

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合
信託期間	無期限（2022年1月27日設定）
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、主としてわが国を含む先進国の株式、債券、わが国の不動産投資信託証券および短期公社債等に投資を行います。投資対象とする投資信託証券（以下「指定投資信託証券」といいます。）については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、指定投資信託証券として指定されていた投資信託証券を指定から外したり、新たに投資信託証券（この投資信託の設定以降に設定された投資信託証券も含まれます。）を指定投資信託証券として指定する場合があります。投資にあたっては、マクロ経済分析等に基づくトップダウンアプローチ、個別資産の魅力度判断等に基づくボトムアップアプローチにより基本ポートフォリオを決定するとともに、投資環境判断、ファンドのリスク水準等を考慮して機動的に資産配分の変更を行うことで、価格下落リスクの抑制を図りながら安定した収益の獲得をめざします。投資信託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、為替ヘッジを行う場合があります。
主要運用対象	投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への直接投資は行いません。 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書（全体版）

ラップ向け アクティブアロケーションファンド

第2期（決算日：2023年6月26日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
さて、お手持ちの「ラップ向けアクティブアロケーションファンド」は、去る6月26日に第2期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先

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

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託組入比率	純資産総額
	(分配落)	税金	み騰落						
(設定日)	円	円	%	%	%	%	%	%	百万円
2022年1月27日	10,000	—	—	—	—	—	—	—	10
1期(2022年6月27日)	9,607	0	△3.9	30.4	1.4	41.7	—	8.2	62
2期(2023年6月26日)	9,941	0	3.5	32.2	1.3	58.4	0.0	3.2	232

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

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

(注) 株式先物比率には、不動産投信指数先物を含めて表示しております。

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

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
	円	騰 落 率					
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%
2022年6月27日	9,607	—	30.4	1.4	41.7	—	8.2
6月末	9,613	0.1	30.1	1.5	42.2	—	8.4
7月末	9,746	1.4	23.9	0.5	50.7	—	7.9
8月末	9,596	△0.1	33.8	0.8	53.5	—	4.3
9月末	9,295	△3.2	30.2	0.7	47.7	—	4.0
10月末	9,522	△0.9	24.4	0.6	49.1	—	5.0
11月末	9,474	△1.4	29.8	1.0	51.4	0.0	5.2
12月末	9,255	△3.7	23.2	1.0	52.8	0.0	3.3
2023年1月末	9,341	△2.8	32.7	2.0	47.5	0.0	3.1
2月末	9,387	△2.3	29.4	0.7	47.7	0.0	4.4
3月末	9,459	△1.5	28.2	1.3	44.0	0.0	3.9
4月末	9,580	△0.3	28.0	0.7	53.6	0.0	3.1
5月末	9,718	1.2	25.0	0.7	64.0	0.0	3.0
(期 末)							
2023年6月26日	9,941	3.5	32.2	1.3	58.4	0.0	3.2

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式先物比率には、不動産投信指数先物を含めて表示しております。

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

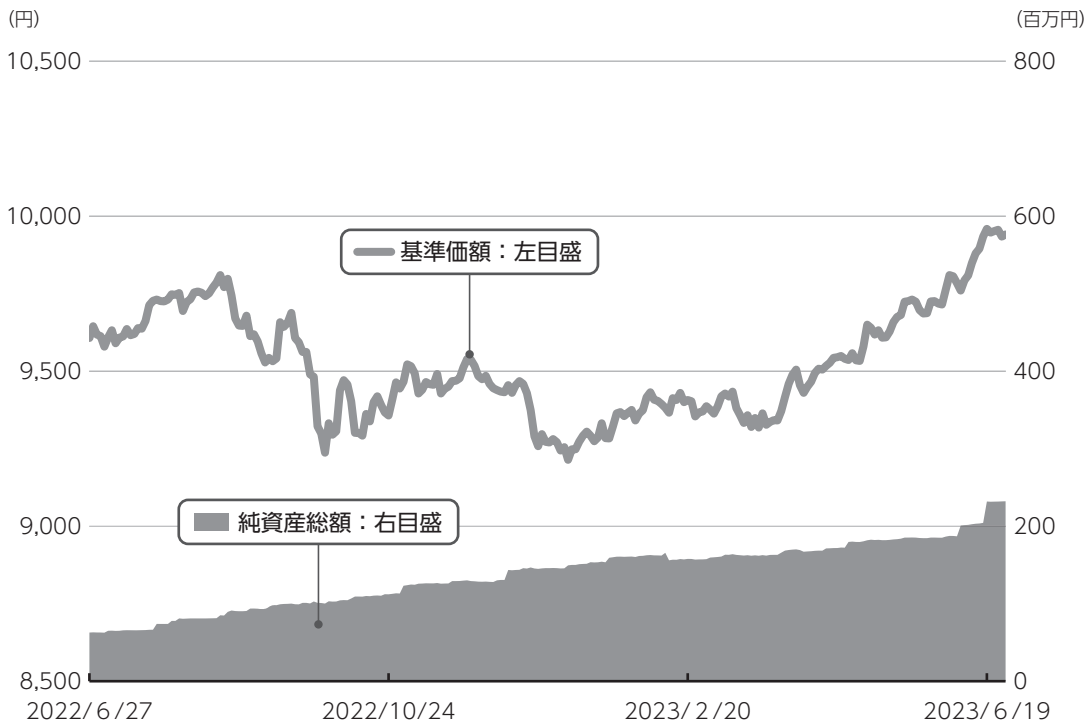
(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第2期：2022年6月28日～2023年6月26日

▶ 当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第2期首	9,607円
第2期末	9,941円
既払分配金	0円
騰落率	3.5%

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

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

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ3.5%の上昇となりました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

TOPIXマザーファンドの上昇などがプラスに寄与しました。

組入ファンド	騰落率	組入比率（対純資産総額）
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	7.2%	14.6%
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	-	6.9%
東証REIT指数マザーファンド	-0.6%	2.9%
新マネー・マーケット・マザーファンド	-0.1%	2.0%
国内債券インデックスマザーファンド	-	20.9%
TOPIXマザーファンド	23.1%	18.6%
外国債券インデックスマザーファンド	5.1%	29.6%

※期首に組入れのないファンドについては騰落率を表示しておりません。

第2期：2022年6月28日～2023年6月26日

投資環境について

▶ 株式市況

日本を含む先進国株式市況は上昇しました。

日本を含む先進国の株式市況は、主要国でインフレ鈍化傾向がみられることなどを背景に、主要中央銀行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。

▶ 債券市況

日本を含む先進国の債券利回りは上昇しました。

日本を含む先進国の債券利回りは、主要中央銀行による利上げが継続したことなどから上昇しました。

▶ リート市況

国内のリート市況は下落しました。

日銀による金融政策の修正があったことを受けて、景気の先行き懸念が強まったことなどから下落しました。

▶ 為替市況

米ドル、ユーロともに円に対して上昇しました。

米ドルは米国金利の上昇による日米金利差拡大などから円に対して上昇しました。ユーロは、欧州金利の上昇による日欧金利差拡大などから円に対して上昇しました。

▶ 国内短期金融市場

無担保コール翌日物金利は0%を下回る水準で推移しました。

当期間の短期金融市場をみると、日銀は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）はマイナス圏で推移し、足下のコール・レートは-0.075%となりました。

▶ 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、主として日本を含む先進国の株式・債券、日本の不動産投資信託証券および短期公社債等に実質的な投資を行いました。三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき、指定投資信託証券への投資を行いました。

指定投資信託証券の当期間末に適用される資産配分比率は以下の通りとなっています。

TOPIXマザーファンド	19%
国内債券インデックスマザーファンド	21%
日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ	0%
東証REIT指数マザーファンド	3%
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	15%
外国債券インデックスマザーファンド	29%
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	7%
先進国高格付国債マザーファンドⅡ	0%

▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

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

分配金について

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

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第2期
	2022年6月28日～2023年6月26日
当期分配金（対基準価額比率）	－（－％）
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	350

(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。）

日本を含む先進国の株式・債券、日本の不動産投資信託証券および短期公社債等を実質的な主要投資対象とし、値上がり益の獲得および利子・配当収益の確保をめざします。投資対象とする投資信託証券および資産配分比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。

2022年6月28日～2023年6月26日

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	21	0.219	(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)	(17)	(0.175)	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) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 ÷ 期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(0)	(0.001)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.004	(c) 有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 ÷ 期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.004)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	2	0.017	(d) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.014)	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)	(0.003)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	23	0.241	

期中の平均基準価額は、9,520円です。

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

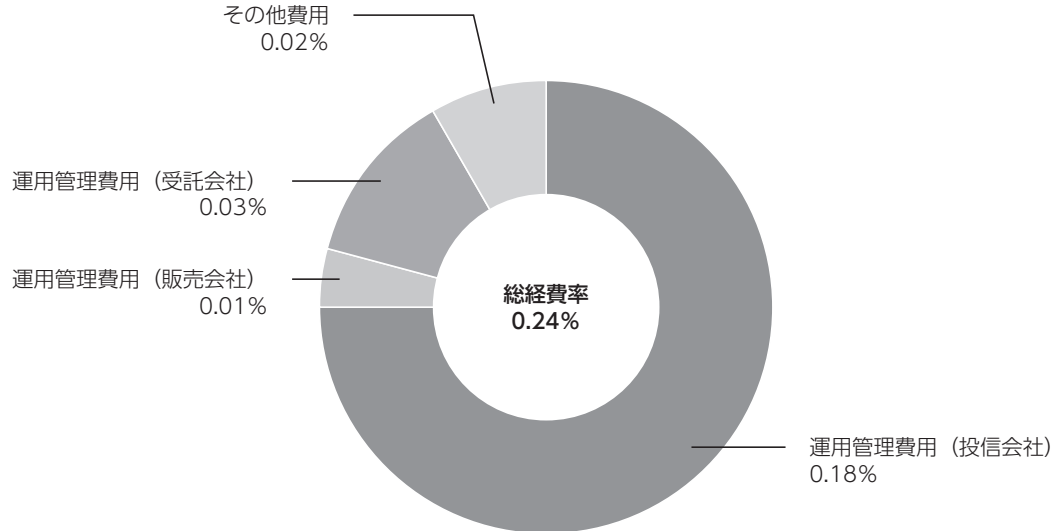
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

(参考情報)

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.24%**です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

○売買及び取引の状況

(2022年6月28日～2023年6月26日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	25,516	61,210	15,233	35,780
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	38,791	44,700	24,629	28,351
東証REIT指数マザーファンド	2,329	8,310	1,817	6,480
新マネー・マーケット・マザーファンド	176,353	174,660	186,528	184,718
先進国高格付国債マザーファンドⅡ	21,831	18,630	21,831	17,213
国内債券インデックスマザーファンド	158,209	148,550	107,550	100,131
日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ	7,120	6,730	7,120	6,548
TOPIXマザーファンド	31,283	76,310	20,824	50,850
外国債券インデックスマザーファンド	37,514	87,250	17,339	40,280

○株式売買比率

(2022年6月28日～2023年6月26日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	TOPIXマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	17,236,329千円	567,788,919千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	19,469,669千円	841,291,880千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.88	0.67

(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

(2022年6月28日～2023年6月26日)

利害関係人との取引状況

<ラップ向けアクティブアロケーションファンド>

該当事項はございません。

<ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	246,536	183,893	74.6	256,560	191,962	74.8
為替直物取引	13,387	12,442	92.9	3,419	3,262	95.4

平均保有割合 0.1%

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

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	3,238,776	2,738,390	84.6	3,364,796	2,850,084	84.7
為替直物取引	445,054	331,247	74.4	300,867	205,332	68.2

平均保有割合 0.0%

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

<東証REIT指数マザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	28,138	17,551	62.4	6,368	3,860	60.6
不動産投信指数先物取引	8,191	8,191	100.0	7,070	7,070	100.0

平均保有割合 0.0%

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

<新マネー・マーケット・マザーファンド>

該当事項はございません。

<先進国高格付国債マザーファンドⅡ>

該当事項はございません。

<国内債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 452,778	百万円 155,866	% 34.4	百万円 449,798	百万円 118,647	% 26.4

平均保有割合 0.0%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

<日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 41,934	百万円 13,329	% 31.8	百万円 80,781	百万円 16,334	% 20.2

平均保有割合 0.0%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

<TOPIXマザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 362,437	百万円 37,883	% 10.5	百万円 205,351	百万円 8,363	% 4.1

平均保有割合 0.0%

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

<外国債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 20,551	百万円 19,360	% 94.2	百万円 20,099	百万円 10,090	% 50.2
為替直物取引	196,363	142,970	72.8	66,458	50,367	75.8

平均保有割合 0.0%

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

利害関係人の発行する有価証券等

<国内債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 315	百万円 300	百万円 909

<TOPIXマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 6,525	百万円 4,036	百万円 22,112

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<東証REIT指数マザーファンド>

種 類	買 付 額
投資信託証券	百万円 1,651

<国内債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額
公社債	百万円 2,700

<TOPIXマザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 774

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	1千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.016千円
(B) / (A)	1.2%

(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です。

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2022年6月28日～2023年6月26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 10	百万円 -	百万円 10	百万円 -	当初設定時における取得とその処分

○組入資産の明細

(2023年6月26日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	3,308	13,590	33,980
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	-	14,162	16,081
東証REIT指数マザーファンド	1,423	1,936	6,798
新マネー・マーケット・マザーファンド	14,844	4,669	4,622
国内債券インデックスマザーファンド	-	50,659	48,419
TOPIXマザーファンド	5,455	15,914	43,118
外国債券インデックスマザーファンド	7,666	27,841	68,603

○有価証券の貸付及び借入の状況

東証REIT指数マザーファンドにおいて、2023年6月26日現在における貸付口数の総口数は52,320口です。
TOPIXマザーファンドにおいて、2023年6月26日現在における貸付株数の総株数は20,484,900株です。

○投資信託財産の構成

(2023年6月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	33,980	14.6
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	16,081	6.9
東証REIT指数マザーファンド	6,798	2.9
新マネー・マーケット・マザーファンド	4,622	2.0
国内債券インデックスマザーファンド	48,419	20.8
TOPIXマザーファンド	43,118	18.6
外国債券インデックスマザーファンド	68,603	29.5
コール・ローン等、その他	10,724	4.7
投資信託財産総額	232,345	100.0

(注) ヘッジ付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（31,616,612千円）の投資信託財産総額（32,282,037千円）に対する比率は97.9%です。

(注) ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（332,825,706千円）の投資信託財産総額（336,394,912千円）に対する比率は98.9%です。

(注) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（463,960,259千円）の投資信託財産総額（465,690,327千円）に対する比率は99.6%です。

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

1 アメリカドル=143.49円	1 カナダドル=108.95円	1 メキシコペソ=8.3773円	1 ユーロ=156.48円
1 イギリスポンド=182.69円	1 スイスフラン=160.15円	1 スウェーデンクローネ=13.40円	1 ノルウェークローネ=13.28円
1 デンマーククローネ=21.01円	1 ポーランドズロチ=35.237円	1 オーストラリアドル=95.77円	1 ニュージーランドドル=88.32円
1 香港ドル=18.32円	1 シンガポールドル=106.19円	1 マレーシアリンギット=30.6836円	1 中国元=19.9726円
1 イスラエルシェケル=39.5827円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年6月26日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	232,345,316
コール・ローン等	1,820,889
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	33,980,112
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	16,081,718
東証REIT指数マザーファンド(評価額)	6,798,009
新マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	4,622,795
国内債券インデックスマザーファンド(評価額)	48,419,966
TOPIXマザーファンド(評価額)	43,118,334
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	68,603,493
未収入金	8,900,000
(B) 負債	189,465
未払信託報酬	187,086
未払利息	4
その他未払費用	2,375
(C) 純資産総額(A-B)	232,155,851
元本	233,524,084
次期繰越損益金	△ 1,368,233
(D) 受益権総口数	233,524,084口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,941円

<注記事項>

- ①期首元本額 65,355,671円
 期中追加設定元本額 182,223,164円
 期中一部解約元本額 14,054,751円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9941円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は1,368,233円です。

③分配金の計算過程

項目	2022年6月28日～ 2023年6月26日
費用控除後の配当等収益額	2,033,832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	5,760,837円
収益調整金額	326,695円
分配準備積立金額	73,270円
当ファンドの分配対象収益額	8,194,634円
1万口当たり収益分配対象額	350円
1万口当たり分配金額	-円
収益分配金金額	-円

④「先進国高格付国債マザーファンドⅡ」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の7.5以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

○損益の状況 (2022年6月28日～2023年6月26日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	△ 3,341
受取利息	58
支払利息	△ 3,399
(B) 有価証券売買損益	8,382,289
売買益	12,171,239
売買損	△ 3,788,950
(C) 信託報酬等	△ 304,767
(D) 当期損益金(A+B+C)	8,074,181
(E) 前期繰越損益金	△ 206,242
(F) 追加信託差損益金	△ 9,236,172
(配当等相当額)	(249,838)
(売買損益相当額)	(△ 9,486,010)
(G) 計(D+E+F)	△ 1,368,233
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△ 1,368,233
追加信託差損益金	△ 9,236,172
(配当等相当額)	(326,695)
(売買損益相当額)	(△ 9,562,867)
分配準備積立金	7,867,939

(注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

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

【お 知 ら せ】

- ①定量・定性の評価を勘案し、指定投資信託証券を追加するため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2022年11月21日)
- ②三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。

T O P I X マザーファンド

《第22期》決算日2023年3月27日

[計算期間：2022年3月26日～2023年3月27日]

「T O P I X マザーファンド」は、3月27日に第22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22期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数 (T O P I X) (配当込み)		株組入比率	株先物比率	純資産額
	期騰落率	期中騰落率	期騰落率	期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
22期(2023年3月27日)	23,227	1.7	3,217.73	1.7	100.8	1.4	854,874

(注) 東証株価指数（T O P I X）（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。T O P I X の指数値及び T O P I X に係る標章又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」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 T O P I X に関するすべての権利・ノウハウ及び T O P I X に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X 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 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年 3月25日	円	%		%	%	%
	22,839	—	3,163.63	—	99.1	0.9
3 月 末	22,683	△0.7	3,142.06	△0.7	98.1	1.7
4 月 末	22,140	△3.1	3,066.68	△3.1	98.7	1.7
5 月 末	22,311	△2.3	3,090.73	△2.3	98.1	1.7
6 月 末	21,854	△4.3	3,027.34	△4.3	97.8	2.2
7 月 末	22,668	△0.7	3,140.07	△0.7	98.5	1.0
8 月 末	22,941	0.4	3,177.98	0.5	99.2	0.5
9 月 末	21,682	△5.1	3,003.39	△5.1	98.8	1.5
10 月 末	22,788	△0.2	3,156.44	△0.2	98.1	1.7
11 月 末	23,458	2.7	3,249.61	2.7	97.9	1.3
12 月 末	22,386	△2.0	3,101.25	△2.0	99.1	1.1
2023年 1 月 末	23,377	2.4	3,238.48	2.4	98.8	0.7
2 月 末	23,598	3.3	3,269.12	3.3	99.5	0.8
(期 末) 2023年 3月27日	23,227	1.7	3,217.73	1.7	100.8	1.4

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

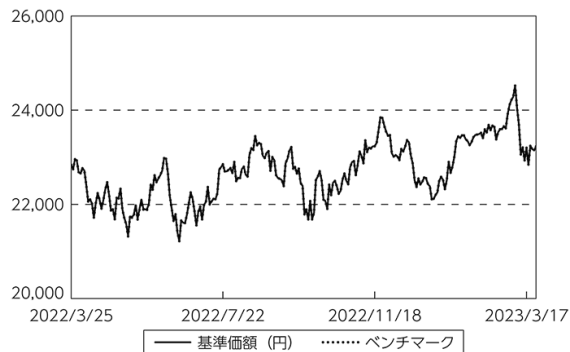
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ1.7%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(1.7%)と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。
- ・ 円安・米ドル高進行に伴う輸出企業の採算改善や、新型コロナウイルス対策の入国規制緩和によるインバウンド需要期待等を背景に、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

- ・ 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1.7%の上昇になったため、乖離は $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ 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

(2022年3月26日～2023年3月27日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	0	0.001	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
合 計	(0)	(0.001)	
期中の平均基準価額は、22,682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

(2022年3月26日～2023年3月27日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株	千円	千株	千円
		139,383	331,852,196	85,123	196,207,828
		(5,147)	(-)		

(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	百万円	百万円	百万円
		130,167	126,090	-	-

○株式売買比率

(2022年3月26日～2023年3月27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	528,060,025千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	788,478,906千円
(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

(2022年3月26日～2023年3月27日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 86,376	% 26.0	百万円 196,207	百万円 20,959	% 10.7	

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 5,583	百万円 3,557	百万円 16,914

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 380

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)	8,515千円
うち利害関係人への支払額 (B)	37千円
(B) / (A)	0.4%

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MUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2023年3月27日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				
極洋	12.9	16.3	56,724	
ニッセイ	367.6	429.1	235,575	
マルハニチロ	57.5	63.8	152,354	
雪国まいたけ	26.8	36.5	37,157	
カネコ種苗	10.4	13.1	21,510	
サカタのタネ	43.8	48.8	188,124	
ホクト	30.8	38.2	71,625	
ホクリヨウ	5	3.9	3,182	
鉱業 (0.3%)				
住石ホールディングス	64.3	51	17,697	
日鉄鉱業	8.4	17.2	59,942	
三井松島ホールディングス	15.4	19.4	71,586	
I N P E X	1,474.7	1,587.1	2,133,062	
石油資源開発	43.2	49.7	222,407	
K&Oエナジーグループ	16.7	19.5	39,663	
建設業 (2.0%)				
ヒノキヤグループ	8	—	—	
ショーボンドホールディングス	52.5	58.5	312,390	
ミライト・ワン	118.3	148.8	244,924	
タマホーム	22.3	27	95,040	
サンヨーホームズ	4.2	3.3	2,541	
日本アクア	14.6	11.6	10,312	
ファーストコーポレーション	9	7.1	6,248	
ベステラ	7.4	6	5,346	
Robot Home	61.3	73	15,038	
キャンディル	6.3	4.3	2,266	
ダイセキ環境ソリューション	7.1	5.6	5,073	
第一カッター興業	9.1	11	12,650	
安藤・間	182.5	248.6	215,536	
東急建設	107.7	122.2	83,096	
コムシスホールディングス	118.5	145.2	355,449	
ビーアールホールディングス	50	68.1	24,379	
高松コンストラクショングループ	22.9	27.9	56,106	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東建コーポレーション	10.2	12.3	93,480	
ソネック	3.8	3	2,964	
ヤマウラ	17.7	21.7	24,130	
オリエンタル白石	123.6	154.2	49,035	
大成建設	245.3	298.8	1,198,188	
大林組	848.9	1,073.5	1,075,647	
清水建設	795.2	902.5	670,557	
飛鳥建設	22.7	33.2	35,524	
長谷工コーポレーション	252.8	309.8	474,923	
松井建設	33.4	28	18,676	
銭高組	3.7	2.5	7,537	
鹿島建設	622	665.6	1,047,654	
不動テトラ	18	20.8	33,384	
大末建設	8.9	7.1	8,363	
鉄建建設	18.4	21.5	39,775	
西松建設	51.4	50.9	174,841	
三井住友建設	191.4	242	92,928	
大豊建設	12.4	12.4	47,058	
佐田建設	18.3	14.5	7,177	
ナカノフドー建設	20.3	16.1	5,860	
奥村組	50	48.7	157,788	
東鉄工業	39.4	41.3	111,344	
イチケン	6.1	4.9	8,918	
富士ビー・エス	10.9	8.7	3,906	
浅沼組	9.5	24	79,320	
戸田建設	352.5	369.3	258,510	
熊谷組	43.3	52	141,284	
北野建設	5.2	4.1	12,382	
植木組	7.5	5.5	7,408	
矢作建設工業	37.5	40.8	34,108	
ビーエス三菱	27.9	38	25,650	
日本ハウスホールディングス	57.9	59.5	23,086	
大東建託	86.9	—	—	
新日本建設	36.1	42.1	38,184	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東亜道路工業	4.4	6	43,560	
日本道路	8.2	6	44,040	
東亜建設工業	20.8	25.7	67,976	
日本国土開発	82.6	90	53,640	
若築建設	14.2	13.4	48,977	
東洋建設	95.2	97.2	91,368	
五洋建設	336.5	425.6	265,574	
世紀東急工業	40.8	39.6	33,184	
福田組	9.1	11.3	50,793	
住友林業	217.2	230.3	595,786	
日本基礎技術	23.3	15.7	8,054	
巴コーポレーション	37.7	24.5	10,510	
大和ハウス工業	783.8	838.9	2,606,462	
ライト工業	53.4	57.2	112,169	
積水ハウス	920.6	940.4	2,489,238	
日特建設	17.5	28.6	27,742	
北陸電気工事	17.6	20.6	15,903	
ユアテック	48.6	66.1	53,012	
日本リーテック	17.8	19.8	17,760	
四電工	9.2	12.6	24,116	
中電工	39.1	46.6	102,100	
関電工	138	164.5	150,353	
きんでん	189.6	211.3	332,586	
東京エネシス	28.2	29.9	26,611	
トーエネック	8.5	10	34,000	
住友電設	21	28.6	70,928	
日本電設工業	46.5	49.3	77,055	
エクシオグループ	127.6	138.3	332,058	
新日本空調	22.4	16.7	31,730	
九電工	65.5	73	245,280	
三機工業	55.2	66.6	96,769	
日揮ホールディングス	261.5	296.9	475,040	
中外炉工業	8.5	9.8	17,826	
ヤマト	24.9	16.1	13,926	
太平電業	18.8	18.6	74,028	
高砂熱学工業	76.7	72.4	147,334	
三晃金属工業	3.3	2.7	10,408	
朝日工業社	5.7	12.5	26,700	
明星工業	54.9	51.6	39,783	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
大氣社	41.3	36.1	130,140	
ダイダシ	18.8	19.7	46,964	
日比谷総合設備	27.3	25.8	53,406	
フィル・カンパニー	4.9	5.3	5,353	
テスホールディングス	17.7	32.3	34,205	
インフロニア・ホールディングス	361.9	314.6	325,611	
東洋エンジニアリング	35.6	39.7	21,398	
レイズネクスト	41	43.4	64,362	
食料品 (3.5%)				
ニッポン	79.5	81.2	134,386	
日清製粉グループ本社	306.9	278.7	437,280	
日東富士製粉	3.9	5.4	23,760	
昭和産業	25.7	26.3	67,091	
鳥越製粉	24.1	15.6	9,328	
中部飼料	30.6	41.7	43,451	
フィード・ワン	36.5	44	29,656	
東洋精糖	4.6	3.7	3,415	
日本甜菜製糖	14.2	17.5	29,592	
DM三井製糖ホールディングス	24.7	29.9	61,115	
塩水港精糖	32.4	25.7	5,268	
ウエルネオシュガー	12.9	15.6	26,395	
森永製菓	63.8	55.8	213,993	
中村屋	6.5	7.5	23,700	
江崎グリコ	74.8	86.2	285,322	
名糖産業	12	11.9	20,087	
井村屋グループ	15.4	16.5	36,943	
不二家	15.2	20.7	50,963	
山崎製パン	203.6	201.7	318,686	
第一屋製パン	5.2	3.7	1,457	
モロゾフ	8.6	9.7	33,028	
亀田製菓	15.5	19.2	83,232	
寿スピリッツ	26.2	32.1	284,406	
カルビー	123.8	138	389,436	
森永乳業	50.3	54.8	270,438	
六甲バター	19.8	22.1	29,591	
ヤクルト本社	201.2	215.3	2,038,891	
明治ホールディングス	179.6	186.8	1,197,388	
雪印メグミルク	65.4	72.9	132,459	
プリマハム	34	40.5	90,234	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本ハム	103.8	117.8	462,954
林兼産業	8.2	6.5	3,126
丸大食品	26.7	30.3	44,328
S Foods	24.4	33.2	94,354
柿安本店	9.4	11.8	25,346
伊藤ハム米久ホールディングス	174.9	234.2	168,155
サッポロホールディングス	92.7	99.2	332,816
アサヒグループホールディングス	639.1	696.3	3,349,203
キリンホールディングス	998.5	1,359.9	2,806,833
宝ホールディングス	184.6	205.7	214,956
オエノンホールディングス	77.2	90.1	23,966
養命酒製造	8.3	9.9	18,552
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	190.7	236.1	329,359
サントリー食品インターナショナル	181.8	212.2	1,030,231
ダイドーグループホールディングス	13.9	17.1	83,277
伊藤園	82.5	102.1	441,582
キーコーヒー	26.7	33.8	68,850
ユニカフェ	8.2	6.5	5,817
ジャパンフーズ	3.9	3.1	3,419
日清オイリオグループ	34	42.4	139,284
不二製油グループ本社	58.9	70.2	131,835
かどや製油	3	1.9	6,973
J-オイルミルズ	25.3	30.7	47,124
キッコーマン	195.5	199.7	1,322,014
味の素	599.9	737.5	3,278,187
ブルドックソース	11.4	12	23,052
キュービー	142.7	162	359,964
ハウス食品グループ本社	101.6	92.3	254,932
カゴメ	103.1	140.4	431,730
焼津水産化学工業	13.2	8.7	7,716
アリアケジャパン	24.8	26.3	125,451
ビエトロ	3.5	2.8	5,255
エバラ食品工業	5.9	8.1	25,353
やまみ	2.3	1.9	2,511
ニチレイ	123.9	138.1	373,974
東洋水産	130.5	152.3	842,219
イートアンドホールディングス	10.2	12.8	28,582
大冷	3	2.4	4,605
ヨシムラ・フード・ホールディングス	14	19.1	20,666

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日清食品ホールディングス	106.6	106	1,258,220
永谷園ホールディングス	12.1	14.8	31,035
一正蒲鉾	11.7	8.3	6,025
フジッコ	25.3	31	57,846
ロック・フィールド	29.3	33.7	51,898
日本たばこ産業	1,456.6	1,983.9	5,431,918
ケンコーマヨネーズ	15.2	20.7	25,212
わらべや日洋ホールディングス	17.8	22.2	39,360
なとり	15.2	18.9	37,195
イフジ産業	4.7	3.7	3,799
ピックスコーポレーション	13	—	—
ファーマフーズ	25.7	46.6	65,706
ユウグレナ	138.4	194	180,614
紀文食品	15.8	23.5	22,654
ピックスホールディングス	—	17.7	21,045
ミヨシ油脂	10.4	6.9	6,534
理研ビタミン	28.2	26	50,076
繊維製品 (0.5%)			
片倉工業	29.6	28.2	50,196
グンゼ	16.9	23	104,190
東洋紡	104.8	132.5	136,740
ユニチカ	72.8	92.5	19,887
富士紡ホールディングス	11.8	12.1	38,841
倉敷紡績	22.7	22.9	55,509
シキボウ	13.9	11	11,297
日本毛織	79.9	80.8	78,133
ダイトウボウ	42.9	34.2	2,872
トーア紡コーポレーション	9.8	7.7	2,710
ダイドーリミテッド	34.8	30.1	9,120
帝国繊維	29.9	34.6	57,090
帝人	249.5	294.5	400,225
東レ	1,919.5	2,054	1,535,981
住江織物	5.2	3.6	7,196
日本フェルト	15	11.9	4,950
イチカワ	3.4	2.5	3,405
日東製網	2.8	2.3	3,680
アツギ	20.4	15	5,910
ダイニック	10	6.8	5,351
セーレン	54.3	59.2	135,390

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソトー	9.7	7.7	6,221
東海染工	3	2.4	2,664
小松マテール	43.5	44.4	30,369
ワコールホールディングス	66.1	59.1	144,676
ホギメディカル	35.7	41.1	129,876
クラウディアホールディングス	6.5	4.5	1,728
T S I ホールディングス	88.5	103.2	61,300
マツオカコーポレーション	8.5	6.1	8,430
ワールド	34.7	39.4	55,908
三陽商会	12.7	9.3	13,401
ナイガイ	9	7.1	1,853
オンワードホールディングス	159.3	198.8	72,959
ルックホールディングス	8.4	5.7	12,716
キムラタン	148.7	120.7	2,655
ゴールドウイン	47.8	54.3	638,025
デサント	51.7	52.8	217,008
キング	12.5	9.9	4,979
ヤマトインターナショナル	23.3	15.6	3,993
パルプ・紙 (0.2%)			
特種東海製紙	16.3	13.7	40,812
王子ホールディングス	1,108.2	1,277.1	673,031
日本製紙	127	159.7	161,456
三菱製紙	37.6	26.9	9,415
北越コーポレーション	173.8	193.7	166,194
中越パルプ工業	10.1	8	7,984
巴川製紙所	7.9	6.2	4,222
大王製紙	127.8	135.4	138,649
阿波製紙	6.8	4.7	3,233
レンゾー	250.6	279.2	235,644
トーモク	16.3	17.7	27,771
ザ・バック	20.1	22.8	67,875
化学 (6.3%)			
北の達人コーポレーション	94.8	129.2	43,023
クラレ	387.7	487.4	572,207
旭化成	1,757.1	1,914.5	1,746,598
共和レザー	16.5	11.4	6,133
レゾナック・ホールディングス	229.9	296.3	618,378
住友化学	1,947.6	2,274.2	996,099
住友精化	11.7	12.8	55,808

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日産化学	144.2	145.6	867,776
ラサ工業	9.3	11.8	24,815
クレハ	21	26.2	217,460
多木化学	10.3	11.9	54,859
テイカ	19.4	20.6	24,102
石原産業	44.1	55.5	61,438
片倉コープアグリ	6	4.7	8,182
日本曹達	33.9	32.9	152,820
東ソー	382.5	409.3	729,372
トクヤマ	84.8	99	207,207
セントラル硝子	43.3	49.2	144,598
東亜合成	147.3	153.7	183,978
大阪ソーダ	24.7	18.4	75,808
関東電化工業	58	59.3	60,070
デンカ	96.7	111.5	302,722
信越化学工業	455.2	509.7	10,683,312
日本カーバイド工業	9.5	7.5	9,975
堺化学工業	18.6	23.3	40,775
第一稀元素化学工業	24.6	27.9	27,872
エア・ウォーター	251	289.3	477,634
日本酸素ホールディングス	254.8	297.4	697,105
日本化学工業	8.2	10.2	19,584
東邦アセチレン	4.4	4.2	5,539
日本パーカライズニング	133.7	151.8	148,764
高圧ガス工業	42	44.5	31,105
チタン工業	3.1	2.4	3,540
四国化成ホールディングス	34.6	36.4	49,977
戸田工業	5.6	7	17,983
ステラ ケミファ	13.3	18.1	47,041
保土谷化学工業	8.5	8.7	25,586
日本触媒	44.6	46.7	244,241
大日精化工業	21.9	21.3	37,530
カネカ	68.6	70	234,150
三菱瓦斯化学	246.6	228.9	442,921
三井化学	240.8	252.8	834,240
J S R	247	286.2	892,944
東京応化工業	43	53.6	402,536
大阪有機化学工業	22.6	23.1	49,295
三菱ケミカルグループ	1,772.2	2,068.8	1,584,080

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
KHネオケム	43.7	51	115,158
ダイセル	381.9	450.8	438,177
住友ベークライト	41.7	45.4	222,460
積水化学工業	554.7	627	1,155,561
日本ゼオン	239.1	183.9	255,437
アイカ工業	73.8	77.4	233,361
UBE	124.9	158	318,370
積水樹脂	40	44.6	91,296
タキロンシーアイ	57.4	67	33,165
旭有機材	15	20.4	63,546
ニチバン	15.7	19	35,872
リケンテクノス	64.7	66	37,884
大倉工業	13.6	14.2	28,101
積水化成成品工業	35.5	43	17,716
群栄化学工業	6	7.2	18,208
タイガースポリマー	13.9	10.1	4,534
ミライアル	8.5	6.7	10,907
ダイキアクシス	10.3	7.3	5,088
ダイキョーニシカワ	55.9	67.7	43,192
竹本容器	9.5	6.7	5,594
森六ホールディングス	14.3	15.5	28,520
恵和	7.2	19.8	29,482
日本化薬	208.8	234.2	275,419
カーリットホールディングス	26.3	27.5	18,837
日本精化	21.3	17.4	43,917
扶桑化学工業	23.9	28.5	105,307
トリケミカル研究所	27.3	40.9	97,710
ADEKA	122.1	106.9	233,148
日油	90.5	94.8	565,956
新日本理化	43.9	29.8	6,198
ハリマ化成グループ	19.7	13.9	12,662
花王	598.8	746.5	3,822,826
第一工業製薬	9.9	11	20,570
石原ケミカル	13.4	14	19,460
日華化学	8.9	8	6,592
ニイタカ	5.5	3.9	7,963
三洋化成工業	15.8	18.9	82,593
有機合成薬品工業	18.5	14.7	4,292
大日本塗料	32.5	37.4	31,453

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本ペイントホールディングス	996	1,356.6	1,618,423
関西ペイント	274.9	280.8	498,700
神東塗料	20.8	16.5	2,227
中国塗料	62.5	50.4	53,726
日本特殊塗料	19.8	12.6	11,743
藤倉化成	33	41.2	17,716
太陽ホールディングス	39	46.6	115,241
D I C	112	119.8	278,055
サカタインクス	52.6	68.2	68,677
東洋インキSCホールディングス	56	60	119,460
T&K TOKA	21.4	27.2	29,348
富士フイルムホールディングス	475.7	589	3,824,377
資生堂	504.2	640.9	3,850,527
ライオン	326.8	368.3	533,666
高砂香料工業	18.6	20.8	54,454
マンダム	56.8	66.3	97,394
ミルボン	33.4	45.5	247,975
ファンケル	109.5	134.3	334,675
コーセー	50.9	62.4	969,072
コタ	17.2	25.7	44,075
シーボン	3.5	2.8	4,524
ポーラ・オルビスホールディングス	115.5	157.4	268,996
ノエビアホールディングス	23	27.4	147,412
アジupanホールディングス	6.1	4.8	4,708
新日本製薬	7.3	17.5	25,585
アクシージア	—	10.5	12,001
エステー	17.4	23.7	37,137
アグロ カネショウ	9	12.3	20,172
コニシ	44.5	51.3	94,853
長谷川香料	46.7	63.5	177,673
星光PMC	15.3	10.1	5,353
小林製薬	75.8	89.3	716,186
荒川化学工業	22.6	26	25,974
メック	20.2	25.3	62,313
日本高純度化学	7.4	7.6	20,269
タカラバイオ	70.8	82.7	144,807
J C U	30.4	34.7	114,683
新田ゼラチン	17	12.3	10,688
OATアグリオ	11.2	8.1	11,437

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
デクセリアルズ	70.4	88.6	234,878	
アース製薬	22.3	27.8	129,826	
北興化学工業	25.2	30.9	24,936	
大成ラミック	8.3	9.7	28,110	
クミアイ化学工業	100.7	121.9	102,030	
日本農薬	48.2	56.3	37,495	
アキレス	17.3	20	27,320	
有沢製作所	39.5	49.7	66,399	
日東電工	163.6	222.8	1,878,204	
レック	35.3	43.7	36,839	
三光合成	30.9	38.6	21,963	
きもと	41.4	32.9	6,580	
藤森工業	24.3	24.3	76,180	
前澤化成工業	17.2	19.8	29,106	
未来工業	9.7	11	18,854	
ウェーブロックホールディングス	10.3	7.9	4,811	
J S P	15.8	21.6	33,998	
エフビコ	49.7	58.1	183,305	
天馬	21.3	26.1	60,134	
信越ポリマー	48.6	56.7	82,782	
東リ	67.4	49	13,328	
ニフコ	90.3	110.7	400,734	
バルカー	22	25.7	89,307	
ユニ・チャーム	521.7	639.5	3,413,651	
ショーエイコーポレーション	7.3	5.7	3,306	
医薬品 (5.6%)				
協和キリン	317.7	370.8	1,064,196	
武田薬品工業	2,127.5	2,716.5	11,667,367	
アステラス製薬	2,346.9	2,941.7	5,490,683	
住友ファーマ	167.2	227.7	184,209	
塩野義製薬	340.4	392.3	2,338,500	
わかもと製薬	32.2	20.9	4,995	
日本新薬	70.8	72.4	427,160	
中外製薬	846.6	960.9	3,143,103	
科研製薬	42.5	52.6	198,039	
エーザイ	324	373.4	2,726,940	
ロート製薬	138.9	297.3	787,547	
小野薬品工業	621.6	592.2	1,627,957	
久光製薬	71.6	68.2	251,658	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
持田製薬	34.1	36.8	122,728	
参天製薬	504.9	577.7	659,733	
扶桑薬品工業	9.5	9.7	19,516	
日本ケミファ	3.2	2.3	4,146	
ツムラ	83.9	96.6	252,995	
日医工	84	—	—	
キッセイ薬品工業	47.9	47.4	124,330	
生化学工業	47.7	58.5	46,566	
栄研化学	47.6	49.8	77,837	
日水製薬	9.9	—	—	
鳥居薬品	14.5	16.5	50,655	
J C R ファーマ	76.3	103.9	160,317	
東和薬品	39	47.2	89,868	
富士製薬工業	16.6	19.8	22,215	
ゼリア新薬工業	49.1	42.6	93,762	
そーせいグループ	—	84.8	181,556	
第一三共	2,127.1	2,674.2	12,552,694	
キョーリン製薬ホールディングス	54.3	66.6	113,819	
大幸薬品	40.8	55.6	21,016	
ダイト	17.6	21.5	52,653	
大塚ホールディングス	562.5	702.3	2,821,841	
大正製薬ホールディングス	64.4	68.2	373,736	
ペプチドリーム	142	148.8	266,203	
あすか製薬ホールディングス	30.8	31.5	37,170	
サワイグループホールディングス	59.3	70.2	256,932	
石油・石炭製品 (0.5%)				
日本コークス工業	228.7	276.8	22,974	
ニチレキ	34.6	36.3	55,284	
ユシロ化学工業	14	15.9	13,244	
ビービー・カストロール	9.7	7.7	6,891	
富士石油	72.3	62.6	16,276	
MORESCO	9	7.1	8,207	
出光興産	300.4	340.9	989,632	
ENEOSホールディングス	4,071.9	5,545.8	2,574,914	
コスモエネルギーホールディングス	78.4	121.3	487,626	
ゴム製品 (0.8%)				
横浜ゴム	156.7	174.7	456,840	
TOYO TIRE	142.5	176.4	260,542	
ブリヂストン	779.7	980.2	5,113,703	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
住友ゴム工業	243.2	301.1	342,952	
藤倉コンポジット	21.7	17.2	16,924	
オカモト	16.1	17	65,705	
フコク	11.8	16.1	16,405	
ニッタ	28	31.2	91,322	
住友理工	52.5	59.5	39,329	
三ツ星ベルト	32.9	44.8	177,632	
バンドー化学	43.6	48.6	51,467	
ガラス・土石製品 (0.7%)				
日東紡績	40.3	34.5	69,690	
AGC	248.5	312.4	1,497,958	
日本板硝子	129.9	156.5	92,961	
石塚硝子	4.6	3.4	5,086	
日本山村硝子	10.3	7.4	4,721	
日本電気硝子	108.7	125.3	310,368	
オハラ	10.7	14.6	16,293	
住友大阪セメント	50.1	43.2	158,112	
太平洋セメント	153.8	195.5	475,651	
日本ヒューム	27.1	26.9	18,937	
日本コンクリート工業	53.4	59.5	14,815	
三谷セキサン	12.6	12.9	56,050	
アジアバイルホールディングス	41.6	48	34,992	
東海カーボン	226.8	257.5	311,317	
日本カーボン	13.9	17.6	69,608	
東洋炭素	17.6	19.2	75,072	
ノリタケカンパニーリミテド	15	15.3	69,615	
TOTO	193.3	202.6	888,401	
日本碍子	293.2	363.2	631,968	
日本特殊陶業	205.9	233.7	645,479	
ダントーホールディングス	17.6	14	7,196	
MARUWA	9.4	11.3	199,445	
品川リフラクトリーズ	6.3	8.6	38,571	
黒崎播磨	4.6	6.3	40,194	
ヨータイ	17.2	20.5	29,868	
東京窯業	34.4	21.2	6,932	
ニッカトー	12.2	8.9	5,687	
フジミインコーポレーテッド	21.7	24.4	168,848	
クニミネ工業	8.5	6.7	6,257	
エーアンドエーマテリアル	4.6	3.6	3,326	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ニチアス	62.7	77.6	204,010	
ニチハ	37.6	38.4	101,875	
鉄鋼 (0.9%)				
日本製鉄	1,197.9	1,414	4,239,172	
神戸製鋼所	499.6	635.1	638,910	
中山製鋼所	42.4	65	59,670	
合同製鐵	14.4	15.7	50,475	
JFEホールディングス	722.9	843.9	1,356,147	
東京製鐵	91.2	88.7	117,172	
共英製鋼	30.2	36	56,088	
大和工業	51.2	52.1	274,046	
東京製鋼	11.8	15	25,800	
大阪製鐵	14.2	14.5	18,009	
淀川製鋼所	35.1	35.9	95,458	
中部鋼板	—	25.9	58,922	
丸一鋼管	94.8	96.1	271,002	
モリ工業	7.9	5.2	18,200	
大同特殊鋼	43.8	39.8	202,184	
日本高周波鋼業	9.9	7.8	2,862	
日本冶金工業	19.5	23.1	94,594	
山陽特殊製鋼	27.5	31.2	75,441	
愛知製鋼	15	18.2	40,440	
日立金属	288.3	—	—	
日本金属	6.8	5.3	4,876	
大太平洋金属	16.5	22.4	41,932	
新日本電工	172.8	201.8	68,612	
栗本鐵工所	12.1	15	29,745	
虹技	3.7	2.7	2,737	
日本鑄鉄管	2.8	2.2	2,158	
三菱製鋼	17.2	19.8	22,809	
日亜鋼業	34.8	24.1	6,964	
日本精線	4.4	4.3	19,866	
エンビプロ・ホールディングス	8.9	14.1	8,403	
シンニッタン	32.4	25.7	6,502	
新家工業	6.6	4.4	10,071	
非鉄金属 (0.7%)				
大紀アルミニウム工業所	40.3	44.9	64,072	
日本軽金属ホールディングス	67.7	85.1	123,820	
三井金属鉱業	72.2	91.9	297,296	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東邦亜鉛	14.8	18.7	37,605	
三菱マテリアル	176.8	210.7	439,098	
住友金属鉱山	342.1	366.1	1,812,561	
DOWAホールディングス	72.9	70.9	296,716	
古河機械金属	44.2	46.3	59,402	
エス・サイエンス	132	94.3	2,357	
大阪チタニウムテクノロジーズ	30.9	46.3	147,697	
東邦チタニウム	47.9	57.1	128,874	
UACJ	40.6	44.3	113,673	
CKサンエツ	5.6	7.6	31,882	
古河電気工業	83.1	105.1	250,558	
住友電気工業	1,000.8	1,090.4	1,789,346	
フジクラ	298.4	338.6	306,433	
昭和電線ホールディングス	23.3	35.3	64,881	
東京特殊電線	4	—	—	
タツタ電線	47.2	64.2	45,582	
カナレ電気	4	3.1	3,847	
平河ヒューテック	14.8	18.2	26,917	
リョービ	32.9	33.6	48,854	
アーレスティ	28.5	22.6	10,938	
アサヒホールディングス	107.2	127.7	256,677	
金属製品 (0.6%)				
稲葉製作所	15.1	18.5	26,492	
宮地エンジニアリンググループ	8.1	8.7	32,103	
トーカロ	69	86.8	111,451	
アルファCo	10.3	7.5	7,567	
SUMCO	412	601.2	1,171,137	
川田テクノロジーズ	5.5	7.4	27,639	
RS Technologies	8.7	21.1	66,570	
ジェイテックコーポレーション	3.4	2.7	7,222	
信和	16.6	13.1	9,563	
東洋製織グループホールディングス	170.5	209	368,885	
ホッカンホールディングス	14.7	17	23,188	
コロナ	14.8	17.6	16,121	
横河ブリッジホールディングス	45.9	41.7	87,611	
駒井ハルテック	5	3.3	5,656	
高田機工	2.4	1.8	4,950	
三和ホールディングス	252.4	290.8	466,538	
文化シヤッター	84.9	90.9	99,353	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
三協立山	34.5	36.1	25,233	
アルインコ	19.4	24.1	25,064	
東洋シヤッター	5.9	4.7	2,444	
LIXIL	421.3	460.1	974,951	
日本フィルコン	18.6	13.3	6,064	
ノーリツ	51.2	46.5	78,957	
長府製作所	27.2	31.8	67,606	
リンナイ	50.4	57.3	545,496	
ダイニチ工業	12.8	10.1	6,878	
日東精工	33.6	45.8	25,098	
三洋工業	3.3	2.6	4,885	
岡部	51.1	50.8	38,557	
ジーテクト	33.2	35.2	49,491	
東プレ	49.9	55.6	65,218	
高周波熱錬	47.8	51.5	35,123	
東京製綱	16.4	18.6	21,390	
サンコール	22.9	18.1	10,697	
モリテック スチール	20.9	16.5	5,181	
パイオラックス	38.4	43.6	82,447	
エイチワン	26.2	32.5	20,117	
日本発條	246.1	279.3	257,235	
中央発條	12.9	17.5	12,442	
アドパネクス	3.5	2.8	3,290	
立川ブラインド工業	11.8	14.3	18,389	
三益半導体工業	20.9	24.4	68,710	
機械 (5.4%)				
日本ドライケミカル	6.6	4.8	8,424	
日本製鋼所	81.3	85.1	208,750	
三浦工業	115.8	129.1	427,321	
タクマ	90.7	95	124,260	
ツガミ	58.8	68.7	96,180	
オークマ	31.2	30.9	177,984	
芝浦機械	30.2	30.9	92,854	
アマダ	422.5	493.2	604,663	
アイダエンジニアリング	70	63.6	51,834	
TAKISAWA	7.7	6.1	7,442	
FUJI	123.3	134.4	294,470	
牧野フライス製作所	29.3	34.2	160,740	
オーエスジー	123.9	147.6	283,834	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ダイジェット工業	3	2.2	1,839	
旭ダイヤモンド工業	70.2	86.3	77,497	
DMG森精機	158.8	187.4	395,788	
ソディック	58.8	85.2	63,133	
ディスコ	39.4	49.6	2,202,240	
日東工器	14.7	15	27,300	
日進工具	21	25.8	26,625	
パンチ工業	22.4	18.2	8,099	
富士ダイス	13.4	10.7	9,480	
豊和工業	13.7	10.9	9,602	
ニデックオーケーケー	9.6	—	—	
石川製作所	7	5.5	7,485	
東洋機械金属	17.4	13.8	8,252	
津田駒工業	5.1	3.6	1,875	
エンシュウ	5.9	4.7	3,153	
島精機製作所	39.1	49.2	90,380	
オプトラン	33.5	45.7	98,574	
NCホールディングス	7.5	5.4	10,314	
イワキポンプ	17	20.6	26,306	
ブリュー	23.8	32.4	39,042	
ヤマシンフィルタ	54	73.7	24,542	
日阪製作所	33	30	26,820	
やまびこ	51.9	50.5	64,135	
野村マイクロ・サイエンス	7	10.5	43,627	
平田機工	12.7	14.8	97,976	
ベガサスミシン製造	27.1	34.1	21,551	
マルマエ	11	14.9	27,475	
タツモ	12.5	17	36,703	
ナブテスコ	152.6	194	610,130	
三井海洋開発	28.4	38.7	52,167	
レオン自動車	28.6	32.5	42,477	
SMC	79.3	100.2	6,864,702	
ホソカワミクロン	18.8	23.7	67,379	
ユニオンツール	10	13.6	43,656	
オイレス工業	37.5	43.2	72,489	
日精エー・エス・ビー機械	9	14.1	54,567	
サトーホールディングス	35.2	44	96,448	
技研製作所	23.7	32.3	87,177	
日本エアータック	12.3	15.6	17,394	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
カワタ	8.5	6.3	5,336	
日精樹脂工業	18.7	22.9	23,151	
オカダアイオン	8.4	6.7	11,751	
ワイエイシイホールディングス	10.7	8.5	23,247	
小松製作所	1,226.7	1,448.4	4,689,919	
住友重機械工業	154.9	182.9	566,990	
日立建機	108.5	123.1	364,745	
日工	37	45.8	29,357	
巴工業	10.6	13.3	31,600	
井関農機	25.1	28.9	33,235	
TOWA	23.1	31.5	65,205	
丸山製作所	5.5	3.3	5,850	
北川鉄工所	12.2	12.2	12,956	
ローツェ	13.3	16.2	186,138	
タカキタ	9.4	6.5	2,697	
クボタ	1,311.2	1,635.8	3,129,285	
荏原実業	12.4	14.8	40,300	
三菱化工機	8.6	10	22,700	
月島機械	49.8	41.8	45,562	
帝国電機製作所	18.9	22.4	54,880	
東京機械製作所	11	6.2	3,143	
新東工業	59.6	62.5	50,687	
澁谷工業	23.7	29	69,020	
アイチ コーポレーション	38.5	43.7	35,615	
小森コーポレーション	68.6	71.6	67,733	
鶴見製作所	20.8	23.6	47,388	
住友精密工業	4	—	—	
日本ギア工業	9.6	7.6	3,883	
酒井重工業	4.8	3.5	13,895	
荏原製作所	108.2	126.5	752,675	
石井鐵工所	3.8	2.5	5,712	
西島製作所	24.5	26.7	40,984	
北越工業	25.3	31.1	42,233	
ダイキン工業	344.9	369	8,505,450	
オルガノ	7.8	42.4	144,372	
トーヨーカネツ	10.2	11.7	31,578	
栗田工業	146.5	172.9	1,023,568	
椿本チエイン	35.4	43.8	140,598	
大同工業	11.9	8.7	6,542	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
木村化工機	22.5	23.6	15,505	
アネスト岩田	42.1	52.6	51,653	
ダイフク	149	159.4	1,149,274	
サムコ	6.8	10.1	43,531	
加藤製作所	12.8	10.2	9,883	
油研工業	4.5	3.3	6,623	
タダノ	141.5	163	162,348	
フジテック	100.4	113.2	340,732	
CKD	79.9	85.5	183,312	
キトー	23	—	—	
平和	75.5	102.8	262,962	
理想科学工業	22.7	27.5	64,515	
SANKYO	58.5	60.7	335,064	
日本金銭機械	27.4	34	38,794	
マースグループホールディングス	17.2	18.2	54,873	
フクシマガリレイ	18.5	22.7	104,647	
オーイズミ	9.5	7.5	3,712	
ダイコク電機	12.4	16.9	51,291	
竹内製作所	41.2	56.1	158,819	
アマノ	70.9	87.7	220,039	
JUKI	37.7	47.9	29,171	
サンデン	37.5	29.8	6,079	
ジャノメ	23	31.3	19,437	
マックス	36	38.1	80,276	
グローリー	69.5	80.1	230,367	
新晃工業	25.2	31.1	51,159	
大和冷機工業	39.1	47.4	61,809	
セガサミーホールディングス	268.5	248.5	604,849	
日本ビストンリング	9.9	7.8	10,834	
リケン	11.6	12.2	31,158	
TPR	36.4	35.3	46,807	
ツバキ・ナカシマ	59.4	76.2	72,923	
ホシザキ	79.1	199	946,245	
大豊工業	22.1	26.7	16,660	
日本精工	509.6	567.9	416,838	
NTN	581.7	609.4	194,398	
ジェイテクト	259.6	275	267,025	
不二越	23	22.8	87,210	
日本トムソン	74.1	75.7	43,603	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
THK	152.8	178.4	528,777	
ユウシン精機	21	24.5	18,081	
前澤給装工業	20.3	21.7	20,962	
イーグル工業	33.5	34.2	39,535	
前澤工業	18	12.9	8,539	
日本ビラー工業	27.4	28.7	105,903	
キッツ	91.2	113.8	104,468	
マキタ	329.4	384.6	1,257,642	
三井E&Sホールディングス	97.8	142.1	57,550	
日立造船	228.9	253.3	215,558	
三菱重工業	425.3	540.6	2,516,493	
IHI	169	194.7	624,013	
サノヤスホールディングス	33.4	24.3	3,183	
スター精密	40.8	58.3	103,424	
電気機器 (17.9%)				
日清紡ホールディングス	165.5	251.6	245,561	
イビデン	142	177.3	865,224	
コニカミノルタ	591.4	690.4	386,624	
ブラザー工業	330.5	413	812,784	
ミネベアミツミ	466.6	537.7	1,307,686	
日立製作所	1,301.9	1,503.1	10,506,669	
東芝	473	594.9	2,591,979	
三菱電機	2,706.6	3,194.8	4,955,134	
富士電機	163.1	188	955,040	
東洋電機製造	9.8	7.1	6,390	
安川電機	291.4	366.3	2,054,943	
シンフォニアテクノロジ	32.5	34.1	55,242	
明電舎	45.9	46.9	88,218	
オリジン	6.8	4.9	6,394	
山洋電気	12	13.4	79,462	
デンヨー	23.1	23.5	39,010	
PHCホールディングス	31.2	43	61,232	
ソシオネクスト	—	31.8	311,004	
東芝テック	29.1	46.2	173,481	
芝浦メカトロニクス	4.8	5.9	95,344	
マブチモーター	62.7	76.8	286,080	
日本電産	701.5	752.1	5,102,998	
ユウ・エム・シー・エレクトロニクス	11.9	22.7	10,623	
トレックス・セミコンダクター	13.6	14.5	34,452	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東光高岳	15	18.6	42,724	
ダブル・スコープ	77.8	101.1	126,678	
ダイヘン	29.6	27.9	120,946	
ヤーマン	44.1	53.4	56,657	
JVCケンウッド	220.5	281.6	108,134	
ミマキエンジニアリング	24.2	29.3	18,869	
IPEX	12.6	17.1	22,725	
日新電機	63.4	72.5	123,032	
大崎電気工業	49.7	73.3	38,409	
オムロン	225.3	283.3	2,120,500	
日東工業	36.1	41.7	110,213	
IDEC	33.5	45.6	152,988	
正興電機製作所	8.5	7.5	7,402	
不二電機工業	5	4	4,376	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	88.1	101.5	231,927	
サクサホールディングス	6.3	5	8,770	
メルコホールディングス	6	8.2	26,404	
テクノメディカ	6.1	7.5	13,627	
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	7.5	10.4	8,840	
日本電気	343.9	437.2	2,186,000	
富士通	243.5	308	5,406,940	
沖電気工業	109.9	139.8	98,838	
岩崎通信機	11	8.7	6,986	
電気興業	14.2	12.5	27,125	
サンケン電気	25.3	28.7	300,776	
ナカヨ	4.8	3.5	4,025	
アイホン	15.3	18.8	37,769	
ルネサスエレクトロニクス	1,469	2,016.9	3,576,972	
セイコーエプソン	335.8	411.7	769,879	
ワコム	209.9	244.8	170,136	
アルバック	53.9	73.4	406,636	
アクセル	11.3	8.2	14,694	
EIZO	21	22.6	88,931	
ジャパンディスプレイ	924.4	1,186.8	45,098	
日本信号	68.9	70.4	74,272	
京三製作所	58.1	64.7	27,562	
能美防災	35.8	41.8	70,182	
ホーチキ	19.6	23.1	35,458	
星和電機	12.2	7.9	3,610	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
エレコム	62	73.9	92,227	
パナソニック ホールディングス	2,887	3,651.4	4,191,807	
シャープ	308.6	372.2	352,101	
アンリツ	174.3	217.7	265,594	
富士通ゼネラル	73.5	87.6	322,806	
ソニーグループ	1,695.6	2,165	24,789,250	
TDK	392.1	489.5	2,283,517	
帝国通信工業	11.9	13.9	20,585	
タムラ製作所	104.3	132.6	105,151	
アルプスアルパイン	239.6	276.1	351,199	
池上通信機	8	6.3	3,962	
日本電波工業	24.4	37.1	46,968	
鈴木	13.3	16.5	16,929	
メイコー	22	33.7	93,551	
日本トリム	5.1	6.9	21,286	
ローランド ディー・ジー	16	17.4	54,897	
フォスター電機	27.3	28.6	33,633	
SMK	6.3	7.4	18,270	
ヨコオ	20	24.6	49,224	
ティアック	43.8	32.8	3,706	
ホシデン	65.3	72.1	114,783	
ヒロセ電機	41.7	51.1	868,700	
日本航空電子工業	62.1	63.4	146,010	
TOA	29	35.2	28,828	
マクセル	53.8	67.2	103,958	
古野電気	32.2	40.2	37,868	
ユニデンホールディングス	5.9	—	—	
スミダコーポレーション	25.4	28.3	42,393	
アイコム	10	11.9	30,118	
リオン	10.3	12.7	23,850	
本多通信工業	21	—	—	
横河電機	270.9	338.2	700,412	
新電元工業	10.4	11.8	40,356	
アズビル	158.6	213.8	744,024	
東亜ディーケーケー	13.4	10.6	8,713	
日本光電工業	111.8	141.4	507,626	
チノー	8.6	12.7	27,546	
共和電業	25.9	18.7	6,432	
日本電子材料	13.8	20.2	30,017	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
堀場製作所	50	68.2	517,638	
アドバンテスト	201.2	241.2	2,889,576	
小野測器	11.3	7.3	3,197	
エスベック	22	24.5	49,024	
キーエンス	245.3	306.2	18,993,586	
日置電機	13	16.1	135,401	
シスメックス	229	264	2,237,664	
日本マイクロニクス	47.1	50.4	64,764	
メガチップス	25.2	25.1	81,951	
OBARA GROUP	12.3	14.3	55,269	
澤藤電機	3.3	2.6	3,008	
原田工業	12.8	10.1	8,968	
コーセル	30	36.8	41,216	
イリソ電子工業	22.7	28.1	136,847	
オブテックスグループ	44.4	56.1	110,853	
千代田インテグレ	11.4	10.6	23,638	
アイ・オー・データ機器	8.7	—	—	
レーザーテック	118.9	140.3	3,076,779	
スタンレー電気	189	217.8	618,334	
岩崎電気	9.9	9.6	42,816	
ウシオ電機	138.7	159.9	261,436	
岡谷電機産業	19.3	15.3	4,773	
ヘリオス テクノ ホールディング	23	18.3	6,478	
エノモト	7.5	5.9	10,248	
日本セラミック	25.2	31.2	82,898	
遠藤照明	12.4	9.9	8,444	
古河電池	19.3	22.5	23,827	
双信電機	12.9	10.3	3,975	
山一電機	19.6	26.7	53,133	
図研	17.6	26.6	89,775	
日本電子	56.3	76.7	316,771	
カシオ計算機	195.9	228	296,400	
ファナック	237.5	300.4	6,906,196	
日本シイエムケイ	53	65	29,055	
エンプラス	6.7	8.9	39,471	
大真空	36.5	37.3	26,967	
ローム	121.2	141.5	1,488,580	
浜松ホトニクス	194.2	245.6	1,704,464	
三井ハイテック	26.5	31.6	255,960	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
新光電気工業	79.5	108.3	403,417	
京セラ	380.8	475.4	3,252,211	
太陽誘電	131.3	149	632,505	
村田製作所	795.1	928.2	7,231,606	
双葉電子工業	46.4	58.3	30,374	
北陸電気工業	10.1	8	11,040	
ニチコン	85.2	62.5	86,125	
日本ケミコン	25.6	30.2	64,144	
KO A	40.8	46.3	83,756	
市光工業	32.4	44.1	19,007	
小糸製作所	148.6	368.1	863,562	
ミツバ	49.8	57.4	28,068	
S C R E E Nホールディングス	47	52.3	604,065	
キャノン電子	24.8	33.8	61,279	
キャノン	1,345	1,679.2	4,834,416	
リコー	751.2	767.4	753,586	
象印マホービン	73.2	91.4	143,041	
M U T O Hホールディングス	3.4	2.7	4,660	
東京エレクトロン	171.7	215.9	10,525,125	
イノテック	—	20.4	28,335	
輸送用機器 (7.3%)				
トヨタ紡織	110.4	128.9	263,342	
芦森工業	5.1	4.1	5,949	
ユニプレス	40.3	54.9	48,147	
豊田自動織機	219.1	223.8	1,494,984	
モリタホールディングス	43.4	53.7	69,541	
三櫻工業	37.4	46.7	30,448	
デンソー	595.9	631.3	4,512,532	
東海理化電機製作所	71.3	86.3	134,973	
川崎重工業	197.6	230.6	637,839	
名村造船所	81.3	55.4	17,728	
日本車輛製造	9.9	11.8	23,352	
三菱ロジスネクスト	35.8	48.8	41,919	
近畿車輛	4.1	3.2	4,432	
日産自動車	3,192.2	4,347.7	2,084,722	
いすゞ自動車	849.3	889.8	1,419,231	
トヨタ自動車	13,710.5	16,805.9	30,082,561	
日野自動車	338	394.6	209,532	
三菱自動車工業	1,001.9	1,194	586,254	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
エフテック	18.9	13.7	8,740	
レシップホールディングス	10.7	8.5	4,122	
GMB	4.9	3.9	3,252	
ファルテック	4.7	3.7	2,186	
武蔵精密工業	60.4	74.8	128,656	
日産車体	39.6	54	44,658	
新明和工業	76.5	96.1	111,091	
極東開発工業	50.3	53.8	84,627	
トビー工業	22.3	24.8	46,772	
ティラド	7.7	7.7	17,486	
曙ブレーキ工業	148.6	186.8	26,712	
タチエス	47.4	48.4	57,886	
NOK	130.9	118.9	164,438	
フタバ産業	67.8	82	32,882	
KYB	28.1	29.5	113,280	
大同メタル工業	51.9	59.8	30,199	
プレス工業	134.1	136.7	66,162	
ミクニ	34.3	24.9	7,918	
太平洋工業	56.7	70.2	77,360	
河西工業	33.2	26.3	4,944	
アイシン	198.1	236.1	844,057	
マツダ	849.5	1,012.4	1,165,272	
今仙電機製作所	17.8	14.1	10,532	
本田技研工業	2,131.2	2,487.9	8,436,468	
スズキ	619.1	562.1	2,666,602	
SUBARU	775.7	968.4	2,008,461	
安永	13	8.6	8,858	
ヤマハ発動機	353.2	481	1,536,795	
TBK	29.7	21.6	5,918	
エクセディ	40.8	50.1	89,228	
豊田合成	87.4	89.3	194,138	
愛三工業	42.4	50.5	43,935	
盟和産業	3.8	3.1	3,059	
日本プラスト	21.2	15.5	6,215	
ヨロズ	25.3	28.7	23,849	
エフ・シー・シー	44.2	54.2	81,408	
シマノ	108.2	125.2	2,755,026	
テイ・エス テック	114.3	140.1	229,483	
ジャムコ	15.8	12.5	18,812	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
精密機器 (2.5%)				
テルモ	765.9	941.3	3,270,076	
クリエートメディック	8.1	6.5	5,778	
日機装	81.2	71.3	65,239	
日本エム・ディ・エム	15.6	18.2	18,509	
島津製作所	348.3	372.8	1,500,520	
JMS	22.9	28.3	14,602	
クボテック	5.8	4.6	989	
長野計器	19.6	22.2	28,593	
ブイ・テクノロジー	11.8	15	37,050	
東京計器	17.2	23.5	28,881	
愛知時計電機	11.7	11.9	17,766	
インターアクション	13.5	14.5	21,416	
オーバル	24.2	19.2	8,563	
東京精密	45.7	67.1	344,223	
マニー	107.8	134.6	239,453	
ニコン	413.3	475.8	633,765	
トプコン	127.3	161.1	278,219	
オリンパス	1,419.4	1,913.3	4,314,491	
理研計器	21.9	19	97,090	
タムロン	21	22.9	71,333	
HOYA	528.2	653.7	9,106,041	
シード	12.6	10	5,600	
ノーリツ鋼機	24.3	29	61,422	
A&Dホロンホールディングス	24.7	44.6	62,127	
朝日インテック	296.8	342	769,158	
シチズン時計	317	336.5	260,114	
リズム	8.5	6.7	12,368	
大研医器	21.4	17	8,398	
メニコン	89.8	105.1	290,076	
シンシア	2.9	1.8	990	
松風	11.3	13.8	28,000	
セイコーグループ	38.3	47.4	135,801	
ニプロ	201.7	255.1	255,355	
その他製品 (2.3%)				
KYORITSU	—	29.4	4,321	
中本パックス	7.6	6	9,342	
スノーピーク	35.3	52.4	104,904	
パラマウントベッドホールディングス	51.9	70.7	163,599	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
トランザクション	14.8	23.5	36,143	
粧美堂	7.9	5.3	2,008	
ニホンフラッシュ	23.2	28.7	27,236	
前田工織	29.8	25.8	80,754	
永大産業	35.4	23.4	5,311	
アートネイチャー	23.1	31.5	24,286	
バンダイナムコホールディングス	242.5	279.5	2,383,296	
アイフィスジャパン	6.9	5.5	3,311	
共立印刷	45.3	—	—	
SHOE I	25.4	32.3	177,650	
フランスベッドホールディングス	34.8	37.9	39,453	
パイロットコーポレーション	45.7	47.9	198,785	
萩原工業	17.5	20.5	25,153	
フジシールインターナショナル	65.7	62	92,256	
タカラトミー	113.3	141.3	209,265	
広済堂ホールディングス	16.8	13.3	29,818	
エステールホールディングス	6.5	4.6	2,902	
タカノ	9.2	7.3	5,146	
プロネクス	21	25.4	24,587	
ホクシン	19.1	15.1	2,159	
ウッドワン	8.3	6.5	9,106	
大建工業	15.9	18.6	42,631	
凸版印刷	411.4	400.3	1,017,562	
大日本印刷	319.9	363.1	1,312,606	
共同印刷	7.7	8.6	23,460	
N I S S H A	55.6	58.2	102,664	
光村印刷	2.3	1.7	2,096	
TAKARA & COMPANY	16.6	19.6	43,864	
アシックス	239.3	282.5	998,637	
ツツミ	6.7	5.4	12,236	
ローランド	18.8	22.5	85,837	
小松ウオール工業	8.2	11.2	22,680	
ヤマハ	157.4	192.9	956,784	
河合楽器製作所	7.6	8.3	24,086	
クリナップ	25.2	34.3	22,946	
ビジョン	163.6	194.9	400,714	
兼松サステック	1.7	1.4	3,143	
キングジム	23.8	27	24,192	
リンテック	58	61.4	132,746	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
イトーキ	49.9	62.7	43,388	
任天堂	152.8	1,932.3	9,845,068	
三菱鉛筆	44.6	43.5	68,991	
タカラスタンダード	55.9	59.2	86,964	
コクヨ	129.8	147.4	270,921	
ナカバヤシ	24.2	33	16,005	
グローブライド	24.2	24.7	59,798	
オカムラ	93	92.1	124,150	
美津濃	26.8	30.4	95,456	
電気・ガス業 (1.2%)				
東京電力ホールディングス	2,025.7	2,759	1,233,273	
中部電力	828.1	1,127.8	1,578,920	
関西電力	1,025.5	1,181.9	1,497,467	
中国電力	423	487.4	323,633	
北陸電力	247.5	288.9	169,295	
東北電力	633.9	748.2	471,366	
四国電力	243.7	261.3	191,271	
九州電力	557.9	705.5	518,542	
北海道電力	235.2	295.7	141,344	
沖縄電力	57.4	71.7	74,424	
電源開発	230.7	230.5	486,585	
エフオン	16.4	19.8	11,800	
イーレックス	39.8	54.3	97,740	
レノバ	53	81.5	158,191	
東京瓦斯	518.8	647.1	1,624,868	
大阪瓦斯	490.2	620	1,365,860	
東邦瓦斯	123.8	120.5	298,599	
北海道瓦斯	13.4	18.3	34,477	
広島ガス	51.6	64.6	23,256	
西部ガスホールディングス	30.5	28.7	49,679	
静岡ガス	70.4	69.8	78,734	
メタウォーター	28.1	38.3	64,765	
陸運業 (3.0%)				
SBSホールディングス	20	27.3	89,134	
東武鉄道	264.5	336.2	1,059,030	
相鉄ホールディングス	86.6	101.1	227,980	
東急	682.7	858.2	1,493,268	
京浜急行電鉄	347.6	347.2	435,041	
小田急電鉄	402.6	463.9	797,444	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
京王電鉄	140.4	161.8	760,460	
京成電鉄	188.4	197.3	787,227	
富士急行	32.3	37.7	164,937	
新京成電鉄	6.3	—	—	
東日本旅客鉄道	476.4	519.1	3,817,461	
西日本旅客鉄道	328.1	391	2,126,258	
東海旅客鉄道	225	235.8	3,762,189	
西武ホールディングス	353.4	370.2	510,505	
鴻池運輸	43.1	52.1	75,597	
西日本鉄道	75	81.7	192,893	
ハマキョウレックス	19.2	23.9	75,165	
サカイ引越センター	12.4	14.5	67,352	
近鉄グループホールディングス	256.4	305.5	1,302,957	
阪急阪神ホールディングス	320.5	407.5	1,595,362	
南海電気鉄道	114.4	146	426,174	
京阪ホールディングス	114.1	126.3	434,472	
神戸電鉄	6.1	8.3	26,435	
名古屋鉄道	210.8	337.7	694,648	
山陽電気鉄道	19.7	23	51,152	
アルプス物流	17.9	24.4	31,183	
ヤマトホールディングス	359.2	391.3	872,599	
山九	67.5	77.8	378,886	
丸運	14.6	9.7	2,201	
丸全昭和運輸	20.8	18.9	58,684	
センコーグループホールディングス	128.5	161.8	151,444	
トナミホールディングス	6.2	6.7	26,867	
ニッコンホールディングス	86	97.8	240,196	
日本石油輸送	2.8	2.2	5,154	
福山通運	42.2	23.2	81,432	
セイノーホールディングス	174.5	190.2	270,844	
エスライン	7.7	5.5	4,741	
神奈川中央交通	6.4	8.7	28,014	
日立物流	49.5	—	—	
AZ-COM丸和ホールディングス	54.1	73.8	142,212	
C&Fロジホールディングス	25.9	29.4	36,279	
九州旅客鉄道	198.3	216	648,000	
SGホールディングス	484.3	586.4	1,101,259	
NIPPON EXPRESSホールディン	88.7	114.1	884,275	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
海運業 (0.7%)				
日本郵船	214.4	817.5	2,687,940	
商船三井	141.9	538.6	1,912,030	
川崎汽船	78.9	260.3	861,593	
NSユニテッド海運	14.1	16.5	71,692	
明治海運	30.3	19.2	11,731	
飯野海運	119	112.2	114,331	
共栄タンカー	4.5	3.6	3,340	
乾汽船	17.5	38.8	77,173	
空運業 (0.5%)				
日本航空	587.8	750.5	1,895,763	
ANAホールディングス	651.2	831.4	2,338,312	
パスコ	4.8	3.9	5,541	
倉庫・運輸関連業 (0.1%)				
トランコム	7.2	8.9	64,347	
日新	20.4	23.2	47,745	
三菱倉庫	81.3	65.7	202,684	
三井倉庫ホールディングス	27.2	28.5	112,005	
住友倉庫	90.6	83.9	182,902	
澁澤倉庫	15.3	12.2	26,888	
東陽倉庫	43	28.8	8,380	
日本トランスシティ	56.4	61.5	36,654	
ケイヒン	4.4	3.5	5,635	
中央倉庫	15.6	14.7	16,052	
川西倉庫	4.7	3.7	3,725	
安田倉庫	21	20.8	21,361	
ファイズホールディングス	5.5	4.3	5,981	
東洋埠頭	7.8	5.7	7,712	
上組	141	146.5	399,505	
サンリツ	7.1	5.2	3,936	
キムラユニティ	6.7	10.6	10,801	
キューソー流通システム	12.8	11.8	11,457	
近鉄エクスプレス	48.4	—	—	
東海運	14.6	11.5	3,450	
エーアイテイ	16.1	19.2	29,990	
内外トランスライン	9.9	11	24,167	
日本コンセプト	8.2	9.5	15,523	
情報・通信業 (8.8%)				
NECネットエスアイ	87.8	102.5	165,845	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
クロスキャット	7	17.5	22,802	
システナ	378.9	516.1	151,217	
デジタルアーツ	14.3	19.4	98,746	
日鉄ソリューションズ	38.4	52.4	184,186	
キューブシステム	13.4	18.3	21,301	
WOW WORLD	3.8	—	—	
コア	11.2	13.6	21,977	
手間いらず	—	5.2	24,934	
ラクーンホールディングス	22.5	25.4	21,463	
ソリトンシステムズ	13.3	15.8	16,337	
ソフトクリエイトホールディングス	11.6	12.6	42,966	
T I S	253.3	345	1,198,875	
JNSホールディングス	12.2	9.7	3,744	
グリー	120.8	82.3	58,679	
GMOペパボ	2.8	4.4	8,258	
コーエーテクモホールディングス	84.7	192.3	472,673	
三菱総合研究所	11.4	15	75,300	
ボルテージ	7.1	5.7	1,761	
電算	2.9	2.3	4,144	
AGS	13.5	8.3	5,810	
ファインデックス	22.4	24.4	16,958	
ブレインバッド	22.5	23	15,916	
KL a b	48.7	61.1	23,034	
ポルトトゥウィンホールディングス	38.5	52.4	46,164	
ネクソン	599.3	793.8	2,464,749	
アイスタイル	68.5	89.2	49,773	
エムアップホールディングス	30.7	37.6	41,209	
エイチーム	18.3	22.6	15,255	
エニグモ	28.7	39	19,539	
テクノスジャパン	20.6	16.3	9,714	
e n i s h	16.6	14.9	6,421	
コロブラ	87.3	119	70,329	
オルトプラス	20.5	15.1	2,869	
ブロードリーフ	131.6	179.3	71,899	
クロス・マーケティンググループ	10.1	8	5,544	
デジタルハーツホールディングス	12	19.1	27,790	
システム情報	19.9	27.1	21,869	
メディアドゥ	9.3	12.4	17,843	
じげん	75.1	89.5	41,170	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ブイキューブ	27	36.8	19,246	
エンカレッジ・テクノロジー	5.8	4.6	2,364	
サイバーリンクス	8.9	6.3	5,670	
ディー・エル・イー	17.8	14.1	3,440	
フィックスターズ	28.3	34.6	49,720	
CARTA HOLDINGS	10.8	14.4	20,145	
オブティム	18.5	25.2	23,209	
セレス	9.9	12.3	15,756	
S H I F T	13.4	22.4	522,368	
ティーガイア	23.6	32.1	54,184	
セック	3.9	3.1	10,338	
テクマトリックス	44.9	56	82,488	
プロシップ	8.8	13.4	18,719	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	69	93.9	227,238	
GMOペイメントゲートウェイ	51.5	70.1	799,841	
ザッパラス	10.3	7.3	2,715	
システムリサーチ	7.7	9.6	20,112	
インターネットイニシアティブ	70.7	171.3	460,968	
さくらインターネット	28.5	34.4	21,018	
ヴェィンクス	7.4	5.9	8,029	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5.9	9.4	39,856	
SRAホールディングス	12.8	15.7	46,189	
システムインテグレータ	8.4	6.7	3,102	
朝日ネット	24.2	33	19,602	
e B A S E	31.7	43.2	29,246	
アバントグループ	28.5	38.8	56,725	
アドソル日進	9.5	12.9	21,684	
ODKソリューションズ	5.5	4.4	2,692	
フリービット	13.8	16.1	22,684	
コムチュア	29.8	40.6	85,260	
サイバーコム	4	3.2	4,614	
アステリア	19.1	24	18,888	
アイル	14.7	17.2	37,152	
マークラインズ	13.3	16.6	41,035	
メディカル・データ・ビジョン	33.6	45.8	41,174	
g u m i	36.8	44.9	33,944	
ショーケース	5.8	4.6	1,499	
モバイルファクトリー	6	4.1	3,624	
テラスカイ	9.7	13.2	23,812	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	11.7	17.7	30,090	
PC Iホールディングス	11.9	8.3	8,316	
パイブドHD	4.8	—	—	
アイビーシー	4.3	3.1	1,271	
ネオジャパン	7.5	10.2	9,006	
PR T I M E S	5.7	7.7	14,553	
ラクス	91.4	145.2	272,540	
ランドコンピュータ	6	4.8	5,179	
ダブルスタンダード	8	12.4	25,792	
オープンドア	15.8	21.5	33,991	
マイネット	9.5	6.4	2,348	
アカツキ	11.8	14.6	32,733	
ベネフィットジャパン	2	1.6	1,921	
Ubicomホールディングス	7	9.5	18,762	
カナミックネットワーク	28.3	44.1	21,564	
ノムラシステムコーポレーション	13.6	18.5	2,072	
チェンジ	49	75.2	175,065	
シンクロ・フード	13.6	10.7	4,772	
オークネット	14.1	15.1	23,238	
キャピタル・アセット・プランニング	5.3	3.8	2,363	
セグエグループ	6.8	5.5	4,301	
エイトレッド	3.8	3	4,401	
マクロミル	57.7	60.2	55,685	
ビーグリー	6.3	3.3	4,029	
オロ	8.4	9.2	19,504	
ユーザーローカル	8	11	23,518	
テモナ	5.7	3.8	1,143	
ニーズウェル	6	6.1	6,630	
マネーフォワード	40.4	73.9	365,805	
サインポスト	8.6	6.8	3,828	
Sun Asterisk	—	16.3	18,679	
電算システムホールディングス	10.9	14.8	38,243	
Appier Group	—	87.2	153,908	
ソルクシーズ	22.5	16.1	5,490	
フェイス	7	5.5	2,750	
プロトコーポレーション	28.2	38.4	45,158	
ハイマックス	7	9.6	13,795	
野村総合研究所	513.2	629.7	1,895,397	
サイバネットシステム	18.9	25.7	22,333	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
CEホールディングス	14	10.2	5,691	
日本システム技術	5.2	7.5	12,532	
インテージホールディングス	30.6	34.7	53,056	
東邦システムサイエンス	7	5.5	6,182	
ソースネクスト	114.5	156.1	33,249	
インフォコム	29	39.6	92,941	
シンプレクス・ホールディングス	31.2	51.6	119,815	
HEROZ	7.6	10.3	14,935	
ラクスル	29.1	86.8	123,429	
メルカリ	—	138.5	320,489	
I P S	7.3	10	24,300	
F I G	28.8	22.9	6,732	
システムサポート	9.6	11.9	21,063	
イーソル	16.2	19.7	15,996	
アルテリア・ネットワークス	33.6	28.6	37,037	
東海ソフト	4.1	3.3	2,973	
ウイングアーク1 s t	15.2	31.6	61,304	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン	6	8.2	12,972	
サーバーワークス	4.5	6.2	15,407	
東名	2.5	1.5	3,502	
ヴィッツ	2.4	1.9	1,732	
トビラシステムズ	5.4	4.9	5,429	
Sansan	94.4	100.4	159,134	
Link-U	4.8	3.8	3,819	
ギフティ	24.2	33.4	77,621	
メドレー	—	30.9	127,153	
ベース	4.5	10.4	57,616	
JMDC	24.9	50.4	233,352	
フォーカスシステムズ	17.8	22.4	22,713	
クレスコ	19.3	23.7	41,380	
フジ・メディア・ホールディングス	255.9	294.9	350,636	
オービック	83.7	102.6	2,137,158	
ジャストシステム	37.8	44.1	155,011	
TDCソフト	23.2	25.9	38,176	
Zホールディングス	3,860.5	4,368.4	1,639,460	
トレンドマイクロ	141.9	177.3	1,150,677	
IDホールディングス	16.7	20.7	21,155	
日本オラクル	43.1	58.7	544,149	
アルファシステムズ	7.1	9.7	38,606	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
フューチャー	56.1	76.4	137,520	
CAC Holdings	15.5	18.8	31,095	
S B テクノロジー	11.5	13	25,597	
トーセ	7.2	5.2	3,785	
オービックビジネスコンサルタント	25.3	60.4	297,772	
伊藤忠テクノソリューションズ	121	164.8	534,776	
アイティフォー	32.2	40.4	34,946	
東計電算	3.1	4.3	27,950	
エクスネット	4.2	3.3	3,356	
大塚商会	143.7	174	792,570	
サイボウズ	35.5	42.3	126,434	
電通国際情報サービス	38.3	37.3	190,230	
ACCESS	30	36.3	30,383	
デジタルガレージ	43.9	54.5	230,535	
EMシステムズ	43.8	51.2	43,110	
ウェザーニューズ	9	9.5	62,890	
C I J	17.2	25.5	27,438	
ビジネスエンジニアリング	3	4.8	13,872	
日本エンタープライズ	27	20.5	2,767	
WOWOW	12.7	17.3	21,815	
スカラ	22.3	28.4	21,158	
インテリジェント ウェイブ	13.3	10.5	7,308	
WOW WORLD GROUP	—	2.9	4,344	
IMAGICA GROUP	22.6	25.6	15,308	
ネットワンシステムズ	101.2	114.4	346,060	
システムソフト	57	106.8	8,864	
アルゴグラフィックス	20.7	28.1	100,879	
マーベラス	41.8	49.8	34,362	
エイベックス	45.8	52.1	79,244	
B I P R O G Y	82.9	113	364,990	
兼松エレクトロニクス	14.4	19.1	118,229	
都築電気	13.6	16.2	25,191	
TBSホールディングス	161.5	157.1	293,305	
日本テレビホールディングス	221.7	271.8	306,862	
朝日放送グループホールディングス	26.4	28.7	19,372	
テレビ朝日ホールディングス	63.8	74.5	110,930	
スカパーJ SATホールディングス	224.9	272.3	133,971	
テレビ東京ホールディングス	19	22.1	54,808	
日本BS放送	9	7.1	6,446	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ビジョン	45.4	40.4	65,852	
スマートバリュー	6	4.8	2,049	
USEN-NEXT HOLDINGS	25.2	27.5	67,540	
ワイヤレスゲート	10.9	8.6	2,098	
コネクシオ	18.8	—	—	
日本通信	220.9	283.3	69,691	
クロップス	4.8	3.9	5,093	
日本電信電話	2,778.6	3,933.3	15,709,600	
KDDI	1,936.4	2,372	9,710,968	
ソフトバンク	4,022.9	4,931.2	7,668,016	
光通信	30.6	36.1	664,962	
エムティーアイ	25.7	28	16,100	
GMOインターネットグループ	94	114	293,094	
ファイバーゲート	12.1	16.5	16,120	
アイドママーケティングコミュニケーション	5.7	4.5	1,314	
KADOKAWA	145	162.3	436,587	
学研ホールディングス	37.5	51.1	43,230	
ゼンリン	43.3	52.5	44,100	
昭文社ホールディングス	10.7	8.5	2,652	
インプレスホールディングス	22	17.5	3,570	
アイネット	13.6	18.6	23,715	
松竹	17.6	17.5	199,850	
東宝	156.7	192.1	964,342	
東映	8.7	8.5	146,880	
エス・ティ・ティ・データ	707.2	963.1	1,647,864	
ビー・シー・エー	15.5	17.6	22,052	
ビジネスブレイン太田昭和	9.1	13.1	26,881	
DTS	50.9	65.4	210,915	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	123.6	154.3	979,805	
シーイーシー	28.4	43	55,642	
カブコン	250.4	305	1,428,925	
アイ・エス・ビー	12.4	15.6	18,595	
ジャステック	15.4	18.8	23,913	
S C S K	183.9	250.5	483,715	
NSW	10	11.9	25,596	
アイネス	24.1	21.5	29,046	
TKC	44.9	55.1	198,360	
富士ソフト	28.3	34.7	265,108	
NSD	85.4	109.5	265,318	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
コナミグループ	96.5	131.4	821,250	
福井コンピュータホールディングス	12.2	21.3	58,894	
J B C Cホールディングス	17.9	22.4	48,809	
ミロク情報サービス	23.4	27.9	46,509	
ソフトバンクグループ	1,592.7	1,774.8	8,797,683	
卸売業 (6.1%)				
ハウスイ	2.1	—	—	
高千穂交易	10.3	7.5	19,140	
オルパヘルスケアホールディングス	4.3	3.5	5,897	
伊藤忠食品	6.4	7.3	37,084	
エレマテック	21.3	29.1	52,292	
J A L U X	7.5	—	—	
あらた	21.2	24.8	98,828	
トーマンデバイス	4	4.7	31,678	
東京エレクトロン デバイス	7.9	12	103,680	
円谷フィールズホールディングス	23.3	55.6	110,199	
双日	294.5	343.8	911,757	
アルフレッサ ホールディングス	296.3	325	549,250	
横浜冷凍	74.7	88.2	83,701	
神栄	3.7	3.1	2,737	
ラサ商事	13.1	9.6	13,804	
アルコニクス	33.1	42.6	58,021	
神戸物産	206.9	250.5	934,365	
ハイバー	6.6	3.9	1,680	
あい ホールディングス	38	51.8	114,322	
ディーブイエックス	9.1	7.2	7,524	
ダイワボウホールディングス	129.6	132.3	282,195	
マクニカホールディングス	63.6	79.4	285,840	
ラクト・ジャパン	9.2	12.5	24,925	
グリムス	11.8	13.4	30,927	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	46.3	47.3	42,238	
八洲電機	19.2	26.2	31,361	
メディアスホールディングス	15.2	20.7	15,918	
レスターホールディングス	25.3	31	67,115	
ジュウテックホールディングス	6.1	4.1	5,211	
大光	11.3	8.9	5,393	
O C H I ホールディングス	7.7	4.7	5,978	
T O K A I ホールディングス	129.1	159.9	140,712	
黒谷	7.2	5.7	3,368	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
C o m i n i x	4.6	3.7	2,956	
三洋貿易	26.8	33.2	39,375	
ビューティガレージ	4.3	5.1	19,635	
ウイン・パートナーズ	19.2	23.6	24,732	
ミタチ産業	6.7	5.3	7,679	
シップヘルスケアホールディングス	85.4	116.4	279,709	
明治電機工業	8.7	12	14,448	
デリカフーズホールディングス	10.3	8.2	4,460	
スターティアホールディングス	6	4.8	7,032	
コメダホールディングス	58.2	79.3	185,086	
ピーバンドットコム	3.7	2.9	1,629	
アセンテック	9.1	10.8	5,961	
富士興産	6.6	5.3	6,545	
協栄産業	2.7	2.1	4,584	
フルサト・マルカホールディングス	25.6	32.2	86,296	
ヤマエグループホールディングス	17.9	18.3	30,615	
小野建	25.8	29.7	44,074	
南陽	5.4	4	9,044	
佐島電機	16.6	13.1	21,130	
エコートレーディング	5.6	4.4	3,784	
伯東	16.2	18.5	87,690	
コンドテック	19.9	24.9	25,124	
中山福	14	11.1	3,873	
ナガイレーベン	35.3	40.9	81,268	
三菱食品	25.6	29.9	96,427	
松田産業	19.4	24.6	54,759	
第一興商	50.6	62.6	267,928	
メディバルホールディングス	287.7	335.8	604,440	
S P K	10.5	14.4	25,243	
萩原電気ホールディングス	9.9	12.4	39,680	
アズワン	38.2	46.1	245,713	
スズデン	9.2	11.3	29,572	
尾家産業	7	4.9	5,409	
シモジマ	16.3	22.2	21,778	
ドウシシャ	25.1	34.2	65,869	
小津産業	5.8	4.7	8,116	
高速	15.9	16.8	32,592	
たけびし	10	12.3	21,094	
リックス	6	4.3	10,788	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
丸文	23.6	28.9	39,159	
ハビネット	22.2	27.5	51,507	
橋本総業ホールディングス	5.4	12.8	14,592	
日本ライフライン	79	94.9	89,300	
タカショー	20.2	28.2	19,514	
I D O M	80.8	97.9	80,473	
進和	15.7	21.4	44,126	
エスケイジャパン	6.4	5.1	2,968	
ダイトロン	11.3	12.8	32,896	
シークス	38.1	46.1	62,235	
田中商事	8.2	6.5	4,199	
オーハシテクニカ	14.3	16.2	25,579	
白銅	8.6	11.7	29,998	
ダイコー通産	3.1	2.5	2,895	
伊藤忠商事	1,864.6	1,995.4	8,352,744	
丸紅	2,629.7	2,556.5	4,449,588	
高島	3.8	3	8,700	
長瀬産業	146.4	152.2	304,704	
蝶理	14.9	17.4	42,891	
豊田通商	267.8	283.7	1,526,306	
三共生興	35.3	46.5	25,947	
兼松	99.4	125.7	204,513	
ツカモトコーポレーション	4.4	3.5	5,145	
三井物産	2,070.3	2,369.4	8,958,701	
日本紙パルプ商事	13.9	17.2	87,548	
カメイ	31.6	34.4	47,919	
東都水産	1.4	1.1	7,128	
OUGホールディングス	3.9	3.1	7,647	
スターゼン	19.7	24.6	54,439	
山善	112.1	87.3	87,998	
椿本興業	5.5	5.2	21,814	
住友商事	1,682.6	2,005.5	4,611,647	
内田洋行	11.4	14.3	68,497	
三菱商事	1,997.7	2,024.7	9,386,509	
第一実業	12.1	11.4	61,104	
キャノンマーケティングジャパン	66.1	75	231,375	
西華産業	14	12.7	26,111	
佐藤商事	22	22.5	31,432	
菱洋エレクトロ	15.8	27.6	66,930	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東京産業	24.1	29.5	21,092	
ユアサ商事	25.3	29.2	109,646	
神鋼商事	6	8.1	47,223	
トルク	14.1	11.2	2,408	
阪和興業	53.4	58.1	218,456	
正栄食品工業	17.2	21.5	86,645	
カナデン	21.6	26.2	29,920	
菱電商事	21.1	26.1	48,650	
岩谷産業	64	73.7	419,353	
ナイス	9.2	6.5	8,677	
ニチモウ	3.8	2.5	7,650	
極東貿易	7.6	19.3	29,586	
アステナホールディングス	37.6	56	23,968	
三愛オブリ	65.6	89.4	118,723	
稲畑産業	58.7	65.4	172,786	
G S I クレオス	12.7	18.8	30,061	
明和産業	24.6	43	29,498	
クワザワホールディングス	10.5	7.5	3,667	
ワキタ	56.8	59.5	70,091	
東邦ホールディングス	85.5	80.6	186,911	
サンゲツ	70.5	81.3	182,030	
ミツウロコグループホールディングス	39.3	41.6	53,206	
シナネンホールディングス	9.9	10.5	33,022	
伊藤忠エネクス	58.9	80.3	91,220	
サンリオ	82.3	91.7	518,105	
サンワテクノス	16.2	16.5	32,818	
リョーサン	29.4	34.3	113,190	
新光商事	39.9	43.5	54,244	
トーホー	12	13.9	29,718	
三信電気	12.2	13	32,136	
東陽テクニカ	26.3	35.8	47,470	
モスフードサービス	35	47.6	143,990	
加賀電子	24.1	26.3	130,185	
ソーダニッカ	26.2	16.9	13,874	
立花エレテック	21.3	23.6	47,318	
フォーバル	11.7	12.7	13,970	
PAL TAC	37.4	50.9	245,847	
三谷産業	31.1	56.6	18,395	
太平洋興発	9.8	7.8	6,645	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
西本Wismettacホールディングス	6	8.2	29,192	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	2.4	1.9	3,581	
コア商事ホールディングス	16.6	18.1	12,851	
KPPグループホールディングス	55.4	75.4	47,954	
ヤマタネ	12.4	14.3	23,852	
丸紅建材リース	2.3	1.8	3,533	
日鉄物産	19	22.2	206,238	
泉州電業	7.3	16.2	52,893	
トラスコ中山	55.5	68	146,540	
オートバックスセブン	89.6	112.7	162,964	
モリト	19.4	23.2	23,246	
加藤産業	38.5	39.3	138,532	
北恵	6.7	4.7	3,341	
イノテック	16.1	—	—	
イエローハット	46.1	57.1	102,209	
JKホールディングス	21.4	25.5	26,188	
日伝	22.1	19.2	37,382	
北沢産業	18	11.1	3,141	
杉本商事	12.5	14.4	29,203	
因幡電機産業	71.1	83.9	238,108	
東テック	8.8	10.8	44,928	
ミスミグループ本社	334.6	488.6	1,575,735	
アルテック	17.9	11.6	3,166	
タキヒヨー	8	5.7	5,443	
蔵王産業	5.1	4.1	9,483	
スズケン	104.2	100.7	332,813	
ジェコス	18.4	20.9	18,141	
グローセル	31.1	22.9	9,847	
小売業 (4.5%)				
ローソン	59	80.4	439,788	
サンエー	20.2	24.7	101,270	
カワチ薬品	20.7	25.3	57,304	
エービーシー・マート	41.6	47.2	335,120	
ハードオフコーポレーション	11.7	9.3	12,062	
アスクル	60.3	67	111,555	
ゲオホールディングス	35.6	34.1	52,718	
アダストリア	28.7	39.1	94,582	
ジーフット	16.1	12.7	3,441	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	3.8	3.1	1,314	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
くら寿司	27.8	37.9	119,953	
キャンドウ	9.9	11.5	27,876	
IKホールディングス	8.4	6.7	2,532	
バルグループホールディングス	23.3	31.8	94,859	
エディオン	122.4	128.2	172,429	
サーラコーポレーション	54.1	68	49,164	
ワッツ	12.9	10.2	7,048	
ハローズ	12.2	14.7	45,570	
フジオフードグループ本社	22.5	26.9	37,417	
あみやき亭	6.3	7.8	24,375	
ひらまつ	56.5	44.8	8,601	
大黒天物産	8.5	9.9	49,401	
ハニーズホールディングス	23.4	25.5	39,372	
ファーマライズホールディングス	6.5	4.5	2,763	
アルペン	19.8	26.7	52,091	
ハブ	8.6	6.9	4,574	
クオールホールディングス	32.7	44.5	51,308	
ジンズホールディングス	18.1	19.2	70,272	
ビックカメラ	158.1	215.3	236,830	
DCMホールディングス	164.5	197.7	225,575	
ベッパーフードサービス	36.4	69.3	12,127	
MonotaRO	337	459.1	765,319	
東京一番フーズ	6.8	4.8	2,395	
DDホールディングス	13.9	11.1	7,947	
きちりホールディングス	7.1	5.6	3,729	
アークランドサービスホールディングス	19.5	26.5	58,750	
J. フロント リテイリング	318.3	402.6	487,951	
ドトール・日レスホールディングス	46	57.4	107,739	
マツキヨココカラ&カンパニー	163.9	196.4	1,329,628	
ブロンコビリー	15.2	17.3	42,938	
ZOZO	183.3	214	654,840	
トレジャー・ファクトリー	7.8	12.4	15,363	
物語コーポレーション	13.2	54.1	142,120	
三越伊勢丹ホールディングス	466.7	545.1	751,692	
Hamee	9.6	11.2	10,539	
マーケットエンタープライズ	2	2.1	2,631	
ウエルシアホールディングス	140.9	168	471,576	
クリエイトSDホールディングス	39.3	53.5	176,817	
丸善CHIホールディングス	31.1	24.7	8,521	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ミサワ	5.4	4.3	2,580	
ティーライフ	3.6	2.8	3,595	
エー・ビーホールディングス	5.2	4.1	3,247	
チムニー	8.1	6.5	7,748	
シュッピン	22.2	24.1	20,798	
オイシックス・ラ・大地	38.3	43.5	99,049	
ネクステージ	54	73.9	203,151	
ジョイフル本田	80.1	96.2	162,000	
鳥貴族ホールディングス	9.8	12	25,704	
ホットランド	19.9	24.8	35,984	
すかいらーくホールディングス	344.1	442.7	737,095	
SFPホールディングス	13	17.7	32,674	
綿半ホールディングス	20	25	35,900	
ヨシックスホールディングス	5.2	4.1	8,700	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	77.5	105.5	117,210	
ゴルフダイジェスト・オンライン	13.8	14.6	13,621	
BEENOS	13.4	18.3	38,100	
あさひ	22.1	27	35,640	
日本調剤	16.2	22	25,190	
コスモス薬品	26.9	32	380,160	
トーエル	13	9.3	7,402	
セブン&アイ・ホールディングス	1,042.9	1,116	6,528,600	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	142	243.6	246,036	
ツルハホールディングス	58.2	68	586,160	
サンマルクホールディングス	21.1	26.1	46,771	
フェリシモ	5.9	4.7	4,690	
トリドールホールディングス	66.3	80.5	222,019	
TOKYO BASE	24.5	33.3	16,983	
ウイルプラスホールディングス	5	4	4,456	
JMホールディングス	17.9	27.5	51,975	
サツドラホールディングス	12	9.5	7,533	
アレンザホールディングス	20.3	24.2	23,328	
串カツ田中ホールディングス	7.1	8.6	13,923	
パロックジャパンリミテッド	18.5	21	17,031	
クスリのアオキホールディングス	26.5	28.9	191,607	
力の源ホールディングス	13.6	11.2	16,520	
FOOD & LIFE COMPANIE	156.1	186	618,450	
メディカルシステムネットワーク	25.8	28.1	11,099	
一家ホールディングス	5.6	4.5	2,655	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ジャパンクラフトホールディングス	8.3	6.5	3,711	
はるやまホールディングス	12.5	9.9	4,969	
ノジマ	43.1	105.7	145,866	
カッパ・クリエイト	37.4	50.9	73,448	
ライトオン	19.9	15.8	8,784	
良品計画	306.7	417.8	593,276	
バリミキホールディングス	33	26.1	9,135	
アドヴァングループ	27.1	30.8	29,876	
アルビス	8.6	10.6	26,478	
コナカ	31.4	22.8	8,139	
ハウス オブ ローゼ	3.3	2.6	4,334	
G-7ホールディングス	29.6	40.3	57,790	
イオン北海道	46.9	47.9	38,320	
コジマ	45.8	62.4	34,008	
ヒマラヤ	9.3	6.6	6,039	
コーナン商事	37.9	43.7	139,184	
エコス	9.8	12	22,320	
ワタミ	32.3	39.1	34,916	
マルシェ	6.5	6.9	2,691	
パン・バシフィック・インターナショナルホ	533.1	653.6	1,620,274	
西松屋チェーン	58.5	71.7	117,659	
ゼンショーホールディングス	130.1	177.2	715,888	
幸楽苑ホールディングス	16.9	21.1	22,914	
ハークスレイ	11.1	8.8	6,767	
サイゼリヤ	39.5	53.8	175,657	
V Tホールディングス	100.3	123	62,238	
魚力	7.4	10	21,610	
ポプラ	6.9	4.6	625	
フジ・コーポレーション	14.1	18.3	23,643	
ユナイテッドアローズ	27.9	34.6	63,283	
ハイデイ日高	38.5	48	101,232	
YU-WA Creation Holdi	15.6	12.4	2,480	
コロワイド	109.5	149.2	284,972	
ピーシーデポコーポレーション	31	36.1	10,649	
壺番屋	18.8	25.6	125,696	
トップカルチャー	9.6	6.7	1,313	
PLANT	6.8	4.9	3,258	
スギホールディングス	53.2	65.2	366,424	
薬王堂ホールディングス	13.3	18.1	46,354	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヴィア・ホールディングス	34.6	27.8	2,641
スクロール	41	48	39,360
ヨンドシーホールディングス	24.5	27.8	49,734
木曽路	36.1	49	107,359
SRSホールディングス	37	53.4	50,730
千趣会	48.1	59.6	23,840
タカキュー	20.6	14.3	1,058
リテールパートナーズ	32.3	48	65,328
ケーヨー	49.3	52.2	43,273
上新電機	30.6	28.8	57,225
日本瓦斯	129.6	173.5	332,773
ロイヤルホールディングス	45.8	62.8	167,990
東天紅	1.9	1.5	1,108
いなげや	33	31.5	40,320
チヨダ	26	30.9	24,781
ライフコーポレーション	24.9	28.3	71,683
リンガーハット	32.9	41.8	94,342
MrMaxHD	33.3	45.3	30,033
テンアライド	25.8	21.2	5,724
AOKIホールディングス	51.6	60.2	49,303
オークワ	41.8	51.8	43,097
コメリ	41.2	49.8	135,406
青山商事	55.1	69.2	62,626
しまむら	31	38	505,400
はせがわ	14.1	11.2	4,233
高島屋	194.2	244.1	449,388
松屋	53.7	54.9	56,766
エイチ・ツー・オー リテイリング	126.3	157.6	220,640
近鉄百貨店	10.2	10.4	24,824
丸井グループ	210.4	238.8	477,122
アクシアル リテイリング	20.6	22.1	74,477
井筒屋	12.5	9.9	3,177
イオン	1,025.8	1,097.8	2,776,336
イズミ	48.2	49.2	151,290
平和堂	49.2	54.1	110,472
フジ	73	49.7	85,633
ヤオコー	30.3	36.6	250,344
ゼビオホールディングス	36.2	43.9	43,636
ケーズホールディングス	245.8	257.5	306,167

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
Olympicグループ	13.7	9.3	4,761
日産東京販売ホールディングス	39.2	31.1	10,387
シルバーライフ	5.4	7.4	9,997
Genky DrugStores	11.7	14.2	54,528
ナルミヤ・インターナショナル	6	4.5	4,144
ブックオフグループホールディングス	15.5	12.3	15,399
ギフトホールディングス	4.2	6.8	30,532
アインホールディングス	35.7	44.6	244,408
元気寿司	7.5	9.2	28,290
ヤマダホールディングス	974.8	1,327.8	628,049
アークランズ	41.7	47.4	70,341
ニトリホールディングス	105.8	131	2,139,885
グルメ杵屋	21.2	26.2	27,117
愛眼	19.5	15.5	2,697
ケーユーホールディングス	13.9	18.9	27,877
吉野家ホールディングス	93	126.7	303,826
松屋フーズホールディングス	12.8	15.3	62,806
サガミホールディングス	40.7	52	67,340
関西フードマーケット	20.1	29.2	42,778
王将フードサービス	17.6	21.3	129,078
ブレナス	29.8	—	—
ミニストップ	19.7	23.5	32,759
アークス	50.9	59.4	132,759
パローホールディングス	59	61.8	119,026
ベルク	11.8	16.1	89,516
大庄	14.3	11.3	11,526
ファーストリテイリング	35.7	145.7	4,027,876
サンドラッグ	100.3	122.9	447,356
サックスパー ホールディングス	25.1	30.8	24,147
ヤマザワ	6.2	4.4	5,605
やまや	5.5	4.3	11,347
ペルーナ	57.2	77.9	53,283
銀行業 (5.9%)			
いぎんホールディングス	—	358.7	262,927
しずおかフィナンシャルグループ	—	681.2	632,834
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	—	253.8	223,344
島根銀行	8.5	6.7	3,262
じもとホールディングス	19	14	5,460
めぶきフィナンシャルグループ	1,387.2	1,495.8	469,681

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東京きらぼしフィナンシャルグループ	33.5	38.6	95,921	
九州フィナンシャルグループ	545.2	530.4	246,105	
ゆうちょ銀行	630.2	858.3	957,862	
富山第一銀行	63.6	75.1	43,332	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,524.8	1,661.4	775,873	
西日本フィナンシャルホールディングス	174.4	190.9	188,418	
三十三フィナンシャルグループ	24.7	27	42,498	
第四北越フィナンシャルグループ	43.4	47.3	134,946	
ひろぎんホールディングス	393.8	393.3	246,599	
おきなわフィナンシャルグループ	24.1	28.7	60,470	
十六フィナンシャルグループ	35.9	39.1	107,994	
北國フィナンシャルホールディングス	24.8	25.4	97,917	
プロクレアホールディングス	—	36.9	76,825	
あいちフィナンシャルグループ	—	42.2	89,970	
SBI新生銀行	174.1	88.9	201,447	
あおぞら銀行	149.1	189.5	455,558	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	16,742.6	19,139.1	15,801,240	
りそなホールディングス	3,026.5	3,809.9	2,285,940	
三井住友トラスト・ホールディングス	504.6	547.8	2,478,795	
三井住友フィナンシャルグループ	1,847.9	2,202.8	11,313,580	
千葉銀行	890.9	840.1	690,562	
群馬銀行	501.1	584.9	254,431	
武蔵野銀行	39.8	38.7	84,404	
千葉興業銀行	62.7	45.6	22,024	
筑波銀行	104.1	132.3	27,650	
七十七銀行	83.7	96.5	202,457	
青森銀行	20.7	—	—	
秋田銀行	17.1	20.2	35,390	
山形銀行	30	33.5	33,969	
岩手銀行	17.5	20.6	44,331	
東邦銀行	222.8	238.4	52,209	
東北銀行	12.8	9.5	9,376	
みちのく銀行	17.1	—	—	
ふくおかフィナンシャルグループ	224.9	240.6	595,966	
静岡銀行	650.2	—	—	
スルガ銀行	234.1	265.7	119,565	
八十二銀行	601.3	618.3	343,156	
山梨中央銀行	28.9	31	34,906	
大垣共立銀行	52.7	57.5	102,695	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
福井銀行	22.8	26.9	39,408	
清水銀行	11	12	17,184	
富山銀行	4.8	3.3	5,507	
滋賀銀行	50.2	50.1	133,366	
南都銀行	41.6	45.4	105,555	
百五銀行	256.3	283.6	104,081	
京都銀行	95.6	95.5	585,415	
紀陽銀行	90.5	107.8	158,466	
ほくほくフィナンシャルグループ	166.6	191.6	176,655	
山陰合同銀行	158.3	188.7	138,505	
中国銀行	213.3	—	—	
鳥取銀行	8.5	6.7	7,899	
伊予銀行	353.7	—	—	
百十四銀行	28.4	27.5	50,627	
四国銀行	40.6	47.9	42,008	
阿波銀行	40.9	44.5	85,662	
大分銀行	15.4	18.1	36,543	
宮崎銀行	16.7	19.7	45,723	
佐賀銀行	15.1	17.7	28,355	
琉球銀行	58	69.1	62,673	
セブン銀行	792.8	1,079.8	286,147	
みずほフィナンシャルグループ	3,414.2	4,359.4	8,032,194	
高知銀行	9.7	6.7	4,475	
山口フィナンシャルグループ	311	332.8	264,243	
長野銀行	8.8	6.5	9,139	
名古屋銀行	19.9	19.9	62,287	
北洋銀行	402.4	456.7	126,505	
愛知銀行	9.7	—	—	
中京銀行	9.6	—	—	
大光銀行	9.1	6.3	7,112	
愛媛銀行	37.3	40.6	34,144	
トマト銀行	9.6	6.4	6,560	
京葉銀行	113.8	140	77,980	
栃木銀行	129	138	36,708	
北日本銀行	8.3	10.6	20,882	
東和銀行	46.9	55.3	30,470	
福島銀行	30.6	22.4	5,084	
大東銀行	12.8	9.3	6,175	
トモニホールディングス	206.4	243.6	84,772	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
フィデアホールディングス	24.4	31.1	41,736
池田泉州ホールディングス	307	386	88,780
証券、商品先物取引業 (0.8%)			
F P G	89.8	122.3	136,976
ジャパンインベストメントアドバイザー	20.7	24.6	25,510
マーキュリアホールディングス	10.6	11.4	8,185
S B I ホールディングス	329.4	436.3	1,165,793
日本アジア投資	21	16.7	4,342
ジャフコ グループ	102	100.6	205,324
大和証券グループ本社	1,999.3	2,155.5	1,321,321
野村ホールディングス	4,076.1	5,551.4	2,768,483
岡三証券グループ	210	264.6	127,272
丸三証券	79.3	100.3	44,232
東洋証券	88.1	100	35,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	306.6	328.1	123,693
光世証券	5.6	4.4	1,830
水戸証券	71.3	80.9	24,917
いちよし証券	49.9	55.5	34,243
松井証券	130.7	178	141,510
マネックスグループ	217.7	336.7	162,962
極東証券	35.8	37.5	22,837
岩井コスモホールディングス	25.2	34.4	48,297
アイザワ証券グループ	43.9	43.5	30,537
マネーパートナーズグループ	28.4	22.5	6,075
スパークス・グループ	123.3	33.6	48,619
小林洋行	9.5	7.5	1,755
保険業 (2.2%)			
かんぽ生命保険	268.7	366	757,986
S O M P O ホールディングス	438.3	517.3	2,756,174
アニコム ホールディングス	82	102.4	51,712
MS&ADインシュアランスグループホール	598.6	613.4	2,528,434
第一生命ホールディングス	1,314.1	1,534.5	3,583,057
東京海上ホールディングス	879.2	3,035.3	7,671,720
T & D ホールディングス	693	809	1,233,725
アドバンスクリエイト	12.8	17.4	17,974
その他金融業 (1.1%)			
全国保証	63.7	78.8	405,820
あんしん保証	7.9	8.4	2,175
ジェイリース	9	7.1	15,201

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
イントラスト	11.3	8.9	8,802
日本モーゲージサービス	14.8	11.7	8,365
C a s a	9.4	7.5	6,150
アルヒ	39.4	37.2	39,952
プレミアムグループ	13.5	50.6	82,376
ネットプロテクションズホールディングス	60.8	99.7	53,140
クレディセゾン	171.4	191	322,599
芙蓉総合リース	28	27.7	246,253
みずほリース	41.2	44.9	156,701
東京センチュリー	51.7	56.3	241,527
日本証券金融	104.9	120.9	119,811
アイフル	448	499.2	173,222
リコーリース	23.6	28.6	110,968
イオンフィナンシャルサービス	145.2	173.1	210,143
アコム	527.5	538.1	170,577
ジャックス	29.5	32.1	138,511
オリエントコーポレーション	722.2	78.7	88,144
オリックス	1,586.1	1,978.7	4,230,460
三菱HCキャピタル	986.2	1,175.3	803,905
九州リースサービス	13.1	9.1	8,190
日本取引所グループ	676.1	847	1,740,585
イー・ギャランティ	39.3	48.7	106,506
アサックス	13.9	11	7,018
NECキャピタルソリューション	10.9	14.8	37,725
不動産業 (1.8%)			
大東建託	—	110.4	1,419,744
いちご	297.3	347.1	93,369
日本駐車場開発	292.8	358.9	82,905
スター・マイカ・ホールディングス	14.4	27.2	18,740
S R E ホールディングス	6.7	14.8	48,322
A D ワークスグループ	55.4	47.4	7,868
ヒューリック	637.6	703.1	742,473
三栄建築設計	10.7	14.6	22,162
野村不動産ホールディングス	138.1	188.4	541,084
三重交通グループホールディングス	54.1	64.5	34,830
サムティ	42.9	47.9	101,835
ディア・ライフ	34.4	46.2	30,076
コーセーアールイー	7.8	6.2	4,482
地主	16.9	23	42,826

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
プレサンスコーポレーション	34.9	39.6	69,339	
THEグローバル社	14.3	11.3	2,384	
ハウスコム	4.6	3.7	4,110	
JPMC	12.8	15.2	16,020	
サンセイランディック	7.8	5.7	4,770	
エストラスト	3.1	2.5	1,462	
フージャースホールディングス	34.1	46.5	38,455	
オープンハウスグループ	84.8	110.3	538,264	
東急不動産ホールディングス	786.4	906.3	568,250	
飯田グループホールディングス	222.7	264.1	561,476	
イグランド	4.3	3	4,497	
ムゲンエステート	16.4	13	7,228	
ビーロット	18.1	13.3	8,219	
ファーストブラザーズ	6.1	3.9	3,330	
And Doホールディングス	13.1	17.9	15,948	
シーアールイー	7.4	13.7	17,645	
プロバティエージェント	3.1	2.5	2,900	
ケイアイスター不動産	12	14.5	60,175	
アグレ都市デザイン	4.3	3.5	5,663	
グッドコムアセット	11.5	28	22,344	
ジェイ・エス・ビー	5.4	7.5	31,725	
ロードスターキャピタル	5.4	12.9	17,943	
テンボイノベーション	7.4	5.9	7,103	
グローバル・リンク・マネジメント	4.7	3.7	4,558	
フェイスネットワーク	2.5	2.7	4,943	
パーク24	143.3	234.9	446,310	
バラカ	6.9	10.6	21,210	
宮越ホールディングス	10.1	13.7	10,946	
三井不動産	1,217	1,310.1	3,152,100	
三菱地所	1,754	1,818.8	2,842,784	
平和不動産	45.7	48.9	182,397	
東京建物	263.7	287.3	451,061	
ダイビル	38.7	—	—	
京阪神ビルディング	41.2	38	44,498	
住友不動産	560.1	544.9	1,582,934	
テーオーシー	48	54.5	33,299	
東京楽天地	4.4	5.2	20,930	
レオパレス21	276.8	339.3	112,308	
スターツコーポレーション	36.3	43.3	108,639	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
フジ住宅	31	42.2	28,527	
空港施設	26.7	36.4	19,765	
明和地所	12.6	9.9	8,603	
ゴールドクレスト	21.1	28.7	48,876	
エスリード	10.4	14.2	31,666	
日神グループホールディングス	43.4	48.4	22,554	
日本エスコン	49.7	67.7	56,055	
MIRARTHホールディングス	111.9	152.3	58,026	
AVANTIA	13.8	9.9	7,910	
イオンモール	133.9	156.3	265,553	
毎日コムネット	9.1	7.2	5,781	
ファースト住建	9.9	7.9	8,690	
ランド	1,453.1	1,814.2	18,142	
カチタス	66.1	81	205,821	
トーセイ	36.8	50.1	71,442	
穴吹興産	5.8	4.6	10,115	
サンフロンティア不動産	36.9	50.2	61,344	
FJネクストホールディングス	26.2	31.7	31,161	
インテリックス	6	4.7	2,458	
ランドビジネス	11.3	7.1	1,746	
サンネクスタグループ	8.5	6.4	6,361	
グランディハウス	18.1	14.4	8,179	
日本空港ビルデング	101.8	106.6	683,306	
サービス業 (5.2%)				
明豊ファシリティワークス	11.8	9.3	7,393	
日本工営	16.5	19	61,560	
LIFULL	79	107.6	23,026	
MIXI	59.2	71.6	192,890	
ジェイエイシーリクルートメント	20.9	28.4	73,016	
日本M&Aセンターホールディングス	424.2	539.9	542,599	
メンバーズ	7.7	9.2	11,932	
中広	4.1	3.3	1,349	
UTグループ	37.3	46.2	111,203	
アイティメディア	12.3	11.9	16,374	
E・Jホールディングス	14.9	18.4	26,698	
オープンアップグループ	84.3	94.3	178,698	
コシダカホールディングス	69.2	94.2	87,417	
アルトナー	6.3	4.9	6,492	
パソナグループ	28	38.2	70,440	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
CDS	6.4	5.1	9,205	
リンクアンドモチベーション	57	90.6	48,108	
エス・エム・エス	87.9	119.7	383,040	
サニーサイドアップグループ	8.9	7.1	4,409	
パーソルホールディングス	258.6	352.2	917,128	
リニカル	14.6	11.5	7,866	
クックパッド	81.3	86.1	18,769	
エスクリ	11.6	9.2	3,082	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	12.6	10	6,770	
学情	10.5	14.2	22,862	
スタジオオアリス	11.6	15.7	33,189	
シミックホールディングス	14.3	17.3	35,586	
エプロ	5.5	4.3	3,057	
NJS	5.7	6.9	15,173	
総合警備保障	102.9	116.8	416,392	
カカココム	189.8	230.9	424,625	
アイロムグループ	9.3	11.3	20,328	
セントケア・ホールディング	16.8	20	15,160	
サイネックス	4.4	3.5	2,068	
ルネサンス	18	22	20,724	
ディップ	45.5	55.1	188,442	
デジタルホールディングス	18	24.5	27,856	
新日本科学	31.5	33.4	94,054	
キャリアデザインセンター	6.5	4.2	9,252	
ベネフィット・ワン	94.1	145.8	279,207	
エムスリー	456.4	621.7	2,107,563	
ツカダ・グローバルホールディング	16.5	13.1	5,371	
プラス	3.4	2.7	2,883	
アウトソーシング	148.2	187.4	233,875	
ウェルネット	26.1	18.1	11,384	
ワールドホールディングス	10.3	14.1	35,729	
ディー・エヌ・エー	98.5	134.1	240,307	
博報堂DYホールディングス	360.1	401.3	575,062	
ぐるなび	42.4	57.8	19,305	
タカミヤ	31.3	42.7	18,446	
ジャパンバストレスキューシステム	17.5	19.5	14,157	
ファンコムコミュニケーションズ	64.6	61.6	24,701	
ライク	8.6	11.7	22,908	
ビジネス・ブレークスルー	9.6	7.6	3,564	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
エスプール	73	90.4	52,341	
WDBホールディングス	11.8	16.1	32,344	
手間いらず	3.8	—	—	
ティア	15.1	11.9	5,164	
CDG	2.8	2.2	2,633	
アドウェイズ	38.5	43.3	29,703	
バリューコマース	20.3	23.7	40,645	
インフォマート	283.4	326.6	93,081	
J Pホールディングス	66.4	90.5	31,222	
エコナックホールディングス	46.7	35.3	3,282	
CLホールディングス	5.5	8.7	7,247	
プレステージ・インターナショナル	97	132.3	77,263	
アミューズ	14.1	17.1	31,036	
ドリームインキュベータ	7	9.6	27,062	
クイック	17.7	24	43,128	
TAC	14	11.1	2,242	
電通グループ	266.6	309.2	1,357,388	
テイクアンドギヴ・ニーズ	12.1	9.3	12,248	
びあ	9	10.5	34,125	
イオンファンタジー	10	13.6	35,659	
シーティーエス	29.2	34.8	26,413	
ネクシィーズグループ	9.1	6.3	3,918	
H. U. グループホールディングス	67.6	92.1	246,091	
アルプス技研	22.9	27.4	66,801	
サニックス	45.2	50.4	14,162	
ダイオーズ	5.1	—	—	
日本空調サービス	27.1	33.8	24,606	
オリエンタルランド	305.6	333	7,287,705	
ダスキン	60	70	224,000	
明光ネットワークジャパン	30.4	41.4	26,247	
ファルコホールディングス	12.3	14.2	28,101	
秀英予備校	5.6	4.5	1,930	
田谷	4.7	3.7	1,994	
ラウンドワン	72.2	263.1	128,919	
リゾートトラスト	118.6	124.2	262,062	
ビー・エム・エル	33.3	39	120,900	
りらいあコミュニケーションズ	38.1	51.9	75,722	
リソー教育	118.1	143	46,475	
早稲田アカデミー	14.4	17.4	21,088	

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・エス・エス	289.6	323.6	734,572
東京個別指導学院	22.8	37.3	19,284
サイバーエージェント	637.5	752.9	840,236
楽天グループ	1,329.5	1,456.6	907,461
クリーク・アンド・リバー社	13.5	18.4	40,774
モーニングスター	45.2	51.3	25,803
テー・オー・ダブリュー	49.4	61.7	19,373
山田コンサルティンググループ	13.4	15.9	23,865
セントラルスポーツ	9.6	11.8	29,582
フルキャストホールディングス	22.1	30	69,390
エン・ジャパン	41.8	56.9	138,836
リソルホールディングス	2.8	2.2	11,484
テクノプロ・ホールディングス	154.9	186.1	665,307
アトラグループ	5.7	4.6	851
インターワークス	7.4	5.9	2,165
アイ・アールジャパンホールディングス	12	16.3	36,560
Keeper 技研	16.6	19.4	94,575
ファーストロジック	5	3.1	2,604
三機サービス	4.5	3.5	3,265
Gunosy	14.2	25	15,075
デザインワン・ジャパン	6.4	6.1	1,171
イー・ガーディアン	10.5	11.9	27,370
リブセンス	14.2	9.4	2,462
ジャパンマテリアル	79.5	96.3	217,156
ベクトル	36.3	49.4	74,939
ウチヤマホールディングス	12.7	10.1	2,828
チャーム・ケア・コーポレーション	19.2	26.2	28,243
キャリアリンク	9.5	11.5	29,129
IBJ	21.2	19.2	13,056
アサンテ	11.4	15.5	25,947
バリューHR	10.3	27.5	43,917
M&Aキャピタルパートナーズ	21.3	29.1	109,707
ライドオンエクスプレスホールディングス	10	11.2	12,902
ERIホールディングス	7.2	5.7	8,373
アピスト	4	3.2	9,712
シグマクシス・ホールディングス	15.6	47.7	52,040
ウィルグループ	19	26.2	28,479
エスクロー・エージェント・ジャパン	34.6	21.3	3,173
メドピア	19.9	24.8	27,552

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
レアジョブ	4.9	3.9	4,964
リクルートホールディングス	1,995.3	2,329.3	8,618,410
エラン	35.6	41.6	43,804
土木管理総合試験所	12	8.5	2,796
ネットマーケティング	12.6	—	—
日本郵政	3,377.5	4,123.5	4,504,923
ベルシステム24ホールディングス	37.2	42.2	59,755
鎌倉新書	29.4	35.7	34,557
SMN	5.6	4.7	2,110
一蔵	3.2	2.6	1,508
グローバルキッズCOMPANY	4.7	3.1	2,476
エアトリ	16.7	20.3	53,348
アトラエ	18	24.7	21,711
ストライク	9.8	15.5	59,365
ソラスト	63.5	86.7	55,054
セラク	8.2	11.2	17,785
インソース	25.1	78.1	106,450
ペイカレント・コンサルティング	18.3	249	1,342,110
Orchestra Holdings	4.9	6.7	11,256
アイモバイル	7.3	16.3	20,733
キャリアインデックス	8.8	7	2,191
MS-Japan	10.5	8.3	8,432
船場	5.2	3.5	2,586
ジャパンエレベーターサービスホールディング	82	112.1	230,365
フルテック	3.6	2.9	3,082
グリーンズ	9.7	7.7	10,556
ツナググループ・ホールディングス	5.8	5.7	3,744
GameWith	7.7	6.1	2,171
ソウルドアウト	6.2	—	—
MS&Consulting	3.8	3	1,830
ウェルビー	16.9	23.1	14,460
エル・ティー・エス	3.3	4	10,772
ミダックホールディングス	11.7	19.1	42,497
日総工産	20.2	23.6	16,685
キュービーネットホールディングス	11.9	14.9	20,860
RPAホールディングス	36.4	42.6	18,318
スプリックス	7.3	7	6,174
マネジメントソリューションズ	12.7	17.3	55,014
プロレド・パートナーズ	5.6	7.7	3,465

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
and factory	5.8	5.9	2,141
テノ.ホールディングス	3.1	2.5	2,030
フロンティア・マネジメント	6.7	10.5	10,384
ピアラ	4.2	3.3	1,953
コプロ・ホールディングス	5	4	5,740
ギークス	4.4	3.5	3,948
アンビスホールディングス	—	26.5	80,692
カーブスホールディングス	71	96.7	74,072
フォーラムエンジニアリング	18	18.3	16,488
Fast Fitness Japan	3.5	10.7	14,562
ダイレクトマーケティングミックス	29.9	37.6	51,399
ポピンズ	6	4.7	9,132
LITALICO	20.9	24.5	62,328
アドバンテッジリスクマネジメント	13.1	10.3	4,480
リログループ	141.4	175.1	358,254
東祥	19.3	21.9	24,966
ビーウィズ	—	5.9	10,148
TREホールディングス	35.4	66.2	93,011
人・夢・技術グループ	10.3	14	20,972
大栄環境	—	60	106,140
エイチ・アイ・エス	57.4	82.3	161,390
ラックランド	7.5	9.8	28,469
共立メンテナンス	46.1	53.9	284,592
イチネンホールディングス	26.5	33.3	41,458
建設技術研究所	15.5	16.2	50,382
スペース	18.4	22.8	20,428
燦ホールディングス	11.2	13.9	29,565
スバル興業	1.6	1.3	11,908
東京テアトル	10.1	7.5	8,625
タナベコンサルティンググループ	9.9	7.9	7,275
ナガワ	8.2	8.4	58,128

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京都競馬	19.3	26.3	92,444
常磐興産	10.4	7.1	9,009
カナモト	45.6	57.6	122,400
西尾レントオール	23.9	29.2	87,512
アゴーラ ホスピタリティーループ	142	112.7	2,592
トランス・コスモス	32.8	39.1	123,165
乃村工藝社	110.8	137.2	122,794
藤田観光	11.3	14	44,590
KNT-CTホールディングス	16.1	18.8	30,869
日本管財	27.7	33	85,272
トーカイ	22.7	27.8	54,071
白洋舎	2.9	1.9	3,353
セコム	254.9	320.4	2,619,270
セントラル警備保障	12.5	17	44,540
丹青社	52.9	61	47,641
メイテック	31.2	125.4	295,442
応用地質	29.1	29.4	64,356
船井総研ホールディングス	52.9	65.5	171,348
進学会ホールディングス	8.4	6.7	2,077
オオバ	18.2	12.8	9,651
いであ	6.9	4.5	7,069
学究社	8.3	12.6	24,910
ベネッセホールディングス	86.2	117.4	229,517
イオンデイライト	31.9	34.8	103,112
ナック	12.3	13.9	13,496
ダイセキ	47.1	64.2	253,590
ステップ	9.5	12.9	23,929
合 計	株数・金額 297,416	356,823	862,140,675
	銘柄数<比率>	2,176	2,162 <100.8%>

(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	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	
		百万円 11,587	百万円 —

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2023年3月27日現在)

区 分	当 期	
	数	量
貸付有価証券<株式>総株数		株 16,555,800

○投資信託財産の構成

(2023年3月27日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
株式	千円 862,140,675	% 94.1
コール・ローン等、その他	53,753,746	5.9
投資信託財産総額	915,894,421	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年3月27日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	915,841,163,699	
コール・ローン等	51,758,002,649	
株式(評価額)	862,140,675,060	
未収配当金	1,266,685,464	
その他未収収益	54,635,526	
差入委託証拠金	621,165,000	
(B) 負債	60,966,718,265	
未払金	18,446,834,199	
未払解約金	569,155,505	
未払利息	△ 776,974	
受入担保金	41,951,505,535	
(C) 純資産総額(A-B)	854,874,445,434	
元本	368,050,508,229	
次期繰越損益金	486,823,937,205	
(D) 受益権総口数	368,050,508,229口	
1万口当たり基準価額(C/D)	23,227円	

○損益の状況 (2022年3月26日～2023年3月27日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	20,507,507,585	
受取配当金	20,237,006,370	
受取利息	557,428	
その他収益金	276,802,916	
支払利息	△ 6,859,129	
(B) 有価証券売買損益	△ 6,484,422,647	
売買益	54,762,083,881	
売買損	△ 61,246,506,528	
(C) 先物取引等取引損益	856,715,050	
取引益	2,645,935,000	
取引損	△ 1,789,219,950	
(D) 当期損益金(A+B+C)	14,879,799,988	
(E) 前期繰越損益金	415,898,270,162	
(F) 追加信託差損益金	221,576,043,684	
(G) 解約差損益金	△ 165,530,176,629	
(H) 計(D+E+F+G)	486,823,937,205	
次期繰越損益金(H)	486,823,937,205	

(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	323,925,697,289円	
期中追加設定元本額	175,107,546,693円	
期中一部解約元本額	130,982,735,753円	
また、1口当たり純資産額は、期末2,3227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		56,729,592,054円
三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）		42,213,759,113円
三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）		38,502,991,405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）		32,916,222,762円
eMAXIS Slim 国内株式（TOPIX）		27,782,563,574円
国内株式インデックス・オープン（ラップ向け）		18,024,377,534円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）		9,574,549,071円
三菱UFJ DCトピックスオープン		8,007,179,410円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）		7,838,889,024円
三菱UFJ トピックスインデックスオープン		7,676,918,036円
つみたて日本株式（TOPIX）		7,557,227,401円
eMAXIS TOPIXインデックス		7,386,886,105円
三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）		7,335,641,950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）		5,318,526,795円
三菱UFJ TOPIX・ファンド		5,072,429,657円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）		5,036,974,076円
MUAM インデックスファンドTOPIXi（適格機関投資家限定）		4,780,955,914円
つみたて8資産均等バランス		4,496,427,105円
国内株式セレクション（ラップ向け）		4,224,379,838円
ラップ向けインデックスf 国内株式		3,904,520,892円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）		3,897,427,490円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）		3,581,056,554円
三菱UFJ トピックスオープン（確定拠出年金）		3,427,654,813円
MUKAM 日本株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）		3,269,450,249円
三菱UFJ DC年金バランス（株式65）		2,963,070,522円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）		2,887,783,335円
三菱UFJ DC年金インデックス（国内株式）		2,432,321,387円
eMAXIS バランス（8資産均等型）		2,237,038,000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）		1,659,362,488円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）		1,623,574,463円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド		1,607,827,539円
つみたて4資産均等バランス		1,528,825,144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）		1,525,704,563円
三菱UFJ DC年金バランス（株式40）		1,524,461,549円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）		1,429,481,445円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）		1,382,183,934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）		1,373,859,266円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）		1,110,565,458円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）		1,103,441,785円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）		992,480,155円
三菱UFJ トピックスオープン		983,119,651円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）		951,556,158円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）		948,645,098円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）		945,147,224円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）		908,357,638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）		906,746,798円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）		833,513,276円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）		829,973,257円

MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	811,913,677円
日本株式インデックスファンドS	803,018,008円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	765,366,163円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	655,665,493円
ファンド・マネジャー (国内株式)	634,945,965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)	608,379,349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)	605,539,391円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	585,738,745円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	574,318,112円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	535,773,138円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	501,702,306円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	487,092,747円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	478,984,073円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	469,620,490円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	468,700,199円
MUKAM 日米コアバランス 2021-07 (適格機関投資家限定)	456,343,616円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	444,719,553円
MUKAM バランス・イノベーション (リスク抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	443,070,181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)	406,582,112円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	290,071,871円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)	277,294,372円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	259,191,462円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	247,870,237円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	173,292,744円
日米コアバランス (FOFs用) (適格機関投資家限定)	170,810,686円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	164,535,090円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	162,546,668円
eMAXIS バランス (波乗り型)	160,701,797円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	148,423,928円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	146,021,159円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	143,875,949円
MUKAM 米国公債プラス日本株式ファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	117,460,290円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	115,318,127円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)	106,974,398円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	98,774,266円
MUKAM バランス・イノベーション (債券重視型) (適格機関投資家転売制限付)	98,524,693円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	98,045,148円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	87,257,716円
三菱UFJ トピックスオープンVA (適格機関投資家限定)	63,773,458円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	60,131,019円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	40,598,807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)	40,180,532円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	40,095,797円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	39,980,785円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	39,919,767円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	39,815,667円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	39,470,553円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	39,043,668円
MUKAM バランス・イノベーション 2 (適格機関投資家転売制限付)	37,426,460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)	35,980,732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)	35,950,680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)	35,822,253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)	35,818,860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)	35,768,349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)	35,501,352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)	35,434,968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)	35,160,631円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	35,083,406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)	34,885,307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)	34,844,004円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	30,558,435円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	16,659,048円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	14,678,858円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	11,878,435円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	9,996,720円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	9,587,982円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	6,687,385円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	6,683,280円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	4,663,008円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	4,229,397円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	3,311,246円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	3,305,801円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	2,812,810円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,591,906円
三菱UFJ バランスファンドVA30型 (適格機関投資家限定)	1,184,580円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	263,431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)	233,613円
コアバランス	213,831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)	56,534円
合計	368,050,508,229円

[お知らせ]

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)

国内債券インデックスマザーファンド

《第4期》決算日2023年5月12日

〔計算期間：2022年5月13日～2023年5月12日〕

「国内債券インデックスマザーファンド」は、5月12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	主としてわが国の公社債に投資を行い、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果をめざして運用を行います。 公社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公社債の実質投資比率が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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合		債組入比率	債先物比率	純資産総額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
(設定日) 2020年3月2日	円	%		%	%	%	百万円 999
1期(2020年5月12日)	10,000	—	394.51	—	—	—	71,305
2期(2021年5月12日)	9,835	△1.7	388.75	△1.5	99.5	—	145,774
3期(2022年5月12日)	9,791	△0.4	386.93	△0.5	100.6	0.1	234,196
4期(2023年5月12日)	9,596	△2.0	379.29	△2.0	99.5	0.1	288,926
	9,507	△0.9	375.76	△0.9	100.6	0.1	

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) NOMURA-BPI総合とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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。

(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		N O M U R A - B P I 総 合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年 5月12日	円	%		%	%	%
	9,596	—	379.29	—	99.5	0.1
5月末	9,603	0.1	379.54	0.1	99.7	0.1
6月末	9,514	△0.9	376.08	△0.8	99.7	0.1
7月末	9,577	△0.2	378.55	△0.2	99.5	0.1
8月末	9,555	△0.4	377.67	△0.4	99.5	0.1
9月末	9,454	△1.5	373.60	△1.5	99.7	0.1
10月末	9,443	△1.6	373.25	△1.6	99.6	0.1
11月末	9,397	△2.1	371.33	△2.1	99.7	0.1
12月末	9,272	△3.4	366.60	△3.3	99.3	0.2
2023年 1月末	9,244	△3.7	365.59	△3.6	99.5	0.2
2月末	9,347	△2.6	369.57	△2.6	93.1	0.2
3月末	9,478	△1.2	374.74	△1.2	99.1	0.2
4月末	9,505	△0.9	375.61	△1.0	99.6	0.1
(期 末) 2023年 5月12日	9,507	△0.9	375.76	△0.9	100.6	0.1

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

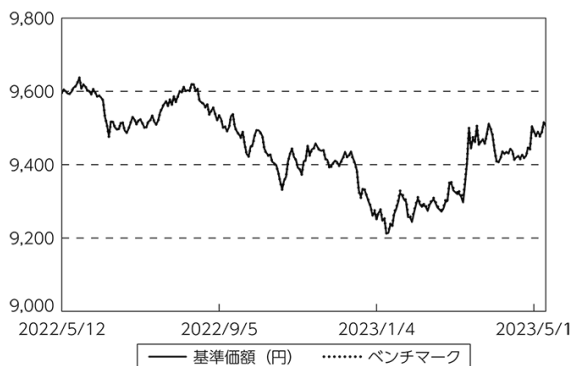
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ0.9%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(−0.9%)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、期間の前半はインフレ率の高止まりを受けた欧米金利の上昇などから下落しました。2022年12月には日銀がイールドカーブコントロール（YCC）の修正を決定したことなどにより国内債券市況は下落しましたが、期間の終わりにかけては米欧金融不安などを背景に反発しました。期間を通じてみると国内債券市況は下落しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

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

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・ベンチマークは0.9%の下落になったため、乖離は0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ポートフォリオ要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・取引要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2022年5月13日～2023年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、9,446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

(2022年5月13日～2023年5月12日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国債証券	397,042,330	342,067,590
	地方債証券	15,019,639	12,881,226 (25,000)
内	特殊債券	13,094,477	9,928,534 (206,271)
	社債券	14,040,859	10,568,484 (100,000)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国	債券先物取引	百万円 1,183	百万円 1,190	百万円 -	百万円 -

○利害関係人との取引状況等

(2022年5月13日～2023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	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %
公社債	百万円 439,197	百万円 157,603	35.9	百万円 375,445	百万円 108,821	29.0

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 315	百万円 99	百万円 1,107

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公社債	百万円 2,300

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、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2023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		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	241,065,000	245,070,320	84.8	—	58.0	18.4	8.4
地方債証券	15,719,000	16,131,391	5.6	—	1.9	2.6	1.1
	(15,719,000)	(16,131,391)	(5.6)	(—)	(1.9)	(2.6)	(1.1)
特殊債券 (除く金融債)	11,460,426	11,641,347	4.0	—	2.2	1.3	0.5
	(11,460,426)	(11,641,347)	(4.0)	(—)	(2.2)	(1.3)	(0.5)
金融債券	900,000	898,634	0.3	—	—	0.2	0.1
	(900,000)	(898,634)	(0.3)	(—)	(—)	(0.2)	(0.1)
普通社債券	16,810,000	16,784,470	5.8	—	1.4	3.5	0.9
	(16,810,000)	(16,784,470)	(5.8)	(—)	(1.4)	(3.5)	(0.9)
合 計	285,954,426	290,526,163	100.6	—	63.5	26.0	11.0
	(44,889,426)	(45,455,843)	(15.7)	(—)	(5.5)	(7.6)	(2.6)

(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438回利付国債 (2年)	0.005	400,000	400,584	2024/7/1
第439回利付国債 (2年)	0.005	5,340,000	5,348,063	2024/8/1
第440回利付国債 (2年)	0.005	800,000	801,248	2024/9/1
第441回利付国債 (2年)	0.005	720,000	721,144	2024/10/1
第442回利付国債 (2年)	0.005	4,230,000	4,236,810	2024/11/1
第443回利付国債 (2年)	0.005	370,000	370,629	2024/12/1
第445回利付国債 (2年)	0.005	2,370,000	2,373,649	2025/2/1
第446回利付国債 (2年)	0.005	2,920,000	2,924,175	2025/3/1
第447回利付国債 (2年)	0.005	1,450,000	1,452,044	2025/4/1
第140回利付国債 (5年)	0.1	1,200,000	1,202,964	2024/6/20
第141回利付国債 (5年)	0.1	460,000	461,334	2024/9/20
第142回利付国債 (5年)	0.1	503,000	504,569	2024/12/20
第143回利付国債 (5年)	0.1	1,800,000	1,805,814	2025/3/20
第144回利付国債 (5年)	0.1	5,170,000	5,187,888	2025/6/20
第145回利付国債 (5年)	0.1	1,130,000	1,134,384	2025/9/20
第146回利付国債 (5年)	0.1	4,120,000	4,137,139	2025/12/20
第147回利付国債 (5年)	0.005	4,280,000	4,287,318	2026/3/20
第148回利付国債 (5年)	0.005	3,200,000	3,204,960	2026/6/20
第149回利付国債 (5年)	0.005	3,760,000	3,765,038	2026/9/20
第150回利付国債 (5年)	0.005	3,140,000	3,142,826	2026/12/20
第151回利付国債 (5年)	0.005	510,000	510,193	2027/3/20
第152回利付国債 (5年)	0.1	3,030,000	3,042,210	2027/3/20
第153回利付国債 (5年)	0.005	3,110,000	3,108,724	2027/6/20
第154回利付国債 (5年)	0.1	4,470,000	4,481,622	2027/9/20
第155回利付国債 (5年)	0.3	70,000	70,753	2027/12/20
第156回利付国債 (5年)	0.2	3,250,000	3,269,370	2027/12/20
第157回利付国債 (5年)	0.2	1,080,000	1,085,205	2028/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	620,000	785,707	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	370,000	451,451	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	600,000	731,484	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	350,000	426,611	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	410,000	482,869	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	271,000	314,067	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	580,000	643,834	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	680,000	701,630	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	1,060,000	809,649	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)	0.9	960,000	857,644	2057/3/20
第11回利付国債 (40年)	0.8	900,000	775,341	2058/3/20
第12回利付国債 (40年)	0.5	781,000	602,439	2059/3/20
第13回利付国債 (40年)	0.5	1,130,000	863,885	2060/3/20
第14回利付国債 (40年)	0.7	1,120,000	913,606	2061/3/20
第15回利付国債 (40年)	1.0	1,300,000	1,161,836	2062/3/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	370,000	373,074	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	600,000	605,718	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	400,000	403,512	2025/3/20

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339回利付国債 (10年)	0.4	230,000	232,247	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	750,000	758,205	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	300,000	302,811	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	110,000	110,485	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	540,000	542,424	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	770,000	773,480	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	1,350,000	1,355,832	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	300,000	301,209	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	940,000	943,271	2027/6/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	1,200,000	1,201,920	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	1,950,000	1,950,468	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)	0.1	2,170,000	2,169,435	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)	0.1	2,400,000	2,398,704	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	2,633,000	2,630,051	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	2,850,000	2,845,839	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)	0.1	2,560,000	2,554,572	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)	0.1	1,720,000	1,715,115	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)	0.1	3,070,000	3,058,948	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)	0.1	1,380,000	1,373,914	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)	0.1	2,840,000	2,823,073	2030/6/20
第360回利付国債 (10年)	0.1	2,580,000	2,559,437	2030/9/20
第361回利付国債 (10年)	0.1	3,330,000	3,297,632	2030/12/20
第362回利付国債 (10年)	0.1	2,960,000	2,925,812	2031/3/20
第363回利付国債 (10年)	0.1	2,450,000	2,417,929	2031/6/20
第364回利付国債 (10年)	0.1	2,930,000	2,886,958	2031/9/20
第365回利付国債 (10年)	0.1	2,950,000	2,902,947	2031/12/20
第366回利付国債 (10年)	0.2	2,900,000	2,873,755	2032/3/20
第367回利付国債 (10年)	0.2	1,330,000	1,315,888	2032/6/20
第368回利付国債 (10年)	0.2	30,000	29,632	2032/9/20
第370回利付国債 (10年)	0.5	1,390,000	1,405,818	2033/3/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	50,000	57,705	2031/5/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	50,000	58,828	2032/5/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	50,000	53,416	2033/3/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	470,000	549,138	2033/9/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	190,000	228,670	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	100,000	121,669	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	520,000	633,744	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	250,000	302,410	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	280,000	336,179	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	100,000	120,260	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	500,000	614,180	2035/9/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	650,000	801,599	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	650,000	802,906	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	200,000	247,428	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	770,000	934,002	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	860,000	1,056,544	2037/3/20

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27回利付国債 (30年)	2.5	450,000	560,007	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	570,000	710,852	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	270,000	333,390	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	940,000	1,147,984	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	770,000	929,228	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	590,000	721,381	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	600,000	705,930	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	1,000,000	1,208,250	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	990,000	1,165,180	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	920,000	1,083,934	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	650,000	754,630	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	410,000	467,801	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	590,000	684,010	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	531,000	605,902	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	640,000	718,361	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	600,000	673,608	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	610,000	684,987	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	700,000	785,519	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	650,000	703,976	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	800,000	866,280	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	740,000	815,191	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	796,000	844,898	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	760,000	806,375	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	860,000	807,729	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)	0.3	740,000	618,425	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)	0.5	810,000	707,867	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)	0.6	810,000	722,609	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)	0.8	700,000	652,316	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)	0.8	760,000	706,473	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)	0.8	700,000	649,068	2047/9/20
第57回利付国債 (30年)	0.8	700,000	647,430	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)	0.8	640,000	590,432	2048/3/20
第59回利付国債 (30年)	0.7	730,000	655,795	2048/6/20
第60回利付国債 (30年)	0.9	480,000	450,691	2048/9/20
第61回利付国債 (30年)	0.7	688,000	613,420	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)	0.5	680,000	573,641	2049/3/20
第63回利付国債 (30年)	0.4	760,000	621,254	2049/6/20
第64回利付国債 (30年)	0.4	640,000	521,318	2049/9/20
第65回利付国債 (30年)	0.4	690,000	561,156	2049/12/20
第66回利付国債 (30年)	0.4	290,000	234,554	2050/3/20
第67回利付国債 (30年)	0.6	750,000	638,392	2050/6/20
第68回利付国債 (30年)	0.6	910,000	772,125	2050/9/20
第69回利付国債 (30年)	0.7	790,000	687,434	2050/12/20
第70回利付国債 (30年)	0.7	930,000	807,658	2051/3/20
第71回利付国債 (30年)	0.7	810,000	702,739	2051/6/20
第72回利付国債 (30年)	0.7	770,000	667,374	2051/9/20

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73回利付国債 (30年)	0.7	810,000	701,362	2051/12/20
第74回利付国債 (30年)	1.0	870,000	815,242	2052/3/20
第75回利付国債 (30年)	1.3	670,000	675,701	2052/6/20
第76回利付国債 (30年)	1.4	700,000	723,317	2052/9/20
第77回利付国債 (30年)	1.6	910,000	985,193	2052/12/20
第78回利付国債 (30年)	1.4	620,000	640,906	2053/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	50,000	51,388	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	100,000	102,996	2024/9/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	100,000	104,021	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	150,000	155,754	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)	1.9	100,000	104,129	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	100,000	104,549	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	100,000	104,861	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	200,000	211,248	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	200,000	210,728	2025/12/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	140,000	149,399	2026/3/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	200,000	213,932	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	300,000	322,491	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	700,000	753,459	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	50,000	53,856	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	60,000	64,858	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	400,000	437,436	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	100,000	108,540	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	100,000	109,381	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	200,000	217,892	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	300,000	328,074	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	650,000	716,176	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	200,000	223,334	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	200,000	222,320	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	220,000	243,350	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	140,000	155,605	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	250,000	277,610	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	300,000	329,796	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	300,000	331,002	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	100,000	111,495	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	40,000	45,023	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	500,000	559,765	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	620,000	696,712	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	100,000	112,780	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	100,000	113,434	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	1,050,000	1,195,467	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	1,060,000	1,199,665	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	350,000	394,786	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	100,000	111,393	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	250,000	274,977	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	610,000	685,121	2030/9/20

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122回利付国債 (20年)	1.8	160,000	178,544	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	180,000	205,371	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	400,000	453,388	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	510,000	587,208	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	110,000	124,957	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	40,000	45,131	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	190,000	214,884	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	490,000	550,284	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	180,000	202,572	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	540,000	603,304	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	290,000	324,715	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	702,000	791,933	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	610,000	689,446	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	100,000	112,161	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	100,000	111,299	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	2,580,000	2,898,604	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	70,000	77,405	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	380,000	423,563	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	2,520,000	2,833,135	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	370,000	416,583	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	2,990,000	3,394,248	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	1,210,000	1,351,388	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	530,000	586,895	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	1,474,000	1,661,595	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	860,000	970,148	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	1,480,000	1,655,542	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	1,060,000	1,175,094	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	1,380,000	1,529,923	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	1,290,000	1,416,213	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	1,310,000	1,408,223	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	1,080,000	1,160,654	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	1,390,000	1,509,109	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	820,000	880,114	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	1,540,000	1,614,998	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	782,000	761,527	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	960,000	908,400	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	1,210,000	1,187,699	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	610,000	605,431	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	760,000	762,888	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)	0.6	1,040,000	1,027,967	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	1,420,000	1,399,651	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	1,130,000	1,110,609	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	1,194,000	1,154,120	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)	0.5	1,120,000	1,079,086	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	1,310,000	1,295,629	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)	0.5	1,000,000	957,060	2038/12/20

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168回利付国債 (20年)	0.4	630,000	591,645	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)	0.3	960,000	883,977	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)	0.3	770,000	706,159	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)	0.3	940,000	859,160	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)	0.4	1,090,000	1,009,525	2040/3/20
第173回利付国債 (20年)	0.4	1,160,000	1,070,877	2040/6/20
第174回利付国債 (20年)	0.4	1,670,000	1,536,617	2040/9/20
第175回利付国債 (20年)	0.5	1,070,000	998,138	2040/12/20
第176回利付国債 (20年)	0.5	880,000	818,320	2041/3/20
第177回利付国債 (20年)	0.4	1,180,000	1,074,791	2041/6/20
第178回利付国債 (20年)	0.5	1,240,000	1,147,421	2041/9/20
第179回利付国債 (20年)	0.5	1,080,000	996,872	2041/12/20
第180回利付国債 (20年)	0.8	1,160,000	1,127,670	2042/3/20
第181回利付国債 (20年)	0.9	1,000,000	987,920	2042/6/20
第182回利付国債 (20年)	1.1	1,460,000	1,489,696	2042/9/20
第183回利付国債 (20年)	1.4	1,000,000	1,071,690	2042/12/20
第184回利付国債 (20年)	1.1	730,000	741,468	2043/3/20
小 計		241,065,000	245,070,320	
地方債証券				
第6回東京都公募公債 (20年)	2.0	100,000	103,600	2025/3/19
第7回東京都公募公債 (20年)	2.16	100,000	104,928	2025/9/19
第8回東京都公募公債 (30年)	2.23	80,000	94,766	2038/9/17
第9回東京都公募公債 (20年)	2.44	100,000	107,240	2026/6/19
第13回東京都公募公債 (20年)	2.15	200,000	217,706	2027/12/20
第26回東京都公募公債 (20年)	1.74	100,000	109,932	2032/6/18
第31回東京都公募公債 (5年)	0.005	100,000	100,005	2024/6/20
第732回東京都公募公債	0.645	100,000	100,713	2024/6/20
第749回東京都公募公債	0.436	1,000,000	1,008,720	2025/9/19
第750回東京都公募公債	0.444	100,000	100,946	2025/12/19
第753回東京都公募公債	0.065	150,000	149,914	2026/3/19
第792回東京都公募公債	0.05	100,000	98,642	2029/3/19
第1回神奈川県公募公債 (30年)	2.54	100,000	120,341	2035/6/20
第7回神奈川県公募公債 (20年)	2.22	400,000	431,940	2027/3/19
第12回神奈川県公募公債 (20年)	2.19	100,000	111,651	2029/9/20
第26回神奈川県公募公債 (20年)	1.477	20,000	21,612	2034/6/20
第40回神奈川県公募公債 (20年)	0.2	100,000	88,834	2039/6/20
第209回神奈川県公募公債	0.549	200,000	201,434	2024/9/20
第211回神奈川県公募公債	0.438	200,000	201,292	2024/12/20
第11回大阪府公募公債 (20年)	1.693	100,000	109,603	2033/9/27
第13回大阪府公募公債 (20年)	1.203	100,000	104,832	2035/9/28
第171回大阪府公募公債 (5年)	0.001	200,000	199,704	2025/5/28
第176回大阪府公募公債 (5年)	0.001	100,000	99,805	2025/10/29
第182回大阪府公募公債 (5年)	0.001	340,000	339,054	2026/4/28
第187回大阪府公募公債 (5年)	0.001	200,000	199,190	2026/9/29
第388回大阪府公募公債	0.54	200,000	201,388	2024/9/27
第391回大阪府公募公債	0.513	300,000	302,247	2024/12/25

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
第449回大阪府公募公債		0.001	400,000	391,544	2029/10/30
第451回大阪府公募公債		0.063	152,000	149,175	2029/12/26
第466回大阪府公募公債		0.176	137,000	134,001	2031/3/20
平成28年度第5回京都府公募公債 (20年)		0.327	100,000	93,869	2036/8/15
令和元年度第11回京都府公募公債 (5年)		0.001	400,000	399,776	2024/12/18
第1回兵庫県公募公債 (15年)		1.66	500,000	524,725	2026/7/29
第2回兵庫県公募公債 (30年)		2.36	100,000	120,612	2040/3/19
第3回兵庫県公募公債 (15年)		1.35	200,000	209,746	2027/7/16
第4回兵庫県公募公債 (12年)		0.73	200,000	203,994	2026/8/6
第5回兵庫県公募公債 (15年)		1.31	400,000	420,988	2028/5/26
第6回兵庫県公募公債 (15年)		1.35	100,000	105,515	2028/7/14
第15回兵庫県公募公債 (20年)		1.64	200,000	218,026	2032/7/23
第11回静岡県公募公債 (20年)		1.841	200,000	220,640	2030/10/18
平成27年度第10回静岡県公募公債		0.461	100,000	100,919	2025/9/19
令和2年度第7回静岡県公募公債 (5年)		0.02	200,000	199,768	2025/6/20
令和4年度第1回静岡県公募公債		0.269	300,000	293,259	2032/3/19
平成20年度第2回愛知県公募公債 (20年)		2.46	100,000	111,142	2028/6/20
平成24年度第14回愛知県公募公債 (15年)		1.314	200,000	210,034	2027/12/13
平成26年度第4回愛知県公募公債 (20年)		1.542	100,000	108,773	2034/5/15
平成27年度第5回愛知県公募公債		0.544	100,000	100,979	2025/5/27
平成26年度第4回広島県公募公債		0.5	100,000	100,714	2024/11/25
平成29年度第7回広島県公募公債		0.2	100,000	99,831	2028/3/23
令和元年度第6回広島県公募公債 (5年)		0.001	500,000	499,570	2025/2/18
平成26年度第8回埼玉県公募公債		0.335	100,000	100,497	2025/1/28
平成29年度第8回埼玉県公募公債		0.245	200,000	200,232	2028/1/26
平成22年度第1回福岡県公募公債 (20年)		1.77	100,000	109,716	2030/8/19
平成23年度第1回福岡県公募公債 (15年)		1.491	200,000	209,640	2026/11/27
平成26年度第10回福岡県公募公債		0.453	100,000	100,714	2025/2/26
第13回千葉県公募公債 (20年)		1.701	200,000	219,632	2032/10/15
第140回共同発行市場公募地方債		0.505	100,000	100,722	2024/11/25
第149回共同発行市場公募地方債		0.5	500,000	504,910	2025/8/25
第153回共同発行市場公募地方債		0.469	100,000	101,017	2025/12/25
第162回共同発行市場公募地方債		0.105	500,000	499,895	2026/9/25
第167回共同発行市場公募地方債		0.245	400,000	401,648	2027/2/25
第214回共同発行市場公募地方債		0.13	100,000	97,650	2031/1/24
第222回共同発行市場公募地方債		0.115	100,000	96,939	2031/9/25
第227回共同発行市場公募地方債		0.244	100,000	97,486	2032/2/25
平成27年度第1回長崎県公募公債		0.515	200,000	202,120	2025/9/30
平成28年度第2回島根県公募公債 (20年)		0.506	100,000	95,973	2036/9/30
平成27年度第2回熊本県公募公債		0.476	200,000	202,000	2025/10/30
令和3年度第1回熊本県公募公債 (5年)		0.005	200,000	199,388	2026/7/30
令和3年度第1回熊本市公募公債		0.13	100,000	96,969	2031/11/26
平成27年度第1回新潟市公募公債		0.464	10,000	10,100	2025/12/24
令和3年度第1回静岡市公募公債		0.16	200,000	194,430	2031/11/25
平成26年度第5回大阪市公募公債		0.593	200,000	201,562	2024/9/27
第1回名古屋市公募公債 (15年)		1.329	200,000	209,728	2027/8/10

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1回名古屋市政公募債(30年)		2.53	100,000	120,091	2035/3/20
第3回名古屋市政公募債(20年)		2.03	100,000	104,123	2025/6/20
第27回名古屋市政公募債(5年)		0.001	200,000	199,872	2024/12/20
第490回名古屋市政公募債		0.489	120,000	120,964	2025/3/19
平成20年度第24回神戸市公募債(20年)		2.08	100,000	109,906	2028/12/20
第22回横浜市公募債(20年)		1.895	200,000	221,314	2030/9/13
平成27年度第3回横浜市公募債		0.524	100,000	101,028	2025/8/18
平成23年度第3回札幌市公募債		1.944	100,000	111,606	2031/7/29
平成26年度第5回札幌市公募債		0.961	100,000	103,994	2029/9/20
第6回川崎市公募債(20年)		2.21	100,000	111,318	2029/5/25
第9回川崎市公募債(20年)		2.15	100,000	112,275	2030/5/24
平成23年度第4回福岡市公募債(20年)		1.89	100,000	111,208	2031/8/19
2021年度第5回福岡市公募債		0.135	100,000	97,073	2031/10/28
平成30年度第3回千葉市公募債		0.259	10,000	9,996	2028/11/22
令和元年度第2回徳島県公募債		0.09	100,000	98,462	2029/11/28
第148回福岡北九州高速道路債券(20年)		0.731	100,000	97,549	2037/3/19
小 計			15,719,000	16,131,391	
特殊債券(除く金融債)					
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	112,931	2042/5/30
第221回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.466	100,000	108,699	2034/6/30
第225回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.556	100,000	100,728	2024/8/30
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.544	100,000	100,746	2024/9/30
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	300,000	302,229	2024/11/29
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.32	300,000	301,497	2025/1/31
第259回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.119	100,000	104,623	2035/10/31
第303回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.174	106,000	106,272	2027/2/26
第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.145	100,000	99,647	2028/6/30
第358回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.625	100,000	96,580	2038/8/31
第372回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.095	200,000	198,470	2029/1/31
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.544	200,000	201,458	2024/9/13
第72回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.509	200,000	201,888	2025/5/23
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.425	500,000	504,435	2025/9/12
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.381	13,000	13,108	2025/11/18
第101回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.17	118,000	118,050	2027/10/15
第102回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.16	122,000	121,945	2027/11/15
第17回政府保証民間都市開発債券		0.145	200,000	200,502	2026/2/26
第3回政府保証新関西国際空港債券		0.644	100,000	100,724	2024/6/26
第4回政府保証新関西国際空港債券		0.484	378,000	381,462	2025/6/13
第37回政府保証日本政策投資銀行		0.085	260,000	259,950	2026/12/14
第21回政府保証中部国際空港債券		0.45	204,000	205,564	2025/3/17
第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.59	100,000	120,162	2035/12/20
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.37	100,000	110,769	2028/9/20
第42回道路債券(財投機関債)		2.22	110,000	114,346	2025/3/21
第50回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		0.5	100,000	92,197	2039/3/18
第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.14	50,000	55,899	2030/5/10
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	100,000	103,703	2035/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第156回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.257	100,000	105,216	2035/6/20
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)	2.95	100,000	122,789	2034/3/24
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.043	100,000	111,385	2030/6/28
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	110,269	2030/10/28
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.846	100,000	110,712	2031/8/28
第22回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.32	400,000	434,228	2027/6/18
第24回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.29	100,000	109,765	2028/4/25
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.702	100,000	109,777	2032/9/28
第48回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.121	100,000	103,500	2035/12/28
F 89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.602	100,000	105,806	2027/8/20
F 149回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.145	100,000	102,755	2025/12/19
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.16	37,511	37,304	2033/1/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	32,150	33,823	2044/6/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	18,640	19,487	2045/5/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	52,788	55,034	2046/5/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	55,893	58,058	2046/7/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	33,424	34,391	2047/11/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.32	106,770	110,878	2048/7/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.066	80,000	89,736	2031/6/13
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	94,254	96,808	2048/11/10
第82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0	108,834	111,302	2049/3/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	115,323	118,008	2049/6/10
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	95,114	94,982	2050/2/10
第94回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.882	300,000	333,720	2032/2/13
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.86	58,441	59,007	2050/12/10
第107回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	126,040	124,135	2051/4/10
第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.23	338,560	328,819	2051/7/10
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	210,966	206,575	2051/12/10
第120回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	71,381	69,734	2052/5/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	146,504	143,096	2052/10/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	150,302	146,445	2053/5/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	77,029	74,937	2053/7/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	77,820	75,936	2053/9/10
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	80,769	77,921	2054/4/10
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	332,092	315,915	2054/9/10
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	341,308	328,843	2055/2/10
第156回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	172,618	166,277	2055/5/10
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	89,924	86,488	2056/2/10
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	91,903	88,490	2056/6/10
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	93,030	88,889	2056/9/10
第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	94,683	90,418	2057/1/10
第177回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	0.484	200,000	201,994	2025/12/19
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	94,681	91,678	2057/3/10
第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	95,355	92,091	2057/4/10
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	96,266	93,192	2057/6/10
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	99,341	100,899	2058/3/10

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191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	199,712	200,406	2058/4/10
第192回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	100,000	101,108	2058/5/10
第84回中日本高速道路	0.07	100,000	99,859	2025/7/10
第85回中日本高速道路	0.07	300,000	299,523	2025/10/21
第25回西日本高速道路	0.524	100,000	100,679	2024/12/20
第26回西日本高速道路	0.604	100,000	100,950	2025/5/21
第30回西日本高速道路	0.17	130,000	129,940	2026/5/22
第65回西日本高速道路	0.1	300,000	298,764	2026/12/18
小 計		11,460,426	11,641,347	
金融債券				
い第832号商工債券	0.06	100,000	99,909	2024/9/27
い第853号商工債券	0.09	100,000	99,596	2026/6/26
い第854号商工債券	0.08	100,000	99,552	2026/7/27
い第862号商工債券	0.18	200,000	199,378	2027/3/26
い第863号商工債券	0.22	200,000	199,564	2027/4/27
第11号商工債券 (10年)	0.66	100,000	100,744	2024/9/20
第268号商工債券 (3年)	0.11	100,000	99,891	2025/5/27
小 計		900,000	898,634	
普通社債券				
第503回中部電力	0.584	10,000	10,061	2025/3/25
第496回関西電力	0.908	100,000	101,066	2025/2/25
第522回関西電力	0.47	300,000	298,440	2028/9/20
第554回関西電力	0.41	200,000	200,412	2025/10/24
第389回中国電力	0.3	300,000	299,736	2026/4/24
第420回中国電力	0.23	200,000	194,198	2029/10/25
第337回北陸電力	0.32	200,000	194,454	2030/6/25
第513回東北電力	0.31	100,000	97,533	2029/10/25
第525回東北電力	0.22	100,000	98,974	2027/10/25
第545回東北電力	0.4	200,000	199,918	2027/6/25
第552回東北電力	0.864	100,000	101,298	2028/12/25
第476回九州電力	0.43	100,000	98,664	2029/5/25
第484回九州電力	0.375	100,000	97,788	2029/11/22
第493回九州電力	0.1	200,000	198,706	2026/5/25
第511回九州電力	0.51	300,000	301,392	2027/2/25
第325回北海道電力	1.264	100,000	103,189	2030/10/25
第345回北海道電力	0.27	200,000	200,146	2024/9/25
第357回北海道電力	0.475	100,000	99,011	2029/5/25
第358回北海道電力	0.32	200,000	195,068	2029/10/25
第12回新関西国際空港	1.067	100,000	103,749	2029/9/20
第21回新関西国際空港	1.017	100,000	89,617	2048/9/18
第24回成田国際空港	0.25	100,000	99,637	2027/12/17
第27回成田国際空港	0.657	200,000	188,568	2038/3/12
第48回鹿島建設 (サステナビリティ)	0.554	400,000	402,704	2028/3/16
第3回住友林業	0.33	200,000	200,134	2026/6/17
第13回キリンホールディングス	0.23	100,000	98,008	2029/9/5
第9回サントリーホールディングス	0.3	100,000	99,846	2027/6/8

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2回コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	0.2	200,000	199,314	2026/9/18
第5回サントリー食品インターナショナル	0.001	100,000	99,880	2024/7/8
第3回 キューピー	0.23	100,000	99,951	2026/2/13
第13回日本たばこ産業	0.355	100,000	99,348	2028/9/8
第11回ヒューリック	0.32	100,000	100,049	2026/4/13
第10回東急不動産ホールディングス	0.455	100,000	100,212	2027/2/26
第14回セブン&アイ・ホールディングス	0.19	100,000	99,837	2025/12/19
第9回クラレ	0.34	100,000	99,811	2027/4/30
第16回旭化成	0.001	100,000	99,772	2024/12/9
第13回イビデン	0.29	300,000	299,874	2025/9/12
第46回三井化学	0.37	200,000	199,274	2027/7/23
第56回三井化学	0.3	100,000	100,033	2026/2/27
第5回電通グループ	0.32	200,000	199,442	2027/7/8
第19回オリエンタルランド	0.001	100,000	99,858	2024/9/2
第13回ヤフー	0.46	100,000	96,408	2029/7/31
第19回Zホールディングス	0.35	100,000	98,969	2026/7/28
第20回Zホールディングス (グリーン)	0.46	100,000	97,368	2028/7/28
第22回Zホールディングス	0.76	100,000	99,674	2027/9/15
第11回ブリヂストン	0.295	200,000	199,584	2027/4/21
第4回新日本製鐵	0.375	100,000	99,967	2027/5/20
第9回新日本製鐵	0.385	100,000	99,297	2028/6/20
第28回ジェイ エフ イー ホールディングス	0.26	200,000	199,830	2026/5/27
第14回LIXIL	0.475	100,000	99,904	2027/8/27
第30回ダイキン工業	0.459	100,000	99,149	2029/7/27
第7回ジェイテクト	0.345	100,000	98,727	2028/3/8
第17回パナソニック	0.47	200,000	200,708	2026/9/18
第18回パナソニック	0.23	200,000	199,398	2026/3/5
第36回三菱重工業 (グリーン)	0.14	300,000	299,319	2025/11/21
第18回アイシン精機	0.28	100,000	99,648	2027/9/6
第4回ヤマハ発動機	0.32	100,000	100,094	2026/4/24
第1回明治安田生命2018基金	0.315	200,000	199,988	2023/9/25
第1回明治安田生命2019基金	0.29	100,000	99,878	2024/8/2
第114回丸紅	0.614	200,000	201,096	2028/2/24
第63回三井物産	2.37	100,000	107,926	2027/4/23
第61回住友商事	0.644	100,000	100,596	2028/3/1
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.724	100,000	100,019	2025/3/5
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.535	100,000	98,040	2028/5/31
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	1.95	100,000	103,050	2025/11/12
第33回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	2.21	200,000	208,938	2026/6/9
第7回みずほリース	0.33	200,000	197,608	2028/1/20
第16回エス・ティ・ティ・ファイナンス	0.18	300,000	299,628	2025/12/19
第38回東京センチュリー	0.55	200,000	200,474	2027/4/13
第70回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,772	2024/9/19
第72回ホンダファイナンス	0.03	100,000	99,730	2024/12/19
第78回トヨタファイナンス	0.265	300,000	299,751	2027/7/23
第79回アコム	0.29	100,000	99,833	2025/2/28

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80回アコム	0.28	100,000	99,058	2026/2/26
第61回日立キャピタル	0.31	200,000	199,306	2026/6/19
第34回三井住友ファイナンス&リース	0.43	100,000	100,167	2026/2/2
第1回三菱HCキャピタル	0.05	200,000	199,308	2024/11/29
第3回野村ホールディングス	0.28	100,000	98,725	2026/9/4
第118回三菱地所	0.27	100,000	99,899	2026/12/18
第137回三菱地所	0.05	100,000	99,794	2025/2/7
第107回住友不動産	0.23	200,000	199,534	2026/7/31
第111回住友不動産(グリーン)	0.52	100,000	99,920	2028/4/28
第78回東京急行電鉄	1.528	100,000	104,986	2028/6/12
第57回東日本旅客鉄道	2.376	100,000	110,343	2028/12/12
第147回東日本旅客鉄道	0.265	100,000	97,898	2030/4/22
第184回東日本旅客鉄道	0.21	100,000	99,939	2025/10/14
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	108,421	2030/10/25
第68回東海旅客鉄道	1.584	100,000	107,030	2034/4/24
第73回東海旅客鉄道	1.014	100,000	100,505	2035/1/26
第13回東京地下鉄	1.702	100,000	108,376	2032/5/25
第58回阪急阪神ホールディングス	0.09	100,000	99,396	2026/2/26
第64回名古屋鉄道	0.09	100,000	99,198	2026/3/23
第9回九州旅客鉄道	0.001	100,000	99,649	2024/12/9
第31回KDDI(サステナビリティ)	0.43	100,000	99,923	2027/10/27
第7回ソフトバンク	0.58	100,000	96,513	2030/7/29
第9回ソフトバンク	0.48	200,000	197,076	2027/12/3
第13回ソフトバンク	0.52	100,000	94,778	2031/6/3
第15回ソフトバンク	0.41	100,000	97,336	2028/10/12
第84回電源開発	0.754	100,000	101,269	2028/2/18
第85回電源開発	0.872	100,000	101,025	2029/10/31
第6回東京電力パワーグリッド	0.85	300,000	300,525	2027/8/31
第34回東京電力パワーグリッド	0.75	300,000	301,341	2025/4/23
第44回東京電力パワーグリッド	0.4	100,000	99,255	2026/4/22
第45回東京電力パワーグリッド	0.8	100,000	97,259	2031/4/22
第49回東京電力パワーグリッド	0.6	200,000	198,668	2027/4/26
第50回東京電力パワーグリッド	0.94	100,000	97,562	2032/4/26
第55回東京電力パワーグリッド	0.72	300,000	300,804	2025/10/17
第16回JERA	0.64	100,000	100,621	2028/4/25
第17回JERA	0.9	100,000	101,114	2030/4/25
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	199,288	2024/9/9
第13回広島ガス	0.405	100,000	98,653	2028/9/13
第19回フランス相互信用連合銀行	0.999	100,000	100,847	2025/10/15
第29回フランス相互信用連合銀行	0.25	100,000	99,654	2024/10/10
第35回フランス相互信用連合銀行	0.279	100,000	98,551	2026/10/21
第21回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.528	200,000	199,896	2024/1/25
第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.302	100,000	97,815	2026/12/16
第4回フランス預金供託公庫	0.725	100,000	100,600	2024/7/30

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券 第1回サンタンデール銀行 (2019)	% 0.463	千円 100,000	千円 99,302	2024/12/5
小 計		16,810,000	16,784,470	
合 計		285,954,426	290,526,163	

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 297	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2023年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 290,526,163	% 99.4
コール・ローン等、その他	1,831,073	0.6
投資信託財産総額	292,357,236	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	292,350,456,484
コール・ローン等	803,793,520
公社債(評価額)	290,526,163,528
未収入金	544,307,800
未収利息	315,897,980
前払費用	163,353,656
差入委託証拠金	△ 3,060,000
(B) 負債	3,423,567,695
未払金	3,337,665,922
未払解約金	85,900,822
未払利息	951
(C) 純資産総額(A-B)	288,926,888,789
元本	303,911,087,355
次期繰越損益金	△ 14,984,198,566
(D) 受益権総口数	303,911,087,355口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,507円

<注記事項>

- ①期首元本額 244,057,504,595円
期中追加設定元本額 426,756,171,290円
期中一部解約元本額 366,902,588,530円
また、1口当たり純資産額は、期末0.9507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)

MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド(適格機関投資家限定)	141,001,300,138円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	41,991,646,995円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)	28,885,886,976円
ファンド・マネジャー(国内債券)	24,232,514,437円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	23,081,853,939円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	10,220,071,024円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	10,120,486,986円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	9,072,920,571円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	5,884,177,411円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	5,273,845,787円
MUKAM バランス・イノベーション(債券重視型)(適格機関投資家転売制限付)	2,051,982,247円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	779,610,799円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)2(適格機関投資家転売制限付)	763,369,592円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	378,042,698円
アクティブアロケーションファンド(ラップ向け)	126,903,220円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	45,576,374円
MUKAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	898,161円
合計	303,911,087,355円

- ③純資産総額が元本額を下回っており、その差額は14,984,198,566円です。

○損益の状況 (2022年5月13日～2023年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,553,425,665
受取利息	1,554,919,780
支払利息	△ 1,494,115
(B) 有価証券売買損益	△ 6,012,501,427
売買益	2,585,280,109
売買損	△ 8,597,781,536
(C) 先物取引等取引損益	5,802,400
取引益	7,946,800
取引損	△ 2,144,400
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 4,453,273,362
(E) 前期繰越損益金	△ 9,861,075,132
(F) 追加信託差損益金	△ 25,062,232,773
(G) 解約差損益金	24,392,382,701
(H) 計(D+E+F+G)	△ 14,984,198,566
次期繰越損益金(H)	△ 14,984,198,566

(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。

[お知らせ]

三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。

東証REIT指数マザーファンド

《第14期》決算日2023年1月26日

[計算期間：2022年1月27日～2023年1月26日]

「東証REIT指数マザーファンド」は、1月26日に第14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14期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証REIT指数 (配当込み)		投資信託証券 組入比率	不動産 投信指 先物比 率	純総 資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
10期(2019年1月28日)	29,481	9.3	3,670.43	9.1	98.2	2.0	23,792
11期(2020年1月27日)	36,432	23.6	4,533.90	23.5	98.4	1.6	35,177
12期(2021年1月26日)	31,049	△14.8	3,872.69	△14.6	98.0	2.0	42,741
13期(2022年1月26日)	34,244	10.3	4,269.20	10.2	98.9	1.2	62,254
14期(2023年1月26日)	34,199	△0.1	4,262.37	△0.2	98.1	1.9	77,896

(注) 東証REIT指数（配当込み）とは、東京証券取引所に上場している不動産投資信託全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。東証REIT指数の指数値及び東証REIT指数に係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証REIT指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。

(注) 「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 R E I T 指 数 (配当込み)		投 資 信 託 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年1月26日	円 34,244	% —	4,269.20	% —	% 98.9	% 1.2
1月末	35,070	2.4	4,372.24	2.4	98.6	1.3
2月末	34,041	△0.6	4,243.65	△0.6	98.1	2.0
3月末	36,389	6.3	4,536.64	6.3	98.1	1.9
4月末	35,960	5.0	4,483.12	5.0	98.2	1.9
5月末	36,604	6.9	4,563.32	6.9	98.9	1.0
6月末	35,993	5.1	4,487.40	5.1	98.9	1.1
7月末	37,125	8.4	4,628.79	8.4	98.8	1.1
8月末	37,564	9.7	4,683.62	9.7	98.1	1.8
9月末	36,002	5.1	4,488.86	5.1	98.5	1.5
10月末	36,616	6.9	4,564.72	6.9	98.5	1.5
11月末	36,621	6.9	4,565.38	6.9	98.5	1.5
12月末	35,326	3.2	4,403.82	3.2	98.0	2.0
(期 末) 2023年1月26日	34,199	△0.1	4,262.37	△0.2	98.1	1.9

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

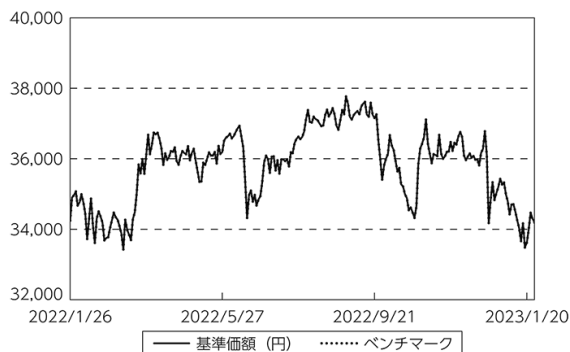
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ0.1%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(−0.2%)を0.1%上回りました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(下落要因)

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

● 投資環境について**◎ 国内REIT市況**

- ・ 国内REIT市況は下落しました。
- ・ 国内REIT市況は期間の初めから、米国金融引き締め観測等を背景に上値の重い展開となりました。期間末にかけては、日銀による金融政策の一部修正等により下落しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

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

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは0.2%の下落となったため、乖離は0.1%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：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。

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

(2022年1月27日～2023年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(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
(投 資 信 託 証 券)	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、35,808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

(2022年1月27日～2023年1月26日)

投資信託証券

銘	柄	買		付		売		付	
		口	数	金	額	口	数	金	額
			千口		千円		千口		千円
	エスコンジャパンリート投資法人		0.415		50,754		0.083		10,492
	サンケイリアルエステート投資法人		0.658		63,672		0.13		13,029
	S O S i L A物流リート投資法人		1 (0.121)		169,696 (16,250)		0.303		46,842
	東海道リート投資法人		0.492		60,281		0.039		4,633
	日本アコモデーションファンド投資法人		0.696		441,744		0.151		99,391
	森ヒルズリート投資法人		2		359,910		0.51		77,353
	産業ファンド投資法人		3		580,798		0.6		107,497
	アドバンス・レジデンス投資法人		2		692,682		0.432		152,384
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		1		362,037		0.296		63,044
	アクティブピア・プロパティーズ投資法人		1		441,260		0.262		109,069
	GLP投資法人		7		1,166,844		2		396,514
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人		1 (0.022)		327,920 (6,645)		0.24		79,302
国	日本プロロジスリート投資法人		3		1,195,555		0.695		238,281
	星野リゾート・リート投資法人		0.394		263,581		0.075		50,255
	Oneリート投資法人		0.353		93,131		0.073		20,025
	イオンリート投資法人		2		331,380		0.907		138,494
	ビューリックリート投資法人		1		307,469		0.391		64,306
	日本リート投資法人		0.737		268,557		0.129		48,401
	積水ハウス・リート投資法人		6		477,323		1		120,376
	トーセイ・リート投資法人		0.515		69,338		0.089		11,948
	ケネディクス商業リート投資法人		1		285,196		0.169		46,648
	ヘルスケア&メディカル投資法人		0.592 (0.096)		97,691 (12,284)		0.103		17,190
	サムティ・レジデンシャル投資法人		0.643 (0.059)		79,130 (7,333)		0.095		12,088
	野村不動産マスターファンド投資法人		6		1,057,676		1		232,547
	いちごホテルリート投資法人		0.335		32,556		0.073		6,824
	ラサールロジポート投資法人		2		427,816		0.634		109,753
	スターアジア不動産投資法人		3		212,568		0.454		26,688
内	マリモ地方創生リート投資法人		0.518		67,362		0.068		9,048
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		0.917 (0.03)		475,600 (17,255)		0.157		84,156
	大江戸温泉リート投資法人		0.322		21,361		0.067		4,553
	投資法人みらい		2		118,532		0.503		25,015
	森トラスト・ホテルリート投資法人		0.43		55,949		0.099		12,819
	三菱地所物流リート投資法人		1 (0.057)		496,653 (23,197)		0.124		57,113
	CREロジスティクスファンド投資法人		0.864		171,981		0.252		52,188
	ザイマックス・リート投資法人		0.375 (0.045)		45,558 (5,086)		0.063		7,917
	タカラレーベン不動産投資法人		0.981 (0.138)		105,306 (14,446)		0.171		19,413
	アドバンス・ロジスティクス投資法人		1		165,181		0.173		26,731
	日本ビルファンド投資法人		2		1,526,424		0.504		345,803
	ジャパンリアルエステイト投資法人		2		1,226,082		0.433		274,940

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国 内	日本都市ファンド投資法人	10	1,056,087	2	230,505
	オリックス不動産投資法人	4	728,128	0.865	160,119
	日本プライムリアルティ投資法人	1	534,448	0.292	117,174
	NIT都市開発リート投資法人	1	283,131	0.4	59,824
	東急リアル・エステート投資法人	1	264,645	0.293	56,960
	グローバル・ワン不動産投資法人	1	191,525	0.357	39,511
	ユナイテッド・アーバン投資法人	4	654,414	1	153,672
	森トラスト総合リート投資法人	1	226,143	0.422	60,735
	インヴィンシブル投資法人	8	395,938	1	80,032
	フロンティア不動産投資法人	0.854	441,573	0.148	76,893
	平和不動産リート投資法人	1 (0.081)	220,396 (11,170)	0.277	41,209
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1	463,019	0.291	93,436
	福岡リート投資法人	1	173,776	0.228	38,318
	ケネディクス・オフィス投資法人	0.755 (2)	402,183 (-)	0.283	169,701
	いちごオフィスリート投資法人	1	140,375	0.359	30,375
	大和証券オフィス投資法人	0.421	287,410	0.118	81,115
	阪急阪神リート投資法人	0.908	135,774	0.194	29,401
	スターツプロシード投資法人	0.423 (0.088)	101,406 (18,562)	0.134	33,318
	大和ハウスリート投資法人	3	924,025	0.613	193,948
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	7	510,874	1	86,205
	大和証券リビング投資法人	2 (0.028)	336,639 (3,202)	0.574	67,315
	ジャパンエクセレント投資法人	1	240,618	0.467	60,484
	SOSiLA物流リート(新)	0.121 (△0.121)	16,250 (△ 16,250)	-	-
	東海道リート投資法人(新)	0.251	28,583	-	-
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人(新)	0.029 (△0.022)	8,106 (△ 6,645)	-	-
	イオンリート投資法人(新)	0.104	14,087	-	-
	ヘルスケア&メディカル投資法人(新)	- (△0.096)	- (△ 12,284)	-	-
	サムティ・レジデンシャル投資法人(新)	0.059 (△0.059)	7,333 (△ 7,333)	-	-
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人(新)	- (△ 0.03)	- (△ 17,255)	-	-
	三菱地所物流リート投資法人(新)	0.057 (△0.057)	23,197 (△ 23,197)	-	-
	ザイマックス・リート投資法人(新)	0.045 (△0.045)	5,086 (△ 5,086)	-	-
タカラレーベン不動産投資法人(新)	0.138 (△0.138)	14,446 (△ 14,446)	-	-	
平和不動産リート投資法人(新)	0.081 (△0.081)	11,170 (△ 11,170)	-	-	
スターツプロシード投資法人(新)	0.088 (△0.088)	18,562 (△ 18,562)	-	-	
大和ハウスリート投資法人(新)	0.027 (△0.027)	8,133 (△ 8,133)	-	-	

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	大和証券リビング投資法人(新)	千口 0.028 (△0.028)	千円 3,202 (△3,202)	千口 -	千円 -
合計		127 ()	23,263,271 (△8,133)	27	5,183,348

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内	不動産投信指数先物取引	百万円 6,587	百万円 5,867	百万円 -	百万円 -

○利害関係人との取引状況等

(2022年1月27日～2023年1月26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		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 23,263	百万円 12,863	% 55.3	百万円 5,183	百万円 3,378	% 65.2
不動産投信指数先物取引	6,587	6,587	100.0	5,867	5,867	100.0

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種類	買付額
投資信託証券	百万円 1,006

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)	320千円
うち利害関係人への支払額 (B)	268千円
(B) / (A)	83.8%

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モルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2023年1月26日現在)

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千口	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人	1	1	182,800	0.2
サンケイリアルエステート投資法人	1	2	211,133	0.3
S O S i L A 物流リート投資法人	2	3	478,410	0.6
東海道リート投資法人	0.449	0.902	107,698	0.1
日本アコモデーションファンド投資法人	2	2	1,489,440	1.9
森ヒルズリート投資法人	6	8	1,326,045	1.7
産業ファンド投資法人	8	11	1,630,717	2.1
アドバンス・レジデンス投資法人	5	7	2,413,306	3.1
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	4	5	1,074,635	1.4
アクティビア・プロパティーズ投資法人	3	3	1,535,457	2.0
GLP投資法人	18	24	3,466,755	4.5
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2	3	1,005,283	1.3
日本プロロジスリート投資法人	9	12	3,656,080	4.7
星野リゾート・リート投資法人	0.982	1	961,439	1.2
One リート投資法人	1	1	321,266	0.4
イオンリート投資法人	6	8	1,206,343	1.5
ヒューリックリート投資法人	5	6	1,071,686	1.4
日本リート投資法人	1	2	800,904	1.0
積水ハウス・リート投資法人	17	22	1,586,992	2.0
トーセイ・リート投資法人	1	1	215,325	0.3
ケネディクス商業リート投資法人	2	3	789,419	1.0
ヘルスケア&メディカル投資法人	1	1	304,627	0.4
サムティ・レジデンシャル投資法人	1	1	213,707	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人	18	24	3,665,829	4.7
いちごホテルリート投資法人	0.97	1	141,433	0.2
ラサールロジポート投資法人	7	9	1,416,893	1.8
スターアジア不動産投資法人	6	9	502,426	0.6
マリモ地方創生リート投資法人	0.686	1	142,568	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2	2	1,313,286	1.7
大江戸温泉リート投資法人	0.946	1	73,741	0.1
投資法人みらい	7	9	397,628	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人	1	1	227,276	0.3
三菱地所物流リート投資法人	1	2	1,031,346	1.3
CREロジスティクスファンド投資法人	2	2	508,784	0.7
ザイマックス・リート投資法人	0.85	1	140,856	0.2
タカラレーベン不動産投資法人	2	3	316,677	0.4
アドバンス・ロジスティクス投資法人	2	3	450,313	0.6
日本ビルファンド投資法人	6	8	4,937,782	6.3
ジャパンリアルエステイト投資法人	5	7	4,165,280	5.3
日本都市ファンド投資法人	29	37	3,790,631	4.9
オリックス不動産投資法人	11	14	2,652,959	3.4
日本プライムリアルティ投資法人	4	5	1,813,515	2.3
NTT都市開発リート投資法人	5	7	963,820	1.2
東急リアル・エステート投資法人	3	4	992,911	1.3
グローバル・ワン不動産投資法人	4	5	586,812	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人	13	16	2,487,530	3.2

銘	柄	期首(前期末)			
		口数	口数	評価額	比率
		千口	千口	千円	%
森トラスト総合リート投資法人		4	5	774,043	1.0
インヴィンシブル投資法人		25	32	1,823,618	2.3
フロンティア不動産投資法人		2	2	1,391,040	1.8
平和不動産リート投資法人		3	5	771,242	1.0
日本ロジスティクスファンド投資法人		3	5	1,524,864	2.0
福岡リート投資法人		3	3	638,602	0.8
ケネディクス・オフィス投資法人		1	4	1,348,172	1.7
いちごオフィスリート投資法人		4	6	519,294	0.7
大和証券オフィス投資法人		1	1	952,338	1.2
阪急阪神リート投資法人		2	3	482,160	0.6
スターツプロシード投資法人		0.912	1	288,993	0.4
大和ハウスリート投資法人		8	11	3,100,118	4.0
ジャパン・ホテル・リート投資法人		17	23	2,005,396	2.6
大和証券リビング投資法人		7	10	1,118,418	1.4
ジャパンエクセレント投資法人		5	6	852,317	1.1
東海道リート投資法人(新)		—	0.251	29,166	0.0
コンフォリア・レジデンシャル投資法人(新)		0.022	0.029	8,340	0.0
イオンリート投資法人(新)		—	0.104	15,031	0.0
ヘルスケア&メディカル投資法人(新)		0.096	—	—	—
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人(新)		0.03	—	—	—
合 計	口数・金額 銘柄数<比率>	341 64	443 64	76,412,934 <98.1%>	

(注) 比率および合計欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) エスコンジャパンリート投資法人、サンケイリアルエステート投資法人、SOSiLA物流リート投資法人、東海道リート投資法人、日本アコモデーションファンド投資法人、森ヒルズリート投資法人、産業ファンド投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、アクティビア・プロパティーズ投資法人、GLP投資法人、コンフォリア・レジデンシャル投資法人、日本プロロジスリート投資法人、星野リゾート・リート投資法人、Oneリート投資法人、イオンリート投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本リート投資法人、積水ハウス・リート投資法人、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、野村不動産マスターファンド投資法人、いちごホテルリート投資法人、ラサールロジポート投資法人、スターアジア不動産投資法人、マリモ地方創生リート投資法人、三井不動産ロジスティクスパーク投資法人、投資法人みらい、森トラスト・ホテルリート投資法人、三菱地所物流リート投資法人、CREロジスティクスファンド投資法人、ザイマックス・リート投資法人、タカラレーベン不動産投資法人、アドバンス・ロジスティクス投資法人、日本ビルファンド投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、日本都市ファンド投資法人、オリックス不動産投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、NTT都市開発リート投資法人、東急リアル・エステート投資法人、グローバル・ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、森トラスト総合リート投資法人、インヴィンシブル投資法人、フロンティア不動産投資法人、平和不動産リート投資法人、日本ロジスティクスファンド投資法人、福岡リート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、いちごオフィスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、阪急阪神リート投資法人、スターツプロシード投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、大和証券リビング投資法人、ジャパンエクセレント投資法人につきましては、委託会社の利害関係者である三菱UFJ信託銀行、三菱UFJ銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUFJ証券が当該ファンドの一般事務受託会社等となっています。(各ファンドで開示されている2022年7月29日時点の有価証券報告書または有価証券届出書等より記載)

純資産総額の10%を超える不動産ファンドに関する組入投資証券の内容

当期末において10%を超える銘柄の組入れはございません。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期	
			買 建 額	売 建 額
国内	不動産投信指数先物取引	東証REIT指数	百万円 1,459	百万円 -

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2023年1月26日現在)

区 分	当 期	
	数	量
貸付有価証券<投資証券>総口数		口 53,683

○投資信託財産の構成

(2023年1月26日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
投資証券	千円 76,412,934	% 87.3
コール・ローン等、その他	11,081,557	12.7
投資信託財産総額	87,494,491	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年1月26日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	87,492,052,027
コール・ローン等	10,488,043,309
投資証券(評価額)	76,412,934,920
未収配当金	459,019,346
その他未収収益	235,552
差入委託証拠金	131,818,900
(B) 負債	9,595,097,306
未払金	74,314,750
未払解約金	7,371,356
未払利息	△ 158,215
受入担保金	9,513,569,415
(C) 純資産総額(A-B)	77,896,954,721
元本	22,777,413,306
次期繰越損益金	55,119,541,415
(D) 受益権総口数	22,777,413,306口
1万口当たり基準価額(C/D)	34,199円

<注記事項>

- ①期首元本額 18,179,611,266円
 期中追加設定元本額 6,863,945,251円
 期中一部解約元本額 2,266,143,211円
 また、1口当たり純資産額は、期末3.4199円です。

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

eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	6,284,369,345円
eMAXIS 国内リートインデックス	4,208,838,142円
eMAXIS Slim 国内リートインデックス	3,480,914,231円
つみたて8資産均等バランス	2,900,117,819円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,488,711,080円
オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け)	858,564,722円
三菱UFJ <DC> J-REITインデックスファンド	603,576,534円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型)	448,776,041円
MUKAM 3資産インカムバランスファンド(適格機関投資家転売制限付)	357,470,418円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	343,532,294円
ラップ向けインデックスf 国内リート	218,069,509円
eMAXIS バランス(波乗り型)	151,487,037円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	151,177,661円
日本リートインデックスファンドS	123,474,064円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	122,994,999円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型)	105,236,888円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型)	86,065,093円
J-REITインデックスファンド(ラップ向け)	66,559,524円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	48,039,012円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01(適格機関投資家限定)	43,683,780円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11(適格機関投資家限定)	41,380,171円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07(適格機関投資家限定)	41,189,187円

○損益の状況 (2022年1月27日~2023年1月26日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	2,657,700,972
受取配当金	2,654,694,915
受取利息	37,702
その他収益金	3,488,439
支払利息	△ 520,084
(B) 有価証券売買損益	△ 3,231,305,209
売買益	2,621,713,964
売買損	△ 5,853,019,173
(C) 先物取引等取引損益	14,077,030
取引益	127,773,310
取引損	△ 113,696,280
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 559,527,207
(E) 前期繰越損益金	44,074,779,357
(F) 追加信託差損益金	17,518,572,458
(G) 解約差損益金	△ 5,914,283,193
(H) 計(D+E+F+G)	55,119,541,415
次期繰越損益金(H)	55,119,541,415

(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。

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)	41,025,580円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	40,524,225円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	40,129,598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)	36,872,615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)	36,383,347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)	36,375,423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)	36,352,853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)	36,247,289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)	36,183,882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)	36,150,033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)	36,098,235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)	35,735,992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)	35,712,758円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	35,670,793円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	24,008,507円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	22,277,579円
三菱UFJ 国内リートインデックスファンド	15,846,563円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	10,438,274円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	4,559,924円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	2,964,387円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	1,284,800円
eMAXIS マイマネージャ 1980s	1,205,122円
eMAXIS マイマネージャ 1970s	682,524円
eMAXIS マイマネージャ 1990s	345,282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)	110,170円
合計	22,777,413,306円

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

《第16期》決算日2023年5月12日

[計算期間：2022年5月13日～2023年5月12日]

「ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド」は、5月12日に第16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16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、円ヘッジ・円ベース）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、円ヘッジ・円ベース）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、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。
主要運用対象	MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ヘッジ・円ベース）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、円ヘッジ・円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率	純資 産額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
12期(2019年5月13日)	17,997	3.1	717.72	2.9	88.9	6.8	2.3	49,740
13期(2020年5月12日)	17,659	△ 1.9	703.98	△ 1.9	88.1	9.9	2.3	52,656
14期(2021年5月12日)	24,790	40.4	987.53	40.3	94.5	3.3	2.1	21,043
15期(2022年5月12日)	23,630	△ 4.7	939.04	△ 4.9	94.9	3.2	2.3	16,192
16期(2023年5月12日)	24,311	2.9	965.09	2.8	96.5	1.8	2.1	29,355

(注) MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ヘッジ・円ベース）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で構成されています。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、 円ヘッジ・円ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2022年 5月12日	円	%		%	%	%	%
	23,630	—	939.04	—	94.9	3.2	2.3
5月末	24,954	5.6	991.62	5.6	92.3	5.3	2.3
6月末	22,884	△3.2	908.68	△3.2	95.8	8.0	2.4
7月末	24,111	2.0	958.16	2.0	93.4	2.7	2.4
8月末	23,642	0.1	939.35	0.0	96.5	3.7	2.4
9月末	21,564	△8.7	856.60	△8.8	98.0	3.7	2.3
10月末	22,996	△2.7	913.12	△2.8	96.6	3.6	2.3
11月末	23,525	△0.4	934.63	△0.5	88.6	5.6	2.1
12月末	22,913	△3.0	909.90	△3.1	88.0	6.4	2.1
2023年 1月末	23,969	1.4	952.57	1.4	89.5	9.3	2.1
2月末	23,798	0.7	945.64	0.7	98.5	3.6	2.2
3月末	23,949	1.3	950.94	1.3	90.1	6.9	2.0
4月末	24,365	3.1	966.45	2.9	95.5	3.3	2.1
(期 末) 2023年 5月12日	24,311	2.9	965.09	2.8	96.5	1.8	2.1

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」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

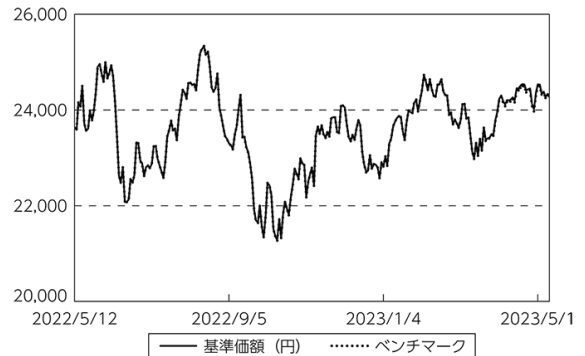
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ2.9%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2.8%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。
- ・ 世界的なインフレへの警戒、米銀破綻による金融システム不安を受けて外国株式市況は期間中下落したものの、米国の利上げペース減速やインフレピークアウトへの期待、堅調な経済指標などを受けて上昇して期間を終えました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ M S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円ヘッジ・円ベース）に採用されている株式（先物・不動産投資信託証券（R E I T）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するモデル

- ・ 組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動性を維持するため、為替ヘッジを行いました。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは2.8%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)

- ・ 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。
- ・ 組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年5月13日～2023年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 1	% 0.006	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(1)	(0.004)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	6	0.027	(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)	(6)	(0.026)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	18	0.074	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保 管 費 用)	(18)	(0.074)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	25	0.107	
期中の平均基準価額は、23,565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

(2022年5月13日～2023年5月12日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ	百株 6,998 (621)	千アメリカドル 71,920 (△ 1)	百株 1,304 (46)	千アメリカドル 11,886 (256)
	カナダ	776 (48)	千カナダドル 5,026 (2)	157 (20)	千カナダドル 891 (74)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	509 (-)	2,440 (△ 11)	102	390
	イタリア	811 (-)	490 (△0.09138)	170	115
	フランス	526 (14)	3,283 (-)	139 (4)	567 (9)
	オランダ	449 (2)	1,750 (16)	61 (2)	334 (18)
	スペイン	873 (487)	713 (9)	596	100
	ベルギー	39 (0.83)	224 (-)	11	30
	オーストリア	11	41	6	13
	ルクセンブルク	22	58	10	12
	フィンランド	177	280	8	36
	アイルランド	107	206	3	11
	ポルトガル	70	59	5	5
スイス	7	90	-	-	
国	イギリス	5,592 (156)	千イギリスポンド 3,793 (△ 16)	1,132 (145)	千イギリスポンド 701 (12)
	スイス	346 (74)	千スイスフラン 2,936 (△ 11)	108 (1)	千スイスフラン 494 (20)
	スウェーデン	743 (176)	千スウェーデンクローネ 11,450 (21)	216 (-)	千スウェーデンクローネ 2,172 (21)
	ノルウェー	122	千ノルウェークローネ 2,691	17	千ノルウェークローネ 465
	デンマーク	97	千デンマーククローネ 6,406	22	千デンマーククローネ 1,098
	オーストラリア	1,487 (86)	千オーストラリアドル 3,496 (1)	415 (8)	千オーストラリアドル 644 (12)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ニュージーランド	百株 70	千ニュージーランドドル 121	百株 50	千ニュージーランドドル 43
	香港	1,212	千香港ドル 6,400	321	千香港ドル 1,077
	シンガポール	870 (668)	千シンガポールドル 499 (-)	70 (0.53)	千シンガポールドル 65 (1)
	イスラエル	171	千イスラエルシェケル 473	6	千イスラエルシェケル 59

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外 国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1	34	0.466	11
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.46	70	0.22	32
	PROLOGIS INC	2 (0.451)	252 (50)	0.368	42
	CAMDEN PROPERTY TRUST	0.182	20	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	0.514	54	0.109	10
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.21	13	—	—
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.197	44	0.088	20
	EXTRA SPACE STORAGE INC	0.254	40	—	—
	WELLTOWER INC	1	87	0.1	7
	BOSTON PROPERTIES INC	0.199	13	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.24	38	0.071	11
	REALTY INCOME CORP	1	82	0.1	6
	REGENCY CENTERS CORP	0.5	30	—	—
	SUN COMMUNITIES INC	0.31	44	—	—
	UDR INC	1	49	0.58	24
	VENTAS INC	0.792	38	—	—
	WEYERHAEUSER CO	1	41	0.303	9
	AMERICAN TOWER CORP	0.993	207	0.124	26
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	2	55	—	—
	WP CAREY INC	0.353	28	—	—
	DUKE REALTY CORP	— (△0.951)	— (△ 50)	—	—
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	2	93	0.83	26
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	1	51	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	0.405	21	—	—
	EQUINIX INC	0.171	117	0.015	8
	CROWN CASTLE INC	0.792	105	0.066	9
	EQUITY RESIDENTIAL	0.685	42	0.175	11
	INVITATION HOMES INC	1	43	—	—
	VICI PROPERTIES INC	1	61	0.306	9
	SBA COMMUNICATIONS CORP	0.284	77	0.041	11
	HOST HOTELS & RESORTS INC	1	19	—	—
PUBLIC STORAGE	0.296	87	0.036	11	
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.646	78	0.102	11	
VORNADO REALTY TRUST	—	—	0.416	10	
KIMCO REALTY CORP	1	20	—	—	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.253	42	0.063	11	
小計	28 (△ 0.5)	2,114 (—)	4	322	

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外 国	ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	フランス				
	GECINA SA	0.214	23	—	—
	KLEPIERRE	—	—	—	—
		(—)	(△ 0.7667)		
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	—	—	—
		(0.684)	(44)		
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.38	22	—	—
				(0.684)	(44)
	小計	0.594	45	—	—
		(0.684)	(43)	(0.684)	(44)
	ベルギー				
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	0.408	14	—	—
	小計	0.408	14	—	—
	ユーロ計	1	59	—	—
		(0.684)	(43)	(0.684)	(44)
	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	SEGRO PLC	2	20	—	—
	小計	2	20	—	—
	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
	SCENTRE GROUP	11	35	—	—
	DEXUS/AU	3	30	—	—
	GPT GROUP	6	31	—	—
	STOCKLAND	8	34	—	—
	GOODMAN GROUP	4	88	0.893	15
	小計	35	221	0.893	15
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	8	409	—	—
	LINK REIT-RIGHTS	—	—	1	4
		(1)	(—)		
小計	8	409	1	4	
	(1)	(—)			
シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル	
CAPITALAND ASCOTT TRUST	—	—	—	—	
	(0.963)	(1)			
CDL HOSPITALITY TRUSTS	—	—	0.079	0.09629	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	5	8	—	—	
	(—)	(△ 0.3576)			
MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	—	—	—	—	
	(—)	(△0.02624)			
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	18	35	—	—	
	(—)	(△0.01888)			
CAPITALAND ASCENDAS REIT	6	18	3	8	
	(—)	(△ 0.2727)			
小計	30	62	3	8	
	(0.963)	(0.34638)			

(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 13,062	百万円 13,269	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

(2022年5月13日～2023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	15,675,525千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	18,347,259千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.85

(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5月13日～2023年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替先物取引	百万円 232,309	百万円 172,449	% 74.2	百万円 243,150	百万円 180,491	% 74.2
為替直物取引	13,609	12,665	93.1	2,620	2,463	94.0

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

○組入資産の明細

(2023年5月12日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AMERICAN EXPRESS CO	16	27	401	54,053	金融サービス
ABBOTT LABORATORIES	44	75	825	111,164	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7	13	168	22,721	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10	18	377	50,872	商業・専門サービス
AES CORP	16	31	69	9,339	公益事業
AFLAC INC	15	24	161	21,694	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	20	30	161	21,699	保険
ADVANCED MICRO DEVICES	41	69	674	90,841	半導体・半導体製造装置
ACCENTURE PLC-CL A	15	26	731	98,530	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5	9	252	34,029	素材
ELEVANCE HEALTH INC	6	10	490	65,985	ヘルスケア機器・サービス
BOSTON SCIENTIFIC CORP	36	58	314	42,329	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	12	20	88	11,949	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	14	24	490	66,004	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	8	11	295	39,735	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	5	9	67	9,150	一般消費財・サービス流通・小売り
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	56	91	630	84,911	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	3	6	395	53,244	金融サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	104	180	679	91,476	電気通信サービス
BALL CORP	8	14	84	11,375	素材
ALLSTATE CORP	7	12	142	19,164	保険
EVERETT DENNISON CORP	2	3	57	7,701	素材
CHUBB LTD	10	17	354	47,773	保険
ANALOG DEVICES INC	13	20	374	50,473	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	0.53	0.79	214	28,878	一般消費財・サービス流通・小売り
CVS HEALTH CORP	33	56	390	52,555	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	20	34	108	14,547	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	74	125	1,702	229,174	銀行
CHARLES RIVER LABORATORIES	1	2	42	5,666	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	13	22	467	62,886	資本財
COCA-COLA CO/THE	103	175	1,117	150,498	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	10	17	155	20,996	金融サービス
CAMPBELL SOUP CO	4	9	52	7,126	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	55	86	275	37,110	運輸
CHEVRON CORP	48	78	1,226	165,100	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	33	54	541	72,862	エネルギー
CME GROUP INC	9	14	272	36,682	金融サービス
CARDINAL HEALTH INC	6	11	98	13,226	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	20	35	287	38,706	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC	20	35	196	26,491	公益事業
DEVON ENERGY CORP	16	23	112	15,174	エネルギー
DEERE & CO	7	12	474	63,840	資本財
DANAHER CORP	16	29	675	90,922	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WALT DISNEY CO/THE	45	78	720	97,010	メディア・娯楽
DARDEN RESTAURANTS INC	3	5	74	10,014	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	19	33	330	44,434	公益事業

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

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	8	14	156	21,116	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	12	19	305	41,194	生活必需品流通・小売り
DAVITA INC	1	2	24	3,243	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	3	6	87	11,722	資本財
DTE ENERGY COMPANY	4	8	97	13,181	公益事業
EXXON MOBIL CORP	107	176	1,863	250,910	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	15	27	247	33,323	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	14	24	269	36,264	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	15	24	203	27,371	資本財
EXELON CORP	24	41	178	23,991	公益事業
ECOLAB INC	6	11	204	27,536	素材
EQUIFAX INC	3	4	98	13,243	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5	9	193	26,107	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	10	16	272	36,731	資本財
EDISON INTERNATIONAL	9	16	120	16,272	公益事業
ENTERGY CORP	5	8	85	11,450	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	1	1	61	8,286	保険
NEXTERA ENERGY INC	49	85	647	87,218	公益事業
FEDEX CORP	6	10	231	31,178	運輸
FORD MOTOR CO	99	174	206	27,809	自動車・自動車部品
FIRST HORIZON CORP	—	24	23	3,198	銀行
FRANKLIN RESOURCES INC	8	14	36	4,915	金融サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	0.93	2	90	12,232	金融サービス
FIRSTENERGY CORP	13	25	102	13,756	公益事業
FREEPORT-MCMORAN INC	37	60	207	27,928	素材
GENERAL MILLS INC	15	26	239	32,226	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	6	9	199	26,833	資本財
WW GRAINGER INC	1	1	120	16,216	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	27	47	467	62,966	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	7	10	107	14,426	金融サービス
GENUINE PARTS CO	3	5	96	12,963	一般消費財・サービス流通・小売り
GRACO INC	—	7	57	7,768	資本財
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8	14	471	63,515	金融サービス
HALLIBURTON CO	22	35	101	13,696	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	17	28	548	73,880	資本財
HP INC	29	38	113	15,225	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8	12	87	11,777	保険
HERSHEY CO/THE	3	6	164	22,196	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC	26	43	1,254	168,908	一般消費財・サービス流通・小売り
HASBRO INC	3	7	46	6,294	耐久消費財・アパレル
TRANE TECHNOLOGIES PLC	5	10	187	25,212	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	22	38	469	63,251	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	9	13	44	5,955	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	7	12	282	38,076	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	9	15	55	7,522	メディア・娯楽
IDEX CORP	2	3	66	8,902	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6	10	88	11,871	素材
JOHNSON & JOHNSON	66	110	1,785	240,387	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KELLOGG CO	6	11	82	11,098	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	8	14	204	27,525	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	35	59	462	62,284	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	17	30	150	20,325	生活必需品流通・小売り

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ELI LILLY & CO	20	34	1,518	204,471	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CORP OF AMER HLDGS	2	3	75	10,222	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	3	11	32	4,329	運輸
LENNAR CORP-A	6	10	118	15,961	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	17	25	526	70,834	一般消費財・サービス流通・小売り
BATH & BODY WORKS INC	6	11	36	4,950	一般消費財・サービス流通・小売り
LAS VEGAS SANDS CORP	9	13	83	11,221	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	6	9	432	58,249	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	4	-	-	-	保険
LENNOX INTERNATIONAL INC	0.83	1	52	7,130	資本財
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	7	11	198	26,733	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	18	31	930	125,333	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	8	14	529	71,352	金融サービス
MEDTRONIC PLC	33	57	514	69,283	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	63	107	1,268	170,807	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	28	44	277	37,317	半導体・半導体製造装置
3M CO	14	23	232	31,355	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4	6	201	27,103	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9	11	48	6,554	消費者サービス
MASCO CORP	6	9	50	6,774	資本財
M & T BANK CORP	4	8	99	13,356	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	12	20	377	50,873	保険
MOLINA HEALTHCARE INC	1	2	62	8,408	ヘルスケア機器・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	1	1	14	1,908	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	33	54	449	60,506	金融サービス
MCKESSON CORP	3	5	228	30,824	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	18	30	154	20,801	保険
MOODY'S CORP	4	6	214	28,907	金融サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	6	9	202	27,294	運輸
BANK OF AMERICA CORP	186	308	845	113,855	銀行
NISOURCE INC	10	18	50	6,858	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	3	6	264	35,559	資本財
NEWMONT CORP	20	34	159	21,439	素材
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6	11	103	13,978	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	0.34	0.62	85	11,467	保険
NUCOR CORP	7	11	164	22,123	素材
NEWELL BRANDS INC	9	9	8	1,184	耐久消費財・アパレル
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	23	30	177	23,888	エネルギー
OMNICOM GROUP	5	8	81	10,980	メディア・娯楽
PEPSICO INC	34	58	1,142	153,846	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	2	4	53	7,215	素材
ALTRIA GROUP INC	46	73	334	45,001	食品・飲料・タバコ
PROCTER & GAMBLE CO/THE	61	101	1,559	209,975	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	10	16	187	25,217	銀行
PFIZER INC	141	239	900	121,212	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9	15	127	17,114	保険
PULTEGROUP INC	6	10	70	9,427	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP	3	5	174	23,466	資本財
PIIONEER NATURAL RESOURCES CO	5	10	219	29,485	エネルギー
CITIGROUP INC	50	83	383	51,583	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6	9	64	8,641	保険
PPG INDUSTRIES INC	6	10	150	20,287	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	4	7	46	6,261	資本財
P G & E CORP	37	57	99	13,459	公益事業
PPL CORP	19	31	90	12,207	公益事業
PROGRESSIVE CORP	14	25	343	46,180	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	12	23	146	19,712	公益事業
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5	9	72	9,765	消費者サービス
REPUBLIC SERVICES INC	5	10	154	20,739	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	23	36	57	7,680	銀行
ROPER TECHNOLOGIES INC	2	4	204	27,589	ソフトウェア・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	15	23	68	9,277	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	2	5	36	4,881	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	2	5	144	19,482	資本財
SCHLUMBERGER LTD	35	58	259	34,906	エネルギー
STRYKER CORP	8	15	430	57,924	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	36	63	303	40,810	金融サービス
SEMPRA ENERGY	8	12	199	26,820	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6	10	237	31,949	素材
STANLEY BLACK & DECKER INC	4	7	63	8,588	資本財
TRAVELERS COS INC/THE	6	9	176	23,725	保険
SOUTHERN CO/THE	26	47	352	47,446	公益事業
AT&T INC	180	305	518	69,776	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	7	13	43	5,872	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	9	14	95	12,811	金融サービス
SYSCO CORP	12	21	158	21,360	生活必需品流通・小売り
SEALED AIR CORP	3	3	15	2,141	素材
TEXAS INSTRUMENTS INC	23	38	622	83,863	半導体・半導体製造装置
TERADYNE INC	4	6	58	7,880	半導体・半導体製造装置
GLOBE LIFE INC	2	4	50	6,735	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	17	28	177	23,962	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	9	16	899	121,039	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	5	8	54	7,329	資本財
UNION PACIFIC CORP	16	26	519	69,895	運輸
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	37	63	603	81,265	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	23	39	1,954	263,075	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	35	58	168	22,722	銀行
MARATHON OIL CORP	—	21	48	6,573	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	18	31	539	72,696	運輸
VALERO ENERGY CORP	10	16	179	24,149	エネルギー
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	15	24	38	5,148	メディア・娯楽
VF CORP	8	16	34	4,652	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	3	5	103	13,954	素材
WILLIAMS COS INC	30	52	153	20,688	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	18	28	88	11,922	生活必需品流通・小売り
WEC ENERGY GROUP INC	7	15	141	19,062	公益事業
WALMART INC	38	63	974	131,232	生活必需品流通・小売り
WELLS FARGO & CO	100	162	624	84,072	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	10	16	287	38,653	商業・専門サービス
WATERS CORP	1	2	79	10,646	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHIRLPOOL CORP	1	2	32	4,314	耐久消費財・アパレル
XCEL ENERGY INC	13	25	175	23,603	公益事業
KEYCORP	23	43	39	5,333	銀行
CARMAX INC	4	6	49	6,723	一般消費財・サービス流通・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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5	8	110	14,924	ヘルスケア機器・サービス
YUM! BRANDS INC	7	12	171	23,112	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	30	50	396	53,365	一般消費財・サービス流通・小売り
CLOROX COMPANY	3	4	83	11,233	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP	2	4	47	6,446	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	6	11	232	31,326	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	20	37	38	5,179	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	15	26	148	19,948	金融サービス
CONAGRA BRANDS INC	12	20	73	9,906	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	8	14	144	19,398	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	17	27	64	8,622	銀行
INTEL CORP	102	178	513	69,199	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	106	174	811	109,236	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	2	3	183	24,708	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	11	19	956	128,719	生活必需品流通・小売り
APPLIED MATERIALS INC	22	36	426	57,420	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	7	12	155	20,988	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	7	14	70	9,545	食品・飲料・タバコ
GEN DIGITAL INC	14	27	47	6,454	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	8	15	157	21,160	一般消費財・サービス流通・小売り
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14	23	169	22,877	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	32	53	657	88,475	耐久消費財・アパレル
EXACT SCIENCES CORP	4	8	65	8,786	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	14	22	524	70,646	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NORTHERN TRUST CORP	4	9	64	8,668	金融サービス
MICROSOFT CORP	180	302	9,371	1,261,730	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	2	3	100	13,549	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	14	25	171	23,119	ヘルスケア機器・サービス
STARBUCKS CORP	29	48	516	69,512	消費者サービス
ORACLE CORP	41	68	671	90,411	ソフトウェア・サービス
NETFLIX INC	11	19	665	89,534	メディア・娯楽
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1	2	251	33,800	一般消費財・サービス流通・小売り
ACTIVISION BLIZZARD INC	19	32	248	33,490	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	4	6	63	8,493	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	3	6	49	6,597	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2	4	117	15,757	一般消費財・サービス流通・小売り
POOL CORP	1	2	80	10,870	一般消費財・サービス流通・小売り
LAM RESEARCH CORP	3	5	293	39,484	半導体・半導体製造装置
COPART INC	5	18	147	19,852	商業・専門サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2	4	42	5,662	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WYNN RESORTS LTD	2	4	48	6,533	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	115	185	750	100,977	メディア・娯楽
PACCAR INC	8	22	165	22,323	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	5	10	44	6,009	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	1	3	100	13,473	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	31	53	423	56,960	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	3	—	—	—	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	9	14	447	60,262	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	6	11	473	63,724	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	1	—	—	—	銀行
PAYCHEX INC	8	13	147	19,821	商業・専門サービス
ON SEMICONDUCTOR	10	19	156	21,064	半導体・半導体製造装置

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

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	
SIGNATURE BANK	1	—	—	—	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2	4	55	7,437	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2	4	142	19,182	運輸
AUTODESK INC	5	9	180	24,255	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	3	13	22	3,076	電気通信サービス
SALESFORCE INC	24	43	881	118,612	ソフトウェア・サービス
AXON ENTERPRISE INC	—	3	61	8,290	資本財
ALPHABET INC-CL A	7	255	2,977	400,851	メディア・娯楽
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1	2	66	8,892	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MARKETAXESS HOLDINGS INC	0.96	1	46	6,265	金融サービス
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	2	44	6,035	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARMIN LTD	3	5	60	8,170	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	6	9	45	6,185	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	28	47	496	66,825	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	6	9	78	10,523	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSIS INC	3	6	236	31,902	ソフトウェア・サービス
AMAZON.COM INC	11	392	4,397	592,074	一般消費財・サービス流通・小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	5	9	96	13,021	金融サービス
QUEST DIAGNOSTICS INC	3	5	65	8,827	ヘルスケア機器・サービス
KLA CORP	3	5	223	30,079	半導体・半導体製造装置
STEEL DYNAMICS INC	5	7	73	9,950	素材
CERNER CORP	7	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	2	4	98	13,208	ソフトウェア・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	6	11	170	22,907	商業・専門サービス
EBAY INC	15	21	98	13,226	一般消費財・サービス流通・小売り
NVIDIA CORP	63	105	3,007	404,944	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	5	8	130	17,573	生活必需品流通・小売り
BOOKING HOLDINGS INC	1	1	422	56,867	消費者サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	32	55	1,802	242,639	金融サービス
TRUIST FINANCIAL CORP	33	55	147	19,910	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	19	32	133	17,925	金融サービス
BORGWARNER INC	5	10	46	6,280	自動車・自動車部品
JM SMUCKER CO/THE	2	4	68	9,259	食品・飲料・タバコ
AMERISOURCEBERGEN CORP	3	5	101	13,687	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	1	1	19	2,594	保険
AMEREN CORPORATION	6	10	90	12,199	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	12	21	193	25,991	公益事業
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	14	23	173	23,343	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	7	12	169	22,784	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	8	15	45	6,112	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
F5 INC	1	3	42	5,734	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	6	6	4	540	メディア・娯楽
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4	6	59	7,969	ソフトウェア・サービス
PLUG POWER INC	12	27	20	2,800	資本財
NETAPP INC	5	8	55	7,478	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	4	7	51	6,894	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENTEGRIS INC	3	5	51	6,918	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	3	6	203	27,427	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	3	7	148	20,014	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	12	20	689	92,801	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6	10	366	49,391	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	27	49	40	5,497	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

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	
WOLFSPEED INC	—	5	23	3,098	半導体・半導体製造装置
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	13	23	146	19,735	ソフトウェア・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	4	6	73	9,833	運輸
FASTENAL CO	14	24	134	18,061	資本財
FISERV INC	15	25	298	40,250	金融サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	24	24	8	1,173	メディア・娯楽
APPLE INC	414	678	11,794	1,587,846	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3	5	61	8,340	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	35	57	53	7,173	銀行
COSTAR GROUP INC	10	15	118	15,886	商業・専門サービス
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3	3	39	5,267	運輸
LUMEN TECHNOLOGIES INC	22	—	—	—	電気通信サービス
ONEOK INC	11	20	130	17,585	エネルギー
CLEVELAND-CLIFFS INC	—	25	36	4,962	素材
BUNGE LTD	3	5	48	6,589	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	1	3	38	5,132	一般消費財・サービス流通・小売り
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4	7	163	22,039	食品・飲料・タバコ
NVR INC	0.08	0.13	75	10,217	耐久消費財・アパレル
COOPER COS INC/THE	1	2	81	10,979	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	—	15	48	6,527	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	15	24	186	25,131	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	5	10	60	8,141	保険
HUBBELL INC	—	2	62	8,372	資本財
MONSTER BEVERAGE CORP	10	33	198	26,703	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA GROUP INC	3	7	66	8,891	消費者サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5	9	62	8,411	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	9	8	16	2,184	電気通信サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2	4	131	17,643	金融サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	6	10	36	4,903	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	14	23	251	33,798	金融サービス
NASDAQ INC	2	16	88	11,939	金融サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	4	7	56	7,610	メディア・娯楽
CBRE GROUP INC - A	8	12	90	12,204	不動産管理・開発
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	0.71	1	242	32,702	消費者サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	7	13	87	11,715	食品・飲料・タバコ
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1	1	62	8,479	半導体・半導体製造装置
ARROW ELECTRONICS INC	1	1	20	2,812	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN & BROWN INC	5	8	53	7,257	保険
CUMMINS INC	3	6	138	18,605	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3	—	—	—	商業・専門サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1	2	100	13,536	素材
ALLIANT ENERGY CORP	6	10	59	7,990	公益事業
MASTERCARD INC - A	22	36	1,416	190,668	金融サービス
WESTERN UNION CO	9	—	—	—	金融サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	3	5	42	5,742	商業・専門サービス
FIRST SOLAR INC	—	3	70	9,470	半導体・半導体製造装置
AERCAP HOLDINGS NV	3	6	37	5,030	資本財
IPG PHOTONICS CORP	0.95	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	9	14	50	6,800	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3	—	—	—	消費者サービス
HEICO CORP	1	1	19	2,674	資本財
TRANSDIGM GROUP INC	1	2	176	23,709	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	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	2	5	92	12,413	商業・専門サービス
INSULET CORP	1	3	99	13,408	ヘルスケア機器・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3	4	93	12,603	保険
BLACKSTONE INC	17	29	243	32,806	金融サービス
TE CONNECTIVITY LTD	8	14	168	22,629	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	7	10	101	13,675	金融サービス
LULULEMON ATHLETICA INC	2	5	205	27,634	耐久消費財・アパレル
MERCADOLIBRE INC	1	1	247	33,339	一般消費財・サービス流通・小売り
VMWARE INC-CLASS A	5	9	112	15,093	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	5	8	49	6,620	保険
SEAGEN INC	3	5	119	16,088	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AECOM	—	6	47	6,353	資本財
MASIMO CORP	1	2	40	5,442	ヘルスケア機器・サービス
ULTA BEAUTY INC	1	1	101	13,720	一般消費財・サービス流通・小売り
LKQ CORP	6	10	59	7,968	一般消費財・サービス流通・小売り
HORMEL FOODS CORP	7	12	49	6,709	食品・飲料・タバコ
ESSENTIAL UTILITIES INC	5	10	42	5,770	公益事業
EASTMAN CHEMICAL CO	3	6	49	6,610	素材
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	4	8	155	20,982	資本財
HUMANA INC	3	5	276	37,175	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	5	5	18	2,444	公益事業
INVESCO LTD	8	8	13	1,791	金融サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4	7	76	10,248	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	2	2	16	2,285	金融サービス
MSCI INC	2	3	142	19,188	金融サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	4	8	54	7,298	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	39	66	635	85,561	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	42	69	1,599	215,311	金融サービス
KEURIG DR PEPPER INC	18	29	96	12,971	食品・飲料・タバコ
COTERRA ENERGY INC	19	35	85	11,501	エネルギー
T-MOBILE US INC	15	27	389	52,447	電気通信サービス
RESMED INC	3	6	155	20,885	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	2	3	92	12,394	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	5	10	152	20,573	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	9	17	133	17,943	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	6	9	94	12,755	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2	3	58	7,929	運輸
QUANTA SERVICES INC	—	5	94	12,659	資本財
FMC CORP	3	5	57	7,680	素材
WABTEC CORP	4	7	68	9,256	資本財
EVERSOURCE ENERGY	8	13	103	13,930	公益事業
CROWN HOLDINGS INC	3	5	49	6,602	素材
DELTA AIR LINES INC	4	4	15	2,128	運輸
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4	9	135	18,205	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	3	6	131	17,712	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	5	9	206	27,849	生活必需品流通・小売り
FORTINET INC	3	28	191	25,744	ソフトウェア・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	0.58	0.86	115	15,608	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENERAL MOTORS CO	33	59	198	26,673	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	6	10	177	23,861	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	6	11	100	13,588	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1	1	36	4,980	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	
NORDSON CORP	1	2	51	6,986	資本財
HCA HEALTHCARE INC	6	8	246	33,247	ヘルスケア機器・サービス
MARATHON PETROLEUM CORP	15	19	217	29,260	エネルギー
ZILLOW GROUP INC - A	1	—	—	—	不動産管理・開発
ATMOS ENERGY CORP	3	5	68	9,221	公益事業
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	3	5	32	4,420	資本財
DEXCOM INC	2	16	199	26,812	ヘルスケア機器・サービス
XYLEM INC	4	7	83	11,293	資本財
ABIOMED INC	1	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1	3	41	5,555	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4	—	—	—	銀行
ALLEGHANY CORP	0.35	—	—	—	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	2	4	325	43,763	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	12	20	194	26,217	エネルギー
META PLATFORMS INC-CLASS A	59	95	2,262	304,651	メディア・娯楽
CMS ENERGY CORP	7	12	74	10,010	公益事業
ALBEMARLE CORP	2	4	89	12,000	素材
KINDER MORGAN INC	51	87	145	19,643	エネルギー
APTIV PLC	6	10	98	13,316	自動車・自動車部品
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4	9	36	4,904	資本財
SPLUNK INC	4	7	65	8,828	ソフトウェア・サービス
HEICO CORP-CLASS A	1	3	47	6,397	資本財
ABBVIE INC	44	75	1,111	149,574	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1	1	78	10,580	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TESLA INC	21	114	1,970	265,309	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	6	10	155	20,879	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4	8	70	9,491	金融サービス
ZOETIS INC	11	19	356	48,050	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1	2	106	14,350	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	9	23	39	5,323	メディア・娯楽
SNAP-ON INC	1	2	57	7,721	資本財
PERKINELMER INC	2	5	62	8,366	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIO-TECHNE CORP	0.99	6	53	7,268	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TWITTER INC	20	—	—	—	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1	3	47	6,342	金融サービス
WORKDAY INC-CLASS A	4	9	173	23,311	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	5	8	387	52,155	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1	1	26	3,506	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1	3	74	10,092	金融サービス
ALLEGION PLC	2	3	42	5,686	資本財
DARLING INGREDIENTS INC	—	7	47	6,372	食品・飲料・タバコ
ALPHABET INC-CL C	7	233	2,734	368,086	メディア・娯楽
UNITED RENTALS INC	1	2	88	11,963	資本財
WESTLAKE CORP	—	1	11	1,587	素材
IQVIA HOLDINGS INC	4	8	153	20,654	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	9	17	44	6,036	金融サービス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	7	12	176	23,731	消費者サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	4	6	85	11,549	エネルギー
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	4	7	101	13,638	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LIBERTY BROADBAND-C	3	4	33	4,521	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-A	0.66	—	—	—	メディア・娯楽
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2	7	95	12,881	メディア・娯楽

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

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	
OWENS CORNING	2	2	27	3,661	資本財
PALO ALTO NETWORKS INC	2	12	251	33,820	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	13	15	43	5,896	金融サービス
QORVO INC	2	5	46	6,205	半導体・半導体製造装置
REPLIGEN CORP	—	2	39	5,270	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5	8	189	25,511	保険
ARAMARK	5	11	44	5,999	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	12	19	48	6,567	銀行
LEAR CORP	1	3	43	5,849	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3	4	100	13,539	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TARGA RESOURCES CORP	—	8	59	7,984	エネルギー
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1	1	16	2,171	ソフトウェア・サービス
WESTROCK CO	6	13	38	5,157	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	17	28	115	15,504	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	28	45	290	39,124	金融サービス
EPAM SYSTEMS INC	1	2	59	8,050	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	1	1	49	6,643	商業・専門サービス
ZILLOW GROUP INC - C	4	4	21	2,918	不動産管理・開発
HORIZON THERAPEUTICS PLC	5	8	92	12,517	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	32	59	82	11,066	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
U-HAUL HOLDING CO	0.23	—	—	—	運輸
CDW CORP/DE	3	5	87	11,771	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	1	2	72	9,725	半導体・半導体製造装置
ARISTA NETWORKS INC	5	10	143	19,276	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNEX CORP	4	8	43	5,790	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSUNION	4	7	50	6,789	商業・専門サービス
GODADDY INC - CLASS A	4	5	36	4,892	ソフトウェア・サービス
ZENDESK INC	3	—	—	—	ソフトウェア・サービス
WAYFAIR INC- CLASS A	2	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
PAYLOCITY HOLDING CORP	—	2	35	4,759	商業・専門サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4	7	21	2,875	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	1	1	4	671	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-LIBERTY-C	4	7	56	7,650	メディア・娯楽
VAIL RESORTS INC	1	2	47	6,446	消費者サービス
BIO-RAD LABORATORIES-A	0.6	1	40	5,493	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA INC	0.92	1	40	5,413	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	3	5	175	23,646	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	2	4	202	27,259	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A. O.) CORP	3	5	39	5,331	資本財
UGI CORP	5	10	31	4,175	公益事業
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	5	8	57	7,685	食品・飲料・タバコ
FORTIVE CORP	8	14	94	12,693	資本財
ATLASSIAN CORP-CL A	—	5	78	10,539	ソフトウェア・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	6	9	53	7,171	商業・専門サービス
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	1	—	—	—	ソフトウェア・サービス
COUPA SOFTWARE INC	1	—	—	—	ソフトウェア・サービス
HOWMET AEROSPACE INC	9	13	58	7,812	資本財
ALCOA CORP	—	8	30	4,100	素材
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	5	66	8,965	食品・飲料・タバコ
TELEFLEX INC	1	1	42	5,748	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3	5	94	12,714	ヘルスケア機器・サービス
TWILIO INC - A	4	7	37	5,056	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	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2	4	62	8,348	金融サービス
SNAP INC - A	27	46	40	5,469	メディア・娯楽
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1	3	38	5,138	保険
ROLLINS INC	5	10	46	6,262	商業・専門サービス
FAIR ISAAC CORP	0.65	0.88	65	8,877	ソフトウェア・サービス
BAKER HUGHES CO	20	46	127	17,153	エネルギー
OKTA INC	3	6	52	7,052	ソフトウェア・サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	13	22	140	18,914	素材
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3	7	42	5,683	運輸
BLACK KNIGHT INC	4	7	40	5,496	ソフトウェア・サービス
SEA LTD-ADR	8	14	126	17,020	メディア・娯楽
BLOCK INC	12	24	142	19,165	金融サービス
VISTRA CORP	10	18	45	6,123	公益事業
INGERSOLL-RAND INC	10	16	92	12,490	資本財
NOVOCURE LTD	2	2	17	2,334	ヘルスケア機器・サービス
HUBSPOT INC	1	2	123	16,650	ソフトウェア・サービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	1	1	68	9,155	ソフトウェア・サービス
PTC INC	2	4	56	7,670	ソフトウェア・サービス
ZSCALER INC	2	3	41	5,640	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	10	17	1,124	151,345	半導体・半導体製造装置
EVERGY INC	6	11	70	9,430	公益事業
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	11	17	111	15,073	メディア・娯楽
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	0.72	0.72	16	2,267	保険
DOCUSIGN INC	5	8	41	5,564	ソフトウェア・サービス
TELADOC HEALTH INC	3	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
LINDE PLC	12	—	—	—	素材
WIX.COM LTD	1	1	11	1,515	ソフトウェア・サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	9	15	37	5,043	金融サービス
BURLINGTON STORES INC	1	2	45	6,103	一般消費財・サービス流通・小売り
KKR & CO INC	13	25	122	16,531	金融サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	10	10	9	1,278	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
THE CIGNA GROUP	8	12	325	43,789	ヘルスケア機器・サービス
DELL TECHNOLOGIES -C	7	12	55	7,414	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CAESARS ENTERTAINMENT INC	5	9	42	5,664	消費者サービス
MONGODB INC	1	3	90	12,159	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS A	8	11	36	4,864	メディア・娯楽
FOX CORP - CLASS B	3	5	14	2,001	メディア・娯楽
DOW INC	18	31	166	22,400	素材
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	5	8	52	7,106	ソフトウェア・サービス
AVALARA INC	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DROPBOX INC-CLASS A	8	8	17	2,368	ソフトウェア・サービス
STERIS PLC	2	4	83	11,257	ヘルスケア機器・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	36	62	241	32,571	運輸
CORTEVA INC	18	31	179	24,169	素材
AMCOR PLC	38	62	64	8,728	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	4	8	106	14,304	ソフトウェア・サービス
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	2	5	40	5,461	金融サービス
ROKU INC	2	6	37	5,082	メディア・娯楽
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	3	5	52	7,032	商業・専門サービス
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	—	3	58	7,895	金融サービス
DATADOG INC - CLASS A	5	9	86	11,595	ソフトウェア・サービス
LYFT INC-A	6	—	—	—	運輸

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

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	
PINTEREST INC- CLASS A	14	28	60	8,128	メディア・娯楽
CABLE ONE INC	0.14	—	—	—	メディア・娯楽
CARVANA CO	1	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
CHEWY INC - CLASS A	2	2	7	1,047	一般消費財・サービス流通・小売り
PELOTON INTERACTIVE INC-A	6	—	—	—	耐久消費財・アパレル
ETSY INC	3	4	43	5,876	一般消費財・サービス流通・小売り
AVANTOR INC	14	31	64	8,636	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MODERNA INC	8	13	177	23,960	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	2	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CLARIVATE PLC	8	8	7	960	商業・専門サービス
CERIDIAN HCM HOLDING INC	3	6	35	4,756	商業・専門サービス
DYNATRACE INC	4	9	43	5,803	ソフトウェア・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	6	10	52	7,111	ソフトウェア・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス
RPM INTERNATIONAL INC	3	5	45	6,131	素材
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	37	21	40	5,440	金融サービス
AGNC INVESTMENT CORP	13	—	—	—	金融サービス
BILL HOLDINGS INC	2	4	39	5,359	ソフトウェア・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	1	1	20	2,743	資本財
AON PLC-CLASS A	5	8	279	37,684	保険
OTIS WORLDWIDE CORP	10	18	156	21,044	資本財
CARRIER GLOBAL CORP	20	37	160	21,634	資本財
CARLYLE GROUP INC/THE	4	9	25	3,438	金融サービス
CATALENT INC	4	7	24	3,245	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MATCH GROUP INC	6	9	31	4,199	メディア・娯楽
IAC INC	2	—	—	—	メディア・娯楽
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	7	7	14	1,996	メディア・娯楽
SNOWFLAKE INC-CLASS A	5	10	181	24,476	ソフトウェア・サービス
SUNRUN INC	4	—	—	—	資本財
ASANA INC - CL A	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス
FIVERR INTERNATIONAL LTD	1	—	—	—	商業・専門サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	9	14	51	6,888	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITY SOFTWARE INC	1	9	30	4,134	ソフトウェア・サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	40	70	69	9,424	ソフトウェア・サービス
VIATRIS INC	32	50	46	6,325	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENPHASE ENERGY INC	3	5	93	12,555	半導体・半導体製造装置
DOORDASH INC - A	3	8	57	7,791	消費者サービス
KORNIT DIGITAL LTD	1	—	—	—	資本財
AIRBNB INC-CLASS A	7	16	178	23,998	消費者サービス
AFFIRM HOLDINGS INC	4	—	—	—	金融サービス
ARES MANAGEMENT CORP - A	—	7	59	7,986	金融サービス
TORO CO	—	4	50	6,814	資本財
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	4	8	36	4,870	ソフトウェア・サービス
NOVAVAX INC	1	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
APA CORP	—	13	45	6,150	エネルギー
ROBLOX CORP -CLASS A	—	14	57	7,795	メディア・娯楽
UPSTART HOLDINGS INC	0.6	—	—	—	金融サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	20	37	150	20,309	半導体・半導体製造装置
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	5	7	45	6,086	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1	1	4	636	金融サービス
INMODE LTD	2	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	14	—	—	—	メディア・娯楽

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	4	8	11	1,490	自動車・自動車部品	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	1	6	36	4,874	金融サービス	
LUCID GROUP INC	11	11	7	1,045	自動車・自動車部品	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	5	—	—	—	金融サービス	
SOFI TECHNOLOGIES INC	15	—	—	—	金融サービス	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	30	30	9	1,296	運輸	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	8	17	110	14,875	金融サービス	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	0.33	0.33	40	5,481	銀行	
WEBSTER FINANCIAL CORP	4	7	25	3,478	銀行	
CONSTELLATION ENERGY	7	12	99	13,421	公益事業	
WARNER BROS DISCOVERY INC	55	104	129	17,492	メディア・娯楽	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	—	5	41	5,616	エネルギー	
HF SINCLAIR CORP	—	4	17	2,408	エネルギー	
DRAFTKINGS INC-CL A	7	—	—	—	消費者サービス	
FERGUSON PLC	—	8	125	16,912	資本財	
OVINTIV INC	—	12	41	5,543	エネルギー	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	—	2	62	8,347	素材	
CARLISLE COS INC	—	2	44	5,982	資本財	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	—	0.26	35	4,775	エネルギー	
JACOBS SOLUTIONS INC	—	5	60	8,105	商業・専門サービス	
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	—	2	11	1,527	運輸	
ASPEN TECHNOLOGY INC	—	0.8	13	1,792	ソフトウェア・サービス	
TOAST INC-CLASS A	—	6	13	1,853	金融サービス	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	—	16	120	16,173	ヘルスケア機器・サービス	
LINDE PLC	—	21	779	104,956	素材	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	27	27	11	1,610	不動産管理・開発	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5	6	30	4,087	資本財	
小 計	株 数	8,113	14,383	152,100	20,477,288	
	銘 柄 数 < 比 率 >	607	601	—	< 69.8% >	
(カナダ)				千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA	36	59	766	76,444	銀行	
IMPERIAL OIL LTD	6	10	61	6,103	エネルギー	
THOMSON REUTERS CORP	4	7	119	11,967	商業・専門サービス	
TC ENERGY CORP	25	46	256	25,637	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	9	17	112	11,196	電気通信サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	15	27	174	17,386	保険	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	12	22	127	12,733	素材	
BARRICK GOLD CORP	45	71	182	18,187	素材	
BCE INC	1	2	12	1,283	電気通信サービス	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	4	—	—	—	資本財	
BANK OF MONTREAL	16	28	330	32,992	銀行	
BROOKFIELD CORP	36	61	256	25,633	金融サービス	
BANK OF NOVA SCOTIA	31	50	332	33,210	銀行	
BAUSCH HEALTH COS INC	8	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAE INC	7	17	49	4,934	資本財	
CAMECO CORP	10	17	63	6,348	エネルギー	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	11	41	230	22,997	銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	30	47	353	35,265	エネルギー	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	18	24	388	38,788	運輸	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1	2	34	3,413	一般消費財・サービス流通・小売り	
ENBRIDGE INC	51	84	447	44,661	エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	0.6	0.6	56	5,613	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
CGI INC	5	8	110	11,050	ソフトウェア・サービス
IGM FINANCIAL INC	2	2	7	788	金融サービス
LOBLAW COMPANIES LTD	4	6	74	7,392	生活必需品流通・小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	49	80	209	20,908	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	7	12	86	8,608	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	8	13	131	13,108	銀行
ONEX CORPORATION	2	2	12	1,247	金融サービス
POWER CORP OF CANADA	15	22	78	7,879	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	12	—	—	—	メディア・娯楽
SUNCOR ENERGY INC	37	57	221	22,109	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	2	4	71	7,092	生活必需品流通・小売り
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	23	39	426	42,514	運輸
AGNICO EAGLE MINES LTD	11	19	149	14,947	素材
KINROSS GOLD CORP	31	31	22	2,227	素材
GREAT-WEST LIFE CO INC	8	8	30	3,026	保険
TMX GROUP LTD	1	3	43	4,369	金融サービス
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6	11	44	4,471	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	7	7	24	2,488	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	16	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TELUS CORP	11	11	30	3,037	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	16	25	77	7,716	素材
FORTIS INC	12	24	146	14,645	公益事業
LUNDIN MINING CORP	16	16	16	1,620	素材
PAN AMERICAN SILVER CORP	6	6	13	1,363	素材
TORONTO-DOMINION BANK	46	77	632	63,138	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	5	8	167	16,669	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	11	21	142	14,195	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	5	10	35	3,529	生活必需品流通・小売り
CANADIAN UTILITIES LTD-A	3	3	11	1,176	公益事業
METRO INC/CN	6	10	77	7,769	生活必需品流通・小売り
OPEN TEXT CORP	7	13	70	7,046	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	4	7	139	13,937	保険
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3	7	51	5,141	商業・専門サービス
CENOVUS ENERGY INC	33	56	119	11,964	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	—	17	28	2,890	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	8	13	72	7,225	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	14	28	123	12,302	エネルギー
DOLLARAMA INC	7	10	84	8,426	一般消費財・サービス流通・小売り
KEYERA CORP	5	5	16	1,607	エネルギー
ALTAGAS LTD	8	8	18	1,888	公益事業
CONSTELLATION SOFTWARE INC	0.5	0.8	207	20,733	ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN	6	11	115	11,567	消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2	3	30	2,995	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	4	8	54	5,406	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	—	12	24	2,424	金融サービス
HYDRO ONE LTD	8	15	58	5,858	公益事業
EMERA INC	7	13	75	7,583	公益事業
IVANHOE MINES LTD-CL A	18	18	19	1,970	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	2	53	450	44,918	ソフトウェア・サービス
NUTRIEN LTD	14	22	190	19,016	素材
WSP GLOBAL INC	3	6	104	10,408	資本財
CANOPY GROWTH CORP	7	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
IA FINANCIAL CORP INC	3	5	42	4,247	保険
QUEBECOR INC -CL B	4	4	13	1,353	メディア・娯楽
ATR CANADA	7	3	6	628	運輸
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	16	43	49	4,981	公益事業
PARKLAND CORP	4	4	13	1,333	エネルギー
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	3	3	14	1,421	公益事業
FIRSTSERVICE CORP	1	3	59	5,970	不動産管理・開発
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	5	11	56	5,604	商業・専門サービス
NORTHLAND POWER INC	5	11	31	3,154	公益事業
TOROMONT INDUSTRIES LTD	2	4	41	4,163	資本財
LIGHTSPEED COMMERCE INC	3	—	—	—	ソフトウェア・サービス
NUVEL CORP-SUBORDINATE VTG	2	2	9	977	金融サービス
TFI INTERNATIONAL INC	2	4	57	5,718	運輸
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	22	34	228	22,803	生活必需品流通・小売り
BRP INC/CA- SUB VOTING	—	1	9	985	耐久消費財・アパレル
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	—	6	63	6,340	ソフトウェア・サービス
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	—	15	67	6,770	金融サービス
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,003 86	1,650 85	10,278 —	1,025,661 <3.5%>
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
COMMERZBANK AG	24	36	35	5,273	銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	52	81	78	11,533	金融サービス
SIEMENS AG-REG	19	33	492	72,323	資本財
RWE AG	16	24	103	15,201	公益事業
BASF SE	23	41	196	28,890	素材
VOLKSWAGEN AG	0.85	0.85	12	1,870	自動車・自動車部品
MERCEDES-BENZ GROUP AG	21	34	231	34,031	自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	4	5	42	6,173	家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE	57	98	117	17,237	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	8	14	162	23,847	自動車・自動車部品
BAYER AG-REG	24	40	220	32,373	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANZ SE-REG	10	17	378	55,632	保険
CONTINENTAL AG	2	5	38	5,616	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	33	55	185	27,248	半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	3	7	40	5,999	自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	11	27	24	3,658	運輸
DEUTSCHE POST AG-REG	25	45	186	27,401	運輸
SAP SE	26	45	551	81,059	ソフトウェア・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	4	8	142	20,914	金融サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & ADIDAS AG	5	9	44	6,490	ヘルスケア機器・サービス
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	4	6	110	16,309	耐久消費財・アパレル
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	82	141	305	44,845	電気通信サービス
BEIERSDORF AG	3	5	188	27,741	保険
HEIDELBERGCEMENT AG	2	4	52	7,770	家庭用品・パーソナル用品
MERCK KGAA	3	4	29	4,326	素材
VOLKSWAGEN AG-PREF	3	4	81	12,021	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PUMA SE	4	7	88	12,958	自動車・自動車部品
LANXESS AG	2	5	30	4,458	耐久消費財・アパレル
FRESENIUS SE & CO KGAA	2	—	—	—	素材
GEA GROUP AG	10	18	50	7,390	ヘルスケア機器・サービス
SYMRISE AG	3	8	32	4,840	資本財
	3	6	72	10,589	素材

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
HENKEL AG & CO KGAA	3	6	46	6,771	家庭用品・パーソナル用品	
RHEINMETALL AG	—	1	50	7,354	資本財	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2	2	3	565	電気通信サービス	
RATIONAL AG	0.13	0.13	8	1,248	資本財	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1	1	16	2,453	自動車・自動車部品	
HANNOVER RUECK SE	1	2	48	7,129	保険	
BRENTAG SE	4	6	51	7,502	資本財	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1	1	11	1,643	ヘルスケア機器・サービス	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	1	—	—	—	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	18	15	4	693	電気通信サービス	
LEG IMMOBILIEN SE	1	1	10	1,471	不動産管理・開発	
VONOVIA SE	18	30	57	8,464	不動産管理・開発	
EVONIK INDUSTRIES AG	6	12	24	3,536	素材	
ZALANDO SE	5	11	38	5,599	一般消費財・サービス流通・小売り	
COVESTRO AG	4	10	40	5,966	素材	
UNIPER SE	2	—	—	—	公益事業	
KION GROUP AG	1	—	—	—	資本財	
MTU AERO ENGINES AG	1	1	44	6,553	資本財	
DELIVERY HERO SE	4	4	17	2,516	消費者サービス	
SCOUT24 SE	1	1	11	1,733	メディア・娯楽	
SARTORIUS AG-VORZUG	0.62	1	36	5,312	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	7	11	59	8,703	ヘルスケア機器・サービス	
NEMETSCHKE SE	1	1	8	1,321	ソフトウェア・サービス	
BECHTLE AG	1	1	7	1,056	ソフトウェア・サービス	
KNORR-BREMSE AG	1	1	10	1,590	資本財	
HELLOFRESH SE	4	4	9	1,407	生活必需品流通・小売り	
SIEMENS ENERGY AG	10	19	42	6,200	資本財	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	10	21	62	9,121	資本財	
DR ING HC F PORSCHKE AG	—	4	48	7,175	自動車・自動車部品	
小 計	株 数	金 額	623	1,029	5,097	749,126
銘 柄 数 < 比 率 >	59	57	—	< 2.6% >		
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	28	42	79	11,655	保険	
INTESA SANPAOLO	417	733	176	25,883	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	297	297	8	1,185	電気通信サービス	
ENI SPA	62	94	124	18,317	エネルギー	
UNICREDIT SPA	53	85	161	23,683	銀行	
ENEL SPA	205	355	215	31,598	公益事業	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	2	2	11	1,642	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ATLANTIA SPA	11	—	—	—	運輸	
MEDIOBANCA SPA	16	39	38	5,660	銀行	
SNAM SPA	52	93	47	6,930	公益事業	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	36	61	48	7,168	公益事業	
PRYSMIAN SPA	6	12	44	6,556	資本財	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	7	7	9	1,325	電気通信サービス	
POSTE ITALIANE SPA	15	16	15	2,303	保険	
FINECOBANK SPA	15	23	29	4,278	銀行	
MONCLER SPA	4	7	49	7,213	耐久消費財・アパレル	
DIASORIN SPA	0.77	0.77	8	1,185	ヘルスケア機器・サービス	
AMPLIFON SPA	3	3	11	1,619	ヘルスケア機器・サービス	

銘柄	株数	当 期		業 種 等		
		株 数	株 数		評 価 額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
NEXI SPA	13	13	10	1,531	金融サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,249	1,890	1,086	159,740	
	銘柄 数 < 比 率 >	19	18	—	< 0.5% >	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)	4	25	72	10,594	自動車・自動車部品	
LVHM MOET HENNESSY LOUIS VUI	7	11	1,051	154,573	耐久消費財・アパレル	
AXA SA	49	77	208	30,602	保険	
DANONE	16	29	172	25,283	食品・飲料・タバコ	
CARREFOUR SA	15	26	47	7,010	生活必需品流通・小売り	
VIVENDI SE	20	41	40	5,917	メディア・娯楽	
SOCIETE GENERALE SA	20	40	87	12,888	銀行	
AIR LIQUIDE SA	12	21	350	51,533	素材	
TOTALENERGIES SE	63	107	589	86,668	エネルギー	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	12	21	115	16,948	資本財	
VINCI SA	13	22	243	35,792	資本財	
SANOFI	28	49	489	71,886	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	16	31	87	12,789	公益事業	
L'OREAL	6	10	441	64,819	家庭用品・パーソナル用品	
ACCOR SA	3	11	38	5,669	消費者サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	13	22	353	51,999	資本財	
BNP PARIBAS	28	46	266	39,098	銀行	
ESSILORLUXOTTICA	7	12	231	34,003	ヘルスケア機器・サービス	
CAPGEMINI SE	4	7	125	18,398	ソフトウェア・サービス	
VALEO	5	5	9	1,379	自動車・自動車部品	
HERMES INTERNATIONAL	0.81	1	264	38,872	耐久消費財・アパレル	
SODEXO SA	2	4	47	6,929	消費者サービス	
KERING	1	3	183	26,906	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SE	16	25	93	13,752	ソフトウェア・サービス	
ORANGE	50	82	95	13,993	電気通信サービス	
CNP ASSURANCES	4	—	—	—	保険	
SAFRAN SA	8	15	211	31,136	資本財	
RENAULT SA	4	9	30	4,441	自動車・自動車部品	
PUBLICIS GROUPE	5	8	60	8,900	メディア・娯楽	
BOUYGUES SA	6	6	20	3,060	資本財	
THALES SA	2	3	51	7,560	資本財	
PERNOD RICARD SA	5	9	194	28,626	食品・飲料・タバコ	
CREDIT AGRICOLE SA	29	54	62	9,211	銀行	
ENGIE	46	70	104	15,367	公益事業	
ALSTOM	8	14	35	5,154	資本財	
ARKEMA	1	3	34	5,076	素材	
LEGRAND SA	6	10	93	13,747	資本財	
ADP	0.62	0.62	8	1,284	運輸	
EDF	15	—	—	—	公益事業	
WENDEL	0.66	0.66	6	967	金融サービス	
BUREAU VERITAS SA	7	14	35	5,244	商業・専門サービス	
EURAZEO SE	0.89	0.89	5	839	金融サービス	
EIFFAGE	2	4	44	6,499	資本財	
ORPEA	1	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
BIOMERIEUX	1	1	11	1,704	ヘルスケア機器・サービス	
GETLINK SE	10	18	30	4,497	運輸	
EDENRED	6	9	53	7,793	金融サービス	
REMY COINTREAU	0.59	0.59	9	1,360	食品・飲料・タバコ	

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		業 種 等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BOLLORE SE	22	22	13	2,017	メディア・娯楽	
DASSAULT AVIATION SA	0.54	1	26	3,838	資本財	
SEB SA	0.52	0.52	5	810	耐久消費財・アパレル	
IPSEN	0.84	0.84	9	1,383	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMUNDI SA	1	1	10	1,471	金融サービス	
FAURECIA	3	—	—	—	自動車・自動車部品	
TELEPERFORMANCE	1	2	33	4,870	商業・専門サービス	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2	—	—	—	メディア・娯楽	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	0.73	1	34	5,011	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WORLDLINE SA	6	11	46	6,783	金融サービス	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	2	2	7	1,106	消費者サービス	
EUROAPI SASU	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	643	1,040	6,995	1,028,082	
	銘柄数<比率>	60	54	—	<3.5%>	
(ユーロ…オランダ)						
QIAGEN N.V.	5	10	43	6,426	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CNH INDUSTRIAL NV	25	46	58	8,645	資本財	
STELLANTIS NV	51	102	152	22,376	自動車・自動車部品	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	12	34	42	6,214	食品・飲料・タバコ	
FERRARI NV	3	5	157	23,081	自動車・自動車部品	
EXOR NV	2	—	—	—	金融サービス	
AIRBUS SE	14	24	300	44,091	資本財	
STMICROELECTRONICS NV	17	30	116	17,133	半導体・半導体製造装置	
EURONEXT NV	2	5	35	5,275	金融サービス	
WOLTERS KLUWER	6	11	121	17,919	商業・専門サービス	
KONINKLIJKE KPN NV	84	146	48	7,114	電気通信サービス	
AKZO NOBEL N.V.	4	8	59	8,784	素材	
HEINEKEN NV	6	9	103	15,201	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	23	45	85	12,608	ヘルスケア機器・サービス	
AEGON NV	42	78	31	4,636	保険	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	26	46	144	21,258	生活必需品流通・小売り	
RANDSTAD NV	2	6	29	4,380	商業・専門サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	2	5	48	7,130	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	4	—	—	—	素材	
ING GROEP NV	99	156	180	26,474	銀行	
ASML HOLDING NV	10	17	1,033	151,887	半導体・半導体製造装置	
OCI NV	—	2	5	850	素材	
NN GROUP NV	7	11	39	5,775	保険	
ABN AMRO BANK NV-CVA	9	20	28	4,160	銀行	
IMCD NV	1	2	37	5,511	資本財	
ASM INTERNATIONAL NV	1	1	63	9,287	半導体・半導体製造装置	
ADYEN NV	0.5	0.84	122	17,986	金融サービス	
JUST EAT TAKEAWAY	4	4	6	994	消費者サービス	
PROSUS NV	23	33	220	32,402	一般消費財・サービス流通・小売り	
JDE PEET'S NV	3	3	8	1,238	食品・飲料・タバコ	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	18	28	53	7,920	メディア・娯楽	
EXOR NV	—	4	36	5,422	金融サービス	
ARGENX SE	1	2	83	12,286	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	520	908	3,500	514,477	
	銘柄数<比率>	31	31	—	<1.8%>	
(ユーロ…スペイン)						
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	6	—	—	—	資本財	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ENDESA SA	7	19	38	5,640	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6	9	29	4,367	資本財
IBERDROLA SA	146	252	296	43,607	公益事業
TELEFONICA SA	133	239	92	13,558	電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA	438	705	221	32,528	銀行
REPSOL SA	36	64	84	12,423	エネルギー
ACCIONA SA	—	0.68	11	1,701	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	168	271	177	26,123	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	4	2	8	1,188	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	27	50	156	23,031	一般消費財・サービス流通・小売り
FERROVIAL SA	12	20	58	8,583	資本財
FERROVIAL SA-RTS	12	—	—	—	資本財
ENAGAS SA	7	7	13	1,993	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	11	20	34	5,022	公益事業
CAIXABANK SA	112	202	67	9,875	銀行
GRIFOLS SA	6	9	10	1,530	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMADEUS IT GROUP SA	11	17	115	17,008	消費者サービス
AENA SME SA	1	2	44	6,527	運輸
CELLNEX TELECOM SA	12	22	85	12,560	電気通信サービス
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	—	2	6	988	公益事業
EDP RENOVEVEIS SA	7	7	14	2,172	公益事業
EDP RENOVEVEIS SA-BONUS-RTS	—	7	0.19709	28	公益事業
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額	
銘柄 数 < 比 率 >	1,172	1,936	1,568	230,462	
(ユーロ…ベルギー)					
AGEAS	4	8	33	4,920	保険
UCB SA	3	4	33	4,987	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	2	2	22	3,236	金融サービス
UMICORE	4	10	31	4,562	素材
COLRUYT SA	0.99	—	—	—	生活必需品流通・小売り
D' IETEREN GROUP	—	0.66	11	1,616	一般消費財・サービス流通・小売り
KBC GROUP NV	6	10	62	9,143	銀行
SOLVAY SA	1	3	38	5,637	素材
PROXIMUS	1	—	—	—	電気通信サービス
SOFINA	0.37	0.37	7	1,129	金融サービス
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	22	36	203	29,921	食品・飲料・タバコ
ELIA GROUP SA/NV	0.36	1	22	3,248	公益事業
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額	
銘柄 数 < 比 率 >	49	78	465	68,405	
(ユーロ…オーストリア)					
ERSTE GROUP BANK AG	9	12	39	5,863	銀行
VERBUND AG	1	1	13	1,957	公益事業
OMV AG	3	8	34	5,036	エネルギー
VOESTALPINE AG	3	3	10	1,482	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3	—	—	—	銀行
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額	
銘柄 数 < 比 率 >	21	25	97	14,340	
(ユーロ…ルクセンブルク)					
AROUNDTOWN SA	23	23	2	358	不動産管理・開発
TENARIS SA	11	25	30	4,450	エネルギー
EUROFINS SCIENTIFIC	3	6	38	5,664	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCELORMITTAL	16	18	44	6,581	素材

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…ルクセンブルク)	百株	百株	千ユーロ	千円	
INPOST SA	7	—	—	—	運輸
小 計	株 数 ・ 金 額	61	73	116	17,055
	銘柄 数 < 比 率 >	5	4	—	< 0.1% >
(ユーロ…フィンランド)					
NOKIA OYJ	136	210	78	11,534	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS	14	32	38	5,607	素材
UPM-KYMMENE OYJ	14	22	69	10,168	素材
FORTUM OYJ	11	11	15	2,248	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	7	7	13	1,957	生活必需品流通・小売り
KONE OYJ-B	8	14	74	10,952	資本財
SAMPO OYJ-A SHS	12	19	88	12,954	保険
WARTSILA OYJ ABP	10	10	11	1,628	資本財
ELISA OYJ	3	7	40	5,885	電気通信サービス
NESTE OYJ	10	17	67	9,907	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	3	3	12	1,886	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METSO CORPORATION	—	45	48	7,079	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	231	400	556	81,812
	銘柄 数 < 比 率 >	11	12	—	< 0.3% >
(ユーロ…アイルランド)					
KERRY GROUP PLC-A	4	6	59	8,672	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC	3	6	43	6,354	資本財
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	4	6	122	17,987	消費者サービス
BANK OF IRELAND GROUP PLC	—	49	43	6,410	銀行
AIB GROUP PLC	—	31	12	1,780	銀行
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	6	12	43	6,443	素材
CRH PLC	19	28	130	19,133	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	37	142	454	66,783
	銘柄 数 < 比 率 >	5	7	—	< 0.2% >
(ユーロ…ポルトガル)					
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	71	117	56	8,289	公益事業
JERONIMO MARTINS	7	16	37	5,438	生活必需品流通・小売り
GALP ENERGIA SGPS SA	10	20	21	3,111	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	88	153	114	16,839
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.1% >
(ユーロ…スイス)					
DSM-FIRMENICH AG	—	7	87	12,897	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	—	7	87	12,897
	銘柄 数 < 比 率 >	—	1	—	< 0.0% >
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	4,700	7,688	20,141	2,960,023
	銘柄 数 < 比 率 >	229	222	—	< 10.1% >
(イギリス)					
BARCLAYS PLC	422	744	114	19,262	銀行
BP PLC	499	791	377	63,673	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,795	3,095	141	23,925	銀行
ASTRAZENECA PLC	39	66	790	133,269	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC	9	19	32	5,438	資本財
NEXT PLC	3	6	41	7,008	一般消費財・サービス流通・小売り
DIAGEO PLC	58	98	356	60,067	食品・飲料・タバコ
BAE SYSTEMS PLC	80	136	134	22,659	資本財
UNILEVER PLC	64	110	477	80,454	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC	194	285	78	13,170	生活必需品流通・小売り
RELX PLC	49	78	196	33,175	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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	18	30	193	32,624	家庭用品・パーソナル用品
HALMA PLC	9	17	42	7,203	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PRUDENTIAL PLC	69	117	138	23,350	保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	145	251	57	9,730	保険
SAGE GROUP PLC/THE	26	55	45	7,620	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	514	864	513	86,447	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	55	87	239	40,310	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	18	25	26	4,542	公益事業
SCHRODERS PLC	2	57	26	4,526	金融サービス
NATWEST GROUP PLC	138	237	61	10,405	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	23	35	66	11,248	食品・飲料・タバコ
WPP PLC	30	37	33	5,646	メディア・娯楽
BT GROUP PLC	226	295	45	7,585	電気通信サービス
SSE PLC	27	42	79	13,312	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	64	108	67	11,351	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	222	349	50	8,583	資本財
COMPASS GROUP PLC	45	76	160	27,075	消費者サービス
KINGFISHER PLC	54	54	13	2,345	一般消費財・サービス流通・小売り
PEARSON PLC	19	19	15	2,626	消費者サービス
SEVERN TRENT PLC	6	10	31	5,276	公益事業
RIO TINTO PLC	28	49	240	40,534	素材
GSK PLC	127	167	242	40,799	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3I GROUP PLC	24	46	83	14,091	金融サービス
VODAFONE GROUP PLC	692	1,044	95	16,020	電気通信サービス
SAINSBURY (J) PLC	49	49	14	2,386	生活必需品流通・小売り
AVIVA PLC	95	117	48	8,172	保険
JOHNSON MATTHEY PLC	5	5	10	1,701	素材
RENTOKIL INITIAL PLC	48	122	78	13,280	商業・専門サービス
WHITBREAD PLC	4	12	40	6,858	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	91	154	178	30,133	公益事業
BUNZL PLC	8	13	43	7,412	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	32	58	136	23,056	素材
INTERTEK GROUP PLC	3	7	32	5,555	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	10	18	47	8,059	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	4	7	38	6,461	消費者サービス
PERSIMMON PLC	8	8	10	1,786	耐久消費財・アパレル
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	8	15	130	21,981	金融サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	2	2	12	2,115	耐久消費財・アパレル
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	22	30	14	2,515	耐久消費財・アパレル
SMITH & NEPHEW PLC	22	36	47	7,930	ヘルスケア機器・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	88	88	10	1,832	耐久消費財・アパレル
ABRDN PLC	61	61	12	2,138	金融サービス
EXPERIAN PLC	23	42	117	19,791	商業・専門サービス
MONDI PLC	12	25	32	5,544	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10	14	26	4,549	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC	9	20	28	4,813	素材
ADMIRAL GROUP PLC	4	4	10	1,848	保険
ST JAMES'S PLACE PLC	13	23	27	4,576	金融サービス
GLENCORE PLC	251	426	182	30,722	素材
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	1	3	36	6,143	資本財
HARGREAVES LANSDOWN PLC	9	9	7	1,225	金融サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	3	5	34	5,865	素材

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
MELROSE INDUSTRIES PLC	117	—	—	—	資本財
COCA-COLA HBC AG-DI	4	4	11	1,917	食品・飲料・タバコ
AVEVA GROUP PLC	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ASHTREAD GROUP PLC	11	20	93	15,777	資本財
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	3	3	6	1,128	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OCADO GROUP PLC	11	11	4	839	生活必需品流通・小売り
AUTO TRADER GROUP PLC	22	49	31	5,288	メディア・娯楽
DCC PLC	2	2	11	2,021	資本財
ENTAIN PLC	14	30	44	7,542	消費者サービス
INFORMA PLC	38	64	45	7,656	メディア・娯楽
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	17	49	28	4,823	保険
FERGUSON PLC	5	—	—	—	資本財
M&G PLC	66	66	13	2,259	金融サービス
JD SPORTS FASHION PLC	67	67	11	1,916	一般消費財・サービス流通・小売り
SHELL PLC	194	303	724	122,034	エネルギー
HALEON PLC	—	196	67	11,342	家庭用品・パーソナル用品
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,298 78	11,769 76	7,824 — <4.5%>	
(スイス)			千スイスフラン		
NESTLE SA-REG	71	118	1,359	204,674	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	13	21	324	48,924	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	65	110	8	1,265	金融サービス
HOLCIM LTD	13	21	123	18,573	素材
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	17	30	852	128,316	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GIVAUDAN-REG	0.23	0.36	114	17,254	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	1	2	61	9,220	ヘルスケア機器・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	3	6	278	41,966	保険
BACHEM HOLDING AG	0.9	0.9	8	1,280	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
STRAUMANN HOLDING AG-REG	2	5	75	11,372	ヘルスケア機器・サービス
LONZA GROUP AG-REG	1	3	193	29,183	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	0.93	2	13	1,990	耐久消費財・アパレル
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	0.95	2	40	6,066	資本財
GEBERIT AG-REG	0.92	1	74	11,205	資本財
SWISS RE AG	7	13	124	18,818	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR	0.81	1	41	6,228	耐久消費財・アパレル
NOVARTIS AG-REG	55	92	858	129,258	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	3	8	25	3,911	商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG	0.67	1	61	9,187	電気通信サービス
ABB LTD-REG	41	64	211	31,858	資本財
CLARIANT AG-REG	5	5	7	1,064	素材
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	4	8	50	7,641	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROCHE HOLDING AG-BR	0.8	0.99	30	4,651	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SGS SA-REG	0.15	7	60	9,098	商業・専門サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	0.63	0.63	11	1,784	資本財
TEMENOS AG - REG	1	1	12	1,903	ソフトウェア・サービス
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1	2	59	8,948	運輸
BALOISE HOLDING AG - REG	1	2	31	4,807	保険
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	0.79	1	64	9,706	保険
JULIUS BAER GROUP LTD	6	8	52	7,868	金融サービス
SIKA AG-REG	3	6	159	23,981	素材
SWISS PRIME SITE-REG	2	2	16	2,550	不動産管理・開発
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.05	0.08	89	13,443	食品・飲料・タバコ

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	0.58	0.94	79	11,988	金融サービス	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.09	0.2	39	5,878	食品・飲料・タバコ	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	—	1	8	1,291	銀行	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	0.17	0.17	12	1,848	素材	
UBS GROUP AG-REG	88	149	255	38,487	金融サービス	
VAT GROUP AG	0.67	1	40	6,144	資本財	
ALCON INC	12	22	161	24,267	ヘルスケア機器・サービス	
VIFOR PHARMA AG-NEW	0.84	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SIG GROUP AG	—	16	41	6,315	素材	
BKW AG	—	0.6	9	1,451	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	436	748	6,147	925,683	
	銘柄 数 < 比 率 >	40	42	—	< 3.2% >	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ			
ELECTROLUX AB-B	4	4	75	978	耐久消費財・アパレル	
ERICSSON LM-B SHS	73	117	629	8,206	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ATLAS COPCO AB-B SHS	9	59	789	10,291	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	41	64	720	9,390	銀行	
INVESTOR AB-B SHS	46	69	1,512	19,704	金融サービス	
GETINGE AB-B SHS	5	5	141	1,844	ヘルスケア機器・サービス	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	35	59	514	6,707	銀行	
ATLAS COPCO AB-A SHS	17	122	1,832	23,872	資本財	
SKF AB-B SHARES	9	20	367	4,782	資本財	
ASSA ABLOY AB-B	25	44	1,098	14,314	資本財	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	19	34	500	6,517	一般消費財・サービス流通・小売り	
SANDVIK AB	28	51	1,028	13,396	資本財	
SWEDBANK AB - A SHARES	23	35	591	7,713	銀行	
SECURITAS AB-B SHS	8	8	76	1,003	商業・専門サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	15	29	425	5,539	素材	
HOLMEN AB-B SHARES	—	2	104	1,356	素材	
SKANSKA AB-B SHS	7	19	288	3,762	資本財	
SWEDISH MATCH AB	38	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	14	14	150	1,956	電気通信サービス	
TELIA CO AB	68	145	394	5,136	電気通信サービス	
VOLVO AB-A SHS	4	18	393	5,128	資本財	
VOLVO AB-B SHS	36	52	1,082	14,098	資本財	
ALFA LAVAL AB	7	13	525	6,843	資本財	
ORRON ENERGY AB	5	—	—	—	公益事業	
BOLIDEN AB	7	12	416	5,433	素材	
BOLIDEN AB RED SHS	7	12	14	182	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	10	10	91	1,187	資本財	
HEXAGON AB-B SHS	49	95	1,115	14,529	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KINNEVIK AB - B	5	5	95	1,245	金融サービス	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5	10	300	3,913	金融サービス	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	2	17	70	916	不動産管理・開発	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	35	61	699	9,111	資本財	
LUNDBERGS AB-B SHS	2	2	106	1,389	金融サービス	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	14	23	721	9,405	家庭用品・パーソナル用品	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	2	5	152	1,991	金融サービス	
SWEDISH ORPHAN BLOVITRUM AB	—	4	106	1,389	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
EPIROC AB-B	10	22	382	4,981	資本財	
EPIROC AB-A	16	26	525	6,853	資本財	
NORDEA BANK ABP	81	139	1,497	19,513	銀行	

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等		
		株 数	株 数	評 価 額			
				外貨建金額		邦貨換算金額	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円		
EQT AB		8	17	364	4,744	金融サービス	
EVOLUTION AB		4	7	1,057	13,778	消費者サービス	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		4	4	92	1,204	資本財	
SINCH AB		16	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
EMBRACER GROUP AB		13	13	71	927	メディア・娯楽	
INVESTOR AB-A SHS		13	35	782	10,194	金融サービス	
LIFCO AB-B SHS		5	16	394	5,139	資本財	
SAGAX AB-B		3	5	112	1,461	不動産管理・開発	
INDUTRADE AB		—	8	205	2,677	資本財	
VOLVO CAR AB-B		—	15	56	732	自動車・自動車部品	
小 計		株 数 ・ 金 額	864	1,567	22,674	295,452	
		銘柄 数 < 比 率 >	45	46	—	< 1.0% >	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ			
NORSK HYDRO ASA		32	55	377	4,760	素材	
ORKLA ASA		18	18	149	1,889	食品・飲料・タバコ	
EQUINOR ASA		25	37	1,111	14,021	エネルギー	
TELENOR ASA		17	36	456	5,759	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA		4	9	388	4,908	素材	
MOWI ASA		11	23	452	5,714	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		5	5	100	1,268	保険	
SCHIBSTED ASA-CL A		1	—	—	—	メディア・娯楽	
SCHIBSTED ASA-B SHS		2	—	—	—	メディア・娯楽	
AKER BP ASA		3	15	375	4,734	エネルギー	
SALMAR ASA		—	1	76	965	食品・飲料・タバコ	
ADEVINTA ASA		5	5	43	551	メディア・娯楽	
DNB BANK ASA		23	44	803	10,142	銀行	
KONGSBERG GRUPPEN ASA		—	1	89	1,135	資本財	
小 計		株 数 ・ 金 額	150	255	4,425	55,850	
		銘柄 数 < 比 率 >	12	12	—	< 0.2% >	
(デンマーク)				千デンマーククローネ			
NOVO NORDISK A/S-B		42	70	8,162	161,036	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		5	9	327	6,456	素材	
DANSKE BANK A/S		16	26	371	7,325	銀行	
DEMANT A/S		2	2	66	1,312	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		25	39	766	15,113	資本財	
GN STORE NORD A/S		3	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
CARLSBERG AS-B		2	4	451	8,911	食品・飲料・タバコ	
COLOPLAST-B		3	6	570	11,260	ヘルスケア機器・サービス	
DSV A/S		5	7	983	19,409	運輸	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		0.15	0.13	155	3,063	運輸	
TRYG A/S		8	18	288	5,695	保険	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A		0.08	0.2	235	4,644	運輸	
PANDORA A/S		2	4	278	5,494	耐久消費財・アパレル	
CHR HANSEN HOLDING A/S		2	5	311	6,138	素材	
GENMAB A/S		1	3	975	19,245	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ORSTED A/S		4	8	566	11,176	公益事業	
ROCKWOOL A/S-B SHS		0.21	0.21	36	723	資本財	
AMBU A/S-B		5	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
小 計		株 数 ・ 金 額	132	207	14,546	287,007	
		銘柄 数 < 比 率 >	18	16	—	< 1.0% >	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル			
BHP GROUP LTD		127	218	961	86,715	素材	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
CSL LTD	12	20	628	56,678	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	24	84	286	25,894	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	71	—	—	—	銀行
RIO TINTO LTD	9	15	172	15,590	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	37	57	87	7,857	保険
LENLEASE GROUP	15	15	12	1,116	不動産管理・開発
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	43	72	713	64,346	銀行
WESTPAC BANKING CORP	92	147	311	28,137	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	82	132	349	31,512	銀行
BRAMBLES LTD	36	64	91	8,221	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	23	23	14	1,331	運輸
WOOLWORTHS GROUP LTD	30	46	181	16,346	生活必需品流通・小売り
TELSTRA CORP LTD	112	—	—	—	電気通信サービス
TABCORP HOLDINGS LTD	58	—	—	—	消費者サービス
COMPUTERSHARE LTD	12	20	43	3,944	商業・専門サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	15	25	97	8,816	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	8	17	308	27,841	金融サービス
ASX LTD	4	9	64	5,850	金融サービス
COCHLEAR LTD	1	3	78	7,116	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	11	14	49	4,488	素材
NEWCREST MINING LTD	20	43	125	11,360	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	63	130	63	5,753	保険
ORIGIN ENERGY LTD	38	88	74	6,677	公益事業
ORICA LTD	9	9	15	1,410	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	11	20	73	6,660	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	81	155	111	10,063	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	31	53	65	5,923	保険
TRANSURBAN GROUP	77	125	185	16,693	運輸
WESFARMERS LTD	28	51	264	23,884	一般消費財・サービス流通・小売り
BLUESCOPE STEEL LTD	12	12	23	2,130	素材
AMPOL LTD	5	5	16	1,529	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	46	69	140	12,681	素材
CROWN RESORTS LTD	8	—	—	—	消費者サービス
AURIZON HOLDINGS LTD	52	48	17	1,545	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	18	39	51	4,651	食品・飲料・タバコ
APA GROUP	37	48	50	4,528	公益事業
RAMSAY HEALTH CARE LTD	4	7	45	4,095	ヘルスケア機器・サービス
SEEK LTD	9	8	21	1,935	メディア・娯楽
REA GROUP LTD	1	1	19	1,777	メディア・娯楽
IGO LTD	—	19	28	2,574	素材
MEDIBANK PRIVATE LTD	66	66	23	2,121	保険
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1	—	—	—	消費者サービス
SOUTH32 LTD	119	208	84	7,646	素材
EVOLUTION MINING LTD	51	—	—	—	素材
PILBARA MINERALS LTD	—	68	32	2,955	素材
IDP EDUCATION LTD	6	6	16	1,515	消費者サービス
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	26	63	88	7,989	素材
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	5	5	16	1,484	エネルギー
COLES GROUP LTD	32	61	112	10,123	生活必需品流通・小売り
WISETECH GLOBAL LTD	3	8	61	5,555	ソフトウェア・サービス
MINERAL RESOURCES LTD	5	5	41	3,757	素材
XERO LTD	3	6	61	5,522	ソフトウェア・サービス

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
REECE LTD	6	6	12	1,135	資本財	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	34	79	50	4,593	生活必需品流通・小売り	
LOTTERY CORP LTD/THE	—	119	58	5,274	消費者サービス	
TELSTRA GROUP LTD	—	139	60	5,446	電気通信サービス	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	—	132	322	29,103	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,758 53	2,909 52	6,892 —	621,908 <0.1%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
SPARK NEW ZEALAND LTD	65	45	23	2,007	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	42	73	64	5,503	運輸	
FISHER & PAYKAL HEALTHCARE C	15	24	63	5,384	ヘルスケア機器・サービス	
RYMAN HEALTHCARE LTD	10	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	36	36	19	1,693	公益事業	
MERCURY NZ LTD	12	12	8	706	公益事業	
EBOS GROUP LTD	—	9	43	3,684	ヘルスケア機器・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	183 6	202 6	223 —	18,980 <0.1%>	
(香港)			千香港ドル			
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	10	10	59	1,013	不動産管理・開発	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	68	133	706	12,132	資本財	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	35	65	682	11,718	不動産管理・開発	
MTR CORP	40	80	316	5,425	運輸	
HONG KONG & CHINA GAS	284	444	340	5,841	公益事業	
NEW WORLD DEVELOPMENT	42	42	86	1,488	不動産管理・開発	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	40	70	324	5,570	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	30	57	1,780	30,574	金融サービス	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	50	50	66	1,136	不動産管理・開発	
CLP HOLDINGS LTD	40	65	399	6,863	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	41	41	113	1,955	不動産管理・開発	
HANG SENG BANK LTD	20	29	330	5,671	銀行	
SINO LAND CO	70	250	257	4,421	不動産管理・開発	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	15	15	70	1,204	公益事業	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	95	170	419	7,195	銀行	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	35	60	481	8,272	資本財	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	40	40	53	918	資本財	
SANDS CHINA LTD	64	132	343	5,892	消費者サービス	
AIA GROUP LTD	306	496	4,015	68,939	保険	
SWIRE PROPERTIES LTD	22	22	45	783	不動産管理・開発	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	50	90	463	7,966	消費者サービス	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	56	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	100	100	102	1,754	電気通信サービス	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	40	40	53	917	運輸	
WH GROUP LTD	210	210	89	1,536	食品・飲料・タバコ	
CK ASSET HOLDINGS LTD	53	98	456	7,841	不動産管理・開発	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	125	—	—	—	公益事業	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	40	80	339	5,830	不動産管理・開発	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	37	80	167	2,877	食品・飲料・タバコ	
ESR GROUP LTD	64	44	54	927	不動産管理・開発	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,124 30	3,015 28	12,619 —	216,672 <0.7%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	87	146	179	18,159	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		
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
CITY DEVELOPMENTS LTD	5	11	7	775	不動産管理・開発	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	—	4	13	1,383	資本財	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	46	77	239	24,215	銀行	
KEPPEL CORP LTD	35	91	58	5,916	資本財	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	30	46	128	13,014	銀行	
VENTURE CORP LTD	7	7	10	1,108	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	51	85	31	3,137	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	217	344	88	8,974	電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	39	39	23	2,330	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	20	42	39	4,017	金融サービス	
SEATRUM LTD	—	667	8	851	資本財	
UOL GROUP LTD	6	11	7	767	不動産管理・開発	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	49	119	47	4,765	食品・飲料・タバコ	
GENTING SINGAPORE LTD	123	393	44	4,450	消費者サービス	
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	69	169	63	6,391	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額	784	2,251	991	100,259	
	銘柄 数 < 比 率 >	14	16	—	<0.3%>	
(イスラエル)			千イスラエルシケル			
ICL GROUP LTD	19	19	44	1,646	素材	
BANK HAPOALIM BM	30	62	203	7,530	銀行	
NICE LTD	1	2	146	5,408	ソフトウェア・サービス	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	43	75	220	8,125	銀行	
ELBIT SYSTEMS LTD	0.62	0.62	43	1,605	資本財	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	30	74	143	5,296	銀行	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	—	52	26	994	電気通信サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3	3	47	1,765	銀行	
AZRIELI GROUP LTD	0.97	0.97	20	769	不動産管理・開発	
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	—	3	45	1,686	半導体・半導体製造装置	
FIRST INTL BANK ISRAEL	—	1	24	921	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	130	295	968	35,750	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	11	—	<0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	27,680	46,945	—	28,338,912	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,226	1,213	—	<96.5%>	

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

(注) 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	1	2	48	6,530	0.0	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.376	0.616	74	9,985	0.0	
PROLOGIS INC	1	3	501	67,578	0.2	
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.26	0.442	49	6,598	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.719	1	109	14,794	0.1	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.452	0.662	45	6,171	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.163	0.272	59	7,945	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.34	0.594	90	12,201	0.0	
WELLTOWER INC	1	2	174	23,517	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	0.38	0.579	28	3,853	0.0	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	1	1	12	1,706	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.295	0.464	71	9,565	0.0	
REALTY INCOME CORP	1	2	163	21,956	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	0.399	0.899	52	7,079	0.0	
SUN COMMUNITIES INC	0.297	0.607	82	11,109	0.0	
UDR INC	0.796	1	57	7,765	0.0	
VENTAS INC	1	1	84	11,310	0.0	
WEYERHAEUSER CO	1	2	86	11,695	0.0	
AMERICAN TOWER CORP	1	2	395	53,244	0.2	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	—	2	47	6,380	0.0	
WP CAREY INC	0.487	0.84	60	8,113	0.0	
DUKE REALTY CORP	0.951	—	—	—	—	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	—	1	67	9,025	0.0	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	—	1	50	6,758	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	0.736	1	63	8,482	0.0	
EQUINIX INC	0.228	0.384	285	38,434	0.1	
CROWN CASTLE INC	1	1	212	28,576	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	0.907	1	89	12,001	0.0	
INVITATION HOMES INC	1	2	99	13,354	0.0	
VICI PROPERTIES INC	2	3	125	16,944	0.1	
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.275	0.518	120	16,252	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	1	2	50	6,759	0.0	
PUBLIC STORAGE	0.4	0.66	194	26,212	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.833	1	146	19,697	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	0.416	—	—	—	—	
KIMCO REALTY CORP	1	2	46	6,293	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.356	0.546	98	13,257	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	29	53	3,945	531,156	
	銘柄 数 < 比 率 >	34	35	—	< 1.8% >	
(カナダ)				千カナダドル		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		0.2	0.2	9	986	0.0

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.2	0.2	4	406	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	0.4 2	0.4 2	13 —	1,393 <0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA	0.099	0.313	30	4,498	0.0	
KLEPIERRE	0.451	0.451	9	1,416	0.0	
COVIVIO	0.129	0.129	6	925	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	0.684	30	4,546	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.304	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	0.983 4	1 4	77 —	11,386 <0.0%>	
(ユーロ…ベルギー)						
WAREHOUSES DE PAUW SCA	—	0.408	10	1,598	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	— —	0.408 1	10 —	1,598 <0.0%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	0.983 4	1 5	88 —	12,985 <0.0%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC	2	2	7	1,304	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	1	1	11	1,952	0.0	
SEGRO PLC	3	5	45	7,602	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	6 3	9 3	64 —	10,858 <0.0%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES	11	11	22	2,059	0.0	
SCENTRE GROUP	13	25	71	6,454	0.0	
DEXUS/AU	2	6	50	4,537	0.0	
GPT GROUP	4	11	51	4,651	0.0	
MIRVAC GROUP	9	9	22	2,014	0.0	
STOCKLAND	5	14	63	5,734	0.0	
GOODMAN GROUP	4	7	158	14,265	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	51 7	85 7	440 —	39,717 <0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT	5	13	670	11,503	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	5 1	13 1	670 —	11,503 <0.0%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND ASCOTT TRUST	—	0.963	1	104	0.0	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	0.079	—	—	—	—	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	3	8	15	1,548	0.0	
MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	4	4	7	708	0.0	
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	13	32	66	6,707	0.0	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール) CAPITALAND ASCENDAS REIT	千口	千口	千シンガポールドル	千円	%
	9	12	37	3,756	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	30	58	126	12,825
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.0% >
合 計	口 数 ・ 金 額	125	223	—	620,440
	銘柄 数 < 比 率 >	56	58	—	< 2.1% >

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円
株式先物取引	362	—
SP EMINI	24	—
SP/TSE60	17	—
SWISS IX	69	—
EURO ST	16	—
SPI 200	26	—
FTSE100	—	—

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

○投資信託財産の構成

(2023年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円	%
	28,338,912	95.2
投資証券	620,440	2.1
コール・ローン等、その他	813,167	2.7
投資信託財産総額	29,772,519	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(29,609,716千円)の投資信託財産総額(29,772,519千円)に対する比率は99.5%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=134.63円	1 カナダドル=99.79円	1 ユーロ=146.96円	1 イギリスポンド=168.50円
1 スイスフラン=150.58円	1 スウェーデンクローネ=13.03円	1 ノルウェークローネ=12.62円	1 デンマーククローネ=19.73円
1 オーストラリアドル=90.23円	1 ニュージーランドドル=84.76円	1 香港ドル=17.17円	1 シンガポールドル=101.12円
1 イスラエルシェケル=36.9299円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	59,133,813,402
コール・ローン等	525,737,806
株式(評価額)	28,338,912,075
投資証券(評価額)	620,440,395
未収入金	29,401,017,855
未収配当金	34,725,940
差入委託証拠金	212,979,331
(B) 負債	29,777,927,759
未払金	29,522,601,601
未払解約金	255,325,991
未払利息	167
(C) 純資産総額(A-B)	29,355,885,643
元本	12,075,113,170
次期繰越損益金	17,280,772,473
(D) 受益権総口数	12,075,113,170口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,311円

<注記事項>

- ①期首元本額 6,852,502,538円
期中追加設定元本額 7,462,675,450円
期中一部解約元本額 2,240,064,818円
また、1口当たり純資産額は、期末2.4311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)

ラップ向けインデックスf 先進国株式(為替ヘッジあり)	3,512,225,263円
MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	1,725,514,669円
三菱UFJ バランスファンド2 OVA(適格機関投資家限定)	1,382,454,129円
MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	1,369,873,664円
三菱UFJ バランスファンド5 OVA(適格機関投資家限定)	1,004,794,729円
三菱UFJ バランスファンドVA 5 O型(適格機関投資家限定)	978,480,823円
ヘッジ付先進国株式インデックス・オープン(ラップ向け)	688,993,621円
つみたて先進国株式(為替ヘッジあり)	613,582,506円
ヘッジ付先進国株式インデックスオープン	370,607,561円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03(適格機関投資家限定)	25,902,465円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07(適格機関投資家限定)	25,809,044円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09(適格機関投資家限定)	25,466,024円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11(適格機関投資家限定)	25,212,214円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01(適格機関投資家限定)	25,019,907円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05(適格機関投資家限定)	24,769,405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)	23,459,282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)	23,276,679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)	22,660,076円
アクティブアロケーションファンド(ラップ向け)	22,590,576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)	22,579,810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)	22,543,390円

○損益の状況 (2022年5月13日～2023年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	403,419,274
受取配当金	392,161,346
受取利息	7,832,489
その他収益金	3,767,229
支払利息	△ 342,290
(B) 有価証券売買損益	336,230,809
売買益	5,736,379,213
売買損	△ 5,400,148,404
(C) 先物取引等取引損益	140,639,715
取引益	320,057,474
取引損	△ 179,417,759
(D) 保管費用等	△ 14,673,372
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	865,616,426
(F) 前期繰越損益金	9,340,279,870
(G) 追加信託差損益金	10,151,281,706
(H) 解約差損益金	△ 3,076,405,529
(I) 計(E+F+G+H)	17,280,772,473
次期繰越損益金(I)	17,280,772,473

(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。

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)	22,121,197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)	22,000,341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)	21,619,842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)	21,465,912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)	21,436,099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)	21,314,355円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	8,185,407円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,154,180円
合計	12,075,113,170円

【お 知 ら せ】

三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。

外国債券インデックスマザーファンド

《第22期》決算日2023年5月12日

[計算期間：2022年5月13日～2023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22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22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 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
22期(2023年5月12日)	23,421	1.2	130,897.72	1.2	98.5	—	438,949

(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 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年5月12日	円	%		%	%	%
	23,133	—	129,384.40	—	98.8	—
5月末	23,145	0.1	129,451.47	0.1	98.3	—
6月末	23,694	2.4	132,579.22	2.5	98.2	—
7月末	23,857	3.1	133,117.57	2.9	99.0	—
8月末	23,571	1.9	131,430.25	1.6	98.7	—
9月末	23,363	1.0	130,076.63	0.5	98.3	—
10月末	24,062	4.0	134,355.57	3.8	98.3	—
11月末	23,329	0.8	130,450.40	0.8	98.9	—
12月末	22,191	△4.1	123,946.23	△4.2	98.2	—
2023年1月末	22,448	△3.0	125,559.33	△3.0	98.5	—
2月末	22,721	△1.8	126,903.56	△1.9	98.6	—
3月末	23,007	△0.5	128,532.24	△0.7	98.1	—
4月末	23,176	0.2	129,370.99	△0.0	98.4	—
(期 末) 2023年5月12日	23,421	1.2	130,897.72	1.2	98.5	—

(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

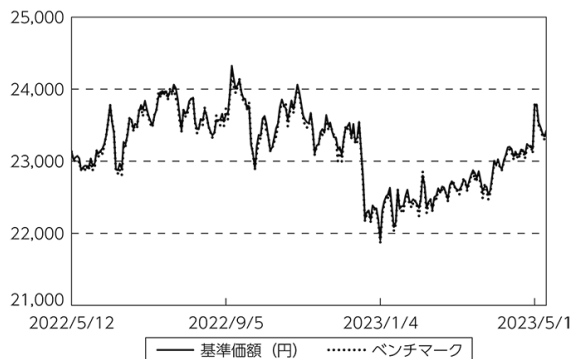
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ1.2%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(1.2%)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

◎ 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、欧米中銀による利上げペースの減速期待等を背景とした金利低下により上昇する局面もありましたが、金融政策引き締め等を背景とした金利上昇により、期間の初めとの比較では下落しました。

◎ 為替市況

- ・ 期間の初めに比べて米ドル、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1.2%の上昇になったため、乖離は0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ 評価時価差異要因[※]によるものです。

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

(主なマイナス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年5月13日～2023年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 3	% 0.011	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(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	0.011	
期中の平均基準価額は、23,203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

(2022年5月13日～2023年5月12日)

公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカドル 923,541	千アメリカドル 472,668
	カナダ	千カナダドル 44,421	千カナダドル 17,942
	メキシコ	千メキシコペソ 208,742	千メキシコペソ 47,184
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 115,071	48,628
	イタリア	国債証券 117,361	59,767
	フランス	国債証券 144,196	62,765
	オランダ	国債証券 19,977	7,812
	スペイン	国債証券 95,846	75,855
	ベルギー	国債証券 21,211	5,219
	オーストリア	国債証券 21,856	9,841
	フィンランド	国債証券 8,073	3,864
	アイルランド	国債証券 6,614	2,030
	イギリス	国債証券 69,855	千イギリスポンド 24,084
	スウェーデン	国債証券 18,599	千スウェーデンクローネ 11,821
	ノルウェー	国債証券 12,710	千ノルウェークローネ 14,223
	デンマーク	国債証券 15,498	千デンマーククローネ 5,317
	ポーランド	国債証券 26,162	千ポーランドズロチ 11,810
	オーストラリア	国債証券 30,751	千オーストラリアドル 6,890
	ニュージーランド	国債証券 11,716	千ニュージーランドドル -
	シンガポール	国債証券 6,462	千シンガポールドル 1,573
	マレーシア	国債証券 37,423	千マレーシアリンギット 10,292
	中国	国債証券 千中国元 1,021,684	千中国元 135,355
	イスラエル	国債証券 千イスラエルシェケル 11,086	千イスラエルシェケル 8,387

(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

(2022年5月13日～2023年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	17,950	15,865	88.4	17,505	8,441	48.2
為替直物取引	196,034	146,825	74.9	65,531	51,698	78.9

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

○組入資産の明細

(2023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
アメリカ	千アメリカドル 1,725,740	千アメリカドル 1,585,778	千円 213,493,402	% 48.6	% —	% 21.7	% 18.4	% 8.6
カナダ	千カナダドル 93,270	千カナダドル 87,764	8,758,059	2.0	—	1.1	0.5	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 545,340	千メキシコペソ 511,318	3,918,232	0.9	—	0.5	0.2	0.2
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	203,800	191,453	28,136,045	6.4	—	3.6	2.0	0.8
イタリア	242,400	225,270	33,105,693	7.5	—	4.1	2.4	1.0
フランス	274,010	251,800	37,004,556	8.4	—	5.1	2.5	0.7
オランダ	50,860	46,364	6,813,719	1.6	—	1.0	0.5	0.1
スペイン	158,430	147,621	21,694,488	4.9	—	2.9	1.4	0.7
ベルギー	60,410	55,255	8,120,366	1.8	—	1.2	0.5	0.1
オーストリア	40,920	36,636	5,384,081	1.2	—	0.7	0.4	0.1
フィンランド	17,290	14,893	2,188,808	0.5	—	0.3	0.1	0.0
アイルランド	20,230	17,963	2,639,842	0.6	—	0.5	0.1	0.1
イギリス	千イギリスポンド 146,500	千イギリスポンド 123,149	20,750,700	4.7	—	3.5	1.0	0.2
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 67,170	千スウェーデンクローネ 64,325	838,161	0.2	—	0.1	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 56,330	千ノルウェークローネ 52,631	664,205	0.2	—	0.1	0.0	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 72,140	千デンマーククローネ 66,811	1,318,191	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 69,250	千ポーランドズロチ 60,864	1,970,642	0.4	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 80,430	千オーストラリアドル 74,871	6,755,640	1.5	—	1.1	0.4	0.1
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 13,330	千ニュージーランドドル 11,834	1,003,059	0.2	—	0.2	0.0	0.0
シンガポール	千シンガポールドル 18,890	千シンガポールドル 18,858	1,906,986	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 78,500	千マレーシアリンギット 80,507	2,420,296	0.6	—	0.3	0.1	0.1
中国	千中国元 1,120,000	千中国元 1,144,058	22,153,430	5.0	—	2.4	1.8	0.8
イスラエル	千イスラエルシェケル 31,870	千イスラエルシェケル 30,468	1,125,216	0.3	—	0.2	0.0	0.1
合 計	—	—	432,163,832	98.5	—	51.2	32.9	14.4

(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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	0.25 T-NOTE 240615	0.25	7,100	6,774	912,093	2024/6/15
		0.25 T-NOTE 250531	0.25	5,000	4,644	625,319	2025/5/31
		0.25 T-NOTE 250630	0.25	6,650	6,172	831,027	2025/6/30
		0.25 T-NOTE 250731	0.25	5,800	5,365	722,305	2025/7/31
		0.25 T-NOTE 250831	0.25	4,200	3,876	521,922	2025/8/31
		0.25 T-NOTE 250930	0.25	7,600	7,009	943,711	2025/9/30
		0.25 T-NOTE 251031	0.25	10,300	9,465	1,274,372	2025/10/31
		0.375 T-NOTE 240715	0.375	6,200	5,910	795,725	2024/7/15
		0.375 T-NOTE 240815	0.375	7,200	6,845	921,645	2024/8/15
		0.375 T-NOTE 240915	0.375	12,000	11,387	1,533,046	2024/9/15
		0.375 T-NOTE 250430	0.375	4,670	4,359	586,909	2025/4/30
		0.375 T-NOTE 251130	0.375	10,150	9,339	1,257,335	2025/11/30
		0.375 T-NOTE 251231	0.375	8,500	7,816	1,052,381	2025/12/31
		0.375 T-NOTE 260131	0.375	7,700	7,054	949,730	2026/1/31
		0.375 T-NOTE 270731	0.375	7,150	6,298	848,013	2027/7/31
		0.375 T-NOTE 270930	0.375	7,300	6,401	861,849	2027/9/30
		0.5 T-NOTE 250331	0.5	6,500	6,097	820,931	2025/3/31
		0.5 T-NOTE 260228	0.5	7,900	7,249	975,935	2026/2/28
		0.5 T-NOTE 270430	0.5	5,280	4,707	633,777	2027/4/30
		0.5 T-NOTE 270531	0.5	4,280	3,807	512,596	2027/5/31
		0.5 T-NOTE 270630	0.5	4,700	4,172	561,711	2027/6/30
		0.5 T-NOTE 270831	0.5	4,950	4,375	589,012	2027/8/31
		0.5 T-NOTE 271031	0.5	7,900	6,951	935,926	2027/10/31
		0.625 T-NOTE 241015	0.625	7,400	7,029	946,371	2024/10/15
		0.625 T-NOTE 260731	0.625	7,930	7,233	973,886	2026/7/31
		0.625 T-NOTE 270331	0.625	1,800	1,617	217,698	2027/3/31
		0.625 T-NOTE 271130	0.625	7,550	6,672	898,253	2027/11/30
		0.625 T-NOTE 271231	0.625	7,630	6,729	905,925	2027/12/31
		0.625 T-NOTE 300515	0.625	12,090	10,048	1,352,815	2030/5/15
		0.625 T-NOTE 300815	0.625	15,160	12,532	1,687,245	2030/8/15
		0.75 T-NOTE 241115	0.75	6,700	6,362	856,638	2024/11/15
		0.75 T-NOTE 260331	0.75	8,100	7,483	1,007,565	2026/3/31
		0.75 T-NOTE 260430	0.75	7,000	6,446	867,955	2026/4/30
		0.75 T-NOTE 260531	0.75	8,200	7,536	1,014,613	2026/5/31
		0.75 T-NOTE 260831	0.75	7,600	6,945	935,097	2026/8/31
		0.75 T-NOTE 280131	0.75	8,850	7,838	1,055,247	2028/1/31
		0.875 T-NOTE 260630	0.875	8,300	7,652	1,030,217	2026/6/30
		0.875 T-NOTE 260930	0.875	10,000	9,167	1,234,283	2026/9/30
		0.875 T-NOTE 301115	0.875	17,730	14,903	2,006,423	2030/11/15
		1 T-NOTE 241215	1.0	8,000	7,613	1,025,060	2024/12/15
		1 T-NOTE 280731	1.0	9,150	8,109	1,091,788	2028/7/31
		1.125 T-BOND 400515	1.125	6,020	4,027	542,193	2040/5/15
		1.125 T-BOND 400815	1.125	7,350	4,873	656,182	2040/8/15
		1.125 T-NOTE 250115	1.125	6,000	5,711	768,905	2025/1/15
		1.125 T-NOTE 250228	1.125	4,150	3,943	530,866	2025/2/28
		1.125 T-NOTE 261031	1.125	7,600	7,013	944,230	2026/10/31

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末 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 270228	1.125	2,950	2,708	364,664	2027/2/28
	1.125 T-NOTE 280229	1.125	8,660	7,798	1,049,966	2028/2/29
	1.125 T-NOTE 280831	1.125	8,500	7,570	1,019,191	2028/8/31
	1.125 T-NOTE 310215	1.125	14,760	12,616	1,698,537	2031/2/15
	1.25 T-BOND 500515	1.25	8,900	5,104	687,284	2050/5/15
	1.25 T-NOTE 240831	1.25	9,500	9,126	1,228,724	2024/8/31
	1.25 T-NOTE 261130	1.25	10,200	9,440	1,271,011	2026/11/30
	1.25 T-NOTE 261231	1.25	8,200	7,578	1,020,306	2026/12/31
	1.25 T-NOTE 280331	1.25	9,950	8,997	1,211,315	2028/3/31
	1.25 T-NOTE 280430	1.25	8,150	7,357	990,597	2028/4/30
	1.25 T-NOTE 280531	1.25	11,250	10,140	1,365,258	2028/5/31
	1.25 T-NOTE 280630	1.25	8,480	7,630	1,027,228	2028/6/30
	1.25 T-NOTE 280930	1.25	12,200	10,916	1,469,704	2028/9/30
	1.25 T-NOTE 310815	1.25	17,720	15,073	2,029,381	2031/8/15
	1.375 T-BOND 401115	1.375	8,100	5,593	753,022	2040/11/15
	1.375 T-BOND 500815	1.375	10,130	5,994	807,093	2050/8/15
	1.375 T-NOTE 250131	1.375	5,320	5,083	684,364	2025/1/31
	1.375 T-NOTE 260831	1.375	2,000	1,866	251,237	2026/8/31
	1.375 T-NOTE 281031	1.375	8,250	7,420	999,063	2028/10/31
	1.375 T-NOTE 281231	1.375	8,700	7,809	1,051,407	2028/12/31
	1.375 T-NOTE 311115	1.375	16,700	14,275	1,921,875	2031/11/15
	1.5 T-NOTE 240930	1.5	6,000	5,776	777,693	2024/9/30
	1.5 T-NOTE 241031	1.5	4,100	3,940	530,539	2024/10/31
	1.5 T-NOTE 241130	1.5	6,430	6,174	831,297	2024/11/30
	1.5 T-NOTE 250215	1.5	6,300	6,027	811,442	2025/2/15
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	9,740	9,132	1,229,493	2026/8/15
	1.5 T-NOTE 270131	1.5	11,540	10,750	1,447,303	2027/1/31
	1.5 T-NOTE 281130	1.5	7,650	6,918	931,473	2028/11/30
	1.5 T-NOTE 300215	1.5	8,740	7,769	1,046,037	2030/2/15
	1.625 T-BOND 501115	1.625	10,140	6,413	863,402	2050/11/15
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	9,760	9,247	1,245,055	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	7,670	7,245	975,455	2026/5/15
	1.625 T-NOTE 260930	1.625	2,100	1,974	265,853	2026/9/30
	1.625 T-NOTE 261031	1.625	3,350	3,146	423,659	2026/10/31
	1.625 T-NOTE 261130	1.625	3,400	3,190	429,472	2026/11/30
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	6,050	5,466	735,955	2029/8/15
	1.625 T-NOTE 310515	1.625	15,460	13,633	1,835,516	2031/5/15
	1.75 T-BOND 410815	1.75	11,370	8,254	1,111,313	2041/8/15
	1.75 T-NOTE 240630	1.75	3,500	3,392	456,746	2024/6/30
	1.75 T-NOTE 240731	1.75	5,150	4,984	671,054	2024/7/31
	1.75 T-NOTE 241231	1.75	3,350	3,224	434,150	2024/12/31
	1.75 T-NOTE 250315	1.75	9,030	8,670	1,167,365	2025/3/15
	1.75 T-NOTE 261231	1.75	4,300	4,047	544,909	2026/12/31
	1.75 T-NOTE 290131	1.75	7,300	6,677	899,049	2029/1/31
	1.75 T-NOTE 291115	1.75	5,150	4,684	630,726	2029/11/15
	1.875 T-BOND 410215	1.875	10,800	8,096	1,089,991	2041/2/15
	1.875 T-BOND 510215	1.875	11,310	7,627	1,026,906	2051/2/15

銘柄	銘柄	利率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.875 T-BOND 511115	1.875	10,450	7,011	943,985	2051/11/15
	1.875 T-NOTE 260630	1.875	3,500	3,327	448,022	2026/6/30
	1.875 T-NOTE 260731	1.875	2,500	2,374	319,634	2026/7/31
	1.875 T-NOTE 270228	1.875	7,700	7,265	978,177	2027/2/28
	1.875 T-NOTE 290228	1.875	8,800	8,102	1,090,797	2029/2/28
	1.875 T-NOTE 320215	1.875	17,060	15,149	2,039,610	2032/2/15
	2 T-BOND 411115	2.0	9,250	6,998	942,143	2041/11/15
	2 T-BOND 500215	2.0	8,090	5,669	763,260	2050/2/15
	2 T-BOND 510815	2.0	11,240	7,795	1,049,456	2051/8/15
	2 T-NOTE 240531	2.0	11,730	11,411	1,536,353	2024/5/31
	2 T-NOTE 240630	2.0	7,000	6,803	915,978	2024/6/30
	2 T-NOTE 250215	2.0	8,110	7,829	1,054,103	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	11,490	11,046	1,487,198	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	9,550	9,079	1,222,435	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 240731	2.125	3,450	3,354	451,609	2024/7/31
	2.125 T-NOTE 240930	2.125	6,800	6,603	889,092	2024/9/30
	2.125 T-NOTE 241130	2.125	1,900	1,841	247,958	2024/11/30
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	6,970	6,730	906,187	2025/5/15
	2.125 T-NOTE 260531	2.125	5,000	4,792	645,264	2026/5/31
	2.25 T-BOND 410515	2.25	8,940	7,112	957,537	2041/5/15
	2.25 T-BOND 460815	2.25	5,490	4,126	555,493	2046/8/15
	2.25 T-BOND 490815	2.25	6,330	4,713	634,595	2049/8/15
	2.25 T-BOND 520215	2.25	9,580	7,048	948,877	2052/2/15
	2.25 T-NOTE 241031	2.25	2,380	2,312	311,370	2024/10/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	6,450	6,264	843,448	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 241231	2.25	6,900	6,695	901,405	2024/12/31
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	10,290	9,930	1,336,909	2025/11/15
	2.25 T-NOTE 260331	2.25	4,500	4,336	583,826	2026/3/31
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	6,810	6,520	877,829	2027/2/15
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	6,190	5,906	795,174	2027/8/15
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	7,290	6,940	934,335	2027/11/15
	2.375 T-BOND 420215	2.375	7,780	6,261	843,051	2042/2/15
	2.375 T-BOND 491115	2.375	6,100	4,663	627,898	2049/11/15
	2.375 T-BOND 510515	2.375	11,720	8,893	1,197,265	2051/5/15
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	7,590	7,401	996,435	2024/8/15
	2.375 T-NOTE 260430	2.375	4,500	4,348	585,470	2026/4/30
	2.375 T-NOTE 270515	2.375	7,070	6,790	914,206	2027/5/15
	2.375 T-NOTE 290331	2.375	6,200	5,862	789,302	2029/3/31
	2.375 T-NOTE 290515	2.375	7,480	7,066	951,429	2029/5/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	5,050	4,029	542,524	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	4,030	3,192	429,787	2046/2/15
	2.5 T-BOND 460515	2.5	3,830	3,031	408,155	2046/5/15
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	11,950	11,695	1,574,529	2024/5/15
	2.5 T-NOTE 240531	2.5	6,000	5,867	789,992	2024/5/31
	2.5 T-NOTE 250131	2.5	3,350	3,263	439,303	2025/1/31
	2.5 T-NOTE 260228	2.5	3,450	3,347	450,630	2026/2/28
	2.5 T-NOTE 270331	2.5	9,200	8,883	1,195,922	2027/3/31

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日		
		利 率	額面金額	評 価 額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ	国債証券	2.625	T-NOTE 250331	2.625	1,960	1,913	257,556	2025/3/31
		2.625	T-NOTE 250415	2.625	4,000	3,902	525,362	2025/4/15
		2.625	T-NOTE 251231	2.625	3,200	3,116	419,557	2025/12/31
		2.625	T-NOTE 260131	2.625	3,900	3,797	511,233	2026/1/31
		2.625	T-NOTE 270531	2.625	7,900	7,656	1,030,734	2027/5/31
		2.625	T-NOTE 290215	2.625	10,420	9,999	1,346,182	2029/2/15
		2.625	T-NOTE 290731	2.625	5,600	5,360	721,621	2029/7/31
		2.75	T-BOND 420815	2.75	2,120	1,809	243,662	2042/8/15
		2.75	T-BOND 421115	2.75	3,100	2,638	355,190	2042/11/15
		2.75	T-BOND 470815	2.75	5,160	4,263	573,988	2047/8/15
		2.75	T-BOND 471115	2.75	5,110	4,223	568,560	2047/11/15
		2.75	T-NOTE 250228	2.75	3,440	3,365	453,032	2025/2/28
		2.75	T-NOTE 250515	2.75	6,400	6,257	842,497	2025/5/15
		2.75	T-NOTE 250630	2.75	2,370	2,316	311,856	2025/6/30
		2.75	T-NOTE 250831	2.75	8,250	8,065	1,085,836	2025/8/31
		2.75	T-NOTE 270430	2.75	9,700	9,448	1,272,038	2027/4/30
		2.75	T-NOTE 270731	2.75	7,650	7,447	1,002,662	2027/7/31
		2.75	T-NOTE 280215	2.75	9,990	9,710	1,307,389	2028/2/15
		2.75	T-NOTE 290531	2.75	5,500	5,306	714,375	2029/5/31
		2.75	T-NOTE 320815	2.75	15,810	15,016	2,021,701	2032/8/15
		2.875	T-BOND 430515	2.875	4,880	4,224	568,787	2043/5/15
		2.875	T-BOND 450815	2.875	3,500	2,977	400,809	2045/8/15
		2.875	T-BOND 461115	2.875	2,340	1,984	267,126	2046/11/15
		2.875	T-BOND 490515	2.875	7,270	6,171	830,837	2049/5/15
		2.875	T-BOND 520515	2.875	8,920	7,536	1,014,666	2052/5/15
		2.875	T-NOTE 250430	2.875	6,000	5,879	791,561	2025/4/30
		2.875	T-NOTE 250531	2.875	4,230	4,145	558,139	2025/5/31
		2.875	T-NOTE 250615	2.875	7,800	7,647	1,029,542	2025/6/15
		2.875	T-NOTE 250731	2.875	6,100	5,979	805,074	2025/7/31
		2.875	T-NOTE 251130	2.875	3,800	3,723	501,322	2025/11/30
		2.875	T-NOTE 280515	2.875	8,990	8,777	1,181,720	2028/5/15
		2.875	T-NOTE 280815	2.875	9,110	8,885	1,196,296	2028/8/15
		2.875	T-NOTE 290430	2.875	7,000	6,801	915,739	2029/4/30
		2.875	T-NOTE 320515	2.875	14,680	14,107	1,899,359	2032/5/15
		3.0	T-BOND 420515	3.0	1,920	1,710	230,277	2042/5/15
		3.0	T-BOND 441115	3.0	3,560	3,107	418,324	2044/11/15
		3.0	T-BOND 450515	3.0	2,190	1,906	256,671	2045/5/15
		3.0	T-BOND 451115	3.0	2,300	1,998	269,092	2045/11/15
		3.0	T-BOND 470215	3.0	4,210	3,645	490,850	2047/2/15
		3.0	T-BOND 470515	3.0	3,390	2,934	395,049	2047/5/15
		3.0	T-BOND 480215	3.0	5,800	5,022	676,140	2048/2/15
		3.0	T-BOND 480815	3.0	6,770	5,865	789,646	2048/8/15
		3.0	T-BOND 490215	3.0	7,090	6,158	829,077	2049/2/15
		3.0	T-BOND 520815	3.0	8,670	7,518	1,012,217	2052/8/15
		3.0	T-NOTE 240630	3.0	4,100	4,029	542,549	2024/6/30
		3.0	T-NOTE 240731	3.0	6,000	5,895	793,691	2024/7/31
		3.0	T-NOTE 250715	3.0	6,700	6,584	886,411	2025/7/15

銘柄	銘柄	利 率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	3 T-NOTE 250930	3.0	5,400	5,306	714,393	2025/9/30
	3 T-NOTE 251031	3.0	3,300	3,242	436,590	2025/10/31
	3.125 T-BOND 411115	3.125	1,990	1,816	244,612	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	2,200	2,003	269,749	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	2,850	2,571	346,180	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	4,130	3,688	496,618	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	6,010	5,325	716,930	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 250815	3.125	5,000	4,927	663,420	2025/8/15
	3.125 T-NOTE 270831	3.125	7,300	7,214	971,281	2027/8/31
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	8,280	8,164	1,099,234	2028/11/15
	3.125 T-NOTE 290831	3.125	5,900	5,809	782,122	2029/8/31
	3.25 T-BOND 420515	3.25	6,580	6,082	818,941	2042/5/15
	3.25 T-NOTE 240831	3.25	7,400	7,293	981,960	2024/8/31
	3.25 T-NOTE 270630	3.25	6,300	6,254	842,023	2027/6/30
	3.25 T-NOTE 290630	3.25	6,700	6,643	894,445	2029/6/30
	3.375 T-BOND 420815	3.375	6,300	5,923	797,477	2042/8/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	3,160	2,943	396,232	2044/5/15
	3.375 T-BOND 481115	3.375	6,620	6,146	827,540	2048/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	760	755	101,665	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 250915	3.5	5,100	5,070	682,697	2025/9/15
	3.5 T-NOTE 280131	3.5	8,300	8,343	1,123,278	2028/1/31
	3.5 T-NOTE 300131	3.5	5,100	5,135	691,413	2030/1/31
	3.5 T-NOTE 330215	3.5	15,100	15,233	2,050,859	2033/2/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	3,500	3,405	458,486	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	3,770	3,652	491,713	2044/2/15
	3.625 T-BOND 530215	3.625	8,690	8,512	1,145,987	2053/2/15
	3.625 T-NOTE 280331	3.625	4,500	4,552	612,887	2028/3/31
	3.625 T-NOTE 300331	3.625	6,500	6,603	889,041	2030/3/31
	3.75 T-BOND 410815	3.75	2,060	2,059	277,218	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	3,450	3,415	459,883	2043/11/15
	3.75 T-NOTE 260415	3.75	7,000	7,030	946,533	2026/4/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	1,870	1,922	258,819	2040/8/15
	3.875 T-BOND 430215	3.875	4,290	4,325	582,390	2043/2/15
	3.875 T-NOTE 250331	3.875	5,000	4,990	671,900	2025/3/31
	3.875 T-NOTE 260115	3.875	6,700	6,735	906,760	2026/1/15
	3.875 T-NOTE 271130	3.875	6,900	7,042	948,088	2027/11/30
	3.875 T-NOTE 271231	3.875	7,000	7,144	961,920	2027/12/31
	3.875 T-NOTE 290930	3.875	5,100	5,238	705,226	2029/9/30
	3.875 T-NOTE 291130	3.875	5,100	5,243	705,950	2029/11/30
	3.875 T-NOTE 291231	3.875	5,700	5,864	789,573	2029/12/31
	4 T-BOND 421115	4.0	6,370	6,548	881,578	2042/11/15
	4 T-BOND 521115	4.0	8,950	9,387	1,263,867	2052/11/15
	4 T-NOTE 251215	4.0	5,700	5,745	773,521	2025/12/15
	4 T-NOTE 260215	4.0	8,000	8,075	1,087,179	2026/2/15
	4 T-NOTE 280229	4.0	6,000	6,170	830,688	2028/2/29
	4 T-NOTE 291031	4.0	5,500	5,692	766,323	2029/10/31
	4 T-NOTE 300228	4.0	5,000	5,187	698,340	2030/2/28

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	4.125 T-NOTE 250131	4.125	5,000	5,002	673,504	2025/1/31
	4.125 T-NOTE 270930	4.125	5,900	6,068	816,967	2027/9/30
	4.125 T-NOTE 271031	4.125	6,500	6,690	900,681	2027/10/31
	4.125 T-NOTE 321115	4.125	14,300	15,142	2,038,615	2032/11/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	1,770	1,917	258,187	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	2,180	2,346	315,975	2040/11/15
	4.25 T-NOTE 240930	4.25	2,200	2,197	295,896	2024/9/30
	4.25 T-NOTE 241231	4.25	5,200	5,207	701,060	2024/12/31
	4.25 T-NOTE 251015	4.25	6,000	6,069	817,104	2025/10/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	1,000	1,100	148,190	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	1,930	2,115	284,794	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	2,080	2,278	306,709	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,760	1,918	258,329	2041/5/15
	4.375 T-NOTE 241031	4.375	4,000	4,006	539,371	2024/10/31
	4.5 T-BOND 360215	4.5	1,160	1,298	174,755	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	1,530	1,704	229,527	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	1,880	2,095	282,161	2039/8/15
	4.5 T-NOTE 241130	4.5	9,000	9,038	1,216,876	2024/11/30
	4.5 T-NOTE 251115	4.5	8,700	8,861	1,192,967	2025/11/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	2,100	2,371	319,289	2040/2/15
	4.625 T-NOTE 250228	4.625	8,000	8,083	1,088,252	2025/2/28
	4.625 T-NOTE 260315	4.625	6,000	6,166	830,214	2026/3/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	2,010	2,297	309,262	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	1,020	1,195	160,997	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	2,690	2,937	395,427	2028/11/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	2,300	2,619	352,721	2031/2/15
	6 T-BOND 260215	6.0	1,200	1,274	171,621	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	1,160	1,292	173,953	2027/11/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	1,150	1,356	182,574	2030/5/15
小 計					213,493,402	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.25 CAN GOVT 260301	0.25	2,200	2,020	201,580	2026/3/1
	0.5 CAN GOVT 250901	0.5	2,900	2,707	270,149	2025/9/1
	0.5 CAN GOVT 301201	0.5	5,800	4,897	488,756	2030/12/1
	0.75 CAN GOVT 241001	0.75	3,500	3,351	334,488	2024/10/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	1,930	1,789	178,535	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 250301	1.25	2,100	2,012	200,792	2025/3/1
	1.25 CAN GOVT 270301	1.25	2,500	2,337	233,295	2027/3/1
	1.25 CAN GOVT 300601	1.25	3,510	3,165	315,839	2030/6/1
	1.5 CAN GOVT 240901	1.5	2,000	1,937	193,369	2024/9/1
	1.5 CAN GOVT 250401	1.5	1,000	960	95,846	2025/4/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	4,070	3,872	386,410	2026/6/1
	1.5 CAN GOVT 310601	1.5	5,900	5,347	533,639	2031/6/1
	1.5 CAN GOVT 311201	1.5	4,270	3,849	384,146	2031/12/1
	1.75 CAN GOVT 531201	1.75	4,500	3,395	338,870	2053/12/1
	2 CAN GOVT 280601	2.0	670	644	64,310	2028/6/1
	2 CAN GOVT 320601	2.0	3,750	3,506	349,954	2032/6/1

銘柄		当 期 末					償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円			
	国債証券	2 CAN GOVT 511201	2.0	6,060	4,902	489,251	2051/12/1	
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	4,360	4,248	423,931	2025/6/1	
		2.25 CAN GOVT 290601	2.25	2,210	2,147	214,267	2029/6/1	
		2.25 CAN GOVT 291201	2.25	1,000	969	96,771	2029/12/1	
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	4,000	3,933	392,482	2024/6/1	
		2.5 CAN GOVT 321201	2.5	2,800	2,723	271,818	2032/12/1	
		2.75 CAN GOVT 270901	2.75	2,000	1,979	197,540	2027/9/1	
		2.75 CAN GOVT 330601	2.75	2,300	2,283	227,860	2033/6/1	
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	1,680	1,603	160,009	2048/12/1	
		2.75 CAN GOVT 551201	2.75	450	425	42,423	2055/12/1	
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	1,250	1,177	117,481	2064/12/1	
		3 CAN GOVT 251001	3.0	3,000	2,965	295,929	2025/10/1	
		3.5 CAN GOVT 280301	3.5	2,000	2,049	204,552	2028/3/1	
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,650	1,775	177,197	2045/12/1	
		3.75 CAN GOVT 250501	3.75	3,500	3,507	349,965	2025/5/1	
		4 CAN GOVT 410601	4.0	1,200	1,359	135,700	2041/6/1	
		5 CAN GOVT 370601	5.0	830	1,020	101,876	2037/6/1	
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	950	1,105	110,284	2029/6/1	
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,430	1,791	178,728	2033/6/1	
小	計					8,758,059		
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	58,650	58,093	445,168	2024/12/5	
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	12,350	13,566	103,959	2036/11/20	
		5 MEXICAN BONOS 250306	5.0	49,000	44,787	343,210	2025/3/6	
		5.5 MEXICAN BONOS 270304	5.5	34,000	30,188	231,335	2027/3/4	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	65,500	59,562	456,428	2026/3/5	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	48,750	46,332	355,042	2027/6/3	
		7.5 MEXICAN BONOS 330526	7.5	10,000	9,167	70,250	2033/5/26	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	68,050	64,052	490,830	2031/5/29	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	13,400	12,423	95,198	2034/11/23	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	35,190	31,065	238,056	2042/11/13	
		8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	12,000	11,592	88,836	2024/9/5	
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	39,100	35,273	270,299	2047/11/7	
		8 MEXICAN BONOS 530731	8.0	20,500	18,355	140,655	2053/7/31	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	39,150	38,674	296,361	2029/5/31	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	39,700	38,183	292,599	2038/11/18	
小	計					3,918,232		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ			
	ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	5,930	5,513	810,320	2026/8/15
			0 BUND 271115	—	3,100	2,816	413,874	2027/11/15
			0 BUND 281115	—	4,400	3,916	575,623	2028/11/15
			0 BUND 290815	—	4,550	3,989	586,325	2029/8/15
			0 BUND 300215	—	4,120	3,575	525,454	2030/2/15
			0 BUND 300815	—	4,960	4,260	626,140	2030/8/15
			0 BUND 300815	—	650	559	82,209	2030/8/15
			0 BUND 310215	—	3,700	3,143	461,944	2031/2/15
			0 BUND 310815	—	5,400	4,537	666,758	2031/8/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	0 BUND 310815	—	1,900	1,598	234,907	2031/8/15
		0 BUND 320215	—	4,690	3,892	572,113	2032/2/15
		0 BUND 350515	—	3,630	2,757	405,247	2035/5/15
		0 BUND 360515	—	3,800	2,804	412,216	2036/5/15
		0 BUND 500815	—	5,350	2,863	420,788	2050/8/15
		0 BUND 500815	—	1,560	838	123,160	2050/8/15
		0 BUND 520815	—	3,690	1,878	276,115	2052/8/15
		0 OBL 241018	—	4,400	4,235	622,388	2024/10/18
		0 OBL 250411	—	2,800	2,669	392,349	2025/4/11
		0 OBL 251010	—	4,000	3,775	554,809	2025/10/10
		0 OBL 251010	—	1,000	945	138,897	2025/10/10
		0 OBL 260410	—	3,700	3,460	508,607	2026/4/10
		0 OBL 261009	—	2,900	2,687	394,928	2026/10/9
		0 OBL 270416	—	3,050	2,800	411,502	2027/4/16
		0.2 SCHATS 240614	0.2	3,800	3,693	542,814	2024/6/14
		0.25 BUND 270215	0.25	4,490	4,177	613,965	2027/2/15
		0.25 BUND 280815	0.25	4,170	3,782	555,841	2028/8/15
		0.25 BUND 290215	0.25	4,050	3,641	535,193	2029/2/15
		0.5 BUND 250215	0.5	7,110	6,862	1,008,450	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	6,660	6,336	931,189	2026/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	5,120	4,777	702,174	2027/8/15
		0.5 BUND 280215	0.5	4,280	3,965	582,802	2028/2/15
		1 BUND 240815	1.0	3,600	3,523	517,829	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	5,580	5,403	794,025	2025/8/15
		1 BUND 380515	1.0	2,260	1,860	273,467	2038/5/15
		1.25 BUND 480815	1.25	5,740	4,558	669,913	2048/8/15
		1.3 OBL 271015	1.3	4,050	3,901	573,399	2027/10/15
		1.3 OBL 271015	1.3	2,500	2,415	354,992	2027/10/15
		1.5 BUND 240515	1.5	2,460	2,428	356,835	2024/5/15
		1.7 BUND 320815	1.7	3,750	3,601	529,228	2032/8/15
		1.8 BUND 530815	1.8	1,850	1,609	236,586	2053/8/15
		2.1 BUND 291115	2.1	3,800	3,786	556,438	2029/11/15
		2.2 OBL 280413	2.2	2,250	2,253	331,167	2028/4/13
		2.3 BUND 330215	2.3	3,450	3,472	510,388	2033/2/15
		2.5 BUND 440704	2.5	4,730	4,803	705,952	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	4,600	4,706	691,708	2046/8/15
		2.5 SCHATS 250313	2.5	1,000	998	146,750	2025/3/13
		3.25 BUND 420704	3.25	2,880	3,238	475,874	2042/7/4
		4 BUND 370104	4.0	4,040	4,798	705,173	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	2,710	3,366	494,684	2039/7/4
4.75 BUND 280704	4.75	2,340	2,636	387,422	2028/7/4		
4.75 BUND 340704	4.75	3,550	4,411	648,331	2034/7/4		
4.75 BUND 400704	4.75	3,430	4,539	667,152	2040/7/4		
5.5 BUND 310104	5.5	4,280	5,279	775,918	2031/1/4		
5.625 BUND 280104	5.625	2,540	2,926	430,052	2028/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	1,700	2,130	313,061	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	1,750	2,045	300,575	2027/7/4		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ	千円		
イタリア	国債証券	0 ITALY GOVT 240815	—	2,500	2,400	352,760	2024/8/15
		0 ITALY GOVT 241215	—	2,000	1,901	279,446	2024/12/15
		0 ITALY GOVT 260401	—	3,300	3,002	441,221	2026/4/1
		0 ITALY GOVT 260801	—	2,500	2,248	330,497	2026/8/1
		0.25 ITALY GOVT 280315	0.25	2,700	2,314	340,204	2028/3/15
		0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	3,060	2,914	428,360	2025/2/1
		0.45 ITALY GOVT 290215	0.45	2,300	1,922	282,584	2029/2/15
		0.5 ITALY GOVT 260201	0.5	2,450	2,273	334,101	2026/2/1
		0.5 ITALY GOVT 280715	0.5	2,400	2,059	302,672	2028/7/15
		0.6 ITALY GOVT 310801	0.6	3,100	2,388	350,941	2031/8/1
		0.85 ITALY GOVT 270115	0.85	3,060	2,798	411,291	2027/1/15
		0.9 ITALY GOVT 310401	0.9	2,830	2,263	332,581	2031/4/1
		0.95 ITALY GOVT 270915	0.95	4,000	3,606	530,025	2027/9/15
		0.95 ITALY GOVT 300801	0.95	2,500	2,052	301,635	2030/8/1
		0.95 ITALY GOVT 311201	0.95	2,730	2,143	314,963	2031/12/1
		0.95 ITALY GOVT 320601	0.95	2,600	2,008	295,116	2032/6/1
		0.95 ITALY GOVT 370301	0.95	2,560	1,683	247,418	2037/3/1
		1.1 ITALY GOVT 270401	1.1	3,300	3,028	445,099	2027/4/1
		1.2 ITALY GOVT 250815	1.2	2,100	2,007	295,021	2025/8/15
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	2,680	2,495	366,790	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 300401	1.35	3,610	3,085	453,375	2030/4/1
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	2,400	2,337	343,564	2024/11/15
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	2,300	2,222	326,691	2025/5/15
		1.45 ITALY GOVT 360301	1.45	2,140	1,547	227,364	2036/3/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	3,300	3,188	468,581	2025/6/1
		1.5 ITALY GOVT 450430	1.5	2,010	1,196	175,806	2045/4/30
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	2,620	2,490	366,022	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 301201	1.65	3,870	3,315	487,285	2030/12/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	4,450	3,698	543,507	2032/3/1
		1.7 ITALY GOVT 510901	1.7	2,390	1,366	200,873	2051/9/1
1.75 ITALY GOVT 240530	1.75	2,500	2,458	361,230	2024/5/30		
1.75 ITALY GOVT 240701	1.75	3,000	2,947	433,111	2024/7/1		
1.8 ITALY GOVT 410301	1.8	2,240	1,522	223,777	2041/3/1		
1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	1,870	1,843	270,863	2024/5/15		
1.85 ITALY GOVT 250701	1.85	2,400	2,335	343,276	2025/7/1		
2 ITALY GOVT 251201	2.0	3,530	3,422	502,929	2025/12/1		
2 ITALY GOVT 280201	2.0	4,580	4,291	630,619	2028/2/1		
2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	3,650	3,458	508,225	2027/8/1		
2.1 ITALY GOVT 260715	2.1	2,350	2,264	332,791	2026/7/15		
2.15 ITALY GOVT 520901	2.15	2,150	1,346	197,876	2052/9/1		
2.15 ITALY GOVT 720301	2.15	850	476	70,093	2072/3/1		
2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	2,000	1,911	280,938	2027/6/1		
2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	2,720	2,156	316,973	2036/9/1		
2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	2,870	2,468	362,739	2033/9/1		
2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	2,490	1,704	250,512	2050/9/1		
2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	3,360	3,322	488,346	2024/12/1		
2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	2,330	2,289	336,478	2025/11/15		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	2.5 ITALY GOVT 321201	2.5	2,850	2,507	368,527	2032/12/1
		2.65 ITALY GOVT 271201	2.65	2,800	2,707	397,836	2027/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	2,630	1,966	289,046	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	4,680	4,500	661,365	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 290615	2.8	3,200	3,046	447,649	2029/6/15
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	1,620	1,104	162,319	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	2,380	2,000	293,972	2038/9/1
		3 ITALY GOVT 290801	3.0	3,400	3,275	481,354	2029/8/1
		3.1 ITALY GOVT 400301	3.1	1,890	1,590	233,765	2040/3/1
		3.25 ITALY GOVT 380301	3.25	1,340	1,171	172,155	2038/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	2,740	2,263	332,685	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	3,110	2,842	417,757	2035/3/1
		3.4 ITALY GOVT 250328	3.4	2,300	2,303	338,489	2025/3/28
		3.4 ITALY GOVT 280401	3.4	1,500	1,491	219,225	2028/4/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	2,820	2,388	350,949	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 260115	3.5	2,500	2,511	369,089	2026/1/15
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	3,670	3,621	532,223	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	4,230	4,255	625,351	2024/9/1
		3.8 ITALY GOVT 260415	3.8	1,500	1,518	223,112	2026/4/15
		3.85 ITALY GOVT 291215	3.85	2,600	2,613	384,104	2029/12/15
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	1,950	1,750	257,243	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 311030	4.0	2,400	2,415	354,970	2031/10/30
		4 ITALY GOVT 350430	4.0	1,150	1,119	164,528	2035/4/30
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	4,300	4,152	610,221	2037/2/1
		4.4 ITALY GOVT 330501	4.4	2,900	2,975	437,283	2033/5/1
		4.45 ITALY GOVT 430901	4.45	1,200	1,182	173,847	2043/9/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	3,740	3,858	567,090	2026/3/1
		4.5 ITALY GOVT 531001	4.5	700	688	101,135	2053/10/1
4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	3,930	4,156	610,819	2028/9/1		
4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	2,650	2,726	400,624	2044/9/1		
5 ITALY GOVT 250301	5.0	4,280	4,409	647,995	2025/3/1		
5 ITALY GOVT 340801	5.0	3,850	4,108	603,720	2034/8/1		
5 ITALY GOVT 390801	5.0	3,980	4,230	621,784	2039/8/1		
5 ITALY GOVT 400901	5.0	3,600	3,828	562,656	2040/9/1		
5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	4,110	4,486	659,368	2029/11/1		
5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	3,820	4,326	635,802	2033/2/1		
6 ITALY GOVT 310501	6.0	5,230	5,998	881,505	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	3,900	4,398	646,453	2027/11/1		
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	2,300	2,592	381,064	2026/11/1		
フランス	国債証券	0 O. A. T 250225	—	2,900	2,764	406,245	2025/2/25
		0 O. A. T 250325	—	7,380	7,023	1,032,170	2025/3/25
		0 O. A. T 260225	—	6,600	6,149	903,723	2026/2/25
		0 O. A. T 270225	—	6,130	5,581	820,236	2027/2/25
		0 O. A. T 291125	—	6,380	5,408	794,835	2029/11/25
		0 O. A. T 301125	—	8,390	6,904	1,014,661	2030/11/25
		0 O. A. T 311125	—	9,100	7,263	1,067,495	2031/11/25
		0 O. A. T 320525	—	5,430	4,265	626,864	2032/5/25

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	0.25 O.A.T 261125	0.25	5,680	5,246	771,017	2026/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	6,490	6,214	913,327	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	7,530	7,084	1,041,145	2026/5/25
		0.5 O.A.T 290525	0.5	9,570	8,488	1,247,470	2029/5/25
		0.5 O.A.T 400525	0.5	4,390	2,869	421,699	2040/5/25
		0.5 O.A.T 440625	0.5	2,730	1,625	238,845	2044/6/25
		0.5 O.A.T 720525	0.5	1,500	588	86,455	2072/5/25
		0.75 O.A.T 280225	0.75	7,400	6,812	1,001,195	2028/2/25
		0.75 O.A.T 280525	0.75	8,850	8,115	1,192,646	2028/5/25
		0.75 O.A.T 281125	0.75	8,360	7,600	1,116,993	2028/11/25
		0.75 O.A.T 520525	0.75	4,710	2,546	374,274	2052/5/25
		0.75 O.A.T 530525	0.75	5,540	2,915	428,486	2053/5/25
		1 O.A.T 251125	1.0	6,580	6,327	929,825	2025/11/25
		1 O.A.T 270525	1.0	6,260	5,899	866,919	2027/5/25
		1.25 O.A.T 340525	1.25	6,390	5,413	795,576	2034/5/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	7,070	5,745	844,380	2036/5/25
		1.25 O.A.T 380525	1.25	2,000	1,558	229,087	2038/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	8,560	7,883	1,158,504	2031/5/25
		1.5 O.A.T 500525	1.5	5,230	3,618	531,767	2050/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	6,520	6,420	943,547	2024/11/25
		1.75 O.A.T 390625	1.75	4,550	3,790	557,053	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	2,590	1,762	258,964	2066/5/25
		2 O.A.T 321125	2.0	6,650	6,242	917,410	2032/11/25
		2 O.A.T 480525	2.0	4,650	3,680	540,944	2048/5/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	6,190	6,141	902,573	2024/5/25
		2.5 O.A.T 260924	2.5	1,800	1,794	263,688	2026/9/24
		2.5 O.A.T 300525	2.5	9,590	9,548	1,403,274	2030/5/25
		2.5 O.A.T 430525	2.5	1,330	1,188	174,734	2043/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	8,490	8,572	1,259,758	2027/10/25
		2.75 O.A.T 290225	2.75	1,500	1,513	222,404	2029/2/25
3 O.A.T 330525	3.0	1,000	1,017	149,510	2033/5/25		
3 O.A.T 540525	3.0	700	656	96,524	2054/5/25		
3.25 O.A.T 450525	3.25	4,710	4,733	695,630	2045/5/25		
3.5 O.A.T 260425	3.5	6,690	6,867	1,009,211	2026/4/25		
4 O.A.T 381025	4.0	4,020	4,455	654,728	2038/10/25		
4 O.A.T 550425	4.0	3,090	3,521	517,504	2055/4/25		
4 O.A.T 600425	4.0	2,740	3,158	464,215	2060/4/25		
4.5 O.A.T 410425	4.5	5,580	6,593	968,928	2041/4/25		
4.75 O.A.T 350425	4.75	4,800	5,669	833,178	2035/4/25		
5.5 O.A.T 290425	5.5	5,820	6,747	991,656	2029/4/25		
5.75 O.A.T 321025	5.75	5,090	6,356	934,224	2032/10/25		
6 O.A.T 251025	6.0	8,760	9,451	1,389,037	2025/10/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 260115	—	2,200	2,059	302,633	2026/1/15
		0 NETH GOVT 270115	—	1,950	1,785	262,400	2027/1/15
		0 NETH GOVT 290115	—	1,300	1,134	166,795	2029/1/15
		0 NETH GOVT 300715	—	2,650	2,227	327,325	2030/7/15
		0 NETH GOVT 310715	—	1,620	1,325	194,824	2031/7/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 380115	—	1,540	1,036	152,279	2038/1/15
		0 NETH GOVT 520115	—	2,830	1,367	200,946	2052/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,930	1,838	270,232	2025/7/15
		0.25 NETH GOVT 290715	0.25	2,950	2,587	380,322	2029/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	3,970	3,737	549,212	2026/7/15
		0.5 NETH GOVT 320715	0.5	2,300	1,921	282,399	2032/7/15
		0.5 NETH GOVT 400115	0.5	2,630	1,852	272,268	2040/1/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	2,670	2,497	366,962	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	3,020	2,780	408,591	2028/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	2,900	2,875	422,604	2024/7/15
		2 NETH GOVT 540115	2.0	960	825	121,366	2054/1/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	2,250	2,241	329,426	2033/1/15
		2.5 NETH GOVT 330715	2.5	650	647	95,165	2033/7/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	3,270	3,319	487,794	2047/1/15
3.75 NETH GOVT 420115	3.75	2,690	3,078	452,480	2042/1/15		
4 NETH GOVT 370115	4.0	3,100	3,546	521,142	2037/1/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,480	1,677	246,543	2028/1/15		
スペイン	国債証券	0 SPAIN GOVT 240531	—	5,600	5,421	796,703	2024/5/31
		0 SPAIN GOVT 250131	—	3,630	3,459	508,362	2025/1/31
		0 SPAIN GOVT 250531	—	2,500	2,359	346,704	2025/5/31
		0 SPAIN GOVT 260131	—	3,000	2,781	408,757	2026/1/31
		0 SPAIN GOVT 270131	—	2,800	2,522	370,686	2027/1/31
		0 SPAIN GOVT 280131	—	3,800	3,325	488,764	2028/1/31
		0.1 SPAIN GOVT 310430	0.1	4,360	3,451	507,263	2031/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 240730	0.25	2,700	2,610	383,663	2024/7/30
		0.5 SPAIN GOVT 300430	0.5	3,580	3,023	444,297	2030/4/30
		0.5 SPAIN GOVT 311031	0.5	2,490	2,007	295,039	2031/10/31
		0.6 SPAIN GOVT 291031	0.6	3,680	3,173	466,450	2029/10/31
		0.7 SPAIN GOVT 320430	0.7	3,800	3,073	451,612	2032/4/30
		0.8 SPAIN GOVT 270730	0.8	4,850	4,460	655,496	2027/7/30
		0.8 SPAIN GOVT 290730	0.8	2,530	2,218	325,996	2029/7/30
		0.85 SPAIN GOVT 370730	0.85	1,850	1,284	188,762	2037/7/30
		1 SPAIN GOVT 420730	1.0	1,350	843	124,033	2042/7/30
		1 SPAIN GOVT 501031	1.0	3,100	1,627	239,236	2050/10/31
		1.2 SPAIN GOVT 401031	1.2	2,730	1,846	271,387	2040/10/31
		1.25 SPAIN GOVT 301031	1.25	3,230	2,844	417,960	2030/10/31
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	3,650	3,472	510,295	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	3,740	3,487	512,537	2028/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	4,240	3,935	578,430	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	3,330	3,135	460,789	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	3,300	3,036	446,210	2029/4/30
		1.45 SPAIN GOVT 711031	1.45	950	450	66,268	2071/10/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	3,290	3,128	459,734	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	3,510	3,429	503,970	2025/4/30
		1.85 SPAIN GOVT 350730	1.85	4,200	3,532	519,193	2035/7/30
1.9 SPAIN GOVT 521031	1.9	1,700	1,104	162,248	2052/10/31		
1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	3,520	3,435	504,946	2026/4/30		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	3,790	3,525	518,084	2030/7/30
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	3,110	2,857	419,880	2033/7/30
		2.55 SPAIN GOVT 321031	2.55	4,190	3,955	581,285	2032/10/31
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	2,610	2,126	312,526	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	5,400	5,386	791,668	2024/10/31
		2.8 SPAIN GOVT 260531	2.8	1,500	1,496	219,943	2026/5/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	2,990	2,576	378,622	2046/10/31
		3.15 SPAIN GOVT 330430	3.15	3,000	2,960	435,128	2033/4/30
		3.45 SPAIN GOVT 430730	3.45	1,820	1,718	252,544	2043/7/30
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	2,230	2,001	294,088	2066/7/30
		3.9 SPAIN GOVT 390730	3.9	1,050	1,071	157,489	2039/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	3,460	3,696	543,292	2037/1/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	2,890	3,001	441,166	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	3,200	3,593	528,043	2041/7/30
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	2,930	3,367	494,927	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	2,500	2,774	407,795	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	2,390	2,851	419,084	2044/10/31
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	3,480	4,188	615,520	2032/7/30
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	4,650	5,080	746,640	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	4,230	4,905	720,949	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0 BEL GOVT 271022	—	1,800	1,610	236,683	2027/10/22
		0 BEL GOVT 311022	—	1,700	1,347	197,974	2031/10/22
		0.1 BEL GOVT 300622	0.1	2,520	2,108	309,935	2030/6/22
		0.35 BEL GOVT 320622	0.35	2,450	1,964	288,704	2032/6/22
		0.4 BEL GOVT 400622	0.4	1,300	816	119,980	2040/6/22
		0.5 BEL GOVT 241022	0.5	2,190	2,121	311,709	2024/10/22
		0.65 BEL GOVT 710622	0.65	910	376	55,383	2071/6/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	2,970	2,861	420,502	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	2,880	2,686	394,872	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	2,250	2,067	303,868	2028/6/22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	3,090	2,804	412,121	2029/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	2,760	2,634	387,142	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	2,850	2,494	366,574	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	1,770	1,530	224,967	2033/4/22
		1.4 BEL GOVT 530622	1.4	2,120	1,338	196,754	2053/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	1,220	986	144,957	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	1,570	1,122	164,917	2047/6/22
		1.7 BEL GOVT 500622	1.7	1,540	1,092	160,501	2050/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	1,360	1,150	169,144	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	1,090	813	119,527	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	1,020	798	117,295	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	2,180	2,171	319,076	2024/6/22
		2.75 BEL GOVT 390422	2.75	950	893	131,235	2039/4/22
		3 BEL GOVT 330622	3.0	1,300	1,308	192,269	2033/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	1,230	1,231	180,935	2034/6/22
3.3 BEL GOVT 540622	3.3	800	778	114,341	2054/6/22		
3.75 BEL GOVT 450622	3.75	1,620	1,727	253,854	2045/6/22		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	4 BEL GOVT 320328	4.0	1,250	1,364	200,496	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	2,780	3,142	461,824	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	1,610	1,695	249,137	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	2,950	3,513	516,385	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	2,380	2,703	397,291	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 250420	—	800	760	111,721	2025/4/20
		0 AUSTRIA GOVT 281020	—	900	781	114,883	2028/10/20
		0 AUSTRIA GOVT 300220	—	2,150	1,794	263,772	2030/2/20
		0 AUSTRIA GOVT 310220	—	2,130	1,722	253,204	2031/2/20
		0 AUSTRIA GOVT 401020	—	810	475	69,882	2040/10/20
		0.25 AUSTRIA GOVT 361020	0.25	1,050	731	107,449	2036/10/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	2,300	2,125	312,375	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	2,050	1,819	267,432	2029/2/20
		0.7 AUSTRIA GOVT 710420	0.7	680	306	45,076	2071/4/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	2,480	2,336	343,368	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,690	1,553	228,284	2028/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 510320	0.75	1,180	676	99,392	2051/3/20
		0.85 AUSTRIA GOVT 200630	0.85	650	275	40,550	2120/6/30
		0.9 AUSTRIA GOVT 320220	0.9	2,120	1,805	265,399	2032/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	2,710	2,623	385,589	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	1,430	1,052	154,681	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	460	275	40,543	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	2,510	2,472	363,345	2024/10/21
		1.85 AUSTRIA GOVT 490523	1.85	870	676	99,487	2049/5/23
		2 AUSTRIA GOVT 260715	2.0	1,000	984	144,649	2026/7/15
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	810	595	87,574	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	1,300	1,236	181,643	2034/5/23
		2.9 AUSTRIA GOVT 290523	2.9	700	709	104,204	2029/5/23
2.9 AUSTRIA GOVT 330220	2.9	1,000	1,000	147,045	2033/2/20		
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	1,250	1,258	184,992	2044/6/20		
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	700	811	119,190	2062/1/26		
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	2,190	2,454	360,749	2037/3/15		
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	1,370	1,457	214,153	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	1,630	1,860	273,437	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 240915	—	850	820	120,527	2024/9/15
		0 FINNISH GOVT 300915	—	750	616	90,586	2030/9/15
		0.125 FINNISH GOV 310915	0.125	1,070	862	126,796	2031/9/15
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	510	353	51,993	2036/4/15
		0.125 FINNISH GOV 520415	0.125	750	347	51,028	2052/4/15
		0.25 FINNISH GOVT 400915	0.25	540	337	49,626	2040/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	1,670	1,578	231,987	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	700	642	94,474	2027/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	1,480	1,329	195,396	2028/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 290915	0.5	720	631	92,787	2029/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 430415	0.5	480	297	43,709	2043/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	1,050	902	132,608	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	630	606	89,141	2025/9/15

銘柄	銘柄		当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フィンランド	国債証券	1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	730	608	89,490	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 270415	1.375	800	766	112,693	2027/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	840	615	90,449	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 320915	1.5	750	670	98,513	2032/9/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	940	884	129,929	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	1,110	1,121	164,825	2028/7/4
		2.75 FINNISH GOV 380415	2.75	680	652	95,928	2038/4/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	240	247	36,313	2025/7/4
アイルランド	国債証券	0 IRISH GOVT 311018	—	1,350	1,083	159,185	2031/10/18
		0.2 IRISH GOVT 270515	0.2	500	456	67,119	2027/5/15
		0.2 IRISH GOVT 301018	0.2	620	522	76,794	2030/10/18
		0.35 IRISH GOVT 321018	0.35	400	323	47,514	2032/10/18
		0.4 IRISH GOVT 350515	0.4	700	527	77,497	2035/5/15
		0.55 IRISH GOVT 410422	0.55	1,000	650	95,664	2041/4/22
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	1,640	1,521	223,550	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	1,850	1,771	260,284	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	1,610	1,488	218,729	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	860	753	110,667	2033/5/15
		1.35 IRISH GOVT 310318	1.35	1,070	978	143,839	2031/3/18
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	1,160	809	118,954	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	1,190	1,015	149,305	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	1,640	1,338	196,708	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	2,090	2,078	305,454	2030/5/15
		3 IRISH GOVT 431018	3.0	450	440	64,761	2043/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	2,100	2,203	323,811	2025/3/13
小計						145,087,603	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
イギリス	国債証券	0.125 GILT 260130	0.125	2,600	2,366	398,679	2026/1/30
		0.125 GILT 280131	0.125	2,300	1,956	329,750	2028/1/31
		0.25 GILT 250131	0.25	4,100	3,838	646,753	2025/1/31
		0.25 GILT 310731	0.25	4,460	3,402	573,244	2031/7/31
		0.375 GILT 261022	0.375	3,750	3,345	563,632	2026/10/22
		0.375 GILT 301022	0.375	2,390	1,895	319,335	2030/10/22
		0.5 GILT 290131	0.5	4,900	4,104	691,613	2029/1/31
		0.5 GILT 611022	0.5	2,550	844	142,341	2061/10/22
		0.625 GILT 250607	0.625	2,880	2,703	455,463	2025/6/7
		0.625 GILT 350731	0.625	4,030	2,772	467,225	2035/7/31
		0.625 GILT 501022	0.625	1,590	689	116,212	2050/10/22
		0.875 GILT 291022	0.875	2,320	1,967	331,506	2029/10/22
		0.875 GILT 330731	0.875	2,350	1,785	300,798	2033/7/31
		0.875 GILT 460131	0.875	2,420	1,267	213,520	2046/1/31
		1 GILT 320131	1.0	5,100	4,099	690,831	2032/1/31
		1.125 GILT 390131	1.125	3,550	2,356	396,991	2039/1/31
		1.125 GILT 731022	1.125	1,500	613	103,397	2073/10/22
		1.25 GILT 270722	1.25	2,100	1,910	321,925	2027/7/22
		1.25 GILT 411022	1.25	3,750	2,386	402,145	2041/10/22
		1.25 GILT 510731	1.25	3,480	1,835	309,202	2051/7/31

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額		千円	
			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		
国債証券	1.5 GILT 260722	1.5	2,490	2,328	392,305	2026/7/22
	1.5 GILT 470722	1.5	3,160	1,893	319,060	2047/7/22
	1.5 GILT 530731	1.5	1,250	691	116,585	2053/7/31
	1.625 GILT 281022	1.625	1,790	1,621	273,188	2028/10/22
	1.625 GILT 541022	1.625	2,060	1,171	197,352	2054/10/22
	1.625 GILT 711022	1.625	2,530	1,307	220,382	2071/10/22
	1.75 GILT 370907	1.75	3,340	2,540	428,101	2037/9/7
	1.75 GILT 490122	1.75	1,780	1,115	187,970	2049/1/22
	1.75 GILT 570722	1.75	2,830	1,647	277,624	2057/7/22
	2 GILT 250907	2.0	2,100	2,015	339,566	2025/9/7
	2.5 GILT 650722	2.5	2,480	1,747	294,379	2065/7/22
	3.25 GILT 330131	3.25	2,100	2,023	340,899	2033/1/31
	3.25 GILT 440122	3.25	3,060	2,684	452,369	2044/1/22
	3.5 GILT 251022	3.5	2,500	2,464	415,251	2025/10/22
	3.5 GILT 450122	3.5	3,190	2,893	487,551	2045/1/22
	3.5 GILT 680722	3.5	2,250	2,038	343,431	2068/7/22
	3.75 GILT 380129	3.75	1,250	1,215	204,851	2038/1/29
	3.75 GILT 520722	3.75	1,810	1,698	286,193	2052/7/22
	3.75 GILT 531022	3.75	2,150	2,009	338,545	2053/10/22
	4 GILT 600122	4.0	1,980	1,975	332,850	2060/1/22
	4.125 GILT 270129	4.125	3,300	3,325	560,376	2027/1/29
	4.25 GILT 271207	4.25	2,450	2,514	423,735	2027/12/7
	4.25 GILT 320607	4.25	2,770	2,907	489,928	2032/6/7
	4.25 GILT 360307	4.25	2,410	2,509	422,854	2036/3/7
	4.25 GILT 390907	4.25	2,320	2,376	400,446	2039/9/7
	4.25 GILT 401207	4.25	2,120	2,169	365,526	2040/12/7
	4.25 GILT 461207	4.25	2,680	2,718	458,112	2046/12/7
	4.25 GILT 491207	4.25	2,340	2,380	401,086	2049/12/7
	4.25 GILT 551207	4.25	2,770	2,853	480,896	2055/12/7
	4.5 GILT 340907	4.5	1,990	2,123	357,739	2034/9/7
	4.5 GILT 421207	4.5	2,790	2,945	496,343	2042/12/7
	4.75 GILT 301207	4.75	3,650	3,934	662,997	2030/12/7
	4.75 GILT 381207	4.75	2,310	2,516	423,992	2038/12/7
	5 GILT 250307	5.0	2,490	2,532	426,705	2025/3/7
	6 GILT 281207	6.0	1,890	2,118	356,919	2028/12/7
小計					20,750,700	
スウェーデン			千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	0.125	9,450	8,034	104,695	2031/5/12
	0.75 SWD GOVT 280512	0.75	8,000	7,421	96,704	2028/5/12
	0.75 SWD GOVT 291112	0.75	12,200	11,123	144,935	2029/11/12
	1 SWD GOVT 261112	1.0	11,960	11,371	148,169	2026/11/12
	1.75 SWD GOVT 331111	1.75	3,500	3,362	43,818	2033/11/11
	2.25 SWD GOVT 320601	2.25	6,750	6,764	88,141	2032/6/1
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	8,840	8,785	114,480	2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	6,470	7,460	97,215	2039/3/30
小計					838,161	

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		
ノルウェー		%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円	
国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	1.25	4,700	4,049	51,098	2031/9/17
	1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	8,770	7,773	98,095	2030/8/19
	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	6,040	5,760	72,695	2026/2/19
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	10,200	9,894	124,872	2025/3/13
	1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	5,120	4,868	61,439	2027/2/17
	1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	4,600	4,245	53,578	2029/9/6
	2 NORWE GOVT 280426	2.0	6,900	6,541	82,551	2028/4/26
	2.125 NORWE GOVT 320518	2.125	5,500	5,057	63,825	2032/5/18
	3 NORWE GOVT 330815	3.0	4,500	4,441	56,048	2033/8/15
小計					664,205	
デンマーク			千デンマーククロネ	千デンマーククロネ		
国債証券	0 DMK GOVT 241115	—	4,800	4,603	90,825	2024/11/15
	0 DMK GOVT 311115	—	14,550	11,873	234,255	2031/11/15
	0.25 DMK GOVT 521115	0.25	8,900	4,713	92,990	2052/11/15
	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	10,200	9,388	185,229	2027/11/15
	0.5 DMK GOVT 291115	0.5	10,550	9,360	184,683	2029/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	7,490	7,336	144,753	2025/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	15,650	19,536	385,453	2039/11/15
小計					1,318,191	
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	2,500	80,953	2026/10/25
	0.75 POLAND 250425	0.75	3,500	3,190	103,303	2025/4/25
	1.25 POLAND 301025	1.25	5,890	4,346	140,724	2030/10/25
	1.75 POLAND 320425	1.75	7,600	5,552	179,790	2032/4/25
	2.25 POLAND 241025	2.25	4,000	3,816	123,582	2024/10/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	7,840	7,119	230,504	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	6,110	5,394	174,671	2027/7/25
	2.75 POLAND 280425	2.75	5,760	5,047	163,425	2028/4/25
	2.75 POLAND 291025	2.75	7,900	6,684	216,435	2029/10/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	8,700	8,268	267,705	2025/7/25
	3.75 POLAND 270525	3.75	4,000	3,721	120,496	2027/5/25
	5.75 POLAND 290425	5.75	1,450	1,457	47,186	2029/4/25
	7.5 POLAND 280725	7.5	3,500	3,763	121,861	2028/7/25
小計					1,970,642	
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 251121	0.25	5,450	5,079	458,317	2025/11/21
	0.5 AUST GOVT 260921	0.5	4,100	3,766	339,857	2026/9/21
	1 AUST GOVT 301221	1.0	3,010	2,548	229,976	2030/12/21
	1 AUST GOVT 311121	1.0	4,250	3,515	317,160	2031/11/21
	1.25 AUST GOVT 320521	1.25	4,530	3,788	341,791	2032/5/21
	1.5 AUST GOVT 310621	1.5	4,740	4,130	372,739	2031/6/21
	1.75 AUST GOVT 321121	1.75	3,980	3,453	311,640	2032/11/21
	1.75 AUST GOVT 510621	1.75	3,070	1,929	174,142	2051/6/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	1,900	1,824	164,609	2028/5/21
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	3,940	3,756	338,940	2030/5/21
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	2,490	2,454	221,424	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	1,940	1,902	171,650	2028/11/21

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
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	2.75 AUST GOVT 291121	2,980	2,900	261,674	2029/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	1,520	1,405	126,822	2035/6/21
		2.75 AUST GOVT 410521	1,370	1,173	105,872	2041/5/21
		3 AUST GOVT 331121	4,100	3,951	356,526	2033/11/21
		3 AUST GOVT 470321	2,020	1,728	155,997	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 250421	5,460	5,465	493,174	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	2,660	2,671	241,078	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	2,130	1,997	180,215	2039/6/21
		3.5 AUST GOVT 341221	2,300	2,306	208,102	2034/12/21
		3.75 AUST GOVT 340521	1,700	1,749	157,852	2034/5/21
		3.75 AUST GOVT 370421	2,150	2,172	196,026	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 260421	2,490	2,572	232,101	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 330421	3,100	3,389	305,807	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	3,050	3,237	292,133	2027/4/21
小	計				6,755,640	
ニュージーランド			千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル		
	国債証券	0.25 NZ GOVT 280515	2,000	1,659	140,617	2028/5/15
		1.75 NZ GOVT 410515	600	400	33,951	2041/5/15
		2 NZ GOVT 320515	2,300	1,939	164,363	2032/5/15
		2.75 NZ GOVT 250415	2,000	1,931	163,696	2025/4/15
		2.75 NZ GOVT 370415	1,450	1,210	102,582	2037/4/15
		2.75 NZ GOVT 510515	680	503	42,636	2051/5/15
		3 NZ GOVT 290420	1,700	1,604	136,033	2029/4/20
		3.5 NZ GOVT 330414	800	760	64,437	2033/4/14
		4.5 NZ GOVT 270415	1,800	1,825	154,739	2027/4/15
小	計				1,003,059	
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	700	662	66,997	2026/11/1
		1.625 SINGAPORGOV 310701	1,050	967	97,788	2031/7/1
		1.875 SINGAPORGOV 500301	700	642	65,015	2050/3/1
		1.875 SINGAPORGOV 511001	950	884	89,449	2051/10/1
		2.125 SINGAPORGOV 260601	1,530	1,494	151,077	2026/6/1
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	1,300	1,245	125,961	2036/8/1
		2.375 SINGAPORGOV 250601	1,560	1,537	155,500	2025/6/1
		2.375 SINGAPORGOV 390701	380	370	37,477	2039/7/1
		2.625 SINGAPORGOV 280501	800	797	80,671	2028/5/1
		2.625 SINGAPORGOV 320801	700	693	70,137	2032/8/1
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	980	1,026	103,838	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	1,140	1,208	122,193	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOV 270901	1,000	1,006	101,726	2027/9/1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	920	930	94,100	2029/7/1
		2.875SINGAPORGOVT 300901	1,340	1,354	136,991	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	1,500	1,492	150,967	2024/9/1
		3 SINGAPORGOVT 720801	560	690	69,849	2072/8/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	780	825	83,503	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	1,000	1,025	103,739	2027/3/1
小	計				1,906,986	

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
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					
	2.632 MALAYSIAGOV 310415	2.632	2,800	2,587	77,786	2031/4/15
	3.478 MALAYSIAGOV 240614	3.478	1,300	1,305	39,258	2024/6/14
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	3,000	2,995	90,044	2027/5/31
	3.582 MALAYSIAGOV 320715	3.582	2,100	2,080	62,554	2032/7/15
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	2,800	2,827	85,014	2028/6/15
	3.757 MALAYSIAGOV 400522	3.757	3,630	3,540	106,423	2040/5/22
	3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	2,300	2,302	69,228	2034/7/5
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	2,400	2,408	72,404	2033/4/15
	3.882 MALAYSIAGOV 250314	3.882	2,410	2,439	73,347	2025/3/14
	3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	3,600	3,641	109,476	2029/8/15
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	5,100	5,170	155,435	2027/3/15
	3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	5,640	5,737	172,494	2027/11/16
	3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	1,100	1,116	33,571	2026/11/30
	3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	1,400	1,422	42,773	2026/7/15
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	4,270	4,334	130,321	2025/9/15
	4.059 MALAYSIAGOV 240930	4.059	2,000	2,022	60,815	2024/9/30
	4.065 MALAYSIAGOV 500615	4.065	5,250	5,189	156,009	2050/6/15
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	2,500	2,527	75,998	2024/7/15
	4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	2,550	2,637	79,280	2031/6/30
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	2,150	2,213	66,529	2035/5/31
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	900	925	27,836	2026/4/15
	4.457 MALAYSIAGOV 530331	4.457	600	631	18,996	2053/3/31
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	2,240	2,356	70,848	2030/4/15
	4.504 MALAYSIAGOV 290430	4.504	1,500	1,567	47,109	2029/4/30
	4.642 MALAYSIAGOV 331107	4.642	1,200	1,292	38,858	2033/11/7
	4.696 MALAYSIAGOV 421015	4.696	1,900	2,097	63,065	2042/10/15
	4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	1,650	1,806	54,303	2046/3/15
	4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	4,440	4,814	144,744	2037/4/7
	4.893 MALAYSIAGOV 380608	4.893	2,750	3,065	92,162	2038/6/8
	4.921 MALAYSIAGOV 480706	4.921	2,020	2,327	69,977	2048/7/6
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	1,000	1,118	33,623	2043/9/30
小	計				2,420,296	
中国			千中国元	千中国元		
	国債証券					
	1.99 CHINA GOVT 240915	1.99	14,000	13,950	270,129	2024/9/15
	1.99 CHINA GOVT 250409	1.99	20,000	19,866	384,694	2025/4/9
	2.18 CHINA GOVT 240625	2.18	26,000	25,992	503,324	2024/6/25
	2.18 CHINA GOVT 250825	2.18	16,000	15,923	308,336	2025/8/25
	2.24 CHINA GOVT 250525	2.24	9,000	8,979	173,883	2025/5/25
	2.26 CHINA GOVT 250224	2.26	14,000	13,985	270,810	2025/2/24
	2.28 CHINA GOVT 251125	2.28	22,000	21,946	424,963	2025/11/25
	2.29 CHINA GOVT 241225	2.29	33,000	33,014	639,295	2024/12/25
	2.35 CHINA GOVT 250315	2.35	12,000	12,010	232,564	2025/3/15
	2.37 CHINA GOVT 270120	2.37	21,000	20,887	404,453	2027/1/20
	2.44 CHINA GOVT 271015	2.44	15,000	14,924	289,005	2027/10/15
	2.46 CHINA GOVT 260215	2.46	20,000	20,033	387,918	2026/2/15
	2.47 CHINA GOVT 240902	2.47	16,000	16,047	310,733	2024/9/2
	2.48 CHINA GOVT 270415	2.48	13,000	12,974	251,228	2027/4/15

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
中国		%	千中国元	千中国元	千円		
	国債証券	2.5 CHINA GOVT 270725	2.5	17,000	16,962	328,457	2027/7/25
		2.6 CHINA GOVT 320901	2.6	17,000	16,753	324,415	2032/9/1
		2.62 CHINA GOVT 280415	2.62	8,000	8,016	155,240	2028/4/15
		2.62 CHINA GOVT 290925	2.62	14,000	13,922	269,591	2029/9/25
		2.64 CHINA GOVT 280115	2.64	19,000	19,052	368,929	2028/1/15
		2.68 CHINA GOVT 300521	2.68	27,000	26,907	521,040	2030/5/21
		2.69 CHINA GOVT 260812	2.69	24,000	24,163	467,897	2026/8/12
		2.69 CHINA GOVT 320815	2.69	17,000	16,879	326,844	2032/8/15
		2.74 CHINA GOVT 260804	2.74	5,000	5,042	97,648	2026/8/4
		2.75 CHINA GOVT 290615	2.75	20,000	20,061	388,460	2029/6/15
		2.75 CHINA GOVT 320217	2.75	15,000	14,969	289,866	2032/2/17
		2.76 CHINA GOVT 320515	2.76	16,000	15,985	309,533	2032/5/15
		2.79 CHINA GOVT 291215	2.79	19,000	19,077	369,423	2029/12/15
		2.8 CHINA GOVT 290324	2.8	14,000	14,089	272,829	2029/3/24
		2.8 CHINA GOVT 300325	2.8	15,000	15,077	291,955	2030/3/25
		2.8 CHINA GOVT 321115	2.8	17,000	17,049	330,145	2032/11/15
		2.85 CHINA GOVT 270604	2.85	22,000	22,267	431,194	2027/6/4
		2.88 CHINA GOVT 330225	2.88	13,000	13,168	254,993	2033/2/25
		2.89 CHINA GOVT 311118	2.89	18,000	18,156	351,586	2031/11/18
		2.9 CHINA GOVT 260505	2.9	17,000	17,243	333,895	2026/5/5
		2.91 CHINA GOVT 281014	2.91	16,000	16,222	314,128	2028/10/14
		2.94 CHINA GOVT 241017	2.94	10,000	10,105	195,685	2024/10/17
		2.99 CHINA GOVT 251015	2.99	9,000	9,136	176,916	2025/10/15
		3.01 CHINA GOVT 280513	3.01	21,000	21,428	414,948	2028/5/13
		3.02 CHINA GOVT 251022	3.02	22,000	22,353	432,844	2025/10/22
		3.02 CHINA GOVT 310527	3.02	30,000	30,625	593,029	2031/5/27
		3.03 CHINA GOVT 260311	3.03	28,000	28,504	551,950	2026/3/11
		3.12 CHINA GOVT 261205	3.12	17,000	17,369	336,334	2026/12/5
		3.12 CHINA GOVT 521025	3.12	8,000	8,053	155,946	2052/10/25
		3.13 CHINA GOVT 291121	3.13	21,000	21,599	418,252	2029/11/21
		3.22 CHINA GOVT 251206	3.22	13,000	13,293	257,407	2025/12/6
		3.25 CHINA GOVT 260606	3.25	18,000	18,467	357,601	2026/6/6
		3.25 CHINA GOVT 281122	3.25	17,000	17,622	341,240	2028/11/22
		3.27 CHINA GOVT 301119	3.27	24,000	25,050	485,082	2030/11/19
		3.28 CHINA GOVT 271203	3.28	24,000	24,822	480,651	2027/12/3
		3.29 CHINA GOVT 290523	3.29	25,000	26,011	503,681	2029/5/23
		3.32 CHINA GOVT 520415	3.32	14,000	14,502	280,830	2052/4/15
		3.39 CHINA GOVT 500316	3.39	20,000	20,896	404,645	2050/3/16
		3.52 CHINA GOVT 270504	3.52	19,000	19,851	384,406	2027/5/4
		3.53 CHINA GOVT 511018	3.53	12,000	12,889	249,594	2051/10/18
		3.54 CHINA GOVT 280816	3.54	13,000	13,686	265,017	2028/8/16
		3.57 CHINA GOVT 240622	3.57	10,000	10,175	197,033	2024/6/22
		3.59 CHINA GOVT 270803	3.59	7,000	7,345	142,241	2027/8/3
		3.6 CHINA GOVT 250906	3.6	8,000	8,262	159,984	2025/9/6
		3.61 CHINA GOVT 250607	3.61	10,000	10,312	199,681	2025/6/7
		3.69 CHINA GOVT 240921	3.69	20,000	20,460	396,201	2024/9/21
		3.69 CHINA GOVT 280517	3.69	18,000	19,091	369,686	2028/5/17

銘	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
中国		%	千中国元	千中国元	千円		
	国債証券	3.72 CHINA GOVT 510412	3.72	14,000	15,511	300,367	2051/4/12
		3.77 CHINA GOVT 250308	3.77	11,000	11,343	219,660	2025/3/8
		3.81 CHINA GOVT 500914	3.81	23,000	25,823	500,035	2050/9/14
		3.86 CHINA GOVT 490722	3.86	17,000	19,191	371,627	2049/7/22
		4.08 CHINA GOVT 481022	4.08	16,000	18,664	361,420	2048/10/22
小	計					22,153,430	
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	6,500	6,082	224,609	2025/4/30
		1 ISRAEL FIXED B0 300331	1.0	3,370	2,859	105,599	2030/3/31
		1.3 ISRAEL FIXED 320430	1.3	1,300	1,078	39,820	2032/4/30
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	1.5	4,900	3,771	139,264	2037/5/31
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	3,080	2,943	108,705	2028/9/28
		2.8 ISRAEL FIXED 521129	2.8	800	636	23,516	2052/11/29
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	3.75	3,790	3,672	135,618	2047/3/31
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	3,130	3,850	142,216	2042/1/31
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	5,000	5,574	205,865	2026/10/30
小	計					1,125,216	
合	計					432,163,832	

(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

(2023年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 432,163,832	% 97.5
コール・ローン等、その他	10,950,597	2.5
投資信託財産総額	443,114,429	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(437,240,656千円)の投資信託財産総額(443,114,429千円)に対する比率は98.7%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=134.63円	1 カナダドル=99.79円	1 メキシコペソ=7.663円	1 ユーロ=146.96円
1 イギリスポンド=168.50円	1 スウェーデンクローネ=13.03円	1 ノルウェークローネ=12.62円	1 デンマーククローネ=19.73円
1 ポーランドズロチ=32.3776円	1 オーストラリアドル=90.23円	1 ニュージーランドドル=84.76円	1 シンガポールドル=101.12円
1 マレーシアリンギット=30.0631円	1 中国元=19.3639円	1 イスラエルシェケル=36.9299円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年5月12日現在)

項目	当期末
(A) 資産	444,971,140,382
コール・ローン等	7,418,114,223
公社債(評価額)	432,163,832,554
未収入金	1,857,476,039
未収利息	3,073,913,333
前払費用	457,804,233
(B) 負債	6,022,036,026
未払金	4,937,106,508
未払解約金	1,084,926,207
未払利息	3,311
(C) 純資産総額(A-B)	438,949,104,356
元本	187,414,503,873
次期繰越損益金	251,534,600,483
(D) 受益権総口数	187,414,503,873口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,421円

○損益の状況 (2022年5月13日～2023年5月12日)

項目	当期
(A) 配当等収益	7,994,718,131
受取利息	7,995,994,315
その他収益金	19,593
支払利息	△ 1,295,777
(B) 有価証券売買損益	△ 2,986,653,570
売買益	17,476,084,722
売買損	△ 20,462,738,292
(C) 保管費用等	△ 39,530,135
(D) 当期損益金(A+B+C)	4,968,534,426
(E) 前期繰越損益金	171,579,946,706
(F) 追加信託差損益金	117,951,459,412
(G) 解約差損益金	△ 42,965,340,061
(H) 計(D+E+F+G)	251,534,600,483
次期繰越損益金(H)	251,534,600,483

<注記事項>

- ①期首元本額 130,645,783,749円
 期中追加設定元本額 89,496,876,451円
 期中一部解約元本額 32,728,156,327円
 また、1口当たり純資産額は、期末23,421円です。

- (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)	39,738,593,500円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	28,814,450,386円
三菱UFJ 外国債券オープン(毎月分配型)	18,226,597,326円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	14,892,577,798円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	10,187,407,813円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	6,108,692,888円
eMAXIS 先進国債券インデックス	5,748,942,871円
海外債券セレクション(ラップ向け)	5,530,356,826円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	5,020,170,893円
つみたて8資産均等バランス	4,881,952,480円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	4,442,752,400円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	3,023,028,851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)	2,780,155,532円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,330,308,055円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	2,245,206,953円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,895,240,582円
ラップ向けインデックスf 先進国債券	1,875,465,345円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,794,102,985円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,689,603,690円
三菱UFJ DC年金インデックス(先進国債券)	1,685,566,185円
つみたて4資産均等バランス	1,657,706,534円
海外債券インデックスファンドS	1,589,361,392円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	1,446,793,569円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	1,336,382,083円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	1,249,524,589円

三菱UFJ 外国債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,176,683,452円
ワールド・インカムオープン	1,053,216,176円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	1,002,617,862円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	950,166,493円
三菱UFJ 外国債券オープン	943,508,323円
外国債券インデックスファンドV (適格機関投資家限定)	729,262,532円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	688,643,497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)	672,493,265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)	670,216,424円
ファンド・マネジャー (海外債券)	625,951,232円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	625,677,891円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型)	622,195,097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)	566,800,741円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)	546,364,581円
MUAM 世界債券オープン (適格機関投資家限定)	532,787,246円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	519,245,544円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	509,769,954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)	454,194,293円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (毎月分配型)	431,469,643円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	391,387,792円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (成長型)	379,189,541円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定型)	288,855,047円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	287,539,625円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	252,402,895円
eMAXIS バランス (波乗り型)	227,901,520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)	206,007,507円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	201,413,304円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	199,391,427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)	178,017,661円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	157,298,781円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	150,296,670円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	129,612,489円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	127,703,170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
三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)	96,488,467円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	67,394,969円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	64,756,271円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	61,692,086円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	58,006,403円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	54,006,522円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	45,046,948円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	29,012,753円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	22,350,024円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	21,016,144円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	15,312,462円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2 (適格機関投資家限定)	14,307,790円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	13,027,436円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	10,358,602円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	9,981,478円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	5,999,800円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	5,148,930円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	3,858,584円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	3,704,278円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	2,998,291円

eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,996,018円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	1,696,708円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	857,987円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	675,668円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	536,373円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	430,163円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	403,401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)	8,925円
合計	187,414,503,873円

【お 知 ら せ】

三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

《第14期》決算日2023年1月26日

[計算期間：2022年1月27日～2023年1月26日]

「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第14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14期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
10期(2019年1月28日)	12,706	0.6	385.22	0.6	98.0	—	226,657
11期(2020年1月27日)	13,512	6.3	409.73	6.4	97.8	—	237,847
12期(2021年1月26日)	14,060	4.1	427.41	4.3	98.7	—	250,742
13期(2022年1月26日)	13,500	△4.0	410.80	△3.9	97.2	—	280,521
14期(2023年1月26日)	11,680	△13.5	355.93	△13.4	97.5	—	230,844

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		FTSE世界国債インデックス (<small>係(日本、円ヘッジ・円ベース)</small>)		債 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年 1 月26日	円 13,500	% —	410.80	% —	97.2	—
1 月末	13,473	△ 0.2	409.98	△ 0.2	98.0	—
2 月末	13,189	△ 2.3	401.33	△ 2.3	98.6	—
3 月末	12,828	△ 5.0	390.67	△ 4.9	104.1	—
4 月末	12,541	△ 7.1	382.14	△ 7.0	101.4	—
5 月末	12,417	△ 8.0	378.13	△ 8.0	98.1	—
6 月末	12,077	△10.5	367.91	△10.4	103.7	—
7 月末	12,433	△ 7.9	378.91	△ 7.8	96.9	—
8 月末	12,007	△11.1	365.57	△11.0	100.9	—
9 月末	11,501	△14.8	350.26	△14.7	101.9	—
10 月末	11,479	△15.0	349.59	△14.9	101.3	—
11 月末	11,643	△13.8	354.67	△13.7	95.3	—
12 月末	11,424	△15.4	347.74	△15.4	95.5	—
(期 末) 2023年 1 月26日	11,680	△13.5	355.93	△13.4	97.5	—

(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

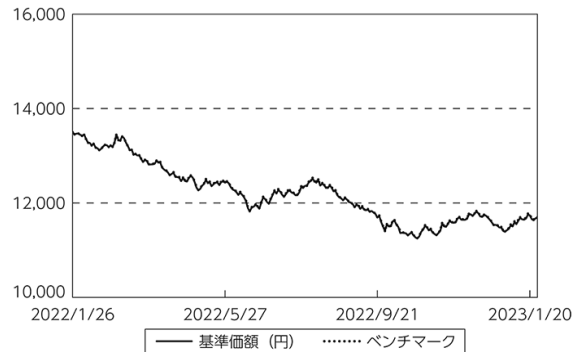
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ13.5%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(−13.4%)を0.1%下回りました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(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

◎ 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、期間の初めとの比較では下落しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・ 期間を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。
- ・ 組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行いました。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは13.4%の下落になったため、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)

- ・ 取引要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・ ポートフォリオ要因によるものです。

○ 今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年1月27日～2023年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.013)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	2	0.013	
期中の平均基準価額は、12,176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

(2022年1月27日～2023年1月26日)

公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカドル 1,545,378	千アメリカドル 1,722,070
	カナダ	千カナダドル 85,453	千カナダドル 96,285
	メキシコ	千メキシコペソ 374,997	千メキシコペソ 454,329
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	千ユーロ 190,677	千ユーロ 209,914
	イタリア	千ユーロ 210,931	千ユーロ 251,294
	フランス	千ユーロ 254,535	千ユーロ 291,093
	オランダ	千ユーロ 42,187	千ユーロ 51,855
	スペイン	千ユーロ 141,665	千ユーロ 167,024
	ベルギー	千ユーロ 48,965	千ユーロ 59,678
	オーストリア	千ユーロ 32,516	千ユーロ 38,486
	フィンランド	千ユーロ 12,026	千ユーロ 14,644
	アイルランド	千ユーロ 14,706	千ユーロ 19,873
	イギリス	千イギリスポンド 118,808	千イギリスポンド 133,082
	スウェーデン	千スウェーデンクローネ 64,113	千スウェーデンクローネ 81,239
	ノルウェー	千ノルウェークローネ 43,484	千ノルウェークローネ 61,275
	デンマーク	千デンマーククローネ 67,446	千デンマーククローネ 89,438
	ポーランド	千ポーランドズロチ 43,781	千ポーランドズロチ 56,888
	オーストラリア	千オーストラリアドル 69,174	千オーストラリアドル 77,621
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 7,288	千ニュージーランドドル 2,328	
シンガポール	千シンガポールドル 18,357	千シンガポールドル 21,011	
マレーシア	千マレーシアリンギット 59,063	千マレーシアリンギット 71,839	
中国	千中国元 825,716	千中国元 457,077	
イスラエル	千イスラエルシェケル 33,033	千イスラエルシェケル 44,571	

(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

(2022年1月27日～2023年1月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	3,257,563	1,926,468	59.1	3,176,280	1,929,758	60.8
為替直物取引	375,138	316,037	84.2	416,856	299,523	71.9

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

○組入資産の明細

(2023年1月26日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 950,740	千アメリカドル 865,341	千円 111,862,707	% 48.5	% —	% 21.6	% 17.4	% 9.5
カナダ	千カナダドル 50,760	千カナダドル 47,524	4,586,585	2.0	—	1.1	0.5	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 287,850	千メキシコペソ 272,699	1,875,272	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	114,220	108,292	15,278,931	6.6	—	3.6	2.1	1.0
イタリア	132,870	123,630	17,443,094	7.6	—	4.2	2.4	1.0
フランス	149,270	138,057	19,478,581	8.4	—	5.2	2.6	0.7
オランダ	26,900	24,806	3,499,905	1.5	—	1.0	0.5	0.1
スペイン	86,280	81,013	11,430,142	5.0	—	2.9	1.6	0.4
ベルギー	32,120	29,871	4,214,536	1.8	—	1.3	0.5	0.0
オーストリア	21,450	19,615	2,767,565	1.2	—	0.7	0.4	0.2
フィンランド	9,250	7,967	1,124,187	0.5	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	11,430	10,094	1,424,297	0.6	—	0.4	0.1	0.0
イギリス	千イギリスポンド 79,850	千イギリスポンド 69,652	11,172,242	4.8	—	3.5	0.9	0.4
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 40,000	千スウェーデンクローネ 38,834	492,035	0.2	—	0.1	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 36,000	千ノルウェークローネ 34,163	446,174	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 41,620	千デンマーククローネ 39,580	750,451	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 38,650	千ポーランドズロチ 33,577	1,004,681	0.4	—	0.1	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 44,690	千オーストラリアドル 41,229	3,787,753	1.6	—	1.1	0.4	0.1
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 5,600	千ニュージーランドドル 5,013	420,041	0.2	—	0.1	0.1	—
シンガポール	千シンガポールドル 10,790	千シンガポールドル 10,573	1,041,131	0.5	—	0.3	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 39,590	千マレーシアリンギット 40,266	1,222,547	0.5	—	0.3	0.2	—
中国	千中国元 462,000	千中国元 468,755	8,912,969	3.9	—	1.8	1.5	0.6
イスラエル	千イスラエルシェケル 22,060	千イスラエルシェケル 21,380	819,390	0.4	—	0.1	0.2	0.1
合 計	—	—	225,055,227	97.5	—	50.5	32.2	14.7

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ						
	国債証券					
	0.125 T-NOTE 240215	0.125	5,800	5,528	714,657	2024/2/15
	0.25 T-NOTE 240315	0.25	5,000	4,758	615,092	2024/3/15
	0.25 T-NOTE 240515	0.25	8,000	7,564	977,887	2024/5/15
	0.25 T-NOTE 240615	0.25	6,500	6,129	792,334	2024/6/15
	0.25 T-NOTE 250531	0.25	5,200	4,765	615,972	2025/5/31
	0.25 T-NOTE 250630	0.25	4,000	3,662	473,471	2025/6/30
	0.25 T-NOTE 250731	0.25	5,000	4,561	589,655	2025/7/31
	0.25 T-NOTE 250831	0.25	1,900	1,728	223,464	2025/8/31
	0.25 T-NOTE 250930	0.25	5,050	4,590	593,359	2025/9/30
	0.25 T-NOTE 251031	0.25	4,000	3,621	468,179	2025/10/31
	0.375 T-NOTE 240415	0.375	3,500	3,325	429,875	2024/4/15
	0.375 T-NOTE 240715	0.375	1,000	942	121,826	2024/7/15
	0.375 T-NOTE 240815	0.375	3,600	3,383	437,322	2024/8/15
	0.375 T-NOTE 240915	0.375	5,300	4,970	642,497	2024/9/15
	0.375 T-NOTE 250430	0.375	4,000	3,685	476,430	2025/4/30
	0.375 T-NOTE 251130	0.375	4,000	3,626	468,805	2025/11/30
	0.375 T-NOTE 251231	0.375	2,000	1,812	234,266	2025/12/31
	0.375 T-NOTE 260131	0.375	6,600	5,955	769,846	2026/1/31
	0.375 T-NOTE 270731	0.375	4,000	3,468	448,425	2027/7/31
	0.375 T-NOTE 270930	0.375	4,200	3,626	468,853	2027/9/30
	0.5 T-NOTE 260228	0.5	2,700	2,440	315,503	2026/2/28
	0.5 T-NOTE 270430	0.5	4,200	3,687	476,700	2027/4/30
	0.5 T-NOTE 270531	0.5	500	437	56,608	2027/5/31
	0.5 T-NOTE 270630	0.5	1,000	874	113,020	2027/6/30
	0.5 T-NOTE 270831	0.5	3,850	3,351	433,223	2027/8/31
	0.5 T-NOTE 271031	0.5	5,200	4,505	582,401	2027/10/31
	0.625 T-NOTE 241015	0.625	4,200	3,946	510,145	2024/10/15
	0.625 T-NOTE 260731	0.625	2,700	2,425	313,608	2026/7/31
	0.625 T-NOTE 270331	0.625	4,000	3,540	457,656	2027/3/31
	0.625 T-NOTE 271130	0.625	4,500	3,914	506,046	2027/11/30
	0.625 T-NOTE 271231	0.625	5,480	4,757	615,062	2027/12/31
	0.625 T-NOTE 300515	0.625	7,800	6,406	828,228	2030/5/15
	0.625 T-NOTE 300815	0.625	8,900	7,276	940,581	2030/8/15
	0.75 T-NOTE 241115	0.75	5,600	5,260	680,024	2024/11/15
	0.75 T-NOTE 260331	0.75	4,900	4,459	576,526	2026/3/31
	0.75 T-NOTE 260430	0.75	5,300	4,811	621,943	2026/4/30
	0.75 T-NOTE 260531	0.75	5,200	4,711	609,001	2026/5/31
	0.75 T-NOTE 260831	0.75	6,000	5,405	698,785	2026/8/31
	0.75 T-NOTE 280131	0.75	4,300	3,750	484,815	2028/1/31
	0.875 T-NOTE 260630	0.875	5,000	4,542	587,244	2026/6/30
	0.875 T-NOTE 260930	0.875	3,000	2,709	350,316	2026/9/30
	0.875 T-NOTE 301115	0.875	7,250	6,018	778,065	2030/11/15
	1 T-NOTE 241215	1.0	6,000	5,653	730,840	2024/12/15
	1 T-NOTE 280731	1.0	3,090	2,698	348,842	2028/7/31
	1.125 T-BOND 400515	1.125	4,220	2,833	366,243	2040/5/15
	1.125 T-BOND 400815	1.125	2,800	1,869	241,648	2040/8/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄		利 率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ						
国債証券	1.125 T-NOTE 250115	1.125	4,500	4,242	548,470	2025/1/15
	1.125 T-NOTE 261031	1.125	4,400	4,005	517,819	2026/10/31
	1.125 T-NOTE 270228	1.125	1,900	1,721	222,577	2027/2/28
	1.125 T-NOTE 280229	1.125	4,400	3,906	504,977	2028/2/29
	1.125 T-NOTE 280831	1.125	2,900	2,545	329,091	2028/8/31
	1.125 T-NOTE 310215	1.125	11,590	9,797	1,266,480	2031/2/15
	1.25 T-BOND 500515	1.25	3,850	2,268	293,257	2050/5/15
	1.25 T-NOTE 261130	1.25	5,700	5,206	672,998	2026/11/30
	1.25 T-NOTE 261231	1.25	2,900	2,645	341,919	2026/12/31
	1.25 T-NOTE 280331	1.25	5,590	4,984	644,401	2028/3/31
	1.25 T-NOTE 280430	1.25	4,000	3,561	460,342	2028/4/30
	1.25 T-NOTE 280531	1.25	7,100	6,307	815,351	2028/5/31
	1.25 T-NOTE 280630	1.25	6,200	5,501	711,151	2028/6/30
	1.25 T-NOTE 280930	1.25	7,300	6,443	833,010	2028/9/30
	1.25 T-NOTE 310815	1.25	11,160	9,405	1,215,829	2031/8/15
	1.375 T-BOND 401115	1.375	4,100	2,857	369,369	2040/11/15
	1.375 T-BOND 500815	1.375	5,990	3,643	470,948	2050/8/15
	1.375 T-NOTE 250131	1.375	4,000	3,787	489,589	2025/1/31
	1.375 T-NOTE 260831	1.375	3,400	3,133	405,043	2026/8/31
	1.375 T-NOTE 281031	1.375	2,620	2,325	300,637	2028/10/31
	1.375 T-NOTE 281231	1.375	3,000	2,657	343,575	2028/12/31
	1.375 T-NOTE 311115	1.375	10,230	8,660	1,119,521	2031/11/15
	1.5 T-NOTE 240229	1.5	5,000	4,831	624,535	2024/2/29
	1.5 T-NOTE 240930	1.5	4,000	3,818	493,569	2024/9/30
	1.5 T-NOTE 241031	1.5	2,000	1,905	246,340	2024/10/31
	1.5 T-NOTE 241130	1.5	4,000	3,807	492,155	2024/11/30
	1.5 T-NOTE 250215	1.5	5,000	4,741	612,972	2025/2/15
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	5,000	4,631	598,681	2026/8/15
	1.5 T-NOTE 270131	1.5	4,700	4,324	558,975	2027/1/31
	1.5 T-NOTE 281130	1.5	6,300	5,626	727,361	2028/11/30
	1.5 T-NOTE 300215	1.5	3,300	2,906	375,766	2030/2/15
	1.625 T-BOND 501115	1.625	4,500	2,922	377,819	2050/11/15
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	2,120	1,986	256,731	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	3,500	3,269	422,594	2026/5/15
	1.625 T-NOTE 260930	1.625	1,950	1,812	234,283	2026/9/30
	1.625 T-NOTE 261031	1.625	4,000	3,711	479,773	2026/10/31
	1.625 T-NOTE 261130	1.625	2,200	2,040	263,747	2026/11/30
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	3,400	3,038	392,784	2029/8/15
	1.625 T-NOTE 310515	1.625	7,280	6,358	821,905	2031/5/15
	1.75 T-BOND 410815	1.75	4,900	3,597	465,058	2041/8/15
	1.75 T-NOTE 240630	1.75	4,850	4,665	603,056	2024/6/30
	1.75 T-NOTE 240731	1.75	5,000	4,804	621,026	2024/7/31
	1.75 T-NOTE 250315	1.75	6,200	5,905	763,372	2025/3/15
	1.75 T-NOTE 261231	1.75	2,800	2,608	337,205	2026/12/31
	1.75 T-NOTE 290131	1.75	5,100	4,610	596,001	2029/1/31
	1.75 T-NOTE 291115	1.75	4,000	3,598	465,210	2029/11/15
	1.875 T-BOND 410215	1.875	6,820	5,158	666,898	2041/2/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.875 T-BOND 510215	1.875	7,300	5,049	652,810	2051/2/15
	1.875 T-BOND 511115	1.875	7,350	5,064	654,664	2051/11/15
	1.875 T-NOTE 260630	1.875	3,000	2,823	365,041	2026/6/30
	1.875 T-NOTE 260731	1.875	2,700	2,537	327,964	2026/7/31
	1.875 T-NOTE 270228	1.875	5,700	5,317	687,361	2027/2/28
	1.875 T-NOTE 290228	1.875	5,500	5,003	646,746	2029/2/28
	1.875 T-NOTE 320215	1.875	7,450	6,560	848,133	2032/2/15
	2 T-BOND 411115	2.0	5,890	4,507	582,738	2041/11/15
	2 T-BOND 500215	2.0	5,400	3,870	500,365	2050/2/15
	2 T-BOND 510815	2.0	5,440	3,872	500,597	2051/8/15
	2 T-NOTE 240430	2.0	4,000	3,872	500,638	2024/4/30
	2 T-NOTE 250215	2.0	4,800	4,598	594,391	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	5,150	4,905	634,091	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	1,500	1,410	182,304	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	2,900	2,821	364,749	2024/2/29
	2.125 T-NOTE 240331	2.125	4,500	4,371	565,104	2024/3/31
	2.125 T-NOTE 240930	2.125	4,000	3,858	498,780	2024/9/30
	2.125 T-NOTE 241130	2.125	4,000	3,851	497,830	2024/11/30
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	5,100	4,885	631,592	2025/5/15
	2.125 T-NOTE 260531	2.125	1,400	1,328	171,752	2026/5/31
	2.25 T-BOND 410515	2.25	4,140	3,325	429,856	2041/5/15
	2.25 T-BOND 460815	2.25	2,500	1,915	247,658	2046/8/15
	2.25 T-BOND 490815	2.25	4,800	3,646	471,383	2049/8/15
	2.25 T-BOND 520215	2.25	4,490	3,386	437,833	2052/2/15
	2.25 T-NOTE 240331	2.25	6,000	5,834	754,260	2024/3/31
	2.25 T-NOTE 240430	2.25	3,100	3,010	389,184	2024/4/30
	2.25 T-NOTE 241031	2.25	2,300	2,220	287,054	2024/10/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	3,000	2,896	374,479	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 241231	2.25	3,600	3,471	448,720	2024/12/31
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	6,400	6,123	791,617	2025/11/15
	2.25 T-NOTE 260331	2.25	3,250	3,102	401,041	2026/3/31
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	4,200	3,981	514,663	2027/2/15
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	4,000	3,776	488,246	2027/8/15
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	4,200	3,955	511,375	2027/11/15
	2.375 T-BOND 420215	2.375	5,350	4,356	563,136	2042/2/15
	2.375 T-BOND 491115	2.375	2,560	1,997	258,216	2049/11/15
	2.375 T-BOND 510515	2.375	6,500	5,052	653,199	2051/5/15
	2.375 T-NOTE 240229	2.375	2,400	2,341	302,716	2024/2/29
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	4,600	4,458	576,303	2024/8/15
	2.375 T-NOTE 260430	2.375	2,100	2,011	260,014	2026/4/30
	2.375 T-NOTE 270515	2.375	5,800	5,511	712,497	2027/5/15
	2.375 T-NOTE 290331	2.375	2,650	2,479	320,552	2029/3/31
	2.375 T-NOTE 290515	2.375	4,100	3,834	495,660	2029/5/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	3,780	3,069	396,781	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	1,900	1,532	198,169	2046/2/15
	2.5 T-BOND 460515	2.5	2,570	2,072	267,920	2046/5/15
	2.5 T-NOTE 240430	2.5	5,300	5,163	667,427	2024/4/30

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	2.5 T-NOTE 240515	2.5	3,700	3,602	465,715	2024/5/15
	2.5 T-NOTE 240531	2.5	5,000	4,866	629,080	2024/5/31
	2.5 T-NOTE 250131	2.5	2,700	2,614	337,999	2025/1/31
	2.5 T-NOTE 260228	2.5	3,000	2,884	372,918	2026/2/28
	2.5 T-NOTE 270331	2.5	4,500	4,301	556,083	2027/3/31
	2.625 T-NOTE 250331	2.625	3,900	3,784	489,245	2025/3/31
	2.625 T-NOTE 250415	2.625	3,100	3,005	388,527	2025/4/15
	2.625 T-NOTE 251231	2.625	4,000	3,868	500,093	2025/12/31
	2.625 T-NOTE 260131	2.625	1,600	1,546	199,891	2026/1/31
	2.625 T-NOTE 270531	2.625	4,900	4,705	608,271	2027/5/31
	2.625 T-NOTE 290215	2.625	3,500	3,325	429,911	2029/2/15
	2.625 T-NOTE 290731	2.625	4,500	4,266	551,583	2029/7/31
	2.75 T-BOND 420815	2.75	300	258	33,430	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	2,900	2,495	322,545	2042/11/15
	2.75 T-BOND 470815	2.75	1,820	1,534	198,354	2047/8/15
	2.75 T-BOND 471115	2.75	3,400	2,866	370,517	2047/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	8,000	7,839	1,013,367	2024/2/15
	2.75 T-NOTE 250228	2.75	5,000	4,864	628,827	2025/2/28
	2.75 T-NOTE 250515	2.75	4,000	3,887	502,496	2025/5/15
	2.75 T-NOTE 250831	2.75	3,000	2,911	376,312	2025/8/31
	2.75 T-NOTE 270430	2.75	2,200	2,123	274,506	2027/4/30
	2.75 T-NOTE 270731	2.75	6,000	5,788	748,276	2027/7/31
	2.75 T-NOTE 280215	2.75	6,650	6,399	827,308	2028/2/15
	2.75 T-NOTE 290531	2.75	5,500	5,257	679,629	2029/5/31
	2.75 T-NOTE 320815	2.75	8,300	7,838	1,013,258	2032/8/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	3,070	2,688	347,561	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	1,800	1,557	201,400	2045/8/15
	2.875 T-BOND 461115	2.875	200	172	22,335	2046/11/15
	2.875 T-BOND 490515	2.875	3,000	2,597	335,735	2049/5/15
	2.875 T-BOND 520515	2.875	5,700	4,931	637,480	2052/5/15
	2.875 T-NOTE 250615	2.875	6,800	6,628	856,819	2025/6/15
	2.875 T-NOTE 251130	2.875	4,500	4,378	566,035	2025/11/30
	2.875 T-NOTE 280515	2.875	7,100	6,862	887,091	2028/5/15
	2.875 T-NOTE 280815	2.875	6,160	5,947	768,852	2028/8/15
	2.875 T-NOTE 290430	2.875	4,500	4,333	560,173	2029/4/30
	2.875 T-NOTE 320515	2.875	11,000	10,515	1,359,314	2032/5/15
	3 T-BOND 420515	3.0	1,950	1,754	226,740	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	1,700	1,509	195,079	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	650	575	74,382	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	1,610	1,423	183,970	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	3,420	3,019	390,363	2047/2/15
	3 T-BOND 470515	3.0	2,050	1,809	233,958	2047/5/15
	3 T-BOND 480215	3.0	3,980	3,514	454,383	2048/2/15
	3 T-BOND 480815	3.0	3,980	3,518	454,785	2048/8/15
	3 T-BOND 490215	3.0	5,100	4,520	584,309	2049/2/15
	3 T-BOND 520815	3.0	4,100	3,642	470,836	2052/8/15
	3 T-NOTE 240630	3.0	6,000	5,874	759,380	2024/6/30

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
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 T-NOTE 240731	3.0	6,000	5,873	759,319	2024/7/31
	3 T-NOTE 250715	3.0	4,100	4,005	517,833	2025/7/15
	3 T-NOTE 250930	3.0	3,500	3,417	441,823	2025/9/30
	3 T-NOTE 251031	3.0	3,000	2,928	378,614	2025/10/31
	3.125 T-BOND 411115	3.125	550	507	65,595	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	1,340	1,232	159,309	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	2,250	2,054	265,623	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	3,090	2,802	362,316	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	2,360	2,133	275,796	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 250815	3.125	4,500	4,409	569,967	2025/8/15
	3.125 T-NOTE 270831	3.125	5,000	4,902	633,789	2027/8/31
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	6,500	6,356	821,743	2028/11/15
	3.125 T-NOTE 290831	3.125	3,250	3,174	410,346	2029/8/31
	3.25 T-BOND 420515	3.25	3,000	2,800	362,056	2042/5/15
	3.25 T-NOTE 240831	3.25	4,500	4,421	571,512	2024/8/31
	3.25 T-NOTE 270630	3.25	4,500	4,433	573,068	2027/6/30
	3.25 T-NOTE 290630	3.25	900	885	114,461	2029/6/30
	3.375 T-BOND 420815	3.375	2,400	2,283	295,123	2042/8/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	1,850	1,747	225,884	2044/5/15
	3.375 T-BOND 481115	3.375	3,900	3,693	477,507	2048/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	700	697	90,103	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 250915	3.5	3,450	3,413	441,242	2025/9/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	1,100	1,082	139,914	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	1,300	1,276	164,959	2044/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,900	1,923	248,587	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	2,210	2,212	285,954	2043/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	910	943	121,913	2040/8/15
	3.875 T-NOTE 271130	3.875	2,980	3,022	390,686	2027/11/30
	3.875 T-NOTE 290930	3.875	1,500	1,531	197,957	2029/9/30
	3.875 T-NOTE 291130	3.875	3,060	3,126	404,157	2029/11/30
	4 T-BOND 421115	4.0	2,080	2,162	279,489	2042/11/15
	4 T-BOND 521115	4.0	3,790	4,065	525,491	2052/11/15
	4 T-NOTE 251215	4.0	1,800	1,807	233,622	2025/12/15
	4 T-NOTE 291031	4.0	2,840	2,921	377,681	2029/10/31
	4.125 T-NOTE 270930	4.125	1,700	1,738	224,767	2027/9/30
	4.125 T-NOTE 271031	4.125	2,400	2,455	317,483	2027/10/31
	4.125 T-NOTE 321115	4.125	4,740	5,004	646,919	2032/11/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	1,500	1,634	211,299	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	1,410	1,530	197,799	2040/11/15
	4.25 T-NOTE 240930	4.25	4,000	3,993	516,292	2024/9/30
	4.25 T-NOTE 251015	4.25	1,000	1,008	130,350	2025/10/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	390	430	55,632	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	1,680	1,855	239,824	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	2,050	2,260	292,156	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,580	1,742	225,253	2041/5/15
	4.375 T-NOTE 241031	4.375	5,000	5,005	647,056	2024/10/31
	4.5 T-BOND 360215	4.5	900	1,005	129,924	2036/2/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額		千円	
			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		
国債証券	4.5 T-BOND 390815	4.5	900	1,009	130,490	2039/8/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	1,260	1,455	188,113	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	440	515	66,630	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	1,000	1,087	140,626	2028/11/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	520	588	76,116	2031/2/15
	6 T-BOND 260215	6.0	1,100	1,168	151,056	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	800	888	114,896	2027/11/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	660	775	100,282	2030/5/15
小計					111,862,707	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.25 CAN GOVT 260301	0.25	1,200	1,097	105,949	2026/3/1
	0.5 CAN GOVT 250901	0.5	2,500	2,325	224,450	2025/9/1
	0.5 CAN GOVT 301201	0.5	3,800	3,197	308,569	2030/12/1
	0.75 CAN GOVT 240201	0.75	500	482	46,555	2024/2/1
	0.75 CAN GOVT 241001	0.75	1,750	1,665	160,731	2024/10/1
	1 CAN GOVT 260901	1.0	1,300	1,210	116,834	2026/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	600	555	53,632	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 250301	1.25	850	811	78,358	2025/3/1
	1.25 CAN GOVT 270301	1.25	3,200	2,994	288,992	2027/3/1
	1.25 CAN GOVT 300601	1.25	1,870	1,684	162,580	2030/6/1
	1.5 CAN GOVT 240501	1.5	1,500	1,453	140,250	2024/5/1
	1.5 CAN GOVT 250401	1.5	1,000	958	92,541	2025/4/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	1,150	1,094	105,635	2026/6/1
	1.5 CAN GOVT 310601	1.5	2,350	2,127	205,314	2031/6/1
	1.5 CAN GOVT 311201	1.5	3,300	2,968	286,519	2031/12/1
	1.75 CAN GOVT 531201	1.75	2,180	1,660	160,219	2053/12/1
	2 CAN GOVT 280601	2.0	1,000	962	92,862	2028/6/1
	2 CAN GOVT 320601	2.0	2,250	2,103	203,022	2032/6/1
	2 CAN GOVT 511201	2.0	3,410	2,786	268,892	2051/12/1
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,600	1,561	150,702	2025/6/1
	2.25 CAN GOVT 290601	2.25	700	679	65,622	2029/6/1
	2.25 CAN GOVT 291201	2.25	1,000	969	93,586	2029/12/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,000	981	94,676	2024/6/1
	2.5 CAN GOVT 321201	2.5	1,300	1,266	122,216	2032/12/1
	2.75 CAN GOVT 240801	2.75	2,000	1,967	189,845	2024/8/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	970	935	90,319	2048/12/1
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	870	831	80,236	2064/12/1
	3 CAN GOVT 241101	3.0	2,000	1,976	190,744	2024/11/1
	3.5 CAN GOVT 280301	3.5	100	103	9,941	2028/3/1
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	960	1,045	100,903	2045/12/1
	4 CAN GOVT 410601	4.0	740	847	81,814	2041/6/1
	5 CAN GOVT 370601	5.0	300	371	35,847	2037/6/1
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	600	703	67,874	2029/6/1
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	910	1,143	110,337	2033/6/1
小計					4,586,585	
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	26,750	26,888	184,905	2024/12/5

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末					償還年月日	
	利 率	額面金額	評 価 額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
国債証券	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	3,000	3,340	22,974	2036/11/20	
	5 MEXICAN BONOS 250306	5.0	23,000	20,913	143,817	2025/3/6	
	5.5 MEXICAN BONOS 270304	5.5	20,000	17,662	121,461	2027/3/4	
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	41,350	37,605	258,602	2026/3/5	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	9,750	9,305	63,994	2027/6/3	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	31,000	29,489	202,791	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	10,800	10,132	69,674	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	23,600	21,453	147,528	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	18,000	17,410	119,727	2024/9/5	
	8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	16,500	15,291	105,153	2047/11/7	
	8 MEXICAN BONOS 530731	8.0	6,000	5,567	38,286	2053/7/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	32,900	32,756	225,254	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	25,200	24,881	171,100	2038/11/18	
小 計					1,875,272		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	1,700	1,573	221,976	2026/8/15
		0 BUND 271115	—	2,150	1,941	273,995	2027/11/15
		0 BUND 281115	—	1,180	1,045	147,576	2028/11/15
		0 BUND 290815	—	2,300	2,008	283,439	2029/8/15
		0 BUND 300215	—	3,000	2,596	366,352	2030/2/15
		0 BUND 300815	—	2,250	1,928	272,045	2030/8/15
		0 BUND 300815	—	1,200	1,030	145,404	2030/8/15
		0 BUND 310215	—	2,070	1,755	247,683	2031/2/15
		0 BUND 310815	—	2,100	1,761	248,593	2031/8/15
		0 BUND 310815	—	850	713	100,721	2031/8/15
		0 BUND 320215	—	2,050	1,698	239,701	2032/2/15
		0 BUND 350515	—	1,920	1,465	206,752	2035/5/15
		0 BUND 360515	—	2,800	2,087	294,474	2036/5/15
		0 BUND 500815	—	2,650	1,513	213,484	2050/8/15
		0 BUND 500815	—	950	544	76,825	2050/8/15
		0 BUND 520815	—	2,050	1,126	159,004	2052/8/15
		0 OBL 240405	—	2,200	2,135	301,289	2024/4/5
		0 OBL 241018	—	3,500	3,353	473,151	2024/10/18
		0 OBL 250411	—	3,000	2,846	401,573	2025/4/11
		0 OBL 251010	—	1,200	1,127	159,058	2025/10/10
		0 OBL 260410	—	3,200	2,979	420,443	2026/4/10
		0 OBL 261009	—	1,750	1,612	227,564	2026/10/9
		0 OBL 270416	—	2,000	1,824	257,418	2027/4/16
		0.2 SCHATS 240614	0.2	1,000	968	136,662	2024/6/14
		0.25 BUND 270215	0.25	2,300	2,130	300,612	2027/2/15
		0.25 BUND 280815	0.25	2,620	2,367	334,074	2028/8/15
		0.25 BUND 290215	0.25	3,470	3,110	438,867	2029/2/15
		0.4 SCHATS 240913	0.4	2,000	1,932	272,676	2024/9/13
		0.5 BUND 250215	0.5	3,150	3,030	427,512	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	3,450	3,272	461,708	2026/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	3,260	3,030	427,503	2027/8/15
		0.5 BUND 280215	0.5	2,000	1,845	260,445	2028/2/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	1 BUND 240815	1.0	2,500	2,443	344,805	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	3,200	3,092	436,285	2025/8/15
		1 BUND 380515	1.0	980	822	116,094	2038/5/15
		1.25 BUND 480815	1.25	2,480	2,067	291,730	2048/8/15
		1.3 OBL 271015	1.3	1,000	961	135,643	2027/10/15
		1.3 OBL 271015	1.3	1,000	963	136,002	2027/10/15
		1.5 BUND 240515	1.5	2,500	2,467	348,128	2024/5/15
		1.7 BUND 320815	1.7	2,700	2,603	367,369	2032/8/15
		1.75 BUND 240215	1.75	3,000	2,974	419,698	2024/2/15
		1.8 BUND 530815	1.8	450	417	58,876	2053/8/15
		2.1 BUND 291115	2.1	1,000	998	140,852	2029/11/15
		2.5 BUND 440704	2.5	2,430	2,565	361,997	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	3,100	3,307	466,703	2046/8/15
		3.25 BUND 420704	3.25	2,030	2,359	332,890	2042/7/4
		4 BUND 370104	4.0	2,070	2,508	353,910	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	1,970	2,515	354,877	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	1,300	1,473	207,842	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,820	2,294	323,754	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	980	1,331	187,795	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	2,170	2,702	381,232	2031/1/4
5.625 BUND 280104	5.625	1,850	2,149	303,311	2028/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	1,300	1,645	232,192	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	1,070	1,263	178,336	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0 ITALY GOVT 240130	—	3,000	2,911	410,852	2024/1/30
		0 ITALY GOVT 240415	—	3,000	2,894	408,344	2024/4/15
		0 ITALY GOVT 241215	—	1,300	1,230	173,553	2024/12/15
		0 ITALY GOVT 260801	—	2,200	1,970	278,037	2026/8/1
		0.25 ITALY GOVT 280315	0.25	1,400	1,193	168,420	2028/3/15
		0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	1,200	1,138	160,631	2025/2/1
		0.45 ITALY GOVT 290215	0.45	1,500	1,249	176,295	2029/2/15
		0.5 ITALY GOVT 260201	0.5	2,000	1,850	261,018	2026/2/1
		0.5 ITALY GOVT 280715	0.5	1,400	1,196	168,876	2028/7/15
		0.6 ITALY GOVT 310801	0.6	2,230	1,721	242,838	2031/8/1
		0.85 ITALY GOVT 270115	0.85	1,300	1,188	167,622	2027/1/15
		0.9 ITALY GOVT 310401	0.9	1,600	1,282	181,004	2031/4/1
		0.95 ITALY GOVT 270915	0.95	2,250	2,027	286,021	2027/9/15
		0.95 ITALY GOVT 300801	0.95	1,150	944	133,234	2030/8/1
		0.95 ITALY GOVT 311201	0.95	2,100	1,653	233,301	2031/12/1
		0.95 ITALY GOVT 320601	0.95	2,170	1,684	237,705	2032/6/1
		0.95 ITALY GOVT 370301	0.95	1,850	1,244	175,561	2037/3/1
		1.1 ITALY GOVT 270401	1.1	2,300	2,109	297,655	2027/4/1
		1.2 ITALY GOVT 250815	1.2	200	190	26,935	2025/8/15
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	2,200	2,049	289,096	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 300401	1.35	1,200	1,028	145,092	2030/4/1
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	2,100	2,045	288,532	2024/11/15
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	1,300	1,257	177,450	2025/5/15
		1.45 ITALY GOVT 360301	1.45	1,420	1,048	147,901	2036/3/1

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄		当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
ユーロ		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
イタリア	国債証券	1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	3,280	3,171	447,432	2025/6/1
		1.5 ITALY GOVT 450430	1.5	1,640	1,025	144,649	2045/4/30
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	2,550	2,425	342,261	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 301201	1.65	2,130	1,831	258,418	2030/12/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,240	1,037	146,334	2032/3/1
		1.7 ITALY GOVT 510901	1.7	1,050	644	90,891	2051/9/1
		1.75 ITALY GOVT 240701	1.75	2,000	1,965	277,287	2024/7/1
		1.8 ITALY GOVT 410301	1.8	1,430	1,010	142,618	2041/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	2,000	1,970	278,068	2024/5/15
		1.85 ITALY GOVT 250701	1.85	1,600	1,555	219,502	2025/7/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	2,800	2,718	383,557	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	2,550	2,393	337,725	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	2,250	2,136	301,479	2027/8/1
		2.1 ITALY GOVT 260715	2.1	1,400	1,351	190,696	2026/7/15
		2.15 ITALY GOVT 520901	2.15	1,050	702	99,123	2052/9/1
		2.15 ITALY GOVT 720301	2.15	170	105	14,908	2072/3/1
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	400	383	54,152	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	1,660	1,349	190,389	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	2,500	2,160	304,836	2033/9/1
		2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	1,460	1,072	151,292	2050/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,500	1,488	210,054	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	1,150	1,132	159,846	2025/11/15
		2.5 ITALY GOVT 321201	2.5	1,440	1,274	179,842	2032/12/1
		2.65 ITALY GOVT 271201	2.65	1,500	1,451	204,820	2027/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	1,650	1,308	184,586	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	1,260	1,219	172,054	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 290615	2.8	2,120	2,024	285,606	2029/6/15
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	980	723	102,065	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	1,910	1,654	233,368	2038/9/1
		3 ITALY GOVT 290801	3.0	2,250	2,182	307,911	2029/8/1
		3.1 ITALY GOVT 400301	3.1	1,570	1,365	192,611	2040/3/1
		3.25 ITALY GOVT 380301	3.25	780	699	98,692	2038/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,260	1,098	154,930	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	1,970	1,823	257,315	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,780	1,600	225,860	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 260115	3.5	1,400	1,412	199,352	2026/1/15
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	3,450	3,434	484,526	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,400	1,416	199,846	2024/9/1
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	900	857	121,010	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 350430	4.0	550	543	76,679	2035/4/30
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,190	2,174	306,785	2037/2/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,700	1,767	249,444	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	1,800	1,921	271,124	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,650	1,777	250,807	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	2,150	2,237	315,653	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,420	1,536	216,853	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,820	1,998	281,917	2039/8/1

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,420	1,563	220,633	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,980	3,298	465,412	2029/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,500	1,713	241,743	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	3,270	3,808	537,284	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	1,720	1,965	277,266	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	900	1,031	145,576	2026/11/1
フランス	国債証券	0 O. A. T 240225	—	2,500	2,430	342,922	2024/2/25
		0 O. A. T 240325	—	2,000	1,940	273,758	2024/3/25
		0 O. A. T 250225	—	1,250	1,184	167,076	2025/2/25
		0 O. A. T 250325	—	5,300	5,011	707,053	2025/3/25
		0 O. A. T 260225	—	4,200	3,892	549,188	2026/2/25
		0 O. A. T 270225	—	2,200	1,995	281,495	2027/2/25
		0 O. A. T 291125	—	4,800	4,074	574,818	2029/11/25
		0 O. A. T 301125	—	4,500	3,723	525,282	2030/11/25
		0 O. A. T 311125	—	3,450	2,772	391,121	2031/11/25
		0 O. A. T 320525	—	4,250	3,357	473,696	2032/5/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	4,450	4,099	578,389	2026/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	2,400	2,289	322,994	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	5,100	4,785	675,125	2026/5/25
		0.5 O. A. T 290525	0.5	3,980	3,534	498,741	2029/5/25
		0.5 O. A. T 400525	0.5	2,560	1,727	243,727	2040/5/25
		0.5 O. A. T 440625	0.5	1,060	662	93,419	2044/6/25
		0.5 O. A. T 720525	0.5	1,160	490	69,240	2072/5/25
		0.75 O. A. T 280225	0.75	3,770	3,466	489,020	2028/2/25
		0.75 O. A. T 280525	0.75	4,170	3,821	539,176	2028/5/25
		0.75 O. A. T 281125	0.75	4,520	4,112	580,226	2028/11/25
		0.75 O. A. T 520525	0.75	2,340	1,371	193,459	2052/5/25
		0.75 O. A. T 530525	0.75	2,830	1,617	228,245	2053/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	4,300	4,127	582,374	2025/11/25
		1 O. A. T 270525	1.0	4,500	4,238	597,953	2027/5/25
		1.25 O. A. T 340525	1.25	4,700	4,026	568,057	2034/5/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	4,360	3,602	508,312	2036/5/25
		1.25 O. A. T 380525	1.25	600	478	67,542	2038/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	4,690	4,362	615,475	2031/5/25
		1.5 O. A. T 500525	1.5	3,410	2,517	355,182	2050/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	3,700	3,644	514,166	2024/11/25
		1.75 O. A. T 390625	1.75	2,740	2,353	332,119	2039/6/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	860	639	90,245	2066/5/25
		2 O. A. T 321125	2.0	3,300	3,130	441,720	2032/11/25
		2 O. A. T 480525	2.0	2,360	1,978	279,094	2048/5/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	3,800	3,781	533,485	2024/5/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	4,800	4,827	681,095	2030/5/25
		2.5 O. A. T 430525	2.5	650	606	85,544	2043/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	3,980	4,037	569,650	2027/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	2,750	2,894	408,433	2045/5/25
		3.5 O. A. T 260425	3.5	2,400	2,476	349,400	2026/4/25
		4 O. A. T 381025	4.0	2,070	2,351	331,771	2038/10/25

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ	千円		
フランス	国債証券	4 O. A. T 550425	4.0	1,450	1,758	248,112	2055/4/25
		4 O. A. T 600425	4.0	1,640	2,033	286,886	2060/4/25
		4.5 O. A. T 410425	4.5	3,010	3,669	517,730	2041/4/25
		4.75 O. A. T 350425	4.75	1,250	1,500	211,662	2035/4/25
		5.5 O. A. T 290425	5.5	3,690	4,337	611,945	2029/4/25
		5.75 O. A. T 321025	5.75	1,970	2,505	353,450	2032/10/25
		6 O. A. T 251025	6.0	3,500	3,820	538,990	2025/10/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 260115	—	1,000	931	131,362	2026/1/15
		0 NETH GOVT 270115	—	600	547	77,277	2027/1/15
		0 NETH GOVT 290115	—	1,330	1,158	163,465	2029/1/15
		0 NETH GOVT 300715	—	1,500	1,264	178,348	2030/7/15
		0 NETH GOVT 310715	—	750	615	86,872	2031/7/15
		0 NETH GOVT 380115	—	930	644	90,948	2038/1/15
		0 NETH GOVT 520115	—	1,520	807	113,994	2052/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	2,250	2,133	301,028	2025/7/15
		0.25 NETH GOVT 290715	0.25	1,360	1,192	168,319	2029/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,550	1,455	205,296	2026/7/15
		0.5 NETH GOVT 320715	0.5	1,320	1,108	156,347	2032/7/15
		0.5 NETH GOVT 400115	0.5	1,640	1,199	169,181	2040/1/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	1,750	1,637	230,998	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	1,100	1,013	142,957	2028/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	900	893	126,029	2024/7/15
		2 NETH GOVT 540115	2.0	420	390	55,110	2054/1/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,250	1,254	177,013	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	1,530	1,641	231,633	2047/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,150	1,370	193,408	2042/1/15
4 NETH GOVT 370115	4.0	1,650	1,940	273,717	2037/1/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,400	1,606	226,592	2028/1/15		
スペイン	国債証券	0 SPAIN GOVT 240531	—	1,300	1,255	177,069	2024/5/31
		0 SPAIN GOVT 250131	—	2,000	1,896	267,581	2025/1/31
		0 SPAIN GOVT 250531	—	2,500	2,346	331,107	2025/5/31
		0 SPAIN GOVT 260131	—	3,700	3,413	481,677	2026/1/31
		0 SPAIN GOVT 270131	—	900	808	114,022	2027/1/31
		0 SPAIN GOVT 280131	—	2,100	1,832	258,506	2028/1/31
		0.1 SPAIN GOVT 310430	0.1	2,500	1,986	280,312	2031/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 240730	0.25	1,200	1,158	163,402	2024/7/30
		0.5 SPAIN GOVT 300430	0.5	1,800	1,526	215,368	2030/4/30
		0.5 SPAIN GOVT 311031	0.5	1,390	1,126	158,965	2031/10/31
		0.6 SPAIN GOVT 291031	0.6	2,750	2,380	335,900	2029/10/31
		0.7 SPAIN GOVT 320430	0.7	1,950	1,585	223,716	2032/4/30
		0.8 SPAIN GOVT 270730	0.8	2,600	2,392	337,494	2027/7/30
		0.85 SPAIN GOVT 370730	0.85	1,450	1,027	144,911	2037/7/30
		1 SPAIN GOVT 420730	1.0	900	591	83,393	2042/7/30
		1 SPAIN GOVT 501031	1.0	1,470	832	117,467	2050/10/31
		1.2 SPAIN GOVT 401031	1.2	2,100	1,474	208,092	2040/10/31
		1.25 SPAIN GOVT 301031	1.25	2,630	2,334	329,332	2030/10/31
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	1,900	1,810	255,468	2026/10/31

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	2,850	2,662	375,680	2028/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	1,450	1,350	190,564	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	2,850	2,690	379,643	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	1,290	1,192	168,289	2029/4/30
		1.45 SPAIN GOVT 711031	1.45	700	361	50,991	2071/10/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	1,550	1,478	208,557	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,700	1,661	234,361	2025/4/30
		1.85 SPAIN GOVT 350730	1.85	1,730	1,481	208,985	2035/7/30
		1.9 SPAIN GOVT 521031	1.9	1,150	800	113,008	2052/10/31
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,500	1,467	206,998	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	1,870	1,754	247,600	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	2,700	2,666	376,239	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	2,080	1,935	273,030	2033/7/30
		2.55 SPAIN GOVT 321031	2.55	1,500	1,430	201,784	2032/10/31
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	1,390	1,209	170,627	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,200	2,204	310,995	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	1,620	1,481	209,087	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 430730	3.45	700	691	97,550	2043/7/30
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	1,160	1,124	158,641	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	2,500	2,531	357,163	2024/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,590	1,745	246,239	2037/1/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,000	1,047	147,815	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,680	1,974	278,561	2041/7/30
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,430	1,713	241,690	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	1,100	1,236	174,446	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	1,150	1,450	204,622	2044/10/31
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	2,300	2,827	398,934	2032/7/30		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,800	1,995	281,580	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	2,600	3,066	432,659	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0 BEL GOVT 271022	—	800	712	100,529	2027/10/22
		0.1 BEL GOVT 300622	0.1	1,370	1,150	162,327	2030/6/22
		0.35 BEL GOVT 320622	0.35	2,050	1,656	233,753	2032/6/22
		0.4 BEL GOVT 400622	0.4	600	390	55,073	2040/6/22
		0.65 BEL GOVT 710622	0.65	570	262	37,051	2071/6/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	2,900	2,787	393,347	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,190	1,108	156,458	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	500	459	64,771	2028/6/22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	2,300	2,089	294,852	2029/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,300	1,240	174,984	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	1,900	1,675	236,384	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	970	846	119,375	2033/4/22
		1.4 BEL GOVT 530622	1.4	950	648	91,547	2053/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	610	504	71,174	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	560	423	59,815	2047/6/22
		1.7 BEL GOVT 500622	1.7	1,320	997	140,717	2050/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	1,170	1,018	143,643	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	410	337	47,686	2066/6/22

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日	
			利 率	額面金額	評 価 額			
					外貨建金額	邦貨換算金額		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ユーロ								
ベルギー	国債証券	2.25 BEL GOVT 570622	2.25	800	678	95,706	2057/6/22	
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	700	699	98,730	2024/6/22	
		2.75 BEL GOVT 390422	2.75	500	484	68,374	2039/4/22	
		3 BEL GOVT 340622	3.0	1,140	1,158	163,447	2034/6/22	
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	890	993	140,199	2045/6/22	
		4 BEL GOVT 320328	4.0	710	785	110,772	2032/3/28	
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,210	1,416	199,805	2041/3/28	
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	1,700	1,805	254,687	2026/3/28	
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,390	1,693	238,966	2035/3/28	
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,610	1,845	260,349	2028/3/28	
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 240715	—	2,000	1,927	271,993	2024/7/15	
		0 AUSTRIA GOVT 250420	—	1,000	944	133,296	2025/4/20	
		0 AUSTRIA GOVT 281020	—	200	172	24,393	2028/10/20	
		0 AUSTRIA GOVT 300220	—	1,250	1,041	146,965	2030/2/20	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	—	1,600	1,295	182,762	2031/2/20	
		0 AUSTRIA GOVT 401020	—	420	256	36,166	2040/10/20	
		0.25 AUSTRIA GOVT 361020	0.25	400	284	40,206	2036/10/20	
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	540	498	70,299	2027/4/20	
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	1,150	1,018	143,629	2029/2/20	
		0.7 AUSTRIA GOVT 710420	0.7	200	99	14,047	2071/4/20	
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	800	752	106,122	2026/10/20	
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,150	1,054	148,831	2028/2/20	
		0.75 AUSTRIA GOVT 510320	0.75	740	461	65,089	2051/3/20	
		0.85 AUSTRIA GOVT 200630	0.85	450	211	29,789	2120/6/30	
		0.9 AUSTRIA GOVT 320220	0.9	500	428	60,452	2032/2/20	
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	400	387	54,702	2025/10/20	
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	900	698	98,577	2047/2/20	
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	310	207	29,221	2086/11/2	
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	680	669	94,481	2024/10/21	
		1.85 AUSTRIA GOVT 490523	1.85	260	217	30,620	2049/5/23	
		2 AUSTRIA GOVT 260715	2.0	500	492	69,444	2026/7/15	
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	460	377	53,263	2117/9/20	
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	660	637	89,912	2034/5/23	
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	630	661	93,375	2044/6/20			
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	400	494	69,727	2062/1/26			
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,350	1,558	219,872	2037/3/15			
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	1,600	1,724	243,294	2026/3/15			
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	900	1,042	147,026	2027/7/15			
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 240915	—	400	384	54,195	2024/9/15	
		0 FINNISH GOVT 260915	—	420	384	54,209	2026/9/15	
		0 FINNISH GOVT 300915	—	400	328	46,391	2030/9/15	
		0.125 FINNISH GOV 310915	0.125	500	404	57,040	2031/9/15	
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	300	212	30,025	2036/4/15	
		0.125 FINNISH GOV 520415	0.125	580	298	42,058	2052/4/15	
		0.25 FINNISH GOVT 400915	0.25	270	175	24,691	2040/9/15	
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	250	235	33,272	2026/4/15	
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	1,100	1,004	141,730	2027/9/15	

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フィンランド	国債証券	0.5 FINNISH GOVT 290915	0.5	480	420	59,287	2029/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 430415	0.5	610	400	56,489	2043/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	280	241	34,097	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	500	480	67,741	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	280	236	33,360	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 270415	1.375	300	286	40,444	2027/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	160	125	17,735	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 320915	1.5	900	810	114,403	2032/9/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	480	472	66,695	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	590	598	84,391	2028/7/4
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	450	467	65,923	2025/7/4
アイルランド	国債証券	0 IRISH GOVT 311018	—	750	602	84,987	2031/10/18
		0.2 IRISH GOVT 270515	0.2	700	637	89,975	2027/5/15
		0.2 IRISH GOVT 301018	0.2	1,200	1,010	142,637	2030/10/18
		0.35 IRISH GOVT 321018	0.35	700	567	80,090	2032/10/18
		0.4 IRISH GOVT 350515	0.4	550	415	58,613	2035/5/15
		0.55 IRISH GOVT 410422	0.55	430	287	40,493	2041/4/22
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	900	833	117,536	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	550	526	74,334	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	820	756	106,697	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	630	554	78,215	2033/5/15
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	960	718	101,378	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	280	242	34,184	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	620	525	74,211	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	540	538	76,007	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	600	606	85,515	2024/3/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,200	1,271	179,418	2025/3/13
小 計						76,661,241	
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	3,200	3,093	496,246	2024/1/31
		0.125 GILT 260130	0.125	1,100	1,007	161,654	2026/1/30
		0.125 GILT 280131	0.125	1,550	1,331	213,584	2028/1/31
		0.25 GILT 250131	0.25	150	140	22,553	2025/1/31
		0.25 GILT 310731	0.25	2,550	1,983	318,094	2031/7/31
		0.375 GILT 261022	0.375	2,000	1,802	289,135	2026/10/22
		0.375 GILT 301022	0.375	1,670	1,348	216,223	2030/10/22
		0.5 GILT 290131	0.5	1,830	1,556	249,604	2029/1/31
		0.5 GILT 611022	0.5	1,720	662	106,285	2061/10/22
		0.625 GILT 250607	0.625	2,050	1,933	310,126	2025/6/7
		0.625 GILT 350731	0.625	1,900	1,350	216,650	2035/7/31
		0.625 GILT 501022	0.625	1,330	642	103,051	2050/10/22
		0.875 GILT 291022	0.875	1,630	1,404	225,280	2029/10/22
		0.875 GILT 330731	0.875	900	700	112,411	2033/7/31
		0.875 GILT 460131	0.875	1,810	1,026	164,700	2046/1/31
		1 GILT 240422	1.0	2,000	1,942	311,618	2024/4/22
		1 GILT 320131	1.0	2,950	2,422	388,631	2032/1/31
		1.125 GILT 390131	1.125	800	556	89,192	2039/1/31

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利率	当期末			償還年月日
			額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券					
	1.125 GILT 731022	1.125	910	431	69,170	2073/10/22
	1.25 GILT 270722	1.25	1,300	1,198	192,183	2027/7/22
	1.25 GILT 411022	1.25	2,520	1,697	272,328	2041/10/22
	1.25 GILT 510731	1.25	1,720	1,001	160,577	2051/7/31
	1.5 GILT 260722	1.5	1,370	1,296	207,899	2026/7/22
	1.5 GILT 470722	1.5	1,860	1,210	194,221	2047/7/22
	1.5 GILT 530731	1.5	1,200	735	118,028	2053/7/31
	1.625 GILT 281022	1.625	1,000	921	147,728	2028/10/22
	1.625 GILT 541022	1.625	1,340	844	135,497	2054/10/22
	1.625 GILT 711022	1.625	1,570	930	149,245	2071/10/22
	1.75 GILT 370907	1.75	1,500	1,185	190,122	2037/9/7
	1.75 GILT 490122	1.75	440	300	48,252	2049/1/22
	1.75 GILT 570722	1.75	1,180	763	122,458	2057/7/22
	2 GILT 250907	2.0	1,200	1,165	186,907	2025/9/7
	2.5 GILT 650722	2.5	1,030	812	130,358	2065/7/22
	2.75 GILT 240907	2.75	1,050	1,039	166,717	2024/9/7
	3.25 GILT 440122	3.25	1,900	1,774	284,595	2044/1/22
	3.5 GILT 450122	3.5	1,310	1,269	203,568	2045/1/22
	3.5 GILT 680722	3.5	1,130	1,138	182,582	2068/7/22
	3.75 GILT 380129	3.75	500	505	81,127	2038/1/29
	3.75 GILT 520722	3.75	1,270	1,296	207,914	2052/7/22
	4 GILT 600122	4.0	1,320	1,446	231,958	2060/1/22
	4.125 GILT 270129	4.125	1,730	1,778	285,289	2027/1/29
	4.25 GILT 271207	4.25	1,160	1,215	195,002	2027/12/7
	4.25 GILT 320607	4.25	1,680	1,813	290,854	2032/6/7
	4.25 GILT 360307	4.25	1,610	1,730	277,577	2036/3/7
	4.25 GILT 390907	4.25	1,070	1,146	183,894	2039/9/7
	4.25 GILT 401207	4.25	910	976	156,553	2040/12/7
	4.25 GILT 461207	4.25	1,230	1,334	214,020	2046/12/7
	4.25 GILT 491207	4.25	1,280	1,402	224,927	2049/12/7
	4.25 GILT 551207	4.25	1,130	1,268	203,523	2055/12/7
	4.5 GILT 340907	4.5	1,480	1,633	261,957	2034/9/7
	4.5 GILT 421207	4.5	1,950	2,170	348,128	2042/12/7
	4.75 GILT 301207	4.75	1,070	1,184	190,017	2030/12/7
	4.75 GILT 381207	4.75	1,340	1,519	243,694	2038/12/7
	5 GILT 250307	5.0	1,830	1,897	304,435	2025/3/7
	6 GILT 281207	6.0	620	709	113,871	2028/12/7
小	計				11,172,242	
スウェーデン			千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券					
	0.125 SWD GOVT 310512	0.125	5,300	4,557	57,743	2031/5/12
	0.75 SWD GOVT 280512	0.75	8,500	7,927	100,447	2028/5/12
	0.75 SWD GOVT 291112	0.75	6,200	5,711	72,370	2029/11/12
	1 SWD GOVT 261112	1.0	6,150	5,877	74,472	2026/11/12
	2.25 SWD GOVT 320601	2.25	3,100	3,182	40,317	2032/6/1
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	7,200	7,199	91,213	2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,550	4,378	55,470	2039/3/30
小	計				492,035	

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
ノルウェー		%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円	
国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	1.25	3,800	3,353	43,800	2031/9/17
	1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	5,400	4,893	63,909	2030/8/19
	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	2,850	2,743	35,833	2026/2/19
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	6,300	6,147	80,289	2025/3/13
	1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	4,250	4,091	53,429	2027/2/17
	1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	3,500	3,292	42,993	2029/9/6
	2 NORWE GOVT 280426	2.0	2,650	2,556	33,385	2028/4/26
	2.125 NORWE GOVT 320518	2.125	2,800	2,642	34,514	2032/5/18
	3 NORWE GOVT 240314	3.0	4,450	4,442	58,018	2024/3/14
小 計					446,174	
デンマーク			千デンマーククロネ	千デンマーククロネ		
国債証券	0 DMK GOVT 241115	—	3,500	3,338	63,289	2024/11/15
	0 DMK GOVT 311115	—	7,700	6,259	118,680	2031/11/15
	0.25 DMK GOVT 521115	0.25	5,000	2,895	54,897	2052/11/15
	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	6,900	6,315	119,733	2027/11/15
	0.5 DMK GOVT 291115	0.5	3,300	2,916	55,289	2029/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	5,500	5,385	102,104	2025/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	9,720	12,471	236,455	2039/11/15
小 計					750,451	
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	4,000	3,257	97,479	2026/10/25
	0.75 POLAND 250425	0.75	1,000	896	26,822	2025/4/25
	1.25 POLAND 301025	1.25	4,400	3,164	94,699	2030/10/25
	1.75 POLAND 320425	1.75	1,800	1,279	38,284	2032/4/25
	2.25 POLAND 241025	2.25	4,000	3,761	112,537	2024/10/25
	2.5 POLAND 240425	2.5	3,000	2,879	86,146	2024/4/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	2,500	2,234	66,850	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	2,300	2,004	59,985	2027/7/25
	2.75 POLAND 280425	2.75	3,700	3,189	95,433	2028/4/25
	2.75 POLAND 291025	2.75	3,000	2,501	74,851	2029/10/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	3,550	3,331	99,693	2025/7/25
	3.75 POLAND 270525	3.75	4,000	3,674	109,957	2027/5/25
	5.75 POLAND 290425	5.75	1,400	1,401	41,937	2029/4/25
小 計					1,004,681	
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	1,700	1,614	148,322	2024/11/21
	0.25 AUST GOVT 251121	0.25	1,450	1,338	122,986	2025/11/21
	0.5 AUST GOVT 260921	0.5	2,000	1,817	166,984	2026/9/21
	1 AUST GOVT 301221	1.0	1,100	916	84,193	2030/12/21
	1 AUST GOVT 311121	1.0	3,500	2,846	261,496	2031/11/21
	1.25 AUST GOVT 320521	1.25	2,610	2,148	197,390	2032/5/21
	1.5 AUST GOVT 310621	1.5	2,550	2,188	201,082	2031/6/21
	1.75 AUST GOVT 321121	1.75	1,900	1,625	149,309	2032/11/21
	1.75 AUST GOVT 510621	1.75	1,450	919	84,467	2051/6/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	1,400	1,332	122,454	2028/5/21
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	1,770	1,669	153,392	2030/5/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,000	994	91,357	2024/4/21

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
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	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	1,500	1,469	134,968	2027/11/21	
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	1,650	1,605	147,452	2028/11/21	
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	1,280	1,233	113,347	2029/11/21	
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	1,400	1,275	117,208	2035/6/21	
	2.75 AUST GOVT 410521	2.75	890	757	69,548	2041/5/21	
	3 AUST GOVT 331121	3.0	1,700	1,618	148,668	2033/11/21	
	3 AUST GOVT 470321	3.0	1,380	1,181	108,536	2047/3/21	
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	2,200	2,207	202,837	2025/4/21	
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	1,800	1,795	164,908	2029/4/21	
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	1,150	1,068	98,142	2039/6/21	
	3.75 AUST GOVT 340521	3.75	1,100	1,119	102,859	2034/5/21	
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	960	961	88,323	2037/4/21	
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,950	3,049	280,193	2026/4/21	
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	1,400	1,518	139,548	2033/4/21	
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	900	955	87,769	2027/4/21	
小 計					3,787,753		
ニュージーランド				千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル		
国債証券	1.75 NZ GOVT 410515	1.75	300	201	16,882	2041/5/15	
	2 NZ GOVT 320515	2.0	800	674	56,536	2032/5/15	
	2.75 NZ GOVT 250415	2.75	900	868	72,721	2025/4/15	
	2.75 NZ GOVT 370415	2.75	700	586	49,114	2037/4/15	
	2.75 NZ GOVT 510515	2.75	600	448	37,545	2051/5/15	
	3 NZ GOVT 290420	3.0	800	755	63,314	2029/4/20	
	3.5 NZ GOVT 330414	3.5	700	666	55,799	2033/4/14	
	4.5 NZ GOVT 270415	4.5	800	813	68,127	2027/4/15	
小 計					420,041		
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	550	520	51,261	2026/11/1	
	1.625 SINGAPORGOV 310701	1.625	100	91	8,988	2031/7/1	
	1.875 SINGAPORGOV 500301	1.875	790	676	66,589	2050/3/1	
	1.875 SINGAPORGOV 511001	1.875	460	399	39,292	2051/10/1	
	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	1,000	976	96,195	2026/6/1	
	2.25 SINGAPORGOVT 360801	2.25	500	467	46,046	2036/8/1	
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	800	789	77,736	2025/6/1	
	2.375 SINGAPORGOV 390701	2.375	250	237	23,398	2039/7/1	
	2.625 SINGAPORGOV 280501	2.625	250	248	24,432	2028/5/1	
	2.625 SINGAPORGOV 320801	2.625	400	394	38,815	2032/8/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	700	705	69,440	2042/4/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	400	405	39,900	2046/3/1	
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	950	953	93,920	2029/7/1	
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	800	803	79,091	2030/9/1	
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	1,500	1,497	147,491	2024/9/1	
	3 SINGAPORGOVT 720801	3.0	170	189	18,656	2072/8/1	
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	600	632	62,242	2033/9/1	
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	570	585	57,632	2027/3/1	
小 計					1,041,131		

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利率	当期末			償還年月日
			額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
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					
	2.632 MALAYSIAGOV 310415	2.632	1,500	1,385	42,060	2031/4/15
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	1,000	1,000	30,387	2027/5/31
	3.582 MALAYSIAGOV 320715	3.582	2,300	2,271	68,957	2032/7/15
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	2,300	2,318	70,385	2028/6/15
	3.757 MALAYSIAGOV 400522	3.757	800	762	23,146	2040/5/22
	3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	1,000	992	30,123	2034/7/5
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	1,950	1,941	58,952	2033/4/15
	3.882 MALAYSIAGOV 250314	3.882	3,000	3,034	92,126	2025/3/14
	3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	2,500	2,527	76,740	2029/8/15
	3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	1,500	1,526	46,357	2027/11/16
	3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	1,500	1,523	46,241	2026/11/30
	3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	1,500	1,525	46,322	2026/7/15
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	3,000	3,043	92,416	2025/9/15
	4.065 MALAYSIAGOV 500615	4.065	3,100	2,976	90,358	2050/6/15
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	1,200	1,237	37,586	2035/5/31
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	3,000	3,092	93,879	2026/4/15
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	500	524	15,936	2030/4/15
	4.696 MALAYSIAGOV 421015	4.696	2,500	2,680	81,389	2042/10/15
	4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	1,200	1,275	38,740	2046/3/15
	4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	2,900	3,151	95,694	2037/4/7
	4.893 MALAYSIAGOV 380608	4.893	700	773	23,479	2038/6/8
	4.921 MALAYSIAGOV 480706	4.921	640	700	21,263	2048/7/6
小	計				1,222,547	
中国			千中国元	千中国元		
	国債証券					
	1.99 CHINA GOVT 240915	1.99	10,000	9,944	189,082	2024/9/15
	1.99 CHINA GOVT 250409	1.99	4,000	3,962	75,344	2025/4/9
	2.24 CHINA GOVT 250525	2.24	9,000	8,958	170,345	2025/5/25
	2.26 CHINA GOVT 250224	2.26	10,000	9,960	189,389	2025/2/24
	2.28 CHINA GOVT 240317	2.28	10,000	10,008	190,295	2024/3/17
	2.28 CHINA GOVT 251125	2.28	12,000	11,920	226,650	2025/11/25
	2.37 CHINA GOVT 270120	2.37	10,000	9,879	187,858	2027/1/20
	2.44 CHINA GOVT 271015	2.44	4,000	3,948	75,071	2027/10/15
	2.47 CHINA GOVT 240902	2.47	10,000	10,009	190,330	2024/9/2
	2.48 CHINA GOVT 270415	2.48	8,000	7,923	150,666	2027/4/15
	2.5 CHINA GOVT 270725	2.5	8,000	7,920	150,594	2027/7/25
	2.6 CHINA GOVT 320901	2.6	5,000	4,868	92,567	2032/9/1
	2.62 CHINA GOVT 290925	2.62	5,000	4,921	93,574	2029/9/25
	2.68 CHINA GOVT 300521	2.68	10,000	9,870	187,673	2030/5/21
	2.69 CHINA GOVT 260812	2.69	11,000	11,018	209,514	2026/8/12
	2.69 CHINA GOVT 320815	2.69	7,000	6,856	130,366	2032/8/15
	2.74 CHINA GOVT 260804	2.74	5,000	5,028	95,614	2026/8/4
	2.75 CHINA GOVT 290615	2.75	15,000	14,911	283,520	2029/6/15
	2.75 CHINA GOVT 320217	2.75	9,000	8,854	168,368	2032/2/17
	2.76 CHINA GOVT 320515	2.76	9,000	8,870	168,672	2032/5/15
	2.8 CHINA GOVT 290324	2.8	8,000	7,989	151,919	2029/3/24
	2.8 CHINA GOVT 321115	2.8	7,000	6,935	131,871	2032/11/15
	2.84 CHINA GOVT 240408	2.84	15,000	15,114	287,392	2024/4/8

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
中国		%	千中国元	千中国元	千円	
国債証券	2.85 CHINA GOVT 270604	2.85	15,000	15,082	286,783	2027/6/4
	2.89 CHINA GOVT 311118	2.89	5,000	4,997	95,029	2031/11/18
	2.9 CHINA GOVT 260505	2.9	2,000	2,018	38,385	2026/5/5
	2.91 CHINA GOVT 281014	2.91	8,000	8,056	153,185	2028/10/14
	2.94 CHINA GOVT 241017	2.94	9,000	9,096	172,959	2024/10/17
	2.99 CHINA GOVT 251015	2.99	3,000	3,039	57,796	2025/10/15
	3.01 CHINA GOVT 280513	3.01	14,000	14,185	269,715	2028/5/13
	3.02 CHINA GOVT 251022	3.02	7,000	7,102	135,047	2025/10/22
	3.02 CHINA GOVT 310527	3.02	11,000	11,130	211,630	2031/5/27
	3.03 CHINA GOVT 260311	3.03	11,000	11,165	212,308	2026/3/11
	3.12 CHINA GOVT 261205	3.12	10,000	10,190	193,762	2026/12/5
	3.12 CHINA GOVT 521025	3.12	3,000	2,915	55,440	2052/10/25
	3.13 CHINA GOVT 291121	3.13	10,000	10,232	194,568	2029/11/21
	3.22 CHINA GOVT 251206	3.22	9,000	9,193	174,797	2025/12/6
	3.25 CHINA GOVT 260606	3.25	7,000	7,158	136,107	2026/6/6
	3.25 CHINA GOVT 281122	3.25	8,000	8,233	156,543	2028/11/22
	3.27 CHINA GOVT 301119	3.27	13,000	13,473	256,178	2030/11/19
	3.28 CHINA GOVT 271203	3.28	12,000	12,360	235,031	2027/12/3
	3.29 CHINA GOVT 290523	3.29	6,000	6,212	118,116	2029/5/23
	3.32 CHINA GOVT 520415	3.32	6,000	6,052	115,074	2052/4/15
	3.39 CHINA GOVT 500316	3.39	9,000	9,128	173,564	2050/3/16
	3.52 CHINA GOVT 270504	3.52	1,000	1,041	19,793	2027/5/4
	3.53 CHINA GOVT 511018	3.53	4,000	4,164	79,192	2051/10/18
	3.54 CHINA GOVT 280816	3.54	4,000	4,183	79,552	2028/8/16
	3.57 CHINA GOVT 240622	3.57	9,000	9,180	174,562	2024/6/22
	3.59 CHINA GOVT 270803	3.59	7,000	7,327	139,320	2027/8/3
	3.6 CHINA GOVT 250906	3.6	9,000	9,297	176,777	2025/9/6
	3.61 CHINA GOVT 250607	3.61	7,000	7,212	137,143	2025/6/7
	3.69 CHINA GOVT 240921	3.69	4,000	4,101	77,981	2024/9/21
	3.69 CHINA GOVT 280517	3.69	5,000	5,274	100,284	2028/5/17
	3.72 CHINA GOVT 510412	3.72	6,000	6,452	122,689	2051/4/12
	3.77 CHINA GOVT 250308	3.77	2,000	2,065	39,274	2025/3/8
	3.81 CHINA GOVT 500914	3.81	10,000	10,919	207,630	2050/9/14
	3.86 CHINA GOVT 490722	3.86	6,000	6,586	125,229	2049/7/22
	4.08 CHINA GOVT 481022	4.08	9,000	10,246	194,827	2048/10/22
小 計					8,912,969	
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	3,751	143,779	2025/4/30
	0.5 ISRAEL FIXED 260227	0.5	1,800	1,661	63,659	2026/2/27
	1 ISRAEL FIXED BO 300331	1.0	1,800	1,552	59,502	2030/3/31
	1.3 ISRAEL FIXED 320430	1.3	1,500	1,278	48,982	2032/4/30
	1.5 ISRAEL FIXED 370531	1.5	1,800	1,431	54,880	2037/5/31
	1.75 ISRAEL FIXED 250831	1.75	1,800	1,731	66,359	2025/8/31
	2 ISRAEL FIXED BO 270331	2.0	2,500	2,408	92,310	2027/3/31
	3.75 ISRAEL FIXED 240331	3.75	3,000	3,092	118,527	2024/3/31
	3.75 ISRAEL FIXED 470331	3.75	1,650	1,761	67,507	2047/3/31
	5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	1,510	1,931	74,030	2042/1/31

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
イスラエル	%	千イスラエルシケル	千イスラエルシケル	千円	
国債証券	6.25	ISRAEL FIXED 261030	700	778	29,849
小 計					819,390
合 計					225,055,227

(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

(2023年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 225,055,227	% 97.2
コール・ローン等、その他	6,443,939	2.8
投資信託財産総額	231,499,166	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（227,032,959千円）の投資信託財産総額（231,499,166千円）に対する比率は98.1%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=129.27円	1 カナダドル=96.51円	1 メキシコペソ=6.8767円	1 ユーロ=141.09円
1 イギリスポンド=160.40円	1 スウェーデンクローネ=12.67円	1 ノルウェークローネ=13.06円	1 デンマーククローネ=18.96円
1 ポーランドズロチ=29.9211円	1 オーストラリアドル=91.87円	1 ニュージーランドドル=83.78円	1 シンガポールドル=98.47円
1 マレーシアリンギット=30.3617円	1 中国元=19.0141円	1 イスラエルシケル=38.3249円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年1月26日現在)

項目	当期末
(A) 資産	453,943,495,513
コール・ローン等	1,956,314,371
公社債(評価額)	225,055,227,991
未収入金	225,260,171,381
未収利息	1,072,244,598
前払費用	599,537,172
(B) 負債	223,099,387,442
未払金	222,739,200,712
未払解約金	360,185,897
未払利息	833
(C) 純資産総額(A-B)	230,844,108,071
元本	197,648,585,205
次期繰越損益金	33,195,522,866
(D) 受益権総口数	197,648,585,205口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,680円

<注記事項>

- ①期首元本額 207,797,445,119円
期中追加設定元本額 295,149,205,041円
期中一部解約元本額 305,298,064,955円
また、1口当たり純資産額は、期末1.1680円です。

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

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド(適格機関投資家転売制限付)	90,390,214,009円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	16,938,050,283円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	11,836,613,756円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	11,450,242,548円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	10,221,600,661円
三菱UFJ バランスファンド2 OVA(適格機関投資家限定)	9,817,843,855円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン(適格機関投資家限定)	8,049,330,980円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	4,379,885,493円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	4,139,379,769円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	3,938,003,291円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	3,708,138,293円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	2,424,810,611円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,292,590,386円
MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定)	2,280,758,521円
MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定)	2,269,914,309円
MUKAM バランスファンド2021-03(適格機関投資家限定)	2,002,113,906円
MUKAM バランスファンド2021-06(適格機関投資家限定)	1,973,203,301円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	823,298,571円
MUKAM バランス・イノベーション(債券重視型)(適格機関投資家転売制限付)	801,899,314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)	767,455,615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)	764,138,227円
eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	472,626,962円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11(適格機関投資家限定)	379,989,610円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01(適格機関投資家限定)	376,017,480円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)2(適格機関投資家転売制限付)	374,936,978円

○損益の状況 (2022年1月27日~2023年1月26日)

項目	当期
(A) 配当等収益	4,842,008,862
受取利息	4,843,719,322
その他収益金	132,461
支払利息	△ 1,842,921
(B) 有価証券売買損益	△ 37,798,191,329
売買益	65,309,182,456
売買損	△ 103,107,373,785
(C) 保管費用等	△ 31,203,396
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 32,987,385,863
(E) 前期繰越損益金	72,724,250,082
(F) 追加信託差損益金	56,205,214,325
(G) 解約差損益金	△ 62,746,555,678
(H) 計(D+E+F+G)	33,195,522,866
次期繰越損益金(H)	33,195,522,866

- (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。

MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	371,026,379円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	359,565,752円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	352,830,037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)	336,722,167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)	329,350,862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)	325,643,502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)	322,720,012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)	322,196,277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)	321,351,725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)	316,748,113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)	315,633,120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)	315,490,691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)	315,059,067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)	312,894,225円
eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	81,644,836円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	74,233,155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)	1,683,199円
ラップ向けインデックス f 先進国債券 (為替ヘッジあり)	735,357円
合計	197,648,585,205円

新マネー・マーケット・マザーファンド

《第13期》決算日2023年3月27日

[計算期間：2022年9月27日～2023年3月27日]

「新マネー・マーケット・マザーファンド」は、3月27日に第13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13期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主としてわが国の短期公社債等に投資を行います。市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主要運用対象	わが国の公社債等を主要投資対象とします。
主な組入制限	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		債組入比率	債券先物比率	純総資産額
		期騰落	中率			
	円		%	%	%	百万円
9期(2021年3月25日)	9,919		△0.1	90.0	—	11
10期(2021年9月27日)	9,915		△0.0	90.0	—	11
11期(2022年3月25日)	9,910		△0.1	61.7	—	811
12期(2022年9月26日)	9,908		△0.0	57.6	—	2,431
13期(2023年3月27日)	9,902		△0.1	52.9	—	284

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
(期 首) 2022年 9 月26日	円 9,908	% —	% 57.6	% —	% —
9 月末	9,907	△0.0	57.6	—	—
10 月末	9,907	△0.0	52.7	—	—
11 月末	9,906	△0.0	57.0	—	—
12 月末	9,902	△0.1	60.7	—	—
2023年 1 月末	9,901	△0.1	59.4	—	—
2 月末	9,903	△0.1	56.6	—	—
(期 末) 2023年 3 月27日	9,902	△0.1	52.9	—	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

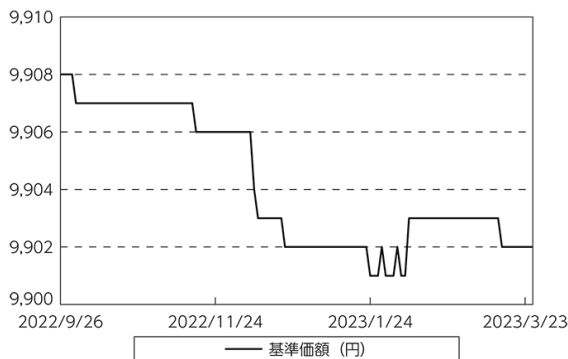
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べて0.1%の下落となりました。

基準価額等の推移



●基準価額の主な変動要因

(下落要因)

運用資金に対するマイナス金利適用などが基準価額の下落要因となりました。

●投資環境について

◎国内短期金融市場

- ・無担保コール翌日物金利は0%を下回る水準で推移しました。
- ・当期間の短期金融市場をみると、日銀は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）はマイナス圏で推移し、足下のコール・レートは-0.014%となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。

○今後の運用方針

- ・今後も日銀による金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は引き続き低位で推移すると予想しています。以上の見通しにより、コール・ローン等への投資を通じて、安定した収益の確保をめざした運用を行う方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2022年9月27日～2023年3月27日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2022年9月27日～2023年3月27日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	443,368,805	444,616,511

(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

(2022年9月27日～2023年3月27日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2023年3月27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	150,000	150,175	52.9	—	—	—	52.9
	(150,000)	(150,175)	(52.9)	(—)	(—)	(—)	(52.9)
合計	150,000	150,175	52.9	—	—	—	52.9
	(150,000)	(150,175)	(52.9)	(—)	(—)	(—)	(52.9)

(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	利 率	当 期 末	
		額 面 金 額	評 価 額
国債証券	%	千円	千円
第1128回国庫短期証券※	—	150,000	150,175
合 計		150,000	150,175

(注) ※印は現先で保有している債券です。

○投資信託財産の構成

(2023年3月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 150,175	% 52.9
コール・ローン等、その他	133,933	47.1
投資信託財産総額	284,108	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年3月27日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	284,108,716 円
コール・ローン等	133,933,216
公社債(評価額)	150,175,500
(B) 負債	44
未払利息	44
(C) 純資産総額(A-B)	284,108,672
元本	286,919,952
次期繰越損益金	△ 2,811,280
(D) 受益権総口数	286,919,952口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,902円

<注記事項>

- ①期首元本額 2,453,888,120円
 期中追加設定元本額 27,311,131,648円
 期中一部解約元本額 29,478,099,816円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9902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)

アクティブアロケーションファンド(ラップ向け)	109,034,114円
MUKAM バランス・イノベーション(債券重視型)(適格機関投資家転売制限付)	100,989,700円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	36,162,535円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)2(適格機関投資家転売制限付)	30,296,910円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	9,931,744円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド(適格機関投資家限定)	504,949円
合計	286,919,952円

- ③純資産総額が元本額を下回っており、その差額は2,811,280円です。

○損益の状況

(2022年9月27日~2023年3月27日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 3,498,437 円
受取利息	△ 2,229,494
支払利息	△ 1,268,943
(B) 当期損益金(A)	△ 3,498,437
(C) 前期繰越損益金	△ 22,677,182
(D) 追加信託差損益金	△ 254,371,648
(E) 解約差損益金	277,735,987
(F) 計(B+C+D+E)	△ 2,811,280
次期繰越損益金(F)	△ 2,811,280

(注) (D)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) (E)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。