

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合／インデックス型	
信託期間	無期限（2000年8月18日設定）	
運用方針	三菱UFJ 国内債券マザーファンド受益証券、三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド受益証券、三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券、三菱UFJ 外国株式マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、リスクの軽減に努めつつ中長期的に着実な成長を図ることを目標として運用を行います。	
主要運用対象	ベビーファンド	三菱UFJ 国内債券マザーファンド受益証券、三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド受益証券、三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券、三菱UFJ 外国株式マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式、公社債、短期金融商品に直接投資することもできます。
	三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
	三菱UFJ 外国株式マザーファンド	日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。
	三菱UFJ 国内債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	三菱UFJ 外国債券マザーファンド	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	ベビーファンド	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の40%以下とし、外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
	三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	三菱UFJ 外国株式マザーファンド	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）並びに外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	三菱UFJ 国内債券マザーファンド	外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
	三菱UFJ 外国債券マザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎年1回決算（原則として5月20日。ただし、5月20日が休業日の場合は翌営業日とします。）を行い基準価額水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。ただし、分配対象収益等が少額の場合には分配を行わないこともあります。	

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

運用報告書（全体版）

三菱UFJ ライフセレクトファンド （安定型）

第16期（決算日：2016年5月20日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、お手持ちの「三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）」は、去る5月20日に第16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投信株式会社は2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、「三菱UFJ国際投信株式会社」となりました。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 URL:<http://www.am.mufg.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル **TEL. 0120-151034**
 (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、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目次

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）のご報告

◇最近5期の運用実績	1
◇当期中の基準価額と市況等の推移	2
◇運用経過	3
◇今後の運用方針	15
◇1万口当たりの費用明細	16
◇売買及び取引の状況	17
◇株式売買比率	17
◇利害関係人との取引状況等	17
◇組入資産の明細	19
◇投資信託財産の構成	20
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	21
◇損益の状況	21
◇お知らせ	22

マザーファンドのご報告

◇三菱UFJ トピックスイндеックスマザーファンド	49
◇三菱UFJ 外国株式マザーファンド	82
◇三菱UFJ 国内債券マザーファンド	123
◇三菱UFJ 外国債券マザーファンド	145

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			ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
12期(2012年5月21日)	9,999	0	△ 1.3	108.67	△ 1.0	22.3	0.5	73.5	0.0	0.1	4,893
13期(2013年5月20日)	11,645	100	17.5	128.03	17.8	26.1	0.4	69.5	0.4	0.2	5,865
14期(2014年5月20日)	11,795	0	1.3	130.11	1.6	24.3	0.4	71.7	—	0.2	6,194
15期(2015年5月20日)	12,948	100	10.6	144.45	11.0	25.1	0.3	70.9	—	0.2	7,070
16期(2016年5月20日)	12,859	0	△ 0.7	143.94	△ 0.4	24.0	0.6	71.7	0.2	0.2	7,280

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドのベンチマークは、NOMURA-BPI総合指数67%、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）5%、東証株価指数（TOPIX）17%、MSCIコクサイインデックス（除く日本円換算ベース）8%、短期金融資産（有担保コール（翌日物））3%を合成した指数です。ベンチマークは、設定日を100.00として委託会社が計算したものです。

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

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

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 証 書 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率					
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%	%	%
2015年5月20日	12,948	—	144.45	—	25.1	0.3	70.9	—	0.2
5月末	13,018	0.5	145.29	0.6	25.2	0.4	71.2	0.2	0.2
6月末	12,899	△0.4	144.01	△0.3	24.1	0.3	71.5	0.1	0.2
7月末	12,993	0.3	145.16	0.5	24.9	0.2	71.6	—	0.2
8月末	12,745	△1.6	142.44	△1.4	23.2	0.4	71.8	—	0.2
9月末	12,529	△3.2	139.93	△3.1	23.4	0.4	71.8	—	0.2
10月末	12,886	△0.5	144.01	△0.3	25.9	0.4	71.0	0.2	0.2
11月末	12,919	△0.2	144.47	0.0	24.5	0.4	71.6	0.1	0.2
12月末	12,887	△0.5	144.16	△0.2	24.0	0.4	71.7	—	0.2
2016年1月末	12,743	△1.6	142.53	△1.3	23.2	0.4	71.7	—	0.2
2月末	12,604	△2.7	141.18	△2.3	23.2	0.4	72.1	—	0.2
3月末	12,836	△0.9	143.62	△0.6	24.9	0.5	71.5	0.2	0.2
4月末	12,868	△0.6	144.14	△0.2	24.0	0.5	72.0	0.2	0.2
(期 末)									
2016年5月20日	12,859	△0.7	143.94	△0.4	24.0	0.6	71.7	0.2	0.2

(注) 騰落率は期首比。

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

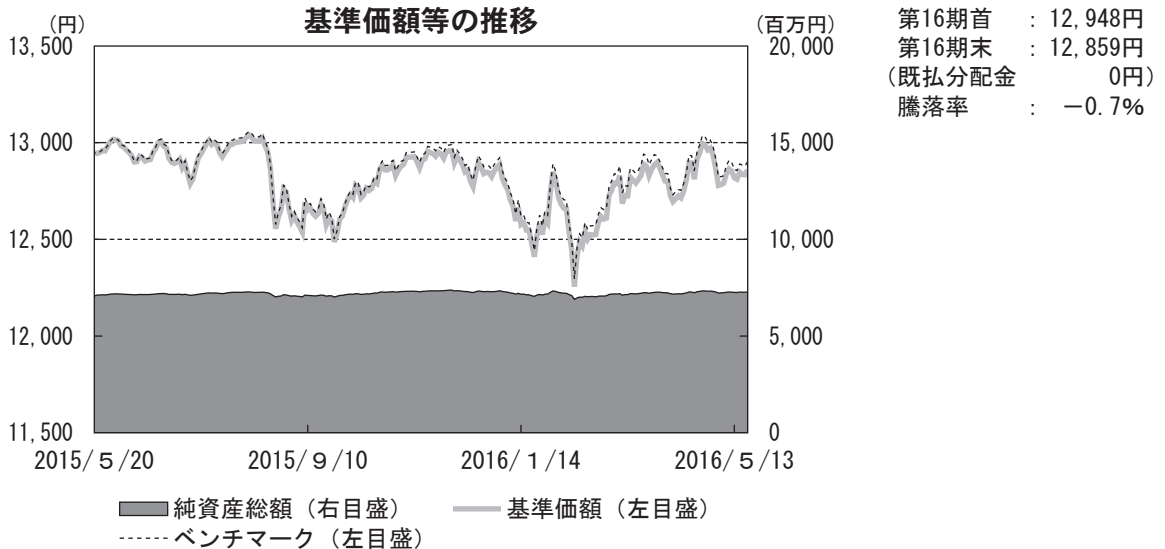
(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第16期：2015/5/21～2016/5/20）

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ0.7%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（-0.4%）を0.3%下回りました。



基準価額の主な変動要因

上昇要因	主として国内債券市況が好調であったことなどが基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	内外株式市況の下落に加え、主要通貨に対する円高が進行したことなどが基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

（第16期：2015/5/21～2016/5/20）

市況の推移
（期首を100として指数化）

・東証株価指数（TOPIX）とは、東京証券取引所第一部に上場する国内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代表的な株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

市況の推移
（期首を100として指数化）

・MSCIコクサイ インデックスは、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（除く日本 円換算ベース）は、MSCIコクサイ インデックス（除く日本 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。

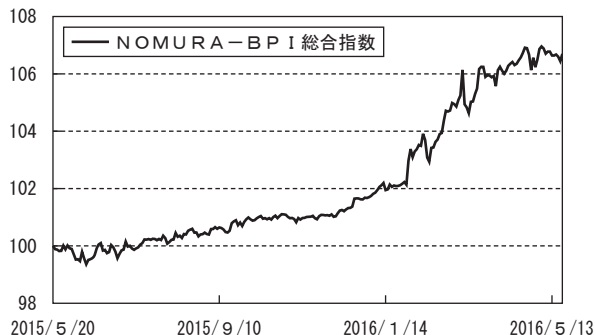
◎国内株式市況

- ・中国経済減速への不安から世界同時株安となったことや、円高・米ドル安が進行したことなどから、期を通じて国内株式市況は下落しました。

◎外国株式市況

- ・米国の利上げを巡る警戒感に加え、原油価格の下落や中国経済の減速懸念などから、外国株式市況は下落しました。

市況の推移
(期首を100として指数化)



・NOMURA-BPI 総合指数とは、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、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI 総合指数は野村證券株式会社の知的財産であり、ファンドの運用成果に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。

市況の推移
(期首を100として指数化)



・シティ世界国債インデックス (除く日本、Local) は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総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。

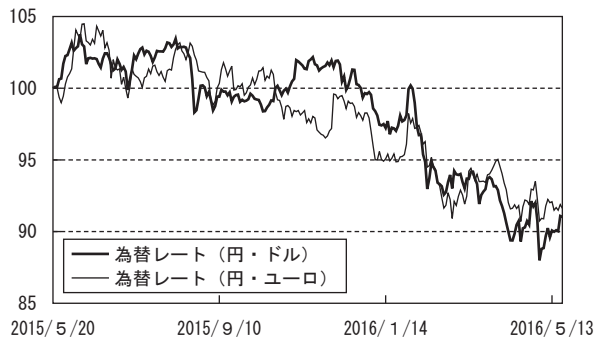
◎国内債券市況

- ・原油価格など商品市況の下落を受けた期待インフレ率の低下や新興国を中心とした海外景気の先行きに対する懸念などから、債券市況は上昇（金利は低下）基調で推移し、2016年1月29日に日銀が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を決定したことから、債券市況は一段と上昇しました。

◎外国債券市況

- ・先進国の債券市況は、世界的な景気減速懸念や原油をはじめとする商品市況の悪化によるインフレ期待の低下などを背景に上昇しました。

為替市況の推移
 (期首を100として指数化)



◎為替市況

- ・円・ドル相場は、FRB（米連邦準備制度理事会）による政策金利の引き上げが意識されてドルが対円で上昇する局面もありましたが、世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景にドルが対円で売られました。期首との比較では、ドルは対円で9.0%下落しました。
- ・円・ユーロ相場は、ユーロ圏の景況感の改善などを背景に上昇する局面もありましたが、ECB（欧州中央銀行）が緩和的な金融政策を維持したことなどを背景に、ユーロが対円で売られました。期首との比較では、ユーロは対円で8.4%下落しました。

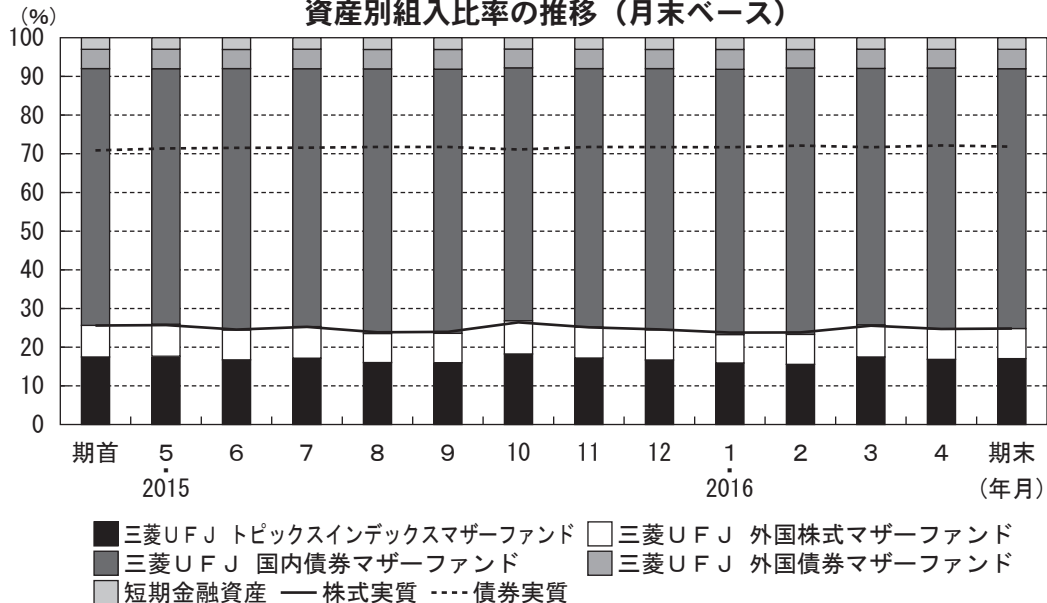
当該投資信託のポートフォリオについて

＜三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）＞

- ・内外の株式・債券に投資し、リスクの軽減に努めつつ中長期的に着実な成長を図るため各資産の指数を独自に合成した指数に連動する投資成果をめざした運用を行いました。その結果、当期は、主に内外株式市況の下落や主要通貨に対する円高の進行などから基準価額は下落しました。
- ・当期の資産配分の推移は以下の通りです。

（ご参考）

資産別組入比率の推移（月末ベース）



<三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド>

基準価額は期首に比べ16.5%の下落となりました。

- ・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）と業種別比率などが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。

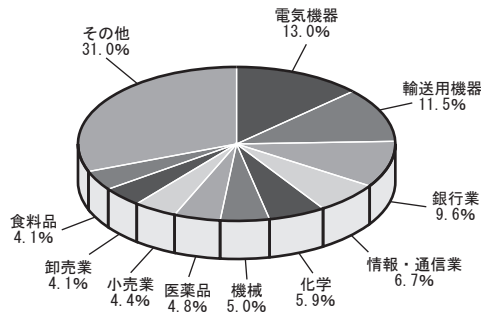
（注）マルチファクターモデル

株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・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

（ご参考）

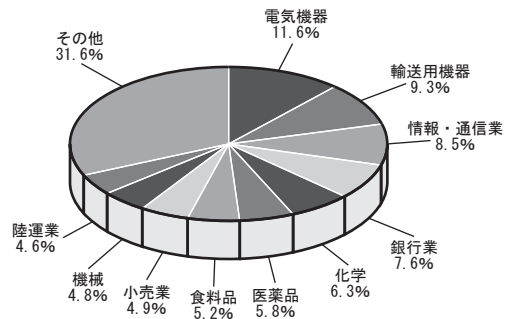
組入上位10業種

期首（2015年5月20日）



（注）比率は現物株式評価額に対する割合です。

期末（2016年5月20日）



（注）比率は現物株式評価額に対する割合です。

<三菱UFJ 外国株式マザーファンド>

基準価額は期首に比べ15.6%の下落となりました。

- ・ベンチマークであるMSCIコクサイ インデックス（除く日本 円換算ベース）に採用されている株式（先物・REIT（不動産投資信託証券）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

<三菱UFJ 国内債券マザーファンド>

基準価額は期首に比べ6.7%の上昇となりました。

- ・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。
- ・ベンチマークであるNOMURA-BPI総合指数の構成銘柄を種別や年限など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。

（ご参考）

利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

期首（2015年5月20日）

最終利回り	0.4%
直接利回り	1.2%
デュレーション	8.0年

- ・数値は債券現物部分で計算しております（先物は考慮しておりません）。
- ・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。

期末（2016年5月20日）

最終利回り	-0.0%
直接利回り	1.1%
デュレーション	8.8年

- ・数値は債券現物部分で計算しております。
- ・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。
- ・デュレーション調整のため、債券先物を組み入れることがあります。この場合、デュレーションについては債券先物を含めて計算しています。

<三菱UFJ 外国債券マザーファンド>

基準価額は期首に比べ6.5%の下落となりました。

- ・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シティ世界国債インデックス（除く日本、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。

（ご参考）

利回り・デュレーション

期首（2015年5月20日）

最終利回り	1.3%
直接利回り	2.7%
デュレーション	6.6年

- ・数値は債券現物部分で計算しております（先物は考慮しておりません）。
- ・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。

期末（2016年5月20日）

最終利回り	1.1%
直接利回り	2.5%
デュレーション	6.9年

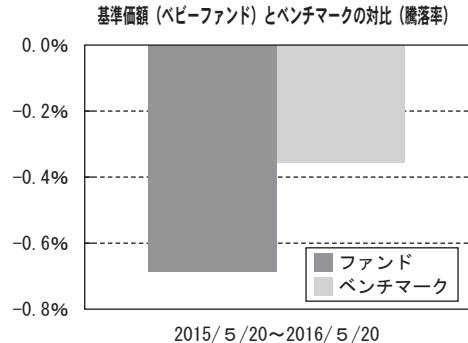
- ・数値は債券現物部分で計算しております（先物は考慮しておりません）。
- ・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

＜三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）＞
基準価額の騰落率は、0.7%の下落となり、ベンチマークの0.4%の下落を0.3%下回りました。
差異の内訳は以下の通りです。

（内訳）

三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	0.4%程度
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	0.0%程度
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	0.0%程度
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	0.0%程度
その他（信託報酬等）	△0.7%程度



＜三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド＞

ベンチマークは18.3%の下落となったため、カイ離は1.8%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い流動性を維持しました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	0.0%程度	1.7%程度	1.8%程度

（注）四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

- ・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・期中における先物組入比率の平均は、1.3%程度となりました。

（注）先物の使用は、「利便性に優れ、売買コストが低い」利点がある反面、必ずしも指数の値動きと一致しないことから、ベンチマークからのカイ離を生む可能性があります。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.7%程度でした。

- ・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

プラス要因	配当・利子収入等	計	2.1%程度
マイナス要因	売買コスト等	計	△0.4%程度

信託財産の収益向上を目的に、保有株式の貸し付けを行っています。貸付契約額は、期末時点で概ね純資産総額の6割程度となり、信託財産に若干の収益寄与となりました。

<三菱UFJ 外国株式マザーファンド>

ベンチマークは16.0%の下落となったため、カイ離は0.4%程度となりました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合計
ベンチマークとのカイ離	△0.0%程度	△0.1%程度	0.5%程度	0.4%程度

（注）四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率による影響は△0.0%程度でした。

- ・期中、ファンドの資産をほぼ全額株式（先物・REITを含む）に投資しました。
- ・効率的に運用を行うため、円貨、外貨現金などを若干保有しました。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.1%程度でした。

ファンドとベンチマークの値動きや、推定トラッキングエラー、株式の国別比率、業種別比率などについてモニターし、必要に応じて定量モデルを用いた調整を図ることでベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。その際に、ファンドがベンチマークと連動する可能性をより高めるため、

- ・売買に係るコストを考慮しつつ、できる限り多くの銘柄に分散投資を行いました。
- ・ファンドの特性をよりベンチマークに近づけるべく、マルチファクターモデルを用いて組入銘柄とその組入比率を決定しています。

◎その他の要因

その他の要因による影響は0.5%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入・為替効果等	計	0.6%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料等	計	△0.1%程度

為替効果：現地通貨建て株価を円建てに換算する方法が、ファンドとベンチマークで異なるため生じる差異。

ファンド：株価（現地通貨建て前日終値）を翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。

ベンチマーク：株価（現地通貨建て前日終値）を同日ロンドン時間の16時時点の為替レートをを用い一旦ドル換算で評価。その後翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。

<三菱UFJ 国内債券マザーファンド>

ベンチマークは6.7%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

- ・ 公社債の実質の組入比率については、期を通じて概ね100%の水準で推移させ、ベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。そのため、期を通じて現金の保有による影響は軽微でした。
- ・ ポートフォリオについては、主に層化抽出法に基づき運用を行い、ファンドとベンチマークの値動きや推定トラッキングエラーなどについてモニターし必要に応じて調整を図ることでベンチマークとの連動性を維持するよう努めました。結果、種別および年限構成比については、概ねベンチマーク並みとなっており、影響は軽微でした。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

- ・ 年限構成、種別構成、デュレーション、流動性などを考慮して選択した銘柄に分散投資しました。
- ・ 流動性の問題を勘案し、相対的に格付の低い社債への投資は見送りましたが、影響は軽微でした。

◎その他の要因

取引コストや基準価額とベンチマークの算出に用いる債券評価価格の差異の影響などにより、 $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

<三菱UFJ 外国債券マザーファンド>

ベンチマークは6.3%の下落となったため、カイ離は $\Delta 0.2\%$ 程度となりました。

	ポートフォリオ要因	管理コスト等要因	評価時価差異に基づく要因	合計
ベンチマークとのカイ離	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.1\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

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。

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

為替の効果および債券の効果による要因です。

為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

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16期	
	2015年5月21日～2016年5月20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	3,910	

(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

<三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）>

- ・資産配分方針は、従前通り基準ポートフォリオを維持します。また各資産の組入比率は、期を通じて同比率に準ずるよう調整を行います。

<基準ポートフォリオ>

国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期金融資産
17%	8%	67%	5%	3%

<三菱UFJ トピックス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。

<三菱UFJ 外国株式マザーファンド>

- ・ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を株式（先物・REITを含む）に投資し、高い株式組入比率を維持します。
- ・売買に係るコストを考慮しつつ、多くの銘柄に分散投資を行います。

<三菱UFJ 国内債券マザーファンド>

- ・ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を公社債（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持します。
- ・組入銘柄の見直しと投資比率の調整を適宜行い、種別構成比についてもベンチマークの比率に近づけるように運用します。

<三菱UFJ 外国債券マザーファンド>

- ・今後の運用についても、運用方針を堅持します。
- ・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

(2015年5月21日～2016年5月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	94	0.734	(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 ）	(33)	(0.259)	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 ）	(50)	(0.389)	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 ）	(11)	(0.086)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（ 株 式 ）	(0)	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	(0)	(0.001)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	1	0.008	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(1)	(0.008)	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	95	0.744	
期中の平均基準価額は、12,827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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(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

(2015年5月21日～2016年5月20日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	515,133	575,278	316,507	367,779
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	565,864	758,862	649,985	878,113
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	32,472	86,910	18,819	51,176
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	125,923	229,220	80,349	151,105

○株式売買比率

(2015年5月21日～2016年5月20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	
	三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	三菱UFJ 外国株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	91,682,036千円	48,776,644千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	231,862,274千円	129,910,903千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.39	0.37

(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

(2015年5月21日～2016年5月20日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）>

該当事項はございません。

<三菱UFJ トピックス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	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
株式	百万円 38,315	百万円 7,120	% 18.6	百万円 53,366	百万円 8,302	% 15.6

平均保有割合 0.5%

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

＜三菱UFJ 外国株式マザーファンド＞

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 17,338	百万円 13,044	% 75.2	百万円 41,757	百万円 33,499	% 80.2

平均保有割合 0.4%

※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。

＜三菱UFJ 国内債券マザーファンド＞

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 56,318	百万円 18,303	% 32.5	百万円 104,383	百万円 35,239	% 33.8

平均保有割合 2.0%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

＜三菱UFJ 外国債券マザーファンド＞

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 5,876	百万円 3,836	% 65.3	百万円 54,626	百万円 41,821	% 76.6

平均保有割合 0.4%

※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。

利害関係人の発行する有価証券等

＜三菱UFJ トピックス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
株式	百万円 845	百万円 1,397	百万円 4,658

＜三菱UFJ 国内債券マザーファンド＞

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 -	百万円 305	百万円 331

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

<三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 176

<三菱UFJ 国内債券マザーファンド>

種 類	買 付 額
公社債	百万円 600

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	69千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.697千円
(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、カブドットコム証券、三菱東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱UFJリース、アコム、ジャックス、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2016年5月20日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	972,175	1,170,801	1,241,166
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	3,558,582	3,474,461	4,890,304
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	128,142	141,795	364,642
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	284,440	330,014	565,810

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「参考情報」または「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

（2016年5月20日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	千円 1,241,166	% 17.0
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	4,890,304	66.9
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	364,642	5.0
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	565,810	7.7
コール・ローン等、その他	246,346	3.4
投資信託財産総額	7,308,268	100.0

(注) 三菱UFJ 外国債券マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（73,799,116千円）の投資信託財産総額（73,862,308千円）に対する比率は99.9%です。

(注) 三菱UFJ 外国株式マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（114,260,390千円）の投資信託財産総額（114,397,698千円）に対する比率は99.9%です。

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

1 アメリカドル=110.09円	1 カナダドル=84.13円	1 メキシコペソ=5.98円	1 ユーロ=123.28円
1 イギリスポンド=160.73円	1 スイスフラン=111.03円	1 スウェーデンクローネ=13.18円	1 ノルウェークローネ=13.17円
1 デンマーククローネ=16.58円	1 ポーランドズロチ=27.95円	1 オーストラリアドル=79.63円	1 ニュージーランドドル=74.43円
1 香港ドル=14.17円	1 シンガポールドル=79.85円	1 マレーシアリングット=27.03円	1 イスラエルシェケル=28.47円
1 南アフリカランド=6.97円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2016年5月20日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	7,308,268,699
コール・ローン等	244,848,226
三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド(評価額)	1,241,166,842
三菱UFJ 国内債券マザーファンド(評価額)	4,890,304,593
三菱UFJ 外国債券マザーファンド(評価額)	364,642,591
三菱UFJ 外国株式マザーファンド(評価額)	565,810,443
未収入金	1,496,004
(B) 負債	28,102,610
未払解約金	1,718,459
未払信託報酬	26,383,465
未払利息	398
その他未払費用	288
(C) 純資産総額(A-B)	7,280,166,089
元本	5,661,629,521
次期繰越損益金	1,618,536,568
(D) 受益権総口数	5,661,629,521口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,859円

<注記事項>

- ①期首元本額 5,460,957,343円
 期中追加設定元本額 967,487,085円
 期中一部解約元本額 766,814,907円
 また、1口当たり純資産額は、期末12,859円です。

②分配金の計算過程

項 目	2015年5月21日～ 2016年5月20日
費用控除後の配当等収益額	50,752,663円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	1,157,398,124円
分配準備積立金額	1,005,993,844円
当ファンドの分配対象収益額	2,214,144,631円
1万口当たり収益分配対象額	3,910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（2015年5月21日～2016年5月20日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	86,177
受取利息	102,037
支払利息	△ 15,860
(B) 有価証券売買損益	13,903,266
売買益	331,784,693
売買損	△ 317,881,427
(C) 信託報酬等	△ 52,894,574
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 38,905,131
(E) 前期繰越損益金	1,005,993,844
(F) 追加信託差損益金	651,447,855
(配当等相当額)	(1,156,398,196)
(売買損益相当額)	(△ 504,950,341)
(G) 計(D+E+F)	1,618,536,568
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	1,618,536,568
追加信託差損益金	651,447,855
(配当等相当額)	(1,157,398,124)
(売買損益相当額)	(△ 505,950,269)
分配準備積立金	1,056,746,507
繰越損益金	△ 89,657,794

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

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

【お 知 ら せ】

- ①2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年7月1日)
- ②2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5% (法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。)) の税率が適用されます。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2016年5月20日現在）

＜三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド＞

下記は、三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド全体(198,095,381千口)の内容です。

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
極洋	53	49	13,034
日本水産	151.5	132.7	78,956
マルハニチロ	25.7	23.5	58,585
サカタのタネ	19.7	17.1	48,222
ホクト	13.5	11.8	23,092
ホクリヨウ	—	1.2	1,194
鉱業 (0.3%)			
住石ホールディングス	38.6	35.3	3,212
日鉄鉱業	34	32	12,288
三井松島産業	81	77	8,085
国際石油開発帝石	647.2	606.7	519,881
日本海洋掘削	3.7	3.5	8,431
石油資源開発	17.5	18.4	43,810
K&Oエナジーグループ	8.1	7.8	10,296
建設業 (3.3%)			
ショーボンドホールディングス	11.9	12.1	58,564
ミライト・ホールディングス	37.6	35.4	38,055
タマホーム	9.1	9.6	4,329
サンヨーホームズ	1.9	3.3	1,494
ダイセキ環境ソリューション	1.5	2.7	3,183
安藤・間	82.1	77.3	47,230
東急建設	43.9	37.8	35,834
コムシスホールディングス	54.7	49.5	92,515
ミサワホーム	14.7	13.9	10,925
ビーアールホールディングス	—	3.2	1,366
高松コンストラクショングループ	9.3	8.6	22,403
東建コーポレーション	4.6	4.8	42,624
ソネック	—	0.9	513
ヤマウラ	6.1	5.5	2,838
大成建設	638	598	478,400
大林組	368	345.4	392,374

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
清水建設	376	352	345,312
飛鳥建設	84.2	94.9	17,461
長谷工コーポレーション	153.6	134.4	159,667
松井建設	14	12.8	11,955
銭高組	18	17	6,800
鹿島建設	540	540	395,820
不動テトラ	94.4	83.6	12,205
鉄建建設	75	71	20,803
日鉄住金テックスエンジ	23	—	—
西松建設	133	133	61,712
三井住友建設	498.4	446.7	43,329
大豊建設	34	45	20,295
前田建設工業	82	71	57,865
佐田建設	44	8.4	3,242
ナカノフドー建設	9.8	9	4,392
奥村組	117	109	66,708
大和小田急建設	6.9	—	—
東鉄工業	14.7	13.9	39,698
イチケン	14	13	3,562
淺沼組	41	38	9,196
戸田建設	154	134	66,732
熊谷組	155	170	48,790
青木あすなろ建設	8.2	7.7	5,459
北野建設	26	24	6,288
植木組	16	15	3,240
三井ホーム	15	15	7,305
矢作建設工業	15.2	15.8	13,935
ビーエス三菱	13.8	14.3	5,434
日本ハウスホールディングス	21	23.9	8,651
大東建託	45.9	42.4	695,572
新日本建設	15	13.9	8,423
N I P P O	28	27	52,596

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東亜道路工業	23	22	7,062	
前田道路	38	36	70,488	
日本道路	37	34	15,742	
東亜建設工業	93	102	15,708	
若築建設	73	69	11,040	
東洋建設	37.3	36.7	18,203	
五洋建設	136.3	127.8	69,778	
大林道路	15	13.6	10,363	
世紀東急工業	18.5	18.6	9,895	
福田組	18	19	22,192	
住友林業	90.6	79.3	119,663	
日本基礎技術	15.1	13.1	4,768	
日成ビルド工業	34	32	16,064	
ヤマダ・エスバイエルホーム	59	62	5,332	
バコーボレーション	16.1	15	5,205	
バナホーム	46	43	37,496	
大和ハウス工業	359.7	340.2	1,101,907	
ライト工業	19.9	22.3	25,734	
積水ハウス	382.1	385.1	761,150	
日特建設	16.8	12.9	5,456	
北陸電気工事	6	5.6	4,552	
ユアテック	19	18	14,670	
西部電気工業	11	9	3,915	
四電工	10	9	3,690	
中電工	17.7	16.5	36,597	
関電工	56	46	40,158	
きんでん	82	69.6	89,505	
東京エネシス	14	13	14,482	
トーエネック	17	16	8,992	
住友電設	9.7	9.2	12,824	
日本電設工業	20	18.8	36,584	
協和エクシオ	52.1	45.1	61,651	
新日本空調	10.1	9.8	10,280	
NDS	19	18	4,968	
九電工	23	21	67,935	
三機工業	25	25.8	22,549	
日揮	123	116	200,912	
中外炉工業	38	36	8,208	
ヤマト	11	10.6	5,300	

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
太平電業	17	17	19,108	
高砂熟学工業	33.7	34.3	47,814	
三晃金属工業	13	12	3,372	
朝日工業社	14	13	6,513	
明星工業	20.5	21.2	9,964	
大気社	17.5	14.1	36,053	
ダイダシ	16	15	11,850	
日比谷総合設備	15.8	14	22,722	
東芝プラントシステム	19.9	18.5	29,803	
東洋エンジニアリング	60	62	21,080	
千代田化工建設	89	83	66,649	
新興ブランテック	25.1	23.4	20,966	
食料品 (5.1%)				
日本製粉	75	74	61,716	
日清製粉グループ本社	134.7	126.3	236,054	
日東富士製粉	10	9	3,006	
昭和産業	50	47	22,936	
鳥越製粉	9.4	9.3	5,914	
中部飼料	11.6	10.8	8,802	
フィード・ワン	75.5	70	8,610	
東洋精糖	25	22	2,442	
日本甜菜製糖	62	59	10,915	
三井製糖	48	45	23,265	
塩水港精糖	14.8	13.9	3,308	
日新製糖	—	4.9	6,938	
森永製菓	111	104	58,136	
中村屋	28	27	12,393	
江崎グリコ	28.4	26.6	156,408	
名糖産業	5.5	5.2	6,905	
不二家	70	66	12,936	
山崎製パン	90	84	218,988	
第一屋製パン	20	21	2,394	
モロゾフ	19	18	7,686	
亀田製菓	6.8	6.4	29,376	
寿スピリッツ	2.9	8.3	22,376	
カルビー	45.5	42.7	174,856	
森永乳業	111	103	68,392	
六甲バター	5.5	5.2	10,238	
ヤクルト本社	65.9	61.8	334,338	

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）

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
明治ホールディングス	36.4	68.2	674,498	
雪印メグミルク	28.7	27.1	86,313	
ブリマハム	69	73	21,535	
日本ハム	90	85	216,750	
伊藤ハム	67	—	—	
丸大食品	63	60	28,440	
米久	4	—	—	
S Foods	7.7	7.2	20,808	
伊藤ハム米久ホールディングス	—	69	64,722	
サッポロホールディングス	201	176	103,840	
アサヒグループホールディングス	247	216.1	780,121	
キリンホールディングス	497.9	466.8	850,042	
宝ホールディングス	96.3	83.4	82,649	
オエノンホールディングス	31	33	6,897	
養命酒製造	7	3.5	6,471	
コカ・コーラウエスト	41.6	39	122,655	
コカ・コーライーストジャパン	37.3	40.8	87,475	
サントリー食品インターナショナル	73.6	78.9	407,124	
ダイドードリンコ	6.2	5.8	33,060	
伊藤園	36.5	34.2	126,027	
キーコーヒー	10.9	10.2	18,441	
ユニカフェ	3.7	3.4	3,015	
ジャパンフーズ	2.2	1.9	2,356	
日清オイリオグループ	59	61	29,463	
不二製油グループ本社	32.8	30.7	60,417	
かどや製油	1.1	1.1	3,054	
J-オイルミルズ	52	48	17,088	
キッコーマン	100	87	330,600	
味の素	283	242.2	605,621	
キュービー	62.5	58.6	172,225	
ハウス食品グループ本社	45.5	39.4	86,758	
カゴメ	47.5	41.3	110,766	
焼津水産化学工業	6.3	5.4	5,410	
アリアケジャパン	11.2	9.4	63,732	
ビエトロ	—	1.2	2,312	
エバラ食品工業	2.1	2.7	5,213	
ニチレイ	131	123	117,957	
東洋水産	64.2	56.6	241,682	
イートアンド	1.3	1.3	2,837	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日清食品ホールディングス	52	48.7	270,772	
永谷園ホールディングス	11	11	13,167	
一正蒲鉾	4.4	4.1	4,259	
フジッコ	12	11.2	26,700	
ロック・フィールド	6.5	12.1	20,715	
日本たばこ産業	680.9	680.9	2,993,917	
ケンコーマヨネーズ	4.1	3.8	9,591	
わらべや日洋	7.3	6.3	13,469	
なとり	5.7	5.8	9,657	
北の達人コーポレーション	—	2.2	1,042	
ユーグレナ	41.1	36.9	58,486	
ミヨシ油脂	45	41	5,207	
理研ビタミン	3.6	3.3	14,652	
繊維製品 (0.7%)				
片倉工業	14.6	13.8	17,636	
グンゼ	93	88	28,864	
東洋紡	455	426	87,756	
ユニチカ	349	325	20,475	
富士紡ホールディングス	58	53	13,462	
日清紡ホールディングス	73	—	—	
倉敷紡績	120	112	22,064	
シキボウ	78	73	8,249	
日本毛織	36	32.9	24,773	
トーア紡コーポレーション	72	6.1	2,885	
ダイドリーミテッド	14.1	13.4	6,164	
帝国繊維	12	11.3	15,469	
帝人	469	440	170,280	
東レ	889	781	731,172	
サカイオーバックス	34	30	5,070	
住江織物	29	27	7,101	
日本フェルト	6	5.4	2,575	
イチカワ	8	7	1,911	
日本バイリーン	15	—	—	
芦森工業	27	25	4,100	
アツギ	105	88	9,768	
ダイニック	23	22	3,542	
セーレン	28.5	27	32,238	
東海染工	—	18	2,340	
小松精練	20.1	17	10,200	

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）

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
ワコールホールディングス	68	64	76,224	
ホギメディカル	7.2	6.7	43,081	
クラウディア	3.4	3	1,503	
T S I ホールディングス	51.7	48.5	32,495	
三陽商会	63	62	15,252	
オンワードホールディングス	82	70	53,760	
ルック	22	20	3,020	
キムラタン	587	537	3,759	
ゴールドウイン	26	4.6	21,988	
デサント	26.3	24.7	35,172	
キング	8	6	2,172	
ヤマトインターナショナル	8.9	7.8	3,034	
パルプ・紙 (0.3%)				
特種東海製紙	66	63	21,735	
王子ホールディングス	471	442	186,966	
日本製紙	55.4	55.7	108,559	
三菱製紙	176	167	13,360	
北越紀州製紙	71.2	66.7	47,557	
中越パルプ工業	45	44	9,460	
巴川製紙所	20	18	3,420	
大王製紙	51	47.9	54,366	
レンゴー	101	95	59,945	
トーモク	36	34	10,166	
ザ・バック	8.1	7.6	19,972	
化学 (6.3%)				
クラレ	195.5	169.9	244,656	
旭化成	716	672	483,436	
共和レザー	7.5	6.9	6,203	
コープケミカル	21	—	—	
昭和電工	765	717	81,021	
住友化学	845	793	389,363	
日本化成	22	21	2,331	
住友精化	24	22	12,012	
日産化学工業	75.3	64.7	207,040	
ラサ工業	45	43	4,558	
クレハ	80	81	32,967	
多木化学	7	7	4,515	
テイカ	19	18	9,306	
石原産業	196	195	14,625	

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
片倉コープアグリ	8	13	2,704	
日東エフシー	—	6.2	5,394	
日本曹達	73	70	35,350	
東ソー	287	291	161,796	
トクヤマ	180	181	51,223	
セントラル硝子	117	117	64,233	
東亜合成	144	67.4	68,748	
大阪ソーダ	45	45	17,730	
関東電化工業	28	26	25,142	
デンカ	238	223	108,601	
信越化学工業	205.9	193.1	1,224,254	
日本カーバイド工業	40	38	6,118	
堺化学工業	46	44	13,640	
エア・ウォーター	101	89	153,169	
大陽日酸	147.4	82.9	87,127	
日本化学工業	44	41	8,323	
日本パーカライジング	54.2	55	56,925	
高圧ガス工業	16	16	10,336	
チタン工業	14	14	2,576	
四国化成工業	17	16	13,632	
戸田工業	24	23	7,291	
ステラ ケミファ	6	5.6	16,794	
保土谷化学工業	35	34	8,874	
日本触媒	90	15.6	97,968	
大日精化工業	47	41	18,901	
カネカ	155	145	128,905	
三菱瓦斯化学	198	185	116,365	
三井化学	522	457	173,660	
J S R	113.4	101	162,004	
東京応化工業	23.8	21.6	57,780	
大阪有機化学工業	8.2	7.6	4,742	
三菱ケミカルホールディングス	717.9	721.1	406,267	
日本合成化学工業	27	25	17,100	
ダイセル	161.5	151.4	202,119	
住友ベークライト	107	100	52,200	
積水化学工業	266	244.4	353,646	
日本ゼオン	99	91	74,529	
アイカ工業	34.5	32.4	80,481	
宇部興産	578	576	115,776	

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
積水樹脂	17.7	16.7	26,285
タキロン	24	25	13,425
旭有機材	40	34	7,072
日立化成	56.7	53.2	107,517
ニチバン	12	11	7,887
リケンテクノス	18.4	23	9,959
大倉工業	27	26	7,618
積水化成成品工業	33	27	9,774
群栄化学工業	30	29	8,265
タイガースポリマー	5.8	5	2,810
ミライアル	4.3	4.2	3,267
ダイキアクシス	1.8	2.1	1,829
ダイキョーニシカワ	3.7	14	19,656
日本化薬	75	70	74,970
カーリットホールディングス	9.2	10.3	4,830
日本精化	9.6	9	6,525
扶桑化学工業	—	6.8	11,002
ADEKA	52.9	52.9	80,143
日油	94	81	76,059
新日本理化	19.1	18.6	3,329
ハリマ化成グループ	9.3	9.2	4,857
花王	308.8	289.6	1,747,736
第一工業製薬	26	24	8,376
ニイタカ	—	1.6	2,225
三洋化成工業	36	34	29,036
大日本塗料	65	62	12,462
日本ペイントホールディングス	99.4	83.1	250,962
関西ペイント	139	121.8	256,876
神東塗料	9	9	1,593
中国塗料	33	31	23,684
日本特殊塗料	8.9	7.5	7,500
藤倉化成	15.3	14.5	7,482
太陽ホールディングス	9.3	7.9	27,729
D I C	460	425	108,375
サカタインクス	23.5	22.1	28,464
東洋インキＳＣホールディングス	114	105	48,300
T&K TOKA	3.8	7.7	6,837
富士フイルムホールディングス	262.8	246.4	1,119,888
資生堂	204.3	204.3	568,771

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ライオン	132	124	210,552
高砂香料工業	37	7.1	18,062
マンダム	11.5	10.1	51,005
ミルボン	6.8	6.4	31,360
ファンケル	26.9	25.2	38,379
コーセー	18.6	17.4	162,864
コタ	4	3.8	4,130
シーズ・ホールディングス	7.8	13.7	31,647
シーボン	1.4	1.3	2,986
ポーラ・オルビスホールディングス	13.7	11	102,080
ノエビアホールディングス	7.2	6.8	21,454
アジupanコスメジャパン	2.4	2.2	2,074
エステー	7.7	7.4	8,421
アグロ カネショウ	3.2	4.2	4,414
コニシ	9	16.9	23,981
長谷川香料	14.4	13.7	26,030
星光PMC	6.6	6.1	7,228
小林製薬	18.8	16.3	145,396
荒川化学工業	9.7	9.2	8,859
メック	9.2	8.5	7,301
日本高純度化学	3.2	3	6,339
タカラバイオ	—	22.5	31,860
J C U	3.1	3.2	10,880
新田ゼラチン	7	7.1	5,332
O A Tアグリオ	—	1.3	2,072
デクセリアルズ	—	32.2	28,400
アース製薬	8.2	7.8	38,376
イハラケミカル工業	17.7	16.7	21,659
北興化学工業	12	12	3,852
大成ラミック	3.2	3	8,376
クミアイ化学工業	23.7	22.4	20,227
日本農薬	26.3	25	12,650
アキレス	100	86	11,610
有沢製作所	19.4	16.1	8,694
日電電工	88.7	83.2	561,766
レック	4	3.4	4,637
きもと	21.2	19.7	3,250
藤森工業	9.8	9.3	22,292
前澤化成工業	8	7.6	7,508

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）

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
JSP	8.6	7	15,302	
エフビコ	10.2	9.5	45,552	
天馬	8.8	8.2	14,079	
信越ポリマー	22.7	21.1	13,989	
東リ	30	28	9,156	
ニフコ	25.6	20.6	113,712	
日本バルカー工業	46	40	11,320	
ユニ・チャーム	232.5	218	475,458	
医薬品 (5.8%)				
協和発酵キリン	137	128.8	266,616	
武田薬品工業	430.3	428.8	2,011,072	
アステラス製薬	1,307.9	1,205.5	1,793,181	
大日本住友製薬	81.3	76.2	116,814	
塩野義製薬	179.3	156.9	957,090	
田辺三菱製薬	133.8	125.4	229,607	
わかもと製薬	14	13	3,302	
あすか製薬	13.5	13.8	24,232	
日本新薬	26	24.7	130,169	
ビオフェルミン製薬	1.8	1.7	5,072	
中外製薬	114.3	107.2	413,256	
科研製薬	40	18.6	108,996	
エーザイ	151.4	132.5	901,265	
ロート製薬	52.2	52.7	89,958	
小野薬品工業	52.2	244.5	1,269,688	
久光製薬	32.4	33.4	189,044	
有機合成薬品工業	8	8	1,928	
持田製薬	7.9	7.4	58,016	
参天製薬	211	198.3	313,908	
扶桑薬品工業	38	36	10,656	
日本ケミファ	14	15	7,305	
ツムラ	36.1	33.9	87,970	
日医工	26.8	25.2	59,724	
キッセイ薬品工業	21.3	19.1	47,730	
生化学工業	22	20.8	31,220	
栄研化学	9.7	9.1	19,328	
日水製薬	4.6	4.2	4,855	
鳥居薬品	7.9	7.4	19,225	
JCRファーマ	8.9	8.4	23,452	
東和薬品	5.9	5	26,500	

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
富士製薬工業	3.1	3.4	6,939	
沢井製薬	18.2	18.3	141,093	
ゼリア新薬工業	23.4	22.2	32,034	
第一三共	386.2	362.1	944,899	
キョーリン製薬ホールディングス	30.6	28.7	60,040	
大幸薬品	5.2	5.4	7,975	
ダイト	5.2	6	16,878	
大塚ホールディングス	227.9	231.5	1,055,408	
大正製薬ホールディングス	27.6	25.9	253,561	
ペプチドリーム	—	17.9	104,178	
石油・石炭製品 (0.5%)				
日本コークス工業	105.6	89.6	6,272	
昭和シェル石油	102.6	108.3	121,945	
コスモ石油	317	—	—	
ニチレキ	14	13.2	9,741	
東燃ゼネラル石油	173	162	166,374	
ユシロ化学工業	6.2	5.7	7,170	
ビービー・カストロール	4.7	4.2	5,392	
富士石油	26.8	25.6	9,113	
MORESCO	3	3.4	3,937	
出光興産	54.5	56.2	128,529	
JXホールディングス	1,274.4	1,274.4	538,179	
コスモエネルギーホールディングス	—	32.7	46,630	
ゴム製品 (0.9%)				
横浜ゴム	127	64.9	102,477	
東洋ゴム工業	52	48.7	61,264	
ブリヂストン	359.9	363.3	1,326,045	
住友ゴム工業	89.6	100.7	156,991	
藤倉ゴム工業	9.9	9.2	3,965	
オカモト	39	34	34,238	
フコク	4.7	3.4	2,825	
ニッタ	11.3	11.3	30,171	
住友理工	21.1	23	20,976	
三ツ星ベルト	28	26	22,620	
バンドー化学	42	39	19,227	
ガラス・土石製品 (0.9%)				
日東紡績	84	72	23,904	
旭硝子	566	568	378,856	
日本板硝子	554	527	46,376	

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）

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
石塚硝子	16	16	2,800	
日本山村硝子	46	43	6,966	
日本電気硝子	220	222	116,550	
オハラ	4	4.3	2,214	
住友大阪セメント	213	213	91,803	
太平洋セメント	716	672	186,144	
デイ・シイ	11.9	10.5	4,000	
日本ヒューム	12.1	10.6	6,360	
日本コンクリート工業	20.2	23.3	7,362	
三谷セキサン	5.7	5.4	9,185	
アジアパイルホールディングス	15.4	13.7	5,534	
東海カーボン	99	94	28,106	
日本カーボン	61	55	12,210	
東洋炭素	6.4	6.1	8,796	
ノリタケカンパニーリミテド	64	59	14,809	
TOTO	169	79.1	322,332	
日本碍子	145	136	326,808	
日本特殊陶業	98.9	92.8	185,600	
ダントーホールディングス	18	14	2,632	
MARUWA	3.4	4	12,760	
品川リフラクトリーズ	29	26	5,200	
黒崎播磨	25	23	5,980	
ヨータイ	6	6	1,722	
イソライト工業	5.7	5.5	1,237	
東京窯業	13	12.8	2,163	
ニッカトー	2.7	3.3	1,247	
フジミインコーポレーテッド	11.2	9.6	16,684	
エーアンドエーマテリアル	27	27	2,376	
ニチアス	51	55	46,695	
ニチハ	15.3	14.4	22,219	
鉄鋼 (1.2%)				
新日鐵住金	4,853	485.3	1,080,277	
神戸製鋼所	1,985	1,977	203,631	
中山製鋼所	89	120	7,320	
合同製鐵	60	60	10,800	
ジェイ エフ イー ホールディングス	292.9	294.2	428,208	
日新製鋼	48.6	49.1	68,543	
東京製鐵	58.4	59.6	38,382	
共英製鋼	12.3	11.4	19,049	

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
大和工業	26.1	23.8	60,309	
東京鐵鋼	23	22	7,128	
大阪製鐵	7.1	6.6	11,800	
淀川製鋼所	78	15.9	42,866	
東洋鋼板	27.3	26.2	7,938	
丸一鋼管	35.2	36	127,620	
モリ工業	18	16	4,752	
大同特殊鋼	192	180	64,620	
日本高周波鋼業	48	46	3,404	
日本冶金工業	91.1	82	12,792	
山陽特殊製鋼	68	63	28,728	
愛知製鋼	68	63	27,279	
日立金属	117	123.2	142,296	
日本金属	32	31	3,193	
大太平洋金属	74	76	24,548	
新日本電工	69.7	62.1	11,115	
栗本鐵工所	60	53	9,275	
缸技	16	15	2,340	
日本鑄鉄管	12	13	1,963	
三菱製鋼	75	76	13,148	
日亜鋼業	15.3	15	3,585	
日本精線	9	7	3,206	
シンニッタン	12	9.7	5,732	
新家工業	24	24	3,600	
非鉄金属 (0.9%)				
大紀アルミニウム工業所	19	16	5,088	
日本軽金属ホールディングス	278.4	241	51,815	
三井金属鋁業	312	274	54,252	
東邦亜鉛	65	58	19,140	
三菱マテリアル	716	671	210,023	
住友金属鋁山	317	297	343,926	
DOWAホールディングス	137	138	95,220	
古河機械金属	179	169	29,406	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11.4	10.8	14,256	
東邦チタニウム	19.6	18.6	13,447	
UACJ	130	151	39,864	
古河電気工業	337	338	91,936	
住友電気工業	432.5	430.8	639,738	
フジクラ	160	150	83,250	

三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
昭和電線ホールディングス	132	134	8,174
東京特殊電線	1.9	1.9	1,533
タツタ電線	21.9	22.6	7,503
沖電線	13	13	2,587
カナレ電気	1.8	1.7	3,318
平河ヒューテック	2.7	5	4,695
リョービ	64	66	29,436
アーレスティ	13.4	12.6	9,676
アサヒホールディングス	17.2	16.1	25,566
金属製品 (0.6%)			
稲葉製作所	6	5.7	7,598
宮地エンジニアリンググループ	35	35	5,250
トーカロ	7.5	7.6	13,946
アルファC o	3.8	3.4	3,308
SUMCO	89.4	84.2	58,603
川田テクノロジーズ	2.3	2.1	7,434
東洋製織グループホールディングス	81.6	76.5	174,573
ホッカンホールディングス	27	28	9,268
コロナ	5.7	5.6	5,880
横河ブリッジホールディングス	21.8	20.6	21,712
駒井ハルテック	22	20	4,140
高田機工	12	11	2,112
三和ホールディングス	108	106.8	101,353
文化シャッター	31.9	30	25,860
三協立山	15	14.3	21,550
アルインコ	4.9	7.8	7,815
東洋シャッター	3.1	2.8	1,447
L I X I Lグループ	170.5	149.9	286,908
日本フィルコン	8.9	7.8	3,361
ノーリツ	22.3	21	42,000
長府製作所	12.3	11.6	29,533
リンナイ	21.3	20	187,800
ダイニチ工業	5.6	5.4	3,288
日東精工	17	16	4,880
三洋工業	15	15	2,730
岡部	22.8	22.5	17,100
ジーテクト	10.3	11.2	14,963
東プレ	22	20.6	52,859
高周波熱練	19.9	20.2	16,402

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京製鋼	79	75	11,850
サンコール	6	5.5	2,497
モリテック スチール	5.9	5.5	1,446
バイオラックス	5.8	5.4	30,240
日本発條	99.7	101.3	96,235
中央発條	15	13	3,796
アドバネクス	—	2.2	2,624
立川ブラインド工業	—	4.5	3,159
三益半導体工業	8.5	7.9	8,073
機械 (4.8%)			
日本ドライケミカル	1.5	1.3	2,778
日本製鋼所	164	178	81,524
三浦工業	51.2	48	104,640
タクマ	37	40	40,440
ツガミ	33	32	15,264
オークマ	75	70	56,770
東芝機械	63	59	19,706
アマダホールディングス	171.1	156.9	181,690
アイダエンジニアリング	25	28.2	31,273
滝澤鉄工所	36	35	4,480
富士機械製造	37.5	34.9	36,610
牧野フライス製作所	57	54	35,370
オーエスジー	52.3	49	98,735
ダイジェット工業	14	15	2,085
旭ダイヤモンド工業	31.5	29.2	26,718
DMG森精機	72.4	59.4	77,695
ソディック	22	27.3	24,679
ディスコ	13.4	13.7	132,890
日東工器	6.7	6.2	14,880
パンチ工業	4.1	4.3	3,676
豊和工業	6.3	6.5	3,653
OKK	46	44	4,664
石川製作所	32	31	2,232
東洋機械金属	8.1	7.9	3,246
津田駒工業	29	28	3,388
島精機製作所	16.2	15.3	35,373
NCホールディングス	—	4	4,728
フリーユー	—	2.1	5,023
ヤマシンフィルタ	—	1.5	648

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日阪製作所	14.5	13.7	11,699
やまびこ	4.5	19.8	16,275
ベガサスミシン製造	10.2	11.1	5,527
ナブテスコ	69.9	55.9	150,650
三井海洋開発	11.6	12.6	22,591
レオン自動車	9	9.2	5,455
SMC	34.4	32.3	875,007
新川	9.7	10.3	4,542
ホソカワミクロン	19	17	10,098
ユニオンツール	5.7	4.7	13,836
オイレス工業	13.5	13.6	24,820
日精エー・エス・ピー機械	4.2	3.5	7,147
サトーホールディングス	14.3	14.6	33,375
日本エアータック	3.8	4.2	2,713
日精樹脂工業	8.4	8	5,648
オカダアイヨン	—	1.5	1,186
ワイエイシイ	4.5	4.5	5,022
小松製作所	562.5	527.4	953,802
住友重機械工業	314	314	166,420
日立建機	51.3	48.1	80,134
日工	16	16	4,960
巴工業	4.4	4.2	6,245
井関農機	118	111	28,194
TOWA	9.5	10.6	9,126
丸山製作所	25	24	4,032
北川鉄工所	53	50	9,350
タカキタ	—	3.7	1,972
クボタ	552	516.5	871,335
荏原実業	2.8	2.7	3,450
三菱化工機	38	37	7,548
月島機械	20.1	20.4	19,706
帝国電機製作所	7.7	8	6,400
新東工業	26.9	24.4	20,837
遊谷工業	9.6	8.9	14,596
アイチ コーポレーション	16.2	15.2	13,041
小森コーポレーション	27.9	26.3	34,190
鶴見製作所	8.5	8	11,840
住友精密工業	18	18	6,012
酒井重工業	22	20	3,680

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
荏原製作所	238	238	134,232
石井鐵工所	17	17	2,754
西島製作所	11.3	11.6	12,377
北越工業	11.3	11.5	7,015
ダイキン工業	159.7	149.7	1,379,186
オルガノ	22	18	7,524
トーヨーカネツ	66	58	11,252
栗田工業	64.9	64.7	168,867
椿本チエイン	59	61	46,116
大同工業	23	22	4,378
日本コンパヤ	37	—	—
木村化工機	11.2	9.6	3,139
アネスト岩田	17.2	17.5	18,235
ダイフク	54.2	55.2	108,523
サムコ	1.7	2.6	2,363
加藤製作所	24	25	10,500
油研工業	22	21	3,675
タダノ	53	49.6	52,328
フジテック	31.8	29.8	31,737
CKD	30.7	28.9	26,674
キトー	12	13.1	10,244
平和	23.6	31.9	70,211
理想科学工業	13.3	11.4	18,627
SANKYO	30.5	28.6	118,547
日本金銭機械	10.2	9.6	8,448
マースエンジニアリング	6.1	5.6	11,827
福島工業	6	6.4	18,688
オーイズミ	3.9	4.5	2,011
ダイコク電機	4.6	4.3	6,127
竹内製作所	4.6	20.3	35,768
アマノ	36.5	31.8	57,399
JUKI	82	15.6	17,643
サンデンホールディングス	67	64	23,424
蛇の目シン工業	108	10.3	6,375
マックス	17	15	19,035
グローリー	35.1	35.1	115,830
新晃工業	7.6	7.2	11,066
大和冷機工業	15.8	16.5	15,328
セガサミーホールディングス	117.8	110.5	138,898

三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定型)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本ビストンリング	44	4.4	6,978	
リケン	47	47	16,638	
T P R	12.2	12.5	33,637	
ツバキ・ナカシマ	—	12.7	18,897	
ホシザキ電機	24	22.5	230,400	
大豊工業	8.9	8.3	9,926	
日本精工	225.2	211.1	200,756	
NTN	254	255	92,565	
ジェイテクト	116.9	109.6	159,796	
不二越	102	96	34,848	
日本トムソン	38	35.8	13,425	
THK	72.9	68.4	135,774	
ユーシン精機	4.8	4	6,580	
前澤給装工業	4.2	4.2	6,039	
イーグル工業	15.2	12.8	17,331	
前澤工業	8.3	7.9	2,291	
日本ビラー工業	12.1	10.4	9,380	
キッツ	49.2	44.7	21,768	
日立工機	29.2	27.4	20,029	
マキタ	71.5	67	477,040	
日立造船	85.9	81.1	48,254	
三菱重工業	1,838	1,831	755,104	
I H I	790	790	213,300	
電気機器 (11.6%)				
日清紡ホールディングス	—	57.1	69,890	
イビデン	71.9	62.9	86,361	
コニカミノルタ	261.3	256.7	235,393	
ブラザー工業	141.7	132.9	167,586	
ミネベア	163	166	141,930	
日立製作所	2,633	2,623	1,311,500	
東芝	2,308	2,164	484,952	
三菱電機	1,096	1,097	1,421,712	
富士電機	305	310	138,880	
東洋電機製造	22	21	6,804	
安川電機	133.7	127.7	168,436	
シンフォニアテクノロジー	77	69	12,420	
明電舎	100	95	39,615	
オリジン電気	16	15	4,170	
山洋電気	24	27	14,472	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
デンヨー	9.3	9.6	11,702	
東芝テック	79	75	28,800	
芝浦メカトロニクス	19	17	3,553	
マブチモーター	33.5	29.4	151,998	
日本電産	120.2	123.7	1,036,853	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	—	0.9	1,787	
東光高岳	5.5	5.8	10,416	
ダブル・スコープ	—	4.1	27,101	
ダイヘン	60	61	31,842	
田淵電機	12.6	12	4,896	
ヤーマン	1.7	1.4	2,949	
J V Cケンウッド	81.4	77.2	19,763	
ミマキエンジニアリング	6.7	9.3	4,696	
第一精工	4.1	4.5	5,031	
日新電機	25.8	24.4	34,916	
大崎電気工業	20	19	14,497	
オムロン	118.4	116.1	398,223	
日東工業	17.5	16.5	26,334	
I D E C	12.8	13.1	13,060	
不二電機工業	0.9	0.5	717	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	211	198	91,674	
サクサホールディングス	29	28	6,160	
メルコホールディングス	6.2	5.8	12,957	
テクノメディカ	2.5	2.3	4,618	
日本電気	1,419	1,413	344,772	
富士通	1,057	991	415,229	
沖電気工業	386	445	71,645	
岩崎通信機	57	56	3,864	
電気興業	31	27	13,338	
サンケン電気	56	57	17,328	
ナカヨ	11	11	3,509	
アイホン	6.4	5.9	10,555	
ルネサスエレクトロニクス	56.5	53	33,390	
セイコーエプソン	149.7	153.1	288,287	
ワコム	86.7	81.7	33,415	
アルバック	18.6	18.9	70,308	
アクセル	5	4.8	4,056	
E I Z O	10	10	30,750	
ジャパンディスプレイ	225.2	193.9	38,392	

三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本信号	30.1	28.7	26,604	
京三製作所	25	23	7,659	
能美防災	14.4	11.8	15,941	
ホーチキ	8.1	7.5	9,900	
エレコム	4.6	9	19,197	
日本無線	24	30	8,280	
パナソニック	1,336.2	1,174.4	1,134,118	
シャープ	927	869	120,791	
アンリツ	66	61.9	36,892	
富士通ゼネラル	34	31	60,791	
日立国際電気	29	23.6	31,128	
ソニー	716.8	725.3	2,115,700	
TDK	66.2	62	385,640	
帝国通信工業	27	26	4,082	
ミツミ電機	39.2	39.8	20,099	
タムラ製作所	43	40	13,400	
アルプス電気	86.5	88.6	183,667	
バイオニア	166.5	168.2	38,517	
日本電波工業	10.2	9.5	6,735	
鈴木	1.5	4.1	2,378	
日本トリム	2.7	2.8	19,936	
ローランド ディー. ジー.	4.4	5.1	10,026	
フォスター電機	12.9	13	26,338	
クラリオン	59	55	17,600	
SMK	32	30	13,590	
ヨコオ	8.7	7.5	3,690	
東光	26	—	—	
ホシデン	33.3	31.5	22,081	
ヒロセ電機	18.6	16.6	218,788	
日本航空電子工業	31	30	39,060	
TOA	11.6	12.3	11,980	
日立マクセル	21.9	16.9	26,803	
古野電気	13.3	12.7	7,442	
ユニデンホールディングス	32	36	4,680	
アルパイン	26.1	24.8	28,445	
スミダコーポレーション	10	8.7	6,446	
アイコム	6.1	5.8	11,704	
リオン	4.3	4	6,452	
本多通信工業	—	1.8	1,704	

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
船井電機	11.3	10.7	9,865	
横河電機	109.7	102.9	126,978	
新元元工業	42	37	14,504	
アズビル	35.8	33.6	103,320	
東亜ディーケーケー	4.8	5.8	2,778	
日本光電工業	46.7	43	135,235	
チノー	3.8	3.6	3,614	
共和電業	13.7	12.6	4,561	
日本電子材料	4.9	4.4	1,795	
堀場製作所	20.3	19	87,970	
アドバンテスト	74.7	70.1	81,175	
小野測器	5.5	5	4,120	
エスベック	12.2	10.7	15,964	
パナソニック デバイスSUNX	9.5	8.8	5,368	
キーエンス	24.8	23.3	1,602,108	
日置電機	5.8	5.4	12,673	
シスメックス	84.9	79.8	612,066	
日本マイクロニクス	—	19.2	16,857	
メガチップス	11.3	10.4	12,448	
OBARA GROUP	7.1	6	22,800	
澤藤電機	7	7	1,197	
コーセル	15.9	14.1	16,863	
新日本無線	8	7.9	3,270	
オブテックス	7.5	7.7	25,333	
千代田インテグレ	5.8	5.3	10,843	
アイ・オー・データ機器	—	3.4	2,142	
レーザーテック	11.3	12.1	16,286	
スタンレー電気	78.7	73.5	170,079	
岩崎電気	38	36	5,904	
ウシオ電機	66.5	62.4	79,060	
岡谷電機産業	6.1	5.6	2,122	
ヘリオス テクノ ホールディング	10.8	8.9	3,293	
日本セラミック	6.2	5.7	11,856	
遠藤照明	4.9	5.3	5,580	
日本デジタル研究所	9.2	8.5	12,070	
古河電池	8	8	5,112	
双信電機	5.2	5.9	1,640	
山一電機	13	9.2	5,308	
図研	8.1	7.5	7,995	

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本電子	47	41	21,115
カシオ計算機	109.9	103	176,542
ファナック	114.2	105.2	1,690,564
日本シイエムケイ	28.3	22.7	9,329
エンブラス	5	5.2	16,146
大真空	20	20	5,080
ローム	54	50.7	227,136
浜松ホトニクス	85.6	80.2	227,928
三井ハイテック	14.5	15.1	10,705
新光電気工業	41.5	39.1	24,242
京セラ	180	168.7	928,862
太陽誘電	57.4	50	55,350
村田製作所	115	108.3	1,367,287
ユーシン	15.3	13.7	9,521
双葉電子工業	18.7	16.9	34,053
北陸電気工業	49	43	5,418
ニチコン	34.6	32.5	25,642
日本ケミコン	89	85	12,920
KOA	15	14.1	11,040
市光工業	27	25	7,075
小糸製作所	65.7	61.6	308,000
ミツバ	20.2	17.6	27,913
スター精密	20.9	19.7	24,152
S C R E E Nホールディングス	104	105	108,045
キャノン電子	10.1	9.1	14,387
キャノン	635.7	553.4	1,723,287
リコー	329.7	332.9	314,590
M U T O Hホールディングス	15	13	3,042
東京エレクトロン	92.2	84.4	658,235
輸送用機器 (9.3%)			
トヨタ紡織	38.3	35.9	76,790
鬼怒川ゴム工業	25	24	18,552
ユニプレス	21	21.3	45,965
豊田自動織機	99.8	93.6	427,752
モリタホールディングス	19.1	18	25,650
三櫻工業	13.8	13	7,280
デンソー	270.9	254	1,055,878
東海理化電機製作所	28.9	30.1	58,965
三井造船	424	398	72,436

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
川崎重工業	796	800	263,200
名村造船所	30.7	31.1	20,526
サノヤスホールディングス	14	13.2	2,283
日本車輛製造	40	43	11,739
ニチユ三菱フォークリフト	12.2	11.6	5,916
近畿車輛	17	16	4,592
日産自動車	1,539	1,434.6	1,499,874
いすゞ自動車	346.6	297.9	360,161
トヨタ自動車	1,512.7	1,278.5	7,111,017
日野自動車	156.5	146.7	162,983
三菱自動車工業	401.9	408.1	217,517
エフテック	6.4	5.3	5,527
レシップホールディングス	3.5	3.5	2,509
GMB	1.4	2	1,682
ファルテック	1.7	1.1	1,345
武蔵精密工業	11.7	10.9	24,612
日産車体	48.2	50.2	58,382
新明和工業	44	45	33,840
極東開発工業	20.3	20.5	23,431
日信工業	20.1	22.8	32,923
トビー工業	90	85	18,020
ティラド	42	41	7,831
曙ブレーキ工業	46.3	53.5	12,840
タチエス	17.4	16.3	28,378
NOK	53	49.7	90,106
フタバ産業	33.7	31.9	16,141
KYB	122	115	43,125
シロキ工業	25	—	—
大同メタル工業	15.3	14.5	14,239
プレス工業	54.4	53.8	20,659
ミクニ	10.8	13.1	4,152
カルソニックカンセイ	84	78	69,030
太平洋工業	22.3	22.8	25,125
ケーヒン	25.2	23.5	40,866
河西工業	13.5	12.7	14,363
アイシン精機	100.3	105.4	442,153
富士機工	12.8	11.8	4,767
マツダ	326.8	325.5	584,760
ダイハツ工業	130.9	122.7	180,000

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）

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
今仙電機製作所	9.5	9.5	9.5	8,901
本田技研工業	986.7	925	925	2,726,900
スズキ	229.2	188.1	188.1	512,478
富士重工業	373.1	324.8	324.8	1,265,420
安永	3.9	4.2	4.2	2,041
ヤマハ発動機	166.8	145.2	145.2	268,474
ショーワ	25.8	26.5	26.5	20,961
TBK	14.1	12.9	12.9	4,605
エクセディ	14.8	13.9	13.9	35,556
豊田合成	35.4	37.3	37.3	77,957
愛三工業	17.2	17.7	17.7	15,469
盟和産業	11	1.8	1.8	1,796
ヨロズ	10.2	9.3	9.3	15,828
エフ・シー・シー	16	16.8	16.8	32,659
シマノ	47.3	41.4	41.4	682,686
タカタ	19.9	19.4	19.4	6,731
テイ・エス テック	23.2	23.9	23.9	67,302
ジャムコ	4.1	6	6	13,374
精密機器 (1.6%)				
テルモ	168.1	157.6	157.6	691,076
クリエートメディック	3.9	3.4	3.4	2,896
日機装	35.6	37.2	37.2	30,876
島津製作所	131	132	132	229,548
JMS	21	19	19	5,358
モリテックス	3.5	—	—	—
長野計器	7.2	6.4	6.4	3,731
ブイ・テクノロジー	2.2	2.5	2.5	19,800
東京計器	38	33	33	5,412
愛知時計電機	14	13	13	3,952
オーバル	12.3	11.2	11.2	2,576
東京精密	19.7	19.9	19.9	50,506
マニー	3.4	13.6	13.6	24,303
ニコン	204.7	191.9	191.9	294,374
トプコン	33.1	34.9	34.9	34,830
オリンパス	163.3	153.1	153.1	665,219
理研計器	9.8	8.4	8.4	9,391
タムロン	8.4	8.4	8.4	12,986
HOYA	260.9	232.4	232.4	894,972
ノーリツ鋼機	9.9	9.6	9.6	7,065

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
エー・アンド・デイ	10.1	9.4	9.4	4,230
シチズンホールディングス	135	126.5	126.5	77,038
リズム時計工業	48	45	45	6,525
大研医器	7.7	8.3	8.3	7,470
メニコン	—	6.9	6.9	25,668
松風	5.5	5	5	7,245
セイコーホールディングス	78	67	67	27,068
ニプロ	70	76.6	76.6	95,060
その他製品 (1.7%)				
スノーピーク	—	1.1	1.1	4,130
パラマウントベッドホールディングス	11.5	10.8	10.8	47,574
トランザクション	1	2.2	2.2	1,577
SHO-BI	4	3.8	3.8	1,512
ニホンフラッシュ	—	3.9	3.9	4,410
前田工織	12.1	10.3	10.3	11,556
永大産業	15	14	14	6,048
アートネイチャー	7.8	10.8	10.8	9,752
ダンロップスポーツ	6.9	6.8	6.8	7,167
バンダイナムコホールディングス	120.9	106.3	106.3	283,927
アイフィスジャパン	—	2.7	2.7	1,128
共立印刷	20.2	17.1	17.1	5,061
SHOEI	—	4.6	4.6	7,337
フランスベッドホールディングス	74	14.3	14.3	13,570
パイロットコーポレーション	9.6	17.9	17.9	86,367
萩原工業	2.4	2.9	2.9	7,728
トッパン・フォームズ	19.6	18.3	18.3	23,204
フジシールインターナショナル	13.3	12.5	12.5	51,875
タカラトミー	39.9	34.3	34.3	25,176
廣済堂	10.4	10.3	10.3	3,368
A s - m e エステール	3	2.9	2.9	1,803
アーク	36.3	45.8	45.8	3,709
タカノ	4.9	4.6	4.6	2,852
プロネクス	11.1	9.8	9.8	10,005
ホクシン	10.9	10.8	10.8	1,371
ウツドワン	19	20	20	5,000
大建工業	44	41	41	12,628
凸版印刷	310	290	290	292,320
大日本印刷	334	304	304	342,608
図書印刷	18	20	20	11,460

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
共同印刷	34	35	11,725	
日本写真印刷	18.5	17.5	41,772	
光村印刷	11	12	2,508	
宝印刷	5.9	5.1	7,282	
アシックス	108.9	95.7	235,326	
ツツミ	5.5	5.1	11,454	
小松ウオール工業	3.3	3.4	5,691	
ヤマハ	80.6	75.5	249,150	
河合楽器製作所	3.8	3.9	7,690	
クリナップ	9.9	12.2	9,796	
ビジョン	62.1	58.2	168,547	
兼松日産農林	15	12	1,740	
キングジム	9.3	8.7	7,429	
リンテック	26.1	24.4	53,021	
TASAKI	2.2	2.1	3,378	
イトーキ	23.1	21.8	13,799	
任天堂	67.5	63.3	1,035,904	
三菱鉛筆	9	7.8	43,602	
タカラスタンダード	45	42	40,950	
コクヨ	57	53.4	79,459	
ナカバヤシ	24	21	6,195	
グローブライド	54	5	7,395	
岡村製作所	41.8	35.7	38,591	
美津濃	58	55	29,590	
アデランス	12.9	18.2	9,445	
電気・ガス業 (2.0%)				
東京電力ホールディングス	930.1	872	463,904	
中部電力	335.5	314.5	470,649	
関西電力	447.4	419.5	422,017	
中国電力	151.6	142.1	196,950	
北陸電力	107.4	100.7	137,052	
東北電力	273.9	256.8	361,574	
四国電力	98.7	92.6	117,972	
九州電力	242.1	227	248,338	
北海道電力	102.6	96.2	87,830	
沖縄電力	7.2	11	34,210	
電源開発	79.5	87.6	248,170	
ファーストエスコ	—	4.5	2,155	
イーレックス	—	3.1	5,285	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東京瓦斯	1,333	1,147	511,217	
大阪瓦斯	1,135	1,064	443,900	
東邦瓦斯	279	259	205,905	
北海道瓦斯	23	25	6,975	
広島ガス	18	18.4	6,403	
西部瓦斯	122	117	29,601	
静岡ガス	31.1	29.3	21,652	
メタウォーター	6.9	6.7	19,289	
陸運業 (4.6%)				
SBSホールディングス	11	10.5	8,925	
東武鉄道	586	549	304,146	
相鉄ホールディングス	188	176	117,040	
東京急行電鉄	596	598	574,080	
京浜急行電鉄	300	282	289,614	
小田急電鉄	351	329	384,601	
京王電鉄	306	287	267,484	
京成電鉄	164	154	221,606	
富士急行	30	28	37,632	
新京成電鉄	14	13	5,421	
東日本旅客鉄道	200.9	187.9	1,854,197	
西日本旅客鉄道	105.5	98.9	647,597	
東海旅客鉄道	98.2	92	1,772,840	
西武ホールディングス	87.4	109.2	232,705	
鴻池運輸	13.6	14.4	17,856	
西日本鉄道	142	133	79,268	
ハマキョウレックス	3.4	7.9	16,882	
サカイ引越センター	1.8	4.1	13,202	
近鉄グループホールディングス	1,103	1,035	457,470	
阪急阪神ホールディングス	736	690	513,360	
南海電気鉄道	246	231	130,284	
京阪ホールディングス	246	230	174,340	
神戸電鉄	29	26	9,438	
名糖運輸	4.9	—	—	
名古屋鉄道	399	374	207,570	
山陽電気鉄道	41	38	18,886	
日本通運	424	398	193,428	
ヤマトホールディングス	192.8	183.8	424,578	
山九	133	135	73,440	
丸運	7.3	6.2	1,481	

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
丸全昭和運輸	36	32	12,832	
センコー	48	45.1	29,720	
トナミホールディングス	23	21	6,090	
ニッコンホールディングス	35.9	32.7	73,967	
日本石油輸送	13	11	2,552	
福山通運	66	61	32,940	
セイノーホールディングス	84.8	72.9	80,773	
神奈川中央交通	13	12	7,296	
日立物流	22.7	21.4	41,152	
丸和運輸機関	—	3.1	9,008	
C&Fロジホールディングス	—	10	9,210	
海運業 (0.2%)				
日本郵船	926	923	192,907	
商船三井	575	501	122,244	
川崎汽船	480	450	101,250	
NSユニテッド海運	47	47	7,097	
明治海運	10.1	9.6	3,580	
飯野海運	56.5	53.7	21,372	
共栄タンカー	10	10	1,820	
第一中央汽船	140	—	—	
乾汽船	—	8.3	7,453	
空運業 (0.7%)				
日本航空	209.9	196.8	742,723	
ANAホールディングス	2,155	1,908	619,146	
バスコ	10	10	3,790	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
トランコム	3.2	3	19,410	
日新	42	42	14,154	
三菱倉庫	72	73	110,887	
三井倉庫ホールディングス	64	60	18,000	
住友倉庫	80	74	42,476	
滋澤倉庫	28	27	7,398	
東陽倉庫	19	18	3,960	
乾汽船	7.6	—	—	
日本トランスシテイ	25	23	7,820	
ケイヒン	22	20	2,840	
中央倉庫	6.2	5.7	5,112	
安田倉庫	8.4	8.1	5,670	
東洋埠頭	35	31	4,836	

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
宇徳	9.1	8.4	2,730	
上組	131	123	124,968	
サンリツ	2.7	2.8	1,293	
キムラユニティー	2.3	2.6	2,802	
キューソー流通システム	3.1	2.9	7,777	
郵船ロジスティクス	9.9	9.4	10,716	
近鉄エクスプレス	9.8	18.5	25,345	
東海運	6.5	5.3	1,383	
エーアイテイー	5	6.1	5,496	
内外トランスライン	1.3	3.4	3,284	
情報・通信業 (8.5%)				
NECネットエスアイ	13.6	12.7	23,685	
システナ	10.2	10	16,780	
デジタルアーツ	5.9	5.1	15,192	
新日鉄住金ソリューションズ	9	16.9	31,146	
キューブシステム	4.8	4.6	2,617	
コア	4.5	4.4	5,363	
ソフトクリエイイトホールディングス	3.4	4.7	4,371	
ITホールディングス	35.9	33.6	87,393	
ネオス	3.3	3.6	2,476	
電算システム	3.7	3.6	5,461	
グリー	66.3	62.2	39,808	
コーエーテクモホールディングス	24.4	24	47,448	
三菱総合研究所	4.1	3.9	13,864	
ボルテージ	2	2.1	2,515	
電算	1.2	1.1	2,191	
AGS	1.9	2.3	2,316	
ファインデックス	6.2	6.7	11,792	
ヒト・コミュニケーションズ	1.2	2.3	4,790	
ブレインパッド	1.6	1.9	1,808	
KL a b	11.6	16.1	9,885	
ポルトゥウィン・ビッドクルーホールディ	7.3	6.9	6,417	
イーブックイニシアティブジャパン	2.5	2.5	1,722	
ネクソン	103	97.2	181,083	
アイスタイル	4.7	15.7	14,208	
エムアップ	3.2	3	1,674	
エイチーム	4	5.6	9,161	
テクノスジャパン	—	3	7,635	
e n i s h	2.9	3.3	2,798	

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コロブラ	29.7	28.2	60,912
モバイルクリエイト	6.4	7.2	3,016
オルトプラス	4.2	4.1	1,652
ブロードリーフ	9	10.4	11,055
ハーツユナイテッドグループ	3.2	3.1	8,500
メディアドゥ	—	2.2	3,764
ブイキューブ	—	6.7	8,334
サイバーリンクス	—	1.7	1,742
VOYAGE GROUP	—	3.5	4,284
オブティム	—	0.9	4,563
ベリサーブ	1.4	1.2	5,460
ティーガイア	10.8	10.2	16,014
日本アジアグループ	—	11.8	5,109
豆蔵ホールディングス	8.7	8.2	6,199
テクマトリックス	4.7	4.5	9,958
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	—	236.4	63,355
GMOペイメントゲートウェイ	9.4	8.3	60,009
ザッパラス	6.3	6.4	2,451
インターネットイニシアティブ	17.5	16.4	39,032
さくらインターネット	—	6.7	7,979
GMOクラウド	2.4	2.4	2,791
ビットアイル	12.4	—	—
SRAホールディングス	5.6	5.9	13,935
Minor iソリューションズ	—	2	1,732
システムインテグレータ	1.7	1.5	1,062
パイブドビッツ	1.4	—	—
朝日ネット	10.8	8.4	4,158
コムチュア	1.8	1.7	5,278
gumi	11	10.8	11,124
パイブドHD	—	1.3	1,606
パナソニック インフォメーションシステム	2.6	—	—
フェイス	3.4	2.8	3,264
ハイマックス	1.6	1.2	1,370
野村総合研究所	61.3	71.1	297,198
サイバネットシステム	9.1	8.5	7,463
CEホールディングス	1.8	1.7	1,630
インタージホールディングス	6.2	5.4	8,121
東邦システムサイエンス	3.1	3	1,803
ソースネクスト	5.5	5.3	2,496

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ティー・ワイ・オー	16.7	21	3,549
フォーカスシステムズ	—	2.7	1,355
クレスコ	2.4	2.2	4,140
フジ・メディア・ホールディングス	112.7	105.6	143,721
オービック	37.3	35	204,750
ジャストシステム	19.7	18.5	16,169
TDCソフトウェアエンジニアリング	2.4	4.4	2,930
ヤフー	775.5	727.1	365,731
トレンドマイクロ	57.3	49.3	204,841
インフォメーション・ディベロプメント	2.1	1.7	1,671
日本オラクル	17.3	16.3	95,355
アルファシステムズ	3.5	3.2	5,552
フューチャー	11.1	12.1	9,196
CAC Holdings	7.2	7.6	6,163
ソフトバンク・テクノロジー	2.9	2.8	4,838
トーセ	3.2	2.7	1,792
オービックビジネスコンサルタント	6.8	5.1	24,888
伊藤忠テクノソリューションズ	24.5	22.8	55,723
アイティフォー	13.1	13.3	6,982
東計電算	1.7	1.7	3,078
エクスペネット	1.1	0.7	1,066
大塚商会	29.1	27.3	149,877
サイボウズ	15.1	13.6	4,760
ソフトブレーン	15.9	15.7	3,595
電通国際情報サービス	6.5	6.3	12,524
EMシステムズ	1.6	3.4	4,022
ウェザーニューズ	3.2	3.4	12,580
CIJ	10	9.1	4,613
東洋ビジネスエンジニアリング	1.1	1	1,387
日本エンタープライズ	9.9	11.3	2,802
WOWOW	5.2	4.8	12,547
フュージョンパートナー	6.3	6.7	3,906
日本コロムビア	4.6	4	1,664
イマジカ・ロボット ホールディングス	7.8	8.9	3,880
ネットワンシステムズ	44.7	44.5	26,789
アルゴグラフィックス	4.6	4.6	8,119
マーベラス	18.4	17.3	15,794
エイベックス・グループ・ホールディングス	21.5	18.9	26,044
日本ユニシス	29.9	28	37,548

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
兼松エレクトロニクス	6.8	6.2	12,083	
東京放送ホールディングス	64.8	60.8	97,219	
日本テレビホールディングス	98.8	92.6	180,847	
朝日放送	10.7	10.1	6,655	
テレビ朝日ホールディングス	29.6	27.7	49,001	
スカパーJ SATホールディングス	81.3	77	41,503	
テレビ東京ホールディングス	8.8	9.2	19,734	
日本BS放送	1.9	2.2	2,224	
U-NEXT	—	3.2	2,848	
ワイヤレスゲート	—	2.5	5,095	
コネクシオ	7.5	8.7	11,901	
日本通信	—	72.6	16,407	
クロップス	1.9	2.5	1,307	
日本電信電話	423.5	784.2	3,764,160	
KDDI	1,099.3	1,030.6	3,242,267	
光通信	9.7	12.2	107,238	
NTTドコモ	834.6	758.1	2,029,054	
エムティーアイ	14	15.4	10,718	
GMOインターネット	36.1	37.3	48,415	
カドカワ	26.5	31.9	43,352	
学研ホールディングス	35	34	8,568	
ゼンリン	14.3	13.5	35,100	
昭文社	6.6	5.8	3,410	
インプレスホールディングス	8.7	10.6	1,441	
アイネット	5.6	5.6	6,115	
松竹	71	67	70,752	
東宝	77.2	72.4	213,797	
東映	40	38	32,148	
AOI Pro.	4.9	4.9	4,851	
エヌ・ティ・ティ・データ	66.8	62.7	357,390	
ピー・シー・エー	1.3	1.2	1,549	
ビジネスブレイン太田昭和	—	1.4	1,283	
DTS	11.2	11.2	25,760	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	41.6	42.9	146,074	
シーイーシー	7	6.7	10,378	
カブコン	27.7	25.9	67,443	
アイ・エス・ピー	1.4	1.9	1,746	
ジャステック	6	6.4	6,092	
SCSK	25.7	24.1	96,761	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本システムウエア	4.2	3.9	4,422	
アイネス	14.9	14.5	15,993	
TKC	10	9.3	26,988	
富士ソフト	14.8	15	35,985	
NSD	25.3	21.1	37,304	
コナミホールディングス	44	45.8	176,559	
福井コンピュータホールディングス	2.9	2.9	4,463	
JBCホールディングス	9.3	8.5	5,771	
ミロク情報サービス	7.1	7.6	9,682	
ソフトバンクグループ	572.3	574.8	3,509,154	
卸売業(4.2%)				
ハウスイ	10	10	1,190	
高千穂交易	4.2	3.8	3,294	
伊藤忠食品	2.6	2.4	9,696	
エレマテック	5	4.6	9,273	
JALUX	3.1	3.4	6,847	
あらた	24	4.6	11,164	
トーマンデバイス	1.5	1.2	2,283	
東京エレクトロン デバイス	2.9	3	4,530	
フィールズ	—	8.8	13,552	
双日	724.3	639.1	155,301	
アルフレッサ ホールディングス	128	127.5	294,015	
横浜冷凍	26.5	25.2	26,409	
山下医科器械	0.8	0.8	1,516	
ラサ商事	5.9	4.8	2,256	
ラクーン	—	3	1,779	
アルコニックス	6.2	5.8	9,135	
神戸物産	3.5	6.6	16,381	
あい ホールディングス	17.4	18.1	52,707	
ディービーエックス	3.3	3.5	3,853	
ダイワボウホールディングス	101	93	20,367	
マクニカ・富士エレホールディングス	19.2	17.7	21,434	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20.3	17.7	17,735	
八洲電機	8.8	8	4,200	
UKCホールディングス	6.9	6.5	12,168	
OCHIホールディングス	2.8	3	3,084	
TOKAIホールディングス	52.8	44.9	30,397	
三洋貿易	6	5.6	7,823	
ウイン・パートナーズ	3.6	3.7	5,572	

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ミタチ産業	2.7	2.4	1,581	
シップヘルスケアホールディングス	19.8	20.6	65,611	
明治電機工業	3.1	3	3,051	
デリカフーズ	2	2.2	2,057	
スターティア	1.2	2.3	1,232	
富士興産	4.3	4	1,700	
協栄産業	14	16	2,080	
小野建	9.2	8.1	9,938	
佐鳥電機	8.7	8.1	5,686	
エコートレーディング	2.6	2.6	1,479	
伯東	7.2	7.7	7,099	
コンドーテック	7.6	8	6,400	
中山福	5.9	6	4,674	
ナガイレーベン	15.8	14.8	35,372	
三菱食品	11.7	11.1	30,325	
松田産業	7.8	7.4	9,316	
第一興商	—	17.9	75,180	
メディバルホールディングス	108.2	101.5	195,387	
アドヴァン	5.5	10.3	11,391	
S P K	2.2	2.1	4,200	
萩原電気	2.9	3.4	6,045	
アズワン	7.7	7.9	32,627	
スズデン	3.5	3.3	3,121	
尾冢産業	3.4	3.2	2,771	
シモジマ	6.4	7	6,972	
ドウシシャ	14	12	25,416	
小津産業	2.2	2.2	4,699	
高速	6.1	6	5,256	
たけびし	3.8	3.2	3,184	
黒田電気	18.8	18.9	34,813	
丸文	9.3	8.8	5,359	
ハビネット	6.8	9.3	8,165	
橋本総業ホールディングス	2	2.1	3,160	
エクセル	5.1	4.9	6,668	
マルカキカイ	3.5	3.3	4,118	
ガリバーインターナショナル	33	27.6	30,829	
日本エム・ディ・エム	9.4	8.6	7,344	
進和	6.3	6	8,550	
エスケイジャパン	4.7	3.1	926	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ダイトエレクトロン	5	4.7	2,946	
シークス	6.9	6.5	24,700	
田中商事	3	3.1	2,111	
オーハシテクニカ	6.6	5.4	6,766	
白銅	3.5	2.7	3,140	
伊藤忠商事	905.8	796.1	1,100,210	
丸紅	946.7	998.5	506,539	
高島	21	20	3,400	
長瀬産業	60.7	61	73,749	
蝶理	7	6.4	9,670	
豊田通商	120.5	113	282,952	
三共生興	19	15.8	5,245	
兼松	218	218	38,150	
ツカモトコーポレーション	24	24	2,544	
三井物産	917.4	917.4	1,201,335	
日本紙パルプ商事	54	49	16,268	
日立ハイテクノロジーズ	37.5	35.2	110,000	
カメイ	14	13.2	12,012	
東都水産	20	17	2,890	
OUGホールディングス	17	15	3,765	
スターゼン	42	3.7	13,449	
山善	41.5	38.8	34,609	
椿本興業	12	10	2,850	
住友商事	638.6	638.6	705,653	
内田洋行	27	25	11,150	
三菱商事	829.3	761.3	1,429,721	
第一実業	26	23	12,282	
キヤノンマーケティングジャパン	30.9	28.9	57,915	
西華産業	36	33	8,349	
佐藤商事	9.3	8.4	5,317	
菱洋エレクトロ	12.5	11.6	15,497	
東京産業	10.9	10.3	3,883	
ユアサ商事	9.4	9.6	23,769	
神鋼商事	28	21	3,780	
小林産業	7.6	6.5	1,436	
阪和興業	108	101	55,550	
カナデン	9.3	9.6	8,380	
菱電商事	17	16	10,384	
フルサト工業	6	5.5	7,546	

三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定型)

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
岩谷産業	120	120	76,200
すてきなイスグループ	47	45	6,795
昭光通商	42	42	3,108
ニチモウ	19	17	2,873
極東貿易	13	15	3,000
イワキ	17	16	3,184
三菱石油	27	25	19,075
稲畑産業	25.8	24.2	26,474
G S I クレオス	35	31	3,472
明和産業	9.2	9.4	3,327
ワキタ	22.8	21.7	16,275
東邦ホールディングス	37.3	32.5	86,840
サンゲツ	37.8	35.3	71,094
ミツウロコグループホールディングス	17.1	16.2	8,391
シナネンホールディングス	22	21	8,841
伊藤忠エネクス	23.8	26.3	24,643
サンリオ	30.3	31.3	65,010
サンワテクノス	6.8	6.4	4,793
リョーサン	18.2	15.9	41,260
新光商事	12.5	11.7	12,530
トーホー	24	4.6	11,104
三信電気	15	14.1	12,097
東陽テクニカ	15.8	13.6	14,048
モスフードサービス	14	13.3	38,410
加賀電子	9.6	9.1	11,247
ソーダニッカ	11.4	9.9	4,801
立花エレテック	7.9	7.3	8,701
フォーバル	2.2	5.4	4,185
P A L T A C	17.3	16.3	36,218
三谷産業	11.8	11.1	3,862
太平洋興発	50	49	3,528
ヤマタネ	57	49	7,203
丸紅建材リース	10	10	1,880
日鉄住金物産	70	86	33,540
トラスコ中山	13.5	11.6	59,044
オートバックスセブン	39.8	38.9	66,130
加藤産業	16.9	15.8	43,908
イノテック	10.4	9.3	3,729
イエローハット	10.2	9.6	22,435

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
J Kホールディングス	10.9	9.9	4,504
日伝	4.3	4	12,140
北沢産業	9.6	10.4	1,632
杉本商事	5.9	5.6	6,384
因幡電機産業	16.1	14	51,730
バイテックホールディングス	3.6	4.2	4,263
ミスミグループ本社	40.4	113.9	192,718
アルテック	9.3	11.8	1,699
タキヒヨー	19	17	7,718
蔵王産業	1.5	1.1	1,422
スズケン	49.3	46.2	161,469
ジェコス	7.5	7	7,735
ルネサスイーストン	5.3	8.2	3,296
小売業 (4.9%)			
ローソン	41	38.4	328,704
サンエー	8.2	6.9	35,190
ダイユーエイト	2.8	2.5	1,707
カワチ薬品	8.6	8	20,240
エービーシー・マート	15.4	13.2	95,172
ハードオフコーポレーション	5.3	4.9	6,610
アスクル	11.3	12.3	50,553
ゲオホールディングス	20.3	17	25,857
アダストリア	9.2	18.7	67,133
ジーフット	—	6.2	4,904
シー・ヴィ・エス・バイエリア	16	19	1,634
くらコーポレーション	6.4	6	29,760
キャンドウ	5.1	5.4	8,607
パル	6.3	5.9	15,487
エディオン	49.6	42.3	35,193
サーラコーポレーション	9.3	8.8	4,972
ワッツ	4.3	4.3	3,943
ハローズ	—	3.4	7,860
あみやき亭	1.9	1.9	8,303
ひらまつ	14.6	14.1	10,166
ゲンキー	1.1	2.1	7,108
サッポロドラッグストアー	1.1	1.4	2,938
大黒天物産	2.6	2.4	11,688
ハニーズ	9.6	9	9,783
ファーマライズホールディングス	2.7	2.4	1,339

三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定型)

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アルベン	9.4	8.7	15,164
クオール	11.1	10.4	15,444
ジェイアイエヌ	7.4	6.9	25,012
ビックカメラ	53.2	58.2	58,258
DCMホールディングス	52.3	49.3	38,454
Monotaro	21.1	35.8	138,546
東京一番フーズ	—	2.7	1,387
ダイヤモンドダイニング	—	2.3	2,272
きちり	3	2.8	1,789
アークランドサービス	1.3	3.2	10,336
J. フロント リテイリング	136.9	128.4	158,188
ドトール・日レスホールディングス	19	17.6	32,172
マツモトキヨシホールディングス	24.2	20.9	121,638
ブロンコピリー	1.9	5.2	15,860
スタートトゥデイ	33.7	30.9	150,174
トレジャー・ファクトリー	1.4	2.9	3,271
物語コーポレーション	3.1	2.7	13,770
ココカラファイン	11.2	10.6	55,650
三越伊勢丹ホールディングス	215.1	201.8	203,818
ウエルシアホールディングス	9.3	8.8	52,976
クリエイトSDホールディングス	5.3	15	38,595
丸善CHIホールディングス	12	11.8	4,377
ミサワ	—	1.9	951
エー・ピーカンパニー	1.5	1.7	1,688
チムニー	2.6	2.5	7,382
シュッピン	—	3.8	4,111
ネクステージ	1.5	1.8	1,184
ジョイフル本田	7.8	16.5	40,210
キリン堂ホールディングス	3.4	3.4	3,590
ホットランド	—	3.6	3,153
すかいらく	52.9	30.7	38,620
綿半ホールディングス	—	3.8	5,738
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	35.6	33.4	35,270
ブックオフコーポレーション	6	5.6	4,726
ゴルフダイジェスト・オンライン	—	2.9	2,923
あさひ	7.2	7.6	12,129
日本調剤	1.4	2.6	11,297
コスモス薬品	5.4	5.1	99,450
トーエル	5.9	5	4,005

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
一六堂	2.7	2.5	832
セブン&アイ・ホールディングス	452.7	424.4	2,006,138
薬王堂	1.6	1.9	7,524
クリエイト・レストランツ・ホールディング	7.6	27.4	27,619
ツルハホールディングス	23.1	23.3	263,290
サンマルクホールディングス	7.7	8	25,480
フェリシモ	2.9	3.1	3,143
トリドール	11.8	12.6	34,927
クスリのアオキ	8.6	9.1	58,786
メディカルシステムネットワーク	9.9	11.7	6,224
総合メディカル	5.2	4.9	16,390
はるやま商事	4.4	3.9	2,925
カッパ・クリエイト	17	14.4	17,524
ライトオン	8.1	7.7	10,618
ジーンズメイト	4.5	4.8	878
良品計画	13.4	11.7	296,010
三城ホールディングス	12.1	10.9	4,447
アルビス	2.5	2.6	5,410
コナカ	12.7	12.8	6,540
ハウス オブ ローゼ	1.4	1.3	1,830
G-7ホールディングス	2.2	3	3,609
イオン北海道	6.6	6.9	3,539
コジマ	16.6	15.9	3,816
ヒマラヤ	3.2	3	3,030
コーナン商事	16.6	14.4	26,640
エコス	4	4	5,320
ワタミ	13	12.3	11,955
マルシェ	2.8	2.7	2,227
ドンキホーテホールディングス	34.9	65.6	231,240
西松屋チェーン	21.4	20	24,240
ゼンショーホールディングス	55.6	52.2	72,453
幸楽苑ホールディングス	6.8	6.3	9,601
ハークスレイ	3	2.9	3,033
サイゼリヤ	17.8	16.6	33,382
V Tホールディングス	—	34.4	17,303
魚力	3	3.2	4,150
ポプラ	3.8	4	1,888
ユナイテッドアローズ	14.1	14.5	48,792
ハイデイ日高	8.2	9.3	24,021

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）

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
京都市もの友禅	6.5	7.2	6,429	
コロワイド	35.9	33.6	64,411	
ピーシーデポコーポレーション	—	11.2	16,945	
老番屋	4.9	4.6	32,660	
トップカルチャー	4.7	4.1	1,873	
P L A N T	2.7	2.4	2,901	
スギホールディングス	19.4	18.2	101,192	
スクロール	14	15.9	7,425	
ヨンドシーホールディングス	8.3	7.8	19,991	
ファミリーマート	36.6	31.2	185,016	
木曽路	13.2	12.3	27,908	
サトレストランシシステムズ	10	12	9,564	
千趣会	19.1	20.2	15,129	
タカキュー	8	8.7	1,574	
ケーヨー	19.9	17.2	9,202	
上新電機	23	24	21,912	
日本瓦斯	17.4	15.5	38,207	
ベスト電器	40.3	35.8	3,938	
ロイヤルホールディングス	18.1	16.7	34,769	
東天紅	8	9	1,161	
いなげや	12	11.4	16,370	
島忠	28	26.2	64,766	
チヨダ	12.7	12	32,604	
ライフコーポレーション	6.8	6.5	20,117	
リンガーハット	10.6	9.2	21,509	
さが美	14	11	979	
Mr M a x	10.8	9.7	2,890	
テンアライド	9.5	10.1	3,716	
AOK I ホールディングス	24.8	22.9	27,022	
オークワ	17	16	18,960	
コメリ	18.4	15.5	42,051	
青山商事	27.2	19.4	78,570	
しまむら	12.6	11.8	168,740	
C F S コーポレーション	7.3	—	—	
はせがわ	3.7	5	2,035	
高島屋	157	148	113,368	
松屋	21.8	20.8	17,472	
エイチ・ツー・オー リテイリング	51.1	51.9	83,766	
近鉄百貨店	41	39	13,143	

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
丸栄	20	24	2,184	
ニッセンホールディングス	22.7	17.1	2,103	
バルコ	10.5	9.9	9,048	
丸井グループ	113.8	124.5	198,328	
アクシアル リテイリング	8.4	7.9	29,467	
イオン	446.3	417.4	697,475	
ユニグループ・ホールディングス	103.6	97.1	78,942	
イズミ	24.2	20.1	88,138	
東武ストア	15	13	3,900	
平和堂	21.9	20.6	46,638	
フジ	11.9	11.4	26,527	
ヤオコー	12.2	11.5	56,120	
ゼビオホールディングス	14.6	13.7	21,632	
ケーズホールディングス	24.9	21.4	74,900	
O l y m p i c グループ	6.6	6.4	3,520	
日産東京販売ホールディングス	18.4	16.6	3,718	
アインホールディングス	13	12.2	72,224	
元気寿司	3.4	2.8	6,109	
ヤマダ電機	427.7	308.5	154,558	
アークランドサカモト	7.8	17.3	20,275	
ニトリホールディングス	46.7	43.8	458,148	
グルメ軒屋	8	7	6,888	
愛眼	9.7	9.7	2,037	
ケーユーホールディングス	5	5.1	3,646	
吉野家ホールディングス	30.4	37.1	51,828	
松屋フーズ	5.1	4.8	13,329	
サガミチェーン	14	13.6	16,646	
関西スーパーマーケット	8	8.1	8,083	
王将フードサービス	7.9	7.4	27,158	
プレナス	12.1	11.2	21,548	
ミニストップ	8.1	7.6	13,619	
アークス	18.7	18.9	47,930	
パローホールディングス	23.3	21.9	64,013	
藤久	0.7	0.8	1,404	
ベルク	4.8	5	21,850	
大庄	5.1	5.4	7,986	
ファーストリテイリング	21.7	16.9	486,297	
サンドラッグ	22.9	21.4	188,748	
サックスパー ホールディングス	8.2	9.7	11,804	

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ヤマザワ	2	2	2	3,338
やまや	1.8	2	2	3,970
ペルーナ	26.3	25.4	25.4	15,290
銀行業 (7.5%)				
島根銀行	2.2	2.4	2.4	2,995
じもとホールディングス	77	72.2	72.2	10,757
足利ホールディングス	67	74.7	74.7	24,800
東京TYフィナンシャルグループ	13.9	14	14	36,414
九州フィナンシャルグループ	—	155.3	155.3	86,657
ゆうちょ銀行	—	260	260	340,860
富山第一銀行	—	23.8	23.8	12,542
コンコルディア・フィナンシャルグループ	—	707	707	349,682
新生銀行	1,030	878	878	151,016
あおぞら銀行	730	642	642	238,824
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,682.6	8,140.1	8,140.1	4,339,487
りそなホールディングス	1,266	1,186.9	1,186.9	506,212
三井住友トラスト・ホールディングス	2,392	2,118	2,118	764,598
三井住友フィナンシャルグループ	818.4	812.4	812.4	2,786,532
第四銀行	137	129	129	47,859
北越銀行	116	110	110	20,460
西日本シティ銀行	380	331	331	66,862
千葉銀行	417	391	391	218,960
横浜銀行	726	—	—	—
常陽銀行	391	367	367	143,130
群馬銀行	256	225	225	94,500
武蔵野銀行	17.3	16.3	16.3	44,841
千葉興業銀行	22.6	28.1	28.1	12,560
筑波銀行	45	42.2	42.2	12,533
七十七銀行	183	159	159	60,897
青森銀行	84	74	74	23,162
秋田銀行	71	67	67	20,502
山形銀行	65	57	57	23,028
岩手銀行	7.6	7.1	7.1	29,713
東邦銀行	96	91	91	32,396
東北銀行	58	51	51	7,344
みちのく銀行	54	50	50	9,250
ふくおかフィナンシャルグループ	439	439	439	166,381
静岡銀行	317	297	297	236,709
十六銀行	136	127	127	38,608

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
スルガ銀行	114.2	96.3	96.3	212,726
八十二銀行	196	183.5	183.5	90,282
山梨中央銀行	67	63	63	24,507
大垣共立銀行	135	136	136	45,560
福井銀行	93	88	88	18,392
北國銀行	121	109	109	34,880
清水銀行	3.7	3.6	3.6	8,964
富山銀行	—	2	2	7,050
滋賀銀行	108	95	95	43,890
南都銀行	103	97	97	31,137
百五銀行	104	92	92	37,076
京都銀行	207	194	194	137,352
紀陽銀行	42.5	39.8	39.8	55,202
三重銀行	49	46	46	9,246
ほくほくフィナンシャルグループ	736	690	690	91,770
広島銀行	319	299	299	119,002
山陰合同銀行	66	61.6	61.6	44,044
中国銀行	76.7	71.9	71.9	87,502
鳥取銀行	35	33	33	5,709
伊予銀行	115.7	108.5	108.5	79,747
百十四銀行	118	111	111	35,187
四国銀行	84	79	79	16,669
阿波銀行	89	82	82	46,658
鹿児島銀行	75	—	—	—
大分銀行	66	58	58	19,024
宮崎銀行	72	67	67	19,095
肥後銀行	88	—	—	—
佐賀銀行	65	62	62	14,384
十八銀行	67	63	63	16,569
沖縄銀行	8.6	7.8	7.8	29,484
琉球銀行	22.5	21	21	24,906
セブン銀行	364.9	380.1	380.1	159,642
みずほフィナンシャルグループ	15,088.2	14,380.2	14,380.2	2,456,138
高知銀行	44	41	41	4,305
山口フィナンシャルグループ	108	95	95	105,450
長野銀行	34	33	33	6,501
名古屋銀行	98	86	86	30,358
北洋銀行	163	153.7	153.7	45,187
愛知銀行	3.9	3.5	3.5	16,957

三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定型)

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
第三銀行	59	57	57	9,462
中京銀行	44	41	41	9,512
東日本銀行	47	—	—	—
大光銀行	39	37	37	7,030
愛媛銀行	63	59	59	13,924
トマト銀行	41	39	39	5,850
みなと銀行	98	93	93	16,554
京葉銀行	89	84	84	34,440
関西アーバン銀行	14.4	13.8	13.8	14,131
栃木銀行	54	53	53	22,472
北日本銀行	3.4	3.2	3.2	8,227
東和銀行	155	186	186	16,182
福島銀行	137	127	127	10,922
大東銀行	70	61	61	10,614
トモニホールディングス	83	78.6	78.6	25,702
フィデアホールディングス	64.7	82.2	82.2	12,987
池田泉州ホールディングス	102.5	106.9	106.9	43,935
証券・商品先物取引業 (1.0%)				
F P G	32.2	36.1	36.1	40,215
S B Iホールディングス	130	121.8	121.8	152,493
日本アジア投資	88	—	—	—
ジャフコ	14.8	17	17	54,825
大和証券グループ本社	1,012	949	949	601,381
野村ホールディングス	2,212.3	1,952.1	1,952.1	906,164
岡三証券グループ	92	86	86	48,676
丸三証券	34.7	30.6	30.6	29,773
東洋証券	42	40	40	9,360
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	124.2	116.4	116.4	62,041
光世証券	26	27	27	3,429
水戸証券	33.7	32	32	8,928
いちよし証券	22.6	22.9	22.9	20,106
松井証券	54.6	48.7	48.7	47,287
だいこう証券ビジネス	5.2	5.1	5.1	3,707
マネックスグループ	127.9	118.8	118.8	33,264
カブドットコム証券	48	86.4	86.4	30,412
極東証券	14.5	13.8	13.8	17,595
岩井コスモホールディングス	11.1	9.8	9.8	9,760
藍澤証券	15.3	19	19	11,514
マネースクウェアHD	4.4	3.7	3.7	3,463

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
マネーパートナーズグループ	12.2	9.8	9.8	6,330
保険業 (2.3%)				
かんぽ生命保険	—	41.3	41.3	99,367
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	240.4	225.4	225.4	686,117
アニコム ホールディングス	6.1	7	7	20,552
MS&ADインシュアランスグループホール	345	303.2	303.2	919,908
ソニーフィナンシャルホールディングス	103.7	97.2	97.2	126,360
第一生命保険	693.3	650	650	895,700
東京海上ホールディングス	438.4	411	411	1,543,716
T&Dホールディングス	394.4	369.8	369.8	381,818
その他金融業 (1.3%)				
全国保証	28.1	26.4	26.4	101,244
クレディセゾン	88.4	76.9	76.9	159,183
芙蓉総合リース	11.4	11.6	11.6	55,448
興銀リース	20.3	19.3	19.3	38,117
東京センチュリーリース	25.4	23.8	23.8	93,891
日本証券金融	48.5	46.4	46.4	21,483
アイフル	181.1	169.9	169.9	62,693
ポケットカード	8.5	10.7	10.7	5,863
リコーリース	8.6	8.1	8.1	24,624
イオンフィナンシャルサービス	71	66.6	66.6	161,571
アコム	217.4	203.8	203.8	128,801
ジャックス	60	57	57	28,215
オリエントコーポレーション	251.3	438.7	438.7	98,707
日立キャピタル	21.2	23.9	23.9	56,165
アプラスフィナンシャル	52.6	50.9	50.9	5,548
オリックス	766.1	718.4	718.4	1,102,384
三菱UFJリース	274.5	257.3	257.3	121,702
日本取引所グループ	158.9	297.9	297.9	462,638
イー・ギャランティ	3.2	3.4	3.4	8,734
アサックス	2	2.1	2.1	2,832
NECキャピタルソリューション	4.5	4.3	4.3	6,587
不動産業 (2.8%)				
いちごグループホールディングス	—	112.3	112.3	52,331
日本駐車場開発	119.2	122.5	122.5	15,190
ヒューリック	201	211.5	211.5	235,611
東京建物不動産販売	6.4	—	—	—
三栄建築設計	4.3	4.1	4.1	4,952
野村不動産ホールディングス	65.1	67.3	67.3	127,466

三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定型)

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
三重交通グループホールディングス	20	18.4	8,390	
サムティ	—	7.4	8,058	
ディア・ライフ	—	7	2,590	
ユー・ディー・ワークス	—	99.9	4,195	
日本商業開発	3.5	4.5	7,942	
ブレサンスコーポレーション	3.6	3.5	14,122	
ユニゾホールディングス	6	6.4	36,416	
日本管理センター	7.1	6.8	11,369	
サンセイランディック	1.9	2.5	2,310	
エストラスト	1.4	2.2	1,174	
フージャースホールディングス	16.8	14.4	9,086	
オープンハウス	7.8	14.8	39,516	
東急不動産ホールディングス	283.6	245.4	179,878	
飯田グループホールディングス	70.2	94	227,292	
ムゲンエステート	—	1.5	3,595	
パーク24	54.5	51.2	166,656	
バラカ	3.8	2.9	4,651	
三井不動産	574	538	1,456,635	
三菱地所	805	754	1,602,627	
平和不動産	20.6	19.6	26,479	
東京建物	236	110.8	153,901	
ダイビル	28	26.6	26,999	
京阪神ビルディング	18.1	17.3	10,207	
住友不動産	259	243	744,309	
大京	176	189	31,185	
テーオーシー	37.4	39.7	37,476	
東京楽天地	18	16	7,568	
レオパレス21	118.4	119.5	81,499	
スターツコーポレーション	12.4	11.7	27,600	
フジ住宅	14	12.7	9,042	
空港施設	13.2	12.8	6,220	
住友不動産販売	7.8	7.4	16,124	
ゴールドクレスト	9.9	8.2	14,801	
日本エスリード	4.4	4	4,332	
日神不動産	14.5	13.1	4,899	
タカラレーベン	48.3	44.8	32,524	
サンヨーハウジング名古屋	6.2	5.3	5,029	
イオンモール	69.8	65.5	96,612	
ファースト住建	4.1	3.7	4,861	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
トーセイ	15.1	15.8	12,023	
穴吹興産	11	11	2,827	
エス・ティ・ティ都市開発	67.2	63	71,127	
サンフロンティア不動産	11.8	12.4	15,413	
エフ・ジェー・ネクスト	8.5	8.8	4,532	
グランディハウス	10	9	3,051	
日本空港ビルデング	37.4	32.4	118,746	
サービス業 (3.9%)				
日本工営	38	36	12,672	
ネクスト	13.5	30.6	38,678	
ジェイエイシーリクルートメント	—	6.6	10,573	
日本M&Aセンター	17.7	16.6	112,382	
ノバレーゼ	2.9	2.5	2,067	
アコーディア・ゴルフ	43.1	29.5	29,618	
中広	—	1	618	
タケエイ	11.3	9.6	10,876	
トラスト・テック	2	4.4	6,415	
パソナグループ	8.6	9.6	6,662	
CDS	2.5	2.4	2,148	
リンクアンドモチベーション	15.9	22.6	3,548	
GCAサヴィアン	9.3	9.8	9,251	
エス・エム・エス	12.9	13.5	29,551	
テンブホールディングス	22.5	75.3	126,729	
リニカル	3	6.4	13,139	
クックパッド	7.3	24.2	39,131	
エスクリ	4.1	5	2,875	
アイ・ケイ・ケイ	6.4	5.8	3,619	
学情	4.3	4.1	4,374	
スタジオアリス	5.3	4.9	12,818	
シミックホールディングス	5.2	5.5	8,888	
NJS	2.6	2.3	2,762	
総合警備保障	38.2	35.8	189,740	
カカココム	75.5	77.1	162,681	
ルネサンス	6	5.5	6,528	
ディップ	2.6	12	33,672	
オプトホールディング	5	6.7	5,071	
新日本科学	11.1	—	—	
ツクイ	13.7	12.9	19,440	
総合臨床ホールディングス	6.1	—	—	

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キャリアデザインセンター	3.1	2.4	2,304
エムスリー	99.1	93	302,715
ツカダ・グローバルホールディング	8.3	7.5	5,437
アウトソーシング	4.5	5.1	22,746
ウェルネット	4.1	4.1	16,687
ディー・エヌ・エー	56.5	48.1	104,521
博報堂DYホールディングス	158.7	148.8	205,939
ぐるなび	13.4	12.5	36,012
エスアールジータカミヤ	9.2	11.7	5,194
一休	9.1	—	—
ジャパンベストレスキューシステム	13.9	13.9	3,266
ファンコミュニケーションズ	26.5	25	19,650
ジェイコムホールディングス	2.8	2.3	6,074
PGMホールディングス	16.3	—	—
WDBホールディングス	4.2	3.9	3,459
ティア	5.1	5.2	3,702
バリューコマース	9.6	10	3,600
インフォマート	—	20.6	19,879
J Pホールディングス	28.3	27.2	9,900
E P Sホールディングス	10.5	13.3	19,072
レッグス	—	2.2	1,562
ブレステージ・インターナショナル	8.8	9.1	13,067
アミューズ	3.5	6	13,194
ドリームインキュベータ	3.8	3.6	8,470
クイック	5.3	5.6	4,384
TAC	7.4	7.6	1,603
ケネディクス	162.8	144.1	62,251
電通	127.6	119.7	658,350
テイクアンドグヴィ・ニーズ	4.7	5.4	2,494
びあ	3.3	3.2	6,876
イオンファンタジー	3.8	3.8	10,035
シーティーエス	—	3.3	2,550
ネクシィーズグループ	4.2	3.9	7,761
みらかホールディングス	29.2	27.4	123,985
アルプス技研	4.7	4	9,024
サニックス	13.6	—	—
ダイオーズ	2	1.9	1,882
日本空調サービス	5.6	9.7	5,199
オリエンタルランド	123.8	116.1	859,140

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ダスキン	32.4	27.5	52,662
明光ネットワークジャパン	13.3	13.2	16,315
ファルコホールディングス	5.5	4.8	6,408
秀英予備校	3.7	2.5	1,025
田谷	2.5	2.6	1,773
ラウンドワン	33.1	34.2	24,008
リゾートトラスト	43.3	45	105,615
ビー・エム・エル	6.7	6.4	32,064
ワタベウエディング	4.3	3.8	1,653
りらいあコミュニケーションズ	21.4	18	19,710
リソー教育	—	20.4	8,241
早稲田アカデミー	1.9	1.3	1,094
ユー・エス・エス	138.6	130	217,360
東京個別指導学院	5.9	5.1	3,524
サイバーエージェント	28	28.2	143,820
楽天	498.1	502.4	594,339
テー・オー・ダブリュー	3.6	8.7	5,846
セントラルスポーツ	4	3.7	8,695
フルキャストホールディングス	12.1	10.2	8,333
リゾートソリューション	13	11	3,322
テクノプロ・ホールディングス	16.3	17.4	55,419
インターワークス	—	2.1	1,969
Ke e P e r 技研	—	0.8	1,410
ファーストロジック	—	0.6	1,491
リブセンス	6.8	7.6	3,465
ジャパンマテリアル	4.8	4.5	14,085
ベクトル	2.5	3.4	10,404
ウチヤマホールディングス	6.8	5.6	2,951
サクセスホールディングス	1.3	1.1	1,457
キャリアリンク	1.6	1.5	2,670
I B J	—	8.4	4,888
アサンテ	3.8	4	5,524
N・フィールド	—	5.1	8,338
M&Aキャピタルパートナーズ	0.5	1.4	3,071
ライドオン・エクस्प्रेस	—	2.4	3,218
E R Iホールディングス	2.9	3	2,622
アピスト	1.4	1.7	3,590
ウィルグループ	1.3	2.5	2,565
日本ビューホテル	—	1.6	2,534

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リクルートホールディングス	173.2	216.5	795,637
エラン	—	1.2	1,633
日本郵政	—	315.7	447,978
ベルシステム24ホールディングス	—	21	19,257
リロ・ホールディング	3.9	4	61,920
東祥	2.5	3.2	13,952
エイチ・アイ・エス	18.7	17.4	49,659
ラックランド	—	1.5	2,541
共立メンテナンス	6.8	8.1	67,311
イチネンホールディングス	12	11.3	12,328
建設技術研究所	6.9	6.4	5,702
スペース	6.1	5.8	7,528
燦ホールディングス	2.3	2.1	2,902
スバル興業	8	8	3,008
東京テアトル	49	44	5,104
ナガワ	—	2	7,040
よみうりランド	23	22	10,318
東京都競馬	79	74	16,354
常磐興産	43	40	5,920
カナモト	16	15.1	37,901
東京ドーム	79	86	38,958
西尾レントオール	9.2	8.7	22,298
トランス・コスモス	14.9	12.5	39,437
乃村工藝社	22.5	23.2	39,532
藤田観光	42	40	20,240

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
KNT-CTホールディングス	55	52	8,788	
日本管財	5.6	9.1	14,050	
トーカイ	5	4.8	15,480	
白洋舎	13	12	3,072	
セコム	111.2	111.7	966,093	
セントラル警備保障	5.1	4.8	10,512	
丹青社	13.4	20.4	18,523	
メイテック	15.3	13	49,660	
アサツー ディ・ケイ	21.5	18.8	51,098	
応用地質	12	10.2	12,005	
船井総研ホールディングス	12.5	15.1	24,899	
進学会	5	4.7	2,561	
オオバ	—	7.9	3,713	
学究社	—	1.6	1,868	
ベネッセホールディングス	41.9	36	88,236	
イオンデライト	11	10.3	32,445	
ナック	7.5	6.6	6,204	
ニチイ学館	22.4	19	12,939	
ダイセキ	18.4	20.2	43,147	
ステップ	3.9	3.5	3,717	
合 計	株 数・金 額	183,713	171,074	204,519,272
	銘柄数<比率>	1,847	1,918	<97.4%>

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	
		百万円	百万円
		5,468	—

<有価証券の貸付及び借入の状況>

2016年5月20日現在における貸付株数の総株数は34,988,100株です。

うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUFJ証券株式会社に対する貸付は、31,291,700株です。

三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド

《第16期》決算日2016年2月22日

[計算期間：2015年2月21日～2016年2月22日]

「三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド」は、2月22日に第16期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	東証株価指数（TOPIX）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 株式（株価指数先物取引等を含む）の組入比率は、高位を保ちます。 運用の効率化を図るためおよび当該株価指数への連動をめざすため、株価指数先物取引等を利用します。
主要運用対象	わが国の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 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 (TOPIX)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	期騰落	期中率	期騰落	期中率			
	円	%		%	%	%	百万円
12期(2012年2月20日)	5,890	△14.0	819.03	△16.0	98.8	1.1	288,676
13期(2013年2月20日)	7,172	21.8	973.70	18.9	98.9	1.1	312,556
14期(2014年2月20日)	8,968	25.0	1,194.56	22.7	98.5	1.5	285,064
15期(2015年2月20日)	11,495	28.2	1,500.33	25.6	99.1	0.5	276,171
16期(2016年2月22日)	10,155	△11.7	1,300.00	△13.4	99.0	1.0	199,359

(注) 東証株価指数（TOPIX）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代表的な株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

(注) 上記指数は、配当相当分を含まないインデックスです。このためファンドとベンチマークの騰落率との差異には、ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる「配当金要因」が含まれている点にご留意ください。

(注) 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 (T O P I X)	株 組 入 比 率		株 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率		式 率	式 率	
(期 首) 2015年2月20日	円 11,495	% —	1,500.33	% —	% 99.1	% 0.5
2月末	11,678	1.6	1,523.85	1.6	98.0	0.6
3月末	11,918	3.7	1,543.11	2.9	97.9	1.2
4月末	12,306	7.1	1,592.79	6.2	97.7	1.3
5月末	12,937	12.5	1,673.65	11.6	97.8	1.3
6月末	12,614	9.7	1,630.40	8.7	99.5	0.9
7月末	12,841	11.7	1,659.52	10.6	99.5	0.5
8月末	11,896	3.5	1,537.05	2.4	100.0	1.1
9月末	11,006	△ 4.3	1,411.16	△ 5.9	100.5	1.7
10月末	12,154	5.7	1,558.20	3.9	97.0	1.5
11月末	12,327	7.2	1,580.25	5.3	98.0	1.5
12月末	12,085	5.1	1,547.30	3.1	99.5	0.7
2016年1月末	11,187	△ 2.7	1,432.07	△ 4.5	100.6	1.5
(期 末) 2016年2月22日	10,155	△11.7	1,300.00	△13.4	99.0	1.0

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ11.7%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（-13.4%）を1.7%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内株式市況

- ・期首から2015年8月上旬にかけては、国内企業業績改善への期待が高まったことや、円安・米ドル高の進行などを受けて国内株式市況は上昇しました。
- ・8月中旬から期末にかけては、2015年内の米利上げ観測の高まりを受けて円安が進んだことなどから国内株式市況が一時上昇する場面もありましたが、中国経済減速への不安から世界同時株安となったことなどにより、国内株式市況は下落しました。
- ・期を通じてみると、国内株式市況は下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・株式ポートフォリオは、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）と業種別比率などが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・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13.4%の下落となったため、カイ離は1.7%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率 要因	銘柄選択 要因	その他の 要因	合計
ベンチマーク とのカイ離	0.0%程度	0.0%程度	1.7%程度	1.7%程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

- ・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・期中における先物組入比率の平均は、1.2%程度となりました。

(注) 先物の使用は、「利便性に優れ、売買コストが低い」利点がある反面、必ずしも指数の値動きと一致しないことから、ベンチマークからのカイ離を生む可能性があります。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.7%程度でした。配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

プラス要因	配当・利子収入等	計 1.9%程度
マイナス要因	売買コスト等	計 Δ0.2%程度

信託財産の収益向上を目的に、保有株式の貸し付けを行っています。貸付契約額は、期末時点で概ね純資産総額の6割程度となり、信託財産に若干の収益寄与となりました。

○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

(2015年2月21日～2016年2月22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	0.003	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
合 計	(0)	(0.003)	
期中の平均基準価額は、12,079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

(2015年2月21日～2016年2月22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
		23,951	31,446,911	57,878	80,787,988
		(△ 3,082)	()		

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
		57,482	57,014	—	—

○株式売買比率

(2015年2月21日～2016年2月22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	112,234,899千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	246,106,376千円
(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

(2015年2月21日～2016年2月22日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
株式	百万円 31,446	百万円 6,634	% 21.1	百万円 80,787	百万円 17,743	% 22.0

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 703	百万円 2,246	百万円 4,158

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 196

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)	7,355千円
うち利害関係人への支払額 (B)	119千円
(B) / (A)	1.6%

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中京銀行、カブドットコム証券、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱UFJリース、アコム、ジャックス、モルガン・スタンレーMUFJG証券です。

○組入資産の明細

(2016年2月22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	59	49	12,838	
日本水産	172	132.6	72,399	
マルハニチロ	27.1	23.5	52,546	
サカタのタネ	22.5	16.9	46,559	
ホクト	15.5	11.7	23,669	
鉱業 (0.3%)				
住石ホールディングス	42.4	35.3	3,282	
日鉄鉱業	39	32	13,120	
三井松島産業	94	76	8,968	
国際石油開発帝石	736.6	606	499,889	
日本海洋掘削	4.2	3.4	6,898	
石油資源開発	19.9	18.2	46,300	
K&Oエナジーグループ	9.4	7.6	9,310	
建設業 (3.1%)				
ショーボンドホールディングス	13.5	12	46,080	
ミライト・ホールディングス	42.8	35.3	28,063	
タマホーム	11.8	9.8	4,096	
サンヨーホームズ	1.8	3.5	1,750	
ダイセキ環境ソリューション	1.7	2.7	2,799	
安藤・間	93.3	76.8	39,782	
東急建設	49.8	37.6	30,944	
コムシスホールディングス	62.2	49.4	83,881	
ミサワホーム	16.8	13.8	9,108	
高松コンストラクショングループ	10.5	8.6	18,464	
東建コーポレーション	5.2	4.7	40,279	
ヤマウラ	6.8	5.8	2,627	
大成建設	707	597	413,124	
大林組	419	345	341,205	
清水建設	428	352	304,480	
飛鳥建設	92	88.7	13,659	
長谷工コーポレーション	174.8	134.2	126,953	
松井建設	16	12.8	8,537	
銭高組	20	16	7,072	

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
鹿島建設	615	539	347,116	
不動テトラ	106.3	82.3	9,382	
鉄建建設	85	70	17,990	
日鉄住金テックスエンジ	27	—	—	
西松建設	151	133	57,057	
三井住友建設	567.3	443.5	40,802	
大豊建設	39	44	18,744	
前田建設工業	93	71	53,321	
佐田建設	50	8.3	3,344	
ナカノフドー建設	11.2	8.9	4,681	
奥村組	133	109	60,604	
大和小田急建設	7.8	—	—	
東鉄工業	16.7	13.7	41,511	
イチケン	16	14	4,172	
浅沼組	47	37	8,399	
戸田建設	175	134	60,970	
熊谷組	176	168	49,728	
青木あすなろ建設	8.5	7.6	5,046	
北野建設	29	25	6,675	
植木組	18	16	3,424	
三井ホーム	17	15	7,590	
矢作建設工業	17.7	15.8	11,549	
ビーエス三菱	15.4	14.1	5,907	
日本ハウスホールディングス	17.6	24	9,576	
大東建託	53.1	43	653,170	
新日本建設	17.1	13.9	7,228	
N I P P O	32	26	43,914	
東亜道路工業	27	22	7,700	
前田道路	44	36	61,812	
日本道路	42	34	18,904	
東亜建設工業	106	100	24,300	
若築建設	81	68	7,820	
東洋建設	37.4	36.2	15,095	
五洋建設	155.2	127.6	59,716	

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大林道路	16	13.6	9,941
世紀東急工業	21	18.3	8,546
福田組	21	18	16,416
住友林業	103.1	79.2	100,900
日本基礎技術	16.9	13	5,811
日成ビルド工業	39	31	11,439
ヤマダ・エスバイエルホーム	67	63	4,284
巴コーポレーション	18	15	5,595
パナホーム	52	43	35,389
大和ハウス工業	409.4	339.8	1,041,147
ライト工業	22.5	22.2	24,331
積水ハウス	430.3	384.6	693,626
日特建設	18.9	12.7	5,054
北陸電気工事	7	4.3	3,289
ユアテック	22	18	14,166
西部電気工業	12	10	4,100
四電工	12	10	3,700
中電工	20.1	16.5	38,626
関電工	64	46	38,594
きんでん	93	69.5	100,705
東京エネシス	16	13	11,349
トーエネック	20	16	10,864
住友電設	11.1	9.2	12,263
日本電設工業	22.7	18.8	40,156
協和エクシオ	59.3	45.1	56,871
新日本空調	11.7	9.8	9,417
NDS	22	19	5,358
九電工	26	21	47,124
三機工業	28.7	25.7	24,080
日揮	141	116	198,360
中外炉工業	43	36	6,336
ヤマト	13	10.6	4,547
太平電業	19	16	14,240
高砂熱学工業	38.9	34.3	52,410
三晃金属工業	15	13	3,445
朝日工業社	16	14	6,258
明星工業	24.8	21.1	8,693
大気社	19.9	14.1	35,785
ダイダン	19	15	11,310

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日比谷総合設備	18	14	22,834
東芝プラントシステム	22.4	18.5	23,328
東洋エンジニアリング	68	61	16,043
千代田化工建設	101	83	70,301
新興ブランテック	28.3	23.6	20,768
食料品 (5.2%)			
日本製粉	85	76	61,180
日清製粉グループ本社	153.3	126.1	235,933
日東富士製粉	11	9	3,177
昭和産業	57	47	21,244
鳥越製粉	11.6	8.9	5,687
中部飼料	13.6	10.6	8,405
フィード・ワン	88.2	69.6	8,143
東洋精糖	28	23	2,323
日本甜菜製糖	73	59	11,033
三井製糖	55	45	21,600
塩水港精糖	16.1	13.9	3,197
日新製糖	—	1.6	6,920
森永製菓	126	104	66,768
中村屋	33	27	12,501
江崎グリコ	32.3	26.6	161,196
名糖産業	6.3	5.2	6,760
不二家	81	65	12,350
山崎製パン	102	84	181,020
第一屋製パン	23	23	2,369
モロゾフ	22	18	7,578
亀田製菓	7.7	6.4	27,520
寿スピリッツ	3.3	2.7	14,769
カルビー	51.8	42.6	197,877
森永乳業	126	103	55,208
六甲バター	6.3	5.1	9,134
ヤクルト本社	75	61.7	343,052
明治ホールディングス	41.4	68.1	635,373
雪印メグミルク	32.8	27.1	73,684
プリマハム	78	72	20,016
日本ハム	103	85	215,730
伊藤ハム	76	55	38,830
丸大食品	72	59	24,898
米久	4.5	3.6	9,237

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
S Foods	8.7	7.1	15,257	
サッポロホールディングス	229	176	96,624	
アサヒグループホールディングス	281.1	215.8	754,652	
キリンホールディングス	598.3	466.2	698,833	
宝ホールディングス	109.7	83.3	68,389	
オエノンホールディングス	37	32	6,560	
養命酒製造	9	3.5	6,702	
コカ・コーラウエスト	47.4	39	101,322	
コカ・コーライーストジャパン	42.5	40.7	83,516	
サントリー食品インターナショナル	83.8	78.8	393,212	
ダイドードリンコ	7	5.8	29,696	
伊藤園	41.5	34.1	110,654	
キーコーヒー	12.4	10	18,010	
ユニカフェ	4.3	3.3	3,042	
ジャパンフーズ	2.2	1.9	2,141	
日清オイリオグループ	67	61	27,694	
不二製油グループ本社	37.3	30.7	59,834	
かどや製油	1.2	1	2,798	
J-オイルミルズ	58	48	16,320	
キッコーマン	114	87	331,470	
味の素	322	246	708,603	
キュービー	71.1	58.5	149,409	
ハウス食品グループ本社	51.8	39.3	86,656	
カゴメ	54	41.3	88,340	
焼津水産化学工業	6.9	5.4	5,427	
アリアケジャパン	12.7	9.4	59,972	
ビエトロ	—	1.2	2,215	
エバラ食品工業	2.4	2.8	5,451	
ニチレイ	149	123	109,101	
東洋水産	73	56.6	235,739	
イートアンド	1.6	1.3	2,956	
日清食品ホールディングス	59.2	48.7	263,467	
永谷園ホールディングス	13	11	11,418	
一正蒲鉾	2.5	4.2	3,624	
フジッコ	13	11.2	24,628	
ロック・フィールド	7.2	6	17,976	
日本たばこ産業	775	680.1	3,089,014	
ケンコーマヨネーズ	4.6	3.7	8,576	
わらべや日洋	8.2	6.2	14,594	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
なとり	6.5	5.7	9,074	
北の達人コーポレーション	—	1.8	939	
ユーグレナ	30.3	38.8	59,014	
ミヨシ油脂	50	42	5,082	
理研ビタミン	4.1	3.3	12,342	
繊維製品 (0.7%)				
片倉工業	16.6	13.7	16,179	
グンゼ	105	87	24,882	
東洋紡	518	426	66,882	
ユニチカ	395	324	16,524	
富士紡ホールディングス	64	54	11,016	
日清紡ホールディングス	83	—	—	
倉敷紡績	135	111	19,425	
シキボウ	87	74	7,918	
日本毛織	41	33	24,453	
トーア紡コーポレーション	79	6.5	3,003	
ダイドーリミテッド	16.5	13.6	6,351	
帝国繊維	13.6	11.2	16,508	
帝人	534	439	166,381	
東レ	1,011	780	712,764	
サカイオーベックス	39	30	5,040	
住江織物	33	28	8,008	
日本フェルト	7.3	5.1	2,315	
イチカワ	9	7	1,897	
日本バイリーン	18	—	—	
芦森工業	31	25	3,725	
アツギ	121	87	9,483	
ダイニック	26	22	3,322	
セーレン	32.4	26.9	28,621	
東海染工	—	19	2,223	
小松精練	22.5	16.8	9,710	
ワコールホールディングス	78	64	83,904	
ホギメディカル	8.2	6.7	37,118	
クラウディア	1.7	3.6	1,746	
T S I ホールディングス	58.3	48	34,992	
三陽商会	70	61	15,677	
オンワードホールディングス	94	71	50,055	
ルック	24	21	3,003	
キムラタン	649	510	3,570	

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
ゴールドウイン	30	4.5	20,565	
デサント	29.8	24.6	42,139	
キング	8	6.8	2,604	
ヤマトインターナショナル	10.4	7.6	2,888	
パルプ・紙 (0.3%)				
特種東海製紙	76	62	22,816	
王子ホールディングス	536	441	189,630	
日本製紙	63.1	55.6	101,470	
三菱製紙	205	166	13,280	
北越紀州製紙	80.7	66.6	41,092	
中越パルプ工業	51	44	6,996	
巴川製紙所	—	18	3,168	
大王製紙	58	47.5	41,420	
レンゴー	115	95	51,205	
トーモク	41	34	8,500	
ザ・バック	9.1	7.5	19,815	
化学 (6.1%)				
クラレ	222.5	169.7	210,258	
旭化成	815	671	440,243	
共和レザー	8.5	7	5,782	
コープケミカル	23	—	—	
昭和電工	870	716	80,908	
住友化学	962	792	397,584	
日本化成	26	22	2,508	
住友精化	27	22	12,914	
日産化学工業	87.3	64.6	165,569	
ラサ工業	52	42	4,242	
クレハ	91	81	29,241	
多木化学	8	7	4,438	
テイカ	22	18	9,468	
石原産業	223	195	14,235	
片倉コープアグリ	9	14	3,038	
日東エフシー	—	6.3	5,260	
日本曹達	83	69	34,845	
東ソー	326	290	124,120	
トクヤマ	204	180	25,200	
セントラル硝子	133	116	62,988	
東亜合成	164	67.3	59,224	
大阪ソーダ	52	46	19,044	

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
関東電化工業	32	25	21,925	
デンカ	271	223	89,423	
信越化学工業	234.4	192.8	1,094,140	
日本カーバイド工業	46	39	4,641	
堺化学工業	53	43	12,771	
エア・ウォーター	115	89	140,887	
大陽日酸	168	82.8	83,296	
日本化学工業	49	41	7,913	
日本パーカライジング	30.8	55	53,460	
高压ガス工業	19	16	9,376	
チタン工業	16	14	2,324	
四国化成工業	19	15	13,035	
戸田工業	27	23	7,291	
ステラ ケミファ	6.9	5.5	12,655	
保土谷化学工業	41	34	5,916	
日本触媒	103	15.6	105,924	
大日精化工業	54	41	18,122	
カネカ	176	145	125,280	
三菱瓦斯化学	225	185	105,635	
三井化学	594	456	180,576	
J S R	129.1	100.9	159,119	
東京応化工業	27.1	21.6	64,022	
大阪有機化学工業	9.5	7.8	4,797	
三菱ケミカルホールディングス	817.1	720.2	439,322	
日本合成化学工業	30	25	16,550	
ダイセル	183.8	151.2	229,068	
住友ベークライト	122	100	48,300	
積水化学工業	303	244.1	312,203	
日本ゼオン	113	93	64,728	
アイカ工業	39.3	32.3	70,607	
宇部興産	658	576	110,592	
積水樹脂	20	16.5	22,176	
タキロン	27	25	13,575	
旭有機材工業	46	34	6,868	
日立化成	64.6	53.1	99,243	
ニチバン	13	11	6,864	
リケンテクノス	21.3	17.4	6,246	
大倉工業	31	26	7,072	
積水化成成品工業	37	27	9,369	

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
群栄化学工業	35	28	7,476	
タイガースポリマー	6.4	5.3	3,217	
ミライアル	4.8	4.2	3,607	
ダイキアクシス	1.6	2.2	1,909	
ダイキョーニシカワ	3.2	13.8	21,169	
日本化薬	85	70	79,870	
カーリットホールディングス	10.5	10.3	5,026	
日本精化	10.7	9	6,489	
扶桑化学工業	—	6.8	9,241	
ADEKA	60.2	52.9	79,085	
日油	109	82	64,944	
新日本理化	21.5	18.3	2,635	
ハリマ化成グループ	11	9.4	4,756	
花王	351.5	289.2	1,691,241	
第一工業製薬	29	24	7,488	
ニイタカ	—	1.7	2,221	
三洋化成工業	41	33	25,278	
大日本塗料	75	62	12,276	
日本ペイントホールディングス	113.1	83	196,876	
関西ペイント	158	121.7	205,551	
神東塗料	10	9	1,611	
中国塗料	37	30	21,390	
日本特殊塗料	10.1	7.6	7,531	
藤倉化成	17.7	14.6	7,533	
太陽ホールディングス	10.6	7.9	29,111	
D I C	524	431	104,302	
サカタインクス	26.6	21.9	24,900	
東洋インキS Cホールディングス	129	105	46,935	
T&K TOKA	4.3	7.6	6,908	
富士フイルムホールディングス	299.1	246.1	1,050,600	
資生堂	232.5	204	494,904	
ライオン	151	124	151,776	
高砂香料工業	43	7.1	16,124	
マンダム	13	9.9	45,936	
ミルボン	7.7	6.3	27,657	
ファンケル	30.4	24.9	34,635	
コーセー	21.1	17.4	166,344	
コタ	3.7	3.4	4,838	
シーズ・ホールディングス	8.8	13.5	24,853	

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
シーボン	1.6	1.3	3,120	
ポーラ・オルビスホールディングス	15.5	11	94,600	
ノエビアホールディングス	8.1	6.8	20,536	
アジュバンコスメジャパン	2.5	2	1,996	
エステー	8.9	7.3	7,993	
アグロ カネショウ	3.6	4.2	3,704	
コニシ	10.3	8.4	21,982	
長谷川香料	16.5	13.6	19,706	
星光PMC	7.4	6.1	5,575	
小林製薬	21.4	16.3	157,947	
荒川化学工業	10.9	9.2	8,528	
メック	10.4	8.5	7,148	
日本高純度化学	3.7	3.1	6,274	
J C U	3.6	3.1	10,199	
新田ゼラチン	8.2	7.2	5,119	
OATアグリオ	—	1	1,239	
デクセリアルズ	—	24.1	24,750	
アース製薬	9.3	7.7	31,185	
イハラケミカル工業	20	16.6	20,517	
北興化学工業	14	12	3,504	
大成ラミック	3.6	3	9,045	
クミアイ化学工業	27	22.3	25,600	
日本農薬	29.8	24.6	14,489	
アキレス	111	88	12,848	
有沢製作所	21.9	16	8,960	
日東電工	101	83.1	497,104	
レック	4.5	3.3	4,151	
きもと	25	19.3	3,223	
藤森工業	11.2	9.2	22,475	
前澤化成工業	9.2	7.5	7,312	
J S P	9.7	7	15,673	
エフビコ	11.5	9.5	41,800	
天馬	10	8.2	15,637	
信越ポリマー	25.7	21	12,201	
東リ	35	28	8,148	
ニフコ	29.2	20.6	104,236	
日本バルカー工業	54	40	11,040	
ユニ・チャーム	264.6	217.7	525,745	

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
医薬品 (5.8%)				
協和発酵キリン	156	128.6	207,817	
武田薬品工業	489.6	428.2	2,319,559	
アステラス製薬	1,488.6	1,204	1,898,708	
大日本住友製薬	92.5	76.1	94,059	
塩野義製薬	204.1	156.7	746,518	
田辺三菱製薬	152.3	125.3	254,484	
わかもと製薬	16	13	3,484	
あすか製薬	15.5	13.8	16,228	
日本新薬	30	24.6	95,448	
ピオフェルミン製薬	2.1	1.7	5,967	
中外製薬	130.1	107	360,590	
科研製薬	45	18.5	133,200	
エーザイ	172.4	132.4	926,800	
ロート製薬	59.4	52.6	108,408	
小野薬品工業	59.4	48.8	962,092	
久光製薬	36.9	33.4	167,668	
有機合成薬品工業	9	8	1,872	
持田製薬	9.3	7.4	63,196	
参天製薬	48	197.9	344,741	
扶桑薬品工業	44	36	9,072	
日本ケミファ	17	15	7,200	
ツムラ	41.1	33.8	94,403	
日医工	30.6	25.1	68,548	
キッセイ薬品工業	24.3	19	50,293	
生化学工業	25	20.6	27,521	
栄研化学	11.1	9	19,242	
日水製薬	5.2	4.4	5,416	
鳥居薬品	8.9	7.3	17,089	
JCRファーマ	10.1	8.3	16,666	
東和薬品	6.6	4.9	25,578	
富士製薬工業	3.6	3	6,072	
沢井製薬	20.7	18.2	138,684	
ゼリア新薬工業	26.8	22.1	30,696	
第一三共	439.6	361.6	816,854	
キョーリン製薬ホールディングス	34.8	28.7	61,044	
大幸薬品	5.9	5.2	6,994	
ダイト	5.3	4.5	12,172	
大塚ホールディングス	259.4	231.2	959,942	

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
大正製薬ホールディングス	31.4	25.9	230,769	
ベプチドリーム	—	13.2	56,166	
石油・石炭製品 (0.5%)				
日本コークス工業	118.7	90.4	6,870	
昭和シェル石油	116.8	108.1	101,181	
コスモ石油	361	—	—	
ニチレキ	16	13	9,685	
東燃ゼネラル石油	197	162	145,800	
ユシロ化学工業	7.7	5.7	7,022	
ビービー・カストロール	5.3	4.3	5,276	
富士石油	30.5	25.4	7,010	
MORESCO	3.4	3.4	5,004	
出光興産	62	56.1	100,755	
JXホールディングス	1,450.4	1,272.8	566,650	
コスモエネルギーホールディングス	—	32.5	38,610	
ゴム製品 (1.0%)				
横浜ゴム	146	64.9	123,504	
東洋ゴム工業	59.1	48.6	83,154	
ブリヂストン	409.6	362.9	1,448,333	
住友ゴム工業	101.9	100.6	166,694	
藤倉ゴム工業	11.3	9.2	4,167	
オカモト	44	33	30,954	
フコク	5.4	3.7	3,148	
ニッタ	12.8	11.6	33,779	
住友理工	24.1	23.1	22,961	
三ツ星ベルト	33	26	22,698	
バンドー化学	48	39	16,809	
ガラス・土石製品 (0.8%)				
日東紡績	96	71	25,773	
旭硝子	644	567	309,015	
日本板硝子	630	521	37,512	
石塚硝子	19	16	3,472	
日本山村硝子	52	44	7,216	
日本電気硝子	251	222	118,104	
オハラ	4.6	3.8	1,972	
住友大阪セメント	243	213	87,756	
太平洋セメント	815	671	152,988	
デイ・シイ	13.7	10.5	3,318	
日本ヒューム	13.8	10.3	5,634	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本コンクリート工業	22.7	22.8	5,700	
三谷セキサン	6.5	5.3	7,271	
アジアバイルホールディングス	17.6	13.5	4,833	
東海カーボン	112	93	25,389	
日本カーボン	69	54	11,556	
東洋炭素	7.3	6	8,718	
ノリタケカンパニーリミテド	73	60	14,580	
TOTO	192	79	255,565	
日本碍子	165	136	279,480	
日本特殊陶業	112.6	92.6	200,479	
ダントーホールディングス	21	15	2,715	
MARUWA	3.8	3.9	9,707	
品川リフラクトリーズ	33	26	5,278	
黒崎播磨	28	24	5,616	
ヨータイ	7	6	1,758	
イソライト工業	6.6	6	1,062	
東京窯業	16	12	2,004	
ニッカー	3.9	3.6	1,342	
フジミインコーポレーテッド	12.6	9.4	10,951	
ユーアンドエーマテリアル	31	27	1,917	
ニチアス	58	54	33,912	
ニチハ	17.4	14.4	22,017	
鉄鋼 (1.1%)				
新日鐵住金	5,524	484.7	908,327	
神戸製鋼所	2,259	1,975	169,850	
中山製鋼所	101	125	8,125	
合同製鐵	68	61	11,712	
ジェイ エフ イー ホールディングス	333.3	293.8	379,736	
日新製鋼	55.3	49	57,134	
東京製鐵	66.3	59.4	43,005	
共英製鋼	13.9	11.3	19,221	
大和工業	29.7	23.7	54,675	
東京鐵鋼	25	22	8,558	
大阪製鐵	8.2	6.7	11,570	
淀川製鋼所	92	15.9	38,970	
東洋鋼板	31	26	7,826	
丸一鋼管	40.1	36	112,500	
モリ工業	21	17	5,219	
大同特殊鋼	219	180	73,620	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本高周波鋼業	54	45	3,240	
日本冶金工業	103.4	81.7	9,232	
山陽特殊製鋼	78	63	30,177	
愛知製鋼	77	63	26,649	
日立金属	133	123.1	146,735	
日本金属	36	31	3,317	
大平洋金属	84	76	23,712	
新日本電工	79.9	61.5	10,147	
栗本鐵工所	68	52	8,112	
虹技	19	16	2,464	
日本鑄鉄管	13	13	1,742	
三菱製鋼	86	76	13,300	
日亜鋼業	18	14.9	3,903	
日本精線	10	8	3,816	
シンニッタン	13.7	9.8	5,762	
新家工業	27	24	3,168	
非鉄金属 (0.8%)				
大紀アルミニウム工業所	22	17	4,369	
日本軽金属ホールディングス	316.2	242.7	40,773	
三井金属鉱業	355	275	44,000	
東邦亜鉛	74	58	16,298	
三菱マテリアル	815	671	208,681	
住友金属鉱山	361	297	344,668	
DOWAホールディングス	156	138	83,076	
古河機械金属	204	168	26,880	
大阪チタニウムテクノロジーズ	12.9	10.6	17,299	
東邦チタニウム	22.2	18.4	15,916	
UACJ	149	150	32,100	
古河電気工業	383	338	78,078	
住友電気工業	492.2	430.2	576,683	
フジクラ	182	150	69,900	
昭和電線ホールディングス	150	135	7,425	
東京特殊電線	2.2	1.8	1,542	
タツタ電線	24.7	22.3	7,336	
沖電線	14	14	2,744	
カナレ電気	2	1.7	2,878	
平河ヒューテック	3	5.2	5,012	
リョービ	73	65	26,455	
アールステイ	11.7	12.6	8,253	

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
アサヒホールディングス	19.5	16.1	23,184	
金属製品 (0.7%)				
稲葉製作所	5.4	5.7	6,600	
宮地エンジニアリンググループ	40	35	4,830	
トーカロ	8.6	7.5	14,130	
アルファC o	4.3	3.5	3,710	
SUMCO	89.9	84.1	64,168	
川田テクノロジーズ	2.5	2.1	6,615	
東洋製織グループホールディングス	92.8	76.4	150,584	
ホッカンホールディングス	32	29	8,381	
コロナ	6.7	5.7	5,700	
横河ブリッジホールディングス	24.8	20.5	21,689	
駒井ハルテック	24	21	4,704	
高田機工	13	12	2,232	
三和ホールディングス	125.9	108.9	78,299	
文化シャッター	36	29.8	26,969	
三協立山	17.2	14.1	18,315	
アルインコ	5.6	5.9	5,823	
東洋シャッター	3.4	3.1	1,683	
L I X I Lグループ	194.1	149.7	358,232	
日本フィルコン	10.2	8.1	3,369	
ノーリツ	25.6	21	39,774	
長府製作所	13.9	11.6	28,884	
リンナイ	24.3	20	194,800	
ダイニチ工業	6.6	5.6	3,410	
日東精工	19	16	4,832	
三洋工業	17	15	2,235	
岡部	25.8	22.2	15,051	
ジーテクト	8.9	11.1	13,009	
東プレ	25	20.6	42,333	
高周波熱練	22.5	20	16,340	
東京製綱	90	74	10,286	
サンコール	8	5.6	2,648	
モリテック スチール	6.6	5.5	1,364	
バイオラックス	6.6	5.4	28,242	
日本発條	113.5	101.1	103,122	
中央発條	17	14	3,682	
アドバネクス	—	2.2	2,756	
立川ブラインド工業	—	4.7	3,219	

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
三益半導体工業	9.7	8	8,208	
機械 (4.6%)				
日本ドライケミカル	1.7	1.3	2,704	
日本製鋼所	187	178	67,640	
三浦工業	58.3	47.9	86,699	
タクマ	44	39	33,930	
ツガミ	38	31	12,369	
オークマ	85	70	60,340	
東芝機械	71	59	21,830	
アマダホールディングス	194.7	156.7	170,646	
アイダエンジニアリング	28.5	28.1	24,278	
滝澤鉄工所	41	35	4,340	
富士機械製造	42.5	35	37,695	
牧野フライス製作所	65	53	38,266	
オーエスジー	59.5	48.9	93,496	
ダイジェット工業	16	14	1,820	
旭ダイヤモンド工業	35.8	29.4	28,694	
DMG森精機	82.4	59.3	57,698	
ソディック	—	20.6	15,202	
ディスコ	15.2	13.7	147,686	
日東工器	7.5	6.3	13,047	
パンチ工業	2.9	4.4	3,036	
豊和工業	7.6	6.5	3,510	
OKK	53	44	4,928	
石川製作所	36	32	2,176	
東洋機械金属	9.4	8	2,576	
津田駒工業	34	29	2,842	
島精機製作所	18.5	15.1	25,911	
フリーユー	—	1.6	5,120	
日阪製作所	16.5	13.6	10,948	
やまびこ	5.1	19.7	14,775	
ペガサスミシン製造	11.7	11.1	5,439	
ナブテスコ	79.5	55.8	123,820	
三井海洋開発	13.2	12.5	18,437	
レオン自動機	10.4	9.1	5,505	
SMC	39.2	32.2	881,153	
新川	11.1	9.9	3,940	
ホソカワミクロン	22	18	9,504	
ユニオンツール	6.5	4.6	11,178	

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
オイレス工業	16.2	14	24,878	
日精エー・エス・ビー機械	4.2	4	7,224	
サトーホールディングス	16.3	14.5	36,134	
日本エアータック	4.2	4.4	3,040	
日精樹脂工業	9.5	8	5,440	
ワイエイシイ	5.5	4.5	2,785	
小松製作所	647.6	526.7	917,248	
住友重機械工業	357	313	145,232	
日立建機	58.3	48	78,576	
日工	18	16	5,200	
巴工業	4.8	4.4	6,261	
井関農機	134	111	19,980	
TOWA	10.9	10.6	7,335	
丸山製作所	30	24	3,960	
北川鉄工所	60	49	10,094	
タカキタ	—	2.8	1,450	
クボタ	630	515.9	747,539	
荏原実業	3.7	3.1	3,751	
三菱化工機	43	36	8,028	
月島機械	22.9	20.2	20,341	
帝国電機製作所	8.8	7.9	5,229	
新東工業	30.8	24.5	22,270	
澁谷工業	10.9	9	11,988	
アイチ コーポレーション	18.4	15.2	11,734	
小森コーポレーション	31.9	26	31,252	
鶴見製作所	9.7	8	14,064	
住友精密工業	21	18	6,192	
酒井重工業	25	21	3,696	
荏原製作所	271	238	101,388	
石井鐵工所	20	17	2,482	
西島製作所	13.2	11.6	11,240	
北越工業	9.7	11.4	7,318	
ダイキン工業	181.7	149.5	1,167,445	
オルガノ	24	19	7,847	
トーヨーカネツ	76	58	13,920	
栗田工業	73.9	64.6	164,471	
椿本チエイン	67	60	37,620	
大同工業	26	22	4,180	
日本コンベヤ	42	38	4,484	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
木村化工機	12.5	9.6	3,456	
アネスト岩田	19.6	17.3	14,929	
ダイフク	61.7	55.2	96,820	
サムコ	1.8	1.8	1,441	
加藤製作所	27	24	8,976	
油研工業	25	21	3,906	
タダノ	60	50	48,700	
フジテック	36.2	29.7	34,838	
C K D	35	28.7	22,414	
キトー	13.7	13	9,659	
平和	27.1	31.8	75,048	
理想科学工業	15.2	11.4	20,360	
SANKYO	37.8	28.6	121,550	
日本金銭機械	11.6	9.5	9,395	
マースエンジニアリング	6.9	5.7	11,097	
福島工業	6.8	6.3	14,263	
オーイズミ	4.4	4.6	2,185	
ダイコク電機	5.2	4.2	5,115	
竹内製作所	—	15.2	21,842	
アマノ	41.6	31.7	50,181	
J U K I	93	15.4	13,274	
サンデンホールディングス	76	63	18,333	
蛇の目ミシン工業	122	10.2	5,477	
マックス	19	16	19,040	
グローリー	39.9	35	132,650	
新晃工業	8.7	7.2	12,211	
大和冷機工業	18	16.5	15,180	
セガサミーホールディングス	134.1	110.3	131,918	
日本ビストンリング	50	4.4	6,613	
リケン	53	47	16,685	
T P R	13.9	12.6	33,415	
ツバキ・ナカシマ	—	9.5	14,848	
ホシザキ電機	27.3	22.5	193,275	
大豊工業	10.1	8.4	9,130	
日本精工	256	210.9	221,023	
NTN	289	255	92,310	
ジェイテクト	133	109.4	169,570	
不二越	116	95	35,910	
日本トムソン	43	35	13,265	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
THK	83	68.3	134,482	
ユーシン精機	5.5	4	6,896	
前澤給装工業	4.8	4.3	5,886	
イーグル工業	17.3	12.7	17,805	
前澤工業	9.5	7.9	2,148	
日本ビラー工業	13.8	10.4	9,484	
キッツ	56.3	49.5	23,265	
日立工機	33.5	27.6	20,424	
マキタ	81.4	66.9	452,244	
日立造船	97.6	81.2	41,736	
三菱重工業	2,092	1,828	749,297	
I H I	899	789	149,910	
電気機器 (11.4%)				
日清紡ホールディングス	—	57	63,270	
イビデン	81.8	62.9	85,103	
コニカミノルタ	297.4	256.4	236,400	
ブラザー工業	161.3	132.7	158,974	
ミネベア	186	165	130,680	
日立製作所	2,997	2,619	1,248,215	
東芝	2,627	2,161	396,543	
三菱電機	1,248	1,095	1,241,730	
富士電機	347	309	118,038	
東洋電機製造	25	21	6,699	
安川電機	146.7	127.5	163,327	
シンフォニアテクノロジー	88	68	9,792	
明電舎	115	94	43,616	
オリジン電気	18	15	3,825	
山洋電気	28	27	13,500	
デンヨー	11.3	9.4	11,007	
東芝テック	89	74	26,048	
芝浦メカトロニクス	21	18	3,438	
マブチモーター	38.2	29.4	135,828	
日本電産	134.9	123.6	911,179	
東光高岳	6.3	5.7	7,620	
ダブル・スコープ	—	3	12,075	
ダイヘン	68	60	27,240	
田淵電機	—	11.8	5,156	
ヤーマン	1.7	1.4	2,704	
JVCケンウッド	92.6	76.6	22,520	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ミマキエンジニアリング	—	7.2	3,088	
第一精工	4.6	4.5	5,782	
日新電機	29	24.1	22,099	
大崎電気工業	20	19	13,623	
オムロン	134.8	117.8	361,646	
日東工業	19.9	16.4	29,503	
I D E C	14.8	13.1	13,401	
不二電機工業	1.1	0.9	1,257	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	240	198	88,704	
サクサホールディングス	33	29	5,539	
メルコホールディングス	7	5.8	12,974	
テクノメディカ	2.8	2.4	5,364	
日本電気	1,615	1,412	385,476	
富士通	1,203	990	410,058	
沖電気工業	432	445	67,640	
岩崎通信機	63	56	4,032	
電気興業	36	27	14,877	
サンケン電気	63	56	16,968	
ナカヨ	13	11	3,553	
アイホン	7.3	5.8	11,211	
ルネサスエレクトロニクス	64.3	53.1	34,992	
セイコーエプソン	85.2	152.9	275,067	
ワコム	98.7	80.9	39,155	
アルバック	21.1	18.9	61,992	
アクセル	5.7	4.7	4,042	
E I Z O	11.5	10.2	30,498	
ジャパンディスプレイ	192.2	192.2	40,554	
日本信号	34.3	28.3	22,611	
京三製作所	29	24	7,704	
能美防災	16.4	11.7	15,830	
ホーチキ	9	7.6	8,618	
エレコム	3.9	8.9	14,400	
日本無線	27	26	6,942	
パナソニック	1,520.8	1,173	991,302	
シャープ	1,055	868	150,164	
アンリツ	78.1	61.4	39,173	
富士通ゼネラル	38	31	46,128	
日立国際電気	33	23	29,118	
ソニー	807.4	724.4	1,802,307	

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
TDK	75.3	62	355,880
帝国通信工業	31	27	4,401
ミツミ電機	44.4	39.6	19,285
タムラ製作所	48	40	10,840
アルプス電気	98.5	87.1	157,128
バイオニア	189.4	167	40,748
日本電波工業	11.5	9.6	6,480
鈴木	1.4	3	1,389
日本トリム	3.1	2.7	11,704
ローランド ディー. ジー.	5.1	5.1	11,903
フォスター電機	12.8	12.8	27,366
クラリオン	67	54	18,954
SMK	37	30	15,870
ヨコオ	9.9	7.4	4,003
東光	30	21	7,518
ホシデン	39.6	31.4	20,755
ヒロセ電機	20.2	16.6	209,326
日本航空電子工業	36	29	33,379
TOA	13.3	12.2	12,346
日立マクセル	18.6	17	27,659
古野電気	15	12.5	8,725
ユニデンホールディングス	37	36	4,068
アルパイン	29.8	24.6	31,242
スミダコーポレーション	11.3	8.8	6,230
アイコム	7	5.7	12,517
リオン	3.7	3.9	6,084
船井電機	12.9	10.9	10,496
横河電機	124.9	102.8	115,547
新電元工業	48	36	12,996
アズビル	40.7	33.5	93,029
東亜ディーケーケー	5.1	4.5	2,295
日本光電工業	26.6	42.9	121,235
チノー	4.4	3.5	3,517
共和電業	15.4	12.6	4,573
日本電子材料	5.6	4.4	1,689
堀場製作所	23.1	19	69,445
アドバンテラスト	85.1	70	71,750
小野測器	6.2	5.1	3,605
エスベック	13.9	10.6	14,235

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
パナソニック デバイスSUNX	10.9	8.8	4,787
キーエンス	28.3	23.3	1,364,914
日置電機	6.5	5.4	12,090
シスメックス	96.6	79.7	530,802
日本マイクロニクス	—	13.5	12,946
メガチップス	13	10.8	11,480
OBARA GROUP	8.1	6.6	27,390
澤藤電機	9	7	1,253
コーセル	18.1	14.3	14,271
新日本無線	9	7.7	2,872
オブテックス	8.5	7.6	21,052
千代田インテグレ	5.5	5.4	13,705
レーザーテック	12.8	12.1	17,169
スタンレー電気	89.6	73.7	186,755
岩崎電気	43	37	6,438
ウシオ電機	75.7	62.3	98,309
岡谷電機産業	6.8	5.8	2,146
ヘリオス テクノ ホールディング	12.3	8.8	3,361
日本セラミック	7	5.8	10,556
遠藤照明	5.7	5.3	5,443
日本デジタル研究所	10.4	8.6	13,493
古河電池	9	8	4,992
双信電機	6.2	5.9	1,528
山一電機	14.6	9.1	5,205
図研	9.3	7.6	8,838
日本電子	53	40	20,960
カシオ計算機	125.1	102.9	216,295
ファナック	129.9	105	1,789,200
日本シイエムケイ	32.3	22.7	8,853
エンプラス	5.7	5.2	19,838
大真空	23	21	4,263
ローム	61.5	50.6	237,061
浜松ホトニクス	51.9	80.1	224,680
三井ハイテック	16.5	14.9	7,867
新光電気工業	47.2	38.8	25,142
京セラ	204.8	168.5	830,199
太陽誘電	65.4	49.9	55,438
村田製作所	130.9	107.7	1,446,949
ユーシン	17.5	13.7	9,028

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
双葉電子工業	21.3		17.5	26,320
北陸電気工業	54		43	5,332
ニチコン	39.3		32.3	23,675
日本ケミコン	102		84	11,928
KOA	17.3		14.2	12,268
市光工業	31		26	4,784
小糸製作所	74.8		61.5	303,195
ミツバ	22.9		17.4	26,047
スター精密	23.8		19.5	24,823
SCREENホールディングス	118		105	85,260
キャノン電子	11.5		9.5	15,608
キャノン	723.5		552.7	1,829,989
リコー	375.2		332.4	376,941
MUTOHホールディングス	18		13	3,029
東京エレクトロン	105		92.1	649,581
輸送用機器 (9.9%)				
トヨタ紡織	43.6		35.9	63,291
鬼怒川ゴム工業	29		23	12,052
ユニプレス	23.9		21.2	37,799
豊田自動織機	113.6		93.5	446,930
モリタホールディングス	21.8		17.8	22,143
三櫻工業	16		12.9	7,275
デンソー	308.3		253.6	1,065,120
東海理化電機製作所	32.9		30	70,710
三井造船	483		397	58,359
川崎重工業	907		799	242,097
名村造船所	34.9		30.8	20,790
サノヤスホールディングス	15.9		13.6	2,774
日本車輛製造	46		43	10,449
ニチユ三菱フォークリフト	14.1		11.5	4,956
近畿車輛	20		17	5,066
日産自動車	1,751.7		1,441.1	1,411,125
いすゞ自動車	394.5		297.5	338,406
トヨタ自動車	1,721.7		1,276.9	7,635,862
日野自動車	178.1		146.5	173,163
三菱自動車工業	457.4		407.6	329,748
エフテック	7.4		5.5	5,824
レシップホールディングス	4		3.4	2,590
GMB	1.8		1.9	1,569

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
ファルテック	1.4		1.8	2,383
武蔵精密工業	13.3		10.8	22,734
日産車体	54.8		50.1	56,763
新明和工業	50		44	33,748
極東開発工業	23.1		20.3	20,949
日信工業	22.8		22.8	32,877
トビー工業	103		85	18,190
ティラド	49		41	6,888
曙ブレーキ工業	53.7		53.7	12,888
タチエス	19.8		16.2	24,219
NOK	60.4		49.7	91,945
フタバ産業	38.5		31.7	14,677
KYB	140		114	33,516
シロキ工業	28		25	8,275
大同メタル工業	17.5		14.4	11,217
プレス工業	62		54.2	21,192
ミクニ	—		10.2	3,468
カルソニックカンセイ	95		78	63,492
太平洋工業	25.4		22.7	22,722
ケーヒン	28.7		23.5	37,247
河西工業	15.3		12.6	15,561
アイシン精機	114.2		103.3	462,784
富士機工	15		12	4,920
マツダ	371.9		325.1	524,873
ダイハツ工業	149		122.5	194,285
今仙電機製作所	10.7		9.5	9,652
本田技研工業	1,123		923.9	2,702,407
スズキ	260.9		214.6	602,918
富士重工業	424.7		324.4	1,198,009
安永	4.3		4	2,008
ヤマハ発動機	189.8		145	258,535
ショーワ	29.4		26.5	24,539
TBK	16.2		12.9	4,760
エクセディ	16.9		13.8	31,353
豊田合成	40.3		37.3	83,365
愛三工業	19.5		17.9	15,877
盟和産業	11		1.5	1,300
ヨロズ	11.6		9.5	20,634
エフ・シー・シー	18.3		16.7	31,062

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
シマノ	53.9	41.4	764,658
タカタ	22.9	18.9	9,582
テイ・エス テック	26.3	23.8	60,761
ジャムコ	—	4.5	11,200
精密機器 (1.6%)			
テルモ	191.3	157.4	611,499
クリエートメディック	3.9	3.5	2,814
日機装	40.6	38.5	32,109
島津製作所	149	132	235,884
JMS	23	19	5,510
モリテックス	3.8	3.4	982
長野計器	8	6.7	4,006
ブイ・テクノロジー	2.6	2.5	9,187
東京計器	44	33	5,082
愛知時計電機	16	14	4,186
オーバル	10.3	11.2	2,408
東京精密	22.4	19.7	42,177
マニー	3.4	9.3	15,456
ニコン	233	191.7	324,356
トプコン	37.7	34.8	41,238
オリンパス	185.9	152.9	626,890
理研計器	11	8.3	8,665
タムロン	9.5	8.2	14,087
HOYA	297	238.9	991,435
ノーリツ銅機	11.4	9.4	3,929
ユー・アンド・デイ	11.6	9.4	3,553
シチズンホールディングス	153.6	126.4	79,126
リズム時計工業	55	45	6,390
大研医器	8.7	8.1	7,290
メニコン	—	5.1	15,606
松風	6.1	5.1	6,681
セイコーホールディングス	88	66	26,268
ニプロ	79.7	76.5	82,237
その他製品 (1.6%)			
スノーピーク	—	0.9	3,109
パラマウントベッドホールディングス	13	10.8	40,446
トランザクション	—	1.6	945
SHO-BI	4.8	3.8	1,501
ニホンフラッシュ	—	3	2,940

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
前田工織	12.4	11.3	11,096
永大産業	18	15	5,865
アートネイチャー	9	8.1	7,776
ダンロップスポーツ	7.8	6.8	6,351
バンダイナムコホールディングス	137.6	106.2	249,039
アイフィスジャパン	—	2.4	984
共立印刷	22.2	16.9	4,765
SHOEI	—	4.9	8,918
フランスペッドホールディングス	85	14.3	13,785
パイロットコーポレーション	10.9	17.9	70,973
萩原工業	2.7	2.2	4,347
トッパン・フォームズ	22.1	18.3	24,247
フジシールインターナショナル	15.1	12.4	45,260
タカラトミー	45.1	34	28,662
廣済堂	12	10	3,080
As-me エステール	3.5	3.1	1,838
アーク	41.6	45.5	3,776
タカノ	5.5	4.6	2,755
プロネクス	12.6	9.7	10,786
ホクシン	12.3	10.8	1,166
ウッドワン	22	21	5,082
大建工業	51	40	9,560
凸版印刷	352	290	281,880
大日本印刷	380	304	300,960
図書印刷	21	19	8,759
共同印刷	38	35	11,830
日本写真印刷	21	17.2	29,859
光村印刷	11	12	2,460
宝印刷	6.7	5.1	6,420
アシックス	124	95.6	194,259
ツツミ	6.2	5.1	12,489
小松ウオール工業	3.8	3.5	5,834
ヤマハ	91.7	75.5	240,090
河合楽器製作所	4.4	3.9	7,398
クリナップ	11.4	12.1	8,748
ビジョン	23.6	58.2	153,473
兼松日産農林	18	12	1,560
キングジム	10.7	8.8	6,476
リンテック	29.7	24.4	51,850

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
TASAKI	2.4	2.1	2,746	
イトーキ	26.3	21.6	15,055	
任天堂	76.9	63.2	1,042,484	
三菱鉛筆	10.2	7.6	33,136	
タカラスタンダード	51	42	40,656	
コクヨ	64.9	53.4	59,113	
ナカバヤシ	27	21	5,460	
グローブライド	62	5	7,115	
岡村製作所	47.5	35.7	35,450	
美津濃	66	55	27,665	
アデランス	14.7	17.7	10,000	
電気・ガス業 (2.2%)				
東京電力	1,058.6	870.9	487,704	
中部電力	381.8	314.1	448,691	
関西電力	509.2	418.9	517,760	
中国電力	172.5	141.9	215,404	
北陸電力	122.3	100.6	164,984	
東北電力	311.8	256.5	373,977	
四国電力	112.4	92.4	150,150	
九州電力	275.6	226.7	246,196	
北海道電力	116.8	96.1	92,928	
沖縄電力	8.2	10.9	30,312	
電源開発	83.9	87.5	301,875	
イーレックス	—	2.1	3,494	
東京瓦斯	1,517	1,146	619,871	
大阪瓦斯	1,292	1,063	469,420	
東邦瓦斯	317	259	205,905	
北海道瓦斯	24	24	6,576	
広島ガス	—	18.1	7,330	
西部瓦斯	140	114	28,956	
静岡ガス	35.3	28.8	20,851	
メタウォーター	5.8	6.6	15,734	
陸運業 (5.0%)				
SBSホールディングス	9.3	10.4	6,718	
東武鉄道	667	549	329,400	
相鉄ホールディングス	214	176	123,376	
東京急行電鉄	678	598	570,492	
京浜急行電鉄	342	281	285,215	
小田急電鉄	400	329	450,401	

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
京王電鉄	349	287	309,099	
京成電鉄	187	154	254,562	
富士急行	34	27	33,291	
新京成電鉄	17	13	5,447	
東日本旅客鉄道	228.7	187.7	1,868,178	
西日本旅客鉄道	120.1	98.8	673,223	
東海旅客鉄道	111.8	91.9	1,907,384	
西武ホールディングス	99.4	81.8	192,639	
鴻池運輸	7.6	14.5	18,473	
西日本鉄道	161	133	111,454	
ハマキョウレックス	3.9	7.8	14,258	
サカイ引越センター	2.1	4	10,692	
近鉄グループホールディングス	1,256	1,033	506,170	
阪急阪神ホールディングス	838	689	497,458	
南海電気鉄道	280	230	154,560	
京阪電気鉄道	280	230	181,470	
神戸電鉄	32	25	8,875	
名糖運輸	5.3	—	—	
名古屋鉄道	452	374	207,196	
山陽電気鉄道	46	37	16,835	
日本通運	494	397	204,852	
ヤマトホールディングス	219.4	189.7	448,925	
山九	152	135	71,280	
丸運	7.3	5.6	1,366	
丸全昭和運輸	42	34	13,566	
センコー	50	46	32,706	
トナミホールディングス	26	22	5,676	
ニッコンホールディングス	40.8	33.6	65,822	
日本石油輸送	15	12	2,880	
福山通運	75	62	33,108	
セイノーホールディングス	97	72.8	87,214	
神奈川中央交通	15	12	8,220	
日立物流	25.8	21.2	36,697	
丸和運輸機関	—	2.4	5,205	
C&F ロジホールディングス	—	9.8	8,310	
海運業 (0.2%)				
日本郵船	1,054	922	196,386	
商船三井	654	500	104,500	
川崎汽船	546	449	84,861	

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
NSユニテッド海運	54	47	7,144	
明治海運	11.7	9.5	3,239	
飯野海運	64.6	53.5	23,005	
共栄タンカー	11	11	1,518	
第一中央汽船	124	—	—	
乾汽船	—	8.2	6,297	
空運業 (0.7%)				
日本航空	238.9	196.6	824,147	
ANAホールディングス	2,453	1,906	621,165	
パスコ	12	10	4,110	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
トランコム	3.6	2.9	18,386	
日新	48	42	11,550	
三菱倉庫	82	73	108,989	
三井倉庫ホールディングス	73	60	16,380	
住友倉庫	91	75	41,250	
滋澤倉庫	33	28	7,728	
東陽倉庫	22	18	4,158	
乾汽船	8.6	—	—	
日本トランスシティ	28	24	8,472	
ケイヒン	24	21	3,045	
中央倉庫	7.1	5.9	5,380	
安田倉庫	9.6	8	5,576	
東洋埠頭	40	32	4,608	
宇徳	10.3	8.8	2,754	
上組	149	122	128,100	
サンリツ	3.7	2.4	1,164	
キムラユニティー	2.8	2.7	2,932	
キューソー流通システム	3.4	2.8	5,807	
郵船ロジスティクス	11.3	9.3	11,197	
近鉄エクスプレス	11.1	18.3	27,340	
東海運	7.3	5.5	1,490	
エーアイティー	5.7	4.6	4,664	
内外トランスライン	—	2.5	2,242	
情報・通信業 (8.3%)				
NECネットエスアイ	15.4	12.7	22,047	
システナ	11.6	9.9	14,998	
デジタルアーツ	6.6	4.9	9,486	
新日鉄住金ソリューションズ	10.3	16.8	33,079	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
キューブシステム	5.4	4.1	2,054	
コア	5.2	4.4	5,790	
ソフトクリエイトホールディングス	3.9	3.5	2,702	
ITホールディングス	40.8	33.6	84,369	
ネオス	3.7	3.6	1,548	
電算システム	4.3	3.6	5,500	
グリー	74.5	61.5	33,271	
コーエーテクモホールディングス	27.5	24	40,296	
三菱総合研究所	4.7	3.9	13,572	
ボルテージ	2.4	2.2	2,978	
電算	1.3	1.1	2,634	
AGS	2.1	1.5	1,222	
ファインデックス	1.8	6.8	6,895	
ヒト・コミュニケーションズ	1.8	2.3	3,983	
ブレインパッド	1.9	1.8	1,186	
KL a b	13.1	15.8	7,805	
ポルトウウィン・ビットクルーホールディ	8.4	6.7	6,499	
イーブックイニシアティブジャパン	2.9	2.3	1,156	
ネクソン	117	96.9	160,950	
アイスタイル	5.3	15.5	12,059	
エムアップ	3.5	2.9	1,380	
エイチーム	1.5	3.7	5,294	
テクノスジャパン	—	1.2	3,120	
e n i s h	3.3	3.3	1,613	
コロブラ	21.6	28	55,412	
モバイルクリエイト	7.4	6.8	2,713	
オルトプラス	2.5	4.1	1,693	
ブロードリーフ	10.2	10.5	13,440	
ハーツユニテッドグループ	3.7	3.1	5,936	
ブイキューブ	—	5	6,435	
サイバーリンクス	—	1.3	986	
VOYAGE GROUP	—	2.4	2,582	
オプティム	—	0.7	2,947	
ベリサーブ	1.6	1.3	2,878	
ティーガイア	12.2	10.2	12,280	
日本アジアグループ	—	8.9	4,521	
豆蔵ホールディングス	9.8	8	5,160	
テクマトリックス	5.6	4.4	6,538	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	—	177	50,268	

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
GMOペイメントゲートウェイ	10.7	8.8	53,768
ザッパラス	7.5	6.4	2,508
インターネットイニシアティブ	19.9	16.4	35,555
さくらインターネット	—	4.9	8,741
GMOクラウド	2.2	2.4	1,641
ビットアイル	14.2	—	—
SRAホールディングス	6.5	5.8	13,084
Minorisソリューションズ	—	1.4	1,202
システムインテグレータ	2	1.6	1,155
パイブドビッツ	1.2	—	—
朝日ネット	12.5	8.4	4,057
コムチュア	2.1	1.7	3,343
gumi	9.3	10.9	6,976
パイブドHD	—	1.4	1,506
パナソニック インフォメーションシステム	2.9	—	—
フェイス	3.9	2.8	3,340
ハイマックス	—	1.3	1,423
野村総合研究所	69.7	71	272,995
サイバネットシステム	10.5	8.4	7,660
CEホールディングス	1.6	1.8	1,693
インテージホールディングス	7	5.4	7,700
東邦システムサイエンス	3.8	3	1,740
ソースネクスト	6.2	5.4	2,440
ティー・ワイ・オー	13.8	15.3	2,448
クレスコ	2.7	2.2	3,865
フジ・メディア・ホールディングス	128.3	105.5	138,627
オービック	42.5	34.9	194,393
ジャストシステム	17	18.4	15,658
TDCソフトウェアエンジニアリング	2.7	2.2	2,294
ヤフー	882.7	726.2	314,444
トレンドマイクロ	65.2	49.2	189,912
インフォメーション・ディベロップメント	2.4	1.8	1,584
日本オラクル	19.7	16.2	87,156
アルファシステムズ	4	3.3	5,718
フューチャーアーキテクト	12.7	12	9,624
CAC Holdings	8.2	7.4	5,350
ソフトバンク・テクノロジー	3.4	2.8	3,640
トーセ	2.9	2.9	2,018
オービックビジネスコンサルタント	7.7	5.1	23,001

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
伊藤森テクノソリューションズ	13.8	22.9	52,120
アイティフォー	14.9	13.2	6,006
東計電算	2.1	1.8	3,463
エックスネット	1.1	0.9	1,334
大塚商会	33.1	27.3	149,331
サイボウズ	16.9	14.1	4,272
ソフトブレーン	17.9	16.1	2,366
電通国際情報サービス	7.5	6.2	13,038
EMシステムズ	1.4	1.8	4,622
ウェザーニューズ	3.6	3.4	12,053
C I J	11.3	9	3,933
東洋ビジネスエンジニアリング	1.3	1.1	1,444
日本エンタープライズ	8.6	10.5	2,404
WOWOW	2.9	4.8	12,307
フュージョンパートナー	5.3	6	3,114
日本コロムビア	5.1	4	2,036
イマジカ・ロボット ホールディングス	6.3	8.9	3,462
ネットワンシステムズ	50.4	44.2	25,989
アルゴグラフィックス	5.2	4.7	7,924
マーベラス	20.8	17.1	14,039
エイベックス・グループ・ホールディングス	24.5	18.7	24,347
日本ユニシス	34	27.7	38,641
兼松エレクトロニクス	7.7	6.3	11,554
東京放送ホールディングス	73.8	60.7	106,953
日本テレビホールディングス	112.4	92.5	182,780
朝日放送	12.2	10.4	7,113
テレビ朝日ホールディングス	33.3	27.7	56,064
スカパーJ SATホールディングス	93.5	76.5	52,249
テレビ東京ホールディングス	10	9.1	16,807
日本BS放送	—	1.5	1,549
U-NEXT	—	2.6	2,433
コネクシオ	8.5	8.8	9,477
日本通信	—	55.2	9,439
クロップス	1.8	2.1	1,094
日本電信電話	482	783.2	3,768,758
KDDI	417.1	1,029.3	3,101,280
光通信	11.1	12.2	94,916
NTTドコモ	1,014.8	781.5	2,064,723
エムティーアイ	—	13	9,555

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
GMOインターネット	41	37.6	45,796
カドカワ	30.2	31.6	57,259
学研ホールディングス	41	34	8,058
ゼンリン	16.3	13.4	24,816
昭文社	7.3	5.7	3,568
インプレスホールディングス	11.6	10	1,250
アイネット	6.5	5.7	6,213
松竹	81	67	68,340
東宝	87.9	72.3	203,596
東映	46	37	32,523
AOI Pro.	5.6	5.1	5,120
エス・ティ・ティ・データ	76.1	62.6	351,812
ピー・シー・エー	1.6	1.2	1,741
ビジネスブレイン太田昭和	—	1.4	1,289
DTS	12.7	11.2	23,396
スクウェア・エニックス・ホールディングス	44.8	42.9	125,268
シーイーシー	8	6.6	7,213
カブコン	31.5	25.9	62,263
アイ・エス・ピー	—	1.5	1,105
ジャステック	7.2	6.4	5,849
SCSK	29.3	24.1	105,558
日本システムウェア	4.8	4	3,488
アイネス	16.9	14.5	15,790
TKC	10.3	9.4	29,563
富士ソフト	16.9	15	35,025
NSD	25.9	21.3	35,315
コナミホールディングス	50	45.7	129,970
福井コンピュータホールディングス	3.3	2.3	2,318
JBCホールディングス	10.3	8.5	5,406
ミロク情報サービス	8	7.5	6,877
ソフトバンクグループ	651.3	574.1	2,925,039
卸売業 (4.3%)			
ハウスイ	13	10	1,090
高千穂交易	4.9	3.7	3,222
伊藤忠食品	2.9	2.5	10,462
エレマテック	5.6	4.7	10,100
JALUX	3.6	3.3	6,755
あらた	28	4.5	9,765
トーマンデバイス	1.7	1.4	2,412

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京エレクトロン デバイス	2.4	3.5	5,260
フィールズ	—	6.6	11,437
双日	824.4	638.3	143,617
アルフレッサ ホールディングス	145.7	127.4	254,163
横浜冷凍	30.1	24.9	25,422
山下医科器械	1	0.8	1,274
ラサ商事	6.9	4.8	2,880
アルコニクス	7.1	5.8	8,305
神戸物産	4.1	6.5	15,431
あい ホールディングス	19.8	18	50,274
ディーブイエックス	3.6	2.7	2,802
ダイワボウホールディングス	115	92	18,400
マクニカ・富士エレホールディングス	—	18	23,868
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23.2	17.4	16,651
八洲電機	9.5	8.2	4,255
UKCホールディングス	7.9	6.5	13,422
OCHIホールディングス	3.2	3.1	3,121
TOKAIホールディングス	60	44.3	25,118
三洋貿易	7.3	5.4	6,966
ウイン・パートナーズ	4	3.8	5,506
ミタチ産業	2.9	2.2	1,350
シップヘルスケアホールディングス	22.5	20.6	57,494
明治電機工業	3.6	2.9	2,975
デリカフーズ	2.3	2.4	2,287
スターティア	1.1	2	1,046
富士興産	4.9	4	1,736
協栄産業	16	16	2,000
小野建	10.6	8.6	8,264
佐島電機	9.7	8.1	5,580
エコートレーディング	3.6	2.5	1,512
伯東	8.1	7.6	7,075
コンドーターック	8.9	7.8	5,967
中山福	6.9	6.2	4,631
ナガイレーベン	17.9	14.7	29,297
三菱食品	13.4	11.1	32,944
松田産業	9	7.3	8,906
第一興商	—	17.9	83,235
メディバルホールディングス	123.2	101.3	176,160
アドヴァン	6.2	10.3	10,794

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
S P K		2.5	2.2	4,191
萩原電気		3.4	2.6	4,802
アズワン		8.7	7.9	31,007
スズデン		3.8	3.4	3,559
尾家産業		4	3.3	2,791
シモジマ		7.6	6.9	7,458
ドウシシャ		15.9	11.9	25,489
小津産業		2.5	2.1	4,531
高速		7.4	6	5,136
たけびし		4.4	3.4	3,270
黒田電気		20.6	18.7	30,350
丸文		10.7	8.8	6,204
ハピネット		7.6	9.2	8,565
橋本総業		2.3	2.2	3,333
エクセル		5.7	5	6,470
マルカキカイ		4	3.3	4,573
ガリバーインターナショナル		37.3	27.3	30,466
日本エム・ディ・エム		10.6	8.6	4,867
進和		7.2	6	8,448
エスケイジャパン		4.8	3.1	1,398
ダイトエレクトロン		5.7	4.9	3,518
シークス		7.8	6.4	18,131
田中商事		4.1	3.3	2,046
オーハシテクニカ		7.5	5.6	7,044
マクニカ		6.2	—	—
白銅		3.7	2.8	2,833
伊藤忠商事	1,030.9		795.1	1,096,045
丸紅	1,077.5		997.2	582,763
高島	24		20	3,300
長瀬産業	75.1		60.9	71,253
蝶理	7.9		6.4	9,139
豊田通商	137.2		112.9	263,057
三共生興	21.3		15.6	6,068
兼松	247		215	32,465
ツカモトコーポレーション	27		25	2,625
三井物産	1,044.2		916.3	1,203,101
日本紙バルブ商事	63		51	16,116
日立ハイテクノロジーズ	42.7		35.1	106,353
カメイ	16		13.2	12,975

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
東都水産		23	17	2,941
OUGホールディングス		19	15	3,225
スターゼン		48	3.7	11,636
山善		47.2	38.8	35,191
椿本興業		14	11	3,146
住友商事	726.9		637.9	724,973
内田洋行		31	25	9,750
三菱商事	943.9		760.3	1,423,281
第一実業		30	22	10,032
キャノンマーケティングジャパン		35.1	28.9	56,239
西華産業		40	33	7,161
佐藤商事		10.5	9	5,598
菱洋エレクトロ		14.2	11.6	12,702
東京産業		12.5	10.3	4,047
ユアサ商事		10.7	9.5	23,199
神鋼商事		32	23	4,554
小林産業		9.7	6.5	1,254
阪和興業		123	101	43,935
カナデン		12	9.7	7,866
菱電商事		19	16	9,984
フルサト工業		6.8	5.5	8,596
岩谷産業		136	120	73,080
すてきなイスグループ		54	45	5,940
昭光通商		46	42	3,150
ニチモウ		22	17	2,975
極東貿易		16	16	3,568
イワキ		19	17	3,145
三菱石油		31	26	22,594
稲畑産業		29.6	24.2	28,894
G S I クレオス		39	30	3,570
明和産業		10.1	9.2	3,440
ワキタ		26.2	21.5	17,737
東邦ホールディングス		42.5	32.4	75,394
サンゲツ		22.1	36.6	71,370
ミツウロコグループホールディングス		19.5	16.2	9,023
シナネンホールディングス		26	22	9,680
伊藤忠エネクス		27.2	26	21,242
サンリオ		34.5	31.2	65,520
サンワテクノス		7.8	6.4	4,326

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
リョーサン	20.5	16	45,136	
新光商事	14.1	11.7	12,051	
トーホー	28	4.6	10,175	
三信電気	16.9	14	11,718	
東陽テクニカ	18	14.9	16,181	
モスフードサービス	16.1	13.2	40,986	
加賀電子	11	9.2	11,877	
ソーダニッカ	12	10.4	4,680	
立花エレテック	7.6	7.4	8,073	
フォーバル	2.5	4.3	2,605	
PAL TAC	19.7	16.1	27,997	
三谷産業	—	11.2	3,472	
太平洋興発	54	49	3,626	
ヤマタネ	63	49	7,840	
丸紅建材リース	11	10	1,830	
日鉄住金物産	80	65	21,840	
トラスコ中山	15.3	11.5	44,965	
オートバックスセブン	45.3	38.8	75,466	
加藤産業	17.7	15.7	42,735	
イノテック	11.6	9.5	4,180	
イエローハット	11.6	9.5	18,050	
富士エレクトロニクス	6.2	—	—	
JKホールディングス	12.4	10.2	4,651	
日伝	4.9	4.1	11,549	
北沢産業	10.9	10.4	1,684	
杉本商事	6.8	5.9	7,434	
因幡電機産業	18.2	14.1	48,574	
バイテックホールディングス	4.2	3.2	3,040	
ミスミグループ本社	46	113.7	175,666	
江守グループホールディングス	5.5	—	—	
アルテック	11.2	10.6	1,505	
タキヒヨー	22	17	7,820	
蔵王産業	—	1.7	2,126	
スズケン	51	46.1	171,261	
ジェコス	8.5	7	6,265	
ルネサスイーストン	5.5	6.6	2,706	
小売業 (4.8%)				
ローソン	46.6	38.4	352,128	
サンエー	9.2	6.8	32,674	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ダイユーエイト	2.6	2.8	1,974	
カワチ薬品	9.7	7.9	15,294	
エービーシー・マート	17.5	12.9	87,204	
ハードオフコーポレーション	5.9	4.9	7,991	
アスクル	12.9	12.3	42,004	
ゲオホールディングス	23.2	19.2	32,313	
アダストリア	10.4	9.3	55,056	
ジーフット	—	6.2	5,270	
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	18	20	1,660	
くらコーポレーション	7.2	5.9	30,680	
キャンドウ	6	5.4	7,884	
パル	7.1	5.9	15,050	
エディオン	56.4	42.8	36,636	
サーラコーポレーション	10.9	8.9	5,188	
ワッツ	5	4.1	3,202	
ハローズ	—	3	7,971	
あみやき亭	2.1	1.9	8,217	
ひらまつ	17.1	14	9,142	
ゲンキー	1.2	2	5,604	
サッポロドラッグストア	1.1	1.1	2,233	
大黒天物産	2.9	2.4	11,304	
ハニーズ	10.9	8.9	10,786	
ファーマライズホールディングス	—	2.5	1,232	
アルペン	10.9	9	15,993	
クオール	12.5	10.3	14,656	
ジェイアイエヌ	8.4	6.8	32,266	
ビックカメラ	53.4	52.4	46,583	
DCMホールディングス	59.2	49.7	41,748	
Monotaro	24	35.7	86,108	
東京一番フーズ	—	2	1,032	
ダイヤモンドダイニング	—	1.8	2,016	
きちり	2.6	2.9	1,885	
アークランドサービス	1.4	3.1	8,856	
J. フロント リテイリング	155.8	128.2	171,403	
ドトール・日レスホールディングス	21.5	17.6	31,644	
マツモトキヨシホールディングス	27.5	20.9	108,262	
ブロンコビリー	2.2	3.9	10,377	
スタートトゥデイ	38.3	30.8	104,412	
トレジャー・ファクトリー	1.2	2.9	3,471	

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
物語コーポレーション	3.5	2.6	13,572
ココカラファイン	12.8	10.5	46,042
三越伊勢丹ホールディングス	244.8	201.5	264,972
ウエルシアホールディングス	11.1	8.8	49,368
クリエイトSDホールディングス	6	14.9	36,028
丸善CHIホールディングス	14.3	11.7	3,872
ミサワ	—	1.4	694
エー・ピーカンパニー	1.8	1.7	1,949
チムニー	2.2	2.4	6,516
シュッピン	—	2.9	2,931
ネクステージ	1.2	1.9	1,039
ジョイフル本田	6.6	16.4	36,244
キリン堂ホールディングス	4.3	3.5	3,524
ホットランド	—	2.8	2,912
すかいらく	45	30.9	46,350
綿半ホールディングス	—	3	3,975
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	—	33.3	31,501
ブックオフコーポレーション	7	5.9	5,339
ゴルフダイジェスト・オンライン	—	2.3	1,591
あさひ	8.2	7.5	9,757
日本調剤	1.6	2.5	9,012
コスモス薬品	6.2	5.1	84,966
トーエル	6.7	4.9	3,430
一六堂	3.5	2.6	863
セブン&アイ・ホールディングス	515.2	423.9	1,931,288
葉王堂	1.8	1.5	3,873
クリエイト・レストランツ・ホールディング	8.5	9	26,505
ツルハホールディングス	26.3	23.3	221,816
サンマルクホールディングス	4.4	7.9	22,878
フェリシモ	3.3	3.1	3,047
トリドール	13.3	12.4	27,924
クスリのアオキ	4.9	9	44,010
メディカルシステムネットワーク	11.6	11.8	5,015
総合メディカル	2.9	4.9	16,880
はるやま商事	5.1	4.1	3,091
カップバ・クリエイト	19.1	14.1	15,876
ライトオン	9.4	7.6	11,080
ジーンズメイト	5.3	4.8	801
良品計画	15.2	11.6	276,660

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三城ホールディングス	15.2	11.4	5,073
アルビス	—	2.6	4,947
コナカ	14.7	11.9	6,342
ハウス オブ ローゼ	1.5	1.3	1,898
G-7ホールディングス	2.5	3.1	3,475
イオン北海道	7.7	6.7	3,470
コジマ	18.8	15.6	3,556
ヒマラヤ	2.8	3.2	3,219
コーナン商事	18.9	14.3	22,122
エコス	4.5	3.9	4,602
ワタミ	14.8	12.1	13,019
マルシェ	3.5	2.5	2,090
ドンキホーテホールディングス	39.6	65.5	242,677
西松屋チェーン	24.4	19.9	19,342
ゼンショーホールディングス	63.3	52.1	72,575
幸楽苑ホールディングス	7.8	6.4	10,003
ハークスレイ	3.4	3	3,153
サイゼリヤ	18.2	16.7	38,393
V Tホールディングス	—	34.4	19,573
魚力	—	3.2	3,872
ポプラ	4.1	4	2,012
ユナイテッドアローズ	16.1	14.5	73,660
ハイデイ日高	7.8	7.5	26,212
京都市もの友禅	7.5	7.2	6,062
コロワイド	40.8	33.6	58,128
ピーシーデポコーポレーション	—	8.4	8,635
老番屋	5.5	4.5	26,640
トップカルチャー	5.5	4	1,828
PLANT	3.3	2.4	2,791
スギホールディングス	22.1	18.2	98,826
スクロール	17.1	15.8	6,383
ヨンドシーホールディングス	9.5	7.7	18,764
ファミリーマート	41.6	31.1	172,916
木曽路	15	12.3	27,416
サトレストランシステムズ	11.6	11.7	9,126
千趣会	21.9	19.8	13,959
タカキュー	10.1	9.1	1,638
ケーヨー	23	16.8	8,450
上新電機	27	24	20,472

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本瓦斯	19.8	11.7	24,336
ベスト電器	43.5	34.8	4,176
マルエツ	30	—	—
ロイヤルホールディングス	20.5	16.8	33,885
東天紅	10	9	1,170
いなげや	13.7	11.3	13,899
島忠	29.9	26.2	64,687
チョダ	14.4	11.9	33,510
ライフコーポレーション	7.7	6.4	14,950
カスミ	25.1	—	—
リンガーハット	12	9.1	21,940
さが美	14	12	1,104
MrMax	13.1	9.7	2,764
テンアライド	10.7	10.1	3,666
AOKIホールディングス	28.3	22.9	28,350
オークワ	19	16	16,080
コメリ	21	15.6	33,898
青山商事	30.9	19.4	80,995
しまむら	14.3	11.8	142,308
CFSコーポレーション	8.2	—	—
はせがわ	4.5	3.9	1,583
高島屋	179	147	135,240
松屋	24.8	20.6	17,510
エイチ・ツー・オー リテイリング	58.2	51.9	96,015
近鉄百貨店	47	39	11,934
丸栄	23	25	2,150
ニッセンホールディングス	26.6	16.4	2,394
パルコ	11.9	9.8	8,486
丸井グループ	148.2	124.4	186,600
アクシアル リテイリング	9.5	7.8	26,286
イオン	507.9	416.9	594,290
ユニグループ・ホールディングス	117.9	97	72,653
イズミ	27.5	20.1	86,932
東武ストア	17	13	3,861
平和堂	25	20.5	42,947
フジ	13.8	11.3	23,232
ヤオコー	6.9	11.5	47,437
ゼビオホールディングス	16.7	13.7	24,029
ケーズホールディングス	28.4	21.4	74,472

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
Olympicグループ	7.5	6.5	3,685
日産東京販売ホールディングス	21.1	17.1	4,839
アインホールディングス	14.8	12.2	60,329
元気寿司	3.8	2.9	6,214
ヤマダ電機	486.8	308.1	159,595
アークランドサカモト	8.8	17	17,595
ニトリホールディングス	53.2	43.8	368,796
グルメ杵屋	9	8	7,968
愛眼	11.2	9.7	2,027
ケーユーホールディングス	5.7	5.2	3,614
吉野家ホールディングス	34.7	37.3	53,301
松屋フーズ	5.9	4.8	13,497
サガミチェーン	15	13.4	16,294
関西スーパーマーケット	9.5	8	6,184
王将フードサービス	9	7.3	28,543
プレナス	13.6	11.3	22,068
ミニストップ	9	7.5	15,292
アークス	21.2	18.8	43,221
パローホールディングス	26.5	21.8	52,690
藤久	0.9	0.7	1,199
ベルク	5.5	4.9	18,693
大庄	6.6	4.8	6,873
ファーストリテイリング	24.7	20.3	644,728
サンドラッグ	26	21.4	161,784
サックスパー ホールディングス	9.3	9.5	14,231
ヤマザワ	2.5	2.1	3,494
やまや	2.1	2.1	3,927
ベルーナ	30.2	25.3	12,751
銀行業 (7.2%)			
島根銀行	2.8	2.2	2,543
じもとホールディングス	88.4	71.6	10,382
足利ホールディングス	76.2	74.4	23,510
東京TYフィナンシャルグループ	15.8	13.9	36,098
九州フィナンシャルグループ	—	155.1	102,210
ゆうちょ銀行	—	194.7	231,887
新生銀行	1,172	877	123,657
あおぞら銀行	831	641	228,837
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,882.3	8,130	3,880,449
りそなホールディングス	1,440.9	1,185.4	461,831

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井住友トラスト・ホールディングス	2,723	2,115	686,317
三井住友フィナンシャルグループ	931.5	811.4	2,455,296
第四銀行	156	128	47,104
北越銀行	131	110	20,020
西日本シティ銀行	432	330	66,000
千葉銀行	475	391	210,358
横浜銀行	851	680	342,856
常陽銀行	445	366	140,910
群馬銀行	292	225	109,575
武蔵野銀行	19.6	16.2	46,882
千葉興業銀行	25.8	28.1	12,560
筑波銀行	51.1	41.8	11,662
七十七銀行	208	159	63,918
青森銀行	96	74	21,830
秋田銀行	82	67	17,956
山形銀行	74	57	21,489
岩手銀行	8.6	7.1	26,305
東邦銀行	109	90	29,070
東北銀行	67	52	7,280
みちのく銀行	60	48	7,968
ふくおかフィナンシャルグループ	500	439	154,528
静岡銀行	361	297	244,134
十六銀行	154	126	45,486
スルガ銀行	130	96.2	175,084
八十二銀行	223	183	92,232
山梨中央銀行	79	63	24,696
大垣共立銀行	153	135	46,305
福井銀行	105	87	16,182
北國銀行	136	113	31,301
清水銀行	4.3	3.5	7,378
富山銀行	—	2	5,406
滋賀銀行	123	94	42,112
南都銀行	118	98	29,498
百五銀行	118	91	35,763
京都銀行	235	193	140,311
紀陽銀行	48.4	39.8	47,123
三重銀行	56	46	8,786
ほくほくフィナンシャルグループ	838	689	115,063
広島銀行	363	299	122,590

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
山陰合同銀行	75	61.5	40,098
中国銀行	88.6	71.8	84,436
鳥取銀行	40	34	5,406
伊予銀行	131.7	108.4	83,684
百十四銀行	135	111	35,076
四国銀行	94	79	16,353
阿波銀行	101	82	41,164
鹿児島銀行	86	—	—
大分銀行	76	58	19,662
宮崎銀行	82	67	17,420
肥後銀行	101	—	—
佐賀銀行	75	61	12,200
十八銀行	76	63	14,490
沖縄銀行	9.8	8.1	27,985
琉球銀行	25.4	20.8	23,566
セブン銀行	415.3	379.7	183,395
みずほフィナンシャルグループ	17,054.3	14,274.5	2,373,849
高知銀行	49	42	4,578
山口フィナンシャルグループ	123	95	99,750
長野銀行	40	33	5,808
名古屋銀行	111	86	30,616
北洋銀行	185.6	152.7	42,145
愛知銀行	4.5	3.4	14,875
第三銀行	71	57	7,980
中京銀行	50	42	8,064
東日本銀行	54	48	13,008
大光銀行	46	37	7,030
愛媛銀行	72	58	12,064
トマト銀行	49	39	5,694
みなと銀行	110	92	13,984
京葉銀行	101	84	35,280
関西アーバン銀行	16.3	13.6	14,212
栃木銀行	62	54	22,572
北日本銀行	3.9	3.2	8,348
東和銀行	173	144	11,664
福島銀行	157	125	8,875
大東銀行	81	61	10,797
トモニホールディングス	94	78.6	26,016
フィデアホールディングス	71	63	10,836

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
池田泉州ホールディングス	99.3	106.1	41,060
証券、商品先物取引業 (1.1%)			
F P G	10.6	30.2	28,901
S B I ホールディングス	147.9	121.7	123,647
日本アジア投資	94	—	—
ジャフコ	16.8	16.9	53,657
大和証券グループ本社	1,152	948	636,866
野村ホールディングス	2,518	1,949.7	963,346
岡三証券グループ	105	86	45,752
丸三証券	39	30.1	36,089
東洋証券	50	39	11,271
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	141.3	116.3	60,824
光世証券	30	27	3,726
水戸証券	38.1	31.8	10,271
いちよし証券	25.8	22.6	24,362
松井証券	62.6	50.6	48,727
だいこう証券ビジネス	6	5.1	3,927
マネックスグループ	146	119.1	33,705
カブドットコム証券	54.3	89.8	29,634
極東証券	16.6	13.6	18,047
岩井コスモホールディングス	12.7	9.9	10,444
藍澤證券	—	14.3	8,065
マネースクウェアHD	3.8	3.5	3,482
マネーパートナーズグループ	13.5	10.3	3,172
保険業 (2.4%)			
かんぽ生命保険	—	30.9	73,449
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	273.6	225.1	692,182
アニコム ホールディングス	5.2	6.9	17,201
MS&ADインシュアランスグループホール	392.6	302.8	899,921
ソニーフィナンシャルホールディングス	118	97.1	150,699
第一生命保険	789.1	649.2	847,855
東京海上ホールディングス	506.9	410.5	1,556,205
T&Dホールディングス	448.9	369.3	412,323
その他金融業 (1.3%)			
全国保証	32	26.3	87,053
クレディセゾン	100.6	76.8	142,387
芙蓉総合リース	12.9	11.6	53,418
興銀リース	23.1	19.1	36,003
東京センチュリーリース	28.9	23.8	89,012

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本証券金融	58.9	45.6	21,842
アイフル	206.1	169.6	49,862
ポケットカード	9.5	10.6	4,664
リコーリース	9.7	8.1	25,677
イオンフィナンシャルサービス	80.8	66.5	166,250
アコム	247.4	203.5	95,238
ジャックス	68	57	21,375
オリエントコーポレーション	286.1	438.1	83,677
日立キャピタル	24.1	23.9	56,666
アプラスフィナンシャル	59.8	51.6	4,489
オリックス	871.9	717.5	1,025,666
三菱UFJリース	312.4	257	123,617
日本取引所グループ	180.8	297.5	514,377
イー・ギランティ	3.7	3.4	7,347
アサックス	2.2	2.2	2,904
NECキャピタルソリューション	5.2	4.4	6,806
不動産業 (2.9%)			
いちごグループホールディングス	—	84.4	30,468
日本駐車場開発	134.7	111.5	13,268
ヒューリック	207.9	211.2	208,876
東京建物不動産販売	7.3	—	—
三栄建築設計	4.8	4.2	5,040
野村不動産ホールディングス	74	67.2	132,988
三重交通グループホールディングス	—	17.9	7,893
サムティ	—	5.7	5,865
ディア・ライフ	—	5.6	1,702
ユー・ディー・ワークス	—	77.5	3,410
日本商業開発	3.8	3.3	5,765
プレサンスコーポレーション	4.1	3.4	12,053
ユニゾホールディングス	5.1	6.3	24,696
日本管理センター	6	6.7	11,651
サンセイランディック	1.7	2.7	2,289
エストラスト	1.7	2.2	1,357
フージャースホールディングス	19.1	14.6	6,234
オープンハウス	7.8	14.7	30,958
東急不動産ホールディングス	322.8	245.1	173,285
飯田グループホールディングス	79.9	93.9	192,682
パーク 2 4	61.9	51.1	150,387
バラカ	4.7	3.6	4,791

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
三井不動産	653	537	1,424,124	
三菱地所	916	753	1,614,808	
平和不動産	23.4	19.5	23,088	
東京建物	268	110.7	146,898	
ダイビル	32.1	26.4	24,578	
京阪神ビルディング	20.9	17.4	9,935	
住友不動産	295	243	749,655	
大京	199	191	34,762	
テーオーシー	42.8	39.6	35,679	
東京楽天地	21	17	8,041	
レオパレス21	134.7	119.4	79,759	
スターツコーポレーション	14.1	11.7	26,991	
フジ住宅	16.1	13.3	9,017	
空港施設	15.6	12.9	6,437	
住友不動産販売	8.9	7.3	15,585	
ゴールドクレスト	11.3	8.2	13,251	
日本エスリード	5	4.1	4,251	
日神不動産	16.4	13.9	4,990	
タカラレーベン	54.8	45.4	27,013	
サンヨーハウジング名古屋	7	5.9	5,988	
イオンモール	79.5	65.4	103,920	
ファースト住建	4.6	3.9	5,011	
トーセイ	17.3	15.8	10,270	
穴吹興産	12	12	2,952	
エヌ・ティ・ティ都市開発	76.5	62.9	68,938	
サンフロンティア不動産	13.5	12.3	12,361	
エフ・ジェー・ネクスト	9.5	8.9	4,423	
グランディハウス	11.6	9	3,276	
日本空港ビルデング	42.6	32.3	129,523	
サービス業 (3.8%)				
日本工営	43	36	12,960	
ネクスト	15.4	30.4	31,312	
ジェイエイシーリクルートメント	—	4.9	5,262	
日本M&Aセンター	20.1	16.6	84,826	
ノバレーゼ	3.6	2.6	2,147	
アコーディア・ゴルフ	49.1	30	32,940	
中広	—	1	670	
タケエイ	12.9	9.3	6,761	
トラスト・テック	2.2	2.2	5,253	

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
パソナグループ	9.8	9.4	5,940	
CDS	3	2.5	2,122	
リンクアンドモチベーション	17.2	21.9	2,562	
GCAサヴィアン	10.3	9.8	8,594	
エス・エム・エス	14.6	13.4	24,146	
テンプホールディングス	25.6	75.2	109,641	
リニカル	3.4	6.4	9,932	
クックパッド	8.3	23.9	48,182	
エスクリ	4.7	4.5	2,565	
アイ・ケイ・ケイ	3.5	5.8	3,706	
学情	4.9	4.1	4,177	
スタジオアリス	6	4.7	10,490	
シミックホールディングス	4.9	4.9	7,634	
NJS	—	2.4	2,769	
総合警備保障	43.5	35.8	207,282	
カカコム	86.7	77.8	153,888	
アイロムグループ	3.3	—	—	
ルネサンス	6.8	5.5	6,627	
ディップ	2.9	11.9	25,930	
オプトホールディング	6.1	6.8	3,991	
新日本科学	12.6	—	—	
ツクイ	15.6	12.7	16,979	
総合臨床ホールディングス	6.1	—	—	
キャリアデザインセンター	3.9	3	2,487	
エムスリー	112.8	92.9	250,737	
ツカダ・グローバルホールディング	9.6	7.7	5,182	
アウトソーシング	5	5	14,525	
ウエルネット	3.5	4.1	12,894	
ディー・エヌ・エー	64.3	48.1	83,934	
博報堂DYホールディングス	180.7	148.6	187,384	
ぐるなび	15.1	12.4	31,186	
エスアールジータカミヤ	10.5	9.1	2,893	
一休	10.2	—	—	
ジャパンバネストレスキューシステム	12	13	3,094	
ファンコミュニケーションズ	22.6	24.7	16,104	
ジェイコムホールディングス	2.8	2.3	4,639	
PGMホールディングス	18.5	—	—	
WDBホールディングス	4.7	3.9	3,400	
ティア	3.8	4.7	2,937	

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
バリュートマース	11.3	10	3,420
インフォマート	—	15.5	14,849
J Pホールディングス	33	27	6,966
E P Sホールディングス	16.4	12	16,284
レグス	—	1.9	1,200
プレステージ・インターナショナル	9.8	9	10,863
アミューズ	4	2.9	11,919
ドリームインキュベータ	4.3	3.7	8,014
クイック	4.4	5.6	3,981
T A C	8.1	7.6	1,360
ケネディクス	185.3	144	66,816
電通	145.3	119.5	662,030
テイクアンドギヴ・ニーズ	5.4	5.1	2,351
びあ	3.8	2.9	6,272
イオンファンタジー	4.3	3.9	8,291
シーティーエス	—	2.5	1,805
ネクシィーズ	4.9	4.1	2,849
みらかホールディングス	34.3	27.4	130,424
アルプス技研	5.2	4	8,764
サニックス	15.6	—	—
ダイオーズ	2.5	2	2,010
日本空調サービス	6.3	5.2	5,777
オリエンタルランド	35.2	115.9	928,359
ダスキン	36.9	30.4	65,664
明光ネットワークジャパン	13	12.2	13,810
ファルコホールディングス	6.2	4.8	6,081
秀英予備校	4.2	2.5	1,310
田谷	2.6	2.6	1,786
ラウンドワン	37.6	33.8	23,355
リゾートトラスト	48.1	45	113,085
ビー・エム・エル	7.6	6.3	25,798
ワタベウエディング	5.1	3.8	1,675
りらいあコミュニケーションズ	24.3	17.8	17,479
リゾー教育	—	20.4	6,283
早稲田アカデミー	2.3	1.2	1,080
ユー・エス・エス	157.8	129.8	223,126
東京個別指導学院	6.7	5.4	3,769
サイバーエージェント	23.9	26.2	134,406
楽天	566.3	501.6	501,399

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
テー・オー・ダブリュー	4	6.8	3,957
セントラルスポーツ	4.5	3.6	8,179
フルキャストホールディングス	13.7	10.1	6,736
リゾートソリューション	14	12	3,720
テクノプロ・ホールディングス	13.9	17.4	53,418
インターワークス	—	1.6	1,033
リブセンス	7.8	7.6	2,956
ジャパンマテリアル	5.2	4.4	9,750
ベクトル	2.1	3.3	8,540
ウチヤマホールディングス	5.9	5.6	2,749
サクセスホールディングス	1.2	1.1	1,185
キャリアリンク	—	1.6	2,444
I B J	—	6.6	2,673
アサンテ	3.1	4	5,984
N・フィールド	—	3.9	4,282
M&Aキャピタルパートナーズ	0.2	1.1	1,745
ライドオン・エクスプレス	—	1.8	3,153
ER Iホールディングス	3.4	2.9	2,349
アビスト	—	1.3	2,575
ウィルグループ	1.2	2.5	2,240
日本ビューホテル	—	1.3	1,952
リクルートホールディングス	147.9	216.3	731,094
エラン	—	1.1	1,107
日本郵政	—	236.5	328,971
ベルシステム24ホールディングス	—	15.8	15,136
リロ・ホールディング	4.4	4	51,400
東洋	2.8	3.2	12,624
エイチ・アイ・エス	21.2	17.5	57,050
ラックランド	—	1.7	2,400
共立メンテナンス	6.5	8.1	68,850
イチネンホールディングス	13.6	11.3	10,226
建設技術研究所	7.7	6.3	5,758
スペース	6.9	5.8	7,186
燦ホールディングス	2.7	2.1	2,881
スバル興業	10	8	3,048
東京テアトル	54	44	5,148
ナガワ	—	2	5,460
よみうりランド	27	21	8,799
東京都競馬	90	73	15,476

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
常磐興産	49	40	5,960	
カナモト	18.2	14.9	36,937	
東京ドーム	90	85	44,285	
西尾レントオール	10.5	8.6	22,342	
トランス・コスモス	16.9	12.4	29,995	
乃村工藝社	25.6	23.1	33,102	
藤田観光	48	39	21,528	
KNT-CTホールディングス	63	52	8,840	
日本管財	6.3	9.2	16,155	
トーカイ	5.7	4.7	14,429	
白洋舎	15	12	3,084	
セコム	126.6	111.5	905,380	
セントラル警備保障	5.7	4.7	9,935	
丹青社	15.2	20.2	13,534	
メイテック	17.6	13.3	52,934	

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
アサツー ディ・ケイ	24.5	18.8	53,749	
応用地質	13.6	11.3	13,831	
船井総研ホールディングス	13.8	15	20,985	
進学会	5.6	5	3,110	
オオバ	—	6	2,244	
学究社	—	1.6	2,046	
ベネッセホールディングス	47.6	35.9	126,906	
イオンディライト	12.4	10.3	37,440	
ナック	8.9	6.7	5,587	
ニチイ学館	25.6	18.8	14,833	
ダイセキ	20.9	20.1	35,315	
ステップ	4.4	3.6	3,567	
合 計	株 数 ・ 金 額	207,046	170,037	197,392,717
	銘柄数 < 比率 >	1,827	1,905	< 99.0% >

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	
		百万円	百万円
		1,972	—

○有価証券の貸付及び借入の状況

2016年2月22日現在における貸付株数の総株数は24,418,300株です。

うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUFJ証券株式会社に対する貸付は、17,244,600株です。

○投資信託財産の構成

(2016年2月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	197,392,717	86.3
コール・ローン等、その他	31,244,240	13.7
投資信託財産総額	228,636,957	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年2月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	228,636,668,502
コール・ローン等	30,638,245,080
株式(評価額)	197,392,717,480
未収配当金	266,376,813
未収利息	53
その他未収収益	42,899,076
差入委託証拠金	296,430,000
(B) 負債	29,277,148,836
未払金	156,484,784
未払解約金	168,940,011
未払利息	522,077
受入担保金	28,951,201,964
(C) 純資産総額(A-B)	199,359,519,666
元本	196,312,695,095
次期繰越損益金	3,046,824,571
(D) 受益権総口数	196,312,695,095口
1口当たり基準価額(C/D)	10,155円

<注記事項>

- ①期首元本額 240,254,912,958円
 期中追加設定元本額 38,117,449,694円
 期中一部解約元本額 82,059,667,557円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0155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 トピックスインデックスオープン	15,195,569,292円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	1,089,092,666円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	3,938,080,266円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	3,752,462,434円
三菱UFJ トピックスオープン(確定拠出年金)	5,052,520,179円
三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	7,911,190,817円
三菱UFJ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	37,806,277,742円
三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	35,335,066,662円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	314,855,534円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	630,178,746円
F Pバランスファンド(安定型)	57,961,441円
F Pバランスファンド(安定成長型)	88,678,014円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	846,368,364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)	84,282,665,330円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)VA(適格機関投資家限定)	394,339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)	11,333,269円
合計	196,312,695,095円

【お知らせ】

2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。(2015年7月1日)

○損益の状況 (2015年2月21日～2016年2月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,798,033,960
受取配当金	4,422,869,654
受取利息	22,811,982
その他収益金	363,173,408
支払利息	△ 10,821,084
(B) 有価証券売買損益	△26,848,492,578
売買益	14,407,278,415
売買損	△41,255,770,993
(C) 先物取引等取引損益	31,763,800
取引益	947,098,808
取引損	△ 915,335,008
(D) 当期損益金(A+B+C)	△22,018,694,818
(E) 前期繰越損益金	35,916,971,931
(F) 追加信託差損益金	6,800,354,901
(G) 解約差損益金	△17,651,807,443
(H) 計(D+E+F+G)	3,046,824,571
次期繰越損益金(H)	3,046,824,571

(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 外国株式マザーファンド

《第16期》決算日2016年5月20日

[計算期間：2015年5月21日～2016年5月20日]

「三菱UFJ 外国株式マザーファンド」は、5月20日に第16期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とし、ベンチマーク（MSCIコクサイインデックス（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。
主要運用対象	日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）並びに外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

○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 (除く日本 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
	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
12期(2012年5月21日)	8,087	△13.1	262,612.35	△13.3	94.9	2.9	2.0	169,037
13期(2013年5月20日)	13,762	70.2	445,900.88	69.8	95.9	1.3	2.3	235,276
14期(2014年5月20日)	15,742	14.4	508,902.69	14.1	96.3	1.5	2.1	182,512
15期(2015年5月20日)	20,323	29.1	655,211.07	28.7	96.7	0.9	2.2	160,903
16期(2016年5月20日)	17,145	△15.6	550,658.40	△16.0	95.4	1.8	2.7	114,202

(注) MSCIコクサイインデックスは、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（除く日本 円換算ベース）は、MSCIコクサイインデックス（除く日本 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 (除く日本 円換算ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2015年5月20日	円	%		%	%	%	%
	20,323	—	655,211.07	—	96.7	0.9	2.2
5月末	20,685	1.8	665,986.38	1.6	95.7	1.4	2.2
6月末	19,863	△ 2.3	639,675.25	△ 2.4	95.5	2.3	2.2
7月末	20,426	0.5	657,639.37	0.4	95.9	1.0	2.2
8月末	18,804	△ 7.5	605,323.67	△ 7.6	95.9	3.5	2.4
9月末	17,517	△13.8	563,736.55	△14.0	96.2	1.8	2.5
10月末	19,431	△ 4.4	625,024.47	△ 4.6	94.7	1.2	2.4
11月末	19,643	△ 3.3	632,617.45	△ 3.4	95.4	2.1	2.4
12月末	19,181	△ 5.6	616,951.51	△ 5.8	94.7	3.5	2.5
2016年1月末	17,485	△14.0	562,468.06	△14.2	97.2	2.2	2.6
2月末	16,761	△17.5	539,065.32	△17.7	95.3	2.9	2.6
3月末	17,733	△12.7	570,645.55	△12.9	94.4	2.3	2.6
4月末	17,652	△13.1	567,147.39	△13.4	95.2	2.3	2.6
(期 末) 2016年5月20日	17,145	△15.6	550,658.40	△16.0	95.4	1.8	2.7

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

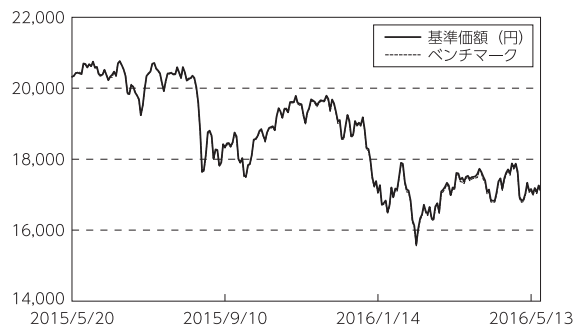
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ15.6%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(－16.0%)を0.4%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国株式市況

- ・米国の利上げを巡る警戒感に加え、原油価格の下落や中国経済の減速懸念などから、外国株式市況は下落しました。

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて9.0%の円高・米ドル安、8.4%の円高・ユーロ安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ベンチマークであるMSCIコクサイインデックス（除く日本円換算ベース）に採用されている株式（先物・REIT（不動産投資信託証券）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16.0%の下落となったため、カイ離は0.4%程度となりました。

	組入比率 要因	銘柄選択 要因	その他の 要因	合計
ベンチマークとのカイ離	△0.0%程度	△0.1%程度	0.5%程度	0.4%程度

（注）四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率による影響は△0.0%程度でした。

- ・期中、ファンドの資産をほぼ全額株式（先物・REITを含む）に投資しました。
- ・効率的に運用を行うため、円貨、外貨現金などを若干保有しました。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.1%程度でした。

ファンドとベンチマークの値動きや、推定トラッキングエラー、株式の国別比率、業種別比率などについてモニターし、必要に応じて定量モデルを用いた調整を図ることでベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。その際に、ファンドがベンチマークと連動する可能性をより高めるため、

- ・売買に係るコストを考慮しつつ、できる限り多くの銘柄に分散投資を行いました。
- ・ファンドの特性をよりベンチマークに近づけるべく、マルチファクターモデルを用いて組入銘柄とその組入比率を決定しています。

◎その他の要因

その他の要因による影響は0.5%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入・為替効果等	計 0.6%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料等	計 △0.1%程度

為替効果：現地通貨建て株価を円建てに換算する方法が、ファンドとベンチマークで異なるため生じる差異。

ファンド：株価（現地通貨建て前日終値）を翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。

ベンチマーク：株価（現地通貨建て前日終値）を同日ロンドン時間の16時時点の為替レートをを用い一旦ドル換算で評価。その後翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。

◎今後の運用方針

- ・ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を株式（先物・REITを含む）に投資し、高い株式組入比率を維持します。
- ・売買に係るコストを考慮しつつ、多くの銘柄に分散投資を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年5月21日～2016年5月20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)	(0.005)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.008	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(1)	(0.008)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	15	0.078	(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)	(14)	(0.076)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	17	0.092	
期中の平均基準価額は、18,765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

(2015年5月21日～2016年5月20日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 13,775 (2,907)	千アメリカドル 72,653 (460)	百株 33,343 (955)	千アメリカドル 185,461 (11,268)
	カナダ	2,144 (46)	千カナダドル 6,301 (—)	4,229 (81)	千カナダドル 13,742 (596)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	929 (257)	3,644 (△ 173)	2,299	9,520
	イタリア	5,831 (△ 133)	1,168 (△ 6)	6,769	2,520
	フランス	1,070 (0.69)	3,962 (△ 64)	3,589	10,309
	オランダ	735 (308)	1,421 (398)	1,836	3,580
	スペイン	2,208 (25,139)	1,472 (207)	29,651	3,746
	ベルギー	77 (21)	552 (—)	222	1,505
	オーストリア	19 (—)	48 (△ 4)	480	317
	ルクセンブルク	324 (337)	186 (△ 297)	546	282
	フィンランド	973	818	661	918
	アイルランド	1,251	559	2,697	387
	ポルトガル	4,430	101	3,514	166
	イギリス	15,856 (112,079)	千イギリスポンド 8,286 (△ 103)	29,112 (179,557)	千イギリスポンド 16,301 (591)
	スイス	695 (618)	千スイスフラン 4,617 (△ 388)	2,263 (—)	千スイスフラン 10,728 (0.0179)
	スウェーデン	747 (269)	千スウェーデンクローネ 9,279 (—)	2,724	千スウェーデンクローネ 29,643
	ノルウェー	240	千ノルウェークローネ 3,663	780	千ノルウェークローネ 7,123
	デンマーク	265	千デンマーククローネ 9,259	490	千デンマーククローネ 15,762

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	オーストラリア	百株 4,332 (1,724)	千オーストラリアドル 4,904 (200)	百株 7,684	千オーストラリアドル 9,577
	ニュージーランド	263	千ニュージーランドドル 105	516	千ニュージーランドドル 204
	香港	3,373 (2,069)	千香港ドル 8,413 (-)	7,525 (880)	千香港ドル 26,839 (-)
	シンガポール	1,152 (4)	千シンガポールドル 600 (-)	3,884	千シンガポールドル 1,898
	イスラエル	202	千イスラエルシケル 1,582	471	千イスラエルシケル 2,693

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
HCP INC	1	53	3	141
MACERICH CO/THE	0.608	46	1	136
PROLOGIS INC	2	95	4	193
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.259	18	0.739	56
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.891	65	1	100
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.25	53	0.55	122
EXTRA SPACE STORAGE INC	5	357	0.915	71
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.205	29	0.549	78
WELLTOWER INC	1	65	2	191
BOSTON PROPERTIES INC	0.447	52	1	172
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2	251	0.111	11
REALTY INCOME CORP	1	75	1	86
REGENCY CENTERS CORP	0.565	36	1	68
SL GREEN REALTY CORP	0.27	26	0.778	87
UDR INC	0.97	32	2	84
VENTAS INC	0.795	45	2	141
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	3	34	9	91
RAYONIER INC	—	—	5	138
WEYERHAEUSER CO	1 (10)	44 (275)	5	175
AMERICAN TOWER CORP	1	107	3	344
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	1	26	3	71
VEREIT INC	2	17	7	64
DUKE REALTY CORP	1	28	3	66
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7	192	1	38
IRON MOUNTAIN INC	1	62	1	51
EQUINIX INC	0.492 (0.06)	147 (17)	0.457	133
COMMUNICATIONS SALES & LE	—	—	4	93
CROWN CASTLE INTL CORP	0.783 (13)	64 (1,096)	2	172
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	— (3)	— (—)	3	95
EQUITY RESIDENTIAL	1	124	3	230
GENERAL GROWTH PROPERTIES	2	74	4	117
HOST HOTELS & RESORTS INC	3	50	7	141
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.576	17	1	55
PLUM CREEK TIMBER CO	0.613 (△ 6)	23 (△ 275)	1	57
PUBLIC STORAGE	0.409	91	1	286
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.68	124	2	493
VORNADO REALTY TRUST	0.635	56	1	159
KIMCO REALTY CORP	1	29	3	96

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.485	82	1	194
小 計	54 (20)	2,709 (1,114)	107	5,117
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	2	73	—	—
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	1	18	2	49
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	—	—	0.8	21
小 計	3	92	3	71
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
GECINA SA	0.291	34	0.228	26
KLEPIERRE	2	112	2	87
UNIBAIL-RODAMCO SE	0.315	72	0.879	212
FONCIERE DES REGIONS	0.072 (—)	5 (△ 1)	0.292	24
ICADE	0.247	15	0.651	43
小 計	3 (—)	240 (△ 1)	4	394
ユ ー ロ 計	3 (—)	240 (△ 1)	4	394
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	5	40	10	81
HAMMERSON PLC	4	29	10	62
LAND SECURITIES GROUP PLC	2	23	6	84
INTU PROPERTIES PLC	6	19	9	31
SEGRO PLC	3	14	7	32
小 計	21	126	43	292
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	8	25	19	57
SCENTRE GROUP	16	67	47	196
FEDERATION CENTRES	— (72)	— (221)	—	—
NOVION PROPERTY GROUP	— (△ 88)	— (△ 221)	—	—
GPT GROUP	10	45	14	68
MIRVAC GROUP	16	29	37	71
STOCKLAND	11	47	24	103
WESTFIELD CORP	6	60	17	170
DEXUS PROPERTY GROUP	5	37	9	71
GOODMAN GROUP	7	45	17	111
小 計	82 (△ 15)	359 (—)	189	850
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	6	256	21	961
小 計	6	256	21	961

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
	SUNTEC REIT	11 (-)	16 (△0.85185)	21 (-)	35 (0.00001)
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	-	-	7	10
	CAPITALAND MALL TRUST	12	23	27	56
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	14 (-)	32 (△0.11507)	24	59
小計		37 (-)	72 (△0.96692)	80 (-)	162 (0.00001)

(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 42,583	百万円 41,448	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

(2015年5月21日～2016年5月20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	48,776,644千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	129,910,903千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.37

(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

(2015年5月21日～2016年5月20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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 17,338	百万円 13,044	% 75.2	百万円 41,757	百万円 33,499	% 80.2

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

(2016年5月20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	
ALCOA INC	484	464	423	46,649	素材
AMERICAN EXPRESS CO	385	296	1,858	204,572	各種金融
AVON PRODUCTS INC	182	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
ABBOTT LABORATORIES	623	527	1,965	216,364	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	137	117	521	57,464	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	23	19	311	34,314	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	199	163	1,387	152,790	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	30	26	122	13,519	小売
AES CORP	284	241	259	28,583	公益事業
AFLAC INC	186	150	1,034	113,856	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	579	437	2,466	271,553	保険
APACHE CORP	155	133	760	83,749	エネルギー
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	26	21	443	48,807	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	259	220	2,563	282,248	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	88	72	1,025	112,911	素材
ANTHEM INC	111	92	1,235	136,036	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	209	179	884	97,399	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	547	475	1,054	116,081	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	224	192	832	91,689	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	280	225	2,885	317,638	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	86	74	1,223	134,657	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	122	110	347	38,213	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	687	598	4,207	463,218	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	54	43	1,523	167,769	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,718	1,440	7,148	787,017	電気通信サービス
CR BARD INC	31	26	570	62,853	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	53	46	331	36,466	素材
BAKER HUGHES INC	179	156	709	78,118	エネルギー
ALLSTATE CORP	173	136	915	100,758	保険
VERY DENNISON CORP	37	32	239	26,312	素材
CHUBB LTD	137	163	2,035	224,052	保険
ANALOG DEVICES INC	130	110	613	67,513	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	13	10	817	89,948	小売
CVS HEALTH CORP	475	391	3,955	435,430	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ENTERPRISES	94	76	387	42,684	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	530	419	793	87,388	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	1,548	1,303	8,260	909,375	銀行
CIGNA CORP	108	91	1,175	129,451	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	237	206	1,431	157,556	資本財
COCA-COLA CO/THE	1,632	1,481	6,563	722,622	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	229	188	1,328	146,216	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	85	65	418	46,022	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	412	345	882	97,114	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	80	71	245	27,053	メディア
CHEVRON CORP	782	666	6,653	732,506	エネルギー
COACH INC	113	97	371	40,849	耐久消費財・アパレル

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	
ROCKWELL COLLINS INC	49	47	415	45,759	資本財
COMPUTER SCIENCES CORP	58	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CONOCOPHILLIPS	510	437	1,895	208,621	エネルギー
CME GROUP INC	132	113	1,087	119,679	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	137	116	899	99,051	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	377	301	2,125	233,958	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION RESOURCES INC/VA	242	212	1,503	165,466	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE	488	397	2,019	222,380	素材
DEVON ENERGY CORP	161	162	551	60,724	エネルギー
DEERE & CO	140	110	906	99,848	資本財
DANAHER CORP	261	218	2,137	235,318	資本財
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	375	310	1,997	219,931	素材
WALT DISNEY CO/THE	667	555	5,468	602,075	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC	54	41	271	29,912	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	293	244	1,883	207,341	公益事業
DR HORTON INC	136	118	346	38,132	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC	39	31	129	14,251	小売
TARGET CORP	250	206	1,387	152,783	小売
DUN & BRADSTREET CORP	15	12	150	16,532	商業・専門サービス
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	27	—	—	—	エネルギー
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I	71	59	459	50,617	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	68	55	355	39,164	資本財
DTE ENERGY COMPANY	73	64	569	62,685	公益事業
EXXON MOBIL CORP	1,754	1,473	13,280	1,462,040	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	44	76	746	82,189	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	227	194	1,557	171,515	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	286	234	1,174	129,287	資本財
EXELON CORP	356	326	1,116	122,951	公益事業
ECOLAB INC	111	94	1,092	120,246	素材
EQUIFAX INC	49	41	512	56,448	商業・専門サービス
ENSCO PLC-CL A	95	—	—	—	エネルギー
EMC CORP/MA	842	686	1,898	209,021	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	95	78	715	78,821	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	196	163	974	107,288	資本財
EDISON INTERNATIONAL	128	116	809	89,147	公益事業
ENTERGY CORP	75	64	476	52,494	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	18	14	267	29,488	保険
EDGEMOUNT PERSONAL CARE CO	25	21	162	17,836	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC	181	163	1,938	213,460	公益事業
MACY'S INC	142	111	343	37,770	小売
FEDEX CORP	111	95	1,511	166,405	運輸
FMC TECHNOLOGIES INC	97	80	219	24,199	エネルギー
FAMILY DOLLAR STORES	42	—	—	—	小売
FORD MOTOR CO	1,486	1,311	1,717	189,026	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	166	137	485	53,395	各種金融
FOOT LOCKER INC	59	48	284	31,345	小売
FIRSTENERGY CORP	176	150	485	53,499	公益事業
FLUOR CORP	64	50	247	27,284	資本財
FREEMPORT-MCMORAN INC	429	407	447	49,300	素材
GENERAL MILLS INC	249	211	1,330	146,496	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	116	94	1,363	150,095	資本財
WW GRAINGER INC	25	20	444	48,971	資本財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
GENERAL ELECTRIC CO	4,160	3,341	9,809	1,079,895	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	—	46	343	37,780	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	63	53	496	54,677	小売
TEGNA INC	—	74	164	18,119	メディア
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	—	94	254	28,047	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	99	85	147	16,257	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	162	135	2,103	231,552	各種金融
HALLIBURTON CO	350	306	1,230	135,438	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	308	258	2,908	320,249	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	88	68	300	33,105	自動車・自動車部品
HP INC	773	636	728	80,224	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	177	144	636	70,118	保険
HERSHEY CO/THE	62	52	475	52,377	食品・飲料・タバコ
DIRECTV	197	—	—	—	メディア
HOSPIRA INC	70	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARMAN INTERNATIONAL	—	25	180	19,844	耐久消費財・アパレル
HOME DEPOT INC	545	448	5,910	650,697	小売
HASBRO INC	47	40	339	37,392	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	110	92	590	65,042	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	389	326	4,727	520,463	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	166	139	560	61,732	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	153	115	1,189	130,934	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	174	144	341	37,558	メディア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	33	28	367	40,442	素材
JOHNSON & JOHNSON	1,159	979	11,050	1,216,574	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC	275	229	969	106,749	自動車・自動車部品
KANSAS CITY SOUTHERN	45	39	353	38,950	運輸
KELLOGG CO	110	93	703	77,422	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	154	128	1,629	179,434	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	695	562	2,433	267,914	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	193	327	1,139	125,455	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	84	69	242	26,683	小売
ELI LILLY & CO	415	352	2,622	288,716	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	40	35	451	49,754	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	71	59	249	27,427	運輸
LENNAR CORP-A	72	63	277	30,589	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	408	324	2,591	285,249	小売
LEGGETT & PLATT INC	56	47	231	25,538	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	102	86	526	58,014	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	165	140	620	68,342	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	111	97	2,339	257,602	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	107	88	392	43,219	保険
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	34	28	383	42,244	資本財
LEGG MASON INC	42	34	109	12,039	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	93	72	472	52,034	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	402	324	4,070	448,154	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	112	95	1,023	112,702	各種金融
MEDTRONIC PLC	586	500	4,001	440,553	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	1,180	988	5,395	594,009	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	444	382	385	42,455	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	138	119	361	39,835	耐久消費財・アパレル
3M CO	252	217	3,597	396,021	資本財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	93	56	386	42,532	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	161	158	340	37,488	消費者サービス
MASCO CORP	148	120	378	41,691	資本財
MONSANTO CO	200	155	1,565	172,319	素材
MEADWESTVACO CORP	69	—	—	—	素材
M & T BANK CORP	49	50	587	64,645	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	224	184	1,185	130,479	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	25	22	425	46,806	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	607	514	1,368	150,663	各種金融
MCKESSON CORP	96	81	1,473	162,223	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	399	334	1,480	163,030	保険
MANPOWERGROUP INC	32	26	201	22,150	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	77	63	587	64,683	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	128	105	891	98,130	運輸
BANK OF AMERICA CORP	4,355	3,686	5,356	589,642	銀行
NISOURCE INC	131	—	—	—	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	79	61	1,293	142,394	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	185	171	258	28,418	銀行
NEWMONT MINING CORP	208	187	639	70,354	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	562	414	1,156	127,325	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	48	41	394	43,458	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	—	4	476	52,432	保険
NUCOR CORP	131	113	530	58,378	素材
NEWELL BRANDS INC	113	161	760	83,762	耐久消費財・アパレル
NOBLE CORP PLC	102	—	—	—	エネルギー
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	181	155	439	48,361	メディア
NOBLE ENERGY INC	159	152	531	58,501	エネルギー
PALL CORP	44	—	—	—	資本財
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	322	270	2,024	222,860	エネルギー
OMNICARE INC	41	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
OMNICOM GROUP	102	85	705	77,615	メディア
PEPSICO INC	619	515	5,225	575,307	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	—	34	220	24,314	素材
ALTRIA GROUP INC	818	694	4,397	484,169	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	47	40	292	32,177	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,119	962	7,720	849,900	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	217	179	1,579	173,864	銀行
PFIZER INC	2,609	2,184	7,292	802,856	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	188	158	1,235	135,995	保険
PULTEGROUP INC	138	110	195	21,557	耐久消費財・アパレル
PEPCO HOLDINGS LLC	105	—	—	—	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	61	48	524	57,695	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	61	57	929	102,273	エネルギー
CITIGROUP INC	1,254	1,054	4,752	523,244	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	122	104	443	48,821	保険
PPG INDUSTRIES INC	56	95	1,006	110,763	素材
PENTAIR PLC	78	63	368	40,579	資本財
PRAXAIR INC	120	100	1,109	122,158	素材
P G & E CORP	197	175	1,006	110,855	公益事業
PPL CORP	276	240	909	100,158	公益事業
PROGRESSIVE CORP	232	205	670	73,823	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	210	180	808	88,953	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	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	73	60	442	48,685	消費者サービス
SPX CORP	14	—	—	—	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	68	61	474	52,234	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	127	106	1,375	151,474	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	118	85	405	44,641	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	566	459	434	47,883	銀行
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	18	15	172	19,030	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	41	35	641	70,601	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	171	149	328	36,116	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	57	46	182	20,051	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	56	46	514	56,622	資本財
SCHLUMBERGER LTD	533	493	3,658	402,723	エネルギー
STRYKER CORP	140	119	1,309	144,211	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	486	419	1,214	133,687	各種金融
SEMPRA ENERGY	97	84	867	95,469	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	33	27	807	88,849	素材
ST JUDE MEDICAL INC	118	99	757	83,376	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	61	53	599	65,999	資本財
SUNTRUST BANKS INC	214	179	765	84,226	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	137	107	1,183	130,336	保険
SOUTHERN CO/THE	374	323	1,573	173,274	公益事業
AT&T INC	2,148	2,177	8,368	921,322	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	91	98	376	41,443	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	172	142	866	95,363	各種金融
SYSCO CORP	242	199	979	107,788	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	83	70	329	36,325	素材
SCANA CORP	56	48	333	36,735	公益事業
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	65	—	—	—	エネルギー
TEXAS INSTRUMENTS INC	438	359	2,057	226,501	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	53	45	289	31,871	小売
TORCHMARK CORP	52	43	258	28,403	保険
TYCO INTERNATIONAL PLC	172	149	602	66,338	商業・専門サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	165	141	2,095	230,730	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	113	98	368	40,519	資本財
UNION PACIFIC CORP	368	302	2,462	271,141	運輸
UNUM GROUP	104	86	304	33,475	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	358	298	2,937	323,386	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	397	337	4,384	482,733	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	740	618	2,569	282,890	銀行
MARATHON OIL CORP	279	292	372	41,044	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	291	246	2,499	275,151	運輸
VALERO ENERGY CORP	215	170	944	103,963	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	41	34	286	31,535	ヘルスケア機器・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	198	153	799	88,008	メディア
VF CORP	142	120	725	79,906	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	55	47	536	59,104	素材
TOWERS WATSON & CO-CL A	29	—	—	—	商業・専門サービス
WILLIAMS COS INC	294	252	543	59,809	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	361	308	2,348	258,578	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	95	112	658	72,450	公益事業
WAL-MART STORES INC	667	567	3,924	432,037	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO	2,041	1,717	8,309	914,820	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
WASTE MANAGEMENT INC	179	157	959	105,647	商業・専門サービス
WATERS CORP	34	28	386	42,495	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	319	292	149	16,505	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	32	27	466	51,389	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	447	325	294	32,450	ソフトウェア・サービス
XL GROUP PLC	125	104	356	39,296	保険
XCEL ENERGY INC	212	181	736	81,073	公益事業
KEYCORP	356	298	369	40,666	銀行
CARMAX INC	89	72	373	41,091	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	70	66	790	86,995	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	69	58	156	17,233	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	181	152	1,221	134,506	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	286	236	1,794	197,538	小売
CA INC	137	117	365	40,229	ソフトウェア・サービス
CAMERON INTERNATIONAL CORP	82	—	—	—	エネルギー
CLOROX COMPANY	53	45	591	65,065	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	64	52	364	40,100	素材
CARNIVAL CORP	159	145	722	79,538	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	118	99	724	79,728	ソフトウェア・サービス
CHUBB CORP	97	—	—	—	保険
CONAGRA FOODS INC	176	153	685	75,468	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	122	104	753	82,920	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	341	282	512	56,462	銀行
STERICYCLE INC	35	29	290	31,963	商業・専門サービス
INTEL CORP	2,003	1,671	4,951	545,090	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	2,119	1,797	4,954	545,425	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	40	31	291	32,095	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	53	44	435	47,907	電気通信サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	181	154	2,207	243,046	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	503	425	847	93,311	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	128	109	808	88,975	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	126	104	680	74,866	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	285	240	406	44,717	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	86	143	799	88,003	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	83	72	347	38,239	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	283	479	2,737	301,379	耐久消費財・アパレル
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	—	3	39	4,380	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	315	267	3,969	437,050	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	74	62	275	30,333	銀行
NORTHERN TRUST CORP	93	78	554	61,046	各種金融
MICROSOFT CORP	3,243	2,686	13,516	1,488,026	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	38	31	268	29,554	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	—	60	342	37,755	ヘルスケア機器・サービス
STAPLES INC	267	226	181	20,022	小売
STARBUCKS CORP	620	525	2,865	315,416	消費者サービス
ORACLE CORP	1,468	1,131	4,396	483,980	ソフトウェア・サービス
ALTERA CORP	126	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WHOLE FOODS MARKET INC	148	120	370	40,829	食品・生活必需品小売り
NETFLIX INC	23	143	1,287	141,706	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	41	34	891	98,095	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	206	180	683	75,263	ソフトウェア・サービス
URBAN OUTFITTERS INC	44	—	—	—	小売

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	78	67	421	46,376	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	34	29	504	55,555	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	56	47	439	48,378	小売
LAM RESEARCH CORP	65	56	413	45,492	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	33	29	256	28,248	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	890	878	5,294	582,841	メディア
XILINX INC	108	90	396	43,639	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	146	124	664	73,150	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	57	84	511	56,269	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	624	510	4,190	461,318	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	67	54	445	49,044	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	15	13	824	90,785	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	112	88	899	99,047	ソフトウェア・サービス
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	172	—	—	—	メディア
NUANCE COMMUNICATIONS INC	108	87	141	15,630	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	136	114	590	65,022	ソフトウェア・サービス
YAHOO! INC	372	317	1,175	129,442	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	34	31	143	15,848	ヘルスケア機器・サービス
SIGNATURE BANK	—	18	242	26,739	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	—	24	197	21,763	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	93	80	460	50,709	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	102	90	325	35,821	メディア
SALESFORCE.COM INC	248	223	1,811	199,380	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	58	48	181	19,990	小売
ALPHABET INC-CL A	118	103	7,377	812,211	ソフトウェア・サービス
JOY GLOBAL INC	39	—	—	—	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	16	179	19,772	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B/E AEROSPACE INC	43	36	170	18,800	資本財
GARMIN LTD	47	39	158	17,408	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE NAVIGATION LTD	106	88	208	22,952	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	688	532	2,808	309,213	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	92	84	279	30,786	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	64	55	271	29,892	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP	98	84	375	41,311	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	118	100	357	39,393	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	163	141	9,852	1,084,675	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	106	88	651	71,706	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	59	51	390	42,936	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	68	56	381	42,035	半導体・半導体製造装置
E*TRADE FINANCIAL CORP	—	104	275	30,345	各種金融
CERNER CORP	127	108	581	64,047	ヘルスケア機器・サービス
BROADCOM LTD	—	139	1,988	218,962	半導体・半導体製造装置
ALKERMES PLC	61	53	210	23,123	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	47	36	300	33,046	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	118	106	552	60,772	電気通信サービス
BROADCOM CORP-CL A	224	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WASTE CONNECTIONS INC	—	44	303	33,437	商業・専門サービス
EBAY INC	463	382	896	98,689	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	225	189	826	90,954	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	84	78	602	66,339	小売
PRICELINE GROUP INC/THE	21	17	2,203	242,533	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	478	419	5,908	650,439	各種金融

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
BB&T CORP	297	287	1,005	110,705	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	465	386	1,578	173,744	各種金融
BORGWARNER INC	94	79	257	28,400	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	114	84	169	18,663	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	42	41	523	57,639	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC	347	282	2,025	222,978	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP	90	68	517	56,926	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	28	22	199	21,963	保険
AETNA INC	145	123	1,353	148,995	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	102	87	416	45,841	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	203	175	1,117	123,018	公益事業
AON PLC	112	96	1,016	111,880	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	266	211	809	89,129	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	39	33	179	19,735	保険
HESS CORP	111	99	567	62,463	エネルギー
CROWN CASTLE INTL CORP	138	—	—	—	不動産
JUNIPER NETWORKS INC	159	124	278	30,631	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	112	95	289	31,882	各種金融
RED HAT INC	77	64	467	51,454	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	30	24	261	28,808	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	91	79	351	38,733	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	73	63	323	35,601	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	130	103	243	26,776	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	62	59	449	49,432	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	157	150	146	16,116	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	97	78	2,041	224,755	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	58	51	711	78,364	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC	196	176	1,692	186,356	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	100	87	704	77,607	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC	76	59	250	27,573	小売
CELGENE CORP	330	278	2,780	306,075	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CREE INC	50	—	—	—	半導体・半導体製造装置
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	252	215	1,334	146,862	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	304	239	1,731	190,634	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	80	65	311	34,318	運輸
FASTENAL CO	115	97	435	47,923	資本財
FISERV INC	100	80	823	90,659	ソフトウェア・サービス
FLEXTRONICS INTL LTD	238	198	242	26,710	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOSSIL GROUP INC	19	—	—	—	耐久消費財・アクセサリー
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,030	744	290	32,030	メディア
SANDISK CORP	90	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	2,429	1,973	18,593	2,046,924	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	64	54	366	40,336	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	332	281	288	31,711	銀行
SIGMA-ALDRICH	49	—	—	—	素材
NABORS INDUSTRIES LTD	106	—	—	—	エネルギー
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	82	79	1,109	122,109	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHLAND INC	27	22	253	27,875	素材
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	60	50	370	40,785	運輸
CENTURYLINK INC	235	193	520	57,343	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	59	47	141	15,594	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	172	147	605	66,672	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	
ONEOK INC	86	74	308	33,987	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC	132	303	1,509	166,169	食品・飲料・タバコ
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	201	—	—	—	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	135	107	219	24,203	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	59	50	310	34,143	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	29	26	373	41,117	小売
CONSOL ENERGY INC	95	—	—	—	エネルギー
NATIONAL OILWELL VARCO INC	177	132	411	45,265	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	69	61	957	105,371	食品・飲料・タバコ
CHESAPEAKE ENERGY CORP	223	—	—	—	エネルギー
PARTNERRE LTD	18	—	—	—	保険
COOPER COS INC/THE	19	17	275	30,355	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	63	53	371	40,935	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	128	109	605	66,687	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	44	35	195	21,535	保険
OWENS-ILLINOIS INC	67	—	—	—	素材
AGCO CORP	35	23	120	13,294	資本財
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	61	52	137	15,108	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP	58	50	743	81,866	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA INC	42	44	478	52,633	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	20	83	239	26,318	素材
HUDSON CITY BANCORP INC	201	—	—	—	銀行
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	263	210	747	82,286	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC	76	61	595	65,537	各種金融
TESORO CORP	52	42	328	36,184	エネルギー
FNF GROUP	104	89	292	32,177	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	46	41	1,094	120,452	各種金融
NASDAQ INC	48	40	257	28,301	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	69	63	237	26,160	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	148	124	477	52,582	メディア
AUTOLIV INC	37	30	371	40,916	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	122	107	297	32,700	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	12	10	493	54,274	消費者サービス
IHS INC-CLASS A	28	24	289	31,825	商業・専門サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	50	41	392	43,219	食品・飲料・タバコ
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	184	159	403	44,451	小売
ARROW ELECTRONICS INC	39	32	199	21,987	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	71	59	642	70,689	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	54	42	207	22,824	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP	130	114	203	22,405	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	23	20	370	40,781	素材
RANGE RESOURCES CORP	69	60	242	26,652	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO	159	134	161	17,810	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	36	33	382	42,109	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	25	20	184	20,279	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	46	41	298	32,893	公益事業
OCEANEERING INTL INC	43	35	112	12,381	エネルギー
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	50	41	277	30,559	消費者サービス
HANESBRANDS INC	164	137	371	40,864	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC-CLASS A	414	350	3,318	365,331	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	215	180	341	37,592	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	—	31	113	12,494	資本財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AVNET INC	57	46	181	20,032	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	132	113	290	31,973	素材
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	—	30	42	4,699	消費者サービス
SPECTRA ENERGY CORP	277	236	735	81,015	エネルギー
TRANSDIGM GROUP INC	20	19	471	51,954	資本財
WILLIS TOWERS WATSON PLC	66	46	579	63,830	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	125	105	160	17,654	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	168	136	791	87,081	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	187	151	824	90,774	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	44	39	243	26,798	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	—	19	192	21,208	資本財
PRECISION CASTPARTS CORP	58	—	—	—	資本財
VMWARE INC-CLASS A	35	28	168	18,578	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	138	99	397	43,778	保険
TIME WARNER CABLE	116	—	—	—	メディア
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	25	21	450	49,641	小売
LKQ CORP	126	106	336	37,017	小売
HORMEL FOODS CORP	60	103	366	40,352	食品・飲料・タバコ
EASTMAN CHEMICAL CO	61	52	381	42,042	素材
GAMESTOP CORP-CLASS A	47	35	102	11,271	小売
HARRIS CORP	43	43	338	37,263	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	63	52	882	97,178	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP	70	59	175	19,267	エネルギー
NRG ENERGY INC	139	110	171	18,898	公益事業
INVESCO LTD	177	149	429	47,317	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	64	56	480	52,911	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	58	49	242	26,740	各種金融
TERADATA CORP	62	45	117	12,948	ソフトウェア・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	68	59	317	34,944	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	49	45	534	58,795	エネルギー
MSCI INC	—	35	263	29,010	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	38	33	135	14,965	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	63	65	637	70,148	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	643	548	5,395	594,016	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	817	688	5,295	582,972	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	81	66	613	67,570	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N.V.	18	14	171	18,838	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP	170	160	372	41,054	エネルギー
FLOWSERVE CORP	56	46	207	22,822	資本財
HELMERICH & PAYNE	44	38	219	24,210	エネルギー
MDU RESOURCES GROUP INC	78	—	—	—	公益事業
ENERGEN CORP	30	—	—	—	エネルギー
T-MOBILE US INC	100	100	410	45,219	電気通信サービス
LORILLARD INC	149	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	31	27	167	18,430	メディア
RACKSPACE HOSTING INC	50	—	—	—	ソフトウェア・サービス
INTERVAL LEISURE GROUP	—	26	35	3,907	消費者サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	113	97	243	26,836	メディア
RESMED INC	58	49	283	31,206	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	—	29	291	32,074	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	101	85	400	44,050	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	53	42	304	33,543	保険

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
CHURCH & DWIGHT CO INC	55	46	460	50,682	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	39	32	263	29,031	運輸
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	33	—	—	—	公益事業
PERRIGO CO PLC	58	52	479	52,814	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUANTA SERVICES INC	89	55	124	13,683	資本財
FMC CORP	54	47	216	23,887	素材
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	50	—	—	—	食品・飲料・タバコ
WABTEC CORP	39	34	262	28,952	資本財
EVERSOURCE ENERGY	132	113	628	69,232	公益事業
NETSUITE INC	14	14	113	12,501	ソフトウェア・サービス
ALLERGAN PLC	156	139	3,166	348,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRGAS INC	27	23	331	36,447	素材
CROWN HOLDINGS INC	57	49	259	28,552	素材
CALPINE CORP	139	121	176	19,411	公益事業
EATON VANCE CORP	50	41	144	15,961	各種金融
DELTA AIR LINES INC	88	71	308	33,987	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	83	69	575	63,317	食品・飲料・タバコ
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	104	—	—	—	半導体・半導体製造装置
AMERICAN WATER WORKS CO INC	75	64	474	52,208	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	65	57	435	47,912	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	124	104	853	93,938	小売
FORTINET INC	—	53	177	19,588	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	38	33	147	16,226	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	11	9	355	39,161	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	76	60	193	21,259	銀行
QEP RESOURCES INC	69	—	—	—	エネルギー
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	422	413	205	22,568	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO	532	500	1,517	167,053	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	48	414	45,672	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	176	135	1,092	120,264	素材
HCA HOLDINGS INC	125	115	886	97,645	ヘルスケア機器・サービス
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	187	130	109	12,052	運輸
WHITING PETROLEUM CORP	85	—	—	—	エネルギー
ROCK-TENN COMPANY -CL A	57	—	—	—	素材
HOLLYFRONTIER CORP	78	62	171	18,905	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	116	188	681	75,017	エネルギー
ZILLOW GROUP INC - A	19	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ATMOS ENERGY CORP	—	37	265	29,283	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	—	56	322	35,529	資本財
XYLEM INC	76	63	275	30,279	資本財
TRIPADVISOR INC	48	42	266	29,335	小売
MEDIVATION INC	32	58	354	39,038	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	25	21	322	35,483	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	53	52	366	40,325	銀行
ALLEGHANY CORP	6	5	294	32,400	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	33	27	1,039	114,481	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	229	188	1,466	161,463	エネルギー
FACEBOOK INC-A	829	803	9,389	1,033,732	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP	116	100	410	45,223	公益事業
ALBEMARLE CORP	46	40	303	33,399	素材
PVH CORP	34	29	255	28,132	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A	44	40	511	56,364	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	
KINDER MORGAN INC	745	671	1,159	127,659	エネルギー
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	122	—	—	—	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	144	122	631	69,534	商業・専門サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	122	98	651	71,685	自動車・自動車部品
CHARTER COMMUNICATION-A	31	—	—	—	メディア
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	66	60	207	22,825	資本財
SPLUNK INC	—	45	227	25,039	ソフトウェア・サービス
ADT CORP/THE	72	—	—	—	商業・専門サービス
KRAFT FOODS GROUP INC	243	—	—	—	食品・飲料・タバコ
OGE ENERGY CORP	83	71	218	24,035	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	26	21	180	19,850	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	659	578	3,431	377,752	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LIBERTY MEDIA CORP - A	38	—	—	—	メディア
TESLA MOTORS INC	36	34	748	82,426	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	93	80	265	29,244	エネルギー
REALOGY HOLDINGS CORP	60	52	158	17,480	不動産
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	52	45	234	25,786	各種金融
ZOETIS INC	207	167	778	85,693	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC	48	41	244	26,928	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	156	134	155	17,074	メディア
SPRINT CORP	330	294	107	11,884	電気通信サービス
TECO ENERGY INC	—	84	233	25,676	公益事業
SNAP-ON INC	24	20	328	36,159	資本財
AGL RESOURCES INC	—	43	283	31,222	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	85	66	268	29,572	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	158	206	292	32,230	ソフトウェア・サービス
VANTIV INC - CL A	60	54	293	32,293	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	41	39	292	32,247	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	55	53	370	40,781	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	37	32	436	48,068	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	41	34	124	13,666	資本財
PHARMACYCLICS INC	26	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	32	27	402	44,331	ソフトウェア・サービス
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	—	65	150	16,525	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL C	119	110	7,709	848,697	ソフトウェア・サービス
IMS HEALTH HOLDINGS INC	—	56	140	15,416	ヘルスケア機器・サービス
NAVIENT CORP	172	127	157	17,388	各種金融
ENDO INTERNATIONAL PLC	71	77	114	12,637	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED RENTALS INC	41	32	211	23,230	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	75	56	182	20,142	運輸
VOYA FINANCIAL INC	95	76	242	26,745	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	19	16	70	7,726	素材
ANTERO RESOURCES CORP	22	29	78	8,590	エネルギー
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	28	33	215	23,678	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIREEYE INC	34	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP - C	87	—	—	—	メディア
ALLY FINANCIAL INC	180	155	259	28,618	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	204	174	358	39,510	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	—	48	248	27,411	ソフトウェア・サービス
JARDEN CORP	75	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	47	57	267	29,432	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	28	28	401	44,183	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	株数	当期		業種等		
		株数	株数		期末	
					評価額	評価額
株数	株数	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		
SIGNET JEWELERS LTD	31	26	286	31,523	小売	
SYNCHRONY FINANCIAL	70	294	882	97,155	各種金融	
QORVO INC	60	49	235	25,923	半導体・半導体製造装置	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	48	42	140	15,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	—	62	299	33,006	保険	
ACUITY BRANDS INC	—	15	377	41,527	資本財	
JONES LANG LASALLE INC	—	15	170	18,733	不動産	
ARAMARK	—	81	261	28,812	消費者サービス	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	—	186	427	47,045	銀行	
LEAR CORP	—	26	299	32,924	自動車・自動車部品	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	26	142	15,740	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WHITEAVE FOODS CO	—	63	277	30,559	食品・飲料・タバコ	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	—	50	138	15,251	素材	
RITE AID CORP	—	373	288	31,717	食品・生活必需品小売り	
BAXALTA INC	—	241	1,054	116,083	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLUMBIA PIPELINE GROUP	—	136	349	38,479	エネルギー	
WESTROCK CO	—	91	340	37,454	素材	
KRAFT HEINZ CO/THE	—	214	1,782	196,263	食品・飲料・タバコ	
PAYPAL HOLDINGS INC	—	389	1,464	161,281	ソフトウェア・サービス	
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	—	19	92	10,135	ソフトウェア・サービス	
ZILLOW GROUP INC - C	—	34	93	10,326	ソフトウェア・サービス	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	—	638	1,008	110,994	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MOBILEYE NV	—	30	108	11,945	ソフトウェア・サービス	
AMERCO	—	2	105	11,628	運輸	
CDW CORP/DE	—	50	212	23,406	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MEDNAX INC	—	33	223	24,654	ヘルスケア機器・サービス	
SABRE CORP	—	67	186	20,511	ソフトウェア・サービス	
WR GRACE & CO	—	25	188	20,793	素材	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	—	63	221	24,416	耐久消費財・アパレル	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	—	71	220	24,292	メディア	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	—	33	104	11,486	メディア	
INGEVITY CORP	—	15	38	4,292	素材	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	—	76	1,745	192,208	メディア	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	—	220	133	14,749	不動産	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	—	90	484	53,285	資本財	
小計	株数・金額	128,954	111,339	641,953	70,672,647	
	銘柄数<比率>	592	596	—	<61.9%>	
(カナダ)				千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA	597	525	4,072	342,613	銀行	
IMPERIAL OIL LTD	123	107	435	36,637	エネルギー	
THOMSON REUTERS CORP	149	122	646	54,418	メディア	
TRANSCANADA CORP	294	251	1,326	111,580	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	151	128	636	53,520	電気通信サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	254	216	951	80,048	保険	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	232	197	250	21,081	素材	
BARRICK GOLD CORP	482	412	978	82,355	素材	
BCE INC	59	51	306	25,743	電気通信サービス	
AGRIUM INC	60	47	540	45,444	素材	
BOMBARDIER INC-B	588	712	142	11,980	資本財	
BANK OF MONTREAL	267	227	1,867	157,077	銀行	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	358	313	1,375	115,758	不動産	
BANK OF NOVA SCOTIA	504	425	2,666	224,292	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	132	116	397	33,444	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC	111	94	153	12,914	資本財
CAMECO CORP	164	141	210	17,746	エネルギー
CI FINANCIAL CORP	95	83	227	19,125	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	164	140	1,411	118,724	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	453	387	1,448	121,898	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	338	282	2,125	178,836	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	31	25	347	29,275	小売
ENBRIDGE INC	352	325	1,693	142,453	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	8	7	512	43,112	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	93	79	461	38,814	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	143	123	178	15,034	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	42	34	124	10,500	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	94	80	551	46,426	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	816	697	1,282	107,895	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	172	143	731	61,560	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	137	120	503	42,391	銀行
ONEX CORPORATION	36	30	227	19,156	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	344	295	642	54,079	素材
POWER CORP OF CANADA	155	133	384	32,325	保険
POWER FINANCIAL CORP	104	89	277	23,361	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	163	145	354	29,838	メディア
SUNCOR ENERGY INC	601	560	1,920	161,596	エネルギー
TRANSALTA CORP	113	—	—	—	公益事業
WESTON (GEORGE) LTD	21	18	200	16,859	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	71	51	856	72,091	運輸
ENCANA CORP	318	302	298	25,153	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	88	78	466	39,267	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	70	62	131	11,058	資本財
GOLDCORP INC	337	293	664	55,931	素材
KINROSS GOLD CORP	472	433	279	23,496	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	63	53	273	22,994	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC	125	106	365	30,784	保険
METHANEX CORP	38	31	123	10,379	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	334	346	127	10,741	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	36	32	61	5,212	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	97	82	308	25,966	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	106	91	365	30,730	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	206	175	153	12,926	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELUS CORP	84	79	319	26,864	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	251	239	206	17,332	素材
YAMANA GOLD INC	379	343	214	18,035	素材
FORTIS INC	116	102	407	34,290	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	173	148	829	69,776	食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP	306	267	158	13,365	素材
TORONTO-DOMINION BANK	763	656	3,691	310,550	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	65	62	526	44,310	素材
SILVER WHEATON CORP	155	148	370	31,140	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	23	60	129	10,862	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	43	37	152	12,809	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	52	45	162	13,666	公益事業
METRO INC	105	86	369	31,104	食品・生活必需品小売り

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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
OPEN TEXT CORP	51	43	313	26,386		ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	55	47	419	35,250		保険
CRESCENT POINT ENERGY CORP	177	179	390	32,844		エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	341	295	566	47,651		エネルギー
MEG ENERGY CORP	64	—	—	—		エネルギー
ARC RESOURCES LTD	131	122	253	21,348		エネルギー
CANADIAN OIL SANDS LTD	205	—	—	—		エネルギー
BAYTEX ENERGY CORP	72	—	—	—		エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	70	66	203	17,146		エネルギー
ENERPLUS CORP	83	—	—	—		エネルギー
NEW GOLD INC	227	—	—	—		素材
PEMBINA PIPELINE CORP	140	133	491	41,377		エネルギー
VERMILION ENERGY INC	45	41	174	14,694		エネルギー
CATAMARAN CORP	85	—	—	—		ヘルスケア機器・サービス
DOLLARAMA INC	53	43	381	32,131		小売
KEYERA CORP	69	61	232	19,573		エネルギー
ALTAGAS LTD	54	51	151	12,777		エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	62	53	170	14,344		エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	33	30	125	10,557		公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	38	42	87	7,349		不動産
INTER PIPELINE LTD	136	120	316	26,612		エネルギー
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	54	63	158	13,351		エネルギー
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	—	59	150	12,682		エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	7	7	361	30,385		ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION SOFTWARE INC-RTS	8	—	—	—		ソフトウェア・サービス
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	25	—	—	—		エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	79	72	385	32,395		消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	28	25	97	8,194		素材
VERESEN INC	—	108	104	8,758		エネルギー
CCL INDUSTRIES INC - CL B	—	10	225	18,955		素材
ELEMENT FINANCIAL CORP	—	136	202	17,070		各種金融
LINAMAR CORP	—	18	91	7,703		自動車・自動車部品
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	—	38	165	13,929		商業・専門サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	16,269	14,150	50,805	4,274,238	
		93	90	—	<3.7%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
COMMERZBANK AG	440	375	272	33,562		銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	570	488	729	89,938		各種金融
METRO AG	66	63	176	21,705		食品・生活必需品小売り
SIEMENS AG-REG	328	280	2,602	320,867		資本財
RWE AG	202	173	197	24,307		公益事業
BASF SE	380	324	2,162	266,573		素材
VOLKSWAGEN AG	12	12	168	20,804		自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	399	340	1,956	241,187		自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	73	62	642	79,176		家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE	829	707	578	71,309		公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	137	117	830	102,353		自動車・自動車部品
BAYER AG-REG	342	292	2,590	319,369		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINDE AG	76	65	832	102,611		素材
ALLIANZ SE-REG	189	161	2,202	271,488		保険
MAN SE	14	11	112	13,908		資本財
CONTINENTAL AG	45	38	711	87,709		自動車・自動車部品

銘柄	株数	当期末			業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
INFINEON TECHNOLOGIES AG	466	401	491	60,585	半導体・半導体製造装置	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	63	54	259	32,032	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	99	82	102	12,583	運輸	
HUGO BOSS AG -ORD	27	23	135	16,761	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE POST AG-REG	401	343	883	108,886	運輸	
SAP SE	381	347	2,382	293,672	ソフトウェア・サービス	
CELESIO AG	22	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	91	78	341	42,117	メディア	
DEUTSCHE BOERSE AG	80	67	515	63,538	各種金融	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	90	77	569	70,208	ヘルスケア機器・サービス	
ADIDAS AG	15	14	73	9,098	運輸	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	87	74	810	99,974	耐久消費財・アパレル	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,315	1,141	1,801	222,037	電気通信サービス	
THYSSENKRUPP AG	71	58	936	115,452	保険	
BEIERSDORF AG	187	130	235	29,070	素材	
HEIDELBERGCEMENT AG	41	35	274	33,899	家庭用品・パーソナル用品	
MERCK KGAA	58	48	358	44,159	素材	
VOLKSWAGEN AG-PREF	53	46	398	49,126	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LANXESS AG	67	65	841	103,795	自動車・自動車部品	
FRESENIUS SE & CO KGAA	38	32	133	16,422	素材	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	157	135	859	105,956	ヘルスケア機器・サービス	
GEA GROUP AG	120	118	329	40,645	不動産	
SYMRISE AG	75	65	268	33,137	資本財	
K+S AG-REG	51	44	244	30,144	素材	
HENKEL AG & CO KGAA	70	69	147	18,189	素材	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	48	36	337	41,590	家庭用品・パーソナル用品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	50	44	197	24,300	ソフトウェア・サービス	
HANNOVER RUECK SE	22	18	117	14,497	自動車・自動車部品	
BRENNTAG AG	25	21	204	25,251	保険	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	63	54	255	31,442	資本財	
AXEL SPRINGER SE	9	—	—	—	メディア	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	17	15	75	9,319	メディア	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	29	23	86	10,631	素材	
OSRAM LICHT AG	246	253	114	14,176	電気通信サービス	
VONOVIA SE	37	30	140	17,361	資本財	
EVONIK INDUSTRIES AG	141	165	495	61,026	不動産	
ZALANDO SE	—	49	130	16,147	素材	
	—	31	86	10,613	小売	
小計	株数・金額	8,933	7,820	32,403	3,994,730	
	銘柄数<比率>	52	52	—	<3.5%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	484	411	515	63,515	保険	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	91	—	—	—	銀行	
INTESA SANPAOLO	5,244	4,499	1,032	127,347	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	4,221	4,068	337	41,657	電気通信サービス	
ENI SPA	1,052	901	1,188	146,522	エネルギー	
UNICREDIT SPA	1,819	1,687	471	58,075	銀行	
ENEL SPA	2,731	2,712	1,068	131,752	公益事業	
SAIPEM SPA	108	2,049	73	9,064	エネルギー	
ATLANTIA SPA	172	144	352	43,517	運輸	
INTESA SANPAOLO-RSP	397	324	71	8,835	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	69	60	293	36,161	耐久消費財・アパレル	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
MEDIOBANCA SPA	246	203	134	16,533	各種金融	
SNAM SPA	868	753	387	47,718	公益事業	
TELECOM ITALIA-RSP	2,448	2,076	140	17,330	電気通信サービス	
BANCO POPOLARE SC	147	130	55	6,893	銀行	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	164	146	154	19,029	資本財	
PIRELLI & C.	96	—	—	—	自動車・自動車部品	
UBI BANCA SPA	359	318	110	13,623	銀行	
TERNA SPA	629	551	263	32,543	公益事業	
UNIPOLSAI SPA	369	391	72	8,930	保険	
PRYSMIAN SPA	85	66	143	17,660	資本財	
EXOR SPA	41	38	121	15,017	各種金融	
ENEL GREEN POWER SPA	754	—	—	—	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	22,607	21,536	6,990	861,731	
	銘柄 数 < 比 率 >	23	20	—	< 0.8% >	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)	76	65	569	70,165	自動車・自動車部品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	115	98	1,406	173,340	耐久消費財・アパレル	
PEUGEOT SA	162	157	206	25,450	自動車・自動車部品	
AXA SA	752	696	1,452	179,044	保険	
DANONE	239	208	1,240	152,960	食品・飲料・タバコ	
CARREFOUR SA	228	194	467	57,581	食品・生活必需品小売り	
VIVENDI	502	409	696	85,917	メディア	
INGENICO GROUP	—	19	197	24,349	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ALCATEL-LUCENT SA	1,161	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SOCIETE GENERALE SA	299	256	884	109,046	銀行	
AIR LIQUIDE SA	142	121	1,165	143,628	素材	
TOTAL SA	886	777	3,273	403,562	エネルギー	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	185	168	645	79,519	資本財	
ZODIAC AEROSPACE	76	70	150	18,499	資本財	
VINCI SA	195	169	1,105	136,321	資本財	
LAFARGE SA	76	—	—	—	素材	
SANOFI	494	415	2,868	353,624	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	176	164	319	39,428	公益事業	
L'OREAL	104	88	1,407	173,556	家庭用品・パーソナル用品	
ACCOR SA	87	75	287	35,433	消費者サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	217	197	1,094	134,982	資本財	
BNP PARIBAS	438	374	1,698	209,439	銀行	
ESSILOR INTERNATIONAL	84	72	815	100,479	ヘルスケア機器・サービス	
CAPGEMINI	59	57	462	57,065	ソフトウェア・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	23	20	101	12,528	食品・生活必需品小売り	
VALEO SA	31	28	365	45,036	自動車・自動車部品	
HERMES INTERNATIONAL	10	9	293	36,190	耐久消費財・アパレル	
VALLOUREC SA	44	—	—	—	エネルギー	
SODEXO	39	33	299	36,886	消費者サービス	
KERING	31	27	383	47,318	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	53	45	310	38,316	ソフトウェア・サービス	
TECHNIP SA	42	37	183	22,645	エネルギー	
CHRISTIAN DIOR SE	22	19	279	34,460	耐久消費財・アパレル	
ATOS SE	33	31	249	30,770	ソフトウェア・サービス	
ORANGE	768	702	1,050	129,547	電気通信サービス	
CNP ASSURANCES	70	59	84	10,456	保険	
IMERYS SA	14	13	81	10,050	素材	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
SAFRAN SA	121	110	647	79,873	資本財
RENAULT SA	79	67	537	66,219	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	77	67	427	52,763	メディア
LAGARDERE SCA	47	40	87	10,845	メディア
JC DECAUX SA	27	27	95	11,769	メディア
SOCIETE BIC SA	12	10	126	15,615	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	69	73	209	25,860	資本財
THALES SA	37	37	285	35,218	資本財
PERNOD RICARD SA	87	75	704	86,877	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	428	375	328	40,515	銀行
ENGIE	600	519	685	84,460	公益事業
ALSTOM	89	54	120	14,866	資本財
ARKEMA	27	23	165	20,363	素材
LEGRAND SA	109	94	453	55,935	資本財
SCOR SE	64	53	153	18,895	保険
ADP	12	10	112	13,889	運輸
EDF	101	85	98	12,161	公益事業
NATIXIS	389	335	145	17,914	銀行
WENDEL	13	10	107	13,311	各種金融
BUREAU VERITAS SA	110	94	178	21,992	商業・専門サービス
EURAZEO	17	13	78	9,622	各種金融
EURAZEO-NEW	—	0.69	3	474	各種金融
SUEZ	124	109	159	19,687	公益事業
ILIAD SA	10	9	181	22,394	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	63	60	108	13,392	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	195	168	196	24,225	運輸
EDENRED	84	71	117	14,479	商業・専門サービス
REMY COINTREAU	10	7	56	7,000	食品・飲料・タバコ
REXEL SA	115	105	137	16,997	資本財
BOLLORE	360	319	102	12,640	運輸
NUMERICABLE-SFR	39	40	110	13,676	電気通信サービス
小 計	株 数	金 額			
	銘柄 数 < 比 率 >				
	66	65	—	< 3.6% >	
(ユーロ…オランダ)					
QIAGEN N.V.	95	80	151	18,660	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV	387	334	202	24,953	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	373	320	201	24,826	自動車・自動車部品
FERRARI NV	—	44	160	19,766	自動車・自動車部品
AIRBUS GROUP SE	243	209	1,116	137,598	資本財
STMICROELECTRONICS NV	259	221	110	13,683	半導体・半導体製造装置
GEMALTO	33	28	152	18,846	ソフトウェア・サービス
WOLTERS KLUWER	124	107	366	45,197	メディア
KONINKLIJKE KPN NV	1,322	1,149	397	48,995	電気通信サービス
AKZO NOBEL	101	87	529	65,330	素材
HEINEKEN NV	95	81	657	81,083	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV	386	336	771	95,076	資本財
RELX NV	291	351	523	64,589	メディア
AEGON NV	747	652	288	35,522	保険
KONINKLIJKE AHOLD NV	368	294	555	68,501	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD HOLDING NV	52	45	207	25,541	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV	42	36	254	31,384	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	72	63	335	41,339	素材

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等		
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額		邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ING GROEP NV-CVA	1,598	1,369	1,408	173,613	銀行	
ASML HOLDING NV	145	122	1,022	126,011	半導体・半導体製造装置	
UNILEVER NV-CVA	674	576	2,225	274,301	家庭用品・パーソナル用品	
VOPAK	29	25	119	14,702	エネルギー	
BOSKALIS WESTMINSTER	36	30	99	12,300	資本財	
DELTA LLOYD NV	85	—	—	—	保険	
TNT EXPRESS NV	182	173	138	17,084	運輸	
OCI NV	36	30	40	5,007	素材	
NN GROUP NV	64	113	327	40,339	保険	
ALTICE NV - B	—	40	58	7,191	メディア	
ALTICE NV - A	—	130	184	22,790	メディア	
小 計	株 数 ・ 金 額	7,850	7,057	12,607	1,554,240	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	28	—	< 1.4% >	
(ユーロ…スペイン)						
BANCO POPULAR ESPANOL	748	600	127	15,659	銀行	
ENDESA SA	133	114	204	25,200	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	73	67	189	23,365	資本財	
IBERDROLA SA	2,142	1,948	1,174	144,796	公益事業	
TELEFONICA SA	1,852	1,592	1,451	178,896	電気通信サービス	
BANCO SANTANDER SA	5,953	5,105	2,086	257,242	銀行	
BANKINTER SA	273	236	154	19,048	銀行	
REPSOL SA	429	388	434	53,559	エネルギー	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,614	2,292	1,277	157,500	銀行	
GAS NATURAL SDG SA	146	126	214	26,382	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	451	383	1,082	133,441	小売	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	169	186	266	32,803	運輸	
MAPPRE SA	386	391	84	10,422	保険	
FERROVIAL SA	174	168	311	38,383	資本財	
ZARDOYA OTIS SA	69	67	61	7,552	資本財	
ENAGAS SA	84	76	200	24,744	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	45	38	295	36,443	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	1,805	1,836	286	35,316	銀行	
CAIXABANK S. A	946	937	228	28,209	銀行	
GRIFOLS SA	60	105	191	23,635	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	186	154	604	74,495	ソフトウェア・サービス	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	347	293	196	24,272	運輸	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	251	215	111	13,758	食品・生活必需品小売り	
BANKIA SA	1,886	1,600	123	15,195	銀行	
AENA SA	24	24	293	36,143	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額	21,256	18,953	11,652	1,436,469	
	銘柄 数 < 比 率 >	25	25	—	< 1.3% >	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS	92	72	248	30,591	保険	
UCB SA	52	44	293	36,144	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	333	284	3,081	379,920	食品・飲料・タバコ	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	33	28	206	25,443	各種金融	
DELHAIZE GROUP	42	36	333	41,134	食品・生活必需品小売り	
UMICORE	38	33	145	17,951	素材	
COLRUYT SA	29	25	131	16,158	食品・生活必需品小売り	
KBC GROEP NV	103	88	432	53,320	銀行	
SOLVAY SA	24	26	226	27,938	素材	
PROXIMUS	63	53	150	18,536	電気通信サービス	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円	
TELENET GROUP HOLDING NV		22	19	81	10,043	メディア
小 計		株 数 ・ 金 額	837	713	5,330	657,183
		銘柄 数 < 比 率 >	11	11	-	<0.6%>
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG		116	99	228	28,168	銀行
OMV AG		62	54	136	16,865	エネルギー
VOESTALPINE AG		46	41	118	14,600	素材
IMMOFINANZ AG		403	-	-	-	不動産
ANDRITZ AG		31	28	124	15,407	資本財
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		47	39	44	5,470	銀行
VIENNA INSURANCE GROUP AG		17	-	-	-	保険
小 計		株 数 ・ 金 額	723	262	653	80,513
		銘柄 数 < 比 率 >	7	5	-	<0.1%>
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP		16	13	109	13,454	メディア
TENARIS SA		194	165	190	23,544	エネルギー
SES		125	117	254	31,418	メディア
ARCELORMITTAL		415	607	238	29,423	素材
ALTICE SA		36	-	-	-	メディア
小 計		株 数 ・ 金 額	788	903	793	97,841
		銘柄 数 < 比 率 >	5	4	-	<0.1%>
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ		1,550	2,041	940	115,996	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS		226	194	139	17,234	素材
NOKIAN RENKAAT OYJ		47	41	129	15,914	自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ		223	185	307	37,863	素材
FORTUM OYJ		186	159	207	25,520	公益事業
KONE OYJ-B		129	118	465	57,333	資本財
METSO OYJ		47	41	81	10,062	資本財
SAMPO OYJ-A SHS		185	157	614	75,696	保険
WARTSILA OYJ ABP		61	52	189	23,419	資本財
ELISA OYJ		60	50	162	20,042	電気通信サービス
NESTE OYJ		53	45	129	15,937	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		40	37	115	14,210	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	2,813	3,125	3,481	429,233
		銘柄 数 < 比 率 >	12	12	-	<0.4%>
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A		67	57	454	56,070	食品・飲料・タバコ
PADDY POWER BETFAIR PLC		-	30	339	41,847	消費者サービス
BANK OF IRELAND		11,576	10,157	243	30,052	銀行
CRH PLC		342	295	768	94,686	素材
小 計		株 数 ・ 金 額	11,986	10,540	1,806	222,655
		銘柄 数 < 比 率 >	3	4	-	<0.2%>
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		973	836	245	30,211	公益事業
JERONIMO MARTINS		105	89	122	15,082	食品・生活必需品小売り
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R		14,749	15,817	51	6,395	銀行
GALP ENERGIA SGPS SA		163	163	191	23,591	エネルギー
小 計		株 数 ・ 金 額	15,900	16,906	610	75,280
		銘柄 数 < 比 率 >	4	4	-	<0.1%>
ユ ー ロ 計		株 数 ・ 金 額	105,272	96,787	109,356	13,481,428
		銘柄 数 < 比 率 >	234	230	-	<11.8%>

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	
BARCLAYS PLC	6,813	5,939	1,013	162,925	銀行
BP PLC	7,555	6,486	2,309	371,139	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	23,650	20,217	1,396	224,479	銀行
ASTRAZENECA PLC	523	447	1,704	273,951	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC	163	140	151	24,324	資本財
NEXT PLC	63	52	277	44,556	小売
DIAGEO PLC	1,040	890	1,618	260,105	食品・飲料・タバコ
SKY PLC	427	365	336	54,128	メディア
BAE SYSTEMS PLC	1,303	1,116	533	85,789	資本財
UNILEVER PLC	531	453	1,380	221,874	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC	3,362	2,873	459	73,861	食品・生活必需品小売り
RELX PLC	472	392	477	76,672	メディア
MARKS & SPENCER GROUP PLC	675	583	256	41,199	小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	267	225	1,523	244,850	家庭用品・パーソナル用品
PRUDENTIAL PLC	1,063	909	1,177	189,320	保険
BG GROUP PLC	1,413	—	—	—	エネルギー
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,463	2,095	462	74,288	保険
SAGE GROUP PLC/THE	441	380	221	35,586	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	7,948	6,929	2,955	475,109	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	772	660	2,697	433,489	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	287	251	234	37,712	公益事業
SCHRODERS PLC	51	43	110	17,744	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,047	1,224	277	44,626	銀行
BHP BILLITON PLC	874	748	609	98,003	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	396	339	1,244	200,010	食品・飲料・タバコ
WPP PLC	544	463	723	116,305	メディア
CENTRICA PLC	2,056	1,805	358	57,649	公益事業
BT GROUP PLC	3,373	2,996	1,297	208,498	電気通信サービス
SSE PLC	410	359	537	86,322	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	1,023	1,158	593	95,313	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	780	650	412	66,330	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF C	112,001	46,179	4	742	資本財
COMPASS GROUP PLC	690	580	727	116,902	消費者サービス
KINGFISHER PLC	971	802	283	45,641	小売
PEARSON PLC	339	289	232	37,383	メディア
SEVERN TRENT PLC	101	87	189	30,522	公益事業
RIO TINTO PLC	526	439	852	137,007	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,013	1,722	2,424	389,728	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SABMILLER PLC	400	343	1,447	232,619	食品・飲料・タバコ
PROVIDENT FINANCIAL PLC	—	51	144	23,289	各種金融
3I GROUP PLC	404	342	171	27,520	各種金融
GKN PLC	685	608	166	26,712	自動車・自動車部品
VODAFONE GROUP PLC	10,978	9,393	2,117	340,297	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	872	793	149	24,039	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	504	476	120	19,292	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	1,657	1,430	608	97,833	保険
CAPITA PLC	273	237	252	40,535	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC	408	349	150	24,121	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	84	68	199	32,041	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	420	361	173	27,908	保険
WHITBREAD PLC	75	65	265	42,730	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	1,564	1,331	1,292	207,793	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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
ARM HOLDINGS PLC	582	495	458	73,650	半導体・半導体製造装置
WOLSELEY PLC	108	90	353	56,810	資本財
LONMIN PLC	49	—	—	—	素材
BUNZL PLC	137	120	240	38,613	資本財
COBHAM PLC	468	414	67	10,834	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	576	495	286	46,105	素材
INTERTEK GROUP PLC	66	57	187	30,093	商業・専門サービス
WILLIAM HILL PLC	356	312	95	15,345	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	184	159	171	27,613	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	98	68	174	27,995	消費者サービス
CARNIVAL PLC	76	67	235	37,820	消費者サービス
PERSIMMON PLC	127	109	221	35,554	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	335	272	102	16,472	資本財
ICAP PLC	223	193	83	13,345	各種金融
ITV PLC	1,586	1,368	283	45,632	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	130	110	284	45,750	各種金融
G4S PLC	643	550	102	16,504	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS	—	46	142	22,860	耐久消費財・アパレル
AMEC FOSTER WHEELER PLC	159	—	—	—	エネルギー
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	—	358	200	32,187	耐久消費財・アパレル
IMI PLC	111	95	94	15,240	資本財
REXAM PLC	287	250	155	25,045	素材
SMITH & NEPHEW PLC	372	314	356	57,226	ヘルスケア機器・サービス
TATE & LYLE PLC	196	161	96	15,543	食品・飲料・タバコ
TAYLOR WIMPEY PLC	—	1,157	228	36,802	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,619	1,394	2,298	369,360	エネルギー
PETROFAC LTD	110	94	75	12,184	エネルギー
TRAVIS PERKINS PLC	102	86	156	25,175	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,010	1,403	2,335	375,337	エネルギー
OLD MUTUAL PLC	2,024	1,743	286	46,012	保険
INVESTEC PLC	226	192	90	14,562	各種金融
STANDARD LIFE PLC	815	689	226	36,475	保険
EXPERIAN PLC	412	341	429	69,054	商業・専門サービス
MONDI PLC	—	130	170	27,441	素材
WEIR GROUP PLC/THE	87	77	92	14,855	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	146	125	363	58,366	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC	159	135	56	9,104	素材
TULLOW OIL PLC	371	—	—	—	エネルギー
SHIRE PLC	244	209	861	138,522	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INMARSAT PLC	175	157	116	18,760	電気通信サービス
ADMIRAL GROUP PLC	82	74	140	22,563	保険
FRESNILLO PLC	91	80	85	13,794	素材
RANDGOLD RESOURCES LTD	36	32	198	31,932	素材
AGGREKO PLC	105	93	103	16,646	商業・専門サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	105	92	90	14,509	商業・専門サービス
ST JAMES'S PLACE PLC	—	188	166	26,789	保険
GLENCORE PLC	4,605	4,329	554	89,135	素材
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	382	321	86	13,897	各種金融
HARGREAVES LANSDOWN PLC	99	92	116	18,676	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC	55	46	138	22,234	素材
MELROSE INDUSTRIES PLC	423	—	—	—	資本財
COCA-COLA HBC AG-DI	81	70	91	14,638	食品・飲料・タバコ

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		
EASYJET PLC	67	57	84	13,542	運輸	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	613	489	179	28,803	保険	
ROYAL MAIL PLC	264	320	156	25,157	運輸	
ASHTAD GROUP PLC	206	177	168	27,009	資本財	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	113	96	34	5,599	小売	
MERLIN ENTERTAINMENT	291	252	103	16,711	消費者サービス	
TUI AG-DI	187	178	180	28,995	消費者サービス	
SOUTH32 LTD	874	—	—	—	素材	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	—	129	106	17,105	ヘルスケア機器・サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC	—	277	105	17,000	ソフトウェア・サービス	
WORLDPAY GROUP PLC	—	506	131	21,145	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	229,853	149,119	54,532	8,764,992	
	銘柄 数 < 比 率 >	106	109	—	< 7.7% >	
(スイス)			千スイスフラン			
NESTLE SA-REG	1,335	1,128	8,155	905,449	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	215	184	1,138	126,427	耐久消費財・アパレル	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	631	636	845	93,843	各種金融	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	94	161	709	78,726	素材	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	291	248	6,021	668,622	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GIVAUDAN-REG	3	3	623	69,237	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	22	18	241	26,858	ヘルスケア機器・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	61	53	1,245	138,278	保険	
SYNGENTA AG-REG	38	32	1,298	144,223	素材	
LONZA GROUP AG-REG	22	18	315	34,978	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	20	17	103	11,506	耐久消費財・アパレル	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	18	15	278	30,891	資本財	
GEBERIT AG-REG	15	13	494	54,930	資本財	
SWISS RE AG	145	124	1,067	118,522	保険	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	12	10	330	36,742	耐久消費財・アパレル	
PARGESA HOLDING SA-BR	12	11	71	7,926	各種金融	
NOVARTIS AG-REG	952	805	5,939	659,498	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	70	58	341	37,951	商業・専門サービス	
SWISSCOM AG-REG	9	9	436	48,424	電気通信サービス	
ABB LTD-REG	909	778	1,556	172,822	資本財	
SGS SA-REG	2	1	416	46,222	商業・専門サービス	
SULZER AG-REG	9	5	44	4,966	資本財	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	8	7	126	14,031	資本財	
ACTELION LTD-REG	42	36	568	63,110	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	22	19	260	28,928	運輸	
BALOISE HOLDING AG - REG	20	17	209	23,215	保険	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	13	11	269	29,882	保険	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.04	0.04	290	32,289	食品・飲料・タバコ	
ARYZTA AG	35	29	116	12,892	食品・飲料・タバコ	
JULIUS BAER GROUP LTD	92	78	321	35,666	各種金融	
SIKA AG-BR	0.9	0.76	320	35,584	素材	
TRANSOCEAN LTD	151	—	—	—	エネルギー	
SWISS PRIME SITE-REG	24	23	199	22,152	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.42	0.34	210	23,367	食品・飲料・タバコ	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	7	5	231	25,744	各種金融	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.9	0.83	96	10,671	食品・飲料・タバコ	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	3	2	135	15,041	素材	
UBS GROUP AG-REG	1,512	1,295	1,889	209,784	各種金融	

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等		
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額		邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円		
DUFREY AG-REG	—	14	191	21,232	小売	
GALENICA AG-REG	—	1	182	20,207	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	6,834	5,884	37,294	4,140,851	
	銘柄 数 < 比 率 >	38	39	—	< 3.6% >	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-SER B	100	84	1,822	24,021	耐久消費財・アパレル	
ERICSSON LM-B SHS	1,259	1,078	6,734	88,758	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ATLAS COPCO AB-B SHS	161	138	2,655	35,004	資本財	
ATLAS COPCO AB- B REDEMPTION	161	—	—	—	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	631	539	4,059	53,508	銀行	
INVESTOR AB-B SHS	187	161	4,434	58,441	各種金融	
NORDEA BANK AB	1,256	1,076	8,283	109,180	銀行	
GETINGE AB-B SHS	81	73	1,232	16,246	ヘルスケア機器・サービス	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	623	527	5,405	71,249	銀行	
ATLAS COPCO AB-A SHS	277	237	4,920	64,852	資本財	
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	277	—	—	—	資本財	
SKF AB-B SHARES	165	141	2,039	26,886	資本財	
ASSA ABLOY AB-B	137	353	5,848	77,085	資本財	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	392	335	8,591	113,229	小売	
SANDVIK AB	439	375	3,064	40,393	資本財	
SWEDBANK AB - A SHARES	373	318	5,502	72,517	銀行	
SECURITAS AB-B SHS	133	111	1,401	18,477	商業・専門サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	244	213	5,437	71,660	家庭用品・パーソナル用品	
SKANSKA AB-B SHS	158	135	2,349	30,967	資本財	
SWEDISH MATCH AB	82	69	1,891	24,935	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	130	117	923	12,167	電気通信サービス	
TELIA CO AB	1,079	939	3,539	46,646	電気通信サービス	
VOLVO AB-B SHS	633	543	4,920	64,853	資本財	
ALFA LAVAL AB	128	103	1,288	16,980	資本財	
ELEKTA AB-B SHS	155	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
LUNDIN PETROLEUM AB	90	79	1,176	15,504	エネルギー	
BOLIDEN AB	113	93	1,305	17,206	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	166	144	940	12,398	耐久消費財・アパレル	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	26	24	1,104	14,555	電気通信サービス	
HEXAGON AB-B SHS	106	91	2,830	37,310	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	98	84	1,866	24,600	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	68	50	695	9,164	各種金融	
ICA GRUPPEN AB	32	28	786	10,366	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額	9,980	8,273	97,053	1,279,171	
	銘柄 数 < 比 率 >	33	30	—	< 1.1% >	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
DNB ASA	403	349	3,457	45,540	銀行	
NORSK HYDRO ASA	558	475	1,493	19,674	素材	
ORKLA ASA	334	286	2,118	27,897	食品・飲料・タバコ	
STATOIL ASA	461	394	5,250	69,151	エネルギー	
TELENOR ASA	310	264	3,605	47,487	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	74	63	1,835	24,176	素材	
SUBSEA 7 SA	117	—	—	—	エネルギー	
SEADRILL LTD	161	—	—	—	エネルギー	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	84	69	950	12,517	保険	
SCHIBSTED ASA-CL A	—	27	716	9,442	メディア	

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	
(ノルウェー)	百株	百株	千円	
SCHIBSTED ASA-B SHS	—	32	819	メディア
小 計	株数・金額	2,505	1,965	20,249
	銘柄数<比率>	9	9	—
(デンマーク)			千デンマーククローネ	
NOVO NORDISK A/S-B	832	693	24,759	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	99	82	2,603	素材
DANSKE BANK A/S	272	250	4,578	銀行
WILLIAM DEMANT HOLDING	8	9	614	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	93	79	3,492	資本財
TDC A/S	334	280	946	電気通信サービス
CARLSBERG AS-B	44	37	2,322	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B	46	39	1,962	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S	76	68	2,021	運輸
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	3	2	2,142	運輸
TRYG A/S	41	39	499	保険
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	1	1	1,126	運輸
PANDORA A/S	48	38	3,768	耐久消費財・アパレル
ISS A/S	52	52	1,366	商業・専門サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	—	35	1,437	素材
GENMAB A/S	—	19	2,027	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	1,955	1,731	55,669
	銘柄数<比率>	14	16	—
(オーストラリア)			千オーストラリアドル	
BHP BILLITON LIMITED	1,331	1,140	2,133	素材
CSL LTD	196	165	1,887	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINA LTD	1,063	896	123	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	308	263	712	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,144	1,033	2,573	銀行
RIO TINTO LTD	180	150	668	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	566	488	587	保険
LENLEASE GROUP	232	198	260	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	672	606	4,716	銀行
WESTPAC BANKING CORP	1,290	1,180	3,558	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,049	933	2,547	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-RTS	79	—	—	銀行
BRAMBLES LTD	651	566	720	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	242	206	66	運輸
BORAL LTD	342	268	180	素材
WOOLWORTHS LTD	523	452	1,002	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	1,780	1,529	862	電気通信サービス
AMP LTD	1,243	1,062	583	保険
TABCORP HOLDINGS LTD	355	295	124	消費者サービス
AMCOR LIMITED	508	415	677	素材
COMPUTERSHARE LTD	204	169	176	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	—	197	245	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	119	109	768	各種金融
CIMIC GROUP LTD	44	38	148	資本財
ASX LTD	82	70	309	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	246	214	189	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	24	20	239	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	189	161	324	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	241	206	94	小売

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額	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		
NEWCREST MINING LTD	322	270	533	42,477	素材	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	974	889	524	41,778	保険	
ORIGIN ENERGY LTD	462	625	348	27,731	エネルギー	
ORICA LTD	156	132	183	14,594	素材	
SONIC HEALTHCARE LTD	159	141	302	24,124	ヘルスケア機器・サービス	
SANTOS LTD	408	597	252	20,111	エネルギー	
SUNCORP GROUP LTD	541	459	595	47,414	保険	
TRANSURBAN GROUP	760	735	893	71,115	運輸	
WESFARMERS LTD	466	400	1,702	135,574	食品・生活必需品小売り	
CHALLENGER LTD	—	207	189	15,055	各種金融	
SYDNEY AIRPORT	484	408	293	23,367	運輸	
CALTEX AUSTRALIA LTD	111	98	331	26,384	エネルギー	
OIL SEARCH LTD	—	492	340	27,076	エネルギー	
WORLEYPARSONS LTD	89	—	—	—	エネルギー	
AGL ENERGY LTD	287	251	463	36,942	公益事業	
TATTS GROUP LTD	618	531	206	16,462	消費者サービス	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	645	573	168	13,421	素材	
ASCIANO LTD	410	229	203	16,166	運輸	
ILUKA RESOURCES LTD	179	152	88	7,028	素材	
AUSNET SERVICES	832	765	120	9,570	公益事業	
CROWN RESORTS LTD	156	128	152	12,175	消費者サービス	
INCITEC PIVOT LTD	690	604	204	16,307	素材	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	193	161	161	12,864	銀行	
AURIZON HOLDINGS LTD	891	753	334	26,643	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	268	265	267	21,270	食品・飲料・タバコ	
ALS LTD	170	—	—	—	商業・専門サービス	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	55	51	365	29,080	ヘルスケア機器・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	24	21	76	6,068	消費者サービス	
SEEK LTD	139	122	196	15,639	商業・専門サービス	
BANK OF QUEENSLAND LTD	155	134	151	12,033	銀行	
REA GROUP LTD	23	21	116	9,298	メディア	
TPG TELECOM LTD	120	109	127	10,125	電気通信サービス	
HEALTHSCOPE LTD	476	633	174	13,928	ヘルスケア機器・サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,146	985	302	24,079	保険	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	100	100	62	4,982	各種金融	
SOUTH32 LTD	1,331	1,890	296	23,629	素材	
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	—	160	142	11,377	電気通信サービス	
小 計	株 数	金 額	28,774	27,147	37,359	2,974,972
	銘柄 数	< 比 率 >	62	63	—	< 2.6% >
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
SPARK NEW ZEALAND LTD	749	634	232	17,331	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	392	351	224	16,674	運輸	
CONTACT ENERGY LTD	170	262	141	10,539	公益事業	
FLETCHER BUILDING LTD	284	247	211	15,730	素材	
RYMAN HEALTHCARE LTD	163	137	131	9,796	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	544	454	122	9,081	公益事業	
MIGHTY RIVER POWER	307	270	79	5,947	公益事業	
小 計	株 数	金 額	2,612	2,359	1,143	85,101
	銘柄 数	< 比 率 >	7	7	—	< 0.1% >
(香港)			千香港ドル			
WHARF HOLDINGS LTD	630	490	2,023	28,675	不動産	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	880	—	—	—	資本財	

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円			
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	260	205	1,670	23,674	不動産		
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	575	956	8,463	119,934	資本財		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	700	610	5,261	74,551	不動産		
MTR CORP	620	525	2,052	29,087	運輸		
HONG KONG & CHINA GAS	2,627	2,541	3,633	51,492	公益事業		
NEW WORLD DEVELOPMENT	2,130	1,900	1,331	18,873	不動産		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	575	495	3,658	51,834	公益事業		
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	460	406	7,214	102,231	各種金融		
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	510	430	509	7,226	運輸		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	920	790	1,090	15,448	不動産		
CLP HOLDINGS LTD	790	680	4,821	68,316	公益事業		
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	433	406	1,774	25,145	不動産		
BANK OF EAST ASIA LTD	479	435	1,204	17,074	銀行		
HANG SENG BANK LTD	316	273	3,614	51,217	銀行		
HYSAN DEVELOPMENT CO	260	240	762	10,797	不動産		
SHANGRI-LA ASIA LTD	460	420	367	5,201	消費者サービス		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	97	92	482	6,831	半導体・半導体製造装置		
SINO LAND CO	1,222	1,062	1,187	16,824	不動産		
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	310	260	735	10,426	耐久消費財・アパレル		
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	260	240	1,731	24,536	公益事業		
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,545	1,325	2,941	41,681	銀行		
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	570	490	1,489	21,107	耐久消費財・アパレル		
PCCW LTD	1,660	1,550	781	11,069	電気通信サービス		
LI & FUNG LTD	2,424	2,184	932	13,214	耐久消費財・アパレル		
KERRY PROPERTIES LTD	260	245	464	6,582	不動産		
NWS HOLDINGS LTD	650	560	677	9,601	資本財		
SANDS CHINA LTD	1,012	864	2,354	33,361	消費者サービス		
WHEELLOCK & CO LTD	380	320	1,043	14,782	不動産		
WYNN MACAU LTD	656	576	620	8,798	消費者サービス		
SJM HOLDINGS LTD	820	700	332	4,711	消費者サービス		
FIRST PACIFIC CO	1,000	860	420	5,959	各種金融		
AIA GROUP LTD	4,990	4,266	18,215	258,118	保険		
SWIRE PROPERTIES LTD	478	430	872	12,368	不動産		
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	970	840	2,037	28,864	消費者サービス		
MGM CHINA HOLDINGS LTD	384	348	356	5,049	消費者サービス		
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,080	940	1,041	14,758	電気通信サービス		
WH GROUP LTD	1,570	2,090	1,254	17,769	食品・飲料・タバコ		
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	-	956	4,253	60,272	不動産		
小 計	株 数	金 額	35,964	33,002	93,681	1,327,470	
銘 柄 数 < 比 率 >			39	39	-	< 1.2% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル				
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,247	1,099	925	73,889	銀行		
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	702	568	221	17,703	メディア		
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	422	375	102	8,144	資本財		
CAPITALAND LTD	1,100	920	272	21,744	不動産		
CITY DEVELOPMENTS LTD	180	143	114	9,169	不動産		
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	44	42	135	10,798	小売		
DBS GROUP HOLDINGS LTD	721	626	939	75,029	銀行		
KEPPEL CORP LTD	603	515	268	21,466	資本財		
UNITED OVERSEAS BANK LTD	537	459	814	65,055	銀行		
SINGAPORE TECH ENGINEERING	686	556	171	13,674	資本財		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,317	2,825	1,076	85,971	電気通信サービス		

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
SINGAPORE AIRLINES LTD	241	206	218	17,486	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	340	288	213	17,063	各種金融	
SEBICORP MARINE LTD	350	315	48	3,898	資本財	
UOL GROUP LTD	199	166	93	7,436	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	890	765	211	16,920	運輸	
NOBLE GROUP LTD	1,786	1,738	55	4,442	資本財	
STARHUB LTD	270	245	85	6,788	電気通信サービス	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	2,890	2,673	94	7,578	食品・飲料・タバコ	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	840	688	223	17,854	食品・飲料・タバコ	
GENTING SINGAPORE PLC	2,510	2,260	163	13,083	消費者サービス	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	1,310	1,119	206	16,485	不動産	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	840	706	62	5,017	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	22,028	19,300	6,721	536,704	
	銘柄 数 < 比 率 >	23	23	—	<0.5%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
ISRAEL CHEMICALS LTD	184	185	279	7,949	素材	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	356	323	6,450	183,650	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BANK HAPOALIM BM	441	373	712	20,285	銀行	
NICE SYSTEMS LTD	24	19	497	14,165	ソフトウェア・サービス	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	545	491	671	19,110	銀行	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	1	—	—	—	素材	
DELEK GROUP LTD	1	1	115	3,300	エネルギー	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	780	671	510	14,522	電気通信サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	59	46	200	5,711	銀行	
AZRIELI GROUP	—	12	199	5,682	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,394	2,125	9,637	274,379	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.2%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	593,398	473,185	—	109,001,635	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,259	1,260	—	<95.4%>	

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

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

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
HCP INC	18	16	531	58,511	0.1	
MACERICH CO/THE	5	4	346	38,169	0.0	
PROLOGIS INC	20	18	858	94,551	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST	3	3	259	28,513	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	5	5	476	52,500	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2	2	518	57,136	0.1	
EXTRA SPACE STORAGE INC	—	4	369	40,638	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2	2	368	40,545	0.0	
WELLTOWER INC	14	12	854	94,089	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	6	5	668	73,557	0.1	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	2	266	29,333	0.0	
REALTY INCOME CORP	9	8	524	57,720	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	3	3	253	27,929	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	4	3	343	37,866	0.0	
UDR INC	10	9	324	35,729	0.0	
VENTAS INC	13	11	765	84,264	0.1	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	38	32	356	39,216	0.0	
RAYONIER INC	5	—	—	—	—	
WEYERHAEUSER CO	21	27	845	93,047	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	17	15	1,559	171,669	0.2	
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	14	11	221	24,423	0.0	
VEREIT INC	37	32	302	33,316	0.0	
DUKE REALTY CORP	14	12	283	31,257	0.0	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	6	154	17,008	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	6	7	258	28,492	0.0	
EQUINIX INC	2	2	811	89,355	0.1	
COMMUNICATIONS SALES & LE	4	—	—	—	—	
CROWN CASTLE INTL CORP	—	11	1,059	116,600	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	14	12	860	94,748	0.1	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	22	20	535	59,002	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	31	26	390	43,010	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	6	5	184	20,312	0.0	
PLUM CREEK TIMBER CO	7	—	—	—	—	
PUBLIC STORAGE	6	5	1,301	143,332	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	12	10	2,127	234,195	0.2	
VORNADO REALTY TRUST	7	6	557	61,389	0.1	
KIMCO REALTY CORP	17	14	397	43,742	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5	4	866	95,444	0.1	
小 計	口 数	口 数	金 額	金 額		
	414	381	20,806	2,290,622		
	銘柄 数 < 比 率 >	34	35	—	< 2.0% >	
(カナダ)			千カナダドル			
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	—	2	79	6,646	0.0	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	5	4	86	7,255	0.0	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		6	5	158	13,374	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	11	12	324	27,276	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	3	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		1	1	154	19,036	0.0
KLEPIERRE		7	7	306	37,792	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		4	3	805	99,352	0.1
FONCIERE DES REGIONS		1	1	81	10,001	0.0
ICADE		1	1	75	9,300	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	15	14	1,423	175,483	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.2% >	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		39	34	251	40,419	0.0
HAMMERSON PLC		32	27	153	24,673	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		32	28	321	51,746	0.0
INTU PROPERTIES PLC		38	34	97	15,729	0.0
SEGRO PLC		30	26	109	17,655	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	173	151	934	150,225	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.1% >	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		61	123	407	32,439	0.0
SCENTRE GROUP		221	189	891	70,950	0.1
NOVION PROPERTY GROUP		88	—	—	—	—
GPT GROUP		70	65	345	27,515	0.0
MIRVAC GROUP		156	134	257	20,499	0.0
STOCKLAND		99	86	390	31,107	0.0
WESTFIELD CORP		82	70	737	58,756	0.1
DEXUS PROPERTY GROUP		39	35	305	24,314	0.0
GOODMAN GROUP		73	63	450	35,899	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	890	768	3,786	301,482	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	8	—	< 0.3% >	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		94	79	3,641	51,594	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	94	79	3,641	51,594	
	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		101	91	146	11,675	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		87	80	110	8,815	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		103	87	178	14,290	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		88	77	176	14,083	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	379	336	611	48,864	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.0% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	1,979	1,743	—	3,045,550	
	銘柄 数 < 比 率 >	60	61	—	< 2.7% >	

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

(注) 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	1,346	—
		SP/TSE60	67	—
		SWISS IX	70	—
		EURO ST	307	—
		SPI 200	74	—
		FTSE100	165	—
				百万円

(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

(2016年5月20日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
株式	109,001,635	95.3
投資証券	3,045,550	2.7
コール・ローン等、その他	2,350,513	2.0
投資信託財産総額	114,397,698	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（114,260,390千円）の投資信託財産総額（114,397,698千円）に対する比率は99.9%です。

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

1 アメリカドル=110.09円	1 カナダドル=84.13円	1 ユーロ=123.28円	1 イギリスポンド=160.73円
1 スイスフラン=111.03円	1 スウェーデンクローネ=13.18円	1 ノルウェークローネ=13.17円	1 デンマーククローネ=16.58円
1 オーストラリアドル=79.63円	1 ニュージールランドドル=74.43円	1 香港ドル=14.17円	1 シンガポールドル=79.85円
1 イスラエルシェゲル=28.47円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月20日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	114,567,704,891
コール・ローン等	1,345,336,375
株式(評価額)	109,001,635,166
投資証券(評価額)	3,045,550,194
未収入金	294,027,013
未収配当金	254,814,873
差入委託証拠金	626,341,270
(B) 負債	364,731,025
未払金	207,525,066
未払解約金	157,205,584
未払利息	162
その他未払費用	213
(C) 純資産総額(A-B)	114,202,973,866
元本	66,611,642,280
次期繰越損益金	47,591,331,586
(D) 受益権総口数	66,611,642,280口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,145円

<注記事項>

- ①期首元本額 79,173,628,594円
 期中追加設定元本額 11,761,805,506円
 期中一部解約元本額 24,323,791,820円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.7145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 ライフセレクトファンド(安定型)	330,014,840円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	1,292,335,372円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	1,164,998,999円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	2,477,065,925円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	12,696,753,102円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	11,191,695,429円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	193,813,124円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	386,082,104円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	744,745,443円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA(適格機関投資家限定)	36,132,317,138円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)VA(適格機関投資家限定)	118,264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)	1,702,540円
合計	66,611,642,280円

【お知らせ】

2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。(2015年7月1日)

○損益の状況 (2015年5月21日～2016年5月20日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	2,967,680,825
受取配当金	2,910,707,919
受取利息	△ 167,822
その他収益金	57,689,634
支払利息	△ 548,906
(B) 有価証券売買損益	△24,813,700,439
売買益	6,241,759,685
売買損	△31,055,460,124
(C) 先物取引等取引損益	△ 174,382,614
取引益	486,037,222
取引損	△ 660,419,836
(D) 保管費用等	△ 105,443,513
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△22,125,845,741
(F) 前期繰越損益金	81,730,103,163
(G) 追加信託差損益金	10,019,772,822
(H) 解約差損益金	△22,032,698,658
(I) 計(E+F+G+H)	47,591,331,586
次期繰越損益金(I)	47,591,331,586

(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 国内債券マザーファンド

《第16期》決算日2016年5月20日

[計算期間：2015年5月21日～2016年5月20日]

「三菱UFJ 国内債券マザーファンド」は、5月20日に第16期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマーク（NOMURA-BPI総合指数）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	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とし、外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合指数		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
12期(2012年5月21日)	12,405	3.0	341.171	3.0	99.4	0.1	280,753
13期(2013年5月20日)	12,518	0.9	344.269	0.9	99.0	0.6	316,364
14期(2014年5月20日)	12,874	2.8	354.058	2.8	99.4	—	290,123
15期(2015年5月20日)	13,192	2.5	362.715	2.4	99.3	—	256,631
16期(2016年5月20日)	14,075	6.7	386.993	6.7	99.3	0.3	219,902

(注) NOMURA-BPI総合指数とは、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、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI総合指数は野村証券株式会社の知的財産であり、各ファンドの運用成果に関し、野村証券株式会社は一切関係ありません。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準 価 額		NOMURA-BPI総合指数		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	率	騰 落 率	率		
(期 首) 2015年5月20日	円 13,192	% —	362.715	% —	% 99.3	% —
5月末	13,193	0.0	362.770	0.0	100.3	0.3
6月末	13,186	△0.0	362.542	△0.0	98.6	0.1
7月末	13,224	0.2	363.584	0.2	99.9	—
8月末	13,246	0.4	364.201	0.4	97.7	—
9月末	13,284	0.7	365.235	0.7	97.7	—
10月末	13,335	1.1	366.655	1.1	101.2	0.2
11月末	13,333	1.1	366.578	1.1	99.9	0.2
12月末	13,415	1.7	368.877	1.7	99.0	—
2016年1月末	13,582	3.0	373.520	3.0	97.3	—
2月末	13,814	4.7	379.830	4.7	97.9	—
3月末	13,924	5.5	382.913	5.6	100.5	0.3
4月末	14,047	6.5	386.253	6.5	99.7	0.3
(期 末) 2016年5月20日	14,075	6.7	386.993	6.7	99.3	0.3

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.7%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(6.7%)とほぼ同程度となりました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内債券市況

- ・原油価格など商品市況の下落を受けた期待インフレ率の低下や新興国を中心とした海外景気の先行きに対する懸念などから、債券市況は上昇（金利は低下）基調で推移し、2016年1月29日に日銀が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を決定したことから、債券市況は一段と上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
- ・ベンチマークであるNOMURA-BPI総合指数の構成銘柄を種別や年限など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6.7%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率 要因	銘柄選択 要因	その他の 要因	合計
ベンチマーク とのカイ離	0.0%程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

- ・公社債の実質の組入比率については、期を通じて概ね100%の水準で推移させ、ベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。そのため、期を通じて現金の保有による影響は軽微でした。
- ・ポートフォリオについては、主に層化抽出法に基づき運用を行い、ファンドとベンチマークの値動きや推定トラッキングエラーなどについてモニターし必要に応じて調整を図ることでベンチマークとの連動性を維持するよう努めました。結果、種別および年限構成比については、概ねベンチマーク並みとなっており、影響は軽微でした。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

- ・年限構成、種別構成、デュレーション（平均回収期間や金利感応度）、流動性などを考慮して選択した銘柄に分散投資しました。
- ・流動性の問題を勘案し、相対的に格付の低い社債への投資は見送りましたが、影響は軽微でした。

◎その他の要因

取引コストや基準価額とベンチマークの算出に用いる債券評価価格の差異の影響などにより、 $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

◎今後の運用方針

- ・ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を公社債（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持します。
- ・組入銘柄の見直しと投資比率の調整を適宜行い、種別構成比についてもベンチマークの比率に近づけるように運用します。

○1万口当たりの費用明細

(2015年5月21日～2016年5月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,465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

(2015年5月21日～2016年5月20日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 52,279,840	千円 89,673,403
	地方債証券	1,115,939	4,238,690
	特殊債券	1,415,305	6,020,189
	社債券	1,506,951	(419,559)
			4,451,059 (400,000)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	百万円 4,904	百万円 4,297	百万円 602	百万円 602
債券先物取引				

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月21日～2016年5月20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 56,318	百万円 18,303	% 32.5	百万円 104,383	百万円 35,239	% 33.8

(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 -	百万円 305	百万円 331

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 600

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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJリース、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2016年5月20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	156,554,000 (100,000)	178,095,596 (100,649)	81.0 (0.0)	— (—)	50.9 (—)	20.6 (0.0)	9.5 (—)
地方債証券	11,299,900 (11,299,900)	12,409,380 (12,409,380)	5.6 (5.6)	— (—)	3.5 (3.5)	1.9 (1.9)	0.2 (0.2)
特殊債券 (除く金融債)	14,004,337 (14,004,337)	15,462,010 (15,462,010)	7.0 (7.0)	— (—)	5.5 (5.5)	1.4 (1.4)	0.2 (0.2)
金融債券	2,030,000 (2,030,000)	2,041,508 (2,041,508)	0.9 (0.9)	— (—)	— (—)	0.6 (0.6)	0.4 (0.4)
普通社債券	9,821,000 (9,821,000)	10,380,161 (10,380,161)	4.7 (4.7)	— (—)	1.6 (1.6)	1.8 (1.8)	1.2 (1.2)
合 計	193,709,237 (37,255,237)	218,388,657 (40,393,709)	99.3 (18.4)	— (—)	61.6 (10.6)	26.3 (5.7)	11.5 (2.0)

(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	
国債証券	%	千円	千円	
第355回利付国債 (2年)	0.1	530,000	532,379	2017/8/15
第356回利付国債 (2年)	0.1	950,000	954,626	2017/9/15
第357回利付国債 (2年)	0.1	850,000	854,454	2017/10/15
第358回利付国債 (2年)	0.1	1,320,000	1,327,352	2017/11/15
第360回利付国債 (2年)	0.1	1,100,000	1,106,446	2018/1/15
第362回利付国債 (2年)	0.1	1,200,000	1,207,620	2018/3/15
第105回利付国債 (5年)	0.2	1,010,000	1,014,999	2017/6/20
第106回利付国債 (5年)	0.2	3,350,000	3,370,502	2017/9/20
第107回利付国債 (5年)	0.2	1,270,000	1,279,232	2017/12/20
第108回利付国債 (5年)	0.1	900,000	905,121	2017/12/20
第109回利付国債 (5年)	0.1	660,000	664,283	2018/3/20
第110回利付国債 (5年)	0.3	800,000	808,120	2018/3/20
第111回利付国債 (5年)	0.4	990,000	1,001,860	2018/3/20
第112回利付国債 (5年)	0.4	560,000	567,588	2018/6/20
第114回利付国債 (5年)	0.3	720,000	729,259	2018/9/20
第115回利付国債 (5年)	0.2	1,190,000	1,202,518	2018/9/20
第116回利付国債 (5年)	0.2	2,080,000	2,103,982	2018/12/20
第117回利付国債 (5年)	0.2	2,880,000	2,916,403	2019/3/20
第118回利付国債 (5年)	0.2	1,200,000	1,216,344	2019/6/20
第119回利付国債 (5年)	0.1	780,000	788,205	2019/6/20
第120回利付国債 (5年)	0.2	1,060,000	1,075,454	2019/9/20
第121回利付国債 (5年)	0.1	530,000	535,946	2019/9/20
第122回利付国債 (5年)	0.1	2,030,000	2,054,502	2019/12/20
第123回利付国債 (5年)	0.1	1,760,000	1,782,387	2020/3/20
第124回利付国債 (5年)	0.1	2,040,000	2,067,682	2020/6/20
第125回利付国債 (5年)	0.1	2,470,000	2,505,049	2020/9/20
第126回利付国債 (5年)	0.1	1,160,000	1,177,423	2020/12/20
第127回利付国債 (5年)	0.1	1,310,000	1,330,750	2021/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	210,000	340,080	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	245,000	385,240	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	305,000	483,684	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	420,000	671,592	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	440,000	679,747	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	410,000	623,388	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	410,000	598,870	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	450,000	612,535	2055/3/20
第286回利付国債 (10年)	1.8	130,000	132,883	2017/6/20
第287回利付国債 (10年)	1.9	870,000	890,236	2017/6/20
第288回利付国債 (10年)	1.7	740,000	759,299	2017/9/20
第289回利付国債 (10年)	1.5	1,610,000	1,654,677	2017/12/20
第290回利付国債 (10年)	1.4	190,000	195,719	2018/3/20
第291回利付国債 (10年)	1.3	230,000	236,502	2018/3/20
第292回利付国債 (10年)	1.7	480,000	497,083	2018/3/20
第293回利付国債 (10年)	1.8	895,000	933,144	2018/6/20
第294回利付国債 (10年)	1.7	270,000	280,945	2018/6/20

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295回利付国債 (10年)	1.5	730,000	756,550	2018/6/20
第296回利付国債 (10年)	1.5	1,620,000	1,685,934	2018/9/20
第297回利付国債 (10年)	1.4	760,000	792,087	2018/12/20
第298回利付国債 (10年)	1.3	950,000	987,648	2018/12/20
第299回利付国債 (10年)	1.3	810,000	845,194	2019/3/20
第300回利付国債 (10年)	1.5	100,000	104,913	2019/3/20
第301回利付国債 (10年)	1.5	620,000	653,306	2019/6/20
第302回利付国債 (10年)	1.4	680,000	714,421	2019/6/20
第303回利付国債 (10年)	1.4	1,470,000	1,550,306	2019/9/20
第304回利付国債 (10年)	1.3	520,000	546,665	2019/9/20
第305回利付国債 (10年)	1.3	830,000	875,616	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)	1.4	1,120,000	1,190,616	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)	1.3	455,000	481,931	2020/3/20
第308回利付国債 (10年)	1.3	810,000	860,787	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	1,270,000	1,339,176	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	1,200,000	1,263,936	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	590,000	616,278	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	1,890,000	2,014,040	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	90,000	96,666	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	580,000	617,311	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	1,080,000	1,158,980	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	500,000	534,000	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	580,000	621,423	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	700,000	746,221	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	790,000	849,099	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	150,000	160,374	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	720,000	772,027	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	170,000	181,281	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	320,000	342,166	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	980,000	1,041,857	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	990,000	1,054,775	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	220,000	233,503	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	500,000	534,025	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	1,290,000	1,363,259	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	870,000	933,423	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	1,110,000	1,192,961	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	620,000	657,119	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	1,810,000	1,921,369	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	1,300,000	1,381,536	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	1,680,000	1,787,352	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	2,090,000	2,208,252	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	740,000	782,801	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	1,210,000	1,258,387	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	1,280,000	1,342,937	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	1,940,000	2,036,262	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	2,320,000	2,436,069	2025/9/20

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341回利付国債 (10年)		0.3	1,730,000	1,800,376	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)		0.1	1,120,000	1,143,352	2026/3/20
第1回利付国債 (30年)		2.8	120,000	164,665	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)		2.4	170,000	225,613	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)		2.3	190,000	250,431	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)		2.9	125,000	176,513	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)		2.2	180,000	237,574	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)		2.4	170,000	230,708	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)		2.3	225,000	303,615	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)		1.8	160,000	203,816	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)		1.4	90,000	108,810	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)		1.1	263,000	305,245	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)		1.7	100,000	126,224	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)		2.1	205,000	272,965	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)		2.0	390,000	513,988	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)		2.4	380,000	527,949	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)		2.5	440,000	620,857	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)		2.5	345,000	488,295	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)		2.4	350,000	490,098	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)		2.3	360,000	498,484	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)		2.3	290,000	402,259	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)		2.5	260,000	370,578	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)		2.3	250,000	347,587	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)		2.5	285,000	408,031	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)		2.5	140,000	200,978	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)		2.5	250,000	359,847	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)		2.3	205,000	287,799	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)		2.4	510,000	727,734	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)		2.5	400,000	582,808	2037/6/20
第28回利付国債 (30年)		2.5	445,000	652,187	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)		2.4	470,000	682,952	2038/6/20
第30回利付国債 (30年)		2.3	585,000	842,095	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)		2.2	435,000	619,909	2039/6/20
第32回利付国債 (30年)		2.3	640,000	931,833	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)		2.0	653,000	910,869	2040/6/20
第34回利付国債 (30年)		2.2	625,000	906,662	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)		2.0	770,000	1,085,769	2041/6/20
第36回利付国債 (30年)		2.0	710,000	1,006,496	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)		1.9	650,000	909,291	2042/6/20
第38回利付国債 (30年)		1.8	535,000	737,877	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)		1.9	500,000	704,730	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)		1.8	430,000	595,906	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)		1.7	420,000	571,939	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)		1.7	450,000	614,137	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)		1.7	530,000	724,939	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)		1.7	490,000	670,844	2044/9/20

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
国債証券	%	千円	千円
第45回利付国債 (30年)	1.5	520,000	686,036
第46回利付国債 (30年)	1.5	630,000	831,650
第47回利付国債 (30年)	1.6	620,000	836,652
第48回利付国債 (30年)	1.4	670,000	868,655
第49回利付国債 (30年)	1.4	460,000	597,452
第50回利付国債 (30年)	0.8	410,000	462,943
第36回利付国債 (20年)	3.0	50,000	52,168
第37回利付国債 (20年)	3.1	250,000	261,175
第39回利付国債 (20年)	2.6	1,120,000	1,178,195
第40回利付国債 (20年)	2.3	290,000	307,191
第41回利付国債 (20年)	1.5	240,000	251,827
第42回利付国債 (20年)	2.6	835,000	902,242
第43回利付国債 (20年)	2.9	360,000	397,699
第44回利付国債 (20年)	2.5	710,000	784,429
第45回利付国債 (20年)	2.4	100,000	110,098
第47回利付国債 (20年)	2.2	100,000	110,552
第48回利付国債 (20年)	2.5	250,000	281,447
第49回利付国債 (20年)	2.1	170,000	189,196
第50回利付国債 (20年)	1.9	515,000	567,993
第51回利付国債 (20年)	2.0	140,000	155,996
第52回利付国債 (20年)	2.1	260,000	292,601
第53回利付国債 (20年)	2.1	80,000	90,501
第54回利付国債 (20年)	2.2	530,000	602,562
第55回利付国債 (20年)	2.0	240,000	271,514
第56回利付国債 (20年)	2.0	370,000	420,693
第57回利付国債 (20年)	1.9	160,000	180,937
第58回利付国債 (20年)	1.9	350,000	397,726
第59回利付国債 (20年)	1.7	590,000	665,354
第60回利付国債 (20年)	1.4	230,000	254,858
第61回利付国債 (20年)	1.0	260,000	281,967
第62回利付国債 (20年)	0.8	560,000	600,824
第63回利付国債 (20年)	1.8	275,000	314,690
第64回利付国債 (20年)	1.9	480,000	555,148
第65回利付国債 (20年)	1.9	430,000	499,264
第66回利付国債 (20年)	1.8	170,000	196,076
第67回利付国債 (20年)	1.9	80,000	93,238
第68回利付国債 (20年)	2.2	395,000	469,769
第69回利付国債 (20年)	2.1	120,000	141,762
第70回利付国債 (20年)	2.4	510,000	617,293
第71回利付国債 (20年)	2.2	200,000	238,802
第72回利付国債 (20年)	2.1	645,000	768,001
第73回利付国債 (20年)	2.0	200,000	237,354
第74回利付国債 (20年)	2.1	380,000	454,271
第75回利付国債 (20年)	2.1	230,000	276,018
第76回利付国債 (20年)	1.9	210,000	248,264
第77回利付国債 (20年)	2.0	260,000	309,696

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79回利付国債 (20年)	2.0	100,000	119,558	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	370,000	445,761	2025/6/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	620,000	749,815	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	182,000	220,816	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	410,000	493,476	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	230,000	280,052	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	532,000	658,323	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	170,000	208,680	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	460,000	571,766	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	130,000	160,264	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	470,000	581,874	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	80,000	99,876	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	650,000	800,702	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	230,000	281,915	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	260,000	321,521	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	490,000	619,605	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	120,000	149,061	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	330,000	415,044	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	340,000	423,745	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	555,000	693,922	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	370,000	468,723	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	450,000	580,765	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	360,000	466,570	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	320,000	410,848	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	90,000	113,366	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	270,000	341,147	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	190,000	242,419	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	30,000	38,017	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	510,000	633,445	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	620,000	772,526	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	100,000	127,170	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	170,000	219,038	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	650,000	828,997	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	310,000	396,486	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	680,000	872,079	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	270,000	349,922	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	215,000	279,603	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	560,000	720,552	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	314,000	400,971	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	430,000	537,039	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	160,000	195,340	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	430,000	544,311	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	310,000	387,992	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	530,000	688,210	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	330,000	423,726	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	270,000	355,406	2031/3/20

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126回利付国債 (20年)		2.0	330,000	424,677	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)		1.9	260,000	330,766	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)		1.9	610,000	777,670	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)		1.8	200,000	251,986	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)		1.8	610,000	770,015	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)		1.7	110,000	137,187	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)		1.7	270,000	337,545	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)		1.8	370,000	468,260	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)		1.8	380,000	482,117	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)		1.7	220,000	275,684	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)		1.6	260,000	321,744	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)		1.7	390,000	489,489	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)		1.5	150,000	183,511	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)		1.6	110,000	136,317	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)		1.7	880,000	1,106,177	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)		1.7	960,000	1,208,467	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)		1.6	490,000	609,574	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)		1.5	460,000	564,668	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)		1.7	1,000,000	1,262,240	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)		1.7	880,000	1,112,214	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)		1.6	730,000	911,251	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	690,000	850,211	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)		1.5	840,000	1,035,896	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)		1.4	790,000	960,126	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)		1.2	840,000	991,326	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	920,000	1,085,894	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)		1.3	910,000	1,091,899	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)		1.2	1,120,000	1,322,238	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)		1.0	710,000	811,643	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	540,000	554,250	2036/3/20
第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013)		0.67	100,000	100,649	2018/11/15
小	計		156,554,000	178,095,596	
地方債証券					
第5回東京都公募公債 (20年)		2.11	100,000	118,305	2025/3/19
第7回東京都公募公債 (20年)		2.16	100,000	119,579	2025/9/19
第7回東京都公募公債 (30年)		2.51	70,000	99,370	2038/9/17
第10回東京都公募公債 (30年)		2.31	100,000	139,305	2039/9/20
第25回東京都公募公債 (20年)		1.8	100,000	124,468	2031/12/19
第27回東京都公募公債 (20年)		1.68	100,000	123,276	2032/12/20
第655回東京都公募公債		1.42	30,000	30,769	2018/3/20
第682回東京都公募公債		1.32	100,000	105,096	2020/3/19
第700回東京都公募公債		1.02	100,000	105,295	2021/9/17
第718回東京都公募公債		0.6	100,000	103,891	2023/3/20
第719回東京都公募公債		0.86	200,000	211,324	2023/3/20
第3回東京都公募公債 (20年)		2.26	100,000	117,413	2024/3/19
平成20年度第12回北海道公募公債		1.72	50,000	52,183	2018/12/26

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
平成21年度第7回北海道公募公債	1.46	50,000	52,367	2019/9/25
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	80,000	83,228	2020/10/29
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	50,000	52,313	2022/10/31
第2回神奈川県公募公債(30年)	2.87	100,000	145,529	2036/6/20
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	143,433	2038/3/19
第155回神奈川県公募公債	1.61	60,000	62,008	2018/6/20
第196回神奈川県公募公債	0.678	100,000	104,565	2023/3/20
第5回大阪府公募公債(20年)	2.16	100,000	126,482	2030/5/28
第311回大阪府公募公債	1.68	50,000	51,442	2018/2/28
第313回大阪府公募公債	1.66	50,000	51,553	2018/4/27
第318回大阪府公募公債	1.7	14,000	14,540	2018/9/28
第322回大阪府公募公債	1.62	60,000	62,510	2019/1/29
第332回大阪府公募公債	1.58	50,000	52,659	2019/11/27
第335回大阪府公募公債	1.48	30,000	31,596	2020/2/25
第336回大阪府公募公債	1.46	50,000	52,686	2020/3/30
第342回大阪府公募公債	1.2	25,000	26,222	2020/9/29
第344回大阪府公募公債	1.06	21,000	21,908	2020/11/27
第346回大阪府公募公債	1.25	140,000	147,555	2021/1/28
第348回大阪府公募公債	1.32	50,000	53,065	2021/3/30
第358回大阪府公募公債	0.97	70,000	73,627	2022/2/28
平成20年度第3回京都府公募公債	1.57	20,200	21,011	2018/12/19
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	2.19	100,000	126,031	2029/9/20
平成22年度第2回京都府公募公債	1.16	40,000	42,008	2020/9/24
平成22年度第7回京都府公募公債	1.31	45,900	48,797	2021/3/22
平成23年度第2回京都府公募公債	1.2	66,000	69,960	2021/6/22
第2回兵庫県公募公債(30年)	2.36	50,000	69,741	2040/3/19
第5回兵庫県公募公債(15年)	1.31	100,000	113,314	2028/5/26
平成20年度第3回兵庫県公募公債	1.76	40,000	41,378	2018/5/22
平成21年度第35回兵庫県公募公債	1.46	40,000	42,069	2020/1/22
平成23年度第11回兵庫県公募公債	0.95	50,000	52,539	2022/1/27
平成24年度第18回兵庫県公募公債	0.77	100,000	104,575	2022/10/19
第3回静岡県公募公債(15年)	1.368	100,000	114,169	2027/10/29
第14回静岡県公募公債(20年)	1.736	100,000	123,936	2032/6/18
平成19年度第9回静岡県公募公債	1.53	50,000	51,412	2018/3/27
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	29,800	31,302	2023/10/24
平成20年度第8回愛知県公募公債(20年)	2.04	200,000	246,400	2028/12/20
平成21年度第6回愛知県公募公債	1.44	50,000	52,284	2019/7/30
平成21年度第10回愛知県公募公債	1.38	201,000	210,539	2019/10/30
平成22年度第5回愛知県公募公債	1.258	27,200	28,602	2020/6/30
平成23年度第11回愛知県公募公債	1.03	70,000	73,863	2021/10/28
平成23年度第20回愛知県公募公債	1.082	100,000	106,249	2022/3/29
平成24年度第13回愛知県公募公債	0.772	100,000	104,942	2022/11/30
平成19年度第4回広島県公募公債	1.53	29,300	30,110	2018/3/19
平成21年度第1回広島県公募公債	1.57	20,000	20,957	2019/5/28
平成22年度第3回広島県公募公債	1.08	45,000	47,153	2020/9/24
第8回埼玉県公募公債(20年)	2.19	100,000	126,195	2029/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第10回埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	124,770	2030/11/12
平成20年度第3回埼玉県公募公債	1.87	29,000	30,128	2018/6/25
平成21年度第8回埼玉県公募公債	1.3	12,000	12,565	2019/12/25
平成22年度第11回埼玉県公募公債	1.28	40,000	42,432	2021/2/25
平成23年度第1回埼玉県公募公債	1.37	100,000	106,785	2021/4/27
平成22年度第10回福岡県公募公債	1.36	50,000	53,230	2021/2/25
平成21年度第2回千葉県公募公債	1.57	80,000	83,766	2019/5/24
平成22年度第12回千葉県公募公債	1.28	80,000	84,865	2021/2/25
平成22年度第14回千葉県公募公債	1.33	80,000	85,136	2021/3/25
平成23年度第5回千葉県公募公債	1.06	80,000	84,610	2021/11/25
平成23年度第9回千葉県公募公債	1.0	80,000	84,606	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債	1.05	80,000	84,918	2022/4/25
平成21年度第1回新潟県公募公債	1.42	54,500	56,940	2019/7/29
平成21年度第2回新潟県公募公債	1.55	80,550	84,988	2019/11/27
平成22年度第1回岐阜県公募公債	1.21	42,000	44,226	2020/9/30
平成21年度第1回大分県公募公債	1.35	54,900	57,489	2019/10/31
第55回共同発行市場公募地方債	1.85	50,000	51,324	2017/10/25
第69回共同発行市場公募地方債	1.56	34,000	35,374	2018/12/25
第73回共同発行市場公募地方債	1.59	80,600	84,352	2019/4/25
第80回共同発行市場公募地方債	1.54	200,000	210,854	2019/11/25
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	50,000	52,383	2019/12/25
第84回共同発行市場公募地方債	1.38	20,000	21,057	2020/3/25
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	100,000	104,872	2020/9/25
第96回共同発行市場公募地方債	1.29	20,000	21,240	2021/3/25
第97回共同発行市場公募地方債	1.38	212,000	226,354	2021/4/23
第98回共同発行市場公募地方債	1.18	150,000	158,793	2021/5/25
第104回共同発行市場公募地方債	1.03	100,000	105,627	2021/11/25
第108回共同発行市場公募地方債	1.01	70,000	74,093	2022/3/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	200,000	210,274	2022/9/22
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	315,444	2022/11/25
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	105,681	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	105,017	2024/3/25
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	600,000	631,554	2024/4/25
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	200,000	208,194	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	205,702	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	200,000	207,864	2025/3/25
平成21年度第1回栃木県公募公債	1.55	100,000	105,451	2019/11/30
平成20年度第1回新潟市公募公債	1.56	34,190	35,568	2018/12/26
平成21年度第1回新潟市公募公債	1.34	94,450	99,027	2019/12/25
平成19年度第1回浜松市公募公債	1.81	82,390	84,651	2017/11/28
平成21年度第1回浜松市公募公債	1.54	33,900	35,756	2019/11/27
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	50,000	52,721	2019/11/25
平成22年度第8回大阪市公募公債	1.28	50,000	52,924	2021/1/25
平成22年度第10回大阪市公募公債	1.31	20,000	21,253	2021/3/17
平成26年度第7回大阪市公募公債	0.535	100,000	104,224	2024/11/28
第1回名古屋市公募公債(20年)	1.99	100,000	114,831	2023/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
第9回名古屋市公募公債(20年)		2.07	100,000	123,646	2028/12/20
第9回名古屋市公募公債(30年)		2.095	90,000	124,420	2042/9/19
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)		2.54	110,000	136,451	2026/6/19
平成23年度第5回神戸市公募公債		1.025	100,000	105,438	2021/10/19
第5回横浜市公募公債(20年)		2.17	100,000	119,537	2025/6/20
第7回横浜市公募公債(20年)		2.06	250,000	299,455	2025/12/19
平成24年度第4回横浜市公募公債		0.81	100,000	105,297	2023/2/20
第27回横浜市公募公債(20年)		1.599	40,000	48,844	2033/5/20
平成22年度第7回札幌市公募公債		1.05	50,000	52,310	2020/9/18
第7回川崎市公募公債(20年)		2.08	100,000	124,483	2029/7/17
平成19年度第5回福岡市公募公債		1.49	20,000	20,545	2018/3/28
平成20年度第5回福岡市公募公債		1.57	30,000	31,151	2018/10/24
平成20年度第8回福岡市公募公債		1.49	84,500	88,020	2019/3/25
平成22年度第9回福岡市公募公債		1.32	127,300	135,212	2021/3/25
平成23年度第6回福岡市公募公債		1.0	50,000	52,677	2021/10/28
平成24年度第1回福岡市公募公債(5年)		0.25	55,000	55,146	2017/6/26
平成24年度第4回福岡市公募公債		0.8	70,000	73,542	2022/10/31
平成20年度第1回広島市公募公債		1.56	50,000	51,997	2018/12/25
平成20年度第2回広島市公募公債		1.52	50,000	52,068	2019/2/25
平成22年度第6回広島市公募公債		1.21	50,000	53,016	2021/5/31
平成22年度第1回相模原市公募公債		1.29	60,000	63,517	2020/12/18
平成22年度第1回三重県公募公債		1.056	149,170	156,240	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債		1.021	117,600	124,140	2021/11/30
平成20年度第1回徳島県公募公債		1.73	130,300	136,025	2018/11/28
平成21年度第1回徳島県公募公債		1.55	36,500	38,514	2019/11/29
平成19年度第1回岡山県公募公債		1.72	60,650	62,235	2017/11/30
平成22年度第1回岡山県公募公債		1.05	50,000	52,403	2020/11/30
小	計		11,299,900	12,409,380	
特殊債券(除く金融債)					
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	100,000	109,103	2021/2/26
第9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	109,214	2021/3/26
第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	11,000	11,386	2018/9/28
第73回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	14,000	14,488	2019/1/30
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	100,000	103,577	2019/2/27
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	30,000	31,094	2019/3/19
第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	100,000	104,108	2019/4/30
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	200,000	209,292	2019/6/28
第85回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	124,000	129,544	2019/7/31
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	200,000	251,118	2029/10/31
第100回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	10,000	10,528	2020/2/28
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	100,000	126,729	2030/4/30
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	140,248	2040/5/31
第114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	124,251	2030/7/31
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	131,456	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	124,445	2030/9/30
第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.2	14,000	14,856	2021/6/30

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157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	200,000	210,648	2022/2/28
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	137,896	2042/2/28
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	200,000	210,738	2022/3/18
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.895	100,000	105,629	2022/6/30
第173回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.819	300,000	316,044	2022/9/30
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.791	300,000	315,615	2022/10/31
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.734	163,000	171,136	2022/12/28
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.834	200,000	211,464	2023/1/31
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.815	30,000	31,700	2023/2/28
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	355,065	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	106,459	2023/6/30
第197回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.835	101,000	107,268	2023/8/31
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	105,153	2024/3/29
第344回政府保証道路債券		1.6	100,000	106,626	2020/7/15
第11回政府保証東日本高速道路債券		1.6	50,000	51,425	2018/2/27
第13回政府保証東日本高速道路債券		1.6	80,000	83,074	2018/10/19
第14回政府保証東日本高速道路債券		1.4	80,000	82,874	2018/12/21
第12回政府保証日本政策投資銀行債券		2.1	100,000	110,712	2021/6/28
第1回政府保証公営企業債券(15年)		1.6	200,000	213,058	2020/6/22
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.5	200,000	209,150	2019/6/14
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.4	200,000	208,782	2019/7/12
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.3	31,000	32,330	2019/9/13
第5回政府保証公営企業債券(15年)		2.2	100,000	113,662	2022/7/15
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.3	14,000	14,495	2019/2/18
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.2	200,000	208,160	2019/10/18
第21回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.2	11,000	11,627	2021/2/15
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.3	20,000	21,247	2021/3/12
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.1	200,000	212,268	2021/12/14
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.9	35,000	36,875	2022/3/14
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.734	100,000	104,967	2022/12/16
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.815	38,000	40,144	2023/2/17
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.835	100,000	106,173	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.693	100,000	105,376	2023/12/18
第2回政府保証公営企業債券(15年)		2.1	100,000	110,310	2021/4/16
第25回政府保証日本政策金融公庫債券		0.815	100,000	105,660	2023/2/24
第16回政府保証民間都市開発債券		0.699	90,000	94,775	2023/10/20
第5回政府保証日本政策投資銀行		1.4	10,000	10,403	2019/4/15
第13回政府保証中部国際空港債券		1.3	72,000	76,518	2021/3/15
第16回政府保証西日本高速道路債券		1.6	75,000	77,972	2018/11/16
第17回政府保証西日本高速道路債券		1.3	75,000	77,607	2019/1/28
第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債)		2.23	30,000	36,788	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	161,567	2045/9/20
第17回道路債券(財投機関債)		1.54	150,000	164,725	2022/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.75	100,000	155,852	2047/3/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.67	110,000	168,934	2047/3/20
第31回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.56	100,000	102,474	2017/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第39回	日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.37	100,000	126,279	2028/9/20
第47回	日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.41	100,000	127,821	2029/4/20
第48回	日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.71	100,000	104,739	2019/3/20
第67回	日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.3	100,000	106,048	2021/3/19
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	122,658	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	106,322	2023/6/20
第3回	回営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	100,000	106,718	2023/3/22
第4回	回営企業債券(30年)(財投機関債)	2.95	100,000	143,982	2034/3/24
第5回	地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.22	100,000	126,181	2030/1/28
第7回	回営企業債券(20年)(財投機関債)	2.2	100,000	116,598	2024/3/22
第8回	回営企業債券(20年)(財投機関債)	2.25	100,000	116,988	2024/3/22
第12回	地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.38	100,000	105,359	2020/5/28
第13回	地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.278	100,000	105,049	2020/6/26
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	126,245	2031/1/28
第19回	地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.84	100,000	123,150	2031/12/26
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	121,323	2032/7/28
第36回	地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.892	200,000	210,220	2022/5/27
第41回	地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.801	200,000	209,716	2022/10/28
第44回	地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.791	200,000	209,958	2023/1/27
F131回	地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	70,000	82,873	2031/7/30
第1回	回営企業債券(20年)(財投機関債)	2.1	100,000	112,501	2022/6/20
第16回	回都市再生債券(財投機関債)	1.76	100,000	102,342	2017/9/20
第100回	回都市再生債券(財投機関債)	0.569	100,000	104,103	2024/11/20
第7回	本州四国連絡橋債券(財投機関債)	2.26	100,000	119,273	2025/6/20
第29回	福祉医療機構債券(財投機関債)	1.145	100,000	106,161	2021/12/20
第1回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	52,952	56,753	2042/5/10
第2回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	56,422	60,783	2042/6/10
第3回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.85	26,706	27,569	2036/9/10
第3回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	38,828	41,054	2036/5/10
第5回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	59,805	63,158	2036/11/10
第6回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	20,909	22,525	2037/5/10
第7回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	62,919	67,734	2037/5/10
第8回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	28,382	30,384	2042/12/10
第9回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.52	44,835	46,129	2037/12/10
第10回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	15,949	16,425	2038/2/10
第11回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	0.92	17,545	17,868	2038/6/10
第13回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	31,322	33,733	2043/5/10
第16回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.64	67,486	70,607	2032/11/10
第17回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.71	69,280	72,685	2032/11/10
第18回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.57	34,572	36,092	2032/11/10
第19回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8	19,211	20,117	2039/6/10
第23回	一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.6	100,000	128,661	2028/9/20
第29回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	46,434	50,143	2044/10/10
第31回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	26,809	28,291	2040/6/10
第31回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	48,555	52,239	2044/12/10
第32回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	29,093	30,719	2040/7/10

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36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	113,056	121,095	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.71	112,682	120,202	2045/6/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	52,124	55,291	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	65,596	69,079	2045/9/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	52,264	56,640	2041/5/10
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.3	49,670	53,859	2041/7/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	214,980	231,761	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	132,970	143,090	2046/2/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	128,572	139,150	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	64,274	69,120	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	64,107	68,652	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	68,941	73,864	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.18	55,758	60,342	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	71,981	76,732	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	73,005	77,740	2046/10/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	76,428	81,327	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	76,918	81,881	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	77,502	82,072	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.26	154,424	163,249	2047/6/10
第63回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.358	100,000	106,004	2020/12/18
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	243,672	255,845	2047/11/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	87,869	92,129	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	176,722	185,004	2049/5/10
第86回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.046	100,000	105,349	2021/9/17
第87回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.53	100,000	113,997	2026/9/18
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	123,434	2031/11/18
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	184,808	192,048	2049/11/10
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	248,550	2032/4/16
第17回国際協力機構債券(財投機関債)		0.72	30,000	31,293	2022/12/26
第3回中日本高速道路		1.92	100,000	102,568	2017/9/20
第13回中日本高速道路		1.49	100,000	105,191	2019/12/20
第38回中日本高速道路		0.677	100,000	101,767	2019/2/28
第21回西日本高速道路		0.754	100,000	105,205	2023/12/20
第17回東京都住宅供給公社債券		1.17	100,000	105,308	2021/9/17
小	計		14,004,337	15,462,010	
金融債券					
い第749号農林債券		0.3	100,000	100,417	2017/10/27
い第752号農林債券		0.3	200,000	200,934	2018/1/26
い第755号農林債券		0.3	100,000	100,484	2018/4/27
い第758号農林債券		0.4	100,000	100,764	2018/7/27
い第760号農林債券		0.4	100,000	100,811	2018/9/27
い第761号農林債券		0.3	100,000	100,583	2018/10/26
い第765号農林債券		0.3	200,000	201,328	2019/2/27
い第769号農林債券		0.3	130,000	131,008	2019/6/27
い第774号農林債券		0.24	100,000	100,628	2019/11/27
い第778号農林債券		0.25	300,000	302,253	2020/3/27

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
金融債券		%	千円	千円	
第274回信中金債		0.3	100,000	100,401	2017/9/27
第288回信中金債		0.3	200,000	201,258	2018/11/27
第178号商工債券（3年）		0.15	300,000	300,639	2017/11/27
小 計			2,030,000	2,041,508	
普通社債券					
第459回東京電力		2.7	20,000	21,221	2019/1/29
第522回東京電力		2.06	100,000	100,521	2016/8/31
第526回東京電力		1.78	100,000	101,525	2017/5/31
第532回東京電力		1.75	30,000	30,574	2017/9/28
第536回東京電力		1.672	100,000	102,232	2018/1/29
第542回東京電力		1.602	100,000	102,392	2018/4/25
第548回東京電力		2.347	100,000	112,266	2028/9/29
第559回東京電力		1.377	140,000	144,095	2019/10/29
第497回中部電力		0.986	100,000	103,610	2020/10/23
第499回中部電力		1.194	50,000	53,439	2023/6/23
第410回関西電力		2.0	100,000	104,572	2018/11/22
第460回関西電力		1.77	100,000	102,636	2017/12/20
第478回関西電力		1.448	100,000	104,580	2020/1/24
第365回中国電力		1.405	100,000	104,605	2019/12/25
第287回北陸電力		2.01	50,000	51,082	2017/6/23
第288回北陸電力		1.89	30,000	30,799	2017/10/25
第297回北陸電力		0.976	20,000	20,713	2020/10/23
第431回東北電力		2.05	80,000	82,844	2018/3/23
第432回東北電力		2.09	20,000	20,005	2016/5/25
第267回四国電力		1.89	100,000	105,943	2019/9/25
第400回九州電力		1.777	70,000	74,317	2020/4/24
第409回九州電力		1.483	100,000	104,308	2019/8/23
第296回北海道電力		2.027	100,000	103,938	2018/6/25
第315回北海道電力		0.82	100,000	101,290	2018/4/25
第316回北海道電力		1.164	100,000	103,900	2020/6/25
第319回北海道電力		0.514	100,000	101,131	2019/9/25
第16回沖縄電力		1.83	70,000	71,373	2017/6/20
第26回関西国際空港		1.156	100,000	104,802	2020/9/18
第15回成田国際空港		0.739	100,000	105,124	2024/2/20
第11回セブン&アイ・ホールディングス		0.514	200,000	204,318	2022/6/20
第3回富士フイルムホールディングス		0.882	100,000	104,907	2022/12/2
第19回豊田自動織機		1.109	100,000	105,348	2021/9/17
第12回パナソニック		0.387	100,000	100,935	2020/3/19
第1回B号日本生命2011基金		1.12	100,000	101,103	2017/8/5
第1回明治安田生命2014基金		0.51	100,000	101,028	2019/8/7
第78回三菱商事		1.155	100,000	105,620	2022/3/9
第79回三菱商事		1.022	100,000	104,991	2022/5/20
第3回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）		2.26	100,000	103,669	2018/3/2
第7回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）		2.5	200,000	213,866	2019/6/3
第8回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）		1.62	100,000	107,200	2021/10/29
第10回みずほコーポレート銀行		1.945	100,000	102,751	2017/10/27

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33回みずほコーポレート銀行	0.41	400,000	402,640	2018/4/20
第12回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	2.16	100,000	102,471	2017/7/28
第88回三菱東京UFJ銀行	2.34	100,000	121,834	2027/4/20
第6回りそな銀行(劣後特約付)	2.084	100,000	106,936	2020/3/4
第9回三菱UFJ信託銀行(劣後特約付)	1.68	100,000	107,143	2021/4/28
第12回住友信託銀行(劣後特約付)	1.373	100,000	104,999	2020/11/11
第15回住友信託銀行(劣後特約付)	1.62	100,000	107,842	2022/3/22
第11回三井住友銀行(劣後特約付)	2.17	100,000	103,235	2017/12/20
第17回三井住友銀行(劣後特約付)	2.8	200,000	214,434	2019/2/12
第20回三井住友銀行(劣後特約付)	2.21	100,000	106,537	2019/7/24
第22回三井住友銀行(劣後特約付)	1.43	100,000	105,269	2020/9/28
第23回三井住友銀行(劣後特約付)	1.61	100,000	106,375	2020/12/17
第57回三井住友銀行	0.28	100,000	100,381	2017/10/20
第18回みずほ銀行(劣後特約付)	2.14	100,000	116,418	2026/9/11
第19回みずほ銀行(劣後特約付)	1.67	100,000	107,695	2022/2/24
第28回日産フィナンシャルサービス	0.253	100,000	100,397	2019/6/20
第69回トヨタファイナンス	0.02	100,000	99,962	2019/4/26
第52回日立キャピタル	0.508	100,000	101,636	2021/6/18
第9回三井住友ファイナンス&リース	0.518	100,000	101,579	2021/1/29
第14回三井住友ファイナンス&リース	0.321	100,000	100,712	2020/10/30
第8回野村ホールディングス	2.12	100,000	102,535	2017/8/14
第10回野村ホールディングス	1.91	100,000	102,798	2017/11/27
第23回野村ホールディングス	1.808	100,000	106,637	2020/6/24
第24回野村ホールディングス	2.329	100,000	116,653	2025/6/24
第2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回	1.98	100,000	103,674	2018/6/20
第72回三菱地所	2.28	100,000	116,596	2024/9/20
第80回三菱地所	2.305	100,000	120,203	2027/3/19
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	105,114	2021/9/17
第15回東日本旅客鉄道	2.65	20,000	22,192	2020/8/25
第19回東日本旅客鉄道	2.36	100,000	113,190	2022/2/25
第32回東日本旅客鉄道	2.26	100,000	116,866	2024/3/19
第34回東日本旅客鉄道	2.53	100,000	119,480	2024/6/20
第43回東日本旅客鉄道	1.86	100,000	108,149	2020/12/18
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	132,838	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道	2.28	100,000	112,901	2022/3/25
第27回西日本旅客鉄道	1.36	100,000	105,202	2020/6/11
第6回東海旅客鉄道	2.39	21,000	23,792	2022/2/15
第42回東海旅客鉄道	2.312	100,000	126,136	2029/4/24
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	120,902	2030/10/25
第63回日本電信電話	0.69	200,000	208,368	2023/3/20
第19回KDDI	1.151	100,000	104,206	2020/6/19
第21回KDDI	0.669	100,000	103,826	2024/9/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	104,636	2023/9/20
第8回電源開発	2.11	100,000	115,077	2024/12/20
第23回東京ガス	1.01	100,000	106,484	2023/6/9
第4回ファーストリテイリング	0.749	100,000	104,031	2025/12/18

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20回GEキャピタルコーポレーション	2.885	100,000	105,390	2018/5/29
第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.32	200,000	201,716	2017/2/9
第6回ナショナル・オーストラリア銀行	1.03	100,000	100,134	2016/7/8
第8回ナショナル・オーストラリア銀行	1.3	100,000	100,768	2017/1/20
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	100,681	2020/1/16
第8回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.407	100,000	100,971	2019/5/2
第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション	1.2	100,000	100,844	2017/3/9
第18回ラボバンク・ネダーランド	0.778	100,000	100,928	2017/11/2
第23回ラボバンク・ネダーランド	0.557	100,000	101,226	2018/12/19
第27回ラボバンク・ネダーランド	0.38	100,000	100,946	2020/5/22
小 計		9,821,000	10,380,161	
合 計		193,709,237	218,388,657	

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 607	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2016年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	218,388,657	99.1
コール・ローン等、その他	2,060,126	0.9
投資信託財産総額	220,448,783	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	220,448,783,747
コール・ローン等	1,151,083,926
公社債(評価額)	218,388,657,037
未収入金	281,589,100
未収利息	617,374,535
前払費用	5,859,149
差入委託証拠金	4,220,000
(B) 負債	546,120,829
未払金	184,320
未払解約金	545,933,508
未払利息	1,873
その他未払費用	1,128
(C) 純資産総額(A-B)	219,902,662,918
元本	156,236,987,608
次期繰越損益金	63,665,675,310
(D) 受益権総口数	156,236,987,608口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,075円

<注記事項>

- ①期首元本額 194,532,901,496円
 期中追加設定元本額 35,141,302,845円
 期中一部解約元本額 73,437,216,733円
 また、1口当たり純資産額は、期末14,075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 ライフセレクトファンド(安定型)	3,474,461,523円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	4,013,687,275円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	995,870,644円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	26,078,973,744円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	39,433,106,342円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	9,566,943,379円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	243,447,663円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	156,299,901円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	2,131,354,864円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,966,065,487円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	8,402,293,348円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	59,767,950,667円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)VA(適格機関投資家限定)	1,245,106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)	5,287,665円
合計	156,236,987,608円

【お知らせ】

2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。(2015年7月1日)

○損益の状況 (2015年5月21日～2016年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,740,172,135
受取利息	2,740,257,904
支払利息	△ 85,769
(B) 有価証券売買損益	12,364,381,209
売買益	12,878,060,435
売買損	△ 513,679,226
(C) 先物取引等取引損益	△ 335,600
取引益	3,727,600
取引損	△ 4,063,200
(D) 保管費用等	△ 1,128
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	15,104,216,616
(F) 前期繰越損益金	62,098,845,367
(G) 追加信託差損益金	11,927,318,479
(H) 解約差損益金	△25,464,705,152
(I) 計(E+F+G+H)	63,665,675,310
次期繰越損益金(I)	63,665,675,310

(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 外国債券マザーファンド

《第16期》決算日2016年5月20日

[計算期間：2015年5月21日～2016年5月20日]

「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」は、5月20日に第16期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	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（シティ世界国債インデックス（除く日本、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。
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	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とし、外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		シティ世界国債インデックス (除く日本、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
12期(2012年5月21日)	17,164	△ 0.4	291.3347	△ 0.4	98.8	—	204,958
13期(2013年5月20日)	23,300	35.7	396.6181	36.1	98.9	—	238,488
14期(2014年5月20日)	24,305	4.3	412.1913	3.9	98.7	—	174,867
15期(2015年5月20日)	27,492	13.1	466.3665	13.1	98.8	—	128,186
16期(2016年5月20日)	25,716	△ 6.5	436.8953	△ 6.3	98.7	—	73,559

(注) シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、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。

(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		シティ世界国債インデックス (除く日本、 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) 2015年5月20日	円	%		%	%	%
5月末	27,492	—	466.3665	—	98.8	—
6月末	27,995	1.8	477.0137	2.3	98.8	—
7月末	27,567	0.3	468.9247	0.5	98.6	—
8月末	27,947	1.7	475.9564	2.1	98.7	—
9月末	27,512	0.1	467.1813	0.2	98.0	—
10月末	27,440	△0.2	465.8771	△0.1	98.8	—
11月末	27,460	△0.1	467.3170	0.2	98.7	—
12月末	27,440	△0.2	467.1041	0.2	98.6	—
2016年1月末	27,060	△1.6	459.3212	△1.5	98.7	—
2月末	27,477	△0.1	459.2838	△1.5	97.9	—
3月末	26,073	△5.2	444.8363	△4.6	98.2	—
4月末	26,542	△3.5	451.2808	△3.2	98.8	—
(期 末) 2016年5月20日	25,684	△6.6	443.0580	△5.0	99.3	—
	25,716	△6.5	436.8953	△6.3	98.7	—

(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

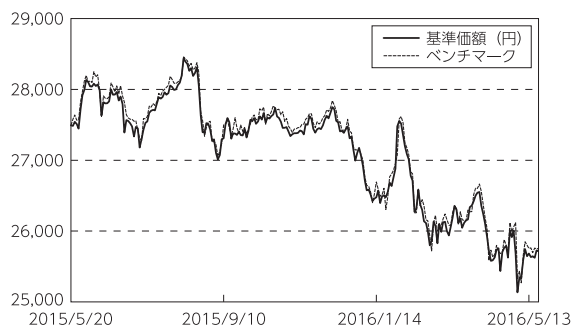
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−6.3%)を0.2%下回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国債券市況

- ・先進国の債券市況は、世界的な景気減速懸念や原油をはじめとする商品市況の悪化によるインフレ期待の低下などを背景に上昇しました。

◎為替市況

- ・円・ドル相場は、FRB（米連邦準備制度理事会）による政策金利の引き上げが意識されてドルが対円で上昇する局面もありましたが、世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景にドルが対円で売られました。期首との比較では、ドルは対円で9.0%下落しました。
- ・円・ユーロ相場は、ユーロ圏の景況感の改善などを背景に上昇する局面もありましたが、ECB（欧州中央銀行）が緩和的な金融政策を維持したことなどを背景に、ユーロが対円で売られました。期首との比較では、ユーロは対円で8.4%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シティ世界国債インデックス（除く日本、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。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは6.3%の下落となったため、乖離は△0.2%程度となりました。

	ポートフォリオ 要因	管理コスト等 要因	評価時価差異 に基づく要因	合計
ベンチマーク との乖離	△0.0%程度	△0.0%程度	△0.1%程度	△0.2%程度

（注）四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は△0.0%程度でした。

- ・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。

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は△0.0%程度でした。

- ・カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は△0.1%程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。
為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。
債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

○今後の運用方針

- ・今後の運用についても、運用方針を堅持します。
- ・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

(2015年5月21日～2016年5月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 9	% 0.033	(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)	(9)	(0.033)	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	9	0.033	
期中の平均基準価額は、27,183円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年5月21日～2016年5月20日)

公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカドル 110,713	千アメリカドル 271,940
	カナダ	千カナダドル 3,839	千カナダドル 16,264
	メキシコ	千メキシコペソ 23,784	千メキシコペソ 82,387
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 10,160	38,773
	イタリア	国債証券 11,509	46,337
	フランス	国債証券 11,635	43,941
	オランダ	国債証券 2,223	12,146
	スペイン	国債証券 6,667	25,125
	ベルギー	国債証券 2,747	11,719
	オーストリア	国債証券 1,860	7,773
	フィンランド	国債証券 219	2,167
	アイルランド	国債証券 110	2,710
	イギリス	国債証券 6,260	千イギリスポンド 28,377
	スイス	国債証券 90	千スイスフラン 1,343
	国	スウェーデン	千スウェーデンクローネ 5,068
ノルウェー		千ノルウェークローネ 3,019	千ノルウェークローネ 9,934
デンマーク		千デンマーククローネ 3,823	千デンマーククローネ 23,208
ポーランド		千ポーランドズロチ 4,090	千ポーランドズロチ 11,030
オーストラリア		千オーストラリアドル 4,072	千オーストラリアドル 11,495
シンガポール		千シンガポールドル 593	千シンガポールドル 2,553
マレーシア		千マレーシアリンギット 1,781	千マレーシアリンギット 9,790
南アフリカ		千南アフリカランド 8,332	千南アフリカランド 28,025

(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

(2015年5月21日～2016年5月20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 3,836	% 65.3		百万円 41,821	% 76.6	

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東京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

(2016年5月20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 270,600	千アメリカドル 282,904	千円 31,144,976	% 42.3	% —	% 17.2	% 17.0	% 8.2
カナダ	千カナダドル 15,600	千カナダドル 17,645	1,484,480	2.0	—	1.0	0.6	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 101,300	千メキシコペソ 111,846	668,839	0.9	—	0.6	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	36,480	43,972	5,420,943	7.4	—	4.3	2.1	1.0
イタリア	48,900	58,331	7,191,094	9.8	—	6.1	2.6	1.1
フランス	47,200	58,002	7,150,540	9.7	—	6.0	2.9	0.7
オランダ	11,750	14,245	1,756,137	2.4	—	1.5	0.6	0.3
スペイン	27,500	32,512	4,008,144	5.4	—	3.1	1.7	0.6
ベルギー	11,800	15,280	1,883,804	2.6	—	1.9	0.4	0.3
オーストリア	7,550	9,149	1,127,970	1.5	—	1.0	0.4	0.1
フィンランド	3,150	3,631	447,666	0.6	—	0.3	0.2	0.1
アイルランド	4,050	4,761	587,036	0.8	—	0.4	0.4	0.1
イギリス	千イギリスポンド 29,820	千イギリスポンド 36,454	5,859,411	8.0	—	5.7	1.7	0.5
スイス	千スイスフラン 1,480	千スイスフラン 1,765	195,968	0.3	—	0.1	0.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 23,600	千スウェーデンクローネ 27,355	360,539	0.5	—	0.3	0.2	0.0
ノルウェー	千ノルウェーカローネ 15,350	千ノルウェーカローネ 16,692	219,836	0.3	—	0.2	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 23,250	千デンマーククローネ 29,716	492,702	0.7	—	0.5	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 14,300	千ポーランドズロチ 15,199	424,834	0.6	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 14,650	千オーストラリアドル 16,238	1,293,106	1.8	—	1.0	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 3,040	千シンガポールドル 3,199	255,501	0.3	—	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 12,100	千マレーシアリンギット 12,199	329,762	0.4	—	0.2	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 48,200	千南アフリカランド 42,462	295,964	0.4	—	0.3	0.1	0.0
合 計	—	—	72,599,265	98.7	—	52.1	32.5	14.1

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	0.5 T-NOTE 170731	0.5	1,900	1,894	208,525	2017/7/31
	0.625 T-NOTE 170531	0.625	3,400	3,397	374,013	2017/5/31
	0.625 T-NOTE 170731	0.625	500	499	54,956	2017/7/31
	0.625 T-NOTE 170831	0.625	2,800	2,794	307,661	2017/8/31
	0.625 T-NOTE 170930	0.625	1,600	1,596	175,751	2017/9/30
	0.625 T-NOTE 171130	0.625	1,200	1,196	131,690	2017/11/30
	0.625 T-NOTE 180430	0.625	700	696	76,677	2018/4/30
	0.75 T-NOTE 170630	0.75	2,400	2,400	264,267	2017/6/30
	0.75 T-NOTE 171031	0.75	2,300	2,297	252,979	2017/10/31
	0.75 T-NOTE 171231	0.75	1,200	1,198	131,911	2017/12/31
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	1,500	1,497	164,806	2018/2/28
	0.75 T-NOTE 180331	0.75	400	399	43,934	2018/3/31
	0.75 T-NOTE 180415	0.75	500	498	54,903	2018/4/15
	0.875 T-NOTE 170430	0.875	2,100	2,104	231,667	2017/4/30
	0.875 T-NOTE 170515	0.875	3,000	3,005	330,927	2017/5/15
	0.875 T-NOTE 170615	0.875	1,100	1,101	121,292	2017/6/15
	0.875 T-NOTE 170715	0.875	500	500	55,122	2017/7/15
	0.875 T-NOTE 170815	0.875	900	901	99,220	2017/8/15
	0.875 T-NOTE 171015	0.875	2,000	2,001	220,386	2017/10/15
	0.875 T-NOTE 171115	0.875	400	400	44,065	2017/11/15
	0.875 T-NOTE 180131	0.875	1,200	1,200	132,144	2018/1/31
	0.875 T-NOTE 181015	0.875	2,400	2,395	263,689	2018/10/15
	0.875 T-NOTE 190415	0.875	1,500	1,492	164,341	2019/4/15
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	200	198	21,879	2019/7/31
	1 T-NOTE 170915	1.0	500	501	55,201	2017/9/15
	1 T-NOTE 171215	1.0	300	300	33,108	2017/12/15
	1 T-NOTE 180315	1.0	200	200	22,065	2018/3/15
	1 T-NOTE 180815	1.0	700	700	77,168	2018/8/15
	1 T-NOTE 180915	1.0	2,300	2,302	253,493	2018/9/15
	1 T-NOTE 190630	1.0	700	698	76,924	2019/6/30
	1 T-NOTE 190831	1.0	700	697	76,804	2019/8/31
	1 T-NOTE 190930	1.0	700	697	76,786	2019/9/30
	1 T-NOTE 191130	1.0	900	895	98,601	2019/11/30
	1.125 T-NOTE 180615	1.125	1,200	1,205	132,701	2018/6/15
	1.125 T-NOTE 190531	1.125	100	100	11,035	2019/5/31
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,000	998	109,926	2019/12/31
	1.125 T-NOTE 200331	1.125	900	897	98,813	2020/3/31
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	2,200	2,176	239,605	2021/2/28
	1.25 T-NOTE 181031	1.25	300	302	33,251	2018/10/31
	1.25 T-NOTE 181115	1.25	2,300	2,315	254,918	2018/11/15
	1.25 T-NOTE 181130	1.25	800	805	88,670	2018/11/30
	1.25 T-NOTE 181215	1.25	1,300	1,308	144,084	2018/12/15
	1.25 T-NOTE 190131	1.25	2,000	2,013	221,624	2019/1/31
	1.25 T-NOTE 190430	1.25	800	805	88,629	2019/4/30

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					
	1.25 T-NOTE 191031	1.25	900	903	99,452	2019/10/31
	1.25 T-NOTE 200131	1.25	1,500	1,503	165,522	2020/1/31
	1.25 T-NOTE 200229	1.25	100	100	11,031	2020/2/29
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	1,300	1,292	142,289	2021/3/31
	1.375 T-NOTE 180731	1.375	1,300	1,312	144,514	2018/7/31
	1.375 T-NOTE 180930	1.375	2,700	2,726	300,192	2018/9/30
	1.375 T-NOTE 181130	1.375	1,100	1,111	122,314	2018/11/30
	1.375 T-NOTE 181231	1.375	1,400	1,413	155,649	2018/12/31
	1.375 T-NOTE 190228	1.375	1,700	1,716	189,002	2019/2/28
	1.375 T-NOTE 200131	1.375	800	805	88,705	2020/1/31
	1.375 T-NOTE 200229	1.375	1,500	1,509	166,167	2020/2/29
	1.375 T-NOTE 200331	1.375	1,900	1,911	210,412	2020/3/31
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	1,900	1,910	210,314	2020/4/30
	1.375 T-NOTE 200831	1.375	600	601	66,244	2020/8/31
	1.375 T-NOTE 200930	1.375	2,400	2,405	264,855	2020/9/30
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	3,100	3,106	341,945	2020/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	2,100	2,101	231,315	2021/1/31
	1.5 T-NOTE 180831	1.5	1,000	1,012	111,517	2018/8/31
	1.5 T-NOTE 181231	1.5	1,500	1,519	167,328	2018/12/31
	1.5 T-NOTE 190131	1.5	2,300	2,330	256,569	2019/1/31
	1.5 T-NOTE 190228	1.5	1,500	1,520	167,354	2019/2/28
	1.5 T-NOTE 190331	1.5	900	912	100,451	2019/3/31
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	1,700	1,722	189,645	2019/5/31
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	1,800	1,822	200,592	2019/10/31
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	500	506	55,713	2019/11/30
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	1,900	1,917	211,148	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	400	399	44,032	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	1,100	1,089	119,888	2023/3/31
	1.625 T-NOTE 190331	1.625	1,300	1,321	145,532	2019/3/31
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	1,400	1,423	156,738	2019/4/30
	1.625 T-NOTE 190630	1.625	1,900	1,932	212,782	2019/6/30
	1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,400	1,423	156,762	2019/7/31
	1.625 T-NOTE 190831	1.625	3,400	3,457	380,666	2019/8/31
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,300	1,321	145,431	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,800	1,823	200,731	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	600	602	66,286	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	2,200	2,202	242,425	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	1,100	1,076	118,554	2026/2/15
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	1,100	1,121	123,416	2018/10/31
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	500	510	56,188	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	1,500	1,527	168,140	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	300	303	33,457	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	1,400	1,417	156,064	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	1,200	1,214	133,687	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,400	1,417	156,040	2022/5/15

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ	国債証券					
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,400	1,412	155,534	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	1,300	1,309	144,134	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	2,100	2,113	232,688	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 170831	1.875	1,500	1,521	167,450	2017/8/31
	1.875 T-NOTE 170930	1.875	1,700	1,724	189,879	2017/9/30
	1.875 T-NOTE 171031	1.875	1,700	1,725	189,982	2017/10/31
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	2,900	2,971	327,130	2020/6/30
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	700	715	78,724	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	100	101	11,215	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,300	1,322	145,599	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	1,400	1,423	156,666	2022/10/31
	2 T-NOTE 200731	2.0	900	926	101,976	2020/7/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	1,000	1,029	113,332	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	800	823	90,617	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	800	823	90,652	2021/2/28
	2 T-NOTE 210531	2.0	1,700	1,749	192,650	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,300	1,336	147,170	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	1,200	1,233	135,792	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2.0	1,500	1,542	169,856	2021/11/15
	2 T-NOTE 220215	2.0	1,400	1,438	158,376	2022/2/15
	2 T-NOTE 220731	2.0	1,800	1,845	203,177	2022/7/31
	2 T-NOTE 221130	2.0	1,300	1,330	146,482	2022/11/30
	2 T-NOTE 230215	2.0	3,900	3,992	439,581	2023/2/15
	2 T-NOTE 250215	2.0	2,600	2,640	290,728	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	3,700	3,751	413,029	2025/8/15
	2.125 T-NOTE 200831	2.125	1,600	1,654	182,157	2020/8/31
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	100	103	11,391	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,400	1,449	159,568	2021/6/30
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	2,000	2,069	227,869	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,200	1,241	136,659	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	800	827	91,078	2021/12/31
	2.125 T-NOTE 220630	2.125	2,400	2,480	273,071	2022/6/30
	2.125 T-NOTE 221231	2.125	500	515	56,769	2022/12/31
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	3,000	3,075	338,604	2025/5/15
	2.25 T-NOTE 171130	2.25	900	919	101,217	2017/11/30
	2.25 T-NOTE 180731	2.25	1,200	1,234	135,926	2018/7/31
	2.25 T-NOTE 210331	2.25	200	208	22,922	2021/3/31
	2.25 T-NOTE 210430	2.25	1,600	1,666	183,437	2021/4/30
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	2,000	2,073	228,230	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	3,500	3,621	398,650	2025/11/15
	2.375 T-NOTE 170731	2.375	1,600	1,630	179,515	2017/7/31
	2.375 T-NOTE 180531	2.375	300	308	34,007	2018/5/31
	2.375 T-NOTE 180630	2.375	100	103	11,343	2018/6/30
	2.375 T-NOTE 201231	2.375	2,100	2,196	241,809	2020/12/31
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	2,200	2,303	253,569	2024/8/15

銘柄		当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	2.5 T-BOND 450215	2.5	2,650	2,577	283,784	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	900	874	96,232	2046/2/15
	2.5 T-NOTE 170630	2.5	1,800	1,835	202,024	2017/6/30
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	2,200	2,325	255,973	2023/8/15
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	2,100	2,219	244,355	2024/5/15
	2.625 T-NOTE 180131	2.625	1,000	1,029	113,328	2018/1/31
	2.625 T-NOTE 180430	2.625	700	723	79,657	2018/4/30
	2.625 T-NOTE 200815	2.625	2,200	2,320	255,481	2020/8/15
	2.625 T-NOTE 201115	2.625	1,200	1,267	139,513	2020/11/15
	2.75 T-BOND 420815	2.75	600	619	68,205	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	1,400	1,442	158,809	2042/11/15
	2.75 T-NOTE 170531	2.75	1,300	1,327	146,124	2017/5/31
	2.75 T-NOTE 171231	2.75	500	515	56,722	2017/12/31
	2.75 T-NOTE 180228	2.75	1,000	1,033	113,766	2018/2/28
	2.75 T-NOTE 190215	2.75	1,000	1,047	115,349	2019/2/15
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	2,400	2,579	284,011	2023/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	1,700	1,827	201,233	2024/2/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	2,800	2,949	324,724	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	1,400	1,469	161,735	2045/8/15
	2.875 T-NOTE 180331	2.875	500	518	57,081	2018/3/31
	3 T-BOND 420515	3.0	100	108	11,927	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	2,300	2,476	272,692	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	2,100	2,259	248,762	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	1,200	1,290	142,098	2045/11/15
	3.125 T-BOND 411115	3.125	800	887	97,691	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	350	388	42,757	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	2,100	2,322	255,644	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	2,300	2,537	279,378	2044/8/15
	3.125 T-NOTE 170430	3.125	1,600	1,637	180,217	2017/4/30
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	1,600	1,698	186,987	2019/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	1,600	1,733	190,854	2021/5/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	2,200	2,543	280,060	2044/5/15
	3.375 T-NOTE 191115	3.375	500	538	59,298	2019/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	500	594	65,434	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 180215	3.5	800	836	92,114	2018/2/15
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	1,400	1,523	167,720	2020/5/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	1,300	1,574	173,328	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	1,300	1,572	173,115	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	800	864	95,214	2019/8/15
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	1,900	2,070	227,947	2020/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	2,100	2,317	255,120	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	950	1,167	128,546	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	300	371	40,925	2043/11/15
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	1,800	1,924	211,886	2018/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	800	1,001	110,296	2040/8/15

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	3.875 T-NOTE 180515		3.875	700	742	81,695	2018/5/15
	4 T-NOTE 180815		4.0	1,300	1,390	153,118	2018/8/15
	4.25 T-BOND 390515		4.25	500	660	72,745	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115		4.25	300	396	43,657	2040/11/15
	4.25 T-NOTE 171115		4.25	1,500	1,575	173,501	2017/11/15
	4.375 T-BOND 380215		4.375	500	674	74,216	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115		4.375	500	672	74,005	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515		4.375	800	1,076	118,491	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515		4.375	800	1,078	118,704	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215		4.5	600	820	90,308	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515		4.5	400	548	60,370	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815		4.5	700	958	105,498	2039/8/15
	4.5 T-NOTE 170515		4.5	1,100	1,141	125,626	2017/5/15
	4.625 T-BOND 400215		4.625	900	1,252	137,846	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215		4.75	400	567	62,493	2041/2/15
	4.75 T-NOTE 170815		4.75	1,000	1,049	115,564	2017/8/15
	5 T-BOND 370515		5.0	400	583	64,223	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115		5.25	300	407	44,862	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215		5.25	50	68	7,503	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215		5.375	600	853	93,920	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815		5.5	100	138	15,204	2028/8/15
	6 T-BOND 260215		6.0	1,700	2,335	257,064	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115		6.125	300	429	47,246	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815		6.25	300	394	43,427	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515		6.25	600	907	99,906	2030/5/15
	6.5 T-BOND 261115		6.5	400	576	63,470	2026/11/15
	8 T-BOND 211115		8.0	700	942	103,746	2021/11/15
	8.125 T-BOND 190815		8.125	300	366	40,401	2019/8/15
	8.75 T-BOND 170515		8.75	500	539	59,437	2017/5/15
	8.75 T-BOND 200815		8.75	700	915	100,826	2020/8/15
	8.875 T-BOND 190215		8.875	600	728	80,206	2019/2/15
小 計						31,144,976	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.25 CAN GOVT 170501		0.25	300	299	25,158	2017/5/1
	0.25 CAN GOVT 180501		0.25	200	198	16,705	2018/5/1
	0.75 CAN GOVT 200901		0.75	600	601	50,570	2020/9/1
	0.75 CAN GOVT 210301		0.75	300	299	25,236	2021/3/1
	1.25 CAN GOVT 170801		1.25	400	403	33,906	2017/8/1
	1.25 CAN GOVT 180201		1.25	400	404	34,006	2018/2/1
	1.25 CAN GOVT 180301		1.25	800	808	68,059	2018/3/1
	1.25 CAN GOVT 180901		1.25	400	405	34,131	2018/9/1
	1.5 CAN GOVT 170901		1.5	900	910	76,568	2017/9/1
	1.5 CAN GOVT 200301		1.5	500	515	43,358	2020/3/1
	1.5 CAN GOVT 230601		1.5	500	516	43,426	2023/6/1
	1.5 CAN GOVT 260601		1.5	500	507	42,689	2026/6/1

銘柄		当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
カナダ							
	国債証券	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	500	515	43,379	2019/3/1
		1.75 CAN GOVT 190901	1.75	400	414	34,840	2019/9/1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	500	543	45,725	2025/6/1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	650	718	60,418	2024/6/1
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	600	664	55,908	2022/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	330	389	32,738	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	200	249	21,029	2064/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	500	560	47,178	2021/6/1
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	500	555	46,732	2020/6/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	630	843	70,996	2045/12/1
		3.75 CAN GOVT 190601	3.75	900	983	82,719	2019/6/1
		4 CAN GOVT 170601	4.0	900	931	78,341	2017/6/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	850	1,184	99,630	2041/6/1
		4.25 CAN GOVT 180601	4.25	800	858	72,201	2018/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	470	714	60,134	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	450	666	56,073	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	520	815	68,591	2033/6/1
		8 CAN GOVT 270601	8.0	100	166	14,021	2027/6/1
小	計					1,484,480	
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	11,200	14,193	84,874	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	2,400	3,271	19,565	2036/11/20
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	7,600	7,596	45,427	2018/6/14
		5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	2,100	2,115	12,649	2017/6/15
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	4,900	4,843	28,961	2019/12/11
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	1,800	1,751	10,475	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	9,500	9,857	58,945	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	4,200	4,347	25,995	2022/6/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	4,000	4,382	26,210	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	7,900	8,325	49,787	2017/12/14
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	5,900	6,546	39,148	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	3,400	3,775	22,576	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	6,000	6,713	40,143	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	5,900	6,447	38,558	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	3,400	3,823	22,865	2023/12/7
		8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	12,100	13,128	78,509	2018/12/13
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	4,100	4,849	28,997	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	4,900	5,877	35,146	2038/11/18
小	計					668,839	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
	ドイツ	国債証券					
		0 OBL 200417	—	1,100	1,119	138,021	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	700	712	87,801	2021/4/9
		0 SCHATS 170616	—	400	402	49,575	2017/6/16
		0 SCHATS 170915	—	600	603	74,459	2017/9/15
		0 SCHATS 171215	—	100	100	12,424	2017/12/15

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	0.25 OBL 180413	0.25	1,000	1,014	125,061	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	500	512	63,199	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	400	411	50,764	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	1,000	1,041	128,340	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	500	515	63,603	2026/2/15
		0.5 OBL 171013	0.5	800	811	99,999	2017/10/13
		0.5 OBL 180223	0.5	1,100	1,119	138,008	2018/2/23
		0.5 OBL 190412	0.5	900	926	114,202	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	1,000	1,085	133,832	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	900	974	120,144	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	700	725	89,437	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,000	1,042	128,457	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	800	888	109,590	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	600	669	82,511	2023/2/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,000	1,126	138,819	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,200	1,348	166,287	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,100	1,258	155,176	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	900	1,017	125,458	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	800	926	114,181	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	800	893	110,118	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	700	796	98,243	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	700	794	97,958	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	800	1,127	139,049	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	600	856	105,648	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,300	1,485	183,189	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	1,000	1,136	140,083	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	600	711	87,740	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	600	940	115,911	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	700	787	97,113	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	700	778	95,991	2019/1/4
4 BUND 180104	4.0	800	858	105,882	2018/1/4		
4 BUND 370104	4.0	1,230	2,009	247,709	2037/1/4		
4.25 BUND 170704	4.25	800	842	103,880	2017/7/4		
4.25 BUND 180704	4.25	1,000	1,101	135,762	2018/7/4		
4.25 BUND 390704	4.25	500	869	107,179	2039/7/4		
4.75 BUND 280704	4.75	400	614	75,730	2028/7/4		
4.75 BUND 340704	4.75	850	1,455	179,459	2034/7/4		
4.75 BUND 400704	4.75	500	935	115,322	2040/7/4		
5.5 BUND 310104	5.5	700	1,200	148,014	2031/1/4		
5.625 BUND 280104	5.625	700	1,132	139,618	2028/1/4		
6.25 BUND 240104	6.25	600	893	110,153	2024/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	400	715	88,204	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	400	678	83,613	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	500	502	61,979	2018/5/15
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	100	101	12,475	2020/11/1

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	0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	700	711	87,771	2020/5/1
		0.75 ITALY GOVT 180115	0.75	900	911	112,416	2018/1/15
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	300	300	37,026	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	1,200	1,237	152,544	2019/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	900	932	114,996	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	500	519	64,080	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	600	626	77,218	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	900	908	111,939	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	700	702	86,619	2026/6/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	600	627	77,315	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	900	974	120,194	2021/12/15
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	700	749	92,375	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	900	984	121,381	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	400	402	49,620	2047/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	600	675	83,295	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 171101	3.5	1,000	1,051	129,616	2017/11/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	1,100	1,177	145,222	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,100	1,196	147,507	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	700	833	102,692	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	900	1,040	128,243	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	600	695	85,680	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	900	1,047	129,175	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	800	953	117,545	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,000	1,155	142,468	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,050	1,327	163,617	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	1,200	1,336	164,704	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	600	680	83,872	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,400	1,612	198,791	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	1,600	1,722	212,406	2018/2/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	900	988	121,891	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	800	898	110,794	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	1,200	1,389	171,324	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	900	1,115	137,480	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,100	1,370	168,933	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	800	1,015	125,198	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 170601	4.75	600	629	77,651	2017/6/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	1,300	1,583	195,153	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,000	1,261	155,474	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	900	1,188	146,512	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	800	1,138	140,312	2044/9/1
5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,000	1,243	153,274	2022/3/1		
5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,200	1,558	192,191	2025/3/1		
5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,350	1,902	234,497	2034/8/1		
5 ITALY GOVT 390801	5.0	900	1,296	159,848	2039/8/1		
5 ITALY GOVT 400901	5.0	900	1,294	159,643	2040/9/1		

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	
ユーロ		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
イタリア	国債証券	5.25 ITALY GOVT 170801	5.25	1,400	1,489	183,603	2017/8/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	1,300	1,810	223,255	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	900	1,158	142,856	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	900	1,161	143,211	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,100	1,652	203,689	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	800	1,207	148,858	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	800	1,190	146,787	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	400	616	75,979	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	300	469	57,876	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O. A. T 180225	—	200	201	24,847	2018/2/25
		0 O. A. T 190225	—	200	202	24,907	2019/2/25
		0 O. A. T 200525	—	700	708	87,284	2020/5/25
		0.25 O. A. T 201125	0.25	600	612	75,554	2020/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	1,200	1,235	152,292	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	1,500	1,519	187,360	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	400	399	49,287	2026/5/25
		1 BTAN 170725	1.0	700	712	87,780	2017/7/25
		1 O. A. T 180525	1.0	1,300	1,337	164,831	2018/5/25
		1 O. A. T 181125	1.0	1,000	1,035	127,637	2018/11/25
		1 O. A. T 190525	1.0	700	729	89,881	2019/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	800	842	103,905	2025/11/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	300	299	36,910	2036/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	1,400	1,567	193,234	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	1,300	1,462	180,329	2024/11/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	1,100	1,260	155,427	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	1,500	1,747	215,422	2024/5/25
		2.5 O. A. T 201025	2.5	1,900	2,132	262,890	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	1,400	1,701	209,759	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	1,200	1,478	182,234	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	1,700	2,011	248,001	2022/4/25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	1,750	2,072	255,554	2021/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	650	922	113,711	2045/5/25
		3.5 O. A. T 200425	3.5	1,800	2,070	255,245	2020/4/25
		3.5 O. A. T 260425	3.5	1,700	2,203	271,652	2026/4/25
		3.75 O. A. T 191025	3.75	1,600	1,826	225,158	2019/10/25
		3.75 O. A. T 210425	3.75	1,600	1,912	235,750	2021/4/25
		4 O. A. T 180425	4.0	1,600	1,737	214,142	2018/4/25
		4 O. A. T 381025	4.0	750	1,144	141,149	2038/10/25
		4 O. A. T 550425	4.0	650	1,088	134,136	2055/4/25
		4 O. A. T 600425	4.0	600	1,019	125,660	2060/4/25
		4.25 O. A. T 171025	4.25	1,700	1,814	223,701	2017/10/25
		4.25 O. A. T 181025	4.25	1,500	1,670	205,917	2018/10/25
		4.25 O. A. T 190425	4.25	1,200	1,363	168,114	2019/4/25
		4.25 O. A. T 231025	4.25	1,700	2,226	274,450	2023/10/25
		4.5 O. A. T 410425	4.5	1,500	2,500	308,280	2041/4/25

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	4.75 O.A.T 350425	4.75	1,350	2,184	269,313	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	1,300	2,063	254,387	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	1,250	2,158	266,099	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	800	1,219	150,347	2025/10/25
		8.5 O.A.T 191025	8.5	500	652	80,464	2019/10/25
		8.5 O.A.T 230425	8.5	600	953	117,520	2023/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	300	302	37,302	2018/4/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	500	512	63,137	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	600	599	73,923	2025/7/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	1,000	1,028	126,787	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	400	418	51,553	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	500	563	69,455	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	900	1,038	127,972	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	600	688	84,833	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	500	639	78,819	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	450	654	80,717	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	800	945	116,534	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	800	929	114,596	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	550	690	85,161	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	650	1,070	131,993	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	1,000	1,096	135,145	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	600	684	84,378	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	600	963	118,740	2037/1/15
4.5 NETH GOVT 170715	4.5	300	317	39,103	2017/7/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	700	1,103	135,980	2028/1/15		
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	200	201	24,806	2018/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25	100	100	12,400	2019/1/31
		0.5 SPAIN GOVT 171031	0.5	700	705	87,029	2017/10/31
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	200	206	25,469	2020/7/30
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	1,400	1,458	179,858	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,100	1,116	137,676	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	600	619	76,379	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	400	395	48,784	2030/7/30
		2.1 SPAIN GOVT 170430	2.1	800	816	100,714	2017/4/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	600	633	78,084	2025/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	700	754	93,005	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	1,300	1,443	177,949	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	150	152	18,805	2046/10/31
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	1,200	1,310	161,553	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,100	1,309	161,495	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	1,200	1,372	169,209	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	1,100	1,199	147,914	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	600	765	94,353	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	900	1,026	126,529	2019/10/31
4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	500	618	76,224	2023/10/31		

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	4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	900	969	119,556	2018/1/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	600	684	84,419	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	700	890	109,781	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	700	962	118,644	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	800	1,013	124,971	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	800	955	117,826	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	750	1,054	130,017	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	700	949	117,103	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	400	590	72,757	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	900	1,163	143,427	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 170730	5.5	1,000	1,066	131,527	2017/7/30
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	1,100	1,368	168,737	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	800	1,192	147,058	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,100	1,421	175,212	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	400	559	68,940	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,000	1,459	179,920	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	600	621	76,579	2025/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	500	577	71,218	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	800	951	117,328	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	500	557	68,676	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	300	391	48,230	2034/6/22
		3.5 BEL GOVT 170628	3.5	700	730	90,093	2017/6/28
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	800	942	116,164	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	400	614	75,706	2045/6/22
		4 BEL GOVT 180328	4.0	700	758	93,471	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	600	676	83,410	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	800	994	122,584	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	350	504	62,146	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	600	743	91,620	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	600	764	94,294	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	800	1,286	158,557	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	400	557	68,671	2026/3/28
5 BEL GOVT 350328	5.0	1,050	1,736	214,029	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 170928	5.5	300	324	39,987	2017/9/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,000	1,549	191,034	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	100	102	12,589	2019/10/18
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	300	306	37,766	2026/10/20
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	400	415	51,193	2018/10/19
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	200	215	26,550	2025/10/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	800	897	110,606	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	300	338	41,703	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	400	428	52,864	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	200	245	30,238	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	300	432	53,301	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	300	368	45,399	2022/11/22

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
オーストリア	国債証券	3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	700	838	103,356	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	500	612	75,496	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	150	261	32,211	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	700	823	101,535	2020/7/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	500	781	96,337	2037/3/15
		4.3 AUSTRIA GOVT 170915	4.3	100	106	13,103	2017/9/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	600	680	83,898	2019/3/15
		4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	500	542	66,863	2018/1/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	300	429	52,887	2026/3/15
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	200	325	40,066	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	300	308	38,019	2020/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	150	148	18,272	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	100	104	12,895	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	200	207	25,560	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	100	110	13,583	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	200	221	27,260	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	200	229	28,238	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	250	339	41,845	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	200	249	30,796	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	200	229	28,232	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	300	354	43,737	2021/4/15
		3.875 FINNISH GOVT170915	3.875	300	317	39,114	2017/9/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	350	466	57,565	2025/7/4
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	300	345	42,542	2019/7/4		
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	200	206	25,501	2022/3/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	300	310	38,304	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	400	458	56,481	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	300	364	44,876	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	200	247	30,516	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	300	342	42,259	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	500	557	68,768	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	400	471	58,141	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	400	488	60,185	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	450	627	77,358	2025/3/13
		5.5 IRISH GOVT 171018	5.5	300	324	40,035	2017/10/18
		5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	300	361	44,606	2019/10/18
		小 計					29,573,339
イギリス			千イギリスポンド	千イギリスポンド			
	国債証券	1 GILT 170907	1.0	1,300	1,309	210,537	2017/9/7
		1.25 GILT 180722	1.25	1,300	1,322	212,626	2018/7/22
		1.5 GILT 210122	1.5	400	411	66,133	2021/1/22
		1.75 GILT 190722	1.75	1,200	1,242	199,771	2019/7/22
		1.75 GILT 220907	1.75	1,000	1,041	167,448	2022/9/7
		2 GILT 200722	2.0	1,500	1,575	253,185	2020/7/22
		2 GILT 250907	2.0	900	943	151,694	2025/9/7

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
国債証券	2.25 GILT 230907	2.25	800	857	137,899	2023/9/7
	2.5 GILT 650722	2.5	200	221	35,604	2065/7/22
	2.75 GILT 240907	2.75	1,000	1,110	178,530	2024/9/7
	3.25 GILT 440122	3.25	1,250	1,488	239,316	2044/1/22
	3.5 GILT 450122	3.5	680	848	136,390	2045/1/22
	3.5 GILT 680722	3.5	1,000	1,424	228,879	2068/7/22
	3.75 GILT 190907	3.75	500	552	88,779	2019/9/7
	3.75 GILT 200907	3.75	1,000	1,128	181,303	2020/9/7
	3.75 GILT 210907	3.75	700	803	129,134	2021/9/7
	3.75 GILT 520722	3.75	670	929	149,364	2052/7/22
	4 GILT 220307	4.0	650	762	122,600	2022/3/7
	4 GILT 600122	4.0	390	595	95,653	2060/1/22
	4.25 GILT 271207	4.25	600	765	123,035	2027/12/7
	4.25 GILT 320607	4.25	800	1,046	168,265	2032/6/7
	4.25 GILT 360307	4.25	900	1,199	192,777	2036/3/7
	4.25 GILT 390907	4.25	590	803	129,097	2039/9/7
	4.25 GILT 401207	4.25	900	1,237	198,888	2040/12/7
	4.25 GILT 461207	4.25	800	1,145	184,100	2046/12/7
	4.25 GILT 491207	4.25	700	1,033	166,094	2049/12/7
	4.25 GILT 551207	4.25	520	811	130,413	2055/12/7
	4.5 GILT 190307	4.5	700	779	125,241	2019/3/7
	4.5 GILT 340907	4.5	900	1,225	197,015	2034/9/7
	4.5 GILT 421207	4.5	1,000	1,443	231,933	2042/12/7
	4.75 GILT 200307	4.75	800	923	148,373	2020/3/7
	4.75 GILT 301207	4.75	750	1,022	164,378	2030/12/7
	4.75 GILT 381207	4.75	470	679	109,220	2038/12/7
	5 GILT 180307	5.0	1,000	1,084	174,239	2018/3/7
	5 GILT 250307	5.0	800	1,043	167,750	2025/3/7
	6 GILT 281207	6.0	600	896	144,121	2028/12/7
	8 GILT 210607	8.0	550	744	119,607	2021/6/7
小 計					5,859,411	
スイス			千スイスフラン	千スイスフラン		
国債証券	2 SWISS GOVT 210428	2.0	180	204	22,743	2021/4/28
	2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	250	282	31,327	2020/7/6
	3 SWISS GOVT 180108	3.0	330	350	38,950	2018/1/8
	3 SWISS GOVT 190512	3.0	110	122	13,637	2019/5/12
	4 SWISS GOVT 230211	4.0	190	249	27,727	2023/2/11
	4 SWISS GOVT 280408	4.0	250	375	41,713	2028/4/8
	4.25 SWISS GOVT 170605	4.25	170	178	19,869	2017/6/5
小 計					195,968	
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	1 SWD GOVT 261112	1.0	1,700	1,737	22,906	2026/11/12
	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	3,300	3,575	47,129	2023/11/13
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	2,400	2,812	37,070	2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 220601	3.5	3,700	4,446	58,601	2022/6/1

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
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	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	2,000	2,679	35,311	2039/3/30
	3.75 SWD GOVT 170812	3.75	2,400	2,528	33,322	2017/8/12
	4.25 SWD GOVT 190312	4.25	4,200	4,756	62,686	2019/3/12
	5 SWD GOVT 201201	5.0	3,900	4,818	63,511	2020/12/1
小計					360,539	
ノルウェー			千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	850	857	11,288	2026/2/19
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	1,600	1,654	21,795	2025/3/13
	2 NORWE GOVT 230524	2.0	2,200	2,330	30,695	2023/5/24
	3 NORWE GOVT 240314	3.0	2,000	2,264	29,819	2024/3/14
	3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	3,200	3,643	47,985	2021/5/25
	4.25 NORWE GOVT 170519	4.25	2,400	2,485	32,736	2017/5/19
	4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	3,100	3,456	45,515	2019/5/22
小計					219,836	
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	0.25 DMK GOVT 181115	0.25	1,500	1,521	25,229	2018/11/15
	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	2,900	3,183	52,786	2023/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	2,700	3,021	50,104	2025/11/15
	3 DMK GOVT 211115	3.0	4,100	4,787	79,374	2021/11/15
	4 DMK GOVT 171115	4.0	1,700	1,813	30,063	2017/11/15
	4 DMK GOVT 191115	4.0	4,200	4,831	80,105	2019/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	5,350	9,297	154,152	2039/11/15
	7 DMK GOVT 241110	7.0	800	1,259	20,886	2024/11/10
小計					492,702	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	1,000	980	27,406	2020/4/25
	1.75 POLAND 210725	1.75	200	193	5,417	2021/7/25
	2 POLAND 210425	2.0	1,200	1,186	33,150	2021/4/25
	2.5 POLAND 180725	2.5	900	916	25,607	2018/7/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	750	715	19,988	2026/7/25
	3.25 POLAND 190725	3.25	900	939	26,264	2019/7/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	1,150	1,181	33,010	2025/7/25
	3.75 POLAND 180425	3.75	900	936	26,186	2018/4/25
	4 POLAND 231025	4.0	1,200	1,300	36,355	2023/10/25
	5.25 POLAND 171025	5.25	1,300	1,368	38,246	2017/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	1,000	1,134	31,716	2020/10/25
	5.5 POLAND 191025	5.5	900	1,008	28,192	2019/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	800	938	26,242	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	1,000	1,188	33,212	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	500	627	17,535	2029/4/25
	POLAND 170725	—	300	294	8,244	2017/7/25
	POLAND 181025	—	300	288	8,055	2018/10/25
小計					424,834	
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	1.75 AUST GOVT 201121	1.75	600	598	47,693	2020/11/21

銘柄	銘柄	当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円		
	国債証券	2.75 AUST GOVT 191021	2.75	700	725	57,756	2019/10/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,200	1,245	99,169	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	500	513	40,920	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	250	241	19,210	2035/6/21
		3.25 AUST GOVT 181021	3.25	600	622	49,579	2018/10/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,000	1,076	85,693	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	300	321	25,598	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	220	223	17,824	2039/6/21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	380	421	33,530	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 170721	4.25	700	720	57,376	2017/7/21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,100	1,283	102,206	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 200415	4.5	900	995	79,234	2020/4/15
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	450	551	43,929	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,000	1,223	97,414	2027/4/21
		5.25 AUST GOVT 190315	5.25	1,000	1,099	87,526	2019/3/15
		5.5 AUST GOVT 180121	5.5	1,000	1,062	84,624	2018/1/21
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	850	1,034	82,414	2023/4/21
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,000	1,184	94,309	2021/5/15
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	900	1,093	87,091	2022/7/15
小	計					1,293,106	
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	0.5 SINGAPORGOVT 180401	0.5	200	197	15,808	2018/4/1
		1.375 SINGAPORGOV 171001	1.375	130	130	10,448	2017/10/1
		1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	110	111	8,892	2019/10/1
		2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	150	153	12,270	2020/7/1
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	290	298	23,845	2021/6/1
		2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	50	51	4,084	2025/6/1
		2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	220	228	18,243	2019/6/1
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	130	136	10,935	2023/7/1
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	250	260	20,796	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	50	52	4,154	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	100	106	8,485	2029/7/1
		2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	160	169	13,521	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	350	375	29,976	2024/9/1
		3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	200	215	17,215	2022/9/1
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	200	215	17,177	2020/9/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	90	101	8,106	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	200	224	17,918	2027/3/1
		4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	160	170	13,619	2018/9/1
小	計					255,501	
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	3.26 MALAYSIAGOV 180301	3.26	400	402	10,877	2018/3/1
		3.314 MALAYSIA 171031	3.314	600	603	16,302	2017/10/31
		3.418MALAYSIAGOV 220815	3.418	500	490	13,251	2022/8/15
		3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	400	391	10,585	2023/3/15

銘柄	当 期 末						
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
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	3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	700	702	18,985	2020/3/31	
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	500	473	12,786	2027/5/31	
	3.654 MALAYSIAGOV 191031	3.654	200	202	5,464	2019/10/31	
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	100	95	2,593	2028/6/15	
	3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	500	500	13,517	2022/9/30	
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	200	188	5,091	2033/4/15	
	3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	600	611	16,520	2020/7/31	
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	500	486	13,142	2027/3/15	
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	500	504	13,627	2025/9/15	
	4.012 MALAYSIAGOV 170915	4.012	500	507	13,706	2017/9/15	
	4.048 MALAYSIA 210930	4.048	600	612	16,549	2021/9/30	
	4.127 MALAYSIA 320415	4.127	500	488	13,215	2032/4/15	
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	600	616	16,664	2021/7/15	
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	500	509	13,772	2024/7/15	
	4.24 MALAYSIAGOV 180207	4.24	800	817	22,104	2018/2/7	
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	200	198	5,366	2035/5/31	
	4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	1,200	1,240	33,539	2019/11/29	
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	300	309	8,362	2026/4/15	
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	500	512	13,865	2030/4/15	
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	400	413	11,175	2043/9/30	
	5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	300	321	8,693	2019/7/30	
小 計					329,762		
南アフリカ			千南アフリカランド	千南アフリカランド			
国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	7,300	7,798	54,352	2026/12/21	
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	3,500	2,382	16,607	2036/3/31	
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	4,000	2,698	18,811	2041/2/28	
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	2,800	2,561	17,855	2021/3/31	
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	4,400	3,419	23,833	2031/2/28	
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	2,900	2,761	19,247	2020/1/15	
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	2,400	2,226	15,515	2023/2/28	
	8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	2,200	2,175	15,164	2018/12/21	
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	3,000	2,584	18,011	2030/1/31	
	8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	1,700	1,703	11,872	2017/9/15	
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	3,000	2,586	18,030	2032/3/31	
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	3,500	3,017	21,031	2037/1/31	
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	1,700	1,476	10,293	2044/1/31	
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	4,300	3,720	25,933	2048/2/28	
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	800	721	5,025	2035/2/28	
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	700	627	4,376	2040/1/31	
小 計					295,964		
合 計					72,599,265		

(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

(2016年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 72,599,265	% 98.3
コール・ローン等、その他	1,263,043	1.7
投資信託財産総額	73,862,308	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(73,799,116千円)の投資信託財産総額(73,862,308千円)に対する比率は99.9%です。

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

1 アメリカドル=110.09円	1 カナダドル=84.13円	1 メキシコペソ=5.98円	1 ユーロ=123.28円
1 イギリスポンド=160.73円	1 スイスフラン=111.03円	1 スウェーデンクローネ=13.18円	1 ノルウェークローネ=13.17円
1 デンマーククローネ=16.58円	1 ポーランドズロチ=27.95円	1 オーストラリアドル=79.63円	1 シンガポールドル=79.85円
1 マレーシアリングgit=27.03円	1 南アフリカランド=6.97円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	74,227,871,302
コール・ローン等	349,393,660
公社債(評価額)	72,599,265,135
未収入金	697,161,641
未収利息	558,004,764
前払費用	24,046,102
(B) 負債	668,093,021
未払金	376,375,592
未払解約金	291,717,030
未払利息	84
その他未払費用	315
(C) 純資産総額(A-B)	73,559,778,281
元本	28,604,779,095
次期繰越損益金	44,954,999,186
(D) 受益権総口数	28,604,779,095口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,716円

<注記事項>

- ①期首元本額 46,627,128,292円
 期中追加設定元本額 2,802,793,513円
 期中一部解約元本額 20,825,142,710円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.5716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 ライフセレクトファンド(安定型)	141,795,999円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	261,304,013円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	160,179,013円
三菱UFJ 外国債券オープン	1,628,310,178円
三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,064,308,305円
三菱UFJ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	2,567,222,628円
三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	1,538,777,805円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	649,701,085円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	85,661,921円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	127,996,840円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	2,070,086,833円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	466,436,440円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,305,529,740円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	15,532,981,085円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)VA(適格機関投資家限定)	50,813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)	344,244円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定)	54,786,002円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	949,306,151円
合計	28,604,779,095円

【お知らせ】

2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。(2015年7月1日)

○損益の状況 (2015年5月21日～2016年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,467,941,776
受取利息	2,467,961,693
支払利息	△ 19,917
(B) 有価証券売買損益	△ 8,012,222,758
売買益	2,117,722,366
売買損	△10,129,945,124
(C) 保管費用等	△ 33,570,008
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 5,577,850,990
(E) 前期繰越損益金	81,559,629,107
(F) 追加信託差損益金	4,764,215,467
(G) 解約差損益金	△35,790,994,398
(H) 計(D+E+F+G)	44,954,999,186
次期繰越損益金(H)	44,954,999,186

- (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。