

■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（2016年4月28日設定）		
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> 投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の株式、債券に実質的な投資を行います。 運用につきましては、安定性を重視します。 投資対象とする投資信託証券は、原則として、別に定める投資信託証券（以下、「指定投資信託証券」といいます。）の中から選定します。なお、選定する投資信託証券は、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（ファンド設定以降に設定された投資信託証券も含みます。）を指定投資信託証券として指定する場合もあります。 指定投資信託証券の投資配分比率については、三菱UFJ信託銀行株式会社からの投資助言及び情報提供をもとに決定します。なお、一部の指定投資信託証券への投資配分比率がゼロとなる場合があります。 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。 		
主要投資対象	当ファンド	指定投資信託証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、債券および短期金融資産を実質的な主要投資対象とします。	
	指定投資信託証券	MUAMインデックスファンドTOPIXi（適格機関投資家限定）	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）と連動する投資成果をめざして運用を行います。
		MUKAM外国株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。
		MUKAM日本債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	国内債券NOMURA-BPI総合インデックスと連動する投資成果をめざして運用を行います。
		国内物価連動国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）	NOMURA物価連動国債インデックス（フロアあり）と連動する投資成果をめざして運用を行います。
		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）	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。
		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）	FTSE世界国債インデックス（除く日本、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。
	マネープールファンド（F O F s 用）（適格機関投資家限定）	国内の短期公社債等安定した収益の確保をめざして安定運用を行います。	
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は、制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行いません。同一銘柄の投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。		
収益分配方針	<ul style="list-style-type: none"> 年1回の決算時（4月23日（休業日の場合は翌営業日））に分配を行います。 経費等控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額は、委託会社が分配可能額、基準価額水準、市況動向等を勘案のうえ決定します。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。 		

先進国資産配分コントロール ファンド＜安定型＞ （愛称：コア安定）

第7期 運用報告書（全体版）

決算日 2023年4月24日

■受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、「先進国資産配分コントロールファンド＜安定型＞（愛称：コア安定）」は2023年4月24日に第7期の決算を行いました。

当ファンドは、指定投資信託証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、債券および短期金融資産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・配当等収益の確保をめざして運用を行ってまいりました。ここに期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

◆ 中銀アセットマネジメント

岡山県岡山市北区柳町2丁目11番23号

＜お問い合わせ先＞

サポートダイヤル：086-224-5310

受付時間：営業日の午前9時～午後5時

ホームページ：<https://www.chugin-am.jp/>

*お取引内容等につきましては、ご購入された販売会社にお問い合わせください。

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 (分配落)	準 価 額			投 資 信 託 証 組 入 比 券 率	純 資 産 総 額
		税 分 配 込 金	騰 落 中 率	騰 落 中 率		
3期 (2019年4月23日)	円 10,150	円 0	% △0.0	% 95.0	百万円 6,609	
4期 (2020年4月23日)	9,960	0	△1.9	76.2	6,651	
5期 (2021年4月23日)	10,329	0	3.7	98.1	4,604	
6期 (2022年4月25日)	10,148	0	△1.8	58.4	2,806	
7期 (2023年4月24日)	9,855	0	△2.9	98.2	2,727	

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てております。

(注) 当ファンドにはベンチマークおよび参考指数はありません。

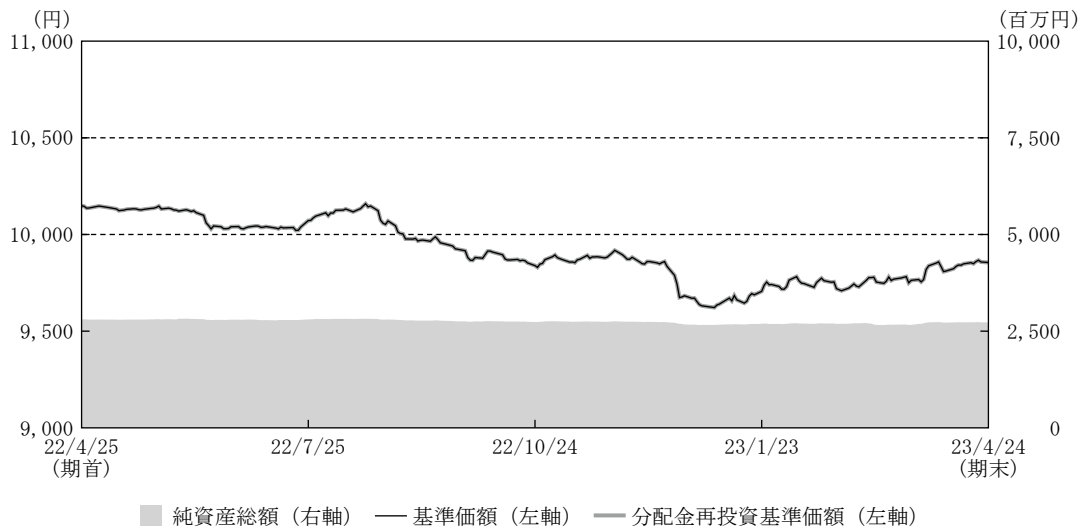
■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	投 資 信 託 証 組 入 比 券 率
(期 首) 2022年 4月25日	円 10,148	% -	% 58.4
4月末	10,137	△0.1	54.3
5月末	10,133	△0.1	50.9
6月末	10,035	△1.1	54.0
7月末	10,099	△0.5	88.9
8月末	10,005	△1.4	89.9
9月末	9,881	△2.6	55.6
10月末	9,885	△2.6	55.7
11月末	9,872	△2.7	87.3
12月末	9,631	△5.1	88.1
2023年 1月末	9,717	△4.2	95.0
2月末	9,733	△4.1	97.8
3月末	9,838	△3.1	97.8
(期 末) 2023年 4月24日	9,855	△2.9	98.2

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

運用経過

■基準価額等の推移について（2022年4月26日～2023年4月24日）



第7期首：10,148円

第7期末：9,855円（既払分配金0円）

騰落率：△2.9%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについては、お客様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、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

■基準価額の主な変動要因

【上昇要因】

国内株式

1月以降、国内株式の上昇局面で組入比率を引き上げたことが、プラス寄与しました。

【下落要因】

国内債券・先進国債券（ヘッジあり）

期前半に国内超長期金利および先進国金利が上昇基調となったことが、マイナス寄与しました。

■投資環境について（2022年4月26日～2023年4月24日）

【概況】

期前半はウクライナ情勢の長期化、市場予想を上回る物価上昇による欧米中央銀行の金融引き締め長期化観測、およびロックダウン（都市封鎖）による中国景気の減速懸念から欧米株式市場は下落しました。また、金利上昇により債券価格も下落しました。期後半は物価指標の鈍化および中国経済の正常化期待から株式市場は上昇基調となりました。また、各国金融政策の違いにより、日本および欧州金利は上昇、米国金利は低下しました。

為替は内外金利差の拡大・縮小を背景に、対ドルでは期前半に大幅な円安、期後半は円高になりました。一方対ユーロでは期を通じて円安が進行しました。

【株式】

国内株式

円安が支えとなり米国株対比で底堅い動きとなりました。また、好決算を発表した銘柄が牽引し上昇しました。

先進国株式

期前半はウクライナ情勢の長期化やロックダウンに伴う中国景気の減速懸念および大手ハイテク企業の低調な決算内容などから下落基調となりました。期後半は物価指標の鈍化および中国経済の正常化期待から上昇基調となりました。

【債券】

国内債券

期前半は日銀の金融緩和と政策維持により、長期金利は日銀の許容変動幅上限の0.25%近傍で推移する一方、超長期金利は海外金利上昇に連れて上昇しました。期後半は12月に日銀が長期金利の許容変動幅を0.5%へ拡大したことを受けて、国内金利は上昇しました。

先進国債券

期前半は市場予想を上回る物価指標を受け、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融引き締め加速およびECB（欧州中央銀行）による大幅利上げから欧米金利は上昇しました。期後半は米国の物価上昇が鈍化したことから、FRBの利上げペース鈍化が意識され米国金利は低下しました。一方、欧州では利上げの継続懸念から金利上昇基調となりました。

【為替】

為替は、対ドルで期前半はFRBの金融引き締め長期化観測による米金利上昇と日銀の金融緩和と政策維持により日米金利差の拡大が意識され、ドル高・円安が進行し、2022年10月には32年ぶりとなる150円台の水準となりました。期後半はFRBの利上げペース鈍化期待と日銀による長期金利の許容変動幅を拡大を受け、ドル安・円高となりました。

対ユーロでは、ECBによる利上げ継続観測から、期を通じてユーロ高・円安が進行しました。

■当ファンドのポートフォリオについて（2022年4月26日～2023年4月24日）

当ファンドは、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき、各指定投資信託証券を組み入れた運用を行いました。株式の組入比率については、「投資環境」や「株式部分の収益寄与」に基づいて組入比率を決定する『株式ウェイトマトリクス』（※「交付目論見書」運用方法／プロセスをご参照ください）を活用しています。

【組入比率】

期前半は一時的に株式保有を高位とすることがあったものの、概ね低位での株式保有としました。期後半は内外株式ともに徐々に組入比率を上げ、期末にかけては上限に近い約12%を維持しました。

【パフォーマンス要因】

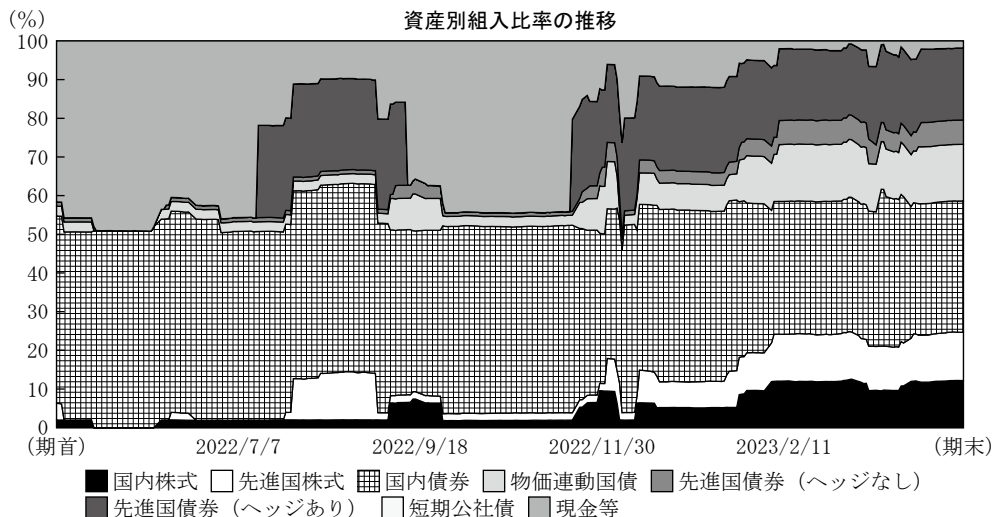
国内株式はプラスに寄与した一方で、国内債券および先進国債券（ヘッジあり）がマイナスに寄与し、全体としてマイナスとなりました。

(ご参考)

資産別組入比率および基準価額騰落率

(2023年4月24日現在)

主要投資対象	投資信託証券名	組入可能範囲	組入比率	期中の基準価額騰落率
先進国債券 (ヘッジあり)	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)	0.0%~25.0% (原則25.0%固定とします)	18.6%	△8.2%
先進国債券 (ヘッジなし)	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)		6.3%	△1.4%
物価連動国債	国内物価連動国債インデックスファンド (適格機関投資家限定)	0.0%~51.0%	14.7%	1.5%
国内債券	MUKAM日本債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)		33.9%	△1.7%
先進国株式	MUKAM外国株式インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	0.0%~12.0%	12.5%	3.6%
国内株式	MUKAMインデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)	0.0%~12.0%	12.2%	9.6%
短期公社債	マネープールファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定)	—	—	0.0%



※比率は、各資産に対応する指定投資信託証券の純資産総額に対する割合です。

■ベンチマークとの差異について

当ファンドは、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産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・配当等収益の確保を目指しますが、特定の指数を上回るまたは連動を目指した運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

従って、ベンチマークおよび参考指数との対比はできません。

■分配金について

当期につきましては、分配可能額、基準価額水準、市況動向等を勘案し、収益分配の実施は見送りといたしました。なお、収益分配に充てなかった留保益につきましては、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

分配原資の内訳

(1万口当たり・税込み)

項 目	第 7 期
	2022年4月26日～2023年4月24日
当期分配金	－円
(対基準価額比率)	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	283円

(注) 「当期の収益」は、費用控除後の配当等収益および費用控除後・繰越欠損補填後の有価証券売買等損益から分配に充当した金額です。また「当期の収益以外」は収益調整金および分配準備積立金から分配に充当した金額です。

(注) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は小数点以下切捨てのため、合計額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(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、当ファンドの収益率とは異なります。

■今後の運用方針について

- 引き続き、三菱UFJ信託銀行の投資助言・情報提供に基づいた運用を行う方針です。
- 三菱UFJ信託銀行は『株式ウェイトマトリクス』に基づく株式組入比率、および債券組入比率について日次で情報を提供しています。加えて、国内外の債券市況が下落した場合などに、引き下げる債券の比率についての情報を適時、提供しています。

■1万口当たりの費用明細

項 目	当 期 2022年4月26日～2023年4月24日		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	105円	1.064%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 <div style="border: 1px solid black; padding: 2px; display: inline-block;">※期中の平均基準価額は9,913円です。</div>
(投 信 会 社)	(48)	(0.483)	委託した資金の運用等の対価
(販 売 会 社)	(54)	(0.548)	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.033)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	1	0.005	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	106	1.069	

(注) 期中において発生した費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって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) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

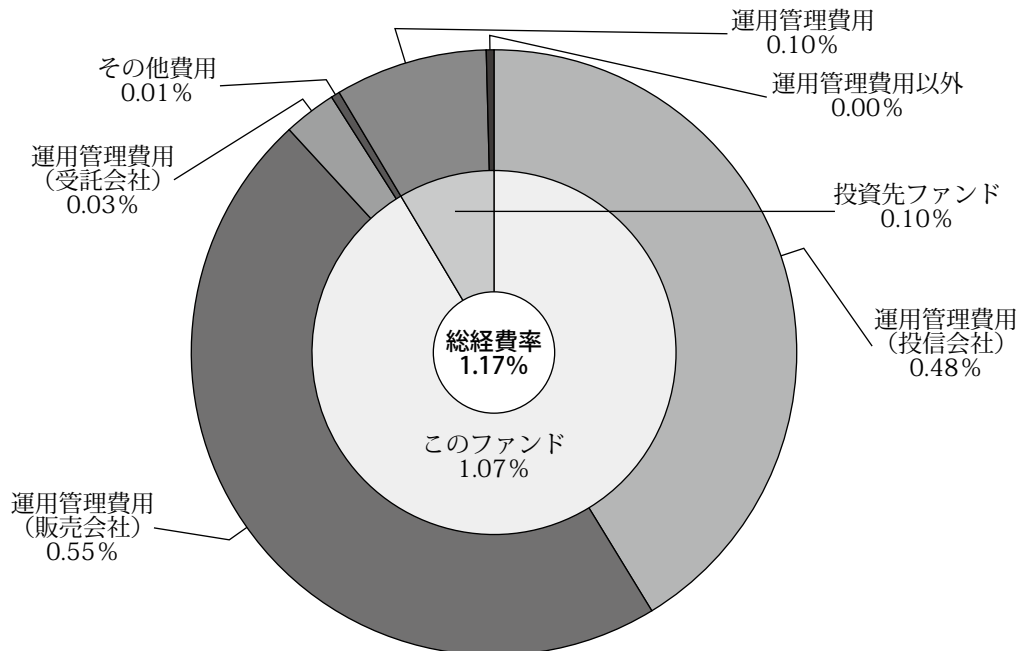
(注) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

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

(参考情報)

■総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.17%です。



総経費率 (①+②+③)	1.17%
①このファンドの費用の比率	1.07%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.10%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.00%

- (注) ①の費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
- (注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。
- (注) 各比率は、年率換算した値です。
- (注) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券です。
- (注) ①の費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
- (注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
- (注) 上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4月26日から2023年4月24日まで）

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	MUAMインデックスファンドTOPIXi（適格機関投資家限定）	444,603,932	766,000	292,861,008	491,349
	国内物価連動国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）	944,798,999	970,000	628,101,916	644,487
	MUKAM日本債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	754,445,902	736,000	1,175,723,540	1,143,000
	MUKAM外国株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	520,830,824	943,000	406,160,111	720,392
	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）	339,662,813	393,000	216,850,316	250,735
	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）	1,557,835,329	1,463,000	994,600,508	924,770
合計	4,562,177,799	5,271,000	3,714,297,399	4,174,734	

（注）金額は受渡代金です。

（注）口数、金額の単位未満は切捨てております。

■利害関係人との取引状況等（2022年4月26日から2023年4月24日まで）

期中における利害関係人との取引はありません。

（注）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4月24日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄		期首(前期末)	当期		期末
		口数	口数	評価額	比率
		口数	口数	千円	%
MUAMインデックスファンドTOPIXi（適格機関投資家限定）		33,520,483	185,263,407	332,103	12.2
国内物価連動国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）		71,101,067	387,798,150	399,858	14.7
MUKAM日本債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）		1,374,060,978	952,783,340	925,819	33.9
MUKAM外国株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）		66,735,046	181,405,759	341,079	12.5
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）		25,915,728	148,728,225	171,037	6.3
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）		—	563,234,821	508,037	18.6
合計		1,571,333,302	2,419,213,702	2,677,935	98.2

（注）口数・評価額の単位未満は切捨てております。

（注）比率は、純資産総額に対する割合です。

■投資信託財産の構成

(2023年4月24日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 2,677,935	% 97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	69,601	2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	2,747,536	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年4月24日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,747,536,685円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	69,600,885
投資信託受益証券(評価額)	2,677,935,800
(B) 負 債	20,021,289
未 払 解 約 金	5,619,185
未 払 信 託 報 酬	14,328,113
未 払 利 息	190
そ の 他 未 払 費 用	73,801
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,727,515,396
元 本	2,767,578,211
次 期 繰 越 損 益 金	△ 40,062,815
(D) 受 益 権 総 口 数	2,767,578,211口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,855円

(注) 当ファンドの期首元本額は2,765,092,834円、期中追加設定元本額は321,673,441円、期中一部解約元本額は319,188,064円です。

(注) 1口当たり純資産額は0.9855円です。

(注) 純資産総額が元本額を下回っており、その差額は40,062,815円です。

■損益の状況

当期 (自2022年4月26日 至2023年4月24日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,889,016円
受 取 配 当 金	4,497,510
支 払 利 息	△ 608,494
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 48,344,209
売 買 損 益	32,937,206
売 買 損	△ 81,281,415
(C) 信 託 報 酬 等	△ 29,402,493
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 73,857,686
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 2,372,518
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	36,167,389
(配 当 等 相 当 額)	(34,899,111)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,268,278)
(G) 計 (D+E+F)	△ 40,062,815
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△ 40,062,815
追 加 信 託 差 損 益 金	36,167,389
(配 当 等 相 当 額)	(34,899,111)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,268,278)
分 配 準 備 積 立 金	43,504,899
繰 越 損 益 金	△119,735,103

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(34,899,111円)および分配準備積立金(43,504,899円)より分配対象収益は78,404,010円(10,000口当たり283円)ですが、当期に分配した金額はありません。

■分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----

当期につきましては、分配可能額、基準価額水準、市況動向等を勘案し、収益分配の実施は見送りといたしました。なお、収益分配に充てなかった留保益につきましては、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

■お知らせ

該当事項はございません。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型	
信託期間	2028年8月14日〔当初、2023年8月14日〕まで (2013年7月11日設定)	
運用方針	東京証券取引所に上場されている株式、TOPIXマザーファンド受益証券および有価証券指数等先物取引等に投資を行い、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果をめざして運用を行います。	
主要運用対象	ベビーフンド	TOPIXマザーファンド受益証券またはわが国の株式を主要投資対象とします。
	マザーファンド	東京証券取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
	マザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書(全体版)

MUAM インデックスファンドTOPIX i
(適格機関投資家限定)

第19期(決算日:2023年2月14日)

信託期間を従来の2023年8月14日から2028年8月14日へ延長しました。

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
さて、お手持ちの「MUAM インデックスファンドTOPIX i(適格機関投資家限定)」は、去る2月14日に第19期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先

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

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	基準価額		東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
		税込み 分配金	騰落率	騰落率	騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
15期(2021年2月15日)	16,938	106	21.5	3,053.35	21.6	95.2	9.9	20,677
16期(2021年8月16日)	16,703	147	△0.5	3,041.68	△0.4	90.0	9.4	15,154
17期(2022年2月14日)	16,781	125	1.2	3,081.09	1.3	95.6	5.1	13,623
18期(2022年8月15日)	17,270	210	4.2	3,212.32	4.3	100.4	0.7	14,035
19期(2023年2月14日)	17,349	205	1.6	3,267.69	1.7	100.2	0.8	12,711

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率-売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	騰落率		
(期首) 2022年8月15日	円 17,270	% -	% -	% 100.4	% 0.7
8月末	17,084	△1.1	△1.1	99.2	0.5
9月末	16,144	△6.5	△6.5	98.8	1.5
10月末	16,965	△1.8	△1.7	98.1	1.7
11月末	17,462	1.1	1.2	97.9	1.3
12月末	16,662	△3.5	△3.5	99.1	1.1
2023年1月末	17,397	0.7	0.8	98.8	0.7
(期末) 2023年2月14日	円 17,554	% 1.6	% 1.7	% 100.2	% 0.8

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

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

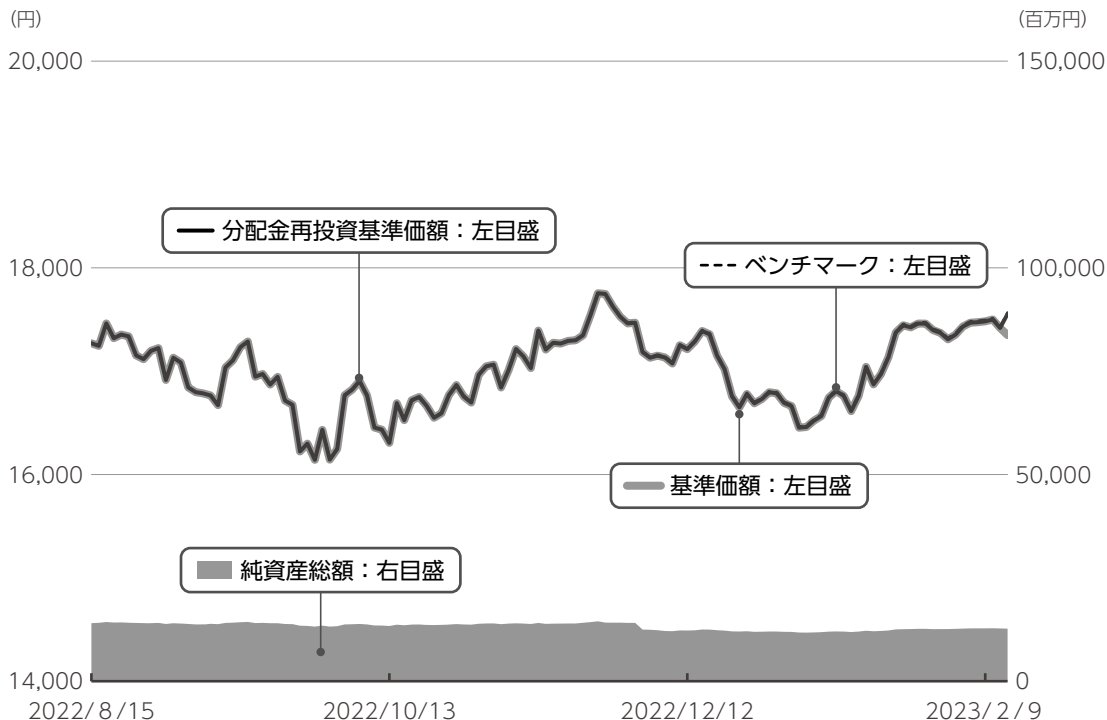
(注) 「株式先物比率」は買建比率-売建比率。

運用経過

第19期：2022年8月16日～2023年2月14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19期首	17,270円
第19期末	17,349円
既払分配金	205円
騰落率	1.6%

(分配金再投資ベース)

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

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

※ベンチマークは、期首の値をファンドの基準価額と同一になるように指数化しています。

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ1.6% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率 (1.7%) を0.1% 下回りました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

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

第19期：2022年8月16日～2023年2月14日

投資環境について

▶ 国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

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から、国内株式市況は上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)

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

▶ TOPIXマザーファンド

資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

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

▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)

ベンチマークとの乖離は△0.1%程度となりました。

マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は△0.1%程度でした。

マザーファンド保有による要因

マザーファンド保有による影響は△0.0%程度でした。

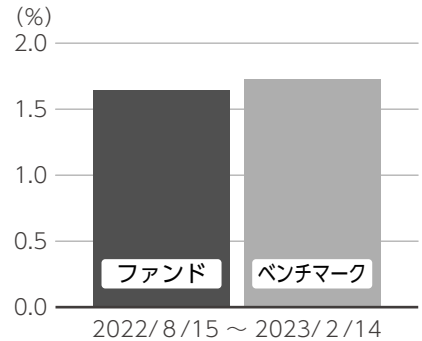
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：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。

基準価額 (ベビーファンド) とベンチマークの対比 (騰落率)



*ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。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19期 2022年8月16日～2023年2月14日
当期分配金 (対基準価額比率)	205 (1.168%)
当期の収益	205
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	9,304

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

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

今後の運用方針 (作成対象期間末での見解です。)

▶ MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ TOPIXマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2022年8月16日～2023年2月14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	13	0.077	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数)
(投 信 会 社)	(8)	(0.050)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(3)	(0.017)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.011)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 ÷ 期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	0	0.001	(c) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.001)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合 計	13	0.078	

期中の平均基準価額は、17,004円です。

- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
- (注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2022年8月16日～2023年2月14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
TOPIXマザーファンド	千口 485,890	千円 1,123,147	千口 1,159,189	千円 2,694,049

○株式売買比率

(2022年8月16日～2023年2月14日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
	TOPIXマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	247,541,666千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	807,550,408千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.30

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2022年8月16日～2023年2月14日)

利害関係人との取引状況

<MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)>

該当事項はございません。

<TOPIXマザーファンド>

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
株式	百万円 147,598	百万円 6,281	% 4.3	百万円 99,942	百万円 5,300	% 5.3

平均保有割合 1.6%

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

利害関係人の発行する有価証券等

<TOPIXマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 2,440	百万円 2,027	百万円 19,461

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<TOPIXマザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 15

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)	62千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.624千円
(B) / (A)	1.0%

(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MUF G証券です。

○組入資産の明細

(2023年2月14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
TOPIXマザーファンド	千口 6,125,424	千口 5,452,125	千円 12,861,018

○有価証券の貸付及び借入の状況

TOPIXマザーファンドにおいて、2023年2月14日現在における貸付株数の総株数は38,998,100株です。

○投資信託財産の構成

(2023年2月14日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TOPIXマザーファンド	12,861,018	99.9
コール・ローン等、その他	11,173	0.1
投資信託財産総額	12,872,191	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年2月14日現在)

○損益の状況 (2022年8月16日～2023年2月14日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	12,872,191,211
コール・ローン等	11,172,806
TOPIXマザーファンド(評価額)	12,861,018,405
(B) 負債	160,515,485
未払収益分配金	150,205,261
未払信託報酬	10,215,414
未払利息	13
その他未払費用	94,797
(C) 純資産総額(A-B)	12,711,675,726
元本	7,327,085,908
次期繰越損益金	5,384,589,818
(D) 受益権総口数	7,327,085,908口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,349円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,294
受取利息	31
支払利息	△ 1,325
(B) 有価証券売買損益	221,694,686
売買益	271,131,831
売買損	△ 49,437,145
(C) 信託報酬等	△ 10,310,211
(D) 当期損益金(A+B+C)	211,383,181
(E) 前期繰越損益金	1,506,675,625
(F) 追加信託差損益金	3,816,736,273
(配当等相当額)	(5,249,205,118)
(売買損益相当額)	(△1,432,468,845)
(G) 計(D+E+F)	5,534,795,079
(H) 収益分配金	△ 150,205,261
次期繰越損益金(G+H)	5,384,589,818
追加信託差損益金	3,816,736,273
(配当等相当額)	(5,249,348,983)
(売買損益相当額)	(△1,432,612,710)
分配準備積立金	1,567,853,545

<注記事項>

- ①期首元本額 8,127,115,267円
 期中追加設定元本額 723,212,175円
 期中一部解約元本額 1,523,241,534円
 また、1口当たり純資産額は、期末17,349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) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

②分配金の計算過程

項 目	2022年8月16日～ 2023年2月14日
費用控除後の配当等収益額	154,098,720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	57,284,461円
収益調整金額	5,249,348,983円
分配準備積立金額	1,506,675,625円
当ファンドの分配対象収益額	6,967,407,789円
1万口当たり収益分配対象額	9,509円
1万口当たり分配金額	205円
収益分配金金額	150,205,261円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金 (税込み)	205円
------------------	------

- ◆分配金は決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。
- ◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、2023年2月14日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

[お 知 ら せ]

信託期間を従来2023年8月14日から2028年8月14日へ延長し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2022年9月30日)

T O P I X マザーファンド

《第21期》決算日2022年3月25日

[計算期間：2021年3月26日～2022年3月25日]

「T O P I X マザーファンド」は、3月25日に第21期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第21期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		東 証 株 価 指 数		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率	(T O P I X) (配当込み)	期 騰 落 率			
	円	%		%	%	%	百万円
17期(2018年3月26日)	17,551	11.9	2,433.96	11.9	98.1	1.1	275,958
18期(2019年3月25日)	16,939	△ 3.5	2,348.27	△ 3.5	99.3	1.4	245,020
19期(2020年3月25日)	15,695	△ 7.3	2,174.58	△ 7.4	95.4	4.2	244,088
20期(2021年3月25日)	22,066	40.6	3,057.07	40.6	98.8	0.8	506,225
21期(2022年3月25日)	22,839	3.5	3,163.63	3.5	99.1	0.9	739,823

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

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 株 価 指 数		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	(TOPIX) (配当込み)	騰 落 率	(TOPIX) (配当込み)		
(期 首) 2021年3月25日	円	%		%	%	%
	22,066	—	3,057.07	—	98.8	0.8
3 月 末	22,238	0.8	3,080.87	0.8	98.1	2.0
4 月 末	21,610	△2.1	2,993.46	△2.1	98.0	1.2
5 月 末	21,907	△0.7	3,034.76	△0.7	98.7	1.3
6 月 末	22,166	0.5	3,070.81	0.4	98.1	1.3
7 月 末	21,683	△1.7	3,003.91	△1.7	99.5	0.5
8 月 末	22,370	1.4	3,099.08	1.4	99.5	0.5
9 月 末	23,344	5.8	3,234.08	5.8	97.3	1.6
10 月 末	23,013	4.3	3,188.28	4.3	99.4	1.3
11 月 末	22,181	0.5	3,073.26	0.5	99.9	1.0
12 月 末	22,950	4.0	3,179.28	4.0	98.9	0.7
2022年1 月 末	21,842	△1.0	3,025.69	△1.0	99.7	0.8
2 月 末	21,748	△1.4	3,012.57	△1.5	99.0	1.0
(期 末) 2022年3月25日	22,839	3.5	3,163.63	3.5	99.1	0.9

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

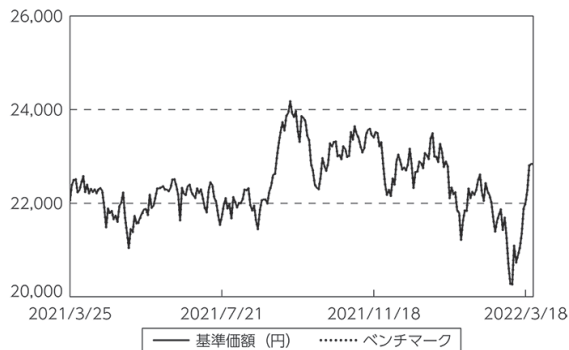
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ3.5%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(3.5%)と同程度となりました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因
(上昇要因)

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

● 投資環境について

◎ 国内株式市況

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

● 当該投資信託のポートフォリオについて

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

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは3.5%の上昇になったため、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)

- ・ その他の要因※によるものです。
※貸株収入要因等が含まれます。

(主なマイナス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2021年3月26日～2022年3月25日)

項 目	当 期		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、22,410円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2021年3月26日～2022年3月25日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株	千円	千株	千円
		248,637	640,027,454	160,575	394,647,862
		(13,319)	()		

(注) 金額は受渡代金。

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

新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内	証券	千円	千円	証券	千円
	—	—	—	5,200	—
	(16,500)	()	()	(11,300)	()

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株主割当および権利行使等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	株式先物取引	百万円 120,970	百万円 118,473	百万円 -	百万円 -

○株式売買比率

(2021年3月26日～2022年3月25日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	1,034,675,316千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	617,188,957千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.67

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2021年3月26日～2022年3月25日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %
貸付有価証券(株式)	909,575	286,661	31.5	907,773	297,466	32.8

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 10,120	百万円 7,127	百万円 14,175

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 1,168

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	8,465千円
うち利害関係人への支払額 (B)	121千円
(B) / (A)	1.4%

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

○組入資産の明細

(2022年3月25日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)		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	8.2	12.9	45,601	
日本水産	235.2	367.6	212,472	
マルハニチロ	39.6	57.5	144,900	
雪国まいたけ	15.6	26.8	31,865	
カネコ種苗	7.7	10.4	16,889	
サカタのタネ	30.2	43.8	164,031	
ホクト	21.3	30.8	61,261	
ホクリヨウ	3.9	5	3,540	
鉱業 (0.3%)				
住石ホールディングス	44.3	64.3	11,316	
日鉄鉱業	5.8	8.4	60,816	
三井松島ホールディングス	10.6	15.4	32,324	
I N P E X	931.6	1,474.7	2,194,353	
石油資源開発	33.1	43.2	126,230	
K&Oエナジーグループ	12.3	16.7	28,623	
建設業 (2.3%)				
ヒノキヤグループ	6.3	8	18,976	
ショーボンドホールディングス	36.2	52.5	288,225	
ミライト・ホールディングス	87.8	118.3	238,611	
タマホーム	15.4	22.3	54,523	
サンヨーホームズ	2.9	4.2	3,423	
日本アクア	10.1	14.6	8,803	
ファーストコーポレーション	7.7	9	7,011	
ベストテラ	4.8	7.4	8,680	
Robot Home	47.5	61.3	12,689	
キャンディル	4.3	6.3	3,219	
スペースバリューホールディングス	30.9	—	—	
ダイセキ環境ソリューション	4.9	7.1	8,740	
第一カッター興業	6.3	9.1	12,503	
安藤・間	162.4	182.5	158,045	
東急建設	74.2	107.7	76,036	
コムシスホールディングス	89.8	118.5	328,126	
ピーアールホールディングス	33.9	50	16,500	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
高松コンストラクショングループ	15.8	22.9	48,044	
東建コーポレーション	7.8	10.2	90,168	
ソネック	2.6	3.8	4,043	
ヤマウラ	11	17.7	17,770	
オリエンタル白石	—	123.6	29,664	
大成建設	182.1	245.3	927,234	
大林組	585	848.9	805,606	
清水建設	548	795.2	614,689	
飛鳥建設	16.8	22.7	24,833	
長谷工コーポレーション	191.6	252.8	375,408	
松井建設	23	33.4	22,478	
銭高組	2.6	3.7	15,928	
鹿島建設	428.7	622	972,186	
不動テトラ	14.3	18	28,170	
大末建設	7.4	8.9	11,721	
鉄建建設	11.8	18.4	36,174	
西松建設	41.9	51.4	200,203	
三井住友建設	141.3	191.4	84,216	
大豊建設	12.8	12.4	53,258	
前田建設工業	146.5	—	—	
佐田建設	13.5	18.3	8,527	
ナカノフド一建設	14	20.3	7,105	
奥村組	32.2	50	157,500	
東鉄工業	25.1	39.4	92,747	
イチケン	4.2	6.1	11,956	
富士ビー・エス	7.5	10.9	5,613	
浅沼組	7	9.5	51,585	
戸田建設	242.9	352.5	273,187	
熊谷組	27.1	43.3	125,786	
北野建設	3.6	5.2	11,674	
植木組	2.6	7.5	11,310	
矢作建設工業	25.8	37.5	30,600	
ビーエス三菱	19.3	27.9	17,074	
日本ハウスホールディングス	39.9	57.9	24,607	

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ニチレイ	89.2	123.9	303,926	
東洋水産	96.3	130.5	588,555	
イートアンドホールディングス	6.5	10.2	21,379	
大冷	2.1	3	5,751	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10.5	14	7,742	
日清食品ホールディングス	73.5	106.6	933,816	
永谷園ホールディングス	9.1	12.1	24,103	
一正蒲鉾	7.3	11.7	9,945	
フジッコ	20.3	25.3	50,625	
ロック・フィールド	20.2	29.3	42,279	
日本たばこ産業	1,003.9	1,456.6	3,045,750	
ケンコーマヨネーズ	11.5	15.2	21,690	
わらべや日洋ホールディングス	12.2	17.8	31,310	
なとり	10.4	15.2	31,023	
イフジ産業	2.9	4.7	4,742	
ピクルスコーポレーション	4.5	13	20,124	
ファーマフーズ	12.8	25.7	54,072	
北の達人コーポレーション	65.4	—	—	
ユーグレナ	80.9	138.4	113,764	
紀文食品	—	15.8	17,632	
ミヨシ油脂	6.6	10.4	12,168	
理研ビタミン	17.7	28.2	48,898	
繊維製品 (0.4%)				
片倉工業	24.5	29.6	64,764	
グンゼ	13.4	16.9	65,825	
東洋紡	72.2	104.8	118,843	
ユニチカ	53.5	72.8	21,403	
富士紡ホールディングス	8.8	11.8	40,887	
倉敷紡績	16.8	22.7	41,836	
シキボウ	10.3	13.9	12,732	
日本毛織	60.1	79.9	72,309	
ダイトウボウ	29.5	42.9	3,903	
トーア紡コーポレーション	7.2	9.8	3,871	
ダイドーリミテッド	24	34.8	5,115	
帝国繊維	20.6	29.9	53,371	
帝人	172	249.5	350,048	
東レ	1,322.9	1,919.5	1,257,272	
サカイオーベックス	4.8	—	—	
住江織物	4	5.2	9,318	

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ビオフェルミン製薬	3.2	—	—
中外製薬	583.5	846.6	3,532,861
科研製薬	31.9	42.5	170,850
エーザイ	206.1	324	1,933,308
ロート製薬	88.9	138.9	541,015
小野薬品工業	428.4	621.6	1,966,120
久光製薬	54.3	71.6	276,376
持田製薬	25.9	34.1	134,183
参天製薬	324.6	504.9	673,031
扶桑薬品工業	6	9.5	21,337
日本ケミファ	2.2	3.2	6,947
ツムラ	62.2	83.9	287,357
日医工	52.8	84	68,292
キッセイ薬品工業	33	47.9	124,252
生化学工業	32.9	47.7	43,597
栄研化学	32.8	47.6	85,727
日水製薬	6.9	9.9	9,840
鳥居薬品	11.7	14.5	45,747
JCRファーマ	52.6	76.3	164,960
東和薬品	26.9	39	112,671
富士製薬工業	12.7	16.6	16,716
沢井製薬	40.9	—	—
ゼリア新薬工業	33.8	49.1	97,021
第一三共	1,601.5	2,127.1	5,743,170
キョーリン製薬ホールディングス	41.2	54.3	102,246
大幸薬品	22.9	40.8	23,949
ダイト	11.9	17.6	51,286
大塚ホールディングス	387.7	562.5	2,400,187
大正製薬ホールディングス	44.4	64.4	396,704
ペプチドリーム	96.2	142	302,460
あすか製薬ホールディングス	—	30.8	35,635
サワイグループホールディングス	—	59.3	273,669
石油・石炭製品 (0.5%)			
日本コークス工業	157.6	228.7	35,905
ニチレキ	22	34.6	44,080
ユシロ化学工業	10.5	14	14,980
ビービー・カストロール	6.7	9.7	11,843
富士石油	45.3	72.3	20,894
MORESCO	6.7	9	10,386

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

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
北越工業	19.2	25.3	22.643	
ダイキン工業	237.7	344.9	7,949,945	
オルガノ	6	7.8	79,404	
トーヨーカネツ	7	10.2	26,112	
栗田工業	101	146.5	692,945	
椿本チエイン	26.6	35.4	112,926	
大同工業	8.9	11.9	11,424	
木村化工機	15.5	22.5	19,575	
アネスト岩田	31.4	42.1	35,069	
ダイフク	102.7	149	1,311,200	
サムコ	4.7	6.8	17,741	
加藤製作所	10.2	12.8	10,329	
油研工業	3.1	4.5	8,154	
タダノ	90	141.5	147,160	
フジテック	64.2	100.4	314,754	
CKD	43.3	79.9	152,369	
キトー	15.7	23	40,641	
平和	52	75.5	144,809	
理想科学工業	14.4	22.7	46,285	
SANKYO	44.3	58.5	205,042	
日本金銭機械	20.6	27.4	18,632	
マースグループホールディングス	11.8	17.2	30,203	
フクシマガリレイ	12.8	18.5	73,907	
オーイズミ	7.8	9.5	3,781	
ダイコク電機	8.6	12.4	15,772	
竹内製作所	31.2	41.2	106,955	
アマノ	48.8	70.9	159,737	
JUKI	26	37.7	30,725	
サンデン	26	37.5	7,575	
ジャノメ	17	23	17,526	
マックス	25.6	36	61,560	
グローリー	47.9	69.5	146,158	
新晃工業	17.3	25.2	44,125	
大和冷機工業	30	39.1	42,228	
セガサミーホールディングス	169.6	268.5	590,700	
日本ビストンリング	6.8	9.9	13,523	
リケン	8.6	11.6	29,046	
TPR	25.1	36.4	49,285	
ツバキ・ナカシマ	35.7	59.4	56,489	

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
サノヤスホールディングス	22.8	—	—	—
日本車輛製造	6.8	9.9	21,681	
三菱ロジスネクスト	24.7	35.8	33,580	
近畿車輛	3.2	4.1	4,842	
日産自動車	2,200.1	3,192.2	1,693,462	
いすゞ自動車	540.5	849.3	1,353,784	
トヨタ自動車	1,889.8	13,710.5	30,012,284	
日野自動車	232.9	338	247,416	
三菱自動車工業	690.5	1,001.9	321,609	
エフテック	13	18.9	10,489	
レシップホールディングス	7.4	10.7	6,120	
GMB	3.3	4.9	3,660	
ファルテック	3.3	4.7	3,224	
武蔵精密工業	41.6	60.4	93,499	
日産車体	27.3	39.6	23,205	
新明和工業	52.7	76.5	71,986	
極東開発工業	32.2	50.3	72,482	
トビー工業	15.3	22.3	23,861	
ティラド	5.8	7.7	18,841	
曙ブレーキ工業	102.4	148.6	23,033	
タチエス	28.6	47.4	50,101	
NOK	90.2	130.9	156,294	
フタバ産業	46.7	67.8	24,882	
KYB	20.9	28.1	85,424	
大同メタル工業	38.5	51.9	30,776	
プレス工業	92.4	134.1	52,164	
ミクニ	23.7	34.3	14,028	
太平洋工業	39.1	56.7	53,581	
河西工業	25.2	33.2	9,262	
アイシン	136.5	198.1	845,887	
マツダ	585.5	849.5	761,152	
今仙電機製作所	16.3	17.8	10,929	
本田技研工業	1,468.8	2,131.2	7,365,427	
スズキ	369.8	619.1	2,600,220	
SUBARU	534.6	775.7	1,503,306	
安永	9	13	11,284	
ヤマハ発動機	263.6	353.2	951,874	
TBK	22.2	29.7	11,256	
エクセディ	25.3	40.8	65,892	

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
豊田合成	60.2	87.4	176,810	
愛三工業	29.2	42.4	31,121	
盟和産業	2.8	3.8	3,982	
日本プラス	15.7	21.2	11,299	
ヨロズ	16	25.3	23,073	
エフ・シー・シー	30.5	44.2	60,554	
シマノ	69.8	108.2	3,067,470	
テイ・エス テック	43.3	114.3	164,134	
ジャムコ	10.9	15.8	12,671	
精密機器 (2.5%)				
テルモ	571.9	765.9	2,904,292	
クリエートメディック	6.2	8.1	8,019	
日機装	60.2	81.2	73,648	
日本エム・ディ・エム	10.7	15.6	25,599	
島津製作所	240.1	348.3	1,515,105	
JMS	15.8	22.9	14,175	
クボテック	4.8	5.8	1,490	
長野計器	13.5	19.6	25,656	
ブイ・テクノロジー	8.7	11.8	40,356	
東京計器	11.9	17.2	20,691	
愛知時計電機	2.5	11.7	18,860	
インターアクション	9.3	13.5	28,458	
オーバル	16.7	24.2	6,969	
東京精密	31.4	45.7	221,873	
マニー	74.3	107.8	156,956	
ニコン	284.9	413.3	541,836	
トプコン	94	127.3	200,879	
オリンパス	1,032.2	1,419.4	3,270,297	
理研計器	16.4	21.9	114,099	
タムロン	15	21	51,450	
HOYA	370.1	528.2	7,500,440	
シード	7.9	12.6	6,715	
ノーリツ鋼機	16.8	24.3	54,383	
エー・アンド・デイ	15.7	24.7	22,699	
朝日インテック	196.3	296.8	699,854	
シチズン時計	236.7	317	160,719	
リズム	5.8	8.5	12,937	
大研医器	14.8	21.4	11,320	
メニコン	28.7	89.8	269,040	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ジェイ・エス・ビー	3.4	5.4		17,874
ロードスターキャピタル	—	5.4		8,742
テンポイノベーション	5.2	7.4		6,526
グローバル・リンク・マネジメント	3.1	4.7		4,056
フェイスネットワーク	—	2.5		3,362
パーク24	98.8	143.3		289,752
バラカ	4.8	6.9		11,633
宮越ホールディングス	—	10.1		9,120
三井不動産	838.6	1,217	3,295	027
三菱地所	1,208.7	1,754	3,243	146
平和不動産	31.5	45.7		188,055
東京建物	181.7	263.7		484,153
ダイビル	47.4	38.7		85,023
京阪神ビルディング	31.7	41.2		63,448
住友不動産	413.6	560.1	1,951	388
テーオーシー	36.1	48		34,032
東京楽天地	3	4.4		18,458
レオパレス21	152.6	276.8		52,038
スターツコーポレーション	21.9	36.3		90,024
フジ住宅	21.3	31		19,809
空港施設	18.4	26.7		14,845
明和地所	8.7	12.6		8,278
ゴールドクレスト	16.6	21.1		36,819
エスリード	7.2	10.4		18,470
日神グループホールディングス	27.2	43.4		21,135
日本エスコン	33.3	49.7		39,809
タカラレーベン	77.1	111.9		34,577
AVANTIA	10.3	13.8		11,688
イオンモール	92.3	133.9		227,094
毎日コムネット	4.7	9.1		6,461
ファースト住建	7.8	9.9		11,771
ランド	1,001.5	1,453.1		14,531
カチタス	45.6	66.1		235,316
トーセイ	25.4	36.8		42,614
穴吹興産	4	5.8		12,458
サンフロンティア不動産	22.6	36.9		39,815
FJネクストホールディングス	18.1	26.2		26,357
インテリックス	4.1	6		4,062
ランドビジネス	6.2	11.3		2,745

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

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
ベネッセホールディングス	65.3	86.2	197,915	
イオンディライト	22	31.9	98,252	
ナック	8.4	12.3	12,287	
ダイセキ	29.9	47.1	223,725	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
ステップ	6.5	9.5	16,995	
合 計	株 数 ・ 金 額	196,035	297,416	732,980,729
	銘柄数<比率>	2,188	2,176	<99.1%>

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 6,654	百万円 -

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2022年3月25日現在)

区 分	当 期 末	
	数	量
貸付有価証券<株式>総株数		株 7,879,100

○投資信託財産の構成

(2022年3月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 732,980,729	% 96.7
コール・ローン等、その他	24,852,394	3.3
投資信託財産総額	757,833,123	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年3月25日現在)

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

○損益の状況 (2021年3月26日～2022年3月25日)

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

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

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

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

<注記事項>

①期首元本額	229,410,107,801円	
期中追加設定元本額	327,037,089,764円	
期中一部解約元本額	232,521,500,276円	
また、1口当たり純資産額は、期末2,2839円です。		
②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）		
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド		52,810,604,615円
三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）		39,252,787,441円
三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）		37,989,399,040円
MUAM 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）		33,944,715,365円
eMAXIS Slim 国内株式（TOPIX）		21,395,917,107円
国内株式インデックス・オープン（ラップ向け）		17,152,297,991円
三菱UFJ DCトピックスオープン		8,950,943,499円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）		7,679,908,171円
三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）		7,551,945,344円
eMAXIS TOPIXインデックス		7,472,214,149円
三菱UFJ トピックスインデックスファンドVA（適格機関投資家限定）		6,811,785,880円
三菱UFJ トピックスインデックスオープン		6,626,325,908円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）		6,276,859,123円
つみたて日本株式（TOPIX）		6,127,188,300円
三菱UFJ TOPIX・ファンド		5,404,629,236円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）		3,809,495,323円
ラップ向けインデックスf 国内株式		3,633,834,912円
三菱UFJ トピックスオープン（確定拠出年金）		3,592,758,918円
つみたて8資産均等バランス		3,445,707,353円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）		3,407,583,661円
MUKAM 日本株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）		2,849,999,030円
国内株式セレクション（ラップ向け）		2,602,555,962円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）		2,546,980,075円
eMAXIS バランス（8資産均等型）		2,195,076,058円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）		1,916,649,476円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）		1,729,464,382円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド		1,621,488,028円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）		1,571,045,378円
三菱UFJ DC年金バランス（株式65）		1,441,243,433円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）		1,371,665,055円
三菱UFJ DC年金インデックス（国内株式）		1,186,416,421円
つみたて4資産均等バランス		1,059,688,814円
三菱UFJ トピックスオープン		1,021,130,854円
MUKAM 日米コアバランス（除く米国株）2022-03（適格機関投資家限定）		1,002,058,697円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）		985,513,911円
三菱UFJ DC年金バランス（株式40）		873,575,793円
ファンド・マネジャー（国内株式）		855,212,531円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）		837,630,956円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）		741,021,306円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）		691,728,999円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1		656,190,031円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）		633,448,179円
三菱UFJ ターゲット・イヤール・ファンド2040（確定拠出年金）		612,824,520円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）		594,534,742円
eMAXIS バランス（4資産均等型）		548,317,388円
三菱UFJ ターゲット・イヤール・ファンド2030（確定拠出年金）		533,046,136円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）		524,101,851円
MUKAM 日米コアバランス 2021-07（適格機関投資家限定）		513,316,949円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	460,314,871円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	438,667,332円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	425,005,692円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	414,458,675円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	370,403,983円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	346,806,753円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	311,660,218円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	308,941,970円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	303,190,142円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)	286,479,219円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	228,173,832円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	217,070,213円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	200,384,194円
日米コアバランス (FOF s用) (適格機関投資家限定)	193,173,307円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	161,780,307円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	140,368,408円
MUKAM 米国公債プラス日本株式ファンド2019-04 (適格機関投資家限定)	137,983,540円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	137,032,047円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	132,841,270円
MUKAM 米国公債プラス日本株式ファンド2019-11 (適格機関投資家限定)	132,502,514円
MUKAM 米国公債プラス日本株式ファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	125,237,116円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	124,717,775円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)	117,570,360円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	102,685,085円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	86,117,941円
eMAXIS バランス (波乗り型)	82,839,831円
三菱UFJ トピックスオープンVA (適格機関投資家限定)	82,388,733円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	71,741,381円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	70,001,032円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	60,616,892円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	45,277,979円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	43,640,133円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	42,857,545円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	42,011,017円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	41,969,101円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	41,396,338円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	40,655,690円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	40,141,981円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	39,905,941円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	39,760,908円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	38,804,680円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	38,386,516円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	21,158,245円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	20,539,362円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	12,161,841円
MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)	8,726,654円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	7,436,030円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	7,217,653円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	5,365,850円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	5,246,978円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,784,845円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	3,569,286円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	3,502,109円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	2,526,489円

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

【お 知 ら せ】

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型
信託期間	2026年2月20日まで（2016年3月25日設定）
運用方針	主としてわが国の物価連動国債に投資を行い、NOMURA 物価連動国債インデックス（フロアあり）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 物価連動国債の組入比率は高位を維持することを基本とします。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し債券の実質投資比率が100%を超える場合があります。
主要運用対象	わが国の物価連動国債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告に係わる情報

国内物価連動国債インデックスファンド
(適格機関投資家限定)

第7期（決算日：2023年2月24日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
さて、お手持ちの「国内物価連動国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）」は、去る2月24日に第7期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先

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

お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA 物価連動国債 インデックス (フロアあり)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配	み 金 騰 落	期 騰 落	中 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
3期(2019年2月25日)	9,943	0	△1.4	102.63	△1.2	99.7	—	14,231
4期(2020年2月25日)	9,859	0	△0.8	101.98	△0.6	99.8	—	14,458
5期(2021年2月24日)	9,620	0	△2.4	100.06	△1.9	99.7	—	14,346
6期(2022年2月24日)	9,910	0	3.0	103.41	3.3	99.8	—	13,619
7期(2023年2月24日)	10,265	0	3.6	107.51	4.0	99.7	—	17,000

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA 物価連動国債 インデックス (フロアあり)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	円	騰 落 率	インデックス	騰 落 率		
(期 首) 2022年 2月24日	9,910	—	103.41	—	99.8	—
2月末	9,987	0.8	104.18	0.7	99.8	—
3月末	10,040	1.3	104.99	1.5	99.9	—
4月末	10,168	2.6	106.23	2.7	99.9	—
5月末	10,194	2.9	106.50	3.0	99.9	—
6月末	10,165	2.6	106.14	2.6	99.8	—
7月末	10,194	2.9	106.48	3.0	99.9	—
8月末	10,224	3.2	106.87	3.3	99.6	—
9月末	10,252	3.5	107.16	3.6	99.9	—
10月末	10,290	3.8	107.58	4.0	99.9	—
11月末	10,313	4.1	107.89	4.3	99.6	—
12月末	10,222	3.1	107.09	3.6	99.8	—
2023年 1月末	10,251	3.4	107.31	3.8	99.5	—
(期 末) 2023年 2月24日	10,265	3.6	107.51	4.0	99.7	—

(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3.6%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（4.0%）を0.4%下回りました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

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

● 投資環境について

◎ 物価連動国債市況

物価連動国債市況は上昇しました。

- ・ 物価連動国債市況は、期間を通して見ると原材料価格の高騰などを背景に期待インフレ率が高まったことから上昇しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 資産のほぼ全額を債券に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
- ・ ベンチマーク採用全銘柄に投資することで、指数を模倣しました。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは4.0%の上昇になったため、カイ離は△0.4%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ ありません。

(主なマイナス要因)

- ・ 信託報酬要因によるものです。

● 分配金について

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

【分配原資の内訳】

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第7期
	2022年2月25日～ 2023年2月24日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	491

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

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

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2022年2月25日～2023年2月24日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 24	% 0.236	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
（ 投 信 会 社 ）	(20)	(0.192)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(1)	(0.011)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(3)	(0.033)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	0	0.003	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.003)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合 計	24	0.239	
期中の平均基準価額は、10,199円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2022年2月25日～2023年2月24日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 5,956,060	千円 3,103,658

(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2月25日～2023年2月24日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	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 5,956	百万円 1,199	% 20.1	百万円 3,103	百万円 1,497	% 48.2

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJモルガン・スタンレー証券、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2月25日～2023年2月24日)

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

○組入資産の明細

(2023年2月24日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期		末				
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	15,496,000 (15,496,000)	16,947,373 (16,947,373)	99.7 (99.7)	— (—)	42.8 (42.8)	43.6 (43.6)	13.3 (13.3)
合 計	15,496,000 (15,496,000)	16,947,373 (16,947,373)	99.7 (99.7)	— (—)	42.8 (42.8)	43.6 (43.6)	13.3 (13.3)

(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18回利付国債 (物価連動・10年)	0.1	730,000	813,205	2024/3/10
第19回利付国債 (物価連動・10年)	0.1	1,332,000	1,446,512	2024/9/10
第20回利付国債 (物価連動・10年)	0.1	2,606,000	2,840,817	2025/3/10
第21回利付国債 (物価連動・10年)	0.1	2,065,000	2,272,048	2026/3/10
第22回利付国債 (物価連動・10年)	0.1	2,063,000	2,301,712	2027/3/10
第23回利付国債 (物価連動・10年)	0.1	2,040,000	2,214,823	2028/3/10
第24回利付国債 (物価連動・10年)	0.1	1,950,000	2,109,634	2029/3/10
第25回利付国債 (物価連動・10年)	0.2	960,000	1,083,356	2030/3/10
第26回利付国債 (物価連動・10年)	0.005	900,000	967,109	2031/3/10
第27回利付国債 (物価連動・10年)	0.005	850,000	898,153	2032/3/10
合 計		15,496,000	16,947,373	

○投資信託財産の構成

(2023年2月24日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 16,947,373	% 99.5
コール・ローン等、その他	79,214	0.5
投資信託財産総額	17,026,587	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2023年2月24日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	17,026,587,112
コール・ローン等	72,067,160
公社債(評価額)	16,947,373,638
未収利息	6,162,567
前払費用	983,747
(B) 負債	25,682,958
未払解約金	7,796,723
未払信託報酬	17,672,565
未払利息	18
その他未払費用	213,652
(C) 純資産総額(A-B)	17,000,904,154
元本	16,562,649,031
次期繰越損益金	438,255,123
(D) 受益権総口数	16,562,649,031口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,265円

<注記事項>

- ①期首元本額 13,742,937,614円
 期中追加設定元本額 5,465,175,359円
 期中一部解約元本額 2,645,463,942円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0265円です。

②分配金の計算過程

項 目	2022年2月25日～ 2023年2月24日
費用控除後の配当等収益額	11,514,891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	393,379,192円
収益調整金額	239,895,949円
分配準備積立金額	168,870,503円
当ファンドの分配対象収益額	813,660,535円
1万口当たり収益分配対象額	491円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況（2022年2月25日～2023年2月24日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	12,475,592
受取利息	12,504,614
支払利息	△ 29,022
(B) 有価証券売買損益	426,245,992
売買益	532,654,817
売買損	△106,408,825
(C) 信託報酬等	△ 33,827,501
(D) 当期損益金(A+B+C)	404,894,083
(E) 前期繰越損益金	168,870,503
(F) 追加信託差損益金	△135,509,463
(配当等相当額)	(239,895,949)
(売買損益相当額)	(△375,405,412)
(G) 計(D+E+F)	438,255,123
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	438,255,123
追加信託差損益金	△135,509,463
(配当等相当額)	(239,895,949)
(売買損益相当額)	(△375,405,412)
分配準備積立金	573,764,586

- (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。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型	
信託期間	2028年5月12日まで（2018年3月16日設定）	
運用方針	外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除く先進国の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要運用対象	ベビーファンド	外国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く先進国の株式に直接投資することがあります。
	マザーファンド	MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告に係わる情報

MUKAM 外国株式 インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)

第4期（決算日：2022年5月12日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、お手持ちの「MUKAM 外国株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）」は、去る5月12日に第4期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



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			MSCIコクサイ・インデックス		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(配当込み、 円換算ベース)	期中 騰落率				
(設定日)	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2018年3月16日	10,000	—	—	717,996.52	—	—	—	—	1
1期(2019年5月13日)	10,694	0	6.9	767,126.93	6.8	93.8	3.8	2.5	6,044
2期(2020年5月12日)	10,333	0	△ 3.4	740,810.97	△ 3.4	93.7	4.0	2.4	6,806
3期(2021年5月12日)	15,208	0	47.2	1,089,727.74	47.1	93.4	4.5	2.1	8,930
4期(2022年5月12日)	16,792	0	10.4	1,203,027.98	10.4	94.9	2.9	2.3	10,375

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

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

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

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCI コクサイ・インデックス (配当込み、 円換算ベース)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首)	円	%		%	%	%	%
2021年5月12日	15,208	—	1,089,727.74	—	93.4	4.5	2.1
5月末	15,642	2.9	1,120,295.08	2.8	94.5	3.2	2.1
6月末	16,030	5.4	1,148,321.00	5.4	93.4	4.5	2.1
7月末	16,257	6.9	1,164,636.70	6.9	95.3	2.5	2.2
8月末	16,656	9.5	1,193,049.12	9.5	95.3	2.4	2.2
9月末	16,267	7.0	1,165,043.55	6.9	94.6	3.3	2.2
10月末	17,452	14.8	1,250,124.47	14.7	95.6	1.7	2.2
11月末	17,382	14.3	1,244,334.35	14.2	94.6	2.9	2.2
12月末	18,090	19.0	1,295,472.56	18.9	93.5	4.3	2.2
2022年1月末	16,823	10.6	1,204,715.68	10.6	96.0	1.7	2.3
2月末	16,708	9.9	1,197,243.59	9.9	96.2	1.5	2.2
3月末	18,482	21.5	1,323,494.86	21.5	95.4	1.7	2.3
4月末	17,690	16.3	1,265,687.53	16.1	94.1	3.0	2.5
(期 末)							
2022年5月12日	16,792	10.4	1,203,027.98	10.4	94.9	2.9	2.3

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ10.4%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（10.4%）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の基準価額と同一になるよう指数化しています。

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

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

● 投資環境について

◎ 外国株式市況

外国株式市況は下落しました。

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

◎ 為替市況

米ドル、ユーロは円に対して上昇しました。

- ・ 為替市況は、期首に比べて19.3%の円安・米ドル高、3.4%の円安・ユーロ高となりました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

<MUKAM 外国株式インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)>

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

<外国株式インデックスマザーファンド>

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

(注) マルチファクターモデル

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

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について
<MUKAM 外国株式インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)>

ベンチマークとのカイ離は0.0%程度となりました。

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

- ・ マザーファンド保有による要因
マザーファンド保有による影響は0.2%程度でした。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ その他の要因[※]によるものです。

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

(主なマイナス要因)

- ・ 為替評価差異要因[※]によるものです。

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

●分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。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4期
	2021年5月13日～ 2022年5月12日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	6,792

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

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

○今後の運用方針

<MUKAM 外国株式インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)>

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

<外国株式インデックスマザーファンド>

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年5月13日～2022年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	28 (22) (2) (4)	0.165 (0.132) (0.011) (0.022)	(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) 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 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 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 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	0 (0) (0) (0)	0.003 (0.001) (0.000) (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
(c) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	2 (2) (0)	0.011 (0.011) (0.000)	(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
(d) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (監 査 費 用) (そ の 他)	5 (3) (0) (1)	0.027 (0.021) (0.002) (0.005)	(d) 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 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 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	35	0.206	
期中の平均基準価額は、16,856円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2021年5月13日～2022年5月12日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
外国株式インデックスマザーファンド	千口 739,056	千円 3,400,281	千口 625,945	千円 2,804,693

○株式売買比率

(2021年5月13日～2022年5月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2021年5月13日～2022年5月12日)

利害関係人との取引状況

<MUKAM 外国株式インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)>

該当事項はございません。

<外国株式インデックスマザーファンド>

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

平均保有割合 0.8%

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

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

(2022年5月12日現在)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国株式インデックスマザーファンド	千口 2,256,201	千口 2,369,312	千円 10,374,745

○投資信託財産の構成

(2022年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国株式インデックスマザーファンド	千円 10,374,745	% 99.8
コール・ローン等、その他	16,586	0.2
投資信託財産総額	10,391,331	100.0

(注) 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(1,458,398,210千円)の投資信託財産総額(1,506,538,279千円)に対する比率は96.8%です。

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

1 アメリカドル=129.77円	1 カナダドル=99.93円	1 ユーロ=136.58円	1 イギリスポンド=158.93円
1 スイスフラン=130.55円	1 スウェーデンクローネ=12.89円	1 ノルウェークローネ=13.33円	1 デンマーククローネ=18.36円
1 オーストラリアドル=90.06円	1 ニュージーランドドル=81.68円	1 香港ドル=16.53円	1 シンガポールドル=93.41円
1 イスラエルシェケル=37.6208円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	10,391,331,468
コール・ローン等	9,201,208
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	10,374,745,145
未収入金	7,385,115
(B) 負債	15,517,960
未払解約金	7,077,304
未払信託報酬	8,354,386
未払利息	1
その他未払費用	86,269
(C) 純資産総額(A-B)	10,375,813,508
元本	6,178,921,992
次期繰越損益金	4,196,891,516
(D) 受益権総口数	6,178,921,992口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,792円

<注記事項>

- ①期首元本額 5,872,457,469円
 期中追加設定元本額 1,926,034,547円
 期中一部解約元本額 1,619,570,024円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.6792円です。

○損益の状況 (2021年5月13日～2022年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 2,068
受取利息	20
支払利息	△ 2,088
(B) 有価証券売買損益	563,790,160
売買益	823,043,906
売買損	△ 259,253,746
(C) 信託報酬等	△ 16,387,633
(D) 当期損益金(A+B+C)	547,400,459
(E) 前期繰越損益金	1,752,879,241
(F) 追加信託差損益金	1,896,611,816
(配当等相当額)	(784,671,416)
(売買損益相当額)	(1,111,940,400)
(G) 計(D+E+F)	4,196,891,516
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	4,196,891,516
追加信託差損益金	1,896,611,816
(配当等相当額)	(786,520,699)
(売買損益相当額)	(1,110,091,119)
分配準備積立金	2,300,279,700

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

②分配金の計算過程

項 目	2021年5月13日～ 2022年5月12日
費用控除後の配当等収益額	150,160,868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	397,239,591円
収益調整金額	1,896,611,816円
分配準備積立金額	1,752,879,241円
当ファンドの分配対象収益額	4,196,891,516円
1万口当たり収益分配対象額	6,792円
1万口当たり分配金額	—円
収益分配金金額	—円

外国株式インデックスマザーファンド

《第21期》決算日2022年5月12日

[計算期間：2021年5月13日～2022年5月12日]

「外国株式インデックスマザーファンド」は、5月12日に第21期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第21期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
17期(2018年5月14日)	26,785	10.2	742,711.39	9.9	94.4	3.4	2.2	337,226
18期(2019年5月13日)	27,724	3.5	767,126.93	3.3	93.8	3.8	2.5	437,368
19期(2020年5月12日)	26,834	△ 3.2	740,810.97	△ 3.4	93.7	4.0	2.4	449,841
20期(2021年5月12日)	39,579	47.5	1,089,727.74	47.1	93.4	4.5	2.1	974,704
21期(2022年5月12日)	43,788	10.6	1,203,027.98	10.4	94.9	2.9	2.3	1,466,498

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

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

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、 円換算ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2021年5月12日	円	%		%	%	%	%
5月末	39,579	—	1,089,727.74	—	93.4	4.5	2.1
6月末	40,713	2.9	1,120,295.08	2.8	94.5	3.2	2.1
7月末	41,729	5.4	1,148,321.00	5.4	93.4	4.5	2.1
8月末	42,325	6.9	1,164,636.70	6.9	95.3	2.5	2.2
9月末	43,370	9.6	1,193,049.12	9.5	95.3	2.4	2.2
10月末	43,363	7.0	1,165,043.55	6.9	94.6	3.3	2.2
11月末	45,461	14.9	1,250,124.47	14.7	95.6	1.7	2.2
12月末	45,285	14.4	1,244,334.35	14.2	94.6	2.9	2.2
2022年1月末	47,137	19.1	1,295,472.56	18.9	93.5	4.3	2.2
2月末	43,842	10.8	1,204,715.68	10.6	96.0	1.7	2.3
3月末	43,550	10.0	1,197,243.59	9.9	96.2	1.5	2.2
4月末	48,183	21.7	1,323,494.86	21.5	95.4	1.7	2.3
(期 末) 2022年5月12日	46,125	16.5	1,265,687.53	16.1	94.1	3.0	2.5
	43,788	10.6	1,203,027.98	10.4	94.9	2.9	2.3

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

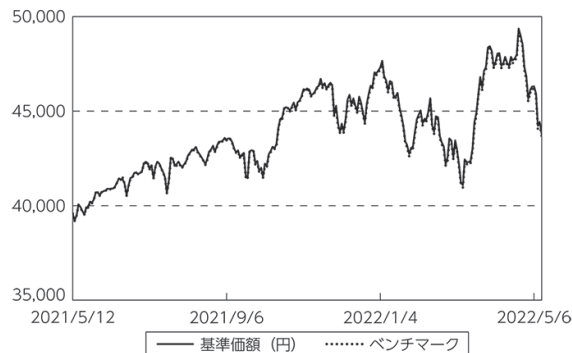
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ10.6%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(10.4%)を0.2%上回りました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

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

● 投資環境について

◎ 外国株式市況

外国株式市況は下落しました。

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

◎ 為替市況

米ドル、ユーロは円に対して上昇しました。

- ・ 為替市況は、期首に比べて19.3%の円安・米ドル高、3.4%の円安・ユーロ高となりました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ M S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式（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をするモデル

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは10.4%の上昇になったため、カ
イ離は0.2%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通り
です。

(主なプラス要因)

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

(主なマイナス要因)

- ・ 為替評価差異要因※によるものです。
※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる為替レ
ートが異なるため生じる要因です。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年5月13日～2022年5月12日)

項 目	当 期		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)	(1)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.002)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	5	0.011	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(5)	(0.011)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	11	0.026	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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)	(9)	(0.021)	
(そ の 他)	(2)	(0.005)	
合 計	17	0.040	
期中の平均基準価額は、43,911円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2021年5月13日～2022年5月12日)

株式

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

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	香港	百株 58,203 (915)	千香港ドル 259,747 (△ 178)	百株 19,023	千香港ドル 34,071
	シンガポール	21,158 (9,367)	千シンガポールドル 16,564 (1,268)	4,244 (9,367)	千シンガポールドル 2,810 (1,914)
	イスラエル	3,822	千イスラエルシエケル 18,513	747	千イスラエルシエケル 3,188

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

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

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
カナダ	千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8	456	—	—
小 計	8	456	—	—
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
GECINA SA	3	510	1	249
KLEPIERRE	24	564	—	—
	(—)	(△ 38)		
COVIVIO	4	302	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7	499	3	224
小 計	40	1,876	5	474
	(—)	(△ 38)		
ユ ー ロ 計	40	1,876	5	474
	(—)	(△ 38)		
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	42	217	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	34	244	—	—
SEGRO PLC	73	904	—	—
小 計	150	1,365	—	—
オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
VICINITY CENTRES	566	1,009	256	461
SCENTRE GROUP	454	1,294	—	—
DEXUS/AU	131	1,416	47	516
	(172)	(1,802)		
GPT GROUP	90	459	—	—
MIRVAC GROUP	290	836	—	—
STOCKLAND	178	834	—	—
DEXUS	—	—	—	—
	(△ 172)	(△ 1,802)		
GOODMAN GROUP	96	2,125	—	—
小 計	1,806	7,976	303	978
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	127	8,981	—	—
小 計	127	8,981	—	—
シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
SUNTEC REIT	—	—	254	361
CDL HOSPITALITY TRUSTS	—	—	—	—
	(18)	(22)		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	226	453	—	—
	(—)	(△ 15)		
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
	(—)	(△ 2)		
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	211	446	—	—
	(79)	(132)		

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	149 (-)	450 (△ 17)	-	-
	小計	587 (98)	1,350 (120)	254	361

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 741,257	百万円 744,969	百万円 -	百万円 -

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

○株式売買比率

(2021年5月13日～2022年5月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	561,405,953千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,239,023,226千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.45

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2021年5月13日～2022年5月12日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A			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	$\frac{D}{C}$	%
為替直物取引	百万円 680,861	百万円 707,260	96.3	百万円 298,244	百万円 314,672	94.8

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

○組入資産の明細

(2022年5月12日現在)

外国株式

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
KONE OYJ-B	554	808	3,488	476,474	資本財	
SAMPO OYJ-A SHS	761	1,139	5,057	690,761	保険	
WARTSILA OYJ ABP	659	1,117	809	110,581	資本財	
ELISA OYJ	237	350	1,881	257,010	電気通信サービス	
NESTE OYJ	681	987	3,890	531,328	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	180	264	949	129,676	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15,698 11	21,041 11	31,224 -	4,264,640 <0.3%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A	268	350	3,435	469,165	食品・飲料・タバコ	
KINGSPAN GROUP PLC	242	341	2,640	360,632	資本財	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	274	399	3,948	539,264	消費者サービス	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	404	604	2,276	310,863	素材	
CRH PLC	1,277	1,749	6,434	878,787	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,468 5	3,445 5	18,734 -	2,558,714 <0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	4,760	6,703	3,023	412,903	公益事業	
JERONIMO MARTINS	425	587	1,154	157,726	食品・生活必需品小売り	
GALP ENERGIA SGPS SA	840	1,122	1,196	163,484	エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,025 3	8,413 3	5,374 -	734,115 <0.1%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	309,456 233	422,186 229	978,492 -	133,642,554 <9.1%>	
(イギリス)			千ギリスポンド			
BARCLAYS PLC	27,987	36,130	5,322	845,838	銀行	
BP PLC	32,582	42,664	17,914	2,847,218	エネルギー	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	114,275	151,720	6,541	1,039,630	銀行	
ASTRAZENECA PLC	2,114	3,342	33,516	5,326,764	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SMITHS GROUP PLC	608	914	1,340	213,079	資本財	
NEXT PLC	220	302	1,879	298,775	小売	
DIAGEO PLC	3,765	5,011	18,841	2,994,489	食品・飲料・タバコ	
BAE SYSTEMS PLC	5,182	6,993	5,208	827,843	資本財	
UNILEVER PLC	4,231	5,543	20,457	3,251,271	家庭用品・パーソナル用品	
TESCO PLC	12,397	16,506	4,554	723,811	食品・生活必需品小売り	
RELX PLC	3,119	4,139	9,517	1,512,552	商業・専門サービス	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,145	1,528	9,757	1,550,810	家庭用品・パーソナル用品	
HALMA PLC	631	849	1,862	295,940	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PRUDENTIAL PLC	4,201	5,929	5,586	887,909	保険	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	9,618	12,984	3,151	500,842	保険	
SAGE GROUP PLC/THE	1,855	2,195	1,469	233,614	ソフトウェア・サービス	
HSBC HOLDINGS PLC	32,804	43,951	21,951	3,488,783	銀行	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	3,697	4,687	15,770	2,506,373	食品・飲料・タバコ	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,038	1,476	1,624	258,154	公益事業	
SCHRODERS PLC	215	290	822	130,777	各種金融	
NATWEST GROUP PLC	7,634	11,812	2,427	385,810	銀行	
BHP GROUP PLC	3,399	-	-	-	素材	
IMPERIAL BRANDS PLC	1,534	2,079	3,523	560,064	食品・飲料・タバコ	
WPP PLC	2,004	2,502	2,403	381,993	メディア・娯楽	
BT GROUP PLC	13,947	19,609	3,460	549,910	電気通信サービス	
SSE PLC	1,681	2,262	4,164	661,850	公益事業	
STANDARD CHARTERED PLC	4,375	5,467	3,124	496,527	銀行	

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

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

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

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

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

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランドドル	千円		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	2,002	2,646	1,897	155,011	運輸	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	924	1,407	2,940	240,217	ヘルスケア機器・サービス	
RYMAN HEALTHCARE LTD	653	990	864	70,579	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	2,072	3,106	1,428	116,720	公益事業	
MERCURY NZ LTD	1,230	1,230	705	57,601	公益事業	
A2 MILK CO LTD	1,153	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	11,009	13,223	9,673	790,096	
(香港)		7	6	—	<0.1%>	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	850	850	3,706	61,260	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	4,388	6,188	33,542	554,459	資本財	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	2,220	3,020	27,391	452,779	不動産	
MTR CORP	2,535	3,765	16,245	268,545	運輸	
HONG KONG & CHINA GAS	18,308	24,313	20,423	337,597	公益事業	
NEW WORLD DEVELOPMENT	2,792	3,622	10,251	169,460	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	2,345	2,910	15,786	260,954	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,988	2,786	90,656	1,498,550	各種金融	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,400	4,940	7,034	116,281	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	2,575	3,860	29,297	484,286	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	2,346	3,196	10,068	166,435	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	2,088	—	—	—	銀行	
HANG SENG BANK LTD	1,265	1,791	24,948	412,400	銀行	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	441	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
SINO LAND CO	4,914	6,734	7,097	117,323	不動産	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	1,010	1,605	8,570	141,673	公益事業	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	5,830	8,080	23,674	391,337	銀行	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	2,230	3,165	31,206	515,850	資本財	
PCCW LTD	5,490	—	—	—	電気通信サービス	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	3,040	4,280	7,361	121,687	資本財	
SANDS CHINA LTD	4,332	5,032	7,900	130,590	消費者サービス	
WYNN MACAU LTD	2,864	—	—	—	消費者サービス	
SJM HOLDINGS LTD	3,650	—	—	—	消費者サービス	
AIA GROUP LTD	19,970	27,914	201,120	3,324,519	保険	
SWIRE PROPERTIES LTD	1,740	3,056	5,671	93,757	不動産	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	3,550	5,210	21,908	362,140	消費者サービス	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	—	4,712	5,861	96,894	小売	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	6,340	8,910	10,014	165,545	電気通信サービス	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	—	2,570	6,617	109,391	運輸	
WH GROUP LTD	15,900	20,990	11,229	185,626	食品・飲料・タバコ	
CK ASSET HOLDINGS LTD	4,178	4,698	24,996	413,200	不動産	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	5,015	5,015	3,891	64,328	公益事業	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	2,570	3,640	13,377	221,121	不動産	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	2,855	4,244	8,471	140,026	食品・飲料・タバコ	
ESR CAYMAN LTD	2,950	4,968	11,823	195,448	不動産	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	145,971	186,066	700,149	11,573,475	
(シンガポール)		33	30	—	<0.8%>	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	5,464	7,907	9,346	873,016	銀行	
CAPITALAND LTD	4,156	—	—	—	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	1,012	1,181	932	87,150	不動産	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	2,919	4,083	13,032	1,217,406	銀行	
KEPPEL CORP LTD	2,389	3,232	2,142	200,160	資本財	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,924	2,688	7,655	715,093	銀行	
VENTURE CORP LTD	461	769	1,341	125,347	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	2,685	3,904	1,557	145,504	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	12,959	18,457	5,223	487,927	電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	2,017	2,828	1,484	138,705	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,336	1,805	1,694	158,320	各種金融	
UOL GROUP LTD	1,040	1,040	733	68,488	不動産	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	3,069	4,043	1,698	158,615	食品・飲料・タバコ	
GENTING SINGAPORE LTD	12,345	12,345	962	89,945	消費者サービス	
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	—	6,408	2,486	232,245	不動産	
小計	株数・金額	53,777	70,691	50,293	4,697,927	
	銘柄数<比率>	14	14	—	<0.3%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
ICL GROUP LTD	1,300	1,691	6,681	251,348	素材	
BANK HAPOALIM BM	1,757	2,511	7,586	285,397	銀行	
NICE LTD	97	154	9,872	371,414	ソフトウェア・サービス	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	2,209	3,271	10,926	411,076	銀行	
ELBIT SYSTEMS LTD	34	55	3,890	146,368	資本財	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	2,044	2,647	5,029	189,209	銀行	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	182	369	4,117	154,917	銀行	
AZRIELI GROUP LTD	91	92	2,400	90,290	不動産	
小計	株数・金額	7,718	10,794	50,504	1,900,024	
	銘柄数<比率>	8	8	—	<0.1%>	
合計	株数・金額	1,797,058	2,452,415	—	1,392,087,914	
	銘柄数<比率>	1,226	1,227	—	<94.9%>	

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

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

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	92	122	3,626	470,562	0.0	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21	33	5,424	703,946	0.0	
PROLOGIS INC	122	170	21,048	2,731,405	0.2	
CAMDEN PROPERTY TRUST	15	24	3,526	457,691	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	46	64	8,160	1,059,006	0.1	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27	40	2,764	358,766	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10	15	4,430	574,916	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	20	30	5,357	695,281	0.0	
WELLTOWER INC	67	101	8,800	1,141,986	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	23	32	3,568	463,090	0.0	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	94	144	2,530	328,431	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	18	26	4,675	606,754	0.0	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	37	—	—	—	—	
REALTY INCOME CORP	56	131	8,376	1,087,025	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	30	34	2,256	292,771	0.0	
SUN COMMUNITIES INC	17	26	4,125	535,415	0.0	
UDR INC	51	72	3,429	445,062	0.0	
VENTAS INC	60	91	4,845	628,858	0.0	
WEYERHAEUSER CO	124	169	6,406	831,307	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	73	104	23,540	3,054,914	0.2	
WP CAREY INC	28	41	3,194	414,536	0.0	
VEREIT INC	36	—	—	—	—	
DUKE REALTY CORP	59	88	4,711	611,402	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	48	69	3,493	453,379	0.0	
EQUINIX INC	14	20	12,949	1,680,395	0.1	
CROWN CASTLE INTL CORP	71	99	16,974	2,202,813	0.2	
EQUITY RESIDENTIAL	60	79	5,878	762,842	0.1	
INVITATION HOMES INC	92	140	5,041	654,295	0.0	
VICI PROPERTIES INC	92	214	5,871	761,938	0.1	
SBA COMMUNICATIONS CORP	18	25	7,958	1,032,812	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	113	170	3,281	425,785	0.0	
PUBLIC STORAGE	26	36	11,352	1,473,200	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	54	74	8,372	1,086,464	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	26	33	1,148	148,982	0.0	
KIMCO REALTY CORP	—	135	2,999	389,283	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	22	32	6,668	865,390	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,781	2,698	226,791	29,430,720	
	銘柄 数 < 比 率 >	35	34	—	< 2.0% >	
(カナダ)				千カナダドル		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14	23	1,075	107,477	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	30	30	652	65,188	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	45	54	1,727	172,666	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 0.0% >	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
GECINA SA	7	9	942	128,753	0.0	
KLEPIERRE	28	53	1,198	163,658	0.0	
COVIVIO	9	13	865	118,272	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	27	1,922	262,516	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	45	102	4,928	673,201	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	4	—	<0.0%>	
(ユーロ…オランダ)						
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	22	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	22	—	—	—	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	—	—	<—%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	67	102	4,928	673,201	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.0%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
BRITISH LAND CO PLC	132	174	852	135,544	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	120	155	1,112	176,754	0.0	
SEGRO PLC	187	260	2,898	460,587	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	439	590	4,863	772,886	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
VICINITY CENTRES	685	995	1,782	160,562	0.0	
SCENTRE GROUP	825	1,280	3,545	319,333	0.0	
DEXUS/AU	—	256	2,732	246,123	0.0	
GPT GROUP	311	401	1,919	172,845	0.0	
MIRVAC GROUP	610	900	1,989	179,189	0.0	
STOCKLAND	364	543	2,096	188,786	0.0	
DEXUS	172	—	—	—	—	
GOODMAN GROUP	281	377	7,359	662,777	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	3,251	4,755	21,425	1,929,617	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	7	—	<0.1%>	
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	335	462	30,762	508,510	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	335	462	30,762	508,510	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
SUNTEC REIT	254	—	—	—	—	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	—	18	23	2,209	0.0	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	478	704	1,162	108,612	0.0	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	383	383	686	64,139	0.0	
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	763	1,054	2,362	220,698	0.0	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	593	742	2,042	190,808	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	2,473	2,904	6,278	586,469	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	8,395	11,568	—	34,074,072	
	銘柄 数 < 比 率 >	57	56	—	<2.3%>	

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引	SP EMINI	28,255	—
		SP/TSE60	1,489	—
		SWISS IX	1,127	—
		EURO ST	4,502	—
		SPI 200	1,395	—
		FTSE100	5,848	—

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

○投資信託財産の構成

(2022年5月12日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
株式	1,392,087,914	92.4
投資証券	34,074,072	2.3
コール・ローン等、その他	80,376,293	5.3
投資信託財産総額	1,506,538,279	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (1,458,398,210千円) の投資信託財産総額 (1,506,538,279千円) に対する比率は96.8%です。

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

1 アメリカドル=129.77円	1 カナダドル=99.93円	1 ユーロ=136.58円	1 イギリスポンド=158.93円
1 スイスフラン=130.55円	1 スウェーデンクローネ=12.89円	1 ノルウェークローネ=13.33円	1 デンマーククローネ=18.36円
1 オーストラリアドル=90.06円	1 ニュージーランドドル=81.68円	1 香港ドル=16.53円	1 シンガポールドル=93.41円
1 イスラエルシェケル=37.6208円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年5月12日現在)

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

<注記事項>

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

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

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

○損益の状況 (2021年5月13日~2022年5月12日)

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

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

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

三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	1,782,940円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	1,735,210円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	1,589,027円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,463,348円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	1,434,803円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	855,152円
三菱UFJ バランスファンドVA30型 (適格機関投資家限定)	623,458円
コアバランス	135,443円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	20,140円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定)	14,993円
合計	334,911,394,157円

[お 知 ら せ]

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型	
信託期間	2028年5月12日まで（2018年3月16日設定）	
運用方針	日本債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の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。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し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	ベビーフンド	日本債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、わが国の公社債に直接投資することがあります。
	マザーファンド	NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	外貨建資産への投資は行いません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告に係わる情報

MUKAM 日本債券 インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)

第4期（決算日：2022年5月12日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
さて、お手持ちの「MUKAM 日本債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）」は、去る5月12日に第4期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



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 (分配落)	標準価額			NOMURA-BPI総合		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		税込分配	み金騰落	中率	期騰落	中率			
(設定日)	円	円		%		%	%	%	百万円
2018年3月16日	10,000	—	—	—	381.60	—	—	—	1
1期(2019年5月13日)	10,159	0	1.6	388.16	1.7	99.8	0.1	3,258	
2期(2020年5月12日)	10,163	0	0.0	388.75	0.2	99.6	0.1	7,645	
3期(2021年5月12日)	10,105	0	△0.6	386.93	△0.5	99.5	0.2	10,058	
4期(2022年5月12日)	9,894	0	△2.1	379.29	△2.0	99.7	0.1	15,802	

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

(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 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2021年5月12日	10,105	% —	386.93	% —	99.5	0.2
5月末	10,096	△0.1	386.62	△0.1	99.4	0.3
6月末	10,101	△0.0	386.90	△0.0	99.4	0.4
7月末	10,151	0.5	388.81	0.5	99.3	0.4
8月末	10,142	0.4	388.46	0.4	99.3	0.4
9月末	10,106	0.0	387.12	0.0	99.4	0.4
10月末	10,094	△0.1	386.72	△0.1	99.3	0.4
11月末	10,117	0.1	387.65	0.2	99.2	0.2
12月末	10,094	△0.1	386.84	△0.0	100.5	0.1
2022年1月末	10,021	△0.8	384.06	△0.7	98.5	0.1
2月末	9,970	△1.3	382.13	△1.2	99.4	0.1
3月末	9,942	△1.6	381.04	△1.5	101.1	0.1
4月末	9,916	△1.9	380.12	△1.8	98.9	0.1
(期 末) 2022年5月12日	9,894	△2.1	379.29	△2.0	99.7	0.1

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.1%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(下落要因)

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

● 投資環境について

◎ 国内債券市況

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

● 当該投資信託のポートフォリオについて

<MUKAM 日本債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)>

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

*一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について
<MUKAM 日本債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)>

ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。

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

- ・ マザーファンド保有による要因
マザーファンド保有による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・ 評価時価差異要因*によるものです。

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

●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4期
	2021年5月13日～ 2022年5月12日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	354

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

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

○今後の運用方針

<MUKAM 日本債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)>

・マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

<日本債券インデックスマザーファンド>

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年5月13日～2022年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
(投 信 会 社)	(8)	(0.077)	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)	(2)	(0.022)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.000	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	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
(c) そ の 他 費 用	0	0.001	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.001)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合 計	11	0.111	
期中の平均基準価額は、10,063円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2021年5月13日～2022年5月12日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
日本債券インデックスマザーファンド	千口 7,843,077	千円 10,534,735	千口 3,338,839	千円 4,428,628

○利害関係人との取引状況等

(2021年5月13日～2022年5月12日)

利害関係人との取引状況

<MUKAM 日本債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)>
該当事項はございません。

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

平均保有割合 2.8%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。
(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

利害関係人の発行する有価証券等

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<日本債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額
公社債	百万円 5,799

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

○組入資産の明細

(2022年5月12日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
日本債券インデックスマザーファンド	千口 7,471,160	千口 11,975,398	千円 15,801,538

○投資信託財産の構成

(2022年5月12日現在)

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
日本債券インデックスマザーファンド	千円 15,801,538	% 99.9
コール・ローン等、その他	10,515	0.1
投資信託財産総額	15,812,053	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	15,812,053,109
コール・ローン等	10,216,804
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	15,801,538,370
未収入金	297,935
(B) 負債	9,523,590
未払信託報酬	9,401,432
未払利息	1
その他未払費用	122,157
(C) 純資産総額(A-B)	15,802,529,519
元本	15,972,151,729
次期繰越損益金	△ 169,622,210
(D) 受益権総口数	15,972,151,729口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,894円

<注記事項>

- ①期首元本額 9,953,583,736円
 期中追加設定元本額 10,480,999,413円
 期中一部解約元本額 4,462,431,420円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9894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169,622,210円です。

③分配金の計算過程

項 目	2021年5月13日～ 2022年5月12日
費用控除後の配当等収益額	83,820,685円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	401,057,955円
分配準備積立金額	81,558,684円
当ファンドの分配対象収益額	566,437,324円
1万口当たり収益分配対象額	354円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況 (2021年5月13日～2022年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 2,053
受取利息	23
支払利息	△ 2,076
(B) 有価証券売買損益	△296,116,535
売買益	59,972,692
売買損	△356,089,227
(C) 信託報酬等	△ 15,507,191
(D) 当期損益金(A+B+C)	△311,625,779
(E) 前期繰越損益金	12,782,567
(F) 追加信託差損益金	129,221,002
(配当等相当額)	(398,298,776)
(売買損益相当額)	(△269,077,774)
(G) 計(D+E+F)	△169,622,210
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△169,622,210
追加信託差損益金	129,221,002
(配当等相当額)	(401,057,955)
(売買損益相当額)	(△271,836,953)
分配準備積立金	165,379,369
繰越損益金	△464,222,581

- (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。

日本債券インデックスマザーファンド

《第21期》決算日2022年5月12日

[計算期間：2021年5月13日～2022年5月12日]

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第21期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第21期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		NOMURA-BPI 総合		債 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
17期(2018年5月14日)	13,283	0.8	381.82	0.8	98.4	0.3	544,273
18期(2019年5月13日)	13,503	1.7	388.16	1.7	99.8	0.1	608,830
19期(2020年5月12日)	13,524	0.2	388.75	0.2	99.6	0.1	630,705
20期(2021年5月12日)	13,462	△0.5	386.93	△0.5	99.5	0.2	314,171
21期(2022年5月12日)	13,195	△2.0	379.29	△2.0	99.7	0.1	666,754

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I 総 合		債 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %
	円	騰 落 率 %		騰 落 率 %		
(期 首) 2021年5月12日	13,462	—	386.93	—	99.5	0.2
5月末	13,450	△0.1	386.62	△0.1	99.4	0.3
6月末	13,459	△0.0	386.90	△0.0	99.4	0.4
7月末	13,526	0.5	388.81	0.5	99.3	0.4
8月末	13,515	0.4	388.46	0.4	99.3	0.4
9月末	13,469	0.1	387.12	0.0	99.4	0.4
10月末	13,454	△0.1	386.72	△0.1	99.3	0.4
11月末	13,486	0.2	387.65	0.2	99.2	0.2
12月末	13,456	△0.0	386.84	△0.0	100.5	0.1
2022年1月末	13,361	△0.8	384.06	△0.7	98.6	0.1
2月末	13,294	△1.2	382.13	△1.2	99.4	0.1
3月末	13,257	△1.5	381.04	△1.5	101.1	0.1
4月末	13,224	△1.8	380.12	△1.8	98.9	0.1
(期 末) 2022年5月12日	13,195	△2.0	379.29	△2.0	99.7	0.1

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

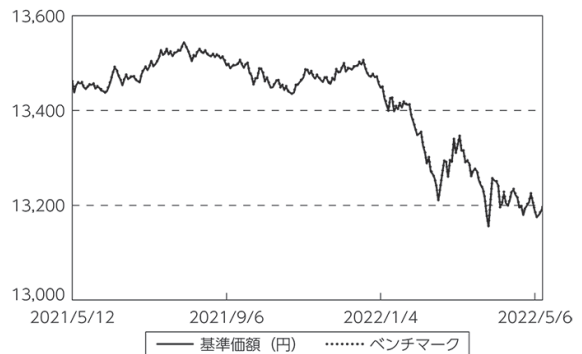
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.0%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−2.0%)とほぼ同程度となりました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(下落要因)

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

● 投資環境について

◎ 国内債券市況

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

● 当該投資信託のポートフォリオについて

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

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは2.0%の下落になったため、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)

- ・ 取引要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・ 評価時価差異要因[※]によるものです。
[※]ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価が異なるため生じる要因です。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年5月13日～2022年5月12日)

項 目	当 期		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、13,413円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○ 売買及び取引の状況

(2021年5月13日～2022年5月12日)

公社債

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

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		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 5,757	百万円 5,911	百万円 -	百万円 -

○利害関係人との取引状況等

(2021年5月13日～2022年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	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 522,104	百万円 72,698	13.9	百万円 151,987	百万円 40,900	26.9

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 2,357	百万円 403	百万円 4,075

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公社債	百万円 5,799

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

○組入資産の明細

(2022年5月12日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
国債証券	536,355,000	554,662,985	83.2	—	56.6	17.4	9.2	
地方債証券	37,976,950	39,181,165	5.9	—	2.4	2.2	1.3	
	(37,976,950)	(39,181,165)	(5.9)	(—)	(2.4)	(2.2)	(1.3)	
特殊債券 (除く金融債)	29,228,207	30,455,697	4.6	—	2.4	1.6	0.6	
	(29,228,207)	(30,455,697)	(4.6)	(—)	(2.4)	(1.6)	(0.6)	
金融債券	2,500,000	2,502,066	0.4	—	—	0.3	0.0	
	(2,500,000)	(2,502,066)	(0.4)	(—)	(—)	(0.3)	(0.0)	
普通社債券	37,600,000	37,849,909	5.7	0.0	1.8	3.4	0.5	
	(37,600,000)	(37,849,909)	(5.7)	(0.0)	(1.8)	(3.4)	(0.5)	
合 計	643,660,157	664,651,823	99.7	0.0	63.1	24.9	11.7	
	(107,305,157)	(109,988,838)	(16.5)	(0.0)	(6.5)	(7.5)	(2.5)	

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第425回利付国債 (2年)	0.005	1,300,000	1,301,222	2023/6/1
第426回利付国債 (2年)	0.005	4,530,000	4,534,348	2023/7/1
第427回利付国債 (2年)	0.005	4,860,000	4,864,714	2023/8/1
第428回利付国債 (2年)	0.005	2,300,000	2,302,392	2023/9/1
第429回利付国債 (2年)	0.005	1,770,000	1,771,964	2023/10/1
第430回利付国債 (2年)	0.005	3,000,000	3,003,510	2023/11/1
第431回利付国債 (2年)	0.005	550,000	550,682	2023/12/1
第432回利付国債 (2年)	0.005	1,600,000	1,601,968	2024/1/1
第433回利付国債 (2年)	0.005	850,000	851,020	2024/2/1
第434回利付国債 (2年)	0.005	5,300,000	5,306,678	2024/3/1
第136回利付国債 (5年)	0.1	2,520,000	2,524,989	2023/6/20
第137回利付国債 (5年)	0.1	3,520,000	3,528,342	2023/9/20
第138回利付国債 (5年)	0.1	6,250,000	6,267,062	2023/12/20
第139回利付国債 (5年)	0.1	2,520,000	2,527,459	2024/3/20
第140回利付国債 (5年)	0.1	3,470,000	3,480,930	2024/6/20
第141回利付国債 (5年)	0.1	4,040,000	4,053,816	2024/9/20
第142回利付国債 (5年)	0.1	310,000	311,171	2024/12/20
第143回利付国債 (5年)	0.1	5,060,000	5,080,948	2025/3/20
第144回利付国債 (5年)	0.1	7,360,000	7,392,016	2025/6/20
第145回利付国債 (5年)	0.1	4,310,000	4,329,524	2025/9/20
第146回利付国債 (5年)	0.1	5,760,000	5,787,014	2025/12/20
第147回利付国債 (5年)	0.005	540,000	540,518	2026/3/20
第148回利付国債 (5年)	0.005	1,750,000	1,751,435	2026/6/20
第149回利付国債 (5年)	0.005	6,950,000	6,952,988	2026/9/20
第150回利付国債 (5年)	0.005	6,280,000	6,281,444	2026/12/20
第151回利付国債 (5年)	0.005	950,000	949,762	2027/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	675,000	903,447	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	1,035,000	1,340,459	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	718,000	934,182	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	1,218,000	1,591,597	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	1,065,000	1,337,501	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	1,230,000	1,517,844	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	1,310,000	1,550,240	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	1,510,000	1,665,530	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	2,430,000	1,990,753	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)	0.9	2,240,000	2,148,764	2057/3/20
第11回利付国債 (40年)	0.8	1,850,000	1,716,115	2058/3/20
第12回利付国債 (40年)	0.5	2,040,000	1,698,973	2059/3/20
第13回利付国債 (40年)	0.5	2,320,000	1,922,305	2060/3/20
第14回利付国債 (40年)	0.7	2,660,000	2,354,339	2061/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	4,690,000	4,735,586	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	3,180,000	3,217,746	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	1,400,000	1,412,824	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	2,920,000	2,951,419	2023/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第333回利付国債 (10年)	0.6	3,950,000	3,998,308	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	3,990,000	4,044,623	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	3,890,000	3,939,986	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	2,460,000	2,494,956	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	1,620,000	1,634,563	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	3,330,000	3,372,291	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	4,020,000	4,074,953	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	3,470,000	3,520,696	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	3,320,000	3,359,541	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	3,720,000	3,737,186	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	4,870,000	4,892,986	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	4,620,000	4,641,113	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	6,340,000	6,369,164	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	5,180,000	5,202,584	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	5,700,000	5,723,199	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	6,020,000	6,040,889	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	5,490,000	5,505,317	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	6,620,000	6,633,504	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)	0.1	4,700,000	4,705,687	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)	0.1	4,150,000	4,151,286	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	5,050,000	5,046,667	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	4,090,000	4,083,047	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)	0.1	4,580,000	4,567,084	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)	0.1	6,230,000	6,202,774	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)	0.1	5,100,000	5,071,287	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)	0.1	6,050,000	6,010,191	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)	0.1	7,170,000	7,112,783	2030/6/20
第360回利付国債 (10年)	0.1	3,440,000	3,408,902	2030/9/20
第361回利付国債 (10年)	0.1	4,130,000	4,088,121	2030/12/20
第362回利付国債 (10年)	0.1	5,210,000	5,153,471	2031/3/20
第363回利付国債 (10年)	0.1	5,430,000	5,364,622	2031/6/20
第364回利付国債 (10年)	0.1	6,480,000	6,396,926	2031/9/20
第365回利付国債 (10年)	0.1	6,460,000	6,375,051	2031/12/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	196,000	233,875	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	268,000	313,980	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	307,000	358,447	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	252,000	309,148	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	238,000	279,797	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	339,000	407,932	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	339,000	407,522	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	302,000	349,124	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	206,000	229,525	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	398,000	431,233	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	237,000	272,362	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	325,000	388,391	2033/9/20

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

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第58回利付国債 (30年)	0.8	2,580,000	2,504,870	2048/3/20
第59回利付国債 (30年)	0.7	1,440,000	1,361,836	2048/6/20
第60回利付国債 (30年)	0.9	1,590,000	1,573,241	2048/9/20
第61回利付国債 (30年)	0.7	1,320,000	1,242,001	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)	0.5	1,370,000	1,222,409	2049/3/20
第63回利付国債 (30年)	0.4	1,760,000	1,523,438	2049/6/20
第64回利付国債 (30年)	0.4	1,450,000	1,252,350	2049/9/20
第65回利付国債 (30年)	0.4	1,330,000	1,148,654	2049/12/20
第66回利付国債 (30年)	0.4	1,160,000	1,000,743	2050/3/20
第67回利付国債 (30年)	0.6	2,500,000	2,270,650	2050/6/20
第68回利付国債 (30年)	0.6	1,520,000	1,379,582	2050/9/20
第69回利付国債 (30年)	0.7	1,720,000	1,601,664	2050/12/20
第70回利付国債 (30年)	0.7	1,910,000	1,775,727	2051/3/20
第71回利付国債 (30年)	0.7	1,860,000	1,726,414	2051/6/20
第72回利付国債 (30年)	0.7	1,960,000	1,816,253	2051/9/20
第73回利付国債 (30年)	0.7	2,030,000	1,878,013	2051/12/20
第74回利付国債 (30年)	1.0	580,000	579,333	2052/3/20
第62回利付国債 (20年)	0.8	560,000	565,443	2023/6/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	617,000	629,815	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	821,000	843,011	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	648,000	668,515	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	240,000	247,212	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)	1.9	80,000	82,907	2024/3/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	1,041,000	1,084,617	2024/3/20
第69回利付国債 (20年)	2.1	120,000	124,804	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	732,000	769,771	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	360,000	377,060	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	1,079,000	1,133,586	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	520,000	547,736	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	698,000	737,053	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	705,000	748,181	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	410,000	432,771	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	370,000	391,604	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)	1.9	310,000	328,689	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	150,000	159,510	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	585,000	623,908	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	250,000	267,092	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	1,082,000	1,159,611	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	395,000	425,363	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	880,000	944,477	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	520,000	562,494	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	1,047,000	1,140,633	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	420,000	455,943	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	1,264,000	1,384,155	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	340,000	370,926	2026/6/20

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

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第135回利付国債 (20年)	1.7	50,000	57,053	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	190,000	214,971	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	5,542,000	6,333,896	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	360,000	404,344	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	310,000	351,242	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	2,717,000	3,108,411	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	1,120,000	1,283,139	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	2,170,000	2,508,411	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	1,840,000	2,091,380	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	940,000	1,058,543	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	2,890,000	3,321,216	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	2,900,000	3,336,682	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	3,060,000	3,490,450	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	2,210,000	2,497,786	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	3,190,000	3,609,676	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	2,840,000	3,181,879	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	3,390,000	3,717,677	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	2,840,000	3,115,792	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	2,520,000	2,797,149	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	3,170,000	3,478,282	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	2,810,000	3,010,043	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	2,910,000	2,881,627	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	3,060,000	2,940,966	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	2,450,000	2,451,641	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	3,020,000	3,059,018	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	2,790,000	2,861,200	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)	0.6	2,170,000	2,191,222	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	3,260,000	3,285,395	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	2,310,000	2,323,259	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	3,190,000	3,152,932	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)	0.5	2,570,000	2,534,097	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	3,590,000	3,643,455	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)	0.5	2,270,000	2,227,301	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)	0.4	2,720,000	2,618,707	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)	0.3	1,890,000	1,784,046	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)	0.3	1,610,000	1,515,010	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)	0.3	2,150,000	2,016,764	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)	0.4	2,660,000	2,533,357	2040/3/20
第173回利付国債 (20年)	0.4	2,530,000	2,404,157	2040/6/20
第174回利付国債 (20年)	0.4	3,550,000	3,363,057	2040/9/20
第175回利付国債 (20年)	0.5	2,460,000	2,367,307	2040/12/20
第176回利付国債 (20年)	0.5	2,860,000	2,744,170	2041/3/20
第177回利付国債 (20年)	0.4	2,470,000	2,321,651	2041/6/20
第178回利付国債 (20年)	0.5	3,270,000	3,126,512	2041/9/20
第179回利付国債 (20年)	0.5	2,900,000	2,766,600	2041/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第180回利付国債（20年）		0.8	550,000	553,789	2042/3/20
小 計			536,355,000	554,662,985	
地方債証券					
第1回東京都公募公債（20年）		1.54	20,000	20,340	2023/6/20
第4回東京都公募公債（20年）		2.22	200,000	210,298	2024/9/20
第5回東京都公募公債（20年）		2.11	100,000	105,909	2025/3/19
第7回東京都公募公債（20年）		2.16	100,000	107,090	2025/9/19
第7回東京都公募公債（30年）		2.51	80,000	102,650	2038/9/17
第10回東京都公募公債（30年）		2.31	100,000	125,864	2039/9/20
第20回東京都公募公債（20年）		2.09	80,000	90,632	2029/9/20
第21回東京都公募公債（20年）		2.19	80,000	91,513	2029/12/20
第28回東京都公募公債（20年）		1.59	100,000	112,670	2033/3/18
第33回東京都公募公債（20年）		0.18	100,000	94,973	2036/6/20
第722回東京都公募公債		0.8	100,000	100,881	2023/6/20
第724回東京都公募公債		0.7	800,000	807,504	2023/9/20
第728回東京都公募公債		0.65	900,000	909,261	2023/12/20
第729回東京都公募公債		0.69	200,000	202,476	2024/3/19
第730回東京都公募公債		0.664	100,000	101,190	2024/3/19
第733回東京都公募公債		0.581	700,000	708,120	2024/6/20
第738回東京都公募公債		0.426	100,000	101,007	2024/12/20
第782回東京都公募公債		0.23	100,000	100,362	2028/6/20
第809回東京都公募公債		0.105	100,000	98,363	2030/9/20
第3回東京都公募公債（20年）		2.26	400,000	416,580	2024/3/19
平成25年度第7回北海道公募公債		0.8	150,000	151,540	2023/8/30
平成26年度第9回北海道公募公債		0.52	100,000	101,198	2024/10/31
平成26年度第13回北海道公募公債		0.461	100,000	101,118	2024/12/26
平成27年度第5回北海道公募公債		0.583	100,000	101,686	2025/6/30
第29回1号宮城県公募公債		0.68	300,000	302,946	2023/10/25
第36回2号宮城県公募公債		0.135	342,000	337,041	2030/10/28
第2回神奈川県公募公債（20年）		2.23	680,000	715,176	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債（30年）		2.87	180,000	236,201	2036/6/20
第4回神奈川県公募公債（30年）		2.62	100,000	129,695	2038/3/19
第27回神奈川県公募公債（20年）		1.398	100,000	111,097	2034/9/20
第234回神奈川県公募公債		0.254	100,000	100,507	2028/6/20
第243回神奈川県公募公債		0.075	100,000	98,548	2029/12/20
第11回大阪府公募公債（20年）		1.693	100,000	113,945	2033/9/27
第153回大阪府公募公債（5年）		0.001	300,000	299,982	2023/8/30
第184回大阪府公募公債（5年）		0.001	120,000	119,707	2026/6/29
第375回大阪府公募公債		0.835	100,000	101,078	2023/8/29
第376回大阪府公募公債		0.82	106,000	107,182	2023/9/27
第378回大阪府公募公債		0.7	100,000	101,076	2023/11/28
第385回大阪府公募公債		0.65	200,000	202,612	2024/6/27
第388回大阪府公募公債		0.54	200,000	202,374	2024/9/27
第391回大阪府公募公債		0.513	210,000	212,631	2024/12/25
第393回大阪府公募公債		0.468	110,000	111,327	2025/2/26

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	%	千円	千円	
地方債証券				
第426回大阪府公募公債	0.172	100,000	100,148	2027/11/29
第435回大阪府公募公債	0.2	130,000	130,000	2028/8/30
第439回大阪府公募公債	0.193	100,000	99,824	2028/12/27
第455回大阪府公募公債	0.116	148,000	145,919	2030/4/26
第460回大阪府公募公債	0.115	194,000	190,818	2030/9/27
第464回大阪府公募公債	0.072	800,000	783,152	2031/1/28
第465回大阪府公募公債	0.12	500,000	491,025	2031/2/25
第467回大阪府公募公債	0.164	500,000	492,905	2031/4/28
第471回大阪府公募公債	0.083	497,000	485,708	2031/8/29
平成26年度第2回京都府公募公債 (15年)	1.071	200,000	211,546	2029/4/27
平成26年度第5回京都府公募公債 (20年)	1.455	100,000	111,728	2034/8/10
第1回兵庫県公募公債 (12年)	1.1	100,000	102,259	2024/6/26
第1回兵庫県公募公債 (15年)	1.66	300,000	320,166	2026/7/29
第2回兵庫県公募公債 (30年)	2.36	90,000	114,241	2040/3/19
第9回兵庫県公募公債 (15年)	1.02	500,000	527,480	2029/7/13
平成25年度第4回兵庫県公募公債	0.82	100,000	101,035	2023/8/18
第27回兵庫県公募公債 (20年)	0.387	200,000	195,640	2036/5/12
令和3年度第8回兵庫県公募公債	0.145	100,000	98,305	2031/10/24
第6回静岡県公募公債 (15年)	1.062	300,000	317,367	2029/6/25
第11回静岡県公募公債 (20年)	1.841	550,000	619,657	2030/10/18
第14回静岡県公募公債 (20年)	1.736	100,000	114,078	2032/6/18
平成25年度第5回静岡県公募公債	0.926	290,000	293,210	2023/7/25
平成25年度第7回静岡県公募公債	0.801	100,000	101,075	2023/9/20
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	159,800	161,410	2023/10/24
平成26年度第3回静岡県公募公債	0.679	800,000	810,584	2024/5/27
令和2年度第15回静岡県公募公債 (5年)	0.01	120,000	119,768	2026/3/19
令和2年度第13回静岡県公募公債 (5年)	0.01	120,000	119,768	2026/3/19
令和3年度第7回静岡県公募公債	0.065	100,000	97,701	2031/6/20
平成20年度第8回愛知県公募公債 (20年)	2.04	200,000	223,994	2028/12/20
平成21年度第5回愛知県公募公債 (20年)	2.28	700,000	800,296	2029/6/20
平成25年度第16回愛知県公募公債	0.665	700,000	707,154	2023/11/28
平成26年度第7回愛知県公募公債	0.591	600,000	607,374	2024/7/29
平成26年度第15回愛知県公募公債	0.48	200,000	202,294	2024/12/20
平成27年度第7回愛知県公募公債	0.548	100,000	101,615	2025/7/28
平成30年度第5回愛知県公募公債	0.195	100,000	100,121	2028/6/29
平成30年度第8回愛知県公募公債	0.255	200,000	200,872	2028/8/31
平成26年度第7回広島県公募公債	0.46	260,000	263,120	2025/3/25
平成28年度第1回広島県公募公債 (20年)	0.414	100,000	97,984	2036/9/26
平成30年度第4回広島県公募公債	0.259	200,000	200,760	2028/11/22
第10回埼玉県公募公債 (20年)	1.94	100,000	113,586	2030/11/12
第14回埼玉県公募公債 (20年)	1.546	200,000	225,442	2034/5/8
第16回埼玉県公募公債 (20年)	1.216	100,000	109,037	2035/8/14
平成26年度第8回埼玉県公募公債	0.335	100,000	100,813	2025/1/28
平成30年度第4回埼玉県公募公債	0.205	100,000	100,181	2028/6/26
令和2年度第1回埼玉県公募公債	0.131	100,000	98,835	2030/4/15

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
令和3年度第2回埼玉県公募公債(5年)	0.01	110,000	109,805	2026/4/15
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.62	70,000	90,429	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.28	80,000	99,840	2038/9/17
平成22年度第2回福岡県公募公債(20年)	2.116	800,000	923,832	2031/2/21
平成25年度第9回福岡県公募公債	0.728	100,000	101,166	2023/12/26
平成26年度第8回福岡県公募公債	0.441	200,000	202,128	2024/12/25
平成26年度第1回福岡県公募公債	0.654	100,000	101,313	2024/6/26
平成27年度第7回福岡県公募公債	0.464	100,000	101,481	2025/12/25
令和2年度第4回福岡県公募公債	0.14	200,000	197,296	2030/9/20
第9回千葉県公募公債(20年)	1.84	80,000	90,140	2030/10/11
平成25年度第1回千葉県公募公債	0.58	82,500	82,952	2023/4/25
平成25年度第8回千葉県公募公債	0.67	100,000	101,014	2023/11/24
平成27年度第3回千葉県公募公債	0.524	200,000	202,990	2025/6/25
平成28年度第3回千葉県公募公債	0.05	400,000	399,824	2026/7/24
令和元年度第6回千葉県公募公債	0.135	100,000	98,945	2030/1/25
平成27年度第2回新潟県公募公債	0.215	100,000	100,606	2026/2/26
平成30年度第3回茨城県公募公債(5年)	0.03	150,000	150,048	2023/8/25
第2回群馬県公募公債(20年)	2.019	100,000	115,309	2031/7/18
第7回群馬県公募公債(20年)	0.313	100,000	96,778	2036/6/13
平成27年度第1回岐阜県公募公債	0.515	300,000	304,725	2025/9/30
令和2年度第2回岐阜県公募公債(5年)	0.02	100,000	99,897	2025/11/25
平成25年度第1回大分県公募公債	0.68	103,250	104,275	2023/10/31
平成27年度第1回大分県公募公債	0.476	203,400	206,406	2025/10/30
第123回共同発行市場公募地方債	0.87	700,000	706,748	2023/6/23
第124回共同発行市場公募地方債	0.91	700,000	707,623	2023/7/25
第125回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	101,049	2023/8/25
第127回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	100,975	2023/10/25
第128回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	302,997	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	200,000	202,540	2024/1/25
第131回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	101,141	2024/2/23
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	101,184	2024/3/25
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	200,000	202,590	2024/4/25
第134回共同発行市場公募地方債	0.674	250,000	253,267	2024/5/24
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	200,000	202,664	2024/6/25
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	300,000	303,801	2024/7/25
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	200,000	202,360	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	400,000	403,292	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	200,000	202,486	2025/3/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	101,078	2025/4/25
第151回共同発行市場公募地方債	0.466	200,000	202,872	2025/10/24
第158回共同発行市場公募地方債	0.08	200,000	200,200	2026/5/25
第185回共同発行市場公募地方債	0.245	300,000	301,119	2028/8/25
第193回共同発行市場公募地方債	0.1	100,000	99,158	2029/4/25
平成30年度第1回福島県公募公債	0.264	100,000	100,414	2028/11/30
平成25年度第1回栃木県公募公債	0.65	100,000	101,000	2023/11/29

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
令和元年度第2回栃木県公募公債	0.09	100,000	98,706	2029/11/29
令和2年度第2回栃木県公募公債	0.135	100,000	98,536	2030/11/27
平成24年度第2回熊本県公募公債	0.8	50,000	50,182	2022/10/26
令和3年度第1回熊本県公募公債 (5年)	0.005	200,000	199,532	2026/7/30
平成25年度第1回浜松市公募公債	0.761	161,000	163,044	2024/1/24
第5回大阪市公募公債 (20年)	2.47	100,000	114,363	2028/9/21
第15回大阪市公募公債 (20年)	2.12	100,000	115,476	2031/1/24
平成26年度第7回大阪市公募公債	0.535	100,000	101,273	2024/11/28
令和3年度第2回大阪市公募公債	0.16	100,000	98,611	2031/5/21
第1回名古屋市公募公債 (20年)	1.99	200,000	206,390	2023/12/20
第1回名古屋市公募公債 (30年)	2.53	100,000	125,194	2035/3/20
第9回名古屋市公募公債 (20年)	2.07	100,000	112,192	2028/12/20
第9回名古屋市公募公債 (30年)	2.095	90,000	111,076	2042/9/19
第28回名古屋市公募公債 (5年)	0.01	500,000	499,205	2025/12/19
第491回名古屋市公募公債	0.587	400,000	406,792	2025/6/19
第511回名古屋市公募公債	0.075	100,000	98,419	2030/3/27
第1回京都市公募公債 (15年)	0.781	100,000	103,896	2030/12/20
第3回京都市公募公債 (20年)	2.09	100,000	107,345	2025/12/19
第5回京都市公募公債 (20年)	2.36	50,000	55,265	2026/12/18
平成18年度第3回神戸市公募公債 (20年)	2.54	110,000	121,192	2026/6/19
平成20年度第24回神戸市公募公債 (20年)	2.08	200,000	224,516	2028/12/20
平成22年度第4回神戸市公募公債	1.895	100,000	113,011	2030/9/13
第5回横浜市公募公債 (20年)	2.17	100,000	106,612	2025/6/20
第7回横浜市公募公債 (20年)	2.06	450,000	482,566	2025/12/19
平成27年度第2回横浜市公募公債	0.568	200,000	203,270	2025/6/16
平成27年度第3回横浜市公募公債	0.524	400,000	406,264	2025/8/18
平成27年度第4回横浜市公募公債	0.486	300,000	304,503	2025/10/20
第27回横浜市公募公債 (20年)	1.599	100,000	112,895	2033/5/20
第33回横浜市公募公債 (20年)	0.323	100,000	96,996	2036/4/28
第35回横浜市公募公債 (20年)	0.443	500,000	491,475	2036/10/28
第54回横浜市公募公債 (5年)	0.02	300,000	299,691	2025/11/25
平成22年度第8回札幌市公募公債 (30年)	2.277	80,000	100,581	2040/9/20
平成23年度第3回札幌市公募公債	1.944	100,000	114,634	2031/7/29
令和元年度第2回札幌市公募公債 (5年)	0.01	600,000	599,682	2024/6/20
令和2年度第7回札幌市公募公債	0.115	200,000	196,634	2030/12/20
令和3年度第2回札幌市公募公債 (5年)	0.01	100,000	99,795	2026/6/19
第7回川崎市公募公債 (20年)	2.08	100,000	113,023	2029/7/17
第12回川崎市公募公債 (20年)	2.04	100,000	115,236	2031/5/30
第62回川崎市公募公債 (5年)	0.005	490,000	488,853	2026/7/30
第17回北九州市公募公債 (20年)	1.529	100,000	112,451	2034/6/20
平成25年度第3回北九州市公募公債	0.728	100,000	101,166	2023/12/26
平成25年度第4回福岡市公募公債	0.68	50,000	50,490	2023/10/24
平成30年度第11回福岡市公募公債 (5年)	0.02	100,000	99,988	2024/3/28
平成25年度第2回広島市公募公債	0.72	100,000	101,155	2023/12/27
令和3年度第4回千葉市公募公債	0.135	100,000	98,180	2031/12/24

銘柄	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
平成26年度第4回福井県公募公債		0.425	100,000	101,133	2025/4/24
令和2年度第2回徳島県公募公債		0.135	100,000	98,536	2030/11/27
平成28年度第1回山梨県公募公債		0.06	200,000	199,950	2026/10/30
平成30年度第1回山梨県公募公債		0.289	100,000	100,600	2028/10/30
令和2年度第1回山梨県公募公債		0.135	700,000	689,843	2030/10/30
第96回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債		2.34	100,000	112,631	2028/12/20
小 計			37,976,950	39,181,165	
特殊債券(除く金融債)					
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.3	100,000	126,108	2040/2/29
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.2	100,000	124,514	2040/5/31
第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	100,000	117,825	2040/8/31
第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	100,000	113,446	2030/9/30
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	100,000	113,969	2031/10/31
第158回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.0	100,000	121,419	2042/2/28
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.737	100,000	114,042	2032/4/30
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.83	100,000	118,394	2042/5/30
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.605	340,000	342,254	2023/5/31
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.882	100,000	101,028	2023/6/30
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.911	323,000	326,685	2023/7/31
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.801	308,000	311,517	2023/9/29
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.693	208,000	210,433	2023/12/28
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.645	100,000	101,229	2024/3/29
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.669	100,000	101,334	2024/4/30
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.644	100,000	101,360	2024/6/28
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.601	124,000	125,640	2024/7/31
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.39	100,000	111,151	2034/8/31
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.495	883,000	893,922	2024/11/29
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.466	100,000	101,198	2024/12/27
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.45	200,000	202,534	2025/3/31
第247回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.509	133,000	135,024	2025/5/30
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.484	101,000	102,486	2025/6/30
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.557	100,000	101,747	2025/7/31
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.32	100,000	101,098	2026/1/30
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.145	200,000	200,912	2026/2/27
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.668	17,000	17,099	2023/3/17
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.605	36,000	36,229	2023/5/16
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.835	100,000	101,081	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.693	465,000	470,347	2023/12/18
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.645	300,000	303,639	2024/3/15
第59回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.669	315,000	319,095	2024/4/12
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.644	100,000	101,391	2024/6/14
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.544	240,000	242,997	2024/9/13
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.484	302,000	306,424	2025/6/13
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.381	150,000	151,909	2025/11/18
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.02	674,000	673,871	2026/3/13

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第83回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	102,000	101,959	2026/4/17
第100回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.09	225,000	224,939	2027/9/17
第16回政府保証民間都市開発債券	0.699	90,000	90,938	2023/10/20
第232回政府保証預金保険機構債券	0.1	400,000	400,984	2024/12/10
第4回政府保証新関西国際空港債券	0.484	104,000	105,523	2025/6/13
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	20,230	2023/12/18
第26回政府保証日本政策投資銀行	0.466	100,000	101,193	2024/12/12
第6回神奈川県住宅供給公社債券	0.215	100,000	98,563	2029/4/23
第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	2.23	30,000	33,195	2027/5/28
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.99	100,000	140,728	2045/9/20
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.45	140,000	152,887	2026/3/19
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.35	300,000	329,670	2026/9/18
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.87	30,000	41,935	2046/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.75	200,000	274,512	2047/3/20
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.28	200,000	221,446	2027/4/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.67	110,000	149,048	2047/3/20
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.39	300,000	335,283	2027/7/20
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.34	200,000	223,814	2027/10/20
第28回道路債券(財投機関債)	2.83	100,000	126,529	2033/12/20
第33回道路債券(財投機関債)	2.91	300,000	384,714	2034/6/20
第38回道路債券(財投機関債)	2.26	200,000	210,438	2024/9/20
第42回道路債券(財投機関債)	2.22	200,000	212,408	2025/3/21
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.9	150,000	172,306	2032/3/19
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.773	100,000	113,870	2032/9/17
第110回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.94	100,000	101,018	2023/6/20
第121回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.689	100,000	101,067	2023/12/20
第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.523	100,000	111,084	2044/12/20
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.133	300,000	322,158	2035/3/20
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.974	100,000	121,780	2055/3/19
第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.284	100,000	109,337	2035/9/20
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.266	50,000	57,017	2029/6/28
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)	2.95	100,000	128,443	2034/3/24
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	103,223	2023/12/20
第7回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.2	100,000	104,023	2024/3/22
第8回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.25	100,000	104,115	2024/3/22
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	52,698	2024/9/24
第11回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.851	100,000	112,648	2030/10/28
第12回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	300,000	317,034	2025/3/24
第13回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.132	100,000	115,353	2031/1/28
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.187	80,000	92,991	2031/4/28
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.846	80,000	90,936	2031/8/28
第17回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.39	150,000	163,509	2026/3/24
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	100,000	113,167	2032/7/28
第24回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.29	100,000	112,392	2028/4/25
第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.785	50,000	57,173	2033/1/28

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第44回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.298	100,000	109,627	2035/6/28
F54回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.588	200,000	205,744	2024/3/19
第54回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.73	200,000	202,180	2023/11/28
第60回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.729	200,000	202,792	2024/5/28
第77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.491	300,000	304,530	2025/10/28
F90回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.609	100,000	108,234	2028/1/28
F104回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.314	100,000	103,570	2025/3/7
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	70,000	77,577	2031/7/30
F151回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.348	100,000	106,631	2027/11/5
F203回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.063	200,000	210,254	2028/2/28
F234回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.605	100,000	113,446	2035/4/27
第27回首都高速道路	0.06	100,000	99,949	2025/12/19
第24回阪神高速道路	0.04	200,000	199,880	2025/3/19
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167	80,000	91,487	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911	80,000	90,517	2030/10/29
第5回本州四国連絡橋債券(財投機関債)	2.23	200,000	211,304	2024/12/20
第48回福祉医療機構債券(財投機関債)	0.175	400,000	401,832	2026/12/18
第54回福祉医療機構債券(財投機関債)	0.225	100,000	100,120	2028/6/20
第4回中部国際空港(財投機関債)	0.305	200,000	201,806	2027/2/22
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	30,735	30,957	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	10,648	10,778	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	34,647	35,354	2042/6/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	10,742	10,901	2037/11/10
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.18	44,913	44,731	2032/5/10
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.16	47,521	47,360	2033/1/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	10,702	10,847	2042/8/10
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.08	56,412	56,097	2033/4/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	10,622	10,779	2042/10/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.94	11,501	11,721	2038/11/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	22,158	22,498	2042/12/10
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.13	76,698	76,224	2034/6/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	10,194	10,264	2037/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.24	12,268	12,643	2039/5/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	10,511	10,632	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	23,678	24,237	2043/5/10
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	21,818	23,148	2044/10/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	10,105	10,159	2040/6/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	22,275	23,592	2044/12/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	21,982	22,213	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	22,280	23,519	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	21,558	22,788	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	41,984	44,170	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	11,097	11,255	2040/12/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	43,200	45,433	2045/6/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61	23,428	24,594	2045/7/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	32,010	32,378	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	45,860	47,656	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.09	11,443	11,678	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	30,921	31,166	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.6	26,600	27,990	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.3	20,956	21,292	2041/7/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	102,536	108,276	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	64,125	67,436	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.92	19,240	20,223	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	39,662	41,660	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	40,352	42,305	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	42,464	44,371	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.21	10,410	10,545	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	44,622	46,679	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.18	23,530	24,206	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	47,910	50,057	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	49,926	52,163	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.42	28,330	29,591	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	28,630	29,928	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	61,884	64,772	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	64,376	67,144	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.26	65,142	67,750	2047/6/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	35,803	37,198	2047/7/10
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.11	35,721	36,965	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	114,477	118,613	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.25	35,047	36,495	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.32	39,401	41,223	2048/7/10
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	33,841	35,171	2048/9/10
第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.751	30,000	32,076	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.08	34,855	36,030	2048/11/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	38,865	40,185	2049/2/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	41,130	42,477	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	162,300	167,386	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.02	83,770	86,442	2049/6/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.863	100,000	114,042	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.95	44,974	46,253	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	139,185	142,574	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	48,841	49,683	2050/1/10
第93回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.557	200,000	213,592	2026/12/18
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.81	60,922	62,218	2050/4/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	58,033	59,032	2050/5/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.9	59,540	61,086	2050/7/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.892	200,000	229,844	2032/4/16
第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.441	100,000	106,551	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.86	62,732	64,202	2050/12/10

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.54	130,872	131,362	2051/3/10
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	286,276	284,254	2051/6/10
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.19	220,035	216,175	2051/8/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	152,052	151,747	2052/2/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	530,250	529,825	2052/3/10
第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.227	130,000	161,475	2042/9/19
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	233,616	232,952	2052/7/10
第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.801	100,000	114,149	2032/9/17
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	78,131	77,764	2052/10/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	79,915	79,385	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	79,103	78,704	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	161,548	161,073	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	160,284	159,455	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	80,454	79,887	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	80,383	79,843	2053/5/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	244,374	243,039	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	81,800	81,204	2053/7/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	82,992	82,644	2053/9/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	166,816	166,385	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	165,850	165,777	2053/11/10
第143回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.192	100,000	106,171	2028/10/20
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	174,786	170,959	2054/8/10
第149回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	0.704	200,000	202,472	2024/3/19
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	267,348	261,348	2054/11/10
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.26	180,278	176,827	2054/12/10
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	90,157	88,917	2055/1/10
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	93,136	92,023	2055/9/10
第161回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	0.713	100,000	103,057	2027/6/18
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	188,534	186,024	2055/11/10
第164回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	0.514	100,000	101,519	2025/8/20
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	94,657	93,427	2056/2/10
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	287,736	285,215	2056/5/10
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	193,034	191,134	2056/6/10
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	193,626	191,223	2056/7/10
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	195,006	192,020	2056/8/10
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	97,462	95,954	2056/9/10
第174回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.129	180,000	193,120	2035/11/20
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	98,602	97,544	2056/12/10
第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	197,794	194,898	2057/1/10
第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	198,310	196,743	2057/2/10
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	99,349	99,357	2057/3/10
第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	199,598	199,168	2057/4/10
第180回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	100,000	100,102	2057/5/10
第194回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	0.075	100,000	99,996	2026/10/20
第203回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	0.24	100,000	100,748	2027/3/19

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第231回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.06	100,000	100,044	2023/6/20
第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)		2.04	50,000	53,096	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)		1.991	70,000	80,223	2031/6/13
第83回東日本高速道路		0.05	400,000	399,264	2026/6/19
第78回中日本高速道路		0.06	300,000	300,057	2024/5/29
第29回西日本高速道路		0.31	200,000	201,762	2026/2/12
第56回西日本高速道路		0.06	900,000	899,874	2025/9/19
第61回西日本高速道路		0.04	400,000	399,100	2026/6/19
第72回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		0.905	100,000	104,539	2029/11/27
小	計		29,228,207	30,455,697	
金融債券					
い第832号商工債券		0.06	100,000	99,905	2024/9/27
い第843号商工債券		0.12	200,000	199,972	2025/8/27
い第848号商工債券		0.1	100,000	99,872	2026/1/27
い第850号商工債券		0.1	300,000	299,421	2026/3/27
い第852号商工債券		0.09	100,000	99,759	2026/5/27
い第854号商工債券		0.08	400,000	398,736	2026/7/27
い第857号商工債券		0.09	100,000	99,665	2026/10/27
い第818号農林債券		0.08	200,000	200,108	2023/7/27
第376回信金中金債		0.05	100,000	99,768	2026/3/27
第11号商工債券(10年)		0.66	300,000	303,987	2024/9/20
第256号商工債券(3年)		0.04	300,000	299,691	2024/5/27
第257号商工債券(3年)		0.04	200,000	199,766	2024/6/27
第2回信金中金債(10年)		0.52	100,000	101,416	2025/9/26
小	計		2,500,000	2,502,066	
普通社債券					
第548回東京電力		2.347	100,000	109,427	2028/9/29
第567回東京電力		1.958	100,000	107,594	2030/7/29
第499回中部電力		1.194	100,000	101,195	2023/6/23
第508回関西電力		0.455	200,000	200,892	2027/4/23
第510回関西電力		0.49	500,000	502,930	2027/7/23
第511回関西電力		0.41	100,000	100,131	2027/9/17
第518回関西電力		0.44	200,000	200,060	2028/6/20
第524回関西電力		0.514	200,000	200,740	2028/10/25
第532回関西電力		0.18	100,000	99,999	2024/7/25
第543回関西電力		0.001	200,000	199,100	2024/10/25
第381回中国電力		0.953	100,000	101,572	2024/4/25
第385回中国電力		0.728	100,000	101,699	2025/7/25
第393回中国電力		0.26	100,000	99,797	2026/11/25
第400回中国電力		0.34	200,000	199,894	2027/9/24
第409回中国電力		0.4	200,000	199,876	2028/9/25
第304回北陸電力		0.989	100,000	101,239	2023/10/25
第307回北陸電力		1.055	100,000	103,282	2026/6/25
第322回北陸電力		0.38	100,000	100,176	2027/6/25
第485回東北電力		0.25	100,000	99,977	2026/7/24

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第494回東北電力	0.425	200,000	200,602	2027/6/25
第529回東北電力	0.07	500,000	496,575	2026/4/24
第449回九州電力	0.43	300,000	301,341	2027/4/23
第468回九州電力	0.435	100,000	99,939	2028/8/25
第471回九州電力	0.455	300,000	299,907	2028/11/24
第484回九州電力	0.375	400,000	395,660	2029/11/22
第493回九州電力	0.1	400,000	397,760	2026/5/25
第29回沖縄電力	0.001	200,000	199,558	2024/6/25
第12回新関西国際空港	1.067	100,000	105,596	2029/9/20
第27回新関西国際空港	0.05	100,000	99,846	2026/3/19
第32回成田国際空港	0.22	100,000	99,802	2029/1/29
第1回国際石油開発帝石	0.08	100,000	99,776	2026/3/16
第21回大和ハウス工業	0.001	300,000	299,658	2023/9/15
第10回明治ホールディングス (サステナビリティ)	0.05	200,000	198,800	2026/4/23
第16回アサヒグループホールディングス	0.08	100,000	99,549	2026/3/13
第5回サントリー食品インターナショナル	0.001	200,000	199,328	2024/7/8
第22回味の素	0.305	100,000	100,454	2026/3/2
第3回 キューピー	0.23	100,000	99,856	2026/2/13
第13回日本たばこ産業	0.355	200,000	199,384	2028/9/8
第6回ヒューリック	0.494	400,000	399,068	2028/10/20
第4回トヨタ紡織	0.21	200,000	199,708	2024/12/20
第9回クラレ	0.34	100,000	100,256	2027/4/30
第16回旭化成	0.001	200,000	199,492	2024/12/9
第42回王子ホールディングス	0.08	300,000	298,809	2026/3/24
第11回イビデン	0.001	200,000	199,484	2024/9/9
第4回野村総合研究所	0.34	100,000	100,047	2028/3/23
第6回花王	0.13	200,000	199,702	2025/9/19
第19回オリエンタルランド	0.001	300,000	299,301	2024/9/2
第6回ヤフー	0.35	100,000	99,945	2024/12/6
第12回ヤフー	0.37	200,000	198,820	2026/7/31
第19回Zホールディングス	0.35	400,000	397,312	2026/7/28
第5回荒川化学工業 (サステナビリティ)	0.18	100,000	99,606	2026/11/26
第11回ブリヂストン	0.295	300,000	299,961	2027/4/21
第12回日本電気硝子	0.26	100,000	99,366	2028/2/25
第4回新日本製鐵	0.375	200,000	200,122	2027/5/20
第19回日立製作所	0.16	100,000	99,380	2027/3/12
第22回パナソニック	0.29	100,000	99,384	2027/12/24
第18回デンソー	0.315	300,000	299,226	2028/3/17
第18回J A 三井リース	0.16	100,000	99,494	2026/3/12
第10回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	0.03	100,000	99,498	2024/10/21
第26回トヨタ自動車 (サステナビリティ)	0.05	800,000	797,848	2026/3/18
第1回明治安田生命2018基金	0.315	200,000	199,958	2023/9/25
第1回明治安田生命2019基金	0.29	200,000	199,726	2024/8/2
第63回三井物産	2.37	400,000	441,048	2027/4/23
第51回住友商事	1.241	100,000	105,178	2029/4/23

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

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第42回東海旅客鉄道	2.312	100,000	113,439	2029/4/24
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	111,367	2030/10/25
第83回東海旅客鉄道	0.001	400,000	399,516	2023/9/19
第2回東京地下鉄	2.36	500,000	523,700	2024/6/20
第28回東京地下鉄	0.25	300,000	299,466	2028/5/24
第50回阪急阪神ホールディングス	0.345	200,000	199,610	2028/9/13
第58回阪急阪神ホールディングス	0.09	200,000	199,182	2026/2/26
第64回名古屋鉄道	0.09	200,000	198,864	2026/3/23
第8回ニッコンホールディングス	0.23	100,000	99,820	2024/9/18
第1回横浜高速鉄道	0.62	300,000	303,501	2026/2/25
第9回九州旅客鉄道	0.001	200,000	199,612	2024/12/9
第9回ソフトバンク	0.48	300,000	298,512	2027/12/3
第16回ソフトバンク	0.52	300,000	291,765	2031/10/10
第50回電源開発	0.415	200,000	201,148	2027/7/20
第57回電源開発	0.355	100,000	99,509	2028/7/20
第59回電源開発	0.414	300,000	299,400	2028/9/20
第64回電源開発	0.405	600,000	596,940	2029/4/20
第67回電源開発	0.24	200,000	196,092	2029/9/20
第6回東京電力パワーグリッド	0.85	100,000	101,299	2027/8/31
第13回東京電力パワーグリッド	0.77	300,000	301,596	2028/4/19
第15回東京電力パワーグリッド	0.89	100,000	100,000	2030/7/24
第16回東京電力パワーグリッド	0.57	200,000	200,922	2025/9/12
第25回東京電力パワーグリッド	1.02	100,000	101,609	2029/4/24
第28回東京電力パワーグリッド	1.01	400,000	405,668	2029/7/10
第31回東京電力パワーグリッド	0.98	300,000	303,129	2029/10/9
第33回東京電力パワーグリッド	0.68	200,000	201,260	2027/1/27
第35回東京電力パワーグリッド	1.2	100,000	102,451	2030/4/23
第38回東京電力パワーグリッド	0.58	400,000	402,004	2025/7/16
第39回東京電力パワーグリッド	1.08	400,000	406,100	2030/7/16
第41回東京電力パワーグリッド	0.64	100,000	100,526	2026/10/8
第44回東京電力パワーグリッド	0.4	200,000	199,356	2026/4/22
第47回東京電力パワーグリッド	0.68	200,000	195,730	2031/8/29
第49回東京電力パワーグリッド	0.6	200,000	200,264	2027/4/26
第1回東京電力リニューアブルパワー (グリーン)	0.18	200,000	199,298	2024/9/9
第13回広島ガス	0.405	200,000	199,122	2028/9/13
第7回ファーストリテイリング	0.405	100,000	100,347	2028/6/6
第19回フランス相互信用連合銀行	0.999	100,000	101,844	2025/10/15
第26回フランス相互信用連合銀行	0.443	100,000	100,201	2023/10/12
第29回フランス相互信用連合銀行	0.25	200,000	199,172	2024/10/10
第35回フランス相互信用連合銀行	0.279	500,000	494,090	2026/10/21
第6回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	1.258	200,000	202,646	2024/1/25
第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.217	200,000	199,912	2023/1/25
第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.302	100,000	98,391	2026/12/16
第1回サタンデール銀行 (2019)	0.463	500,000	498,485	2024/12/5

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券 第17回ナショナル・オーストラリア銀行	% 0.44	千円 100,000	千円 100,100	2024/1/23
小 計		37,600,000	37,849,909	
合 計		643,660,157	664,651,823	

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内 債券先物取引 10年国債標準物	百万円 597	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2022年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 664,651,823	% 99.4
コール・ローン等、その他	3,796,001	0.6
投資信託財産総額	668,447,824	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年5月12日現在)

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

<注記事項>

- ①期首元本額 233,376,402,849円
期中追加設定元本額 338,061,364,572円
期中一部解約元本額 66,136,647,299円
また、1口当たり純資産額は、期末13,195円です。

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

MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	132,821,900,949円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	80,608,730,907円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	49,039,170,647円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	37,303,791,268円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	22,488,923,721円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	12,587,972,410円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	12,181,739,242円
MUKAM 日本債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	11,975,398,538円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	11,448,244,609円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	10,053,277,239円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	8,123,809,275円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	7,846,043,338円
eMAXIS 国内債券インデックス	6,744,612,215円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	6,405,791,117円
つみたて8資産均等バランス	5,712,464,887円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	4,692,511,185円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	4,602,602,433円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,419,966,792円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	4,300,357,035円
国内債券セレクション(ラップ向け)	4,297,241,132円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,267,658,124円
ラップ向けインデックスf 国内債券	4,199,720,600円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2(適格機関投資家限定)	4,129,355,212円

○損益の状況 (2021年5月13日~2022年5月12日)

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

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

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

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

三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	4,058,372,038円
eMAXIS バランス (8資産均等型)	3,468,061,838円
国内債券インデックスファンド (ラップ向け)	3,243,481,473円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	3,014,921,473円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	2,899,656,932円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	2,687,965,605円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	2,413,154,659円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	2,240,064,768円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	2,109,627,765円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	2,012,122,340円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (成長型)	1,927,858,584円
つみたて4資産均等バランス	1,825,124,141円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	1,815,785,887円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	1,666,793,821円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)	1,540,080,866円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	1,535,428,719円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	1,449,641,249円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	1,383,210,986円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	1,223,727,192円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	905,977,226円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	875,561,368円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	788,469,826円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	732,480,950円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	708,480,827円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	701,866,500円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	481,939,883円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	470,894,297円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	465,944,536円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	464,649,283円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	464,386,656円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	464,386,656円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	464,041,874円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	459,282,676円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	459,088,162円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	436,099,602円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	432,299,569円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	426,375,402円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	390,689,148円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	257,816,621円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	233,069,692円
eMAXIS 最適化バランス (マイフワード)	212,736,610円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)	194,552,846円
eMAXIS バランス (波乗り型)	193,760,387円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)	158,782,787円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	105,076,539円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	89,536,855円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	80,245,393円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	74,780,973円
eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	69,278,086円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	56,243,620円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	42,139,087円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	28,604,113円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	27,674,720円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	27,349,665円

三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	16,917,380円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	16,879,532円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	12,163,581円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	10,389,033円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	8,375,940円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	8,235,518円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	6,815,181円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	3,352,099円
コアバランス	2,330,848円
三菱UFJ バランスファンドVA30型 (適格機関投資家限定)	2,196,883円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	2,007,378円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	226,600円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	175,041円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定)	129,462円
合計	505,301,120,122円

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	2028年5月12日まで（2018年3月16日設定）	
運用方針	<p>外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界各国の公社債に投資を行い、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す。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。</p> <p>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。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。</p>	
主要運用対象	ベビーフンド	外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界各国の公社債に直接投資することがあります。
	マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告に係わる情報

MUKAM 外国債券 インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)

第4期（決算日：2022年5月12日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、お手持ちの「MUKAM 外国債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）」は、去る5月12日に第4期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



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 (分配落)	標準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		税込分配	み入金	期騰落	中率	期騰落			
(設定日)	円		円		%		%		百万円
2018年3月16日	10,000		—		—	111,246.64	—	—	1
1期(2019年5月13日)	10,221		0		2.2	113,996.81	2.5	98.7	3,430
2期(2020年5月12日)	10,663		0		4.3	119,287.72	4.6	98.6	5,630
3期(2021年5月12日)	11,303		0		6.0	126,522.01	6.1	97.7	5,893
4期(2022年5月12日)	11,534		0		2.0	129,384.40	2.3	98.7	6,305

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

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

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

(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		FTSE世界国債インデックス (除く日本、 円換算ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2021年5月12日	円	%		%	%	%
	11,303	—	126,522.01	—	97.7	—
5月末	11,471	1.5	128,227.80	1.3	97.1	—
6月末	11,450	1.3	128,117.08	1.3	97.6	—
7月末	11,528	2.0	128,989.36	2.0	97.8	—
8月末	11,524	2.0	128,937.19	1.9	97.5	—
9月末	11,443	1.2	128,115.00	1.3	97.4	—
10月末	11,688	3.4	130,788.36	3.4	97.6	—
11月末	11,557	2.2	129,217.14	2.1	97.5	—
12月末	11,627	2.9	130,157.13	2.9	98.0	—
2022年1月末	11,424	1.1	128,015.91	1.2	97.3	—
2月末	11,217	△0.8	125,907.80	△0.5	98.0	—
3月末	11,585	2.5	129,775.21	2.6	97.8	—
4月末	11,609	2.7	129,955.37	2.7	97.7	—
(期 末) 2022年5月12日						
	11,534	2.0	129,384.40	2.3	98.7	—

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.0%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(2.3%)を0.3%下回りました。

基準価額等の推移



(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、金融政策引き締め等を背景とした金利上昇により、期首との比較では下落しました。

◎ 為替市況

・期首に比べて米ドル、ユーロは対円で上昇しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

<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)>

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

<外国債券インデックスマザーファンド>

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

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

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について
<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)>

ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.3\%$ 程度となりました。

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

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

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

・ありません。

(主なマイナス要因)

・取引要因によるものです。

●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4期
	2021年5月13日～ 2022年5月12日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,533

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

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

○今後の運用方針

<MUKAM 外国債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)>

・マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

<外国債券インデックスマザーファンド>

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年5月13日～2022年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
(投 信 会 社)	(11)	(0.099)	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)	(0.022)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	2	0.013	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(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
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	17	0.145	
期中の平均基準価額は、11,491円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

○売買及び取引の状況

(2021年5月13日～2022年5月12日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券インデックスマザーファンド	千口 594,263	千円 1,381,724	千口 472,043	千円 1,087,084

○利害関係人との取引状況等

(2021年5月13日～2022年5月12日)

利害関係人との取引状況

<MUKAM 外国債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)>
該当事項はございません。

<外国債券インデックスマザーファンド>

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

平均保有割合 2.4%

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

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

○組入資産の明細

(2022年5月12日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券インデックスマザーファンド	千口 2,603,395	千口 2,725,615	千円 6,305,166

○投資信託財産の構成

(2022年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックスマザーファンド	千円 6,305,166	% 99.5
コール・ローン等、その他	34,650	0.5
投資信託財産総額	6,339,816	100.0

(注) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産 (301,284,927千円) の投資信託財産総額 (303,546,959千円) に対する比率は99.3%です。

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,339,816,015
コール・ローン等	4,774,467
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	6,305,166,727
未収入金	29,874,821
(B) 負債	34,118,672
未払解約金	29,735,706
未払信託報酬	4,318,250
その他未払費用	64,716
(C) 純資産総額(A-B)	6,305,697,343
元本	5,467,122,495
次期繰越損益金	838,574,848
(D) 受益権総口数	5,467,122,495口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,534円

<注記事項>

- ①期首元本額 5,214,322,213円
 期中追加設定元本額 1,191,261,114円
 期中一部解約元本額 938,460,832円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.1534円です。

②分配金の計算過程

項 目	2021年5月13日～ 2022年5月12日
費用控除後の配当等収益額	111,836,580円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	—円
収益調整金額	340,714,985円
分配準備積立金額	386,023,283円
当ファンドの分配対象収益額	838,574,848円
1万口当たり収益分配対象額	1,533円
1万口当たり分配金額	—円
収益分配金金額	—円

○損益の状況 (2021年5月13日～2022年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 496
受取利息	5
支払利息	△ 501
(B) 有価証券売買損益	104,201,921
売買益	119,617,851
売買損	△ 15,415,930
(C) 信託報酬等	△ 8,446,895
(D) 当期損益金(A+B+C)	95,754,530
(E) 前期繰越損益金	386,023,283
(F) 追加信託差損益金	356,797,035
(配当等相当額)	(163,293,033)
(売買損益相当額)	(193,504,002)
(G) 計(D+E+F)	838,574,848
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	838,574,848
追加信託差損益金	356,797,035
(配当等相当額)	(163,911,220)
(売買損益相当額)	(192,885,815)
分配準備積立金	497,859,863
繰越損益金	△ 16,082,050

- (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。

【お知らせ】

- ①対象インデックスとの連動性維持のために行う外国為替予約取引について明確化するため、外国為替予約取引にかかる記載を追加し、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2021年9月30日)
- ②「FTSE世界国債インデックス」について、2021年10月末より中国国債の組み入れに伴い、当該指数を参照等する当ファンドにおいて、新たに中国国債の組み入れを適宜開始します。

外国債券インデックスマザーファンド

《第21期》決算日2022年5月12日

[計算期間：2021年5月13日～2022年5月12日]

「外国債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第21期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第21期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
17期(2018年5月14日)	20,178	1.4	112,563.85	1.4	98.9	—	120,314
18期(2019年5月13日)	20,412	1.2	113,996.81	1.3	98.7	—	137,361
19期(2020年5月12日)	21,324	4.5	119,287.72	4.6	98.6	—	149,310
20期(2021年5月12日)	22,636	6.2	126,522.01	6.1	97.7	—	197,147
21期(2022年5月12日)	23,133	2.2	129,384.40	2.3	98.8	—	302,225

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、 円換算ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021年5月12日	円	%	126,522.01	%	%	%
5月末	22,636	—	128,227.80	—	97.7	—
6月末	22,974	1.5	128,117.08	1.3	97.1	—
7月末	22,935	1.3	128,989.36	2.0	97.6	—
8月末	23,095	2.0	128,937.19	1.9	97.8	—
9月末	23,089	2.0	128,937.19	1.9	97.5	—
10月末	22,929	1.3	128,115.00	1.3	97.4	—
11月末	23,422	3.5	130,788.36	3.4	97.6	—
12月末	23,162	2.3	129,217.14	2.1	97.5	—
2022年1月末	23,305	3.0	130,157.13	2.9	98.0	—
2月末	22,902	1.2	128,015.91	1.2	97.3	—
3月末	22,489	△0.6	125,907.80	△0.5	98.0	—
4月末	23,230	2.6	129,775.21	2.6	97.9	—
5月末	23,282	2.9	129,955.37	2.7	97.7	—
(期 末) 2022年5月12日	23,133	2.2	129,384.40	2.3	98.8	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

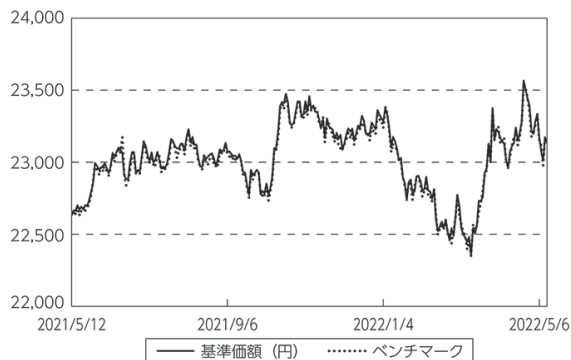
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(2.3%)を0.1%下回りました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

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

● 投資環境について

◎ 債券市況

先進国の債券市況は下落しました。

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

◎ 為替市況

- ・ 期首に比べて米ドル、ユーロは対円で上昇しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

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

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは2.3%の上昇になったため、乖離は $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ ありません。

(主なマイナス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年5月13日～2022年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 3	% 0.012	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(3)	(0.011)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	3	0.012	
期中の平均基準価額は、23,030円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○利害関係人との取引状況等

(2021年5月13日～2022年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			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	24,323	13,310	54.7	23,471	13,202	56.2
為替直物取引	144,540	91,369	63.2	44,380	39,543	89.1

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

○組入資産の明細

(2022年5月12日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

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

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄		当 期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
スウェーデン		%	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ	千円	
国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	0.125	7,850	6,727	86,719	2031/5/12
	0.75 SWD GOVT 280512	0.75	6,900	6,488	83,634	2028/5/12
	0.75 SWD GOVT 291112	0.75	6,300	5,814	74,954	2029/11/12
	1 SWD GOVT 261112	1.0	10,460	10,129	130,571	2026/11/12
	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	9,940	9,975	128,589	2023/11/13
	2.25 SWD GOVT 320601	2.25	4,350	4,499	58,000	2032/6/1
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	8,260	8,473	109,227	2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	5,470	6,638	85,568	2039/3/30
小 計					757,265	
ノルウェー			千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	1.25	3,500	3,032	40,421	2031/9/17
	1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	7,570	6,742	89,881	2030/8/19
	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	4,860	4,656	62,065	2026/2/19
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	8,950	8,744	116,560	2025/3/13
	1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	4,170	3,986	53,144	2027/2/17
	1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	4,200	3,895	51,931	2029/9/6
	2 NORWE GOVT 230524	2.0	5,920	5,930	79,056	2023/5/24
	2 NORWE GOVT 280426	2.0	6,200	5,932	79,084	2028/4/26
	2.125 NORWE GOVT 320518	2.125	3,000	2,797	37,286	2032/5/18
	3 NORWE GOVT 240314	3.0	8,300	8,400	111,984	2024/3/14
小 計					721,417	
デンマーク			千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
国債証券	0 DMK GOVT 241115	—	2,300	2,270	41,683	2024/11/15
	0 DMK GOVT 311115	—	7,500	6,601	121,195	2031/11/15
	0.25 DMK GOVT 521115	0.25	5,400	3,849	70,685	2052/11/15
	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	9,050	8,790	161,396	2027/11/15
	0.5 DMK GOVT 291115	0.5	10,550	10,028	184,125	2029/11/15
	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	3,250	3,319	60,950	2023/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	7,490	7,745	142,214	2025/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	13,740	20,147	369,916	2039/11/15
小 計					1,152,167	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券	0.25 POLAND 261025	0.25	3,000	2,234	65,266	2026/10/25
	1.25 POLAND 301025	1.25	4,090	2,664	77,845	2030/10/25
	1.75 POLAND 320425	1.75	1,000	637	18,618	2032/4/25
	2.25 POLAND 241025	2.25	4,000	3,590	104,870	2024/10/25
	2.5 POLAND 240425	2.5	2,600	2,405	70,281	2024/4/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	6,540	5,460	159,504	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	5,190	4,164	121,659	2027/7/25
	2.75 POLAND 280425	2.75	4,760	3,777	110,349	2028/4/25
	2.75 POLAND 291025	2.75	3,400	2,587	75,582	2029/10/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	7,300	6,521	190,493	2025/7/25
	4 POLAND 231025	4.0	4,300	4,154	121,365	2023/10/25
	5.75 POLAND 290425	5.75	3,450	3,238	94,608	2029/4/25
小 計					1,210,444	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券	0.25 AUST GOVT 241121	0.25	900	843	75,962	2024/11/21

銘柄		当期末					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		
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	3,450	3,129	281,868	2025/11/21	
	1 AUST GOVT 301221	1.0	1,110	908	81,805	2030/12/21	
	1 AUST GOVT 311121	1.0	3,610	2,886	259,973	2031/11/21	
	1.25 AUST GOVT 320521	1.25	2,500	2,027	182,578	2032/5/21	
	1.5 AUST GOVT 310621	1.5	2,590	2,193	197,510	2031/6/21	
	1.75 AUST GOVT 321121	1.75	2,780	2,349	211,595	2032/11/21	
	1.75 AUST GOVT 510621	1.75	1,990	1,264	113,912	2051/6/21	
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	1,250	1,180	106,282	2028/5/21	
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	3,940	3,688	332,186	2030/5/21	
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	2,090	2,039	183,676	2027/11/21	
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	1,630	1,576	141,945	2028/11/21	
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	2,210	2,117	190,691	2029/11/21	
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	960	871	78,517	2035/6/21	
	2.75 AUST GOVT 410521	2.75	1,020	872	78,546	2041/5/21	
	3 AUST GOVT 331121	3.0	1,900	1,801	162,215	2033/11/21	
	3 AUST GOVT 470321	3.0	1,360	1,173	105,681	2047/3/21	
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	5,260	5,304	477,736	2025/4/21	
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	2,260	2,246	202,334	2029/4/21	
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	2,040	1,905	171,574	2039/6/21	
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	1,300	1,307	117,723	2037/4/21	
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	3,320	3,463	311,910	2026/4/21	
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	2,210	2,404	216,581	2033/4/21	
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	2,050	2,197	197,935	2027/4/21	
小計					4,480,744		
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル			
国債証券	1.25 SINGAPORGGOVT 261101	1.25	700	660	61,692	2026/11/1	
	1.625 SINGAPORGOV 310701	1.625	450	407	38,091	2031/7/1	
	1.875 SINGAPORGOV 500301	1.875	700	577	53,944	2050/3/1	
	1.875 SINGAPORGOV 511001	1.875	950	782	73,077	2051/10/1	
	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	1,530	1,505	140,630	2026/6/1	
	2.25 SINGAPORGGOVT 360801	2.25	830	764	71,453	2036/8/1	
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	600	599	55,984	2025/6/1	
	2.375 SINGAPORGOV 390701	2.375	380	349	32,691	2039/7/1	
	2.625 SINGAPORGOV 280501	2.625	800	798	74,541	2028/5/1	
	2.75 SINGAPORGGOVT 230701	2.75	1,000	1,008	94,185	2023/7/1	
	2.75 SINGAPORGGOVT 460301	2.75	790	769	71,838	2046/3/1	
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	920	927	86,667	2029/7/1	
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	1,140	1,146	107,126	2030/9/1	
	3 SINGAPORGGOVT 240901	3.0	1,500	1,522	142,174	2024/9/1	
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	780	819	76,502	2033/9/1	
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	760	789	73,792	2027/3/1	
小計					1,254,396		
マレーシア			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット			
国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	2.632	1,800	1,536	45,498	2031/4/15	
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	1,400	1,357	40,183	2027/5/31	
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	2,100	2,029	60,075	2028/6/15	
	3.757 MALAYSIAGOV 400522	3.757	1,880	1,602	47,425	2040/5/22	

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

銘	柄	当 期 末				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	3.39 CHINA GOVT 500316	3.39	4,000	3,999	77,213	2050/3/16
		3.53 CHINA GOVT 511018	3.53	3,000	3,108	59,999	2051/10/18
		3.54 CHINA GOVT 280816	3.54	4,000	4,208	81,234	2028/8/16
		3.57 CHINA GOVT 240622	3.57	10,000	10,279	198,436	2024/6/22
		3.61 CHINA GOVT 250607	3.61	10,000	10,371	200,214	2025/6/7
		3.72 CHINA GOVT 510412	3.72	4,000	4,258	82,199	2051/4/12
		3.77 CHINA GOVT 250308	3.77	11,000	11,452	221,065	2025/3/8
		3.81 CHINA GOVT 500914	3.81	8,000	8,643	166,840	2050/9/14
		3.86 CHINA GOVT 490722	3.86	5,000	5,438	104,973	2049/7/22
		4.08 CHINA GOVT 230822	4.08	8,000	8,231	158,890	2023/8/22
		4.08 CHINA GOVT 481022	4.08	5,000	5,629	108,674	2048/10/22
小	計					4,891,287	
イスラエル				千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
	国債証券	0.5 ISRAEL FIXED 250430	0.5	4,000	3,846	144,712	2025/4/30
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	1.0	2,800	2,515	94,635	2030/3/31
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	1.5	2,400	2,008	75,545	2037/5/31
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	4,180	4,251	159,944	2028/9/28
		3.75 ISRAEL FIXED 240331	3.75	6,250	6,525	245,487	2024/3/31
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	3.75	2,800	3,049	114,708	2047/3/31
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	2,580	3,529	132,775	2042/1/31
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	3,500	4,240	159,521	2026/10/30
小	計					1,127,330	
合	計					298,451,346	

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

○投資信託財産の構成

(2022年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 298,451,346	% 98.3
コール・ローン等、その他	5,095,613	1.7
投資信託財産総額	303,546,959	100.0

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

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年5月12日現在)

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

<注記事項>

- ①期首元本額 87,094,050,705円
 期中追加設定元本額 62,049,820,231円
 期中一部解約元本額 18,498,087,187円
 また、1口当たり純資産額は、期末23,133円です。

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

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

○損益の状況 (2021年5月13日~2022年5月12日)

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

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

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

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

【お知らせ】

- ①対象インデックスとの連動性維持のために行う外国為替予約取引について明確化するため、外国為替予約取引にかかる記載を追加し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2021年9月30日)
- ②「FTSE世界国債インデックス」について、2021年10月末より中国国債の組み入れに伴い、当該指数を参照等する当ファンドにおいて、新たに中国国債の組み入れを適宜開始します。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	2028年5月12日まで（2018年3月16日設定）	
運用方針	<p>ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界各国の公社債に投資を行い、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。</p> <p>マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。</p> <p>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。</p> <p>実質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。</p>	
主要運用対象	ベビーフンド	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界各国の公社債に直接投資することがあります。
	マザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告に係わる情報

MUKAM 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)

第4期（決算日：2022年5月12日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、お手持ちの「MUKAM 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）」は、去る5月12日に第4期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



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 (分配落)	標準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジ・オフ)		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		税込分配	み金騰落	中率	騰落	中率			
(設定日)	円	円	%	%	%	%	%	百万円	
2018年3月16日	10,000	—	—	—	382.25	—	—	—	1
1期(2019年5月13日)	10,220	0	2.2	2.4	391.37	2.4	96.6	—	8,471
2期(2020年5月12日)	10,985	0	7.5	7.8	422.00	7.8	98.9	—	11,139
3期(2021年5月12日)	10,715	0	△2.5	△2.3	412.37	△2.3	99.0	—	13,860
4期(2022年5月12日)	9,785	0	△8.7	△8.4	377.73	△8.4	98.3	—	19,335

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

(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		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021年5月12日	円 10,715	% —	412.37	% —	% 99.0	% —
5月末	10,760	0.4	414.03	0.4	99.3	—
6月末	10,797	0.8	415.77	0.8	98.1	—
7月末	10,986	2.5	423.02	2.6	97.8	—
8月末	10,987	2.5	423.13	2.6	98.6	—
9月末	10,812	0.9	416.47	1.0	99.4	—
10月末	10,805	0.8	416.21	0.9	100.8	—
11月末	10,871	1.5	418.85	1.6	97.1	—
12月末	10,771	0.5	415.09	0.7	100.5	—
2022年1月末	10,633	△0.8	409.98	△0.6	98.0	—
2月末	10,408	△2.9	401.33	△2.7	98.6	—
3月末	10,122	△5.5	390.67	△5.3	104.1	—
4月末	9,895	△7.7	382.14	△7.3	101.4	—
(期 末) 2022年5月12日	9,785	△8.7	377.73	△8.4	98.3	—

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ8.7%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-8.4%）を0.3%下回りました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(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、期首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

<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)>

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

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

- ・ 日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、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。
- ・ 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
<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)>

ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.3\%$ 程度となりました。

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

- ・ マザーファンド保有による要因
マザーファンド保有による影響は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・ ポートフォリオ要因によるものです。

●分配金について

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

【分配原資の内訳】

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項 目	第4期
	2021年5月13日～ 2022年5月12日
当期分配金	—
（対基準価額比率）	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	930

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

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

○今後の運用方針

<MUKAM 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）>

- ・マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

- ・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

(2021年5月13日～2022年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
(投 信 会 社)	(9)	(0.088)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(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)	(2)	(0.022)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	2	0.015	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(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
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	15	0.136	
期中の平均基準価額は、10,664円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

○売買及び取引の状況

(2021年5月13日～2022年5月12日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千口 6,430,949	千円 8,162,206	千口 1,059,867	千円 1,366,066

○利害関係人との取引状況等

(2021年5月13日～2022年5月12日)

利害関係人との取引状況

<MUKAM 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)>
該当事項はございません。

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	3,439,426	487,066	14.2	3,316,242	411,773	12.4
為替直物取引	84,304	57,111	67.7	183,745	136,615	74.4

平均保有割合 5.7%

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

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

○組入資産の明細

(2022年5月12日現在)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千口 10,216,707	千口 15,587,789	千円 19,333,535

○投資信託財産の構成

(2022年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千円 19,333,535	% 99.9
コール・ローン等、その他	10,737	0.1
投資信託財産総額	19,344,272	100.0

(注) ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産 (172,206,040千円) の投資信託財産総額 (173,748,694千円) に対する比率は99.1%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=129.77円	1 カナダドル=99.93円	1 メキシコペソ=6.3981円	1 ユーロ=136.58円
1 イギリスポンド=158.93円	1 スウェーデンクローネ=12.89円	1 ノルウェークローネ=13.33円	1 デンマーククローネ=18.36円
1 ポーランドズロチ=29.2119円	1 オーストラリアドル=90.06円	1 シンガポールドル=93.41円	1 マレーシアリンギット=29.6027円
1 中国元=19.3035円	1 イスラエルシケル=37.6208円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	19,344,272,570
コール・ローン等	10,337,303
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	19,333,535,057
未収入金	400,210
(B) 負債	9,170,502
未払信託報酬	9,022,909
未払利息	1
その他未払費用	147,592
(C) 純資産総額(A-B)	19,335,102,068
元本	19,759,558,182
次期繰越損益金	△ 424,456,114
(D) 受益権総口数	19,759,558,182口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,785円

<注記事項>

- ①期首元本額 12,935,010,840円
 期中追加設定元本額 8,157,295,098円
 期中一部解約元本額 1,332,747,756円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9785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424,456,114円です。

③分配金の計算過程

項 目	2021年5月13日～ 2022年5月12日
費用控除後の配当等収益額	279,198,303円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	-円
収益調整金額	842,164,316円
分配準備積立金額	717,011,698円
当ファンドの分配対象収益額	1,838,374,317円
1万口当たり収益分配対象額	930円
1万口当たり分配金額	-円
収益分配金金額	-円

○損益の状況 (2021年5月13日～2022年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 706
受取利息	10
支払利息	△ 716
(B) 有価証券売買損益	△1,248,572,467
売買益	76,752,777
売買損	△1,325,325,244
(C) 信託報酬等	△ 17,853,140
(D) 当期損益金(A+B+C)	△1,266,426,313
(E) 前期繰越損益金	177,566,927
(F) 追加信託差損益金	664,403,272
(配当等相当額)	(831,955,825)
(売買損益相当額)	(△ 167,552,553)
(G) 計(D+E+F)	△ 424,456,114
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△ 424,456,114
追加信託差損益金	664,403,272
(配当等相当額)	(842,164,316)
(売買損益相当額)	(△ 177,761,044)
分配準備積立金	996,210,001
繰越損益金	△2,085,069,387

(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。

【お知らせ】

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

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

《第13期》決算日2022年1月26日

[計算期間：2021年1月27日～2022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	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
9期(2018年1月26日)	12,633	1.0	382.76	1.0	98.5	—	183,523
10期(2019年1月28日)	12,706	0.6	385.22	0.6	98.0	—	226,657
11期(2020年1月27日)	13,512	6.3	409.73	6.4	97.8	—	237,847
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

(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>除く日本、円ヘッジ円ベース</small>)		債 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %
	騰 落 率	率	騰 落 率	率		
(期 首) 2021年1月26日	円 14,060	% —	427.41	% —	98.7	—
1月末	14,050	△0.1	427.12	△0.1	99.1	—
2月末	13,632	△3.0	414.29	△3.1	100.7	—
3月末	13,606	△3.2	413.65	△3.2	101.0	—
4月末	13,592	△3.3	413.35	△3.3	98.6	—
5月末	13,622	△3.1	414.03	△3.1	99.3	—
6月末	13,671	△2.8	415.77	△2.7	98.1	—
7月末	13,912	△1.1	423.02	△1.0	97.8	—
8月末	13,914	△1.0	423.13	△1.0	98.6	—
9月末	13,694	△2.6	416.47	△2.6	99.5	—
10月末	13,686	△2.7	416.21	△2.6	100.8	—
11月末	13,771	△2.1	418.85	△2.0	97.1	—
12月末	13,646	△2.9	415.09	△2.9	100.5	—
(期 末) 2022年1月26日	13,500	△4.0	410.80	△3.9	97.2	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.0%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−3.9%)を0.1%下回りました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(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、期中中頃には新型コロナウイルス感染再拡大による景気の先行き懸念を背景とした金利低下等により、上昇する局面もありましたが、経済正常化期待や利上げ観測を背景とした金利上昇等により、期首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3.9%の下落になったため、乖離は $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ ありません。

(主なマイナス要因)

- ・ 評価時価差異要因[※]によるものです。

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

○ 今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年1月27日～2022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 ）	1	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 ）	(1)	(0.011)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	(0)	(0.000)	
期中の平均基準価額は、13,730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。

○利害関係人との取引状況等

(2021年1月27日～2022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	3,287,619	698,575	21.2	3,297,418	729,300	22.1
為替直物取引	66,133	54,221	82.0	46,398	21,623	46.6

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

○組入資産の明細

(2022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 1,102,020	千アメリカドル 1,136,972	千円 129,432,980	% 46.1	% —	% 21.9	% 17.8	% 6.4
カナダ	千カナダドル 59,190	千カナダドル 61,383	5,533,080	2.0	—	1.0	0.6	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 358,350	千メキシコペソ 363,641	2,008,063	0.7	—	0.4	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	126,540	148,585	19,115,479	6.8	—	4.6	2.2	—
イタリア	163,270	189,849	24,424,199	8.7	—	5.4	2.3	1.0
フランス	175,390	205,808	26,477,244	9.4	—	6.3	3.1	—
オランダ	34,640	40,586	5,221,464	1.9	—	1.3	0.3	0.2
スペイン	104,230	124,016	15,954,758	5.7	—	3.7	1.7	0.3
ベルギー	40,950	48,640	6,257,593	2.2	—	1.7	0.4	0.1
オーストリア	25,860	30,625	3,940,022	1.4	—	0.9	0.3	0.2
フィンランド	11,490	12,431	1,599,315	0.6	—	0.4	0.2	—
アイルランド	15,930	17,755	2,284,246	0.8	—	0.5	0.2	0.1
イギリス	千イギリスポンド 85,010	千イギリスポンド 105,622	16,246,861	5.8	—	4.6	1.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 57,150	千スウェーデンクローネ 62,193	764,975	0.3	—	0.1	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 54,050	千ノルウェークローネ 54,166	691,165	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 61,120	千デンマーククローネ 73,032	1,262,725	0.5	—	0.3	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 50,900	千ポーランドズロチ 48,341	1,357,758	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 51,980	千オーストラリアドル 54,593	4,446,668	1.6	—	1.1	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 13,090	千シンガポールドル 13,970	1,183,472	0.4	—	0.3	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 51,190	千マレーシアリンギット 52,375	1,422,668	0.5	—	0.3	0.1	0.1
中国	千中国元 99,000	千中国元 102,276	1,840,247	0.7	—	0.3	0.2	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 29,910	千イスラエルシェケル 35,913	1,287,512	0.5	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	272,752,505	97.2	—	55.6	31.9	9.8

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

(注) 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	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	0.125 T-NOTE 230430	0.125	4,300	4,267	485,783	2023/4/30
	0.125 T-NOTE 230515	0.125	9,500	9,422	1,072,692	2023/5/15
	0.125 T-NOTE 230815	0.125	9,500	9,392	1,069,186	2023/8/15
	0.125 T-NOTE 240115	0.125	9,300	9,140	1,040,556	2024/1/15
	0.125 T-NOTE 240215	0.125	8,800	8,639	983,517	2024/2/15
	0.25 T-NOTE 231115	0.25	6,500	6,419	730,797	2023/11/15
	0.25 T-NOTE 240615	0.25	6,500	6,366	724,727	2024/6/15
	0.25 T-NOTE 250531	0.25	3,700	3,567	406,070	2025/5/31
	0.25 T-NOTE 250930	0.25	7,900	7,572	862,062	2025/9/30
	0.375 T-NOTE 240415	0.375	11,500	11,323	1,289,011	2024/4/15
	0.375 T-NOTE 240815	0.375	9,000	8,821	1,004,228	2024/8/15
	0.375 T-NOTE 240915	0.375	15,000	14,683	1,671,580	2024/9/15
	0.375 T-NOTE 251231	0.375	9,000	8,629	982,376	2025/12/31
	0.375 T-NOTE 260131	0.375	9,600	9,187	1,045,862	2026/1/31
	0.5 T-NOTE 270630	0.5	8,000	7,543	858,709	2027/6/30
	0.5 T-NOTE 270831	0.5	8,550	8,032	914,437	2027/8/31
	0.625 T-NOTE 241015	0.625	9,500	9,351	1,064,539	2024/10/15
	0.625 T-NOTE 260731	0.625	12,400	11,906	1,355,427	2026/7/31
	0.625 T-NOTE 270331	0.625	3,750	3,571	406,622	2027/3/31
	0.625 T-NOTE 271231	0.625	13,680	12,879	1,466,202	2027/12/31
	0.625 T-NOTE 300515	0.625	10,620	9,705	1,104,895	2030/5/15
	0.625 T-NOTE 300815	0.625	13,200	12,025	1,369,030	2030/8/15
	0.75 T-NOTE 241115	0.75	7,100	7,004	797,434	2024/11/15
	0.75 T-NOTE 260331	0.75	9,300	9,019	1,026,743	2026/3/31
	0.75 T-NOTE 260531	0.75	10,400	10,064	1,145,735	2026/5/31
	0.875 T-NOTE 260630	0.875	10,900	10,595	1,206,150	2026/6/30
	0.875 T-NOTE 301115	0.875	13,150	12,211	1,390,159	2030/11/15
	1 T-NOTE 241215	1.0	7,500	7,445	847,563	2024/12/15
	1.125 T-BOND 400515	1.125	8,150	6,861	781,160	2040/5/15
	1.125 T-NOTE 280831	1.125	10,000	9,628	1,096,110	2028/8/31
	1.125 T-NOTE 310215	1.125	13,490	12,779	1,454,837	2031/2/15
	1.25 T-BOND 500515	1.25	6,500	5,261	598,962	2050/5/15
	1.25 T-NOTE 280331	1.25	12,590	12,264	1,396,182	2028/3/31
	1.25 T-NOTE 280630	1.25	14,350	13,951	1,588,233	2028/6/30
	1.25 T-NOTE 310815	1.25	8,330	7,948	904,910	2031/8/15
	1.375 T-BOND 500815	1.375	10,240	8,554	973,832	2050/8/15
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	4,100	4,133	470,518	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	7,700	7,761	883,587	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	7,000	7,056	803,261	2023/9/30
	1.375 T-NOTE 260831	1.375	3,400	3,375	384,274	2026/8/31
	1.375 T-NOTE 281031	1.375	2,240	2,189	249,303	2028/10/31
	1.375 T-NOTE 311115	1.375	1,310	1,261	143,648	2031/11/15
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	5,100	5,147	585,958	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 241031	1.5	6,000	6,045	688,189	2024/10/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	8,800	8,783	999,913	2026/8/15
	1.5 T-NOTE 270131	1.5	8,000	7,972	907,553	2027/1/31

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	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					
	1.5 T-NOTE 300215	1.5	7,800	7,665	872,620	2030/2/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	7,850	7,933	903,173	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	4,900	4,957	564,331	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	6,700	6,780	771,844	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	9,900	9,957	1,133,531	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	9,200	9,240	1,051,991	2026/5/15
	1.625 T-NOTE 260930	1.625	6,950	6,976	794,216	2026/9/30
	1.625 T-NOTE 261031	1.625	7,400	7,428	845,607	2026/10/31
	1.625 T-NOTE 261130	1.625	6,500	6,524	742,792	2026/11/30
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	7,200	7,149	813,884	2029/8/15
	1.625 T-NOTE 310515	1.625	12,730	12,580	1,432,200	2031/5/15
	1.75 T-BOND 410815	1.75	1,300	1,208	137,574	2041/8/15
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	10,000	10,126	1,152,807	2023/5/15
	1.75 T-NOTE 240630	1.75	9,850	9,995	1,137,837	2024/6/30
	1.75 T-NOTE 240731	1.75	6,800	6,902	785,784	2024/7/31
	1.75 T-NOTE 261231	1.75	6,800	6,863	781,369	2026/12/31
	1.875 T-BOND 410215	1.875	7,120	6,770	770,773	2041/2/15
	2 T-BOND 500215	2.0	5,950	5,777	657,715	2050/2/15
	2 T-BOND 510815	2.0	4,850	4,711	536,336	2051/8/15
	2 T-NOTE 240430	2.0	5,700	5,815	661,992	2024/4/30
	2 T-NOTE 240531	2.0	11,260	11,491	1,308,226	2024/5/31
	2 T-NOTE 250215	2.0	4,800	4,901	558,000	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	12,150	12,399	1,411,521	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	11,100	11,330	1,289,834	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	7,700	7,862	895,092	2023/11/30
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	8,700	8,896	1,012,730	2024/2/29
	2.125 T-NOTE 241130	2.125	4,000	4,096	466,370	2024/11/30
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	1,000	1,025	116,730	2025/5/15
	2.25 T-BOND 410515	2.25	3,350	3,383	385,147	2041/5/15
	2.25 T-BOND 460815	2.25	5,330	5,390	613,640	2046/8/15
	2.25 T-NOTE 231231	2.25	8,800	9,010	1,025,780	2023/12/31
	2.25 T-NOTE 240430	2.25	8,100	8,305	945,552	2024/4/30
	2.25 T-NOTE 241031	2.25	4,900	5,037	573,482	2024/10/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	7,900	8,118	924,173	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 241231	2.25	5,100	5,245	597,117	2024/12/31
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	9,500	9,785	1,113,924	2025/11/15
	2.25 T-NOTE 260331	2.25	8,250	8,502	967,869	2026/3/31
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	9,200	9,503	1,081,898	2027/2/15
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	10,300	10,642	1,211,575	2027/8/15
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	9,900	10,221	1,163,644	2027/11/15
	2.375 T-BOND 491115	2.375	5,430	5,705	649,541	2049/11/15
	2.375 T-BOND 510515	2.375	4,820	5,081	578,501	2051/5/15
	2.375 T-NOTE 240229	2.375	10,400	10,688	1,216,771	2024/2/29
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	9,200	9,481	1,079,402	2024/8/15
	2.375 T-NOTE 270515	2.375	10,500	10,910	1,242,105	2027/5/15
	2.375 T-NOTE 290515	2.375	8,100	8,461	963,202	2029/5/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	4,180	4,405	501,576	2045/2/15

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		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	2.5 T-BOND 460215	2.5	4,600	4,864	553,815	2046/2/15
	2.5 T-BOND 460515	2.5	4,780	5,058	575,826	2046/5/15
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	9,050	9,280	1,056,531	2023/8/15
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	10,200	10,523	1,198,044	2024/5/15
	2.5 T-NOTE 250131	2.5	10,000	10,363	1,179,755	2025/1/31
	2.625 T-NOTE 230630	2.625	5,600	5,744	653,914	2023/6/30
	2.625 T-NOTE 250331	2.625	4,500	4,682	533,011	2025/3/31
	2.625 T-NOTE 260131	2.625	5,400	5,643	642,399	2026/1/31
	2.625 T-NOTE 290215	2.625	8,800	9,327	1,061,821	2029/2/15
	2.75 T-BOND 420815	2.75	2,020	2,209	251,560	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	4,200	4,592	522,765	2042/11/15
	2.75 T-BOND 470815	2.75	4,950	5,514	627,783	2047/8/15
	2.75 T-BOND 471115	2.75	4,700	5,240	596,578	2047/11/15
	2.75 T-NOTE 230531	2.75	3,000	3,079	350,551	2023/5/31
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	8,800	9,082	1,033,998	2023/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	6,800	7,038	801,236	2024/2/15
	2.75 T-NOTE 250630	2.75	7,900	8,262	940,578	2025/6/30
	2.75 T-NOTE 250831	2.75	7,500	7,852	893,888	2025/8/31
	2.75 T-NOTE 280215	2.75	13,650	14,496	1,650,307	2028/2/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	4,800	5,355	609,698	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	4,300	4,840	551,083	2045/8/15
	2.875 T-BOND 461115	2.875	3,220	3,648	415,392	2046/11/15
	2.875 T-BOND 490515	2.875	6,300	7,263	826,899	2049/5/15
	2.875 T-NOTE 230930	2.875	6,000	6,196	705,398	2023/9/30
	2.875 T-NOTE 231031	2.875	8,500	8,787	1,000,335	2023/10/31
	2.875 T-NOTE 250430	2.875	4,900	5,141	585,314	2025/4/30
	2.875 T-NOTE 250731	2.875	10,500	11,038	1,256,580	2025/7/31
	2.875 T-NOTE 251130	2.875	5,400	5,686	647,345	2025/11/30
	2.875 T-NOTE 280515	2.875	12,100	12,955	1,474,855	2028/5/15
	2.875 T-NOTE 280815	2.875	10,850	11,634	1,324,423	2028/8/15
	3 T-BOND 420515	3.0	3,040	3,455	393,374	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	4,250	4,860	553,293	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	3,600	4,128	469,984	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	2,910	3,351	381,483	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	4,460	5,171	588,764	2047/2/15
	3 T-BOND 480215	3.0	5,430	6,349	722,850	2048/2/15
	3 T-BOND 480815	3.0	5,600	6,561	746,925	2048/8/15
	3 T-BOND 490215	3.0	6,180	7,275	828,188	2049/2/15
	3 T-NOTE 250930	3.0	7,500	7,927	902,493	2025/9/30
	3.125 T-BOND 411115	3.125	3,050	3,522	401,043	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	3,350	3,877	441,458	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	3,230	3,739	425,673	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	4,690	5,467	622,463	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	5,390	6,453	734,639	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	10,000	10,908	1,241,834	2028/11/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	4,150	5,018	571,352	2044/5/15
	3.375 T-BOND 481115	3.375	6,000	7,520	856,147	2048/11/15

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		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	3.5 T-BOND 390215	3.5	1,700	2,057	234,229	2039/2/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	4,150	5,173	588,957	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	4,200	5,256	598,444	2044/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	2,850	3,578	407,430	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	2,510	3,190	363,200	2043/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	4,280	5,432	618,408	2040/8/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	2,100	2,777	316,236	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	4,860	6,466	736,098	2040/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	1,390	1,850	210,715	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	2,300	3,092	352,020	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	2,450	3,305	376,351	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	4,380	5,937	675,960	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	950	1,264	144,005	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	2,000	2,701	307,492	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	2,420	3,298	375,488	2039/8/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	2,230	3,088	351,600	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	2,960	4,187	476,728	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	1,150	1,619	184,397	2037/5/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	3,120	4,079	464,371	2031/2/15
	6 T-BOND 260215	6.0	3,600	4,243	483,048	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	6,300	7,868	895,705	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	6,500	7,044	801,902	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	2,550	3,444	392,166	2030/5/15
小計					129,432,980	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.75 CAN GOVT 241001	0.75	2,950	2,899	261,401	2024/10/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	1,500	1,451	130,825	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 250301	1.25	3,850	3,824	344,708	2025/3/1
	1.25 CAN GOVT 300601	1.25	7,320	7,049	635,440	2030/6/1
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	3,250	3,265	294,369	2023/6/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	3,650	3,636	327,765	2026/6/1
	1.5 CAN GOVT 310601	1.5	3,500	3,408	307,259	2031/6/1
	1.75 CAN GOVT 230301	1.75	4,000	4,029	363,224	2023/3/1
	2 CAN GOVT 230901	2.0	4,500	4,557	410,776	2023/9/1
	2 CAN GOVT 280601	2.0	1,500	1,530	137,922	2028/6/1
	2 CAN GOVT 511201	2.0	5,400	5,337	481,167	2051/12/1
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	4,200	4,302	387,843	2025/6/1
	2.25 CAN GOVT 290601	2.25	2,100	2,182	196,740	2029/6/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	3,200	3,285	296,130	2024/6/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	950	1,086	97,949	2048/12/1
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	1,010	1,186	106,926	2064/12/1
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,640	2,085	188,002	2045/12/1
	4 CAN GOVT 410601	4.0	790	1,034	93,210	2041/6/1
	5 CAN GOVT 370601	5.0	720	1,000	90,221	2037/6/1
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	1,450	1,855	167,276	2029/6/1
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,710	2,373	213,916	2033/6/1
小計					5,533,080	

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 241205	10.0	44,750	47,751	263,689	2024/12/5	
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	9,000	10,743	59,328	2036/11/20	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	46,350	43,590	240,709	2026/3/5	
		6.75 MEXICAN BONO 230309	6.75	20,000	19,980	110,333	2023/3/9	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	35,750	35,792	197,649	2027/6/3	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	28,000	28,225	155,865	2031/5/29	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	10,800	10,829	59,802	2034/11/23	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	24,100	23,366	129,032	2042/11/13	
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	41,500	42,012	231,998	2023/12/7	
		8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	15,000	15,224	84,073	2024/9/5	
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	22,000	21,852	120,670	2047/11/7	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	33,400	35,269	194,761	2029/5/31	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	27,700	29,001	160,148	2038/11/18	
小	計					2,008,063		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ			
	ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	4,700	4,797	617,139	2026/8/15
			0 BUND 290815	—	3,950	4,028	518,292	2029/8/15
			0 BUND 300815	—	6,000	6,104	785,363	2030/8/15
			0 BUND 310215	—	3,450	3,500	450,356	2031/2/15
			0 BUND 350515	—	4,240	4,224	543,502	2035/5/15
			0 BUND 500815	—	3,710	3,510	451,665	2050/8/15
			0 BUND 520815	—	880	821	105,748	2052/8/15
			0 OBL 240405	—	4,100	4,161	535,329	2024/4/5
			0 OBL 241018	—	7,500	7,629	981,524	2024/10/18
			0 OBL 261009	—	3,700	3,773	485,404	2026/10/9
			0.25 BUND 270215	0.25	3,500	3,616	465,246	2027/2/15
			0.25 BUND 280815	0.25	3,820	3,964	509,968	2028/8/15
			0.25 BUND 290215	0.25	4,600	4,778	614,734	2029/2/15
			0.5 BUND 250215	0.5	4,150	4,291	552,069	2025/2/15
			0.5 BUND 260215	0.5	6,130	6,375	820,182	2026/2/15
			0.5 BUND 270815	0.5	5,090	5,339	686,951	2027/8/15
			0.5 BUND 280215	0.5	3,600	3,786	487,167	2028/2/15
			1 BUND 240815	1.0	5,400	5,629	724,218	2024/8/15
			1 BUND 250815	1.0	4,850	5,116	658,268	2025/8/15
			1.25 BUND 480815	1.25	3,530	4,531	583,038	2048/8/15
			1.5 BUND 240515	1.5	4,850	5,095	655,487	2024/5/15
			1.75 BUND 240215	1.75	1,950	2,049	263,674	2024/2/15
			2.5 BUND 440704	2.5	3,110	4,812	619,169	2044/7/4
			2.5 BUND 460815	2.5	3,610	5,724	736,406	2046/8/15
			3.25 BUND 420704	3.25	2,310	3,831	492,887	2042/7/4
			4 BUND 370104	4.0	3,100	4,996	642,818	2037/1/4
			4.25 BUND 390704	4.25	2,150	3,759	483,684	2039/7/4
			4.75 BUND 280704	4.75	2,100	2,806	361,069	2028/7/4
			4.75 BUND 340704	4.75	3,580	5,785	744,282	2034/7/4
			4.75 BUND 400704	4.75	2,300	4,327	556,711	2040/7/4
			5.5 BUND 310104	5.5	3,810	5,805	746,924	2031/1/4
			5.625 BUND 280104	5.625	2,700	3,685	474,188	2028/1/4

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	6.25 BUND 300104	6.25	2,000	3,060	393,695	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	2,070	2,862	368,302	2027/7/4
イタリア	国債証券	0 ITALY GOVT 240115	—	6,200	6,216	799,732	2024/1/15
		0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	1,400	1,410	181,412	2025/2/1
		0.6 ITALY GOVT 310801	0.6	2,580	2,434	313,174	2031/8/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	3,400	3,452	444,187	2023/10/15
		0.95 ITALY GOVT 300801	0.95	3,900	3,851	495,533	2030/8/1
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	2,600	2,700	347,355	2024/11/15
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	3,300	3,439	442,487	2025/5/15
		1.45 ITALY GOVT 360301	1.45	2,000	1,971	253,672	2036/3/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	2,980	3,112	400,452	2025/6/1
		1.5 ITALY GOVT 450430	1.5	370	339	43,693	2045/4/30
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	6,000	6,314	812,401	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 301201	1.65	2,130	2,218	285,427	2030/12/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	3,190	3,304	425,155	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	4,400	4,594	591,082	2024/5/15
		1.85 ITALY GOVT 250701	1.85	4,300	4,542	584,362	2025/7/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	2,900	3,092	397,910	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	500	538	69,299	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	3,750	4,042	520,022	2027/8/1
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	3,300	3,584	461,094	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	2,060	2,233	287,289	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	2,400	2,668	343,279	2033/9/1
		2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	2,850	3,064	394,298	2050/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	2,500	2,673	343,899	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	2,250	2,441	314,134	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	3,120	3,551	456,919	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	5,260	5,957	766,480	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	1,620	1,763	226,887	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	2,770	3,269	420,593	2038/9/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	2,710	3,371	433,720	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	1,950	2,370	304,909	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	2,680	3,450	443,923	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	6,150	7,357	946,525	2030/3/1
3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	3,400	3,730	479,968	2024/9/1		
4 ITALY GOVT 370201	4.0	3,990	5,246	674,915	2037/2/1		
4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	5,100	5,417	696,952	2023/5/1		
4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,900	3,181	409,292	2024/3/1		
4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	4,300	4,631	595,840	2023/8/1		
4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	6,750	8,472	1,090,028	2028/9/1		
4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	2,470	3,755	483,089	2044/9/1		
5 ITALY GOVT 250301	5.0	3,850	4,431	570,110	2025/3/1		
5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,750	2,459	316,422	2034/8/1		
5 ITALY GOVT 390801	5.0	3,620	5,395	694,170	2039/8/1		
5 ITALY GOVT 400901	5.0	3,680	5,559	715,262	2040/9/1		
5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	6,480	8,602	1,106,682	2029/11/1		
5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	2,600	3,782	486,660	2033/2/1		

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	6 ITALY GOVT 310501	6.0	5,240	7,492	963,955	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	4,070	5,422	697,642	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	3,000	3,967	510,454	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	2,550	2,964	381,432	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O. A. T 240225	—	1,800	1,822	234,416	2024/2/25
		0 O. A. T 240325	—	5,000	5,063	651,441	2024/3/25
		0 O. A. T 250325	—	5,200	5,269	677,961	2025/3/25
		0 O. A. T 291125	—	300	298	38,383	2029/11/25
		0 O. A. T 311125	—	6,000	5,842	751,595	2031/11/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	5,250	5,374	691,435	2026/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	4,500	4,638	596,766	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	7,150	7,395	951,412	2026/5/25
		0.5 O. A. T 290525	0.5	7,660	7,935	1,020,886	2029/5/25
		0.5 O. A. T 720525	0.5	1,350	1,042	134,093	2072/5/25
		0.75 O. A. T 280525	0.75	5,920	6,238	802,541	2028/5/25
		0.75 O. A. T 281125	0.75	5,670	5,978	769,133	2028/11/25
		0.75 O. A. T 520525	0.75	3,740	3,551	456,930	2052/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	6,000	6,312	812,066	2025/11/25
		1 O. A. T 270525	1.0	4,800	5,108	657,190	2027/5/25
		1.25 O. A. T 340525	1.25	4,670	5,125	659,409	2034/5/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	3,380	3,716	478,089	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	8,960	10,039	1,291,609	2031/5/25
		1.5 O. A. T 500525	1.5	4,140	4,772	614,014	2050/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	7,200	7,662	985,821	2024/11/25
		1.75 O. A. T 390625	1.75	4,360	5,221	671,755	2039/6/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	1,600	1,999	257,294	2066/5/25
		2 O. A. T 480525	2.0	3,570	4,553	585,871	2048/5/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	12,600	13,435	1,728,511	2024/5/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	8,750	10,512	1,352,448	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	6,780	7,935	1,020,912	2027/10/25
3.25 O. A. T 450525	3.25	3,370	5,154	663,164	2045/5/25		
3.5 O. A. T 260425	3.5	4,400	5,118	658,468	2026/4/25		
4 O. A. T 381025	4.0	3,520	5,468	703,538	2038/10/25		
4 O. A. T 550425	4.0	2,460	4,607	592,761	2055/4/25		
4 O. A. T 600425	4.0	1,900	3,730	479,874	2060/4/25		
4.5 O. A. T 410425	4.5	4,890	8,294	1,067,078	2041/4/25		
4.75 O. A. T 350425	4.75	3,760	5,863	754,358	2035/4/25		
5.5 O. A. T 290425	5.5	5,090	7,141	918,717	2029/4/25		
5.75 O. A. T 321025	5.75	4,650	7,367	947,780	2032/10/25		
6 O. A. T 251025	6.0	5,000	6,214	799,507	2025/10/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 300715	—	4,250	4,264	548,661	2030/7/15
		0 NETH GOVT 380115	—	550	526	67,774	2038/1/15
		0 NETH GOVT 520115	—	1,120	1,007	129,636	2052/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	2,250	2,307	296,800	2025/7/15
		0.25 NETH GOVT 290715	0.25	1,240	1,274	163,921	2029/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	2,200	2,287	294,309	2026/7/15
		0.5 NETH GOVT 400115	0.5	1,270	1,331	171,301	2040/1/15

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	
オランダ	国債証券	0.75 NETH GOVT 270715	0.75	2,100	2,221	285,750	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	2,500	2,658	342,047	2028/7/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	4,700	4,870	626,634	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,700	1,810	232,885	2024/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,930	2,437	313,539	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	2,290	3,677	473,163	2047/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	2,160	3,642	468,549	2042/1/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	2,180	3,412	438,990	2037/1/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,800	2,424	311,937	2028/1/15
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	400	431	55,561	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35	3,700	3,750	482,485	2023/7/30
		0.5 SPAIN GOVT 300430	0.5	3,150	3,173	408,284	2030/4/30
		0.5 SPAIN GOVT 311031	0.5	3,300	3,257	419,047	2031/10/31
		1 SPAIN GOVT 501031	1.0	1,040	934	120,253	2050/10/31
		1.2 SPAIN GOVT 401031	1.2	1,960	1,962	252,463	2040/10/31
		1.25 SPAIN GOVT 301031	1.25	3,970	4,230	544,222	2030/10/31
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	3,500	3,728	479,685	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	3,800	4,090	526,293	2028/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	3,150	3,396	436,937	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	4,050	4,362	561,221	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	3,240	3,511	451,812	2029/4/30
		1.45 SPAIN GOVT 711031	1.45	70	61	7,855	2071/10/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	3,100	3,341	429,871	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	2,900	3,077	395,971	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	3,000	3,263	419,810	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	3,250	3,661	471,041	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	3,550	3,864	497,184	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	3,130	3,681	473,670	2033/7/30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	2,140	2,783	358,080	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	3,600	3,913	503,504	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	2,650	3,546	456,205	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	2,090	3,133	403,124	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	5,900	6,470	832,492	2024/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	2,790	4,067	523,232	2037/1/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	3,100	3,369	433,476	2023/10/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	3,650	4,284	551,192	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	2,500	4,070	523,661	2041/7/30
4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	3,600	3,987	512,968	2024/1/31		
4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	2,470	4,068	523,428	2040/7/30		
5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	2,800	3,726	479,461	2028/10/31		
5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	2,100	3,748	482,202	2044/10/31		
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	4,310	6,558	843,797	2032/7/30		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	3,200	4,068	523,437	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	3,470	4,868	626,377	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.1 BEL GOVT 300622	0.1	1,770	1,771	227,932	2030/6/22
		0.4 BEL GOVT 400622	0.4	1,000	946	121,709	2040/6/22
		0.5 BEL GOVT 241022	0.5	1,800	1,852	238,377	2024/10/22

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	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	3,100	3,231	415,740	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	3,200	3,378	434,645	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	2,100	2,226	286,431	2028/6/22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	2,300	2,457	316,208	2029/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,300	1,376	177,046	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	2,900	3,121	401,617	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	1,320	1,467	188,748	2033/4/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	550	621	79,985	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	1,750	2,029	261,058	2047/6/22
		1.7 BEL GOVT 500622	1.7	450	534	68,729	2050/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	1,050	1,265	162,753	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	890	1,230	158,265	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	2,150	2,239	288,074	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	1,150	1,572	202,349	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,600	1,724	221,854	2024/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	990	1,304	167,775	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	1,490	2,421	311,520	2045/6/22
		4 BEL GOVT 320328	4.0	1,160	1,606	206,666	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	2,010	3,289	423,149	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	1,200	1,448	186,364	2026/3/28
5 BEL GOVT 350328	5.0	2,030	3,230	415,659	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,690	2,292	294,929	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	—	2,300	2,323	298,876	2023/7/15
		0 AUSTRIA GOVT 310220	—	750	739	95,135	2031/2/20
		0.25 AUSTRIA GOVT 361020	0.25	480	465	59,927	2036/10/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	1,240	1,288	165,707	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	3,400	3,530	454,239	2029/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	1,350	1,416	182,248	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,450	1,528	196,680	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	1,300	1,379	177,455	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	1,370	1,661	213,693	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	440	553	71,259	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	1,500	1,592	204,845	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	1,900	1,980	254,768	2023/10/20
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	880	1,336	171,989	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	1,100	1,385	178,221	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	1,070	1,672	215,156	2044/6/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	430	877	112,953	2062/1/26
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	2,100	3,281	422,123	2037/3/15
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	1,400	1,708	219,862	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	1,400	1,903	244,878	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	500	480	61,806	2036/4/15
		0.125 FINNISH GOV 520415	0.125	390	343	44,215	2052/4/15
		0.25 FINNISH GOVT 400915	0.25	420	404	52,039	2040/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	700	726	93,461	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	800	832	107,155	2027/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	700	728	93,664	2028/9/15

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	800	832	107,162	2029/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	1,010	1,070	137,754	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	900	943	121,383	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	730	804	103,468	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	580	705	90,814	2047/4/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	2,050	2,173	279,602	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	570	815	104,891	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	590	701	90,291	2028/7/4
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	750	867	111,604	2025/7/4
アイルランド	国債証券	0.4 IRISH GOVT 350515	0.4	800	787	101,304	2035/5/15
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	1,600	1,698	218,483	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	1,600	1,688	217,288	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	1,170	1,259	161,997	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	1,100	1,208	155,478	2033/5/15
		1.35 IRISH GOVT 310318	1.35	1,000	1,107	142,459	2031/3/18
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	820	939	120,864	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	1,230	1,430	184,016	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	1,070	1,356	174,498	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	1,740	2,071	266,514	2030/5/15
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	2,200	2,313	297,633	2023/3/20
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,600	1,894	243,708	2025/3/13
		小 計					
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	国債証券	0.125 GILT 240131	0.125	3,500	3,447	530,274	2024/1/31
		0.125 GILT 260130	0.125	1,650	1,599	246,019	2026/1/30
		0.25 GILT 310731	0.25	2,950	2,709	416,764	2031/7/31
		0.375 GILT 301022	0.375	1,900	1,784	274,480	2030/10/22
		0.625 GILT 250607	0.625	2,750	2,727	419,472	2025/6/7
		0.625 GILT 501022	0.625	1,030	868	133,657	2050/10/22
		0.875 GILT 291022	0.875	1,700	1,676	257,945	2029/10/22
		1 GILT 240422	1.0	3,400	3,410	524,661	2024/4/22
		1.25 GILT 270722	1.25	1,800	1,828	281,258	2027/7/22
		1.25 GILT 411022	1.25	2,640	2,593	399,001	2041/10/22
		1.5 GILT 260722	1.5	3,070	3,150	484,564	2026/7/22
		1.5 GILT 470722	1.5	1,850	1,920	295,349	2047/7/22
		1.5 GILT 530731	1.5	490	522	80,311	2053/7/31
		1.625 GILT 281022	1.625	900	936	144,080	2028/10/22
		1.625 GILT 711022	1.625	1,350	1,661	255,553	2071/10/22
		1.75 GILT 370907	1.75	2,400	2,545	391,594	2037/9/7
		1.75 GILT 490122	1.75	1,660	1,827	281,174	2049/1/22
		1.75 GILT 570722	1.75	2,630	3,042	468,040	2057/7/22
		2.25 GILT 230907	2.25	2,200	2,250	346,096	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	2,100	3,105	477,662	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	2,350	2,461	378,694	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	2,760	3,758	578,083	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	2,580	3,678	565,789	2045/1/22
3.5 GILT 680722	3.5	1,940	3,628	558,150	2068/7/22		

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		
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	3.75 GILT 520722	3.75	1,830	2,963	455,792	2052/7/22
		4 GILT 600122	4.0	1,710	3,196	491,650	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	2,860	3,389	521,320	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	3,080	3,998	615,014	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	2,350	3,256	500,866	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	1,700	2,488	382,787	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	1,820	2,707	416,479	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	2,140	3,455	531,449	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	1,710	2,884	443,751	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	1,920	3,514	540,668	2055/12/7
		4.5 GILT 340907	4.5	2,700	3,722	572,664	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	2,040	3,217	494,986	2042/12/7
		4.75 GILT 301207	4.75	1,950	2,551	392,489	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	1,500	2,287	351,927	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	2,930	3,295	506,982	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	1,170	1,556	239,350	2028/12/7
小	計					16,246,861	
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	7,300	7,187	88,408	2031/5/12
		0.75 SWD GOVT 280512	0.75	6,300	6,512	80,106	2028/5/12
		0.75 SWD GOVT 291112	0.75	7,700	7,999	98,398	2029/11/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0	10,150	10,568	129,986	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	11,800	12,151	149,468	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	7,200	7,786	95,774	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	6,700	9,986	122,832	2039/3/30
小	計					764,975	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	1.25	3,800	3,603	45,978	2031/9/17
		1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	4,900	4,727	60,321	2030/8/19
		1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	2,850	2,828	36,097	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	8,300	8,328	106,271	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	4,250	4,251	54,245	2027/2/17
		1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	6,200	6,174	78,780	2029/9/6
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	7,250	7,324	93,461	2023/5/24
		2 NORWE GOVT 280426	2.0	5,050	5,121	65,347	2028/4/26
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	11,450	11,807	150,660	2024/3/14
小	計					691,165	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	0 DMK GOVT 311115	—	3,700	3,668	63,421	2031/11/15
		0.25 DMK GOVT 521115	0.25	5,250	5,153	89,106	2052/11/15
		0.5 DMK GOVT 271115	0.5	10,200	10,611	183,479	2027/11/15
		0.5 DMK GOVT 291115	0.5	10,700	11,173	193,183	2029/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	8,100	8,411	145,440	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	10,200	11,022	190,584	2025/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	12,970	22,990	397,507	2039/11/15
小	計					1,262,725	

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		
ポーランド		%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
国債証券	0.75 POLAND 250425	0.75	6,000	5,510	154,761	2025/4/25
	1.25 POLAND 301025	1.25	4,700	3,812	107,094	2030/10/25
	2.25 POLAND 241025	2.25	4,000	3,895	109,414	2024/10/25
	2.5 POLAND 230125	2.5	4,800	4,778	134,209	2023/1/25
	2.5 POLAND 240425	2.5	3,000	2,957	83,055	2024/4/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	5,000	4,756	133,580	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	5,600	5,218	146,582	2027/7/25
	2.75 POLAND 280425	2.75	3,700	3,483	97,846	2028/4/25
	2.75 POLAND 291025	2.75	5,000	4,633	130,126	2029/10/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	3,550	3,516	98,770	2025/7/25
	4 POLAND 231025	4.0	4,150	4,210	118,267	2023/10/25
	5.75 POLAND 290425	5.75	1,400	1,568	44,047	2029/4/25
小計					1,357,758	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券	0.25 AUST GOVT 241121	0.25	2,200	2,141	174,451	2024/11/21
	0.5 AUST GOVT 260921	0.5	3,700	3,513	286,157	2026/9/21
	1 AUST GOVT 301221	1.0	4,100	3,799	309,477	2030/12/21
	1.25 AUST GOVT 320521	1.25	1,660	1,553	126,508	2032/5/21
	1.5 AUST GOVT 310621	1.5	2,400	2,315	188,602	2031/6/21
	1.75 AUST GOVT 510621	1.75	1,750	1,459	118,839	2051/6/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	2,900	2,986	243,284	2028/5/21
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	3,520	3,692	300,741	2030/5/21
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	2,980	3,178	258,872	2029/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	1,500	1,612	131,308	2035/6/21
	2.75 AUST GOVT 410521	2.75	1,440	1,505	122,588	2041/5/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	1,680	1,819	148,168	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	4,500	4,762	387,871	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	3,100	3,403	277,212	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	900	1,015	82,713	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	1,600	1,914	155,960	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,850	3,162	257,583	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	3,800	4,771	388,676	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	2,800	3,231	263,234	2027/4/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	2,600	2,755	224,414	2023/4/21
小計					4,446,668	
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	1.875 SINGAPORGOV 500301	1.875	250	237	20,086	2050/3/1
	2.25 SINGAPORGOVT 360801	2.25	1,550	1,602	135,712	2036/8/1
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	2,200	2,277	192,903	2025/6/1
	2.625 SINGAPORGOV 280501	2.625	1,000	1,057	89,555	2028/5/1
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	1,400	1,438	121,865	2023/7/1
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	1,220	1,361	115,296	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	1,100	1,229	104,176	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	950	1,024	86,807	2029/7/1
	2.875 SINGAPORGOVT 300901	2.875	1,200	1,305	110,597	2030/9/1
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	500	523	44,303	2024/9/1
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	600	691	58,592	2033/9/1

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
シンガポール		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
国債証券	3.5 SINGAPORGOV 270301	3.5	1,120	1,222	103,575	2027/3/1
小 計					1,183,472	
マレーシア			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
国債証券	3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	4,000	4,061	110,315	2023/3/15
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	7,500	7,544	204,921	2027/5/31
	3.757 MALAYSIAGOV 400522	3.757	1,000	935	25,403	2040/5/22
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	4,000	4,088	111,045	2023/8/17
	3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	4,000	3,921	106,519	2034/7/5
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	4,000	3,982	108,174	2033/4/15
	3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	6,900	7,019	190,677	2029/8/15
	3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	4,000	4,114	111,774	2026/7/15
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	3,000	3,096	84,115	2025/9/15
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	3,000	3,093	84,034	2024/7/15
	4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	4,500	4,860	132,037	2037/4/7
	4.921 MALAYSIAGOV 480706	4.921	2,790	2,974	80,802	2048/7/6
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	2,500	2,681	72,846	2043/9/30
小 計					1,422,668	
中国			千中国元	千中国元		
国債証券	2.85 CHINA GOVT 270604	2.85	7,000	7,118	128,084	2027/6/4
	2.88 CHINA GOVT 231105	2.88	9,000	9,119	164,087	2023/11/5
	3.01 CHINA GOVT 280513	3.01	6,000	6,137	110,437	2028/5/13
	3.02 CHINA GOVT 251022	3.02	7,000	7,163	128,897	2025/10/22
	3.02 CHINA GOVT 310527	3.02	5,000	5,113	92,015	2031/5/27
	3.13 CHINA GOVT 291121	3.13	4,000	4,111	73,973	2029/11/21
	3.25 CHINA GOVT 260606	3.25	8,000	8,280	148,992	2026/6/6
	3.27 CHINA GOVT 301119	3.27	6,000	6,255	112,558	2030/11/19
	3.29 CHINA GOVT 231018	3.29	11,000	11,219	201,872	2023/10/18
	3.39 CHINA GOVT 500316	3.39	4,000	4,030	72,524	2050/3/16
	3.54 CHINA GOVT 280816	3.54	4,000	4,235	76,211	2028/8/16
	3.57 CHINA GOVT 240622	3.57	11,000	11,369	204,567	2024/6/22
	3.61 CHINA GOVT 250607	3.61	9,000	9,402	169,175	2025/6/7
	3.81 CHINA GOVT 500914	3.81	4,000	4,342	78,139	2050/9/14
	3.86 CHINA GOVT 490722	3.86	4,000	4,374	78,710	2049/7/22
小 計					1,840,247	
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	1.5 ISRAEL FIXED 231130	1.5	4,000	4,101	147,041	2023/11/30
	1.75 ISRAEL FIXED 250831	1.75	3,800	3,971	142,366	2025/8/31
	2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	5,300	5,764	206,648	2028/9/28
	4.25 ISRAEL FIXED 230331	4.25	4,500	4,875	174,795	2023/3/31
	5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	6,310	9,594	343,967	2042/1/31
	6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	6,000	7,606	272,692	2026/10/30
小 計					1,287,512	
合 計					272,752,505	

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

○投資信託財産の構成

(2022年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 272,752,505	% 97.0
コール・ローン等、その他	8,292,236	3.0
投資信託財産総額	281,044,741	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(275,215,180千円)の投資信託財産総額(281,044,741千円)に対する比率は97.9%です。

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

1 アメリカドル=113.84円	1 カナダドル=90.14円	1 メキシコペソ=5.5221円	1 ユーロ=128.65円
1 イギリスポンド=153.82円	1 スウェーデンクローネ=12.30円	1 ノルウェークローネ=12.76円	1 デンマーククローネ=17.29円
1 ポーランドズロチ=28.0868円	1 オーストラリアドル=81.45円	1 シンガポールドル=84.71円	1 マレーシアリングギット=27.163円
1 中国元=17.9929円	1 イスラエルシェケル=35.8499円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月26日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	558,473,919,840
コール・ローン等	2,858,378,716
公社債(評価額)	272,752,505,508
未収入金	280,931,646,195
未収利息	1,833,988,051
前払費用	97,401,370
(B) 負債	277,952,224,639
未払金	277,841,008,349
未払解約金	111,215,366
未払利息	924
(C) 純資産総額(A-B)	280,521,695,201
元本	207,797,445,119
次期繰越損益金	72,724,250,082
(D) 受益権総口数	207,797,445,119口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,500円

<注記事項>

- ①期首元本額 178,336,920,306円
期中追加設定元本額 51,424,997,169円
期中一部解約元本額 21,964,472,356円
また、1口当たり純資産額は、期末13,500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)	118,730,254,550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)	11,198,560,066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)	10,588,811,449円
三菱UFJ バランスファンド2 OVA(適格機関投資家限定)	10,350,412,727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)	9,621,727,405円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン(適格機関投資家限定)	7,536,444,398円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	4,430,989,878円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	4,250,612,095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)	3,967,017,434円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	3,051,372,815円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	2,578,174,656円
MUKAM バランスファンド2020-04(適格機関投資家限定)	2,277,992,239円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,228,340,024円
MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定)	2,213,256,791円
MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定)	2,206,893,460円
MUKAM バランスファンド2021-03(適格機関投資家限定)	2,165,159,543円
MUKAM バランスファンド2021-06(適格機関投資家限定)	2,116,614,767円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	1,360,826,023円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2(適格機関投資家限定)	1,299,676,485円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	1,175,239,308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)	664,417,640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)	354,136,263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)	326,476,715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)	320,515,630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)	319,596,394円

○損益の状況 (2021年1月27日～2022年1月26日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	5,563,158,627
受取利息	5,564,232,651
支払利息	△ 1,074,024
(B) 有価証券売買損益	△16,126,892,634
売買益	34,483,235,386
売買損	△50,610,128,020
(C) 保管費用等	△ 28,829,538
(D) 当期損益金(A+B+C)	△10,592,563,545
(E) 前期繰越損益金	72,405,337,489
(F) 追加信託差損益金	19,090,240,529
(G) 解約差損益金	△ 8,178,764,391
(H) 計(D+E+F+G)	72,724,250,082
次期繰越損益金(H)	72,724,250,082

- (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2021-03 (適格機関投資家限定)	318,320,078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)	314,518,867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)	314,267,273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)	312,660,303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)	312,015,642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)	311,484,137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)	311,241,135円
eMAXIS 先進国債券インデックス (為替ヘッジあり)	196,323,246円
eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	69,897,089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)	2,463,502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)	735,092円
合計	207,797,445,119円

[お 知 ら せ]

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