/6/22
		0.4 BEL GOVT 400622	0.4	800	611	83,562	2040/6/22
		0.5 BEL GOVT 241022	0.5	1,740	1,745	238,345	2024/10/22
		0.65 BEL GOVT 710622	0.65	740	417	57,080	2071/6/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	2,170	2,186	298,623	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,930	1,919	262,133	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	1,750	1,726	235,845	2028/6/22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	2,280	2,238	305,710	2029/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	2,240	2,264	309,303	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	1,800	1,738	237,386	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	1,580	1,539	210,291	2033/4/22
		1.4 BEL GOVT 530622	1.4	570	483	66,012	2053/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	720	680	92,946	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	1,370	1,261	172,270	2047/6/22
		1.7 BEL GOVT 500622	1.7	1,300	1,212	165,548	2050/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	1,110	1,114	152,242	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	810	831	113,532	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	780	821	112,265	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	2,980	3,127	427,182	2024/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	930	1,064	145,337	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	1,050	1,390	189,855	2045/6/22
		4 BEL GOVT 320328	4.0	1,140	1,402	191,502	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	2,200	2,981	407,268	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	1,790	2,055	280,772	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	2,540	3,484	475,977	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	2,760	3,483	475,732	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 300220	—	1,450	1,310	179,042	2030/2/20
		0 AUSTRIA GOVT 310220	—	1,350	1,195	163,341	2031/2/20
		0 AUSTRIA GOVT 401020	—	550	400	54,701	2040/10/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	1,400	1,375	187,828	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	1,310	1,252	171,058	2029/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	1,940	1,929	263,566	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,510	1,488	203,236	2028/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 510320	0.75	780	619	84,553	2051/3/20
		0.9 AUSTRIA GOVT 320220	0.9	620	586	80,054	2032/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	1,710	1,737	237,273	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	990	968	132,233	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	460	395	54,039	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	4,030	4,158	567,938	2024/10/21
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	1,040	1,084	148,065	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	1,760	1,929	263,534	2034/5/23

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	840	1,086	148,430	2044/6/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	560	889	121,485	2062/1/26
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,870	2,505	342,147	2037/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	1,370	1,591	217,343	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	1,240	1,579	215,708	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 240915	—	850	843	115,189	2024/9/15
		0 FINNISH GOVT 300915	—	750	672	91,883	2030/9/15
		0.125 FINNISH GOV 310915	0.125	270	239	32,724	2031/9/15
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	510	416	56,850	2036/4/15
		0.125 FINNISH GOV 520415	0.125	360	235	32,135	2052/4/15
		0.25 FINNISH GOVT 400915	0.25	500	389	53,173	2040/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	1,670	1,655	226,040	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	700	684	93,503	2027/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	580	559	76,350	2028/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 290915	0.5	720	685	93,635	2029/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 430415	0.5	330	262	35,839	2043/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	820	780	106,548	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	630	635	86,805	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	630	600	82,069	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	540	522	71,336	2047/4/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	420	434	59,383	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	680	794	108,580	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	730	806	110,123	2028/7/4
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	640	709	96,962	2025/7/4
アイルランド	国債証券	0 IRISH GOVT 311018	—	350	301	41,222	2031/10/18
		0.2 IRISH GOVT 301018	0.2	620	559	76,387	2030/10/18
		0.35 IRISH GOVT 321018	0.35	400	350	47,848	2032/10/18
		0.4 IRISH GOVT 350515	0.4	700	588	80,381	2035/5/15
		0.55 IRISH GOVT 410422	0.55	150	117	16,081	2041/4/22
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	1,860	1,836	250,818	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	1,040	1,050	143,428	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	1,400	1,388	189,576	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	630	604	82,532	2033/5/15
		1.35 IRISH GOVT 310318	1.35	1,070	1,063	145,260	2031/3/18
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	780	697	95,274	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	1,180	1,162	158,744	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	1,220	1,240	169,378	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	1,640	1,776	242,581	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	820	867	118,542	2024/3/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,100	1,249	170,672	2025/3/13
小計						107,853,054	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
	国債証券	0.125 GILT 240131	0.125	2,500	2,447	388,997	2024/1/31
		0.125 GILT 260130	0.125	1,100	1,049	166,740	2026/1/30
		0.25 GILT 250131	0.25	3,600	3,486	554,129	2025/1/31
		0.25 GILT 310731	0.25	2,660	2,305	366,442	2031/7/31
		0.375 GILT 261022	0.375	800	760	120,913	2026/10/22

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	
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	0.375 GILT 301022	0.375	1,690	1,512	240,348	2030/10/22
		0.5 GILT 290131	0.5	1,250	1,156	183,856	2029/1/31
		0.5 GILT 611022	0.5	1,020	614	97,695	2061/10/22
		0.625 GILT 250607	0.625	1,380	1,350	214,595	2025/6/7
		0.625 GILT 350731	0.625	2,440	2,032	322,984	2035/7/31
		0.625 GILT 501022	0.625	1,240	857	136,293	2050/10/22
		0.875 GILT 291022	0.875	2,060	1,946	309,430	2029/10/22
		0.875 GILT 460131	0.875	970	744	118,314	2046/1/31
		1 GILT 240422	1.0	1,700	1,690	268,604	2024/4/22
		1 GILT 320131	1.0	500	461	73,306	2032/1/31
		1.125 GILT 390131	1.125	1,610	1,383	219,958	2039/1/31
		1.125 GILT 731022	1.125	450	343	54,628	2073/10/22
		1.25 GILT 270722	1.25	1,770	1,750	278,143	2027/7/22
		1.25 GILT 411022	1.25	2,630	2,259	359,049	2041/10/22
		1.25 GILT 510731	1.25	1,260	1,029	163,571	2051/7/31
		1.5 GILT 260722	1.5	3,490	3,499	556,246	2026/7/22
		1.5 GILT 470722	1.5	1,840	1,615	256,824	2047/7/22
		1.625 GILT 281022	1.625	1,540	1,547	245,939	2028/10/22
		1.625 GILT 541022	1.625	1,530	1,378	219,027	2054/10/22
		1.625 GILT 711022	1.625	1,530	1,407	223,639	2071/10/22
		1.75 GILT 370907	1.75	2,210	2,103	334,260	2037/9/7
		1.75 GILT 490122	1.75	1,180	1,093	173,841	2049/1/22
		1.75 GILT 570722	1.75	2,130	1,987	315,819	2057/7/22
		2 GILT 250907	2.0	1,760	1,795	285,294	2025/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	2,060	2,397	381,013	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	1,900	1,960	311,536	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	1,810	2,155	342,650	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	2,700	3,354	533,144	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	1,700	2,507	398,516	2068/7/22
		3.75 GILT 520722	3.75	1,930	2,649	421,147	2052/7/22
		4 GILT 600122	4.0	1,700	2,603	413,809	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	2,320	2,654	421,897	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	2,750	3,353	532,956	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	1,750	2,207	350,773	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	1,450	1,898	301,728	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	1,590	2,104	334,396	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	2,350	3,294	523,578	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	1,510	2,181	346,719	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	1,730	2,656	422,186	2055/12/7
		4.5 GILT 340907	4.5	1,630	2,073	329,526	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	2,250	3,134	498,193	2042/12/7
		4.75 GILT 301207	4.75	2,330	2,894	460,016	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	1,730	2,374	377,375	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	2,070	2,273	361,331	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	1,540	1,963	312,016	2028/12/7
小計						15,623,414	

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	
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	千円	
	国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	0.125	7,850	6,727	86,719	2031/5/12
		0.75 SWD GOVT 280512	0.75	6,900	6,488	83,634	2028/5/12
		0.75 SWD GOVT 291112	0.75	6,300	5,814	74,954	2029/11/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0	10,460	10,129	130,571	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	9,940	9,975	128,589	2023/11/13
		2.25 SWD GOVT 320601	2.25	4,350	4,499	58,000	2032/6/1
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	8,260	8,473	109,227	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	5,470	6,638	85,568	2039/3/30
小計						757,265	
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	1.25 NORWE GOVT 310917	1.25	3,500	3,032	40,421	2031/9/17
		1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	7,570	6,742	89,881	2030/8/19
		1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	4,860	4,656	62,065	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	8,950	8,744	116,560	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	4,170	3,986	53,144	2027/2/17
		1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	4,200	3,895	51,931	2029/9/6
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	5,920	5,930	79,056	2023/5/24
		2 NORWE GOVT 280426	2.0	6,200	5,932	79,084	2028/4/26
		2.125 NORWE GOVT 320518	2.125	3,000	2,797	37,286	2032/5/18
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	8,300	8,400	111,984	2024/3/14
小計						721,417	
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 DMK GOVT 241115	—	2,300	2,270	41,683	2024/11/15
		0 DMK GOVT 311115	—	7,500	6,601	121,195	2031/11/15
		0.25 DMK GOVT 521115	0.25	5,400	3,849	70,685	2052/11/15
		0.5 DMK GOVT 271115	0.5	9,050	8,790	161,396	2027/11/15
		0.5 DMK GOVT 291115	0.5	10,550	10,028	184,125	2029/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	3,250	3,319	60,950	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	7,490	7,745	142,214	2025/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	13,740	20,147	369,916	2039/11/15
小計						1,152,167	
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	0.25 POLAND 261025	0.25	3,000	2,234	65,266	2026/10/25
		1.25 POLAND 301025	1.25	4,090	2,664	77,845	2030/10/25
		1.75 POLAND 320425	1.75	1,000	637	18,618	2032/4/25
		2.25 POLAND 241025	2.25	4,000	3,590	104,870	2024/10/25
		2.5 POLAND 240425	2.5	2,600	2,405	70,281	2024/4/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	6,540	5,460	159,504	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	2.5	5,190	4,164	121,659	2027/7/25
		2.75 POLAND 280425	2.75	4,760	3,777	110,349	2028/4/25
		2.75 POLAND 291025	2.75	3,400	2,587	75,582	2029/10/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	7,300	6,521	190,493	2025/7/25
		4 POLAND 231025	4.0	4,300	4,154	121,365	2023/10/25
		5.75 POLAND 290425	5.75	3,450	3,238	94,608	2029/4/25
小計						1,210,444	
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	900	843	75,962	2024/11/21

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
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	千円	
	国債証券	0.25 AUST GOVT 251121	0.25	3,450	3,129	281,868	2025/11/21
		1 AUST GOVT 301221	1.0	1,110	908	81,805	2030/12/21
		1 AUST GOVT 311121	1.0	3,610	2,886	259,973	2031/11/21
		1.25 AUST GOVT 320521	1.25	2,500	2,027	182,578	2032/5/21
		1.5 AUST GOVT 310621	1.5	2,590	2,193	197,510	2031/6/21
		1.75 AUST GOVT 321121	1.75	2,780	2,349	211,595	2032/11/21
		1.75 AUST GOVT 510621	1.75	1,990	1,264	113,912	2051/6/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	1,250	1,180	106,282	2028/5/21
		2.5 AUST GOVT 300521	2.5	3,940	3,688	332,186	2030/5/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	2,090	2,039	183,676	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 281121	2.75	1,630	1,576	141,945	2028/11/21
		2.75 AUST GOVT 291121	2.75	2,210	2,117	190,691	2029/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	960	871	78,517	2035/6/21
		2.75 AUST GOVT 410521	2.75	1,020	872	78,546	2041/5/21
		3 AUST GOVT 331121	3.0	1,900	1,801	162,215	2033/11/21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	1,360	1,173	105,681	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	5,260	5,304	477,736	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	2,260	2,246	202,334	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	2,040	1,905	171,574	2039/6/21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	1,300	1,307	117,723	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	3,320	3,463	311,910	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	2,210	2,404	216,581	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	2,050	2,197	197,935	2027/4/21
小計						4,480,744	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 261101	1.25	700	660	61,692	2026/11/1
		1.625 SINGAPORGOV 310701	1.625	450	407	38,091	2031/7/1
		1.875 SINGAPORGOV 500301	1.875	700	577	53,944	2050/3/1
		1.875 SINGAPORGOV 511001	1.875	950	782	73,077	2051/10/1
		2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	1,530	1,505	140,630	2026/6/1
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	2.25	830	764	71,453	2036/8/1
		2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	600	599	55,984	2025/6/1
		2.375 SINGAPORGOV 390701	2.375	380	349	32,691	2039/7/1
		2.625 SINGAPORGOV 280501	2.625	800	798	74,541	2028/5/1
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	1,000	1,008	94,185	2023/7/1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	790	769	71,838	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	920	927	86,667	2029/7/1
		2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	1,140	1,146	107,126	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	1,500	1,522	142,174	2024/9/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	780	819	76,502	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	760	789	73,792	2027/3/1
小計						1,254,396	
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	2.632 MALAYSIAGOV 310415	2.632	1,800	1,536	45,498	2031/4/15
		3.502MALAYSIAGOVT 270531	3.502	1,400	1,357	40,183	2027/5/31
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	2,100	2,029	60,075	2028/6/15
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	3.757	1,880	1,602	47,425	2040/5/22

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
マレーシア			%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
	国債証券	3.8 MALAYSIAGOVT 230817	3.8	1,950	1,971	58,370	2023/8/17
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	2,300	2,076	61,472	2034/7/5
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	1,400	1,290	38,201	2033/4/15
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	3.882	1,000	1,002	29,674	2025/3/14
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	2,000	1,917	56,755	2029/8/15
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	1,500	1,480	43,830	2027/3/15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	1,100	1,080	31,980	2027/11/16
		3.9 MALAYSIAGOVT 261130	3.9	2,500	2,477	73,350	2026/11/30
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	1,400	1,390	41,152	2026/7/15
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	3,920	3,922	116,115	2025/9/15
		4.065 MALAYSIAGOV 500615	4.065	600	503	14,892	2050/6/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	4,100	4,134	122,381	2024/7/15
		4.232MALAYSIAGOVT 310630	4.232	3,050	2,953	87,418	2031/6/30
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	2,150	2,011	59,557	2035/5/31
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	900	906	26,820	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	2,240	2,225	65,878	2030/4/15
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	4.642	1,200	1,182	35,005	2033/11/7
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	1,650	1,557	46,111	2046/3/15
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	3,340	3,305	97,849	2037/4/7
		4.893 MALAYSIAGOV 380608	4.893	950	937	27,749	2038/6/8
		4.921 MALAYSIAGOV 480706	4.921	2,020	1,934	57,271	2048/7/6
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	2,200	2,162	64,012	2043/9/30
小計						1,449,034	
中国				千中国元	千中国元		
	国債証券	1.99 CHINA GOVT 250409	1.99	20,000	19,742	381,107	2025/4/9
		2.36 CHINA GOVT 230702	2.36	11,000	11,022	212,770	2023/7/2
		2.37 CHINA GOVT 270120	2.37	11,000	10,903	210,472	2027/1/20
		2.56 CHINA GOVT 231021	2.56	9,000	9,045	174,604	2023/10/21
		2.68 CHINA GOVT 300521	2.68	6,000	5,913	114,151	2030/5/21
		2.69 CHINA GOVT 260812	2.69	1,000	1,004	19,394	2026/8/12
		2.75 CHINA GOVT 320217	2.75	3,000	2,981	57,552	2032/2/17
		2.8 CHINA GOVT 290324	2.8	6,000	5,992	115,681	2029/3/24
		2.85 CHINA GOVT 270604	2.85	6,000	6,056	116,904	2027/6/4
		2.89 CHINA GOVT 311118	2.89	5,000	5,017	96,857	2031/11/18
		2.9 CHINA GOVT 260505	2.9	6,000	6,072	117,212	2026/5/5
		2.91 CHINA GOVT 281014	2.91	6,000	6,040	116,599	2028/10/14
		2.94 CHINA GOVT 241017	2.94	6,000	6,085	117,462	2024/10/17
		3.01 CHINA GOVT 280513	3.01	6,000	6,088	117,534	2028/5/13
		3.02 CHINA GOVT 251022	3.02	12,000	12,197	235,462	2025/10/22
		3.02 CHINA GOVT 310527	3.02	5,000	5,056	97,604	2031/5/27
		3.03 CHINA GOVT 260311	3.03	8,000	8,140	157,138	2026/3/11
		3.12 CHINA GOVT 261205	3.12	10,000	10,223	197,356	2026/12/5
		3.13 CHINA GOVT 291121	3.13	7,000	7,141	137,855	2029/11/21
		3.25 CHINA GOVT 281122	3.25	8,000	8,246	159,176	2028/11/22
		3.27 CHINA GOVT 301119	3.27	13,000	13,432	259,299	2030/11/19
		3.28 CHINA GOVT 271203	3.28	7,000	7,223	139,431	2027/12/3
		3.29 CHINA GOVT 290523	3.29	4,000	4,139	79,913	2029/5/23

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
中国			%	千中国元	千中国元	千円	
	国債証券	3.39 CHINA GOVT 500316	3.39	4,000	3,999	77,213	2050/3/16
		3.53 CHINA GOVT 511018	3.53	3,000	3,108	59,999	2051/10/18
		3.54 CHINA GOVT 280816	3.54	4,000	4,208	81,234	2028/8/16
		3.57 CHINA GOVT 240622	3.57	10,000	10,279	198,436	2024/6/22
		3.61 CHINA GOVT 250607	3.61	10,000	10,371	200,214	2025/6/7
		3.72 CHINA GOVT 510412	3.72	4,000	4,258	82,199	2051/4/12
		3.77 CHINA GOVT 250308	3.77	11,000	11,452	221,065	2025/3/8
		3.81 CHINA GOVT 500914	3.81	8,000	8,643	166,840	2050/9/14
		3.86 CHINA GOVT 490722	3.86	5,000	5,438	104,973	2049/7/22
		4.08 CHINA GOVT 230822	4.08	8,000	8,231	158,890	2023/8/22
		4.08 CHINA GOVT 481022	4.08	5,000	5,629	108,674	2048/10/22
小計						4,891,287	
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	0.5 ISRAEL FIXED 250430	0.5	4,000	3,846	144,712	2025/4/30
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	1.0	2,800	2,515	94,635	2030/3/31
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	1.5	2,400	2,008	75,545	2037/5/31
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	4,180	4,251	159,944	2028/9/28
		3.75 ISRAEL FIXED 240331	3.75	6,250	6,525	245,487	2024/3/31
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	3.75	2,800	3,049	114,708	2047/3/31
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	2,580	3,529	132,775	2042/1/31
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	3,500	4,240	159,521	2026/10/30
小計						1,127,330	
合計						298,451,346	

(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

(2022年５月12日現在)

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
公社債	298,451,346	98.3
コール・ローン等、その他	5,095,613	1.7
投資信託財産総額	303,546,959	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（301,284,927千円）の投資信託財産総額（303,546,959千円）に対する比率は99.3%です。

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

１アメリカドル＝129.77円	１カナダドル＝99.93円	１メキシコペソ＝6.3981円	１ユーロ＝136.58円
１イギリスポンド＝158.93円	１スウェーデンクローネ＝12.89円	１ノルウェークローネ＝13.33円	１デンマーククローネ＝18.36円
１ポーランドズロチ＝29.2119円	１オーストラリアドル＝90.06円	１シンガポールドル＝93.41円	１マレーシアリンギット＝29.6027円
１中国元＝19.3035円	１イスラエルシェケル＝37.6208円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年５月12日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	305,505,041,966
コール・ローン等	3,005,298,531
公社債(評価額)	298,451,346,094
未収入金	1,958,317,583
未収利息	1,806,370,005
前払費用	283,709,753
(B) 負債	3,279,311,511
未払金	2,881,020,926
未払解約金	398,290,399
未払利息	186
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	302,225,730,455
元本	130,645,783,749
次期繰越損益金	171,579,946,706
(D) 受益権総口数	130,645,783,749口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	23,133円

＜注記事項＞

①期首元本額　87,094,050,705円
　期中追加設定元本額　62,049,820,231円
　期中一部解約元本額　18,498,087,187円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.3133円です。

○損益の状況 (2021年５月13日～2022年５月12日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	5,434,823,246
受取利息	5,445,029,486
その他収益金	106,450
支払利息	△ 10,312,690
(B) 有価証券売買損益	△ 490,790,063
売買益	32,917,498,261
売買損	△ 33,408,288,324
(C) 保管費用等	△ 29,768,214
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	4,914,264,969
(E) 前期繰越損益金	110,053,119,636
(F) 追加信託差損益金	80,630,436,092
(G) 解約差損益金	△ 24,017,873,991
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	171,579,946,706
次期繰越損益金(Ｈ)	171,579,946,706

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

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

ＭＵＡＭ 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	27,954,564,399円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 先進国債券インデックス	19,777,119,306円
三菱ＵＦＪ ＤＣ海外債券インデックスファンド	12,350,285,889円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	7,771,715,295円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	5,455,901,996円
ｅＭＡＸＩＳ 先進国債券インデックス	4,491,532,555円
海外債券セレクション（ラップ向け）	4,028,989,668円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	3,760,553,557円
ＭＵＡＭ 世界債券オープン（適格機関投資家限定）	3,602,811,119円
つみたて８資産均等バランス	3,530,516,423円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン（確定拠出年金）	2,874,004,026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）	2,725,615,669円
ラップ向けインデックスｆ 先進国債券	2,582,125,247円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	2,138,276,166円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	2,080,670,356円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,929,426,106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）	1,874,028,558円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞外国債券インデックスファンド	1,867,689,160円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（年１回決算型）	1,762,069,735円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,667,434,944円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	1,495,305,690円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	1,345,337,739円
ワールド・インカムオープン	1,136,974,765円
つみたて４資産均等バランス	1,081,421,163円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン	968,492,808円

三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	774,860,477円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式65）	613,884,567円
ファンド・マネジャー（海外債券）	601,253,761円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	575,998,695円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	556,737,085円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	549,854,318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）	549,408,221円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式40）	545,792,953円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	538,904,214円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス（先進国債券）	524,363,536円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	434,344,879円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）	433,656,887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）	426,323,708円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式15）	383,757,287円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	322,378,121円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	271,791,147円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	229,513,465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）	201,912,456円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	199,118,592円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	183,572,650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）	163,349,284円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	131,120,449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）	114,385,679円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	114,207,191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）	112,162,220円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式25）	109,591,461円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	105,468,579円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	98,736,927円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	93,113,760円
アドバンスト・バランスＩ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	70,758,398円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	59,517,350円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	49,872,436円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	40,289,876円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	26,443,302円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	25,537,290円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	24,547,591円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,004,297円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	19,346,496円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	15,550,213円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	15,373,571円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドＶＡ２（適格機関投資家限定）	14,845,502円
三菱ＵＦＪ 外国債券インデックスファンドＶＡ	11,048,572円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）	8,181,139円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	7,195,846円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	6,313,305円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	3,875,165円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,464,137円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	2,026,397円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	1,698,181円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	1,467,097円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	1,280,305円
コアバランス	1,278,760円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式80）	966,234円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	883,282円

三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	839,583円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	646,145円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	99,608円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,763円
合計	130,645,783,749円

［お知らせ］

①対象インデックスとの連動性維持のために行う外国為替予約取引について明確化するため、外国為替予約取引にかかる記載を追加し、信託約款に所要の変更を行いました。
（2021年９月30日）

②「ＦＴＳＥ世界国債インデックス」について、2021年10月末より中国国債の組み入れに伴い、当該指数を参照等する当ファンドにおいて、新たに中国国債の組み入れを適宜開始します。

iシェアーズ グローバル・リート ETF
(iShares Global REIT ETF)
損益計算書、純資産変動計算書、投資明細表は、入手可能なANNUAL REPORTから抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

1．損益計算書

(2022年４月30日に終了する会計年度)
(米ドルで表示)

投資収益		
受取配当金-マスターファンド以外	$	88,106,526
受取配当金-マスターファンド		5,921
有価証券貸付収益-マスターファンド		363,269
その他収益-マスターファンド以外		–
外国源泉徴収税控除後		(4,443,503)
外国源泉徴収税還付		–
投資収益合計		84,032,213
費用		
投資顧問報酬		4,710,137
専門家報酬		217
費用合計		4,710,354
投資純利益		79,321,859
実現および未実現損益（純額）		
実現純損益		
投資-マスターファンド以外		(30,641,895)
投資-マスターファンド		(16,087)
現物償還-マスターファンド以外		123,902,773
先物取引		2,032,251
外国為替取引		(237,701)
実現純損益		95,039,341
未実現評価損益の純変動		
投資-マスターファンド以外[a]		(23,009,306)
投資-マスターファンド		(3,707)
先物取引		(1,195,403)
外国為替取引		(288,017)
未実現評価損益の純変動		(24,496,433)
実現および未実現損益（純額）		70,542,908
運用による純資産の増減（純額）	$	149,864,767

(a) 外国キャピタルゲイン税の繰延純額 $ (3,433)

(注) ( ) 内の金額は、マイナスの金額です。

２．純資産変動計算書

（2022年４月30日に終了する会計年度）

（米ドルで表示）

純資産の増減		
運用：		
投資純利益	$	79,321,859
実現純損益		95,039,341
未実現評価損益の純変動		(24,496,433)
運用による純資産の純増減額		149,864,767
分配[a]：		
分配金による減少		(101,720,806)
資本投資証券の取引：		
資本投資証券の取引による純資産の純増減額		330,213,243
純資産		
純資産の増減		378,357,204
期首		3,083,220,599
期末	$	3,461,577,803

(a)米国連邦所得税規則に従って決定された会計期間の分配。
（注）（　）内の金額は、マイナスの金額です。

３．投資明細表

（2022年４月30日現在）

銘柄	数量	価額
Common Stocks		
Australia — 4.1%		
Abacus Property Group	1,008,395	$ 2,314,259
Arena REIT	685,295	2,319,187
BWP Trust	1,041,714	3,027,826
Centuria Industrial REIT	1,121,371	3,125,057
Centuria Office REIT	985,915	1,519,995
Charter Hall Long Wale REIT	1,459,720	5,478,414
Charter Hall Retail REIT	1,037,916	3,242,198
Charter Hall Social Infrastructure REIT	703,426	1,991,281
Cromwell Property Group	3,035,564	1,821,830
Dexus	2,276,910	17,802,177
Dexus Industria REIT	458,532	1,096,985
GPT Group (The)	4,085,644	14,523,991
Growthpoint Properties Australia Ltd.	595,279	1,830,978
HomeCo Daily Needs REIT	2,828,142	2,847,469
Hotel Property Investments	411,870	1,178,477
Irongate Group	1,065,946	1,441,391
Mirvac Group	8,327,490	14,074,209
National Storage REIT	2,555,730	4,629,061
Scentre Group	10,977,470	22,871,676
Shopping Centres Australasia Property Group	2,475,604	5,298,396
Stockland	5,049,176	14,614,473
Vicinity Centres	8,045,200	10,497,491
Waypoint REIT Ltd	1,548,895	2,919,794
		140,466,615
Belgium — 1.2%		
Aedifica SA	77,797	9,221,503
Ascencio	11,386	622,204
Befimmo SA	46,567	2,324,500
Cofinimmo SA	67,824	9,107,758
Intervest Offices & Warehouses NV	51,326	1,529,635
Montea NV	26,147	3,121,827
Nextensa.	8,935	669,245
Retail Estates NV	22,530	1,716,046
Warehouses De Pauw CVA	300,238	11,550,208
Xior Student Housing NV	46,947	2,507,732
		42,370,658
Canada — 3.0%		
Allied Properties REIT	268,111	8,709,199
Artis REIT	195,461	1,994,702
Boardwalk REIT	80,747	3,543,150
Canadian Apartment Properties REIT	368,805	14,446,166
Choice Properties REIT	550,025	6,499,342
Crombie REIT	217,612	2,966,089
Dream Industrial REIT	482,429	5,617,980
Dream Office REIT	74,397	1,505,719
First Capital Real Estate Investment Trust	466,578	6,217,892
Granite REIT	131,224	9,718,329
H&R Real Estate Investment Trust	607,015	6,038,728
InterRent REIT	277,543	3,048,404
Killam Apartment REIT	240,109	3,777,373
NorthWest Healthcare Properties REIT	419,641	4,328,216
Prinmaris REIT	204,100	2,195,666
RioCan REIT	667,483	12,470,005
SmartCentres Real Estate Investment Trust	278,862	6,792,194
Summit Industrial Income REIT	349,583	5,534,985
		105,404,139
China — 0.0%		
Yuexiu REIT	3,729,000	1,489,456
France — 1.5%		
Carmila SA	86,663	$ 1,348,050
Covivio	107,012	7,621,134
Gecina SA	110,103	12,402,898
ICADE	73,219	4,371,602
Klepierre SA	394,823	9,450,346
Mercialys SA	136,159	1,314,866
Unibail-Rodamco-Westfield[(a)(b)]	218,733	15,437,063
		51,945,959
Germany — 0.0%		
Hamborner REIT AG	152,113	1,419,713
Guernsey — 0.0%		
BMO Commercial Property Trust Ltd.	1,037,461	1,531,323
Hong Kong — 1.3%		
Champion REIT	4,217,000	1,848,666
Fortune REIT	2,914,000	2,546,025
Link REIT	4,493,400	38,813,012
Prosperity REIT	2,636,000	903,637
Sunlight REIT	2,249,000	1,098,768
		45,210,108
India — 0.2%		
Brookfield India Real Estate Trust[(c)]	216,242	935,830
Embassy Office Parks REIT	1,021,706	5,128,845
		6,064,675
Ireland — 0.1%		
Hibernia REIT PLC.	1,438,933	2,462,200
Irish Residential Properties REIT PLC.	962,643	1,474,565
		3,936,765
Italy — 0.0%		
Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA[(a)]	139,355	660,671
Japan — 6.7%		
Activia Properties Inc.	1,508	4,818,842
Advance Residence Investment Corp.	2,742	7,532,445
AEON REIT Investment Corp.	3,587	4,118,285
Comforia Residential REIT Inc.	1,328	3,309,141
CRE Logistics REIT Inc.	1,060	1,621,013
Daiwa House REIT Investment Corp.	4,416	10,748,551
Daiwa Office Investment Corp.	556	3,147,660
Daiwa Securities Living Investments Corp.	4,214	3,708,710
Frontier Real Estate Investment Corp.	982	3,804,802
Fukuoka REIT Corp.	1,456	1,820,964
Global One Real Estate Investment Corp.	1,942	1,664,673
GLP J-Reit	8,961	12,091,745
Hankyu Hanshin REIT Inc.	1,338	1,520,523
Heiwa Real Estate REIT Inc.	1,860	2,130,656
Hoshino Resorts REIT Inc.	493	2,543,211
Hulic Reit Inc.	2,704	3,359,006
Ichigo Office REIT Investment Corp.	2,520	1,617,622
Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp.	3,983	5,715,145
Invincible Investment Corp.	10,443	3,405,220
Itochu Advance Logistics Investment Corp.	1,184	1,462,632
Japan Excellent Inc.	2,660	2,609,948
Japan Hotel REIT Investment Corp.	9,462	4,805,621
Japan Logistics Fund Inc.	1,763	4,302,611
Japan Metropolitan Fund Invest	14,531	11,549,653
Japan Prime Realty Investment Corp.	1,863	5,651,890
Japan Real Estate Investment Corp.	2,755	13,333,804
Kenedix Office Investment Corp.	771	4,029,790

銘柄	数量	価額
Japan (continued)		
Kenedix Residential Next Investment Corp.	1,996	$ 3,210,851
Kenedix Retail REIT Corp.	1,183	2,490,497
LaSalle Logiport REIT	3,746	5,067,971
Mirai Corp.	3,422	1,329,220
Mitsubishi Estate Logistics REIT Investment Corp.	765	2,744,607
Mitsui Fudosan Logistics Park Inc.	1,083	4,643,278
Mori Hills REIT Investment Corp.	3,322	3,767,606
Mori Trust Sogo REIT Inc.	2,021	2,200,602
Nippon Accommodations Fund Inc.	942	4,638,320
Nippon Building Fund Inc.	3,215	16,690,041
Nippon Prologis REIT Inc.	4,809	13,310,195
NIPPON REIT Investment Corp.	881	2,525,293
Nomura Real Estate Master Fund Inc.	9,458	11,874,888
NTT UD REIT Investment Corp.	2,868	3,312,803
One REIT Inc.	499	1,059,265
Orix JREIT Inc.	5,590	7,556,119
Sankei Real Estate Inc.	980	747,029
Sekisui House Reit Inc.	8,890	5,201,996
SOSiLA Logistics REIT Inc.	1,326	1,611,811
Star Asia Investment Corp.	3,439	1,574,083
Starts Proceed Investment Corp.	466	834,838
Takara Leben Real Estate Investment Corp.	1,095	1,020,546
Tokyu REIT Inc.	1,792	2,512,103
United Urban Investment Corp.	6,279	6,870,077
		233,218,202
Malaysia — 0.1%		
Axis Real Estate Investment Trust	2,648,600	1,162,014
Sunway REIT	4,224,800	1,414,064
		2,576,078
Mexico — 0.4%		
Concentradora Fibra Danhos SA de CV[b]	503,515	563,313
Fibra Uno Administracion SA de CV	6,567,113	7,202,214
Macquarie Mexico Real Estate Management SA de CV[c]	1,557,350	1,720,171
PLA Administradora Industrial S. de RL de CV	1,687,609	2,238,678
Prologis Property Mexico SA de CV	967,948	2,597,923
		14,322,299
Netherlands — 0.2%		
Eurocommercial Properties NV	108,105	2,615,705
NSI NV	37,795	1,483,233
Vastned Retail NV	37,892	967,375
Wereldhave NV	87,960	1,434,642
		6,500,955
New Zealand — 0.3%		
Argosy Property Ltd.	1,776,120	1,488,072
Goodman Property Trust	2,339,416	3,405,456
Kiwi Property Group Ltd.	3,394,466	2,315,206
Stride Property Group	1,023,503	1,308,331
Vital Healthcare Property Trust[d]	916,275	1,845,627
		10,362,692
Philippines — 0.0%		
AREIT Inc.	1,300,420	988,604
Saudi Arabia — 0.2%		
Al Maather REIT Fund	89,145	212,229
Al Rajhi REIT	242,473	707,224
Alahli REIT Fund 1	95,189	303,017
Al-Jazira Reit Fund	26,532	161,816
Alkhabeer REIT	177,484	417,678
Saudi Arabia (continued)		
Derayah REIT	233,902	$ 767,906
Jadwa REIT Saudi Fund	322,740	1,211,522
Musharaka Real Estate Income Fund, NVS	173,262	449,785
Riyad REIT Fund	321,168	938,467
Sedco Capital REIT Fund	84,928	250,683
Swicorp Wabel REIT, NVS[a]	190,498	339,802
Taleem REIT	59,213	198,597
		5,958,726
Singapore — 3.2%		
AIMS APAC REIT	1,199,800	1,226,882
Ascendas REIT	7,261,714	14,940,826
Ascott Residence Trust	4,047,732	3,362,786
CapitaLand China Trust	2,408,630	2,023,796
CapitaLand Integrated Commercial Trust	10,359,426	17,358,164
CDL Hospitality Trusts	1,714,100	1,647,412
Cromwell European Real Estate Investment Trust	678,200	1,645,575
ESR-REIT[b]	10,562,843	2,962,454
Far East Hospitality Trust	2,073,800	998,988
First REIT	2,410,800	544,908
Frasers Centrepoint Trust	2,298,970	4,048,581
Frasers Logistics & Commercial Trust	6,099,000	6,351,251
Keppel DC REIT	2,779,833	4,144,143
Keppel Pacific Oak US REIT	1,807,400	1,308,923
Keppel REIT	4,570,900	4,004,501
Lendlease Global Commercial REIT[b]	2,440,191	1,393,851
Manulife US Real Estate Investment Trust	3,368,400	2,098,533
Mapletree Commercial Trust	4,741,991	6,377,605
Mapletree Industrial Trust	3,937,110	7,398,148
Mapletree Logistics Trust	6,818,413	8,757,032
Mapletree North Asia Commercial Trust	5,343,700	4,615,207
OUE Commercial Real Estate Investment Trust	4,589,400	1,371,726
Parkway Life REIT	826,000	2,878,161
Prime U.S. REIT	1,359,900	1,001,882
Sasseur Real Estate Investment Trust	1,138,800	687,587
SPH REIT	1,996,400	1,408,583
Starhill Global REIT	3,034,600	1,299,198
Suntec REIT	4,511,100	5,959,467
		111,816,170
South Africa — 0.6%		
Attacq Ltd.[a][b]	1,516,797	649,943
Emira Property Fund Ltd.	715,975	491,208
Equites Property Fund Ltd.	1,449,492	1,946,035
Growthpoint Properties Ltd.	7,346,986	6,568,906
Hyprop Investments Ltd.	732,290	1,664,713
Investec Property Fund Ltd.	1,208,499	933,588
Redefine Properties Ltd.	15,518,057	4,303,884
SA Corporate Real Estate Ltd.	5,555,493	785,146
Stor-Age Property REIT Ltd.	822,286	782,063
Vukile Property Fund Ltd.	1,900,410	1,618,522
		19,744,008
South Korea — 0.1%		
ESR Kendall Square REIT Co. Ltd.	299,492	1,747,831
Spain — 0.4%		
Inmobiliaria Colonial Socimi SA	766,958	6,377,548
Lar Espana Real Estate Socimi SA	128,979	675,978
Merlin Properties Socimi SA	707,293	7,683,788
		14,737,314

銘柄	数量	価額
Turkey — 0.1%		
AKIS Gayrimenkul Yatirimi AS[a]	1	$ —
Emlak Konut Gayrimenkul Yatirim Ortakligi AS	3,932,161	702,496
Is Gayrimenkul Yatirim Ortakligi AS[a]	905,879	766,275
Ozak Gayrimenkul Yatirim Ortakligi[a]	325,036	108,735
		1,577,506
United Kingdom — 5.0%		
Assura PLC	6,212,578	5,148,114
Big Yellow Group PLC	361,771	6,537,914
BMO Real Estate Investments Ltd.	516,747	626,572
British Land Co PLC/The	1,972,757	12,707,347
Capital & Counties Properties PLC	1,576,135	3,256,556
Civitas Social Housing PLC	1,302,326	1,408,345
Custodian REIT PLC	881,755	1,115,416
Derwent London PLC	214,790	8,149,545
Empiric Student Property PLC	1,263,298	1,445,566
Great Portland Estates PLC	547,579	4,651,090
Hammerson PLC[b]	9,371,392	3,383,369
Home Reit PLC	1,200,053	1,850,043
Impact Healthcare REIT PLC	637,495	996,033
Land Securities Group PLC	1,518,814	14,244,302
LondonMetric Property PLC	2,026,299	6,848,629
LXI REIT Plc	1,570,680	2,915,562
NewRiver REIT PLC	676,345	750,115
Picton Property Income Ltd. (The)	1,171,720	1,496,954
Primary Health Properties PLC	2,858,076	5,183,146
PRS REIT PLC (The)	1,110,317	1,507,862
Regional REIT Ltd.[c]	951,148	1,013,030
Safestore Holdings PLC	437,779	6,887,036
Schroder REIT Ltd.	1,057,916	757,466
Segro PLC	2,551,355	42,715,046
Shaftesbury PLC	608,704	4,558,301
Standard Life Investment Property Income Trust Ltd.	855,122	882,275
Target Healthcare REIT PLC	1,323,087	1,846,660
Triple Point Social Housing REIT PLC[c]	785,816	866,585
Tritax Big Box REIT PLC	3,984,027	12,161,913
UK Commercial Property REIT Ltd.	1,585,622	1,747,031
UNITE Group PLC (The)	678,258	9,604,277
Urban Logistics REIT PLC	976,195	2,295,456
Workspace Group PLC	283,855	2,375,447
		171,933,003
United States — 70.8%		
Acadia Realty Trust	183,387	3,836,456
Agree Realty Corp.	148,400	10,079,328
Alexander & Baldwin Inc.	154,060	3,266,072
Alexandria Real Estate Equities Inc.	354,369	64,551,857
American Assets Trust Inc.	106,086	3,882,748
American Campus Communities Inc.	291,160	18,829,317
American Homes 4 Rent, Class A	626,379	24,810,872
Americold Realty Trust	567,417	14,968,460
Apartment Income REIT Corp.	332,401	16,344,157
Apartment Investment & Management Co., Class A[a]	321,734	2,026,924
Apple Hospitality REIT Inc.	453,923	8,029,898
Armada Hoffler Properties Inc.	140,402	1,902,447
AvalonBay Communities Inc.	296,698	67,492,861
Boston Properties Inc.	332,194	39,066,014
Brandywine Realty Trust	362,237	4,227,306
Brixmor Property Group Inc.	629,670	15,981,025
Broadstone Net Lease Inc.	332,759	6,884,784
Camden Property Trust	210,293	32,992,869

銘柄	数量	価額
United States (continued)		
CareTrust REIT Inc.	205,257	$ 3,327,216
Centerspace	30,285	2,794,094
Community Healthcare Trust Inc.	50,664	1,865,449
Corporate Office Properties Trust	238,870	6,375,440
Cousins Properties Inc.	315,449	11,324,619
CubeSmart	463,775	22,033,950
DiamondRock Hospitality Co.[a]	444,351	4,719,008
Digital Realty Trust Inc.	597,336	87,282,736
DigitalBridge Group Inc.[a]	1,026,040	7,141,238
Diversified Healthcare Trust	507,046	1,140,854
Douglas Emmett Inc.	353,771	10,422,094
Duke Realty Corp.	808,946	44,289,794
Easterly Government Properties Inc.	182,879	3,483,845
EastGroup Properties Inc.	85,399	16,012,313
Empire State Realty Trust Inc., Class A	305,467	2,639,235
EPR Properties	157,639	8,279,200
Equinix Inc.	190,299	136,840,205
Equity Commonwealth[a]	230,504	6,036,900
Equity LifeStyle Properties Inc.	376,476	29,094,065
Equity Residential	784,357	63,925,096
Essential Properties Realty Trust Inc.	256,150	6,147,600
Essex Property Trust Inc.	137,871	45,396,784
Extra Space Storage Inc.	278,977	53,005,630
Federal Realty Investment Trust	165,940	19,424,936
First Industrial Realty Trust Inc.	273,620	15,869,960
Four Corners Property Trust Inc.	163,154	4,480,209
Gaming and Leisure Properties Inc.	495,680	21,998,278
Getty Realty Corp.	85,760	2,307,802
Global Net Lease Inc.	220,693	3,096,323
Healthcare Realty Trust Inc.	311,866	8,445,331
Healthcare Trust of America Inc., Class A	462,933	14,100,939
Healthpeak Properties Inc.	1,147,220	37,640,288
Highwoods Properties Inc.	218,532	8,924,847
Host Hotels & Resorts Inc.	1,504,349	30,613,502
Hudson Pacific Properties Inc.	315,265	7,339,369
Independence Realty Trust Inc.	467,252	12,737,290
Industrial Logistics Properties Trust	138,301	2,234,944
Innovative Industrial Properties Inc.	53,353	7,714,310
InvenTrust Properties Corp.	143,073	4,333,681
Invitation Homes Inc.	1,270,059	50,573,749
JBG SMITH Properties	260,923	6,877,930
Kilroy Realty Corp.	246,959	17,287,130
Kimco Realty Corp.	1,236,019	31,308,361
Kite Realty Group Trust	458,801	10,231,262
Life Storage Inc.	173,271	22,956,675
LTC Properties Inc.	83,117	2,742,861
LXP Industrial Trust.	590,866	7,415,368
Macerich Co. (The)	452,420	5,677,871
Medical Properties Trust Inc.	1,257,359	23,122,832
Mid-America Apartment Communities Inc.	245,469	48,278,843
National Health Investors Inc.	93,204	4,802,802
National Retail Properties Inc.	371,612	16,291,470
National Storage Affiliates Trust	171,617	9,713,522
Necessity Retail REIT Inc	264,292	1,974,261
NexPoint Residential Trust Inc.	47,396	4,225,827
Office Properties Income Trust	102,312	2,211,985
Omega Healthcare Investors Inc.	507,565	12,932,756
Orion Office REIT Inc.	120,265	1,613,956
Paramount Group Inc.	396,437	3,770,116
Park Hotels & Resorts Inc.	499,408	9,843,332

銘柄	数量	価額
United States (continued)		
Pebblebrook Hotel Trust[b]	275,069	$ 6,717,185
Physicians Realty Trust	465,927	7,985,989
Piedmont Office Realty Trust Inc., Class A	264,783	4,263,006
Prologis Inc.	1,570,055	251,664,116
PS Business Parks Inc.	42,485	7,953,192
Public Storage	320,855	119,197,633
Realty Income Corp.	1,204,130	83,518,457
Regency Centers Corp.	359,283	24,729,449
Retail Opportunity Investments Corp.	253,439	4,721,569
Rexford Industrial Realty Inc.	341,856	26,678,442
RLJ Lodging Trust	352,941	4,948,233
RPT Realty	177,851	2,363,640
Ryman Hospitality Properties Inc.[a]	113,619	10,621,104
Sabra Health Care REIT Inc.	484,550	5,659,544
Safehold Inc.[b]	44,192	1,902,466
Service Properties Trust	330,409	2,682,921
Simon Property Group Inc.	694,207	81,916,426
SITE Centers Corp.	368,082	5,852,504
SL Green Realty Corp.	143,882	9,959,512
Spirit Realty Capital Inc.	270,778	11,765,304
STAG Industrial Inc.	378,572	14,128,307
STORE Capital Corp.	519,673	14,774,303
Summit Hotel Properties Inc.[a]	221,490	2,186,106
Sun Communities Inc.	243,671	42,781,317
Sunstone Hotel Investors Inc.[a]	464,506	5,690,199
Tanger Factory Outlet Centers Inc.	216,912	3,498,791
Terreno Realty Corp.	155,922	11,343,326
UDR Inc.	673,516	35,837,786
Universal Health Realty Income Trust	27,217	1,366,021
Urban Edge Properties	247,212	4,620,392
Ventas Inc.	848,036	47,108,400
Veris Residential Inc.[a]	187,009	2,994,014
VICI Properties Inc.	1,338,424	39,898,419
Vornado Realty Trust	373,198	14,446,495
Washington Real Estate Investment Trust	180,507	4,348,414
Welltower Inc.	926,789	84,161,709
WP Carey Inc.	402,135	32,480,444
Xenia Hotels & Resorts Inc.[a]	241,926	4,666,753
		2,449,297,566
Total Common Stocks — 99.5% **(Cost: $3,151,429,733)**		3,445,281,036

銘柄	数量	価額
Preferred Stocks		
Bermuda — 0.0%		
Brookfield Property Partners LP, 6.25%	4,436	$ 92,579
Total Preferred Stocks — 0.0% **(Cost: $109,587)**		92,579
Short-Term Investments		
Money Market Funds — 0.3%		
BlackRock Cash Funds: Institutional, SL Agency Shares, 0.38%[e][f][g]	3,161,788	3,161,788
BlackRock Cash Funds: Treasury, SL Agency Shares, 0.34%[e][f]	6,030,000	6,030,000
		9,191,788
Total Short-Term Investments — 0.3% **(Cost: $9,188,458)**		9,191,788
Total Investments in Securities — 99.8% **(Cost: $3,160,727,778)**		3,454,565,403
Other Assets, Less Liabilities — 0.2%		7,012,400
Net Assets — 100.0%		$ 3,461,577,803

(a) Non-income producing security.
(b) All or a portion of this security is on loan.
(c) Security exempt from registration pursuant to Rule 144A under the Securities Act of 1933, as amended. These securities may be resold in transactions exempt from registration to qualified institutional investors.
(d) Security is valued using significant unobservable inputs and is classified as Level 3 in the fair value hierarchy.
(e) Affiliate of the Fund.
(f) Annualized 7-day yield as of period end.
(g) All or a portion of this security was purchased with the cash collateral from loaned securities.

iシェアーズ MSCI エマージング・マーケット・ミニマム・ボラティリティ・ファクター ETF
(iShares MSCI Emerging Markets Min Vol Factor ETF)

損益計算書、純資産変動計算書、投資明細表は、入手可能なANNUAL REPORTから抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

１．損益計算書

(2022年８月31日に終了する会計年度)

(米ドルで表示)

投資純利益	
受取配当金-マスターファンド以外	$ 167,437,211
受取配当金-マスターファンド	31,520
受取利息-マスターファンド以外	1,294
有価証券貸付収益-マスターファンド-ネット	414,417
その他収益-マスターファンド以外	774
外国源泉徴収税控除後	(20,834,611)
外国源泉徴収税還付	232,894
その他外国税	(164,869)
投資収益合計	147,118,630
費用	
投資顧問報酬	29,923,141
コミットメント・フィー	43,057
専門家報酬	22,297
モーリシャス所得税	298
支払利息	7,448
費用合計	29,996,241
控除：	
投資顧問報酬控除	(19,144,873)
費用合計（控除後）	10,851,368
投資純利益	136,267,262
実現および未実現損益（純額）	
実現純損益	
投資-マスターファンド以外 [a]	194,811,344
投資-マスターファンド	(17,371)
現物償還-マスターファンド以外	8,764,717
先物取引	4,214
外国為替取引	(2,011,160)
	201,551,744
未実現評価損益の純変動	
投資-マスターファンド以外 [c]	(898,200,239)
投資-マスターファンド	25,536
先物取引	(357,310)
外国為替取引	(363,124)
	(898,895,137)
実現および未実現損益（純額）	(697,343,393)
運用による純資産の増減（純額）	$(561,076,131)

(a) 外国キャピタルゲイン税およびキャピタルゲイン税還付の控除後 $ (1,942,900)
(c) 繰延外国キャピタルゲイン税の減額/増額の控除後 $ 4,355,253
(注) ( ) 内の金額は、マイナスの金額です。

２．純資産変動計算書

（2022年８月31日に終了する会計年度）

（米ドルで表示）

純資産の増減	
運用：	
投資純利益	$ 136,267,262
実現純損益	201,551,744
未実現評価損益の純変動	(898,895,137)
運用による純資産の純増減額	(561,076,131)
投資者への分配金：	
分配金による減少	(76,156,771)
資本投資証券の取引：	
資本投資証券の取引による純資産の純増減額	2,939,861,974
純資産	
純資産の増減	2,302,629,072
期首	3,874,514,482
期末	$6,177,143,554

（注）（　）内の金額は、マイナスの金額です。

３．投資明細表

（2022年８月31日現在）

（純資産対比%）

銘柄	数量	価額
Common Stocks		
Brazil — 0.4%		
Klabin SA	2,376,610	$ 8,602,100
Raia Drogasil SA	1,294,730	5,415,448
Suzano SA	1,254,541	10,673,148
Vale SA	201,172	2,494,155
		27,184,851
China — 25.9%		
360 Security Technology Inc., Class A	7,697,300	8,125,495
Agricultural Bank of China Ltd., Class A	37,083,298	15,285,083
Agricultural Bank of China Ltd., Class H	162,895,000	53,227,836
Alibaba Group Holding Ltd.[a]	783,368	9,346,004
Anhui Conch Cement Co. Ltd., Class H	626,500	2,387,499
Anhui Gujing Distillery Co. Ltd., Class B	2,106,189	32,159,248
ANTA Sports Products Ltd.	1,101,000	13,258,721
Apeloa Pharmaceutical Co. Ltd., Class A	1,246,397	3,246,724
Bank of China Ltd., Class A	37,302,600	16,398,320
Bank of China Ltd., Class H	250,911,000	87,559,937
Bank of Communications Co. Ltd., Class A	25,963,774	17,189,646
Bank of Communications Co. Ltd., Class H	16,176,000	9,216,579
Bank of Ningbo Co. Ltd., Class A	894,765	3,846,657
Bank of Shanghai Co. Ltd., Class A	6,283,584	5,366,435
BeiGene Ltd., ADR[a][b]	77,559	13,313,778
Beijing Capital International Airport Co. Ltd., Class H[a]	14,196,000	8,910,209
Beijing Tiantan Biological Products Corp. Ltd., Class A	1,703,367	5,461,903
Beijing Yuanliu Hongyuan Electronic Technology Co. Ltd., Class A	215,900	3,694,662
Beijing-Shanghai High Speed Railway Co. Ltd., Class A	37,125,735	24,821,673
BOE Technology Group Co. Ltd., Class A	36,406,300	19,436,279
CanSino Biologics Inc., Class H[b][c]	354,000	2,209,508
CGN Power Co. Ltd., Class H[c]	88,135,000	20,960,829
Changchun High & New Technology Industry Group Inc., Class A	194,800	4,972,790
Chifeng Jilong Gold Mining Co. Ltd., Class A[a]	1,941,200	5,443,968
China CITIC Bank Corp. Ltd., Class H	27,562,000	11,816,104
China Conch Venture Holdings Ltd.	13,770,000	28,101,630
China Construction Bank Corp., Class A	10,300,584	8,218,086
China Construction Bank Corp., Class H	63,594,000	39,312,722
China Feihe Ltd.[c]	5,607,000	4,640,667
China Gas Holdings Ltd.	2,985,400	4,224,646
China Huishan Dairy Holdings Co. Ltd.[d]	5,944,807	8
China Life Insurance Co. Ltd., Class H	2,318,000	3,323,369
China Meidong Auto Holdings Ltd.	3,118,000	6,340,619
China Mengniu Dairy Co. Ltd.	5,588,000	25,304,013
China Merchants Bank Co. Ltd., Class H	2,949,500	15,084,070
China Minsheng Banking Corp. Ltd., Class A	22,820,554	11,878,961
China Petroleum & Chemical Corp., Class H	16,092,000	7,567,181
China Resources Beer Holdings Co. Ltd.	6,130,000	42,732,336
China Resources Gas Group Ltd.	4,226,100	16,453,921
China Shenhua Energy Co. Ltd., Class H	2,819,500	8,842,716
China Tourism Group Duty Free Corp. Ltd., Class A	821,563	23,166,520
China Tower Corp. Ltd., Class H[c]	347,558,000	43,339,735
China United Network Communications Ltd., Class A	33,690,235	17,281,176
China Yangtze Power Co. Ltd., Class A	25,038,401	86,715,894
China Zhenhua Group Science & Technology Co. Ltd., Class A	241,500	3,907,289
Chongqing Zhifei Biological Products Co. Ltd., Class A	715,000	9,700,960
CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	4,660,000	4,727,214
Daan Gene Co. Ltd., Class A	1,642,200	4,197,433
Dali Foods Group Co. Ltd.[c]	7,066,000	3,230,237
China (continued)		
ENN Energy Holdings Ltd.	1,457,400	$ 21,172,257
Foshan Haitian Flavouring & Food Co. Ltd., Class A	493,929	5,746,869
Founder Securities Co. Ltd., Class A	8,904,400	8,935,381
Fuyao Glass Industry Group Co. Ltd., Class A	587,603	3,317,356
Gree Electric Appliances Inc. of Zhuhai, Class A	1,386,000	6,382,571
Guangdong Haid Group Co. Ltd., Class A	1,765,026	15,559,525
Guangdong Investment Ltd.	15,166,000	13,894,365
Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co. Ltd., Class A	1,520,694	5,980,578
Guangzhou Haige Communications Group Inc. Co., Class A	2,492,600	3,143,158
Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co. Ltd., Class A	545,300	5,251,026
Hangzhou Tigermed Consulting Co. Ltd., Class H[c]	344,100	3,406,886
Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd.[c]	6,200,000	12,369,846
Hengan International Group Co. Ltd.[b]	1,867,500	8,936,940
Huagong Tech Co. Ltd., Class A	1,130,515	3,446,778
Hualan Biological Engineering Inc., Class A	1,305,180	3,715,615
Huaxia Bank Co. Ltd., Class A	9,988,723	7,419,772
Hundsun Technologies Inc., Class A	1,370,012	6,640,547
Iflytek Co. Ltd., Class A	2,495,581	13,478,734
Industrial & Commercial Bank of China Ltd., Class A	4,887,600	3,095,438
Industrial & Commercial Bank of China Ltd., Class H	124,774,000	63,390,540
Industrial Bank Co. Ltd., Class A	2,706,982	6,677,348
Inspur Electronic Information Industry Co. Ltd., Class A	1,566,036	5,234,815
Jiangsu Expressway Co. Ltd., Class H	21,628,000	18,524,502
Jiangsu Hengrui Medicine Co. Ltd., Class A	4,210,153	21,058,694
Joinn Laboratories China Co. Ltd., Class A	522,926	5,873,614
Jointown Pharmaceutical Group Co. Ltd., Class A	2,004,142	3,441,283
Kweichow Moutai Co. Ltd., Class A	55,590	15,453,120
Legend Biotech Corp., ADR[a][b]	144,827	6,733,008
Lenovo Group Ltd.[b]	9,744,000	8,025,273
LONGi Green Energy Technology Co. Ltd., Class A	403,140	2,966,306
Muyuan Foods Co. Ltd., Class A	637,200	5,383,412
PetroChina Co. Ltd., Class A	5,353,200	4,147,571
Pharmaron Beijing Co. Ltd., Class H[c]	443,050	2,930,636
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd., Class H	3,468,500	20,400,480
Postal Savings Bank of China Co. Ltd., Class H[c]	67,477,000	40,281,827
Sangfor Technologies Inc., Class A	247,400	3,443,003
SDIC Power Holdings Co. Ltd., Class A	7,366,982	11,873,853
SF Holding Co. Ltd., Class A	1,244,500	8,867,255
Shandong Gold Mining Co. Ltd., Class A	3,800,248	9,814,516
Shandong Gold Mining Co. Ltd., Class H[b][c]	9,530,250	16,156,183
Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Ltd., Class H	4,971,600	6,744,318
Shanghai Baosight Software Co. Ltd., Class B	9,062,050	27,445,569
Shanghai Friendess Electronic Technology Corp. Ltd., Class A	105,449	3,134,649
Shanghai International Airport Co. Ltd., Class A[a]	589,500	4,797,634
Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co. Ltd., Class B	21,466,594	17,883,175
Shanghai M&G Stationery Inc., Class A	613,551	3,935,106
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co. Ltd., Class H	5,043,900	7,332,784
Shanghai Pudong Development Bank Co. Ltd., Class A	5,944,868	6,244,061
Shanghai RAAS Blood Products Co. Ltd., Class A	7,291,300	6,153,218
Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co. Ltd., Class A	270,700	11,461,379
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co. Ltd., Class A	283,300	12,193,429
Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co. Ltd., Class A	911,961	3,363,723
Shenzhou International Group Holdings Ltd.	1,479,100	15,458,526

（2022年８月31日現在）

（純資産対比%）

銘柄	数量	価額
China (continued)		
Sichuan Chuantou Energy Co. Ltd., Class A	3,879,707	$ 7,397,423
Sino Biopharmaceutical Ltd.	18,287,000	9,604,618
Sinopec Shanghai Petrochemical Co. Ltd., Class A	6,778,567	3,087,759
Sinopharm Group Co. Ltd., Class H	1,638,800	3,650,907
Songcheng Performance Development Co. Ltd., Class A	2,776,559	5,077,960
TCL Technology Group Corp., Class A	5,204,600	3,113,965
TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co. Ltd., Class A	1,309,207	9,071,700
Tencent Holdings Ltd.	391,800	16,193,386
Thunder Software Technology Co. Ltd., Class A	200,400	3,543,175
Tianjin 712 Communication & Broadcasting Co. Ltd., Class A	827,861	3,610,883
Tianshui Huatian Technology Co. Ltd., Class A	2,445,600	3,385,100
Tingyi Cayman Islands Holding Corp.	4,226,000	7,504,214
Topchoice Medical Corp., Class A[a]	237,797	3,988,020
TravelSky Technology Ltd., Class H	2,418,000	4,214,291
Walvax Biotechnology Co. Ltd., Class A	931,106	5,858,214
Want Want China Holdings Ltd.	11,777,000	8,295,970
Wuliangye Yibin Co. Ltd., Class A	276,500	6,663,161
WuXi AppTec Co. Ltd., Class H[c]	669,064	7,553,067
Xiaomi Corp., Class B[a][c]	11,376,000	16,616,452
Yealink Network Technology Corp. Ltd., Class A	325,794	3,362,674
Yonyou Network Technology Co. Ltd., Class A	1,192,500	3,449,033
Yum China Holdings Inc.[b]	920,727	46,137,630
Yunnan Baiyao Group Co. Ltd., Class A	418,738	3,166,791
Zhejiang Dahua Technology Co. Ltd., Class A	1,646,500	3,495,663
Zhejiang Jiuzhou Pharmaceutical Co. Ltd., Class A	970,263	5,751,298
Zhejiang Supor Co. Ltd., Class A	387,685	2,566,275
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	1,826,500	8,636,364
ZTE Corp., Class A	4,199,220	14,824,082
ZTO Express Cayman Inc., ADR	309,732	8,068,519
		1,602,554,336
Czech Republic — 0.2%		
CEZ AS	329,378	13,343,772
Egypt — 0.2%		
Commercial International Bank Egypt SAE	5,431,373	10,756,983
Greece — 0.6%		
Hellenic Telecommunications Organization SA	2,209,242	35,146,502
Hungary — 0.5%		
Richter Gedeon Nyrt	1,391,580	28,057,191
India — 13.8%		
ACC Ltd.	526,655	15,090,978
Adani Green Energy Ltd.[a]	161,320	4,874,419
Apollo Hospitals Enterprise Ltd.	100,630	5,406,687
Asian Paints Ltd.	1,203,778	50,677,634
Bajaj Auto Ltd.	356,570	18,161,486
Bharti Airtel Ltd.	2,399,528	21,735,986
Britannia Industries Ltd.	469,198	21,954,415
Cipla Ltd.	2,540,971	32,926,742
Colgate-Palmolive India Ltd.	231,108	4,852,559
Dabur India Ltd.	5,082,908	37,061,078
Divi's Laboratories Ltd.	353,016	15,938,235
Dr. Reddy's Laboratories Ltd.	532,615	28,146,721
Eicher Motors Ltd.	137,524	5,739,597
HCL Technologies Ltd.	4,688,026	54,530,349
Hindustan Unilever Ltd.	1,717,059	56,844,889
Housing Development Finance Corp. Ltd.	114,368	3,462,538
India (continued)		
Infosys Ltd.	4,001,452	$ 73,751,123
Lupin Ltd.	1,369,434	11,443,596
Marico Ltd.	4,997,885	32,810,421
Maruti Suzuki India Ltd.	37,588	4,239,829
Mindtree Ltd.	87,557	3,562,690
Mphasis Ltd.	201,577	5,302,980
MRF Ltd.	27,909	29,748,791
Nestle India Ltd.	82,783	20,611,218
Page Industries Ltd.	45,113	28,742,258
Pidilite Industries Ltd.	1,508,170	51,482,137
Reliance Industries Ltd.	733,578	24,032,048
Sun Pharmaceutical Industries Ltd.	2,523,890	28,167,156
Tata Consultancy Services Ltd.	1,783,458	71,127,132
Tech Mahindra Ltd.	2,054,414	27,372,042
Titan Co. Ltd.	844,770	27,374,174
UltraTech Cement Ltd.	44,930	3,735,250
Wipro Ltd.	6,177,988	31,632,420
		852,539,578
Indonesia — 0.1%		
Bank Jago Tbk PT[a]	5,461,600	3,094,765
Kuwait — 2.6%		
Agility Public Warehousing Co. KSC	2,351,394	6,414,959
Kuwait Finance House KSCP	9,270,573	27,060,623
Mobile Telecommunications Co. KSCP	28,138,391	55,241,037
National Bank of Kuwait SAKP	20,256,307	69,293,009
		158,009,628
Malaysia — 4.7%		
DiGi.Com Bhd	20,879,000	17,426,256
Genting Malaysia Bhd	4,644,700	3,083,034
Hong Leong Bank Bhd	6,335,500	29,488,826
IHH Healthcare Bhd	27,387,600	37,799,679
IOI Corp. Bhd.	4,014,800	3,794,571
Malayan Banking Bhd.	29,576,400	59,167,510
Malaysia Airports Holdings Bhd[a]	2,389,500	3,122,384
Maxis Bhd.	11,608,400	9,950,958
MISC Bhd[b]	3,339,600	5,284,052
MR DIY Group M Bhd[c]	15,572,950	7,517,815
Nestle Malaysia Bhd	1,317,200	39,085,761
Petronas Chemicals Group Bhd	6,162,600	12,087,748
Petronas Dagangan Bhd	2,058,000	10,806,167
PPB Group Bhd	4,852,200	19,081,381
Public Bank Bhd	6,211,600	6,522,428
Telekom Malaysia Bhd	5,305,800	7,053,405
Tenaga Nasional Bhd	8,154,200	16,379,457
Top Glove Corp. Bhd[b]	9,545,700	1,709,112
		289,360,544
Mexico — 0.5%		
Wal-Mart de Mexico SAB de CV[b]	10,292,300	33,635,869
Peru — 0.5%		
Cia. de Minas Buenaventura SAA, ADR	1,851,127	9,847,996
Credicorp Ltd.	180,780	23,300,734
		33,148,730
Philippines — 1.4%		
ACEN Corp.	25,378,500	3,379,695
Bank of the Philippine Islands	13,261,058	22,389,820
BDO Unibank Inc.	5,087,883	11,634,191
Globe Telecom Inc.	195,025	7,276,680
International Container Terminal Services Inc.	6,416,640	20,665,827

（2022年８月31日現在）

（純資産対比%）

銘柄	数量	価額
Philippines (continued)		
Manila Electric Co.	2,442,310	$ 13,080,165
PLDT Inc.	108,250	3,226,682
SM Investments Corp.	225,985	3,335,752
		84,988,812
Poland — 0.2%		
Dino Polska SA[a][c]	171,511	12,512,335
Qatar — 3.3%		
Masraf Al Rayan QSC	53,709,840	65,875,899
Ooredoo QPSC	3,737,921	9,220,784
Qatar Electricity & Water Co. QSC	5,095,040	26,161,418
Qatar Fuel QSC	1,666,797	8,608,287
Qatar Islamic Bank SAQ	6,154,918	42,756,893
Qatar National Bank QPSC	9,301,059	52,073,556
		204,696,837
Russia — 0.0%		
Polymetal International PLC[d]	244,417	40
Polyus PJSC[d]	95,932	16
Rosneft Oil Co. PJSC[d]	759,070	124
Yandex NV[a][d]	49,681	8
		188
Saudi Arabia — 9.8%		
Advanced Petrochemical Co.	868,544	11,522,603
Al Rajhi Bank	3,873,816	92,738,323
Alinma Bank	4,206,165	42,376,109
Bank AlBilad[a]	527,742	7,090,729
Bank Al-Jazira	1,620,877	10,120,850
Bupa Arabia for Cooperative Insurance Co.	157,583	6,891,898
Dar Al Arkan Real Estate Development Co.[a]	10,320,537	38,694,592
Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co.	176,042	9,353,520
Emaar Economic City[a]	7,806,491	20,918,256
Etihad Etisalat Co.	5,214,463	50,718,607
Jarir Marketing Co.	1,146,726	52,356,866
Mobile Telecommunications Co.[a]	8,517,606	26,172,061
SABIC Agri-Nutrients Co.	1,043,285	48,162,084
Saudi Arabian Oil Co.[c]	2,280,398	22,715,007
Saudi Basic Industries Corp.	1,706,612	45,336,549
Saudi Electricity Co.	4,447,876	29,773,472
Saudi Telecom Co.	7,424,031	82,425,372
Yanbu National Petrochemical Co.	735,247	9,770,199
		607,137,097
South Korea — 5.9%		
Amorepacific Corp.	26,771	2,439,936
Celltrion Healthcare Co. Ltd.	75,881	4,060,707
Celltrion Inc.	52,352	7,368,935
CJ Logistics Corp.[a]	79,356	6,994,597
Coway Co. Ltd.[b]	160,469	7,613,358
Hanon Systems	853,859	6,529,628
HLB Inc.[a]	124,811	4,556,768
HMM Co. Ltd.[b]	906,801	14,944,175
Hotel Shilla Co. Ltd.[b]	484,957	26,565,521
Kakao Corp.	169,091	9,182,259
Kangwon Land Inc.[a]	208,394	4,108,807
Kia Corp.	50,829	3,046,580
KT&G Corp.	571,703	35,512,728
LG Electronics Inc.	51,880	3,882,181
LG H&H Co. Ltd.	6,083	3,221,198
LG Uplus Corp.	594,370	5,090,176
NAVER Corp.	211,317	37,497,480
NCSoft Corp.	31,026	8,718,686
South Korea (continued)		
Netmarble Corp.[c]	86,394	$ 4,073,177
Orion Corp./Republic of Korea[b]	54,862	4,018,890
Pan Ocean Co. Ltd.	931,604	3,564,655
S-1 Corp.	302,639	13,140,551
Samsung Biologics Co. Ltd.[a][c]	50,136	31,182,538
Samsung Electronics Co. Ltd.	1,142,300	50,604,739
Samsung SDS Co. Ltd.	174,795	16,682,181
Seegene Inc.[b]	353,228	8,275,401
SK Bioscience Co. Ltd.[a][b]	33,598	2,812,783
SK Hynix Inc.	278,016	19,546,729
Yuhan Corp.	491,474	20,784,884
		366,020,248
Taiwan — 18.3%		
Accton Technology Corp.	896,000	8,250,907
Advantech Co. Ltd.	5,028,855	53,647,851
Asustek Computer Inc.	4,725,000	39,316,907
Cathay Financial Holding Co. Ltd.	6,216,034	9,043,249
China Steel Corp.	13,809,000	13,078,036
Chunghwa Telecom Co. Ltd.	23,087,000	91,611,257
Compal Electronics Inc.	47,460,000	35,337,072
Delta Electronics Inc.	777,000	6,652,400
E.Sun Financial Holding Co. Ltd.	38,704,071	35,662,270
Evergreen Marine Corp. Taiwan Ltd.	2,534,000	7,261,723
Far EasTone Telecommunications Co. Ltd.	28,667,000	70,307,403
First Financial Holding Co. Ltd.	113,635,796	98,587,979
Formosa Petrochemical Corp.	4,373,000	11,986,886
Formosa Plastics Corp.	4,252,840	12,680,243
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	4,384,000	15,610,455
Hua Nan Financial Holdings Co. Ltd.	108,980,906	82,717,913
Inventec Corp.	11,720,000	8,872,854
Lite-On Technology Corp.	14,505,752	31,216,800
Mega Financial Holding Co. Ltd.	23,114,150	27,111,187
Novatek Microelectronics Corp.	1,516,000	12,969,839
Pou Chen Corp.	5,778,000	5,473,452
President Chain Store Corp.	10,213,000	89,747,399
Quanta Computer Inc.	4,883,000	12,658,731
Realtek Semiconductor Corp.	209,000	2,348,469
Synnex Technology International Corp.	18,838,000	34,337,572
Taiwan Cooperative Financial Holding Co. Ltd.	110,262,509	99,576,980
Taiwan High Speed Rail Corp.	13,276,000	12,692,742
Taiwan Mobile Co. Ltd.	26,614,000	86,991,597
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	4,976,000	81,456,032
Uni-President Enterprises Corp.	5,310,000	11,475,238
United Microelectronics Corp.	2,356,000	3,134,579
WPG Holdings Ltd.	10,847,440	18,242,450
		1,130,058,472
Thailand — 5.6%		
Advanced Info Service PCL, NVDR	13,488,000	70,961,896
Airports of Thailand PCL, NVDR[a]	31,719,500	63,209,110
Bangkok Dusit Medical Services PCL, NVDR	65,734,300	52,682,781
Bangkok Expressway & Metro PCL, NVDR	13,021,100	3,122,166
Bumrungrad Hospital PCL, NVDR	4,781,800	28,314,245
CP ALL PCL, NVDR	26,397,400	44,494,258
Home Product Center PCL, NVDR	46,263,900	17,624,046
Intouch Holdings PCL, NVDR	14,961,400	29,802,097
Osotspa PCL, NVDR	7,370,000	6,310,199
PTT Oil & Retail Business PCL, NVDR	23,683,200	17,680,326
Siam Cement PCL (The), NVDR	805,500	7,901,932

（2022年８月31日現在）

（純資産対比%）

銘柄	数量	価額
Thailand (continued)		
Thai Union Group PCL, NVDR[b]	6,630,700	$ 3,179,511
		345,282,567
Turkey — 0.4%		
BIM Birlesik Magazalar AS	4,042,490	24,252,694
United Arab Emirates — 4.0%		
Abu Dhabi National Oil Co. for Distribution PJSC	60,944,212	73,638,581
Aldar Properties PJSC	34,471,570	45,144,740
Dubai Islamic Bank PJSC	10,200,467	16,223,425
Emirates Telecommunications Group Co. PJSC	11,152,999	78,096,195
First Abu Dhabi Bank PJSC	6,858,188	35,617,667
		248,720,608
Total Common Stocks — 98.9% **(Cost: $6,288,843,743)**		6,110,502,607
Preferred Stocks		
Russia — 0.0%		
Surgutneftegas PJSC, Preference Shares, NVS[d]	40,815,200	6,691
South Korea — 0.7%		
LG H&H Co. Ltd., Preference Shares, NVS	31,553	8,599,586
Samsung Electronics Co. Ltd., Preference Shares, NVS	836,290	33,829,734
		42,429,320
Total Preferred Stocks — 0.7% **(Cost: $80,433,688)**		42,436,011
Rights		
China — 0.0%		
Kangmei Pharmaceutical Co. Ltd. (Expires 12/31/49)[a]	167,567	—
Total Rights — 0.0% **(Cost: $—)**		—
Total Long-Term Investments — 99.6% **(Cost: $6,369,277,431)**		6,152,938,618
Short-Term Securities		
Money Market Funds — 1.5%		
BlackRock Cash Funds: Institutional, SL Agency Shares, 2.42%[e][f][g]	78,648,924	$ 78,672,519
BlackRock Cash Funds: Treasury, SL Agency Shares, 2.07%[e][f]	13,620,000	13,620,000
Total Short-Term Securities — 1.5% **(Cost: $92,252,764)**		92,292,519
Total Investments in Securities — 101.1% **(Cost: $6,461,530,195)**		6,245,231,137
Liabilities in Excess of Other Assets — (1.1)%		(68,087,583)
Net Assets — 100.0%		$ 6,177,143,554

(a) Non-income producing security.
(b) All or a portion of this security is on loan.
(c) Security exempt from registration pursuant to Rule 144A under the Securities Act of 1933, as amended. These securities may be resold in transactions exempt from registration to qualified institutional investors.
(d) Security is valued using significant unobservable inputs and is classified as Level 3 in the fair value hierarchy.
(e) Affiliate of the Fund.
(f) Annualized 7-day yield as of period end.
(g) All or a portion of this security was purchased with the cash collateral from loaned securities.

iシェアーズ MSCI エマージング・マーケット ETF
(iShares MSCI Emerging Markets ETF)
損益計算書、純資産変動計算書、投資明細表は、入手可能なANNUAL REPORTから抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

１．損益計算書

(2022年８月31日に終了する会計年度)

(米ドルで表示)	（連結）
投資純利益	
受取配当金-マスターファンド以外	$ 947,452,077
受取配当金-マスターファンド	256,934
有価証券貸付収益-マスターファンド-ネット [(a)]	13,447,306
その他収益-マスターファンド以外	272,221
外国源泉徴収税控除後	(96,718,589)
外国源泉徴収税還付	2,319,352
その他外国税	(777,834)
投資収益合計	866,251,467
費用	
投資顧問報酬	194,187,377
コミットメント・フィー	43,057
専門家報酬	245,053
モーリシャス所得税	295
支払利息	555,434
費用合計	195,031,216
控除：	
投資顧問報酬控除	—
費用合計（控除後）	195,031,216
投資純利益	671,220,251
実現および未実現損益（純額）	
実現純損益	
投資-マスターファンド以外 [(b)]	813,504,430
投資-マスターファンド	(241,307)
現物償還-マスターファンド以外	12,864,557
現物償還-マスターファンド	—
先物取引	(32,508,753)
外国為替予約取引	—
外国為替取引	(21,008,721)
	772,610,206
未実現評価損益の純変動	
投資-マスターファンド以外 [(d)]	(8,767,149,471)
投資-マスターファンド	91,990
先物取引	(2,503,829)
外国為替予約取引	—
外国為替取引	(2,242,583)
	(8,771,803,893)
実現および未実現損益（純額）	(7,999,193,687)
運用による純資産の増減（純額）	$(7,327,973,436)

(a) 有価証券貸付収益に係る支払税額控除後	$ 1,386,408
(b) 外国キャピタルゲイン税控除後	$ (134,079,740)
(d) 繰延外国キャピタルゲイン税の減額控除後	$ 109.498.234

(注) （ ）内の金額は、マイナスの金額です。

２．純資産変動計算書

（2022年８月31日に終了する会計年度）

（米ドルで表示）

純資産の増減	
運用：	
投資純利益	$ 671,220,251
実現純損益	772,610,206
未実現評価損益の純変動	(8,771,803,893)
運用による純資産の純増減額	(7,327,973,436)
投資者への分配金 [a]：	
分配金による減少	(668,521,066)
資本投資証券の取引：	
資本投資証券の取引による純資産の純増減額	2,883,573,948
純資産	
純資産の増減	(5,112,920,554)
期首	30,983,301,912
期末	$25,870,381,358

（注）（　）内の金額は、マイナスの金額です。

（a）米国連邦所得税法に準じて決定された年間分配金。

３．投資明細表

（2022年８月31日現在）

（純資産対比％）

銘柄	数量	価額
Common Stocks		
Brazil — 3.8%		
Ambev SA	18,574,377	$ 54,519,210
Americanas SA	2,564,832	8,055,773
Atacadao SA	1,964,458	7,457,721
B3 SA - Brasil, Bolsa, Balcao	24,238,889	55,211,217
Banco Bradesco SA	6,259,963	19,060,013
Banco BTG Pactual SA	4,724,704	23,113,124
Banco do Brasil SA	3,412,538	27,346,746
Banco Santander Brasil SA	1,430,560	8,076,185
BB Seguridade Participacoes SA	2,844,898	15,464,731
BRF SA[a]	2,383,183	7,260,774
CCR SA	4,760,337	12,618,224
Centrais Eletricas Brasileiras SA	4,151,285	36,793,740
Cia. de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	1,373,881	12,979,827
Cia. Siderurgica Nacional SA	2,735,978	7,257,515
Cosan SA	4,886,925	18,768,407
CPFL Energia SA	919,907	6,183,521
Energisa SA	749,588	6,093,356
Engie Brasil Energia SA	813,523	6,333,170
Equatorial Energia SA	4,054,196	18,843,315
Hapvida Participacoes e Investimentos SA[b]	18,462,669	25,835,812
Hypera SA	1,693,752	14,022,355
JBS SA	3,124,238	17,769,914
Klabin SA	3,021,911	10,937,756
Localiza Rent a Car SA	2,958,651	34,588,873
Lojas Renner SA	3,951,402	20,104,877
Magazine Luiza SA[a]	12,262,001	10,064,344
Natura & Co. Holding SA	3,543,079	9,820,698
Petro Rio SA[a]	2,849,744	14,959,732
Petroleo Brasileiro SA	14,964,860	106,920,622
Raia Drogasil SA	4,278,122	17,894,036
Rede D'Or Sao Luiz SA[b]	1,579,091	10,116,697
Rumo SA	5,136,425	19,953,704
Suzano SA	2,966,042	25,233,934
Telefonica Brasil SA	1,975,719	15,623,766
Tim SA	3,349,641	7,616,918
TOTVS SA	2,106,702	11,561,268
Ultrapar Participacoes SA	2,883,354	7,498,804
Vale SA	15,915,048	197,316,738
Vibra Energia SA	4,637,709	16,367,126
WEG SA	6,751,241	36,712,403
		982,356,946
Chile — 0.4%		
Banco de Chile	184,801,789	17,532,715
Banco de Credito e Inversiones SA	235,478	6,936,256
Banco Santander Chile	265,565,250	10,667,056
Cencosud SA	5,727,941	8,007,933
Cia. Cervecerias Unidas SA	525,370	2,855,082
Cia. Sud Americana de Vapores SA	64,010,011	6,024,261
Empresas CMPC SA	4,478,158	8,494,135
Empresas COPEC SA	1,564,360	13,494,078
Enel Americas SA	85,240,340	9,234,965
Enel Chile SA	103,060,332	3,383,024
Falabella SA	2,912,146	6,862,429
		93,491,934
China — 32.3%		
360 DigiTech Inc.	400,190	6,395,036
360 Security Technology Inc., Class A	2,389,106	2,522,010
China (continued)		
37 Interactive Entertainment Network Technology Group Co. Ltd., Class A	624,588	$ 1,829,629
3SBio Inc.[b]	6,033,500	4,011,423
AAC Technologies Holdings Inc.[c]	2,894,500	5,362,419
Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc., Class A[a]	170,029	3,017,037
AECC Aviation Power Co. Ltd., Class A	702,473	4,658,996
Agricultural Bank of China Ltd., Class A	22,217,900	9,157,828
Agricultural Bank of China Ltd., Class H	114,423,000	37,389,046
Aier Eye Hospital Group Co. Ltd., Class A	1,756,805	7,449,792
Air China Ltd., Class A[a]	2,495,793	3,710,133
Air China Ltd., Class H[a]	6,026,000	4,827,142
Alibaba Group Holding Ltd.[a]	60,465,156	721,382,037
Alibaba Health Information Technology Ltd.[a]	18,660,000	10,693,371
Alibaba Pictures Group Ltd.[a]	51,160,000	4,024,612
A-Living Smart City Services Co. Ltd., Class A[b]	2,494,750	2,569,803
Aluminum Corp. of China Ltd., Class A	4,324,300	2,806,812
Aluminum Corp. of China Ltd., Class H	14,784,000	5,462,837
Anhui Conch Cement Co. Ltd., Class A	1,137,886	5,243,232
Anhui Conch Cement Co. Ltd., Class H	4,815,500	18,351,161
Anhui Gujing Distillery Co. Ltd., Class A	111,285	4,098,507
Anhui Gujing Distillery Co. Ltd., Class B	433,500	6,619,080
Anhui Kouzi Distillery Co. Ltd., Class A	184,052	1,343,356
Anjoy Foods Group Co. Ltd., Class A	87,400	1,956,736
ANTA Sports Products Ltd.[c]	4,878,602	58,750,246
Asymchem Laboratories Tianjin Co. Ltd., Class A	99,680	2,469,354
Autohome Inc., ADR	302,032	10,755,360
Avary Holding Shenzhen Co. Ltd., Class A	567,900	2,424,746
AVIC Electromechanical Systems Co. Ltd., Class A	1,236,000	1,979,023
AVIC Industry-Finance Holdings Co. Ltd., Class A	3,594,289	1,754,901
AviChina Industry & Technology Co. Ltd., Class H	10,424,000	5,073,710
AVICOPTER PLC, Class A	220,353	1,341,922
Baidu Inc.[a]	7,205,856	128,628,683
Baidu Inc., ADR[a]	215,578	31,036,767
Bank of Beijing Co. Ltd., Class A	5,968,606	3,563,285
Bank of Chengdu Co. Ltd., Class A	1,155,395	2,616,907
Bank of China Ltd., Class A	10,498,500	4,615,168
Bank of China Ltd., Class H	313,691,000	109,468,155
Bank of Communications Co. Ltd., Class A	10,732,573	7,105,636
Bank of Communications Co. Ltd., Class H	33,669,600	19,183,886
Bank of Hangzhou Co. Ltd., Class A	1,611,545	3,335,792
Bank of Jiangsu Co. Ltd., Class A	4,193,110	4,387,491
Bank of Nanjing Co. Ltd., Class A	2,768,846	4,249,764
Bank of Ningbo Co. Ltd., Class A	1,673,379	7,193,973
Bank of Shanghai Co. Ltd., Class A	4,303,642	3,675,485
Baoshan Iron & Steel Co. Ltd., Class A	5,870,173	4,517,347
BeiGene Ltd., ADR[a][c]	187,750	32,229,165
Beijing Capital International Airport Co. Ltd., Class H[a]	8,036,000	5,043,846
Beijing Enlight Media Co. Ltd., Class A	1,188,395	1,584,868
Beijing Enterprises Holdings Ltd.	2,153,000	6,403,935
Beijing Enterprises Water Group Ltd.	18,078,000	4,643,867
Beijing Kingsoft Office Software Inc., Class A	119,281	3,097,069
Beijing New Building Materials PLC, Class A	514,413	1,949,472
Beijing Roborock Technology Co. Ltd., Class A	28,880	1,332,469
Beijing Shiji Information Technology Co. Ltd., Class A	529,786	997,879
Beijing Shunxin Agriculture Co. Ltd., Class A	296,100	1,020,010
Beijing Sinnet Technology Co. Ltd., Class A	748,286	1,002,005

（2022年８月31日現在）

（純資産対比%）

銘柄	数量	価額
China (continued)		
Beijing Tiantan Biological Products Corp. Ltd., Class A	577,614	$ 1,852,138
Beijing Tongrentang Co. Ltd., Class A	300,000	2,030,402
Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Co. Ltd., Class A	150,493	2,781,098
Beijing-Shanghai High Speed Railway Co. Ltd., Class A	10,402,100	6,954,678
Betta Pharmaceuticals Co. Ltd., Class A	172,796	1,130,925
BGI Genomics Co. Ltd., Class A	163,100	1,421,709
Bilibili Inc., ADR[a]	638,112	15,927,276
Bilibili, Inc.[a]	96,302	2,395,180
BOC Aviation Ltd.[b][c]	888,500	7,111,983
BOE Technology Group Co. Ltd., Class A	10,131,000	5,408,650
Bosideng International Holdings Ltd.	13,424,000	7,537,454
BYD Co. Ltd., Class A	448,312	18,544,957
BYD Co. Ltd., Class H	3,271,000	100,796,908
BYD Electronic International Co. Ltd.[c]	2,729,000	7,210,368
Caitong Securities Co. Ltd., Class A	2,470,474	2,702,076
CanSino Biologics Inc., Class H[b][c]	446,400	2,786,227
CGN Power Co. Ltd., Class H[b]	44,370,000	10,552,357
Changchun High & New Technology Industry Group Inc., Class A	108,094	2,759,388
Changjiang Securities Co. Ltd., Class A	3,585,135	2,939,843
Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems Co. Ltd., Class A	98,300	1,990,650
Chaozhou Three-Circle Group Co. Ltd., Class A	651,330	2,545,642
China Cinda Asset Management Co. Ltd., Class H	36,309,000	4,986,051
China CITIC Bank Corp. Ltd., Class H	35,072,800	15,036,059
China Coal Energy Co. Ltd., Class H	8,598,000	7,645,918
China Communications Services Corp. Ltd., Class H	10,428,000	4,477,748
China Conch Venture Holdings Ltd.	6,630,000	13,530,414
China Construction Bank Corp., Class A	3,030,768	2,418,029
China Construction Bank Corp., Class H	382,029,760	236,164,259
China CSSC Holdings Ltd., Class A	1,271,900	4,594,239
China Eastern Airlines Corp. Ltd., Class A[a]	3,400,197	2,409,745
China Energy Engineering Corp. Ltd.	8,271,652	2,697,958
China Everbright Bank Co. Ltd., Class A	11,901,603	4,935,834
China Everbright Bank Co. Ltd., Class H	10,134,000	3,106,704
China Everbright Environment Group Ltd.	15,224,813	7,525,054
China Evergrande Group[a][c][d]	13,878,388	1,914,527
China Feihe Ltd.[b]	14,339,000	11,867,758
China Galaxy Securities Co. Ltd., Class A	1,778,300	2,541,065
China Galaxy Securities Co. Ltd., Class H	13,079,500	7,150,755
China Gas Holdings Ltd.	12,071,600	17,082,548
China Greatwall Technology Group Co. Ltd., Class A	1,196,273	1,565,753
China Hongqiao Group Ltd.[c]	9,627,500	9,335,419
China International Capital Corp. Ltd., Class H[b]	6,716,800	11,816,878
China Jinmao Holdings Group Ltd.	22,510,000	4,739,963
China Jushi Co. Ltd., Class A	1,231,940	2,562,847
China Lesso Group Holdings Ltd.	4,677,000	5,559,091
China Life Insurance Co. Ltd., Class A	1,026,512	4,549,935
China Life Insurance Co. Ltd., Class H	28,122,000	40,319,152
China Literature Ltd.[a][b]	1,637,400	6,635,255
China Longyuan Power Group Corp. Ltd., Class H	13,532,000	21,856,407
China Medical System Holdings Ltd.	5,619,000	8,316,005
China Meidong Auto Holdings Ltd.	2,372,000	4,823,588
China Mengniu Dairy Co. Ltd.	12,648,000	57,273,650
China Merchants Bank Co. Ltd., Class A	5,095,389	25,734,744
China Merchants Bank Co. Ltd., Class H	15,457,967	79,053,757

銘柄	数量	価額
China (continued)		
China Merchants Energy Shipping Co. Ltd., Class A	1,864,000	$ 2,021,189
China Merchants Port Holdings Co. Ltd.	5,524,000	8,293,000
China Merchants Securities Co. Ltd., Class A	2,142,179	4,098,347
China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co. Ltd., Class A	1,971,190	4,159,419
China Minsheng Banking Corp. Ltd., Class A	10,867,955	5,657,182
China Minsheng Banking Corp. Ltd., Class H	21,000,048	6,680,077
China National Building Material Co. Ltd., Class H	15,628,000	14,757,046
China National Chemical Engineering Co. Ltd., Class A	1,932,467	2,400,806
China National Nuclear Power Co. Ltd., Class A	4,944,800	4,544,922
China Northern Rare Earth Group High-Tech Co. Ltd., Class A	971,154	4,215,065
China Oilfield Services Ltd., Class H	7,634,000	7,928,926
China Overseas Land & Investment Ltd.	15,247,460	40,977,103
China Overseas Property Holdings Ltd.	5,255,000	5,576,781
China Pacific Insurance Group Co. Ltd., Class A	1,965,407	5,941,857
China Pacific Insurance Group Co. Ltd., Class H	10,063,200	21,317,042
China Petroleum & Chemical Corp., Class A	9,256,289	5,721,020
China Petroleum & Chemical Corp., Class H	100,668,800	47,338,988
China Power International Development Ltd.	22,103,000	12,339,062
China Railway Group Ltd., Class A	5,531,200	4,595,686
China Railway Group Ltd., Class H	16,475,000	9,431,823
China Resources Beer Holdings Co. Ltd.	6,500,000	45,311,612
China Resources Cement Holdings Ltd.[c]	10,120,000	6,238,060
China Resources Gas Group Ltd.	3,718,500	14,477,628
China Resources Land Ltd.	12,803,333	52,420,000
China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd.[b]	2,732,600	12,391,710
China Resources Power Holdings Co. Ltd.	7,786,999	15,483,196
China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co. Ltd., Class A	352,699	2,010,923
China Ruyi Holdings Ltd.[a][c]	18,708,000	4,747,461
China Shenhua Energy Co. Ltd., Class A	1,804,539	7,908,585
China Shenhua Energy Co. Ltd., Class H	13,487,000	42,298,885
China Southern Airlines Co. Ltd., Class A[a]	3,640,700	3,382,994
China Southern Airlines Co. Ltd., Class H[a]	6,546,000	3,533,264
China State Construction Engineering Corp. Ltd., Class A	10,511,671	7,806,537
China State Construction International Holdings Ltd.	8,432,000	9,736,019
China Suntien Green Energy Corp. Ltd., Class H	7,793,000	3,495,127
China Taiping Insurance Holdings Co. Ltd.	5,742,260	5,862,707
China Three Gorges Renewables Group Co. Ltd., Class A	7,304,825	6,430,195
China Tourism Group Duty Free Corp. Ltd., Class A	472,832	13,332,966
China Tower Corp. Ltd., Class H[b]	176,810,000	22,047,826
China Traditional Chinese Medicine Holdings Co. Ltd.	11,486,000	4,953,146
China United Network Communications Ltd., Class A	8,822,100	4,525,236
China Vanke Co. Ltd., Class A	2,608,334	6,270,506
China Vanke Co. Ltd., Class H	6,429,331	12,551,527
China Yangtze Power Co. Ltd., Class A	5,697,415	19,731,948
China Zhenhua Group Science & Technology Co. Ltd., Class A	184,700	2,988,308
China Zheshang Bank Co. Ltd., Class A[a]	6,175,500	2,901,599
Chinasoft International Ltd.	11,318,000	8,847,274
Chongqing Brewery Co. Ltd., Class A	132,500	2,135,877
Chongqing Changan Automobile Co. Ltd., Class A	2,095,817	4,383,683

（2022年８月31日現在）

（純資産対比%）

銘柄	数量	価額
China (continued)		
Chongqing Zhifei Biological Products Co. Ltd., Class A	395,676	$ 5,368,443
CIFI Holdings Group Co. Ltd.[c]	15,951,991	4,037,364
CITIC Ltd.	23,338,000	24,058,639
CITIC Securities Co. Ltd., Class A	3,430,818	9,651,461
CITIC Securities Co. Ltd., Class H	8,072,600	16,361,843
CMOC Group Ltd., Class A	5,454,698	3,870,042
CMOC Group Ltd., Class H	12,735,000	5,678,747
Contemporary Amperex Technology Co. Ltd., Class A[a]	567,330	39,324,138
COSCO SHIPPING Holdings Co. Ltd., Class A	3,232,164	6,604,179
COSCO SHIPPING Holdings Co. Ltd., Class H	12,643,849	18,875,499
COSCO SHIPPING Ports Ltd.[c]	7,814,000	5,056,261
Country Garden Holdings Co. Ltd.[c]	31,658,939	9,345,585
Country Garden Services Holdings Co. Ltd.	7,992,000	15,705,582
CRRC Corp. Ltd., Class A	7,383,400	5,342,643
CRRC Corp. Ltd., Class H	16,466,000	6,156,463
CSC Financial Co. Ltd., Class A	1,271,433	4,879,195
CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	35,874,479	36,391,920
Dali Foods Group Co. Ltd.[b]	9,102,000	4,160,999
Daqin Railway Co. Ltd., Class A	4,144,900	3,864,800
Daqo New Energy Corp., ADR[a]	238,288	15,886,661
DHC Software Co. Ltd., Class A	2,130,498	1,786,185
Dongfeng Motor Group Co. Ltd., Class H	11,552,000	7,324,522
Dongxing Securities Co. Ltd., Class A	1,766,797	2,119,708
Dongyue Group Ltd.	6,074,000	6,817,109
East Money Information Co. Ltd., Class A	3,288,299	10,493,709
Ecovacs Robotics Co. Ltd., Class A	147,053	1,729,895
ENN Energy Holdings Ltd.	3,172,900	46,094,041
Eve Energy Co. Ltd., Class A	500,853	6,813,886
Everbright Securities Co. Ltd., Class A	1,058,983	2,452,152
Fangda Carbon New Material Co. Ltd., Class A[a]	1,350,034	1,357,352
Far East Horizon Ltd.[c]	6,280,000	4,757,437
Fiberhome Telecommunication Technologies Co. Ltd., Class A	823,381	1,709,766
First Capital Securities Co. Ltd., Class A	2,174,500	1,930,080
Flat Glass Group Co. Ltd., Class A[a]	479,000	2,764,252
Flat Glass Group Co. Ltd., Class H[a]	1,663,000	5,477,395
Focus Media Information Technology Co. Ltd., Class A	3,968,778	3,465,539
Foshan Haitian Flavouring & Food Co. Ltd., Class A	949,750	11,050,351
Fosun International Ltd.	10,176,500	7,511,598
Founder Securities Co. Ltd., Class A	3,736,587	3,749,588
Foxconn Industrial Internet Co. Ltd., Class A	2,779,897	3,728,469
Fuyao Glass Industry Group Co. Ltd., Class A	557,772	3,148,943
Fuyao Glass Industry Group Co. Ltd., Class H[b]	2,414,400	11,521,122
Ganfeng Lithium Co. Ltd., Class A	429,073	5,289,136
Ganfeng Lithium Co. Ltd., Class H[b][c]	1,446,080	12,704,476
GCL System Integration Technology Co. Ltd., Class A[a]	2,172,000	1,148,997
GD Power Development Co. Ltd., Class A[a]	5,115,100	3,209,575
GDS Holdings Ltd., ADR[a]	433,200	11,800,368
Geely Automobile Holdings Ltd.	24,023,000	48,267,437
GEM Co. Ltd., Class A	1,854,000	2,232,221
Gemdale Corp., Class A	1,236,730	2,083,961
Genscript Biotech Corp.[a]	4,678,000	15,026,635
GF Securities Co. Ltd., Class A	1,518,694	3,590,585
GF Securities Co. Ltd., Class H	4,471,400	5,841,020
GigaDevice Semiconductor Inc., Class A	182,794	3,048,440
Ginlong Technologies Co. Ltd., Class A	103,600	3,418,533

銘柄	数量	価額
China (continued)		
GoerTek Inc., Class A	918,600	$ 4,304,419
Gotion High-tech Co. Ltd., Class A	487,223	2,405,655
Great Wall Motor Co. Ltd., Class A	665,000	3,206,301
Great Wall Motor Co. Ltd., Class H	12,127,500	18,195,261
Gree Electric Appliances Inc. of Zhuhai, Class A	812,400	3,741,126
Greentown China Holdings Ltd.	3,603,500	6,799,032
Greentown Service Group Co. Ltd.	5,874,000	4,243,695
Guangdong Haid Group Co. Ltd., Class A	456,627	4,025,379
Guangdong Investment Ltd.	11,932,110	10,931,629
Guanghui Energy Co. Ltd., Class A	1,922,600	3,525,781
Guangzhou Automobile Group Co. Ltd., Class A	1,266,100	2,538,657
Guangzhou Automobile Group Co. Ltd., Class H	11,835,838	10,176,572
Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co. Ltd., Class A	651,496	2,562,200
Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co. Ltd., Class A	143,984	1,386,510
Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co. Ltd., Class A	185,891	1,814,735
Guangzhou Tinci Materials Technology Co. Ltd., Class A	504,200	3,452,549
Guosen Securities Co. Ltd., Class A	2,401,851	3,202,720
Guotai Junan Securities Co. Ltd., Class A	2,436,940	5,198,790
H World Group Ltd., ADR	776,560	29,221,953
Haidilao International Holding Ltd.[a][b][c]	4,421,000	10,403,045
Haier Smart Home Co. Ltd., Class A	1,735,141	6,465,920
Haier Smart Home Co. Ltd., Class H	9,081,200	29,668,267
Haitian International Holdings Ltd.	2,749,000	6,734,924
Haitong Securities Co. Ltd., Class A	3,185,700	4,356,238
Haitong Securities Co. Ltd., Class H	9,969,600	6,527,295
Hangzhou First Applied Material Co. Ltd., Class A	372,480	3,476,499
Hangzhou Robam Appliances Co. Ltd., Class A	359,064	1,302,583
Hangzhou Silan Microelectronics Co. Ltd., Class A	387,300	2,209,586
Hangzhou Tigermed Consulting Co. Ltd., Class A	152,300	2,376,604
Hangzhou Tigermed Consulting Co. Ltd., Class H[b]	426,600	4,223,707
Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd.[b]	4,780,000	9,536,752
Henan Shuanghui Investment & Development Co. Ltd., Class A	944,400	3,656,417
Hengan International Group Co. Ltd.	2,619,500	12,535,643
Hengli Petrochemical Co. Ltd., Class A	1,576,491	4,368,664
Hengyi Petrochemical Co. Ltd., Class A	1,648,429	2,154,018
Hithink RoyalFlush Information Network Co. Ltd., Class A	168,400	2,064,128
Hopson Development Holdings Ltd.[c]	3,149,569	4,330,611
Hoshine Silicon Industry Co. Ltd., Class A	144,300	2,334,131
Hua Hong Semiconductor Ltd.[a][b]	2,333,000	6,848,443
Huadong Medicine Co. Ltd., Class A	519,805	3,157,026
Huafon Chemical Co. Ltd., Class A	1,804,300	1,956,879
Hualan Biological Engineering Inc., Class A	560,783	1,596,449
Huaneng Power International Inc., Class A[a]	2,359,400	2,781,858
Huaneng Power International Inc., Class H[a][c]	15,952,000	8,152,509
Huatai Securities Co. Ltd., Class A	2,517,609	4,769,705
Huatai Securities Co. Ltd., Class H[b]	5,194,400	6,942,948
Huaxia Bank Co. Ltd., Class A	3,994,780	2,967,382
Huaxin Cement Co. Ltd., Class A	482,206	1,209,213
Huayu Automotive Systems Co. Ltd., Class A	917,268	2,470,618
Huizhou Desay Sv Automotive Co. Ltd., Class A	155,400	3,424,637
Hundsun Technologies Inc., Class A	596,237	2,890,004
Hutchmed China Ltd., ADR[a][c]	349,246	4,491,304
Hygeia Healthcare Holdings Co. Ltd.[a][b]	1,387,600	7,489,539
Iflytek Co. Ltd., Class A	650,919	3,515,640

（2022年８月31日現在）

（純資産対比%）

銘柄	数量	価額
China (continued)		
Imeik Technology Development Co. Ltd., Class A	47,500	$ 3,825,121
Industrial & Commercial Bank of China Ltd., Class A	16,313,362	10,331,657
Industrial & Commercial Bank of China Ltd., Class H	223,088,085	113,338,309
Industrial Bank Co. Ltd., Class A	5,088,222	12,551,185
Industrial Securities Co. Ltd., Class A[a]	3,145,676	2,814,265
Ingenic Semiconductor Co. Ltd., Class A	138,100	1,620,044
Inner Mongolia BaoTou Steel Union Co. Ltd., Class A	12,803,300	3,713,748
Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co. Ltd., Class A	2,944,700	1,850,146
Inner Mongolia Yili Industrial Group Co. Ltd., Class A	1,677,170	8,662,315
Inner Mongolia Yitai Coal Co. Ltd., Class B	4,604,000	7,748,297
Innovent Biologics Inc.[a][b][c]	4,095,500	17,264,686
Inspur Electronic Information Industry Co. Ltd., Class A	665,590	2,224,879
Intco Medical Technology Co. Ltd., Class A	208,171	659,869
iQIYI Inc., ADR[a][c]	1,352,269	4,949,305
JA Solar Technology Co. Ltd., Class A	588,900	5,556,908
Jafron Biomedical Co. Ltd., Class A	251,556	1,705,015
JCET Group Co. Ltd., Class A	629,400	2,248,228
JD Health International Inc.[a][b][c]	4,460,000	30,723,250
JD.com Inc., Class A	8,567,054	271,191,171
Jiangsu Eastern Shenghong Co. Ltd., Class A	1,124,500	3,117,501
Jiangsu Expressway Co. Ltd., Class H	5,294,000	4,534,340
Jiangsu Hengli Hydraulic Co. Ltd., Class A	381,188	2,691,495
Jiangsu Hengrui Medicine Co. Ltd., Class A	1,624,741	8,126,765
Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd., Class A	379,886	2,535,157
Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co. Ltd., Class A	377,350	8,951,030
Jiangsu Zhongtian Technology Co. Ltd., Class A	910,624	2,919,306
Jiangxi Copper Co. Ltd., Class A	1,007,000	2,374,097
Jiangxi Copper Co. Ltd., Class H	4,243,000	5,211,139
Jiangxi Zhengbang Technology Co. Ltd., Class A[a]	1,165,024	1,004,628
Jinke Properties Group Co. Ltd., Class A[a]	1,298,282	468,261
Jinxin Fertility Group Ltd.[b]	6,122,500	3,986,829
JiuGui Liquor Co. Ltd., Class A	97,800	2,105,315
Jiumaojiu International Holdings Ltd.[b]	2,961,000	5,825,432
Jonjee Hi-Tech Industrial And Commercial Holding Co. Ltd., Class A	310,425	1,541,319
JOYY Inc., ADR	198,520	6,019,126
Juewei Food Co. Ltd., Class A	212,814	1,433,764
Kanzhun Ltd., ADR[a]	692,111	16,257,687
KE Holdings Inc., ADR[a][c]	2,614,534	47,166,193
Kingboard Holdings Ltd.	2,775,500	8,764,191
Kingboard Laminates Holdings Ltd.[c]	4,021,500	3,836,160
Kingdee International Software Group Co. Ltd.[a][c]	10,447,000	20,276,612
Kingfa Sci & Tech Co. Ltd., Class A	1,121,200	1,738,596
Kingsoft Corp. Ltd.	3,866,000	11,749,878
Kuaishou Technology[a][b]	6,955,800	60,268,428
Kunlun Energy Co. Ltd.	15,890,000	13,835,848
Kweichow Moutai Co. Ltd., Class A	302,187	84,003,093
LB Group Co. Ltd., Class A	749,000	1,898,243
Legend Biotech Corp., ADR[a]	195,472	9,087,493
Lenovo Group Ltd.[c]	28,914,000	23,813,912
Lens Technology Co. Ltd., Class A	1,437,200	2,248,306
Lepu Medical Technology Beijing Co. Ltd., Class A	664,335	1,815,892
Li Auto Inc., ADR[a][c]	2,182,429	62,788,482
Li Ning Co. Ltd.	9,444,000	86,018,850
China (continued)		
Lingyi iTech Guangdong Co., Class A[a]	3,114,580	$ 2,470,433
Longfor Group Holdings Ltd.[b]	7,253,500	23,543,142
LONGi Green Energy Technology Co. Ltd., Class A	1,861,631	13,697,890
Lufax Holding Ltd., ADR	2,846,915	12,441,019
Luxshare Precision Industry Co. Ltd., Class A	1,778,946	9,612,214
Luzhou Laojiao Co. Ltd., Class A	362,239	12,244,809
Mango Excellent Media Co. Ltd., Class A	495,800	1,982,965
Maxscend Microelectronics Co. Ltd., Class A	150,144	2,198,365
Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co. Ltd., Class A[a]	1,510,680	1,053,414
Meituan, Class B[a][b]	17,521,100	420,807,891
Metallurgical Corp. of China Ltd., Class A	5,495,790	2,545,947
Microport Scientific Corp.[a][c]	2,635,000	5,235,952
Ming Yang Smart Energy Group Ltd., Class A	587,000	2,268,260
Ming Yuan Cloud Group Holdings Ltd.	2,730,000	2,237,566
Minth Group Ltd.	3,070,000	8,687,099
MMG Ltd.[a][c]	13,072,000	3,575,982
Montage Technology Co. Ltd., Class A	320,200	2,563,530
Muyuan Foods Co. Ltd., Class A	1,308,739	11,056,939
Nanjing King-Friend Biochemical Pharmaceutical Co. Ltd., Class A	560,853	1,453,155
Nanjing Securities Co. Ltd., Class A	1,940,700	2,382,964
NARI Technology Co. Ltd., Class A	1,804,245	7,132,895
National Silicon Industry Group Co. Ltd., Class A[a]	690,400	2,048,768
NAURA Technology Group Co. Ltd., Class A	136,400	5,526,814
NavInfo Co. Ltd., Class A	836,600	1,577,573
NetEase Inc.	8,260,050	147,502,882
New China Life Insurance Co. Ltd., Class A	628,602	2,612,387
New China Life Insurance Co. Ltd., Class H	3,053,100	7,186,033
New Hope Liuhe Co. Ltd., Class A[a]	1,312,897	2,973,761
New Oriental Education & Technology Group Inc.[a]	6,104,800	17,621,502
Nine Dragons Paper Holdings Ltd.	6,868,000	5,389,115
Ninestar Corp., Class A	528,138	3,366,483
Ningbo Deye Technology Co. Ltd., NVS	49,700	2,647,429
Ningbo Joyson Electronic Corp., Class A[a]	448,700	1,002,489
Ningbo Shanshan Co. Ltd.	634,300	2,271,927
Ningbo Tuopu Group Co. Ltd., Class A	340,100	3,867,961
Ningxia Baofeng Energy Group Co. Ltd., Class A	1,813,200	3,551,310
NIO Inc., ADR[a][c]	5,448,110	108,471,870
Nongfu Spring Co. Ltd., Class H[b]	7,123,400	42,354,666
OFILM Group Co. Ltd., Class A[a]	1,286,865	1,189,674
Oppein Home Group Inc., Class A	165,900	3,126,638
Orient Overseas International Ltd.[c]	533,000	14,857,347
Orient Securities Co. Ltd., Class A	2,248,134	2,806,343
Ovctek China Inc., Class A	251,700	1,547,668
People's Insurance Co. Group of China Ltd. (The), Class A	2,486,600	1,791,120
People's Insurance Co. Group of China Ltd. (The), Class H	29,025,000	8,970,569
Perfect World Co. Ltd., Class A	632,100	1,348,154
PetroChina Co. Ltd., Class A	5,454,000	4,225,669
PetroChina Co. Ltd., Class H	84,080,000	39,098,662
Pharmaron Beijing Co. Ltd., Class A	286,200	2,814,264
Pharmaron Beijing Co. Ltd., Class H[b]	751,400	4,970,274
PICC Property & Casualty Co. Ltd., Class H	27,561,192	29,811,021
Pinduoduo Inc., ADR[a]	2,008,293	143,191,291
Ping An Bank Co. Ltd., Class A	4,685,567	8,611,592
Ping An Healthcare and Technology Co. Ltd.[a][b][c]	2,025,800	5,484,106

（2022年８月31日現在）
（純資産対比%）

銘柄	数量	価額
China (continued)		
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd., Class A	2,817,384	$ 17,803,162
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd., Class H	24,941,500	146,697,010
Poly Developments and Holdings Group Co. Ltd., Class A	3,004,984	7,508,616
Pop Mart International Group Ltd.[(b)(c)]	2,215,800	5,726,291
Postal Savings Bank of China Co. Ltd., Class A	7,126,000	4,637,916
Postal Savings Bank of China Co. Ltd., Class H[(b)(c)]	31,238,000	18,648,187
Power Construction Corp. of China Ltd., Class A	3,941,200	4,386,881
Pylon Technologies Co. Ltd., NVS	38,801	2,409,791
Qinghai Salt Lake Industry Co. Ltd., Class A[(a)]	1,323,200	5,325,365
RLX Technology Inc., ADR[(a)(c)]	1,913,703	2,736,595
Rongsheng Petrochemical Co. Ltd., Class A	2,696,758	5,505,282
SAIC Motor Corp. Ltd., Class A	2,062,606	4,599,053
Sangfor Technologies Inc., Class A	121,600	1,692,276
Sany Heavy Equipment International Holdings Co. Ltd.	4,965,000	5,143,068
Sany Heavy Industry Co. Ltd., Class A	2,212,752	5,024,016
Satellite Chemical Co. Ltd., Class A	807,239	2,554,083
SDIC Power Holdings Co. Ltd., Class A	2,374,090	3,826,478
Seazen Group Ltd.[(a)]	7,698,000	2,555,298
Seazen Holdings Co. Ltd., Class A[(a)]	578,873	1,739,104
SF Holding Co. Ltd., Class A	1,201,235	8,558,985
SG Micro Corp., Class A	103,086	2,375,029
Shaanxi Coal Industry Co. Ltd., Class A	2,670,176	8,504,361
Shandong Gold Mining Co. Ltd., Class A	1,413,136	3,649,563
Shandong Gold Mining Co. Ltd., Class H[(b)(c)]	2,615,250	4,433,510
Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co. Ltd., Class A	699,880	2,947,948
Shandong Linglong Tyre Co. Ltd., Class A	469,800	1,543,871
Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Ltd., Class H	10,074,000	13,666,075
Shanghai Bairun Investment Holding Group Co. Ltd., Class A	363,372	1,221,540
Shanghai Baosight Software Co. Ltd., Class A	470,480	2,576,829
Shanghai Baosight Software Co. Ltd., Class B	2,293,511	6,946,189
Shanghai Construction Group Co. Ltd., Class A	3,391,552	1,328,380
Shanghai Electric Group Co. Ltd., Class A[(a)]	4,959,500	3,036,261
Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co. Ltd., Class A	578,100	3,369,826
Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co. Ltd., Class H	1,888,500	6,075,339
Shanghai International Airport Co. Ltd., Class A[(a)]	310,298	2,525,354
Shanghai International Port Group Co. Ltd., Class A	3,068,399	2,396,622
Shanghai Junshi Biosciences Co. Ltd., Class A[(a)]	161,600	1,234,462
Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co. Ltd., Class B	5,218,006	4,346,964
Shanghai M&G Stationery Inc., Class A	295,337	1,894,190
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co. Ltd., Class A	829,800	2,071,642
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co. Ltd., Class H	2,972,500	4,321,398
Shanghai Pudong Development Bank Co. Ltd., Class A	7,508,122	7,885,990
Shanghai Putailai New Energy Technology Co. Ltd., Class A	393,400	3,586,954
Shanghai RAAS Blood Products Co. Ltd., Class A	2,885,000	2,434,687
Shanxi Coking Coal Energy Group Co. Ltd., Class A	988,700	1,836,413
Shanxi Meijin Energy Co. Ltd., Class A	1,260,200	2,060,008
China (continued)		
Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co. Ltd., Class A	300,400	$ 12,718,871
Shengyi Technology Co. Ltd., Class A	818,000	1,876,922
Shennan Circuits Co. Ltd., Class A	155,140	1,898,986
Shenwan Hongyuan Group Co. Ltd., Class A	6,793,470	4,097,260
Shenzhen Dynanonic Co. Ltd.	47,700	2,202,579
Shenzhen Inovance Technology Co. Ltd., Class A	725,897	6,275,005
Shenzhen International Holdings Ltd.	5,004,500	4,313,913
Shenzhen Kangtai Biological Products Co. Ltd., Class A	302,635	1,470,326
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co. Ltd., Class A	298,032	12,827,505
Shenzhen Overseas Chinese Town Co. Ltd., Class A	2,387,500	1,842,370
Shenzhen Transsion Holding Co. Ltd., Class A	193,601	1,904,380
Shenzhou International Group Holdings Ltd.	3,302,600	34,516,483
Shimao Group Holdings Ltd.[(c)(d)]	4,704,500	1,348,647
Sichuan Chuantou Energy Co. Ltd., Class A	1,439,660	2,744,994
Sichuan Kelun Pharmaceutical Co. Ltd., Class A	719,278	2,229,932
Sichuan Swellfun Co. Ltd., Class A	147,993	1,558,750
Sino Biopharmaceutical Ltd.	41,478,750	21,785,288
Sinoma Science & Technology Co. Ltd., Class A	570,600	1,903,761
Sinopharm Group Co. Ltd., Class H	5,425,200	12,086,222
Sinotruk Hong Kong Ltd.	2,861,000	2,852,513
Skshu Paint Co. Ltd., Class A[(a)]	117,540	1,581,239
Smoore International Holdings Ltd.[(b)(c)]	7,175,000	12,809,352
Songcheng Performance Development Co. Ltd., Class A	917,318	1,677,654
StarPower Semiconductor Ltd., Class A	48,500	2,769,461
Sunac China Holdings Ltd.[(c)(d)]	12,385,000	3,155,937
Sungrow Power Supply Co. Ltd., Class A	372,300	5,957,277
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.[(c)]	2,844,900	38,839,853
Sunwoda Electronic Co. Ltd., Class A	518,600	2,031,768
Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co. Ltd., Class A	639,500	2,380,519
Suzhou Maxwell Technologies Co. Ltd., Class A	50,400	3,393,494
TAL Education Group, ADR[(a)(c)]	1,743,775	10,079,019
TBEA Co. Ltd., Class A	1,066,800	3,809,688
TCL Technology Group Corp., Class A	4,260,755	2,549,253
TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co. Ltd., Class A	824,293	5,711,655
Tencent Holdings Ltd.	24,880,600	1,028,333,752
Tencent Music Entertainment Group, ADR[(a)(c)]	2,810,066	14,359,437
Thunder Software Technology Co. Ltd., Class A	128,187	2,266,412
Tianma Microelectronics Co. Ltd., Class A	2,205,623	3,003,218
Tianqi Lithium Corp., Class A[(a)]	362,700	5,998,530
Tingyi Cayman Islands Holding Corp.[(c)]	8,064,000	14,319,447
Tongcheng Travel Holdings Ltd.[(a)(c)]	5,025,600	10,293,235
Tongkun Group Co. Ltd., Class A	868,900	1,789,113
Tongwei Co. Ltd., Class A	1,107,984	8,451,272
Topchoice Medical Corp., Class A[(a)]	91,900	1,541,226
Topsports International Holdings Ltd.[(b)]	7,567,000	5,972,596
Transfar Zhilian Co. Ltd., Class A	1,438,598	1,156,832
TravelSky Technology Ltd., Class H	3,894,000	6,786,786
Trina Solar Co. Ltd.	561,686	5,777,968
Trip.com Group Ltd., ADR[(a)(c)]	2,170,774	55,832,307
Tsingtao Brewery Co. Ltd., Class A	244,300	3,806,252
Tsingtao Brewery Co. Ltd., Class H	2,402,000	23,325,747
Unigroup Guoxin Microelectronics Co. Ltd., Class A	236,339	5,318,219
Uni-President China Holdings Ltd.	5,617,000	4,835,942

（2022年８月31日現在）
（純資産対比%）

銘柄	数量	価額
China (continued)		
Unisplendour Corp. Ltd., Class A	885,254	$ 2,206,968
Vinda International Holdings Ltd.	1,698,000	4,748,697
Vipshop Holdings Ltd., ADR[a]	1,751,980	20,340,488
Walvax Biotechnology Co. Ltd., Class A	422,347	2,657,269
Wanhua Chemical Group Co. Ltd., Class A	815,991	10,424,112
Want Want China Holdings Ltd.	19,683,000	13,865,126
Weibo Corp., ADR[a]	273,429	5,657,246
Weichai Power Co. Ltd., Class A	2,139,644	3,583,794
Weichai Power Co. Ltd., Class H	7,404,800	9,892,911
Wens Foodstuffs Group Co. Ltd., Class A[a]	1,794,870	6,147,522
Western Securities Co. Ltd., Class A	2,587,710	2,418,275
Western Superconducting Technologies Co. Ltd., Class A	168,866	2,482,275
Wharf Holdings Ltd. (The)	4,958,000	18,671,641
Will Semiconductor Co. Ltd. Shanghai, Class A	299,970	4,047,702
Wingtech Technology Co. Ltd., Class A	328,500	3,057,015
Winning Health Technology Group Co. Ltd., Class A	875,024	892,513
Wuhan Guide Infrared Co. Ltd., Class A	1,395,840	2,876,383
Wuliangye Yibin Co. Ltd., Class A	941,328	22,684,341
WUS Printed Circuit Kunshan Co. Ltd., Class A	702,803	1,210,810
WuXi AppTec Co. Ltd., Class A	680,429	8,785,797
WuXi AppTec Co. Ltd., Class H[b]	1,347,870	15,216,112
Wuxi Biologics Cayman Inc., New[a][b]	14,305,000	126,200,113
Wuxi Shangji Automation Co. Ltd., Class A	122,080	2,370,506
XCMG Construction Machinery Co. Ltd., Class A[a]	3,215,269	2,417,054
Xiaomi Corp., Class B[a][b]	60,845,800	88,874,940
Xinjiang Goldwind Science & Technology Co. Ltd., Class A	1,492,493	2,756,185
Xinjiang Goldwind Science & Technology Co. Ltd., Class H	2,721,846	4,055,991
Xinyi Solar Holdings Ltd.[c]	19,604,000	26,959,790
XPeng Inc., ADR[a][c]	1,687,134	31,245,722
Xtep International Holdings Ltd.	5,329,000	7,394,972
Yadea Group Holdings Ltd.[b]	4,942,000	9,426,354
Yankuang Energy Group Co. Ltd., Class A	659,600	4,569,257
Yankuang Energy Group Co. Ltd., Class H[c]	6,092,800	24,117,796
Yantai Jereh Oilfield Services Group Co. Ltd., Class A	316,898	1,739,319
Yealink Network Technology Corp. Ltd., Class A	288,730	2,980,119
Yifeng Pharmacy Chain Co. Ltd., Class A	265,236	2,043,202
Yihai International Holding Ltd.[c]	1,934,000	4,870,586
Yihai Kerry Arawana Holdings Co. Ltd., Class A	382,700	2,521,503
YongXing Special Materials Technology Co. Ltd., Class A	120,100	2,321,195
Yonyou Network Technology Co. Ltd., Class A	958,551	2,772,389
YTO Express Group Co. Ltd., Class A	952,200	2,701,553
Yuexiu Property Co. Ltd.	5,778,000	7,226,961
Yum China Holdings Inc.	1,681,873	84,278,656
Yunda Holding Co. Ltd., Class A	941,804	2,287,573
Yunnan Baiyao Group Co. Ltd., Class A	505,021	3,819,323
Yunnan Energy New Material Co. Ltd., Class A	237,200	6,603,132
Zai Lab Ltd., ADR[a][c]	350,512	16,197,160
Zhangzhou Pientzehuang Pharmaceutical Co. Ltd., Class A	154,850	6,724,679
Zhaojin Mining Industry Co. Ltd., Class H[a]	4,903,000	4,151,535
Zhejiang Century Huatong Group Co. Ltd., Class A[a]	2,429,098	1,601,573
Zhejiang Chint Electrics Co. Ltd., Class A	609,223	2,777,161
Zhejiang Dahua Technology Co. Ltd., Class A	993,084	2,108,404
Zhejiang Expressway Co. Ltd., Class H	6,002,000	4,572,981
China (continued)		
Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co. Ltd., Class A	524,404	$ 1,510,782
Zhejiang Huayou Cobalt Co. Ltd., Class A	422,915	4,551,657
Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co. Ltd., Class A	379,800	4,148,675
Zhejiang NHU Co. Ltd., Class A	947,387	3,074,634
Zhejiang Supor Co. Ltd., Class A	188,082	1,245,006
Zhejiang Wolwo Bio-Pharmaceutical Co. Ltd., Class A	188,847	1,262,672
Zheshang Securities Co. Ltd., Class A	1,398,600	2,203,509
ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd., Class H[a][b][c]	2,822,900	8,272,682
Zhongji Innolight Co. Ltd., Class A	314,100	1,328,237
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	2,457,500	11,619,964
Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd.[c]	2,477,200	11,978,504
Zijin Mining Group Co. Ltd., Class A	5,651,500	7,157,635
Zijin Mining Group Co. Ltd., Class H	22,628,000	25,569,029
Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co. Ltd., Class A	2,568,654	2,136,157
Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co. Ltd., Class H	5,039,200	2,271,652
ZTE Corp., Class A	990,600	3,497,015
ZTE Corp., Class H	3,006,200	6,347,016
ZTO Express Cayman Inc., ADR	1,679,026	43,738,627
		8,361,114,198
Colombia — 0.1%		
Bancolombia SA	1,004,533	7,756,836
Ecopetrol SA	19,799,511	10,089,749
Interconexion Electrica SA ESP	1,815,930	7,859,873
		25,706,458
Czech Republic — 0.1%		
CEZ AS	655,425	26,552,598
Komercni Banka AS	278,775	6,529,196
Moneta Money Bank AS[b]	1,302,899	4,129,607
		37,211,401
Egypt — 0.1%		
Commercial International Bank Egypt SAE	6,682,339	13,234,556
Eastern Co. SAE	4,132,247	2,093,501
Egyptian Financial Group-Hermes Holding Co.[a]	369,274	245,927
		15,573,984
Greece — 0.3%		
Alpha Services and Holdings SA[a]	8,751,191	8,081,753
Eurobank Ergasias Services and Holdings SA, Class A[a]	10,369,884	9,621,255
FF Group[a][d]	246,892	2,481
Hellenic Telecommunications Organization SA	806,579	12,831,745
JUMBO SA	454,557	6,498,234
Mytilineos SA	404,126	6,319,597
National Bank of Greece SA[a]	2,214,159	7,145,608
OPAP SA	746,659	9,834,925
Public Power Corp. SA[a]	834,611	4,356,998
		64,692,596
Hungary — 0.2%		
MOL Hungarian Oil & Gas PLC	1,635,369	11,268,266
OTP Bank Nyrt	872,751	18,560,800
Richter Gedeon Nyrt	557,868	11,247,797
		41,076,863
India — 14.3%		
ACC Ltd.	307,553	8,812,744
Adani Enterprises Ltd.	1,129,428	44,819,936
Adani Green Energy Ltd.[a]	1,260,348	38,082,471

（2022年８月31日現在）

（純資産対比%）

銘柄	数量	価額
India (continued)		
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	2,026,978	$ 21,207,257
Adani Power Ltd.[a]	3,079,429	15,725,566
Adani Total Gas Ltd.	1,102,395	51,412,890
Adani Transmission Ltd.[a]	1,108,686	54,368,305
Ambuja Cements Ltd.	2,403,224	12,323,340
Apollo Hospitals Enterprise Ltd.	404,347	21,724,909
Asian Paints Ltd.	1,543,287	64,970,562
AU Small Finance Bank Ltd.[b]	634,836	4,992,501
Aurobindo Pharma Ltd.	991,175	6,748,145
Avenue Supermarts Ltd.[a][b]	649,270	36,496,916
Axis Bank Ltd.	9,052,571	84,365,331
Bajaj Auto Ltd.	270,877	13,796,810
Bajaj Finance Ltd.	1,085,074	97,929,338
Bajaj Finserv Ltd.	154,311	32,350,558
Balkrishna Industries Ltd.	320,537	8,142,626
Bandhan Bank Ltd.[b]	2,544,001	8,779,799
Berger Paints India Ltd.	991,053	8,288,532
Bharat Electronics Ltd.	4,918,557	18,793,718
Bharat Forge Ltd.	985,125	9,068,737
Bharat Petroleum Corp. Ltd.	3,361,441	13,769,764
Bharti Airtel Ltd.	8,728,703	79,068,451
Biocon Ltd.	1,611,745	6,236,206
Britannia Industries Ltd.	430,143	20,126,979
Cholamandalam Investment and Finance Co. Ltd.	1,670,400	16,365,087
Cipla Ltd.	1,914,187	24,804,668
Coal India Ltd.	6,143,129	17,950,140
Colgate-Palmolive India Ltd.	481,327	10,106,391
Container Corp. of India Ltd.	1,047,220	9,084,094
Dabur India Ltd.	2,421,181	17,653,591
Divi's Laboratories Ltd.	525,345	23,718,676
DLF Ltd.	2,497,060	12,062,116
Dr. Reddy's Laboratories Ltd.	455,159	24,053,460
Eicher Motors Ltd.	546,070	22,790,361
GAIL India Ltd.	6,041,367	10,262,034
Godrej Consumer Products Ltd.[a]	1,607,075	18,511,707
Godrej Properties Ltd.[a]	502,886	8,771,211
Grasim Industries Ltd.	1,072,415	22,350,667
Havells India Ltd.	1,019,587	17,650,738
HCL Technologies Ltd.	4,281,727	49,804,346
HDFC Life Insurance Co. Ltd.[b]	3,742,724	26,821,132
Hero MotoCorp Ltd.	430,900	15,178,535
Hindalco Industries Ltd.	5,483,579	29,740,736
Hindustan Petroleum Corp. Ltd.	2,502,267	7,594,992
Hindustan Unilever Ltd.	3,277,154	108,493,334
Housing Development Finance Corp. Ltd.	6,867,423	207,914,067
ICICI Bank Ltd.	20,533,922	225,161,534
ICICI Lombard General Insurance Co. Ltd.[b]	919,446	14,769,530
ICICI Prudential Life Insurance Co. Ltd.[b]	1,388,982	10,254,022
Indian Oil Corp. Ltd.	10,999,561	9,815,002
Indian Railway Catering & Tourism Corp. Ltd.	990,897	8,691,538
Indraprastha Gas Ltd.	1,161,168	6,070,961
Indus Towers Ltd.	2,643,111	6,572,765
Info Edge India Ltd.	287,610	15,471,387
Infosys Ltd.	13,384,557	246,691,980
InterGlobe Aviation Ltd.[a][b]	386,911	9,662,127
ITC Ltd.	11,741,551	46,922,520
Jindal Steel & Power Ltd.	1,683,907	9,060,636
JSW Steel Ltd.	2,935,412	24,343,770
Jubilant Foodworks Ltd.	1,546,836	11,782,617
Kotak Mahindra Bank Ltd.	2,208,885	52,403,962
India (continued)		
Larsen & Toubro Infotech Ltd.[b]	209,464	$ 11,986,230
Larsen & Toubro Ltd.	2,735,632	65,291,970
Lupin Ltd.	746,139	6,235,067
Mahindra & Mahindra Ltd.	3,477,231	56,437,648
Marico Ltd.	2,046,151	13,432,697
Maruti Suzuki India Ltd.	480,020	54,145,010
Mindtree Ltd.	244,142	9,934,127
Mphasis Ltd.	334,702	8,805,162
MRF Ltd.	7,625	8,127,648
Muthoot Finance Ltd.	489,848	6,417,632
Nestle India Ltd.	132,486	32,986,214
NTPC Ltd.	15,613,339	32,005,125
Oil & Natural Gas Corp. Ltd.	9,851,022	17,053,237
Page Industries Ltd.	24,804	15,803,050
Petronet LNG Ltd.	2,984,542	8,233,630
PI Industries Ltd.	319,481	13,660,765
Pidilite Industries Ltd.	635,147	21,681,061
Piramal Pharma Ltd., NVS	1,909,920	5,131,137
Power Grid Corp. of India Ltd.	12,580,575	36,019,082
Reliance Industries Ltd.	12,124,944	397,213,709
Samvardhana Motherson International Ltd.	5,049,549	7,701,926
SBI Cards & Payment Services Ltd.	954,108	10,940,058
SBI Life Insurance Co. Ltd.[b]	1,791,913	29,612,678
Shree Cement Ltd.	43,159	11,848,024
Shriram Transport Finance Co. Ltd.	762,968	12,805,891
Siemens Ltd.	299,848	10,765,889
SRF Ltd.	601,955	18,996,383
State Bank of India	7,142,562	47,026,410
Sun Pharmaceutical Industries Ltd.	3,786,810	42,261,615
Tata Consultancy Services Ltd.	3,630,978	144,809,157
Tata Consumer Products Ltd.	2,248,220	22,722,903
Tata Elxsi Ltd.	138,561	15,455,636
Tata Motors Ltd.[a]	6,616,752	38,533,264
Tata Power Co. Ltd. (The)	5,805,971	17,025,225
Tata Steel Ltd.	29,401,154	39,474,058
Tech Mahindra Ltd.	2,305,897	30,722,683
Titan Co. Ltd.	1,414,954	45,850,582
Torrent Pharmaceuticals Ltd.	401,777	7,763,444
Trent Ltd.	764,178	13,365,538
UltraTech Cement Ltd.	403,865	33,575,262
United Spirits Ltd.[a]	1,207,295	12,203,193
UPL Ltd.	1,989,550	19,056,016
Vedanta Ltd.	3,065,834	10,274,865
Wipro Ltd.	5,360,792	27,448,228
Yes Bank Ltd.[a]	44,946,224	9,212,413
Zomato Ltd.[a]	8,955,265	6,401,451
		3,688,211,818
Indonesia — 2.0%		
Adaro Energy Indonesia Tbk PT	58,999,300	14,065,240
Adaro Minerals Indonesia Tbk PT[a]	33,076,700	3,814,638
Aneka Tambang Tbk	35,150,800	4,700,246
Astra International Tbk PT	80,207,400	37,634,842
Bank Central Asia Tbk PT	218,541,100	120,683,385
Bank Jago Tbk PT[a]	16,747,000	9,489,533
Bank Mandiri Persero Tbk PT	73,614,400	43,806,819
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	30,040,476	17,230,189
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	270,196,408	78,905,187
Barito Pacific Tbk PT	118,104,900	6,519,706
Charoen Pokphand Indonesia Tbk PT	29,203,445	11,559,390
Gudang Garam Tbk PT	1,668,800	2,668,561

（2022年８月31日現在）

（純資産対比%）

銘柄	数量	価額
Indonesia (continued)		
Indah Kiat Pulp & Paper Tbk PT	11,263,000	$ 6,308,951
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	9,032,700	5,055,561
Indofood Sukses Makmur Tbk PT	16,793,800	7,045,256
Kalbe Farma Tbk PT	84,976,115	9,609,007
Merdeka Copper Gold Tbk PT[a]	51,809,963	14,898,999
Sarana Menara Nusantara Tbk PT	95,234,800	7,961,846
Semen Indonesia Persero Tbk PT	11,731,100	5,209,315
Sumber Alfaria Trijaya Tbk PT	67,109,900	9,849,183
Telkom Indonesia Persero Tbk PT	196,097,200	60,050,996
Tower Bersama Infrastructure Tbk PT	24,936,400	4,734,303
Unilever Indonesia Tbk PT	30,168,400	9,322,847
United Tractors Tbk PT	6,871,353	15,646,529
Vale Indonesia Tbk PT[a]	10,441,600	4,279,719
		511,050,248
Kuwait — 0.8%		
Agility Public Warehousing Co. KSC	5,881,632	16,045,982
Boubyan Bank KSCP	5,704,433	15,462,430
Gulf Bank KSCP	6,563,793	7,452,893
Kuwait Finance House KSCP	20,402,479	59,554,442
Mabanee Co. KPSC	2,659,251	7,146,993
Mobile Telecommunications Co. KSCP	8,161,550	16,022,682
National Bank of Kuwait SAKP	28,525,141	97,579,132
		219,264,554
Malaysia — 1.5%		
AMMB Holdings Bhd	7,509,275	6,979,465
Axiata Group Bhd	10,722,900	7,271,580
CIMB Group Holdings Bhd	26,484,300	31,671,755
Dialog Group Bhd	14,416,312	7,798,611
DiGi.Com Bhd	12,138,200	10,130,915
Genting Bhd	8,227,900	8,599,679
Genting Malaysia Bhd	11,619,900	7,712,994
HAP Seng Consolidated Bhd	2,629,900	4,083,969
Hartalega Holdings Bhd[c]	6,669,900	2,473,921
Hong Leong Bank Bhd	2,581,500	12,015,690
Hong Leong Financial Group Bhd	1,036,500	4,480,478
IHH Healthcare Bhd	7,216,100	9,959,480
Inari Amertron Bhd	11,347,900	6,753,914
IOI Corp. Bhd	9,799,020	9,261,503
Kuala Lumpur Kepong Bhd	1,740,000	8,996,447
Malayan Banking Bhd	18,820,300	37,649,961
Malaysia Airports Holdings Bhd[a]	2,916,100	3,810,497
Maxis Bhd[c]	9,003,200	7,717,727
MISC Bhd	4,954,700	7,839,529
MR DIY Group M Bhd[b]	9,578,800	4,624,149
Nestle Malaysia Bhd	282,100	8,370,857
Petronas Chemicals Group Bhd	9,798,500	19,219,453
Petronas Dagangan Bhd	1,280,100	6,721,562
Petronas Gas Bhd	3,174,200	12,266,736
PPB Group Bhd	2,670,660	10,502,428
Press Metal Aluminium Holdings Bhd	15,036,000	15,936,601
Public Bank Bhd	57,786,050	60,677,664
QL Resources Bhd	4,705,300	5,361,866
RHB Bank Bhd	5,852,925	7,478,750
Sime Darby Bhd	10,401,573	5,299,596
Sime Darby Plantation Bhd	8,206,973	8,157,742
Telekom Malaysia Bhd	4,715,900	6,269,206
Tenaga Nasional Bhd	9,488,850	19,060,387
Top Glove Corp. Bhd[c]	20,540,400	3,677,661
		388,832,773

銘柄	数量	価額
Mexico — 2.0%		
Alfa SAB de CV, Class A	11,523,200	$ 7,332,659
America Movil SAB de CV, Series L, NVS	110,856,600	94,478,337
Arca Continental SAB de CV	1,733,736	11,802,640
Cemex SAB de CV, NVS[a]	60,437,873	22,409,397
Coca-Cola Femsa SAB de CV	2,051,493	12,543,266
Fibra Uno Administracion SA de CV	12,604,700	13,195,003
Fomento Economico Mexicano SAB de CV	7,640,500	47,887,521
Gruma SAB de CV, Class B[c]	827,135	9,013,027
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV, Class B	1,450,800	20,656,068
Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV, Class B	775,100	16,416,892
Grupo Bimbo SAB de CV, Series A[c]	5,514,800	18,126,725
Grupo Carso SAB de CV, Series A1[c]	1,925,441	6,626,006
Grupo Financiero Banorte SAB de CV, Class O	10,303,456	60,849,537
Grupo Financiero Inbursa SAB de CV, Class O[a][c]	8,875,100	13,982,363
Grupo Mexico SAB de CV, Series B	12,594,988	47,687,970
Grupo Televisa SAB, CPO[c]	9,467,100	11,931,088
Industrias Penoles SAB de CV	582,093	4,784,393
Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV, Class A	5,934,500	8,038,741
Operadora De Sites Mexicanos SAB de CV	5,580,100	5,556,142
Orbia Advance Corp. SAB de CV	4,090,434	7,719,371
Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV	793,945	5,580,649
Wal-Mart de Mexico SAB de CV[c]	20,677,600	67,575,667
		514,193,462
Peru — 0.2%		
Cia. de Minas Buenaventura SAA, ADR	867,823	4,616,818
Credicorp Ltd.	284,131	36,621,645
Southern Copper Corp.	343,751	16,180,360
		57,418,823
Philippines — 0.8%		
Aboitiz Equity Ventures Inc.	7,384,010	7,364,717
ACEN Corp.	35,724,698	4,757,514
Ayala Corp.	979,606	12,207,369
Ayala Land Inc.	28,771,700	14,605,444
Bank of the Philippine Islands	6,770,964	11,432,019
BDO Unibank Inc.	7,878,931	18,016,331
Converge Information and Communications Technology Solutions Inc.[a]	8,992,000	2,772,704
Globe Telecom Inc.	110,870	4,136,729
GT Capital Holdings Inc.	365,862	3,133,567
International Container Terminal Services Inc.	4,217,720	13,583,850
JG Summit Holdings Inc.	12,059,543	10,966,417
Jollibee Foods Corp.	1,813,569	7,729,942
Manila Electric Co.	898,910	4,814,250
Metro Pacific Investments Corp.	46,932,500	3,114,188
Metropolitan Bank & Trust Co.	7,164,105	6,695,784
Monde Nissin Corp.[a][b]	24,438,100	7,172,199
PLDT Inc.	347,198	10,349,168
SM Investments Corp.	951,142	14,039,755
SM Prime Holdings Inc.	43,887,325	29,502,034
Universal Robina Corp.	3,556,120	7,718,445
		194,112,426
Poland — 0.5%		
Allegro.eu SA [a][b][c]	1,467,410	7,696,835
Bank Polska Kasa Opieki SA	723,773	10,012,754
CD Projekt SA[c]	256,051	4,566,169
Cyfrowy Polsat SA	928,748	3,830,416

（2022年８月31日現在）

（純資産対比%）

銘柄	数量	価額
Poland (continued)		
Dino Polska SA[a][b]	203,197	$ 14,823,941
KGHM Polska Miedz SA	567,076	10,626,656
LPP SA	4,487	8,079,393
mBank SA[a][c]	61,238	2,813,342
Orange Polska SA[c]	2,650,073	3,377,123
PGE Polska Grupa Energetyczna SA[a]	3,556,251	5,420,995
Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	1,624,713	21,043,635
Polskie Gornictwo Naftowe i Gazownictwo SA[a]	6,967,340	8,276,702
Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	3,426,666	17,094,067
Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	2,345,160	14,037,723
Santander Bank Polska SA	143,398	6,515,943
		138,215,694
Qatar — 1.1%		
Barwa Real Estate Co.	7,465,281	7,458,825
Commercial Bank PSQC (The)	11,647,451	23,142,495
Industries Qatar QSC	6,057,614	29,808,415
Masraf Al Rayan QSC	21,761,656	26,690,987
Mesaieed Petrochemical Holding Co.	18,901,209	13,332,740
Ooredoo QPSC	3,042,268	7,504,732
Qatar Electricity & Water Co. QSC	1,854,894	9,524,294
Qatar Fuel QSC	1,874,491	9,680,936
Qatar Gas Transport Co. Ltd.	10,496,939	11,387,997
Qatar International Islamic Bank QSC	2,936,123	9,486,746
Qatar Islamic Bank SAQ	6,520,139	45,294,005
Qatar National Bank QPSC	18,211,329	101,959,214
		295,271,386
Romania — 0.0%		
NEPI Rockcastle SA	1,788,798	9,531,687
Russia — 0.0%		
Alrosa PJSC[d]	9,805,890	1,608
Gazprom PJSC[a][d]	43,696,315	7,163
Inter RAO UES PJSC[d]	121,651,300	19,943
LUKOIL PJSC[d]	1,533,792	251
Magnit PJSC[d]	246,156	40
Magnit PJSC, GDR[d]	2	—
MMC Norilsk Nickel PJSC[d]	233,757	38
Mobile TeleSystems PJSC[d]	3,162,662	518
Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC[a][d]	5,279,850	866
Novatek PJSC[d]	3,371,230	553
Novolipetsk Steel PJSC[d]	5,629,360	923
Ozon Holdings PLC, ADR[a][d]	197,078	32
PhosAgro PJSC[d]	174,249	29
PhosAgro PJSC, GDR[d]	2	—
PhosAgro PJSC, New[d]	3,367	34
Polymetal International PLC[d]	1,312,267	215
Polyus PJSC[d]	126,490	21
Rosneft Oil Co. PJSC[d]	4,281,715	702
Sberbank of Russia PJSC[a][d]	39,606,181	6,493
Severstal PAO[d]	805,849	132
Surgutneftegas PJSC[d]	26,192,370	4,294
Tatneft PJSC[d]	5,175,395	848
TCS Group Holding PLC, GDR[a][d]	445,207	73
United Co. RUSAL International PJSC[a][d]	11,428,270	1,873
VK Co. Ltd.[a][d]	404,870	66
VTB Bank PJSC[d]	11,783,971,998	1,932
X5 Retail Group NV, GDR[d]	424,766	70
Yandex NV[a][d]	1,127,576	185
		48,902

銘柄	数量	価額
Saudi Arabia — 4.7%		
ACWA Power Co.	328,232	$ 15,253,818
Advanced Petrochemical Co.	528,177	7,007,099
Al Rajhi Bank	7,821,135	187,236,293
Alinma Bank	3,969,558	39,992,350
Almarai Co. JSC	946,038	13,314,688
AngloGold Ashanti Ltd.	1,672,359	22,333,790
Arab National Bank	2,406,937	19,187,226
Bank AlBilad[a]	1,961,257	26,351,402
Bank Al-Jazira	1,663,498	10,386,978
Banque Saudi Fransi	2,373,133	31,317,132
Bupa Arabia for Cooperative Insurance Co.	246,451	10,778,543
Dar Al Arkan Real Estate Development Co.[a]	2,173,342	8,148,470
Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co.	349,152	18,551,257
Elm Co.	99,397	9,072,328
Emaar Economic City[a]	1,602,140	4,293,091
Etihad Etisalat Co.	1,514,143	14,727,350
Jarir Marketing Co.	222,898	10,177,009
Mobile Telecommunications Co.[a]	1,690,336	5,193,898
Mouwasat Medical Services Co.	200,642	12,859,183
National Industrialization Co.[a]	1,368,161	5,771,295
Rabigh Refining & Petrochemical Co.[a]	1,781,422	8,194,001
Reinet Investments SCA	558,972	9,174,271
Riyad Bank	5,414,736	50,991,288
SABIC Agri-Nutrients Co.	862,217	39,803,282
Sahara International Petrochemical Co.	1,466,717	18,525,691
Saudi Arabian Mining Co.[a]	3,477,659	68,620,601
Saudi Arabian Oil Co.[b]	9,534,856	94,976,543
Saudi Basic Industries Corp.	3,554,501	94,426,154
Saudi British Bank (The)	3,666,116	38,889,867
Saudi Electricity Co.	3,299,705	22,087,773
Saudi Industrial Investment Group	1,493,126	10,126,692
Saudi Investment Bank (The)	1,968,865	10,468,213
Saudi Kayan Petrochemical Co.[a]	2,974,651	11,567,698
Saudi National Bank (The)	8,726,941	161,831,189
Saudi Research & Media Group[a]	146,994	8,239,629
Saudi Tadawul Group Holding Co.	144,140	8,707,633
Saudi Telecom Co.	5,879,002	65,271,674
Savola Group (The)	982,876	8,514,162
Yanbu National Petrochemical Co.	985,080	13,090,060
		1,215,459,621
South Africa — 3.2%		
Absa Group Ltd.	3,226,579	33,418,179
African Rainbow Minerals Ltd.	500,600	6,905,452
Anglo American Platinum Ltd.	214,806	14,995,510
Aspen Pharmacare Holdings Ltd.	1,525,541	13,091,878
Bid Corp. Ltd.[c]	1,337,410	25,379,851
Bidvest Group Ltd. (The)	1,136,340	14,260,018
Capitec Bank Holdings Ltd.	347,240	41,288,694
Clicks Group Ltd.	982,326	17,091,311
Discovery Ltd.[a]	1,989,961	14,257,954
Exxaro Resources Ltd.	1,016,543	12,951,001
FirstRand Ltd.	20,021,800	74,783,603
Foschini Group Ltd. (The)	1,318,304	9,786,793
Gold Fields Ltd.	3,575,423	28,876,374
Growthpoint Properties Ltd.	13,343,722	9,924,777
Harmony Gold Mining Co. Ltd.	2,261,737	5,759,741
Impala Platinum Holdings Ltd.	3,409,292	35,723,745
Kumba Iron Ore Ltd.	261,036	5,779,155
Mr. Price Group Ltd.	1,031,577	11,174,872
MTN Group Ltd.	6,754,605	48,890,125

（2022年８月31日現在）

（純資産対比%）

銘柄	数量	価額
South Africa (continued)		
MultiChoice Group	1,475,107	$ 9,956,192
Naspers Ltd., Class N	867,384	122,306,726
Nedbank Group Ltd.	1,824,364	21,533,819
Northam Platinum Holdings Ltd.[a]	1,372,824	12,919,754
Old Mutual Ltd.	18,714,876	11,087,109
Pepkor Holdings Ltd.[b]	6,682,131	7,845,152
Remgro Ltd.	2,066,049	15,320,654
Sanlam Ltd.	7,043,096	21,895,894
Sasol Ltd.[a]	2,267,852	43,616,797
Shoprite Holdings Ltd.	2,019,712	27,387,335
Sibanye Stillwater Ltd.	11,249,767	25,132,216
SPAR Group Ltd. (The)	725,291	6,630,143
Standard Bank Group Ltd.	5,324,283	47,511,638
Vodacom Group Ltd.	2,501,057	18,409,422
Woolworths Holdings Ltd	4,005,488	13,095,371
		828,987,255
South Korea — 10.9%		
Alteogen Inc.[a][c]	117,279	5,529,482
Amorepacific Corp.[c]	115,475	10,524,509
AMOREPACIFIC Group	115,348	2,985,924
BGF retail Co. Ltd.	32,436	3,885,141
Celltrion Healthcare Co. Ltd.	342,548	18,331,165
Celltrion Inc.	393,286	55,357,940
Celltrion Pharm Inc.[a][c]	68,184	3,965,942
Cheil Worldwide Inc.	290,354	4,733,787
CJ CheilJedang Corp.	33,321	10,107,517
CJ Corp.	57,313	3,334,613
CJ ENM Co. Ltd.	42,252	3,079,612
CJ Logistics Corp.[a][c]	33,141	2,921,114
Coway Co. Ltd.	226,479	10,745,164
DB Insurance Co. Ltd.	184,746	8,227,437
Doosan Bobcat Inc.	214,859	5,524,095
Doosan Enerbility Co. Ltd.[a]	1,638,207	24,620,035
Ecopro BM Co. Ltd.[c]	196,526	16,261,110
E-MART Inc.	80,698	5,858,526
F&F Co. Ltd./New	71,577	7,552,416
Green Cross Corp.	23,639	2,885,724
GS Engineering & Construction Corp.	257,106	5,751,036
GS Holdings Corp.	201,499	6,917,866
Hana Financial Group Inc.	1,176,725	34,297,592
Hankook Tire & Technology Co. Ltd.	288,441	8,131,674
Hanmi Pharm Co. Ltd.[c]	28,558	6,544,358
Hanon Systems[c]	732,251	5,599,667
Hanwha Solutions Corp.[a][c]	459,210	17,905,459
HD Hyundai Co. Ltd.	197,560	9,276,097
HLB Inc.[a][c]	388,751	14,193,046
HMM Co. Ltd.[c]	1,072,126	17,668,748
Hotel Shilla Co. Ltd.[c]	131,161	7,184,885
HYBE Co. Ltd.[a][c]	72,015	9,650,406
Hyundai Engineering & Construction Co. Ltd.[c]	314,774	11,255,638
Hyundai Glovis Co. Ltd.	73,574	9,640,179
Hyundai Heavy Industries Co. Ltd.[a][c]	71,407	7,598,476
Hyundai Mobis Co. Ltd.	242,824	38,723,931
Hyundai Motor Co.	555,452	80,697,302
Hyundai Steel Co.	362,290	8,834,339
Iljin Materials Co. Ltd.[c]	94,960	5,203,802
Industrial Bank of Korea	1,004,346	7,151,274
Kakao Corp.	1,242,391	67,466,369
Kakao Games Corp.[a][c]	143,227	5,586,508
KakaoBank Corp.[a][c]	479,264	9,704,463

銘柄	数量	価額
South Korea (continued)		
Kangwon Land Inc.[a]	386,119	$ 7,612,928
KB Financial Group Inc.[c]	1,565,200	57,456,832
Kia Corp.	1,045,603	62,671,172
Korea Aerospace Industries Ltd.[c]	301,374	13,675,081
Korea Electric Power Corp.[a]	1,019,311	15,893,988
Korea Investment Holdings Co. Ltd.	162,693	6,859,958
Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co. Ltd.[a]	170,253	12,287,318
Korea Zinc Co. Ltd.	36,485	18,250,769
Korean Air Lines Co. Ltd.[a]	690,473	13,723,208
Krafton Inc.[a]	98,164	17,932,110
KT&G Corp.	421,059	26,155,108
Kumho Petrochemical Co. Ltd.[c]	73,469	7,086,598
L&F Co. Ltd.[a][c]	93,970	15,937,567
LG Chem Ltd.	197,117	92,269,734
LG Corp.	374,755	22,867,919
LG Display Co. Ltd.[c]	921,677	10,651,793
LG Electronics Inc.	424,306	31,750,822
LG Energy Solution[a][c]	91,617	31,398,717
LG H&H Co. Ltd.[c]	37,363	19,785,242
LG Innotek Co. Ltd.	57,707	14,689,775
LG Uplus Corp.	831,654	7,122,273
Lotte Chemical Corp.	68,429	8,885,129
Lotte Shopping Co. Ltd.	47,611	3,494,732
Meritz Financial Group Inc.[c]	138,832	3,182,063
Meritz Fire & Marine Insurance Co. Ltd.[c]	148,871	4,250,335
Meritz Securities Co. Ltd.[c]	1,162,248	4,188,791
Mirae Asset Securities Co. Ltd.	1,062,591	5,182,084
NAVER Corp.	522,001	92,627,295
NCSoft Corp.	65,382	18,373,142
Netmarble Corp.[b][c]	81,008	3,819,246
NH Investment & Securities Co. Ltd.	538,901	3,989,392
Orion Corp./Republic of Korea	96,215	7,048,185
Pan Ocean Co. Ltd.	1,078,252	4,125,783
Pearl Abyss Corp.[a][c]	120,416	5,063,632
POSCO Chemical Co. Ltd.[c]	110,916	13,788,394
POSCO Holdings Inc.	313,441	59,292,123
S-1 Corp.[c]	71,151	3,089,368
Samsung Biologics Co. Ltd.[a][b][c]	70,813	44,042,786
Samsung C&T Corp.	331,038	29,640,099
Samsung Electro-Mechanics Co. Ltd.	222,724	23,060,079
Samsung Electronics Co. Ltd.	19,014,523	842,357,498
Samsung Engineering Co. Ltd.[a][c]	634,522	11,032,464
Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd.	119,860	17,419,743
Samsung Heavy Industries Co. Ltd.[a]	2,501,131	11,097,120
Samsung Life Insurance Co. Ltd.[c]	303,757	14,019,613
Samsung SDI Co. Ltd.	219,655	97,109,811
Samsung SDS Co. Ltd.	132,905	12,684,260
Samsung Securities Co. Ltd.	244,492	6,155,120
SD Biosensor Inc.[c]	151,053	3,949,217
Seegene Inc.[c]	149,659	3,506,201
Shinhan Financial Group Co. Ltd.	1,816,065	49,203,499
SK Biopharmaceuticals Co. Ltd.[a][c]	124,529	6,620,843
SK Bioscience Co. Ltd.[a][c]	92,771	7,766,673
SK Chemicals Co. Ltd.[c]	49,921	3,618,913
SK Hynix Inc.	2,171,903	152,701,999
SK IE Technology Co. Ltd.[a][b][c]	100,523	6,183,397
SK Inc.	146,857	25,401,694
SK Innovation Co. Ltd.[a]	221,178	31,136,397
SK Square Co. Ltd.[a]	395,366	11,880,340

（2022年８月31日現在）

（純資産対比%）

銘柄	数量	価額
South Korea (continued)		
SKC Co. Ltd.[c]	87,840	$ 7,893,306
S-Oil Corp.	181,676	13,780,116
Woori Financial Group Inc.	2,069,177	18,717,616
Yuhan Corp.[c]	213,661	9,035,919
		2,807,907,697
Taiwan — 14.4%		
Accton Technology Corp.	2,026,000	18,656,627
Acer Inc.[c]	11,600,121	8,331,458
Advantech Co. Ltd.[c]	1,685,455	17,980,443
Airtac International Group[a][c]	567,526	15,217,601
ASE Technology Holding Co. Ltd.[c]	13,169,110	36,636,596
Asia Cement Corp.	9,340,077	13,222,082
ASMedia Technology Inc.	112,000	3,380,614
Asustek Computer Inc.[c]	2,764,968	23,007,405
AUO Corp.[c]	32,637,000	17,820,760
Catcher Technology Co. Ltd.[a][c]	2,632,210	15,955,903
Cathay Financial Holding Co. Ltd.[c]	31,044,710	45,164,659
Chailease Holding Co. Ltd.[c]	5,511,433	35,387,303
Chang Hwa Commercial Bank Ltd.	19,194,412	11,086,896
Cheng Shin Rubber Industry Co. Ltd.	7,013,128	8,124,322
China Airlines Ltd.[c]	11,161,000	8,256,073
China Development Financial Holding Corp.[c]	62,011,588	27,092,431
China Steel Corp.[c]	47,411,313	44,901,648
Chunghwa Telecom Co. Ltd.	14,890,410	59,086,463
Compal Electronics Inc.[c]	16,317,908	12,149,749
CTBC Financial Holding Co. Ltd.	69,445,772	53,192,406
Delta Electronics Inc.[c]	7,792,000	66,712,353
E Ink Holdings Inc.	3,488,000	27,122,117
E.Sun Financial Holding Co. Ltd.[c]	51,232,510	47,206,083
Eclat Textile Co. Ltd.[c]	766,427	11,100,497
eMemory Technology Inc.	263,000	11,762,478
Eva Airways Corp.[c]	10,293,000	11,264,343
Evergreen Marine Corp. Taiwan Ltd.	10,132,810	29,037,749
Far Eastern New Century Corp.	12,284,038	13,163,078
Far EasTone Telecommunications Co. Ltd.[c]	6,466,000	15,858,223
Feng TAY Enterprise Co. Ltd.	1,745,137	9,790,840
First Financial Holding Co. Ltd.	42,548,679	36,914,321
Formosa Chemicals & Fibre Corp.	13,936,090	31,308,788
Formosa Petrochemical Corp.[c]	4,487,000	12,299,373
Formosa Plastics Corp.[c]	16,483,280	49,146,451
Fubon Financial Holding Co. Ltd.[c]	28,032,974	52,563,183
Giant Manufacturing Co. Ltd.	1,191,203	9,304,975
Globalwafers Co. Ltd.	874,000	13,827,441
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	49,499,873	176,258,102
Hotai Motor Co. Ltd.[c]	1,226,000	24,566,235
Hua Nan Financial Holdings Co. Ltd.	36,381,407	27,613,957
Innolux Corp.	39,933,002	15,729,310
Inventec Corp.[c]	9,891,281	7,488,387
Largan Precision Co. Ltd.	403,000	25,634,895
Lite-On Technology Corp.[c]	8,030,246	17,281,323
MediaTek Inc.[c]	6,042,338	130,736,399
Mega Financial Holding Co. Ltd.	44,505,666	52,201,851
Micro-Star International Co. Ltd.[c]	2,698,000	10,100,302
momo.com Inc[c]	270,600	6,416,592
Nan Ya Plastics Corp.[c]	19,027,160	42,738,731
Nan Ya Printed Circuit Board Corp.[c]	921,000	8,035,012
Nanya Technology Corp.[c]	4,792,000	8,322,697
Nien Made Enterprise Co. Ltd.	715,000	6,602,832
Novatek Microelectronics Corp.[c]	2,297,000	19,651,531
Parade Technologies Ltd.	308,000	8,622,040

銘柄	数量	価額
Taiwan (continued)		
Pegatron Corp.[c]	7,697,414	$ 16,009,266
Pou Chen Corp.	8,669,220	8,212,280
Powerchip Semiconductor Manufacturing Corp.	11,255,000	12,620,694
President Chain Store Corp.	2,253,000	19,798,384
Quanta Computer Inc.[c]	10,582,000	27,432,867
Realtek Semiconductor Corp.[c]	1,824,637	20,502,886
Ruentex Development Co. Ltd.[c]	4,779,161	9,854,874
Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd. (The)[c]	14,613,318	23,786,199
Shin Kong Financial Holding Co. Ltd.	49,911,149	14,338,539
Silergy Corp.[c]	1,288,000	22,080,811
SinoPac Financial Holdings Co. Ltd.	42,883,212	24,311,016
Synnex Technology International Corp.	5,505,834	10,035,937
Taishin Financial Holding Co. Ltd.	43,515,009	21,597,662
Taiwan Cement Corp.[c]	24,451,751	31,476,442
Taiwan Cooperative Financial Holding Co. Ltd.[c]	40,225,716	36,327,446
Taiwan High Speed Rail Corp.[c]	7,597,000	7,263,239
Taiwan Mobile Co. Ltd.	6,821,600	22,297,358
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	98,111,000	1,606,055,619
Unimicron Technology Corp.[c]	5,035,000	24,670,117
Uni-President Enterprises Corp.[c]	18,996,839	41,053,341
United Microelectronics Corp.[c]	47,189,000	62,783,387
Vanguard International Semiconductor Corp.[c]	3,594,000	8,688,581
Voltronic Power Technology Corp.	268,000	15,122,868
Walsin Lihwa Corp.[c]	10,378,406	13,403,019
Wan Hai Lines Ltd.[c]	2,813,090	7,928,389
Win Semiconductors Corp.[c]	1,321,000	7,672,812
Winbond Electronics Corp.[c]	11,961,000	8,617,947
Wiwynn Corp.[c]	349,000	8,736,694
WPG Holdings Ltd.[c]	6,458,449	10,861,359
Yageo Corp.[c]	1,744,861	18,661,664
Yang Ming Marine Transport Corp.[c]	6,978,000	17,876,048
Yuanta Financial Holding Co. Ltd.[c]	38,971,059	25,868,800
Zhen Ding Technology Holding Ltd.[c]	2,612,075	9,693,883
		3,726,674,356
Thailand — 2.0%		
Advanced Info Service PCL, NVDR	4,745,000	24,963,983
Airports of Thailand PCL, NVDR[a]	16,672,200	33,223,567
Asset World Corp. PCL, NVDR	33,969,000	5,202,726
B Grimm Power PCL, NVDR	3,685,900	3,733,779
Bangkok Commercial Asset Management PCL, NVDR[c]	7,490,400	3,775,205
Bangkok Dusit Medical Services PCL, NVDR	40,995,000	32,855,459
Bangkok Expressway & Metro PCL, NVDR	29,974,100	7,187,114
Berli Jucker PCL, NVDR	4,964,000	4,561,776
BTS Group Holdings PCL, NVDR	29,302,800	6,745,294
Bumrungrad Hospital PCL, NVDR	2,248,400	13,313,344
Carabao Group PCL, NVDR	1,314,900	3,638,018
Central Pattana PCL, NVDR	8,111,300	15,382,352
Central Retail Corp. PCL, NVDR	7,507,534	8,321,792
Charoen Pokphand Foods PCL, NVDR	14,781,600	10,531,967
CP ALL PCL, NVDR	23,012,600	38,788,993
Delta Electronics Thailand PCL, NVDR	1,256,500	18,004,526
Electricity Generating PCL, NVDR	1,072,700	5,378,595
Energy Absolute PCL, NVDR[c]	6,830,700	15,947,593
Global Power Synergy PCL, NVDR[c]	2,864,000	5,331,224
Gulf Energy Development PCL, NVDR	11,987,900	16,822,053
Home Product Center PCL, NVDR	23,772,514	9,056,043
Indorama Ventures PCL, NVDR	7,137,180	8,452,637
Intouch Holdings PCL, NVDR	4,572,625	9,108,360

（2022年８月31日現在）
（純資産対比%）

銘柄	数量	価額
Thailand (continued)		
JMT Network Services PCL, NVDR	2,713,800	$ 5,797,916
Kasikornbank PCL, NVDR	2,084,600	8,775,759
Krung Thai Bank PCL, NVDR	13,846,200	6,402,088
Krungthai Card PCL, NVDR[c]	3,772,800	6,220,706
Land & Houses PCL, NVDR	31,983,500	7,802,724
Minor International PCL, NVDR[a]	12,602,420	11,285,435
Muangthai Capital PCL, NVDR[c]	3,120,900	3,630,830
Osotspa PCL, NVDR	5,960,300	5,103,213
PTT Exploration & Production PCL, NVDR	5,556,639	25,699,627
PTT Global Chemical PCL, NVDR	8,786,130	11,423,971
PTT Oil & Retail Business PCL, NVDR	12,040,900	8,988,948
PTT Public Company Ltd., NVDR	39,255,100	40,331,567
Ratch Group PCL, NVDR	3,782,000	4,562,187
SCB X PCL, NVS[c]	3,335,200	10,081,828
SCG Packaging PCL, NVDR	5,346,600	8,305,237
Siam Cement PCL (The), NVDR	3,060,900	30,027,339
Srisawad Corp. PCL, NVDR[c]	2,921,000	3,895,463
Thai Oil PCL, NVDR[c]	4,759,600	7,918,972
Thai Union Group PCL, NVDR[c]	11,659,600	5,590,938
True Corp. PCL, NVDR[c]	48,633,001	6,078,546
		518,249,694
Turkey — 0.3%		
Akbank TAS	12,272,482	7,906,523
Aselsan Elektronik Sanayi Ve Ticaret AS	2,531,502	3,621,391
BIM Birlesik Magazalar AS	1,748,489	10,489,963
Enka Insaat ve Sanayi AS	2	1
Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS[c]	5,730,581	9,055,259
Ford Otomotiv Sanayi AS	280,293	5,092,941
Haci Omer Sabanci Holding AS	3,976,987	5,565,934
KOC Holding AS	2,899,164	7,233,126
Turk Hava Yollari AO[a]	2,242,872	8,995,384
Turkcell Iletisim Hizmetleri AS	4,607,242	5,444,381
Turkiye Is Bankasi AS, Class C[c]	14,199,227	6,150,730
Turkiye Petrol Rafinerileri AS[a]	525,344	10,357,594
Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS[c]	5,776,150	7,868,017
		87,781,244
United Arab Emirates — 1.3%		
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	11,188,696	27,601,433
Abu Dhabi Islamic Bank PJSC	6,062,912	14,584,530
Abu Dhabi National Oil Co. for Distribution PJSC	12,352,939	14,925,993
Aldar Properties PJSC	15,388,576	20,153,224
Dubai Islamic Bank PJSC	11,474,482	18,249,693
Emaar Properties PJSC	16,000,233	27,191,797
Emirates NBD Bank PJSC	7,508,578	27,238,779
Emirates Telecommunications Group Co. PJSC	13,858,636	97,041,768
First Abu Dhabi Bank PJSC	17,590,925	91,357,617
		338,344,834
Total Common Stocks — 97.3%		
(Cost: $24,873,954,611)		25,160,780,854

Preferred Stocks

銘柄	数量	価額
Brazil — 1.4%		
Banco Bradesco SA, Preference Shares, NVS	21,186,468	77,213,485
Braskem SA, Class A, Preference Shares, NVS	767,510	4,492,288
Centrais Eletricas Brasileiras SA, Class B, Preference Shares, NVS	1,077,207	9,918,156
Cia. Energetica de Minas Gerais, Preference Shares, NVS	5,698,424	13,253,678
Brazil (continued)		
Gerdau SA, Preference Shares, NVS	4,638,617	$ 20,792,816
Itau Unibanco Holding SA, Preference Shares, NVS	19,172,732	95,119,217
Itausa SA, Preference Shares, NVS	18,219,560	32,044,628
Petroleo Brasileiro SA, Preference Shares, NVS	18,859,408	120,463,272
		373,297,540
Chile — 0.2%		
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, Class B, Preference Shares	576,643	57,649,502
Colombia — 0.1%		
Bancolombia SA, Preference Shares, NVS	1,806,285	12,471,482
Russia — 0.0%		
Surgutneftegas PJSC, Preference Shares, NVS[d]	25,014,400	4,101
South Korea — 0.6%		
Hyundai Motor Co. Preference Shares, NVS	88,584	6,011,221
Series 2, Preference Shares, NVS	137,724	9,554,671
LG Chem Ltd., Preference Shares, NVS	31,535	7,046,084
LG H&H Co. Ltd., Preference Shares, NVS	7,694	2,096,955
Samsung Electronics Co. Ltd., Preference Shares, NVS	3,262,331	131,968,325
		156,677,256
Total Preferred Stocks — 2.3%		
(Cost: $418,890,938)		600,099,881

Rights

銘柄	数量	価額
China — 0.0%		
Kangmei Pharmaceutical Co. Ltd. (Expires 12/31/49)[a]	274,733	—
Thailand — 0.0%		
Thai Oil PCL (Expires 09/14/22)[a]	404,449	—
Total Rights — 0.0%		
(Cost: $—)		—
Total Long-Term Investments — 99.6%		
(Cost: $25,292,845,549)		25,760,880,735

Short-Term Securities

銘柄	数量	価額
Money Market Funds — 3.3%		
BlackRock Cash Funds: Institutional, SL Agency Shares, 2.42%[e][f][g]	794,752,519	794,990,945
BlackRock Cash Funds: Treasury, SL Agency Shares, 2.07%[e][f]	64,750,000	64,750,000
Total Short-Term Securities — 3.3%		
(Cost: $859,346,790)		859,740,945
Total Investments in Securities — 102.9%		
(Cost: $26,152,192,339)		26,620,621,680
Liabilities in Excess of Other Assets — (2.9)%		(750,240,322)
Net Assets — 100.0%		$ 25,870,381,358

(a) Non-income producing security.
(b) Security exempt from registration pursuant to Rule 144A under the Securities Act of 1933, as amended. These securities may be resold in transactions exempt from registration to qualified institutional investors.
(c) All or a portion of this security is on loan.

（2022年８月31日現在）

(d) Security is valued using significant unobservable inputs and is classified as Level 3 in the fair value hierarchy.
(e) Affiliate of the Fund.
(f) Annualized 7-day yield as of period end.
(g) All or a portion of this security was purchased with the cash collateral from loaned securities.

iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 UCITS ETF
(iShares J.P. Morgan $ EM Bond UCITS ETF)
損益計算書、純資産変動計算書、投資明細表は、入手可能なANNUAL REPORTから抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

１．損益計算書

(2021年10月31日に終了する期間)
(千米ドルで表示)

運用収益	468,551
金融商品の純損益	(6,251)
投資損益合計	**462,300**
運用費用	(49,460)
当期運用利益/(費用)	**412,840**
コスト：	
分配	(338,798)
コスト合計	**(338,798)**
課税前の純利益/(損失)	**74,042**
課税	―
課税後の純利益/(損失)	**74,042**
純資産の増減額	**74,042**

(注) (　) 内の金額は、マイナスの金額です。

２．純資産変動計算書

(2021年10月31日に終了する会計年度)

(千米ドルで表示)

期首の純資産	10,555,643
純資産の増減額	74,042
取引：	
発行	7,070,112
償還	(8,442,176)
純資産の増減	**(1,372,064)**
期末の純資産	**9,257,621**

３．投資明細表

（2021年10月31日現在）

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
Transferable Securities Admitted to an Official Stock Exchange Listing or traded on a Regulated Market (31 October 2020: 98.57%)				
		Bonds (31 October 2020: 98.57%)		
		Angola (31 October 2020: 0.99%)		
		Government Bonds		
USD	22,793,000	Angolan Government International Bond 8.000% 26/11/2029	22,598	0.24
USD	22,669,000	Angolan Government International Bond 8.250% 09/05/2028	22,773	0.25
USD	15,953,000	Angolan Government International Bond 9.125% 26/11/2049	15,517	0.17
USD	23,060,000	Angolan Government International Bond 9.375% 08/05/2048	22,812	0.25
USD	19,363,000	Angolan Government International Bond 9.500% 12/11/2025	20,885	0.22
		Total Angola	**104,585**	**1.13**
		Argentina (31 October 2020: 1.40%)		
		Government Bonds		
USD	92,268,823	Argentine Republic Government International Bond 0.500% 09/07/2030	31,602	0.34
USD	14,894,458	Argentine Republic Government International Bond 1.000% 09/07/2029	5,392	0.06
USD	117,819,309	Argentine Republic Government International Bond 1.125% 09/07/2035	36,229	0.39
USD	11,450,000	Argentine Republic Government International Bond 1.125% 09/07/2046	3,607	0.04
USD	66,211,894	Argentine Republic Government International Bond 2.000% 09/01/2038	24,201	0.26
USD	60,263,295	Argentine Republic Government International Bond 2.500% 09/07/2041	20,640	0.22
		Total Argentina	**121,671**	**1.31**
		Australia (31 October 2020: 0.13%)		
		Corporate Bonds		
USD	9,157,000	CNOOC Curtis Funding No 1 Pty Ltd 4.500% 03/10/2023	9,711	0.10
		Total Australia	**9,711**	**0.10**
		Azerbaijan (31 October 2020: 0.89%)		
		Corporate Bonds		
USD	26,594,000	Southern Gas Corridor CJSC 6.875% 24/03/2026	31,153	0.34
USD	12,808,000	State Oil Co of the Azerbaijan Republic 4.750% 13/03/2023	13,323	0.14
		Government Bonds		
USD	14,024,000	Republic of Azerbaijan International Bond 3.500% 01/09/2032	14,303	0.15
USD	16,084,000	Republic of Azerbaijan International Bond 4.750% 18/03/2024	17,243	0.19
		Total Azerbaijan	**76,022**	**0.82**
		Bahrain (31 October 2020: 2.52%)		
		Corporate Bonds		
USD	13,275,000	Oil and Gas Holding Co BSCC 7.500% 25/10/2027^	14,547	0.16
		Government Bonds		
USD	12,900,000	Bahrain Government International Bond 5.250% 25/01/2033	12,323	0.13
USD	13,163,000	Bahrain Government International Bond 5.450% 16/09/2032^	12,854	0.14
USD	12,875,000	Bahrain Government International Bond 5.625% 30/09/2031	12,781	0.14
USD	16,202,000	Bahrain Government International Bond 6.000% 19/09/2044	14,949	0.16
USD	19,533,000	Bahrain Government International Bond 6.125% 01/08/2023	20,629	0.22
USD	16,211,000	Bahrain Government International Bond 6.750% 20/09/2029	17,460	0.19
USD	14,690,000	Bahrain Government International Bond 7.000% 26/01/2026	16,263	0.18
USD	20,561,000	Bahrain Government International Bond 7.000% 12/10/2028	22,495	0.24
USD	13,099,000	Bahrain Government International Bond 7.375% 14/05/2030	14,546	0.16
USD	12,753,000	CBB International Sukuk Co 5 Spc 5.624% 12/02/2024	13,489	0.15
USD	13,163,000	CBB International Sukuk Co 7 SPC 6.875% 05/10/2025^	14,973	0.16
USD	13,184,000	CBB International Sukuk Programme Co SPC 4.500% 30/03/2027	13,846	0.15
USD	13,000,000	CBB International Sukuk Programme Co WLL 3.950% 16/09/2027^	13,297	0.14
USD	12,975,000	CBB International Sukuk Programme Co WLL 6.250% 14/11/2024	14,036	0.15
		Total Bahrain	**228,488**	**2.47**
		Bolivia (31 October 2020: 0.14%)		
		Government Bonds		
USD	13,183,000	Bolivian Government International Bond 4.500% 20/03/2028	11,756	0.13
		Total Bolivia	**11,756**	**0.13**
		Brazil (31 October 2020: 3.37%)		
		Government Bonds		
USD	10,724,000	Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social 5.750% 26/09/2023	11,651	0.13
USD	14,100,000	Brazilian Government International Bond 2.875% 06/06/2025	14,086	0.15
USD	12,350,000	Brazilian Government International Bond 3.750% 12/09/2031^	11,300	0.12
USD	28,625,000	Brazilian Government International Bond 3.875% 12/06/2030	26,734	0.29
USD	34,871,000	Brazilian Government International Bond 4.250% 07/01/2025	36,883	0.40
USD	16,195,000	Brazilian Government International Bond 4.500% 30/05/2029^	16,168	0.17

（2021年10月31日現在）

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Bonds (31 October 2020: 98.57%) (cont)		
		Brazil (31 October 2020: 3.37%) (cont)		
		Government Bonds (cont)		
USD	24,217,000	Brazilian Government International Bond 4.625% 13/01/2028	24,857	0.27
USD	32,682,000	Brazilian Government International Bond 4.750% 14/01/2050	27,919	0.30
USD	26,785,000	Brazilian Government International Bond 5.000% 27/01/2045	23,969	0.26
USD	18,113,000	Brazilian Government International Bond 5.625% 07/01/2041^	17,675	0.19
USD	22,624,000	Brazilian Government International Bond 5.625% 21/02/2047	21,829	0.24
USD	17,639,000	Brazilian Government International Bond 6.000% 07/04/2026	19,808	0.21
USD	13,284,000	Brazilian Government International Bond 7.125% 20/01/2037	15,507	0.17
USD	10,995,000	Brazilian Government International Bond 8.250% 20/01/2034	14,203	0.15
USD	8,521,000	Brazilian Government International Bond 8.875% 15/04/2024	10,400	0.11
		Total Brazil	**292,989**	**3.16**
		British Virgin Islands (31 October 2020: 2.06%)		
		Corporate Bonds		
USD	39,500,000	1MDB Global Investments Ltd 4.400% 09/03/2023	39,627	0.43
USD	7,310,000	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd 3.375%#	7,458	0.08
USD	6,851,000	Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd 4.875% 17/05/2042	8,548	0.09
USD	10,293,000	Sinopec Group Overseas Development 2013 Ltd 4.375% 17/10/2023	10,948	0.12
USD	9,494,000	Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd 4.375% 10/04/2024^	10,229	0.11
USD	9,974,000	Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd 3.250% 28/04/2025	10,483	0.11
USD	6,761,000	Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd 3.625% 12/04/2027^	7,307	0.08
USD	7,575,000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 1.450% 08/01/2026^	7,458	0.08
USD	6,500,000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 2.150% 13/05/2025	6,603	0.07
USD	8,250,000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 2.300% 08/01/2031^	8,093	0.09
USD	10,019,000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 2.700% 13/05/2030	10,224	0.11
USD	6,600,000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 2.950% 12/11/2029	6,854	0.07
USD	7,150,000	SPIC MTN Co Ltd 1.625% 27/07/2025	7,045	0.08
USD	6,859,000	State Grid Overseas Investment 2013 Ltd 3.125% 22/05/2023	7,084	0.08
USD	11,381,000	State Grid Overseas Investment 2014 Ltd 4.125% 07/05/2024	12,220	0.13
USD	7,650,000	State Grid Overseas Investment BVI Ltd 1.625% 05/08/2030^	7,240	0.08
		British Virgin Islands (31 October 2020: 2.06%) (cont)		
		Corporate Bonds (cont)		
USD	16,422,000	State Grid Overseas Investment BVI Ltd 3.500% 04/05/2027	17,757	0.19
		Total British Virgin Islands	**185,178**	**2.00**
		Cayman Islands (31 October 2020: 1.56%)		
		Corporate Bonds		
USD	5,550,000	DP World Crescent Ltd 3.875% 18/07/2029	5,898	0.06
USD	6,550,000	DP World Crescent Ltd 3.908% 31/05/2023	6,789	0.07
USD	5,600,000	DP World Crescent Ltd 4.848% 26/09/2028	6,295	0.07
USD	8,025,000	DP World Salaam 6.000%#	8,770	0.10
USD	7,065,000	Three Gorges Finance I Cayman Islands Ltd 3.150% 02/06/2026^	7,423	0.08
		Government Bonds		
USD	13,638,000	KSA Sukuk Ltd 2.969% 29/10/2029	14,269	0.15
USD	24,475,000	KSA Sukuk Ltd 3.628% 20/04/2027	26,543	0.29
USD	10,904,000	KSA Sukuk Ltd 4.303% 19/01/2029	12,403	0.13
USD	5,600,000	RAK Capital 3.094% 31/03/2025	5,883	0.06
USD	5,500,000	Sharjah Sukuk Program Ltd 2.942% 10/06/2027	5,557	0.06
USD	5,525,000	Sharjah Sukuk Program Ltd 3.234% 23/10/2029	5,590	0.06
USD	5,825,000	Sharjah Sukuk Program Ltd 3.854% 03/04/2026	6,205	0.07
USD	6,700,000	Sharjah Sukuk Program Ltd 4.226% 14/03/2028	7,193	0.08
		Total Cayman Islands	**118,818**	**1.28**
		Chile (31 October 2020: 2.96%)		
		Corporate Bonds		
USD	10,953,000	Corp Nacional del Cobre de Chile 3.000% 30/09/2029	11,085	0.12
USD	9,939,000	Corp Nacional del Cobre de Chile 3.150% 14/01/2030^	10,143	0.11
USD	12,600,000	Corp Nacional del Cobre de Chile 3.625% 01/08/2027	13,386	0.14
USD	20,004,000	Corp Nacional del Cobre de Chile 3.700% 30/01/2050^	20,345	0.22
USD	2,225,000	Corp Nacional del Cobre de Chile 3.700% 30/01/2050	2,249	0.02
USD	13,034,000	Corp Nacional del Cobre de Chile 4.375% 05/02/2049^	14,662	0.16
USD	12,612,000	Corp Nacional del Cobre de Chile 4.500% 01/08/2047	14,435	0.16
USD	9,830,000	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA 4.700% 07/05/2050^	11,432	0.12
		Government Bonds		
USD	17,100,000	Chile Government International Bond 2.450% 31/01/2031	16,831	0.18
USD	14,525,000	Chile Government International Bond 2.550% 27/01/2032	14,346	0.16
USD	22,275,000	Chile Government International Bond 2.550% 27/07/2033	21,573	0.23
USD	26,350,000	Chile Government International Bond 3.100% 07/05/2041	25,665	0.28

（2021年10月31日現在）

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Bonds (31 October 2020: 98.57%) (cont)		
		Chile (31 October 2020: 2.96%) (cont)		
		Government Bonds (cont)		
USD	19,500,000	Chile Government International Bond 3.100% 22/01/2061	17,919	0.19
USD	19,581,000	Chile Government International Bond 3.240% 06/02/2028	20,686	0.22
USD	9,800,000	Chile Government International Bond 3.250% 21/09/2071	9,021	0.10
USD	22,602,000	Chile Government International Bond 3.500% 25/01/2050	22,952	0.25
USD	14,875,000	Chile Government International Bond 3.500% 15/04/2053^	15,092	0.16
USD	12,303,000	Chile Government International Bond 3.860% 21/06/2047^	13,347	0.15
		Total Chile	**275,169**	**2.97**
		Colombia (31 October 2020: 3.45%)		
		Government Bonds		
USD	8,312,000	Colombia Government International Bond 2.625% 15/03/2023	8,433	0.09
USD	13,789,000	Colombia Government International Bond 3.000% 30/01/2030	13,059	0.14
USD	21,875,000	Colombia Government International Bond 3.125% 15/04/2031	20,526	0.22
USD	17,425,000	Colombia Government International Bond 3.250% 22/04/2032^	16,275	0.18
USD	16,356,000	Colombia Government International Bond 3.875% 25/04/2027	16,967	0.18
USD	11,530,000	Colombia Government International Bond 3.875% 15/02/2061^	9,439	0.10
USD	13,669,000	Colombia Government International Bond 4.000% 26/02/2024	14,274	0.16
USD	9,075,000	Colombia Government International Bond 4.125% 22/02/2042^	8,204	0.09
USD	13,500,000	Colombia Government International Bond 4.125% 15/05/2051^	11,777	0.13
USD	12,953,000	Colombia Government International Bond 4.500% 28/01/2026	13,858	0.15
USD	17,604,000	Colombia Government International Bond 4.500% 15/03/2029	18,592	0.20
USD	39,962,000	Colombia Government International Bond 5.000% 15/06/2045^	39,345	0.43
USD	19,640,000	Colombia Government International Bond 5.200% 15/05/2049^	19,748	0.21
USD	22,029,000	Colombia Government International Bond 5.625% 26/02/2044	23,169	0.25
USD	21,631,000	Colombia Government International Bond 6.125% 18/01/2041	23,960	0.26
USD	15,970,000	Colombia Government International Bond 7.375% 18/09/2037	19,676	0.21
USD	8,811,000	Colombia Government International Bond 8.125% 21/05/2024	10,159	0.11
		Total Colombia	**287,461**	**3.11**

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Costa Rica (31 October 2020: 0.58%)		
		Government Bonds		
USD	15,917,000	Costa Rica Government International Bond 6.125% 19/02/2031^	16,293	0.18
USD	13,119,000	Costa Rica Government International Bond 7.000% 04/04/2044	13,093	0.14
USD	16,764,000	Costa Rica Government International Bond 7.158% 12/03/2045	16,887	0.18
		Total Costa Rica	**46,273**	**0.50**
		Croatia (31 October 2020: 0.57%)		
		Government Bonds		
USD	19,054,000	Croatia Government International Bond 5.500% 04/04/2023	20,302	0.22
USD	22,604,000	Croatia Government International Bond 6.000% 26/01/2024	25,038	0.27
		Total Croatia	**45,340**	**0.49**
		Dominican Republic (31 October 2020: 2.88%)		
		Government Bonds		
USD	23,735,000	Dominican Republic International Bond 4.500% 30/01/2030	23,910	0.26
USD	36,775,000	Dominican Republic International Bond 4.875% 23/09/2032	37,368	0.40
USD	17,944,000	Dominican Republic International Bond 5.300% 21/01/2041	17,790	0.19
USD	15,165,000	Dominican Republic International Bond 5.500% 27/01/2025	16,443	0.18
USD	38,224,000	Dominican Republic International Bond 5.875% 30/01/2060	37,252	0.40
USD	20,120,000	Dominican Republic International Bond 5.950% 25/01/2027	22,415	0.24
USD	15,398,000	Dominican Republic International Bond 6.000% 19/07/2028	17,265	0.19
USD	17,999,000	Dominican Republic International Bond 6.400% 05/06/2049	19,105	0.21
USD	11,644,000	Dominican Republic International Bond 6.500% 15/02/2048	12,372	0.13
USD	23,418,000	Dominican Republic International Bond 6.850% 27/01/2045^	26,027	0.28
USD	17,833,000	Dominican Republic International Bond 6.875% 29/01/2026	20,389	0.22
USD	17,803,000	Dominican Republic International Bond 7.450% 30/04/2044	21,172	0.23
		Total Dominican Republic	**271,508**	**2.93**
		Ecuador (31 October 2020: 1.46%)		
		Government Bonds		
USD	13,369,715	Ecuador Government International Bond 0.000% 31/07/2030	7,119	0.08
USD	44,537,039	Ecuador Government International Bond 0.500% 31/07/2040	26,611	0.29
USD	110,294,614	Ecuador Government International Bond 1.000% 31/07/2035	72,657	0.78

（2021年10月31日現在）

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Bonds (31 October 2020: 98.57%) (cont)		
		Ecuador (31 October 2020: 1.46%) (cont)		
		Government Bonds (cont)		
USD	48,385,853	Ecuador Government International Bond 5.000% 31/07/2030	39,979	0.43
		Total Ecuador	**146,366**	**1.58**
		Egypt (31 October 2020: 2.77%)		
		Government Bonds		
USD	13,001,000	Egypt Government International Bond 5.577% 21/02/2023^	13,310	0.14
USD	13,625,000	Egypt Government International Bond 5.750% 29/05/2024	14,017	0.15
USD	11,250,000	Egypt Government International Bond 5.800% 30/09/2027^	10,884	0.12
USD	15,720,000	Egypt Government International Bond 5.875% 11/06/2025^	16,079	0.17
USD	16,400,000	Egypt Government International Bond 5.875% 16/02/2031^	14,739	0.16
USD	13,854,000	Egypt Government International Bond 6.588% 21/02/2028^	13,542	0.15
USD	10,671,000	Egypt Government International Bond 7.053% 15/01/2032	9,964	0.11
USD	12,300,000	Egypt Government International Bond 7.300% 30/09/2033	11,501	0.12
USD	21,759,000	Egypt Government International Bond 7.500% 31/01/2027^	22,527	0.24
USD	15,800,000	Egypt Government International Bond 7.500% 16/02/2061	13,351	0.14
USD	18,803,000	Egypt Government International Bond 7.600% 01/03/2029	18,827	0.20
USD	18,775,000	Egypt Government International Bond 7.625% 29/05/2032^	18,118	0.20
USD	16,381,000	Egypt Government International Bond 7.903% 21/02/2048	14,333	0.16
USD	27,034,000	Egypt Government International Bond 8.500% 31/01/2047	24,871	0.27
USD	15,880,000	Egypt Government International Bond 8.700% 01/03/2049	14,729	0.16
USD	21,825,000	Egypt Government International Bond 8.875% 29/05/2050	20,515	0.22
		Total Egypt	**251,307**	**2.71**
		El Salvador (31 October 2020: 0.39%)		
		Government Bonds		
USD	14,393,000	El Salvador Government International Bond 7.125% 20/01/2050^	10,181	0.11
USD	13,325,000	El Salvador Government International Bond 7.650% 15/06/2035	9,925	0.11
USD	13,150,000	El Salvador Government International Bond 9.500% 15/07/2052^	10,761	0.11
		Total El Salvador	**30,867**	**0.33**

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Ethiopia (31 October 2020: 0.16%)		
		Government Bonds		
USD	13,529,000	Ethiopia International Bond 6.625% 11/12/2024^	11,012	0.12
		Total Ethiopia	**11,012**	**0.12**
		Gabon (31 October 2020: 0.14%)		
		Government Bonds		
USD	13,150,000	Gabon Government International Bond 6.625% 06/02/2031	13,091	0.14
		Total Gabon	**13,091**	**0.14**
		Ghana (31 October 2020: 1.24%)		
		Government Bonds		
USD	16,294,000	Ghana Government International Bond 6.375% 11/02/2027	14,502	0.16
USD	12,830,000	Ghana Government International Bond 7.625% 16/05/2029	11,226	0.12
USD	12,475,000	Ghana Government International Bond 7.750% 07/04/2029^	11,040	0.12
USD	12,762,000	Ghana Government International Bond 7.875% 11/02/2035	10,768	0.12
USD	12,730,672	Ghana Government International Bond 8.125% 18/01/2026^	12,174	0.13
USD	16,530,000	Ghana Government International Bond 8.125% 26/03/2032	14,402	0.15
USD	12,950,000	Ghana Government International Bond 8.625% 07/04/2034	11,331	0.12
USD	13,175,000	Ghana Government International Bond 8.627% 16/06/2049	11,067	0.12
USD	13,014,000	Ghana Government International Bond 8.950% 26/03/2051	11,029	0.12
USD	13,075,000	Ghana Government International Bond 10.750% 14/10/2030	15,102	0.16
		Total Ghana	**122,641**	**1.32**
		Guatemala (31 October 2020: 0.27%)		
		Government Bonds		
USD	18,245,000	Guatemala Government Bond 6.125% 01/06/2050	21,413	0.23
		Total Guatemala	**21,413**	**0.23**
		Hong Kong (31 October 2020: 0.55%)		
		Corporate Bonds		
USD	6,475,000	CNAC HK Finbridge Co Ltd 3.000% 22/09/2030	6,442	0.07
USD	7,780,000	CNAC HK Finbridge Co Ltd 3.375% 19/06/2024	8,094	0.09
USD	7,050,000	CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.125% 19/07/2027	7,611	0.08
USD	8,912,000	CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.625% 14/03/2023	9,294	0.10
USD	11,825,000	CNAC HK Finbridge Co Ltd 5.125% 14/03/2028	13,428	0.14
		Total Hong Kong	**44,869**	**0.48**

（2021年10月31日現在）

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Bonds (31 October 2020: 98.57%) (cont)		
		Hungary (31 October 2020: 1.31%)		
		Government Bonds		
USD	29,450,000	Hungary Government International Bond 2.125% 22/09/2031	28,784	0.31
USD	26,225,000	Hungary Government International Bond 3.125% 21/09/2051	25,476	0.28
USD	20,464,000	Hungary Government International Bond 5.375% 21/02/2023	21,727	0.23
USD	23,981,000	Hungary Government International Bond 5.375% 25/03/2024	26,421	0.29
USD	22,842,000	Hungary Government International Bond 5.750% 22/11/2023	25,073	0.27
USD	16,472,000	Hungary Government International Bond 7.625% 29/03/2041^	27,141	0.29
		Total Hungary	**154,622**	**1.67**
		India (31 October 2020: 0.50%)		
		Government Bonds		
USD	13,200,000	Export-Import Bank of India 2.250% 13/01/2031	12,399	0.13
USD	12,755,000	Export-Import Bank of India 3.250% 15/01/2030	12,985	0.14
USD	13,119,000	Export-Import Bank of India 3.375% 05/08/2026	13,827	0.15
USD	12,734,000	Export-Import Bank of India 3.875% 01/02/2028	13,671	0.15
		Total India	**52,882**	**0.57**
		Indonesia (31 October 2020: 5.04%)		
		Corporate Bonds		
USD	5,300,000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 4.750% 15/05/2025	5,679	0.06
USD	5,350,000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.450% 15/05/2030	6,109	0.07
USD	5,425,000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 6.530% 15/11/2028	6,511	0.07
USD	6,013,000	Pelabuhan Indonesia II PT 4.250% 05/05/2025	6,510	0.07
USD	5,375,000	Pertamina Persero PT 1.400% 09/02/2026^	5,234	0.06
USD	5,200,000	Pertamina Persero PT 4.175% 21/01/2050^	5,324	0.06
USD	8,597,000	Pertamina Persero PT 4.300% 20/05/2023	8,991	0.10
USD	7,249,000	Pertamina Persero PT 5.625% 20/05/2043	8,644	0.09
USD	6,359,000	Pertamina Persero PT 6.000% 03/05/2042	7,837	0.08
USD	7,800,000	Pertamina Persero PT 6.450% 30/05/2044	10,217	0.11
USD	5,250,000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 4.000% 30/06/2050^	5,077	0.06
USD	7,863,000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 4.125% 15/05/2027	8,464	0.09
USD	5,246,000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 5.250% 24/10/2042^	5,844	0.06
USD	5,183,000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 5.450% 21/05/2028	5,981	0.06
USD	5,231,000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 6.150% 21/05/2048	6,452	0.07

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Indonesia (31 October 2020: 5.04%) (cont)		
		Government Bonds		
USD	6,585,000	Indonesia Government International Bond 1.850% 12/03/2031^	6,273	0.07
USD	5,750,000	Indonesia Government International Bond 2.150% 28/07/2031^	5,571	0.06
USD	6,250,000	Indonesia Government International Bond 2.850% 14/02/2030^	6,447	0.07
USD	10,550,000	Indonesia Government International Bond 3.050% 12/03/2051^	10,221	0.11
USD	8,249,000	Indonesia Government International Bond 3.375% 15/04/2023^	8,539	0.09
USD	6,633,000	Indonesia Government International Bond 3.500% 11/01/2028^	7,146	0.08
USD	4,965,000	Indonesia Government International Bond 3.700% 30/10/2049^	5,146	0.06
USD	4,887,000	Indonesia Government International Bond 3.850% 18/07/2027^	5,363	0.06
USD	8,645,000	Indonesia Government International Bond 3.850% 15/10/2030^	9,600	0.10
USD	5,240,000	Indonesia Government International Bond 4.100% 24/04/2028	5,832	0.06
USD	10,525,000	Indonesia Government International Bond 4.125% 15/01/2025	11,418	0.12
USD	8,554,000	Indonesia Government International Bond 4.200% 15/10/2050	9,539	0.10
USD	6,855,000	Indonesia Government International Bond 4.350% 08/01/2027^	7,653	0.08
USD	9,155,000	Indonesia Government International Bond 4.350% 11/01/2048^	10,278	0.11
USD	4,950,000	Indonesia Government International Bond 4.450% 15/04/2070^	5,606	0.06
USD	7,749,000	Indonesia Government International Bond 4.625% 15/04/2043^	8,815	0.10
USD	11,738,000	Indonesia Government International Bond 4.750% 08/01/2026^	13,193	0.14
USD	6,771,000	Indonesia Government International Bond 4.750% 11/02/2029	7,838	0.08
USD	5,075,000	Indonesia Government International Bond 4.750% 18/07/2047	6,024	0.07
USD	10,454,000	Indonesia Government International Bond 5.125% 15/01/2045	12,690	0.14
USD	11,673,000	Indonesia Government International Bond 5.250% 17/01/2042	14,327	0.16
USD	7,758,000	Indonesia Government International Bond 5.250% 08/01/2047	9,747	0.11
USD	5,140,000	Indonesia Government International Bond 5.350% 11/02/2049	6,586	0.07
USD	10,890,000	Indonesia Government International Bond 5.875% 15/01/2024^	12,036	0.13
USD	6,754,000	Indonesia Government International Bond 5.950% 08/01/2046^	9,142	0.10
USD	7,993,000	Indonesia Government International Bond 6.625% 17/02/2037	10,932	0.12
USD	10,198,000	Indonesia Government International Bond 6.750% 15/01/2044^	14,724	0.16

（2021年10月31日現在）

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Bonds (31 October 2020: 98.57%) (cont)		
		Indonesia (31 October 2020: 5.04%) (cont)		
		Government Bonds (cont)		
USD	10,615,000	Indonesia Government International Bond 7.750% 17/01/2038	15,868	0.17
USD	8,445,000	Indonesia Government International Bond 8.500% 12/10/2035	13,263	0.14
USD	6,275,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 1.500% 09/06/2026^	6,252	0.07
USD	4,900,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.550% 09/06/2031^	4,908	0.05
USD	4,945,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.800% 23/06/2030	5,040	0.05
USD	4,066,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 3.750% 01/03/2023	4,217	0.05
USD	10,731,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.150% 29/03/2027	11,934	0.13
USD	10,873,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.325% 28/05/2025	11,969	0.13
USD	8,413,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.350% 10/09/2024	9,156	0.10
USD	9,363,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.400% 01/03/2028^	10,576	0.11
USD	6,525,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.450% 20/02/2029	7,449	0.08
USD	9,264,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.550% 29/03/2026	10,372	0.11
		Total Indonesia	**454,564**	**4.91**
		Iraq (31 October 2020: 0.49%)		
		Government Bonds		
USD	29,602,625	Iraq International Bond 5.800% 15/01/2028	28,803	0.31
USD	12,123,000	Iraq International Bond 6.752% 09/03/2023	12,353	0.13
		Total Iraq	**41,156**	**0.44**
		Ireland (31 October 2020: 0.23%)		
		Corporate Bonds		
USD	10,067,000	Vnesheconombank Via VEB Finance Plc 5.942% 21/11/2023	10,896	0.12
USD	8,743,000	Vnesheconombank Via VEB Finance Plc 6.800% 22/11/2025	10,190	0.11
		Total Ireland	**21,086**	**0.23**
		Ivory Coast (31 October 2020: 0.52%)		
		Government Bonds		
USD	16,513,000	Ivory Coast Government International Bond 6.125% 15/06/2033^	17,300	0.19
		Total Ivory Coast	**17,300**	**0.19**
		Jamaica (31 October 2020: 0.88%)		
		Government Bonds		
USD	18,302,000	Jamaica Government International Bond 6.750% 28/04/2028	21,360	0.23
		Jamaica (31 October 2020: 0.88%) (cont)		
		Government Bonds (cont)		
USD	23,735,000	Jamaica Government International Bond 7.875% 28/07/2045	33,493	0.36
USD	16,350,000	Jamaica Government International Bond 8.000% 15/03/2039	23,077	0.25
		Total Jamaica	**77,930**	**0.84**
		Jordan (31 October 2020: 0.69%)		
		Government Bonds		
USD	13,148,000	Jordan Government International Bond 5.750% 31/01/2027^	14,018	0.15
USD	16,514,000	Jordan Government International Bond 5.850% 07/07/2030	16,989	0.19
USD	13,003,000	Jordan Government International Bond 6.125% 29/01/2026^	14,013	0.15
USD	12,703,000	Jordan Government International Bond 7.375% 10/10/2047	13,114	0.14
		Total Jordan	**58,134**	**0.63**
		Kazakhstan (31 October 2020: 2.42%)		
		Corporate Bonds		
USD	12,629,000	KazMunayGas National Co JSC 4.750% 19/04/2027	14,028	0.15
USD	16,049,000	KazMunayGas National Co JSC 5.375% 24/04/2030	18,825	0.20
USD	15,977,000	KazMunayGas National Co JSC 5.750% 19/04/2047	19,225	0.21
USD	19,705,000	KazMunayGas National Co JSC 6.375% 24/10/2048	25,294	0.27
		Government Bonds		
USD	19,607,000	Kazakhstan Government International Bond 3.875% 14/10/2024	21,058	0.23
USD	12,875,000	Kazakhstan Government International Bond 4.875% 14/10/2044	15,721	0.17
USD	32,940,000	Kazakhstan Government International Bond 5.125% 21/07/2025	37,403	0.40
USD	19,109,000	Kazakhstan Government International Bond 6.500% 21/07/2045	27,517	0.30
		Total Kazakhstan	**179,071**	**1.93**
		Kenya (31 October 2020: 0.85%)		
		Government Bonds		
USD	12,750,000	Republic of Kenya Government International Bond 6.300% 23/01/2034^	12,367	0.13
USD	25,968,000	Republic of Kenya Government International Bond 6.875% 24/06/2024	27,916	0.30
USD	13,050,000	Republic of Kenya Government International Bond 7.250% 28/02/2028^	13,996	0.15
USD	15,659,000	Republic of Kenya Government International Bond 8.000% 22/05/2032^	16,912	0.18
USD	12,961,000	Republic of Kenya Government International Bond 8.250% 28/02/2048^	13,447	0.15
		Total Kenya	**84,638**	**0.91**

（2021年10月31日現在）

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Bonds (31 October 2020: 98.57%) (cont)		
		Kuwait (31 October 2020: 0.80%)		
		Government Bonds		
USD	58,185,000	Kuwait International Government Bond 3.500% 20/03/2027	63,669	0.69
		Total Kuwait	**63,669**	**0.69**
		Lebanon (31 October 2020: 0.19%)		
		Government Bonds		
USD	15,593,000	Lebanon Government International Bond 6.000% 27/01/2023*	2,300	0.02
USD	22,010,000	Lebanon Government International Bond 6.100% 04/10/2022*	3,246	0.04
USD	22,445,000	Lebanon Government International Bond 6.600% 27/11/2026*	3,311	0.04
USD	19,888,000	Lebanon Government International Bond 6.650% 26/02/2030*	2,933	0.03
USD	13,856,000	Lebanon Government International Bond 6.750% 29/11/2027*	2,044	0.02
USD	17,202,000	Lebanon Government International Bond 6.850% 23/03/2027*	2,537	0.03
USD	13,652,000	Lebanon Government International Bond 7.000% 23/03/2032*	2,014	0.02
		Total Lebanon	**18,385**	**0.20**
		Malaysia (31 October 2020: 2.04%)		
		Corporate Bonds		
USD	16,127,000	Petronas Capital Ltd 2.480% 28/01/2032	16,002	0.17
USD	22,175,000	Petronas Capital Ltd 3.404% 28/04/2061	22,957	0.25
USD	19,451,000	Petronas Capital Ltd 3.500% 18/03/2025	20,689	0.23
USD	29,326,000	Petronas Capital Ltd 3.500% 21/04/2030	31,616	0.34
USD	20,358,000	Petronas Capital Ltd 4.500% 18/03/2045	24,866	0.27
USD	35,545,000	Petronas Capital Ltd 4.550% 21/04/2050	44,434	0.48
USD	13,356,000	Petronas Capital Ltd 4.800% 21/04/2060^	17,801	0.19
		Government Bonds		
USD	12,697,000	Malaysia Sovereign Sukuk Bhd 3.043% 22/04/2025^	13,374	0.14
USD	12,873,000	Malaysia Sukuk Global Bhd 3.179% 27/04/2026^	13,797	0.15
		Total Malaysia	**205,536**	**2.22**
		Mexico (31 October 2020: 5.31%)		
		Corporate Bonds		
USD	4,876,000	Banco Nacional de Comercio Exterior SNC 4.375% 14/10/2025*	5,386	0.06
USD	5,350,000	Comision Federal de Electricidad 3.348% 09/02/2031	5,171	0.06
USD	4,080,000	Comision Federal de Electricidad 4.750% 23/02/2027*	4,510	0.05
USD	5,870,000	Comision Federal de Electricidad 4.875% 15/01/2024	6,266	0.07
USD	9,375,000	Mexico City Airport Trust 5.500% 31/07/2047^	9,473	0.10
USD	5,703,000	Petroleos Mexicanos 4.500% 23/01/2026	5,740	0.06
		Mexico (31 October 2020: 5.31%) (cont)		
		Corporate Bonds (cont)		
USD	4,351,000	Petroleos Mexicanos 4.875% 18/01/2024	4,484	0.05
USD	10,571,000	Petroleos Mexicanos 5.350% 12/02/2028	10,536	0.11
USD	16,130,000	Petroleos Mexicanos 5.950% 28/01/2031^	15,828	0.17
USD	12,493,000	Petroleos Mexicanos 6.350% 12/02/2048	10,603	0.11
USD	6,280,000	Petroleos Mexicanos 6.375% 23/01/2045	5,358	0.06
USD	9,745,000	Petroleos Mexicanos 6.490% 23/01/2027^	10,364	0.11
USD	23,380,000	Petroleos Mexicanos 6.500% 13/03/2027	24,835	0.27
USD	8,514,000	Petroleos Mexicanos 6.500% 23/01/2029	8,844	0.10
USD	6,688,000	Petroleos Mexicanos 6.500% 02/06/2041	6,027	0.06
USD	11,916,000	Petroleos Mexicanos 6.625% 15/06/2035	11,487	0.12
USD	25,808,000	Petroleos Mexicanos 6.750% 21/09/2047	22,743	0.25
USD	18,940,000	Petroleos Mexicanos 6.840% 23/01/2030^	19,793	0.21
USD	6,525,000	Petroleos Mexicanos 6.875% 16/10/2025	7,114	0.08
USD	12,756,000	Petroleos Mexicanos 6.875% 04/08/2026	13,891	0.15
USD	16,531,000	Petroleos Mexicanos 6.950% 28/01/2060	14,613	0.16
USD	34,720,000	Petroleos Mexicanos 7.690% 23/01/2050	33,158	0.36
		Government Bonds		
USD	14,350,000	Mexico Government International Bond 2.659% 24/05/2031^	13,877	0.15
USD	9,615,000	Mexico Government International Bond 3.250% 16/04/2030^	9,812	0.10
USD	7,235,000	Mexico Government International Bond 3.600% 30/01/2025	7,781	0.08
USD	8,355,000	Mexico Government International Bond 3.750% 11/01/2028	9,064	0.10
USD	12,725,000	Mexico Government International Bond 3.750% 19/04/2071	11,411	0.12
USD	13,850,000	Mexico Government International Bond 3.771% 24/05/2061	12,797	0.14
USD	8,958,000	Mexico Government International Bond 4.125% 21/01/2026^	9,885	0.11
USD	10,584,000	Mexico Government International Bond 4.150% 28/03/2027	11,801	0.13
USD	13,860,000	Mexico Government International Bond 4.280% 14/08/2041	14,447	0.16
USD	5,996,000	Mexico Government International Bond 4.350% 15/01/2047^	6,200	0.07
USD	14,576,000	Mexico Government International Bond 4.500% 22/04/2029	16,319	0.18
USD	10,597,000	Mexico Government International Bond 4.500% 31/01/2050^	11,132	0.12
USD	10,764,000	Mexico Government International Bond 4.600% 23/01/2046	11,439	0.12
USD	9,750,000	Mexico Government International Bond 4.600% 10/02/2048^	10,355	0.11
USD	9,797,000	Mexico Government International Bond 4.750% 27/04/2032	11,030	0.12
USD	17,390,000	Mexico Government International Bond 4.750% 08/03/2044	19,062	0.20
USD	10,890,000	Mexico Government International Bond 5.000% 27/04/2051^	12,253	0.13

（2021年10月31日現在）

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Bonds (31 October 2020: 98.57%) (cont)		
		Mexico (31 October 2020: 5.31%) (cont)		
		Government Bonds (cont)		
USD	12,195,000	Mexico Government International Bond 5.550% 21/01/2045	14,602	0.16
USD	11,544,000	Mexico Government International Bond 5.750% 12/10/2110	13,346	0.14
USD	12,350,000	Mexico Government International Bond 6.050% 11/01/2040	15,421	0.17
USD	7,791,000	Mexico Government International Bond 6.750% 27/09/2034	10,356	0.11
USD	4,907,000	Mexico Government International Bond 8.300% 15/08/2031	7,174	0.08
		Total Mexico	**515,788**	**5.57**
		Mongolia (31 October 2020: 0.05%)		
		Morocco (31 October 2020: 0.22%)		
		Government Bonds		
USD	13,400,000	Morocco Government International Bond 3.000% 15/12/2032	12,701	0.14
USD	16,450,000	Morocco Government International Bond 4.000% 15/12/2050	14,789	0.16
		Total Morocco	**27,490**	**0.30**
		Netherlands (31 October 2020: 0.54%)		
		Nigeria (31 October 2020: 1.40%)		
		Government Bonds		
USD	16,325,000	Nigeria Government International Bond 6.125% 28/09/2028	16,182	0.18
USD	19,458,000	Nigeria Government International Bond 6.500% 28/11/2027^	19,857	0.21
USD	16,295,000	Nigeria Government International Bond 7.143% 23/02/2030	16,415	0.18
USD	19,525,000	Nigeria Government International Bond 7.375% 28/09/2033	19,330	0.21
USD	14,597,000	Nigeria Government International Bond 7.625% 21/11/2025	15,872	0.17
USD	20,017,000	Nigeria Government International Bond 7.625% 28/11/2047	18,676	0.20
USD	16,074,000	Nigeria Government International Bond 7.696% 23/02/2038	15,479	0.17
USD	19,265,000	Nigeria Government International Bond 7.875% 16/02/2032	19,600	0.21
USD	16,425,000	Nigeria Government International Bond 8.250% 28/09/2051	16,138	0.17
USD	12,881,000	Nigeria Government International Bond 8.747% 21/01/2031	13,849	0.15
		Total Nigeria	**171,398**	**1.85**

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Oman (31 October 2020: 2.54%)		
		Corporate Bonds		
USD	20,966,000	Oman Sovereign Sukuk Co 4.397% 01/06/2024	21,814	0.24
		Government Bonds		
USD	25,935,000	Oman Government International Bond 4.750% 15/06/2026	26,637	0.29
USD	12,787,000	Oman Government International Bond 4.875% 01/02/2025	13,341	0.14
USD	20,652,000	Oman Government International Bond 5.375% 08/03/2027	21,708	0.23
USD	25,655,000	Oman Government International Bond 5.625% 17/01/2028^	27,034	0.29
USD	23,355,000	Oman Government International Bond 6.000% 01/08/2029	24,987	0.27
USD	18,050,000	Oman Government International Bond 6.250% 25/01/2031^	19,499	0.21
USD	20,582,000	Oman Government International Bond 6.500% 08/03/2047	20,348	0.22
USD	15,369,000	Oman Government International Bond 6.750% 28/10/2027	17,213	0.19
USD	28,518,000	Oman Government International Bond 6.750% 17/01/2048	28,835	0.31
USD	10,300,000	Oman Government International Bond 7.000% 25/01/2051^	10,754	0.12
USD	11,000,000	Oman Government International Bond 7.375% 28/10/2032	12,705	0.14
USD	18,350,000	Oman Sovereign Sukuk Co 4.875% 15/06/2030^	19,629	0.21
USD	15,954,000	Oman Sovereign Sukuk Co 5.932% 31/10/2025	17,634	0.19
		Total Oman	**282,138**	**3.05**
		Pakistan (31 October 2020: 0.52%)		
		Government Bonds		
USD	16,520,000	Pakistan Government International Bond 6.000% 08/04/2026	16,563	0.18
USD	19,291,000	Pakistan Government International Bond 6.875% 05/12/2027	19,675	0.21
USD	18,320,000	Pakistan Government International Bond 7.375% 08/04/2031^	18,528	0.20
USD	12,829,000	Pakistan Government International Bond 8.250% 15/04/2024	13,673	0.15
		Total Pakistan	**68,439**	**0.74**
		Panama (31 October 2020: 3.23%)		
		Corporate Bonds		
USD	15,375,000	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA 5.125% 11/08/2061	16,003	0.17
USD	12,055,000	Banco Nacional de Panama 2.500% 11/08/2030	11,375	0.13
		Government Bonds		
USD	29,254,000	Panama Government International Bond 2.252% 29/09/2032	27,541	0.30
USD	18,045,000	Panama Government International Bond 3.160% 23/01/2030^	18,635	0.20

（2021年10月31日現在）

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Bonds (31 October 2020: 98.57%) (cont)		
		Panama (31 October 2020: 3.23%) (cont)		
		Government Bonds (cont)		
USD	14,741,000	Panama Government International Bond 3.750% 16/03/2025	15,734	0.17
USD	35,155,000	Panama Government International Bond 3.870% 23/07/2060	34,997	0.38
USD	14,547,000	Panama Government International Bond 3.875% 17/03/2028	15,786	0.17
USD	20,350,000	Panama Government International Bond 4.300% 29/04/2053	21,785	0.23
USD	13,414,000	Panama Government International Bond 4.500% 15/05/2047	14,800	0.16
USD	29,503,000	Panama Government International Bond 4.500% 16/04/2050	32,403	0.35
USD	29,186,000	Panama Government International Bond 4.500% 01/04/2056	32,010	0.35
USD	23,696,000	Panama Government International Bond 6.700% 26/01/2036	31,616	0.34
		Total Panama	**272,685**	**2.95**
		Paraguay (31 October 2020: 0.39%)		
		Government Bonds		
USD	12,780,000	Paraguay Government International Bond 4.950% 28/04/2031	14,316	0.15
USD	15,250,000	Paraguay Government International Bond 5.400% 30/03/2050	17,207	0.19
USD	13,079,000	Paraguay Government International Bond 6.100% 11/08/2044^	15,701	0.17
		Total Paraguay	**47,224**	**0.51**
		People's Republic of China (31 October 2020: 1.20%)		
		Corporate Bonds		
USD	6,598,000	China Minmetals Corp 3.750%#	6,699	0.07
		Government Bonds		
USD	6,900,000	China Development Bank 1.000% 27/10/2025	6,755	0.07
USD	8,650,000	China Government International Bond 0.400% 21/10/2023^	8,610	0.09
USD	15,440,000	China Government International Bond 0.550% 21/10/2025	15,042	0.16
USD	3,400,000	China Government International Bond 0.750% 26/10/2024	3,390	0.04
USD	13,575,000	China Government International Bond 1.200% 21/10/2030^	13,097	0.14
USD	4,400,000	China Government International Bond 1.250% 26/10/2026	4,414	0.05
USD	3,500,000	China Government International Bond 1.750% 26/10/2031^	3,534	0.04
USD	13,800,000	China Government International Bond 1.950% 03/12/2024	14,243	0.16
USD	13,575,000	China Government International Bond 2.125% 03/12/2029	14,087	0.15
USD	7,186,000	China Government International Bond 2.625% 02/11/2027	7,620	0.08
		People's Republic of China (31 October 2020: 1.20%) (cont)		
		Government Bonds (cont)		
USD	10,400,000	China Government International Bond 3.250% 19/10/2023	10,928	0.12
USD	6,825,000	China Government International Bond 3.500% 19/10/2028^	7,678	0.08
USD	6,798,000	Export-Import Bank of China 2.875% 26/04/2026	7,148	0.08
USD	10,395,000	Export-Import Bank of China 3.625% 31/07/2024	11,182	0.12
		Total People's Republic of China	**134,427**	**1.45**
		Peru (31 October 2020: 2.83%)		
		Corporate Bonds		
USD	11,461,000	Petroleos del Peru SA 4.750% 19/06/2032	12,109	0.13
USD	22,701,000	Petroleos del Peru SA 5.625% 19/06/2047	22,942	0.25
		Government Bonds		
USD	11,188,000	Peruvian Government International Bond 1.862% 01/12/2032	10,145	0.11
USD	11,287,000	Peruvian Government International Bond 2.392% 23/01/2026^	11,469	0.12
USD	23,000,000	Peruvian Government International Bond 2.780% 01/12/2060^	19,820	0.21
USD	43,190,000	Peruvian Government International Bond 2.783% 23/01/2031	43,090	0.47
USD	5,025,000	Peruvian Government International Bond 3.000% 15/01/2034	4,977	0.05
USD	11,323,000	Peruvian Government International Bond 3.230% 28/07/2121	9,602	0.10
USD	14,500,000	Peruvian Government International Bond 3.300% 11/03/2041	14,166	0.15
USD	11,470,000	Peruvian Government International Bond 3.550% 10/03/2051^	11,512	0.13
USD	5,600,000	Peruvian Government International Bond 3.600% 15/01/2072	5,370	0.06
USD	11,338,000	Peruvian Government International Bond 4.125% 25/08/2027	12,435	0.13
USD	29,323,000	Peruvian Government International Bond 5.625% 18/11/2050^	40,389	0.44
USD	13,255,000	Peruvian Government International Bond 6.550% 14/03/2037^	18,013	0.20
USD	17,873,000	Peruvian Government International Bond 7.350% 21/07/2025	21,429	0.23
USD	24,768,000	Peruvian Government International Bond 8.750% 21/11/2033	38,387	0.42
		Total Peru	**295,855**	**3.20**
		Philippines (31 October 2020: 3.69%)		
		Corporate Bonds		
USD	11,209,000	Power Sector Assets & Liabilities Management Corp 7.390% 02/12/2024^	13,281	0.14
		Government Bonds		
USD	11,075,000	Philippine Government International Bond 1.648% 10/06/2031^	10,578	0.11

（2021年10月31日現在）

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Bonds (31 October 2020: 98.57%) (cont)		
		Philippines (31 October 2020: 3.69%) (cont)		
		Government Bonds (cont)		
USD	9,265,000	Philippine Government International Bond 2.457% 05/05/2030	9,498	0.10
USD	13,525,000	Philippine Government International Bond 2.650% 10/12/2045^	12,750	0.14
USD	12,252,000	Philippine Government International Bond 2.950% 05/05/2045	11,956	0.13
USD	18,526,000	Philippine Government International Bond 3.000% 01/02/2028	19,683	0.21
USD	20,410,000	Philippine Government International Bond 3.200% 06/07/2046	20,514	0.22
USD	18,338,000	Philippine Government International Bond 3.700% 01/03/2041^	19,688	0.21
USD	18,502,000	Philippine Government International Bond 3.700% 02/02/2042^	19,916	0.22
USD	13,950,000	Philippine Government International Bond 3.750% 14/01/2029	15,561	0.17
USD	18,446,000	Philippine Government International Bond 3.950% 20/01/2040	20,404	0.22
USD	13,671,000	Philippine Government International Bond 4.200% 21/01/2024^	14,578	0.16
USD	12,362,000	Philippine Government International Bond 5.000% 13/01/2037^	15,262	0.16
USD	9,503,000	Philippine Government International Bond 5.500% 30/03/2026^	11,052	0.12
USD	9,481,000	Philippine Government International Bond 6.375% 15/01/2032^	12,662	0.14
USD	17,388,000	Philippine Government International Bond 6.375% 23/10/2034	23,879	0.26
USD	16,068,000	Philippine Government International Bond 7.750% 14/01/2031^	23,020	0.25
USD	18,599,000	Philippine Government International Bond 9.500% 02/02/2030	28,692	0.31
USD	13,392,000	Philippine Government International Bond 10.625% 16/03/2025^	17,400	0.19
		Total Philippines	**320,374**	**3.46**
		Poland (31 October 2020: 0.98%)		
		Government Bonds		
USD	25,401,000	Republic of Poland Government International Bond 3.000% 17/03/2023	26,192	0.28
USD	22,442,000	Republic of Poland Government International Bond 3.250% 06/04/2026	24,080	0.26
USD	26,032,000	Republic of Poland Government International Bond 4.000% 22/01/2024	27,720	0.30
		Total Poland	**77,992**	**0.84**
		Qatar (31 October 2020: 4.32%)		
		Corporate Bonds		
USD	9,075,000	Qatar Petroleum 1.375% 12/09/2026	8,939	0.10
USD	21,725,000	Qatar Petroleum 2.250% 12/07/2031^	21,372	0.23
USD	21,350,000	Qatar Petroleum 3.125% 12/07/2041	21,597	0.23
		Qatar (31 October 2020: 4.32%) (cont)		
		Corporate Bonds (cont)		
USD	24,475,000	Qatar Petroleum 3.300% 12/07/2051	25,033	0.27
		Government Bonds		
USD	21,560,000	Qatar Government International Bond 3.250% 02/06/2026	23,107	0.25
USD	12,226,000	Qatar Government International Bond 3.375% 14/03/2024	12,924	0.14
USD	12,565,000	Qatar Government International Bond 3.400% 16/04/2025	13,459	0.15
USD	18,265,000	Qatar Government International Bond 3.750% 16/04/2030^	20,392	0.22
USD	18,414,000	Qatar Government International Bond 3.875% 23/04/2023	19,263	0.21
USD	25,081,000	Qatar Government International Bond 4.000% 14/03/2029	28,247	0.30
USD	30,450,000	Qatar Government International Bond 4.400% 16/04/2050	37,149	0.40
USD	19,019,000	Qatar Government International Bond 4.500% 23/04/2028	21,893	0.24
USD	12,605,000	Qatar Government International Bond 4.625% 02/06/2046	15,696	0.17
USD	37,049,000	Qatar Government International Bond 4.817% 14/03/2049	47,615	0.51
USD	36,835,000	Qatar Government International Bond 5.103% 23/04/2048	48,802	0.53
USD	6,352,000	Qatar Government International Bond 5.750% 20/01/2042	8,820	0.10
USD	6,220,000	Qatar Government International Bond 6.400% 20/01/2040^	9,059	0.10
USD	8,523,000	Qatar Government International Bond 9.750% 15/06/2030^	13,417	0.14
		Total Qatar	**396,784**	**4.29**
		Romania (31 October 2020: 1.38%)		
		Government Bonds		
USD	16,890,000	Romanian Government International Bond 3.000% 14/02/2031^	17,009	0.19
USD	25,810,000	Romanian Government International Bond 4.000% 14/02/2051^	26,000	0.28
USD	19,548,000	Romanian Government International Bond 4.375% 22/08/2023	20,682	0.22
USD	13,218,000	Romanian Government International Bond 4.875% 22/01/2024	14,204	0.15
USD	15,608,000	Romanian Government International Bond 5.125% 15/06/2048^	18,338	0.20
USD	12,826,000	Romanian Government International Bond 6.125% 22/01/2044^	16,684	0.18
		Total Romania	**112,917**	**1.22**
		Russian Federation (31 October 2020: 3.74%)		
		Government Bonds		
USD	20,600,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.250% 23/06/2027	22,845	0.25

（2021年10月31日現在）

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Bonds (31 October 2020: 98.57%) (cont)		
		Russian Federation (31 October 2020: 3.74%) (cont)		
		Government Bonds (cont)		
USD	26,000,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.375% 21/03/2029	29,302	0.31
USD	25,600,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.750% 27/05/2026	28,725	0.31
USD	25,600,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.875% 16/09/2023	27,502	0.30
USD	34,000,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 5.100% 28/03/2035	40,583	0.44
USD	60,400,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 5.250% 23/06/2047	76,870	0.83
USD	25,600,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 5.625% 04/04/2042	33,221	0.36
USD	12,600,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 5.875% 16/09/2043	17,075	0.18
USD	14,950,709	Russian Foreign Bond - Eurobond 7.500% 31/03/2030	17,318	0.19
USD	21,683,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 12.750% 24/06/2028	35,673	0.38
		Total Russian Federation	**329,114**	**3.55**
		Saudi Arabia (31 October 2020: 4.01%)		
		Government Bonds		
USD	15,000,000	Saudi Government International Bond 2.250% 02/02/2033^	14,456	0.16
USD	6,600,000	Saudi Government International Bond 2.500% 03/02/2027^	6,798	0.07
USD	5,625,000	Saudi Government International Bond 2.750% 03/02/2032	5,731	0.06
USD	16,547,000	Saudi Government International Bond 2.875% 04/03/2023	17,028	0.18
USD	13,725,000	Saudi Government International Bond 2.900% 22/10/2025^	14,487	0.16
USD	30,174,000	Saudi Government International Bond 3.250% 26/10/2026	32,301	0.35
USD	8,000,000	Saudi Government International Bond 3.250% 22/10/2030^	8,508	0.09
USD	12,190,000	Saudi Government International Bond 3.450% 02/02/2061^	12,007	0.13
USD	27,353,000	Saudi Government International Bond 3.625% 04/03/2028^	29,760	0.32
USD	14,775,000	Saudi Government International Bond 3.750% 21/01/2055^	15,458	0.17
USD	24,518,000	Saudi Government International Bond 4.000% 17/04/2025	26,663	0.29
USD	22,074,000	Saudi Government International Bond 4.375% 16/04/2029	25,231	0.27
USD	16,314,000	Saudi Government International Bond 4.500% 17/04/2030	18,941	0.21
USD	35,590,000	Saudi Government International Bond 4.500% 26/10/2046	41,106	0.44
USD	15,681,000	Saudi Government International Bond 4.500% 22/04/2060^	18,758	0.20
		Saudi Arabia (31 October 2020: 4.01%) (cont)		
		Government Bonds (cont)		
USD	24,854,000	Saudi Government International Bond 4.625% 04/10/2047^	29,297	0.32
USD	19,175,000	Saudi Government International Bond 5.000% 17/04/2049	23,921	0.26
USD	19,260,000	Saudi Government International Bond 5.250% 16/01/2050^	24,942	0.27
		Total Saudi Arabia	**365,393**	**3.95**
		Senegal (31 October 2020: 0.33%)		
		Government Bonds		
USD	14,576,000	Senegal Government International Bond 6.250% 23/05/2033^	14,989	0.16
USD	13,382,000	Senegal Government International Bond 6.750% 13/03/2048	13,255	0.15
		Total Senegal	**28,244**	**0.31**
		Serbia (31 October 2020: 0.00%)		
		Government Bonds		
USD	15,900,000	Serbia International Bond 2.125% 01/12/2030	14,835	0.16
		Total Serbia	**14,835**	**0.16**
		South Africa (31 October 2020: 2.72%)		
		Corporate Bonds		
USD	11,911,000	Eskom Holdings SOC Ltd 6.350% 10/08/2028	12,816	0.14
USD	11,971,000	Eskom Holdings SOC Ltd 6.750% 06/08/2023	12,347	0.13
USD	15,143,000	Eskom Holdings SOC Ltd 7.125% 11/02/2025	15,756	0.17
		Government Bonds		
USD	24,307,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.300% 12/10/2028^	24,471	0.26
USD	18,333,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.665% 17/01/2024	19,482	0.21
USD	11,994,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.850% 27/09/2027^	12,585	0.14
USD	24,281,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.850% 30/09/2029	24,900	0.27
USD	15,047,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.875% 14/04/2026^	16,037	0.17
USD	11,977,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.000% 12/10/2046	10,615	0.12
USD	12,180,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.375% 24/07/2044	11,474	0.12
USD	18,099,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.650% 27/09/2047	17,147	0.19
USD	36,352,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.750% 30/09/2049	34,632	0.37
USD	24,419,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.875% 16/09/2025^	27,308	0.30
USD	17,037,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.875% 22/06/2030^	18,664	0.20
		Total South Africa	**258,234**	**2.79**

（2021年10月31日現在）

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Bonds (31 October 2020: 98.57%) (cont)		
		Sri Lanka (31 October 2020: 0.90%)		
		Government Bonds		
USD	16,271,000	Sri Lanka Government International Bond 5.750% 18/04/2023	11,189	0.12
USD	19,854,000	Sri Lanka Government International Bond 6.200% 11/05/2027	12,475	0.14
USD	16,269,000	Sri Lanka Government International Bond 6.750% 18/04/2028	10,171	0.11
USD	12,758,000	Sri Lanka Government International Bond 6.825% 18/07/2026	8,060	0.09
USD	13,036,000	Sri Lanka Government International Bond 6.850% 14/03/2024^	8,513	0.09
USD	19,745,000	Sri Lanka Government International Bond 6.850% 03/11/2025	12,653	0.14
USD	19,638,000	Sri Lanka Government International Bond 7.550% 28/03/2030^	12,271	0.13
USD	18,336,000	Sri Lanka Government International Bond 7.850% 14/03/2029	11,549	0.12
		Total Sri Lanka	**86,881**	**0.94**
		Trinidad And Tobago (31 October 2020: 0.16%)		
		Government Bonds		
USD	13,637,000	Trinidad & Tobago Government International Bond 4.500% 04/08/2026	14,142	0.15
		Total Trinidad And Tobago	**14,142**	**0.15**
		Tunisia (31 October 2020: 0.13%)		
		Government Bonds		
USD	13,414,000	Banque Centrale de Tunisie International Bond 5.750% 30/01/2025^	10,748	0.12
		Total Tunisia	**10,748**	**0.12**
		Turkey (31 October 2020: 3.59%)		
		Corporate Bonds		
USD	6,760,000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 5.004% 06/04/2023	6,869	0.08
USD	13,500,000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 5.125% 22/06/2026^	13,258	0.14
		Government Bonds		
USD	5,633,000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 4.489% 25/11/2024^	5,599	0.06
USD	8,118,000	Turkey Government International Bond 3.250% 23/03/2023	8,041	0.09
USD	10,450,000	Turkey Government International Bond 4.250% 13/03/2025	10,057	0.11
USD	7,963,000	Turkey Government International Bond 4.250% 14/04/2026^	7,452	0.08
USD	9,960,000	Turkey Government International Bond 4.750% 26/01/2026	9,540	0.10
USD	16,736,000	Turkey Government International Bond 4.875% 09/10/2026	15,850	0.17
		Turkey (31 October 2020: 3.59%) (cont)		
		Government Bonds (cont)		
USD	16,345,000	Turkey Government International Bond 4.875% 16/04/2043	12,665	0.14
USD	11,012,000	Turkey Government International Bond 5.125% 17/02/2028	10,319	0.11
USD	11,175,000	Turkey Government International Bond 5.250% 13/03/2030^	10,140	0.11
USD	13,519,000	Turkey Government International Bond 5.600% 14/11/2024	13,614	0.15
USD	13,980,000	Turkey Government International Bond 5.750% 22/03/2024	14,227	0.15
USD	19,070,000	Turkey Government International Bond 5.750% 11/05/2047^	15,671	0.17
USD	9,550,000	Turkey Government International Bond 5.875% 26/06/2031	8,873	0.10
USD	12,384,000	Turkey Government International Bond 5.950% 15/01/2031	11,583	0.13
USD	17,779,000	Turkey Government International Bond 6.000% 25/03/2027	17,549	0.19
USD	16,394,000	Turkey Government International Bond 6.000% 14/01/2041	14,127	0.15
USD	15,234,000	Turkey Government International Bond 6.125% 24/10/2028	14,932	0.16
USD	12,482,000	Turkey Government International Bond 6.350% 10/08/2024	12,851	0.14
USD	13,975,000	Turkey Government International Bond 6.375% 14/10/2025	14,187	0.15
USD	8,050,000	Turkey Government International Bond 6.500% 20/09/2033^	7,647	0.08
USD	16,276,000	Turkey Government International Bond 6.625% 17/02/2045	14,779	0.16
USD	10,998,000	Turkey Government International Bond 6.750% 30/05/2040^	10,299	0.11
USD	14,871,000	Turkey Government International Bond 6.875% 17/03/2036	14,363	0.16
USD	11,030,000	Turkey Government International Bond 7.250% 23/12/2023	11,642	0.13
USD	5,364,000	Turkey Government International Bond 7.250% 05/03/2038	5,350	0.06
USD	17,658,000	Turkey Government International Bond 7.375% 05/02/2025	18,655	0.20
USD	16,220,000	Turkey Government International Bond 7.625% 26/04/2029	17,039	0.18
USD	8,131,000	Turkey Government International Bond 8.000% 14/02/2034^	8,725	0.09
USD	7,831,000	Turkey Government International Bond 11.875% 15/01/2030^	10,338	0.11
		Total Turkey	**366,241**	**3.96**
		Ukraine (31 October 2020: 2.10%)		
		Government Bonds		
USD	22,700,000	Ukraine Government International Bond 6.876% 21/05/2029	23,075	0.25

（2021年10月31日現在）

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Bonds (31 October 2020: 98.57%) (cont)		
		Ukraine (31 October 2020: 2.10%) (cont)		
		Government Bonds (cont)		
USD	33,800,000	Ukraine Government International Bond 7.253% 15/03/2033	34,366	0.37
USD	39,147,000	Ukraine Government International Bond 7.375% 25/09/2032	40,194	0.43
USD	17,769,000	Ukraine Government International Bond 7.750% 01/09/2023	18,915	0.21
USD	17,282,000	Ukraine Government International Bond 7.750% 01/09/2024	18,652	0.20
USD	17,343,000	Ukraine Government International Bond 7.750% 01/09/2025	18,687	0.20
USD	17,188,000	Ukraine Government International Bond 7.750% 01/09/2026	18,523	0.20
USD	16,716,000	Ukraine Government International Bond 7.750% 01/09/2027^	18,004	0.20
USD	20,710,000	Ukraine Government International Bond 9.750% 01/11/2028	23,989	0.26
		Total Ukraine	**214,405**	**2.32**
		United Arab Emirates (31 October 2020: 3.05%)		
		Corporate Bonds		
USD	12,100,000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC 4.600% 02/11/2047	14,100	0.15
USD	5,425,000	Abu Dhabi Ports Co PJSC 2.500% 06/05/2031	5,433	0.06
USD	5,575,000	DAE Funding LLC 1.550% 01/08/2024^	5,500	0.06
USD	6,828,000	DP World Plc 5.625% 25/09/2048^	8,296	0.09
USD	9,550,000	DP World Plc 6.850% 02/07/2037	12,587	0.14
USD	5,450,000	MDGH GMTN RSC Ltd 2.500% 07/11/2024	5,661	0.06
USD	5,510,000	MDGH GMTN RSC Ltd 2.500% 21/05/2026	5,696	0.06
USD	5,443,000	MDGH GMTN RSC Ltd 2.875% 07/11/2029	5,662	0.06
USD	5,358,000	MDGH GMTN RSC Ltd 2.875% 21/05/2030	5,567	0.06
USD	5,400,000	MDGH GMTN RSC Ltd 3.400% 07/06/2051^	5,636	0.06
USD	8,200,000	MDGH GMTN RSC Ltd 3.700% 07/11/2049	8,922	0.10
USD	10,778,000	MDGH GMTN RSC Ltd 3.950% 21/05/2050^	12,228	0.13
		Government Bonds		
USD	10,825,000	Abu Dhabi Government International Bond 0.750% 02/09/2023	10,820	0.12
USD	10,625,000	Abu Dhabi Government International Bond 1.625% 02/06/2028	10,460	0.11
USD	8,100,000	Abu Dhabi Government International Bond 1.700% 02/03/2031^	7,779	0.08
USD	8,800,000	Abu Dhabi Government International Bond 1.875% 15/09/2031	8,539	0.09
USD	16,400,000	Abu Dhabi Government International Bond 2.125% 30/09/2024^	16,892	0.18
USD	16,025,000	Abu Dhabi Government International Bond 2.500% 16/04/2025	16,730	0.18
USD	15,800,000	Abu Dhabi Government International Bond 2.500% 30/09/2029	16,377	0.18
USD	8,100,000	Abu Dhabi Government International Bond 2.700% 02/09/2070	7,233	0.08
		United Arab Emirates (31 October 2020: 3.05%) (cont)		
		Government Bonds (cont)		
USD	6,550,000	Abu Dhabi Government International Bond 3.000% 15/09/2051^	6,444	0.07
USD	13,302,000	Abu Dhabi Government International Bond 3.125% 03/05/2026	14,250	0.15
USD	21,741,000	Abu Dhabi Government International Bond 3.125% 11/10/2027	23,382	0.25
USD	16,511,000	Abu Dhabi Government International Bond 3.125% 16/04/2030	17,782	0.19
USD	21,295,000	Abu Dhabi Government International Bond 3.125% 30/09/2049	21,412	0.23
USD	21,473,000	Abu Dhabi Government International Bond 3.875% 16/04/2050^	24,604	0.27
USD	16,045,000	Abu Dhabi Government International Bond 4.125% 11/10/2047	18,973	0.21
USD	7,025,000	Emirate of Dubai Government International Bonds 3.900% 09/09/2050	6,621	0.07
USD	5,450,000	Emirate of Dubai Government International Bonds 5.250% 30/01/2043^	6,269	0.07
USD	5,550,000	Finance Department Government of Sharjah 4.000% 28/07/2050^	4,990	0.05
USD	3,800,000	UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND 2.000% 19/10/2031^	3,725	0.04
USD	3,500,000	UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND 2.875% 19/10/2041	3,430	0.04
USD	5,900,000	UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND 3.250% 19/10/2061^	5,930	0.07
		Total United Arab Emirates	**347,930**	**3.76**
		Uruguay (31 October 2020: 2.43%)		
		Government Bonds		
USD	19,906,821	Uruguay Government International Bond 4.375% 27/10/2027	22,673	0.24
USD	31,722,922	Uruguay Government International Bond 4.375% 23/01/2031	36,616	0.40
USD	12,931,204	Uruguay Government International Bond 4.500% 14/08/2024	13,762	0.15
USD	33,887,005	Uruguay Government International Bond 4.975% 20/04/2055	43,445	0.47
USD	51,358,766	Uruguay Government International Bond 5.100% 18/06/2050	66,792	0.72
USD	13,510,017	Uruguay Government International Bond 7.625% 21/03/2036	20,272	0.22
		Total Uruguay	**203,560**	**2.20**
		Venezuela (31 October 2020: 0.04%)		
		Corporate Bonds		
USD	21,209,600	Petroleos de Venezuela SA 5.375% 12/04/2027*	1,061	0.01
USD	10,763,400	Petroleos de Venezuela SA 5.500% 12/04/2037*	538	0.01
USD	25,826,000	Petroleos de Venezuela SA 6.000% 16/05/2024*	1,291	0.01
USD	22,863,658	Petroleos de Venezuela SA 6.000% 15/11/2026*	1,143	0.01
USD	15,143,204	Petroleos de Venezuela SA 9.000% 17/11/2021*	757	0.01

（2021年10月31日現在）

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Bonds (31 October 2020: 98.57%) (cont)		
		Venezuela (31 October 2020: 0.04%) (cont)		
		Corporate Bonds (cont)		
USD	9,847,319	Petroleos de Venezuela SA 9.750% 17/05/2035*	492	0.01
USD	16,977,000	Petroleos de Venezuela SA 12.750% 17/02/2022*	849	0.01
		Total Venezuela	**6,131**	**0.07**
		Vietnam (31 October 2020: 0.18%)		
		Government Bonds		
USD	13,559,000	Vietnam Government International Bond 4.800% 19/11/2024	14,879	0.16
		Total Vietnam	**14,879**	**0.16**

通貨	保有		公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
		Zambia (31 October 2020: 0.15%)		
		Government Bonds		
USD	13,504,000	Zambia Government International Bond 8.500% 14/04/2024	10,770	0.12
USD	16,502,000	Zambia Government International Bond 8.970% 30/07/2027	12,995	0.14
		Total Zambia	**23,765**	**0.26**
		Total bonds	**9,153,521**	**98.87**

通貨	買付金額	通貨	売付金額	エクスポジャー（米ドル）	満期日	未実現利益（損失）千米ドル	純資産比率（%）
Financial derivative instruments (31 October 2020: (0.02)%)							
Forward currency contracts@ (31 October 2020: (0.02)%)							
CHF	109,533,399	USD	117,500,521	117,500,522	02/11/2021	2,372	0.03
EUR	392,338,895	USD	454,962,579	454,962,579	02/11/2021	(929)	(0.01)
GBP	219,581,133	USD	296,169,716	296,169,716	02/11/2021	4,820	0.05
GBP	3,843,332	USD	5,296,099	5,296,099	02/11/2021	(27)	0.00
MXN	1,624,198,446	USD	78,703,926	78,703,926	03/11/2021	359	0.00
MXN	100,266,105	USD	4,967,954	4,967,955	03/11/2021	(87)	0.00
USD	4,308,731	CHF	4,016,608	4,308,731	02/11/2021	(87)	0.00
USD	23,203,188	EUR	19,992,845	23,203,188	02/11/2021	67	0.00
USD	15,020,460	GBP	11,106,502	15,020,460	02/11/2021	(203)	0.00
USD	3,336,880	GBP	2,431,339	3,336,880	02/11/2021	4	0.00
USD	3,635,373	MXN	75,024,026	3,635,373	03/11/2021	(17)	0.00
					Total unrealised gains on forward currency contracts	**7,622**	**0.08**
					Total unrealised losses on forward currency contracts	**(1,350)**	**(0.01)**
					Net unrealised gains on forward currency contracts	**6,272**	**0.07**
					Total financial derivative instruments	**6,272**	**0.07**

（2021年10月31日現在）

	公正価値 千米ドル	純資産比率（%）
投資総額	**9,159,793**	**98.94**
現金	**10,569**	**0.11**
その他の純資産	**87,259**	**0.95**
期末の純資産	**9,257,621**	**100.00**

†Substantially all cash positions are held with State Street Bank and Trust Company. Cash collateral and cash collateral payable in respect of securities lending transactions is held by the Fund's Depositary (or through its delegates).
^These securities are partially or fully transferred as securities lent.
#Perpetual bond.
*This security was valued in consultation with the Investment Manager. This security was fair valued or suspended at financial year end and valued using the last traded price.
ØThe counterparty for forward currency contracts is State Street Bank and Trust Company. All forwards relate to the CHF Hedged (Acc) Class, EUR Hedged (Acc) Class, GBP Hedged (Dist) Class and MXN Hedged (Acc) Class.

Fixed income securities are primarily classified by country/geographic region of incorporation of the issuer for corporate fixed income securities and country/geographic region of issuer for government type fixed income securities.

Underlying exposure has been calculated according to the guidelines issued by ESMA and represents the market value of an equivalent position in the assets underlying each financial derivative instrument.

全負債の流動資産総額の状況	公正価値 千米ドル	流動資産合計に対する割合（%）
証券取引所上場の有価証券	8,820,326	93.30
規制市場で取引される有価証券	255,716	2.71
規則68(1)(a)、(b)および(c)に規定される種類のその他の有価証券	77,479	0.82
店頭金融デリバティブ商品	7,622	0.08
その他の資産	292,298	3.09
流動資産合計	**9,453,441**	**100.00**

iシェアーズ ゴールド・トラスト
(iShares® Gold Trust)
損益計算書、純資産変動計算書、投資明細表は、当該トラストの米国証券取引委員会に提出されたFORM10-Kから抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

１．損益計算書

(2021年12月31日に終了する期間)
(米ドルで表示)

費用		
スポンサー報酬	$	72,773,331
費用合計		72,773,331
投資純損益		(72,773,331)
実現および未実現損益（純額）		
実現純損益		
費用支払のために売却した金投資の実現純損益		12,824,248
受益権の買戻しにより分配した金の実現純損益		565,428,591
実現純損益		578,252,839
未実現評価損益の純変動		(1,904,612,983)
実現および未実現損益（純額）		(1,326,360,144)
運用による純資産の増減（純額）		(1,399,133,475)
受益権１口当たり純損益 [a] [b]	$	(1.65)

(a)　１単位当たり純資産の純増（減少）は、年間平均発行済数に基づく。
(b)　2021年５月24日の１対２の分割を反映しています。
(注)　(　)内の金額は、マイナスの金額です。

２．純資産変動計算書

（2021年12月31日に終了する期間）
（米ドルで表示）

期首の純資産	$	31,918,269,136
運用：		
投資純損益		(72,773,331)
実現純損益		578,252,839
未実現評価損益の純変動		(1,904,612,983)
運用による純資産の純増減額		(1,399,133,475)
資本投資証券の取引：		
出資による投資証券の発行		1,853,104,516
買戻しによる投資証券の償還		(3,649,216,540)
資本投資証券の取引による純資産の純増減額		(1,796,112,024)
純資産の増減		(3,195,245,499)
期末の純資産	$	28,723,023,637
投資証券の発行および償還		
投資証券の発行 [a]		53,075,000
投資証券の償還 [a]		(108,550,000)
発行済投資証券の純増減		(55,475,000)

(a) 2021年５月24日の１対２の分割を反映しています。
（注）（　）内の金額は、マイナスの金額です。

３．投資明細表

（2021年12月31日現在）

項目	オンス	取得原価	公正価格
金投資	15,784,325	$ 23,722,912,868	$ 28,729,048,695
投資総額 － 100.02%			28,729,048,695
超過する負債の額 － (0.02)%			(6,025,058)
純資産 － 100.00%			$ 28,723,023,637

（注）（　）内の金額は、マイナスの金額です。