

## 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90%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50%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 （成長型）

第17期（決算日：2017年5月22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（成長型）」は、去る5月22日に第17期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。  
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



## 三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号  
 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。

## 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<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | 期中<br>騰落率 | 期中<br>騰落率 |        |        |        |        |            |       |
|                 | 円      | 円          | %         |           | %         | %      | %      | %      | %      | %          | 百万円   |
| 13期(2013年5月20日) | 11,362 | 100        | 54.9      | 115.68    | 54.4      | 74.6   | 1.2    | 20.4   | 0.1    | 0.6        | 6,539 |
| 14期(2014年5月20日) | 11,319 | 0          | △0.4      | 115.00    | △0.6      | 73.2   | 1.1    | 22.0   | —      | 0.5        | 6,782 |
| 15期(2015年5月20日) | 14,495 | 100        | 28.9      | 148.05    | 28.7      | 73.9   | 1.0    | 21.3   | —      | 0.6        | 8,934 |
| 16期(2016年5月20日) | 12,738 | 0          | △12.1     | 129.74    | △12.4     | 72.4   | 1.7    | 22.0   | 0.0    | 0.7        | 8,181 |
| 17期(2017年5月22日) | 14,352 | 100        | 13.5      | 146.81    | 13.2      | 73.3   | 1.4    | 21.5   | 0.0    | 0.6        | 9,183 |

(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17%、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）50%、MSCIコクサイインデックス（除く日本円換算ベース）25%、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<br>組 入 比 率 | 株 式<br>先 物 比 率 | 債 券<br>組 入 比 率 | 債 券<br>先 物 比 率 | 投 資 信 託<br>証 書 組 入 比 率 |
|------------|---------|-------|--------|-------|----------------|----------------|----------------|----------------|------------------------|
|            | 騰 落 率   | 騰 落 率 | 騰 落 率  | 騰 落 率 |                |                |                |                |                        |
| (期 首)      | 円       | %     | %      | %     | %              | %              | %              | %              | %                      |
| 2016年5月20日 | 12,738  | —     | 129.74 | —     | 72.4           | 1.7            | 22.0           | 0.0            | 0.7                    |
| 5月末        | 13,044  | 2.4   | 132.91 | 2.4   | 73.2           | 1.2            | 21.6           | 0.1            | 0.7                    |
| 6月末        | 12,090  | △ 5.1 | 123.17 | △ 5.1 | 72.8           | 1.3            | 22.9           | 0.1            | 0.7                    |
| 7月末        | 12,640  | △ 0.8 | 128.88 | △ 0.7 | 73.5           | 1.1            | 21.1           | 0.1            | 0.7                    |
| 8月末        | 12,630  | △ 0.8 | 128.82 | △ 0.7 | 73.4           | 1.1            | 21.6           | 0.0            | 0.7                    |
| 9月末        | 12,555  | △ 1.4 | 127.68 | △ 1.6 | 72.3           | 1.8            | 21.9           | 0.0            | 0.7                    |
| 10月末       | 12,939  | 1.6   | 131.61 | 1.4   | 73.0           | 1.4            | 21.4           | 0.0            | 0.6                    |
| 11月末       | 13,597  | 6.7   | 138.38 | 6.7   | 72.5           | 1.8            | 21.1           | 0.1            | 0.6                    |
| 12月末       | 14,046  | 10.3  | 142.89 | 10.1  | 73.1           | 1.2            | 21.4           | 0.1            | 0.6                    |
| 2017年1月末   | 14,010  | 10.0  | 142.67 | 10.0  | 73.4           | 0.7            | 21.7           | 0.1            | 0.6                    |
| 2月末        | 14,139  | 11.0  | 144.07 | 11.0  | 73.2           | 1.4            | 21.7           | 0.1            | 0.6                    |
| 3月末        | 14,118  | 10.8  | 143.29 | 10.4  | 72.6           | 1.7            | 21.8           | 0.1            | 0.6                    |
| 4月末        | 14,240  | 11.8  | 144.59 | 11.4  | 72.8           | 1.4            | 21.8           | 0.1            | 0.6                    |
| (期 末)      |         |       |        |       |                |                |                |                |                        |
| 2017年5月22日 | 14,452  | 13.5  | 146.81 | 13.2  | 73.3           | 1.4            | 21.5           | 0.0            | 0.6                    |

(注) 期末基準価額は分配金込み、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17期：2016/5/21～2017/5/22)

|            |   |
|------------|---|
| 基準価額の動き    | 基準価額は期首に比べ13.5%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。    |
| ベンチマークとの差異 | ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（13.2%）を0.3%上回りました。 |



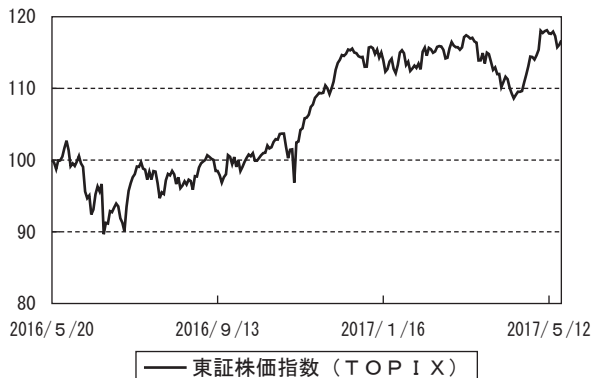
- ・分配金再投資基準価額は、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- ・実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なるため、お客さまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

## 基準価額の主な変動要因

|      |  |
|------|--|
| 上昇要因 | 主として内外株式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 | 国内債券市況が下落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17期：2016/5/21～2017/5/22）

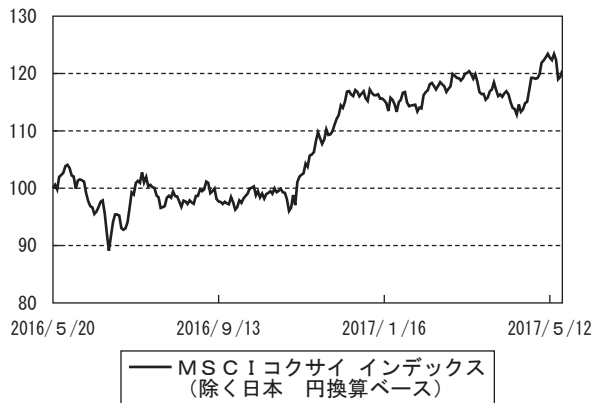
市況の推移  
（期首を100として指数化）

## ◎国内株式市況

- ・米国のトランプ政権下における経済政策への期待などから米国長期金利が上昇し円安・米ドル高が進行したことや、フランス大統領選挙で親欧州連合（EU）派のマクロン氏が勝利したことを受け世界的に株価が上昇したことなどから、国内株式市況は上昇しました。

- ・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。

市況の推移  
(期首を100として指数化)



◎外国株式市況

- ・米国の堅調な企業決算発表や米国大統領選挙結果を受けた今後の政策期待などから、外国株式市況は上昇しました。

・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知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

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。

◎国内債券市況

- ・ 期の前半は、イギリスのEU離脱をめぐる国民投票で離脱派が過半数を占めたことにより、世界的な景気の先行きに対する不透明感が高まったことから、一時、国内債券市況は上昇しました。その後、日本銀行が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を導入したことや、次期米国大統領にトランプ氏が選出され米国の金利が上昇したことなどから、国内債券市況は下落しました。

◎外国債券市況

- ・ 先進国の債券市況は、2016年6月にかけて世界的な景気減速懸念が強まったことなどを背景に上昇しましたが、その後は米連邦準備制度理事会（FRB）の利上げに対する期待が高まったことなどから下落しました。

為替市況の推移  
 (期首を100として指数化)



◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、2016年6月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、米ドルが対円で下落しましたが、その後、FRBの利上げに対する期待が高まったことなどから、米ドルが対円で買われました。期首との比較では、米ドルは対円で1.3%上昇しました。
- ・円・ユーロ相場は、2016年6月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、ユーロが対円で下落しましたが、米国大統領選挙以降、大半の主要通貨に対して円安が進行し、ユーロは対円で上昇しました。期首との比較では、ユーロは対円で1.2%上昇しました。



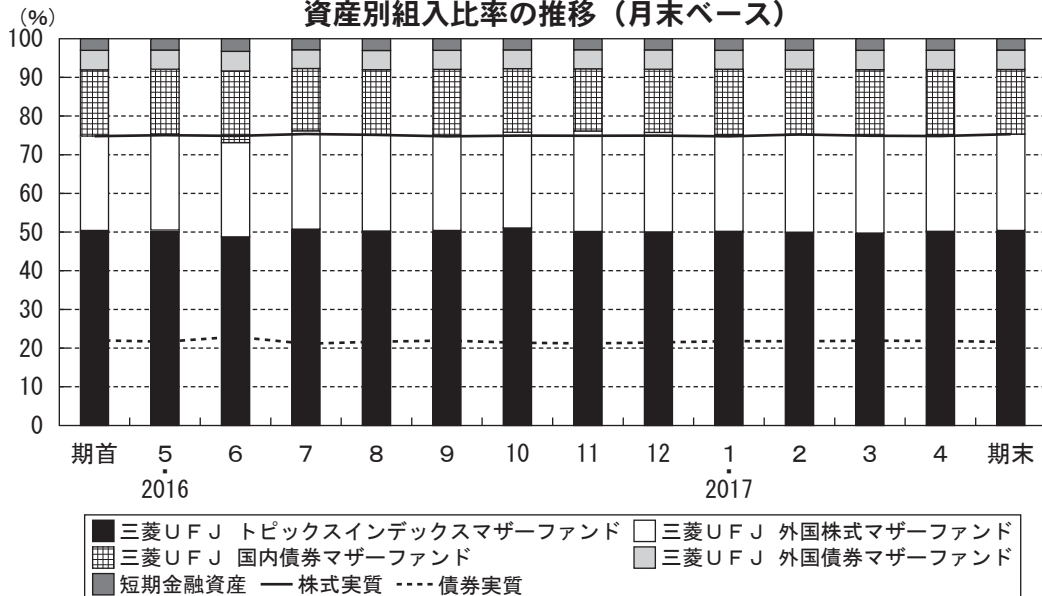
当該投資信託のポートフォリオについて

＜三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）＞

- ・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、国内債券市況が下落したものの、主に内外株式市況が上昇したことなどを背景に基準価額（分配金再投資ベース）は上昇しました。
- ・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19.3%の上昇となりました。

- ・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

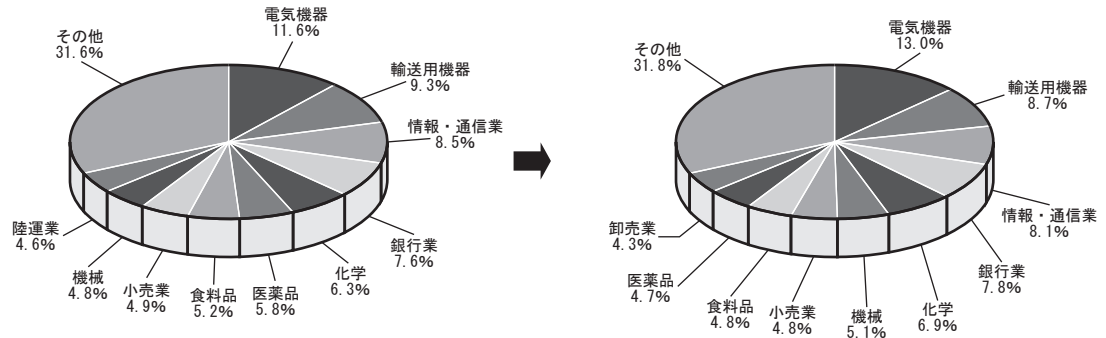
株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

（ご参考）

### 組入上位10業種

期首（2016年5月20日）

期末（2017年5月22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20.8%の上昇となりました。

- ・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・不動産投資信託証券（REIT）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。
- ・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

（注）マルチファクターモデル

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

＜三菱UFJ 国内債券マザーファンド＞

基準価額は期首に比べ2.0%の下落となりました。

- ・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（2016年5月20日）

期末（2017年5月22日）

|         |       |   |         |      |
|---------|-------|---|---------|------|
| 最終利回り   | -0.0% | ➡ | 最終利回り   | 0.1% |
| 直接利回り   | 1.1%  |   | 直接利回り   | 1.0% |
| デュレーション | 8.8年  |   | デュレーション | 8.7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0.8%の上昇となりました。

- ・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（2016年5月20日）

期末（2017年5月22日）

|         |      |   |         |      |
|---------|------|---|---------|------|
| 最終利回り   | 1.1% | ➡ | 最終利回り   | 1.3% |
| 直接利回り   | 2.5% |   | 直接利回り   | 2.5% |
| デュレーション | 6.9年 |   | デュレーション | 7.0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。

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（成長型）>

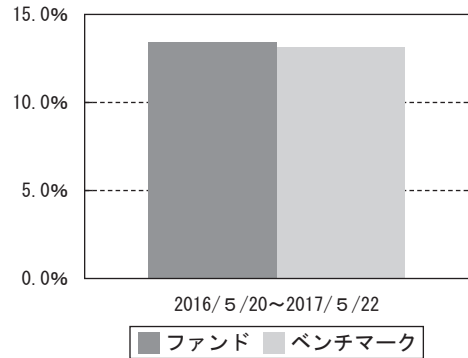
基準価額の騰落率は、13.5%（分配金再投資ベース）の上昇となり、ベンチマークの13.2%の上昇を0.3%上回りました。

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 1.3%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） Δ1.0%程度

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



・ファンドの騰落率は分配金込みで計算していません。

<三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド>

ベンチマークは16.7%の上昇となったため、カイ離は2.6%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 | Δ0.0%程度 | 2.6%程度 | 2.6%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Δ0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.6%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  | 配当収入等  | 計 | 2.6%程度  |
| マイナス要因 | 売買コスト等 | 計 | △0.0%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7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20.5%の上昇となったため、カイ離は0.3%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 | 0.4%程度 | 0.3%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、

- ・売り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0.4%程度でした。

|        |                 |   |         |
|--------|-----------------|---|---------|
| プラス要因  | 配当・利子収入等        | 計 | 0.5%程度  |
| マイナス要因 | 売買コスト・保管料・為替効果等 | 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2.0%の下落となったため、カイ離は△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 | △0.0%程度 | 0.0%程度 | △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△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、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1.0%の上昇となったため、カイ離は△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      |
|-------------|-----------|----------|--------------|---------|
| ベンチマークとのカイ離 | 0.0%程度    | △0.0%程度  | △0.2%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△0.2%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17期                  |
|-----------|-----------------------|
|           | 2016年5月21日～2017年5月22日 |
| 当期分配金     | 100                   |
| （対基準価額比率） | 0.692%                |
| 当期の収益     | 100                   |
| 当期の収益以外   | —                     |
| 翌期繰越分配対象額 | 7,379                 |

（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（成長型）>

- ・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 |
|------|------|------|------|--------|
| 50%  | 25%  | 17%  | 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

(2016年5月21日～2017年5月22日)

| 項 目                   | 当 期    |           | 項 目 の 概 要   |
|-----------------------|--------|-----------|---|
|                       | 金 額    | 比 率       |   |
| (a) 信 託 報 酬           | 116    | 0.869     | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×<br>(期中の日数÷年間日数)                         |
| （ 投 信 会 社 ）           | ( 38 ) | ( 0.282 ) | 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 ）           | ( 67 ) | ( 0.499 ) | 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 ）           | ( 12 ) | ( 0.087 ) | 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      | 0.003     | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| （ 株 式 ）               | ( 0 )  | ( 0.002 ) |   |
| （ 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<br>有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金       |
| （ 株 式 ）               | ( 0 )  | ( 0.001 ) |   |
| （ 投 資 信 託 証 券 ）       | ( 0 )  | ( 0.000 ) |   |
| (d) そ の 他 費 用         | 2      | 0.017     | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数                                     |
| （ 保 管 費 用 ）           | ( 2 )  | ( 0.016 ) | 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                   | 118    | 0.890     |   |
| 期中の平均基準価額は、13,337円です。 |        |           |   |

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

## ○売買及び取引の状況

(2016年5月21日～2017年5月22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 | 365,365 | 399,456 | 594,712 | 674,912 |
| 三菱UFJ 国内債券マザーファンド        | 315,969 | 440,871 | 200,009 | 281,056 |
| 三菱UFJ 外国債券マザーファンド        | 38,903  | 97,106  | 21,294  | 53,552  |
| 三菱UFJ 外国株式マザーファンド        | 189,430 | 327,524 | 249,313 | 464,862 |

## ○株式売買比率

(2016年5月21日～2017年5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                       |                   |
|---------------------|--------------------------|-------------------|
|                     | 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       | 66,120,100千円             | 36,212,721千円      |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 204,328,462千円            | 105,056,647千円     |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.32                     | 0.34              |

(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

(2016年5月21日～2017年5月22日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）&gt;

該当事項はございません。

&lt;三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド&gt;

| 区分         | 買付額等<br>A | うち利害関係人との取引状況B |      | 売付額等<br>C | うち利害関係人との取引状況D |      |
|------------|-----------|----------------|------|-----------|----------------|------|
|            |           |                | B/A  |           |                | D/C  |
|            | 百万円       | 百万円            | %    | 百万円       | 百万円            | %    |
| 株式         | 15,795    | 254            | 1.6  | 50,324    | 8,567          | 17.0 |
| 貸付有価証券(株式) | 465,186   | 313,919        | 67.5 | 469,036   | 319,066        | 68.0 |

平均保有割合 2.1%

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

## ＜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<br>8,932 | 百万円<br>6,530   | %<br>73.1     | 百万円<br>39,062 | 百万円<br>26,169  | %<br>67.0     |

平均保有割合 1.9%

※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<br>61,673 | 百万円<br>17,875  | %<br>29.0     | 百万円<br>61,755 | 百万円<br>9,091   | %<br>14.7     |

平均保有割合 0.7%

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

(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<br>4,020 | 百万円<br>2,560   | %<br>63.7     | 百万円<br>23,107 | 百万円<br>12,940  | %<br>56.0     |

平均保有割合 0.7%

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

## 利害関係人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<br>278 | 百万円<br>1,326 | 百万円<br>4,921 |

## ＜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<br>300 | 百万円<br>102 | 百万円<br>824  |

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<br>6 |

＜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<br>2,500 |

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)    | 260千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 7千円   |
| (B) / (A)        | 2.7%  |

(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、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2017年5月22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 | 3,889,965 | 3,660,618 | 4,629,584 |
| 三菱UFJ 国内債券マザーファンド        | 995,870   | 1,111,830 | 1,534,103 |
| 三菱UFJ 外国債券マザーファンド        | 160,179   | 177,787   | 460,825   |
| 三菱UFJ 外国株式マザーファンド        | 1,164,998 | 1,105,115 | 2,288,473 |

## ○有価証券の貸付及び借入の状況

三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンドにおいて、2017年5月22日現在における貸付株数の総株数は25,609,700株です。

うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUFG証券に対する貸付は、22,532,300株です。

## ○投資信託財産の構成

(2017年5月22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<br>4,629,584 | %<br>49.7 |
| 三菱UFJ 国内債券マザーファンド        | 1,534,103       | 16.5      |
| 三菱UFJ 外国債券マザーファンド        | 460,825         | 5.0       |
| 三菱UFJ 外国株式マザーファンド        | 2,288,473       | 24.6      |
| コール・ローン等、その他             | 394,980         | 4.2       |
| 投資信託財産総額                 | 9,307,965       | 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（54,562,124千円）の投資信託財産総額（54,680,933千円）に対する比率は99.8%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（105,755,144千円）の投資信託財産総額（106,201,274千円）に対する比率は99.6%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売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=111.54円   | 1 カナダドル=82.39円    | 1 メキシコペソ=5.95円       | 1 ユーロ=124.79円        |
| 1 イギリスポンド=144.76円  | 1 スイスフラン=114.49円  | 1 スウェーデンクローネ=12.77円  | 1 ノルウェークローネ=13.31円   |
| 1 デンマーククローネ=16.76円 | 1 ポーランドズロチ=29.76円 | 1 オーストラリアドル=83.03円   | 1 ニューージーランドドル=77.24円 |
| 1 香港ドル=14.33円      | 1 シンガポールドル=80.41円 | 1 マレーシアリングギット=25.88円 | 1 イスラエルシケル=31.13円    |
| 1 南アフリカランド=8.42円   |                   |                      |                      |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年5月22日現在）

| 項 目                           | 当 期 末          |
|-------------------------------|----------------|
|                               | 円              |
| (A) 資産                        | 9,307,965,016  |
| コール・ローン等                      | 322,283,060    |
| 三菱UFJ トビックスインデックスマザーファンド(評価額) | 4,629,584,462  |
| 三菱UFJ 国内債券マザーファンド(評価額)        | 1,534,103,976  |
| 三菱UFJ 外国債券マザーファンド(評価額)        | 460,825,544    |
| 三菱UFJ 外国株式マザーファンド(評価額)        | 2,288,473,140  |
| 未収入金                          | 72,694,834     |
| (B) 負債                        | 124,413,188    |
| 未払収益分配金                       | 63,987,930     |
| 未払解約金                         | 21,112,619     |
| 未払信託報酬                        | 39,312,105     |
| 未払利息                          | 534            |
| (C) 純資産総額(A-B)                | 9,183,551,828  |
| 元本                            | 6,398,793,010  |
| 次期繰越損益金                       | 2,784,758,818  |
| (D) 受益権総口数                    | 6,398,793,010口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)               | 14,352円        |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 6,422,931,220円  
 期中追加設定元本額 794,416,126円  
 期中一部解約元本額 818,554,336円  
 また、1口当たり純資産額は、期末14,352円です。

## ②分配金の計算過程

| 項 目                       | 2016年5月21日～<br>2017年5月22日 |
|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | 157,768,393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                    | 2,489,125,056円            |
| 分配準備積立金額                  | 2,138,903,518円            |
| 当ファンドの分配対象収益額             | 4,785,796,967円            |
| 1万口当たり収益分配対象額             | 7,479円                    |
| 1万口当たり分配金額                | 100円                      |
| 収益分配金金額                   | 63,987,930円               |

## ○損益の状況（2016年5月21日～2017年5月22日）

| 項 目                | 当 期              |
|--------------------|------------------|
|                    | 円                |
| (A) 配当等収益          | △ 122,633        |
| 受取利息               | 2,259            |
| 支払利息               | △ 124,892        |
| (B) 有価証券売買損益       | 1,121,926,459    |
| 売買益                | 1,237,601,246    |
| 売買損                | △ 115,674,787    |
| (C) 信託報酬等          | △ 74,779,313     |
| (D) 当期繰越損益金(A+B+C) | 1,047,024,513    |
| (E) 前期繰越損益金        | 1,139,845,155    |
| (F) 追加信託差損益金       | 661,877,080      |
| (配当等相当額)           | ( 2,487,691,350) |
| (売買損益相当額)          | (△1,825,814,270) |
| (G) 計(D+E+F)       | 2,848,746,748    |
| (H) 収益分配金          | △ 63,987,930     |
| 次期繰越損益金(G+H)       | 2,784,758,818    |
| 追加信託差損益金           | 661,877,080      |
| (配当等相当額)           | ( 2,489,125,056) |
| (売買損益相当額)          | (△1,827,247,976) |
| 分配準備積立金            | 2,232,683,981    |
| 繰越損益金              | △ 109,802,243    |

- (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。

## ○分配金のお知らせ

|                 |      |
|-----------------|------|
| 1 万円当たり分配金（税込み） | 100円 |
|-----------------|------|

◆分配金は決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、2017年5月22日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

※NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

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

### 【お 知 ら せ】

- ①信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める（分散型に分類）ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2016年8月20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。



# 三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド

## 《第17期》決算日2017年2月20日

[計算期間：2016年2月23日～2017年2月20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20日に第17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17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。<br>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。<br>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。<br>外貨建資産への投資は行いません。   |

### ○最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額   |       | 東証株価指数<br>(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     |
| 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 |
| 17期(2017年2月20日) | 12,356 | 21.7  | 1,547.01          | 19.0  | 98.6   | 1.3    | 209,506 |

(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<br>(TOPIX) |            | 株 組 入 比 率<br>% | 株 先 物 比 率<br>% |
|---------------------|---------|------------|------------------------|------------|----------------|----------------|
|                     | 円       | 騰 落 率<br>% | (TOPIX)                | 騰 落 率<br>% |                |                |
| (期 首)<br>2016年2月22日 | 10,155  | —          | 1,300.00               | —          | 99.0           | 1.0            |
| 2月末                 | 10,141  | △ 0.1      | 1,297.85               | △ 0.2      | 101.8          | 1.0            |
| 3月末                 | 10,627  | 4.6        | 1,347.20               | 3.6        | 97.3           | 1.8            |
| 4月末                 | 10,573  | 4.1        | 1,340.55               | 3.1        | 97.7           | 1.6            |
| 5月末                 | 10,888  | 7.2        | 1,379.80               | 6.1        | 98.0           | 1.5            |
| 6月末                 | 9,845   | △ 3.1      | 1,245.82               | △ 4.2      | 101.1          | 0.9            |
| 7月末                 | 10,455  | 3.0        | 1,322.74               | 1.7        | 98.1           | 1.1            |
| 8月末                 | 10,512  | 3.5        | 1,329.54               | 2.3        | 98.8           | 1.1            |
| 9月末                 | 10,545  | 3.8        | 1,322.78               | 1.8        | 97.2           | 2.0            |
| 10月末                | 11,105  | 9.4        | 1,393.02               | 7.2        | 96.8           | 1.6            |
| 11月末                | 11,717  | 15.4       | 1,469.43               | 13.0       | 97.8           | 1.1            |
| 12月末                | 12,124  | 19.4       | 1,518.61               | 16.8       | 98.7           | 0.8            |
| 2017年1月末            | 12,150  | 19.6       | 1,521.67               | 17.1       | 98.6           | 0.8            |
| (期 末)<br>2017年2月20日 | 12,356  | 21.7       | 1,547.01               | 19.0       | 98.6           | 1.3            |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

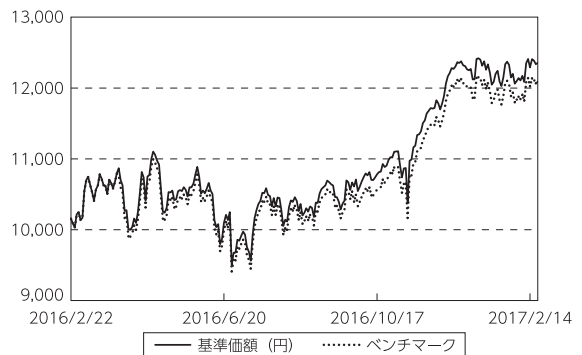
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ21.7%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(19.0%)を2.7%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2016年6月下旬にかけては、日本銀行による追加的な金融緩和策がたびたび見送られたことや英国の国民投票で欧州連合（EU）離脱派が勝利したことなどを受け、国内株式市況は下落しました。
- ・7月上旬から期末にかけては、国内の参議院選挙で与党が勝利し大規模な経済政策への期待が膨らんだことや、米国次期大統領政権下の経済政策への期待などから米国長期金利が上昇し、円安・米ドル高が進行したことなどにより、国内株式市況は上昇しました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・株式ポートフォリオは、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）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19.0%の上昇となったため、カイ離は2.7%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い運動性を維持しました。

|                 | 組入比率<br>要因 | 銘柄選択<br>要因 | その他の<br>要因 | 合計     |
|-----------------|------------|------------|------------|--------|
| ベンチマーク<br>とのカイ離 | 0.0%程度     | △0.0%程度    | 2.6%程度     | 2.7%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、1.3%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2.6%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  | 配当収入等  | 計 | 2.6%程度  |
| マイナス要因 | 売買コスト等 | 計 | △0.0%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7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

(2016年2月23日～2017年2月20日)

| 項 目   | 当 期                  |                                  | 項 目 の 概 要   |
|---|----------------------|----------------------------------|---|
|   | 金 額                  | 比 率                              |   |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料<br>( 株 式 )<br>( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ) | 円<br>0<br>(0)<br>(0) | %<br>0.003<br>(0.000)<br>(0.002) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| (b) そ の 他 費 用<br>( そ の 他 )                          | 0<br>(0)             | 0.000<br>(0.000)                 | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>信託事務の処理等に要するその他諸費用               |
| 合 計   | 0                    | 0.003                            |   |
| 期中の平均基準価額は、10,890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

(2016年2月23日～2017年2月20日)

## 株式

|     |    | 買 付                       |                         | 売 付          |                  |
|-----|----|---------------------------|-------------------------|--------------|------------------|
|     |    | 株 数                       | 金 額                     | 株 数          | 金 額              |
| 国 内 | 上場 | 千株<br>19,571<br>(△11,967) | 千円<br>23,416,677<br>( ) | 千株<br>39,723 | 千円<br>50,850,857 |

(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<br>48,641 | 百万円<br>48,368 | 百万円<br>- | 百万円<br>- |

## ○株式売買比率

(2016年2月23日～2017年2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       | 74,267,535千円  |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 205,001,407千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.36          |

(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

(2016年2月23日～2017年2月20日)

## 利害関係人との取引状況

| 区 分        | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B |               | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D |               |
|------------|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
|            |               |                    | $\frac{B}{A}$ |               |                    | $\frac{D}{C}$ |
| 株式         | 百万円<br>23,416 | 百万円<br>785         | %<br>3.4      | 百万円<br>50,850 | 百万円<br>9,040       | %<br>17.8     |
| 貸付有価証券(株式) | 457,988       | 320,630            | 70.0          | 433,318       | 304,812            | 70.3          |

## 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 買 付 額      | 売 付 額        | 当 期 末 保 有 額  |
|-----|------------|--------------|--------------|
| 株式  | 百万円<br>437 | 百万円<br>1,315 | 百万円<br>5,617 |

## 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 買 付 額    |
|-----|----------|
| 株式  | 百万円<br>5 |

## 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)    | 5,764千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 338千円   |
| (B) / (A)        | 5.9%    |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは中央銀行、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MUFJ証券、日立キャピタルです。

## ○組入資産の明細

(2017年2月20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    |
| <b>水産・農林業 (0.1%)</b> |         |       |         |       |
| 極洋                   | 49      | 4.1   | 11,689  |       |
| 日本水産                 | 132.6   | 133.3 | 74,914  |       |
| マルハニチロ               | 23.5    | 19.5  | 64,057  |       |
| カネコ種苗                | —       | 3.6   | 5,166   |       |
| サカタのタネ               | 16.9    | 15.1  | 48,093  |       |
| ホクト                  | 11.7    | 10.4  | 22,214  |       |
| ホクリヨウ                | —       | 1.2   | 924     |       |
| <b>鉱業 (0.3%)</b>     |         |       |         |       |
| 住石ホールディングス           | 35.3    | 33.3  | 3,296   |       |
| 日鉄鉱業                 | 32      | 2.8   | 16,884  |       |
| 三井松島産業               | 76      | 6.5   | 9,815   |       |
| 国際石油開発帝石             | 606     | 540.7 | 604,772 |       |
| 日本海洋掘削               | 3.4     | 3.8   | 9,169   |       |
| 石油資源開発               | 18.2    | 16.3  | 44,091  |       |
| K&Oエナジーグループ          | 7.6     | 6.9   | 12,185  |       |
| <b>建設業 (2.9%)</b>    |         |       |         |       |
| ショーボンドホールディングス       | 12      | 9.9   | 49,500  |       |
| ミライト・ホールディングス        | 35.3    | 31.6  | 33,274  |       |
| タマホーム                | 9.8     | 8.2   | 4,551   |       |
| サンヨーホームズ             | 3.5     | 2.6   | 1,726   |       |
| ファーストコーポレーション        | —       | 1.1   | 1,019   |       |
| インベスターズクラウド          | —       | 0.7   | 3,167   |       |
| ダイセキ環境ソリューション        | 2.7     | 2.4   | 3,818   |       |
| 安藤・間                 | 76.8    | 73.8  | 62,730  |       |
| 東急建設                 | 37.6    | 36.6  | 30,561  |       |
| コムシスホールディングス         | 49.4    | 40.1  | 81,202  |       |
| ミサワホーム               | 13.8    | 12.4  | 13,069  |       |
| ピーアールホールディングス        | —       | 10.9  | 3,291   |       |
| 高松コンストラクショングループ      | 8.6     | 7.7   | 20,389  |       |
| 東建コーポレーション           | 4.7     | 3.8   | 30,476  |       |
| ソネック                 | —       | 1.4   | 910     |       |
| ヤマウラ                 | 5.8     | 5     | 3,040   |       |
| 大成建設                 | 597     | 522   | 420,732 |       |

| 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    |
| 大林組           | 345     | 307.8 | 327,807 |       |
| 清水建設          | 352     | 314   | 327,188 |       |
| 飛鳥建設          | 88.7    | 99.8  | 17,465  |       |
| 長谷工コーポレーション   | 134.2   | 119.8 | 154,302 |       |
| 松井建設          | 12.8    | 11.5  | 12,213  |       |
| 銭高組           | 16      | 15    | 6,420   |       |
| 鹿島建設          | 539     | 451   | 334,191 |       |
| 不動テトラ         | 82.3    | 84    | 17,052  |       |
| 鉄建建設          | 70      | 63    | 21,231  |       |
| 西松建設          | 133     | 119   | 69,615  |       |
| 三井住友建設        | 443.5   | 394.3 | 48,498  |       |
| 大豊建設          | 44      | 37    | 19,462  |       |
| 前田建設工業        | 71      | 65    | 65,130  |       |
| 佐田建設          | 8.3     | 7.5   | 3,172   |       |
| ナカノフドー建設      | 8.9     | 8     | 4,464   |       |
| 奥村組           | 109     | 84    | 59,304  |       |
| 東鉄工業          | 13.7    | 12.4  | 38,998  |       |
| イチケン          | 14      | 10    | 4,870   |       |
| 浅沼組           | 37      | 33    | 11,847  |       |
| 戸田建設          | 134     | 119   | 79,492  |       |
| 熊谷組           | 168     | 161   | 51,359  |       |
| 青木あすなろ建設      | 7.6     | 6.4   | 5,248   |       |
| 北野建設          | 25      | 21    | 6,720   |       |
| 植木組           | 16      | 12    | 3,156   |       |
| 三井ホーム         | 15      | 13    | 7,488   |       |
| 矢作建設工業        | 15.8    | 14.1  | 14,819  |       |
| ビーエス三菱        | 14.1    | 11.5  | 4,646   |       |
| 日本ハウスホールディングス | 24      | 21    | 10,857  |       |
| 大東建託          | 43      | 37.8  | 596,295 |       |
| 新日本建設         | 13.9    | 12.5  | 11,612  |       |
| N I P P O     | 26      | 24    | 52,224  |       |
| 東亜道路工業        | 22      | 19    | 6,555   |       |
| 前田道路          | 36      | 32    | 64,384  |       |
| 日本道路          | 34      | 31    | 14,911  |       |

| 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    |
| 東亜建設工業        | 100     | 8.4   | 16,413  |       |
| 若築建設          | 68      | 61    | 9,272   |       |
| 東洋建設          | 36.2    | 30    | 12,720  |       |
| 五洋建設          | 127.6   | 113.9 | 58,772  |       |
| 大林道路          | 13.6    | 10.7  | 7,340   |       |
| 世紀東急工業        | 18.3    | 14.7  | 7,585   |       |
| 福田組           | 18      | 17    | 17,748  |       |
| 住友林業          | 79.2    | 70.6  | 113,454 |       |
| 日本基礎技術        | 13      | 11.5  | 4,174   |       |
| 日成ビルド工業       | 31      | 31    | 17,081  |       |
| ヤマダ・エスバイエルホーム | 63      | 58    | 4,640   |       |
| バコーボレーション     | 15      | 13    | 4,654   |       |
| バナホーム         | 43      | 38    | 40,166  |       |
| 大和ハウス工業       | 339.8   | 303.2 | 942,648 |       |
| ライト工業         | 22.2    | 19.8  | 22,888  |       |
| 積水ハウス         | 384.6   | 323   | 580,754 |       |
| 日特建設          | 12.7    | 9.1   | 4,022   |       |
| 北陸電気工事        | 4.3     | 5     | 4,425   |       |
| ユアテック         | 18      | 16    | 12,864  |       |
| 西部電気工業        | 10      | 1.7   | 3,901   |       |
| 四電工           | 10      | 8     | 3,400   |       |
| 中電工           | 16.5    | 12.9  | 30,534  |       |
| 関電工           | 46      | 41    | 37,925  |       |
| きんでん          | 69.5    | 68.3  | 101,425 |       |
| 東京エネシス        | 13      | 11    | 10,461  |       |
| トーエネック        | 16      | 14    | 7,826   |       |
| 住友電設          | 9.2     | 7     | 8,946   |       |
| 日本電設工業        | 18.8    | 16.7  | 33,249  |       |
| 協和エクシオ        | 45.1    | 40.2  | 63,998  |       |
| 新日本空調         | 9.8     | 7.9   | 10,862  |       |
| NDS           | 19      | 1.4   | 4,088   |       |
| 九電工           | 21      | 19.9  | 58,665  |       |
| 三機工業          | 25.7    | 22.6  | 22,645  |       |
| 日揮            | 116     | 95.8  | 196,677 |       |
| 中外炉工業         | 36      | 31    | 7,440   |       |
| ヤマト           | 10.6    | 9.1   | 4,923   |       |
| 太平電業          | 16      | 14    | 14,728  |       |
| 高砂熱学工業        | 34.3    | 28.1  | 46,336  |       |
| 三晃金属工業        | 13      | 0.9   | 2,893   |       |

| 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    |
| 朝日工業社             | 14      | 2.3   | 6,980   |       |
| 明星工業              | 21.1    | 18.8  | 11,524  |       |
| 大氣社               | 14.1    | 13.6  | 39,317  |       |
| ダイダシ              | 15      | 14    | 13,454  |       |
| 日比谷総合設備           | 14      | 11.4  | 19,619  |       |
| 東芝プラントシステム        | 18.5    | 16.7  | 26,903  |       |
| OSJBホールディングス      | —       | 32.7  | 8,207   |       |
| 東洋エンジニアリング        | 61      | 61    | 16,470  |       |
| 千代田化工建設           | 83      | 75    | 54,000  |       |
| 新興ブランテック          | 23.6    | 20.8  | 19,364  |       |
| <b>食料品 (4.4%)</b> |         |       |         |       |
| 日本製粉              | 76      | 30.3  | 51,358  |       |
| 日清製粉グループ本社        | 126.1   | 112.5 | 189,562 |       |
| 日東富士製粉            | 9       | 0.6   | 2,397   |       |
| 昭和産業              | 47      | 42    | 25,578  |       |
| 鳥越製粉              | 8.9     | 7.9   | 6,391   |       |
| 中部飼料              | 10.6    | 11.1  | 12,809  |       |
| フィード・ワン           | 69.6    | 61.8  | 11,124  |       |
| 東洋精糖              | 23      | 17    | 2,023   |       |
| 日本甜菜製糖            | 59      | 5.3   | 13,043  |       |
| 三井製糖              | 45      | 7.2   | 19,137  |       |
| 塩水港精糖             | 13.9    | 12.4  | 3,174   |       |
| 日新製糖              | 1.6     | 4.2   | 7,711   |       |
| 森永製菓              | 104     | 20    | 94,200  |       |
| 中村屋               | 27      | 2.4   | 12,312  |       |
| 江崎グリコ             | 26.6    | 25.7  | 136,210 |       |
| 名糖産業              | 5.2     | 4.4   | 6,111   |       |
| 不二家               | 65      | 60    | 13,380  |       |
| 山崎製パン             | 84      | 75.2  | 167,244 |       |
| 第一屋製パン            | 23      | 18    | 2,268   |       |
| モロゾフ              | 18      | 16    | 8,128   |       |
| 亀田製菓              | 6.4     | 5.8   | 28,797  |       |
| 寿スピリッツ            | 2.7     | 7.4   | 19,195  |       |
| カルビー              | 42.6    | 41.9  | 157,125 |       |
| 森永乳業              | 103     | 92    | 68,080  |       |
| 六甲パター             | 5.1     | 4.6   | 11,274  |       |
| ヤクルト本社            | 61.7    | 55    | 344,850 |       |
| 明治ホールディングス        | 68.1    | 60.8  | 527,136 |       |
| 雪印メグミルク           | 27.1    | 22.1  | 65,128  |       |

| 銘柄               | 期首(前期末) |       | 当 期 末   |       |
|------------------|---------|-------|---------|-------|
|                  | 株 数     | 株 数   | 株 数     | 評 価 額 |
|                  | 千株      | 千株    | 千株      | 千円    |
| ブリマハム            | 72      | 65    | 29,185  |       |
| 日本ハム             | 85      | 70    | 214,550 |       |
| 伊藤ハム             | 55      | —     | —       |       |
| 丸大食品             | 59      | 49    | 24,353  |       |
| 米久               | 3.6     | —     | —       |       |
| S Foods          | 7.1     | 5.5   | 17,820  |       |
| 伊藤ハム米久ホールディングス   | —       | 59.2  | 64,764  |       |
| サッポロホールディングス     | 176     | 33.6  | 95,793  |       |
| アサヒグループホールディングス  | 215.8   | 192.6 | 791,586 |       |
| キリンホールディングス      | 466.2   | 442   | 843,557 |       |
| 宝ホールディングス        | 83.3    | 74.3  | 82,398  |       |
| オエノンホールディングス     | 32      | 26    | 6,890   |       |
| 養命酒製造            | 3.5     | 3     | 5,610   |       |
| コカ・コーラウエスト       | 39      | 34.8  | 110,142 |       |
| コカ・コーライーストジャパン   | 40.7    | 39.9  | 94,044  |       |
| サントリー食品インターナショナル | 78.8    | 70.3  | 326,895 |       |
| ダイドーグループホールディングス | 5.8     | 4.7   | 26,508  |       |
| 伊藤園              | 34.1    | 30.5  | 113,002 |       |
| キーコーヒー           | 10      | 9.1   | 19,992  |       |
| ユニカフェ            | 3.3     | 2.9   | 2,830   |       |
| ジャパンフーズ          | 1.9     | 1.4   | 1,934   |       |
| 日清オイリオグループ       | 61      | 59    | 34,220  |       |
| 不二製油グループ本社       | 30.7    | 27.4  | 66,280  |       |
| かどや製油            | 1       | 1     | 4,685   |       |
| J-オイルミルズ         | 48      | 4.8   | 19,680  |       |
| キッコーマン           | 87      | 72    | 244,440 |       |
| 味の素              | 246     | 211.5 | 490,574 |       |
| キューピー            | 58.5    | 52.2  | 153,572 |       |
| ハウス食品グループ本社      | 39.3    | 38    | 90,896  |       |
| カゴメ              | 41.3    | 36.8  | 105,910 |       |
| 焼津水産化学工業         | 5.4     | 4.8   | 5,899   |       |
| アリアケジャパン         | 9.4     | 8.4   | 52,416  |       |
| ビエトロ             | 1.2     | 1.3   | 2,151   |       |
| エバラ食品工業          | 2.8     | 2.5   | 5,247   |       |
| ニチレイ             | 123     | 50.5  | 129,532 |       |
| 東洋水産             | 56.6    | 50.5  | 200,990 |       |
| イートアンド           | 1.3     | 1.2   | 2,744   |       |
| 大冷               | —       | 0.8   | 1,444   |       |
| 日清食品ホールディングス     | 48.7    | 40.1  | 246,214 |       |

| 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    |
| 永谷園ホールディングス        | 11      | 10    | 14,250    |       |
| 一正蒲鉾               | 4.2     | 3.7   | 4,373     |       |
| フジッコ               | 11.2    | 10    | 24,500    |       |
| ロック・フィールド          | 6       | 10.1  | 17,069    |       |
| 日本たばこ産業            | 680.1   | 568.9 | 2,147,028 |       |
| ケンコーマヨネーズ          | 3.7     | 3.8   | 10,298    |       |
| わらべや日洋ホールディングス     | 6.2     | 6     | 15,318    |       |
| なとり                | 5.7     | 5.2   | 9,698     |       |
| 北の達人コーポレーション       | 1.8     | 2.5   | 1,620     |       |
| ユーグレナ              | 38.8    | 33.2  | 41,168    |       |
| ミヨシ油脂              | 42      | 38    | 5,396     |       |
| 理研ビタミン             | 3.3     | 3.1   | 13,454    |       |
| <b>繊維製品 (0.7%)</b> |         |       |           |       |
| 片倉工業               | 13.7    | 12.2  | 18,434    |       |
| グンゼ                | 87      | 72    | 30,384    |       |
| 東洋紡                | 426     | 380   | 74,860    |       |
| ユニチカ               | 324     | 267   | 24,030    |       |
| 富士紡ホールディングス        | 54      | 4.8   | 16,152    |       |
| 倉敷紡績               | 111     | 98    | 23,226    |       |
| シキボウ               | 74      | 56    | 8,568     |       |
| 日本毛織               | 33      | 27.2  | 24,616    |       |
| トーア紡コーポレーション       | 6.5     | 5.1   | 2,769     |       |
| ダイドーリミテッド          | 13.6    | 12.8  | 5,798     |       |
| 帝国繊維               | 11.2    | 10    | 16,990    |       |
| 帝人                 | 439     | 78.4  | 169,265   |       |
| 東レ                 | 780     | 696   | 676,860   |       |
| サカイオーベックス          | 30      | 2.5   | 4,900     |       |
| 住江織物               | 28      | 27    | 7,857     |       |
| 日本フェルト             | 5.1     | 5.5   | 2,882     |       |
| イチカワ               | 7       | 7     | 2,107     |       |
| 芦森工業               | 25      | —     | —         |       |
| アツギ                | 87      | 83    | 10,541    |       |
| ダイニック              | 22      | 19    | 3,667     |       |
| セーレン               | 26.9    | 23.9  | 37,738    |       |
| ソトー                | —       | 4.2   | 4,897     |       |
| 東海染工               | 19      | 18    | 2,646     |       |
| 小松精練               | 16.8    | 14.3  | 10,510    |       |
| ワコールホールディングス       | 64      | 57    | 80,940    |       |
| ホギメディカル            | 6.7     | 6.1   | 41,297    |       |



| 銘柄                  | 期首(前期末) |       | 当 期 末   |       |
|---------------------|---------|-------|---------|-------|
|                     | 株 数     | 株 数   | 株 数     | 評 価 額 |
|                     | 千株      | 千株    | 千株      | 千円    |
| クラウドディア             | 3.6     | 3.4   | 1,866   |       |
| T S I ホールディングス      | 48      | 40.1  | 33,122  |       |
| 三陽商会                | 61      | 53    | 9,116   |       |
| オンワードホールディングス       | 71      | 62    | 53,196  |       |
| ルック                 | 21      | 20    | 4,180   |       |
| キムラタン               | 510     | —     | —       |       |
| ゴールドウイン             | 4.5     | 4.1   | 23,575  |       |
| デサント                | 24.6    | 22    | 27,434  |       |
| キング                 | 6.8     | 5.7   | 2,365   |       |
| ヤマトインターナショナル        | 7.6     | 7.5   | 3,097   |       |
| <b>パルプ・紙 (0.2%)</b> |         |       |         |       |
| 特種東海製紙              | 62      | 5.6   | 23,548  |       |
| 王子ホールディングス          | 441     | 375   | 195,000 |       |
| 日本製紙                | 55.6    | 43    | 85,183  |       |
| 三菱製紙                | 166     | 13.7  | 10,412  |       |
| 北越紀州製紙              | 66.6    | 53.3  | 40,028  |       |
| 中越パルプ工業             | 44      | 38    | 9,196   |       |
| 巴川製紙所               | 18      | 16    | 4,016   |       |
| 大王製紙                | 47.5    | 38.1  | 49,339  |       |
| 阿波製紙                | —       | 1.9   | 1,151   |       |
| レンゴー                | 95      | 92.5  | 60,217  |       |
| トーモク                | 34      | 30    | 10,050  |       |
| ザ・バック               | 7.5     | 6.8   | 20,910  |       |
| <b>化学 (6.7%)</b>    |         |       |         |       |
| クラレ                 | 169.7   | 161.5 | 277,295 |       |
| 旭化成                 | 671     | 598   | 654,810 |       |
| 共和レザー               | 7       | 5.5   | 5,093   |       |
| 昭和電工                | 716     | 63.9  | 126,649 |       |
| 住友化学                | 792     | 706   | 450,428 |       |
| 日本化成                | 22      | —     | —       |       |
| 住友精化                | 22      | 4     | 18,900  |       |
| 日産化学工業              | 64.6    | 52.6  | 205,929 |       |
| ラサ工業                | 42      | 39    | 5,733   |       |
| クレハ                 | 81      | 7.2   | 34,992  |       |
| 多木化学                | 7       | 7     | 6,608   |       |
| テイカ                 | 18      | 15    | 10,875  |       |
| 石原産業                | 195     | 17.3  | 19,376  |       |
| 片倉コープアグリ            | 14      | 13    | 3,107   |       |
| 日東エフシー              | 6.3     | 5.5   | 5,263   |       |

| 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    |
| 日本曹達           | 69      | 58    | 38,860    |       |
| 東ソー            | 290     | 277   | 278,108   |       |
| トクヤマ           | 180     | 149   | 85,377    |       |
| セントラル硝子        | 116     | 98    | 53,606    |       |
| 東亜合成           | 67.3    | 60.1  | 76,447    |       |
| 大阪ソーダ          | 46      | 41    | 20,295    |       |
| 関東電化工業         | 25      | 20    | 23,180    |       |
| デンカ            | 223     | 199   | 121,390   |       |
| 信越化学工業         | 192.8   | 172.1 | 1,697,766 |       |
| 日本カーバイド工業      | 39      | 35    | 5,670     |       |
| 堺化学工業          | 43      | 36    | 14,796    |       |
| エア・ウォーター       | 89      | 79.1  | 171,014   |       |
| 大陽日酸           | 82.8    | 73.9  | 105,381   |       |
| 日本化学工業         | 41      | 36    | 8,676     |       |
| 日本パーカラライジング    | 55      | 49    | 68,992    |       |
| 高圧ガス工業         | 16      | 14.2  | 10,863    |       |
| チタン工業          | 14      | 14    | 2,660     |       |
| 四国化成工業         | 15      | 14    | 16,590    |       |
| 戸田工業           | 23      | 20    | 5,700     |       |
| ステラ ケミファ       | 5.5     | 4.6   | 15,778    |       |
| 保土谷化学工業        | 34      | 3.4   | 12,410    |       |
| 日本触媒           | 15.6    | 15.1  | 112,797   |       |
| 大日精化工業         | 41      | 39    | 28,236    |       |
| カネカ            | 145     | 129   | 116,100   |       |
| 三菱瓦斯化学         | 185     | 89.4  | 207,855   |       |
| 三井化学           | 456     | 436   | 241,108   |       |
| J S R          | 100.9   | 96.5  | 194,833   |       |
| 東京応化工業         | 21.6    | 18    | 68,130    |       |
| 大阪有機化学工業       | 7.8     | 6.5   | 6,318     |       |
| 三菱ケミカルホールディングス | 720.2   | 646.4 | 555,451   |       |
| K H ネオケム       | —       | 11.9  | 15,946    |       |
| 日本合成化学工業       | 25      | —     | —         |       |
| ダイセル           | 151.2   | 129.4 | 181,289   |       |
| 住友ペークライト       | 100     | 85    | 56,525    |       |
| 積水化学工業         | 244.1   | 217.8 | 408,375   |       |
| 日本ゼオン          | 93      | 81    | 105,138   |       |
| アイカ工業          | 32.3    | 30.8  | 89,258    |       |
| 宇部興産           | 576     | 483   | 137,655   |       |
| 積水樹脂           | 16.5    | 14.6  | 27,477    |       |

| 銘柄              | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|-----------------|---------|-------|-----------|
|                 | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                 | 千株      | 千株    | 千円        |
| タキロン            | 25      | 20    | 10,880    |
| 旭有機材            | 34      | 30    | 7,260     |
| 日立化成            | 53.1    | 53.3  | 171,892   |
| ニチバン            | 11      | 10    | 9,300     |
| リケンテクノス         | 17.4    | 20.9  | 11,432    |
| 大倉工業            | 26      | 23    | 12,972    |
| 積水化成成品工業        | 27      | 13.6  | 11,288    |
| 群栄化学工業          | 28      | 2.3   | 8,705     |
| タイガースポリマー       | 5.3     | 4.7   | 3,769     |
| ミライアル           | 4.2     | 3.7   | 3,478     |
| ダイキアクシス         | 2.2     | 1.7   | 2,281     |
| ダイキョーニシカワ       | 13.8    | 16.9  | 24,572    |
| 日本化薬            | 70      | 62    | 98,022    |
| カーリットホールディングス   | 10.3    | 9.1   | 5,405     |
| 日本精化            | 9       | 7.7   | 7,291     |
| 扶桑化学工業          | 6.8     | 6.8   | 21,352    |
| ADEKA           | 52.9    | 41.3  | 64,510    |
| 日油              | 82      | 77    | 97,328    |
| 新日本理化           | 18.3    | 16.6  | 2,539     |
| ハリマ化成グループ       | 9.4     | 8.2   | 6,453     |
| 花王              | 289.2   | 243.7 | 1,395,669 |
| 第一工業製薬          | 24      | 21    | 9,534     |
| 日華化学            | —       | 2     | 2,576     |
| ニイタカ            | 1.7     | 1.5   | 2,257     |
| 三洋化成工業          | 33      | 5.9   | 27,789    |
| 有機合成薬品工業        | —       | 6.3   | 1,719     |
| 大日本塗料           | 62      | 56    | 13,048    |
| 日本ペイントホールディングス  | 83      | 74    | 266,030   |
| 関西ペイント          | 121.7   | 100.8 | 221,760   |
| 神東塗料            | 9       | 8     | 1,776     |
| 中国塗料            | 30      | 27.4  | 23,399    |
| 日本特殊塗料          | 7.6     | 6.8   | 11,920    |
| 藤倉化成            | 14.6    | 12.7  | 8,661     |
| 太陽ホールディングス      | 7.9     | 7.8   | 37,245    |
| D I C           | 431     | 37.9  | 149,705   |
| サカタインクス         | 21.9    | 19.5  | 31,473    |
| 東洋インキＳＣホールディングス | 105     | 93    | 51,615    |
| T&K TOKA        | 7.6     | 6.8   | 7,357     |
| 富士フィルムホールディングス  | 246.1   | 190.3 | 829,708   |

| 銘柄               | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|------------------|---------|-------|---------|
|                  | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                  | 千株      | 千株    | 千円      |
| 資生堂              | 204     | 182   | 522,886 |
| ライオン             | 124     | 119   | 223,006 |
| 高砂香料工業           | 7.1     | 6.3   | 22,711  |
| マンダム             | 9.9     | 9.6   | 49,920  |
| ミルボン             | 6.3     | 5.2   | 27,508  |
| ファンケル            | 24.9    | 20.4  | 32,925  |
| コーセー             | 17.4    | 15.5  | 142,445 |
| コタ               | 3.4     | 3.6   | 4,780   |
| シーズ・ホールディングス     | 13.5    | 12.5  | 38,937  |
| シーボン             | 1.3     | 1.1   | 2,810   |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 11      | 9.8   | 107,016 |
| ノエビアホールディングス     | 6.8     | 6     | 25,680  |
| アジupanコスメジャパン    | 2       | 1.9   | 1,850   |
| エステー             | 7.3     | 6.6   | 11,431  |
| アグロ カネショウ        | 4.2     | 3.8   | 4,978   |
| コニシ              | 8.4     | 15.2  | 20,672  |
| 長谷川香料            | 13.6    | 12.2  | 23,875  |
| 星光PMC            | 6.1     | 5.5   | 6,226   |
| 小林製薬             | 16.3    | 26.6  | 138,586 |
| 荒川化学工業           | 9.2     | 8.2   | 16,744  |
| メック              | 8.5     | 7.5   | 9,285   |
| 日本高純度化学          | 3.1     | 2.8   | 6,944   |
| タカラバイオ           | —       | 20.7  | 31,960  |
| J C U            | 3.1     | 3     | 22,500  |
| 新田ゼラチン           | 7.2     | 5.8   | 4,379   |
| OATアグリオ          | 1       | 1.2   | 1,761   |
| デクセリアルズ          | 24.1    | 25.1  | 32,328  |
| アース製薬            | 7.7     | 6.9   | 35,259  |
| イハラケミカル工業        | 16.6    | 13.4  | 14,137  |
| 北興化学工業           | 12      | 9     | 4,365   |
| 大成ラミック           | 3       | 2.7   | 8,491   |
| クミアイ化学工業         | 22.3    | 20    | 13,460  |
| 日本農薬             | 24.6    | 22    | 15,400  |
| アキレス             | 88      | 7.7   | 14,060  |
| 有沢製作所            | 16      | 16    | 12,624  |
| 日東電工             | 83.1    | 69.2  | 659,337 |
| レック              | 3.3     | 3     | 13,605  |
| きもと              | 19.3    | 18.6  | 4,631   |
| 藤森工業             | 9.2     | 7.1   | 21,442  |

| 銘柄                | 期首(前期末) |       | 当 期 末     |       |
|-------------------|---------|-------|-----------|-------|
|                   | 株 数     | 株 数   | 株 数       | 評 価 額 |
|                   | 千株      | 千株    | 千株        | 千円    |
| 前澤化成工業            | 7.5     | 6.2   | 7,495     |       |
| J S P             | 7       | 4.4   | 11,369    |       |
| エフビコ              | 9.5     | 8.5   | 43,775    |       |
| 天馬                | 8.2     | 6.3   | 13,513    |       |
| 信越ポリマー            | 21      | 18.8  | 15,698    |       |
| 東リ                | 28      | 23.2  | 9,581     |       |
| ニフコ               | 20.6    | 16.8  | 95,928    |       |
| 日本バルカー工業          | 40      | 7.4   | 13,638    |       |
| ユニ・チャーム           | 217.7   | 194.2 | 474,721   |       |
| <b>医薬品 (4.7%)</b> |         |       |           |       |
| 協和発酵キリン           | 128.6   | 114.8 | 188,157   |       |
| 武田薬品工業            | 428.2   | 359.7 | 1,885,547 |       |
| アステラス製薬           | 1,204   | 980.2 | 1,483,042 |       |
| 大日本住友製薬           | 76.1    | 67.9  | 133,559   |       |
| 塩野義製薬             | 156.7   | 129.8 | 712,602   |       |
| 田辺三菱製薬            | 125.3   | 111.8 | 256,581   |       |
| わかもと製薬            | 13      | 11    | 2,805     |       |
| あすか製薬             | 13.8    | 10.5  | 18,060    |       |
| 日本新薬              | 24.6    | 22    | 134,420   |       |
| ビオフェルミン製薬         | 1.7     | 1.5   | 4,627     |       |
| 中外製薬              | 107     | 95.5  | 366,720   |       |
| 科研製薬              | 18.5    | 17.9  | 105,431   |       |
| エーザイ              | 132.4   | 118.1 | 722,063   |       |
| ロート製薬             | 52.6    | 47    | 103,118   |       |
| 小野薬品工業            | 48.8    | 217.9 | 549,761   |       |
| 久光製薬              | 33.4    | 27.1  | 166,123   |       |
| 有機合成薬品工業          | 8       | —     | —         |       |
| 持田製薬              | 7.4     | 6.6   | 55,638    |       |
| 参天製薬              | 197.9   | 173.2 | 281,103   |       |
| 扶桑薬品工業            | 36      | 3.2   | 9,180     |       |
| 日本ケミファ            | 15      | 1.3   | 7,202     |       |
| ツムラ               | 33.8    | 32.2  | 109,158   |       |
| 日医工               | 25.1    | 22.4  | 38,617    |       |
| キッセイ薬品工業          | 19      | 16.8  | 48,115    |       |
| 生化学工業             | 20.6    | 17.8  | 30,740    |       |
| 栄研化学              | 9       | 8.1   | 24,624    |       |
| 日水製薬              | 4.4     | 3.7   | 5,057     |       |
| 鳥居薬品              | 7.3     | 6.5   | 18,908    |       |
| J C R ファーマ        | 8.3     | 7.4   | 21,134    |       |

| 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    |
| 東和薬品                   | 4.9     | 4.4     | 23,144    |       |
| 富士製薬工業                 | 3       | 3.2     | 9,872     |       |
| 沢井製薬                   | 18.2    | 16.3    | 99,919    |       |
| ゼリア新薬工業                | 22.1    | 19.8    | 33,778    |       |
| 第一三共                   | 361.6   | 282.3   | 723,676   |       |
| キョーリン製薬ホールディングス        | 28.7    | 23.4    | 55,200    |       |
| 大幸薬品                   | 5.2     | 5       | 8,985     |       |
| ダイト                    | 4.5     | 5.8     | 13,195    |       |
| 大塚ホールディングス             | 231.2   | 206.3   | 1,063,476 |       |
| 大正製薬ホールディングス           | 25.9    | 20.5    | 189,215   |       |
| ペプチドリーム                | 13.2    | 17.9    | 95,407    |       |
| <b>石油・石炭製品 (0.5%)</b>  |         |         |           |       |
| 日本コークス工業               | 90.4    | 80.9    | 8,413     |       |
| 昭和シェル石油                | 108.1   | 85.8    | 93,007    |       |
| ニチレキ                   | 13      | 11.8    | 10,797    |       |
| 東燃ゼネラル石油               | 162     | 156     | 205,452   |       |
| ユシロ化学工業                | 5.7     | 5       | 7,260     |       |
| ビービー・カストロール            | 4.3     | 3.9     | 6,438     |       |
| 富士石油                   | 25.4    | 22.7    | 8,943     |       |
| MORESCO                | 3.4     | 3.4     | 5,956     |       |
| 出光興産                   | 56.1    | 45.5    | 161,752   |       |
| J Xホールディングス            | 1,272.8 | 1,064.7 | 561,096   |       |
| コスモエネルギーホールディングス       | 32.5    | 28.9    | 55,863    |       |
| <b>ゴム製品 (1.0%)</b>     |         |         |           |       |
| 横浜ゴム                   | 64.9    | 57.9    | 127,148   |       |
| 東洋ゴム工業                 | 48.6    | 50.6    | 86,374    |       |
| ブリヂストン                 | 362.9   | 323.8   | 1,472,966 |       |
| 住友ゴム工業                 | 100.6   | 89.8    | 162,627   |       |
| 藤倉ゴム工業                 | 9.2     | 8.3     | 5,884     |       |
| オカモト                   | 33      | 29      | 29,841    |       |
| フコク                    | 3.7     | 3.5     | 3,286     |       |
| ニッタ                    | 11.6    | 8.6     | 25,714    |       |
| 住友理工                   | 23.1    | 17.7    | 20,514    |       |
| 三ツ星ベルト                 | 26      | 23      | 23,115    |       |
| パンドー化学                 | 39      | 17.2    | 18,266    |       |
| <b>ガラス・土石製品 (1.0%)</b> |         |         |           |       |
| 日東紡績                   | 71      | 77      | 38,962    |       |
| 旭硝子                    | 567     | 473     | 434,214   |       |
| 日本板硝子                  | 521     | 43.9    | 37,534    |       |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|--------------------|---------|-------|-----------|
|                    | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                    | 千株      | 千株    | 千円        |
| 石塚硝子               | 16      | 14    | 3,374     |
| 日本山村硝子             | 44      | 37    | 7,548     |
| 日本電気硝子             | 222     | 198   | 139,590   |
| オハラ                | 3.8     | 3.8   | 4,297     |
| 住友大阪セメント           | 213     | 178   | 82,058    |
| 太平洋セメント            | 671     | 579   | 236,811   |
| デイ・シイ              | 10.5    | —     | —         |
| 日本ヒューム             | 10.3    | 9     | 6,390     |
| 日本コンクリート工業         | 22.8    | 21.7  | 7,443     |
| 三谷セキサン             | 5.3     | 4.8   | 12,254    |
| アジアパイルホールディングス     | 13.5    | 11.9  | 6,890     |
| 東海カーボン             | 93      | 89.4  | 41,839    |
| 日本カーボン             | 54      | 48    | 14,352    |
| 東洋炭素               | 6       | 5.4   | 10,546    |
| ノリタケカンパニーリミテド      | 60      | 5.3   | 15,502    |
| TOTO               | 79      | 70.5  | 297,510   |
| 日本碍子               | 136     | 121.1 | 297,300   |
| 日本特殊陶業             | 92.6    | 82.7  | 213,696   |
| ダントーホールディングス       | 15      | 9     | 1,719     |
| MARUWA             | 3.9     | 3.5   | 13,002    |
| 品川リフラクトリーズ         | 26      | 24    | 7,248     |
| 黒崎播磨               | 24      | 21    | 9,744     |
| ヨータイ               | 6       | 5     | 1,930     |
| イソライト工業            | 6       | 5.1   | 2,131     |
| 東京窯業               | 12      | 11.7  | 2,445     |
| ニッカトー              | 3.6     | 2.8   | 1,190     |
| フジミインコーポレーテッド      | 9.4     | 8.2   | 21,229    |
| エーアンドエーマテリアル       | 27      | 23    | 3,082     |
| ニチアス               | 54      | 50    | 54,950    |
| ニチハ                | 14.4    | 12.8  | 40,384    |
| <b>鉄鋼 (1.4%)</b>   |         |       |           |
| 新日鐵住金              | 484.7   | 432.5 | 1,218,785 |
| 神戸製鋼所              | 1,975   | 165.8 | 188,846   |
| 中山製鋼所              | 125     | 10.8  | 8,434     |
| 合同製鐵               | 61      | 5.3   | 9,990     |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 293.8   | 262.2 | 561,632   |
| 日新製鋼               | 49      | 43.7  | 68,740    |
| 東京製鐵               | 59.4    | 48.5  | 50,585    |
| 共英製鋼               | 11.3    | 10.2  | 21,889    |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|--------------------|---------|-------|---------|
|                    | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                    | 千株      | 千株    | 千円      |
| 大和工業               | 23.7    | 19.2  | 63,744  |
| 東京鐵鋼               | 22      | 20    | 9,480   |
| 大阪製鐵               | 6.7     | 6     | 13,164  |
| 淀川製鋼所              | 15.9    | 13.2  | 44,352  |
| 東洋鋼板               | 26      | 22.7  | 10,510  |
| 丸一鋼管               | 36      | 32.1  | 115,399 |
| モリ工業               | 17      | 3.1   | 7,188   |
| 大同特殊鋼              | 180     | 161   | 91,770  |
| 日本高周波鋼業            | 45      | 37    | 3,256   |
| 日本冶金工業             | 81.7    | 80.4  | 18,652  |
| 山陽特殊製鋼             | 63      | 57    | 34,998  |
| 愛知製鋼               | 63      | 5.6   | 27,272  |
| 日立金属               | 123.1   | 97.6  | 163,675 |
| 日本金属               | 31      | 2.4   | 3,134   |
| 大平洋金属              | 76      | 61    | 25,437  |
| 新日本電工              | 61.5    | 55    | 18,535  |
| 栗本鐵工所              | 52      | 4.6   | 10,966  |
| 虹技                 | 16      | 15    | 3,795   |
| 日本鑄鉄管              | 13      | 11    | 2,233   |
| 三菱製鋼               | 76      | 67    | 17,487  |
| 日亜鋼業               | 14.9    | 13.4  | 3,819   |
| 日本精練               | 8       | 6     | 3,666   |
| シンニクタン             | 9.8     | 7.7   | 5,467   |
| 新家工業               | 24      | 20    | 3,580   |
| <b>非鉄金属 (1.0%)</b> |         |       |         |
| 大紀アルミニウム工業所        | 17      | 16    | 8,496   |
| 日本軽金属ホールディングス      | 242.7   | 233.8 | 66,866  |
| 三井金属鉱業             | 275     | 261   | 99,441  |
| 東邦亜鉛               | 58      | 54    | 34,290  |
| 三菱マテリアル            | 671     | 59.8  | 229,632 |
| 住友金属鉱山             | 297     | 248   | 401,388 |
| DOWAホールディングス       | 138     | 106   | 100,064 |
| 古河機械金属             | 168     | 150   | 35,700  |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ     | 10.6    | 10.6  | 20,839  |
| 東邦チタニウム            | 18.4    | 16.3  | 16,202  |
| UACJ               | 150     | 122   | 39,162  |
| 古河電気工業             | 338     | 32.2  | 132,181 |
| 住友電気工業             | 430.2   | 361.3 | 679,244 |
| フジクラ               | 150     | 126.2 | 107,648 |

| 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    |
| 昭和電線ホールディングス       | 135     | 119   | 10,829  |       |
| 東京特殊電線             | 1.8     | 1.5   | 2,358   |       |
| タツタ電線              | 22.3    | 17.8  | 8,205   |       |
| 沖電線                | 14      | 11    | 2,739   |       |
| カナレ電気              | 1.7     | 1.3   | 2,935   |       |
| 平河ヒューテック           | 5.2     | 4.7   | 5,259   |       |
| リョービ               | 65      | 58    | 29,638  |       |
| アーレスティ             | 12.6    | 11.2  | 13,216  |       |
| アサヒホールディングス        | 16.1    | 14.5  | 28,710  |       |
| <b>金属製品 (0.7%)</b> |         |       |         |       |
| 稲葉製作所              | 5.7     | 5     | 6,655   |       |
| 宮地エン지니어リンググループ     | 35      | 28    | 6,748   |       |
| トーカロ               | 7.5     | 6.3   | 17,148  |       |
| アルファC o            | 3.5     | 3.2   | 4,348   |       |
| SUMCO              | 84.1    | 100.1 | 177,877 |       |
| 川田テクノロジーズ          | 2.1     | 1.8   | 14,094  |       |
| RS Technologies    | —       | 0.4   | 2,380   |       |
| 東洋製織グループホールディングス   | 76.4    | 68.1  | 140,967 |       |
| ホッカンホールディングス       | 29      | 25    | 13,625  |       |
| コロナ                | 5.7     | 5.1   | 5,936   |       |
| 横河ブリッジホールディングス     | 20.5    | 16.9  | 23,727  |       |
| 駒井ハルテック            | 21      | 1.9   | 3,974   |       |
| 高田機工               | 12      | 9     | 2,187   |       |
| 三和ホールディングス         | 108.9   | 95.2  | 103,292 |       |
| 文化シャッター            | 29.8    | 26.6  | 22,902  |       |
| 三協立山               | 14.1    | 12.7  | 22,440  |       |
| アルインコ              | 5.9     | 6.3   | 6,615   |       |
| 東洋シャッター            | 3.1     | 2.9   | 1,879   |       |
| L I X I Lグループ      | 149.7   | 133.6 | 370,072 |       |
| 日本フィルコン            | 8.1     | 6.3   | 3,521   |       |
| ノーリツ               | 21      | 18.7  | 40,709  |       |
| 長府製作所              | 11.6    | 10.2  | 27,784  |       |
| リンナイ               | 20      | 16.3  | 142,299 |       |
| ダイニチ工業             | 5.6     | 4.6   | 3,367   |       |
| 日東精工               | 16      | 14    | 5,992   |       |
| 三洋工業               | 15      | 12    | 2,376   |       |
| 岡部                 | 22.2    | 19.8  | 19,720  |       |
| ジーテクト              | 11.1    | 10    | 21,510  |       |
| 東プレ                | 20.6    | 18.4  | 53,764  |       |

| 銘柄               | 期首(前期末) |       | 当 期 末   |       |
|------------------|---------|-------|---------|-------|
|                  | 株 数     | 株 数   | 株 数     | 評 価 額 |
|                  | 千株      | 千株    | 千株      | 千円    |
| 高周波熱練            | 20      | 17.7  | 16,248  |       |
| 東京製鋼             | 74      | 6.6   | 12,005  |       |
| サンコール            | 5.6     | 4.7   | 2,603   |       |
| モリテック スチール       | 5.5     | 5.5   | 1,650   |       |
| バイオラックス          | 5.4     | 4.8   | 37,392  |       |
| 日本発條             | 101.1   | 90.2  | 116,358 |       |
| 中央発條             | 14      | 10    | 3,400   |       |
| アドバネクス           | 2.2     | 1.7   | 3,228   |       |
| 立川ブラインド工業        | 4.7     | 3.9   | 3,603   |       |
| 三益半導体工業          | 8       | 8.1   | 14,256  |       |
| <b>機械 (5.1%)</b> |         |       |         |       |
| 日本ドライケミカル        | 1.3     | 1.3   | 3,003   |       |
| 日本製鋼所            | 178     | 31.7  | 64,224  |       |
| 三浦工業             | 47.9    | 39.2  | 67,698  |       |
| タクマ              | 39      | 30.7  | 31,375  |       |
| ツガミ              | 31      | 26    | 17,992  |       |
| オークマ             | 70      | 62    | 75,330  |       |
| 東芝機械             | 59      | 57    | 27,987  |       |
| アマダホールディングス      | 156.7   | 129.1 | 163,182 |       |
| アイダエンジニアリング      | 28.1    | 27.4  | 27,756  |       |
| 滝澤鉄工所            | 35      | 29    | 5,423   |       |
| 富士機械製造           | 35      | 29.1  | 44,610  |       |
| 牧野フライス製作所        | 53      | 48    | 51,168  |       |
| オーエスジー           | 48.9    | 43.7  | 104,748 |       |
| ダイジェット工業         | 14      | 14    | 2,562   |       |
| 旭ダイヤモンド工業        | 29.4    | 27.5  | 25,520  |       |
| DMG森精機           | 59.3    | 56.7  | 97,353  |       |
| ソディック            | 20.6    | 24.3  | 26,365  |       |
| ディスコ             | 13.7    | 11.2  | 191,296 |       |
| 日東工器             | 6.3     | 5.6   | 14,274  |       |
| パンチ工業            | 4.4     | 3.6   | 3,679   |       |
| 豊和工業             | 6.5     | 5.9   | 3,935   |       |
| OKK              | 44      | 37    | 4,662   |       |
| 石川製作所            | 32      | 2.9   | 2,215   |       |
| 東洋機械金属           | 8       | 6.6   | 3,781   |       |
| 津田駒工業            | 29      | 23    | 4,094   |       |
| 島精機製作所           | 15.1    | 12.5  | 47,937  |       |
| NCホールディングス       | —       | 3.4   | 3,185   |       |
| フリュー             | 1.6     | 1.9   | 8,854   |       |

| 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    |
| ヤマシンフィルタ     | —       | 2     | 3,540     |       |
| 日阪製作所        | 13.6    | 13.2  | 12,157    |       |
| やまびこ         | 19.7    | 17.6  | 25,520    |       |
| ベガサスミシン製造    | 11.1    | 9.3   | 7,867     |       |
| ナブテスコ        | 55.8    | 49.8  | 160,107   |       |
| 三井海洋開発       | 12.5    | 9.6   | 23,424    |       |
| レオン自動車       | 9.1     | 8.2   | 8,905     |       |
| SMC          | 32.2    | 28.7  | 909,790   |       |
| 新川           | 9.9     | 8.2   | 6,732     |       |
| ホソカワミクロン     | 18      | 16    | 13,152    |       |
| ユニオンツール      | 4.6     | 4.1   | 14,739    |       |
| オイレス工業       | 14      | 12.3  | 25,325    |       |
| 日精エー・エス・ピー機械 | 4       | 3.1   | 7,452     |       |
| サトーホールディングス  | 14.5    | 12    | 29,988    |       |
| 日本エアータック     | 4.4     | 3.2   | 2,092     |       |
| 日精樹脂工業       | 8       | 7.6   | 8,550     |       |
| オカダアイヨン      | —       | 2.1   | 2,452     |       |
| ワイエイシイ       | 4.5     | 3.7   | 4,983     |       |
| 小松製作所        | 526.7   | 442.3 | 1,238,882 |       |
| 住友重機械工業      | 313     | 280   | 230,440   |       |
| 日立建機         | 48      | 42.8  | 113,976   |       |
| 日工           | 16      | 2.9   | 6,101     |       |
| 巴工業          | 4.4     | 4     | 7,508     |       |
| 井関農機         | 111     | 98    | 25,284    |       |
| TOWA         | 10.6    | 7.9   | 16,432    |       |
| 丸山製作所        | 24      | 22    | 4,290     |       |
| 北川鉄工所        | 49      | 4.4   | 10,824    |       |
| ローツェ         | —       | 3.4   | 8,619     |       |
| タカキタ         | 2.8     | 3.3   | 1,890     |       |
| クボタ          | 515.9   | 458.9 | 848,965   |       |
| 荏原実業         | 3.1     | 2.5   | 3,425     |       |
| 三菱化工機        | 36      | 32    | 7,168     |       |
| 月島機械         | 20.2    | 18.1  | 23,457    |       |
| 帝国電機製作所      | 7.9     | 7     | 7,329     |       |
| 新東工業         | 24.5    | 21.9  | 22,710    |       |
| 澁谷工業         | 9       | 8     | 23,304    |       |
| アイチ コーポレーション | 15.2    | 13.6  | 12,049    |       |
| 小森コーポレーション   | 26      | 23    | 35,006    |       |
| 鶴見製作所        | 8       | 7.1   | 10,934    |       |

| 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    |
| 住友精密工業       | 18      | 15    | 5,520     |       |
| 酒井重工業        | 21      | 19    | 6,460     |       |
| 荏原製作所        | 238     | 43.4  | 146,041   |       |
| 石井鐵工所        | 17      | 1.6   | 2,856     |       |
| 西島製作所        | 11.6    | 9.6   | 10,992    |       |
| 北越工業         | 11.4    | 10.1  | 9,847     |       |
| ダイキン工業       | 149.5   | 125.1 | 1,341,072 |       |
| オルガノ         | 19      | 18    | 8,964     |       |
| トーヨーカネツ      | 58      | 45    | 14,310    |       |
| 栗田工業         | 64.6    | 54.2  | 148,237   |       |
| 椿本チエイン       | 60      | 54    | 53,298    |       |
| 大同工業         | 22      | 19    | 5,377     |       |
| 日本コンベヤ       | 38      | —     | —         |       |
| 木村化工機        | 9.6     | 8.9   | 3,097     |       |
| アネスト岩田       | 17.3    | 16.7  | 18,269    |       |
| ダイフク         | 55.2    | 45.7  | 123,664   |       |
| サムコ          | 1.8     | 2.3   | 2,612     |       |
| 加藤製作所        | 24      | 5     | 15,325    |       |
| 油研工業         | 21      | 19    | 4,256     |       |
| タダノ          | 50      | 47.9  | 69,934    |       |
| フジテック        | 29.7    | 26.5  | 34,715    |       |
| CKD          | 28.7    | 27.5  | 41,140    |       |
| キトー          | 13      | 11.7  | 14,636    |       |
| 平和           | 31.8    | 28.4  | 83,410    |       |
| 理想科学工業       | 11.4    | 9.1   | 19,310    |       |
| SANKYO       | 28.6    | 25.5  | 101,107   |       |
| 日本金銭機械       | 9.5     | 8.7   | 13,084    |       |
| マースエンジニアリング  | 5.7     | 5.2   | 11,944    |       |
| 福島工業         | 6.3     | 5.7   | 21,175    |       |
| オーイズミ        | 4.6     | 4.3   | 2,936     |       |
| ダイコク電機       | 4.2     | 4.1   | 7,654     |       |
| 竹内製作所        | 15.2    | 16.7  | 38,844    |       |
| アマノ          | 31.7    | 28.3  | 64,467    |       |
| JUKI         | 15.4    | 14.5  | 18,603    |       |
| サンデンホールディングス | 63      | 56    | 21,672    |       |
| 蛇の目ミシン工業     | 10.2    | 9.1   | 7,243     |       |
| マックス         | 16      | 14    | 21,378    |       |
| グローリー        | 35      | 29.3  | 111,633   |       |
| 新晃工業         | 7.2     | 6.5   | 9,496     |       |

| 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    |
| 大和冷機工業              | 16.5    | 14.6  | 14,979    |       |
| セガサミーホールディングス       | 110.3   | 90.9  | 152,530   |       |
| 日本ビストンリング           | 4.4     | 3.5   | 8,263     |       |
| リケン                 | 47      | 4.2   | 17,997    |       |
| T P R               | 12.6    | 10.2  | 37,332    |       |
| ツバキ・ナカシマ            | 9.5     | 10.3  | 20,023    |       |
| ホシザキ                | 22.5    | 20.1  | 175,071   |       |
| 大豊工業                | 8.4     | 7.5   | 11,550    |       |
| 日本精工                | 210.9   | 188.2 | 304,131   |       |
| NTN                 | 255     | 212   | 115,752   |       |
| ジェイテクト              | 109.4   | 97.6  | 184,073   |       |
| 不二越                 | 95      | 92    | 56,488    |       |
| 日本トムソン              | 35      | 29.4  | 16,464    |       |
| THK                 | 68.3    | 64.7  | 192,935   |       |
| ユーシン精機              | 4       | 4.1   | 11,988    |       |
| 前澤給装工業              | 4.3     | 3.5   | 5,351     |       |
| イーグル工業              | 12.7    | 9.9   | 15,929    |       |
| 前澤工業                | 7.9     | 6.2   | 2,077     |       |
| 日本ビラー工業             | 10.4    | 9.3   | 14,591    |       |
| キッツ                 | 49.5    | 44    | 32,736    |       |
| 日立工機                | 27.6    | 25    | 21,675    |       |
| マキタ                 | 66.9    | 59.7  | 462,078   |       |
| 日立造船                | 81.2    | 72.2  | 46,569    |       |
| 三菱重工業               | 1,828   | 1,535 | 683,228   |       |
| I H I               | 789     | 704   | 238,656   |       |
| スター精密               | —       | 16    | 26,736    |       |
| <b>電気機器 (12.6%)</b> |         |       |           |       |
| 日清紡ホールディングス         | 57      | 50.9  | 58,840    |       |
| イビデン                | 62.9    | 64.1  | 123,007   |       |
| コニカミノルタ             | 256.4   | 214.5 | 237,022   |       |
| ブラザー工業              | 132.7   | 118.4 | 243,193   |       |
| ミネベアミツミ             | 165     | 166.7 | 235,213   |       |
| 日立製作所               | 2,619   | 2,200 | 1,378,740 |       |
| 東芝                  | 2,161   | 2,049 | 381,728   |       |
| 三菱電機                | 1,095   | 977.2 | 1,642,673 |       |
| 富士電機                | 309     | 276   | 173,604   |       |
| 東洋電機製造              | 21      | 3.9   | 6,762     |       |
| 安川電機                | 127.5   | 106.2 | 227,799   |       |
| シンフォニアテクノロジー        | 68      | 60    | 18,360    |       |

| 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    |
| 明電舎               | 94      | 84    | 32,004    |       |
| オリジン電気            | 15      | 13    | 4,121     |       |
| 山洋電気              | 27      | 24    | 21,216    |       |
| デンヨー              | 9.4     | 8.4   | 14,994    |       |
| 東芝テック             | 74      | 58    | 34,858    |       |
| 芝浦メカトロニクス         | 18      | 15    | 4,230     |       |
| マブチモーター           | 29.4    | 25.9  | 161,357   |       |
| 日本電産              | 123.6   | 118.7 | 1,268,903 |       |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス | —       | 1.1   | 3,227     |       |
| 東光高岳              | 5.7     | 4.7   | 10,325    |       |
| ダブル・スコープ          | 3       | 8.9   | 16,393    |       |
| ダイヘン              | 60      | 50    | 36,050    |       |
| 田淵電機              | 11.8    | 14.4  | 4,982     |       |
| ヤーマン              | 1.4     | 1.2   | 7,392     |       |
| J V Cケンウッド        | 76.6    | 67.8  | 20,611    |       |
| ミマキエンジニアリング       | 7.2     | 8.5   | 6,562     |       |
| 第一精工              | 4.5     | 4.3   | 7,722     |       |
| 日新電機              | 24.1    | 18.5  | 25,400    |       |
| 大崎電気工業            | 19      | 18    | 19,638    |       |
| オムロン              | 117.8   | 97.4  | 472,877   |       |
| 日東工業              | 16.4    | 13.3  | 21,080    |       |
| I D E C           | 13.1    | 12    | 14,244    |       |
| 不二電機工業            | 0.9     | 0.9   | 1,237     |       |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 198     | 176   | 88,176    |       |
| サクサホールディングス       | 29      | 24    | 5,544     |       |
| メルコホールディングス       | 5.8     | 5.1   | 17,110    |       |
| テクノメディカ           | 2.4     | 2.1   | 4,592     |       |
| 日本電気              | 1,412   | 1,259 | 347,484   |       |
| 富士通               | 990     | 883   | 582,603   |       |
| 沖電気工業             | 445     | 39.7  | 63,202    |       |
| 岩崎通信機             | 56      | 44    | 4,004     |       |
| 電気興業              | 27      | 26    | 14,612    |       |
| サンケン電気            | 56      | 54    | 27,756    |       |
| ナカヨ               | 11      | 10    | 4,200     |       |
| アイホン              | 5.8     | 5.2   | 9,661     |       |
| ルネサスエレクトロニクス      | 53.1    | 47.2  | 48,096    |       |
| セイコーエプソン          | 152.9   | 136.4 | 349,184   |       |
| ワコム               | 80.9    | 71.6  | 29,284    |       |
| アルバック             | 18.9    | 15.4  | 78,694    |       |

| 銘柄             | 期首(前期末) |         |           |
|----------------|---------|---------|-----------|
|                | 株数      | 株数      | 評価額       |
|                | 千株      | 千株      | 千円        |
| アクセル           | 4.7     | 4       | 3,356     |
| E I Z O        | 10.2    | 9.1     | 29,711    |
| ジャパンディスプレイ     | 192.2   | 171.7   | 48,419    |
| 日本信号           | 28.3    | 25.4    | 27,000    |
| 京三製作所          | 24      | 21      | 8,589     |
| 能美防災           | 11.7    | 10.6    | 15,815    |
| ホーチキ           | 7.6     | 6.7     | 9,487     |
| エレコム           | 8.9     | 8       | 16,208    |
| 日本無線           | 26      | 5.7     | 8,059     |
| パナソニック         | 1,173   | 1,046.6 | 1,305,110 |
| シャープ           | 868     | —       | —         |
| アンリツ           | 61.4    | 66.8    | 58,116    |
| 富士通ゼネラル        | 31      | 31      | 66,960    |
| 日立国際電気         | 23      | 23.9    | 57,001    |
| ソニー            | 724.4   | 646.8   | 2,268,974 |
| TDK            | 62      | 51.6    | 404,544   |
| 帝国通信工業         | 27      | 21      | 3,948     |
| ミツミ電機          | 39.6    | —       | —         |
| タムラ製作所         | 40      | 35      | 15,925    |
| アルプス電気         | 87.1    | 84.6    | 293,139   |
| バイオニア          | 167     | 138.4   | 31,693    |
| 日本電波工業         | 9.6     | 8.9     | 7,529     |
| 鈴木             | 3       | 3.7     | 2,127     |
| 日本トリム          | 2.7     | 2.3     | 9,292     |
| ローランド ディー. ジー. | 5.1     | 4.7     | 16,685    |
| フォスター電機        | 12.8    | 10.7    | 20,533    |
| クラリオン          | 54      | 49      | 21,364    |
| SMK            | 30      | 23      | 9,706     |
| ヨコオ            | 7.4     | 6.6     | 8,712     |
| 東光             | 21      | —       | —         |
| ホシデン           | 31.4    | 27.9    | 28,039    |
| ヒロセ電機          | 16.6    | 14.8    | 219,040   |
| 日本航空電子工業       | 29      | 26      | 40,014    |
| TOA            | 12.2    | 10.7    | 10,796    |
| 日立マクセル         | 17      | 13.7    | 30,783    |
| 古野電気           | 12.5    | 12      | 9,240     |
| ユニデンホールディングス   | 36      | 30      | 5,040     |
| アルパイン          | 24.6    | 21.9    | 36,770    |
| スマitcoコーポレーション | 8.8     | 7.5     | 9,742     |

| 銘柄               | 期首(前期末) |      |           |
|------------------|---------|------|-----------|
|                  | 株数      | 株数   | 評価額       |
|                  | 千株      | 千株   | 千円        |
| アイコム             | 5.7     | 5.2  | 12,370    |
| リオン              | 3.9     | 3.7  | 5,823     |
| 本多通信工業           | —       | 3    | 3,912     |
| 船井電機             | 10.9    | 10.4 | 9,880     |
| 横河電機             | 102.8   | 99.3 | 171,491   |
| 新元元工業            | 36      | 35   | 16,800    |
| アズビル             | 33.5    | 27.8 | 98,829    |
| 東亜ディーケーケー        | 4.5     | 4.5  | 2,506     |
| 日本光電工業           | 42.9    | 38.3 | 95,098    |
| チノー              | 3.5     | 3.4  | 4,144     |
| 共和電業             | 12.6    | 10   | 4,490     |
| 日本電子材料           | 4.4     | 3.7  | 2,345     |
| 堀場製作所            | 19      | 18.1 | 112,944   |
| アドバンテスト          | 70      | 62.4 | 123,364   |
| 小野測器             | 5.1     | 4.5  | 3,946     |
| エスベック            | 10.6    | 8.2  | 10,537    |
| パナソニック デバイスSUNX  | 8.8     | 8.1  | 6,828     |
| キーエンス            | 23.3    | 41.5 | 1,836,375 |
| 日置電機             | 5.4     | 4.7  | 10,471    |
| シスメックス           | 79.7    | 71.2 | 454,968   |
| 日本マイクロニクス        | 13.5    | 17.3 | 15,587    |
| メガチップス           | 10.8    | 8.6  | 23,598    |
| OBARA GROUP      | 6.6     | 5.4  | 26,973    |
| 澤藤電機             | 7       | 6    | 1,500     |
| コーセル             | 14.3    | 12.7 | 17,729    |
| イリソ電子工業          | —       | 2.9  | 20,706    |
| 新日本無線            | 7.7     | 8    | 3,768     |
| オプテックスグループ       | 7.6     | 7    | 22,015    |
| 千代田インテグレ         | 5.4     | 4.8  | 11,553    |
| アイ・オー・データ機器      | —       | 3    | 3,759     |
| レーザーテック          | 12.1    | 10.1 | 29,178    |
| スタンレー電気          | 73.7    | 65.3 | 206,348   |
| 岩崎電気             | 37      | 35   | 6,090     |
| ウシオ電機            | 62.3    | 55.6 | 80,953    |
| 岡谷電機産業           | 5.8     | 5.2  | 2,184     |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 8.8     | 8.6  | 5,246     |
| 日本セラミック          | 5.8     | 7.5  | 18,217    |
| 遠藤照明             | 5.3     | 4.7  | 4,394     |
| 日本デジタル研究所        | 8.6     | —    | —         |



| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|---------------------|---------|-------|-----------|
|                     | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                     | 千株      | 千株    | 千円        |
| 古河電池                | 8       | 7     | 5,313     |
| 双信電機                | 5.9     | 5.8   | 1,774     |
| 山一電機                | 9.1     | 8.7   | 13,424    |
| 図研                  | 7.6     | 6.1   | 7,887     |
| 日本電子                | 40      | 34    | 18,258    |
| カシオ計算機              | 102.9   | 73.7  | 114,456   |
| ファナック               | 105     | 92.9  | 2,075,850 |
| 日本シイエムケイ            | 22.7    | 20    | 13,120    |
| エンプラス               | 5.2     | 4.1   | 14,452    |
| 大真空                 | 21      | 3.4   | 5,086     |
| ローム                 | 50.6    | 44.3  | 329,592   |
| 浜松ホトニクス             | 80.1    | 71.5  | 241,670   |
| 三井ハイテック             | 14.9    | 12.2  | 10,858    |
| 新光電気工業              | 38.8    | 34.9  | 27,361    |
| 京セラ                 | 168.5   | 150.4 | 936,691   |
| 太陽誘電                | 49.9    | 44.6  | 68,238    |
| 村田製作所               | 107.7   | 96.1  | 1,575,079 |
| ユーシン                | 13.7    | 12.3  | 9,876     |
| 双葉電子工業              | 17.5    | 15    | 30,270    |
| 北陸電気工業              | 43      | 37    | 5,254     |
| ニチコン                | 32.3    | 29.1  | 30,933    |
| 日本ケミコン              | 84      | 79    | 25,201    |
| KOA                 | 14.2    | 12.6  | 16,770    |
| 市光工業                | 26      | 19    | 9,861     |
| 小糸製作所               | 61.5    | 54.9  | 319,518   |
| ミツバ                 | 17.4    | 16.9  | 38,008    |
| スター精密               | 19.5    | —     | —         |
| SCREENホールディングス      | 105     | 18.8  | 143,632   |
| キャノン電子              | 9.5     | 8.2   | 14,645    |
| キャノン                | 552.7   | 493.2 | 1,622,134 |
| リコー                 | 332.4   | 275.4 | 275,950   |
| MUTOHホールディングス       | 13      | 14    | 3,752     |
| 東京エレクトロン            | 92.1    | 61.1  | 683,098   |
| <b>輸送用機器 (9.3%)</b> |         |       |           |
| トヨタ紡織               | 35.9    | 32    | 78,464    |
| 芦森工業                | —       | 21    | 3,570     |
| 鬼怒川ゴム工業             | 23      | —     | —         |
| ユニプレス               | 21.2    | 17.6  | 41,113    |
| 豊田自動織機              | 93.5    | 83.4  | 462,870   |

| 銘柄           | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |
|--------------|---------|---------|-----------|
|              | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |
|              | 千株      | 千株      | 千円        |
| モリタホールディングス  | 17.8    | 16.2    | 24,948    |
| 三櫻工業         | 12.9    | 12      | 10,368    |
| デンソー         | 253.6   | 225.9   | 1,148,701 |
| 東海理化電機製作所    | 30      | 24      | 53,568    |
| 三井造船         | 397     | 331     | 58,918    |
| 川崎重工業        | 799     | 713     | 253,115   |
| 名村造船所        | 30.8    | 27.5    | 21,807    |
| サノヤスホールディングス | 13.6    | 11.4    | 3,397     |
| 日本車輛製造       | 43      | 34      | 10,336    |
| ニチユ三菱フォークリフト | 11.5    | 10.8    | 7,743     |
| 近畿車輛         | 17      | 1.4     | 3,795     |
| 日産自動車        | 1,441.1 | 1,080.5 | 1,206,378 |
| いすゞ自動車       | 297.5   | 265.5   | 409,002   |
| トヨタ自動車       | 1,276.9 | 1,113.7 | 7,163,318 |
| 日野自動車        | 146.5   | 130.7   | 172,654   |
| 三菱自動車工業      | 407.6   | 335.7   | 228,611   |
| エフテック        | 5.5     | 5       | 6,695     |
| レシップホールディングス | 3.4     | 3.3     | 2,818     |
| GMB          | 1.9     | 1.6     | 2,270     |
| ファルテック       | 1.8     | 1.5     | 2,113     |
| 武蔵精密工業       | 10.8    | 10.7    | 30,131    |
| 日産車体         | 50.1    | 40.1    | 43,668    |
| 新明和工業        | 44      | 37      | 43,586    |
| 極東開発工業       | 20.3    | 18.1    | 32,308    |
| 日信工業         | 22.8    | 20.3    | 40,295    |
| トビー工業        | 85      | 7.5     | 24,412    |
| ティラド         | 41      | 36      | 11,196    |
| 曙ブレーキ工業      | 53.7    | 43.6    | 12,382    |
| タチエス         | 16.2    | 15.5    | 32,565    |
| NOK          | 49.7    | 44.3    | 113,186   |
| フタバ産業        | 31.7    | 28.1    | 22,283    |
| KYB          | 114     | 103     | 64,684    |
| シロキ工業        | 25      | —       | —         |
| 大同メタル工業      | 14.4    | 11.7    | 12,062    |
| プレス工業        | 54.2    | 48.5    | 27,257    |
| ミクニ          | 10.2    | 11.7    | 5,066     |
| カルソニックカンセイ   | 78      | 62      | 79,670    |
| 太平洋工業        | 22.7    | 18.8    | 27,222    |
| ケーヒン         | 23.5    | 21      | 41,391    |

| 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    |
| 河西工業               | 12.6    | 12.3  | 17,047    |       |
| アイシン精機             | 103.3   | 83.8  | 474,308   |       |
| 富士機工               | 12      | 9.1   | 4,950     |       |
| マツダ                | 325.1   | 290.1 | 460,823   |       |
| ダイハツ工業             | 122.5   | —     | —         |       |
| 今仙電機製作所            | 9.5     | 8.2   | 8,265     |       |
| 本田技研工業             | 923.9   | 824.4 | 2,946,405 |       |
| スズキ                | 214.6   | 181.6 | 799,766   |       |
| 富士重工業              | 324.4   | 284.4 | 1,217,800 |       |
| 安永                 | 4       | 3.4   | 5,637     |       |
| ヤマハ発動機             | 145     | 129.4 | 334,757   |       |
| ショーワ               | 26.5    | 24.1  | 23,304    |       |
| T B K              | 12.9    | 12.2  | 6,453     |       |
| エクセディ              | 13.8    | 12.4  | 39,556    |       |
| 豊田合成               | 37.3    | 29.6  | 84,123    |       |
| 愛三工業               | 17.9    | 16    | 15,632    |       |
| 盟和産業               | 1.5     | 1.5   | 1,827     |       |
| ヨロズ                | 9.5     | 8.5   | 14,926    |       |
| エフ・シー・シー           | 16.7    | 15    | 33,810    |       |
| シマノ                | 41.4    | 36.9  | 611,433   |       |
| タカタ                | 18.9    | 16.7  | 9,151     |       |
| テイ・エス テック          | 23.8    | 21.3  | 62,153    |       |
| ジャムコ               | 4.5     | 5.4   | 14,169    |       |
| <b>精密機器 (1.5%)</b> |         |       |           |       |
| テルモ                | 157.4   | 140.4 | 546,858   |       |
| クリエートメディック         | 3.5     | 2.8   | 2,660     |       |
| 日機装                | 38.5    | 31.7  | 38,547    |       |
| 島津製作所              | 132     | 117.9 | 221,534   |       |
| J M S              | 19      | 15    | 4,875     |       |
| モリテックス             | 3.4     | —     | —         |       |
| 長野計器               | 6.7     | 6.8   | 4,794     |       |
| ブイ・テクノロジー          | 2.5     | 1.9   | 32,946    |       |
| 東京計器               | 33      | 32    | 7,680     |       |
| 愛知時計電機             | 14      | 1.2   | 4,470     |       |
| オーバル               | 11.2    | 9.5   | 2,584     |       |
| 東京精密               | 19.7    | 17.7  | 67,879    |       |
| マニー                | 9.3     | 12.2  | 33,171    |       |
| ニコン                | 191.7   | 159.6 | 272,437   |       |
| トプコン               | 34.8    | 46.1  | 93,260    |       |

| 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    |
| オリンパス               | 152.9   | 146.2 | 576,028 |       |
| 理研計器                | 8.3     | 8.1   | 13,251  |       |
| タムロン                | 8.2     | 8.1   | 17,131  |       |
| HOYA                | 238.9   | 188.5 | 953,810 |       |
| ノーリツ鋼機              | 9.4     | 9.4   | 9,127   |       |
| エー・アンド・デイ           | 9.4     | 8.4   | 3,931   |       |
| シチズン時計              | 126.4   | 100.2 | 73,947  |       |
| リズム時計工業             | 45      | 36    | 6,732   |       |
| 大研医器                | 8.1     | 8.2   | 6,560   |       |
| メニコン                | 5.1     | 6.3   | 22,176  |       |
| 松風                  | 5.1     | 4.8   | 6,571   |       |
| セイコーホールディングス        | 66      | 65    | 30,160  |       |
| ニプロ                 | 76.5    | 63.4  | 87,428  |       |
| <b>その他製品 (1.7%)</b> |         |       |         |       |
| スノーピーク              | 0.9     | 1.4   | 3,977   |       |
| パラマウントベッドホールディングス   | 10.8    | 8.8   | 36,564  |       |
| トランザクション            | 1.6     | 2.1   | 4,389   |       |
| SHO-B I             | 3.8     | 3.8   | 1,668   |       |
| ニホンフラッシュ            | 3       | 4.4   | 5,645   |       |
| 前田工織                | 11.3    | 9.4   | 12,464  |       |
| 永大産業                | 15      | 12    | 6,396   |       |
| アートネイチャー            | 8.1     | 10    | 7,480   |       |
| ダンロップスポーツ           | 6.8     | 5.9   | 6,130   |       |
| バンダイナムコホールディングス     | 106.2   | 101   | 314,110 |       |
| アイフィスジャパン           | 2.4     | 2.5   | 1,050   |       |
| 共立印刷                | 16.9    | 14.9  | 5,021   |       |
| SHOE I              | 4.9     | 4.1   | 10,479  |       |
| フランスベッドホールディングス     | 14.3    | 11.2  | 10,528  |       |
| パイロットコーポレーション       | 17.9    | 16    | 73,440  |       |
| 萩原工業                | 2.2     | 2.7   | 7,063   |       |
| トッパン・フォームズ          | 18.3    | 16.1  | 17,227  |       |
| フジシールインターナショナル      | 12.4    | 20.5  | 46,555  |       |
| タカラトミー              | 34      | 35.8  | 42,888  |       |
| 廣済堂                 | 10      | 9.8   | 3,831   |       |
| A s - m e エステール     | 3.1     | 2.4   | 1,660   |       |
| アーク                 | 45.5    | 41.8  | 4,514   |       |
| タカノ                 | 4.6     | 3.7   | 3,696   |       |
| プロネクサス              | 9.7     | 8.7   | 10,744  |       |
| ホクシン                | 10.8    | 7.9   | 1,738   |       |

| 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        |
| ウッドワン                | 21      | 15    | 15    | 4,410     |
| 大建工業                 | 40      | 6.5   | 6.5   | 14,144    |
| 凸版印刷                 | 290     | 259   | 259   | 292,411   |
| 大日本印刷                | 304     | 264   | 264   | 313,104   |
| 図書印刷                 | 19      | 12    | 12    | 5,784     |
| 共同印刷                 | 35      | 28    | 28    | 10,752    |
| 日本写真印刷               | 17.2    | 15.4  | 15.4  | 51,205    |
| 光村印刷                 | 12      | 9     | 9     | 2,403     |
| 宝印刷                  | 5.1     | 4.7   | 4.7   | 7,421     |
| アシックス                | 95.6    | 91    | 91    | 177,996   |
| ツツミ                  | 5.1     | 3.4   | 3.4   | 7,194     |
| 小松ウオール工業             | 3.5     | 3     | 3     | 5,829     |
| ヤマハ                  | 75.5    | 61.7  | 61.7  | 180,904   |
| 河合楽器製作所              | 3.9     | 3.6   | 3.6   | 8,280     |
| クリナップ                | 12.1    | 10.9  | 10.9  | 9,090     |
| ビジョン                 | 58.2    | 55.4  | 55.4  | 173,125   |
| 兼松サステック              | 12      | 11    | 11    | 2,706     |
| キングジム                | 8.8     | 7.7   | 7.7   | 6,598     |
| リンテック                | 24.4    | 21.6  | 21.6  | 53,460    |
| TASAKI               | 2.1     | 2.6   | 2.6   | 3,931     |
| イトーキ                 | 21.6    | 19.3  | 19.3  | 14,050    |
| 任天堂                  | 63.2    | 56.4  | 56.4  | 1,302,558 |
| 三菱鉛筆                 | 7.6     | 7.5   | 7.5   | 42,300    |
| タカラスタンダード            | 42      | 18.9  | 18.9  | 36,174    |
| コクヨ                  | 53.4    | 47.6  | 47.6  | 74,113    |
| ナカバヤシ                | 21      | 16    | 16    | 4,400     |
| グローブライド              | 5       | 4.5   | 4.5   | 8,104     |
| 岡村製作所                | 35.7    | 31.9  | 31.9  | 32,569    |
| 美津濃                  | 55      | 49    | 49    | 29,645    |
| アデランス                | 17.7    | —     | —     | —         |
| <b>電気・ガス業 (1.8%)</b> |         |       |       |           |
| 東京電力ホールディングス         | 870.9   | 777.1 | 777.1 | 336,484   |
| 中部電力                 | 314.1   | 301.8 | 301.8 | 447,720   |
| 関西電力                 | 418.9   | 373.8 | 373.8 | 464,633   |
| 中国電力                 | 141.9   | 126.7 | 126.7 | 154,954   |
| 北陸電力                 | 100.6   | 89.7  | 89.7  | 100,194   |
| 東北電力                 | 256.5   | 228.9 | 228.9 | 329,616   |
| 四国電力                 | 92.4    | 82.5  | 82.5  | 90,172    |
| 九州電力                 | 226.7   | 202.3 | 202.3 | 251,458   |

| 銘柄                | 期首(前期末) |       | 当 期 末 |           |
|-------------------|---------|-------|-------|-----------|
|                   | 株 数     | 株 数   | 株 数   | 評 価 額     |
|                   | 千株      | 千株    | 千株    | 千円        |
| 北海道電力             | 96.1    | 85.7  | 85.7  | 69,159    |
| 沖縄電力              | 10.9    | 13.5  | 13.5  | 35,289    |
| 電源開発              | 87.5    | 72.9  | 72.9  | 196,101   |
| エフオン              | —       | 3.5   | 3.5   | 3,503     |
| イーレックス            | 2.1     | 3.9   | 3.9   | 14,313    |
| 東京瓦斯              | 1,146   | 983   | 983   | 507,424   |
| 大阪瓦斯              | 1,063   | 889   | 889   | 383,603   |
| 東邦瓦斯              | 259     | 231   | 231   | 183,414   |
| 北海道瓦斯             | 24      | 21    | 21    | 5,838     |
| 広島ガス              | 18.1    | 18.4  | 18.4  | 6,844     |
| 西部瓦斯              | 114     | 102   | 102   | 26,724    |
| 静岡ガス              | 28.8    | 28    | 28    | 20,188    |
| メタウォーター           | 6.6     | 5.2   | 5.2   | 15,314    |
| <b>陸運業 (4.1%)</b> |         |       |       |           |
| SBSホールディングス       | 10.4    | 9.2   | 9.2   | 7,663     |
| 東武鉄道              | 549     | 489   | 489   | 280,197   |
| 相鉄ホールディングス        | 176     | 147   | 147   | 83,496    |
| 東京急行電鉄            | 598     | 498   | 498   | 411,348   |
| 京浜急行電鉄            | 281     | 251   | 251   | 306,471   |
| 小田急電鉄             | 329     | 146.7 | 146.7 | 327,434   |
| 京王電鉄              | 287     | 256   | 256   | 226,048   |
| 京成電鉄              | 154     | 68.7  | 68.7  | 182,329   |
| 富士急行              | 27      | 25    | 25    | 25,275    |
| 新京成電鉄             | 13      | 11    | 11    | 4,620     |
| 東日本旅客鉄道           | 187.7   | 177.2 | 177.2 | 1,820,730 |
| 西日本旅客鉄道           | 98.8    | 88.2  | 88.2  | 648,270   |
| 東海旅客鉄道            | 91.9    | 76.2  | 76.2  | 1,418,844 |
| 西武ホールディングス        | 81.8    | 126.5 | 126.5 | 248,572   |
| 鴻池運輸              | 14.5    | 13    | 13    | 18,525    |
| 西日本鉄道             | 133     | 110   | 110   | 53,790    |
| ハマキョウレックス         | 7.8     | 6.1   | 6.1   | 12,706    |
| サカイ引越センター         | 4       | 3.2   | 3.2   | 9,920     |
| 近鉄グループホールディングス    | 1,033   | 922   | 922   | 387,240   |
| 阪急阪神ホールディングス      | 689     | 115.7 | 115.7 | 435,032   |
| 南海電気鉄道            | 230     | 194   | 194   | 107,088   |
| 京阪ホールディングス        | 230     | 205   | 205   | 146,985   |
| 神戸電鉄              | 25      | 22    | 22    | 8,382     |
| 名古屋鉄道             | 374     | 334   | 334   | 174,348   |
| 山陽電気鉄道            | 37      | 33    | 33    | 20,031    |

| 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    |
| 日本通運                   | 397     | 354   | 201,426 |       |
| ヤマトホールディングス            | 189.7   | 163.8 | 368,304 |       |
| 山九                     | 135     | 121   | 86,636  |       |
| 丸運                     | 5.6     | 3.8   | 969     |       |
| 丸全昭和運輸                 | 34      | 30    | 13,470  |       |
| センコー                   | 46      | 41.7  | 30,024  |       |
| トナミホールディングス            | 22      | 18    | 6,336   |       |
| ニッコンホールディングス           | 33.6    | 31.1  | 74,951  |       |
| 日本石油輸送                 | 12      | 1     | 2,510   |       |
| 福山通運                   | 62      | 55    | 35,695  |       |
| セイノーホールディングス           | 72.8    | 65    | 81,120  |       |
| 神奈川中央交通                | 12      | 10    | 7,220   |       |
| 日立物流                   | 21.2    | 19    | 44,574  |       |
| 丸和運輸機関                 | 2.4     | 2.3   | 5,913   |       |
| C&Fロジホールディングス          | 9.8     | 9.6   | 15,139  |       |
| 九州旅客鉄道                 | —       | 68.3  | 231,195 |       |
| <b>海運業 (0.3%)</b>      |         |       |         |       |
| 日本郵船                   | 922     | 774   | 191,178 |       |
| 商船三井                   | 500     | 480   | 174,720 |       |
| 川崎汽船                   | 449     | 347   | 102,712 |       |
| NSユニテッド海運              | 47      | 41    | 9,430   |       |
| 明治海運                   | 9.5     | 8.4   | 3,704   |       |
| 飯野海運                   | 53.5    | 47.6  | 24,276  |       |
| 共栄タンカー                 | 11      | 9     | 2,061   |       |
| 乾汽船                    | 8.2     | 6.9   | 6,851   |       |
| <b>空運業 (0.6%)</b>      |         |       |         |       |
| 日本航空                   | 196.6   | 165.1 | 604,266 |       |
| ANAホールディングス            | 1,906   | 1,700 | 556,580 |       |
| バスコ                    | 10      | 9     | 3,708   |       |
| <b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b> |         |       |         |       |
| トランコム                  | 2.9     | 2.7   | 14,850  |       |
| 日新                     | 42      | 38    | 13,832  |       |
| 三菱倉庫                   | 73      | 60    | 94,920  |       |
| 三井倉庫ホールディングス           | 60      | 54    | 18,090  |       |
| 住友倉庫                   | 75      | 66    | 41,844  |       |
| 滋澤倉庫                   | 28      | 24    | 8,424   |       |
| 東陽倉庫                   | 18      | 16.1  | 4,797   |       |
| 日本トランスシティ              | 24      | 20    | 9,220   |       |
| ケイヒン                   | 21      | 18    | 2,826   |       |

| 銘柄                   | 期首(前期末) |      | 当 期 末   |       |
|----------------------|---------|------|---------|-------|
|                      | 株 数     | 株 数  | 株 数     | 評 価 額 |
|                      | 千株      | 千株   | 千株      | 千円    |
| 中央倉庫                 | 5.9     | 5.3  | 5,808   |       |
| 安田倉庫                 | 8       | 7.5  | 5,865   |       |
| 東洋埠頭                 | 32      | 29   | 5,481   |       |
| 宇徳                   | 8.8     | 7.5  | 3,180   |       |
| 上組                   | 122     | 109  | 114,995 |       |
| サンリツ                 | 2.4     | 2.4  | 1,250   |       |
| キムラユニティ              | 2.7     | 2.2  | 2,644   |       |
| キューソー流通システム          | 2.8     | 2.9  | 7,667   |       |
| 郵船ロジスティクス            | 9.3     | 8.4  | 9,886   |       |
| 近鉄エクスプレス             | 18.3    | 16.4 | 27,912  |       |
| 東海運                  | 5.5     | 5.6  | 2,531   |       |
| エーアイテイ               | 4.6     | 5.8  | 6,351   |       |
| 内外トランスライン            | 2.5     | 2.7  | 2,956   |       |
| <b>情報・通信業 (7.8%)</b> |         |      |         |       |
| NECネットエスアイ           | 12.7    | 9.8  | 20,815  |       |
| システナ                 | 9.9     | 7.3  | 11,899  |       |
| デジタルアーツ              | 4.9     | 4    | 13,240  |       |
| 新日鉄住金ソリューションズ        | 16.8    | 15   | 34,275  |       |
| キューブシステム             | 4.1     | 3.9  | 2,667   |       |
| コア                   | 4.4     | 3.9  | 5,401   |       |
| ソフトクリエイトホールディングス     | 3.5     | 4.4  | 5,874   |       |
| T I S                | 33.6    | 30   | 80,880  |       |
| ネオス                  | 3.6     | 3.3  | 1,508   |       |
| 電算システム               | 3.6     | 3.2  | 5,456   |       |
| グリー                  | 61.5    | 54.9 | 37,002  |       |
| コーエーテックモホールディングス     | 24      | 21.6 | 47,088  |       |
| 三菱総合研究所              | 3.9     | 3.5  | 11,147  |       |
| ボルテージ                | 2.2     | 1.7  | 1,708   |       |
| 電算                   | 1.1     | 0.9  | 2,189   |       |
| AGS                  | 1.5     | 2.3  | 4,406   |       |
| ファインデックス             | 6.8     | 6.9  | 6,644   |       |
| ヒト・コミュニケーションズ        | 2.3     | 2.1  | 3,517   |       |
| ブレインパッド              | 1.8     | 2    | 2,378   |       |
| KL a b               | 15.8    | 17.6 | 14,220  |       |
| ポルトウウィン・ビットクルーホールディ  | 6.7     | 6.7  | 7,349   |       |
| イーブックイニシアティブジャパン     | 2.3     | 1.6  | 1,512   |       |
| ネクソン                 | 96.9    | 99   | 190,575 |       |
| アイスタイル               | 15.5    | 19.1 | 18,698  |       |
| エムアップ                | 2.9     | 2.8  | 2,522   |       |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |        |
|----------------------|---------|-------|--------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額  |
|                      | 千株      | 千株    | 千円     |
| エイチーム                | 3.7     | 5.1   | 10,893 |
| テクノスジャパン             | 1.2     | 7.1   | 8,804  |
| e n i s h            | 3.3     | —     | —      |
| コロブラ                 | 28      | 25.6  | 26,240 |
| モバイルクリエイト            | 6.8     | 6.9   | 2,808  |
| オルトプラス               | 4.1     | —     | —      |
| ブロードリーフ              | 10.5    | 22.5  | 14,242 |
| ハーツユナイテッドグループ        | 3.1     | 4.9   | 7,369  |
| メディアドゥ               | —       | 2     | 3,432  |
| ブイキューブ               | 5       | 5.3   | 3,296  |
| サイバーリンクス             | 1.3     | 1.5   | 1,567  |
| ディー・エル・イー            | —       | 3.1   | 1,931  |
| フィックスターズ             | —       | 1.3   | 4,745  |
| VOYAGE GROUP         | 2.4     | 3.2   | 5,283  |
| オブティム                | 0.7     | 1     | 5,260  |
| セレス                  | —       | 1     | 1,682  |
| ベリサーブ                | 1.3     | 1.1   | 3,263  |
| ティーガイア               | 10.2    | 8.9   | 16,607 |
| 日本アジアグループ            | 8.9     | 10.6  | 4,377  |
| 豆蔵ホールディングス           | 8       | 6.9   | 6,106  |
| テクマトリックス             | 4.4     | 2.9   | 7,461  |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 177     | 191.2 | 48,947 |
| GMOベイメントゲートウェイ       | 8.8     | 7.4   | 47,952 |
| ザッパラス                | 6.4     | 5.2   | 2,376  |
| システムリサーチ             | —       | 0.6   | 1,301  |
| インターネットイニシアティブ       | 16.4    | 13.3  | 26,945 |
| さくらインターネット           | 4.9     | 7     | 7,966  |
| GMOクラウド              | 2.4     | 2.1   | 3,836  |
| SRAホールディングス          | 5.8     | 4.7   | 13,136 |
| Minor iソリューションズ      | 1.4     | 2     | 2,424  |
| システムインテグレータ          | 1.6     | 1.5   | 1,038  |
| 朝日ネット                | 8.4     | 8     | 4,200  |
| アドソル日進               | —       | 1.9   | 2,471  |
| フリービット               | —       | 5.1   | 4,962  |
| コムチュア                | 1.7     | 1.6   | 5,632  |
| サイバーコム               | —       | 1.3   | 1,336  |
| メディカル・データ・ビジョン       | —       | 1.5   | 4,018  |
| g u m i              | 10.9    | 10.4  | 13,041 |
| ショーケース・ティービー         | —       | 0.7   | 992    |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|--------------------|---------|-------|---------|
|                    | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                    | 千株      | 千株    | 千円      |
| PCIホールディングス        | —       | 1.1   | 3,163   |
| パイブDHD             | 1.4     | 1.7   | 1,885   |
| アイビシー              | —       | 0.7   | 704     |
| オーブンドア             | —       | 0.6   | 1,926   |
| LINE               | —       | 15.1  | 53,454  |
| AOI TYO Holdings   | —       | 7.4   | 6,230   |
| ソルクシーズ             | —       | 2.8   | 1,534   |
| フェイス               | 2.8     | 2.4   | 3,237   |
| ハイマックス             | 1.3     | 1.2   | 1,789   |
| 野村総合研究所            | 71      | 67.6  | 263,302 |
| サイバネットシステム         | 8.4     | 7.5   | 6,172   |
| CEホールディングス         | 1.8     | 1.5   | 1,702   |
| インテージホールディングス      | 5.4     | 5.2   | 11,294  |
| 東邦システムサイエンス        | 3       | 2.9   | 1,876   |
| ソースネクスト            | 5.4     | 5.8   | 3,775   |
| ティー・ワイ・オー          | 15.3    | —     | —       |
| フォーカスシステムズ         | —       | 3.6   | 2,116   |
| クレスコ               | 2.2     | 2.1   | 5,235   |
| フジ・メディア・ホールディングス   | 105.5   | 94.1  | 144,631 |
| オービック              | 34.9    | 31.2  | 166,920 |
| ジャストシステム           | 18.4    | 14.7  | 17,860  |
| TDCソフトウェアエンジニアリング  | 2.2     | 4.1   | 5,108   |
| ヤフー                | 726.2   | 648   | 341,496 |
| トレンドマイクロ           | 49.2    | 47.9  | 231,836 |
| インフォメーション・ディベロプメント | 1.8     | 2.7   | 3,156   |
| 日本オラクル             | 16.2    | 14.5  | 95,700  |
| アルファシステムズ          | 3.3     | 2.8   | 5,530   |
| フューチャー             | 12      | 12    | 10,788  |
| CAC Holdings       | 7.4     | 6.5   | 7,052   |
| ソフトバンク・テクノロジー      | 2.8     | 2.2   | 9,075   |
| トーセ                | 2.9     | 2.9   | 2,404   |
| オービックビジネスコンサルティング  | 5.1     | 4.6   | 25,576  |
| 伊藤忠テクノソリューションズ     | 22.9    | 20.5  | 64,575  |
| アイティフォー            | 13.2    | 11.7  | 7,663   |
| 東計電算               | 1.8     | 1.3   | 2,879   |
| エックスネット            | 0.9     | 0.9   | 1,855   |
| 大塚商会               | 27.3    | 24.3  | 143,127 |
| サイボウズ              | 14.1    | 12.5  | 5,537   |
| ソフトブレーン            | 16.1    | 12.6  | 5,745   |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|----------------------|---------|-------|-----------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                      | 千株      | 千株    | 千円        |
| 電通国際情報サービス           | 6.2     | 5.6   | 12,426    |
| デジタルガレージ             | —       | 13.2  | 27,218    |
| EMシステムズ              | 1.8     | 3.1   | 5,043     |
| ウェザーニューズ             | 3.4     | 3     | 10,695    |
| C I J                | 9       | 6.7   | 3,564     |
| 東洋ビジネスエンジニアリング       | 1.1     | 0.9   | 1,391     |
| 日本エンタープライズ           | 10.5    | 10    | 2,810     |
| WOWOW                | 4.8     | 4.3   | 15,781    |
| スカラ                  | 6       | 6.3   | 5,399     |
| 日本コロムビア              | 4       | 3.1   | 2,092     |
| イマジカ・ロボット ホールディングス   | 8.9     | 7.8   | 6,193     |
| ネットワンシステムズ           | 44.2    | 39.4  | 34,790    |
| システムソフト              | —       | 17.2  | 2,631     |
| アルゴグラフィックス           | 4.7     | 4.3   | 10,590    |
| マーベラス                | 17.1    | 15.5  | 14,942    |
| エイベックス・グループ・ホールディングス | 18.7    | 16.8  | 27,048    |
| 日本ユニシス               | 27.7    | 24.9  | 37,848    |
| 兼松エレクトロニクス           | 6.3     | 5.7   | 14,688    |
| 東京放送ホールディングス         | 60.7    | 59.6  | 121,822   |
| 日本テレビホールディングス        | 92.5    | 82.5  | 166,650   |
| 朝日放送                 | 10.4    | 8.5   | 6,630     |
| テレビ朝日ホールディングス        | 27.7    | 24.7  | 57,131    |
| スカパーJ SATホールディングス    | 76.5    | 58.3  | 29,150    |
| テレビ東京ホールディングス        | 9.1     | 7.4   | 19,047    |
| 日本BS放送               | 1.5     | 2.1   | 2,202     |
| ビジョン                 | —       | 0.7   | 2,726     |
| U-NEXT               | 2.6     | 2.5   | 2,912     |
| ワイヤレスゲート             | —       | 3.2   | 4,931     |
| コネクシオ                | 8.8     | 7.9   | 12,395    |
| 日本通信                 | 55.2    | 77.2  | 13,896    |
| クロップス                | 2.1     | 1.8   | 1,083     |
| 日本電信電話               | 783.2   | 725.8 | 3,462,791 |
| KDD I                | 1,029.3 | 894.4 | 2,625,511 |
| 光通信                  | 12.2    | 10.9  | 119,573   |
| NTTドコモ               | 781.5   | 675.6 | 1,818,039 |
| エムティーアイ              | 13      | 13.7  | 9,398     |
| GMOインターネット           | 37.6    | 32.9  | 50,073    |
| カドカワ                 | 31.6    | 26.3  | 42,606    |
| 学研ホールディングス           | 34      | 31    | 9,548     |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|----------------------|---------|-------|-----------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                      | 千株      | 千株    | 千円        |
| ゼンリン                 | 13.4    | 12.1  | 26,547    |
| 昭文社                  | 5.7     | 5     | 3,550     |
| インプレスホールディングス        | 10      | 8.5   | 1,249     |
| アイネット                | 5.7     | 5     | 6,140     |
| 松竹                   | 67      | 59    | 77,821    |
| 東宝                   | 72.3    | 59.1  | 192,666   |
| 東映                   | 37      | 34    | 34,136    |
| AOI Pro.             | 5.1     | —     | —         |
| エヌ・ティ・ティ・データ         | 62.6    | 55.8  | 299,088   |
| ビー・シー・エー             | 1.2     | 1.3   | 2,028     |
| ビジネスブレイン太田昭和         | 1.4     | 1.4   | 1,471     |
| DTS                  | 11.2    | 9.3   | 24,059    |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 42.9    | 34.8  | 118,494   |
| シーイーシー               | 6.6     | 5.4   | 9,930     |
| カブコン                 | 25.9    | 21.4  | 51,167    |
| アイ・エス・ピー             | 1.5     | 1.9   | 1,702     |
| ジャステック               | 6.4     | 5.5   | 5,692     |
| S C S K              | 24.1    | 24.6  | 102,459   |
| 日本システムウエア            | 4       | 3.1   | 5,003     |
| アイネス                 | 14.5    | 11.3  | 12,927    |
| TKC                  | 9.4     | 8.3   | 28,386    |
| 富士ソフト                | 15      | 13.3  | 37,559    |
| NSD                  | 21.3    | 19.1  | 33,444    |
| コナミホールディングス          | 45.7    | 40.8  | 187,884   |
| 福井コンピュータホールディングス     | 2.3     | 2.7   | 7,641     |
| J B C Cホールディングス      | 8.5     | 7.2   | 5,803     |
| ミロク情報サービス            | 7.5     | 6.8   | 12,165    |
| ソフトバンクグループ           | 574.1   | 407   | 3,577,123 |
| <b>卸売業 (4.6%)</b>    |         |       |           |
| ハウスイ                 | 10      | 10    | 1,260     |
| 高千穂交易                | 3.7     | 3.8   | 4,005     |
| 伊藤忠食品                | 2.5     | 2.1   | 9,481     |
| エレマテック               | 4.7     | 3.5   | 6,867     |
| J A L U X            | 3.3     | 2.9   | 6,432     |
| あらた                  | 4.5     | 4     | 11,356    |
| トーメンデバイス             | 1.4     | 1.2   | 2,592     |
| 東京エレクトロン デバイス        | 3.5     | 2.9   | 4,637     |
| フィールズ                | 6.6     | 7.1   | 8,875     |
| 双日                   | 638.3   | 534   | 155,928   |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|---------------------|---------|-------|---------|
|                     | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                     | 千株      | 千株    | 千円      |
| アルフレッサ ホールディングス     | 127.4   | 107   | 213,893 |
| 横浜冷凍                | 24.9    | 22.3  | 23,526  |
| 山下医科器械              | 0.8     | 0.9   | 1,617   |
| ラサ商事                | 4.8     | 4.1   | 2,853   |
| ラクーン                | —       | 4.4   | 2,235   |
| アルコニックス             | 5.8     | 5.2   | 9,250   |
| 神戸物産                | 6.5     | 4.9   | 18,399  |
| あい ホールディングス         | 18      | 13.3  | 29,911  |
| ディーブイエックス           | 2.7     | 3.4   | 4,297   |
| ダイワボウホールディングス       | 92      | 78    | 23,010  |
| マクニカ・富士エレホールディングス   | 18      | 16.6  | 27,971  |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 17.4    | 16.8  | 17,035  |
| 八洲電機                | 8.2     | 6.5   | 4,186   |
| UKCホールディングス         | 6.5     | 5.7   | 12,756  |
| OCHIホールディングス        | 3.1     | 2.7   | 3,666   |
| TOKAIホールディングス       | 44.3    | 39.7  | 33,268  |
| 大阪工場                | —       | 1.1   | 804     |
| 三洋貿易                | 5.4     | 5     | 9,085   |
| ビューティガレージ           | —       | 0.9   | 1,048   |
| ウイン・パートナーズ          | 3.8     | 6.6   | 6,520   |
| ミタチ産業               | 2.2     | 2.1   | 1,356   |
| シップヘルスケアホールディングス    | 20.6    | 17.3  | 51,519  |
| 明治電機工業              | 2.9     | 3.1   | 3,803   |
| デリカフーズ              | 2.4     | 2.2   | 2,334   |
| スターティア              | 2       | 2.4   | 1,324   |
| コメダホールディングス         | —       | 12.2  | 23,485  |
| 富士興産                | 4       | 3.2   | 1,584   |
| 協栄産業                | 16      | 13    | 2,236   |
| 小野建                 | 8.6     | 7.9   | 11,225  |
| 佐鳥電機                | 8.1     | 6.1   | 4,867   |
| エコートレーディング          | 2.5     | 2.1   | 1,478   |
| 伯東                  | 7.6     | 5.9   | 6,354   |
| コンドータック             | 7.8     | 7.3   | 6,380   |
| 中山福                 | 6.2     | 4.6   | 3,933   |
| ナガイレベバン             | 14.7    | 13.2  | 32,617  |
| 三菱食品                | 11.1    | 9.8   | 34,006  |
| 松田産業                | 7.3     | 6.5   | 10,374  |
| 第一興商                | 17.9    | 14.7  | 69,604  |
| メディバルホールディングス       | 101.3   | 90.4  | 166,155 |

| 銘柄           | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|--------------|---------|-------|-----------|
|              | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|              | 千株      | 千株    | 千円        |
| アドヴァン        | 10.3    | —     | —         |
| S P K        | 2.2     | 1.9   | 4,803     |
| 萩原電気         | 2.6     | 2.9   | 6,313     |
| アズワン         | 7.9     | 7     | 35,070    |
| スズデン         | 3.4     | 3.2   | 3,388     |
| 尾家産業         | 3.3     | 2.8   | 3,259     |
| シモジマ         | 6.9     | 5.3   | 6,354     |
| ドウシシャ        | 11.9    | 10.8  | 23,004    |
| 小津産業         | 2.1     | 2     | 4,346     |
| 高速           | 6       | 5.2   | 5,798     |
| たけびし         | 3.4     | 3.1   | 4,371     |
| 黒田電気         | 18.7    | 12.2  | 27,877    |
| リックス         | —       | 2.2   | 3,682     |
| 丸文           | 8.8     | 7.5   | 5,512     |
| ハビネット        | 9.2     | 7.7   | 11,226    |
| 橋本総業ホールディングス | 2.2     | 2     | 3,004     |
| 日本ライフライン     | —       | 7.8   | 15,912    |
| エクセル         | 5       | 3.8   | 5,696     |
| マルカキカイ       | 3.3     | 2.9   | 5,486     |
| I D O M      | 27.3    | 24.5  | 18,375    |
| 日本エム・ディ・エム   | 8.6     | 7     | 5,355     |
| 進和           | 6       | 5.4   | 9,628     |
| エスケイジャパン     | 3.1     | 2.2   | 675       |
| ダイトロン        | 4.9     | 4.2   | 4,061     |
| シークス         | 6.4     | 6.4   | 27,136    |
| 田中商事         | 3.3     | 3     | 2,172     |
| オーハシテクニカ     | 5.6     | 5.1   | 7,338     |
| 白銅           | 2.8     | 2.2   | 3,929     |
| 伊藤忠商事        | 795.1   | 662.2 | 1,078,723 |
| 丸紅           | 997.2   | 889.8 | 649,909   |
| 高島           | 20      | 17    | 3,638     |
| 長瀬産業         | 60.9    | 54.4  | 89,705    |
| 蝶理           | 6.4     | 5.8   | 11,588    |
| 豊田通商         | 112.9   | 100.7 | 335,834   |
| 三共生興         | 15.6    | 14.3  | 5,920     |
| 兼松           | 215     | 193   | 37,635    |
| ツカモトコーポレーション | 25      | 22    | 2,816     |
| 三井物産         | 916.3   | 817.6 | 1,392,372 |
| 日本紙パルプ商事     | 51      | 46    | 17,112    |

| 銘柄                | 期首(前期末) |       | 当 期 末     |  |
|-------------------|---------|-------|-----------|--|
|                   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |  |
|                   | 千株      | 千株    | 千円        |  |
| 日立ハイテクノロジーズ       | 35.1    | 31.3  | 150,709   |  |
| カメイ               | 13.2    | 11.7  | 15,853    |  |
| 東都水産              | 17      | 1.4   | 2,749     |  |
| OUGホールディングス       | 15      | 14    | 3,682     |  |
| スターゼン             | 3.7     | 3.8   | 18,563    |  |
| 山善                | 38.8    | 34.5  | 36,708    |  |
| 椿本興業              | 11      | 10    | 3,970     |  |
| 住友商事              | 637.9   | 569.1 | 850,519   |  |
| 内田洋行              | 25      | 4.4   | 11,246    |  |
| 三菱商事              | 760.3   | 678.4 | 1,770,284 |  |
| 第一実業              | 22      | 21    | 16,443    |  |
| キャノンマーケティングジャパン   | 28.9    | 25.8  | 58,824    |  |
| 西華産業              | 33      | 29    | 10,556    |  |
| 佐藤商事              | 9       | 7.6   | 6,688     |  |
| 菱洋エレクトロ           | 11.6    | 8.5   | 13,481    |  |
| 東京産業              | 10.3    | 9.5   | 4,503     |  |
| ユアサ商事             | 9.5     | 8.6   | 28,208    |  |
| 神鋼商事              | 23      | 2.3   | 5,674     |  |
| 小林産業              | 6.5     | 7.4   | 2,049     |  |
| 阪和興業              | 101     | 90    | 70,110    |  |
| カナデン              | 9.7     | 8.4   | 8,803     |  |
| 菱電商事              | 16      | 14    | 10,290    |  |
| フルサト工業            | 5.5     | 4.8   | 8,337     |  |
| 岩谷産業              | 120     | 100   | 66,500    |  |
| すてきなイスグループ        | 45      | 39    | 5,928     |  |
| 昭光通商              | 42      | 36    | 3,636     |  |
| ニチモウ              | 17      | 14    | 2,646     |  |
| 極東貿易              | 16      | 14    | 3,332     |  |
| イワキ               | 17      | 14    | 4,270     |  |
| 三菱石油              | 26      | 24    | 21,456    |  |
| 稲畑産業              | 24.2    | 21.5  | 32,486    |  |
| G S Iクレオス         | 30      | 24    | 3,624     |  |
| 明和産業              | 9.2     | 8.7   | 3,697     |  |
| ワキタ               | 21.5    | 19.3  | 20,689    |  |
| 東邦ホールディングス        | 32.4    | 28.9  | 71,643    |  |
| サンゲツ              | 36.6    | 31    | 59,799    |  |
| ミツウロコグループホールディングス | 16.2    | 14.3  | 10,639    |  |
| シナネンホールディングス      | 22      | 3.6   | 8,272     |  |
| 伊藤忠エネクス           | 26      | 19.9  | 18,785    |  |

| 銘柄            | 期首(前期末) |       | 当 期 末   |  |
|---------------|---------|-------|---------|--|
|               | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |  |
|               | 千株      | 千株    | 千円      |  |
| サンリオ          | 31.2    | 27.9  | 61,101  |  |
| サンワテクノス       | 6.4     | 5.1   | 5,513   |  |
| リョーサン         | 16      | 13.3  | 48,877  |  |
| 新光商事          | 11.7    | 9.8   | 13,230  |  |
| トーホー          | 4.6     | 4     | 10,140  |  |
| 三信電気          | 14      | 10    | 13,500  |  |
| 東陽テクニカ        | 14.9    | 11.9  | 12,126  |  |
| モスフードサービス     | 13.2    | 11.8  | 39,294  |  |
| 加賀電子          | 9.2     | 8.1   | 16,540  |  |
| ソーダニッカ        | 10.4    | 8.8   | 4,576   |  |
| 立花エレテック       | 7.4     | 5.8   | 7,667   |  |
| フォーバル         | 4.3     | 4.1   | 2,849   |  |
| PALTAC        | 16.1    | 14.4  | 45,144  |  |
| 三谷産業          | 11.2    | 9.7   | 3,676   |  |
| 太平洋興発         | 49      | 43    | 4,644   |  |
| ヤマタネ          | 49      | 4.7   | 7,651   |  |
| 丸紅建材リース       | 10      | 9     | 2,160   |  |
| 日鉄住金物産        | 65      | 7.8   | 38,142  |  |
| トラスコ中山        | 11.5    | 20.7  | 53,157  |  |
| オートバックスセブン    | 38.8    | 33.5  | 60,367  |  |
| モリト           | —       | 4.4   | 4,285   |  |
| 加藤産業          | 15.7    | 14    | 41,048  |  |
| イノテック         | 9.5     | 7.8   | 5,428   |  |
| イェローハット       | 9.5     | 8.5   | 23,706  |  |
| J Kホールディングス   | 10.2    | 8.8   | 5,913   |  |
| 日伝            | 4.1     | 3.7   | 12,950  |  |
| 北沢産業          | 10.4    | 8.7   | 1,905   |  |
| 杉本商事          | 5.9     | 5.1   | 7,945   |  |
| 因幡電機産業        | 14.1    | 12.5  | 50,000  |  |
| バイテックホールディングス | 3.2     | 3.6   | 4,950   |  |
| ミスミグループ本社     | 113.7   | 101.6 | 210,820 |  |
| アルテック         | 10.6    | 8.9   | 1,931   |  |
| タキヒヨー         | 17      | 14    | 6,762   |  |
| 蔵王産業          | 1.7     | 1.4   | 2,109   |  |
| スズケン          | 46.1    | 41.2  | 158,002 |  |
| ジェコス          | 7       | 6.3   | 7,119   |  |
| ルネサスイーストン     | 6.6     | 8     | 4,920   |  |
| 小売業 (4.6%)    |         |       |         |  |
| ローソン          | 38.4    | 31.4  | 251,514 |  |



| 銘柄                 | 期首(前期末) |       | 当 期 末   |       |
|--------------------|---------|-------|---------|-------|
|                    | 株 数     | 株 数   | 株 数     | 評 価 額 |
|                    | 千株      | 千株    | 千株      | 千円    |
| サンエー               | 6.8     | 6.8   | 35,156  |       |
| ダイユーエイト            | 2.8     | —     | —       |       |
| カワチ薬品              | 7.9     | 7     | 20,979  |       |
| エービーシー・マート         | 12.9    | 16.4  | 110,044 |       |
| ハードオフコーポレーション      | 4.9     | 4     | 4,684   |       |
| アスクル               | 12.3    | 9.4   | 31,161  |       |
| ゲオホールディングス         | 19.2    | 15    | 20,475  |       |
| アダストリア             | 9.3     | 13.9  | 41,088  |       |
| ジーフット              | 6.2     | 5.6   | 4,586   |       |
| シー・ヴィ・エス・ペイエリア     | 20      | 1.6   | 1,168   |       |
| くらコーポレーション         | 5.9     | 5.9   | 27,376  |       |
| キャンドウ              | 5.4     | 4.9   | 8,888   |       |
| バルグループホールディングス     | 5.9     | 4.6   | 12,783  |       |
| エディオン              | 42.8    | 34.9  | 35,947  |       |
| サーラコーポレーション        | 8.9     | 11.3  | 7,062   |       |
| ワッツ                | 4.1     | 4.2   | 5,447   |       |
| ハローズ               | 3       | 3     | 7,077   |       |
| あみやき亭              | 1.9     | 1.7   | 6,919   |       |
| ひらまつ               | 14      | 12.7  | 8,382   |       |
| ゲンキー               | 2       | 1.8   | 11,592  |       |
| サッポロドラッグストア        | 1.1     | —     | —       |       |
| 大黒天物産              | 2.4     | 2.2   | 11,066  |       |
| ハニーズ               | 8.9     | 8.9   | 9,905   |       |
| ファーマライズホールディングス    | 2.5     | 2.6   | 1,339   |       |
| アルペン               | 9       | 7     | 13,748  |       |
| クオール               | 10.3    | 10.3  | 15,800  |       |
| ジェイアイエヌ            | 6.8     | 6.2   | 37,014  |       |
| ビックカメラ             | 52.4    | 51.9  | 55,740  |       |
| DCMホールディングス        | 49.7    | 54.9  | 54,515  |       |
| Monotaro           | 35.7    | 32    | 103,520 |       |
| 東京一番フーズ            | 2       | 2.4   | 1,406   |       |
| ダイヤモンドダイニング        | 1.8     | 2.1   | 3,521   |       |
| きちり                | 2.9     | 3     | 1,980   |       |
| アークランドサービスホールディングス | 3.1     | 2.8   | 8,974   |       |
| J. フロント リテイリング     | 128.2   | 114.4 | 196,768 |       |
| ドトール・目レスホールディングス   | 17.6    | 15.7  | 35,152  |       |
| マツモトキヨシホールディングス    | 20.9    | 17.1  | 90,288  |       |
| broncoピリ           | 3.9     | 4.8   | 13,459  |       |
| スタートトゥデイ           | 30.8    | 82.5  | 205,177 |       |

| 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    |
| トレジャー・ファクトリー         | 2.9     | 2.7   | 2,268     |       |
| 物語コーポレーション           | 2.6     | 2.6   | 11,596    |       |
| ココカラファイン             | 10.5    | 9.4   | 43,992    |       |
| 三越伊勢丹ホールディングス        | 201.5   | 179.9 | 248,801   |       |
| H a m e e            | —       | 2.1   | 2,003     |       |
| ウエルシアホールディングス        | 8.8     | 9     | 56,610    |       |
| クリエイトSDホールディングス      | 14.9    | 13.3  | 34,207    |       |
| 丸善CHIホールディングス        | 11.7    | 10.3  | 3,749     |       |
| ミサワ                  | 1.4     | 2.2   | 1,016     |       |
| ティーライフ               | —       | 0.9   | 1,314     |       |
| エー・ピーカンパニー           | 1.7     | 1.8   | 1,479     |       |
| チムニー                 | 2.4     | 2.7   | 7,719     |       |
| シュッピン                | 2.9     | 3.5   | 5,145     |       |
| ネクステージ               | 1.9     | 1.8   | 5,097     |       |
| ジョイフル本田              | 16.4    | 14.6  | 50,589    |       |
| 鳥貴族                  | —       | 2.3   | 5,582     |       |
| キリン堂ホールディングス         | 3.5     | 3     | 2,559     |       |
| ホットランド               | 2.8     | 4.3   | 4,437     |       |
| すかいらーく               | 30.9    | 38.8  | 62,235    |       |
| 綿半ホールディングス           | 3       | 3.7   | 5,997     |       |
| ヨシックス                | —       | 1     | 1,321     |       |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 33.3    | 29.6  | 29,896    |       |
| ブックオフコーポレーション        | 5.9     | 5.6   | 4,799     |       |
| ゴルフダイジェスト・オンライン      | 2.3     | 3.7   | 2,923     |       |
| BEENOS               | —       | 1.1   | 1,617     |       |
| あさひ                  | 7.5     | 6.8   | 8,914     |       |
| 日本調剤                 | 2.5     | 3.2   | 11,936    |       |
| コスモス薬品               | 5.1     | 4.6   | 97,566    |       |
| トーエル                 | 4.9     | 4.4   | 4,087     |       |
| 一六堂                  | 2.6     | 3     | 1,218     |       |
| オンリー                 | —       | 1.8   | 1,476     |       |
| セブン&アイ・ホールディングス      | 423.9   | 378.4 | 1,665,338 |       |
| 薬王堂                  | 1.5     | 4.6   | 11,168    |       |
| クリエイト・レストランツ・ホールディング | 9       | 24.2  | 24,950    |       |
| ツルハホールディングス          | 23.3    | 18.1  | 189,688   |       |
| サンマルクホールディングス        | 7.9     | 5.8   | 20,242    |       |
| フェリスモ                | 3.1     | 2.7   | 2,791     |       |
| トリドールホールディングス        | 12.4    | 11.1  | 26,262    |       |
| クスリのアオキ              | 9       | —     | —         |       |

| 銘柄               | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|------------------|---------|-------|---------|
|                  | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                  | 千株      | 千株    | 千円      |
| サツドラホールディングス     | —       | 1.2   | 2,409   |
| ダイユー・リックホールディングス | —       | 2.7   | 2,141   |
| バロックジャパンリミテッド    | —       | 5.5   | 7,727   |
| クスリのアオキホールディングス  | —       | 7.2   | 34,380  |
| メディカルシステムネットワーク  | 11.8    | 10.5  | 4,767   |
| 総合メディカル          | 4.9     | 4.4   | 17,578  |
| はるやまホールディングス     | 4.1     | 3.5   | 3,437   |
| ノジマ              | —       | 10.5  | 14,763  |
| カッパ・クリエイト        | 14.1    | 12.5  | 15,987  |
| ライトオン            | 7.6     | 6.8   | 6,684   |
| ジーンズメイト          | 4.8     | —     | —       |
| 良品計画             | 11.6    | 12    | 269,160 |
| 三城ホールディングス       | 11.4    | 10.5  | 4,998   |
| アドヴァン            | —       | 9.2   | 10,662  |
| アルビス             | 2.6     | 2.4   | 7,812   |
| コナカ              | 11.9    | 11    | 6,600   |
| ハウス オブ ローゼ       | 1.3     | 1.2   | 1,860   |
| G-7ホールディングス      | 3.1     | 2.6   | 5,462   |
| イオン北海道           | 6.7     | 8.1   | 4,997   |
| コジマ              | 15.6    | 13.8  | 3,795   |
| ヒマラヤ             | 3.2     | 3     | 2,571   |
| コーナン商事           | 14.3    | 12.7  | 27,711  |
| エコス              | 3.9     | 3.6   | 4,356   |
| ワタミ              | 12.1    | 10.9  | 12,469  |
| マルシェ             | 2.5     | 2.6   | 2,184   |
| ドンキホーテホールディングス   | 65.5    | 58.5  | 230,197 |
| 西松屋チェーン          | 19.9    | 16    | 20,800  |
| ゼンショーホールディングス    | 52.1    | 46.8  | 88,639  |
| 幸楽苑ホールディングス      | 6.4     | 5.8   | 9,726   |
| ハークスレイ           | 3       | 1.9   | 2,126   |
| サイゼリヤ            | 16.7    | 14.8  | 39,072  |
| V Tホールディングス      | 34.4    | 30.6  | 16,034  |
| 魚力               | 3.2     | 2.7   | 3,510   |
| ポブラ              | 4       | 3.4   | 1,768   |
| フジ・コーポレーション      | —       | 1.4   | 3,201   |
| ユナイテッドアローズ       | 14.5    | 12.1  | 42,289  |
| ハイデイ日高           | 7.5     | 8.2   | 23,698  |
| 京都きもの友禅          | 7.2     | 5.8   | 5,771   |
| コロワイド            | 33.6    | 30    | 55,980  |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|----------------------|---------|-------|---------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                      | 千株      | 千株    | 千円      |
| ピーシーデポコーポレーション       | 8.4     | 12.3  | 6,875   |
| 老番屋                  | 4.5     | 7.2   | 27,180  |
| トップカルチャー             | 4       | 3.4   | 1,638   |
| P L A N T            | 2.4     | 2.1   | 2,515   |
| スギホールディングス           | 18.2    | 19.8  | 105,930 |
| ヴィア・ホールディングス         | —       | 4.2   | 4,859   |
| スクロール                | 15.8    | 13.6  | 4,787   |
| ヨンドシーホールディングス        | 7.7     | 7     | 17,899  |
| ユニー・ファミリーマートホールディングス | 31.1    | 39.6  | 279,180 |
| 木曾路                  | 12.3    | 11.1  | 26,295  |
| サトレストラシスシステムズ        | 11.7    | 10.5  | 9,082   |
| 千趣会                  | 19.8    | 16.2  | 12,862  |
| タカキュー                | 9.1     | 7.8   | 1,669   |
| ケーヨー                 | 16.8    | 14.2  | 8,307   |
| 上新電機                 | 24      | 21    | 22,869  |
| 日本瓦斯                 | 11.7    | 16.6  | 55,527  |
| ベスト電器                | 34.8    | 29.4  | 4,174   |
| ロイヤルホールディングス         | 16.8    | 14.9  | 29,978  |
| 東天紅                  | 9       | 10    | 1,690   |
| いなげや                 | 11.3    | 9.9   | 15,513  |
| 島忠                   | 26.2    | 23.4  | 66,549  |
| チヨダ                  | 11.9    | 10.6  | 29,118  |
| ライフコーポレーション          | 6.4     | 6.8   | 22,542  |
| リンガーハット              | 9.1     | 10.3  | 23,617  |
| さが美                  | 12      | 10    | 1,210   |
| M r M a x            | 9.7     | 11.3  | 4,723   |
| テンアライド               | 10.1    | 9.2   | 3,624   |
| A O K Iホールディングス      | 22.9    | 17.8  | 25,293  |
| オークワ                 | 16      | 13    | 14,534  |
| コメリ                  | 15.6    | 13.9  | 38,086  |
| 青山商事                 | 19.4    | 18.9  | 78,435  |
| しまむら                 | 11.8    | 10.5  | 152,460 |
| はせがわ                 | 3.9     | 5     | 2,235   |
| 高島屋                  | 147     | 152   | 152,000 |
| 松屋                   | 20.6    | 19.8  | 19,938  |
| エイチ・ツー・オー リテイリング     | 51.9    | 46.3  | 86,581  |
| 近鉄百貨店                | 39      | 34    | 12,138  |
| 丸栄                   | 25      | 26    | 2,314   |
| ニッセンホールディングス         | 16.4    | —     | —       |

| 銘柄                | 期首(前期末) |       |         |
|-------------------|---------|-------|---------|
|                   | 株数      | 株数    | 評価額     |
|                   | 千株      | 千株    | 千円      |
| バルコ               | 9.8     | 8.2   | 9,331   |
| 丸井グループ            | 124.4   | 95.1  | 148,451 |
| アクシアル リテイリング      | 7.8     | 7     | 31,500  |
| イオン               | 416.9   | 372   | 633,516 |
| ユニーグループ・ホールディングス  | 97      | —     | —       |
| イズミ               | 20.1    | 17.9  | 87,799  |
| 東武ストア             | 13      | 1.1   | 3,322   |
| 平和堂               | 20.5    | 18.2  | 48,776  |
| フジ                | 11.3    | 10    | 24,010  |
| ヤオコー              | 11.5    | 10.2  | 46,512  |
| ゼビオホールディングス       | 13.7    | 12.3  | 22,078  |
| ケーズホールディングス       | 21.4    | 41.7  | 87,069  |
| O l y m p i cグループ | 6.5     | 5.2   | 3,312   |
| 日産東京販売ホールディングス    | 17.1    | 13.5  | 4,752   |
| アインホールディングス       | 12.2    | 11.8  | 100,654 |
| 元気寿司              | 2.9     | 2.3   | 5,218   |
| ヤマダ電機             | 308.1   | 302.4 | 174,484 |
| アークランドサカモト        | 17      | 15.1  | 21,487  |
| ニトリホールディングス       | 43.8    | 39.1  | 478,975 |
| グルメ杵屋             | 8       | 6     | 6,246   |
| 愛眼                | 9.7     | 8     | 1,576   |
| ケーユーホールディングス      | 5.2     | 4.1   | 3,747   |
| 吉野家ホールディングス       | 37.3    | 31.4  | 52,312  |
| 松屋フーズ             | 4.8     | 4.4   | 18,348  |
| サガミチェーン           | 13.4    | 11.1  | 15,273  |
| 関西スーパーマーケット       | 8       | 7.6   | 11,658  |
| 王将フードサービス         | 7.3     | 6.5   | 27,592  |
| プレナス              | 11.3    | 10.1  | 25,199  |
| ミニストップ            | 7.5     | 6.6   | 14,295  |
| アークス              | 18.8    | 16.8  | 43,428  |
| パローホールディングス       | 21.8    | 19.5  | 54,093  |
| 藤久                | 0.7     | 0.8   | 1,396   |
| ベルク               | 4.9     | 4     | 18,120  |
| 大庄                | 4.8     | 4.9   | 7,815   |
| ファーストリテイリング       | 20.3    | 15.1  | 528,349 |
| サンドラッグ            | 21.4    | 17.2  | 127,968 |
| サックスパー ホールディングス   | 9.5     | 8.6   | 10,793  |
| ヤマザワ              | 2.1     | 1.8   | 3,346   |
| やまや               | 2.1     | 1.7   | 2,925   |

| 銘柄                  | 期首(前期末) |         |           |
|---------------------|---------|---------|-----------|
|                     | 株数      | 株数      | 評価額       |
|                     | 千株      | 千株      | 千円        |
| ブルーナ                | 25.3    | 22.5    | 19,102    |
| <b>銀行業 (8.7%)</b>   |         |         |           |
| 島根銀行                | 2.2     | 2       | 2,820     |
| じもとホールディングス         | 71.6    | 65.9    | 12,916    |
| めぶきフィナンシャルグループ      | 74.4    | 436     | 212,768   |
| 東京T Yフィナンシャルグループ    | 13.9    | 13.1    | 52,400    |
| 九州フィナンシャルグループ       | 155.1   | 148.3   | 117,750   |
| ゆうちょ銀行              | 194.7   | 256     | 364,800   |
| 富山第一銀行              | —       | 22.7    | 12,507    |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | —       | 591.9   | 363,367   |
| 西日本フィナンシャルホールディングス  | —       | 61.3    | 77,176    |
| 新生銀行                | 877     | 861     | 179,949   |
| あおぞら銀行              | 641     | 572     | 238,524   |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ   | 8,130   | 6,851.2 | 5,260,351 |
| りそなホールディングス         | 1,185.4 | 1,057.7 | 665,716   |
| 三井住友トラスト・ホールディングス   | 2,115   | 188.8   | 797,680   |
| 三井住友フィナンシャルグループ     | 811.4   | 724     | 3,293,476 |
| 第四銀行                | 128     | 111     | 59,607    |
| 北越銀行                | 110     | 9.7     | 26,616    |
| 西日本シティ銀行            | 330     | —       | —         |
| 千葉銀行                | 391     | 349     | 275,012   |
| 横浜銀行                | 680     | —       | —         |
| 常陽銀行                | 366     | —       | —         |
| 群馬銀行                | 225     | 200.9   | 134,603   |
| 武蔵野銀行               | 16.2    | 14.3    | 53,053    |
| 千葉興業銀行              | 28.1    | 25      | 15,750    |
| 筑波銀行                | 41.8    | 38.3    | 13,519    |
| 七十七銀行               | 159     | 142     | 76,396    |
| 青森銀行                | 74      | 71      | 27,974    |
| 秋田銀行                | 67      | 58      | 21,344    |
| 山形銀行                | 57      | 51      | 25,245    |
| 岩手銀行                | 7.1     | 5.9     | 28,231    |
| 東邦銀行                | 90      | 80      | 35,280    |
| 東北銀行                | 52      | 46      | 7,360     |
| みちのく銀行              | 48      | 48      | 9,168     |
| ふくおかフィナンシャルグループ     | 439     | 367     | 185,335   |
| 静岡銀行                | 297     | 246     | 250,428   |
| 十六銀行                | 126     | 121     | 49,973    |
| スルガ銀行               | 96.2    | 92.4    | 236,728   |

| 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    |
| 八十二銀行           | 183      | 174.5    | 126,163   |       |
| 山梨中央銀行          | 63       | 56       | 31,192    |       |
| 大垣共立銀行          | 135      | 121      | 54,813    |       |
| 福井銀行            | 87       | 78       | 22,152    |       |
| 北國銀行            | 113      | 95       | 45,505    |       |
| 清水銀行            | 3.5      | 3.1      | 11,718    |       |
| 富山銀行            | 2        | 1.8      | 7,524     |       |
| 滋賀銀行            | 94       | 85       | 53,890    |       |
| 南都銀行            | 98       | 8.7      | 41,151    |       |
| 百五銀行            | 91       | 80       | 41,600    |       |
| 京都銀行            | 193      | 162      | 156,168   |       |
| 紀陽銀行            | 39.8     | 34       | 65,382    |       |
| 三重銀行            | 46       | 4.1      | 10,377    |       |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 689      | 60.1     | 123,385   |       |
| 広島銀行            | 299      | 267      | 146,850   |       |
| 山陰合同銀行          | 61.5     | 54.3     | 55,874    |       |
| 中国銀行            | 71.8     | 64.1     | 116,213   |       |
| 鳥取銀行            | 34       | 2.9      | 5,614     |       |
| 伊予銀行            | 108.4    | 96.7     | 81,421    |       |
| 百十四銀行           | 111      | 99       | 39,699    |       |
| 四国銀行            | 79       | 70       | 22,050    |       |
| 阿波銀行            | 82       | 77       | 58,520    |       |
| 大分銀行            | 58       | 52       | 23,400    |       |
| 宮崎銀行            | 67       | 60       | 22,680    |       |
| 佐賀銀行            | 61       | 55       | 17,215    |       |
| 十八銀行            | 63       | 56       | 20,384    |       |
| 沖縄銀行            | 8.1      | 8.8      | 37,224    |       |
| 琉球銀行            | 20.8     | 18.4     | 30,599    |       |
| セブン銀行           | 379.7    | 338.9    | 112,175   |       |
| みずほフィナンシャルグループ  | 14,274.5 | 12,275.4 | 2,582,744 |       |
| 高知銀行            | 42       | 35       | 4,830     |       |
| 山口フィナンシャルグループ   | 95       | 85       | 112,285   |       |
| 長野銀行            | 33       | 2.9      | 5,863     |       |
| 名古屋銀行           | 86       | 7.5      | 32,737    |       |
| 北洋銀行            | 152.7    | 147.6    | 70,700    |       |
| 愛知銀行            | 3.4      | 3        | 21,360    |       |
| 第三銀行            | 57       | 5.1      | 8,960     |       |
| 中京銀行            | 42       | 3.8      | 8,759     |       |
| 東日本銀行           | 48       | —        | —         |       |

| 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    |
| 大光銀行                     | 37      | 32      | 8,064     |       |
| 愛媛銀行                     | 58      | 10.7    | 15,183    |       |
| トマト銀行                    | 39      | 3.6     | 5,871     |       |
| みなと銀行                    | 92      | 8.2     | 19,991    |       |
| 京葉銀行                     | 84      | 73      | 40,004    |       |
| 関西アーバン銀行                 | 13.6    | 12.5    | 19,737    |       |
| 栃木銀行                     | 54      | 49.6    | 29,412    |       |
| 北日本銀行                    | 3.2     | 2.8     | 8,876     |       |
| 東和銀行                     | 144     | 170     | 21,590    |       |
| 福島銀行                     | 125     | 104     | 10,088    |       |
| 大東銀行                     | 61      | 49      | 8,428     |       |
| トモニホールディングス              | 78.6    | 74.3    | 48,592    |       |
| フィデアホールディングス             | 63      | 87.1    | 18,900    |       |
| 池田泉州ホールディングス             | 106.1   | 95.3    | 49,651    |       |
| <b>証券、商品先物取引業 (1.3%)</b> |         |         |           |       |
| F P G                    | 30.2    | 32.4    | 36,061    |       |
| S B I ホールディングス           | 121.7   | 102.2   | 158,103   |       |
| ジャフコ                     | 16.9    | 15.1    | 59,494    |       |
| 大和証券グループ本社               | 948     | 846     | 601,506   |       |
| 野村ホールディングス               | 1,949.7 | 1,848.4 | 1,386,300 |       |
| 岡三証券グループ                 | 86      | 77      | 58,366    |       |
| 丸三証券                     | 30.1    | 29      | 27,898    |       |
| 東洋証券                     | 39      | 33      | 8,976     |       |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス     | 116.3   | 103.8   | 67,158    |       |
| 光世証券                     | 27      | 24      | 4,584     |       |
| 水戸証券                     | 31.8    | 28.9    | 9,016     |       |
| いちよし証券                   | 22.6    | 20.6    | 18,540    |       |
| 松井証券                     | 50.6    | 51.1    | 47,676    |       |
| だいこう証券ビジネス               | 5.1     | 4.6     | 2,939     |       |
| マネックスグループ                | 119.1   | 97.9    | 28,782    |       |
| カブドットコム証券                | 89.8    | 68.7    | 26,861    |       |
| 極東証券                     | 13.6    | 12.2    | 20,508    |       |
| 岩井コスモホールディングス            | 9.9     | 8.5     | 9,409     |       |
| 藍澤證券                     | 14.3    | 16.8    | 10,869    |       |
| マネースクウェアHD               | 3.5     | —       | —         |       |
| マネーパートナーズグループ            | 10.3    | 11.8    | 6,265     |       |
| <b>保険業 (2.8%)</b>        |         |         |           |       |
| かんぽ生命保険                  | 30.9    | 34.1    | 94,798    |       |
| S O M P O ホールディングス       | 225.1   | 189     | 809,109   |       |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|----------------------|---------|-------|-----------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                      | 千株      | 千株    | 千円        |
| アニコム ホールディングス        | 6.9     | 6.2   | 14,012    |
| MS&ADインシュアランスグループホール | 302.8   | 270.2 | 1,038,919 |
| ソニーフィナンシャルホールディングス   | 97.1    | 86.6  | 174,672   |
| 第一生命ホールディングス         | 649.2   | 545.2 | 1,202,983 |
| 東京海上ホールディングス         | 410.5   | 366.3 | 1,864,100 |
| T&Dホールディングス          | 369.3   | 329.5 | 595,736   |
| アドバンスクリエイト           | —       | 2.2   | 4,580     |
| <b>その他金融業 (1.3%)</b> |         |       |           |
| 全国保証                 | 26.3    | 25.5  | 92,310    |
| クレディセゾン              | 76.8    | 68.6  | 149,205   |
| アクリーティブ              | —       | 7.5   | 2,985     |
| 芙蓉総合リース              | 11.6    | 10.4  | 55,120    |
| 興銀リース                | 19.1    | 17    | 42,534    |
| 東京センチュリー             | 23.8    | 18.2  | 70,980    |
| 日本証券金融               | 45.6    | 39.8  | 25,153    |
| アイフル                 | 169.6   | 153   | 54,315    |
| ポケットカード              | 10.6    | 7.2   | 4,370     |
| リコーリース               | 8.1     | 7.2   | 26,280    |
| イオンフィナンシャルサービス       | 66.5    | 57.7  | 122,554   |
| アコム                  | 203.5   | 184.2 | 90,994    |
| ジャックス                | 57      | 50    | 25,400    |
| オリエントコーポレーション        | 438.1   | 197.6 | 42,484    |
| 日立キャピタル              | 23.9    | 21.3  | 62,728    |
| アブラスフィナンシャル          | 51.6    | 46.4  | 5,521     |
| オリックス                | 717.5   | 640.3 | 1,128,208 |
| 三菱UFJリース             | 257     | 229.3 | 142,166   |
| 日本取引所グループ            | 297.5   | 281.1 | 450,322   |
| イー・ギャランティ            | 3.4     | 2.8   | 7,316     |
| アサックス                | 2.2     | 1.5   | 2,461     |
| NECキャピタルソリューション      | 4.4     | 3.8   | 6,927     |
| <b>不動産業 (2.5%)</b>   |         |       |           |
| いちご                  | 84.4    | 86.6  | 31,695    |
| 日本駐車場開発              | 111.5   | 110.7 | 16,937    |
| ヒューリック               | 211.2   | 188.6 | 205,196   |
| 三栄建築設計               | 4.2     | 3.8   | 5,950     |
| 野村不動産ホールディングス        | 67.2    | 60    | 115,500   |
| 三重交通グループホールディングス     | 17.9    | 16.4  | 6,396     |
| サムティ                 | 5.7     | 7.5   | 8,962     |
| ディア・ライフ              | 5.6     | 6.4   | 2,572     |

| 銘柄             | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|----------------|---------|-------|-----------|
|                | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                | 千株      | 千株    | 千円        |
| エー・ディー・ワークス    | 77.5    | 93.5  | 4,020     |
| 日本商業開発         | 3.3     | 5.1   | 9,904     |
| プレサンスコーポレーション  | 3.4     | 14.2  | 19,979    |
| ユニゾホールディングス    | 6.3     | 7.5   | 23,212    |
| THEグローバル社      | —       | 4.1   | 1,861     |
| 日本管理センター       | 6.7     | 6.6   | 9,154     |
| サンセイランディック     | 2.7     | 2.2   | 1,667     |
| エストラスト         | 2.2     | 2     | 1,548     |
| フージャースホールディングス | 14.6    | 12.1  | 7,417     |
| オープンハウス        | 14.7    | 13.1  | 35,579    |
| 東急不動産ホールディングス  | 245.1   | 218.7 | 143,248   |
| 飯田グループホールディングス | 93.9    | 75.4  | 137,152   |
| ムゲンエステート       | —       | 3.5   | 2,530     |
| ファーストブラザーズ     | —       | 1     | 1,708     |
| ハウスドゥ          | —       | 0.8   | 1,142     |
| シーアールイー        | —       | 1.4   | 2,356     |
| ケイアイスター不動産     | —       | 1.2   | 1,921     |
| パーク24          | 51.1    | 45.9  | 142,060   |
| バラカ            | 3.6     | 2.7   | 5,373     |
| 三井不動産          | 537     | 479   | 1,256,177 |
| 三菱地所           | 753     | 672   | 1,517,712 |
| 平和不動産          | 19.5    | 17.3  | 27,887    |
| 東京建物           | 110.7   | 104.9 | 166,686   |
| ダイビル           | 26.4    | 23.5  | 25,074    |
| 京阪神ビルディング      | 17.4    | 15.2  | 9,956     |
| 住友不動産          | 243     | 217   | 704,382   |
| 大京             | 191     | 169   | 39,208    |
| テアオーシー         | 39.6    | 35.2  | 33,932    |
| 東京楽天地          | 17      | 15    | 7,920     |
| レオパレス21        | 119.4   | 114.1 | 69,144    |
| スターツコーポレーション   | 11.7    | 9.3   | 22,626    |
| フジ住宅           | 13.3    | 11.5  | 8,579     |
| 空港施設           | 12.9    | 11.2  | 6,641     |
| 住友不動産販売        | 7.3     | 8.2   | 23,345    |
| ゴールドクレスト       | 8.2     | 8.3   | 17,737    |
| 日本エスリード        | 4.1     | 3.7   | 5,642     |
| 日神不動産          | 13.9    | 10.9  | 6,005     |
| 日本エスコン         | —       | 12.6  | 5,052     |
| タカラレーベン        | 45.4    | 39.8  | 23,919    |

| 銘柄                  | 期首(前期末) |      | 当 期 末   |       |
|---------------------|---------|------|---------|-------|
|                     | 株 数     | 株 数  | 株 数     | 評 価 額 |
|                     | 千株      | 千株   | 千株      | 千円    |
| サンヨーハウジング名古屋        | 5.9     | 4.9  | 4,953   |       |
| イオンモール              | 65.4    | 58.2 | 100,802 |       |
| ファースト住建             | 3.9     | 3.5  | 5,015   |       |
| トーセイ                | 15.8    | 12.4 | 9,622   |       |
| 穴吹興産                | 12      | 1    | 2,669   |       |
| エヌ・ティ・ティ都市開発        | 62.9    | 56.2 | 59,178  |       |
| サンフロンティア不動産         | 12.3    | 10.1 | 10,362  |       |
| エフ・ジェー・ネクスト         | 8.9     | 8.3  | 6,698   |       |
| インテリックス             | —       | 2.2  | 1,815   |       |
| グランディハウス            | 9       | 8.2  | 3,427   |       |
| 日本空港ビルデング           | 32.3    | 28.8 | 113,904 |       |
| <b>サービス業 (3.6%)</b> |         |      |         |       |
| 日本工営                | 36      | 6.4  | 17,497  |       |
| ネクスト                | 30.4    | 23.8 | 17,564  |       |
| ジェイエイシーリクルートメント     | 4.9     | 6    | 9,282   |       |
| 日本M&Aセンター           | 16.6    | 27.6 | 94,806  |       |
| ノバレーゼ               | 2.6     | —    | —       |       |
| アコーディア・ゴルフ          | 30      | —    | —       |       |
| 中広                  | 1       | 1.1  | 764     |       |
| タケエイ                | 9.3     | 8.6  | 8,815   |       |
| トラスト・テック            | 2.2     | 4    | 6,880   |       |
| コシダカホールディングス        | —       | 3.3  | 8,190   |       |
| パソナグループ             | 9.4     | 7.3  | 5,927   |       |
| CDS                 | 2.5     | 2.4  | 2,412   |       |
| リンクアンドモチベーション       | 21.9    | 23.1 | 10,071  |       |
| GCA                 | 9.8     | 8.7  | 8,308   |       |
| エス・エム・エス            | 13.4    | 13.6 | 34,897  |       |
| テンブホールディングス         | 75.2    | 74   | 143,338 |       |
| リニカル                | 6.4     | 5.7  | 8,225   |       |
| クックパッド              | 23.9    | 21.4 | 20,865  |       |
| エスクリ                | 4.5     | 3.6  | 2,739   |       |
| アイ・ケイ・ケイ            | 5.8     | 4.2  | 3,015   |       |
| 学情                  | 4.1     | 4.1  | 4,936   |       |
| スタジオアリス             | 4.7     | 4    | 8,996   |       |
| シミックホールディングス        | 4.9     | 5    | 7,435   |       |
| NJS                 | 2.4     | 2.2  | 3,075   |       |
| 総合警備保障              | 35.8    | 34.8 | 150,684 |       |
| カカコム                | 77.8    | 68.3 | 110,167 |       |
| セントケア・ホールディング       | —       | 0.8  | 1,344   |       |

| 銘柄               | 期首(前期末) |       | 当 期 末   |       |
|------------------|---------|-------|---------|-------|
|                  | 株 数     | 株 数   | 株 数     | 評 価 額 |
|                  | 千株      | 千株    | 千株      | 千円    |
| サイネックス           | —       | 0.4   | 474     |       |
| ルネサンス            | 5.5     | 4.9   | 8,349   |       |
| ディップ             | 11.9    | 12.3  | 28,548  |       |
| オプトホールディング       | 6.8     | 7     | 6,517   |       |
| 新日本科学            | —       | 11    | 6,182   |       |
| ツクイ              | 12.7    | 23.3  | 15,913  |       |
| キャリアデザインセンター     | 3       | 2.2   | 2,558   |       |
| エムスリー            | 92.9    | 82.9  | 235,850 |       |
| ツカダ・グローバルホールディング | 7.7     | 7.2   | 4,485   |       |
| アウトソーシング         | 5       | 5.5   | 20,542  |       |
| ウェルネット           | 4.1     | 7.3   | 9,438   |       |
| ワールドホールディングス     | —       | 2.2   | 4,246   |       |
| ディー・エヌ・エー        | 48.1    | 42.9  | 105,662 |       |
| 博報堂DYホールディングス    | 148.6   | 132.6 | 177,286 |       |
| ぐるなび             | 12.4    | 14    | 31,038  |       |
| エスアールジータカミヤ      | 9.1     | 10.7  | 6,259   |       |
| ジャパンバストレスキューシステム | 13      | 13.6  | 3,440   |       |
| ファンコムコミュニケーションズ  | 24.7    | 24.4  | 18,910  |       |
| ライク              | 2.3     | 1.8   | 4,410   |       |
| ビジネス・ブレークスルー     | —       | 2     | 896     |       |
| WDBホールディングス      | 3.9     | 3.5   | 4,788   |       |
| ティア              | 4.7     | 4.6   | 3,201   |       |
| バリュエコマース         | 10      | 8.8   | 3,379   |       |
| インフォマート          | 15.5    | 40.7  | 24,135  |       |
| J Pホールディングス      | 27      | 28.3  | 7,301   |       |
| E P Sホールディングス    | 12      | 12    | 18,300  |       |
| レッグス             | 1.9     | 2.4   | 1,932   |       |
| プレステージ・インターナショナル | 9       | 13.7  | 12,193  |       |
| アミューズ            | 2.9     | 5.3   | 10,721  |       |
| ドリームインキュベータ      | 3.7     | 3     | 6,363   |       |
| クイック             | 5.6     | 5     | 5,820   |       |
| TAC              | 7.6     | 7.1   | 1,625   |       |
| ケネディクス           | 144     | 121.3 | 53,493  |       |
| 電通               | 119.5   | 106.6 | 636,402 |       |
| テイクアンドギヴ・ニューズ    | 5.1     | 4.6   | 4,402   |       |
| びあ               | 2.9     | 3     | 8,766   |       |
| イオンファンタジー        | 3.9     | 2.9   | 9,048   |       |
| シーティーエス          | 2.5     | 2.7   | 4,198   |       |
| ネクシィーズグループ       | 4.1     | 3.5   | 5,561   |       |

| 銘柄             | 期首(前期末) |       |         |
|----------------|---------|-------|---------|
|                | 株数      | 株数    | 評価額     |
|                | 千株      | 千株    | 千円      |
| みらかホールディングス    | 27.4    | 24.4  | 123,708 |
| アルプス技研         | 4       | 3.8   | 11,609  |
| ダイオーズ          | 2       | 1.6   | 1,718   |
| 日本空調サービス       | 5.2     | 9.1   | 6,060   |
| オリエンタルランド      | 115.9   | 103.4 | 653,177 |
| ダスキン           | 30.4    | 24.5  | 59,804  |
| 明光ネットワークジャパン   | 12.2    | 12    | 14,508  |
| ファルコホールディングス   | 4.8     | 4.5   | 6,727   |
| 秀英予備校          | 2.5     | 2.1   | 1,010   |
| 田谷             | 2.6     | —     | —       |
| ラウンドワン         | 33.8    | 30.2  | 26,576  |
| リゾートトラスト       | 45      | 37    | 81,437  |
| ビー・エム・エル       | 6.3     | 12.6  | 31,210  |
| ワタベウェディング      | 3.8     | 1.8   | 1,031   |
| りらいあコミュニケーションズ | 17.8    | 16    | 17,440  |
| リゾー教育          | 20.4    | 16.4  | 10,266  |
| 早稲田アカデミー       | 1.2     | 1.3   | 1,557   |
| ユー・エス・エス       | 129.8   | 115.8 | 223,841 |
| 東京個別指導学院       | 5.4     | 3.2   | 3,308   |
| サイバーエージェント     | 26.2    | 50.3  | 151,403 |
| 楽天             | 501.6   | 488.9 | 502,589 |
| クリーク・アンド・リバー社  | —       | 3.5   | 3,797   |
| テー・オー・ダブリュー    | 6.8     | 7.7   | 5,274   |
| セントラルスポーツ      | 3.6     | 3.2   | 11,456  |
| フルキャストホールディングス | 10.1    | 9.9   | 10,632  |
| リソルホールディングス    | 12      | 10    | 3,500   |
| テクノプロ・ホールディングス | 17.4    | 15.6  | 60,138  |
| アトラ            | —       | 1.2   | 870     |
| インターワークス       | 1.6     | 2.1   | 2,368   |
| Keeper 技研      | —       | 1.1   | 2,370   |
| ファーストロジック      | —       | 0.5   | 1,205   |
| デザインワン・ジャパン    | —       | 0.7   | 1,995   |
| イー・ガーディアン      | —       | 3.2   | 5,692   |
| リブセンス          | 7.6     | 7.1   | 3,131   |
| ジャパンマテリアル      | 4.4     | 7.1   | 10,813  |
| ベクトル           | 3.3     | 7.9   | 9,859   |
| ウチヤマホールディングス   | 5.6     | 4.6   | 2,019   |
| サクセスホールディングス   | 1.1     | 0.9   | 1,242   |
| キャリアリンク        | 1.6     | 2.4   | 1,764   |

| 銘柄                | 期首(前期末) |       |           |
|-------------------|---------|-------|-----------|
|                   | 株数      | 株数    | 評価額       |
|                   | 千株      | 千株    | 千円        |
| I B J             | 6.6     | 7.8   | 4,680     |
| アサンテ              | 4       | 3.5   | 6,076     |
| N・フィールド           | 3.9     | 4.7   | 6,913     |
| バリューHR            | —       | 0.4   | 1,028     |
| M&Aキャピタルパートナーズ    | 1.1     | 1.3   | 5,356     |
| ライドオン・エクスプレス      | 1.8     | 2.5   | 2,337     |
| ERIホールディングス       | 2.9     | 2.8   | 2,310     |
| アビスト              | 1.3     | 1.5   | 5,940     |
| ウィルグループ           | 2.5     | 4     | 2,836     |
| エスクロー・エージェント・ジャパン | —       | 1.7   | 2,830     |
| 日本ビューホテル          | 1.3     | 2     | 2,700     |
| リクルートホールディングス     | 216.3   | 209   | 1,113,970 |
| エラン               | 1.1     | 1.4   | 1,955     |
| 土木管理総合試験所         | —       | 1.1   | 774       |
| 日本郵政              | 236.5   | 249.7 | 368,057   |
| ベルシシステム24ホールディングス | 15.8    | 14.7  | 14,700    |
| 一蔵                | —       | 0.4   | 521       |
| ソラスト              | —       | 4.6   | 6,941     |
| リログループ            | 4       | 3.6   | 56,880    |
| 東祥                | 3.2     | 2.1   | 10,815    |
| エイチ・アイ・エス         | 17.5    | 15.6  | 45,661    |
| ラックランド            | 1.7     | 1.7   | 3,396     |
| 共立メンテナンス          | 8.1     | 7.8   | 54,054    |
| イチネンホールディングス      | 11.3    | 10.1  | 12,079    |
| 建設技術研究所           | 6.3     | 6     | 6,564     |
| スペース              | 5.8     | 4.9   | 6,296     |
| 燦ホールディングス         | 2.1     | 1.7   | 2,703     |
| スバル興業             | 8       | 7     | 3,640     |
| 東京テアトル            | 44      | 41    | 6,232     |
| タナベ経営             | —       | 2     | 2,790     |
| ナガワ               | 2       | 1.8   | 8,190     |
| よみうりランド           | 21      | 20    | 9,240     |
| 東京都競馬             | 73      | 66    | 17,028    |
| 常磐興産              | 40      | 3.4   | 5,487     |
| カナモト              | 14.9    | 13.3  | 38,370    |
| 東京ドーム             | 85      | 38.3  | 41,900    |
| 西尾レントオール          | 8.6     | 7.7   | 25,410    |
| トランス・コスモス         | 12.4    | 11.1  | 29,048    |
| 乃村工藝社             | 23.1    | 20.5  | 39,196    |

| 銘柄              | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-----------------|---------|-------|---------|
|                 | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                 | 千株      | 千株    | 千円      |
| 藤田観光            | 39      | 32    | 11,840  |
| KNT-C Tホールディングス | 52      | 56    | 7,728   |
| 日本管財            | 9.2     | 8.1   | 14,490  |
| トーカイ            | 4.7     | 4.2   | 17,220  |
| 白洋舎             | 12      | 0.9   | 2,430   |
| セコム             | 111.5   | 99.5  | 815,303 |
| セントラル警備保障       | 4.7     | 4.3   | 8,161   |
| 丹青社             | 20.2    | 16.5  | 14,305  |
| メイテック           | 13.3    | 11.5  | 50,025  |
| アサツー ディ・ケイ      | 18.8    | 15.6  | 45,099  |
| 応用地質            | 11.3    | 9.1   | 13,340  |
| 船井総研ホールディングス    | 15      | 12.3  | 24,083  |

| 銘柄           | 期首(前期末) | 当 期 末   |         |             |
|--------------|---------|---------|---------|-------------|
|              | 株 数     | 株 数     | 評 価 額   |             |
|              | 千株      | 千株      | 千円      |             |
| 進学会          | 5       | 3.8     | 2,169   |             |
| オオバ          | 6       | 7.6     | 3,663   |             |
| 学究社          | 1.6     | 2.6     | 4,230   |             |
| ベネッセホールディングス | 35.9    | 32.1    | 107,214 |             |
| イオンディライト     | 10.3    | 10.7    | 37,129  |             |
| ナック          | 6.7     | 5.9     | 5,846   |             |
| ニチイ学館        | 18.8    | 16.9    | 14,905  |             |
| ダイセキ         | 20.1    | 16.7    | 38,693  |             |
| ステップ         | 3.6     | 3.2     | 4,486   |             |
| 合 計          | 株 数・金 額 | 170,037 | 137,918 | 206,646,912 |
|              | 銘柄数<比率> | 1,905   | 1,968   | <98.6%>     |

(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   |
|    |        | 2,769 | —     |

### 〇有価証券の貸付及び借入の状況

2017年2月20日現在における貸付株数の総株数は34,597,300株です。

うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUF G証券株式会社に対する貸付は、22,631,300株です。

### 〇投資信託財産の構成

(2017年2月20日現在)

| 項 目          | 当 期 末       |       |
|--------------|-------------|-------|
|              | 評 価 額       | 比 率   |
|              | 千円          | %     |
| 株式           | 206,646,912 | 77.1  |
| コール・ローン等、その他 | 61,484,778  | 22.9  |
| 投資信託財産総額     | 268,131,690 | 100.0 |



## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年2月20日現在)

| 項 目             | 当 期 末            |
|-----------------|------------------|
|                 | 円                |
| (A) 資産          | 268,121,156,164  |
| コール・ローン等        | 59,005,889,657   |
| 株式(評価額)         | 206,646,912,100  |
| 未収入金            | 2,004,392,372    |
| 未収配当金           | 293,303,471      |
| その他未収収益         | 62,053,564       |
| 差入委託証拠金         | 108,605,000      |
| (B) 負債          | 58,614,387,208   |
| 未払解約金           | 628,299,580      |
| 未払利息            | 74,719           |
| 受入担保金           | 57,986,012,909   |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 209,506,768,956  |
| 元本              | 169,558,946,817  |
| 次期繰越損益金         | 39,947,822,139   |
| (D) 受益権総口数      | 169,558,946,817口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,356円          |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 196,312,695,095円  
 期中追加設定元本額 29,546,207,319円  
 期中一部解約元本額 56,299,955,597円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.2356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                 | 12,445,144,834円  |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)                | 1,074,326,259円   |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)              | 3,933,881,466円   |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)                | 3,690,933,846円   |
| 三菱UFJ トピックスオープン(確定拠出年金)               | 5,046,113,528円   |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)           | 8,671,080,698円   |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)         | 40,454,924,530円  |
| 三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)           | 36,916,056,088円  |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)             | 260,993,311円     |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)                | 558,464,368円     |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)           | 1,070,569,534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)    | 55,431,778,742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)   | 364,613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) | 4,315,000円       |
| 合計                                    | 169,558,946,817円 |

## 【お知らせ】

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める(分散型に分類)ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。  
 (2016年7月1日)

## ○損益の状況 (2016年2月23日～2017年2月20日)

| 項 目                | 当 期             |
|--------------------|-----------------|
|                    | 円               |
| (A) 配当等収益          | 4,622,881,913   |
| 受取配当金              | 3,947,611,188   |
| 受取利息               | 525,719         |
| その他収益金             | 697,400,400     |
| 支払利息               | △ 22,655,394    |
| (B) 有価証券売買損益       | 36,688,374,655  |
| 売買益                | 41,718,484,886  |
| 売買損                | △ 5,030,110,231 |
| (C) 先物取引等取引損益      | 523,517,812     |
| 取引益                | 871,255,888     |
| 取引損                | △ 347,738,076   |
| (D) 保管費用等          | △ 52,131        |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 41,834,722,249  |
| (F) 前期繰越損益金        | 3,046,824,571   |
| (G) 追加信託差損益金       | 1,347,955,635   |
| (H) 解約差損益金         | △ 6,281,680,316 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 39,947,822,139  |
| 次期繰越損益金(I)         | 39,947,822,139  |

- (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 外国株式マザーファンド

### 《第17期》決算日2017年5月22日

[計算期間：2016年5月21日～2017年5月22日]

「三菱UFJ 外国株式マザーファンド」は、5月22日に第17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17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<br>(除く日本円換算ベース) |       | 株式組入比率 | 株先物比率 | 投資信託<br>証券組入比率 | 純資産額    |
|-----------------|--------|-------|--------------------------------|-------|--------|-------|----------------|---------|
|                 | 期騰落    | 期中率   | 期騰落                            | 期中率   |        |       |                |         |
|                 | 円      | %     |                                | %     | %      | %     | %              | 百万円     |
| 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 |
| 17期(2017年5月22日) | 20,708 | 20.8  | 663,775.10                     | 20.5  | 95.7   | 1.7   | 2.5            | 105,751 |

- (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知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。
- (注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
- (注) 株式組入比率には新株予約権証券を含めて表示しております。
- (注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日               | 基 準 価 額 |       | MSCIコクサイ インデックス<br>( 除く日本<br>円換算ベース) |       | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|---------------------|---------|-------|--------------------------------------|-------|-----------|-----------|---------------------|
|                     | 騰 落 率   | 騰 落 率 | 騰 落 率                                | 騰 落 率 |           |           |                     |
| (期 首)<br>2016年5月20日 | 円       | %     |                                      | %     | %         | %         | %                   |
|                     | 17,145  | —     | 550,658.40                           | —     | 95.4      | 1.8       | 2.7                 |
| 5月末                 | 17,851  | 4.1   | 573,123.36                           | 4.1   | 95.3      | 1.9       | 2.6                 |
| 6月末                 | 16,144  | △ 5.8 | 518,418.59                           | △ 5.9 | 96.5      | 3.7       | 2.9                 |
| 7月末                 | 17,165  | 0.1   | 550,901.12                           | 0.0   | 93.3      | 2.3       | 2.8                 |
| 8月末                 | 17,112  | △ 0.2 | 549,564.64                           | △ 0.2 | 95.3      | 2.1       | 2.7                 |
| 9月末                 | 16,705  | △ 2.6 | 536,569.52                           | △ 2.6 | 95.1      | 3.0       | 2.7                 |
| 10月末                | 17,051  | △ 0.5 | 546,782.82                           | △ 0.7 | 95.3      | 2.1       | 2.6                 |
| 11月末                | 18,627  | 8.6   | 597,345.24                           | 8.5   | 90.3      | 4.7       | 2.4                 |
| 12月末                | 19,802  | 15.5  | 634,475.83                           | 15.2  | 92.0      | 3.2       | 2.4                 |
| 2017年1月末            | 19,740  | 15.1  | 633,078.14                           | 15.0  | 95.8      | 1.2       | 2.5                 |
| 2月末                 | 20,124  | 17.4  | 646,138.07                           | 17.3  | 93.6      | 3.8       | 2.5                 |
| 3月末                 | 20,320  | 18.5  | 652,220.38                           | 18.4  | 93.9      | 3.6       | 2.4                 |
| 4月末                 | 20,460  | 19.3  | 655,740.71                           | 19.1  | 95.1      | 2.2       | 2.5                 |
| (期 末)<br>2017年5月22日 | 20,708  | 20.8  | 663,775.10                           | 20.5  | 95.7      | 1.7       | 2.5                 |

(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

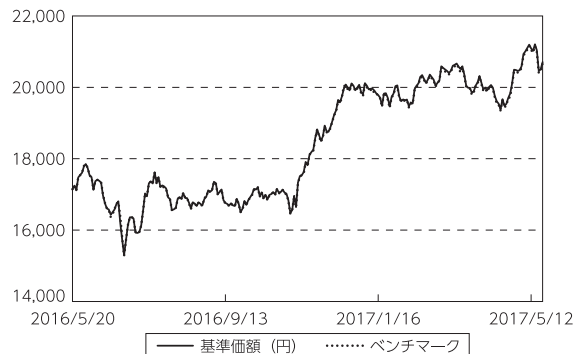
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ20.8%の上昇となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(20.5%)を0.3%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

- ・米国の堅調な企業決算発表や米国大統領選挙結果を受けた今後の政策期待などから、外国株式市況は上昇しました。

## ◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて1.3%の円安・米ドル高、1.2%の円安・ユーロ高となりました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

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

（注）マルチファクターモデル

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

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について  
ベンチマークは20.5%の上昇となったため、カイ離は0.3%程度となりました。

|             | 組入比率<br>要因 | 銘柄選択<br>要因 | その他の<br>要因 | 合計     |
|-------------|------------|------------|------------|--------|
| ベンチマークとのカイ離 | 0.0%程度     | △0.1%程度    | 0.4%程度     | 0.3%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0.4%程度でした。

|        |                 |           |
|--------|-----------------|-----------|
| プラス要因  | 配当・利子収入等        | 計 0.5%程度  |
| マイナス要因 | 売買コスト・保管料・為替効果等 | 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

(2016年5月21日～2017年5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<br>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料                      |
| (株 式)                 | 1    | 0.007   |  |
| (投資信託証券)              | (1)  | (0.005) |  |
| (先物・オプション)            | (0)  | (0.000) |  |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税     | 1    | 0.003   | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<br>有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金                            |
| (株 式)                 | (1)  | (0.003) |  |
| (投資信託証券)              | (0)  | (0.000) |  |
| (c) そ の 他 費 用         | 11   | 0.058   | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用<br>信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| (保 管 費 用)             | (10) | (0.056) |  |
| (そ の 他)               | (0)  | (0.001) |  |
| 合 計                   | 13   | 0.068   |  |
| 期中の平均基準価額は、18,425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

(2016年5月21日～2017年5月22日)

## 株式

|        |         | 買 付                   |                                | 売 付                    |                                 |
|--------|---------|-----------------------|--------------------------------|------------------------|---------------------------------|
|        |         | 株 数                   | 金 額                            | 株 数                    | 金 額                             |
| 外<br>国 | アメリカ    | 百株<br>6,143<br>( 645) | 千アメリカドル<br>31,470<br>( 670)    | 百株<br>29,982<br>( 661) | 千アメリカドル<br>183,943<br>( 3,481)  |
|        | カナダ     | 929<br>( 188)         | 千カナダドル<br>3,785<br>( —)        | 3,533                  | 千カナダドル<br>13,799                |
|        | ユーロ     |                       | 千ユーロ                           |                        | 千ユーロ                            |
|        | ドイツ     | 660<br>( 470)         | 2,333<br>(△ 139)               | 2,378                  | 9,419                           |
|        | イタリア    | 1,848<br>(△ 1,143)    | 953<br>(△ 119)                 | 6,036                  | 2,020                           |
|        | フランス    | 470<br>( 225)         | 1,906<br>(△ 205)               | 2,395                  | 8,880                           |
|        | オランダ    | 416<br>( 191)         | 663<br>( 367)                  | 1,917                  | 3,651                           |
|        | スペイン    | 1,411<br>( 17,690)    | 526<br>( 172)                  | 21,952                 | 3,039                           |
|        | ベルギー    | 17<br>(△ 36)          | 130<br>(△ 333)                 | 173                    | 1,294                           |
|        | オーストリア  | 12                    | 32                             | 59                     | 186                             |
|        | ルクセンブルク | 79<br>(△ 349)         | 216<br>( —)                    | 206                    | 265                             |
|        | フィンランド  | 99                    | 109                            | 736                    | 924                             |
|        | アイルランド  | 654                   | 131                            | 2,852                  | 554                             |
|        | ポルトガル   | 48                    | 28                             | 16,051                 | 173                             |
|        | イギリス    | 78<br>( 66)           | 276<br>( 164)                  | 82                     | 269                             |
|        | イギリス    | 6,389<br>( 66,854)    | 千イギリスポンド<br>3,074<br>( 63)     | 25,575<br>(76,257)     | 千イギリスポンド<br>16,363<br>( 695)    |
|        | スイス     | 201<br>( —)           | 千スイスフラン<br>1,127<br>(△ 238)    | 1,483                  | 千スイスフラン<br>9,596                |
|        | スウェーデン  | 332<br>( 218)         | 千スウェーデンクローネ<br>4,406<br>( —)   | 2,183<br>( 84)         | 千スウェーデンクローネ<br>27,245<br>( 151) |
|        | ノルウェー   | 185<br>( —)           | 千ノルウェークローネ<br>2,532<br>(△ 103) | 486                    | 千ノルウェークローネ<br>5,739             |

|   |          | 買 付                |                             | 売 付               |                               |
|---|----------|--------------------|-----------------------------|-------------------|-------------------------------|
|   |          | 株 数                | 金 額                         | 株 数               | 金 額                           |
| 外 | デンマーク    | 百株<br>130<br>( 36) | 千デンマーククローネ<br>3,705<br>( -) | 百株<br>458         | 千デンマーククローネ<br>13,417          |
|   | オーストラリア  | 1,061<br>( 138)    | 千オーストラリアドル<br>1,435<br>( -) | 6,824<br>( 211)   | 千オーストラリアドル<br>9,718<br>( 187) |
|   | ニュージーランド | 45                 | 千ニュージーランドドル<br>28           | 492               | 千ニュージーランドドル<br>256            |
| 国 | 香港       | 2,722<br>( 282)    | 千香港ドル<br>5,906<br>( -)      | 8,779             | 千香港ドル<br>27,893               |
|   | シンガポール   | 2,194<br>( 1,738)  | 千シンガポールドル<br>383<br>( -)    | 7,819<br>( 1,738) | 千シンガポールドル<br>1,875<br>( 13)   |
|   | イスラエル    | 147                | 千イスラエルシケル<br>954            | 750               | 千イスラエルシケル<br>6,388            |

(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                      | 0.54  | 19      | 3     | 117     |
| MACERICH CO/THE              | 0.101 | 8       | 1     | 116     |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 2     | 277     | 0.742 | 82      |
| PROLOGIS INC                 | 0.804 | 40      | 4     | 234     |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 0.135 | 11      | 0.756 | 62      |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | 4     | 201     | 0.531 | 23      |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 0.598 | 59      | 1     | 138     |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 0.038 | 8       | 0.535 | 119     |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 0.34  | 31      | 0.848 | 64      |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 0.052 | 8       | 0.466 | 67      |
| WELLTOWER INC                | 0.361 | 26      | 2     | 189     |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 0.092 | 12      | 1     | 144     |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 1     | 126     | 0.886 | 87      |
| REALTY INCOME CORP           | 0.561 | 37      | 2     | 128     |
| REGENCY CENTERS CORP         | 1     | 129     | 0.879 | 61      |
| SL GREEN REALTY CORP         | 0.096 | 9       | 0.713 | 77      |
| UDR INC                      | —     | —       | 1     | 54      |
| VENTAS INC                   | 0.75  | 48      | 2     | 174     |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 5     | 57      | 9     | 101     |
| WEYERHAEUSER CO              | 0.643 | 18      | 7     | 248     |
| AMERICAN TOWER CORP          | 0.31  | 35      | 3     | 368     |
| AGNC INVESTMENT CORP         | 0.55  | 10      | 3     | 62      |
| VEREIT INC                   | 4     | 48      | 9     | 82      |
| DUKE REALTY CORP             | 0.465 | 11      | 2     | 71      |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC   | 4     | 119     | 1     | 44      |
| IRON MOUNTAIN INC            | 1     | 73      | 2     | 84      |
| EQUINIX INC                  | 0.13  | 47      | 0.431 | 153     |
| CROWN CASTLE INTL CORP       | 1     | 103     | 2     | 235     |
| QUALITY CARE PROPERTIES      | —     | —       | 3     | 40      |
|                              | ( 3)  | ( —)    |       |         |
| PARK HOTELS & RESORTS INC    | —     | —       | 3     | 109     |
|                              | ( 3)  | ( 83)   |       |         |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 0.333 | 22      | 3     | 195     |
| COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A | 16    | 235     | 1     | 18      |
| GGP INC                      | 0.506 | 15      | 4     | 120     |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 0.954 | 15      | 6     | 116     |
| LIBERTY PROPERTY TRUST       | —     | —       | 1     | 39      |
| PUBLIC STORAGE               | 0.098 | 24      | 1     | 248     |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 0.335 | 68      | 2     | 458     |
| VORNADO REALTY TRUST         | 0.177 | 17      | 1     | 138     |
| KIMCO REALTY CORP            | 0.522 | 16      | 3     | 95      |



| 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    | 0.111         | 19                | 1     | 200        |
| 小 計                          | 53<br>( 6)    | 2,019<br>( 83)    | 105   | 5,180      |
| カナダ                          |               | 千カナダドル            |       | 千カナダドル     |
| SMART REAL ESTATE INVESTMENT | —             | —                 | 0.5   | 15         |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 0.8           | 16                | 0.7   | 15         |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 0.6           | 16                | 2     | 56         |
| 小 計                          | 1             | 33                | 3     | 87         |
| ユーロ                          |               | 千ユーロ              |       | 千ユーロ       |
| フランス                         |               |                   |       |            |
| GECINA SA                    | 0.239         | 30                | 0.287 | 35         |
| KLEPIERRE                    | 0.192         | 7                 | 1     | 59         |
| UNIBAIL-RODAMCO SE           | 0.125         | 29                | 0.785 | 175        |
| FONCIERE DES REGIONS         | 0.171<br>( —) | 13<br>(△0.97615)  | 0.259 | 19         |
| ICADE                        | 0.353         | 23                | 0.393 | 25         |
| 小 計                          | 1<br>( —)     | 104<br>(△0.97615) | 3     | 316        |
| ユ ー ロ 計                      | 1<br>( —)     | 104<br>(△0.97615) | 3     | 316        |
| イギリス                         |               | 千イギリスポンド          |       | 千イギリスポンド   |
| BRITISH LAND CO PLC          | 0.976         | 5                 | 9     | 63         |
| HAMMERSON PLC                | 1             | 6                 | 6     | 35         |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    | 0.596         | 6                 | 7     | 77         |
| INTU PROPERTIES PLC          | 2             | 6                 | 11    | 32         |
| SEGRO PLC                    | 1             | 6                 | 4     | 21         |
| SEGRO PLC -RTS               | —<br>( 4)     | —<br>( —)         | 4     | 4          |
| 小 計                          | 6<br>( 4)     | 31<br>( —)        | 44    | 235        |
| 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             | 5             | 18                | 31    | 95         |
| SCENTRE GROUP                | 3             | 16                | 46    | 204        |
| GPT GROUP                    | 2             | 10                | 15    | 74         |
| MIRVAC GROUP                 | 5             | 10                | 32    | 67         |
| STOCKLAND                    | 2             | 10                | 18    | 83         |
| WESTFIELD CORP               | 2             | 26                | 19    | 178        |
| DEXUS                        | 2             | 23                | 9     | 86         |
| GOODMAN GROUP                | 1             | 13                | 16    | 116        |
| 小 計                          | 25            | 130               | 188   | 906        |
| 香港                           |               | 千香港ドル             |       | 千香港ドル      |
| LINK REIT                    | 3             | 161               | 19    | 1,004      |
| 小 計                          | 3             | 161               | 19    | 1,004      |

| 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                  | 8<br>( - )  | 13<br>(△0.73695) | 26 | 43        |
|    | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST  | 16          | 24               | 32 | 48        |
|    | CAPITALAND MALL TRUST        | 5           | 11               | 21 | 42        |
|    | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | -<br>( - )  | -<br>(△ 0.4084)  | 6  | 13        |
| 小計 |                              | 29<br>( - ) | 50<br>(△ 1)      | 87 | 148       |

(注) 金額は受渡代金。

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

### 先物取引の種類別取引状況

| 種類別 |        | 買建            |               | 売建       |          |
|-----|--------|---------------|---------------|----------|----------|
|     |        | 新規買付額         | 決済額           | 新規売付額    | 決済額      |
| 外国  | 株式先物取引 | 百万円<br>38,472 | 百万円<br>39,374 | 百万円<br>- | 百万円<br>- |

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

### ○株式売買比率

(2016年5月21日～2017年5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       | 36,212,721千円  |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 105,056,647千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.34          |

(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

(2016年5月21日～2017年5月22日)

#### 利害関係人との取引状況

| 区分     | 買付額等<br>A    | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|--------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
|        |              |                    |               |               |                    |               |
| 為替直物取引 | 百万円<br>8,932 | 百万円<br>6,530       | %<br>73.1     | 百万円<br>39,062 | 百万円<br>26,169      | %<br>67.0     |

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

## ○組入資産の明細

(2017年5月22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                    | 464     | —     | —       | —       | 素材                     |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 296     | 218   | 1,680   | 187,455 | 各種金融                   |
| ABBOTT LABORATORIES          | 527     | 484   | 2,092   | 233,371 | ヘルスケア機器・サービス           |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 117     | 89    | 499     | 55,751  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP    | 19      | 15    | 238     | 26,585  | 各種金融                   |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    | 163     | 126   | 1,244   | 138,809 | ソフトウェア・サービス            |
| AUTONATION INC               | 26      | 20    | 79      | 8,907   | 小売                     |
| AES CORP                     | 241     | 178   | 199     | 22,242  | 公益事業                   |
| AFLAC INC                    | 150     | 112   | 834     | 93,097  | 保険                     |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 437     | 288   | 1,766   | 197,046 | 保険                     |
| APACHE CORP                  | 133     | 104   | 534     | 59,563  | エネルギー                  |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | —       | 223   | 254     | 28,431  | 半導体・半導体製造装置            |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP   | 21      | 14    | 348     | 38,847  | ソフトウェア・サービス            |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 220     | 174   | 2,108   | 235,229 | ソフトウェア・サービス            |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 72      | 57    | 817     | 91,235  | 素材                     |
| ANTHEM INC                   | 92      | 73    | 1,302   | 145,234 | ヘルスケア機器・サービス           |
| ANADARKO PETROLEUM CORP      | 179     | 155   | 828     | 92,404  | エネルギー                  |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 475     | 380   | 1,004   | 111,998 | ヘルスケア機器・サービス           |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 192     | 135   | 775     | 86,509  | ヘルスケア機器・サービス           |
| BOEING CO/THE                | 225     | 165   | 2,984   | 332,894 | 資本財                    |
| BECTON DICKINSON AND CO      | 74      | 59    | 1,093   | 121,933 | ヘルスケア機器・サービス           |
| BEST BUY CO INC              | 110     | 81    | 416     | 46,403  | 小売                     |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 598     | 469   | 2,535   | 282,789 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BLACKROCK INC                | 43      | 33    | 1,336   | 149,117 | 各種金融                   |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 1,440   | 1,143 | 5,193   | 579,268 | 電気通信サービス               |
| CR BARD INC                  | 26      | 20    | 622     | 69,431  | ヘルスケア機器・サービス           |
| BALL CORP                    | 46      | 94    | 379     | 42,329  | 素材                     |
| BAKER HUGHES INC             | 156     | 111   | 647     | 72,172  | エネルギー                  |
| ALLSTATE CORP                | 136     | 102   | 859     | 95,846  | 保険                     |
| EVERETT DENNISON CORP        | 32      | 24    | 206     | 23,003  | 素材                     |
| CHUBB LTD                    | 163     | 130   | 1,807   | 201,555 | 保険                     |
| ANALOG DEVICES INC           | 110     | 102   | 834     | 93,052  | 半導体・半導体製造装置            |
| AUTOZONE INC                 | 10      | 7     | 536     | 59,810  | 小売                     |
| CVS HEALTH CORP              | 391     | 299   | 2,285   | 254,896 | 食品・生活必需品小売り            |
| COCA-COLA ENTERPRISES        | 76      | —     | —       | —       | 食品・飲料・タバコ              |
| CORNING INC                  | 419     | 263   | 765     | 85,419  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 1,303   | 1,002 | 8,502   | 948,397 | 銀行                     |
| CIGNA CORP                   | 91      | 71    | 1,144   | 127,702 | ヘルスケア機器・サービス           |
| CATERPILLAR INC              | 206     | 164   | 1,685   | 188,044 | 資本財                    |
| COCA-COLA CO/THE             | 1,481   | 1,148 | 5,044   | 562,610 | 食品・飲料・タバコ              |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 188     | 135   | 1,083   | 120,887 | 各種金融                   |
| CAMPBELL SOUP CO             | 65      | 53    | 300     | 33,478  | 食品・飲料・タバコ              |
| CSX CORP                     | 345     | 263   | 1,324   | 147,789 | 運輸                     |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 71      | —     | —       | —       | メディア                   |
| CHEVRON CORP                 | 666     | 529   | 5,643   | 629,491 | エネルギー                  |
| COACH INC                    | 97      | 78    | 356     | 39,813  | 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        | 47      | 44    | 454     | 50,664    | 資本財                |
| CONOCOPHILLIPS              | 437     | 348   | 1,653   | 184,382   | エネルギー              |
| CME GROUP INC               | 113     | 94    | 1,104   | 123,223   | 各種金融               |
| CARDINAL HEALTH INC         | 116     | 88    | 649     | 72,463    | ヘルスケア機器・サービス       |
| COLGATE-PALMOLIVE CO        | 301     | 237   | 1,778   | 198,337   | 家庭用品・パーソナル用品       |
| DOMINION ENERGY INC         | 212     | 176   | 1,389   | 155,007   | 公益事業               |
| DOW CHEMICAL CO/THE         | 397     | 315   | 1,934   | 215,780   | 素材                 |
| DEVON ENERGY CORP           | 162     | 129   | 496     | 55,375    | エネルギー              |
| DEERE & CO                  | 110     | 74    | 901     | 100,518   | 資本財                |
| DANAHER CORP                | 218     | 174   | 1,434   | 160,021   | ヘルスケア機器・サービス       |
| DU PONT (E. I.) DE NEMOURS  | 310     | 244   | 1,903   | 212,322   | 素材                 |
| WALT DISNEY CO/THE          | 555     | 424   | 4,559   | 508,613   | メディア               |
| DARDEN RESTAURANTS INC      | 41      | 33    | 288     | 32,144    | 消費者サービス            |
| DUKE ENERGY CORP            | 244     | 194   | 1,620   | 180,718   | 公益事業               |
| DR HORTON INC               | 118     | 100   | 339     | 37,907    | 耐久消費財・アパレル         |
| DICK'S SPORTING GOODS INC   | 31      | 24    | 100     | 11,154    | 小売                 |
| TARGET CORP                 | 206     | 148   | 830     | 92,596    | 小売                 |
| DUN & BRADSTREET CORP       | 12      | 10    | 109     | 12,229    | 商業・専門サービス          |
| DAVITA INC                  | 59      | 45    | 294     | 32,870    | ヘルスケア機器・サービス       |
| DOVER CORP                  | 55      | 44    | 367     | 41,016    | 資本財                |
| DTE ENERGY COMPANY          | 64      | 51    | 547     | 61,060    | 公益事業               |
| EXXON MOBIL CORP            | 1,473   | 1,162 | 9,526   | 1,062,575 | エネルギー              |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP   | 76      | 59    | 667     | 74,429    | ヘルスケア機器・サービス       |
| EOG RESOURCES INC           | 194     | 161   | 1,517   | 169,227   | エネルギー              |
| EMERSON ELECTRIC CO         | 234     | 179   | 1,065   | 118,880   | 資本財                |
| EXELON CORP                 | 326     | 258   | 924     | 100,936   | 公益事業               |
| ECOLAB INC                  | 94      | 73    | 909     | 103,637   | 素材                 |
| EQUIFAX INC                 | 41      | 33    | 461     | 51,518    | 商業・専門サービス          |
| EMC CORP/MA                 | 686     | —     | —       | —         | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 78      | 61    | 564     | 62,940    | 家庭用品・パーソナル用品       |
| EATON CORP PLC              | 163     | 125   | 981     | 109,487   | 資本財                |
| EDISON INTERNATIONAL        | 116     | 91    | 713     | 79,539    | 公益事業               |
| ENTERGY CORP                | 64      | 51    | 392     | 43,807    | 公益事業               |
| EVEREST RE GROUP LTD        | 14      | 11    | 281     | 31,453    | 保険                 |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO   | 21      | 16    | 118     | 13,236    | 家庭用品・パーソナル用品       |
| NEXTERA ENERGY INC          | 163     | 131   | 1,810   | 201,952   | 公益事業               |
| MACY'S INC                  | 111     | 86    | 200     | 22,316    | 小売                 |
| FEDEX CORP                  | 95      | 70    | 1,341   | 149,630   | 運輸                 |
| FMC TECHNOLOGIES INC        | 80      | —     | —       | —         | エネルギー              |
| FORD MOTOR CO               | 1,311   | 1,038 | 1,128   | 125,903   | 自動車・自動車部品          |
| FRANKLIN RESOURCES INC      | 137     | 100   | 422     | 47,130    | 各種金融               |
| FOOT LOCKER INC             | 48      | 37    | 221     | 24,718    | 小売                 |
| FIRSTENERGY CORP            | 150     | 116   | 329     | 36,749    | 公益事業               |
| FLUOR CORP                  | 50      | 40    | 183     | 20,482    | 資本財                |
| FREEMPORT-MCMORAN INC       | 407     | 368   | 432     | 48,192    | 素材                 |
| GENERAL MILLS INC           | 211     | 164   | 926     | 103,329   | 食品・飲料・タバコ          |
| GENERAL DYNAMICS CORP       | 94      | 72    | 1,420   | 158,393   | 資本財                |
| WW GRAINGER INC             | 20      | 16    | 280     | 31,321    | 資本財                |
| GENERAL ELECTRIC CO         | 3,341   | 2,483 | 6,966   | 777,011   | 資本財                |
| GLOBAL PAYMENTS INC         | 46      | 41    | 376     | 41,949    | ソフトウェア・サービス        |
| GENUINE PARTS CO            | 53      | 41    | 385     | 43,021    | 小売                 |
| TEGNA INC                   | 74      | 58    | 133     | 14,938    | メディア               |

| 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        |                        |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO    | 94      | 74  | 235     | 26,288    | 自動車・自動車部品              |
| GAP INC/THE                  | 85      | 67  | 151     | 16,881    | 小売                     |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 135     | 100 | 2,173   | 242,408   | 各種金融                   |
| HALLIBURTON CO               | 306     | 241 | 1,155   | 128,939   | エネルギー                  |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | 258     | 203 | 2,679   | 298,828   | 資本財                    |
| HARLEY-DAVIDSON INC          | 68      | 50  | 265     | 29,569    | 自動車・自動車部品              |
| HP INC                       | 636     | 477 | 906     | 101,122   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  | 144     | 106 | 517     | 57,744    | 保険                     |
| HERSHEY CO/THE               | 52      | 40  | 458     | 51,097    | 食品・飲料・タバコ              |
| HARMAN INTERNATIONAL         | 25      | —   | —       | —         | 耐久消費財・アパレル             |
| HOME DEPOT INC               | 448     | 341 | 5,343   | 596,023   | 小売                     |
| HASBRO INC                   | 40      | 31  | 322     | 35,999    | 耐久消費財・アパレル             |
| INGERSOLL-RAND PLC           | 92      | 71  | 635     | 70,911    | 資本財                    |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP  | 326     | 253 | 3,853   | 429,864   | ソフトウェア・サービス            |
| INTERNATIONAL PAPER CO       | 139     | 107 | 549     | 61,323    | 素材                     |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 115     | 88  | 1,212   | 135,190   | 資本財                    |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 144     | 111 | 271     | 30,328    | メディア                   |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 28      | 22  | 304     | 33,982    | 素材                     |
| JOHNSON & JOHNSON            | 979     | 762 | 9,684   | 1,080,252 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JOHNSON CONTROLS INC         | 229     | —   | —       | —         | 自動車・自動車部品              |
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 39      | 30  | 274     | 30,639    | 運輸                     |
| KELLOGG CO                   | 93      | 72  | 513     | 57,265    | 食品・飲料・タバコ              |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 128     | 100 | 1,278   | 142,588   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 562     | 434 | 1,986   | 221,570   | 食品・飲料・タバコ              |
| KROGER CO                    | 327     | 248 | 726     | 81,054    | 食品・生活必需品小売り            |
| KOHL'S CORP                  | 69      | 51  | 191     | 21,310    | 小売                     |
| ELI LILLY & CO               | 352     | 278 | 2,170   | 242,067   | 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 | 35      | 28  | 390     | 43,598    | ヘルスケア機器・サービス           |
| SOUTHWEST AIRLINES CO        | 59      | 44  | 258     | 28,873    | 運輸                     |
| LENNAR CORP-A                | 63      | 57  | 301     | 33,673    | 耐久消費財・アパレル             |
| LOWE'S COS INC               | 324     | 244 | 2,070   | 230,906   | 小売                     |
| LEGGETT & PLATT INC          | 47      | 37  | 191     | 21,380    | 耐久消費財・アパレル             |
| L BRANDS INC                 | 86      | 69  | 339     | 37,813    | 小売                     |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 140     | 121 | 687     | 76,663    | 消費者サービス                |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 97      | 74  | 2,027   | 226,163   | 資本財                    |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 88      | 62  | 406     | 45,396    | 保険                     |
| L3 TECHNOLOGIES INC          | 28      | 21  | 356     | 39,779    | 資本財                    |
| LEGG MASON INC               | 34      | —   | —       | —         | 各種金融                   |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 72      | 92  | 952     | 106,244   | 消費者サービス                |
| MCDONALD'S CORP              | 324     | 233 | 3,458   | 385,767   | 消費者サービス                |
| S&P GLOBAL INC               | 95      | 72  | 1,001   | 111,708   | 各種金融                   |
| MEDTRONIC PLC                | 500     | 391 | 3,261   | 363,735   | ヘルスケア機器・サービス           |
| MERCK & CO. INC.             | 988     | 773 | 4,933   | 550,297   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 382     | 289 | 806     | 89,904    | 半導体・半導体製造装置            |
| MATTEL INC                   | 119     | 98  | 218     | 24,333    | 耐久消費財・アパレル             |
| 3M CO                        | 217     | 169 | 3,310   | 369,240   | 資本財                    |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 56      | 40  | 330     | 36,892    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 158     | 124 | 390     | 43,507    | 消費者サービス                |
| MASCO CORP                   | 120     | 88  | 328     | 36,692    | 資本財                    |
| MONSANTO CO                  | 155     | 122 | 1,427   | 159,256   | 素材                     |
| M & T BANK CORP              | 50      | 38  | 604     | 67,479    | 銀行                     |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 184     | 143 | 1,073   | 119,786   | 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      |                        |
| MOHAWK INDUSTRIES INC        | 22      | 17    | 408     | 45,617  | 耐久消費財・アパレル             |
| MORGAN STANLEY               | 514     | 395   | 1,653   | 184,480 | 各種金融                   |
| MCKESSON CORP                | 81      | 62    | 963     | 107,452 | ヘルスケア機器・サービス           |
| METLIFE INC                  | 334     | 261   | 1,321   | 147,356 | 保険                     |
| MANPOWERGROUP INC            | 26      | 18    | 193     | 21,602  | 商業・専門サービス              |
| MOODY'S CORP                 | 63      | 47    | 546     | 60,911  | 各種金融                   |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 105     | 81    | 923     | 102,955 | 運輸                     |
| BANK OF AMERICA CORP         | 3,686   | 2,834 | 6,532   | 728,648 | 銀行                     |
| NISOURCE INC                 | —       | 93    | 232     | 25,878  | 公益事業                   |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 61      | 46    | 1,169   | 130,467 | 資本財                    |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP   | 171     | 140   | 183     | 20,422  | 銀行                     |
| NEWMONT MINING CORP          | 187     | 145   | 489     | 54,563  | 素材                     |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A   | 414     | 293   | 794     | 88,659  | メディア                   |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 41      | 32    | 325     | 36,327  | 食品・飲料・タバコ              |
| MARKEL CORP                  | 4       | 3     | 379     | 42,346  | 保険                     |
| NUCOR CORP                   | 113     | 87    | 493     | 55,039  | 素材                     |
| NEWELL BRANDS INC            | 161     | 119   | 632     | 70,595  | 耐久消費財・アパレル             |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B | 155     | 125   | 339     | 37,874  | メディア                   |
| NOBLE ENERGY INC             | 152     | 122   | 382     | 42,629  | エネルギー                  |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 270     | 214   | 1,300   | 145,083 | エネルギー                  |
| OMNICOM GROUP                | 85      | 67    | 558     | 62,315  | メディア                   |
| PEPSICO INC                  | 515     | 402   | 4,573   | 510,168 | 食品・飲料・タバコ              |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 34      | 25    | 251     | 28,080  | 素材                     |
| ALTRIA GROUP INC             | 694     | 546   | 3,876   | 432,387 | 食品・飲料・タバコ              |
| PINNACLE WEST CAPITAL        | 40      | 32    | 275     | 30,685  | 公益事業                   |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 962     | 716   | 6,177   | 688,985 | 家庭用品・パーソナル用品           |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 179     | 136   | 1,622   | 180,973 | 銀行                     |
| PFIZER INC                   | 2,184   | 1,701 | 5,523   | 616,101 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 158     | 122   | 1,269   | 141,589 | 保険                     |
| PULTEGROUP INC               | 110     | 84    | 196     | 21,877  | 耐久消費財・アパレル             |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 48      | 36    | 577     | 64,459  | 資本財                    |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 57      | 48    | 851     | 94,935  | エネルギー                  |
| CITIGROUP INC                | 1,054   | 799   | 4,886   | 545,009 | 銀行                     |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 104     | 78    | 479     | 53,458  | 保険                     |
| PPG INDUSTRIES INC           | 95      | 73    | 782     | 87,273  | 素材                     |
| PENTAIR PLC                  | 63      | 46    | 313     | 34,994  | 資本財                    |
| PRAXAIR INC                  | 100     | 79    | 1,031   | 115,026 | 素材                     |
| P G & E CORP                 | 175     | 141   | 930     | 103,784 | 公益事業                   |
| PPL CORP                     | 240     | 190   | 740     | 82,559  | 公益事業                   |
| PROGRESSIVE CORP             | 205     | 164   | 676     | 75,494  | 保険                     |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 180     | 140   | 619     | 69,083  | 公益事業                   |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS    | 60      | —     | —       | —       | 消費者サービス                |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 61      | 47    | 499     | 55,718  | 消費者サービス                |
| RAYTHEON COMPANY             | 106     | 82    | 1,317   | 146,936 | 資本財                    |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 85      | 67    | 415     | 46,363  | 商業・専門サービス              |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 459     | 336   | 474     | 52,920  | 銀行                     |
| RENAISSANCE HOLDINGS LTD     | 15      | 11    | 163     | 18,212  | 保険                     |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 35      | 28    | 638     | 71,250  | 資本財                    |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 149     | 120   | 330     | 36,873  | 公益事業                   |
| ROBERT HALF INTL INC         | 46      | 37    | 172     | 19,199  | 商業・専門サービス              |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 46      | 35    | 555     | 61,923  | 資本財                    |
| SCHLUMBERGER LTD             | 493     | 390   | 2,802   | 312,612 | エネルギー                  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |       | 当 期 末   |         | 業 種 等                  |
|------------------------------|---------|-------|---------|---------|------------------------|
|                              | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |         |                        |
|                              |         |       | 外貨建金額   | 邦貨換算金額  |                        |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株    | 千アメリカドル | 千円      |                        |
| STRYKER CORP                 | 119     | 94    | 1,290   | 143,960 | ヘルスケア機器・サービス           |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 419     | 334   | 1,279   | 142,769 | 各種金融                   |
| SEMPRA ENERGY                | 84      | 66    | 741     | 82,654  | 公益事業                   |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE      | 27      | 21    | 728     | 81,300  | 素材                     |
| ST JUDE MEDICAL INC          | 99      | —     | —       | —       | ヘルスケア機器・サービス           |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 53      | 41    | 565     | 63,055  | 資本財                    |
| SUNTRUST BANKS INC           | 179     | 139   | 752     | 83,913  | 銀行                     |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 107     | 78    | 952     | 106,274 | 保険                     |
| SOUTHERN CO/THE              | 323     | 276   | 1,378   | 153,705 | 公益事業                   |
| AT&T INC                     | 2,177   | 1,720 | 6,578   | 733,736 | 電気通信サービス               |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 98      | 79    | 685     | 76,458  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| STATE STREET CORP            | 142     | 107   | 867     | 96,805  | 各種金融                   |
| SYSCO CORP                   | 199     | 144   | 788     | 87,945  | 食品・生活必需品小売り            |
| SEALED AIR CORP              | 70      | 55    | 239     | 26,669  | 素材                     |
| SCANA CORP                   | 48      | 39    | 259     | 28,929  | 公益事業                   |
| TEXAS INSTRUMENTS INC        | 359     | 281   | 2,261   | 252,228 | 半導体・半導体製造装置            |
| TIFFANY & CO                 | 45      | 35    | 327     | 36,513  | 小売                     |
| TORCHMARK CORP               | 43      | 32    | 238     | 26,553  | 保険                     |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 149     | 261   | 1,114   | 124,363 | 資本財                    |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 141     | 111   | 1,907   | 212,810 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEXTRON INC                  | 98      | 76    | 357     | 39,866  | 資本財                    |
| UNION PACIFIC CORP           | 302     | 231   | 2,480   | 276,622 | 運輸                     |
| UNUM GROUP                   | 86      | 65    | 298     | 33,320  | 保険                     |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP     | 298     | 220   | 2,670   | 297,906 | 資本財                    |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 337     | 269   | 4,650   | 518,671 | ヘルスケア機器・サービス           |
| US BANCORP                   | 618     | 476   | 2,432   | 271,356 | 銀行                     |
| MARATHON OIL CORP            | 292     | 239   | 348     | 38,854  | エネルギー                  |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   | 246     | 194   | 2,011   | 224,341 | 運輸                     |
| VALERO ENERGY CORP           | 170     | 126   | 804     | 89,777  | エネルギー                  |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC   | 34      | 26    | 251     | 27,999  | ヘルスケア機器・サービス           |
| VALSPAR CORP/THE             | —       | 21    | 234     | 26,161  | 素材                     |
| CBS CORP-CLASS B NON VOTING  | 153     | 108   | 669     | 74,662  | メディア                   |
| VF CORP                      | 120     | 90    | 474     | 52,941  | 耐久消費財・アパレル             |
| VULCAN MATERIALS CO          | 47      | 37    | 473     | 52,766  | 素材                     |
| WILLIAMS COS INC             | 252     | 226   | 684     | 76,303  | エネルギー                  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 308     | 258   | 2,084   | 232,477 | 食品・生活必需品小売り            |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 112     | 87    | 536     | 59,796  | 公益事業                   |
| WAL-MART STORES INC          | 567     | 433   | 3,413   | 380,794 | 食品・生活必需品小売り            |
| WELLS FARGO & CO             | 1,717   | 1,337 | 7,096   | 791,580 | 銀行                     |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 157     | 125   | 886     | 98,829  | 商業・専門サービス              |
| WATERS CORP                  | 28      | 22    | 403     | 44,964  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL PL | 292     | 267   | 140     | 15,625  | エネルギー                  |
| WHIRLPOOL CORP               | 27      | 21    | 380     | 42,426  | 耐久消費財・アパレル             |
| XEROX CORP                   | 325     | 244   | 171     | 19,077  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| XL GROUP PLC                 | 104     | —     | —       | —       | 保険                     |
| XCEL ENERGY INC              | 181     | 141   | 650     | 72,579  | 公益事業                   |
| KEYCORP                      | 298     | 297   | 526     | 58,736  | 銀行                     |
| CARMAX INC                   | 72      | 51    | 335     | 37,476  | 小売                     |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 66      | 55    | 652     | 72,738  | ヘルスケア機器・サービス           |
| TOLL BROTHERS INC            | 58      | 44    | 169     | 18,933  | 耐久消費財・アパレル             |
| YUM! BRANDS INC              | 152     | 96    | 675     | 75,326  | 消費者サービス                |
| TJX COMPANIES INC            | 236     | 182   | 1,355   | 151,242 | 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        |                        |
| CA INC                      | 117     | 89    | 278     | 31,084    | ソフトウェア・サービス            |
| CLOROX COMPANY              | 45      | 35    | 467     | 52,139    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| CELANESE CORP-SERIES A      | 52      | 40    | 343     | 38,262    | 素材                     |
| CADENCE DESIGN SYS INC      | —       | 81    | 265     | 29,645    | ソフトウェア・サービス            |
| CARNIVAL CORP               | 145     | 98    | 608     | 67,856    | 消費者サービス                |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV | 99      | 86    | 719     | 80,282    | ソフトウェア・サービス            |
| CONAGRA BRANDS INC          | 153     | 113   | 427     | 47,706    | 食品・飲料・タバコ              |
| CONSOLIDATED EDISON INC     | 104     | 87    | 702     | 78,385    | 公益事業                   |
| FIFTH THIRD BANCORP         | 282     | 206   | 500     | 55,777    | 銀行                     |
| STERICYCLE INC              | 29      | 23    | 200     | 22,312    | 商業・専門サービス              |
| INTEL CORP                  | 1,671   | 1,330 | 4,710   | 525,409   | 半導体・半導体製造装置            |
| CISCO SYSTEMS INC           | 1,797   | 1,409 | 4,400   | 490,812   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CINTAS CORP                 | 31      | 23    | 286     | 31,924    | 商業・専門サービス              |
| SBA COMMUNICATIONS CORP     | 44      | 33    | 451     | 50,332    | 不動産                    |
| COSTCO WHOLESALE CORP       | 154     | 122   | 2,109   | 235,307   | 食品・生活必需品小売り            |
| APPLIED MATERIALS INC       | 425     | 302   | 1,334   | 148,867   | 半導体・半導体製造装置            |
| ELECTRONIC ARTS INC         | 109     | 83    | 901     | 100,587   | ソフトウェア・サービス            |
| TYSON FOODS INC-CL A        | 104     | 82    | 483     | 53,874    | 食品・飲料・タバコ              |
| SYMANTEC CORP               | 240     | 171   | 497     | 55,528    | ソフトウェア・サービス            |
| ROSS STORES INC             | 143     | 109   | 681     | 76,058    | 小売                     |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC    | 72      | 61    | 492     | 54,965    | 半導体・半導体製造装置            |
| NIKE INC -CL B              | 479     | 375   | 1,944   | 216,927   | 耐久消費財・アパレル             |
| TARO PHARMACEUTICAL INDUS   | 3       | 4     | 45      | 5,098     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMGEN INC                   | 267     | 208   | 3,269   | 364,661   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COMERICA INC                | 62      | 48    | 332     | 37,072    | 銀行                     |
| NORTHERN TRUST CORP         | 78      | 59    | 512     | 57,213    | 各種金融                   |
| MICROSOFT CORP              | 2,686   | 2,070 | 14,017  | 1,563,543 | ソフトウェア・サービス            |
| ANSYS INC                   | 31      | 24    | 300     | 33,503    | ソフトウェア・サービス            |
| CENTENE CORP                | 60      | 48    | 363     | 40,535    | ヘルスケア機器・サービス           |
| STAPLES INC                 | 226     | 185   | 161     | 18,043    | 小売                     |
| STARBUCKS CORP              | 525     | 409   | 2,511   | 280,121   | 消費者サービス                |
| ORACLE CORP                 | 1,131   | 864   | 3,829   | 427,101   | ソフトウェア・サービス            |
| WHOLE FOODS MARKET INC      | 120     | 89    | 323     | 36,124    | 食品・生活必需品小売り            |
| NETFLIX INC                 | 143     | 120   | 1,892   | 211,043   | 小売                     |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC     | 34      | 26    | 655     | 73,119    | 小売                     |
| ACTIVISION BLIZZARD INC     | 180     | 165   | 925     | 103,247   | ソフトウェア・サービス            |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC      | 67      | 50    | 529     | 59,075    | 半導体・半導体製造装置            |
| HENRY SCHEIN INC            | 29      | 22    | 406     | 45,338    | ヘルスケア機器・サービス           |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY      | 47      | 37    | 214     | 23,919    | 小売                     |
| LAM RESEARCH CORP           | 56      | 45    | 686     | 76,545    | 半導体・半導体製造装置            |
| WYNN RESORTS LTD            | 29      | 23    | 282     | 31,486    | 消費者サービス                |
| COMCAST CORP-CLASS A        | 878     | 1,336 | 5,193   | 579,257   | メディア                   |
| XILINX INC                  | 90      | 68    | 459     | 51,221    | 半導体・半導体製造装置            |
| PACCAR INC                  | 124     | 99    | 626     | 69,919    | 資本財                    |
| DENTSPLY SIRONA INC         | 84      | 62    | 386     | 43,066    | ヘルスケア機器・サービス           |
| ALIGN TECHNOLOGY INC        | —       | 19    | 274     | 30,649    | ヘルスケア機器・サービス           |
| GILEAD SCIENCES INC         | 510     | 370   | 2,376   | 265,090   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CITRIX SYSTEMS INC          | 54      | 44    | 366     | 40,926    | ソフトウェア・サービス            |
| INTUITIVE SURGICAL INC      | 13      | 10    | 938     | 104,648   | ヘルスケア機器・サービス           |
| INTUIT INC                  | 88      | 67    | 850     | 94,845    | ソフトウェア・サービス            |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC   | 87      | 76    | 145     | 16,191    | ソフトウェア・サービス            |
| PAYCHEX INC                 | 114     | 92    | 530     | 59,149    | 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        |                        |
| YAHOO! INC                   | 317     | 253 | 1,273   | 141,992   | ソフトウェア・サービス            |
| PATTERSON COS INC            | 31      | 23  | 101     | 11,297    | ヘルスケア機器・サービス           |
| SIGNATURE BANK               | 18      | 15  | 211     | 23,565    | 銀行                     |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | 24      | 37  | 401     | 44,748    | ソフトウェア・サービス            |
| AUTODESK INC                 | 80      | 54  | 604     | 67,389    | ソフトウェア・サービス            |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A         | 90      | 67  | 204     | 22,818    | メディア                   |
| SALESFORCE.COM INC           | 223     | 181 | 1,584   | 176,703   | ソフトウェア・サービス            |
| NORDSTROM INC                | 48      | 36  | 150     | 16,739    | 小売                     |
| ALPHABET INC-CL A            | 103     | 83  | 7,930   | 884,543   | ソフトウェア・サービス            |
| UNITED THERAPEUTICS CORP     | 16      | 11  | 145     | 16,240    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| B/E AEROSPACE INC            | 36      | —   | —       | —         | 資本財                    |
| GARMIN LTD                   | 39      | 33  | 170     | 19,047    | 耐久消費財・アパレル             |
| TRIMBLE INC                  | 88      | 71  | 253     | 28,256    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| QUALCOMM INC                 | 532     | 414 | 2,392   | 266,910   | 半導体・半導体製造装置            |
| HOLOGIC INC                  | 84      | 70  | 304     | 33,928    | ヘルスケア機器・サービス           |
| SYNOPSYS INC                 | 55      | 42  | 304     | 33,937    | ソフトウェア・サービス            |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP       | 84      | —   | —       | —         | 半導体・半導体製造装置            |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 100     | 76  | 360     | 40,195    | 半導体・半導体製造装置            |
| AMAZON.COM INC               | 141     | 113 | 10,870  | 1,212,460 | 小売                     |
| T ROWE PRICE GROUP INC       | 88      | 66  | 467     | 52,168    | 各種金融                   |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 51      | 37  | 402     | 44,846    | ヘルスケア機器・サービス           |
| KLA-TENCOR CORP              | 56      | 44  | 450     | 50,246    | 半導体・半導体製造装置            |
| E*TRADE FINANCIAL CORP       | 104     | 77  | 263     | 29,418    | 各種金融                   |
| CERNER CORP                  | 108     | 86  | 555     | 61,937    | ヘルスケア機器・サービス           |
| BROADCOM LTD                 | 139     | 113 | 2,647   | 295,347   | 半導体・半導体製造装置            |
| ALKERMES PLC                 | 53      | 43  | 252     | 28,130    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VERISIGN INC                 | 36      | 27  | 240     | 26,880    | ソフトウェア・サービス            |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC   | 106     | 84  | 500     | 55,869    | 電気通信サービス               |
| WASTE CONNECTIONS INC        | 44      | 48  | 441     | 49,202    | 商業・専門サービス              |
| EBAY INC                     | 382     | 296 | 1,001   | 111,726   | ソフトウェア・サービス            |
| NVIDIA CORP                  | 189     | 151 | 2,059   | 229,741   | 半導体・半導体製造装置            |
| DOLLAR TREE INC              | 78      | 64  | 516     | 57,599    | 小売                     |
| PRICELINE GROUP INC/THE      | 17      | 13  | 2,506   | 279,550   | 小売                     |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 419     | 343 | 5,603   | 625,037   | 各種金融                   |
| BB&T CORP                    | 287     | 226 | 956     | 106,640   | 銀行                     |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 386     | 296 | 1,379   | 153,837   | 各種金融                   |
| BORGWARNER INC               | 79      | 60  | 243     | 27,113    | 自動車・自動車部品              |
| H&R BLOCK INC                | 84      | 61  | 157     | 17,580    | 消費者サービス                |
| JM SMUCKER CO/THE            | 41      | 31  | 397     | 44,372    | 食品・飲料・タバコ              |
| TIME WARNER INC              | 282     | 216 | 2,112   | 235,630   | メディア                   |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 68      | 46  | 418     | 46,711    | ヘルスケア機器・サービス           |
| ASSURANT INC                 | 22      | 16  | 161     | 18,017    | 保険                     |
| AETNA INC                    | 123     | 98  | 1,390   | 155,102   | ヘルスケア機器・サービス           |
| AMEREN CORPORATION           | 87      | 70  | 391     | 43,665    | 公益事業                   |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 175     | 138 | 948     | 105,792   | 公益事業                   |
| AON PLC                      | 96      | 74  | 951     | 106,135   | 保険                     |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    | 211     | 159 | 660     | 73,632    | 食品・飲料・タバコ              |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD    | 33      | 24  | 156     | 17,470    | 保険                     |
| HESS CORP                    | 99      | 81  | 396     | 44,212    | エネルギー                  |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 124     | 97  | 287     | 32,028    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP   | 95      | 70  | 258     | 28,882    | 各種金融                   |
| RED HAT INC                  | 64      | 51  | 440     | 49,158    | 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        |                        |
| F5 NETWORKS INC              | 24      | 18    | 235     | 26,294    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| DISH NETWORK CORP-A          | 79      | 64    | 408     | 45,549    | メディア                   |
| AKAMI TECHNOLOGIES INC       | 63      | 49    | 234     | 26,196    | ソフトウェア・サービス            |
| NETAPP INC                   | 103     | 78    | 311     | 34,783    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| INCYTE CORP                  | 59      | 46    | 613     | 68,475    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 150     | 123   | 198     | 22,086    | 半導体・半導体製造装置            |
| BIOGEN INC                   | 78      | 61    | 1,528   | 170,522   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ILLUMINA INC                 | 51      | 40    | 721     | 80,514    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADOBE SYSTEMS INC            | 176     | 139   | 1,909   | 212,937   | ソフトウェア・サービス            |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 87      | 68    | 814     | 90,804    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | —       | 254   | 758     | 84,653    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BED BATH & BEYOND INC        | 59      | 43    | 154     | 17,264    | 小売                     |
| CELGENE CORP                 | 278     | 217   | 2,546   | 284,023   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 215     | 169   | 1,108   | 123,646   | ソフトウェア・サービス            |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO   | 239     | 172   | 1,035   | 115,454   | ヘルスケア機器・サービス           |
| EXPEDITORS INTL WASH INC     | 65      | 51    | 269     | 30,077    | 運輸                     |
| FASTENAL CO                  | 97      | 81    | 356     | 39,796    | 資本財                    |
| FISERV INC                   | 80      | 60    | 726     | 81,060    | ソフトウェア・サービス            |
| FLEX LTD                     | 198     | 152   | 252     | 28,132    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC       | 744     | 455   | 223     | 24,954    | メディア                   |
| APPLE INC                    | 1,973   | 1,495 | 22,882  | 2,552,310 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    | 54      | 44    | 304     | 33,913    | 保険                     |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    | 281     | 308   | 387     | 43,187    | 銀行                     |
| COSTAR GROUP INC             | —       | 9     | 235     | 26,293    | ソフトウェア・サービス            |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 79      | 62    | 708     | 79,068    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ASHLAND INC                  | 22      | —     | —       | —         | 素材                     |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC  | 50      | 40    | 270     | 30,158    | 運輸                     |
| CENTURYLINK INC              | 193     | 154   | 383     | 42,769    | 電気通信サービス               |
| FLIR SYSTEMS INC             | 47      | 39    | 145     | 16,187    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MYLAN NV                     | 147     | 129   | 490     | 54,704    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ONEOK INC                    | 74      | 60    | 310     | 34,682    | エネルギー                  |
| REYNOLDS AMERICAN INC        | 303     | 239   | 1,592   | 177,586   | 食品・飲料・タバコ              |
| SEAGATE TECHNOLOGY           | 107     | 83    | 356     | 39,748    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| BUNGE LTD                    | 50      | 39    | 274     | 30,567    | 食品・飲料・タバコ              |
| ADVANCE AUTO PARTS INC       | 26      | 20    | 316     | 35,344    | 小売                     |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC   | 132     | 106   | 371     | 41,471    | エネルギー                  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 61      | 49    | 905     | 100,964   | 食品・飲料・タバコ              |
| NEWFIELD EXPLORATION CO      | —       | 56    | 193     | 21,610    | エネルギー                  |
| COOPER COS INC/THE           | 17      | 13    | 295     | 32,917    | ヘルスケア機器・サービス           |
| EQT CORP                     | 53      | 49    | 276     | 30,880    | エネルギー                  |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 109     | 85    | 620     | 69,237    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| WR BERKLEY CORP              | 35      | 25    | 170     | 19,005    | 保険                     |
| AGCO CORP                    | 23      | 18    | 118     | 13,193    | 資本財                    |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A   | 52      | 41    | 107     | 12,029    | メディア                   |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 50      | 109   | 523     | 58,347    | 食品・飲料・タバコ              |
| EXPEDIA INC                  | 44      | 33    | 477     | 53,285    | 小売                     |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | 83      | 67    | 192     | 21,419    | 素材                     |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C        | 210     | 168   | 497     | 55,459    | メディア                   |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 61      | 44    | 565     | 63,129    | 各種金融                   |
| TESORO CORP                  | 42      | 33    | 278     | 31,027    | エネルギー                  |
| FNF GROUP                    | 89      | 69    | 285     | 31,876    | 保険                     |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 41      | 168   | 1,002   | 111,799   | 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      |                        |
| NASDAQ INC                   | 40      | 32  | 220     | 24,627  | 各種金融                   |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A     | 63      | 50  | 96      | 10,728  | 耐久消費財・アパレル             |
| VIACOM INC-CLASS B           | 124     | 98  | 347     | 38,798  | メディア                   |
| AUTOLIV INC                  | 30      | 25  | 263     | 29,350  | 自動車・自動車部品              |
| CBRE GROUP INC - A           | 107     | 86  | 291     | 32,476  | 不動産                    |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 10      | 7   | 382     | 42,681  | 消費者サービス                |
| IHS INC-CLASS A              | 24      | —   | —       | —       | 商業・専門サービス              |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    | 41      | 60  | 317     | 35,428  | 食品・飲料・タバコ              |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A | 159     | 118 | 281     | 31,375  | 小売                     |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 32      | 25  | 188     | 21,024  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CUMMINS INC                  | 59      | 44  | 684     | 76,297  | 資本財                    |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 42      | 34  | 183     | 20,446  | 資本財                    |
| LEUCADIA NATIONAL CORP       | 114     | 92  | 227     | 25,411  | 各種金融                   |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 20      | 16  | 387     | 43,255  | 素材                     |
| RANGE RESOURCES CORP         | 60      | 52  | 134     | 14,993  | エネルギー                  |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO       | 134     | 138 | 98      | 10,993  | エネルギー                  |
| CIMAREX ENERGY CO            | 33      | 26  | 317     | 35,373  | エネルギー                  |
| RALPH LAUREN CORP            | 20      | 15  | 110     | 12,311  | 耐久消費財・アパレル             |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 41      | 66  | 264     | 29,488  | 公益事業                   |
| OCEANEERING INTL INC         | 35      | —   | —       | —       | エネルギー                  |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP       | 41      | 29  | 278     | 31,115  | 消費者サービス                |
| HANESBRANDS INC              | 137     | 100 | 208     | 23,205  | 耐久消費財・アパレル             |
| MASTERCARD INC - A           | 350     | 270 | 3,177   | 354,455 | ソフトウェア・サービス            |
| WESTERN UNION CO             | 180     | 136 | 260     | 29,030  | ソフトウェア・サービス            |
| AERCAP HOLDINGS NV           | 31      | 41  | 182     | 20,345  | 資本財                    |
| AVNET INC                    | 46      | 36  | 135     | 15,145  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MOSAIC CO/THE                | 113     | 95  | 225     | 25,105  | 素材                     |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR   | 30      | 50  | 105     | 11,767  | 消費者サービス                |
| SPECTRA ENERGY CORP          | 236     | —   | —       | —       | エネルギー                  |
| TRANSDIGM GROUP INC          | 19      | 14  | 370     | 41,332  | 資本財                    |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | —       | 33  | 246     | 27,546  | ソフトウェア・サービス            |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 46      | 35  | 498     | 55,552  | 保険                     |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL    | 105     | 86  | 144     | 16,105  | 銀行                     |
| TE CONNECTIVITY LTD          | 136     | 98  | 735     | 81,987  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 151     | 109 | 657     | 73,335  | 各種金融                   |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 39      | 31  | 155     | 17,384  | 耐久消費財・アパレル             |
| WABCO HOLDINGS INC           | 19      | 15  | 178     | 19,952  | 資本財                    |
| MERCADOLIBRE INC             | —       | 11  | 299     | 33,442  | ソフトウェア・サービス            |
| VMWARE INC-CLASS A           | 28      | 18  | 172     | 19,287  | ソフトウェア・サービス            |
| LOEWS CORP                   | 99      | 81  | 374     | 41,764  | 保険                     |
| SEATTLE GENETICS INC         | —       | 28  | 190     | 21,193  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ULTA BEAUTY INC              | 21      | 16  | 476     | 53,138  | 小売                     |
| LKQ CORP                     | 106     | 87  | 272     | 30,345  | 小売                     |
| HORMEL FOODS CORP            | 103     | 77  | 271     | 30,248  | 食品・飲料・タバコ              |
| MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR | —       | 22  | 173     | 19,403  | 運輸                     |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 52      | 41  | 329     | 36,702  | 素材                     |
| GAMESTOP CORP-CLASS A        | 35      | —   | —       | —       | 小売                     |
| HARRIS CORP                  | 43      | 33  | 363     | 40,536  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HUMANA INC                   | 52      | 41  | 947     | 105,640 | ヘルスケア機器・サービス           |
| MURPHY OIL CORP              | 59      | 46  | 123     | 13,775  | エネルギー                  |
| NRG ENERGY INC               | 110     | —   | —       | —       | 公益事業                   |
| INVESCO LTD                  | 149     | 116 | 368     | 41,049  | 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      |                        |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 56      | 48  | 434     | 48,439  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | 49      | 38  | 194     | 21,684  | 各種金融                   |
| TERADATA CORP                | 45      | —   | —       | —       | ソフトウェア・サービス            |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC    | 59      | 46  | 272     | 30,426  | ソフトウェア・サービス            |
| CONCHO RESOURCES INC         | 45      | 40  | 531     | 59,328  | エネルギー                  |
| MSCI INC                     | 35      | 25  | 247     | 27,572  | 各種金融                   |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 33      | 26  | 115     | 12,828  | エネルギー                  |
| MOLSON COORS BREWING CO -B   | 65      | 53  | 503     | 56,160  | 食品・飲料・タバコ              |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 548     | 435 | 4,996   | 557,331 | 食品・飲料・タバコ              |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 688     | 523 | 4,844   | 540,404 | ソフトウェア・サービス            |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC  | 66      | 51  | 471     | 52,622  | 食品・飲料・タバコ              |
| CORE LABORATORIES N.V.       | 14      | 12  | 139     | 15,527  | エネルギー                  |
| CABOT OIL & GAS CORP         | 160     | 132 | 310     | 34,638  | エネルギー                  |
| FLOWSERVE CORP               | 46      | 37  | 184     | 20,579  | 資本財                    |
| HELMERICH & PAYNE            | 38      | 31  | 186     | 20,800  | エネルギー                  |
| T-MOBILE US INC              | 100     | 82  | 545     | 60,874  | 電気通信サービス               |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A  | 27      | 23  | 160     | 17,875  | メディア                   |
| ILG INC                      | 26      | —   | —       | —       | 消費者サービス                |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C   | 97      | 65  | 164     | 18,354  | メディア                   |
| RESMED INC                   | 49      | 40  | 273     | 30,540  | ヘルスケア機器・サービス           |
| GARTNER INC                  | 29      | 23  | 271     | 30,334  | ソフトウェア・サービス            |
| AMETEK INC                   | 85      | 62  | 376     | 42,016  | 資本財                    |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 42      | 34  | 329     | 36,726  | 保険                     |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 46      | 73  | 364     | 40,711  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  | 32      | 25  | 215     | 24,063  | 運輸                     |
| PERRIGO CO PLC               | 52      | 40  | 288     | 32,215  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| QUANTA SERVICES INC          | 55      | —   | —       | —       | 資本財                    |
| FMC CORP                     | 47      | 38  | 284     | 31,728  | 素材                     |
| WABTEC CORP                  | 34      | 24  | 200     | 22,415  | 資本財                    |
| EVERSOURCE ENERGY            | 113     | 88  | 530     | 59,175  | 公益事業                   |
| NETSUITE INC                 | 14      | —   | —       | —       | ソフトウェア・サービス            |
| INGREDION INC                | —       | 20  | 237     | 26,500  | 食品・飲料・タバコ              |
| ALLERGAN PLC                 | 139     | 105 | 2,307   | 257,396 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AIRGAS INC                   | 23      | —   | —       | —       | 素材                     |
| CROWN HOLDINGS INC           | 49      | 40  | 225     | 25,108  | 素材                     |
| CALPINE CORP                 | 121     | 98  | 135     | 15,132  | 公益事業                   |
| EATON VANCE CORP             | 41      | 32  | 143     | 16,053  | 各種金融                   |
| DELTA AIR LINES INC          | 71      | 54  | 261     | 29,209  | 運輸                     |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO    | 69      | 50  | 450     | 50,230  | 食品・飲料・タバコ              |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 64      | 49  | 374     | 41,816  | 公益事業                   |
| VERISK ANALYTICS INC         | 57      | 42  | 340     | 38,033  | 商業・専門サービス              |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 104     | 77  | 557     | 62,172  | 小売                     |
| FORTINET INC                 | 53      | 42  | 170     | 18,967  | ソフトウェア・サービス            |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS  | 33      | 22  | 178     | 19,909  | 運輸                     |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 9       | 7   | 419     | 46,811  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CIT GROUP INC                | 60      | 57  | 269     | 30,028  | 銀行                     |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORP | 413     | 329 | 48      | 5,360   | 電気通信サービス               |
| GENERAL MOTORS CO            | 500     | 384 | 1,258   | 140,417 | 自動車・自動車部品              |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        | 48      | 82  | 883     | 98,551  | 半導体・半導体製造装置            |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 135     | 96  | 779     | 86,967  | 素材                     |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | —       | 13  | 254     | 28,346  | 資本財                    |
| HCA HEALTHCARE INC           | 115     | 83  | 684     | 76,401  | ヘルスケア機器・サービス           |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |     | 当 期 末   |           | 業 種 等                  |
|------------------------------|---------|-----|---------|-----------|------------------------|
|                              | 株 数     | 株 数 | 評 価 額   |           |                        |
|                              |         |     | 外貨建金額   | 邦貨換算金額    |                        |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株  | 千アメリカドル | 千円        |                        |
| HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC    | 130     | —   | —       | —         | 運輸                     |
| HOLLYFRONTIER CORP           | 62      | 47  | 126     | 14,055    | エネルギー                  |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 188     | 146 | 774     | 86,404    | エネルギー                  |
| ATMOS ENERGY CORP            | 37      | 30  | 243     | 27,130    | 公益事業                   |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI | 56      | 43  | 275     | 30,689    | 資本財                    |
| DEXCOM INC                   | —       | 23  | 159     | 17,772    | ヘルスケア機器・サービス           |
| MIDDLEBY CORP                | —       | 16  | 205     | 22,966    | 資本財                    |
| XYLEM INC                    | 63      | 51  | 265     | 29,597    | 資本財                    |
| TRIPADVISOR INC              | 42      | 34  | 150     | 16,736    | 小売                     |
| MEDIVATION INC               | 58      | —   | —       | —         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC     | 21      | 17  | 254     | 28,397    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 52      | 41  | 378     | 42,169    | 銀行                     |
| ALLEGHANY CORP               | 5       | 4   | 250     | 27,913    | 保険                     |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 27      | 21  | 973     | 108,620   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PHILLIPS 66                  | 188     | 131 | 1,026   | 114,511   | エネルギー                  |
| FACEBOOK INC-A               | 803     | 656 | 9,715   | 1,083,672 | ソフトウェア・サービス            |
| CMS ENERGY CORP              | 100     | 77  | 357     | 39,879    | 公益事業                   |
| ALBEMARLE CORP               | 40      | 30  | 337     | 37,665    | 素材                     |
| PVH CORP                     | 29      | 22  | 227     | 25,333    | 耐久消費財・アパレル             |
| LINKEDIN CORP - A            | 40      | —   | —       | —         | ソフトウェア・サービス            |
| KINDER MORGAN INC            | 671     | 531 | 1,036   | 115,651   | エネルギー                  |
| NIELSEN HOLDINGS PLC         | 122     | 97  | 384     | 42,902    | 商業・専門サービス              |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC        | 98      | 74  | 643     | 71,802    | 自動車・自動車部品              |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 60      | 48  | 194     | 21,668    | 資本財                    |
| SPLUNK INC                   | 45      | 35  | 237     | 26,451    | ソフトウェア・サービス            |
| OGE ENERGY CORP              | 71      | 57  | 198     | 22,111    | 公益事業                   |
| POLARIS INDUSTRIES INC       | 21      | 17  | 153     | 17,112    | 耐久消費財・アパレル             |
| ABBVIE INC                   | 578     | 456 | 2,991   | 333,693   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TESLA INC                    | 34      | 36  | 1,119   | 124,915   | 自動車・自動車部品              |
| CHENIERE ENERGY INC          | 80      | 57  | 285     | 31,813    | エネルギー                  |
| REALOGY HOLDINGS CORP        | 52      | —   | —       | —         | 不動産                    |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 45      | 36  | 265     | 29,634    | 各種金融                   |
| ZOETIS INC                   | 167     | 130 | 788     | 87,914    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MALLINCKRODT PLC             | 41      | 30  | 125     | 13,974    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NEWS CORP - CLASS A          | 134     | 107 | 137     | 15,357    | メディア                   |
| SPRINT CORP                  | 294     | 229 | 185     | 20,666    | 電気通信サービス               |
| TECO ENERGY INC              | 84      | —   | —       | —         | 公益事業                   |
| SNAP-ON INC                  | 20      | 16  | 270     | 30,146    | 資本財                    |
| AGL RESOURCES INC            | 43      | —   | —       | —         | 公益事業                   |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD    | 66      | 46  | 169     | 18,933    | 耐久消費財・アパレル             |
| TWITTER INC                  | 206     | 162 | 298     | 33,253    | ソフトウェア・サービス            |
| VANTIV INC - CL A            | 54      | 46  | 283     | 31,612    | ソフトウェア・サービス            |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 39      | 34  | 340     | 37,969    | ソフトウェア・サービス            |
| SERVICENOW INC               | 53      | 45  | 453     | 50,572    | ソフトウェア・サービス            |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 32      | 25  | 302     | 33,795    | ヘルスケア機器・サービス           |
| CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV  | 34      | —   | —       | —         | 資本財                    |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC    | 27      | 26  | 357     | 39,846    | ソフトウェア・サービス            |
| ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS | 65      | —   | —       | —         | ヘルスケア機器・サービス           |
| ALPHABET INC-CL C            | 110     | 86  | 8,124   | 906,257   | ソフトウェア・サービス            |
| IMS HEALTH HOLDINGS INC      | 56      | —   | —       | —         | ヘルスケア機器・サービス           |
| NAVIENT CORP                 | 127     | 88  | 123     | 13,732    | 各種金融                   |
| ENDO INTERNATIONAL PLC       | 77      | —   | —       | —         | 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      |                        |
| UNITED RENTALS INC           | 32      | 23  | 263     | 29,362  | 資本財                    |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC  | 56      | 37  | 170     | 18,995  | 運輸                     |
| VOYA FINANCIAL INC           | 76      | 55  | 197     | 22,042  | 各種金融                   |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP       | 16      | —   | —       | —       | 素材                     |
| ANTERO RESOURCES CORP        | 29      | 46  | 102     | 11,415  | エネルギー                  |
| QUINTILES IMS HOLDINGS INC   | 33      | 42  | 351     | 39,174  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALLY FINANCIAL INC           | 155     | 113 | 213     | 23,791  | 各種金融                   |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 174     | 56  | 360     | 40,245  | 消費者サービス                |
| CDK GLOBAL INC               | 48      | 37  | 227     | 25,364  | ソフトウェア・サービス            |
| DIAMONDBACK ENERGY INC       | —       | 24  | 255     | 28,455  | エネルギー                  |
| LIBERTY BROADBAND-C          | —       | 30  | 251     | 28,004  | メディア                   |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | 57      | 45  | 224     | 25,051  | 消費者サービス                |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 28      | 26  | 303     | 33,902  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SIGNET JEWELERS LTD          | 26      | 17  | 101     | 11,297  | 小売                     |
| SYNCHRONY FINANCIAL          | 294     | 228 | 612     | 68,358  | 各種金融                   |
| QORVO INC                    | 49      | 36  | 277     | 30,969  | 半導体・半導体製造装置            |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC    | 42      | —   | —       | —       | 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      | 50  | 281     | 31,414  | 保険                     |
| ACUITY BRANDS INC            | 15      | 12  | 210     | 23,483  | 資本財                    |
| JONES LANG LASALLE INC       | 15      | 12  | 144     | 16,079  | 不動産                    |
| ARAMARK                      | 81      | 62  | 228     | 25,445  | 消費者サービス                |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 186     | 140 | 485     | 54,156  | 銀行                     |
| LEAR CORP                    | 26      | 20  | 288     | 32,197  | 自動車・自動車部品              |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 26      | —   | —       | —       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WHITEWAVE FOODS CO           | 63      | —   | —       | —       | 食品・飲料・タバコ              |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD   | 50      | 62  | 194     | 21,694  | 素材                     |
| RITE AID CORP                | 373     | 301 | 104     | 11,636  | 食品・生活必需品小売り            |
| TARGA RESOURCES CORP         | —       | 51  | 263     | 29,397  | エネルギー                  |
| BAXALTA INC                  | 241     | —   | —       | —       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COLUMBIA PIPELINE GROUP      | 136     | —   | —       | —       | エネルギー                  |
| LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C | —       | 30  | 60      | 6,720   | メディア                   |
| WESTROCK CO                  | 91      | 68  | 355     | 39,699  | 素材                     |
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 214     | 170 | 1,542   | 172,103 | 食品・飲料・タバコ              |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 389     | 304 | 1,505   | 167,891 | ソフトウェア・サービス            |
| TABLEAU SOFTWARE INC-CL A    | 19      | —   | —       | —       | ソフトウェア・サービス            |
| ZILLOW GROUP INC - C         | 34      | 32  | 134     | 15,019  | ソフトウェア・サービス            |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRIS    | 638     | 463 | 858     | 95,799  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MOBILEYE NV                  | 30      | 50  | 309     | 34,465  | ソフトウェア・サービス            |
| AMERCO                       | 2       | 1   | 70      | 7,899   | 運輸                     |
| CDW CORP/DE                  | 50      | 41  | 235     | 26,311  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MEDNAX INC                   | 33      | 26  | 143     | 16,021  | ヘルスケア機器・サービス           |
| SABRE CORP                   | 67      | 60  | 138     | 15,473  | ソフトウェア・サービス            |
| FIRST DATA CORP- CLASS A     | —       | 91  | 149     | 16,707  | ソフトウェア・サービス            |
| WR GRACE & CO                | 25      | 19  | 141     | 15,773  | 素材                     |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C     | 63      | 53  | 94      | 10,596  | 耐久消費財・アパレル             |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | 71      | 59  | 227     | 25,332  | メディア                   |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A | 33      | 24  | 93      | 10,453  | メディア                   |
| INGEVITY CORP                | 15      | —   | —       | —       | 素材                     |
| DOMINO'S PIZZA INC           | —       | 13  | 268     | 29,898  | 消費者サービス                |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 76      | 60  | 1,922   | 214,396 | メディア                   |
| IDEXX LABORATORIES INC       | —       | 25  | 404     | 45,070  | ヘルスケア機器・サービス           |
| SMITH (A. O.) CORP           | —       | 39  | 209     | 23,407  | 資本財                    |

| 銘柄                           | 株数           | 当 期 末   |         |         | 業 種 等                  |  |
|------------------------------|--------------|---------|---------|---------|------------------------|--|
|                              |              | 株 数     | 評 価 額   |         |                        |  |
|                              |              |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額  |                        |  |
| (アメリカ)                       | 百株           | 百株      | 千アメリカドル | 千円      |                        |  |
| UGI CORP                     | —            | 47      | 225     | 25,205  | 公益事業                   |  |
| WESTAR ENERGY INC            | —            | 41      | 216     | 24,134  | 公益事業                   |  |
| FORTIVE CORP                 | —            | 88      | 544     | 60,699  | 資本財                    |  |
| IHS MARKIT LTD               | —            | 97      | 432     | 48,255  | 商業・専門サービス              |  |
| XL GROUP LTD                 | —            | 76      | 315     | 35,178  | 保険                     |  |
| DELL TECHNOLOGIES INC-CL V   | —            | 63      | 411     | 45,887  | ソフトウェア・サービス            |  |
| ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC  | —            | 17      | 114     | 12,798  | 素材                     |  |
| COTY INC-CL A                | —            | 136     | 256     | 28,628  | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| ARCONIC INC                  | —            | 124     | 344     | 38,444  | 資本財                    |  |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A   | —            | 61      | 193     | 21,542  | エネルギー                  |  |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | —            | 17      | 221     | 24,714  | 保険                     |  |
| SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC | —            | 7       | 97      | 10,835  | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| TELEFLEX INC                 | —            | 12      | 246     | 27,453  | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC      | —            | 45      | 140     | 15,720  | 電気通信サービス               |  |
| ENVISION HEALTHCARE CORP     | —            | 33      | 184     | 20,585  | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| TECHNIPFMC PLC               | —            | 125     | 403     | 45,020  | エネルギー                  |  |
| DXC TECHNOLOGY CO            | —            | 78      | 612     | 68,304  | ソフトウェア・サービス            |  |
| VALVOLINE INC                | —            | 48      | 109     | 12,218  | 素材                     |  |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 220          | 330     | 250     | 27,937  | 不動産                    |  |
| JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD  | —            | 60      | 252     | 28,148  | 資本財                    |  |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | 90           | 70      | 447     | 49,907  | 資本財                    |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 111,339 | 87,483  | 586,145 | 65,378,664             |  |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 596     | 597     | —       | < 61.8% >              |  |
| (カナダ)                        |              |         | 千カナダドル  |         |                        |  |
| ROYAL BANK OF CANADA         | 525          | 417     | 3,878   | 319,585 | 銀行                     |  |
| IMPERIAL OIL LTD             | 107          | 80      | 313     | 25,844  | エネルギー                  |  |
| THOMSON REUTERS CORP         | 122          | 93      | 543     | 44,801  | 各種金融                   |  |
| TRANSCANADA CORP             | 251          | 243     | 1,523   | 125,550 | エネルギー                  |  |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B  | 128          | 99      | 612     | 50,489  | 電気通信サービス               |  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       | 216          | 174     | 780     | 64,310  | 保険                     |  |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B     | 197          | 161     | 407     | 33,546  | 素材                     |  |
| BARRICK GOLD CORP            | 412          | 321     | 722     | 59,532  | 素材                     |  |
| BCE INC                      | 51           | 42      | 253     | 20,900  | 電気通信サービス               |  |
| AGRIUM INC                   | 47           | 37      | 462     | 38,141  | 素材                     |  |
| BOMBARDIER INC-B             | 712          | 541     | 114     | 9,404   | 資本財                    |  |
| BANK OF MONTREAL             | 227          | 180     | 1,685   | 138,899 | 銀行                     |  |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 313          | 249     | 1,265   | 104,241 | 各種金融                   |  |
| BANK OF NOVA SCOTIA          | 425          | 339     | 2,558   | 210,817 | 銀行                     |  |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTE | 116          | 94      | 172     | 14,203  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| CAE INC                      | 94           | 76      | 161     | 13,318  | 資本財                    |  |
| CAMECO CORP                  | 141          | 113     | 150     | 12,401  | エネルギー                  |  |
| CI FINANCIAL CORP            | 83           | 68      | 181     | 14,947  | 各種金融                   |  |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  | 140          | 112     | 1,194   | 98,422  | 銀行                     |  |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES   | 387          | 308     | 1,293   | 106,605 | エネルギー                  |  |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     | 282          | 215     | 2,176   | 179,335 | 運輸                     |  |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   | 25           | 19      | 288     | 23,770  | 小売                     |  |
| ENBRIDGE INC                 | 325          | 459     | 2,456   | 202,358 | エネルギー                  |  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  | 7            | 6       | 389     | 32,090  | 保険                     |  |
| CGI GROUP INC - CLASS A      | 79           | 62      | 408     | 33,632  | ソフトウェア・サービス            |  |
| HUSKY ENERGY INC             | 123          | 99      | 165     | 13,602  | エネルギー                  |  |
| IGM FINANCIAL INC            | 34           | 28      | 111     | 9,163   | 各種金融                   |  |
| LOBLAW COMPANIES LTD         | 80           | 63      | 483     | 39,837  | 食品・生活必需品小売り            |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |     | 当 期 末  |         | 業 種 等              |
|------------------------------|---------|-----|--------|---------|--------------------|
|                              | 株 数     | 株 数 | 評 価 額  |         |                    |
|                              |         |     | 外貨建金額  | 邦貨換算金額  |                    |
| (カナダ)                        | 百株      | 百株  | 千カナダドル | 千円      |                    |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      | 697     | 550 | 1,294  | 106,670 | 保険                 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      | 143     | 105 | 641    | 52,831  | 自動車・自動車部品          |
| NATIONAL BANK OF CANADA      | 120     | 95  | 501    | 41,342  | 銀行                 |
| ONEX CORPORATION             | 30      | 24  | 19,235 | 各種金融    |                    |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN  | 295     | 237 | 532    | 43,895  | 素材                 |
| POWER CORP OF CANADA         | 133     | 100 | 290    | 23,959  | 保険                 |
| POWER FINANCIAL CORP         | 89      | 65  | 210    | 17,319  | 保険                 |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B    | 145     | 119 | 340    | 28,070  | メディア               |
| SUNCOR ENERGY INC            | 560     | 468 | 2,026  | 166,958 | エネルギー              |
| WESTON (GEORGE) LTD          | 18      | 13  | 158    | 13,091  | 食品・生活必需品小売り        |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 51      | 39  | 820    | 67,605  | 運輸                 |
| ENCANA CORP                  | 302     | 263 | 402    | 33,131  | エネルギー              |
| AGNICO EAGLE MINES LTD       | 78      | 63  | 419    | 34,564  | 素材                 |
| FINNING INTERNATIONAL INC    | 62      | 47  | 122    | 10,056  | 資本財                |
| GOLDCORP INC                 | 293     | 243 | 455    | 37,498  | 素材                 |
| KINROSS GOLD CORP            | 433     | 353 | 202    | 16,694  | 素材                 |
| SNC-LAVALIN GROUP INC        | 53      | 43  | 219    | 18,110  | 資本財                |
| GREAT-WEST LIFE CO INC       | 106     | 83  | 279    | 23,058  | 保険                 |
| METHANEX CORP                | 31      | 26  | 155    | 12,814  | 素材                 |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 346     | 281 | 104    | 8,612   | 素材                 |
| JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A | 32      | 25  | 54     | 4,510   | 食品・生活必需品小売り        |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        | 82      | 62  | 232    | 19,170  | 耐久消費財・アパレル         |
| SAPUTO INC                   | 91      | 67  | 292    | 24,139  | 食品・飲料・タバコ          |
| BLACKBERRY LTD               | 175     | 140 | 196    | 16,183  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TELUS CORP                   | 79      | 57  | 260    | 21,442  | 電気通信サービス           |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD   | 239     | 198 | 239    | 19,755  | 素材                 |
| YAMANA GOLD INC              | 343     | 260 | 98     | 8,118   | 素材                 |
| FORTIS INC                   | 102     | 110 | 480    | 39,568  | 公益事業               |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B  | 148     | 115 | 708    | 58,374  | 食品・生活必需品小売り        |
| ELDORADO GOLD CORP           | 267     | 198 | 92     | 7,650   | 素材                 |
| TORONTO-DOMINION BANK        | 656     | 522 | 3,291  | 271,162 | 銀行                 |
| FRANCO-NEVADA CORP           | 62      | 48  | 473    | 39,048  | 素材                 |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 148     | 126 | 358    | 29,544  | 素材                 |
| EMPIRE CO LTD 'A'            | 60      | 45  | 94     | 7,796   | 食品・生活必需品小売り        |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC | 37      | 29  | 147    | 12,135  | 保険                 |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A     | 45      | 37  | 150    | 12,385  | 公益事業               |
| METRO INC                    | 86      | 66  | 300    | 24,779  | 食品・生活必需品小売り        |
| OPEN TEXT CORP               | 43      | 74  | 322    | 26,600  | ソフトウェア・サービス        |
| INTACT FINANCIAL CORP        | 47      | 37  | 344    | 28,396  | 保険                 |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP   | 179     | 151 | 201    | 16,621  | エネルギー              |
| CENOVUS ENERGY INC           | 295     | 290 | 379    | 31,252  | エネルギー              |
| ARC RESOURCES LTD            | 122     | 101 | 185    | 15,311  | エネルギー              |
| TOURMALINE OIL CORP          | 66      | 66  | 184    | 15,220  | エネルギー              |
| PEMBINA PIPELINE CORP        | 133     | 113 | 497    | 40,992  | エネルギー              |
| VERMILION ENERGY INC         | 41      | 34  | 159    | 13,137  | エネルギー              |
| DOLLARAMA INC                | 43      | 32  | 388    | 32,017  | 小売                 |
| KEYERA CORP                  | 61      | 53  | 215    | 17,785  | エネルギー              |
| ALTAGAS LTD                  | 51      | 47  | 145    | 12,008  | エネルギー              |
| PEYTO EXPLORATION & DEV CORP | 53      | 47  | 123    | 10,203  | エネルギー              |
| ATCO LTD -CLASS I            | 30      | 23  | 115    | 9,552   | 公益事業               |
| FIRST CAPITAL REALTY INC     | 42      | 41  | 81     | 6,715   | 不動産                |
| INTER PIPELINE LTD           | 120     | 104 | 280    | 23,143  | エネルギー              |



| 銘柄                           | 株数           | 当 期 末  |        |         | 業 種 等                  |        |
|------------------------------|--------------|--------|--------|---------|------------------------|--------|
|                              |              | 株 数    | 株 数    | 評 価 額   |                        |        |
|                              |              |        |        | 外貨建金額   |                        | 邦貨換算金額 |
| (カナダ)                        | 百株           | 百株     | 千カナダドル | 千円      |                        |        |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD       | 63           | 57     | 172    | 14,214  | エネルギー                  |        |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A | 59           | 68     | 178    | 14,729  | エネルギー                  |        |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 7            | 5      | 341    | 28,116  | ソフトウェア・サービス            |        |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     | 72           | 59     | 486    | 40,079  | 消費者サービス                |        |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD    | 25           | 18     | 108    | 8,898   | 素材                     |        |
| VERESEN INC                  | 108          | 89     | 166    | 13,682  | エネルギー                  |        |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B    | 10           | 8      | 241    | 19,910  | 素材                     |        |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR | 136          | 110    | 122    | 10,059  | 各種金融                   |        |
| LINAMAR CORP                 | 18           | 14     | 89     | 7,375   | 自動車・自動車部品              |        |
| HYDRO ONE LTD                | —            | 55     | 127    | 10,494  | 公益事業                   |        |
| PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS  | 38           | —      | —      | —       | 商業・専門サービス              |        |
| EMERA INC                    | —            | 15     | 70     | 5,815   | 公益事業                   |        |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 14,150 | 11,734 | 47,376  | 3,903,379              |        |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 90     | 91     | —       | < 3.7% >               |        |
| (ユーロ…ドイツ)                    |              |        |        | 千ユーロ    |                        |        |
| COMMERZBANK AG               | 375          | 304    | 290    | 36,252  | 銀行                     |        |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED  | 488          | 578    | 987    | 123,272 | 各種金融                   |        |
| METRO AG                     | 63           | 51     | 156    | 19,572  | 食品・生活必需品小売り            |        |
| SIEMENS AG-REG               | 280          | 215    | 2,764  | 345,007 | 資本財                    |        |
| RWE AG                       | 173          | 140    | 238    | 29,751  | 公益事業                   |        |
| BASF SE                      | 324          | 259    | 2,222  | 277,288 | 素材                     |        |
| VOLKSWAGEN AG                | 12           | 9      | 134    | 16,744  | 自動車・自動車部品              |        |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 340          | 271    | 1,841  | 229,777 | 自動車・自動車部品              |        |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG   | 62           | 49     | 606    | 75,731  | 家庭用品・パーソナル用品           |        |
| E.ON SE                      | 707          | 581    | 430    | 53,660  | 公益事業                   |        |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG  | 117          | 92     | 796    | 99,381  | 自動車・自動車部品              |        |
| BAYER AG-REG                 | 292          | 232    | 2,717  | 339,096 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |
| LINDE AG                     | 65           | 51     | 860    | 107,384 | 素材                     |        |
| ALLIANZ SE-REG               | 161          | 128    | 2,183  | 272,473 | 保険                     |        |
| MAN SE                       | 11           | 9      | 93     | 11,666  | 資本財                    |        |
| CONTINENTAL AG               | 38           | 30     | 612    | 76,479  | 自動車・自動車部品              |        |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG     | 401          | 313    | 603    | 75,288  | 半導体・半導体製造装置            |        |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF   | 54           | 43     | 232    | 29,034  | 自動車・自動車部品              |        |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       | 82           | 67     | 110    | 13,776  | 運輸                     |        |
| HUGO BOSS AG -ORD            | 23           | 18     | 131    | 16,363  | 耐久消費財・アパレル             |        |
| DEUTSCHE POST AG-REG         | 343          | 270    | 854    | 106,687 | 運輸                     |        |
| SAP SE                       | 347          | 276    | 2,597  | 324,111 | ソフトウェア・サービス            |        |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE      | 78           | 66     | 246    | 30,711  | メディア                   |        |
| DEUTSCHE BOERSE AG           | 67           | 54     | 488    | 60,958  | 各種金融                   |        |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG &  | 77           | 59     | 484    | 60,407  | ヘルスケア機器・サービス           |        |
| FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT | 14           | 10     | 74     | 9,302   | 運輸                     |        |
| ADIDAS AG                    | 74           | 52     | 907    | 113,271 | 耐久消費財・アパレル             |        |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG      | 1,141        | 921    | 1,640  | 204,753 | 電気通信サービス               |        |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   | 58           | 44     | 768    | 95,902  | 保険                     |        |
| THYSSENKRUPP AG              | 130          | 104    | 240    | 30,018  | 素材                     |        |
| BEIERSDORF AG                | 35           | 28     | 264    | 33,062  | 家庭用品・パーソナル用品           |        |
| HEIDELBERGCEMENT AG          | 48           | 42     | 353    | 44,130  | 素材                     |        |
| MERCK KGAA                   | 46           | 35     | 383    | 47,854  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           | 65           | 51     | 717    | 89,553  | 自動車・自動車部品              |        |
| LANXESS AG                   | 32           | 24     | 158    | 19,730  | 素材                     |        |
| FRESENIUS SE & CO KGAA       | 135          | 114    | 873    | 108,953 | ヘルスケア機器・サービス           |        |
| HOCHTIEF AG                  | —            | 5      | 94     | 11,849  | 資本財                    |        |

| 銘柄                           | 株数               | 当 期 末  |        |         | 業 種 等        |        |
|------------------------------|------------------|--------|--------|---------|--------------|--------|
|                              |                  | 株数     | 評 価 額  |         |              |        |
|                              |                  |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額  |              |        |
| (ユーロ…ドイツ)                    | 百株               | 百株     | 千ユーロ   | 千円      |              |        |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR        | 118              | 100    | 345    | 43,162  | 不動産          |        |
| GEA GROUP AG                 | 65               | 52     | 193    | 24,091  | 資本財          |        |
| SYMRISE AG                   | 44               | 35     | 222    | 27,775  | 素材           |        |
| K+S AG-REG                   | 69               | 54     | 128    | 16,082  | 素材           |        |
| HENKEL AG & CO KGAA          | 36               | 29     | 321    | 40,078  | 家庭用品・パーソナル用品 |        |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 44               | 35     | 167    | 20,911  | ソフトウェア・サービス  |        |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 18               | 15     | 115    | 14,355  | 自動車・自動車部品    |        |
| HANNOVER RUECK SE            | 21               | 17     | 180    | 22,556  | 保険           |        |
| BRENNTAG AG                  | 54               | 44     | 230    | 28,815  | 資本財          |        |
| AXEL SPRINGER SE             | 15               | 12     | 70     | 8,738   | メディア         |        |
| FUCHS PETROLUB SE -PREF      | 23               | 20     | 98     | 12,311  | 素材           |        |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 253              | 213    | 88     | 11,063  | 電気通信サービス     |        |
| OSRAM LICHT AG               | 30               | 25     | 171    | 21,462  | 資本財          |        |
| VONOVIA SE                   | 165              | 127    | 439    | 54,803  | 不動産          |        |
| EVONIK INDUSTRIES AG         | 49               | 45     | 143    | 17,909  | 素材           |        |
| ZALANDO SE                   | 31               | 23     | 95     | 11,960  | 小売           |        |
| COVESTRO AG                  | —                | 20     | 135    | 16,855  | 素材           |        |
| SCHAEFFLER AG                | —                | 46     | 70     | 8,813   | 自動車・自動車部品    |        |
| INNOGY SE                    | —                | 40     | 140    | 17,512  | 公益事業         |        |
| 小 計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 7,820  | 6,572  | 32,522  | 4,058,520    | <3.8%> |
| (ユーロ…イタリア)                   |                  |        |        |         |              |        |
| ASSICURAZIONI GENERALI       | 411              | 320    | 484    | 60,488  | 保険           |        |
| INTESA SANPAOLO              | 4,499            | 3,537  | 990    | 123,594 | 銀行           |        |
| TELECOM ITALIA SPA           | 4,068            | 3,250  | 286    | 35,775  | 電気通信サービス     |        |
| ENI SPA                      | 901              | 712    | 1,071  | 133,698 | エネルギー        |        |
| UNICREDIT SPA                | 1,687            | 526    | 885    | 110,442 | 銀行           |        |
| ENEL SPA                     | 2,712            | 2,135  | 1,000  | 124,824 | 公益事業         |        |
| SAIPEM SPA                   | 2,049            | 1,674  | 65     | 8,164   | エネルギー        |        |
| ATLANTIA SPA                 | 144              | 117    | 292    | 36,530  | 運輸           |        |
| INTESA SANPAOLO-RSP          | 324              | 275    | 73     | 9,165   | 銀行           |        |
| LUXOTTICA GROUP SPA          | 60               | 47     | 259    | 32,382  | 耐久消費財・アパレル   |        |
| MEDIOBANCA SPA               | 203              | 165    | 149    | 18,663  | 銀行           |        |
| SNAM SPA                     | 753              | 696    | 302    | 37,701  | エネルギー        |        |
| TELECOM ITALIA-RSP           | 2,076            | 1,692  | 121    | 15,202  | 電気通信サービス     |        |
| BANCO POPOLARE SC            | 130              | —      | —      | —       | 銀行           |        |
| LEONARDO SPA                 | 146              | 114    | 175    | 21,890  | 資本財          |        |
| UBI BANCA SPA                | 318              | —      | —      | —       | 銀行           |        |
| TERNA SPA                    | 551              | 409    | 205    | 25,617  | 公益事業         |        |
| UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA  | 391              | 329    | 71     | 8,870   | 保険           |        |
| PRYSMIAN SPA                 | 66               | 55     | 134    | 16,780  | 資本財          |        |
| EXOR SPA                     | 38               | —      | —      | —       | 各種金融         |        |
| POSTE ITALIANE SPA           | —                | 143    | 91     | 11,358  | 保険           |        |
| 小 計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 21,536 | 16,204 | 6,660   | 831,151      | <0.8%> |
| (ユーロ…フランス)                   |                  |        |        |         |              |        |
| MICHELIN (CGDE)              | 65               | 50     | 598    | 74,718  | 自動車・自動車部品    |        |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 98               | 78     | 1,796  | 224,226 | 耐久消費財・アパレル   |        |
| PEUGEOT SA                   | 157              | 136    | 253    | 31,673  | 自動車・自動車部品    |        |
| AXA SA                       | 696              | 543    | 1,292  | 161,265 | 保険           |        |
| DANONE                       | 208              | 165    | 1,087  | 135,760 | 食品・飲料・タバコ    |        |
| CARREFOUR SA                 | 194              | 155    | 354    | 44,273  | 食品・生活必需品小売り  |        |

| 銘柄                        | 期首(前期末) |     | 当 期 末 |         | 業 種 等                  |
|---------------------------|---------|-----|-------|---------|------------------------|
|                           | 株 数     | 株 数 | 評 価 額 |         |                        |
|                           |         |     | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                        |
| (ユーロ…フランス)                | 百株      | 百株  | 千ユーロ  | 千円      |                        |
| VIVENDI                   | 409     | 283 | 536   | 66,960  | メディア                   |
| INGENICO GROUP            | 19      | 15  | 139   | 17,394  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SOCIETE GENERALE SA       | 256     | 214 | 1,073 | 133,953 | 銀行                     |
| AIR LIQUIDE SA            | 121     | 109 | 1,208 | 150,752 | 素材                     |
| TOTAL SA                  | 777     | 640 | 3,098 | 386,706 | エネルギー                  |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN | 168     | 138 | 699   | 87,242  | 資本財                    |
| ZODIAC AEROSPACE          | 70      | 58  | 135   | 16,952  | 資本財                    |
| VINCI SA                  | 169     | 142 | 1,088 | 135,892 | 資本財                    |
| SANOFI                    | 415     | 325 | 2,880 | 359,488 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT      | 164     | 137 | 265   | 33,090  | 公益事業                   |
| L'OREAL                   | 88      | 70  | 1,320 | 164,768 | 家庭用品・パーソナル用品           |
| ACCOR SA                  | 75      | 48  | 201   | 25,169  | 消費者サービス                |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE     | 197     | 157 | 1,077 | 134,470 | 資本財                    |
| BNP PARIBAS               | 374     | 318 | 2,093 | 261,271 | 銀行                     |
| ESSILOR INTERNATIONAL     | 72      | 57  | 683   | 85,282  | ヘルスケア機器・サービス           |
| CAPGEMINI                 | 57      | 44  | 416   | 51,997  | ソフトウェア・サービス            |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 20      | 15  | 84    | 10,527  | 食品・生活必需品小売り            |
| VALEO SA                  | 28      | 65  | 423   | 52,837  | 自動車・自動車部品              |
| HERMES INTERNATIONAL      | 9       | 7   | 328   | 41,012  | 耐久消費財・アパレル             |
| SODEXO                    | 33      | 25  | 308   | 38,524  | 消費者サービス                |
| KERING                    | 27      | 20  | 608   | 75,980  | 耐久消費財・アパレル             |
| DASSAULT SYSTEMES SA      | 45      | 36  | 301   | 37,581  | ソフトウェア・サービス            |
| TECHNIP SA                | 37      | —   | —     | —       | エネルギー                  |
| CHRISTIAN DIOR SE         | 19      | 14  | 375   | 46,810  | 耐久消費財・アパレル             |
| ATOS SE                   | 31      | 24  | 296   | 37,036  | ソフトウェア・サービス            |
| ORANGE                    | 702     | 555 | 850   | 106,073 | 電気通信サービス               |
| CNP ASSURANCES            | 59      | 49  | 93    | 11,668  | 保険                     |
| IMERYS SA                 | 13      | 10  | 81    | 10,150  | 素材                     |
| SAFRAN SA                 | 110     | 86  | 661   | 82,578  | 資本財                    |
| RENAULT SA                | 67      | 52  | 452   | 56,503  | 自動車・自動車部品              |
| PUBLICIS GROUPE           | 67      | 54  | 357   | 44,568  | メディア                   |
| LAGARDERE SCA             | 40      | 32  | 89    | 11,216  | メディア                   |
| JCDECAUX SA               | 27      | 20  | 59    | 7,406   | メディア                   |
| SOCIETE BIC SA            | 10      | 8   | 89    | 11,144  | 商業・専門サービス              |
| BOUYGUES SA               | 73      | 55  | 209   | 26,134  | 資本財                    |
| THALES SA                 | 37      | 29  | 292   | 36,562  | 資本財                    |
| PERNOD RICARD SA          | 75      | 59  | 703   | 87,762  | 食品・飲料・タバコ              |
| CREDIT AGRICOLE SA        | 375     | 319 | 457   | 57,124  | 銀行                     |
| ENGIE                     | 519     | 440 | 594   | 74,129  | 公益事業                   |
| ALSTOM                    | 54      | 43  | 133   | 16,708  | 資本財                    |
| ARKEMA                    | 23      | 17  | 172   | 21,484  | 素材                     |
| LEGRAND SA                | 94      | 73  | 446   | 55,751  | 資本財                    |
| SCOR SE                   | 53      | 42  | 147   | 18,374  | 保険                     |
| ADP                       | 10      | 8   | 110   | 13,793  | 運輸                     |
| EDF                       | 85      | 82  | 76    | 9,561   | 公益事業                   |
| NATIXIS                   | 335     | 270 | 171   | 21,418  | 銀行                     |
| WENDEL                    | 10      | 7   | 107   | 13,398  | 各種金融                   |
| BUREAU VERITAS SA         | 94      | 76  | 161   | 20,100  | 商業・専門サービス              |
| EURAZEO                   | 13      | 11  | 68    | 8,491   | 各種金融                   |
| EURAZEO-NEW               | 0.69    | —   | —     | —       | 各種金融                   |
| SUEZ                      | 109     | 98  | 160   | 20,014  | 公益事業                   |
| EIFFAGE                   | —       | 17  | 133   | 16,640  | 資本財                    |

| 銘柄                           | 株数           | 当 期 末 |       |         | 業 種 等                  |  |
|------------------------------|--------------|-------|-------|---------|------------------------|--|
|                              |              | 株 数   | 評 価 額 |         |                        |  |
|                              |              |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                        |  |
| (ユーロ…フランス)                   | 百株           | 百株    | 千ユーロ  | 千円      |                        |  |
| ILIAD SA                     | 9            | 7     | 165   | 20,712  | 電気通信サービス               |  |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS      | 60           | 48    | 107   | 13,476  | メディア                   |  |
| GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR  | 168          | 137   | 141   | 17,620  | 運輸                     |  |
| EDENRED                      | 71           | 60    | 137   | 17,153  | 商業・専門サービス              |  |
| REMY COINTREAU               | 7            | 6     | 62    | 7,756   | 食品・飲料・タバコ              |  |
| REXEL SA                     | 105          | 86    | 131   | 16,465  | 資本財                    |  |
| BOLLORE                      | 319          | 260   | 103   | 12,907  | 運輸                     |  |
| SFR GROUP SA                 | 40           | 24    | 74    | 9,268   | 電気通信サービス               |  |
| DASSAULT AVIATION SA         | —            | 0.5   | 66    | 8,270   | 資本財                    |  |
| SEB SA                       | —            | 6     | 96    | 12,048  | 耐久消費財・アパレル             |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 8,966 | 7,267 | 32,999  | 4,118,062              |  |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 65    | 66    | —       | < 3.9% >               |  |
| (ユーロ…オランダ)                   |              |       |       |         |                        |  |
| QIAGEN N.V.                  | 80           | 62    | 180   | 22,532  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| CNH INDUSTRIAL NV            | 334          | 291   | 293   | 36,574  | 資本財                    |  |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 320          | 256   | 248   | 31,065  | 自動車・自動車部品              |  |
| FERRARI NV                   | 44           | 35    | 260   | 32,538  | 自動車・自動車部品              |  |
| EXOR NV                      | —            | 31    | 165   | 20,669  | 各種金融                   |  |
| AIRBUS SE                    | 209          | 162   | 1,200 | 149,794 | 資本財                    |  |
| STMICROELECTRONICS NV        | 221          | 182   | 267   | 33,331  | 半導体・半導体製造装置            |  |
| GEMALTO                      | 28           | 23    | 126   | 15,726  | ソフトウェア・サービス            |  |
| WOLTERS KLUWER               | 107          | 85    | 338   | 42,230  | 商業・専門サービス              |  |
| KONINKLIJKE KPN NV           | 1,149        | 970   | 284   | 35,549  | 電気通信サービス               |  |
| AKZO NOBEL                   | 87           | 69    | 522   | 65,173  | 素材                     |  |
| HEINEKEN NV                  | 81           | 63    | 547   | 68,324  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       | 336          | 264   | 834   | 104,187 | 資本財                    |  |
| RELX NV                      | 351          | 273   | 500   | 62,502  | 商業・専門サービス              |  |
| AEGON NV                     | 652          | 504   | 223   | 27,849  | 保険                     |  |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 294          | 354   | 716   | 89,352  | 食品・生活必需品小売り            |  |
| RANDSTAD HOLDING NV          | 45           | 33    | 180   | 22,516  | 商業・専門サービス              |  |
| HEINEKEN HOLDING NV          | 36           | 29    | 237   | 29,659  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| KONINKLIJKE DSM NV           | 63           | 49    | 326   | 40,729  | 素材                     |  |
| ING GROEP NV                 | 1,369        | 1,091 | 1,646 | 205,451 | 銀行                     |  |
| ASML HOLDING NV              | 122          | 104   | 1,261 | 157,449 | 半導体・半導体製造装置            |  |
| UNILEVER NV-CVA              | 576          | 457   | 2,253 | 281,157 | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| VOPAK                        | 25           | 20    | 84    | 10,508  | エネルギー                  |  |
| BOSKALIS WESTMINSTER         | 30           | 25    | 77    | 9,702   | 資本財                    |  |
| TNT EXPRESS NV               | 173          | —     | —     | —       | 運輸                     |  |
| OCI NV                       | 30           | —     | —     | —       | 素材                     |  |
| NN GROUP NV                  | 113          | 89    | 286   | 35,765  | 保険                     |  |
| ALTICE NV - B                | 40           | 26    | 57    | 7,148   | メディア                   |  |
| ALTICE NV - A                | 130          | 110   | 234   | 29,320  | メディア                   |  |
| ABN AMRO GROUP NV-CVA        | —            | 81    | 191   | 23,945  | 銀行                     |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 7,057 | 5,748 | 13,548  | 1,690,756              |  |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 28    | 28    | —       | < 1.6% >               |  |
| (ユーロ…スペイン)                   |              |       |       |         |                        |  |
| BANCO POPULAR ESPANOL        | 600          | 921   | 66    | 8,270   | 銀行                     |  |
| ENDESA SA                    | 114          | 91    | 193   | 24,127  | 公益事業                   |  |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV  | 67           | 54    | 194   | 24,241  | 資本財                    |  |
| IBERDROLA SA                 | 1,948        | 1,548 | 1,073 | 134,003 | 公益事業                   |  |
| TELEFONICA SA                | 1,592        | 1,271 | 1,264 | 157,776 | 電気通信サービス               |  |
| BANCO SANTANDER SA           | 5,105        | 4,092 | 2,387 | 297,881 | 銀行                     |  |

| 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…スペイン)                   | 百株           | 百株     | 千ユーロ   | 千円      |                        |  |
| BANKINTER SA                 | 236          | 190    | 158    | 19,775  | 銀行                     |  |
| REPSOL SA                    | 388          | 320    | 475    | 59,393  | エネルギー                  |  |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 2,292        | 1,864  | 1,382  | 172,488 | 銀行                     |  |
| GAS NATURAL SDG SA           | 126          | 102    | 222    | 27,705  | 公益事業                   |  |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL   | 383          | 303    | 1,091  | 136,211 | 小売                     |  |
| ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA   | 186          | 175    | 287    | 35,911  | 運輸                     |  |
| MAPPRE SA                    | 391          | 298    | 92     | 11,593  | 保険                     |  |
| FERROVIAL SA                 | 168          | 137    | 270    | 33,712  | 資本財                    |  |
| ZARDOYA OTIS SA              | 67           | 51     | 44     | 5,546   | 資本財                    |  |
| ENAGAS SA                    | 76           | 65     | 167    | 20,916  | エネルギー                  |  |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 38           | 125    | 241    | 30,163  | 公益事業                   |  |
| BANCO DE SABADELL SA         | 1,836        | 1,524  | 276    | 34,525  | 銀行                     |  |
| CAIXABANK S. A               | 937          | 1,018  | 429    | 53,635  | 銀行                     |  |
| GRIFOLS SA                   | 105          | 84     | 214    | 26,756  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| AMADEUS IT GROUP SA          | 154          | 124    | 642    | 80,121  | ソフトウェア・サービス            |  |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI | 293          | 240    | 166    | 20,785  | 運輸                     |  |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL  | 215          | 173    | 92     | 11,503  | 食品・生活必需品小売り            |  |
| BANKIA SA                    | 1,600        | 1,303  | 135    | 16,962  | 銀行                     |  |
| AENA SA                      | 24           | 19     | 326    | 40,803  | 運輸                     |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 18,953 | 16,103 | 11,898  | 1,484,813              |  |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 25     | 25     | —       | < 1.4% >               |  |
| (ユーロ…ベルギー)                   |              |        |        |         |                        |  |
| AGEAS                        | 72           | 54     | 205    | 25,598  | 保険                     |  |
| UCB SA                       | 44           | 35     | 275    | 34,359  | 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   | 284          | —      | —      | —       | 食品・飲料・タバコ              |  |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA  | 28           | 22     | 194    | 24,250  | 各種金融                   |  |
| DELHAIZE GROUP               | 36           | —      | —      | —       | 食品・生活必需品小売り            |  |
| UMICORE                      | 33           | 26     | 160    | 20,044  | 素材                     |  |
| COLRUYT SA                   | 25           | 18     | 87     | 10,965  | 食品・生活必需品小売り            |  |
| KBC GROEP NV                 | 88           | 68     | 453    | 56,634  | 銀行                     |  |
| SOLVAY SA                    | 26           | 21     | 249    | 31,182  | 素材                     |  |
| PROXIMUS                     | 53           | 42     | 132    | 16,473  | 電気通信サービス               |  |
| TELENET GROUP HOLDING NV     | 19           | 15     | 90     | 11,266  | メディア                   |  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV   | —            | 214    | 2,265  | 282,773 | 食品・飲料・タバコ              |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 713    | 521    | 4,115   | 513,548                |  |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 11     | 10     | —       | < 0.5% >               |  |
| (ユーロ…オーストリア)                 |              |        |        |         |                        |  |
| ERSTE GROUP BANK AG          | 99           | 86     | 295    | 36,861  | 銀行                     |  |
| OMV AG                       | 54           | 42     | 204    | 25,509  | エネルギー                  |  |
| VOESTALPINE AG               | 41           | 31     | 125    | 15,663  | 素材                     |  |
| ANDRITZ AG                   | 28           | 20     | 109    | 13,667  | 資本財                    |  |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA | 39           | 34     | 78     | 9,768   | 銀行                     |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 262    | 215    | 813     | 101,470                |  |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 5      | 5      | —       | < 0.1% >               |  |
| (ユーロ…ルクセンブルク)                |              |        |        |         |                        |  |
| RTL GROUP                    | 13           | 10     | 73     | 9,175   | メディア                   |  |
| TENARIS SA                   | 165          | 135    | 194    | 24,333  | エネルギー                  |  |
| SES                          | 117          | 104    | 219    | 27,354  | メディア                   |  |
| EUROFINS SCIENTIFIC          | —            | 3      | 138    | 17,275  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| ARCELORMITTAL                | 607          | 174    | 350    | 43,780  | 素材                     |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 903    | 427    | 976     | 121,919                |  |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 4      | 5      | —       | < 0.1% >               |  |

| 銘柄                          | 株数      | 当 期 末  |        |          |                        | 業 種 等 |
|-----------------------------|---------|--------|--------|----------|------------------------|-------|
|                             |         | 株数     | 株数     | 評 価 額    |                        |       |
|                             |         |        |        | 外貨建金額    | 邦貨換算金額                 |       |
| (ユーロ…フィンランド)                | 百株      | 百株     | 千ユーロ   | 千円       |                        |       |
| NOKIA OYJ                   | 2,041   | 1,629  | 906    | 113,158  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |       |
| STORA ENSO OYJ-R SHS        | 194     | 156    | 175    | 21,919   | 素材                     |       |
| NOKIAN RENKAAT OYJ          | 41      | 33     | 124    | 15,495   | 自動車・自動車部品              |       |
| UPM-KYMMENE OYJ             | 185     | 144    | 357    | 44,628   | 素材                     |       |
| FORTUM OYJ                  | 159     | 128    | 179    | 22,404   | 公益事業                   |       |
| KONE OYJ-B                  | 118     | 91     | 394    | 49,244   | 資本財                    |       |
| METSO OYJ                   | 41      | 31     | 97     | 12,146   | 資本財                    |       |
| SAMPO OYJ-A SHS             | 157     | 123    | 552    | 68,930   | 保険                     |       |
| WARTSILA OYJ ABP            | 52      | 41     | 221    | 27,679   | 資本財                    |       |
| ELISA OYJ                   | 50      | 41     | 140    | 17,472   | 電気通信サービス               |       |
| NESTE OYJ                   | 45      | 36     | 137    | 17,166   | エネルギー                  |       |
| ORION OYJ-CLASS B           | 37      | 28     | 161    | 20,173   | 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   | 3,125  | 2,488  | 3,449    | 430,420                |       |
|                             | 銘柄数<比率> | 12     | 12     | —        | <0.4%>                 |       |
| (ユーロ…アイルランド)                |         |        |        |          |                        |       |
| KERRY GROUP PLC-A           | 57      | 46     | 361    | 45,053   | 食品・飲料・タバコ              |       |
| PADDY POWER BETFAIR PLC     | 30      | 20     | 194    | 24,219   | 消費者サービス                |       |
| BANK OF IRELAND             | 10,157  | 8,041  | 196    | 24,484   | 銀行                     |       |
| CRH PLC                     | 295     | 234    | 767    | 95,791   | 素材                     |       |
| 小 計                         | 株数・金額   | 10,540 | 8,341  | 1,518    | 189,548                |       |
|                             | 銘柄数<比率> | 4      | 4      | —        | <0.2%>                 |       |
| (ユーロ…ポルトガル)                 |         |        |        |          |                        |       |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 836     | 687    | 212    | 26,567   | 公益事業                   |       |
| JERONIMO MARTINS            | 89      | 71     | 124    | 15,517   | 食品・生活必需品小売り            |       |
| BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R | 15,817  | —      | —      | —        | 銀行                     |       |
| GALP ENERGIA SGPS SA        | 163     | 144    | 206    | 25,758   | エネルギー                  |       |
| 小 計                         | 株数・金額   | 16,906 | 903    | 543      | 67,843                 |       |
|                             | 銘柄数<比率> | 4      | 3      | —        | <0.1%>                 |       |
| (ユーロ…イギリス)                  |         |        |        |          |                        |       |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS | —       | 62     | 223    | 27,938   | 食品・飲料・タバコ              |       |
| 小 計                         | 株数・金額   | —      | 62     | 223      | 27,938                 |       |
|                             | 銘柄数<比率> | —      | 1      | —        | <0.0%>                 |       |
| ユーロ計                        | 株数・金額   | 96,787 | 64,856 | 109,271  | 13,635,994             |       |
|                             | 銘柄数<比率> | 230    | 233    | —        | <12.9%>                |       |
| (イギリス)                      |         |        |        | 千イギリスポンド |                        |       |
| BARCLAYS PLC                | 5,939   | 4,750  | 1,015  | 146,951  | 銀行                     |       |
| BP PLC                      | 6,486   | 5,315  | 2,509  | 363,294  | エネルギー                  |       |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC    | 20,217  | 18,034 | 1,294  | 187,396  | 銀行                     |       |
| ASTRAZENECA PLC             | 447     | 355    | 1,819  | 263,331  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |       |
| SMITHS GROUP PLC            | 140     | 112    | 178    | 25,835   | 資本財                    |       |
| NEXT PLC                    | 52      | 40     | 176    | 25,618   | 小売                     |       |
| DIAGEO PLC                  | 890     | 706    | 1,620  | 234,568  | 食品・飲料・タバコ              |       |
| SKY PLC                     | 365     | 282    | 283    | 41,071   | メディア                   |       |
| BAE SYSTEMS PLC             | 1,116   | 902    | 577    | 83,568   | 資本財                    |       |
| UNILEVER PLC                | 453     | 360    | 1,491  | 215,957  | 家庭用品・パーソナル用品           |       |
| TESCO PLC                   | 2,873   | 2,249  | 410    | 59,422   | 食品・生活必需品小売り            |       |
| RELX PLC                    | 392     | 308    | 502    | 72,685   | 商業・専門サービス              |       |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC   | 583     | 465    | 179    | 25,921   | 小売                     |       |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 225     | 176    | 1,346  | 194,868  | 家庭用品・パーソナル用品           |       |
| PRUDENTIAL PLC              | 909     | 724    | 1,272  | 184,240  | 保険                     |       |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC   | 2,095   | 1,633  | 406    | 58,903   | 保険                     |       |
| SAGE GROUP PLC/THE          | 380     | 306    | 213    | 30,910   | 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  |                        |
| (イギリス)                       | 百株      | 百株     | 千イギリスポンド | 千円      |                        |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 6,929   | 5,548  | 3,692    | 534,532 | 銀行                     |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 660     | 523    | 2,827    | 409,282 | 食品・飲料・タバコ              |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 251     | 187    | 193      | 28,069  | 公益事業                   |
| SCHRODERS PLC                | 43      | 38     | 118      | 17,177  | 各種金融                   |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 1,224   | 1,002  | 263      | 38,143  | 銀行                     |
| BHP BILLITON PLC             | 748     | 587    | 714      | 103,403 | 素材                     |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 339     | 268    | 986      | 142,831 | 食品・飲料・タバコ              |
| WPP PLC                      | 463     | 354    | 608      | 88,107  | メディア                   |
| CENTRICA PLC                 | 1,805   | 1,569  | 315      | 45,721  | 公益事業                   |
| BT GROUP PLC                 | 2,996   | 2,358  | 734      | 106,378 | 電気通信サービス               |
| SSE PLC                      | 359     | 282    | 425      | 61,611  | 公益事業                   |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 1,158   | 914    | 673      | 97,475  | 銀行                     |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC     | 650     | 506    | 431      | 62,405  | 資本財                    |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C   | 46,179  | 37,114 | 3        | 537     | 資本財                    |
| COMPASS GROUP PLC            | 580     | 457    | 731      | 105,906 | 消費者サービス                |
| KINGFISHER PLC               | 802     | 629    | 231      | 33,524  | 小売                     |
| PEARSON PLC                  | 289     | 236    | 164      | 23,882  | メディア                   |
| SEVERN TRENT PLC             | 87      | 65     | 158      | 22,954  | 公益事業                   |
| RIO TINTO PLC                | 439     | 346    | 1,097    | 158,852 | 素材                     |
| GLAXOSMITHKLINE PLC          | 1,722   | 1,369  | 2,256    | 326,712 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SABMILLER PLC                | 343     | —      | —        | —       | 食品・飲料・タバコ              |
| PROVIDENT FINANCIAL PLC      | 51      | 42     | 132      | 19,125  | 各種金融                   |
| 3I GROUP PLC                 | 342     | 269    | 223      | 32,320  | 各種金融                   |
| GKN PLC                      | 608     | 491    | 173      | 25,156  | 自動車・自動車部品              |
| VODAFONE GROUP PLC           | 9,393   | 7,469  | 1,645    | 238,201 | 電気通信サービス               |
| WM MORRISON SUPERMARKETS     | 793     | 639    | 155      | 22,460  | 食品・生活必需品小売り            |
| SAINSBURY (J) PLC            | 476     | 472    | 129      | 18,746  | 食品・生活必需品小売り            |
| AVIVA PLC                    | 1,430   | 1,125  | 601      | 87,014  | 保険                     |
| CAPITA PLC                   | 237     | 188    | 109      | 15,914  | 商業・専門サービス              |
| DIXONS CARPHONE PLC          | 349     | 277    | 90       | 13,141  | 小売                     |
| JOHNSON MATTHEY PLC          | 68      | 55     | 168      | 24,450  | 素材                     |
| RSA INSURANCE GROUP PLC      | 361     | 292    | 178      | 25,812  | 保険                     |
| WHITBREAD PLC                | 65      | 51     | 215      | 31,147  | 消費者サービス                |
| NATIONAL GRID PLC            | 1,331   | 1,063  | 1,120    | 162,270 | 公益事業                   |
| ARM HOLDINGS PLC             | 495     | —      | —        | —       | 半導体・半導体製造装置            |
| WOLSELEY PLC                 | 90      | 71     | 350      | 50,779  | 資本財                    |
| BUNZL PLC                    | 120     | 95     | 233      | 33,856  | 資本財                    |
| COBHAM PLC                   | 414     | 479    | 66       | 9,638   | 資本財                    |
| ANGLO AMERICAN PLC           | 495     | 384    | 420      | 60,827  | 素材                     |
| INTERTEK GROUP PLC           | 57      | 43     | 179      | 25,938  | 商業・専門サービス              |
| WILLIAM HILL PLC             | 312     | 237    | 68       | 9,963   | 消費者サービス                |
| BURBERRY GROUP PLC           | 159     | 125    | 214      | 31,054  | 耐久消費財・アパレル             |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 68      | 51     | 218      | 31,582  | 消費者サービス                |
| CARNIVAL PLC                 | 67      | 53     | 255      | 36,955  | 消費者サービス                |
| PERSIMMON PLC                | 109     | 88     | 214      | 31,006  | 耐久消費財・アパレル             |
| MEGGITT PLC                  | 272     | 220    | 107      | 15,536  | 資本財                    |
| ICAP PLC                     | 193     | —      | —        | —       | 各種金融                   |
| ITV PLC                      | 1,368   | 1,019  | 199      | 28,916  | メディア                   |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  | 110     | 89     | 309      | 44,792  | 各種金融                   |
| G4S PLC                      | 550     | 410    | 132      | 19,162  | 商業・専門サービス              |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE  | 46      | 37     | 126      | 18,337  | 耐久消費財・アパレル             |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 358     | 288    | 175      | 25,438  | 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  |                        |  |
| (イギリス)                        | 百株      | 百株      | 千イギリスポンド | 千円      |                        |  |
| IMI PLC                       | 95      | 77      | 96       | 14,015  | 資本財                    |  |
| REXAM PLC                     | 250     | —       | —        | —       | 素材                     |  |
| SMITH & NEPHEW PLC            | 314     | 249     | 331      | 47,943  | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| TATE & LYLE PLC               | 161     | 132     | 103      | 14,935  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| TAYLOR WIMPEY PLC             | 1,157   | 926     | 183      | 26,569  | 耐久消費財・アパレル             |  |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS   | 1,394   | 1,221   | 2,587    | 374,541 | エネルギー                  |  |
| PETROFAC LTD                  | 94      | 72      | 47       | 6,870   | エネルギー                  |  |
| TRAVIS PERKINS PLC            | 86      | 70      | 117      | 16,958  | 資本財                    |  |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS   | 1,403   | 1,055   | 2,284    | 330,652 | エネルギー                  |  |
| OLD MUTUAL PLC                | 1,743   | 1,401   | 267      | 38,753  | 保険                     |  |
| INVESTEC PLC                  | 192     | 187     | 112      | 16,323  | 各種金融                   |  |
| STANDARD LIFE PLC             | 689     | 565     | 216      | 31,395  | 保険                     |  |
| EXPERIAN PLC                  | 341     | 270     | 440      | 63,806  | 商業・専門サービス              |  |
| MONDI PLC                     | 130     | 98      | 194      | 28,223  | 素材                     |  |
| WEIR GROUP PLC/THE            | 77      | 62      | 119      | 17,232  | 資本財                    |  |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC  | 125     | 100     | 289      | 41,978  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| ANTOFAGASTA PLC               | 135     | 109     | 88       | 12,806  | 素材                     |  |
| SHIRE PLC                     | 209     | 253     | 1,230    | 178,059 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| INMARSAT PLC                  | 157     | 128     | 100      | 14,608  | 電気通信サービス               |  |
| ADMIRAL GROUP PLC             | 74      | 55      | 110      | 15,982  | 保険                     |  |
| FRESNILLO PLC                 | 80      | 62      | 100      | 14,531  | 素材                     |  |
| RANDGOLD RESOURCES LTD        | 32      | 26      | 194      | 28,200  | 素材                     |  |
| AGGREKO PLC                   | 93      | —       | —        | —       | 商業・専門サービス              |  |
| BABCOCK INTL GROUP PLC        | 92      | 74      | 69       | 10,126  | 商業・専門サービス              |  |
| ST JAMES' S PLACE PLC         | 188     | 149     | 174      | 25,304  | 保険                     |  |
| GLENCORE PLC                  | 4,329   | 3,428   | 1,011    | 146,495 | 素材                     |  |
| ABERDEEN ASSET MGMT PLC       | 321     | 254     | 73       | 10,652  | 各種金融                   |  |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC       | 92      | 72      | 99       | 14,334  | 各種金融                   |  |
| CRODA INTERNATIONAL PLC       | 46      | 37      | 146      | 21,238  | 素材                     |  |
| COCA-COLA HBC AG-DI           | 70      | 51      | 114      | 16,552  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| EASYJET PLC                   | 57      | 47      | 59       | 8,673   | 運輸                     |  |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP   | 489     | 386     | 136      | 19,697  | 保険                     |  |
| ROYAL MAIL PLC                | 320     | 253     | 108      | 15,718  | 運輸                     |  |
| ASHTREAD GROUP PLC            | 177     | 142     | 222      | 32,267  | 資本財                    |  |
| SPORTS DIRECT INTERNATIONAL   | 96      | —       | —        | —       | 小売                     |  |
| MERLIN ENTERTAINMENT          | 252     | 198     | 101      | 14,762  | 消費者サービス                |  |
| TUI AG-DI                     | 178     | 142     | 161      | 23,379  | 消費者サービス                |  |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC     | —       | 40      | 70       | 10,243  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC  | 129     | 104     | 91       | 13,195  | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| AUTO TRADER GROUP PLC         | 277     | 286     | 116      | 16,826  | ソフトウェア・サービス            |  |
| WORLDPAY GROUP PLC            | 506     | 482     | 155      | 22,460  | ソフトウェア・サービス            |  |
| DCC PLC                       | —       | 25      | 186      | 26,961  | 資本財                    |  |
| 小 計                           | 株数・金額   | 149,119 | 120,530  | 52,465  | 7,594,890              |  |
|                               | 銘柄数<比率> | 109     | 105      | —       | <7.2%>                 |  |
| (スイス)                         |         |         |          | 千スイスフラン |                        |  |
| NESTLE SA-REG                 | 1,128   | 872     | 7,186    | 822,765 | 食品・飲料・タバコ              |  |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG  | 184     | 146     | 1,194    | 136,781 | 耐久消費財・アパレル             |  |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG    | 636     | 565     | 794      | 90,989  | 各種金融                   |  |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG         | 161     | 126     | 687      | 78,731  | 素材                     |  |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN | 248     | 197     | 5,267    | 603,061 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| GIVAUDAN-REG                  | 3       | 2       | 520      | 59,584  | 素材                     |  |
| SONOVA HOLDING AG-REG         | 18      | 14      | 231      | 26,528  | ヘルスケア機器・サービス           |  |



| 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                 |     |
| (スイス)                        | 百株    | 百株    | 千スイスフラン     | 千円      |                        |     |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 53    | 42    | 1,204       | 137,929 | 保険                     |     |
| SYNGENTA AG-REG              | 32    | 25    | 1,173       | 134,409 | 素材                     |     |
| LONZA GROUP AG-REG           | 18    | 16    | 325         | 37,320  | 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      | 17    | 14    | 109         | 12,524  | 耐久消費財・アパレル             |     |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 15    | 12    | 253         | 29,017  | 資本財                    |     |
| GEBERIT AG-REG               | 13    | 10    | 477         | 54,640  | 資本財                    |     |
| SWISS RE AG                  | 124   | 89    | 789         | 90,363  | 保険                     |     |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR       | 10    | 8     | 336         | 38,489  | 耐久消費財・アパレル             |     |
| PARGESA HOLDING SA-BR        | 11    | 9     | 70          | 8,074   | 各種金融                   |     |
| NOVARTIS AG-REG              | 805   | 626   | 4,935       | 565,119 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |
| ADECCO GROUP AG-REG          | 58    | 46    | 348         | 39,868  | 商業・専門サービス              |     |
| SWISSCOM AG-REG              | 9     | 7     | 334         | 38,301  | 電気通信サービス               |     |
| ABB LTD-REG                  | 778   | 535   | 1,300       | 148,917 | 資本財                    |     |
| SGS SA-REG                   | 1     | 1     | 364         | 41,719  | 商業・専門サービス              |     |
| SULZER AG-REG                | 5     | —     | —           | —       | 資本財                    |     |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG     | 7     | 4     | 99          | 11,373  | 資本財                    |     |
| ACTELION LTD-REG             | 36    | 26    | 736         | 84,357  | 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   | 19    | 15    | 236         | 27,081  | 運輸                     |     |
| BALOISE HOLDING AG - REG     | 17    | 14    | 208         | 23,889  | 保険                     |     |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | 11    | 9     | 295         | 33,869  | 保険                     |     |
| CHOCOLAFABRIKEN LINDT-REG    | 0.04  | 0.03  | 208         | 23,826  | 食品・飲料・タバコ              |     |
| ARYZTA AG                    | 29    | 24    | 86          | 9,895   | 食品・飲料・タバコ              |     |
| JULIUS BAER GROUP LTD        | 78    | 64    | 332         | 38,036  | 各種金融                   |     |
| SIKA AG-BR                   | 0.76  | 0.59  | 373         | 42,724  | 素材                     |     |
| SWISS PRIME SITE-REG         | 23    | 20    | 177         | 20,322  | 不動産                    |     |
| CHOCOLAFABRIKEN LINDT-PC     | 0.34  | 0.28  | 163         | 18,705  | 食品・飲料・タバコ              |     |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 5     | 4     | 284         | 32,527  | 各種金融                   |     |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG       | 0.83  | 0.61  | 84          | 9,637   | 食品・飲料・タバコ              |     |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    | 2     | 2     | 155         | 17,819  | 素材                     |     |
| UBS GROUP AG-REG             | 1,295 | 1,030 | 1,643       | 188,199 | 各種金融                   |     |
| DUFREY AG-REG                | 14    | 10    | 174         | 19,986  | 小売                     |     |
| GALENICA AG-REG              | 1     | 1     | 131         | 15,059  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |
| 小計                           | 株数    | 5,884 | 4,603       | 33,299  | 3,812,450              |     |
| 銘柄数 < 比率 >                   |       | 39    | 38          | —       | < 3.6% >               |     |
| (スウェーデン)                     |       |       | 千スウェーデンクローネ |         |                        |     |
| ELECTROLUX AB-SER B          | 84    | 63    | 1,696       | 21,665  | 耐久消費財・アパレル             |     |
| ERICSSON LM-B SHS            | 1,078 | 843   | 4,891       | 62,465  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         | 138   | 110   | 3,126       | 39,922  | 資本財                    |     |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 539   | 418   | 4,406       | 56,267  | 銀行                     |     |
| INVESTOR AB-B SHS            | 161   | 128   | 5,110       | 65,266  | 各種金融                   |     |
| NORDEA BANK AB               | 1,076 | 849   | 9,747       | 124,476 | 銀行                     |     |
| GETINGE AB-B SHS             | 73    | 56    | 1,008       | 12,879  | ヘルスケア機器・サービス           |     |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 527   | 435   | 5,444       | 69,529  | 銀行                     |     |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         | 237   | 185   | 5,879       | 75,077  | 資本財                    |     |
| SKF AB-B SHARES              | 141   | 112   | 2,011       | 25,686  | 資本財                    |     |
| ASSA ABLOY AB-B              | 353   | 284   | 5,391       | 68,848  | 資本財                    |     |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS    | 335   | 261   | 5,792       | 73,965  | 小売                     |     |
| SANDVIK AB                   | 375   | 291   | 3,935       | 50,261  | 資本財                    |     |
| SWEDBANK AB - A SHARES       | 318   | 258   | 5,335       | 68,128  | 銀行                     |     |
| SECURITAS AB-B SHS           | 111   | 90    | 1,246       | 15,920  | 商業・専門サービス              |     |
| SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B   | 213   | 172   | 5,174       | 66,082  | 家庭用品・パーソナル用品           |     |
| SKANSKA AB-B SHS             | 135   | 95    | 1,970       | 25,158  | 資本財                    |     |

| 銘柄                         | 株数      | 当 期 末 |             |         | 業 種 等                  |  |
|----------------------------|---------|-------|-------------|---------|------------------------|--|
|                            |         | 株数    | 評 価 額       |         |                        |  |
|                            |         |       | 外貨建金額       | 邦貨換算金額  |                        |  |
| (スウェーデン)                   | 百株      | 百株    | 千スウェーデンクローネ | 千円      |                        |  |
| SWEDISH MATCH AB           | 69      | 54    | 1,595       | 20,374  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| TELE2 AB-B SHS             | 117     | 104   | 901         | 11,517  | 電気通信サービス               |  |
| TELIA CO AB                | 939     | 735   | 2,828       | 36,116  | 電気通信サービス               |  |
| VOLVO AB-B SHS             | 543     | 440   | 6,283       | 80,245  | 資本財                    |  |
| ALFA LAVAL AB              | 103     | 83    | 1,439       | 18,378  | 資本財                    |  |
| LUNDIN PETROLEUM AB        | 79      | 54    | 960         | 12,261  | エネルギー                  |  |
| BOLIDEN AB                 | 93      | 77    | 1,892       | 24,167  | 素材                     |  |
| HUSQVARNA AB-B SHS         | 144     | 116   | 1,013       | 12,936  | 耐久消費財・アパレル             |  |
| MILLICOM INTL CELLULAR-SDR | 24      | 18    | 895         | 11,431  | 電気通信サービス               |  |
| HEXAGON AB-B SHS           | 91      | 70    | 2,733       | 34,909  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| KINNEVIK AB - B            | 84      | 66    | 1,578       | 20,162  | 各種金融                   |  |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS    | 50      | 44    | 902         | 11,523  | 各種金融                   |  |
| ICA GRUPPEN AB             | 28      | 22    | 706         | 9,016   | 食品・生活必需品小売り            |  |
| LUNDBERGS AB-B SHS         | —       | 10    | 663         | 8,472   | 各種金融                   |  |
| 小 計                        | 株数・金額   | 8,273 | 6,557       | 96,563  | 1,233,117              |  |
|                            | 銘柄数<比率> | 30    | 31          | —       | <1.2%>                 |  |
| (ノルウェー)                    |         |       | 千ノルウェークローネ  |         |                        |  |
| DNB ASA                    | 349     | 267   | 3,900       | 51,909  | 銀行                     |  |
| NORSK HYDRO ASA            | 475     | 378   | 1,811       | 24,111  | 素材                     |  |
| ORKLA ASA                  | 286     | 228   | 1,941       | 25,841  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| STATOIL ASA                | 394     | 312   | 4,788       | 63,739  | エネルギー                  |  |
| TELENOR ASA                | 264     | 212   | 2,831       | 37,693  | 電気通信サービス               |  |
| YARA INTERNATIONAL ASA     | 63      | 50    | 1,626       | 21,654  | 素材                     |  |
| MARINE HARVEST             | —       | 109   | 1,687       | 22,458  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA  | 69      | 56    | 766         | 10,198  | 保険                     |  |
| SCHIBSTED ASA-CL A         | 27      | 22    | 463         | 6,162   | メディア                   |  |
| SCHIBSTED ASA-B SHS        | 32      | 25    | 483         | 6,432   | メディア                   |  |
| 小 計                        | 株数・金額   | 1,965 | 1,663       | 20,300  | 270,201                |  |
|                            | 銘柄数<比率> | 9     | 10          | —       | <0.3%>                 |  |
| (デンマーク)                    |         |       | 千デンマーククローネ  |         |                        |  |
| NOVO NORDISK A/S-B         | 693     | 536   | 14,624      | 245,108 | 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     | 82      | 64    | 1,893       | 31,737  | 素材                     |  |
| DANSKE BANK A/S            | 250     | 191   | 4,806       | 80,554  | 銀行                     |  |
| WILLIAM DEMANT HOLDING     | 9       | 34    | 561         | 9,406   | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S    | 79      | 60    | 3,670       | 61,517  | 資本財                    |  |
| TDC A/S                    | 280     | 229   | 842         | 14,118  | 電気通信サービス               |  |
| CARLSBERG AS-B             | 37      | 30    | 2,092       | 35,074  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| COLOPLAST-B                | 39      | 33    | 1,855       | 31,105  | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| DSV A/S                    | 68      | 54    | 2,132       | 35,741  | 運輸                     |  |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B     | 2       | 1     | 2,226       | 37,312  | 運輸                     |  |
| TRYG A/S                   | 39      | 33    | 450         | 7,545   | 保険                     |  |
| AP MOELLER-MAERSK A/S-A    | 1       | 1     | 1,298       | 21,766  | 運輸                     |  |
| PANDORA A/S                | 38      | 31    | 2,114       | 35,447  | 耐久消費財・アパレル             |  |
| ISS A/S                    | 52      | 47    | 1,319       | 22,114  | 商業・専門サービス              |  |
| CHR HANSEN HOLDING A/S     | 35      | 28    | 1,318       | 22,096  | 素材                     |  |
| GENMAB A/S                 | 19      | 16    | 2,268       | 38,025  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| DONG ENERGY A/S            | —       | 42    | 1,188       | 19,925  | 公益事業                   |  |
| 小 計                        | 株数・金額   | 1,731 | 1,439       | 44,665  | 748,598                |  |
|                            | 銘柄数<比率> | 16    | 17          | —       | <0.7%>                 |  |
| (オーストラリア)                  |         |       | 千オーストラリアドル  |         |                        |  |
| BHP BILLITON LIMITED       | 1,140   | 903   | 2,194       | 182,233 | 素材                     |  |
| CSL LTD                    | 165     | 128   | 1,679       | 139,451 | 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  |              |
| (オーストラリア)                    | 百株      | 百株    | 千オーストラリアドル | 千円      |              |
| ALUMINA LTD                  | 896     | 700   | 128        | 10,701  | 素材           |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD       | 263     | 208   | 675        | 56,093  | エネルギー        |
| AUST AND NZ BANKING GROUP    | 1,033   | 825   | 2,352      | 195,318 | 銀行           |
| RIO TINTO LTD                | 150     | 117   | 741        | 61,575  | 素材           |
| QBE INSURANCE GROUP LTD      | 488     | 374   | 480        | 39,902  | 保険           |
| LENLEASE GROUP               | 198     | 160   | 262        | 21,803  | 不動産          |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 606     | 484   | 3,887      | 322,762 | 銀行           |
| WESTPAC BANKING CORP         | 1,180   | 941   | 2,905      | 241,265 | 銀行           |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD  | 933     | 749   | 2,276      | 188,984 | 銀行           |
| BRAMBLES LTD                 | 566     | 457   | 470        | 39,073  | 商業・専門サービス    |
| QANTAS AIRWAYS LTD           | 206     | 157   | 76         | 6,369   | 運輸           |
| BORAL LTD                    | 268     | 340   | 225        | 18,739  | 素材           |
| WOOLWORTHS LTD               | 452     | 358   | 927        | 77,023  | 食品・生活必需品小売り  |
| TELSTRA CORP LTD             | 1,529   | 1,144 | 507        | 42,106  | 電気通信サービス     |
| AMP LTD                      | 1,062   | 846   | 429        | 35,684  | 各種金融         |
| TABCORP HOLDINGS LTD         | 295     | 246   | 112        | 9,368   | 消費者サービス      |
| AMCOR LIMITED                | 415     | 335   | 503        | 41,793  | 素材           |
| COMPUTERSHARE LTD            | 169     | 136   | 197        | 16,366  | ソフトウェア・サービス  |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD       | 197     | 146   | 295        | 24,524  | 消費者サービス      |
| MACQUARIE GROUP LTD          | 109     | 85    | 751        | 62,381  | 各種金融         |
| CIMIC GROUP LTD              | 38      | 27    | 109        | 9,094   | 資本財          |
| ASX LTD                      | 70      | 56    | 289        | 24,059  | 各種金融         |
| COCA-COLA AMATIL LTD         | 214     | 168   | 155        | 12,879  | 食品・飲料・タバコ    |
| COCHLEAR LTD                 | 20      | 16    | 239        | 19,905  | ヘルスケア機器・サービス |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI  | 161     | 126   | 255        | 21,191  | 素材           |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD   | 206     | 173   | 66         | 5,515   | 小売           |
| NEWCREST MINING LTD          | 270     | 219   | 457        | 38,002  | 素材           |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP    | 889     | 685   | 424        | 35,274  | 保険           |
| ORIGIN ENERGY LTD            | 625     | 503   | 381        | 31,710  | エネルギー        |
| ORICA LTD                    | 132     | 108   | 204        | 16,996  | 素材           |
| SONIC HEALTHCARE LTD         | 141     | 115   | 258        | 21,464  | ヘルスケア機器・サービス |
| SANTOS LTD                   | 597     | 521   | 183        | 15,252  | エネルギー        |
| SUNCORP GROUP LTD            | 459     | 356   | 498        | 41,401  | 保険           |
| TRANSURBAN GROUP             | 735     | 572   | 680        | 56,541  | 運輸           |
| WESFARMERS LTD               | 400     | 316   | 1,363      | 113,197 | 食品・生活必需品小売り  |
| CHALLENGER LTD               | 207     | 169   | 214        | 17,822  | 各種金融         |
| SYDNEY AIRPORT               | 408     | 297   | 216        | 17,978  | 運輸           |
| CALTEX AUSTRALIA LTD         | 98      | 76    | 245        | 20,419  | エネルギー        |
| OIL SEARCH LTD               | 492     | 394   | 286        | 23,748  | エネルギー        |
| AGL ENERGY LTD               | 251     | 186   | 495        | 41,157  | 公益事業         |
| TATTS GROUP LTD              | 531     | 420   | 178        | 14,817  | 消費者サービス      |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD   | 573     | 452   | 236        | 19,674  | 素材           |
| ASCIANO LTD                  | 229     | —     | —          | —       | 運輸           |
| ILUKA RESOURCES LTD          | 152     | —     | —          | —       | 素材           |
| AUSNET SERVICES              | 765     | 639   | 111        | 9,290   | 公益事業         |
| CROWN RESORTS LTD            | 128     | 103   | 130        | 10,797  | 消費者サービス      |
| INCITEC PIVOT LTD            | 604     | 492   | 172        | 14,301  | 素材           |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK    | 161     | 135   | 162        | 13,494  | 銀行           |
| AURIZON HOLDINGS LTD         | 753     | 554   | 302        | 25,099  | 運輸           |
| TREASURY WINE ESTATES LTD    | 265     | 196   | 256        | 21,300  | 食品・飲料・タバコ    |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD       | 51      | 41    | 287        | 23,911  | ヘルスケア機器・サービス |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L | 21      | 14    | 53         | 4,409   | 消費者サービス      |

| 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        |              |
| SEEK LTD                     | 122          | 96           | 170         | 14,122    | 商業・専門サービス    |
| BANK OF QUEENSLAND LTD       | 134          | 96           | 113         | 9,416     | 銀行           |
| REA GROUP LTD                | 21           | 15           | 94          | 7,870     | メディア         |
| TPG TELECOM LTD              | 109          | 104          | 61          | 5,129     | 電気通信サービス     |
| HEALTHSCOPE LTD              | 633          | 513          | 108         | 8,998     | ヘルスケア機器・サービス |
| MEDIBANK PRIVATE LTD         | 985          | 794          | 223         | 18,526    | 保険           |
| PLATINUM ASSET MANAGEMENT    | 100          | —            | —           | —         | 各種金融         |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | —            | 17           | 109         | 9,082     | 消費者サービス      |
| SOUTH32 LTD                  | 1,890        | 1,518        | 397         | 33,023    | 素材           |
| VOCUS GROUP LTD              | 160          | 160          | 41          | 3,454     | 電気通信サービス     |
| 小 計                          | 株 数          | 株 数          | 32,323      | 2,683,857 |              |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 銘柄 数 < 比 率 > | —           | < 2.5% >  |              |
| (ニュージーランド)                   |              |              | 千ニュージーランドドル |           |              |
| SPARK NEW ZEALAND LTD        | 634          | 515          | 187         | 14,461    | 電気通信サービス     |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | 351          | 271          | 186         | 14,388    | 運輸           |
| CONTACT ENERGY LTD           | 262          | 208          | 106         | 8,261     | 公益事業         |
| FLETCHER BUILDING LTD        | 247          | 193          | 157         | 12,149    | 素材           |
| RYMAN HEALTHCARE LTD         | 137          | 110          | 93          | 7,219     | ヘルスケア機器・サービス |
| MERIDIAN ENERGY LTD          | 454          | 388          | 113         | 8,782     | 公益事業         |
| MERCURY NZ LTD               | 270          | 224          | 72          | 5,596     | 公益事業         |
| 小 計                          | 株 数          | 株 数          | 917         | 70,859    |              |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 銘柄 数 < 比 率 > | —           | < 0.1% >  |              |
| (香港)                         |              |              | 千香港ドル       |           |              |
| WHARF HOLDINGS LTD           | 490          | 370          | 2,466       | 35,338    | 不動産          |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A     | 205          | 155          | 1,157       | 16,591    | 不動産          |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    | 956          | 746          | 7,439       | 106,605   | 資本財          |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES      | 610          | 400          | 4,576       | 65,574    | 不動産          |
| MTR CORP                     | 525          | 425          | 1,906       | 27,314    | 運輸           |
| HONG KONG & CHINA GAS        | 2,541        | 2,219        | 3,488       | 49,993    | 公益事業         |
| NEW WORLD DEVELOPMENT        | 1,900        | 1,620        | 1,576       | 22,587    | 不動産          |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD    | 495          | 380          | 2,633       | 37,736    | 公益事業         |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  | 406          | 331          | 6,477       | 92,825    | 各種金融         |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS       | 430          | 370          | 418         | 6,001     | 運輸           |
| HANG LUNG GROUP LTD          | —            | 260          | 846         | 12,127    | 不動産          |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD     | 790          | 640          | 1,248       | 17,883    | 不動産          |
| CLP HOLDINGS LTD             | 680          | 475          | 3,940       | 56,461    | 公益事業         |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT   | 406          | 310          | 1,533       | 21,970    | 不動産          |
| BANK OF EAST ASIA LTD        | 435          | 345          | 1,119       | 16,042    | 銀行           |
| HANG SENG BANK LTD           | 273          | 217          | 3,513       | 50,344    | 銀行           |
| HYSAN DEVELOPMENT CO         | 240          | 180          | 644         | 9,234     | 不動産          |
| SHANGRI-LA ASIA LTD          | 420          | 360          | 399         | 5,726     | 消費者サービス      |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY       | 92           | 71           | 784         | 11,242    | 半導体・半導体製造装置  |
| SINO LAND CO                 | 1,062        | 882          | 1,176       | 16,860    | 不動産          |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG     | 260          | 210          | 668         | 9,584     | 耐久消費財・アパレル   |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE   | 240          | 190          | 1,270       | 18,201    | 公益事業         |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD   | 1,325        | 1,050        | 3,601       | 51,609    | 銀行           |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 490          | 395          | 1,364       | 19,556    | 耐久消費財・アパレル   |
| PCCW LTD                     | 1,550        | 1,230        | 548         | 7,861     | 電気通信サービス     |
| LI & FUNG LTD                | 2,184        | 1,684        | 525         | 7,529     | 耐久消費財・アパレル   |
| KERRY PROPERTIES LTD         | 245          | 185          | 527         | 7,555     | 不動産          |
| NWS HOLDINGS LTD             | 560          | 440          | 658         | 9,432     | 資本財          |
| SANDS CHINA LTD              | 864          | 692          | 2,345       | 33,616    | 消費者サービス      |

| 銘柄                           | 株数               | 当 期 末        |              |             | 業 種 等                  |  |
|------------------------------|------------------|--------------|--------------|-------------|------------------------|--|
|                              |                  | 株数           | 評 価 額        |             |                        |  |
|                              |                  |              | 外貨建金額        | 邦貨換算金額      |                        |  |
| (香港)                         | 百株               | 百株           | 千香港ドル        | 千円          |                        |  |
| WHEELLOCK & CO LTD           | 320              | 230          | 1,368        | 19,610      | 不動産                    |  |
| WYNN MACAU LTD               | 576              | 468          | 756          | 10,837      | 消費者サービス                |  |
| SJM HOLDINGS LTD             | 700              | 580          | 411          | 5,901       | 消費者サービス                |  |
| FIRST PACIFIC CO             | 860              | 460          | 280          | 4,014       | 各種金融                   |  |
| AIA GROUP LTD                | 4,266            | 3,388        | 18,532       | 265,568     | 保険                     |  |
| SWIRE PROPERTIES LTD         | 430              | 334          | 863          | 12,372      | 不動産                    |  |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 840              | 670          | 2,680        | 38,404      | 消費者サービス                |  |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD       | 348              | 292          | 477          | 6,845       | 消費者サービス                |  |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS     | 940              | 1,080        | 1,090        | 15,631      | 電気通信サービス               |  |
| WH GROUP LTD                 | 2,090            | 2,125        | 1,479        | 21,194      | 食品・飲料・タバコ              |  |
| CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING | 956              | 766          | 4,390        | 62,917      | 不動産                    |  |
| 小 計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 33,002<br>39 | 27,227<br>40 | 91,186<br>— | 1,306,708<br><1.2%>    |  |
| (シンガポール)                     |                  |              | 千シンガポールドル    |             |                        |  |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 1,099            | 895          | 931          | 74,917      | 銀行                     |  |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 568              | 453          | 149          | 12,033      | メディア                   |  |
| SEBPCORP INDUSTRIES LTD      | 375              | 293          | 92           | 7,397       | 資本財                    |  |
| CAPITALAND LTD               | 920              | 756          | 266          | 21,458      | 不動産                    |  |
| CITY DEVELOPMENTS LTD        | 143              | 124          | 129          | 10,399      | 不動産                    |  |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 42               | 29           | 132          | 10,675      | 小売                     |  |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 626              | 493          | 1,020        | 82,059      | 銀行                     |  |
| KEPPEL CORP LTD              | 515              | 413          | 267          | 21,486      | 資本財                    |  |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD     | 459              | 364          | 847          | 68,109      | 銀行                     |  |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING   | 556              | 455          | 166          | 13,354      | 資本財                    |  |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 2,825            | 2,247        | 838          | 67,421      | 電気通信サービス               |  |
| SINGAPORE AIRLINES LTD       | 206              | 167          | 167          | 13,433      | 運輸                     |  |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 288              | 225          | 162          | 13,062      | 各種金融                   |  |
| SEBPCORP MARINE LTD          | 315              | —            | —            | —           | 資本財                    |  |
| UOL GROUP LTD                | 166              | 138          | 94           | 7,612       | 不動産                    |  |
| COMFORTDELGRO CORP LTD       | 765              | 617          | 149          | 12,006      | 運輸                     |  |
| NOBLE GROUP LTD              | 1,738            | —            | —            | —           | 資本財                    |  |
| STARHUB LTD                  | 245              | 159          | 42           | 3,452       | 電気通信サービス               |  |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD    | 2,673            | 2,089        | 79           | 6,384       | 食品・飲料・タバコ              |  |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 688              | 494          | 181          | 14,578      | 食品・飲料・タバコ              |  |
| GENTING SINGAPORE PLC        | 2,260            | 1,774        | 204          | 16,404      | 消費者サービス                |  |
| SATS LTD                     | —                | 190          | 100          | 8,082       | 運輸                     |  |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L | 1,119            | 784          | 229          | 18,471      | 不動産                    |  |
| YANGZIJANG SHIPBUILDING      | 706              | 513          | 62           | 5,011       | 資本財                    |  |
| 小 計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 19,300<br>23 | 13,674<br>22 | 6,315<br>—  | 507,812<br><0.5%>      |  |
| (イスラエル)                      |                  |              | 千イスラエルシェケル   |             |                        |  |
| ISRAEL CHEMICALS LTD         | 185              | 144          | 224          | 6,993       | 素材                     |  |
| TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD  | 323              | —            | —            | —           | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| BANK HAPALIM BM              | 373              | 301          | 696          | 21,677      | 銀行                     |  |
| NICE LTD                     | 19               | 17           | 464          | 14,475      | ソフトウェア・サービス            |  |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         | 491              | 409          | 695          | 21,662      | 銀行                     |  |
| ELBIT SYSTEMS LTD            | —                | 6            | 292          | 9,111       | 資本財                    |  |
| DELEK GROUP LTD              | 1                | —            | —            | —           | エネルギー                  |  |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO | 671              | 582          | 362          | 11,291      | 電気通信サービス               |  |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD     | 46               | 38           | 244          | 7,610       | 銀行                     |  |
| AZRIELI GROUP LTD            | 12               | 11           | 242          | 7,535       | 不動産                    |  |

| 銘柄                  | 株数               | 当期               |                   | 業種等               |    |
|---------------------|------------------|------------------|-------------------|-------------------|----|
|                     |                  | 期首(前期末)          | 期末                |                   |    |
|                     |                  | 株数               | 株数                |                   |    |
| (イスラエル)<br>FRUTAROM | 百株<br>—          | 百株<br>10         | 千イスラエルシェケル<br>232 | 千円<br>7,249       | 素材 |
| 小計                  | 株数・金額<br>2,125   | 株数・金額<br>1,522   | 外貨建金額<br>3,456    | 邦貨換算金額<br>107,606 |    |
|                     | 銘柄数<比率><br>9     | 銘柄数<比率><br>9     | —                 | <0.1%>            |    |
| 合計                  | 株数・金額<br>473,185 | 株数・金額<br>364,515 | —                 | 101,254,143       |    |
|                     | 銘柄数<比率><br>1,260 | 銘柄数<比率><br>1,261 | —                 | <95.7%>           |    |

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

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

## 外国投資信託証券

| 銘柄                           | 期首(前期末)      |     | 当 期 末   |         |           |     |
|------------------------------|--------------|-----|---------|---------|-----------|-----|
|                              | 口 数          | 口 数 | 評 価 額   |         | 比 率       |     |
|                              |              |     | 外貨建金額   | 邦貨換算金額  |           |     |
| (アメリカ)                       | 千口           | 千口  | 千アメリカドル | 千円      | %         |     |
| HCP INC                      | 16           | 13  | 419     | 46,836  | 0.0       |     |
| MACERICH CO/THE              | 4            | 3   | 190     | 21,249  | 0.0       |     |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | —            | 2   | 247     | 27,562  | 0.0       |     |
| PROLOGIS INC                 | 18           | 14  | 811     | 90,481  | 0.1       |     |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 3            | 2   | 203     | 22,726  | 0.0       |     |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | —            | 4   | 157     | 17,608  | 0.0       |     |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 5            | 4   | 501     | 55,976  | 0.1       |     |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 2            | 1   | 470     | 52,469  | 0.0       |     |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 4            | 3   | 275     | 30,756  | 0.0       |     |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 2            | 2   | 255     | 28,450  | 0.0       |     |
| WELLTOWER INC                | 12           | 10  | 735     | 82,010  | 0.1       |     |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 5            | 4   | 529     | 59,064  | 0.1       |     |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 2            | 3   | 316     | 35,335  | 0.0       |     |
| REALTY INCOME CORP           | 8            | 7   | 395     | 44,156  | 0.0       |     |
| REGENCY CENTERS CORP         | 3            | 4   | 262     | 29,268  | 0.0       |     |
| SL GREEN REALTY CORP         | 3            | 2   | 294     | 32,857  | 0.0       |     |
| UDR INC                      | 9            | 7   | 288     | 32,174  | 0.0       |     |
| VENTAS INC                   | 11           | 9   | 656     | 73,217  | 0.1       |     |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 32           | 28  | 328     | 36,641  | 0.0       |     |
| WEYERHAEUSER CO              | 27           | 20  | 684     | 76,316  | 0.1       |     |
| AMERICAN TOWER CORP          | 15           | 11  | 1,536   | 171,352 | 0.2       |     |
| AGNC INVESTMENT CORP         | 11           | 9   | 184     | 20,560  | 0.0       |     |
| VEREIT INC                   | 32           | 27  | 216     | 24,095  | 0.0       |     |
| DUKE REALTY CORP             | 12           | 10  | 287     | 32,074  | 0.0       |     |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC   | 6            | 8   | 163     | 18,258  | 0.0       |     |
| IRON MOUNTAIN INC            | 7            | 6   | 235     | 26,227  | 0.0       |     |
| EQUINIX INC                  | 2            | 2   | 881     | 98,291  | 0.1       |     |
| CROWN CASTLE INTL CORP       | 11           | 10  | 1,020   | 113,799 | 0.1       |     |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 12           | 10  | 662     | 73,874  | 0.1       |     |
| COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A | —            | 14  | 197     | 22,009  | 0.0       |     |
| GGP INC                      | 20           | 16  | 373     | 41,611  | 0.0       |     |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 26           | 20  | 378     | 42,225  | 0.0       |     |
| LIBERTY PROPERTY TRUST       | 5            | 4   | 170     | 19,015  | 0.0       |     |
| PUBLIC STORAGE               | 5            | 4   | 897     | 100,118 | 0.1       |     |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 10           | 8   | 1,395   | 155,626 | 0.1       |     |
| VORNADO REALTY TRUST         | 6            | 4   | 454     | 50,673  | 0.0       |     |
| KIMCO REALTY CORP            | 14           | 11  | 208     | 23,285  | 0.0       |     |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 4            | 3   | 726     | 81,083  | 0.1       |     |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額    | 381 | 336     | 18,014  | 2,009,344 |     |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 35  | 38      | —       | <1.9%>    |     |
| (カナダ)                        |              |     |         | 千カナダドル  |           |     |
| SMART REAL ESTATE INVESTMENT |              | 2   | 1       | 56      | 4,687     | 0.0 |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS |              | 4   | 4       | 90      | 7,492     | 0.0 |

| 銘柄                           | 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  |              | 5       | 4     | 106        | 8,754     | 0.0 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額    | 12      | 10    | 254        | 20,934    |     |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 3       | 3     | —          | < 0.0% >  |     |
| (ユーロ…フランス)                   |              |         |       | 千ユーロ       |           |     |
| GECINA SA                    |              | 1       | 1     | 156        | 19,563    | 0.0 |
| KLEPIERRE                    |              | 7       | 6     | 228        | 28,541    | 0.0 |
| UNIBAIL-RODAMCO SE           |              | 3       | 2     | 649        | 81,011    | 0.1 |
| FONCIERE DES REGIONS         |              | 1       | 0.948 | 76         | 9,551     | 0.0 |
| ICADE                        |              | 1       | 1     | 76         | 9,553     | 0.0 |
| ユ ー ロ 計                      | 口 数 ・ 金 額    | 14      | 12    | 1,187      | 148,221   |     |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 5       | 5     | —          | < 0.1% >  |     |
| (イギリス)                       |              |         |       | 千イギリスポンド   |           |     |
| BRITISH LAND CO PLC          |              | 34      | 25    | 163        | 23,623    | 0.0 |
| HAMMERSON PLC                |              | 27      | 22    | 128        | 18,650    | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    |              | 28      | 21    | 228        | 33,082    | 0.0 |
| INTU PROPERTIES PLC          |              | 34      | 26    | 69         | 9,994     | 0.0 |
| SEGRO PLC                    |              | 26      | 23    | 112        | 16,325    | 0.0 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額    | 151     | 118   | 702        | 101,676   |     |
|                              | 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             |              | 123     | 97    | 264        | 21,956    | 0.0 |
| SCENTRE GROUP                |              | 189     | 147   | 611        | 50,783    | 0.0 |
| GPT GROUP                    |              | 65      | 52    | 267        | 22,230    | 0.0 |
| MIRVAC GROUP                 |              | 134     | 107   | 245        | 20,350    | 0.0 |
| STOCKLAND                    |              | 86      | 70    | 322        | 26,786    | 0.0 |
| WESTFIELD CORP               |              | 70      | 54    | 446        | 37,073    | 0.0 |
| DEXUS                        |              | 35      | 28    | 284        | 23,583    | 0.0 |
| GOODMAN GROUP                |              | 63      | 49    | 411        | 34,200    | 0.0 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額    | 768     | 606   | 2,853      | 236,965   |     |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 8       | 8     | —          | < 0.2% >  |     |
| (香港)                         |              |         |       | 千香港ドル      |           |     |
| LINK REIT                    |              | 79      | 63    | 3,708      | 53,141    | 0.1 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額    | 79      | 63    | 3,708      | 53,141    |     |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 1       | 1     | —          | < 0.1% >  |     |
| (シンガポール)                     |              |         |       | 千シンガポールドル  |           |     |
| SUNTEC REIT                  |              | 91      | 72    | 128        | 10,318    | 0.0 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST  |              | 80      | 63    | 106        | 8,578     | 0.0 |
| CAPITALAND MALL TRUST        |              | 87      | 71    | 139        | 11,192    | 0.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT |              | 77      | 71    | 182        | 14,701    | 0.0 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額    | 336     | 278   | 557        | 44,791    |     |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 4       | 4     | —          | < 0.0% >  |     |
| 合 計                          | 口 数 ・ 金 額    | 1,743   | 1,425 | —          | 2,615,075 |     |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 61      | 64    | —          | < 2.5% >  |     |

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

(注) 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<br>国 | 株式先物取引 | SP EMINI | 1,195 | —     |
|        |        | SP/TSE60 | 74    | —     |
|        |        | SWISS IX | 61    | —     |
|        |        | EURO ST  | 298   | —     |
|        |        | SPI 200  | 83    | —     |
|        |        | FTSE100  | 129   | —     |
|        |        |          |       | 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

(2017年5月22日現在)

| 項 目          | 当 期         |       |
|--------------|-------------|-------|
|              | 評 価 額       | 比 率   |
| 株式           | 101,254,143 | 95.3  |
| 投資証券         | 2,615,075   | 2.5   |
| コール・ローン等、その他 | 2,332,056   | 2.2   |
| 投資信託財産総額     | 106,201,274 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産 (105,755,144千円) の投資信託財産総額 (106,201,274千円) に対する比率は99.6%です。

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

|                    |                     |                    |                    |
|--------------------|---------------------|--------------------|--------------------|
| 1 アメリカドル=111.54円   | 1 カナダドル=82.39円      | 1 ユーロ=124.79円      | 1 イギリスポンド=144.76円  |
| 1 スイスフラン=114.49円   | 1 スウェーデンクローネ=12.77円 | 1 ノルウェークローネ=13.31円 | 1 デンマーククローネ=16.76円 |
| 1 オーストラリアドル=83.03円 | 1 ニュージーランドドル=77.24円 | 1 香港ドル=14.33円      | 1 シンガポールドル=80.41円  |
| 1 イスラエルシェゲル=31.13円 |                     |                    |                    |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月22日現在)

| 項 目             | 当 期 末           |
|-----------------|-----------------|
|                 | 円               |
| (A) 資産          | 106,273,636,085 |
| コール・ローン等        | 1,565,364,088   |
| 株式(評価額)         | 101,254,143,231 |
| 投資証券(評価額)       | 2,615,075,622   |
| 未収入金            | 89,539,121      |
| 未収配当金           | 221,051,011     |
| 差入委託証拠金         | 528,463,012     |
| (B) 負債          | 522,547,917     |
| 未払金             | 80,349,813      |
| 未払解約金           | 442,197,377     |
| 未払利息            | 727             |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 105,751,088,168 |
| 元本              | 51,068,162,940  |
| 次期繰越損益金         | 54,682,925,228  |
| (D) 受益権総口数      | 51,068,162,940口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 20,708円         |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 66,611,642,280円  
 期中追加設定元本額 7,328,102,204円  
 期中一部解約元本額 22,871,581,544円  
 また、1口当たり純資産額は、期末2.0708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)                | 303,582,885円    |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)              | 1,220,174,987円  |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)                | 1,105,115,482円  |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)           | 2,488,583,685円  |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)         | 12,812,269,671円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)           | 11,314,550,173円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)             | 152,417,674円    |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)                | 329,371,847円    |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)           | 841,812,038円    |
| 三菱UFJ 外国株式ファンドVA(適格機関投資家限定)           | 20,499,300,313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)   | 10,287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) | 973,898円        |
| 合計                                    | 51,068,162,940円 |

## [お知らせ]

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める(分散型に分類)ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。  
 (2016年7月1日)

## ○損益の状況 (2016年5月21日~2017年5月22日)

| 項 目                | 当 期              |
|--------------------|------------------|
|                    | 円                |
| (A) 配当等収益          | 2,550,486,461    |
| 受取配当金              | 2,540,290,082    |
| 受取利息               | △ 550,726        |
| その他収益金             | 13,787,830       |
| 支払利息               | △ 3,040,725      |
| (B) 有価証券売買損益       | 18,629,887,883   |
| 売買益                | 22,617,929,253   |
| 売買損                | △ 3,988,041,370  |
| (C) 先物取引等取引損益      | 577,199,824      |
| 取引益                | 702,621,471      |
| 取引損                | △ 125,421,647    |
| (D) 保管費用等          | △ 64,679,596     |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 21,692,894,572   |
| (F) 前期繰越損益金        | 47,591,331,586   |
| (G) 追加信託差損益金       | 5,353,816,653    |
| (H) 解約差損益金         | △ 19,955,117,583 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 54,682,925,228   |
| 次期繰越損益金(I)         | 54,682,925,228   |

(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17期》決算日2017年5月22日

[計算期間：2016年5月21日～2017年5月22日]

「三菱UFJ 国内債券マザーファンド」は、5月22日に第17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17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     |
| 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 |
| 17期(2017年5月22日) | 13,798 | △2.0 | 379.387        | △2.0 | 99.3  | 0.3   | 212,031 |

(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<br>% | 債 先 物 比 率<br>% |
|---------------------|---------|------------|----------------|------------|----------------|----------------|
|                     | 円       | 騰 落 率<br>% |                | 騰 落 率<br>% |                |                |
| (期 首)<br>2016年5月20日 | 14,075  | —          | 386.993        | —          | 99.3           | 0.3            |
| 5月末                 | 14,096  | 0.1        | 387.599        | 0.2        | 99.6           | 0.3            |
| 6月末                 | 14,268  | 1.4        | 392.355        | 1.4        | 96.3           | 0.3            |
| 7月末                 | 14,148  | 0.5        | 389.242        | 0.6        | 100.9          | 0.4            |
| 8月末                 | 14,011  | △0.5       | 385.240        | △0.5       | 99.2           | 0.3            |
| 9月末                 | 14,021  | △0.4       | 385.504        | △0.4       | 99.6           | 0.3            |
| 10月末                | 13,983  | △0.7       | 384.444        | △0.7       | 100.7          | 0.3            |
| 11月末                | 13,893  | △1.3       | 381.967        | △1.3       | 101.2          | 0.5            |
| 12月末                | 13,815  | △1.8       | 379.825        | △1.9       | 100.8          | 0.4            |
| 2017年1月末            | 13,740  | △2.4       | 377.739        | △2.4       | 99.8           | 0.4            |
| 2月末                 | 13,782  | △2.1       | 378.896        | △2.1       | 99.5           | 0.4            |
| 3月末                 | 13,764  | △2.2       | 378.492        | △2.2       | 99.4           | 0.4            |
| 4月末                 | 13,832  | △1.7       | 380.333        | △1.7       | 99.6           | 0.4            |
| (期 末)<br>2017年5月22日 | 13,798  | △2.0       | 379.387        | △2.0       | 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

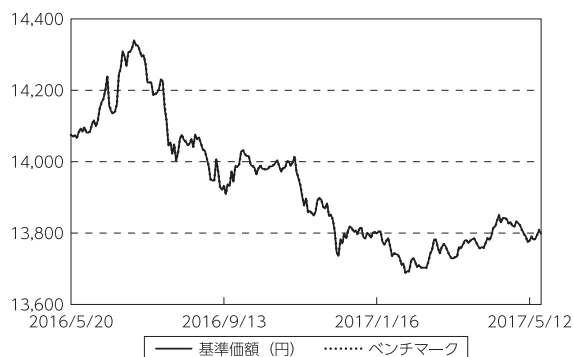
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.0%の下落となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



(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

- ・期の前半は、イギリスの欧州連合（EU）離脱をめぐる国民投票で離脱派が過半数を占めたことにより、世界的な景気の先行きに対する不透明感が高まったことから、一時、国内債券市況は上昇しました。その後、日本銀行が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を導入したことや、次期米国大統領にトランプ氏が選出され米国の金利が上昇したことなどから、国内債券市況は下落しました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
- ・ベンチマークである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2.0%の下落となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度と低水準に抑制し、高い運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 | $\Delta 0.0\%$ 程度 | $\Delta 0.0\%$ 程度 | 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 $\Delta 0.0\%$ 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、ベンチマークとの運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運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、 $0.0\%$ 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

(2016年5月21日～2017年5月22日)

| 項 目                             | 当 期           |                       | 項 目 の 概 要   |
|---------------------------------|---------------|-----------------------|---|
|                                 | 金 額           | 比 率                   |   |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料<br>(先物・オプション) | 円<br>0<br>(0) | %<br>0.000<br>(0.000) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| 合 計                             | 0             | 0.000                 |   |
| 期中の平均基準価額は、13,946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

(2016年5月21日～2017年5月22日)

## 公社債

|        |       | 買 付 額      | 売 付 額                   |
|--------|-------|------------|-------------------------|
|        |       | 千円         | 千円                      |
| 国<br>内 | 国債証券  | 56,319,655 | 54,842,931              |
|        | 地方債証券 | 1,529,796  | 1,267,568               |
|        | 特殊債券  | 1,123,612  | 2,530,801<br>( 680,786) |
|        | 社債券   | 2,700,010  | 3,114,162<br>( 620,000) |

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

## 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別  |        | 買 建          |              | 売 建      |          |
|--------|--------|--------------|--------------|----------|----------|
|        |        | 新規買付額        | 決 済 額        | 新規売付額    | 決 済 額    |
| 国<br>内 | 債券先物取引 | 百万円<br>3,774 | 百万円<br>3,777 | 百万円<br>- | 百万円<br>- |

## ○利害関係人との取引状況等

(2016年5月21日～2017年5月22日)

## 利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$<br>% | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$<br>% |
|-----|---------------|--------------------|--------------------|---------------|--------------------|--------------------|
|     |               |                    |                    |               |                    |                    |
| 公社債 | 百万円<br>61,673 | 百万円<br>17,875      | 29.0               | 百万円<br>61,755 | 百万円<br>9,091       | 14.7               |

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 買 付 額      | 売 付 額      | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|------------|------------|-------------|
| 公社債 | 百万円<br>300 | 百万円<br>102 | 百万円<br>824  |

## 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 買 付 額        |
|-----|--------------|
| 公社債 | 百万円<br>2,500 |

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、日立キャピタルです。

## ○組入資産の明細

(2017年5月22日現在)

## 国内公社債

## (A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分             | 当 期                          |                              |                | 末                  |                |                |                |
|-----------------|------------------------------|------------------------------|----------------|--------------------|----------------|----------------|----------------|
|                 | 額 面 金 額                      | 評 価 額                        | 組 入 比 率        | うちBB格以下<br>組 入 比 率 | 残存期間別組入比率      |                |                |
|                 | 千円                           | 千円                           | %              | %                  | 5年以上           | 2年以上           | 2年未満           |
| 国債証券            | 158,534,000<br>( 100,000)    | 173,740,290<br>( 100,212)    | 81.9<br>( 0.0) | —<br>(—)           | 52.6<br>( —)   | 19.7<br>( —)   | 9.6<br>( 0.0)  |
| 地方債証券           | 11,572,510<br>( 11,572,510)  | 12,450,224<br>( 12,450,224)  | 5.9<br>( 5.9)  | —<br>(—)           | 3.5<br>( 3.5)  | 2.0<br>( 2.0)  | 0.4<br>( 0.4)  |
| 特殊債券<br>(除く金融債) | 12,473,551<br>( 12,473,551)  | 13,565,726<br>( 13,565,726)  | 6.4<br>( 6.4)  | —<br>(—)           | 4.6<br>( 4.6)  | 1.4<br>( 1.4)  | 0.4<br>( 0.4)  |
| 金融債券            | 1,530,000<br>( 1,530,000)    | 1,536,263<br>( 1,536,263)    | 0.7<br>( 0.7)  | —<br>(—)           | —<br>( —)      | 0.4<br>( 0.4)  | 0.3<br>( 0.3)  |
| 普通社債券           | 8,841,000<br>( 8,841,000)    | 9,229,196<br>( 9,229,196)    | 4.4<br>( 4.4)  | —<br>(—)           | 1.3<br>( 1.3)  | 2.7<br>( 2.7)  | 0.4<br>( 0.4)  |
| 合 計             | 192,951,061<br>( 34,517,061) | 210,521,700<br>( 36,881,622) | 99.3<br>(17.4) | —<br>(—)           | 62.1<br>( 9.4) | 26.1<br>( 6.5) | 11.1<br>( 1.5) |

(注) ( )内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。



## (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄              | 当 期 末 |           |           |            |
|-----------------|-------|-----------|-----------|------------|
|                 | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| 国債証券            | %     | 千円        | 千円        |            |
| 第366回利付国債 (2年)  | 0.1   | 150,000   | 150,463   | 2018/7/15  |
| 第367回利付国債 (2年)  | 0.1   | 500,000   | 501,660   | 2018/8/15  |
| 第369回利付国債 (2年)  | 0.1   | 500,000   | 501,885   | 2018/10/15 |
| 第370回利付国債 (2年)  | 0.1   | 1,150,000 | 1,154,680 | 2018/11/15 |
| 第371回利付国債 (2年)  | 0.1   | 500,000   | 502,150   | 2018/12/15 |
| 第373回利付国債 (2年)  | 0.1   | 600,000   | 602,862   | 2019/2/15  |
| 第374回利付国債 (2年)  | 0.1   | 200,000   | 200,996   | 2019/3/15  |
| 第112回利付国債 (5年)  | 0.4   | 1,360,000 | 1,368,404 | 2018/6/20  |
| 第113回利付国債 (5年)  | 0.3   | 1,330,000 | 1,336,796 | 2018/6/20  |
| 第114回利付国債 (5年)  | 0.3   | 720,000   | 724,543   | 2018/9/20  |
| 第115回利付国債 (5年)  | 0.2   | 1,190,000 | 1,195,926 | 2018/9/20  |
| 第116回利付国債 (5年)  | 0.2   | 1,980,000 | 1,991,880 | 2018/12/20 |
| 第117回利付国債 (5年)  | 0.2   | 2,030,000 | 2,043,905 | 2019/3/20  |
| 第118回利付国債 (5年)  | 0.2   | 1,200,000 | 1,208,988 | 2019/6/20  |
| 第119回利付国債 (5年)  | 0.1   | 610,000   | 613,300   | 2019/6/20  |
| 第120回利付国債 (5年)  | 0.2   | 1,040,000 | 1,048,611 | 2019/9/20  |
| 第121回利付国債 (5年)  | 0.1   | 530,000   | 533,153   | 2019/9/20  |
| 第122回利付国債 (5年)  | 0.1   | 1,930,000 | 1,942,467 | 2019/12/20 |
| 第123回利付国債 (5年)  | 0.1   | 1,100,000 | 1,107,788 | 2020/3/20  |
| 第124回利付国債 (5年)  | 0.1   | 1,880,000 | 1,894,212 | 2020/6/20  |
| 第125回利付国債 (5年)  | 0.1   | 2,010,000 | 2,026,441 | 2020/9/20  |
| 第126回利付国債 (5年)  | 0.1   | 1,520,000 | 1,533,376 | 2020/12/20 |
| 第127回利付国債 (5年)  | 0.1   | 1,800,000 | 1,816,938 | 2021/3/20  |
| 第128回利付国債 (5年)  | 0.1   | 2,370,000 | 2,392,799 | 2021/6/20  |
| 第129回利付国債 (5年)  | 0.1   | 2,090,000 | 2,110,900 | 2021/9/20  |
| 第130回利付国債 (5年)  | 0.1   | 1,800,000 | 1,819,890 | 2021/12/20 |
| 第131回利付国債 (5年)  | 0.1   | 800,000   | 808,728   | 2022/3/20  |
| 第1回利付国債 (40年)   | 2.4   | 220,000   | 314,019   | 2048/3/20  |
| 第2回利付国債 (40年)   | 2.2   | 285,000   | 393,186   | 2049/3/20  |
| 第3回利付国債 (40年)   | 2.2   | 235,000   | 325,604   | 2050/3/20  |
| 第4回利付国債 (40年)   | 2.2   | 420,000   | 583,510   | 2051/3/20  |
| 第5回利付国債 (40年)   | 2.0   | 380,000   | 506,950   | 2052/3/20  |
| 第6回利付国債 (40年)   | 1.9   | 410,000   | 535,570   | 2053/3/20  |
| 第7回利付国債 (40年)   | 1.7   | 430,000   | 535,504   | 2054/3/20  |
| 第8回利付国債 (40年)   | 1.4   | 490,000   | 563,901   | 2055/3/20  |
| 第9回利付国債 (40年)   | 0.4   | 790,000   | 651,971   | 2056/3/20  |
| 第293回利付国債 (10年) | 1.8   | 895,000   | 913,965   | 2018/6/20  |
| 第294回利付国債 (10年) | 1.7   | 570,000   | 581,468   | 2018/6/20  |
| 第295回利付国債 (10年) | 1.5   | 730,000   | 743,110   | 2018/6/20  |
| 第296回利付国債 (10年) | 1.5   | 1,620,000 | 1,655,834 | 2018/9/20  |
| 第297回利付国債 (10年) | 1.4   | 760,000   | 778,840   | 2018/12/20 |
| 第298回利付国債 (10年) | 1.3   | 950,000   | 972,049   | 2018/12/20 |
| 第299回利付国債 (10年) | 1.3   | 810,000   | 831,756   | 2019/3/20  |
| 第300回利付国債 (10年) | 1.5   | 100,000   | 103,052   | 2019/3/20  |
| 第301回利付国債 (10年) | 1.5   | 620,000   | 641,414   | 2019/6/20  |

| 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302回利付国債 (10年) | 1.4   | 680,000   | 702,072   | 2019/6/20  |
| 第303回利付国債 (10年) | 1.4   | 1,470,000 | 1,523,361 | 2019/9/20  |
| 第304回利付国債 (10年) | 1.3   | 520,000   | 537,659   | 2019/9/20  |
| 第305回利付国債 (10年) | 1.3   | 830,000   | 861,108   | 2019/12/20 |
| 第306回利付国債 (10年) | 1.4   | 1,120,000 | 1,169,022 | 2020/3/20  |
| 第307回利付国債 (10年) | 1.3   | 455,000   | 473,627   | 2020/3/20  |
| 第308回利付国債 (10年) | 1.3   | 690,000   | 720,560   | 2020/6/20  |
| 第309回利付国債 (10年) | 1.1   | 1,180,000 | 1,224,981 | 2020/6/20  |
| 第310回利付国債 (10年) | 1.0   | 1,200,000 | 1,245,708 | 2020/9/20  |
| 第311回利付国債 (10年) | 0.8   | 590,000   | 608,531   | 2020/9/20  |
| 第312回利付国債 (10年) | 1.2   | 1,890,000 | 1,980,644 | 2020/12/20 |
| 第313回利付国債 (10年) | 1.3   | 90,000    | 94,960    | 2021/3/20  |
| 第314回利付国債 (10年) | 1.1   | 580,000   | 607,515   | 2021/3/20  |
| 第315回利付国債 (10年) | 1.2   | 780,000   | 822,315   | 2021/6/20  |
| 第316回利付国債 (10年) | 1.1   | 400,000   | 420,064   | 2021/6/20  |
| 第317回利付国債 (10年) | 1.1   | 250,000   | 263,320   | 2021/9/20  |
| 第318回利付国債 (10年) | 1.0   | 550,000   | 576,911   | 2021/9/20  |
| 第319回利付国債 (10年) | 1.1   | 690,000   | 728,722   | 2021/12/20 |
| 第320回利付国債 (10年) | 1.0   | 540,000   | 567,820   | 2021/12/20 |
| 第321回利付国債 (10年) | 1.0   | 870,000   | 917,032   | 2022/3/20  |
| 第322回利付国債 (10年) | 0.9   | 420,000   | 440,668   | 2022/3/20  |
| 第323回利付国債 (10年) | 0.9   | 470,000   | 494,092   | 2022/6/20  |
| 第324回利付国債 (10年) | 0.8   | 980,000   | 1,025,236 | 2022/6/20  |
| 第325回利付国債 (10年) | 0.8   | 1,490,000 | 1,561,803 | 2022/9/20  |
| 第326回利付国債 (10年) | 0.7   | 100,000   | 104,455   | 2022/12/20 |
| 第327回利付国債 (10年) | 0.8   | 580,000   | 609,092   | 2022/12/20 |
| 第328回利付国債 (10年) | 0.6   | 1,290,000 | 1,342,090 | 2023/3/20  |
| 第329回利付国債 (10年) | 0.8   | 1,480,000 | 1,559,964 | 2023/6/20  |
| 第330回利付国債 (10年) | 0.8   | 1,240,000 | 1,309,378 | 2023/9/20  |
| 第331回利付国債 (10年) | 0.6   | 770,000   | 803,287   | 2023/9/20  |
| 第332回利付国債 (10年) | 0.6   | 1,650,000 | 1,723,590 | 2023/12/20 |
| 第333回利付国債 (10年) | 0.6   | 820,000   | 857,949   | 2024/3/20  |
| 第334回利付国債 (10年) | 0.6   | 1,290,000 | 1,350,475 | 2024/6/20  |
| 第335回利付国債 (10年) | 0.5   | 1,970,000 | 2,048,898 | 2024/9/20  |
| 第336回利付国債 (10年) | 0.5   | 520,000   | 541,127   | 2024/12/20 |
| 第337回利付国債 (10年) | 0.3   | 1,050,000 | 1,076,712 | 2024/12/20 |
| 第338回利付国債 (10年) | 0.4   | 1,560,000 | 1,611,948 | 2025/3/20  |
| 第339回利付国債 (10年) | 0.4   | 1,940,000 | 2,005,067 | 2025/6/20  |
| 第340回利付国債 (10年) | 0.4   | 1,560,000 | 1,612,618 | 2025/9/20  |
| 第341回利付国債 (10年) | 0.3   | 1,200,000 | 1,230,336 | 2025/12/20 |
| 第342回利付国債 (10年) | 0.1   | 1,490,000 | 1,501,145 | 2026/3/20  |
| 第343回利付国債 (10年) | 0.1   | 1,890,000 | 1,903,683 | 2026/6/20  |
| 第344回利付国債 (10年) | 0.1   | 2,140,000 | 2,153,931 | 2026/9/20  |
| 第345回利付国債 (10年) | 0.1   | 2,160,000 | 2,172,355 | 2026/12/20 |
| 第346回利付国債 (10年) | 0.1   | 1,020,000 | 1,025,477 | 2027/3/20  |
| 第1回利付国債 (30年)   | 2.8   | 120,000   | 158,580   | 2029/9/20  |

| 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2回利付国債  | (30年) | 2.4   | 170,000 | 217,562   | 2030/2/20  |
| 第3回利付国債  | (30年) | 2.3   | 190,000 | 241,277   | 2030/5/20  |
| 第4回利付国債  | (30年) | 2.9   | 125,000 | 169,342   | 2030/11/20 |
| 第5回利付国債  | (30年) | 2.2   | 180,000 | 228,213   | 2031/5/20  |
| 第6回利付国債  | (30年) | 2.4   | 170,000 | 221,273   | 2031/11/20 |
| 第7回利付国債  | (30年) | 2.3   | 225,000 | 290,589   | 2032/5/20  |
| 第8回利付国債  | (30年) | 1.8   | 160,000 | 195,398   | 2032/11/22 |
| 第9回利付国債  | (30年) | 1.4   | 90,000  | 104,575   | 2032/12/20 |
| 第10回利付国債 | (30年) | 1.1   | 263,000 | 293,229   | 2033/3/20  |
| 第11回利付国債 | (30年) | 1.7   | 100,000 | 120,819   | 2033/6/20  |
| 第12回利付国債 | (30年) | 2.1   | 205,000 | 260,604   | 2033/9/20  |
| 第13回利付国債 | (30年) | 2.0   | 390,000 | 490,428   | 2033/12/20 |
| 第14回利付国債 | (30年) | 2.4   | 380,000 | 502,956   | 2034/3/20  |
| 第15回利付国債 | (30年) | 2.5   | 440,000 | 590,031   | 2034/6/20  |
| 第16回利付国債 | (30年) | 2.5   | 345,000 | 463,517   | 2034/9/20  |
| 第17回利付国債 | (30年) | 2.4   | 350,000 | 464,943   | 2034/12/20 |
| 第18回利付国債 | (30年) | 2.3   | 360,000 | 472,608   | 2035/3/20  |
| 第19回利付国債 | (30年) | 2.3   | 290,000 | 381,265   | 2035/6/20  |
| 第20回利付国債 | (30年) | 2.5   | 260,000 | 351,127   | 2035/9/20  |
| 第21回利付国債 | (30年) | 2.3   | 250,000 | 329,000   | 2035/12/20 |
| 第22回利付国債 | (30年) | 2.5   | 285,000 | 385,710   | 2036/3/20  |
| 第23回利付国債 | (30年) | 2.5   | 140,000 | 189,747   | 2036/6/20  |
| 第24回利付国債 | (30年) | 2.5   | 230,000 | 312,165   | 2036/9/20  |
| 第25回利付国債 | (30年) | 2.3   | 205,000 | 271,034   | 2036/12/20 |
| 第26回利付国債 | (30年) | 2.4   | 430,000 | 576,819   | 2037/3/20  |
| 第27回利付国債 | (30年) | 2.5   | 400,000 | 545,592   | 2037/9/20  |
| 第28回利付国債 | (30年) | 2.5   | 415,000 | 567,778   | 2038/3/20  |
| 第29回利付国債 | (30年) | 2.4   | 480,000 | 649,492   | 2038/9/20  |
| 第30回利付国債 | (30年) | 2.3   | 575,000 | 768,803   | 2039/3/20  |
| 第31回利付国債 | (30年) | 2.2   | 435,000 | 574,291   | 2039/9/20  |
| 第32回利付国債 | (30年) | 2.3   | 600,000 | 807,174   | 2040/3/20  |
| 第33回利付国債 | (30年) | 2.0   | 643,000 | 826,351   | 2040/9/20  |
| 第34回利付国債 | (30年) | 2.2   | 615,000 | 819,235   | 2041/3/20  |
| 第35回利付国債 | (30年) | 2.0   | 800,000 | 1,032,272 | 2041/9/20  |
| 第36回利付国債 | (30年) | 2.0   | 590,000 | 762,681   | 2042/3/20  |
| 第37回利付国債 | (30年) | 1.9   | 770,000 | 980,371   | 2042/9/20  |
| 第38回利付国債 | (30年) | 1.8   | 505,000 | 632,007   | 2043/3/20  |
| 第39回利付国債 | (30年) | 1.9   | 500,000 | 637,920   | 2043/6/20  |
| 第40回利付国債 | (30年) | 1.8   | 430,000 | 538,738   | 2043/9/20  |
| 第41回利付国債 | (30年) | 1.7   | 350,000 | 430,353   | 2043/12/20 |
| 第42回利付国債 | (30年) | 1.7   | 450,000 | 553,491   | 2044/3/20  |
| 第43回利付国債 | (30年) | 1.7   | 420,000 | 516,768   | 2044/6/20  |
| 第44回利付国債 | (30年) | 1.7   | 450,000 | 553,855   | 2044/9/20  |
| 第45回利付国債 | (30年) | 1.5   | 520,000 | 614,728   | 2044/12/20 |
| 第46回利付国債 | (30年) | 1.5   | 630,000 | 744,760   | 2045/3/20  |
| 第47回利付国債 | (30年) | 1.6   | 590,000 | 712,076   | 2045/6/20  |

| 銘柄             | 当 期 末 |         |         |            |
|----------------|-------|---------|---------|------------|
|                | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| <b>国債証券</b>    | %     | 千円      | 千円      |            |
| 第48回利付国債 (30年) | 1.4   | 500,000 | 578,630 | 2045/9/20  |
| 第49回利付国債 (30年) | 1.4   | 630,000 | 728,935 | 2045/12/20 |
| 第50回利付国債 (30年) | 0.8   | 550,000 | 551,936 | 2046/3/20  |
| 第51回利付国債 (30年) | 0.3   | 470,000 | 410,211 | 2046/6/20  |
| 第52回利付国債 (30年) | 0.5   | 720,000 | 664,740 | 2046/9/20  |
| 第53回利付国債 (30年) | 0.6   | 620,000 | 587,530 | 2046/12/20 |
| 第54回利付国債 (30年) | 0.8   | 210,000 | 209,745 | 2047/3/20  |
| 第40回利付国債 (20年) | 2.3   | 290,000 | 299,497 | 2018/9/20  |
| 第41回利付国債 (20年) | 1.5   | 240,000 | 247,324 | 2019/3/20  |
| 第42回利付国債 (20年) | 2.6   | 835,000 | 877,267 | 2019/3/20  |
| 第43回利付国債 (20年) | 2.9   | 360,000 | 385,628 | 2019/9/20  |
| 第44回利付国債 (20年) | 2.5   | 710,000 | 763,207 | 2020/3/20  |
| 第45回利付国債 (20年) | 2.4   | 100,000 | 107,211 | 2020/3/20  |
| 第47回利付国債 (20年) | 2.2   | 100,000 | 107,807 | 2020/9/21  |
| 第48回利付国債 (20年) | 2.5   | 250,000 | 273,685 | 2020/12/21 |
| 第49回利付国債 (20年) | 2.1   | 170,000 | 184,616 | 2021/3/22  |
| 第50回利付国債 (20年) | 1.9   | 515,000 | 555,319 | 2021/3/22  |
| 第51回利付国債 (20年) | 2.0   | 140,000 | 152,189 | 2021/6/21  |
| 第52回利付国債 (20年) | 2.1   | 260,000 | 285,053 | 2021/9/21  |
| 第53回利付国債 (20年) | 2.1   | 80,000  | 88,170  | 2021/12/20 |
| 第54回利付国債 (20年) | 2.2   | 530,000 | 586,566 | 2021/12/20 |
| 第55回利付国債 (20年) | 2.0   | 240,000 | 264,561 | 2022/3/21  |
| 第56回利付国債 (20年) | 2.0   | 370,000 | 409,623 | 2022/6/20  |
| 第57回利付国債 (20年) | 1.9   | 160,000 | 176,318 | 2022/6/20  |
| 第58回利付国債 (20年) | 1.9   | 350,000 | 387,481 | 2022/9/20  |
| 第59回利付国債 (20年) | 1.7   | 590,000 | 649,359 | 2022/12/20 |
| 第60回利付国債 (20年) | 1.4   | 230,000 | 249,271 | 2022/12/20 |
| 第61回利付国債 (20年) | 1.0   | 260,000 | 276,585 | 2023/3/20  |
| 第62回利付国債 (20年) | 0.8   | 560,000 | 590,256 | 2023/6/20  |
| 第63回利付国債 (20年) | 1.8   | 275,000 | 306,647 | 2023/6/20  |
| 第64回利付国債 (20年) | 1.9   | 480,000 | 540,427 | 2023/9/20  |
| 第65回利付国債 (20年) | 1.9   | 430,000 | 485,955 | 2023/12/20 |
| 第66回利付国債 (20年) | 1.8   | 170,000 | 190,998 | 2023/12/20 |
| 第67回利付国債 (20年) | 1.9   | 80,000  | 90,771  | 2024/3/20  |
| 第68回利付国債 (20年) | 2.2   | 395,000 | 456,304 | 2024/3/20  |
| 第69回利付国債 (20年) | 2.1   | 120,000 | 137,802 | 2024/3/20  |
| 第70回利付国債 (20年) | 2.4   | 510,000 | 599,127 | 2024/6/20  |
| 第71回利付国債 (20年) | 2.2   | 200,000 | 232,110 | 2024/6/20  |
| 第72回利付国債 (20年) | 2.1   | 645,000 | 746,690 | 2024/9/20  |
| 第73回利付国債 (20年) | 2.0   | 200,000 | 230,824 | 2024/12/20 |
| 第74回利付国債 (20年) | 2.1   | 380,000 | 441,453 | 2024/12/20 |
| 第75回利付国債 (20年) | 2.1   | 230,000 | 268,198 | 2025/3/20  |
| 第76回利付国債 (20年) | 1.9   | 210,000 | 241,586 | 2025/3/20  |
| 第77回利付国債 (20年) | 2.0   | 260,000 | 301,145 | 2025/3/20  |
| 第79回利付国債 (20年) | 2.0   | 100,000 | 116,241 | 2025/6/20  |
| 第80回利付国債 (20年) | 2.1   | 370,000 | 433,081 | 2025/6/20  |

| 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82回利付国債 (20年)  | 2.1   | 620,000 | 728,400 | 2025/9/20  |
| 第83回利付国債 (20年)  | 2.1   | 182,000 | 214,590 | 2025/12/20 |
| 第84回利付国債 (20年)  | 2.0   | 410,000 | 479,905 | 2025/12/20 |
| 第85回利付国債 (20年)  | 2.1   | 230,000 | 272,248 | 2026/3/20  |
| 第86回利付国債 (20年)  | 2.3   | 532,000 | 639,096 | 2026/3/20  |
| 第87回利付国債 (20年)  | 2.2   | 170,000 | 202,725 | 2026/3/20  |
| 第88回利付国債 (20年)  | 2.3   | 460,000 | 554,994 | 2026/6/20  |
| 第89回利付国債 (20年)  | 2.2   | 130,000 | 155,668 | 2026/6/20  |
| 第90回利付国債 (20年)  | 2.2   | 470,000 | 564,850 | 2026/9/20  |
| 第91回利付国債 (20年)  | 2.3   | 80,000  | 96,888  | 2026/9/20  |
| 第92回利付国債 (20年)  | 2.1   | 650,000 | 777,718 | 2026/12/20 |
| 第94回利付国債 (20年)  | 2.1   | 260,000 | 312,247 | 2027/3/20  |
| 第95回利付国債 (20年)  | 2.3   | 490,000 | 600,504 | 2027/6/20  |
| 第96回利付国債 (20年)  | 2.1   | 120,000 | 144,657 | 2027/6/20  |
| 第97回利付国債 (20年)  | 2.2   | 330,000 | 402,266 | 2027/9/20  |
| 第98回利付国債 (20年)  | 2.1   | 340,000 | 410,968 | 2027/9/20  |
| 第99回利付国債 (20年)  | 2.1   | 655,000 | 794,161 | 2027/12/20 |
| 第100回利付国債 (20年) | 2.2   | 370,000 | 453,912 | 2028/3/20  |
| 第101回利付国債 (20年) | 2.4   | 410,000 | 511,778 | 2028/3/20  |
| 第102回利付国債 (20年) | 2.4   | 190,000 | 237,992 | 2028/6/20  |
| 第103回利付国債 (20年) | 2.3   | 320,000 | 397,321 | 2028/6/20  |
| 第104回利付国債 (20年) | 2.1   | 190,000 | 231,746 | 2028/6/20  |
| 第105回利付国債 (20年) | 2.1   | 350,000 | 428,151 | 2028/9/20  |
| 第106回利付国債 (20年) | 2.2   | 210,000 | 259,242 | 2028/9/20  |
| 第107回利付国債 (20年) | 2.1   | 30,000  | 36,802  | 2028/12/20 |
| 第108回利付国債 (20年) | 1.9   | 510,000 | 613,989 | 2028/12/20 |
| 第109回利付国債 (20年) | 1.9   | 570,000 | 687,864 | 2029/3/20  |
| 第110回利付国債 (20年) | 2.1   | 100,000 | 123,008 | 2029/3/20  |
| 第111回利付国債 (20年) | 2.2   | 320,000 | 398,502 | 2029/6/20  |
| 第112回利付国債 (20年) | 2.1   | 550,000 | 678,392 | 2029/6/20  |
| 第113回利付国債 (20年) | 2.1   | 310,000 | 383,156 | 2029/9/20  |
| 第114回利付国債 (20年) | 2.1   | 580,000 | 718,260 | 2029/12/20 |
| 第115回利付国債 (20年) | 2.2   | 270,000 | 337,689 | 2029/12/20 |
| 第116回利付国債 (20年) | 2.2   | 215,000 | 269,597 | 2030/3/20  |
| 第117回利付国債 (20年) | 2.1   | 560,000 | 695,184 | 2030/3/20  |
| 第118回利付国債 (20年) | 2.0   | 314,000 | 386,502 | 2030/6/20  |
| 第119回利付国債 (20年) | 1.8   | 240,000 | 289,291 | 2030/6/20  |
| 第120回利付国債 (20年) | 1.6   | 200,000 | 235,824 | 2030/6/20  |
| 第121回利付国債 (20年) | 1.9   | 430,000 | 524,883 | 2030/9/20  |
| 第122回利付国債 (20年) | 1.8   | 310,000 | 374,380 | 2030/9/20  |
| 第123回利付国債 (20年) | 2.1   | 500,000 | 624,730 | 2030/12/20 |
| 第124回利付国債 (20年) | 2.0   | 260,000 | 321,427 | 2030/12/20 |
| 第125回利付国債 (20年) | 2.2   | 410,000 | 518,891 | 2031/3/20  |
| 第126回利付国債 (20年) | 2.0   | 330,000 | 408,790 | 2031/3/20  |
| 第127回利付国債 (20年) | 1.9   | 240,000 | 294,084 | 2031/3/20  |
| 第128回利付国債 (20年) | 1.9   | 480,000 | 589,276 | 2031/6/20  |

| 銘柄                      | 当 期 末 |             |             |            |
|-------------------------|-------|-------------|-------------|------------|
|                         | 利 率   | 額 面 金 額     | 評 価 額       | 償 還 年 月 日  |
| <b>国債証券</b>             | %     | 千円          | 千円          |            |
| 第129回利付国債 (20年)         | 1.8   | 240,000     | 291,168     | 2031/6/20  |
| 第130回利付国債 (20年)         | 1.8   | 580,000     | 704,821     | 2031/9/20  |
| 第131回利付国債 (20年)         | 1.7   | 270,000     | 324,369     | 2031/9/20  |
| 第132回利付国債 (20年)         | 1.7   | 270,000     | 324,599     | 2031/12/20 |
| 第133回利付国債 (20年)         | 1.8   | 370,000     | 450,016     | 2031/12/20 |
| 第134回利付国債 (20年)         | 1.8   | 320,000     | 389,772     | 2032/3/20  |
| 第135回利付国債 (20年)         | 1.7   | 220,000     | 264,646     | 2032/3/20  |
| 第136回利付国債 (20年)         | 1.6   | 260,000     | 309,059     | 2032/3/20  |
| 第137回利付国債 (20年)         | 1.7   | 260,000     | 313,172     | 2032/6/20  |
| 第138回利付国債 (20年)         | 1.5   | 270,000     | 317,182     | 2032/6/20  |
| 第139回利付国債 (20年)         | 1.6   | 250,000     | 297,512     | 2032/6/20  |
| 第140回利付国債 (20年)         | 1.7   | 820,000     | 988,928     | 2032/9/20  |
| 第141回利付国債 (20年)         | 1.7   | 820,000     | 990,084     | 2032/12/20 |
| 第142回利付国債 (20年)         | 1.8   | 50,000      | 61,114      | 2032/12/20 |
| 第143回利付国債 (20年)         | 1.6   | 540,000     | 644,090     | 2033/3/20  |
| 第144回利付国債 (20年)         | 1.5   | 320,000     | 376,579     | 2033/3/20  |
| 第145回利付国債 (20年)         | 1.7   | 920,000     | 1,111,534   | 2033/6/20  |
| 第146回利付国債 (20年)         | 1.7   | 850,000     | 1,027,208   | 2033/9/20  |
| 第147回利付国債 (20年)         | 1.6   | 750,000     | 894,765     | 2033/12/20 |
| 第148回利付国債 (20年)         | 1.5   | 540,000     | 635,623     | 2034/3/20  |
| 第149回利付国債 (20年)         | 1.5   | 800,000     | 941,392     | 2034/6/20  |
| 第150回利付国債 (20年)         | 1.4   | 780,000     | 904,917     | 2034/9/20  |
| 第151回利付国債 (20年)         | 1.2   | 770,000     | 866,881     | 2034/12/20 |
| 第152回利付国債 (20年)         | 1.2   | 840,000     | 945,495     | 2035/3/20  |
| 第153回利付国債 (20年)         | 1.3   | 820,000     | 936,497     | 2035/6/20  |
| 第154回利付国債 (20年)         | 1.2   | 910,000     | 1,022,940   | 2035/9/20  |
| 第155回利付国債 (20年)         | 1.0   | 880,000     | 957,220     | 2035/12/20 |
| 第156回利付国債 (20年)         | 0.4   | 840,000     | 822,007     | 2036/3/20  |
| 第157回利付国債 (20年)         | 0.2   | 1,020,000   | 958,361     | 2036/6/20  |
| 第158回利付国債 (20年)         | 0.5   | 980,000     | 971,434     | 2036/9/20  |
| 第159回利付国債 (20年)         | 0.6   | 800,000     | 805,640     | 2036/12/20 |
| 第160回利付国債 (20年)         | 0.7   | 500,000     | 512,030     | 2037/3/20  |
| 第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013) | 0.67  | 100,000     | 100,212     | 2018/11/15 |
| 小 計                     |       | 158,534,000 | 173,740,290 |            |
| <b>地方債証券</b>            |       |             |             |            |
| 第5回東京都公募公債 (20年)        | 2.11  | 100,000     | 115,653     | 2025/3/19  |
| 第7回東京都公募公債 (20年)        | 2.16  | 100,000     | 116,829     | 2025/9/19  |
| 第7回東京都公募公債 (30年)        | 2.51  | 70,000      | 93,156      | 2038/9/17  |
| 第10回東京都公募公債 (30年)       | 2.31  | 100,000     | 129,852     | 2039/9/20  |
| 第25回東京都公募公債 (20年)       | 1.8   | 100,000     | 118,957     | 2031/12/19 |
| 第27回東京都公募公債 (20年)       | 1.68  | 100,000     | 117,557     | 2032/12/20 |
| 第682回東京都公募公債            | 1.32  | 100,000     | 103,715     | 2020/3/19  |
| 第700回東京都公募公債            | 1.02  | 100,000     | 104,364     | 2021/9/17  |
| 第718回東京都公募公債            | 0.6   | 100,000     | 103,286     | 2023/3/20  |
| 第719回東京都公募公債            | 0.86  | 200,000     | 209,596     | 2023/3/20  |
| 第3回東京都公募公債 (20年)        | 2.26  | 100,000     | 115,031     | 2024/3/19  |

| 銘柄                    | 当 期 末 |         |         |            |
|-----------------------|-------|---------|---------|------------|
|                       | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| <b>地方債証券</b>          | %     | 千円      | 千円      |            |
| 平成20年度第12回北海道公募公債     | 1.72  | 50,000  | 51,365  | 2018/12/26 |
| 平成21年度第7回北海道公募公債      | 1.46  | 50,000  | 51,700  | 2019/9/25  |
| 平成22年度第8回北海道公募公債      | 0.96  | 80,000  | 82,612  | 2020/10/29 |
| 平成24年度第9回北海道公募公債      | 0.79  | 50,000  | 52,008  | 2022/10/31 |
| 平成28年度第1回北海道公募公債      | 0.085 | 100,000 | 99,250  | 2026/4/28  |
| 第2回神奈川県公募公債(30年)      | 2.87  | 100,000 | 137,959 | 2036/6/20  |
| 第4回神奈川県公募公債(30年)      | 2.62  | 100,000 | 134,891 | 2038/3/19  |
| 第155回神奈川県公募公債         | 1.61  | 60,000  | 61,036  | 2018/6/20  |
| 第196回神奈川県公募公債         | 0.678 | 100,000 | 103,679 | 2023/3/20  |
| 第5回大阪府公募公債(20年)       | 2.16  | 100,000 | 122,078 | 2030/5/28  |
| 第318回大阪府公募公債          | 1.7   | 14,000  | 14,320  | 2018/9/28  |
| 第322回大阪府公募公債          | 1.62  | 60,000  | 61,634  | 2019/1/29  |
| 第332回大阪府公募公債          | 1.58  | 50,000  | 51,980  | 2019/11/27 |
| 第335回大阪府公募公債          | 1.48  | 30,000  | 31,223  | 2020/2/25  |
| 第336回大阪府公募公債          | 1.46  | 50,000  | 52,076  | 2020/3/30  |
| 第342回大阪府公募公債          | 1.2   | 25,000  | 25,998  | 2020/9/29  |
| 第344回大阪府公募公債          | 1.06  | 21,000  | 21,771  | 2020/11/27 |
| 第348回大阪府公募公債          | 1.32  | 50,000  | 52,524  | 2021/3/30  |
| 第358回大阪府公募公債          | 0.97  | 70,000  | 73,152  | 2022/2/28  |
| 第404回大阪府公募公債          | 0.4   | 400,000 | 408,224 | 2026/1/28  |
| 第408回大阪府公募公債          | 0.072 | 118,000 | 116,971 | 2026/5/29  |
| 平成20年度第3回京都府公募公債      | 1.57  | 20,200  | 20,696  | 2018/12/19 |
| 平成21年度第3回京都府公募公債(20年) | 2.19  | 100,000 | 122,108 | 2029/9/20  |
| 平成22年度第2回京都府公募公債      | 1.16  | 40,000  | 41,537  | 2020/9/24  |
| 平成22年度第7回京都府公募公債      | 1.31  | 45,900  | 48,186  | 2021/3/22  |
| 平成23年度第2回京都府公募公債      | 1.2   | 66,000  | 69,206  | 2021/6/22  |
| 第2回兵庫県公募公債(30年)       | 2.36  | 50,000  | 65,364  | 2040/3/19  |
| 第5回兵庫県公募公債(15年)       | 1.31  | 100,000 | 110,760 | 2028/5/26  |
| 平成21年度第35回兵庫県公募公債     | 1.46  | 40,000  | 41,553  | 2020/1/22  |
| 平成23年度第11回兵庫県公募公債     | 0.95  | 50,000  | 52,164  | 2022/1/27  |
| 平成24年度第18回兵庫県公募公債     | 0.77  | 100,000 | 103,885 | 2022/10/19 |
| 第3回静岡県公募公債(15年)       | 1.368 | 100,000 | 111,423 | 2027/10/29 |
| 第14回静岡県公募公債(20年)      | 1.736 | 100,000 | 118,067 | 2032/6/18  |
| 平成25年度第8回静岡県公募公債      | 0.699 | 29,800  | 31,028  | 2023/10/24 |
| 平成20年度第8回愛知県公募公債(20年) | 2.04  | 200,000 | 239,342 | 2028/12/20 |
| 平成21年度第6回愛知県公募公債      | 1.44  | 50,000  | 51,568  | 2019/7/30  |
| 平成21年度第10回愛知県公募公債     | 1.38  | 201,000 | 207,729 | 2019/10/30 |
| 平成22年度第5回愛知県公募公債      | 1.258 | 27,200  | 28,254  | 2020/6/30  |
| 平成23年度第11回愛知県公募公債     | 1.03  | 70,000  | 73,165  | 2021/10/28 |
| 平成23年度第20回愛知県公募公債     | 1.082 | 100,000 | 105,170 | 2022/3/29  |
| 平成24年度第13回愛知県公募公債     | 0.772 | 100,000 | 104,036 | 2022/11/30 |
| 平成28年度第16回愛知県公募公債     | 0.259 | 200,000 | 201,412 | 2027/2/12  |
| 平成21年度第1回広島県公募公債      | 1.57  | 20,000  | 20,631  | 2019/5/28  |
| 平成22年度第3回広島県公募公債      | 1.08  | 45,000  | 46,608  | 2020/9/24  |
| 平成27年度第5回広島県公募公債      | 0.41  | 200,000 | 204,456 | 2026/1/26  |
| 第8回埼玉県公募公債(20年)       | 2.19  | 100,000 | 122,108 | 2029/9/20  |

| 銘柄                     | 当期末   |         |         |            |
|------------------------|-------|---------|---------|------------|
|                        | 利率    | 額面金額    | 評価額     | 償還年月日      |
| <b>地方債証券</b>           | %     | 千円      | 千円      |            |
| 第10回埼玉県公募公債 (20年)      | 1.94  | 100,000 | 120,077 | 2030/11/12 |
| 平成20年度第3回埼玉県公募公債       | 1.87  | 29,000  | 29,589  | 2018/6/25  |
| 平成21年度第8回埼玉県公募公債       | 1.3   | 12,000  | 12,402  | 2019/12/25 |
| 平成22年度第11回埼玉県公募公債      | 1.28  | 40,000  | 41,911  | 2021/2/25  |
| 平成23年度第1回埼玉県公募公債       | 1.37  | 100,000 | 105,345 | 2021/4/27  |
| 平成22年度第10回福岡県公募公債      | 1.36  | 50,000  | 52,540  | 2021/2/25  |
| 平成21年度第2回千葉県公募公債       | 1.57  | 80,000  | 82,512  | 2019/5/24  |
| 平成22年度第12回千葉県公募公債      | 1.28  | 80,000  | 83,823  | 2021/2/25  |
| 平成22年度第14回千葉県公募公債      | 1.33  | 80,000  | 84,054  | 2021/3/25  |
| 平成23年度第5回千葉県公募公債       | 1.06  | 80,000  | 83,788  | 2021/11/25 |
| 平成23年度第9回千葉県公募公債       | 1.0   | 80,000  | 83,810  | 2022/3/25  |
| 平成24年度第1回千葉県公募公債       | 1.05  | 80,000  | 84,068  | 2022/4/25  |
| 平成21年度第1回新潟県公募公債       | 1.42  | 54,500  | 56,183  | 2019/7/29  |
| 平成21年度第2回新潟県公募公債       | 1.55  | 80,550  | 83,679  | 2019/11/27 |
| 平成27年度第2回新潟県公募公債       | 0.215 | 140,000 | 140,725 | 2026/2/26  |
| 平成22年度第1回岐阜県公募公債       | 1.21  | 42,000  | 43,692  | 2020/9/30  |
| 平成21年度第1回大分県公募公債       | 1.35  | 54,900  | 56,700  | 2019/10/31 |
| 第69回共同発行市場公募地方債        | 1.56  | 34,000  | 34,840  | 2018/12/25 |
| 第73回共同発行市場公募地方債        | 1.59  | 80,600  | 83,061  | 2019/4/25  |
| 第80回共同発行市場公募地方債        | 1.54  | 200,000 | 207,700 | 2019/11/25 |
| 第81回共同発行市場公募地方債        | 1.32  | 50,000  | 51,704  | 2019/12/25 |
| 第84回共同発行市場公募地方債        | 1.38  | 20,000  | 20,781  | 2020/3/25  |
| 第90回共同発行市場公募地方債        | 1.12  | 100,000 | 103,712 | 2020/9/25  |
| 第96回共同発行市場公募地方債        | 1.29  | 20,000  | 20,983  | 2021/3/25  |
| 第104回共同発行市場公募地方債       | 1.03  | 100,000 | 104,601 | 2021/11/25 |
| 第108回共同発行市場公募地方債       | 1.01  | 70,000  | 73,368  | 2022/3/25  |
| 第116回共同発行市場公募地方債       | 0.8   | 300,000 | 312,540 | 2022/11/25 |
| 第130回共同発行市場公募地方債       | 0.76  | 100,000 | 104,671 | 2024/1/25  |
| 第132回共同発行市場公募地方債       | 0.66  | 100,000 | 104,086 | 2024/3/25  |
| 第133回共同発行市場公募地方債       | 0.689 | 600,000 | 625,728 | 2024/4/25  |
| 第140回共同発行市場公募地方債       | 0.505 | 200,000 | 206,040 | 2024/11/25 |
| 第142回共同発行市場公募地方債       | 0.345 | 200,000 | 203,654 | 2025/1/24  |
| 第144回共同発行市場公募地方債       | 0.47  | 200,000 | 205,596 | 2025/3/25  |
| 平成21年度第1回栃木県公募公債       | 1.55  | 100,000 | 103,898 | 2019/11/30 |
| 平成20年度第1回新潟市公募公債       | 1.56  | 34,190  | 35,035  | 2018/12/26 |
| 平成21年度第1回新潟市公募公債       | 1.34  | 94,450  | 97,718  | 2019/12/25 |
| 平成21年度第1回浜松市公募公債       | 1.54  | 33,900  | 35,208  | 2019/11/27 |
| 平成21年度第6回大阪市公募公債       | 1.57  | 50,000  | 51,963  | 2019/11/25 |
| 平成22年度第8回大阪市公募公債       | 1.28  | 50,000  | 52,335  | 2021/1/25  |
| 平成22年度第10回大阪市公募公債      | 1.31  | 20,000  | 20,992  | 2021/3/17  |
| 平成26年度第7回大阪市公募公債       | 0.535 | 100,000 | 103,247 | 2024/11/28 |
| 第1回名古屋市公募公債 (20年)      | 1.99  | 100,000 | 112,653 | 2023/12/20 |
| 第9回名古屋市公募公債 (20年)      | 2.07  | 100,000 | 120,007 | 2028/12/20 |
| 第9回名古屋市公募公債 (30年)      | 2.095 | 90,000  | 114,049 | 2042/9/19  |
| 第3回京都市公募公債 (20年)       | 2.09  | 100,000 | 116,584 | 2025/12/19 |
| 平成18年度第3回神戸市公募公債 (20年) | 2.54  | 110,000 | 133,551 | 2026/6/19  |



| 銘柄                         | 当期末   |            |            |            |
|----------------------------|-------|------------|------------|------------|
|                            | 利率    | 額面金額       | 評価額        | 償還年月日      |
| <b>地方債証券</b>               | %     | 千円         | 千円         |            |
| 平成23年度第5回神戸市公募公債           | 1.025 | 100,000    | 104,475    | 2021/10/19 |
| 第5回横浜市公募公債(20年)            | 2.17  | 100,000    | 116,453    | 2025/6/20  |
| 第7回横浜市公募公債(20年)            | 2.06  | 250,000    | 290,822    | 2025/12/19 |
| 平成24年度第4回横浜市公募公債           | 0.81  | 100,000    | 104,388    | 2023/2/20  |
| 第27回横浜市公募公債(20年)           | 1.599 | 40,000     | 46,472     | 2033/5/20  |
| 平成22年度第7回札幌市公募公債           | 1.05  | 50,000     | 51,729     | 2020/9/18  |
| 第7回川崎市公募公債(20年)            | 2.08  | 100,000    | 120,656    | 2029/7/17  |
| 平成20年度第5回福岡市公募公債           | 1.57  | 30,000     | 30,666     | 2018/10/24 |
| 平成20年度第8回福岡市公募公債           | 1.49  | 84,500     | 86,810     | 2019/3/25  |
| 平成22年度第9回福岡市公募公債           | 1.32  | 127,300    | 133,703    | 2021/3/25  |
| 平成23年度第6回福岡市公募公債           | 1.0   | 50,000     | 52,194     | 2021/10/28 |
| 平成24年度第4回福岡市公募公債           | 0.8   | 70,000     | 72,909     | 2022/10/31 |
| 平成20年度第1回広島市公募公債           | 1.56  | 50,000     | 51,235     | 2018/12/25 |
| 平成20年度第2回広島市公募公債           | 1.52  | 50,000     | 51,335     | 2019/2/25  |
| 平成22年度第6回広島市公募公債           | 1.21  | 50,000     | 52,413     | 2021/5/31  |
| 平成22年度第1回相模原市公募公債          | 1.29  | 60,000     | 62,745     | 2020/12/18 |
| 平成22年度第1回三重県公募公債           | 1.056 | 149,170    | 154,669    | 2020/11/30 |
| 平成23年度第1回三重県公募公債           | 1.021 | 162,550    | 169,985    | 2021/11/30 |
| 平成20年度第1回徳島県公募公債           | 1.73  | 130,300    | 133,704    | 2018/11/28 |
| 平成21年度第1回徳島県公募公債           | 1.55  | 36,500     | 37,920     | 2019/11/29 |
| 平成22年度第1回岡山県公募公債           | 1.05  | 50,000     | 51,833     | 2020/11/30 |
| 平成27年度第1回岡山県公募公債           | 0.395 | 189,000    | 192,972    | 2026/1/29  |
| 小計                         |       | 11,572,510 | 12,450,224 |            |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>         |       |            |            |            |
| 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    | 107,257    | 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    | 107,405    | 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     | 11,227     | 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     | 14,314     | 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    | 102,352    | 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     | 30,728     | 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    | 102,774    | 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    | 206,432    | 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    | 127,881    | 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    | 243,764    | 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     | 10,396     | 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    | 122,195    | 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    | 129,219    | 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    | 119,927    | 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    | 120,908    | 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    | 120,019    | 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     | 14,704     | 2021/6/30  |
| 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    | 125,727    | 2042/2/28  |
| 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    | 104,677    | 2022/6/30  |
| 第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.791 | 300,000    | 313,173    | 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    | 169,846    | 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    | 209,620    | 2023/1/31  |

| 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  | 31,429  | 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 | 352,481 | 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 | 105,412 | 2023/6/30  |
| 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 | 104,345 | 2024/3/29  |
| 第218回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    |   | 0.66  | 201,000 | 209,966 | 2024/5/31  |
| 第254回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    |   | 0.44  | 400,000 | 411,704 | 2025/8/29  |
| 第344回政府保証道路債券                 |   | 1.6   | 100,000 | 105,120 | 2020/7/15  |
| 第13回政府保証東日本高速道路債券             |   | 1.6   | 80,000  | 81,834  | 2018/10/19 |
| 第14回政府保証東日本高速道路債券             |   | 1.4   | 80,000  | 81,804  | 2018/12/21 |
| 第12回政府保証日本政策投資銀行債券            |   | 2.1   | 100,000 | 108,724 | 2021/6/28  |
| 第1回政府保証公営企業債券(15年)            |   | 1.6   | 200,000 | 210,034 | 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 | 206,316 | 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 | 206,116 | 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  | 31,950  | 2019/9/13  |
| 第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券          |   | 1.3   | 14,000  | 14,324  | 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 | 205,908 | 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  | 11,503  | 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  | 21,009  | 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 | 210,280 | 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  | 36,559  | 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 | 104,175 | 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  | 39,801  | 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 | 105,200 | 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 | 104,489 | 2023/12/18 |
| 第2回政府保証公営企業債券(15年)            |   | 2.1   | 100,000 | 108,298 | 2021/4/16  |
| 第25回政府保証日本政策金融公庫債券            |   | 0.815 | 100,000 | 104,756 | 2023/2/24  |
| 第16回政府保証民間都市開発債券              |   | 0.699 | 90,000  | 94,003  | 2023/10/20 |
| 第5回政府保証日本政策投資銀行               |   | 1.4   | 100,000 | 10,271  | 2019/4/15  |
| 第13回政府保証中部国際空港債券              |   | 1.3   | 72,000  | 75,641  | 2021/3/15  |
| 第16回政府保証西日本高速道路債券             |   | 1.6   | 75,000  | 76,812  | 2018/11/16 |
| 第17回政府保証西日本高速道路債券             |   | 1.3   | 75,000  | 76,679  | 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  | 35,856  | 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 | 148,056 | 2045/9/20  |
| 第17回道路債券(財投機関債)               |   | 1.54  | 150,000 | 162,303 | 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 | 143,227 | 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 | 155,299 | 2047/3/20  |
| 第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |   | 2.37  | 100,000 | 122,817 | 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 | 124,051 | 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 | 103,188 | 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 | 104,932 | 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 | 118,362 | 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 | 105,229 | 2023/6/20  |
| 第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)         |   | 1.03  | 100,000 | 105,577 | 2023/3/22  |
| 第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)         |   | 2.95  | 100,000 | 137,858 | 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 | 122,642 | 2030/1/28  |
| 第7回公営企業債券(20年)(財投機関債)         |   | 2.2   | 100,000 | 114,406 | 2024/3/22  |

| 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8回公営企業債券(20年)(財投機関債)        |   | 2.25  | 100,000 | 114,746 | 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 | 104,152 | 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 | 103,926 | 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 | 122,472 | 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 | 119,040 | 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 | 116,976 | 2032/7/28  |
| 第44回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)      |   | 0.791 | 200,000 | 208,224 | 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  | 80,440  | 2031/7/30  |
| 第1回公営企業債券(20年)(財投機関債)        |   | 2.1   | 100,000 | 110,303 | 2022/6/20  |
| 第100回都市再生債券(財投機関債)           |   | 0.569 | 100,000 | 103,337 | 2024/11/20 |
| 第7回本州四国連絡橋債券(財投機関債)          |   | 2.26  | 100,000 | 116,939 | 2025/6/20  |
| 第29回福祉医療機構債券(財投機関債)          |   | 1.145 | 100,000 | 105,100 | 2021/12/20 |
| 第4回中部国際空港(財投機関債)             |   | 0.305 | 200,000 | 200,758 | 2027/2/22  |
| 第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券          |   | 2.13  | 40,452  | 42,754  | 2042/5/10  |
| 第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券          |   | 2.19  | 42,672  | 45,333  | 2042/6/10  |
| 第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券            |   | 1.85  | 22,332  | 22,638  | 2036/9/10  |
| 第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券          |   | 1.82  | 33,328  | 34,844  | 2036/5/10  |
| 第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券          |   | 1.76  | 50,844  | 53,107  | 2036/11/10 |
| 第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券          |   | 2.26  | 17,820  | 18,952  | 2037/5/10  |
| 第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券          |   | 2.25  | 53,586  | 56,960  | 2037/5/10  |
| 第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券          |   | 1.99  | 22,358  | 23,670  | 2042/12/10 |
| 第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券            |   | 1.52  | 38,256  | 38,997  | 2037/12/10 |
| 第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券           |   | 1.43  | 13,641  | 13,939  | 2038/2/10  |
| 第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券           |   | 0.92  | 14,979  | 15,187  | 2038/6/10  |
| 第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         |   | 2.16  | 23,595  | 25,090  | 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  | 55,172  | 57,251  | 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  | 56,238  | 58,497  | 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  | 28,236  | 29,242  | 2032/11/10 |
| 第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券           |   | 1.8   | 15,861  | 16,449  | 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 | 125,410 | 2028/9/20  |
| 第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         |   | 1.95  | 38,980  | 41,815  | 2044/10/10 |
| 第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券           |   | 1.7   | 19,914  | 20,739  | 2040/6/10  |
| 第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         |   | 1.89  | 39,518  | 42,223  | 2044/12/10 |
| 第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券           |   | 1.69  | 21,524  | 22,446  | 2040/7/10  |
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         |   | 1.81  | 88,374  | 93,917  | 2045/5/10  |
| 第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         |   | 1.71  | 86,172  | 91,217  | 2045/6/10  |
| 第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券           |   | 1.84  | 39,854  | 41,738  | 2041/2/10  |
| 第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         |   | 1.36  | 49,712  | 51,982  | 2045/9/10  |
| 第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券           |   | 2.34  | 39,164  | 41,709  | 2041/5/10  |
| 第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券           |   | 2.3   | 38,256  | 40,803  | 2041/7/10  |
| 第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         |   | 1.77  | 167,751 | 179,243 | 2046/1/10  |
| 第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         |   | 1.79  | 97,264  | 103,697 | 2046/2/10  |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         |   | 1.89  | 92,934  | 99,525  | 2046/5/10  |
| 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         |   | 1.76  | 45,666  | 48,615  | 2046/6/10  |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         |   | 1.67  | 45,836  | 48,609  | 2046/7/10  |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         |   | 1.64  | 50,078  | 53,138  | 2046/8/10  |

| 銘柄                         | 当 期 末 |            |            |            |
|----------------------------|-------|------------|------------|------------|
|                            | 利 率   | 額 面 金 額    | 評 価 額      | 償 還 年 月 日  |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>         | %     | 千円         | 千円         |            |
| 第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券         | 2.18  | 44,432     | 47,504     | 2042/3/10  |
| 第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.51  | 52,750     | 55,707     | 2046/9/10  |
| 第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.48  | 54,520     | 57,525     | 2046/10/10 |
| 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.44  | 59,372     | 62,603     | 2047/2/10  |
| 第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.44  | 60,874     | 64,205     | 2047/4/10  |
| 第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.34  | 62,987     | 66,116     | 2047/5/10  |
| 第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.26  | 122,584    | 128,298    | 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    | 104,818    | 2020/12/18 |
| 第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.12  | 202,563    | 210,598    | 2047/11/10 |
| 第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.04  | 70,720     | 73,418     | 2049/4/10  |
| 第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.01  | 141,648    | 146,835    | 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    | 104,432    | 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    | 112,335    | 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    | 119,304    | 2031/11/18 |
| 第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 0.87  | 152,734    | 157,103    | 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    | 239,768    | 2032/4/16  |
| 第17回国際協力機構債券(財投機関債)        | 0.72  | 30,000     | 31,095     | 2022/12/26 |
| 第13回中日本高速道路                | 1.49  | 100,000    | 103,816    | 2019/12/20 |
| 第38回中日本高速道路                | 0.677 | 100,000    | 101,201    | 2019/2/28  |
| 第21回西日本高速道路                | 0.754 | 100,000    | 104,038    | 2023/12/20 |
| 第17回東京都住宅供給公社債券            | 1.17  | 100,000    | 103,536    | 2021/9/17  |
| 小 計                        |       | 12,473,551 | 13,565,726 |            |
| <b>金融債券</b>                |       |            |            |            |
| い第758号農林債券                 | 0.4   | 100,000    | 100,454    | 2018/7/27  |
| い第760号農林債券                 | 0.4   | 100,000    | 100,519    | 2018/9/27  |
| い第761号農林債券                 | 0.3   | 100,000    | 100,407    | 2018/10/26 |
| い第765号農林債券                 | 0.3   | 200,000    | 201,020    | 2019/2/27  |
| い第769号農林債券                 | 0.3   | 130,000    | 130,776    | 2019/6/27  |
| い第774号農林債券                 | 0.24  | 100,000    | 100,561    | 2019/11/27 |
| い第778号農林債券                 | 0.25  | 300,000    | 302,001    | 2020/3/27  |
| 第288回信金中金債                 | 0.3   | 200,000    | 200,862    | 2018/11/27 |
| 第318回信金中金債                 | 0.04  | 100,000    | 99,919     | 2021/5/27  |
| 第321回信金中金債                 | 0.03  | 200,000    | 199,744    | 2021/8/27  |
| 小 計                        |       | 1,530,000  | 1,536,263  |            |
| <b>普通社債券</b>               |       |            |            |            |
| 第459回東京電力                  | 2.7   | 20,000     | 20,809     | 2019/1/29  |
| 第548回東京電力                  | 2.347 | 100,000    | 114,781    | 2028/9/29  |
| 第559回東京電力                  | 1.377 | 140,000    | 143,498    | 2019/10/29 |
| 第497回中部電力                  | 0.986 | 100,000    | 102,881    | 2020/10/23 |
| 第499回中部電力                  | 1.194 | 50,000     | 52,859     | 2023/6/23  |
| 第518回中部電力                  | 0.19  | 200,000    | 199,718    | 2023/1/25  |
| 第478回関西電力                  | 1.448 | 100,000    | 103,375    | 2020/1/24  |
| 第297回北陸電力                  | 0.976 | 20,000     | 20,555     | 2020/10/23 |
| 第400回九州電力                  | 1.777 | 70,000     | 73,257     | 2020/4/24  |
| 第296回北海道電力                 | 2.027 | 100,000    | 102,109    | 2018/6/25  |
| 第316回北海道電力                 | 1.164 | 100,000    | 103,060    | 2020/6/25  |

| 銘柄                        | 当期末   |         |         |
|---------------------------|-------|---------|---------|
|                           | 利率    | 額面金額    | 評価額     |
| 普通社債券                     | %     | 千円      | 千円      |
| 第319回北海道電力                | 0.514 | 100,000 | 100,862 |
| 第26回関西国際空港                | 1.156 | 100,000 | 103,775 |
| 第15回成田国際空港                | 0.739 | 100,000 | 104,064 |
| 第7回大和ハウス工業                | 0.06  | 100,000 | 99,498  |
| 第10回大和ハウス工業               | 0.001 | 100,000 | 99,949  |
| 第11回セブン&アイ・ホールディングス       | 0.514 | 200,000 | 202,294 |
| 第3回富士フィルムホールディングス         | 0.882 | 100,000 | 103,757 |
| 第4回富士フィルムホールディングス         | 0.005 | 200,000 | 199,312 |
| 第19回豊田自動織機                | 1.109 | 100,000 | 104,141 |
| 第30回豊田自動織機                | 0.001 | 100,000 | 99,763  |
| 第5回日本電産                   | 0.001 | 100,000 | 99,803  |
| 第15回パナソニック                | 0.19  | 100,000 | 99,939  |
| 第12回デンソー                  | 0.01  | 100,000 | 99,548  |
| 第1回明治安田生命2014基金           | 0.51  | 100,000 | 100,705 |
| 第78回三菱商事                  | 1.155 | 100,000 | 104,514 |
| 第79回三菱商事                  | 1.022 | 100,000 | 104,014 |
| 第7回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)    | 2.5   | 200,000 | 209,398 |
| 第8回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)    | 1.62  | 100,000 | 105,877 |
| 第88回三菱東京UFJ銀行             | 2.34  | 100,000 | 120,220 |
| 第6回りそな銀行 (劣後特約付)          | 2.084 | 100,000 | 105,188 |
| 第9回三菱UFJ信託銀行 (劣後特約付)      | 1.68  | 100,000 | 105,452 |
| 第12回住友信託銀行 (劣後特約付)        | 1.373 | 100,000 | 104,014 |
| 第15回住友信託銀行 (劣後特約付)        | 1.62  | 100,000 | 106,340 |
| 第17回三井住友銀行 (劣後特約付)        | 2.8   | 200,000 | 209,102 |
| 第20回三井住友銀行 (劣後特約付)        | 2.21  | 100,000 | 104,393 |
| 第22回三井住友銀行 (劣後特約付)        | 1.43  | 100,000 | 104,101 |
| 第23回三井住友銀行 (劣後特約付)        | 1.61  | 100,000 | 105,005 |
| 第18回みずほ銀行 (劣後特約付)         | 2.14  | 100,000 | 114,458 |
| 第19回みずほ銀行 (劣後特約付)         | 1.67  | 100,000 | 106,533 |
| 第12回芙蓉総合リース               | 0.12  | 100,000 | 99,706  |
| 第38回日産フィナンシャルサービス         | 0.001 | 100,000 | 99,639  |
| 第40回日産フィナンシャルサービス         | 0.001 | 200,000 | 199,278 |
| 第35回ホンダファイナンス             | 0.001 | 100,000 | 99,644  |
| 第37回ホンダファイナンス             | 0.001 | 100,000 | 99,667  |
| 第38回ホンダファイナンス             | 0.01  | 100,000 | 99,509  |
| 第39回ホンダファイナンス             | 0.001 | 100,000 | 99,798  |
| 第52回日立キャピタル               | 0.508 | 100,000 | 100,943 |
| 第62回日立キャピタル               | 0.001 | 200,000 | 199,518 |
| 第9回三井住友ファイナンス&リース         | 0.518 | 100,000 | 100,984 |
| 第14回三井住友ファイナンス&リース        | 0.321 | 100,000 | 100,417 |
| 第39回三菱UFJリース              | 0.12  | 100,000 | 99,703  |
| 第41回三菱UFJリース              | 0.06  | 200,000 | 198,850 |
| 第23回野村ホールディングス            | 1.808 | 100,000 | 105,087 |
| 第24回野村ホールディングス            | 2.329 | 100,000 | 115,234 |
| 第2回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 | 101,823 |
| 第72回三菱地所                  | 2.28  | 100,000 | 114,312 |

| 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30回三菱地所             |   | 2.305 | 100,000     | 118,147     | 2027/3/19  |
| 第11回エヌ・ティ・ティ都市開発     |   | 1.12  | 100,000     | 103,769     | 2021/9/17  |
| 第15回東日本旅客鉄道          |   | 2.65  | 20,000      | 21,671      | 2020/8/25  |
| 第19回東日本旅客鉄道          |   | 2.36  | 100,000     | 110,742     | 2022/2/25  |
| 第32回東日本旅客鉄道          |   | 2.26  | 100,000     | 114,408     | 2024/3/19  |
| 第34回東日本旅客鉄道          |   | 2.53  | 100,000     | 116,756     | 2024/6/20  |
| 第43回東日本旅客鉄道          |   | 1.86  | 100,000     | 106,326     | 2020/12/18 |
| 第100回東日本旅客鉄道         |   | 1.981 | 100,000     | 122,985     | 2044/1/29  |
| 第9回西日本旅客鉄道           |   | 2.28  | 100,000     | 110,528     | 2022/3/25  |
| 第27回西日本旅客鉄道          |   | 1.36  | 100,000     | 103,903     | 2020/6/11  |
| 第6回東海旅客鉄道            |   | 2.39  | 21,000      | 23,278      | 2022/2/15  |
| 第42回東海旅客鉄道           |   | 2.312 | 100,000     | 123,017     | 2029/4/24  |
| 第53回東海旅客鉄道           |   | 1.797 | 100,000     | 118,030     | 2030/10/25 |
| 第63回日本電信電話           |   | 0.69  | 200,000     | 205,764     | 2023/3/20  |
| 第19回KDDI             |   | 1.151 | 100,000     | 102,880     | 2020/6/19  |
| 第21回KDDI             |   | 0.669 | 100,000     | 102,193     | 2024/9/20  |
| 第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ     |   | 0.73  | 100,000     | 102,664     | 2023/9/20  |
| 第8回電源開発              |   | 2.11  | 100,000     | 113,358     | 2024/12/20 |
| 第23回東京ガス             |   | 1.01  | 100,000     | 105,213     | 2023/6/9   |
| 第4回ファーストリテイリング       |   | 0.749 | 100,000     | 102,703     | 2025/12/18 |
| 第20回GEキャピタルコーポレーション  |   | 2.885 | 100,000     | 102,555     | 2018/5/29  |
| 第11回ナショナル・オーストラリア銀行  |   | 0.284 | 100,000     | 100,218     | 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     | 100,413     | 2019/5/2   |
| 第18回ラボバンク・ネダーランド     |   | 0.778 | 100,000     | 100,249     | 2017/11/2  |
| 第23回ラボバンク・ネダーランド     |   | 0.557 | 100,000     | 100,354     | 2018/12/19 |
| 第27回ラボバンク・ネダーランド     |   | 0.38  | 100,000     | 100,037     | 2020/5/22  |
| 小                    | 計 |       | 8,841,000   | 9,229,196   |            |
| 合                    | 計 |       | 192,951,061 | 210,521,700 |            |

## 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<br>602 | 百万円<br>- |

## ○投資信託財産の構成

(2017年5月22日現在)

| 項 目          | 当 期 末             |           |
|--------------|-------------------|-----------|
|              | 評 価 額             | 比 率       |
| 公社債          | 千円<br>210,521,700 | %<br>99.1 |
| コール・ローン等、その他 | 1,926,788         | 0.9       |
| 投資信託財産総額     | 212,448,488       | 100.0     |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月22日現在)

| 項 目             | 当 期 末            |
|-----------------|------------------|
|                 | 円                |
| (A) 資産          | 212,447,168,706  |
| コール・ローン等        | 1,180,720,001    |
| 公社債(評価額)        | 210,521,700,750  |
| 未収入金            | 156,618,780      |
| 未収利息            | 580,815,977      |
| 前払費用            | 6,113,198        |
| 差入委託証拠金         | 1,200,000        |
| (B) 負債          | 415,199,061      |
| 未払解約金           | 415,197,102      |
| 未払利息            | 1,959            |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 212,031,969,645  |
| 元本              | 153,669,783,979  |
| 次期繰越損益金         | 58,362,185,666   |
| (D) 受益権総口数      | 153,669,783,979口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 13,798円          |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 156,236,987,608円  
 期中追加設定元本額 30,516,869,384円  
 期中一部解約元本額 33,084,073,013円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3798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)                | 3,761,708,082円   |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)              | 4,460,103,900円   |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)                | 1,111,830,683円   |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)           | 30,836,038,682円  |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)         | 46,832,531,993円  |
| 三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)           | 11,383,272,944円  |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)             | 224,306,494円     |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)                | 160,966,135円     |
| 三菱UFJ 国内債券インデックスファンド                  | 2,551,311,938円   |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)           | 2,615,512,359円   |
| 三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)          | 11,804,100,701円  |
| 三菱UFJ 日本債券ファンドVA(適格機関投資家限定)           | 37,924,412,703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)   | 127,478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) | 3,559,887円       |
| 合計                                    | 153,669,783,979円 |

## 【お知らせ】

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める(分散型に分類)ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。  
 (2016年7月1日)

## ○損益の状況 (2016年5月21日~2017年5月22日)

| 項 目              | 当 期             |
|------------------|-----------------|
|                  | 円               |
| (A) 配当等収益        | 2,269,052,671   |
| 受取利息             | 2,269,739,543   |
| 支払利息             | △ 686,872       |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 6,483,781,320 |
| 売買益              | 162,737,150     |
| 売買損              | △ 6,646,518,470 |
| (C) 先物取引等取引損益    | △ 1,474,000     |
| 取引益              | 6,401,920       |
| 取引損              | △ 7,875,920     |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 4,216,202,649 |
| (E) 前期繰越損益金      | 63,665,675,310  |
| (F) 追加信託差損益金     | 12,086,729,169  |
| (G) 解約差損益金       | △13,174,016,164 |
| (H) 計(D+E+F+G)   | 58,362,185,666  |
| 次期繰越損益金(H)       | 58,362,185,666  |

(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 外国債券マザーファンド

### 《第17期》決算日2017年5月22日

[計算期間：2016年5月21日～2017年5月22日]

「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」は、5月22日に第17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17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<br>(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     |
| 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  |
| 17期(2017年5月22日) | 25,920 | 0.8   | 441.3251                     | 1.0   | 98.9  | —     | 54,433  |

(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<br>(除く日本、<br>円ベース) |       | 債 券<br>組 入 比 率 | 債 券<br>先 物 比 率 |
|---------------------|---------|-------|----------------------------------|-------|----------------|----------------|
|                     | 騰 落 率   | 騰 落 率 | 騰 落 率                            | 騰 落 率 |                |                |
| (期 首)<br>2016年5月20日 | 円       | %     |                                  | %     | %              | %              |
|                     | 25,716  | —     | 436.8953                         | —     | 98.7           | —              |
| 5月末                 | 25,916  | 0.8   | 441.6129                         | 1.1   | 98.7           | —              |
| 6月末                 | 24,490  | △4.8  | 415.4491                         | △4.9  | 99.1           | —              |
| 7月末                 | 24,887  | △3.2  | 425.0763                         | △2.7  | 98.8           | —              |
| 8月末                 | 24,703  | △3.9  | 419.0226                         | △4.1  | 98.9           | —              |
| 9月末                 | 24,240  | △5.7  | 414.9990                         | △5.0  | 99.2           | —              |
| 10月末                | 24,279  | △5.6  | 414.5482                         | △5.1  | 99.0           | —              |
| 11月末                | 25,255  | △1.8  | 431.0003                         | △1.3  | 98.7           | —              |
| 12月末                | 26,042  | 1.3   | 442.1486                         | 1.2   | 98.3           | —              |
| 2017年1月末            | 25,421  | △1.1  | 432.5967                         | △1.0  | 99.1           | —              |
| 2月末                 | 25,287  | △1.7  | 429.5990                         | △1.7  | 99.2           | —              |
| 3月末                 | 25,290  | △1.7  | 428.1895                         | △2.0  | 98.9           | —              |
| 4月末                 | 25,444  | △1.1  | 432.7440                         | △1.0  | 98.7           | —              |
| (期 末)<br>2017年5月22日 | 25,920  | 0.8   | 441.3251                         | 1.0   | 98.9           | —              |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

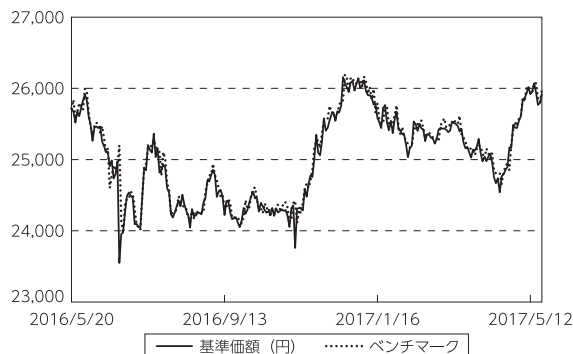
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.8%の上昇となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(1.0%)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、2016年6月にかけて世界的な景気減速懸念が強まったことなどを背景に上昇しましたが、その後は米連邦準備制度理事会（FRB）の利上げに対する期待が高まったことなどから下落しました。

## ◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、2016年6月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、米ドルが対円で下落しましたが、その後、FRBの利上げに対する期待が高まったことなどから、米ドルが対円で買われました。期首との比較では、米ドルは対円で1.3%上昇しました。
- ・円・ユーロ相場は、2016年6月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、ユーロが対円で下落しましたが、米国大統領選挙以降、大半の主要通貨に対して円安が進行し、ユーロは対円で上昇しました。期首との比較では、ユーロは対円で1.2%上昇しました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークである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1.0%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.2\%$ 程度となりました。

|                 | ポートフォリオ<br>要 因 | 管理コスト等<br>要 因     | 評価時価差異<br>に基づく要因  | 合 計               |
|-----------------|----------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| ベンチマーク<br>とのカイ離 | 0.0%程度         | $\Delta 0.0\%$ 程度 | $\Delta 0.2\%$ 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स्ट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 $\Delta 0.2\%$ 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

(2016年5月21日～2017年5月22日)

| 項 目                   | 当 期    |            | 項 目 の 概 要                       |
|-----------------------|--------|------------|---------------------------------|
|                       | 金 額    | 比 率        |                                 |
| (a) そ の 他 費 用         | 円<br>9 | %<br>0.035 | (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)    | (0.035)    | 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      | 0.035      |                                 |
| 期中の平均基準価額は、25,104円です。 |        |            |                                 |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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



## ○利害関係人との取引状況等

(2016年5月21日～2017年5月22日)

## 利害関係人との取引状況

| 区 分    | 買付額等<br>A          |               |           | 売付額等<br>C          |               |           |
|--------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|-----------|
|        | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ |           | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |           |
| 為替直物取引 | 百万円<br>4,020       | 百万円<br>2,560  | %<br>63.7 | 百万円<br>23,107      | 百万円<br>12,940 | %<br>56.0 |

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

## ○組入資産の明細

(2017年5月22日現在)

## 外国公社債

## (A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分     | 額面金額                  | 当 期                   |                  |           | 末               |           |           |          |
|---------|-----------------------|-----------------------|------------------|-----------|-----------------|-----------|-----------|----------|
|         |                       | 評 価 額                 |                  | 組入比率      | うちBB格以下<br>組入比率 | 残存期間別組入比率 |           |          |
|         |                       | 外貨建金額                 | 邦貨換算金額           |           |                 | 5年以上      | 2年以上      | 2年未満     |
| アメリカ    | 千アメリカドル<br>207,950    | 千アメリカドル<br>212,060    | 千円<br>23,653,240 | %<br>43.5 | %<br>—          | %<br>17.8 | %<br>17.1 | %<br>8.5 |
| カナダ     | 千カナダドル<br>12,270      | 千カナダドル<br>13,561      | 1,117,295        | 2.1       | —               | 1.0       | 0.7       | 0.4      |
| メキシコ    | 千メキシコペソ<br>77,350     | 千メキシコペソ<br>80,105     | 476,625          | 0.9       | —               | 0.5       | 0.2       | 0.1      |
| ユーロ     | 千ユーロ                  | 千ユーロ                  |                  |           |                 |           |           |          |
| ドイツ     | 26,330                | 31,020                | 3,871,050        | 7.1       | —               | 4.2       | 2.0       | 1.0      |
| イタリア    | 36,610                | 41,880                | 5,226,286        | 9.6       | —               | 5.6       | 2.7       | 1.3      |
| フランス    | 35,990                | 42,805                | 5,341,738        | 9.8       | —               | 6.0       | 2.8       | 0.9      |
| オランダ    | 8,060                 | 9,556                 | 1,192,503        | 2.2       | —               | 1.4       | 0.6       | 0.2      |
| スペイン    | 20,830                | 24,405                | 3,045,608        | 5.6       | —               | 3.4       | 1.6       | 0.7      |
| ベルギー    | 8,740                 | 10,860                | 1,355,275        | 2.5       | —               | 1.8       | 0.5       | 0.1      |
| オーストリア  | 5,410                 | 6,490                 | 809,966          | 1.5       | —               | 0.9       | 0.4       | 0.1      |
| フィンランド  | 2,410                 | 2,680                 | 334,486          | 0.6       | —               | 0.4       | 0.2       | 0.0      |
| アイルランド  | 3,050                 | 3,520                 | 439,343          | 0.8       | —               | 0.4       | 0.3       | 0.1      |
| イギリス    | 千イギリスポンド<br>20,860    | 千イギリスポンド<br>27,094    | 3,922,132        | 7.2       | —               | 5.2       | 1.6       | 0.4      |
| スイス     | 千スイスフラン<br>710        | 千スイスフラン<br>862        | 98,788           | 0.2       | —               | 0.1       | 0.1       | 0.0      |
| スウェーデン  | 千スウェーデンクローネ<br>16,400 | 千スウェーデンクローネ<br>18,902 | 241,390          | 0.4       | —               | 0.3       | 0.1       | 0.1      |
| ノルウェー   | 千ノルウェークローネ<br>10,750  | 千ノルウェークローネ<br>11,515  | 153,271          | 0.3       | —               | 0.2       | 0.1       | —        |
| デンマーク   | 千デンマーククローネ<br>15,750  | 千デンマーククローネ<br>19,631  | 329,017          | 0.6       | —               | 0.4       | 0.2       | 0.0      |
| ポーランド   | 千ポーランドズロチ<br>11,420   | 千ポーランドズロチ<br>11,768   | 350,241          | 0.6       | —               | 0.3       | 0.3       | 0.1      |
| オーストラリア | 千オーストラリアドル<br>12,510  | 千オーストラリアドル<br>13,592  | 1,128,604        | 2.1       | —               | 1.3       | 0.6       | 0.2      |
| シンガポール  | 千シンガポールドル<br>2,440    | 千シンガポールドル<br>2,581    | 207,601          | 0.4       | —               | 0.2       | 0.1       | 0.0      |
| マレーシア   | 千マレーシアリングギット<br>8,550 | 千マレーシアリングギット<br>8,561 | 221,582          | 0.4       | —               | 0.2       | 0.2       | 0.0      |
| 南アフリカ   | 千南アフリカランド<br>37,600   | 千南アフリカランド<br>34,711   | 292,268          | 0.5       | —               | 0.5       | 0.1       | 0.0      |
| 合 計     | —                     | —                     | 53,808,318       | 98.9      | —               | 52.0      | 32.6      | 14.3     |

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

## (B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄   | 銘柄                  | 利率    | 当<br>期<br>額面金額 | 期<br>末<br>評<br>価<br>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                |       |                |                       |         |            |
|      | 0.625 T-NOTE 180430 | 0.625 | 700            | 696                   | 77,687  | 2018/4/30  |
|      | 0.75 T-NOTE 180731  | 0.75  | 1,800          | 1,790                 | 199,744 | 2018/7/31  |
|      | 0.75 T-NOTE 180930  | 0.75  | 1,700          | 1,690                 | 188,514 | 2018/9/30  |
|      | 0.75 T-NOTE 190215  | 0.75  | 700            | 694                   | 77,422  | 2019/2/15  |
|      | 0.75 T-NOTE 190715  | 0.75  | 700            | 691                   | 77,153  | 2019/7/15  |
|      | 0.875 T-NOTE 180531 | 0.875 | 800            | 797                   | 88,970  | 2018/5/31  |
|      | 0.875 T-NOTE 181015 | 0.875 | 1,400          | 1,393                 | 155,466 | 2018/10/15 |
|      | 0.875 T-NOTE 190415 | 0.875 | 1,100          | 1,091                 | 121,797 | 2019/4/15  |
|      | 0.875 T-NOTE 190731 | 0.875 | 300            | 297                   | 33,152  | 2019/7/31  |
|      | 0.875 T-NOTE 190915 | 0.875 | 900            | 890                   | 99,346  | 2019/9/15  |
|      | 1 T-NOTE 180815     | 1.0   | 700            | 698                   | 77,910  | 2018/8/15  |
|      | 1 T-NOTE 180915     | 1.0   | 1,600          | 1,595                 | 177,996 | 2018/9/15  |
|      | 1 T-NOTE 181130     | 1.0   | 1,400          | 1,395                 | 155,649 | 2018/11/30 |
|      | 1 T-NOTE 190831     | 1.0   | 300            | 297                   | 33,221  | 2019/8/31  |
|      | 1 T-NOTE 190930     | 1.0   | 700            | 694                   | 77,474  | 2019/9/30  |
|      | 1 T-NOTE 191115     | 1.0   | 1,250          | 1,239                 | 138,221 | 2019/11/15 |
|      | 1 T-NOTE 191130     | 1.0   | 900            | 892                   | 99,519  | 2019/11/30 |
|      | 1.125 T-NOTE 180615 | 1.125 | 600            | 599                   | 66,895  | 2018/6/15  |
|      | 1.125 T-NOTE 191231 | 1.125 | 800            | 794                   | 88,667  | 2019/12/31 |
|      | 1.125 T-NOTE 200430 | 1.125 | 350            | 346                   | 38,688  | 2020/4/30  |
|      | 1.125 T-NOTE 210228 | 1.125 | 700            | 687                   | 76,650  | 2021/2/28  |
|      | 1.125 T-NOTE 210630 | 1.125 | 2,000          | 1,955                 | 218,147 | 2021/6/30  |
|      | 1.125 T-NOTE 210731 | 1.125 | 2,000          | 1,953                 | 217,921 | 2021/7/31  |
|      | 1.125 T-NOTE 210930 | 1.125 | 1,300          | 1,267                 | 141,376 | 2021/9/30  |
|      | 1.25 T-NOTE 181031  | 1.25  | 300            | 300                   | 33,480  | 2018/10/31 |
|      | 1.25 T-NOTE 181115  | 1.25  | 1,500          | 1,500                 | 167,394 | 2018/11/15 |
|      | 1.25 T-NOTE 181130  | 1.25  | 500            | 500                   | 55,785  | 2018/11/30 |
|      | 1.25 T-NOTE 181215  | 1.25  | 1,300          | 1,300                 | 145,052 | 2018/12/15 |
|      | 1.25 T-NOTE 190131  | 1.25  | 1,200          | 1,200                 | 133,848 | 2019/1/31  |
|      | 1.25 T-NOTE 190430  | 1.25  | 450            | 449                   | 50,167  | 2019/4/30  |
|      | 1.25 T-NOTE 191031  | 1.25  | 700            | 698                   | 77,907  | 2019/10/31 |
|      | 1.25 T-NOTE 200131  | 1.25  | 1,100          | 1,096                 | 122,262 | 2020/1/31  |
|      | 1.25 T-NOTE 200229  | 1.25  | 100            | 99                    | 11,106  | 2020/2/29  |
|      | 1.25 T-NOTE 210331  | 1.25  | 900            | 886                   | 98,935  | 2021/3/31  |
|      | 1.25 T-NOTE 211031  | 1.25  | 1,300          | 1,273                 | 142,011 | 2021/10/31 |
|      | 1.25 T-NOTE 230731  | 1.25  | 300            | 287                   | 32,055  | 2023/7/31  |
|      | 1.375 T-NOTE 180630 | 1.375 | 2,100          | 2,104                 | 234,773 | 2018/6/30  |
|      | 1.375 T-NOTE 180731 | 1.375 | 1,000          | 1,002                 | 111,792 | 2018/7/31  |
|      | 1.375 T-NOTE 180930 | 1.375 | 400            | 400                   | 44,710  | 2018/9/30  |
|      | 1.375 T-NOTE 181130 | 1.375 | 800            | 801                   | 89,427  | 2018/11/30 |
|      | 1.375 T-NOTE 181231 | 1.375 | 1,400          | 1,403                 | 156,503 | 2018/12/31 |
|      | 1.375 T-NOTE 190228 | 1.375 | 1,700          | 1,703                 | 189,988 | 2019/2/28  |
|      | 1.375 T-NOTE 200115 | 1.375 | 800            | 799                   | 89,214  | 2020/1/15  |
|      | 1.375 T-NOTE 200131 | 1.375 | 1,000          | 999                   | 111,509 | 2020/1/31  |



| 銘柄                 | 銘柄   | 当 期 末               |         |         |            | 償還年月日   |            |
|--------------------|------|---------------------|---------|---------|------------|---------|------------|
|                    |      | 利 率                 | 額面金額    | 評 価 額   |            |         |            |
|                    |      |                     |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額     |         |            |
|                    |      | %                   | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円         |         |            |
| アメリカ               | 国債証券 | 1.375 T-NOTE 200229 | 1.375   | 1,100   | 1,098      | 122,569 | 2020/2/29  |
|                    |      | 1.375 T-NOTE 200331 | 1.375   | 100     | 99         | 11,140  | 2020/3/31  |
|                    |      | 1.375 T-NOTE 200430 | 1.375   | 1,050   | 1,047      | 116,888 | 2020/4/30  |
|                    |      | 1.375 T-NOTE 200831 | 1.375   | 900     | 895        | 99,915  | 2020/8/31  |
|                    |      | 1.375 T-NOTE 200930 | 1.375   | 1,900   | 1,889      | 210,750 | 2020/9/30  |
|                    |      | 1.375 T-NOTE 201031 | 1.375   | 1,900   | 1,888      | 210,601 | 2020/10/31 |
|                    |      | 1.375 T-NOTE 210131 | 1.375   | 1,200   | 1,189      | 132,718 | 2021/1/31  |
|                    |      | 1.375 T-NOTE 230630 | 1.375   | 1,700   | 1,642      | 183,203 | 2023/6/30  |
|                    |      | 1.375 T-NOTE 230831 | 1.375   | 1,000   | 964        | 107,540 | 2023/8/31  |
|                    |      | 1.375 T-NOTE 230930 | 1.375   | 1,000   | 963        | 107,444 | 2023/9/30  |
|                    |      | 1.5 T-NOTE 180831   | 1.5     | 800     | 803        | 89,573  | 2018/8/31  |
|                    |      | 1.5 T-NOTE 181231   | 1.5     | 1,300   | 1,305      | 145,591 | 2018/12/31 |
|                    |      | 1.5 T-NOTE 190131   | 1.5     | 1,800   | 1,807      | 201,603 | 2019/1/31  |
|                    |      | 1.5 T-NOTE 190228   | 1.5     | 1,200   | 1,204      | 134,402 | 2019/2/28  |
|                    |      | 1.5 T-NOTE 190331   | 1.5     | 400     | 401        | 44,814  | 2019/3/31  |
|                    |      | 1.5 T-NOTE 190531   | 1.5     | 900     | 903        | 100,813 | 2019/5/31  |
|                    |      | 1.5 T-NOTE 191031   | 1.5     | 1,700   | 1,706      | 190,314 | 2019/10/31 |
|                    |      | 1.5 T-NOTE 191130   | 1.5     | 500     | 501        | 55,955  | 2019/11/30 |
|                    |      | 1.5 T-NOTE 200415   | 1.5     | 2,400   | 2,404      | 268,187 | 2020/4/15  |
|                    |      | 1.5 T-NOTE 200531   | 1.5     | 1,200   | 1,201      | 133,963 | 2020/5/31  |
|                    |      | 1.5 T-NOTE 220131   | 1.5     | 200     | 197        | 22,039  | 2022/1/31  |
|                    |      | 1.5 T-NOTE 230331   | 1.5     | 900     | 878        | 97,993  | 2023/3/31  |
|                    |      | 1.5 T-NOTE 260815   | 1.5     | 1,650   | 1,549      | 172,811 | 2026/8/15  |
|                    |      | 1.625 T-NOTE 190331 | 1.625   | 1,200   | 1,208      | 134,747 | 2019/3/31  |
|                    |      | 1.625 T-NOTE 190430 | 1.625   | 1,100   | 1,107      | 123,527 | 2019/4/30  |
|                    |      | 1.625 T-NOTE 190630 | 1.625   | 1,800   | 1,812      | 202,120 | 2019/6/30  |
|                    |      | 1.625 T-NOTE 190731 | 1.625   | 1,400   | 1,409      | 157,229 | 2019/7/31  |
|                    |      | 1.625 T-NOTE 190831 | 1.625   | 1,600   | 1,610      | 179,663 | 2019/8/31  |
|                    |      | 1.625 T-NOTE 191231 | 1.625   | 1,200   | 1,207      | 134,695 | 2019/12/31 |
|                    |      | 1.625 T-NOTE 200315 | 1.625   | 2,100   | 2,112      | 235,579 | 2020/3/15  |
|                    |      | 1.625 T-NOTE 200731 | 1.625   | 250     | 250        | 27,987  | 2020/7/31  |
|                    |      | 1.625 T-NOTE 201130 | 1.625   | 1,300   | 1,302      | 145,262 | 2020/11/30 |
|                    |      | 1.625 T-NOTE 220815 | 1.625   | 550     | 543        | 60,671  | 2022/8/15  |
|                    |      | 1.625 T-NOTE 221115 | 1.625   | 1,400   | 1,381      | 154,082 | 2022/11/15 |
|                    |      | 1.625 T-NOTE 230430 | 1.625   | 1,300   | 1,276      | 142,396 | 2023/4/30  |
|                    |      | 1.625 T-NOTE 231031 | 1.625   | 1,200   | 1,173      | 130,867 | 2023/10/31 |
|                    |      | 1.625 T-NOTE 260215 | 1.625   | 1,750   | 1,668      | 186,151 | 2026/2/15  |
|                    |      | 1.625 T-NOTE 260515 | 1.625   | 2,300   | 2,188      | 244,095 | 2026/5/15  |
|                    |      | 1.75 T-NOTE 181031  | 1.75    | 1,100   | 1,108      | 123,599 | 2018/10/31 |
|                    |      | 1.75 T-NOTE 190930  | 1.75    | 500     | 504        | 56,310  | 2019/9/30  |
| 1.75 T-NOTE 201031 | 1.75 | 1,350               | 1,358   | 151,567 | 2020/10/31 |         |            |
| 1.75 T-NOTE 201231 | 1.75 | 250                 | 251     | 28,037  | 2020/12/31 |         |            |
| 1.75 T-NOTE 211130 | 1.75 | 1,550               | 1,551   | 173,008 | 2021/11/30 |         |            |
| 1.75 T-NOTE 220228 | 1.75 | 100                 | 99      | 11,139  | 2022/2/28  |         |            |
| 1.75 T-NOTE 220331 | 1.75 | 950                 | 948     | 105,780 | 2022/3/31  |         |            |

| 銘柄   | 銘柄                  | 当 期 末 |         |         |         | 償還年月日      |
|------|---------------------|-------|---------|---------|---------|------------|
|      |                     | 利 率   | 額面金額    | 評 価 額   |         |            |
|      |                     |       |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額  |            |
|      |                     | %     | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円      |            |
| アメリカ | 国債証券                |       |         |         |         |            |
|      | 1.75 T-NOTE 220430  | 1.75  | 550     | 548     | 61,217  | 2022/4/30  |
|      | 1.75 T-NOTE 220515  | 1.75  | 1,250   | 1,247   | 139,141 | 2022/5/15  |
|      | 1.75 T-NOTE 220930  | 1.75  | 1,100   | 1,093   | 122,003 | 2022/9/30  |
|      | 1.75 T-NOTE 230131  | 1.75  | 850     | 842     | 93,986  | 2023/1/31  |
|      | 1.75 T-NOTE 230515  | 1.75  | 1,200   | 1,186   | 132,347 | 2023/5/15  |
|      | 1.875 T-NOTE 211130 | 1.875 | 900     | 905     | 100,966 | 2021/11/30 |
|      | 1.875 T-NOTE 220331 | 1.875 | 1,700   | 1,707   | 190,447 | 2022/3/31  |
|      | 1.875 T-NOTE 220531 | 1.875 | 100     | 100     | 11,197  | 2022/5/31  |
|      | 1.875 T-NOTE 220831 | 1.875 | 1,000   | 1,001   | 111,705 | 2022/8/31  |
|      | 1.875 T-NOTE 221031 | 1.875 | 1,200   | 1,200   | 133,879 | 2022/10/31 |
|      | 2 T-NOTE 200731     | 2.0   | 600     | 609     | 67,954  | 2020/7/31  |
|      | 2 T-NOTE 200930     | 2.0   | 800     | 812     | 90,584  | 2020/9/30  |
|      | 2 T-NOTE 201130     | 2.0   | 600     | 608     | 67,896  | 2020/11/30 |
|      | 2 T-NOTE 210228     | 2.0   | 700     | 709     | 79,188  | 2021/2/28  |
|      | 2 T-NOTE 210531     | 2.0   | 1,100   | 1,114   | 124,309 | 2021/5/31  |
|      | 2 T-NOTE 210831     | 2.0   | 1,100   | 1,113   | 124,165 | 2021/8/31  |
|      | 2 T-NOTE 211031     | 2.0   | 1,100   | 1,112   | 124,083 | 2021/10/31 |
|      | 2 T-NOTE 211115     | 2.0   | 1,500   | 1,517   | 169,303 | 2021/11/15 |
|      | 2 T-NOTE 220215     | 2.0   | 1,200   | 1,213   | 135,348 | 2022/2/15  |
|      | 2 T-NOTE 220731     | 2.0   | 1,500   | 1,512   | 168,682 | 2022/7/31  |
|      | 2 T-NOTE 221130     | 2.0   | 1,200   | 1,207   | 134,642 | 2022/11/30 |
|      | 2 T-NOTE 230215     | 2.0   | 2,300   | 2,310   | 257,764 | 2023/2/15  |
|      | 2 T-NOTE 250215     | 2.0   | 1,900   | 1,881   | 209,856 | 2025/2/15  |
|      | 2 T-NOTE 250815     | 2.0   | 3,000   | 2,960   | 330,201 | 2025/8/15  |
|      | 2 T-NOTE 261115     | 2.0   | 1,150   | 1,126   | 125,615 | 2026/11/15 |
|      | 2.125 T-NOTE 200831 | 2.125 | 1,600   | 1,630   | 181,865 | 2020/8/31  |
|      | 2.125 T-NOTE 210131 | 2.125 | 100     | 101     | 11,360  | 2021/1/31  |
|      | 2.125 T-NOTE 210630 | 2.125 | 1,400   | 1,424   | 158,900 | 2021/6/30  |
|      | 2.125 T-NOTE 210815 | 2.125 | 1,700   | 1,730   | 193,010 | 2021/8/15  |
|      | 2.125 T-NOTE 210930 | 2.125 | 1,100   | 1,118   | 124,764 | 2021/9/30  |
|      | 2.125 T-NOTE 211231 | 2.125 | 2,100   | 2,133   | 238,003 | 2021/12/31 |
|      | 2.125 T-NOTE 221231 | 2.125 | 1,000   | 1,011   | 112,855 | 2022/12/31 |
|      | 2.125 T-NOTE 231130 | 2.125 | 900     | 906     | 101,146 | 2023/11/30 |
|      | 2.125 T-NOTE 240229 | 2.125 | 850     | 854     | 95,349  | 2024/2/29  |
|      | 2.125 T-NOTE 240331 | 2.125 | 750     | 753     | 84,079  | 2024/3/31  |
|      | 2.125 T-NOTE 250515 | 2.125 | 2,200   | 2,195   | 244,870 | 2025/5/15  |
|      | 2.25 T-BOND 460815  | 2.25  | 600     | 520     | 58,072  | 2046/8/15  |
|      | 2.25 T-NOTE 180731  | 2.25  | 800     | 809     | 90,343  | 2018/7/31  |
|      | 2.25 T-NOTE 210331  | 2.25  | 200     | 204     | 22,820  | 2021/3/31  |
|      | 2.25 T-NOTE 210430  | 2.25  | 1,050   | 1,073   | 119,788 | 2021/4/30  |
|      | 2.25 T-NOTE 210731  | 2.25  | 1,300   | 1,329   | 148,241 | 2021/7/31  |
|      | 2.25 T-NOTE 231231  | 2.25  | 1,000   | 1,014   | 113,134 | 2023/12/31 |
|      | 2.25 T-NOTE 241115  | 2.25  | 700     | 706     | 78,828  | 2024/11/15 |
|      | 2.25 T-NOTE 251115  | 2.25  | 3,200   | 3,214   | 358,545 | 2025/11/15 |
|      | 2.25 T-NOTE 270215  | 2.25  | 900     | 899     | 100,378 | 2027/2/15  |

| 銘柄   |      | 当 期 末 |         |         |         |            |  |
|------|------|-------|---------|---------|---------|------------|--|
|      |      | 利 率   | 額面金額    | 評 価 額   |         | 償還年月日      |  |
|      |      |       |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額  |            |  |
|      |      | %     | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円      |            |  |
| アメリカ | 国債証券 |       |         |         |         |            |  |
|      |      | 2.375 | 1,300   | 1,336   | 149,046 | 2020/12/31 |  |
|      |      | 2.375 | 1,030   | 1,050   | 117,156 | 2024/8/15  |  |
|      |      | 2.5   | 2,900   | 2,670   | 297,891 | 2045/2/15  |  |
|      |      | 2.5   | 950     | 872     | 97,303  | 2046/2/15  |  |
|      |      | 2.5   | 600     | 550     | 61,423  | 2046/5/15  |  |
|      |      | 2.5   | 1,650   | 1,700   | 189,691 | 2023/8/15  |  |
|      |      | 2.5   | 1,550   | 1,595   | 177,911 | 2024/5/15  |  |
|      |      | 2.625 | 300     | 304     | 33,918  | 2018/4/30  |  |
|      |      | 2.625 | 1,500   | 1,552   | 173,178 | 2020/8/15  |  |
|      |      | 2.625 | 1,500   | 1,553   | 173,283 | 2020/11/15 |  |
|      |      | 2.75  | 450     | 439     | 49,008  | 2042/8/15  |  |
|      |      | 2.75  | 950     | 926     | 103,396 | 2042/11/15 |  |
|      |      | 2.75  | 1,000   | 1,025   | 114,415 | 2019/2/15  |  |
|      |      | 2.75  | 1,900   | 1,986   | 221,595 | 2023/11/15 |  |
|      |      | 2.75  | 1,300   | 1,359   | 151,606 | 2024/2/15  |  |
|      |      | 2.875 | 1,850   | 1,844   | 205,784 | 2043/5/15  |  |
|      |      | 2.875 | 1,250   | 1,241   | 138,433 | 2045/8/15  |  |
|      |      | 2.875 | 950     | 943     | 105,193 | 2046/11/15 |  |
|      |      | 3.0   | 200     | 204     | 22,823  | 2042/5/15  |  |
|      |      | 3.0   | 1,500   | 1,529   | 170,577 | 2044/11/15 |  |
|      |      | 3.0   | 1,700   | 1,730   | 193,040 | 2045/5/15  |  |
|      |      | 3.0   | 1,200   | 1,220   | 136,179 | 2045/11/15 |  |
|      |      | 3.0   | 240     | 244     | 27,258  | 2047/2/15  |  |
|      |      | 3.125 | 500     | 523     | 58,421  | 2041/11/15 |  |
|      |      | 3.125 | 250     | 261     | 29,189  | 2042/2/15  |  |
|      |      | 3.125 | 1,130   | 1,179   | 131,613 | 2043/2/15  |  |
|      |      | 3.125 | 1,950   | 2,036   | 227,137 | 2044/8/15  |  |
|      |      | 3.125 | 800     | 829     | 92,484  | 2019/5/15  |  |
|      |      | 3.125 | 1,100   | 1,162   | 129,619 | 2021/5/15  |  |
|      |      | 3.375 | 1,650   | 1,802   | 201,064 | 2044/5/15  |  |
|      |      | 3.375 | 300     | 314     | 35,112  | 2019/11/15 |  |
|      |      | 3.5   | 350     | 392     | 43,824  | 2039/2/15  |  |
|      |      | 3.5   | 800     | 848     | 94,603  | 2020/5/15  |  |
|      |      | 3.625 | 1,250   | 1,422   | 158,672 | 2043/8/15  |  |
|      |      | 3.625 | 1,050   | 1,196   | 133,431 | 2044/2/15  |  |
|      |      | 3.625 | 700     | 735     | 82,052  | 2019/8/15  |  |
|      |      | 3.625 | 1,050   | 1,112   | 124,102 | 2020/2/15  |  |
|      |      | 3.625 | 1,500   | 1,609   | 179,505 | 2021/2/15  |  |
|      |      | 3.75  | 500     | 579     | 64,686  | 2041/8/15  |  |
|      |      | 3.75  | 800     | 930     | 103,746 | 2043/11/15 |  |
|      |      | 3.75  | 1,800   | 1,866   | 208,230 | 2018/11/15 |  |
|      |      | 3.875 | 550     | 649     | 72,451  | 2040/8/15  |  |
|      |      | 3.875 | 600     | 615     | 68,688  | 2018/5/15  |  |
|      |      | 4.0   | 1,300   | 1,344   | 149,946 | 2018/8/15  |  |
|      |      | 4.25  | 350     | 435     | 48,615  | 2039/5/15  |  |

| 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 | 4.25 T-BOND 401115       | 4.25  | 550     | 685     | 76,496     | 2040/11/15 |
|      | 4.375 T-BOND 380215      | 4.375 | 300     | 381     | 42,512     | 2038/2/15  |
|      | 4.375 T-BOND 391115      | 4.375 | 150     | 189     | 21,186     | 2039/11/15 |
|      | 4.375 T-BOND 400515      | 4.375 | 500     | 633     | 70,684     | 2040/5/15  |
|      | 4.375 T-BOND 410515      | 4.375 | 600     | 762     | 85,050     | 2041/5/15  |
|      | 4.5 T-BOND 360215        | 4.5   | 450     | 578     | 64,580     | 2036/2/15  |
|      | 4.5 T-BOND 380515        | 4.5   | 200     | 258     | 28,793     | 2038/5/15  |
|      | 4.5 T-BOND 390815        | 4.5   | 300     | 386     | 43,090     | 2039/8/15  |
|      | 4.625 T-BOND 400215      | 4.625 | 600     | 785     | 87,659     | 2040/2/15  |
|      | 4.75 T-BOND 410215       | 4.75  | 350     | 468     | 52,214     | 2041/2/15  |
|      | 5 T-BOND 370515          | 5.0   | 250     | 341     | 38,128     | 2037/5/15  |
|      | 5.25 T-BOND 281115       | 5.25  | 300     | 387     | 43,241     | 2028/11/15 |
|      | 5.25 T-BOND 290215       | 5.25  | 50      | 64      | 7,233      | 2029/2/15  |
|      | 5.375 T-BOND 310215      | 5.375 | 400     | 540     | 60,290     | 2031/2/15  |
|      | 5.5 T-BOND 280815        | 5.5   | 200     | 262     | 29,287     | 2028/8/15  |
|      | 6 T-BOND 260215          | 6.0   | 1,550   | 2,020   | 225,414    | 2026/2/15  |
|      | 6.125 T-BOND 271115      | 6.125 | 300     | 407     | 45,445     | 2027/11/15 |
|      | 6.25 T-BOND 230815       | 6.25  | 100     | 125     | 13,976     | 2023/8/15  |
|      | 6.25 T-BOND 300515       | 6.25  | 300     | 429     | 47,952     | 2030/5/15  |
|      | 6.5 T-BOND 261115        | 6.5   | 500     | 682     | 76,121     | 2026/11/15 |
|      | 8 T-BOND 211115          | 8.0   | 600     | 762     | 85,009     | 2021/11/15 |
|      | 8.125 T-BOND 190815      | 8.125 | 300     | 344     | 38,469     | 2019/8/15  |
|      | 8.75 T-BOND 200815       | 8.75  | 800     | 982     | 109,574    | 2020/8/15  |
|      | 8.875 T-BOND 190215      | 8.875 | 600     | 679     | 75,767     | 2019/2/15  |
| 小計   |                          |       |         |         | 23,653,240 |            |
| カナダ  |                          |       | 千カナダドル  | 千カナダドル  |            |            |
| 国債証券 | 0.25 CAN GOVT 180501     | 0.25  | 800     | 797     | 65,684     | 2018/5/1   |
|      | 0.5 CAN GOVT 181101      | 0.5   | 400     | 399     | 32,890     | 2018/11/1  |
|      | 0.5 CAN GOVT 220301      | 0.5   | 200     | 195     | 16,132     | 2022/3/1   |
|      | 0.75 CAN GOVT 200901     | 0.75  | 600     | 598     | 49,348     | 2020/9/1   |
|      | 0.75 CAN GOVT 210301     | 0.75  | 400     | 398     | 32,827     | 2021/3/1   |
|      | 0.75 CAN GOVT 210901     | 0.75  | 750     | 745     | 61,423     | 2021/9/1   |
|      | 1 CAN GOVT 220901        | 1.0   | 100     | 99      | 8,230      | 2022/9/1   |
|      | 1 CAN GOVT 270601        | 1.0   | 150     | 143     | 11,816     | 2027/6/1   |
|      | 1.5 CAN GOVT 200301      | 1.5   | 600     | 612     | 50,459     | 2020/3/1   |
|      | 1.5 CAN GOVT 230601      | 1.5   | 550     | 563     | 46,403     | 2023/6/1   |
|      | 1.5 CAN GOVT 260601      | 1.5   | 400     | 404     | 33,337     | 2026/6/1   |
|      | 1.75 CAN GOVT 190301     | 1.75  | 600     | 611     | 50,389     | 2019/3/1   |
|      | 1.75 CAN GOVT 190901     | 1.75  | 300     | 307     | 25,301     | 2019/9/1   |
|      | 2.25 CAN GOVT 250601     | 2.25  | 450     | 483     | 39,849     | 2025/6/1   |
|      | 2.5 CAN GOVT 240601      | 2.5   | 400     | 435     | 35,883     | 2024/6/1   |
|      | 2.75 CAN GOVT 220601     | 2.75  | 550     | 597     | 49,229     | 2022/6/1   |
|      | 2.75 CAN GOVT 481201     | 2.75  | 290     | 332     | 27,431     | 2048/12/1  |
|      | 2.75 CANADA GOVER 641201 | 2.75  | 150     | 180     | 14,873     | 2064/12/1  |
|      | 3.25 CAN GOVT 210601     | 3.25  | 350     | 382     | 31,546     | 2021/6/1   |

| 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 | 3.5 CAN GOVT 200601      | 3.5              | 300    | 324        | 26,733    | 2020/6/1   |            |
|                          |      | 3.5 CAN GOVT 451201      | 3.5              | 540    | 696        | 57,388    | 2045/12/1  |            |
|                          |      | 3.75 CAN GOVT 190601     | 3.75             | 1,000  | 1,061      | 87,454    | 2019/6/1   |            |
|                          |      | 4 CAN GOVT 410601        | 4.0              | 510    | 689        | 56,841    | 2041/6/1   |            |
|                          |      | 4.25 CAN GOVT 180601     | 4.25             | 700    | 725        | 59,804    | 2018/6/1   |            |
|                          |      | 5 CAN GOVT 370601        | 5.0              | 320    | 475        | 39,140    | 2037/6/1   |            |
|                          |      | 5.75 CAN GOVT 290601     | 5.75             | 360    | 519        | 42,831    | 2029/6/1   |            |
|                          |      | 5.75 CAN GOVT 330601     | 5.75             | 350    | 536        | 44,171    | 2033/6/1   |            |
|                          |      | 8 CAN GOVT 270601        | 8.0              | 150    | 241        | 19,870    | 2027/6/1   |            |
| 小 計                      |      |                          |                  |        |            | 1,117,295 |            |            |
| メキシコ                     | 国債証券 | 10 MEXICAN BONOS 241205  | 10.0             | 9,250  | 10,788     | 64,192    | 2024/12/5  |            |
|                          |      | 10 MEXICAN BONOS 361120  | 10.0             | 2,200  | 2,776      | 16,520    | 2036/11/20 |            |
|                          |      | 4.75 MEXICAN BONO 180614 | 4.75             | 2,800  | 2,746      | 16,343    | 2018/6/14  |            |
|                          |      | 5 MEXICAN BONOS 191211   | 5.0              | 6,900  | 6,578      | 39,142    | 2019/12/11 |            |
|                          |      | 5.75 MEXICAN BONO 260305 | 5.75             | 2,900  | 2,637      | 15,690    | 2026/3/5   |            |
|                          |      | 6.5 MEXICAN BONOS 210610 | 6.5              | 9,500  | 9,311      | 55,405    | 2021/6/10  |            |
|                          |      | 6.5 MEXICAN BONOS 220609 | 6.5              | 3,900  | 3,804      | 22,633    | 2022/6/9   |            |
|                          |      | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 7.5              | 2,900  | 2,959      | 17,610    | 2027/6/3   |            |
|                          |      | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 7.75             | 4,600  | 4,782      | 28,453    | 2031/5/29  |            |
|                          |      | 7.75 MEXICAN BONO 341123 | 7.75             | 2,900  | 3,001      | 17,861    | 2034/11/23 |            |
|                          |      | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 7.75             | 5,400  | 5,523      | 32,867    | 2042/11/13 |            |
|                          |      | 8 MEXICAN BONOS 200611   | 8.0              | 5,500  | 5,642      | 33,573    | 2020/6/11  |            |
|                          |      | 8 MEXICAN BONOS 231207   | 8.0              | 2,700  | 2,828      | 16,827    | 2023/12/7  |            |
|                          |      | 8 MEXICAN BONOS 471107   | 8.0              | 800    | 843        | 5,018     | 2047/11/7  |            |
|                          |      | 8.5 MEXICAN BONOS 181213 | 8.5              | 9,700  | 9,922      | 59,041    | 2018/12/13 |            |
|                          |      | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 8.5              | 2,200  | 2,422      | 14,411    | 2029/5/31  |            |
| 8.5 MEXICAN BONOS 381118 | 8.5  | 3,200                    | 3,534            | 21,032 | 2038/11/18 |           |            |            |
| 小 計                      |      |                          |                  |        |            | 476,625   |            |            |
| ユーロ                      | ドイツ  | 国債証券                     | 0 BUND 260815    | —      | 700        | 681       | 85,095     | 2026/8/15  |
|                          |      |                          | 0 OBL 200417     | —      | 750        | 763       | 95,337     | 2020/4/17  |
|                          |      |                          | 0 OBL 210409     | —      | 700        | 713       | 89,087     | 2021/4/9   |
|                          |      |                          | 0 OBL 211008     | —      | 100        | 101       | 12,723     | 2021/10/8  |
|                          |      |                          | 0 OBL 220408     | —      | 350        | 356       | 44,443     | 2022/4/8   |
|                          |      |                          | 0 SCHATS 180615  | —      | 200        | 201       | 25,152     | 2018/6/15  |
|                          |      |                          | 0.25 BUND 270215 | 0.25   | 50         | 49        | 6,172      | 2027/2/15  |
|                          |      |                          | 0.25 OBL 191011  | 0.25   | 500        | 510       | 63,763     | 2019/10/11 |
|                          |      |                          | 0.25 OBL 201016  | 0.25   | 300        | 308       | 38,488     | 2020/10/16 |
|                          |      |                          | 0.5 BUND 250215  | 0.5    | 650        | 672       | 83,899     | 2025/2/15  |
|                          |      |                          | 0.5 BUND 260215  | 0.5    | 750        | 769       | 96,087     | 2026/2/15  |
|                          |      |                          | 0.5 OBL 190412   | 0.5    | 700        | 715       | 89,344     | 2019/4/12  |
|                          |      |                          | 1 BUND 240815    | 1.0    | 900        | 966       | 120,647    | 2024/8/15  |
|                          |      |                          | 1 BUND 250815    | 1.0    | 950        | 1,018     | 127,133    | 2025/8/15  |
| 1 OBL 181012             | 1.0  | 700                      | 716              | 89,471 | 2018/10/12 |           |            |            |

| 銘柄                |       |                        | 当 期 末 |         |          |         | 償還年月日      |
|-------------------|-------|------------------------|-------|---------|----------|---------|------------|
|                   |       |                        | 利 率   | 額面金額    | 評 価 額    |         |            |
|                   |       |                        |       |         | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |            |
| ユーロ               |       |                        | %     | 千ユーロ    | 千ユーロ     | 千円      |            |
| ドイツ               | 国債証券  | 1 OBL 190222           | 1.0   | 900     | 926      | 115,679 | 2019/2/22  |
|                   |       | 1.5 BUND 220904        | 1.5   | 550     | 602      | 75,210  | 2022/9/4   |
|                   |       | 1.5 BUND 230215        | 1.5   | 900     | 989      | 123,511 | 2023/2/15  |
|                   |       | 1.5 BUND 230515        | 1.5   | 550     | 606      | 75,644  | 2023/5/15  |
|                   |       | 1.5 BUND 240515        | 1.5   | 550     | 610      | 76,144  | 2024/5/15  |
|                   |       | 1.75 BUND 220704       | 1.75  | 750     | 830      | 103,595 | 2022/7/4   |
|                   |       | 1.75 BUND 240215       | 1.75  | 550     | 618      | 77,231  | 2024/2/15  |
|                   |       | 2 BUND 220104          | 2.0   | 600     | 667      | 83,335  | 2022/1/4   |
|                   |       | 2 BUND 230815          | 2.0   | 450     | 511      | 63,773  | 2023/8/15  |
|                   |       | 2.25 BUND 200904       | 2.25  | 600     | 656      | 81,912  | 2020/9/4   |
|                   |       | 2.25 BUND 210904       | 2.25  | 550     | 614      | 76,734  | 2021/9/4   |
|                   |       | 2.5 BUND 210104        | 2.5   | 800     | 889      | 110,975 | 2021/1/4   |
|                   |       | 2.5 BUND 440704        | 2.5   | 620     | 811      | 101,243 | 2044/7/4   |
|                   |       | 2.5 BUND 460815        | 2.5   | 630     | 831      | 103,717 | 2046/8/15  |
|                   |       | 3 BUND 200704          | 3.0   | 850     | 946      | 118,140 | 2020/7/4   |
|                   |       | 3.25 BUND 200104       | 3.25  | 600     | 662      | 82,634  | 2020/1/4   |
|                   |       | 3.25 BUND 210704       | 3.25  | 600     | 693      | 86,561  | 2021/7/4   |
|                   |       | 3.25 BUND 420704       | 3.25  | 490     | 720      | 89,919  | 2042/7/4   |
|                   |       | 3.5 BUND 190704        | 3.5   | 700     | 762      | 95,132  | 2019/7/4   |
|                   |       | 3.75 BUND 190104       | 3.75  | 700     | 750      | 93,712  | 2019/1/4   |
|                   |       | 4 BUND 370104          | 4.0   | 700     | 1,087    | 135,672 | 2037/1/4   |
|                   |       | 4.25 BUND 180704       | 4.25  | 800     | 844      | 105,435 | 2018/7/4   |
|                   |       | 4.25 BUND 390704       | 4.25  | 400     | 658      | 82,225  | 2039/7/4   |
|                   |       | 4.75 BUND 280704       | 4.75  | 100     | 146      | 18,283  | 2028/7/4   |
|                   |       | 4.75 BUND 340704       | 4.75  | 590     | 962      | 120,165 | 2034/7/4   |
|                   |       | 4.75 BUND 400704       | 4.75  | 500     | 884      | 110,392 | 2040/7/4   |
|                   |       | 5.5 BUND 310104        | 5.5   | 550     | 900      | 112,342 | 2031/1/4   |
| 5.625 BUND 280104 | 5.625 | 600                    | 925   | 115,524 | 2028/1/4 |         |            |
| 6.25 BUND 240104  | 6.25  | 200                    | 284   | 35,486  | 2024/1/4 |         |            |
| 6.25 BUND 300104  | 6.25  | 300                    | 508   | 63,451  | 2030/1/4 |         |            |
| 6.5 BUND 270704   | 6.5   | 350                    | 564   | 70,408  | 2027/7/4 |         |            |
| イタリア              | 国債証券  | 0.1 ITALY GOVT 190415  | 0.1   | 100     | 100      | 12,527  | 2019/4/15  |
|                   |       | 0.25 ITALY GOVT 180515 | 0.25  | 100     | 100      | 12,552  | 2018/5/15  |
|                   |       | 0.35 ITALY GOVT 211101 | 0.35  | 100     | 98       | 12,340  | 2021/11/1  |
|                   |       | 0.45 ITALY GOVT 210601 | 0.45  | 500     | 500      | 62,425  | 2021/6/1   |
|                   |       | 0.65 ITALY GOVT 201101 | 0.65  | 200     | 202      | 25,271  | 2020/11/1  |
|                   |       | 0.65 ITALY GOVT 231015 | 0.65  | 300     | 288      | 36,038  | 2023/10/15 |
|                   |       | 0.7 ITALY GOVT 200501  | 0.7   | 400     | 405      | 50,617  | 2020/5/1   |
|                   |       | 0.95 ITALY GOVT 230315 | 0.95  | 400     | 397      | 49,591  | 2023/3/15  |
|                   |       | 1.05 ITALY GOVT 191201 | 1.05  | 400     | 409      | 51,105  | 2019/12/1  |
|                   |       | 1.2 ITALY GOVT 220401  | 1.2   | 300     | 305      | 38,090  | 2022/4/1   |
|                   |       | 1.25 ITALY GOVT 261201 | 1.25  | 300     | 281      | 35,179  | 2026/12/1  |
|                   |       | 1.35 ITALY GOVT 220415 | 1.35  | 450     | 461      | 57,596  | 2022/4/15  |
|                   |       | 1.45 ITALY GOVT 220915 | 1.45  | 200     | 205      | 25,613  | 2022/9/15  |
|                   |       | 1.5 ITALY GOVT 190801  | 1.5   | 600     | 619      | 77,334  | 2019/8/1   |

| 銘柄                     |      |                        | 当 期 末 |         |           |         | 償還年月日      |
|------------------------|------|------------------------|-------|---------|-----------|---------|------------|
|                        |      |                        | 利 率   | 額面金額    | 評 価 額     |         |            |
|                        |      |                        |       |         | 外貨建金額     | 邦貨換算金額  |            |
| ユーロ                    |      |                        | %     | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円      |            |
| イタリア                   | 国債証券 | 1.5 ITALY GOVT 250601  | 1.5   | 500     | 492       | 61,416  | 2025/6/1   |
|                        |      | 1.6 ITALY GOVT 260601  | 1.6   | 500     | 486       | 60,754  | 2026/6/1   |
|                        |      | 1.65 ITALY GOVT 320301 | 1.65  | 480     | 433       | 54,124  | 2032/3/1   |
|                        |      | 2 ITALY GOVT 251201    | 2.0   | 550     | 557       | 69,553  | 2025/12/1  |
|                        |      | 2.15 ITALY GOVT 211215 | 2.15  | 600     | 640       | 79,918  | 2021/12/15 |
|                        |      | 2.2 ITALY GOVT 270601  | 2.2   | 200     | 201       | 25,153  | 2027/6/1   |
|                        |      | 2.25 ITALY GOVT 360901 | 2.25  | 350     | 323       | 40,404  | 2036/9/1   |
|                        |      | 2.45 ITALY GOVT 330901 | 2.45  | 50      | 48        | 6,088   | 2033/9/1   |
|                        |      | 2.5 ITALY GOVT 190501  | 2.5   | 700     | 734       | 91,688  | 2019/5/1   |
|                        |      | 2.5 ITALY GOVT 241201  | 2.5   | 650     | 690       | 86,113  | 2024/12/1  |
|                        |      | 2.7 ITALY GOVT 470301  | 2.7   | 400     | 360       | 44,942  | 2047/3/1   |
|                        |      | 2.8 ITALY GOVT 670301  | 2.8   | 210     | 177       | 22,159  | 2067/3/1   |
|                        |      | 3.25 ITALY GOVT 460901 | 3.25  | 450     | 454       | 56,761  | 2046/9/1   |
|                        |      | 3.5 ITALY GOVT 180601  | 3.5   | 650     | 675       | 84,321  | 2018/6/1   |
|                        |      | 3.5 ITALY GOVT 181201  | 3.5   | 1,100   | 1,161     | 144,932 | 2018/12/1  |
|                        |      | 3.5 ITALY GOVT 300301  | 3.5   | 900     | 1,006     | 125,601 | 2030/3/1   |
|                        |      | 3.75 ITALY GOVT 210301 | 3.75  | 1,100   | 1,239     | 154,709 | 2021/3/1   |
|                        |      | 3.75 ITALY GOVT 210501 | 3.75  | 550     | 621       | 77,517  | 2021/5/1   |
|                        |      | 3.75 ITALY GOVT 210801 | 3.75  | 800     | 907       | 113,243 | 2021/8/1   |
|                        |      | 3.75 ITALY GOVT 240901 | 3.75  | 550     | 632       | 78,893  | 2024/9/1   |
|                        |      | 4 ITALY GOVT 200901    | 4.0   | 750     | 841       | 104,976 | 2020/9/1   |
|                        |      | 4 ITALY GOVT 370201    | 4.0   | 750     | 880       | 109,826 | 2037/2/1   |
|                        |      | 4.25 ITALY GOVT 190201 | 4.25  | 1,200   | 1,288     | 160,805 | 2019/2/1   |
|                        |      | 4.25 ITALY GOVT 190901 | 4.25  | 450     | 493       | 61,532  | 2019/9/1   |
|                        |      | 4.25 ITALY GOVT 200301 | 4.25  | 950     | 1,057     | 131,938 | 2020/3/1   |
|                        |      | 4.5 ITALY GOVT 180801  | 4.5   | 900     | 951       | 118,740 | 2018/8/1   |
|                        |      | 4.5 ITALY GOVT 190301  | 4.5   | 700     | 757       | 94,472  | 2019/3/1   |
|                        |      | 4.5 ITALY GOVT 200201  | 4.5   | 700     | 781       | 97,536  | 2020/2/1   |
|                        |      | 4.5 ITALY GOVT 230501  | 4.5   | 900     | 1,074     | 134,049 | 2023/5/1   |
|                        |      | 4.5 ITALY GOVT 240301  | 4.5   | 650     | 778       | 97,188  | 2024/3/1   |
|                        |      | 4.5 ITALY GOVT 260301  | 4.5   | 700     | 847       | 105,816 | 2026/3/1   |
|                        |      | 4.75 ITALY GOVT 210901 | 4.75  | 1,050   | 1,235     | 154,205 | 2021/9/1   |
|                        |      | 4.75 ITALY GOVT 230801 | 4.75  | 900     | 1,092     | 136,374 | 2023/8/1   |
|                        |      | 4.75 ITALY GOVT 280901 | 4.75  | 600     | 746       | 93,197  | 2028/9/1   |
| 4.75 ITALY GOVT 440901 | 4.75 | 450                    | 571   | 71,312  | 2044/9/1  |         |            |
| 5 ITALY GOVT 220301    | 5.0  | 700                    | 837   | 104,558 | 2022/3/1  |         |            |
| 5 ITALY GOVT 250301    | 5.0  | 750                    | 931   | 116,269 | 2025/3/1  |         |            |
| 5 ITALY GOVT 340801    | 5.0  | 1,500                  | 1,961 | 244,797 | 2034/8/1  |         |            |
| 5 ITALY GOVT 390801    | 5.0  | 650                    | 855   | 106,725 | 2039/8/1  |         |            |
| 5 ITALY GOVT 400901    | 5.0  | 680                    | 886   | 110,631 | 2040/9/1  |         |            |
| 5.25 ITALY GOVT 291101 | 5.25 | 1,000                  | 1,307 | 163,213 | 2029/11/1 |         |            |
| 5.5 ITALY GOVT 220901  | 5.5  | 600                    | 741   | 92,496  | 2022/9/1  |         |            |
| 5.5 ITALY GOVT 221101  | 5.5  | 920                    | 1,139 | 142,177 | 2022/11/1 |         |            |
| 6 ITALY GOVT 310501    | 6.0  | 820                    | 1,156 | 144,262 | 2031/5/1  |         |            |
| 6.5 ITALY GOVT 271101  | 6.5  | 800                    | 1,125 | 140,388 | 2027/11/1 |         |            |

| 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 | 7.25 ITALY GOVT 261101 | 7.25  | 600     | 873        | 108,986 | 2026/11/1  |
|                   |      | 9 ITALY GOVT 231101    | 9.0   | 300     | 442        | 55,221  | 2023/11/1  |
| フランス              | 国債証券 | 0 O.A.T 190225         | —     | 200     | 201        | 25,197  | 2019/2/25  |
|                   |      | 0 O.A.T 200525         | —     | 550     | 557        | 69,564  | 2020/5/25  |
|                   |      | 0 O.A.T 210525         | —     | 400     | 404        | 50,512  | 2021/5/25  |
|                   |      | 0.25 O.A.T 201125      | 0.25  | 600     | 613        | 76,562  | 2020/11/25 |
|                   |      | 0.25 O.A.T 261125      | 0.25  | 620     | 592        | 73,957  | 2026/11/25 |
|                   |      | 0.5 O.A.T 191125       | 0.5   | 700     | 717        | 89,552  | 2019/11/25 |
|                   |      | 0.5 O.A.T 250525       | 0.5   | 1,450   | 1,456      | 181,804 | 2025/5/25  |
|                   |      | 0.5 O.A.T 260525       | 0.5   | 400     | 395        | 49,301  | 2026/5/25  |
|                   |      | 1 O.A.T 180525         | 1.0   | 200     | 203        | 25,354  | 2018/5/25  |
|                   |      | 1 O.A.T 181125         | 1.0   | 1,100   | 1,125      | 140,477 | 2018/11/25 |
|                   |      | 1 O.A.T 190525         | 1.0   | 700     | 721        | 90,037  | 2019/5/25  |
|                   |      | 1 O.A.T 251125         | 1.0   | 650     | 674        | 84,230  | 2025/11/25 |
|                   |      | 1 O.A.T 270525         | 1.0   | 250     | 254        | 31,781  | 2027/5/25  |
|                   |      | 1.25 O.A.T 360525      | 1.25  | 400     | 384        | 47,919  | 2036/5/25  |
|                   |      | 1.5 O.A.T 310525       | 1.5   | 850     | 886        | 110,600 | 2031/5/25  |
|                   |      | 1.75 O.A.T 230525      | 1.75  | 1,200   | 1,323      | 165,169 | 2023/5/25  |
|                   |      | 1.75 O.A.T 241125      | 1.75  | 970     | 1,072      | 133,814 | 2024/11/25 |
|                   |      | 1.75 O.A.T 390625      | 1.75  | 250     | 257        | 32,130  | 2039/6/25  |
|                   |      | 2.25 O.A.T 221025      | 2.25  | 950     | 1,069      | 133,510 | 2022/10/25 |
|                   |      | 2.25 O.A.T 240525      | 2.25  | 600     | 684        | 85,442  | 2024/5/25  |
|                   |      | 2.5 O.A.T 201025       | 2.5   | 1,150   | 1,265      | 157,942 | 2020/10/25 |
|                   |      | 2.5 O.A.T 300525       | 2.5   | 1,050   | 1,231      | 153,714 | 2030/5/25  |
|                   |      | 2.75 O.A.T 271025      | 2.75  | 1,020   | 1,215      | 151,621 | 2027/10/25 |
|                   |      | 3 O.A.T 220425         | 3.0   | 1,250   | 1,446      | 180,475 | 2022/4/25  |
|                   |      | 3.25 O.A.T 211025      | 3.25  | 1,400   | 1,618      | 202,003 | 2021/10/25 |
|                   |      | 3.25 O.A.T 450525      | 3.25  | 700     | 924        | 115,314 | 2045/5/25  |
|                   |      | 3.5 O.A.T 200425       | 3.5   | 1,350   | 1,507      | 188,151 | 2020/4/25  |
|                   |      | 3.5 O.A.T 260425       | 3.5   | 1,750   | 2,195      | 273,928 | 2026/4/25  |
|                   |      | 3.75 O.A.T 191025      | 3.75  | 1,200   | 1,325      | 165,392 | 2019/10/25 |
|                   |      | 3.75 O.A.T 210425      | 3.75  | 1,600   | 1,859      | 232,029 | 2021/4/25  |
|                   |      | 4 O.A.T 381025         | 4.0   | 470     | 682        | 85,186  | 2038/10/25 |
|                   |      | 4 O.A.T 550425         | 4.0   | 400     | 620        | 77,440  | 2055/4/25  |
|                   |      | 4 O.A.T 600425         | 4.0   | 560     | 884        | 110,393 | 2060/4/25  |
| 4.25 O.A.T 181025 | 4.25 | 1,100                  | 1,176 | 146,754 | 2018/10/25 |         |            |
| 4.25 O.A.T 190425 | 4.25 | 1,200                  | 1,311 | 163,666 | 2019/4/25  |         |            |
| 4.25 O.A.T 231025 | 4.25 | 1,400                  | 1,773 | 221,286 | 2023/10/25 |         |            |
| 4.5 O.A.T 410425  | 4.5  | 1,280                  | 2,006 | 250,442 | 2041/4/25  |         |            |
| 4.75 O.A.T 350425 | 4.75 | 1,060                  | 1,633 | 203,892 | 2035/4/25  |         |            |
| 5.5 O.A.T 290425  | 5.5  | 900                    | 1,365 | 170,422 | 2029/4/25  |         |            |
| 5.75 O.A.T 321025 | 5.75 | 760                    | 1,248 | 155,741 | 2032/10/25 |         |            |
| 6 O.A.T 251025    | 6.0  | 700                    | 1,022 | 127,580 | 2025/10/25 |         |            |
| 8.5 O.A.T 191025  | 8.5  | 300                    | 366   | 45,691  | 2019/10/25 |         |            |
| 8.5 O.A.T 230425  | 8.5  | 350                    | 526   | 65,743  | 2023/4/25  |         |            |



| 銘柄                     |      |                        | 当 期 末 |        |            |         |            |
|------------------------|------|------------------------|-------|--------|------------|---------|------------|
|                        |      |                        | 利 率   | 額面金額   | 評 価 額      |         | 償還年月日      |
|                        |      |                        |       |        | 外貨建金額      | 邦貨換算金額  |            |
| ユーロ                    |      |                        | %     | 千ユーロ   | 千ユーロ       | 千円      |            |
| オランダ                   | 国債証券 | 0 NETH GOVT 220115     | —     | 250    | 253        | 31,623  | 2022/1/15  |
|                        |      | 0.25 NETH GOVT 200115  | 0.25  | 500    | 511        | 63,813  | 2020/1/15  |
|                        |      | 0.25 NETH GOVT 250715  | 0.25  | 400    | 399        | 49,881  | 2025/7/15  |
|                        |      | 0.5 NETH GOVT 260715   | 0.5   | 460    | 463        | 57,875  | 2026/7/15  |
|                        |      | 0.75 NETH GOVT 270715  | 0.75  | 150    | 152        | 19,052  | 2027/7/15  |
|                        |      | 1.25 NETH GOVT 190115  | 1.25  | 400    | 412        | 51,505  | 2019/1/15  |
|                        |      | 1.75 NETH GOVT 230715  | 1.75  | 350    | 389        | 48,595  | 2023/7/15  |
|                        |      | 2 NETH GOVT 240715     | 2.0   | 500    | 568        | 70,934  | 2024/7/15  |
|                        |      | 2.25 NETH GOVT 220715  | 2.25  | 400    | 451        | 56,395  | 2022/7/15  |
|                        |      | 2.5 NETH GOVT 330115   | 2.5   | 400    | 496        | 61,910  | 2033/1/15  |
|                        |      | 2.75 NETH GOVT 470115  | 2.75  | 380    | 520        | 64,930  | 2047/1/15  |
|                        |      | 3.25 NETH GOVT 210715  | 3.25  | 500    | 576        | 71,997  | 2021/7/15  |
|                        |      | 3.5 NETH GOVT 200715   | 3.5   | 600    | 677        | 84,519  | 2020/7/15  |
|                        |      | 3.75 NETH GOVT 230115  | 3.75  | 550    | 672        | 83,947  | 2023/1/15  |
|                        |      | 3.75 NETH GOVT 420115  | 3.75  | 470    | 733        | 91,562  | 2042/1/15  |
|                        |      | 4 NETH GOVT 180715     | 4.0   | 300    | 316        | 39,457  | 2018/7/15  |
|                        |      | 4 NETH GOVT 190715     | 4.0   | 600    | 660        | 82,362  | 2019/7/15  |
| 4 NETH GOVT 370115     | 4.0  | 450                    | 693   | 86,536 | 2037/1/15  |         |            |
| 5.5 NETH GOVT 280115   | 5.5  | 400                    | 605   | 75,600 | 2028/1/15  |         |            |
| スペイン                   | 国債証券 | 0.25 SPAIN GOVT 180430 | 0.25  | 250    | 251        | 31,378  | 2018/4/30  |
|                        |      | 0.25 SPAIN GOVT 190131 | 0.25  | 100    | 100        | 12,593  | 2019/1/31  |
|                        |      | 0.4 SPAIN GOVT 220430  | 0.4   | 100    | 100        | 12,530  | 2022/4/30  |
|                        |      | 0.75 SPAIN GOVT 210730 | 0.75  | 700    | 720        | 89,866  | 2021/7/30  |
|                        |      | 1.3 SPAIN GOVT 261031  | 1.3   | 300    | 296        | 36,990  | 2026/10/31 |
|                        |      | 1.4 SPAIN GOVT 200131  | 1.4   | 800    | 835        | 104,204 | 2020/1/31  |
|                        |      | 1.6 SPAIN GOVT 250430  | 1.6   | 850    | 879        | 109,734 | 2025/4/30  |
|                        |      | 1.95 SPAIN GOVT 260430 | 1.95  | 1,050  | 1,101      | 137,453 | 2026/4/30  |
|                        |      | 1.95 SPAIN GOVT 300730 | 1.95  | 670    | 668        | 83,442  | 2030/7/30  |
|                        |      | 2.15 SPAIN GOVT 251031 | 2.15  | 500    | 534        | 66,678  | 2025/10/31 |
|                        |      | 2.75 SPAIN GOVT 190430 | 2.75  | 400    | 423        | 52,884  | 2019/4/30  |
|                        |      | 2.75 SPAIN GOVT 241031 | 2.75  | 730    | 820        | 102,328 | 2024/10/31 |
|                        |      | 2.9 SPAIN GOVT 461031  | 2.9   | 350    | 352        | 43,999  | 2046/10/31 |
|                        |      | 3.45 SPAIN GOVT 660730 | 3.45  | 150    | 158        | 19,779  | 2066/7/30  |
|                        |      | 3.75 SPAIN GOVT 181031 | 3.75  | 1,200  | 1,272      | 158,763 | 2018/10/31 |
|                        |      | 3.8 SPAIN GOVT 240430  | 3.8   | 600    | 717        | 89,542  | 2024/4/30  |
|                        |      | 4 SPAIN GOVT 200430    | 4.0   | 1,100  | 1,234      | 154,015 | 2020/4/30  |
|                        |      | 4.1 SPAIN GOVT 180730  | 4.1   | 900    | 947        | 118,234 | 2018/7/30  |
|                        |      | 4.2 SPAIN GOVT 370131  | 4.2   | 630    | 799        | 99,779  | 2037/1/31  |
|                        |      | 4.3 SPAIN GOVT 191031  | 4.3   | 600    | 666        | 83,136  | 2019/10/31 |
|                        |      | 4.4 SPAIN GOVT 231031  | 4.4   | 600    | 739        | 92,270  | 2023/10/31 |
|                        |      | 4.6 SPAIN GOVT 190730  | 4.6   | 600    | 663        | 82,848  | 2019/7/30  |
|                        |      | 4.65 SPAIN GOVT 250730 | 4.65  | 700    | 886        | 110,680 | 2025/7/30  |
|                        |      | 4.7 SPAIN GOVT 410730  | 4.7   | 580    | 788        | 98,444  | 2041/7/30  |
|                        |      | 4.8 SPAIN GOVT 240131  | 4.8   | 500    | 630        | 78,663  | 2024/1/31  |
| 4.85 SPAIN GOVT 201031 | 4.85 | 500                    | 584   | 72,964 | 2020/10/31 |         |            |

| 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 | 4.9 SPAIN GOVT 400730    | 4.9   | 500     | 695       | 86,778  | 2040/7/30  |
|                         |      | 5.15 SPAIN GOVT 281031   | 5.15  | 500     | 677       | 84,521  | 2028/10/31 |
|                         |      | 5.15 SPAIN GOVT 441031   | 5.15  | 170     | 245       | 30,665  | 2044/10/31 |
|                         |      | 5.4 SPAIN GOVT 230131    | 5.4   | 800     | 1,019     | 127,265 | 2023/1/31  |
|                         |      | 5.5 SPAIN GOVT 210430    | 5.5   | 800     | 973       | 121,532 | 2021/4/30  |
|                         |      | 5.75 SPAIN GOVT 320730   | 5.75  | 650     | 957       | 119,541 | 2032/7/30  |
|                         |      | 5.85 SPAIN GOVT 220131   | 5.85  | 800     | 1,010     | 126,076 | 2022/1/31  |
|                         |      | 5.9 SPAIN GOVT 260730    | 5.9   | 250     | 346       | 43,289  | 2026/7/30  |
| 6 SPAIN GOVT 290131     | 6.0  | 900                      | 1,303 | 162,725 | 2029/1/31 |         |            |
| ベルギー                    | 国債証券 | 0.8 BEL GOVT 250622      | 0.8   | 800     | 825       | 102,979 | 2025/6/22  |
|                         |      | 0.8 BEL GOVT 270622      | 0.8   | 200     | 200       | 25,076  | 2027/6/22  |
|                         |      | 1 BEL GOVT 260622        | 1.0   | 50      | 51        | 6,475   | 2026/6/22  |
|                         |      | 1 BEL GOVT 310622        | 1.0   | 320     | 314       | 39,229  | 2031/6/22  |
|                         |      | 1.6 BEL GOVT 470622      | 1.6   | 210     | 200       | 24,995  | 2047/6/22  |
|                         |      | 2.15 BEL GOVT 660622     | 2.15  | 20      | 20        | 2,539   | 2066/6/22  |
|                         |      | 2.25 BEL GOVT 230622     | 2.25  | 500     | 569       | 71,119  | 2023/6/22  |
|                         |      | 2.25 BEL GOVT 570622     | 2.25  | 100     | 106       | 13,277  | 2057/6/22  |
|                         |      | 2.6 BEL GOVT 240622      | 2.6   | 500     | 584       | 72,950  | 2024/6/22  |
|                         |      | 3 BEL GOVT 190928        | 3.0   | 300     | 325       | 40,575  | 2019/9/28  |
|                         |      | 3 BEL GOVT 340622        | 3.0   | 150     | 190       | 23,726  | 2034/6/22  |
|                         |      | 3.75 BEL GOVT 200928     | 3.75  | 750     | 856       | 106,883 | 2020/9/28  |
|                         |      | 3.75 BEL GOVT 450622     | 3.75  | 340     | 494       | 61,717  | 2045/6/22  |
|                         |      | 4 BEL GOVT 190328        | 4.0   | 600     | 651       | 81,238  | 2019/3/28  |
|                         |      | 4 BEL GOVT 220328        | 4.0   | 600     | 724       | 90,468  | 2022/3/28  |
|                         |      | 4 BEL GOVT 320328        | 4.0   | 250     | 348       | 43,497  | 2032/3/28  |
|                         |      | 4.25 BEL GOVT 210928     | 4.25  | 350     | 420       | 52,435  | 2021/9/28  |
| 4.25 BEL GOVT 220928    | 4.25 | 400                      | 494   | 61,764  | 2022/9/28 |         |            |
| 4.25 BEL GOVT 410328    | 4.25 | 660                      | 1,014 | 126,621 | 2041/3/28 |         |            |
| 4.5 BEL GOVT 260328     | 4.5  | 400                      | 541   | 67,516  | 2026/3/28 |         |            |
| 5 BEL GOVT 350328       | 5.0  | 640                      | 1,024 | 127,798 | 2035/3/28 |         |            |
| 5.5 BEL GOVT 280328     | 5.5  | 600                      | 900   | 112,386 | 2028/3/28 |         |            |
| オーストリア                  | 国債証券 | 0.5 AUSTRIA GOVT 270420  | 0.5   | 150     | 147       | 18,467  | 2027/4/20  |
|                         |      | 0.75 AUSTRIA GOVT 261020 | 0.75  | 350     | 356       | 44,525  | 2026/10/20 |
|                         |      | 1.2 AUSTRIA GOVT 251020  | 1.2   | 200     | 213       | 26,687  | 2025/10/20 |
|                         |      | 1.5 AUSTRIA GOVT 470220  | 1.5   | 50      | 49        | 6,158   | 2047/2/20  |
|                         |      | 1.65 AUSTRIA GOVT 241021 | 1.65  | 350     | 387       | 48,299  | 2024/10/21 |
|                         |      | 1.75 AUSTRIA GOVT 231020 | 1.75  | 300     | 333       | 41,616  | 2023/10/20 |
|                         |      | 1.95 AUSTRIA GOVT 190618 | 1.95  | 400     | 420       | 52,533  | 2019/6/18  |
|                         |      | 2.4 AUSTRIA GOVT 340523  | 2.4   | 150     | 180       | 22,550  | 2034/5/23  |
|                         |      | 3.15 AUSTRIA GOVT 440620 | 3.15  | 230     | 317       | 39,597  | 2044/6/20  |
|                         |      | 3.4 AUSTRIA GOVT 221122  | 3.4   | 300     | 358       | 44,728  | 2022/11/22 |
|                         |      | 3.5 AUSTRIA GOVT 210915  | 3.5   | 450     | 524       | 65,487  | 2021/9/15  |
|                         |      | 3.65 AUSTRIA GOVT 220420 | 3.65  | 400     | 476       | 59,436  | 2022/4/20  |
|                         |      | 3.8 AUSTRIA GOVT 620126  | 3.8   | 150     | 249       | 31,122  | 2062/1/26  |
| 3.9 AUSTRIA GOVT 200715 | 3.9  | 450                      | 512   | 63,932  | 2020/7/15 |         |            |

| 銘柄                       |                  |                          | 当 期 末 |          |            |            | 償還年月日      |
|--------------------------|------------------|--------------------------|-------|----------|------------|------------|------------|
|                          |                  |                          | 利 率   | 額面金額     | 評 価 額      |            |            |
|                          |                  |                          |       |          | 外貨建金額      | 邦貨換算金額     |            |
| ユーロ                      |                  |                          | %     | 千ユーロ     | 千ユーロ       | 千円         |            |
| オーストリア                   | 国債証券             | 4.15 AUSTRIA GOVT 370315 | 4.15  | 380      | 576        | 71,955     | 2037/3/15  |
|                          |                  | 4.35 AUSTRIA GOVT 190315 | 4.35  | 600      | 653        | 81,596     | 2019/3/15  |
|                          |                  | 4.85 AUSTRIA GOVT 260315 | 4.85  | 300      | 417        | 52,047     | 2026/3/15  |
|                          |                  | 6.25 AUSTRIA GOVT 270715 | 6.25  | 200      | 314        | 39,222     | 2027/7/15  |
| フィンランド                   | 国債証券             | 0 FINNISH GOVT 230915    | —     | 50       | 49         | 6,221      | 2023/9/15  |
|                          |                  | 0.375 FINNISH GOV 200915 | 0.375 | 250      | 256        | 32,036     | 2020/9/15  |
|                          |                  | 0.5 FINNISH GOVT 260415  | 0.5   | 100      | 100        | 12,568     | 2026/4/15  |
|                          |                  | 0.75 FINNISH GOVT 310415 | 0.75  | 150      | 147        | 18,400     | 2031/4/15  |
|                          |                  | 0.875 FINNISH GOV 250915 | 0.875 | 200      | 209        | 26,083     | 2025/9/15  |
|                          |                  | 1.125 FINNISH GOV 180915 | 1.125 | 100      | 102        | 12,771     | 2018/9/15  |
|                          |                  | 1.5 FINNISH GOVT 230415  | 1.5   | 250      | 272        | 34,065     | 2023/4/15  |
|                          |                  | 1.625 FINNISH GOV 220915 | 1.625 | 200      | 218        | 27,308     | 2022/9/15  |
|                          |                  | 2 FINNISH GOVT 240415    | 2.0   | 100      | 113        | 14,105     | 2024/4/15  |
|                          |                  | 2.625 FINNISH GOV 420704 | 2.625 | 130      | 169        | 21,142     | 2042/7/4   |
|                          |                  | 2.75 FINNISH GOVT 280704 | 2.75  | 160      | 196        | 24,505     | 2028/7/4   |
|                          |                  | 3.375 FINNISH GOV 200415 | 3.375 | 170      | 189        | 23,610     | 2020/4/15  |
|                          |                  | 3.5 FINNISH GOVT 210415  | 3.5   | 150      | 172        | 21,559     | 2021/4/15  |
|                          |                  | 4 FINNISH GOVT 250704    | 4.0   | 200      | 260        | 32,518     | 2025/7/4   |
| 4.375 FINNISH GOV 190704 | 4.375            | 200                      | 221   | 27,588   | 2019/7/4   |            |            |
| アイルランド                   | 国債証券             | 0.8 IRISH GOVT 220315    | 0.8   | 200      | 208        | 26,041     | 2022/3/15  |
|                          |                  | 1 IRISH GOVT 260515      | 1.0   | 100      | 101        | 12,672     | 2026/5/15  |
|                          |                  | 2 IRISH GOVT 450218      | 2.0   | 300      | 302        | 37,724     | 2045/2/18  |
|                          |                  | 2.4 IRISH GOVT 300515    | 2.4   | 300      | 340        | 42,456     | 2030/5/15  |
|                          |                  | 3.4 IRISH GOVT 240318    | 3.4   | 250      | 301        | 37,613     | 2024/3/18  |
|                          |                  | 3.9 IRISH GOVT 230320    | 3.9   | 150      | 183        | 22,857     | 2023/3/20  |
|                          |                  | 4.4 IRISH GOVT 190618    | 4.4   | 200      | 220        | 27,495     | 2019/6/18  |
|                          |                  | 4.5 IRISH GOVT 181018    | 4.5   | 300      | 321        | 40,063     | 2018/10/18 |
|                          |                  | 4.5 IRISH GOVT 200418    | 4.5   | 350      | 399        | 49,896     | 2020/4/18  |
|                          |                  | 5 IRISH GOVT 201018      | 5.0   | 250      | 295        | 36,915     | 2020/10/18 |
|                          |                  | 5.4 IRISH GOVT 250313    | 5.4   | 450      | 615        | 76,817     | 2025/3/13  |
| 5.9 IRISH GOVT 191018    | 5.9              | 200                      | 230   | 28,789   | 2019/10/18 |            |            |
| 小 計                      |                  |                          |       |          |            | 21,616,258 |            |
| イギリス                     |                  |                          |       | 千イギリスポンド | 千イギリスポンド   |            |            |
| 国債証券                     | 1.25 GILT 180722 | 1.25                     | 700   | 709      | 102,699    | 2018/7/22  |            |
|                          | 1.25 GILT 270722 | 1.25                     | 50    | 50       | 7,299      | 2027/7/22  |            |
|                          | 1.5 GILT 210122  | 1.5                      | 350   | 365      | 52,959     | 2021/1/22  |            |
|                          | 1.5 GILT 260722  | 1.5                      | 400   | 416      | 60,338     | 2026/7/22  |            |
|                          | 1.75 GILT 190722 | 1.75                     | 900   | 932      | 134,933    | 2019/7/22  |            |
|                          | 1.75 GILT 220907 | 1.75                     | 750   | 799      | 115,790    | 2022/9/7   |            |
|                          | 1.75 GILT 370907 | 1.75                     | 100   | 100      | 14,561     | 2037/9/7   |            |
|                          | 2 GILT 200722    | 2.0                      | 850   | 898      | 130,111    | 2020/7/22  |            |
|                          | 2 GILT 250907    | 2.0                      | 900   | 980      | 142,003    | 2025/9/7   |            |
|                          | 2.25 GILT 230907 | 2.25                     | 750   | 825      | 119,562    | 2023/9/7   |            |
|                          | 2.5 GILT 650722  | 2.5                      | 350   | 462      | 66,925     | 2065/7/22  |            |
|                          | 2.75 GILT 240907 | 2.75                     | 600   | 685      | 99,201     | 2024/9/7   |            |

| 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 | 3.25 GILT 440122       | 3.25     | 780         | 1,026       | 148,576   | 2044/1/22  |
|        |      | 3.5 GILT 450122        | 3.5      | 420         | 580         | 84,076    | 2045/1/22  |
|        |      | 3.5 GILT 680722        | 3.5      | 940         | 1,588       | 230,020   | 2068/7/22  |
|        |      | 3.75 GILT 190907       | 3.75     | 450         | 487         | 70,622    | 2019/9/7   |
|        |      | 3.75 GILT 200907       | 3.75     | 750         | 838         | 121,425   | 2020/9/7   |
|        |      | 3.75 GILT 210907       | 3.75     | 550         | 631         | 91,418    | 2021/9/7   |
|        |      | 3.75 GILT 520722       | 3.75     | 520         | 814         | 117,897   | 2052/7/22  |
|        |      | 4 GILT 220307          | 4.0      | 600         | 704         | 101,921   | 2022/3/7   |
|        |      | 4 GILT 600122          | 4.0      | 240         | 422         | 61,129    | 2060/1/22  |
|        |      | 4.25 GILT 271207       | 4.25     | 300         | 394         | 57,083    | 2027/12/7  |
|        |      | 4.25 GILT 320607       | 4.25     | 600         | 825         | 119,479   | 2032/6/7   |
|        |      | 4.25 GILT 360307       | 4.25     | 790         | 1,124       | 162,818   | 2036/3/7   |
|        |      | 4.25 GILT 390907       | 4.25     | 370         | 543         | 78,636    | 2039/9/7   |
|        |      | 4.25 GILT 401207       | 4.25     | 700         | 1,041       | 150,731   | 2040/12/7  |
|        |      | 4.25 GILT 461207       | 4.25     | 750         | 1,187       | 171,830   | 2046/12/7  |
|        |      | 4.25 GILT 491207       | 4.25     | 810         | 1,332       | 192,824   | 2049/12/7  |
|        |      | 4.25 GILT 551207       | 4.25     | 310         | 547         | 79,189    | 2055/12/7  |
|        |      | 4.5 GILT 190307        | 4.5      | 700         | 755         | 109,361   | 2019/3/7   |
|        |      | 4.5 GILT 340907        | 4.5      | 410         | 591         | 85,591    | 2034/9/7   |
|        |      | 4.5 GILT 421207        | 4.5      | 430         | 675         | 97,836    | 2042/12/7  |
|        |      | 4.75 GILT 200307       | 4.75     | 500         | 564         | 81,768    | 2020/3/7   |
|        |      | 4.75 GILT 301207       | 4.75     | 420         | 597         | 86,517    | 2030/12/7  |
|        |      | 4.75 GILT 381207       | 4.75     | 490         | 761         | 110,202   | 2038/12/7  |
|        |      | 5 GILT 250307          | 5.0      | 450         | 593         | 85,934    | 2025/3/7   |
|        |      | 6 GILT 281207          | 6.0      | 380         | 578         | 83,813    | 2028/12/7  |
|        |      | 8 GILT 210607          | 8.0      | 500         | 656         | 95,037    | 2021/6/7   |
| 小      | 計    |                        |          |             |             | 3,922,132 |            |
| 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      | 130         | 144         | 16,502    | 2021/4/28  |
|        |      | 2.25 SWISS GOVT 200706 | 2.25     | 150         | 164         | 18,844    | 2020/7/6   |
|        |      | 3 SWISS GOVT 190512    | 3.0      | 110         | 118         | 13,575    | 2019/5/12  |
|        |      | 4 SWISS GOVT 230211    | 4.0      | 150         | 189         | 21,702    | 2023/2/11  |
|        |      | 4 SWISS GOVT 280408    | 4.0      | 170         | 245         | 28,162    | 2028/4/8   |
| 小      | 計    |                        |          |             |             | 98,788    |            |
| 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      | 2,000       | 2,090       | 26,698    | 2026/11/12 |
|        |      | 1.5 SWD GOVT 231113    | 1.5      | 2,450       | 2,669       | 34,095    | 2023/11/13 |
|        |      | 2.5 SWD GOVT 250512    | 2.5      | 1,950       | 2,287       | 29,207    | 2025/5/12  |
|        |      | 3.5 SWD GOVT 220601    | 3.5      | 3,050       | 3,609       | 46,099    | 2022/6/1   |
|        |      | 3.5 SWD GOVT 390330    | 3.5      | 1,300       | 1,787       | 22,824    | 2039/3/30  |
|        |      | 4.25 SWD GOVT 190312   | 4.25     | 2,750       | 2,998       | 38,287    | 2019/3/12  |
|        |      | 5 SWD GOVT 201201      | 5.0      | 2,900       | 3,459       | 44,179    | 2020/12/1  |
| 小      | 計    |                        |          |             |             | 241,390   |            |
| 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      | 1,050       | 1,057       | 14,071    | 2026/2/19  |

| 銘       | 柄    | 当 期 末                  |            |            |         |            |
|---------|------|------------------------|------------|------------|---------|------------|
|         |      | 利 率                    | 額面金額       | 評 価 額      |         | 償還年月日      |
|         |      |                        |            | 外貨建金額      | 邦貨換算金額  |            |
| ノルウェー   |      | %                      | 千ノルウェークロネ  | 千ノルウェークロネ  | 千円      |            |
|         | 国債証券 | 1.75 NORWE GOVT 250313 | 1,350      | 1,391      | 18,515  | 2025/3/13  |
|         |      | 1.75 NORWE GOVT 270217 | 500        | 510        | 6,798   | 2027/2/17  |
|         |      | 2 NORWE GOVT 230524    | 1,850      | 1,944      | 25,885  | 2023/5/24  |
|         |      | 3 NORWE GOVT 240314    | 1,400      | 1,562      | 20,797  | 2024/3/14  |
|         |      | 3.75 NORWE GOVT 210525 | 2,500      | 2,785      | 37,068  | 2021/5/25  |
|         |      | 4.5 NORWE GOVT 190522  | 2,100      | 2,264      | 30,134  | 2019/5/22  |
| 小       | 計    |                        |            |            | 153,271 |            |
| デンマーク   |      |                        | 千デンマーククロネ  | 千デンマーククロネ  |         |            |
|         | 国債証券 | 0.25 DMK GOVT 181115   | 1,000      | 1,012      | 16,966  | 2018/11/15 |
|         |      | 0.5 DMK GOVT 271115    | 500        | 492        | 8,257   | 2027/11/15 |
|         |      | 1.5 DMK GOVT 231115    | 1,300      | 1,421      | 23,830  | 2023/11/15 |
|         |      | 1.75 DMK GOVT 251115   | 2,800      | 3,132      | 52,502  | 2025/11/15 |
|         |      | 3 DMK GOVT 211115      | 2,900      | 3,323      | 55,702  | 2021/11/15 |
|         |      | 4 DMK GOVT 191115      | 3,300      | 3,663      | 61,394  | 2019/11/15 |
|         |      | 4.5 DMK GOVT 391115    | 3,950      | 6,584      | 110,363 | 2039/11/15 |
| 小       | 計    |                        |            |            | 329,017 |            |
| 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      | 700        | 686        | 20,417  | 2020/4/25  |
|         |      | 1.75 POLAND 210725     | 600        | 580        | 17,273  | 2021/7/25  |
|         |      | 2 POLAND 210425        | 1,000      | 980        | 29,173  | 2021/4/25  |
|         |      | 2.25 POLAND 220425     | 500        | 488        | 14,545  | 2022/4/25  |
|         |      | 2.5 POLAND 180725      | 900        | 909        | 27,067  | 2018/7/25  |
|         |      | 2.5 POLAND 260725      | 1,100      | 1,035      | 30,816  | 2026/7/25  |
|         |      | 2.5 POLAND 270725      | 350        | 325        | 9,675   | 2027/7/25  |
|         |      | 3.25 POLAND 190725     | 800        | 821        | 24,436  | 2019/7/25  |
|         |      | 3.25 POLAND 250725     | 1,000      | 1,009      | 30,038  | 2025/7/25  |
|         |      | 4 POLAND 231025        | 850        | 902        | 26,845  | 2023/10/25 |
|         |      | 5.25 POLAND 201025     | 900        | 984        | 29,288  | 2020/10/25 |
|         |      | 5.5 POLAND 191025      | 600        | 648        | 19,290  | 2019/10/25 |
|         |      | 5.75 POLAND 211025     | 700        | 790        | 23,523  | 2021/10/25 |
|         |      | 5.75 POLAND 220923     | 750        | 858        | 25,538  | 2022/9/23  |
|         |      | 5.75 POLAND 290425     | 370        | 457        | 13,609  | 2029/4/25  |
|         |      | POLAND 181025          | 300        | 292        | 8,701   | 2018/10/25 |
| 小       | 計    |                        |            |            | 350,241 |            |
| 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  | 700        | 697        | 57,937  | 2020/11/21 |
|         |      | 2 AUST GOVT 211221     | 400        | 400        | 33,245  | 2021/12/21 |
|         |      | 2.25 AUST GOVT 280521  | 150        | 145        | 12,052  | 2028/5/21  |
|         |      | 2.75 AUST GOVT 191021  | 750        | 768        | 63,840  | 2019/10/21 |
|         |      | 2.75 AUST GOVT 240421  | 800        | 824        | 68,460  | 2024/4/21  |
|         |      | 2.75 AUST GOVT 271121  | 500        | 509        | 42,287  | 2027/11/21 |
|         |      | 2.75 AUST GOVT 281121  | 250        | 253        | 21,035  | 2028/11/21 |
|         |      | 2.75 AUST GOVT 350621  | 200        | 191        | 15,890  | 2035/6/21  |
|         |      | 3 AUST GOVT 470321     | 260        | 238        | 19,763  | 2047/3/21  |
|         |      | 3.25 AUST GOVT 250421  | 800        | 850        | 70,652  | 2025/4/21  |

| 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    | 3.25 AUST GOVT 290421    | 3.25  | 810         | 859         | 71,394    | 2029/4/21  |
|         | 3.25 AUST GOVT 390621    | 3.25  | 70          | 70          | 5,816     | 2039/6/21  |
|         | 3.75 AUST GOVT 370421    | 3.75  | 330         | 359         | 29,876    | 2037/4/21  |
|         | 4.25 AUST GOVT 260421    | 4.25  | 1,000       | 1,145       | 95,071    | 2026/4/21  |
|         | 4.5 AUST GOVT 200415     | 4.5   | 870         | 937         | 77,848    | 2020/4/15  |
|         | 4.5 AUST GOVT 330421     | 4.5   | 370         | 445         | 36,994    | 2033/4/21  |
|         | 4.75 AUST GOVT 270421    | 4.75  | 1,000       | 1,198       | 99,482    | 2027/4/21  |
|         | 5.25 AUST GOVT 190315    | 5.25  | 1,000       | 1,064       | 88,401    | 2019/3/15  |
|         | 5.5 AUST GOVT 230421     | 5.5   | 650         | 771         | 64,028    | 2023/4/21  |
|         | 5.75 AUST GOVT 210515    | 5.75  | 850         | 975         | 80,978    | 2021/5/15  |
|         | 5.75 AUST GOVT 220715    | 5.75  | 750         | 885         | 73,545    | 2022/7/15  |
| 小 計     |                          |       |             |             | 1,128,604 |            |
| シンガポール  |                          |       | 千シンガポールドル   | 千シンガポールドル   |           |            |
| 国債証券    | 1.625 SINGAPORGOV 191001 | 1.625 | 50          | 50          | 4,055     | 2019/10/1  |
|         | 2 SINGAPORGOVT 200701    | 2.0   | 150         | 152         | 12,300    | 2020/7/1   |
|         | 2.125 SINGAPORGOV 260601 | 2.125 | 70          | 70          | 5,688     | 2026/6/1   |
|         | 2.25 SINGAPORGOVT 210601 | 2.25  | 290         | 297         | 23,955    | 2021/6/1   |
|         | 2.5 SINGAPORGOVT 190601  | 2.5   | 220         | 225         | 18,160    | 2019/6/1   |
|         | 2.75 SINGAPORGOVT 230701 | 2.75  | 180         | 190         | 15,284    | 2023/7/1   |
|         | 2.75 SINGAPORGOVT 420401 | 2.75  | 170         | 181         | 14,585    | 2042/4/1   |
|         | 2.75 SINGAPORGOVT 460301 | 2.75  | 30          | 32          | 2,576     | 2046/3/1   |
|         | 2.875 SINGAPORGOV 290701 | 2.875 | 80          | 85          | 6,895     | 2029/7/1   |
|         | 2.875SINGAPORGOVT 300901 | 2.875 | 160         | 171         | 13,776    | 2030/9/1   |
|         | 3 SINGAPORGOVT 240901    | 3.0   | 250         | 268         | 21,590    | 2024/9/1   |
|         | 3.125SINGAPORGOVT 220901 | 3.125 | 190         | 204         | 16,416    | 2022/9/1   |
|         | 3.25 SINGAPORGOVT 200901 | 3.25  | 170         | 180         | 14,487    | 2020/9/1   |
|         | 3.375 SINGAPORGOV 330901 | 3.375 | 70          | 79          | 6,419     | 2033/9/1   |
|         | 3.5 SINGAPORGOVT 270301  | 3.5   | 200         | 224         | 18,062    | 2027/3/1   |
|         | 4 SINGAPORGOVT 180901    | 4.0   | 160         | 165         | 13,346    | 2018/9/1   |
| 小 計     |                          |       |             |             | 207,601   |            |
| マレーシア   |                          |       | 千マレーシアリンギット | 千マレーシアリンギット |           |            |
| 国債証券    | 3.418MALAYSIAGOV 220815  | 3.418 | 350         | 345         | 8,933     | 2022/8/15  |
|         | 3.48 MALAYSIAGOV 230315  | 3.48  | 400         | 393         | 10,185    | 2023/3/15  |
|         | 3.492 MALAYSIAGOV 200331 | 3.492 | 300         | 299         | 7,751     | 2020/3/31  |
|         | 3.502MALAYSIAGOV 270531  | 3.502 | 300         | 281         | 7,281     | 2027/5/31  |
|         | 3.62 MALAYSIAGOV 211130  | 3.62  | 200         | 199         | 5,174     | 2021/11/30 |
|         | 3.733 MALAYSIAGO 280615  | 3.733 | 100         | 95          | 2,470     | 2028/6/15  |
|         | 3.759 MALAYSIAGOV 190315 | 3.759 | 100         | 100         | 2,608     | 2019/3/15  |
|         | 3.795 MALAYSIAGOV 220930 | 3.795 | 400         | 401         | 10,380    | 2022/9/30  |
|         | 3.8 MALAYSIAGOV 230817   | 3.8   | 300         | 299         | 7,744     | 2023/8/17  |
|         | 3.844 MALAYSIAGOV 330415 | 3.844 | 200         | 187         | 4,863     | 2033/4/15  |
|         | 3.889 MALAYSIAGO 200731  | 3.889 | 450         | 454         | 11,765    | 2020/7/31  |
|         | 3.892 MALAYSIAGOV 270315 | 3.892 | 450         | 441         | 11,429    | 2027/3/15  |
|         | 3.955 MALAYSIAGOV 250915 | 3.955 | 500         | 498         | 12,897    | 2025/9/15  |
|         | 4.048 MALAYSIA 210930    | 4.048 | 600         | 610         | 15,787    | 2021/9/30  |

| 銘柄    | 当期末                      |       |             |             |            |            | 償還年月日 |
|-------|--------------------------|-------|-------------|-------------|------------|------------|-------|
|       | 利率                       | 額面金額  | 評価額         |             | 債還年月日      |            |       |
|       |                          |       | 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  | 4.127 MALAYSIA 320415    | 4.127 | 200         | 195         | 5,049      | 2032/4/15  |       |
|       | 4.16 MALAYSIAGOVT 210715 | 4.16  | 400         | 408         | 10,562     | 2021/7/15  |       |
|       | 4.181 MALAYSIAGOV 240715 | 4.181 | 500         | 507         | 13,135     | 2024/7/15  |       |
|       | 4.232MALAYSIAGOVT 310630 | 4.232 | 200         | 197         | 5,098      | 2031/6/30  |       |
|       | 4.254 MALAYSIAGOV 350531 | 4.254 | 200         | 194         | 5,026      | 2035/5/31  |       |
|       | 4.378MALAYSIAGOVT 191129 | 4.378 | 900         | 919         | 23,793     | 2019/11/29 |       |
|       | 4.392 MALAYSIAGOV 260415 | 4.392 | 300         | 307         | 7,969      | 2026/4/15  |       |
|       | 4.498 MALAYSIAGOV 300415 | 4.498 | 500         | 506         | 13,099     | 2030/4/15  |       |
|       | 4.736 MALAYSIAGOV 460315 | 4.736 | 100         | 99          | 2,578      | 2046/3/15  |       |
|       | 4.935 MALAYSIAGOV 430930 | 4.935 | 300         | 303         | 7,861      | 2043/9/30  |       |
|       | 5.734MALAYSIAGOVT 190730 | 5.734 | 300         | 314         | 8,135      | 2019/7/30  |       |
| 小計    |                          |       |             |             | 221,582    |            |       |
| 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  | 5,850       | 6,540       | 55,072     | 2026/12/21 |       |
|       | 6.25 SOUTH AFRICA 360331 | 6.25  | 2,650       | 1,915       | 16,132     | 2036/3/31  |       |
|       | 6.5 SOUTH AFRICA 410228  | 6.5   | 2,700       | 1,922       | 16,186     | 2041/2/28  |       |
|       | 6.75 SOUTH AFRICA 210331 | 6.75  | 1,700       | 1,652       | 13,915     | 2021/3/31  |       |
|       | 7 SOUTH AFRICA 310228    | 7.0   | 3,300       | 2,748       | 23,141     | 2031/2/28  |       |
|       | 7.25 SOUTH AFRICA 200115 | 7.25  | 2,300       | 2,290       | 19,288     | 2020/1/15  |       |
|       | 7.75 SOUTH AFRICA 230228 | 7.75  | 2,100       | 2,070       | 17,435     | 2023/2/28  |       |
|       | 8 SOUTH AFRICA 181221    | 8.0   | 300         | 302         | 2,547      | 2018/12/21 |       |
|       | 8 SOUTH AFRICA 300131    | 8.0   | 2,700       | 2,474       | 20,835     | 2030/1/31  |       |
|       | 8.25 SOUTH AFRICA 320331 | 8.25  | 2,300       | 2,112       | 17,783     | 2032/3/31  |       |
|       | 8.5 SOUTH AFRICA 370131  | 8.5   | 3,400       | 3,086       | 25,986     | 2037/1/31  |       |
|       | 8.75 SOUTH AFRICA 440131 | 8.75  | 2,700       | 2,456       | 20,679     | 2044/1/31  |       |
|       | 8.75 SOUTH AFRICA 480228 | 8.75  | 4,100       | 3,720       | 31,325     | 2048/2/28  |       |
|       | 8.875 SOUTH AFRIC 350228 | 8.875 | 800         | 760         | 6,404      | 2035/2/28  |       |
|       | 9 SOUTH AFRICA 400131    | 9.0   | 700         | 657         | 5,534      | 2040/1/31  |       |
| 小計    |                          |       |             |             | 292,268    |            |       |
| 合計    |                          |       |             |             | 53,808,318 |            |       |

(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

(2017年5月22日現在)

| 項 目          | 当 期 末            |           |
|--------------|------------------|-----------|
|              | 評 価 額            | 比 率       |
| 公社債          | 千円<br>53,808,318 | %<br>98.4 |
| コール・ローン等、その他 | 872,615          | 1.6       |
| 投資信託財産総額     | 54,680,933       | 100.0     |

(注) 期末における外貨建純資産(54,562,124千円)の投資信託財産総額(54,680,933千円)に対する比率は99.8%です。

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

|                      |                   |                     |                    |
|----------------------|-------------------|---------------------|--------------------|
| 1 アメリカドル=111.54円     | 1 カナダドル=82.39円    | 1 メキシコペソ=5.95円      | 1 ユーロ=124.79円      |
| 1 イギリスポンド=144.76円    | 1 スイスフラン=114.49円  | 1 スウェーデンクローネ=12.77円 | 1 ノルウェークローネ=13.31円 |
| 1 デンマーククローネ=16.76円   | 1 ポーランドズロチ=29.76円 | 1 オーストラリアドル=83.03円  | 1 シンガポールドル=80.41円  |
| 1 マレーシアリングgit=25.88円 | 1 南アフリカランド=8.42円  |                     |                    |



## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月22日現在)

| 項 目             | 当 期 末           |
|-----------------|-----------------|
|                 | 円               |
| (A) 資産          | 54,871,368,159  |
| コール・ローン等        | 278,869,388     |
| 公社債(評価額)        | 53,808,318,253  |
| 未収入金            | 361,790,420     |
| 未収利息            | 408,456,394     |
| 前払費用            | 13,933,704      |
| (B) 負債          | 437,766,185     |
| 未払金             | 191,192,100     |
| 未払解約金           | 246,573,888     |
| 未払利息            | 197             |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 54,433,601,974  |
| 元本              | 21,000,747,916  |
| 次期繰越損益金         | 33,432,854,058  |
| (D) 受益権総口数      | 21,000,747,916口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 25,920円         |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 28,604,779,095円  
 期中追加設定元本額 2,130,531,386円  
 期中一部解約元本額 9,734,562,565円  
 また、1口当たり純資産額は、期末25,920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)                | 152,623,703円    |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)              | 288,673,852円    |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)                | 177,787,633円    |
| 三菱UFJ 外国債券オープン                        | 1,558,150,498円  |
| 三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)           | 1,251,110,470円  |
| 三菱UFJ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)         | 3,031,169,817円  |
| 三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)           | 1,820,246,396円  |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)             | 613,153,868円    |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)                | 88,430,177円     |
| 三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)           | 169,285,305円    |
| 三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)                | 2,081,266,693円  |
| 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)           | 446,761,815円    |
| 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)          | 1,321,960,372円  |
| 三菱UFJ 外国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)           | 7,134,634,663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)   | 5,172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) | 230,408円        |
| 三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定)          | 44,151,505円     |
| MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)              | 821,105,569円    |
| 合計                                    | 21,000,747,916円 |

## 【お知らせ】

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める(分散型に分類)ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。

(2016年7月1日)

## ○損益の状況 (2016年5月21日～2017年5月22日)

| 項 目              | 当 期              |
|------------------|------------------|
|                  | 円                |
| (A) 配当等収益        | 1,593,695,114    |
| 受取利息             | 1,593,903,748    |
| その他収益金           | 76,278           |
| 支払利息             | △ 284,912        |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 1,569,972,907  |
| 売買益              | 1,498,481,065    |
| 売買損              | △ 3,068,453,972  |
| (C) 保管費用等        | △ 21,593,843     |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 2,128,364        |
| (E) 前期繰越損益金      | 44,954,999,186   |
| (F) 追加信託差損益金     | 3,177,943,719    |
| (G) 解約差損益金       | △ 14,702,217,211 |
| (H) 計(D+E+F+G)   | 33,432,854,058   |
| 次期繰越損益金(H)       | 33,432,854,058   |

- (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。