

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	2021年7月5日まで（2006年3月17日設定）	
運用方針	マザーファンド受益証券への投資を通じて、世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券への分散投資を行い、信託財産の成長をめざして運用を行います。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要運用対象	ベビーファンド	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 外国株式マザーファンド受益証券、三菱UFJ 国内債券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、MUAM J-REITマザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。各マザーファンド受益証券への資産配分は、信託財産の純資産総額に対して、それぞれ30%、30%、10%、10%、10%、10%を基本投資割合とします。
	三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	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。
	MUAM J-REITマザーファンド	わが国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券（不動産投資法人の投資証券もしくは新投資口予約権証券または不動産投資信託の受益証券をいいます。）を主要投資対象とします。
MUAM G-REITマザーファンド	S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。	
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。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60%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。
	MUAM J-REITマザーファンド	投資信託証券への投資に制限を設けません。株式および外貨建資産への投資は行いません。
MUAM G-REITマザーファンド	株式への直接投資は行いません。投資信託証券への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。	
分配方針	経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
 ※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 6資産バランス
 ファンド（成長型）

第23期（決算日：2017年7月5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 6資産バランスファンド（成長型）」は、去る7月5日に第23期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

 **MUFG**
 三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 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			株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託組入比率	純資産額
	(分配落)	税金分配	み騰落率						
	円	円	%	%	%	%	%	%	百万円
19期(2015年7月6日)	10,774	700	4.8	57.6	0.8	19.5	0.0	19.5	2,339
20期(2016年1月5日)	10,190	100	△4.5	57.1	1.1	20.0	—	19.7	2,314
21期(2016年7月5日)	9,325	0	△8.5	57.5	1.1	20.0	0.0	20.3	2,113
22期(2017年1月5日)	10,454	250	14.8	58.4	1.2	19.1	0.0	20.2	2,310
23期(2017年7月5日)	10,394	300	2.3	58.2	1.2	19.8	0.0	19.6	2,161

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドは、世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券への分散投資を行うことで信託財産の成長をはかることを目標としておりますが、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「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		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託組入比率
	騰落率	騰落率					
(期首) 2017年1月5日	円	%	%	%	%	%	%
1月末	10,250	△2.0	58.4	0.6	19.9	0.0	19.8
2月末	10,355	△0.9	57.9	1.4	19.8	0.0	20.2
3月末	10,304	△1.4	57.5	1.6	20.0	0.0	19.8
4月末	10,362	△0.9	58.5	1.2	19.6	0.0	19.7
5月末	10,493	0.4	58.3	1.1	19.8	0.0	19.6
6月末	10,647	1.8	57.9	1.2	20.0	0.0	19.6
(期末) 2017年7月5日	10,694	2.3	58.2	1.2	19.8	0.0	19.6

(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23期：2017/1/6～2017/7/5）

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.3%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。



第23期首：10,454円
 第23期末：10,394円
 （既払分配金 300円）
 騰落率：2.3%
 （分配金再投資ベース）

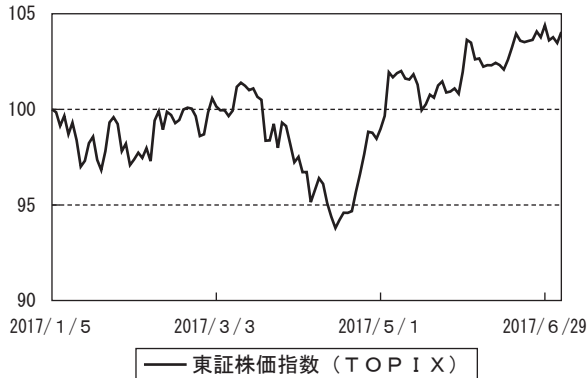
- ・分配金再投資基準価額は、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- ・実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なるため、お客さまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の主な変動要因

上昇要因	フランス大統領選でマクロン氏が勝利し、フランスの欧州連合（EU）離脱懸念が後退したことなどにより、内外株式市況が上昇したことなどが、基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	公募増資が多く発表されたことなどにより、国内REIT市況が下落したことが、基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

（第23期：2017/1/6～2017/7/5）

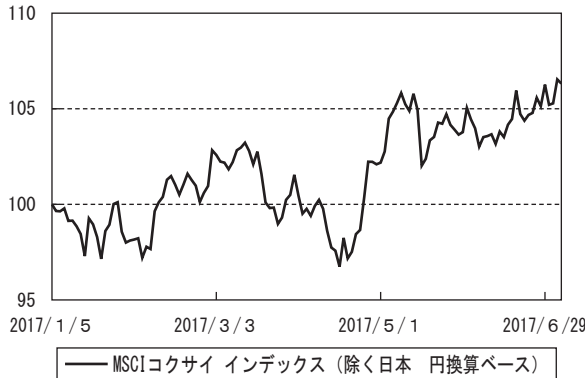
市況の推移
（期首を100として指数化）

◎国内株式市況

- ・北朝鮮情勢が緊迫するなど地政学リスクが意識され下落した局面もありましたが、フランス大統領選挙で親EU派のマクロン氏が勝利したことなどを好感して世界的に株高となったことや、国内企業の業績改善が進んだことなどを受け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)

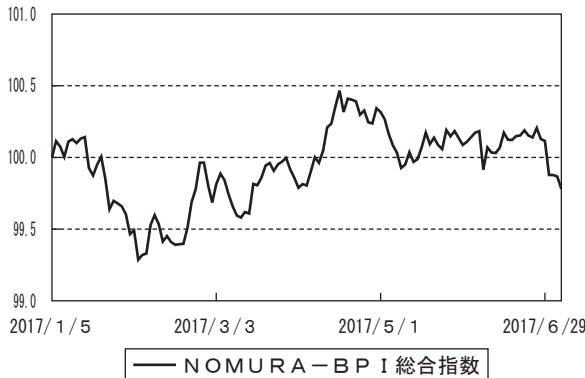


・MSCIコクサイ インデックスは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCIコクサイ インデックス（除く日本 円換算ベース）は、MSCIコクサイ インデックス（除く日本 米ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。またMSCIコクサイ インデックスに対する著作権及びその他の知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

◎外国株式市況

- ・米国の堅調な企業決算発表や良好な経済指標などを受けて、外国株式市況は上昇しました。

市況の推移
(期首を100として指数化)



・NOMURA-BPI 総合指数とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI 総合指数は野村證券株式会社の知的財産であり、ファンドの運用成果に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。

◎国内債券市況

- ・期の初めは、日本銀行が金融政策の一環として実施している国債買入れへの警戒感などから国内債券市況は下落しました。その後、地政学リスクの高まりなどから国内債券市況は上昇する局面もあったものの、期を通してみると若干の下落となりました。

市況の推移
(期首を100として指数化)

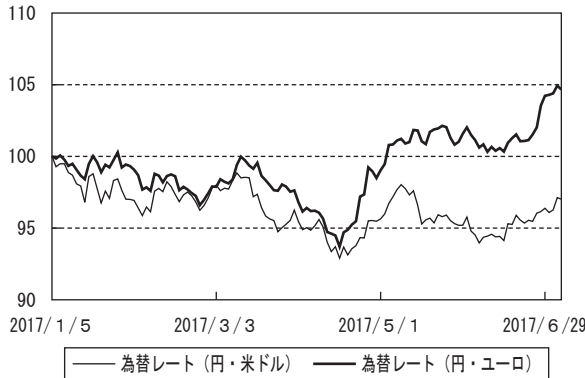


・シティ世界国債インデックス（除く日本、Local）は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

◎外国債券市況

- ・先進国の債券市況は、米連邦準備制度理事会（FRB）の利上げに対する期待が後退したことなどを背景に上昇しました。

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、FRBの利上げに対する期待が後退したことなどを背景に米ドルが対円で売られました。期首との比較では、米ドルは対円で3.0%下落しました。
- ・円・ユーロ相場は、フランス大統領選挙を巡る不透明感などを背景に、ユーロが対円で下落する局面もありましたが、その後実施された選挙の結果などを受けてユーロは対円で買われました。期首との比較では、ユーロは対円で4.7%上昇しました。

市況の推移
(期首を100として指数化)

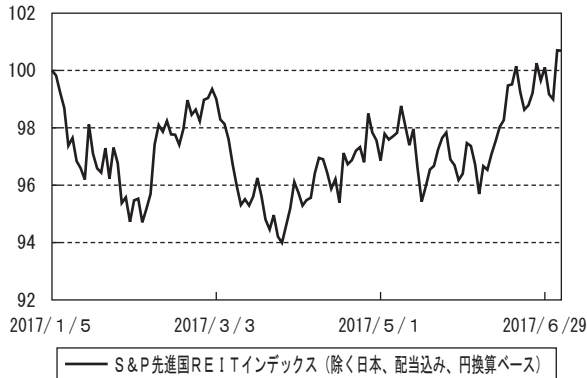


- ・東証REIT指数（配当込み）とは、東京証券取引所に上場している不動産投資信託全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。東証REIT指数の商標に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は東証REIT指数の内容の変更、公表の停止または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。東京証券取引所は東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対して、責任を負いません。

◎国内REIT市況

- ・世界的な金利上昇傾向により海外からの資金流入に対する期待が後退したことや、2017年1月以降、公募増資などが多く発表されたことなどにより、期の初めから軟調な展開となりました。また、地政学リスクや欧州の政治リスクなどの外部要因、さらには投資口需給において投資信託の売り越し基調が鮮明となったことなどが上値の重しとなり、期末にかけても軟調な展開に終了しました。

市況の推移
 (期首を100として指数化)



◎外国REIT市況

- ・米国の堅調な企業決算発表や良好な経済指標などを受けて、外国REIT市況は上昇しました。

・S&P先進国REITインデックスとは、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するS&Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託（REIT）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。なお、S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）は、S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み）をもとに、委託会社が計算したものです。S&P先進国REITインデックスはS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P先進国REITインデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

当該投資信託のポートフォリオについて

＜三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）＞

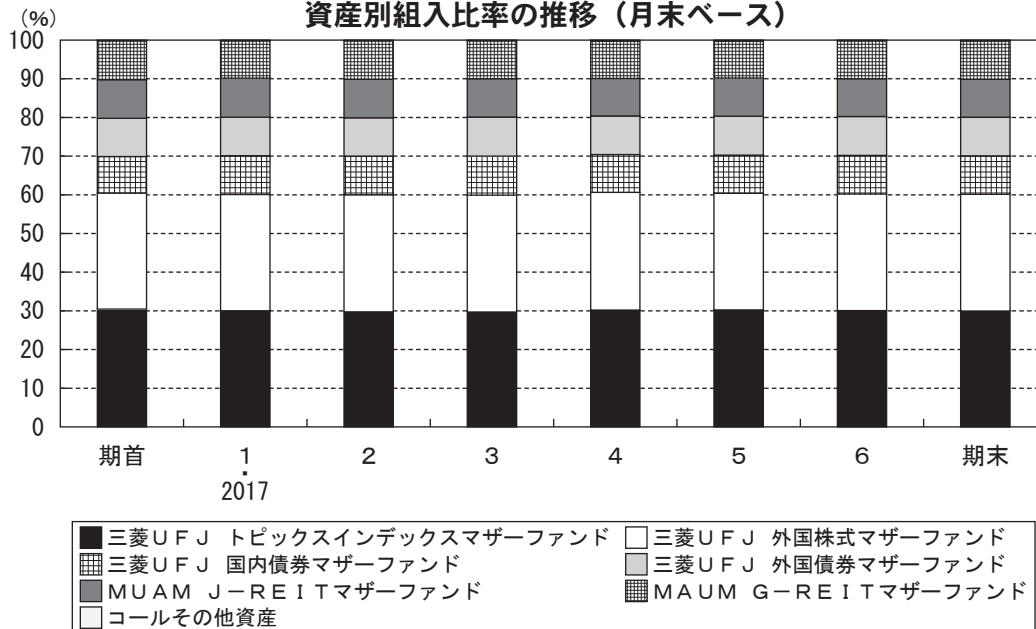
資産配分は、ファンドの基本投資割合に準じて運用を行いました。
その結果、基準価額の主な変動要因の内訳は以下の通りとなりました。

（内訳）

三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	1.6%程度
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	1.9%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	0.2%程度
MUAM J-REITマザーファンド	△0.8%程度
MUAM G-REITマザーファンド	0.1%程度
その他（信託報酬等）	△0.7%程度

（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5.3%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

【ベンチマークとの比較】

ベンチマークは4.0%の上昇となったため、ベンチマークとの乖離は1.3%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
ベンチマークとの乖離	0.0%程度	0.0%程度	1.2%程度	1.3%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乖離を生む可能性があります。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

◎その他の要因

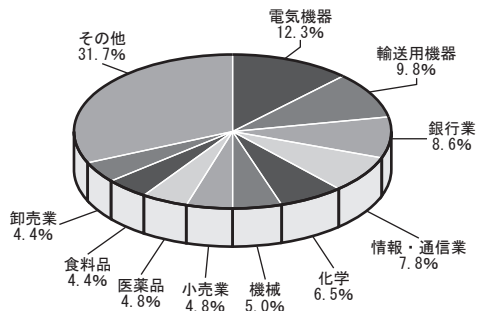
その他の要因による影響は1.2%程度でした。

- ・配当金等の受取りにより、プラス乖離となりました。

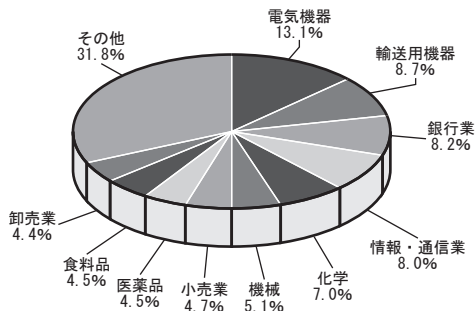
プラス要因	配当収入等	計	1.2%程度
マイナス要因	売買コスト等	計	△0.0%程度

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。

（ご参考）
組入上位10業種
期首（2017年1月5日）



期末（2017年7月5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6.3%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

【ベンチマークとの比較】

ベンチマークは6.3%の上昇となったため、ベンチマークとの乖離は0.0%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
ベンチマークとの乖離	△0.0%程度	△0.1%程度	0.1%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。

- ・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 $\Delta 0.1\%$ 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 0.1% 程度でした。

プラス要因	配当・利子収入等	計	0.3%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料・為替効果等	計	$\Delta 0.2\%$ 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>

基準価額は期首に比べ 0.2% 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。

【ベンチマークとの比較】

ベンチマークは 0.2% 下落となったため、ベンチマークとのカイ離は 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	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 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（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。

（ご参考）

利回り・デュレーション

期首（2017年1月5日）

最終利回り	0.1%
直接利回り	1.0%
デュレーション	8.7年

期末（2017年7月5日）

最終利回り	0.2%
直接利回り	1.0%
デュレーション	8.8年

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

<三菱UFJ 外国債券マザーファンド>

基準価額は期首に比べ1.8%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。

【ベンチマークとの比較】

ベンチマークは1.4%の上昇となったため、ベンチマークとの乖離は0.4%程度となりました。

	ポートフォリオ 要因	管理コスト等 要因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマークとの乖離	0.0%程度	△0.0%程度	0.3%程度	0.4%程度

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

◎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0.3%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。

（ご参考）

利回り・デュレーション

期首（2017年1月5日）

最終利回り	1.3%
直接利回り	2.5%
デュレーション	6.9年

期末（2017年7月5日）

最終利回り	1.4%
直接利回り	2.5%
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。

<MUAM J-REITマザーファンド>

基準価額は期首に比べ8.0%の下落となりました。

- ・銘柄選定およびポートフォリオの構築は主に、定性的評価・定量的評価を経て行っています。
- ・定性的評価については、事業内容および財務内容などの分析を中心に行い、定量的評価においては、キャッシュフロー、配当利回り、投資口価格純資産倍率（PBR）などの分析を行いました。
- ・組入銘柄数は49銘柄程度で推移させました。
- ・主な売買動向については、相対的に割安感のあるジャパン・ホテル・リート投資法人のウェイトを引き上げたことなどや、資産規模の拡大に対し懸念の残るプレミア投資法人のウェイトを引き下げたことなどが挙げられます。

【ベンチマークとの比較】

基準価額の騰落率は、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）を0.8%上回りました。

銘柄選択がプラスに寄与しました。

（プラス要因となった主な銘柄）

- ・インヴィンシブル投資法人：投資口が割安であることに加え、中長期的に見れば業績拡大が今後も見込めることからオーバーウェイトとした時期に投資口価格が好調に推移したことからプラスに寄与。
- ・野村不動産マスターファンド投資法人：相対的に高い利益成長が見込みにくいと想定し、期首よりアンダーウェイト。投資口価格が低調に推移したことからプラスに寄与。
- ・日本プライムリアルティ投資法人：高品質な物件ポートフォリオを保有しているものの、物件取得による資産規模の拡大が見込みにくいと想定し、期首よりアンダーウェイト。投資口価格が低調に推移したことからプラスに寄与。

（マイナス要因となった主な銘柄）

- ・日本ロジスティクスファンド投資法人：相対的な割安感が後退したことなどから期首よりアンダーウェイト。投資口価格が相対的に好調に推移したことからマイナスに影響。

<MUAM G-REITマザーファンド>

基準価額は期首に比べ0.4%の上昇となりました。

- ・ベンチマークであるS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とし、同インデックスに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。
- ・不動産投資信託証券の組入比率は高位を保ち、国別比率や用途別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

【ベンチマークとの比較】

ベンチマークは0.7%の上昇となったため、ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.3\%$ 程度となりました。

	売買コスト 要因	配当課税 要因	為替評価 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	$\Delta 0.2\%$ 程度	$\Delta 0.1\%$ 程度	0.0%程度	$\Delta 0.3\%$ 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。

◎売買コスト要因

売買コストによる影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

◎配当課税要因

配当課税による影響は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。

- ・ベンチマークでは配当金に課される税金が考慮されていないため、ファンドではマイナス要因となりました。

◎為替評価要因

為替評価による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

- ・為替評価要因は、ベンチマークの計算に使用する為替レートとファンドの基準価額の計算に使用する為替レートの差によって生じます。

◎その他の要因

その他の要因による影響は0.0%程度でした。

- ・その他の要因としては、ベンチマークとファンド間でのREITの保有比率の差や、円貨、外貨現金の保有による影響などが含まれます。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・当ファンドは、世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券への分散投資を行うことで信託財産の成長をはかることを目標としておりますが、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。
- ・従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

分配金について

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

【分配原資の内訳】 (単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第23期
	2017年1月6日～2017年7月5日
当期分配金	300
(対基準価額比率)	2.805%
当期の収益	137
当期の収益以外	162
翌期繰越分配対象額	1,438

(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 6資産バランスファンド（成長型）>

◎今後の運用方針

- ・資産配分方針は、従前通り基本投資割合を維持します。また各資産の組入比率は、期を通じて同割合に準ずるよう調整を行います。

<三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド>

◎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。

<三菱UFJ 外国株式マザーファンド>

◎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。

<三菱UFJ 国内債券マザーファンド>

◎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。

<三菱UFJ 外国債券マザーファンド>

◎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。

<MUAM J-REITマザーファンド>

◎運用環境の見通し

- ・当面のJ-REIT市場は、上値の重い展開を想定しています。
- ・オフィス市況については、堅調な需要を背景とした低水準の空室率が賃料の上昇基調を支えるとみており、REIT各社の業績についても、当面賃料値上げなどが牽引する形で、安定した増益基調を維持するとみられます。
- ・一方で、投資口の需給に関しては投資信託からの資金流出傾向が続いており、さらに海外投資家についても米欧での金利上昇傾向が利回り商品であるJ-REITに対する投資意欲を減退させているとみられます。
- ・引き続き日本銀行による金融緩和政策が継続するなか、安定配当・高利回り商品としての魅力は変わらないものの、投資口の需給を踏まえると上値の重い展開が想定されます。

◎今後の運用方針

- ・REITの組入比率については、高水準（90%以上）を維持する方針です。
 - ・配当利回りやPBRなどのバリュエーション、また物件ポートフォリオのクオリティなどに着目し、安定した配当金が見込め相対的に割安と思われる銘柄への投資ウェイトを高めた運用を行います。
- 前述の不動産市況を踏まえ、保有物件の賃料動向など、REIT各社の業績の先行きについて特に注意深く見守るほか、スポンサーのサポート体制などにも着目していく方針です。

<MUAM G-REITマザーファンド>

◎今後の運用方針

- ・S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とし、同インデックス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

（2017年1月6日～2017年7月5日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	56 (24) (29) (3)	0.538 (0.226) (0.280) (0.032)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数) ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価 ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	1 (0) (1) (0)	0.013 (0.001) (0.012) (0.000)	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(c) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	0 (0) (0)	0.001 (0.000) (0.000)	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (監 査 費 用) (そ の 他)	2 (1) (0) (0)	0.016 (0.014) (0.002) (0.000)	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	59	0.568	
期中の平均基準価額は、10,401円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2017年1月6日～2017年7月5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	11,324	14,013	82,508	105,353
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	15,305	21,118	17,676	24,391
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	4,094	10,533	10,343	26,722
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	6,839	13,645	46,708	96,922
MUAM G-R-E-I-Tマザーファンド	2,653	4,088	14,369	22,551
MUAM J-R-E-I-Tマザーファンド	3,825	10,427	3,823	10,233

○株式売買比率

(2017年1月6日～2017年7月5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	23,999,584千円	13,940,969千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	203,364,399千円	102,221,802千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.11	0.13

(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

(2017年1月6日～2017年7月5日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）>

該当事項はございません。

<三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	3,175	11	0.3	20,824	4,160	20.0
貸付有価証券(株式)	226,231	164,565	72.7	241,831	176,876	73.1

平均保有割合 0.3%

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

＜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 2,722	百万円 1,287	% 47.3	百万円 16,149	百万円 10,401	% 64.4

平均保有割合 0.6%

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

＜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 28,095	百万円 6,321	% 22.5	百万円 27,284	百万円 7,179	% 26.3

平均保有割合 0.1%

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

(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 1,741	百万円 1,061	% 60.9	百万円 10,497	百万円 5,923	% 56.4

平均保有割合 0.4%

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

＜MUAM J-REIT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	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 10,909	百万円 2,795	% 25.6	百万円 11,333	百万円 3,028	% 26.7

平均保有割合 1.3%

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

<MUAM G-REITマザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 1,611	百万円 1,049	% 65.1	百万円 1,958	百万円 936	% 47.8

平均保有割合 1.2%

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

利害関係人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 62	百万円 513	百万円 5,335

<三菱UFJ 国内債券マザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 -	百万円 -	百万円 822

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 0.381605

<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 1,100

<MUAM J-REITマザーファンド>

種 類	買 付 額
投資信託証券	百万円 902

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)	285千円
うち利害関係人への支払額 (B)	60千円
(B) / (A)	21.3%

(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MUF G証券、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2017年7月5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	566,635	495,451	647,703
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	158,565	156,195	214,877
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	87,965	81,716	215,878
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	345,620	305,751	651,800
MUAM G-R-E-I-Tマザーファンド	144,605	132,888	213,990
MUAM J-R-E-I-Tマザーファンド	82,682	82,683	212,183

○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7月5日現在における貸付株数の総株数は26,441,000株です。

うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUF G証券に対する貸付は、23,076,600株です。

○投資信託財産の構成

（2017年7月5日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	647,703	29.0
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	214,877	9.6
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	215,878	9.7
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	651,800	29.2
MUAM G-R-E-I-Tマザーファンド	213,990	9.6
MUAM J-R-E-I-Tマザーファンド	212,183	9.5
コール・ローン等、その他	79,356	3.4
投資信託財産総額	2,235,787	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（53,405,435千円）の投資信託財産総額（54,556,693千円）に対する比率は97.9%です。

(注) 三菱UFJ 外国株式マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（107,132,948千円）の投資信託財産総額（107,494,647千円）に対する比率は99.7%です。

(注) MUAM G-R-E-I-Tマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（18,608,497千円）の投資信託財産総額（18,652,078千円）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=113.08円	1 カナダドル=87.44円	1 メキシコペソ=6.22円	1 ユーロ=128.42円
1 イギリスポンド=146.31円	1 スイスフラン=117.23円	1 スウェーデンクローネ=13.28円	1 ノルウェークローネ=13.55円
1 デンマーククローネ=17.27円	1 ポーランドズロチ=30.31円	1 オーストラリアドル=86.09円	1 ニュージーランドドル=82.41円
1 香港ドル=14.48円	1 シンガポールドル=81.83円	1 マレーシアリングギット=26.31円	1 イスラエルシェケル=32.16円
1 南アフリカランド=8.56円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年7月5日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,235,787,242
コール・ローン等	17,252,199
三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド(評価額)	647,703,944
三菱UFJ 国内債券マザーファンド(評価額)	214,877,970
三菱UFJ 外国債券マザーファンド(評価額)	215,878,808
三菱UFJ 外国株式マザーファンド(評価額)	651,800,295
MUAM G-REITマザーファンド(評価額)	213,990,713
MUAM J-REITマザーファンド(評価額)	212,183,280
未収入金	62,100,033
(B) 負債	74,621,426
未払収益分配金	62,376,099
未払解約金	10,050
未払信託報酬	12,191,419
未払利息	30
その他未払費用	43,828
(C) 純資産総額(A-B)	2,161,165,816
元本	2,079,203,315
次期繰越損益金	81,962,501
(D) 受益権総口数	2,079,203,315口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,394円

<注記事項>

- ①期首元本額 2,210,343,450円
 期中追加設定元本額 111,328,317円
 期中一部解約元本額 242,468,452円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0394円です。

②分配金の計算過程

項 目	2017年1月6日～ 2017年7月5日
費用控除後の配当等収益額	21,453,838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	7,033,501円
収益調整金額	215,732,897円
分配準備積立金額	117,334,310円
当ファンドの分配対象収益額	361,554,546円
1万口当たり収益分配対象額	1,738円
1万口当たり分配金額	300円
収益分配金金額	62,376,099円

○損益の状況（2017年1月6日～2017年7月5日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 2,884
受取利息	59
支払利息	△ 2,943
(B) 有価証券売買損益	62,649,089
売買益	84,756,448
売買損	△ 22,107,359
(C) 信託報酬等	△ 12,235,247
(D) 当期損益金(A+B+C)	50,410,958
(E) 前期繰越損益金	95,410,691
(F) 追加信託差損益金	△ 1,483,049
(配当等相当額)	(215,633,450)
(売買損益相当額)	(△217,116,499)
(G) 計(D+E+F)	144,338,600
(H) 収益分配金	△ 62,376,099
次期繰越損益金(G+H)	81,962,501
追加信託差損益金	△ 1,483,049
(配当等相当額)	(215,732,897)
(売買損益相当額)	(△217,215,946)
分配準備積立金	83,445,550

- (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）	300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7月5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】

2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。））の税率が適用されます。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2017年7月5日現在）

<MUAM J-REITマザーファンド>

下記は、MUAM J-REITマザーファンド全体(6,214,076千口)の内容です。

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千口	千円	%
日本アコモデーションファンド投資法人	0.626	0.841	383,496	2.4
MCUBS MidCity投資法人	0.547	0.487	160,710	1.0
森ヒルズリート投資法人	3	1	198,123	1.2
産業ファンド投資法人	0.346	0.716	358,000	2.2
アドバンス・レジデンス投資法人	1	1	379,483	2.4
ケネディクス・レジデンシャル投資法人	0.47	0.41	113,488	0.7
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1	0.805	378,350	2.4
GLP投資法人	5	1	221,918	1.4
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.618	0.498	117,528	0.7
日本プロロジスリート投資法人	3	3	871,016	5.5
星野リゾート・リート投資法人	—	0.37	212,380	1.3
Oneリート投資法人	0.192	0.644	136,334	0.9
イオンリート投資法人	2	0.325	39,877	0.3
ヒューリックリート投資法人	2	2	388,690	2.4
日本リート投資法人	0.019	0.439	129,153	0.8
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	0.775	1	132,355	0.8
積水ハウス・リート投資法人	1	0.249	32,917	0.2
トーセイ・リート投資法人	0.004	0.284	30,331	0.2
ケネディクス商業リート投資法人	1	0.076	17,898	0.1
野村不動産マスターファンド投資法人	3	3	531,513	3.3
いちごホテルリート投資法人	0.266	0.706	79,354	0.5
ラサールロジポート投資法人	3	1	177,612	1.1
三井不動産ロジステイクスパーク投資法人	0.456	0.856	274,348	1.7
投資法人みらい	—	0.99	169,785	1.1
森トラスト・ホテルリート投資法人	—	1	167,776	1.1
日本ビルファンド投資法人	2	1	917,373	5.8
ジャパンリアルエステイト投資法人	2	2	1,213,589	7.6
日本リテールファンド投資法人	3	3	712,908	4.5
オリックス不動産投資法人	4	4	653,489	4.1
日本プライムリアルティ投資法人	0.258	0.233	89,821	0.6
プレミア投資法人	1	0.063	6,772	0.0
東急リアル・エステート投資法人	0.244	0.754	101,413	0.6
グローバル・ワン不動産投資法人	0.342	0.932	353,694	2.2
ユナイテッド・アーバン投資法人	2	2	327,157	2.1
森トラスト総合リート投資法人	1	3	621,972	3.9
インヴィンシブル投資法人	2	9	428,285	2.7
フロンティア不動産投資法人	0.752	0.337	152,661	1.0
平和不動産リート投資法人	0.643	0.063	5,443	0.0
日本ロジステイクスファンド投資法人	0.575	0.165	37,405	0.2
福岡リート投資法人	1	1	297,509	1.9
ケネディクス・オフィス投資法人	0.745	0.89	520,650	3.3
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	0.064	0.794	92,104	0.6
いちごオフィスリート投資法人	2	1	112,778	0.7
大和証券オフィス投資法人	0.875	1	861,470	5.4
阪急リート投資法人	0.641	0.301	41,267	0.3

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率	
	千口	千口	千円	%	
スタートプロシード投資法人	0.289	0.579	84,765	0.5	
大和ハウスリート投資法人	1	1	494,568	3.1	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	5	8	668,203	4.2	
日本賃貸住宅投資法人	4	2	206,654	1.3	
ジャパンエクセレント投資法人	1	0.403	50,495	0.3	
合 計	口 数 ・ 金 額	77	76	14,754,894	
	銘 柄 数 < 比 率 >	47	50	< 92.5% >	

(注) 比率および合計欄の< >内は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の比率。

(注) 日本アコモデーションファンド投資法人、MCUBS Mid City投資法人、森ヒルズリート投資法人、産業ファンド投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、ケネディクス・レジデンシャル投資法人、アクティビア・プロパティーズ投資法人、GLP投資法人、コンフォリア・レジデンシャル投資法人、日本プロロジスリート投資法人、星野リゾート・リート投資法人、イオンリート投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本リート投資法人、インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人、積水ハウス・リート投資法人、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、野村不動産マスターファンド投資法人、いちごホテルリート投資法人、ラサールロジポート投資法人、三井不動産ロジスティクスパーク投資法人、日本ビルファンド投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、日本リテールファンド投資法人、オリックス不動産投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、プレミアム投資法人、東急リアル・エステート投資法人、グローバル・ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、森トラスト総合リート投資法人、インヴィンシブル投資法人、フロンティア不動産投資法人、平和不動産リート投資法人、日本ロジスティクスファンド投資法人、福岡リート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、いちごオフィスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、阪急リート投資法人、スタートプロシード投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、日本賃貸住宅投資法人、ジャパンエクセレント投資法人につきましては、委託会社の利害関係人である三菱UFJ信託銀行、三菱東京UFJ銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUFJ証券が当該ファンドの一般事務受託会社等となっています。(各ファンドで開示されている2017年1月5日時点の有価証券報告書または有価証券届出書等より記載)

純資産総額の10%を超える不動産ファンドに関する組入投資証券の内容
当期末において10%を超える銘柄の組入れはございません。

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。 株式（株価指数先物取引等を含む）の組入比率は、高位を保ちます。 運用の効率化を図るためおよび当該株価指数への連動をめざすため、株価指数先物取引等を利用します。
主要運用対象	わが国の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数 (TOPIX)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	期騰落	期中率	期騰落	期中率			
	円	%		%	%	%	百万円
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国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

(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 (TOPIX)		株 組 入 比 率 %	株 先 物 比 率 %
	円	騰 落 率 %	(TOPIX)	騰 落 率 %		
(期 首) 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) 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

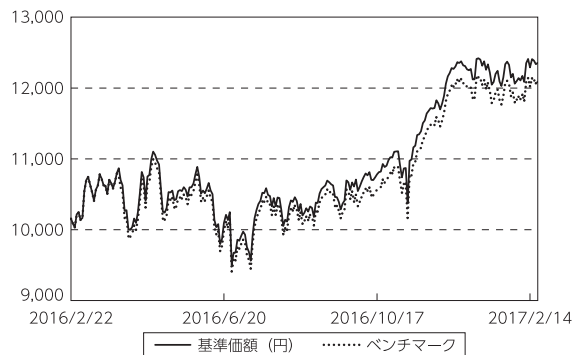
◎基準価額の動き

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 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	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 (株 式) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 0 (0) (0)	% 0.003 (0.000) (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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	0	0.003	
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 19,571 (△11,967)	千円 23,416,677 ()	千株 39,723	千円 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 48,641	百万円 48,368	百万円 -	百万円 -

○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 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
株式	百万円 23,416	百万円 785	% 3.4	百万円 50,850	百万円 9,040	% 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 437	百万円 1,315	百万円 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 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
水産・農林業 (0.1%)				
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	
鉱業 (0.3%)				
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	
建設業 (2.9%)				
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	
ビ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	
パナホーム	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	
食料品 (4.4%)				
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	
六甲バター	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	
キュービー	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	
繊維製品 (0.7%)				
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	
パルプ・紙 (0.2%)				
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	
化学 (6.7%)				
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	
医薬品 (4.7%)				
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	
石油・石炭製品 (0.5%)				
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	
ゴム製品 (1.0%)				
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	
ガラス・土石製品 (1.0%)				
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
鉄鋼 (1.4%)			
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
缸技	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
非鉄金属 (1.0%)			
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
三井金属鋁業	275	261	99,441
東邦亜鉛	58	54	34,290
三菱マテリアル	671	59.8	229,632
住友金属鋁山	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	
金属製品 (0.7%)				
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	
機械 (5.1%)				
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・ビー機械	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	
日本コンパヤ	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	
電気機器 (12.6%)				
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)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	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	
スミダコーポレーション	8.8	7.5	9,742	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
アイコム	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
輸送用機器 (9.3%)			
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	評 価 額
	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
精密機器 (1.5%)			
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
JMS	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	評 価 額
	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
その他製品 (1.7%)			
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	評 価 額
	千株	千株	千円
ウッドワン	21	15	4,410
大建工業	40	6.5	14,144
凸版印刷	290	259	292,411
大日本印刷	304	264	313,104
図書印刷	19	12	5,784
共同印刷	35	28	10,752
日本写真印刷	17.2	15.4	51,205
光村印刷	12	9	2,403
宝印刷	5.1	4.7	7,421
アシックス	95.6	91	177,996
ツツミ	5.1	3.4	7,194
小松ウオール工業	3.5	3	5,829
ヤマハ	75.5	61.7	180,904
河合楽器製作所	3.9	3.6	8,280
クリナップ	12.1	10.9	9,090
ビジョン	58.2	55.4	173,125
兼松サステック	12	11	2,706
キングジム	8.8	7.7	6,598
リンテック	24.4	21.6	53,460
TASAKI	2.1	2.6	3,931
イトーキ	21.6	19.3	14,050
任天堂	63.2	56.4	1,302,558
三菱鉛筆	7.6	7.5	42,300
タカラスタンダード	42	18.9	36,174
コクヨ	53.4	47.6	74,113
ナカバヤシ	21	16	4,400
グローブライド	5	4.5	8,104
岡村製作所	35.7	31.9	32,569
美津濃	55	49	29,645
アデランス	17.7	—	—
電気・ガス業 (1.8%)			
東京電力ホールディングス	870.9	777.1	336,484
中部電力	314.1	301.8	447,720
関西電力	418.9	373.8	464,633
中国電力	141.9	126.7	154,954
北陸電力	100.6	89.7	100,194
東北電力	256.5	228.9	329,616
四国電力	92.4	82.5	90,172
九州電力	226.7	202.3	251,458

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
北海道電力	96.1	85.7	69,159
沖縄電力	10.9	13.5	35,289
電源開発	87.5	72.9	196,101
エフオン	—	3.5	3,503
イーレックス	2.1	3.9	14,313
東京瓦斯	1,146	983	507,424
大阪瓦斯	1,063	889	383,603
東邦瓦斯	259	231	183,414
北海道瓦斯	24	21	5,838
広島ガス	18.1	18.4	6,844
西部瓦斯	114	102	26,724
静岡ガス	28.8	28	20,188
メタウォーター	6.6	5.2	15,314
陸運業 (4.1%)			
SBSホールディングス	10.4	9.2	7,663
東武鉄道	549	489	280,197
相鉄ホールディングス	176	147	83,496
東京急行電鉄	598	498	411,348
京浜急行電鉄	281	251	306,471
小田急電鉄	329	146.7	327,434
京王電鉄	287	256	226,048
京成電鉄	154	68.7	182,329
富士急行	27	25	25,275
新京成電鉄	13	11	4,620
東日本旅客鉄道	187.7	177.2	1,820,730
西日本旅客鉄道	98.8	88.2	648,270
東海旅客鉄道	91.9	76.2	1,418,844
西武ホールディングス	81.8	126.5	248,572
鴻池運輸	14.5	13	18,525
西日本鉄道	133	110	53,790
ハマキョウレックス	7.8	6.1	12,706
サカイ引越センター	4	3.2	9,920
近鉄グループホールディングス	1,033	922	387,240
阪急阪神ホールディングス	689	115.7	435,032
南海電気鉄道	230	194	107,088
京阪ホールディングス	230	205	146,985
神戸電鉄	25	22	8,382
名古屋鉄道	374	334	174,348
山陽電気鉄道	37	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	
海運業 (0.3%)				
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	
空運業 (0.6%)				
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	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
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	
情報・通信業 (7.8%)				
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ペ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
gumi	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HD	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
卸売業 (4.6%)			
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
コンドーテック	7.8	7.3	6,380
中山福	6.2	4.6	3,933
ナガイレーベン	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	
トーヨー	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	
ブロンコビリー	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	
Hamee	—	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
パ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
サトレストランシシステムズ	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
銀行業 (8.7%)			
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	
証券、商品先物取引業 (1.3%)				
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	
保険業 (2.8%)				
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
その他金融業 (1.3%)			
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 J 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
不動産業 (2.5%)			
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	評 価 額
	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
サービス業 (3.6%)			
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	評 価 額
	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

<注記事項>

- 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 (除く日本円換算ベース)		株式組入比率	株先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	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 (除く日本円換算ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 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) 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

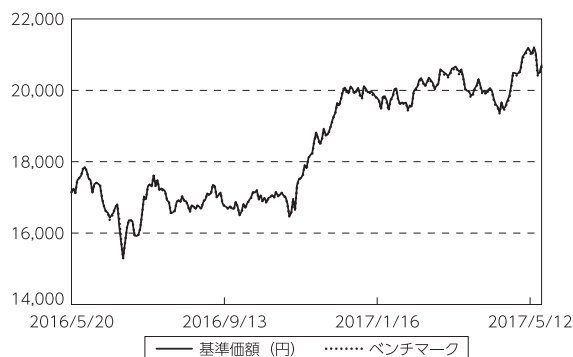
◎基準価額の動き

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 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 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 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 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保 管 費 用)	(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 国	アメリカ	百株 6,143 (645)	千アメリカドル 31,470 (670)	百株 29,982 (661)	千アメリカドル 183,943 (3,481)
	カナダ	929 (188)	千カナダドル 3,785 (—)	3,533	千カナダドル 13,799
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	660 (470)	2,333 (△ 139)	2,378	9,419
	イタリア	1,848 (△ 1,143)	953 (△ 119)	6,036	2,020
	フランス	470 (225)	1,906 (△ 205)	2,395	8,880
	オランダ	416 (191)	663 (367)	1,917	3,651
	スペイン	1,411 (17,690)	526 (172)	21,952	3,039
	ベルギー	17 (△ 36)	130 (△ 333)	173	1,294
	オーストリア	12	32	59	186
	ルクセンブルク	79 (△ 349)	216 (—)	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 (66)	276 (164)	82	269
	イギリス	6,389 (66,854)	千イギリスポンド 3,074 (63)	25,575 (76,257)	千イギリスポンド 16,363 (695)
	スイス	201 (—)	千スイスフラン 1,127 (△ 238)	1,483	千スイスフラン 9,596
	スウェーデン	332 (218)	千スウェーデンクローネ 4,406 (—)	2,183 (84)	千スウェーデンクローネ 27,245 (151)
	ノルウェー	185 (—)	千ノルウェークローネ 2,532 (△ 103)	486	千ノルウェークローネ 5,739

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	デンマーク	百株 130 (36)	千デンマーククローネ 3,705 (-)	百株 458	千デンマーククローネ 13,417
	オーストラリア	1,061 (138)	千オーストラリアドル 1,435 (-)	6,824 (211)	千オーストラリアドル 9,718 (187)
	ニュージーランド	45	千ニュージーランドドル 28	492	千ニュージーランドドル 256
	香港	2,722 (282)	千香港ドル 5,906 (-)	8,779	千香港ドル 27,893
	シンガポール	2,194 (1,738)	千シンガポールドル 383 (-)	7,819 (1,738)	千シンガポールドル 1,875 (13)
	イスラエル	147	千イスラエルシケル 954	750	千イスラエルシケル 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 (6)	2,019 (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 (—)	13 (△0.97615)	0.259	19
ICADE	0.353	23	0.393	25
小 計	1 (—)	104 (△0.97615)	3	316
ユ ー ロ 計	1 (—)	104 (△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	— (4)	— (—)	4	4
小 計	6 (4)	31 (—)	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 (-)	13 (△0.73695)	26	43
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	16	24	32	48
	CAPITALAND MALL TRUST	5	11	21	42
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	- (-)	- (△ 0.4084)	6	13
小計		29 (-)	50 (△ 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 38,472	百万円 39,374	百万円 -	百万円 -

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

○株式売買比率

(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 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 8,932	百万円 6,530	% 73.1	百万円 39,062	百万円 26,169	% 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
FLOWERVE 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	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		
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	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 銘柄 数 < 比 率 >	7,820	6,572	32,522	4,058,520	
		52	56	—	<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 銘柄 数 < 比 率 >	21,536	16,204	6,660	831,151	
		20	18	—	<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・金額	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	株数	期末		業種等
			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 銘柄数<比率>	33,002 39	27,227 40	91,186 —	1,306,708 <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
SEBACORP 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
SEBACORP 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 銘柄数<比率>	19,300 23	13,674 22	6,315 —	507,812 <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	評価額		
(イスラエル) FRUTAROM	百株 —	百株 10	千イスラエルシェケル 232	千円 7,249	素材
小計	株数・金額 2,125	株数 1,522	外貨建金額 3,456	邦貨換算金額 107,606	
	銘柄数<比率> 9	9	—	<0.1%>	
合計	株数・金額 473,185	株数 364,515	—	101,254,143	
	銘柄数<比率> 1,260	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	口 数	金額	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 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

<注記事項>

- 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	期中落率	期騰	期中落率			
	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 %	債 先 物 比 率 %
	円	騰 落 率 %		騰 落 率 %		
(期 首) 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) 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 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,946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 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
	社債券	2,700,010	(680,786)
			3,114,162
			(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 内	債券先物取引	百万円 3,774	百万円 3,777	百万円 -	百万円 -

○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 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %
公社債	百万円 61,673	百万円 17,875	29.0	百万円 61,755	百万円 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 300	百万円 102	百万円 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 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 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 (100,000)	173,740,290 (100,212)	81.9 (0.0)	— (—)	52.6 (—)	19.7 (—)	9.6 (0.0)
地方債証券	11,572,510 (11,572,510)	12,450,224 (12,450,224)	5.9 (5.9)	— (—)	3.5 (3.5)	2.0 (2.0)	0.4 (0.4)
特殊債券 (除く金融債)	12,473,551 (12,473,551)	13,565,726 (13,565,726)	6.4 (6.4)	— (—)	4.6 (4.6)	1.4 (1.4)	0.4 (0.4)
金融債券	1,530,000 (1,530,000)	1,536,263 (1,536,263)	0.7 (0.7)	— (—)	— (—)	0.4 (0.4)	0.3 (0.3)
普通社債券	8,841,000 (8,841,000)	9,229,196 (9,229,196)	4.4 (4.4)	— (—)	1.3 (1.3)	2.7 (2.7)	0.4 (0.4)
合 計	192,951,061 (34,517,061)	210,521,700 (36,881,622)	99.3 (17.4)	— (—)	62.1 (9.4)	26.1 (6.5)	11.1 (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
国債証券	%	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
国債証券	%	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	
地方債証券				
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
地方債証券	%	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
地方債証券	%	千円	千円	
第10回埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	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
地方債証券	%	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	
特殊債券(除く金融債)				
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	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
特殊債券(除く金融債)	%	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	
金融債券				
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	
普通社債券				
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	償還年月日
普通社債券	%	千円	千円	
第319回北海道電力	0.514	100,000	100,862	2019/9/25
第26回関西国際空港	1.156	100,000	103,775	2020/9/18
第15回成田国際空港	0.739	100,000	104,064	2024/2/20
第7回大和ハウス工業	0.06	100,000	99,498	2021/6/18
第10回大和ハウス工業	0.001	100,000	99,949	2020/2/28
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	200,000	202,294	2022/6/20
第3回富士フィルムホールディングス	0.882	100,000	103,757	2022/12/2
第4回富士フィルムホールディングス	0.005	200,000	199,312	2020/3/3
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	104,141	2021/9/17
第30回豊田自動織機	0.001	100,000	99,763	2020/3/19
第5回日本電産	0.001	100,000	99,803	2019/11/25
第15回パナソニック	0.19	100,000	99,939	2021/9/17
第12回デンソー	0.01	100,000	99,548	2021/9/17
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,705	2019/8/7
第78回三菱商事	1.155	100,000	104,514	2022/3/9
第79回三菱商事	1.022	100,000	104,014	2022/5/20
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	2019/6/3
第8回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	1.62	100,000	105,877	2021/10/29
第88回三菱東京UFJ銀行	2.34	100,000	120,220	2027/4/20
第6回りそな銀行(劣後特約付)	2.084	100,000	105,188	2020/3/4
第9回三菱UFJ信託銀行(劣後特約付)	1.68	100,000	105,452	2021/4/28
第12回住友信託銀行(劣後特約付)	1.373	100,000	104,014	2020/11/11
第15回住友信託銀行(劣後特約付)	1.62	100,000	106,340	2022/3/22
第17回三井住友銀行(劣後特約付)	2.8	200,000	209,102	2019/2/12
第20回三井住友銀行(劣後特約付)	2.21	100,000	104,393	2019/7/24
第22回三井住友銀行(劣後特約付)	1.43	100,000	104,101	2020/9/28
第23回三井住友銀行(劣後特約付)	1.61	100,000	105,005	2020/12/17
第18回みずほ銀行(劣後特約付)	2.14	100,000	114,458	2026/9/11
第19回みずほ銀行(劣後特約付)	1.67	100,000	106,533	2022/2/24
第12回芙蓉総合リース	0.12	100,000	99,706	2020/9/18
第38回日産フィナンシャルサービス	0.001	100,000	99,639	2019/6/20
第40回日産フィナンシャルサービス	0.001	200,000	199,278	2020/3/19
第35回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,644	2019/12/20
第37回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,667	2020/3/19
第38回ホンダファイナンス	0.01	100,000	99,509	2021/3/19
第39回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,798	2019/12/20
第52回日立キャピタル	0.508	100,000	100,943	2021/6/18
第62回日立キャピタル	0.001	200,000	199,518	2019/9/20
第9回三井住友ファイナンス&リース	0.518	100,000	100,984	2021/1/29
第14回三井住友ファイナンス&リース	0.321	100,000	100,417	2020/10/30
第39回三菱UFJリース	0.12	100,000	99,703	2021/6/9
第41回三菱UFJリース	0.06	200,000	198,850	2021/7/23
第23回野村ホールディングス	1.808	100,000	105,087	2020/6/24
第24回野村ホールディングス	2.329	100,000	115,234	2025/6/24
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	2018/6/20
第72回三菱地所	2.28	100,000	114,312	2024/9/20

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 602	百万円 -

○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 210,521,700	% 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

<注記事項>

- 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13,798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 (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	期中率	期騰落	期中率			
	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 (除く日本、 円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 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) 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

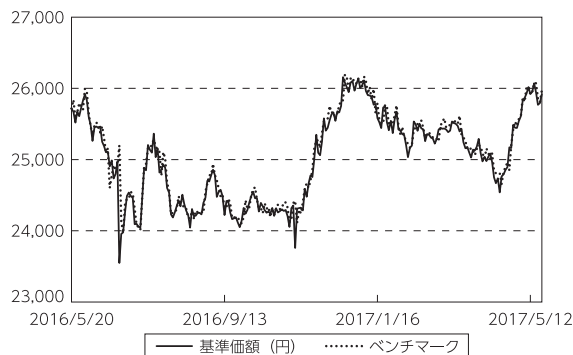
◎基準価額の動き

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 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	$\Delta 0.0\%$ 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 9	% 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。

○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
外 国	アメリカ	千アメリカドル 79,117	千アメリカドル 144,319
	カナダ	千カナダドル 3,947	千カナダドル 7,742
	メキシコ	千メキシコペソ 11,369	千メキシコペソ 36,857
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 6,106	18,076
	イタリア	国債証券 7,227	21,543
	フランス	国債証券 6,879	20,408
	オランダ	国債証券 1,758	6,158
	スペイン	国債証券 5,228	13,086
	ベルギー	国債証券 1,765	5,799
	オーストリア	国債証券 566	3,028
	フィンランド	国債証券 502	1,399
	アイルランド	国債証券 202	1,358
	イギリス	国債証券 3,997	千イギリスポンド 15,159
	スイス	国債証券 —	千スイスフラン 860
	スウェーデン	国債証券 1,819	千スウェーデンクローネ 10,050
	ノルウェー	国債証券 1,134	千ノルウェークローネ 6,095
	デンマーク	国債証券 2,248	千デンマーククローネ 11,789
	ポーランド	国債証券 2,984	千ポーランドズロチ 6,135
オーストラリア	国債証券 3,788	千オーストラリアドル 6,113	
シンガポール	国債証券 261	千シンガポールドル 878	
マレーシア	国債証券 1,110	千マレーシアリンギット 4,658	
南アフリカ	国債証券 2,628	千南アフリカランド 12,479	

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(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 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 4,020	百万円 2,560	% 63.7	百万円 23,107	百万円 12,940	% 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	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 207,950	千アメリカドル 212,060	千円 23,653,240	% 43.5	% —	% 17.8	% 17.1	% 8.5
カナダ	千カナダドル 12,270	千カナダドル 13,561	1,117,295	2.1	—	1.0	0.7	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 77,350	千メキシコペソ 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 20,860	千イギリスポンド 27,094	3,922,132	7.2	—	5.2	1.6	0.4
スイス	千スイスフラン 710	千スイスフラン 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 16,400	千スウェーデンクローネ 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 10,750	千ノルウェークローネ 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 15,750	千デンマーククローネ 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 11,420	千ポーランドズロチ 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 12,510	千オーストラリアドル 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 2,440	千シンガポールドル 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 8,550	千マレーシアリングギット 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 37,600	千南アフリカランド 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 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	0.625 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		利 率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	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 T-NOTE 201231	2.375	1,300	1,336	149,046	2020/12/31
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	1,030	1,050	117,156	2024/8/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	2,900	2,670	297,891	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	950	872	97,303	2046/2/15
	2.5 T-BOND 460515	2.5	600	550	61,423	2046/5/15
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	1,650	1,700	189,691	2023/8/15
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	1,550	1,595	177,911	2024/5/15
	2.625 T-NOTE 180430	2.625	300	304	33,918	2018/4/30
	2.625 T-NOTE 200815	2.625	1,500	1,552	173,178	2020/8/15
	2.625 T-NOTE 201115	2.625	1,500	1,553	173,283	2020/11/15
	2.75 T-BOND 420815	2.75	450	439	49,008	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	950	926	103,396	2042/11/15
	2.75 T-NOTE 190215	2.75	1,000	1,025	114,415	2019/2/15
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	1,900	1,986	221,595	2023/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	1,300	1,359	151,606	2024/2/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	1,850	1,844	205,784	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	1,250	1,241	138,433	2045/8/15
	2.875 T-BOND 461115	2.875	950	943	105,193	2046/11/15
	3 T-BOND 420515	3.0	200	204	22,823	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	1,500	1,529	170,577	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	1,700	1,730	193,040	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	1,200	1,220	136,179	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	240	244	27,258	2047/2/15
	3.125 T-BOND 411115	3.125	500	523	58,421	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	250	261	29,189	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	1,130	1,179	131,613	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	1,950	2,036	227,137	2044/8/15
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	800	829	92,484	2019/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	1,100	1,162	129,619	2021/5/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	1,650	1,802	201,064	2044/5/15
	3.375 T-NOTE 191115	3.375	300	314	35,112	2019/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	350	392	43,824	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	800	848	94,603	2020/5/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	1,250	1,422	158,672	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	1,050	1,196	133,431	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	700	735	82,052	2019/8/15
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	1,050	1,112	124,102	2020/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	1,500	1,609	179,505	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	500	579	64,686	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	800	930	103,746	2043/11/15
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	1,800	1,866	208,230	2018/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	550	649	72,451	2040/8/15
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	600	615	68,688	2018/5/15
	4 T-NOTE 180815	4.0	1,300	1,344	149,946	2018/8/15
	4.25 T-BOND 390515	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	550	685	76,496	2040/11/15
		4.375	300	381	42,512	2038/2/15
		4.375	150	189	21,186	2039/11/15
		4.375	500	633	70,684	2040/5/15
		4.375	600	762	85,050	2041/5/15
		4.5	450	578	64,580	2036/2/15
		4.5	200	258	28,793	2038/5/15
		4.5	300	386	43,090	2039/8/15
		4.625	600	785	87,659	2040/2/15
		4.75	350	468	52,214	2041/2/15
		5.0	250	341	38,128	2037/5/15
		5.25	300	387	43,241	2028/11/15
		5.25	50	64	7,233	2029/2/15
		5.375	400	540	60,290	2031/2/15
		5.5	200	262	29,287	2028/8/15
		6.0	1,550	2,020	225,414	2026/2/15
		6.125	300	407	45,445	2027/11/15
		6.25	100	125	13,976	2023/8/15
		6.25	300	429	47,952	2030/5/15
		6.5	500	682	76,121	2026/11/15
		8.0	600	762	85,009	2021/11/15
		8.125	300	344	38,469	2019/8/15
		8.75	800	982	109,574	2020/8/15
		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	800	797	65,684	2018/5/1
		0.5	400	399	32,890	2018/11/1
		0.5	200	195	16,132	2022/3/1
		0.75	600	598	49,348	2020/9/1
		0.75	400	398	32,827	2021/3/1
		0.75	750	745	61,423	2021/9/1
		1.0	100	99	8,230	2022/9/1
		1.0	150	143	11,816	2027/6/1
		1.5	600	612	50,459	2020/3/1
		1.5	550	563	46,403	2023/6/1
		1.5	400	404	33,337	2026/6/1
		1.75	600	611	50,389	2019/3/1
		1.75	300	307	25,301	2019/9/1
		2.25	450	483	39,849	2025/6/1
		2.5	400	435	35,883	2024/6/1
		2.75	550	597	49,229	2022/6/1
		2.75	290	332	27,431	2048/12/1
		2.75	150	180	14,873	2064/12/1
		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	
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
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				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
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				千ユーロ	千ユーロ		
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				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	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				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	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					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		千円	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	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						
	利率	額面金額	評価額		償還年月日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
マレーシア		%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円		
国債証券	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 53,808,318	% 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

<注記事項>

- 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。

MUAM J-REITマザーファンド

《第13期》決算日2017年3月10日

[計算期間：2016年3月11日～2017年3月10日]

「MUAM J-REITマザーファンド」は、3月10日に第13期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第13期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券への分散投資を行います。東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果をめざします。 銘柄選定およびポートフォリオの構築は、定性的評価・定量的評価を経て行います。定性的評価については、事業内容および財務内容等の分析を行います。定量的評価においては、キャッシュフロー、配当利回り、PBR（株価純資産倍率）等の分析を行います。不動産投資信託証券の組入比率は高位（通常の状態で90%以上）を基本とします。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券（不動産投資法人の投資証券もしくは新投資口予約権証券または不動産投資信託の受益証券をいいます。）を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式及び外貨建資産への投資は行いません。 投資信託証券への投資に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証REIT指数（配当込み）		投資信託証券組入比率	純資産額
	円	騰落率	期騰落	中率		
9期(2013年3月11日)	18,149	58.5	2,273.38	53.0	97.1	3,548
10期(2014年3月10日)	20,786	14.5	2,507.61	10.3	98.0	4,237
11期(2015年3月10日)	26,403	27.0	3,166.15	26.3	95.9	7,117
12期(2016年3月10日)	28,097	6.4	3,332.09	5.2	97.4	15,042
13期(2017年3月10日)	26,870	△ 4.4	3,310.28	△ 0.7	97.8	16,702

(注) 東証REIT指数（配当込み）とは、東京証券取引所に上場している不動産投資信託全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。

東証REIT指数の商標に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は東証REIT指数の内容の変更、公表の停止または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。東京証券取引所は東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対して、責任を負いません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数（配当込み）		投 資 信 託 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	
(期 首) 2016年3月10日	円	%		%	%
	28,097	—	3,332.09	—	97.4
3月末	28,760	2.4	3,409.88	2.3	98.6
4月末	29,131	3.7	3,465.54	4.0	96.5
5月末	28,620	1.9	3,422.69	2.7	98.2
6月末	27,428	△2.4	3,340.35	0.2	97.0
7月末	27,708	△1.4	3,394.01	1.9	95.8
8月末	27,141	△3.4	3,325.60	△0.2	97.7
9月末	27,198	△3.2	3,336.34	0.1	98.0
10月末	26,652	△5.1	3,269.40	△1.9	96.3
11月末	26,788	△4.7	3,298.65	△1.0	97.3
12月末	27,786	△1.1	3,422.06	2.7	95.8
2017年1月末	27,720	△1.3	3,407.69	2.3	95.1
2月末	27,457	△2.3	3,376.46	1.3	95.9
(期 末) 2017年3月10日	26,870	△4.4	3,310.28	△0.7	97.8

(注) 騰落率は期首比。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

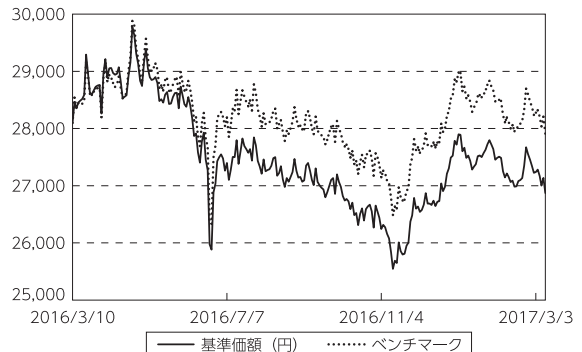
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.4%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、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）（以下、REIT指数）の騰落率（-0.7%）を3.7%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

◎J-REIT市場

- ・期初は日本銀行によるマイナス金利政策導入以降の地合いを引き継ぎ底堅く推移し、2016年4月以降熊本などで発生した一連の地震についてもREIT指数への影響は総じて限定的でした。
- ・しかし6月下旬のイギリスの欧州連合（EU）離脱発表では一時急落し、さらにその後もREIT市場に対しては日本銀行から追加的な金融緩和策が発表されず、総じて上値の重い展開となりました。
- ・ところが11月の米大統領選後は、円安・株高などにより日本の景況感にも前向きな見方が台頭したことなどを受け、一転して上昇基調となりました。
- ・2017年に入ると、公募増資などが多く発表されたことに加え、世界的な金利上昇傾向により海外からの資金流入への期待が後退したことなどにより上値の重い展開となり期末を迎えました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・銘柄選定およびポートフォリオの構築は主に、定性的評価・定量的評価を経て行っています。
- ・定性的評価については、事業内容および財務内容などの分析を中心に、定量的評価においては、キャッシュフロー、配当利回り、投資口価格純資産倍率（PBR）などの分析を行いました。
- ・組入銘柄数は47銘柄程度で推移させました。
- ・主な売買動向については、堅調な業績の見込まれるケネディクス・オフィス投資法人のウェイトを引き上げたことなどや、割安感の後退したジャパンリアルエステイト投資法人のウェイトを引き下げたことなどが挙げられます。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について (プラス要因となった主な銘柄)

- ・日本アコモデーションファンド投資法人：優良な物件ポートフォリオや安定した業績を評価しオーバーウェイトとした時期に、投資口価格が好調に推移したことからプラスに寄与。

(マイナス要因となった主な銘柄)

- ・インヴィンシブル投資法人：物件の取得や賃料収入の増加による大幅な利益成長が見込めることからオーバーウェイトとした時期に、投資口価格が低調に推移したことからマイナスに影響。
- ・大和証券オフィス投資法人：都心オフィス中心の物件ポートフォリオや業績の拡大基調を評価しオーバーウェイトとした時期に、投資口価格が低調に推移したことからマイナスに影響。
- ・グローバル・ワン不動産投資法人：大型で優良立地のオフィスポートフォリオや業績の回復基調を評価しオーバーウェイトとした時期に、投資口価格が低調に推移したことからマイナスに影響。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・当面のJ-REIT市場は、底堅い展開を想定しています。
- ・オフィス市況については、都心での供給が足下限定的な一方で需要については堅調な状態が続いており、低水準の空室率を背景に賃料の上昇基調は当面継続するとみています。したがってREIT各社の業績については、当面賃料値上げなどが牽引する形で、安定した増益基調を維持するとみられます。
- ・さらに日本銀行による金融緩和政策が継続するなか高利回り商品としての魅力は依然変わらず、今後も有望な投資先として選好されるものとみています。

◎今後の運用方針

- ・REITの組入比率については、引き続き高水準（90%以上）を維持する方針です。
- ・配当利回りやPBRなどのバリュエーション、また物件ポートフォリオのクオリティなどに着目し、安定した分配金が見込め相対的に割安と思われる銘柄への投資ウェイトを高めた運用を行います。
- ・前述の不動産市況を踏まえ、保有物件の賃料動向など、REIT各社の業績の先行きについて特に注意深く見守るほか、スポンサーのサポート体制などにも着目していく方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年3月11日～2017年3月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券)	円 72 (72)	% 0.259 (0.259)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	72	0.259	
期中の平均基準価額は、27,699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3月11日～2017年3月10日)

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
日本アコモデーションファンド投資法人	1	565,456	1	571,507
MCUBS MidCity投資法人	1	374,879	1	567,531
森ヒルズリート投資法人	3	612,387	1	296,280
産業ファンド投資法人	0.875	466,353	0.888	471,655
大和ハウスリート投資法人	—	—	0.016	7,752
	(△0.009)	(△ 4,266)		
アドバンス・レジデンス投資法人	4	1,379,992	3	940,423
ケネディクス・レジデンシャル投資法人	1	512,419	1	528,761
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1	719,598	1	599,564
GLP投資法人	8	1,138,513	6	863,677
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2	526,570	1	475,585
日本プロロジスリート投資法人	3	864,112	2	702,955
S I A不動産投資法人	0.47	181,206	0.218	89,034
	(0.222)	(—)		
イオンリート投資法人	3	461,541	4	597,558
ヒューリックリート投資法人	3	722,469	1	256,774
日本リート投資法人	0.23	64,474	0.359	102,434
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	4	395,706	5	476,808
積水ハウス・リート投資法人	3	456,555	0.631	94,462
トーセイ・リート投資法人	0.08	8,743	0.005	608
ケネディクス商業リート投資法人	2	661,360	2	639,038
野村不動産マスターファンド投資法人	6	1,068,773	6	1,140,266
	(0.537)	(87,766)		
いちごホテルリート投資法人	1	227,933	1	249,041
ラサールロジポート投資法人	4	491,206	2	259,808
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1	449,632	0.577	183,033
投資法人みらい	0.56	94,716	—	—
日本ビルファンド投資法人	1	1,330,042	2	1,405,514
ジャパンリアルエステイト投資法人	2	1,632,847	3	2,212,000
日本リートファンド投資法人	7	1,970,620	7	1,767,217
オリックス不動産投資法人	5	1,066,088	3	655,653
日本プライムリアルティ投資法人	1	654,833	1	691,168
プレミアム投資法人	4	627,418	5	710,253
東急リアル・エステート投資法人	2	358,970	2	381,508
グローバル・ワン不動産投資法人	0.86	358,480	1	499,743
ユナイテッド・アーバン投資法人	5	1,096,948	5	884,981
森トラスト総合リート投資法人	3	708,449	2	468,987
インヴェンシブル投資法人	7	440,081	14	921,077
フロンティア不動産投資法人	2	1,080,924	1	603,621

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	平和不動産リート投資法人	千口 3	千円 269,405	千口 3	千円 299,450
	日本ロジスティクスファンド投資法人	2	561,546	2	619,502
	福岡リート投資法人	2	526,772	1	364,600
	ケネディクス・オフィス投資法人	1	854,631	0.982	604,415
	積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	4	518,317	5	611,808
	いちごオフィスリート投資法人	2	214,834	5	460,985
	大和証券オフィス投資法人	1	796,703	1	806,639
	阪急リート投資法人	1	284,693	1	231,221
	スターツプロシード投資法人	0.54	82,642	0.033	5,557
	トップリート投資法人	0.3 (△0.205)	126,372 (△ 87,766)	0.446	194,207
	大和ハウスリート投資法人	1 (0.019)	521,523 (4,266)	0.851	242,036
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	10	908,203	11	977,830
	日本賃貸住宅投資法人	6	519,215	5	436,823
	ジャパンエクセレント投資法人	2	420,178	2	292,731
	合 計	151 (0.564)	30,375,349 (-)	142	27,464,106

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2016年3月11日～2017年3月10日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 30,375	百万円 7,024	% 23.1	百万円 27,464	百万円 5,189	% 18.9

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
投資信託証券	百万円 252

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)	42,123千円
うち利害関係人への支払額 (B)	8,092千円
(B) / (A)	19.2%

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

○組入資産の明細

(2017年3月10日現在)

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千口	千円	%
日本アコモデーションファンド投資法人	0.841	0.806	390,910	2.3
MCUBS MidCity投資法人	1	0.857	286,666	1.7
森ヒルズリート投資法人	0.894	2	440,385	2.6
産業ファンド投資法人	0.329	0.316	162,108	1.0
大和ハウスリート投資法人	0.025	—	—	—
アドバンス・レジデンス投資法人	0.517	2	604,023	3.6
ケネディクス・レジデンシャル投資法人	0.903	0.8	242,400	1.5
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1	1	793,845	4.8
GLP投資法人	0.717	2	338,688	2.0
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1	1	294,624	1.8
日本プロロジスリート投資法人	1	2	486,301	2.9
SI A不動産投資法人	0.04	0.514	97,197	0.6
イオンリート投資法人	2	0.825	104,445	0.6
ヒューリックリート投資法人	0.016	2	462,098	2.8
日本リート投資法人	0.298	0.169	48,181	0.3
インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1	0.635	63,563	0.4
積水ハウス・リート投資法人	—	2	377,326	2.3
トーセイ・リート投資法人	0.009	0.084	9,030	0.1
ケネディクス商業リート投資法人	1	1	308,807	1.8
野村不動産マスターファンド投資法人	3	3	594,180	3.6
いちごホテルリート投資法人	0.55	0.556	66,497	0.4
ラサールロジポート投資法人	—	2	231,315	1.4
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	—	0.876	280,758	1.7
投資法人みらい	—	0.56	93,912	0.6
日本ビルファンド投資法人	2	1	1,186,731	7.1
ジャパンリアルエステイト投資法人	2	1	758,784	4.5
日本リテールファンド投資法人	1	1	432,402	2.6
オリックス不動産投資法人	2	4	823,604	4.9
日本プライムリアルティ投資法人	0.781	0.688	302,032	1.8
プレミアム投資法人	2	2	273,467	1.6
東急リアル・エステート投資法人	0.861	0.724	100,274	0.6
グローバル・ワン不動産投資法人	0.888	0.512	206,592	1.2
ユナイテッド・アーバン投資法人	2	2	509,902	3.1
森トラスト総合リート投資法人	1	2	395,590	2.4
インヴィンシブル投資法人	12	5	257,270	1.5
フロンティア不動産投資法人	0.058	0.952	476,000	2.8
平和不動産リート投資法人	1	1	98,581	0.6
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.688	0.435	103,095	0.6
福岡リート投資法人	0.437	1	229,273	1.4
ケネディクス・オフィス投資法人	0.497	0.87	568,110	3.4
積水ハウス・SI レジデンシャル投資法人	1	0.814	100,284	0.6
いちごオフィスリート投資法人	6	3	259,420	1.6
大和証券オフィス投資法人	1	1	597,575	3.6

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千口	千円	%
阪急リート投資法人	1	1	229,214	1.4
スターツプロシード投資法人	0.042	0.549	83,283	0.5
トップリート投資法人	0.351	—	—	—
大和ハウスリート投資法人	0.664	1	491,766	2.9
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8	8	624,850	3.7
日本賃貸住宅投資法人	3	3	318,361	1.9
ジャパンエクセレント投資法人	0.01	0.893	126,091	0.8
合 計	口 数 ・ 金 額	73	16,329,822	
	銘 柄 数 < 比 率 >	46	48	< 97.8% >

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) 日本アコモデーションファンド投資法人、MCUBS MidCity投資法人、森ヒルズリート投資法人、産業ファンド投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、ケネディクス・レジデンシャル投資法人、アクティブ・プロパティーズ投資法人、GLP投資法人、コンフォリア・レジデンシャル投資法人、日本プロロジスリート投資法人、SIA不動産投資法人、イオンリート投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本リート投資法人、インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人、積水ハウス・リート投資法人、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、野村不動産マスターファンド投資法人、いちごホテルリート投資法人、ラサールロジポート投資法人、三井不動産ロジスティクスパーク投資法人、日本ビルファンド投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、日本リテールファンド投資法人、オリックス不動産投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、プレミア投資法人、東急リアル・エステート投資法人、グローバル・ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、森トラスト総合リート投資法人、インヴィンシブル投資法人、フロンティア不動産投資法人、平和不動産リート投資法人、日本ロジスティクスファンド投資法人、福岡リート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人、いちごオフィスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、阪急リート投資法人、スターツプロシード投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、日本賃貸住宅投資法人、ジャパンエクセレント投資法人につきましては、委託会社の利害関係人である三菱UFJ信託銀行、三菱東京UFJ銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUFJ証券が当該ファンドの一般事務受託会社等となっています。(各ファンドで開示されている2017年1月5日時点の有価証券報告書または有価証券届出書等より記載)

純資産総額の10%を超える不動産ファンドに関する組入投資証券の内容

当期末において10%を超える銘柄の組入れはございません。

○投資信託財産の構成

(2017年3月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	16,329,822	96.5
コール・ローン等、その他	597,707	3.5
投資信託財産総額	16,927,529	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年3月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	16,927,529,057
コール・ローン等	383,381,661
投資証券(評価額)	16,329,822,500
未収入金	61,465,781
未収配当金	152,859,115
(B) 負債	225,276,315
未払金	117,715,433
未払解約金	107,560,606
未払利息	276
(C) 純資産総額(A-B)	16,702,252,742
元本	6,215,978,034
次期繰越損益金	10,486,274,708
(D) 受益権総口数	6,215,978,034口
1万口当たり基準価額(C/D)	26,870円

＜注記事項＞

- ①期首元本額 5,353,748,589円
 期中追加設定元本額 2,729,170,738円
 期中一部解約元本額 1,866,941,293円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.6870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 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	115,251,075円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	84,002,124円
ファンド・マネジャー(国内リート)	21,023,903円
三菱UFJ <DC> J-REITファンド	2,974,584,389円
MUAM J-REITファンド(適格機関投資家転売制限付)	3,021,116,543円
合計	6,215,978,034円

○損益の状況 (2016年3月11日～2017年3月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	429,395,390
受取配当金	428,145,036
受取利息	4,886
その他収益金	1,491,364
支払利息	△ 245,896
(B) 有価証券売買損益	△ 1,229,829,424
売買益	428,548,648
売買損	△ 1,658,378,072
(C) 保管費用等	△ 494
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 800,434,528
(E) 前期繰越損益金	9,688,711,881
(F) 追加信託差損益金	4,948,277,230
(G) 解約差損益金	△ 3,350,279,875
(H) 計(D+E+F+G)	10,486,274,708
次期繰越損益金(H)	10,486,274,708

- (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。

MUAM G-REITマザーファンド

《第11期》決算日2017年1月5日

[計算期間：2016年1月6日～2017年1月5日]

「MUAM G-REITマザーファンド」は、1月5日に第11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11期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目指して、運用を行います。銘柄選定にあたっては、時価総額および流動性等を勘案します。原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。市場動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主要運用対象	S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への直接投資は行いません。投資信託証券への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、配当込み、円換算ベース)		投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	騰落率	騰落	騰落率		
7期(2013年1月7日)	9,018	42.6%	9,337.10	43.7%	98.5%	4,623百万円
8期(2014年1月6日)	10,769	19.4%	11,215.01	20.1%	98.1%	6,129
9期(2015年1月5日)	15,384	42.9%	16,149.24	44.0%	99.1%	11,986
10期(2016年1月5日)	15,105	△1.8%	15,914.11	△1.5%	98.7%	16,191
11期(2017年1月5日)	16,039	6.2%	16,982.66	6.7%	98.8%	18,949

(注) S & P先進国REITインデックスとは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するS & Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託 (REIT) 及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。なお、S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）は、S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み）をもとに、委託会社が計算したものです。S & P先進国REITインデックスはS&P Dow Jones Indices LLC (「SPDJI」) の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®はStandard & Poor's Financial Services LLC (「S & P」) の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」) の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P先進国REITインデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

(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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P 先 進 国 R E I T イ ン デ ッ ク ス (除く日本、配当込 み、円換算ベース)	騰 落 率	投 資 信 託 券 率 組 入 比 率
	円	騰 落 率			
(期 首) 2016年1月5日	15,105	% —	15,914.11	% —	% 98.7
1月末	14,711	△2.6	15,503.98	△2.6	98.8
2月末	14,055	△7.0	14,824.48	△6.8	99.1
3月末	15,250	1.0	16,107.90	1.2	98.8
4月末	14,858	△1.6	15,674.21	△1.5	98.9
5月末	15,118	0.1	15,953.02	0.2	99.4
6月末	14,508	△4.0	15,335.21	△3.6	99.0
7月末	15,381	1.8	16,263.54	2.2	99.4
8月末	14,875	△1.5	15,743.95	△1.1	99.2
9月末	14,403	△4.6	15,255.82	△4.1	98.9
10月末	13,754	△8.9	14,541.87	△8.6	99.1
11月末	14,765	△2.3	15,615.44	△1.9	99.3
12月末	15,625	3.4	16,536.14	3.9	98.5
(期 末) 2017年1月5日	16,039	6.2	16,982.66	6.7	98.8

(注) 騰落率は期首比。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

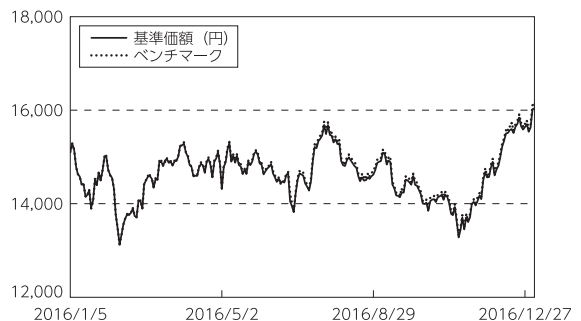
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(6.7%)を0.5%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REIT市況（現地通貨ベース）

- ・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を受けて、外国REIT市況は上昇しました。

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて2.2%の円高・米ドル安、5.0%の円高・ユーロ安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ベンチマークであるS & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とし、同インデックスに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。
- ・不動産投資信託証券の組入比率は高位を保ち、国別比率や用途別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは6.7%の上昇となったため、ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.5\%$ 程度となりました。

	売買コスト 要因	配当課税 要因	為替評価 要因	その他の 要因	合計
ベンチマークとのカイ離	$\Delta 0.1\%$ 程度	$\Delta 0.5\%$ 程度	$\Delta 0.1\%$ 程度	0.1%程度	$\Delta 0.5\%$ 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。

◎売買コスト要因

売買コストによる影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

◎配当課税要因

配当課税による影響は $\Delta 0.5\%$ 程度でした。

- ・ベンチマークでは配当金に課される税金が考慮されていないため、ファンドではマイナス要因となりました。

◎為替評価要因

為替評価による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

- ・為替評価要因は、ベンチマークの計算に使用する為替レートとファンドの基準価額の計算に使用する為替レートの差によって生じます。

◎その他の要因

その他の要因による影響は0.1%程度でした。

- ・その他の要因としては、ベンチマークとファンド間でのREITの保有比率の差や、円貨、外貨現金の保有による影響などが含まれます。

○今後の運用方針

- ・S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とし、同インデックス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1月6日～2017年1月5日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	円 2 (0) (2)	% 0.017 (0.000) (0.017)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (投 資 信 託 証 券)	2 (2)	0.011 (0.011)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	9 (5) (4)	0.059 (0.033) (0.026)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	13	0.087	
期中の平均基準価額は、14,775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1月6日～2017年1月5日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 320	千アメリカドル 575	百株 — (320)	千アメリカドル — (575)

(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す。

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	DDR CORP	8	146	4	61
	HCP INC	13	466	7	239
	MACERICH CO/THE	3	287	3	298
	ACADIA REALTY TRUST	3	120	0.7	23
	AGREE REALTY CORP	1	74	0.5	22
	ALEXANDER'S INC	0.11	40	0.12	49
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2	249	0.76	83
	PROLOGIS INC	15	682	8	448
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	6	272	1	78
	BIOMED REALTY TRUST INC	0.8	18	— (28)	— (667)
	BRANDYWINE REALTY TRUST	4	67	2	34
	CAMDEN PROPERTY TRUST	2	199	1	123
	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	6	80	1	18
	CEDAR REALTY TRUST INC	2	17	2	18
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	5	248	2	97
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	2	70	1	43
	COUSINS PROPERTIES INC	6 (20)	59 (191)	3	31
	DIAMONDRock HOSPITALITY CO	9	80	5	60
	DIGITAL REALTY TRUST INC	5	509	2	218
	EASTGROUP PROPERTIES INC	0.9	51	0.35	24
	EDUCATION REALTY TRUST INC	4	175	0.55	22
	EPR PROPERTIES	2	136	0.87	61
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2	158	0.95	66
	EQUITY ONE INC	4	135	1	29
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	406	1	261
	EXTRA SPACE STORAGE INC	3	308	1	126
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	2	332	0.95	135
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	4	92	1	52

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
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	1	15	1	19
GETTY REALTY CORP	0.8 (-)	14 (0.31014)	-	-
WELLTOWER INC	11	760	5	384
HIGHWOODS PROPERTIES INC	3	158	1	68
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	6	158	2	72
EQUITY COMMONWEALTH	2	69	1	50
INLAND REAL ESTATE CORP	-	-	-	-
			(12)	(136)
KILROY REALTY CORP	2	155	1	113
KITE REALTY GROUP TRUST	2	56	1	24
LEXINGTON REALTY TRUST	6	48	2	23
LTC PROPERTIES INC	1	83	0.55	25
MACK-CALI REALTY CORP	2	50	0.8	23
BOSTON PROPERTIES INC	4	540	2	316
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	18	254	4	51
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1 (6)	185 (513)	1	145
NATL HEALTH INVESTORS INC	1	137	0.6	44
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	9	310	2	72
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0.5	11	-	-
PARKWAY PROPERTIES INC	1 (△ 12)	18 (△ 191)	-	-
PENN REAL ESTATE INVEST TST	2	52	1	19
POST PROPERTIES INC	1 (△ 8)	79 (△ 513)	-	-
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	1	32	-	-
REALTY INCOME CORP	7	474	3	205
REGENCY CENTERS CORP	4	315	1	97
SAUL CENTERS INC	0.3	20	0.3	19
SENIOR HOUSING PROP TRUST	6	111	3	60
SL GREEN REALTY CORP	2	259	1	138
LIFE STORAGE INC	2	273	0.65	55
SUN COMMUNITIES INC	3	210	0.82	61
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	6 (0.875)	76 (9)	3	54
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	2	94	1	63
TAUBMAN CENTERS INC	1	104	0.75	55
CUBESMART	5	174	2	69
UDR INC	8	304	4	142
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.36	18	-	-
URSTADT BIDDLE - CLASS A	1	20	-	-
VENTAS INC	11	740	4	301
WASHINGTON REIT	3	85	0.8	25
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	3	140	1	58
HERSHA HOSPITALITY TRUST	0.8	17	0.9	18

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
PS BUSINESS PARKS INC/CA	0.566	51	0.2	22
UMH PROPERTIES INC	1	16	1	18
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1	14	—	—
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	3	39	1	20
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5	179	2	59
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5	62	1	21
WINTHROP REALTY TRUST	—	—	5	46
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	2	95	1	51
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2	16	—	—
DOUGLAS EMMETT INC	4	130	1	69
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	3	125	1	46
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1	37	0.8	25
CHESAPEAKE LODGING TRUST	1	37	0.8	21
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	3	57	2	43
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	9	303	1	58
CORESITE REALTY CORP	1	109	0.55	40
CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	—	—	—	—
			(9)	(64)
AMERICAN ASSETS TRUST INC	1	42	0.5	21
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	3	38	1	24
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	2	33	1	22
RLJ LODGING TRUST	3	56	1	29
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	4	85	1	21
ROUSE PROPERTIES INC	0.933	16	—	—
			(5)	(86)
STAG INDUSTRIAL INC	1	38	—	—
SABRA HEALTH CARE REIT INC	1	28	0.9	21
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	6	105	4	65
SELECT INCOME REIT	1	33	0.82	19
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	5	150	1	31
WP CAREY INC	3	238	1	73
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1	63	0.82	52
CHATHAM LODGING TRUST	0.9	18	—	—
TERRENO REALTY CORP	1	45	0.9	25
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	1	13	—	—
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	19	215	6	74
CORECIVIC INC	2	86	0.9	22
GEO GROUP INC/THE	2	74	1	41
VEREIT INC	33	311	13	115
DUKE REALTY CORP	10	238	4	121
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	3	38	1	18
AMERICAN RESIDENTIAL PROPERT	—	—	—	—
	(△ 4)	(△ 84)		
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	3	65	1	24
PHYSICIANS REALTY TRUST	10	188	1	22

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
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	9 (5)	191 (84)	3	72
GRAMERCY PROPERTY TRUST	11 (△ 41)	92 (-)	6	53
CYRUSONE INC	2	122	1	44
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	1	15	1	20
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	4	86	2	45
QTS REALTY TRUST INC-CL A	2	125	0.8	38
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	18	502	2	63
COLONY STARWOOD HOMES	2	76	0.76	21
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	3	79	1	27
WASHINGTON PRIME GROUP INC	5	57	2	22
CARETRUST REIT INC	3	43	-	-
NEW YORK REIT INC	6	59	4	39
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	1	15	-	-
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18	604	2	73
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	6	52	-	-
IRON MOUNTAIN INC	14	492	3	127
STORE CAPITAL CORP	15	404	1	32
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	1	17	2	21
URBAN EDGE PROPERTIES	2	60	1	32
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	2	45	1	20
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	4	38	2	21
XENIA HOTELS & RESORTS INC	2	33	1	24
NORTHSTAR REALTY FINANCE	6	71	4	67
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1	41	-	-
NEXPOINT RESIDENTIAL	1	15	1	24
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	2	56	0.8	18
APPLE HOSPITALITY REIT INC	3	72	2	42
GLOBAL NET LEASE INC	4	33	2	19
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	1	14	1	23
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1	82	-	-
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	4 (1)	76 (30)	2	49
FOREST CITY REALTY TRUST- A	3 (32)	66 (575)	3	64
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1	32	-	-
FARMLAND PARTNERS INC	1	20	-	-
MANULIFE US REAL ESTATE INV	90	74	-	-
TIER REIT INC	7	123	-	-
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	10	18	-	-
PARKWAY INC	- (6)	- (-)	-	-
QUALITY CARE PROPERTIES	- (15)	- (-)	1	22
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3	31	-	-

外

国

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
EQUITY RESIDENTIAL	10	774	6	384
FELCOR LODGING TRUST INC	4	28	2	22
GENERAL GROWTH PROPERTIES	17	467	10	262
HOST HOTELS & RESORTS INC	21	321	13	245
ISTAR INC	11	127	1	22
LIBERTY PROPERTY TRUST	3	128	1	70
LASALLE HOTEL PROPERTIES	3	76	1	55
PUBLIC STORAGE	4	1,091	2	506
SIMON PROPERTY GROUP INC	9	1,826	4	891
VORNADO REALTY TRUST	4	450	3	355
KIMCO REALTY CORP	12	336	5	150
AVALONBAY COMMUNITIES INC	4	711	2	385
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	4	172	2	95
小計	861 (21)	26,194 (615)	313 (56)	11,605 (955)
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	0.6	25	—	—
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	1	51	0.9	28
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1	55	0.7	21
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	1	47	0.6	27
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	3	48	—	—
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1	20	—	—
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3	65	1	24
INNVEST REAL ESTATE INVESTME	4	20	— (11)	— (57)
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	1	21	1	26
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	1	21	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5	130	2	53
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	1	51	0.8	28
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2	30	2	24
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	1	27	—	—
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	3	28	2	25
ONEREIT	7	22	6	23
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	0.6	22	—	—
MILESTONE APARTMENTS REAL ES	9	151	7	134
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	6	35	4	24
CHOICE PROPERTIES REIT	2	26	2	26
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1	22	—	—
PLAZA RETAIL REIT	5	26	5	23
SLATE RETAIL REIT - U-RTS	— (2)	— (—)	2	0.09745
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	5	51	—	—
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	2	21	—	—
SLATE OFFICE REIT	3	26	—	—
小計	75 (2)	1,055 (—)	40 (11)	491 (57)

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
ドイツ				
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	3 (-)	43 (△ 8)	1	15
HAMBORNER REIT AG	4	42	1	15
HAMBORNER REIT AG-RTS	- (9)	- (-)	9	0.12675
小 計	8 (9)	85 (△ 8)	12	31
イタリア				
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	18 (-)	13 (△0.28592)	-	-
BENI STABILI SPA	20 (-)	11 (△ 4)	31	17
小 計	38 (-)	25 (△ 4)	31	17
フランス				
GECINA SA	1	216	0.48	60
KLEPIERRE	7	308	2	96
UNIBAIL-RODAMCO SE	2	676	1	317
AFFINE	-	-	1	16
FONCIERE DES REGIONS	2 (-)	177 (△ 8)	0.79	60
MERCIALYS	6	129	1	18
ANF IMMOBILIER	0.7	14	1	35
ICADE	2	201	1	76
ALTAREA	0.18 (-)	31 (△ 3)	0.1	17
ALTAREA-RTS	- (0.36)	- (-)	0.36	1
FONCIERE DES MURS	- (-)	- (△ 1)	1	33
小 計	24 (0.36)	1,755 (△ 13)	12	733
オランダ				
EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	1	54	0.55	18
NSI NV	3	13	-	-
VASTNED RETAIL NV	0.4	15	-	-
WERELDHAVE NV	0.84	39	0.4	16
小 計	6	123	0.95	35
スペイン				
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	5 (-)	41 (△ 1)	-	-
LAR ESPANA REAL ESTATE-RTS	- (10)	- (-)	10	6
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	35 (-)	332 (△ 5)	6	63

外

国

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
スペイン				
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	2	30	1	19
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	17	204	1	20
小 計	60 (10)	609 (△ 6)	19	110
ベルギー				
BEFIMMO	1	57	0.35	18
BEFIMMO - RTS	— (3)	— (—)	3	1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	0.75	18	—	—
RETAIL ESTATES	0.22	17	—	—
WAREHOUSES DE PAUW SCA	0.61 (—)	49 (1)	—	—
WAREHOUSES DE PAUW SCA - RTS	— (2)	— (—)	— (2)	— (1)
AEDIFICA	0.3	18	0.3	20
XIOR STUDENT HOUSING NV	0.5	15	—	—
MONTEA	0.98	46	—	—
COFINIMMO	0.497	51	0.25	25
小 計	4 (5)	273 (1)	4 (2)	65 (1)
アイルランド				
GREEN REIT PLC	23	33	15	21
HIBERNIA REIT PLC	26	33	13	16
小 計	49	67	29	37
ユ ー ロ 計	192 (25)	2,940 (△ 30)	111 (2)	1,030 (1)
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	28	201	14	94
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	9	71	6	39
HAMMERSON PLC	21	120	11	62
LAND SECURITIES GROUP PLC	20	226	11	120
INTU PROPERTIES PLC	39	113	16	43
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	31	33	—	—
SEGRO PLC	36	162	13	57
WORKSPACE GROUP PLC	2	23	1	11
MCKAY SECURITIES PLC-ORD	3	9	—	—
SHAFTESBURY PLC	7	67	4	37
BIG YELLOW GROUP PLC	4	34	2	17
DERWENT LONDON PLC	3	96	1	46
MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	9	47	—	—
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	14	22	9	14
HANSTEEN HOLDINGS PLC	22	23	16	17
REDEFINE INTERNATIONAL PLC	59	26	—	—
SAFESTORE HOLDINGS PLC	3	11	—	—
TRITAX BIG BOX REIT PLC	86	115	14	18

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
ASSURA PLC	44	24	27	15
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	19	11	—	—
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	31	35	15	16
REGIONAL REIT LTD	23	24	24	25
CAPITAL & REGIONAL PLC	75	48	—	—
NEWRIVER REIT PLC	37	120	3	11
小 計	636	1,673	193	650
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	92	280	48	141
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	3	24	3	24
ABACUS PROPERTY GROUP	7	21	—	—
INGENIA COMMUNITIES GROUP	10	30	7	20
ALE PROPERTY GROUP	5	24	5	20
CHARTER HALL GROUP	24	119	6	30
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	8	17	—	—
GALILEO JAPAN TRUST	—	—	15	40
CROMWELL PROPERTY GROUP	24	23	—	—
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	21	44	11	25
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	8	25	7	23
NATIONAL STORAGE REIT	45	70	16	23
GDI PROPERTY GROUP	23	22	24	23
INDUSTRIA REIT	10	21	—	—
SCENTRE GROUP	147	661	80	354
ARENA REIT	10	19	—	—
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	7	18	—	—
GENERATION HEALTHCARE REIT	23	50	—	—
VIVA ENERGY REIT	66	147	—	—
CHARTER HALL LONG WALE REIT	23	93	—	—
GPT GROUP	46	229	26	131
MIRVAC GROUP	117	230	62	127
STOCKLAND	58	255	29	131
WESTFIELD CORP	53	530	28	262
DEXUS PROPERTY GROUP	22	179	12	111
BWP TRUST	13	44	8	23
INVESTA OFFICE FUND	16	68	5	22
CHARTER HALL RETAIL REIT	9	39	6	25
GOODMAN GROUP	38	254	19	134
小 計	937	3,550	424	1,700
ニュージーランド		千ニュージーランドドル		千ニュージーランドドル
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	16	36	13	26
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR-RTS	—	—	9	0.29558
	(9)	(—)		
KIWI PROPERTY GROUP LTD	43	58	—	—
GOODMAN PROPERTY TRUST	22	28	17	21
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	15	24	16	25

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ニュージーランド	千口	千ニュージーランドドル	千口	千ニュージーランドドル
STRIDE PROPERTY LTD	10 (△ 59)	23 (△ 106)	—	—
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	21	27	23	27
ARGOSY PROPERTY LTD	18	21	—	—
STRIDE PROPERTY GROUP	— (59)	— (106)	—	—
INVESTORE PROPERTY LTD	26 (14)	41 (—)	19	25
小 計	173 (23)	262 (—)	97	126
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	62	2,909	39	2,060
CHAMPION REIT	65	248	35	149
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	33	146	35	148
FORTUNE REIT	48	411	20	180
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	47	139	—	—
NEW CENTURY REIT	—	—	63	139
小 計	255	3,854	192	2,679
シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
SUNTEC REIT	81 (—)	132 (△ 3)	35	60
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	76	108	15	23
KEPPEL REIT	73 (—)	70 (△ 2)	33	34
FRASERS COMMERCIAL TRUST	18 (—)	25 (△0.64692)	17	22
ASCOTT RESIDENCE TRUST	28 (—)	31 (△ 7)	21	24
CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	36	19	—	—
CDL HOSPITALITY TRUSTS	16 (—)	24 (△0.19378)	—	—
FRASERS CENTREPOINT TRUST	11	22	—	—
STARHILL GLOBAL REIT	33 (—)	24 (△ 2)	29	22
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	48 (—)	47 (△ 3)	23	23
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	32 (—)	51 (△ 7)	19	26
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	— (—)	— (△ 2)	—	—
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	— (—)	— (△0.39614)	—	—
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	78 (—)	24 (△ 3)	57	20
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	11 (—)	24 (△ 1)	—	—

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
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
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	44 (-)	70 (△0.07522)	20	32
CACHE LOGISTICS TRUST	26 (-)	22 (△0.53467)	-	-
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	105	157	19	28
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	36	23	-	-
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	35	22	-	-
SABANA SHARIAH COMP IND REIT-RTS	- (46)	- (-)	-	-
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	- (-)	- (△ 1)	-	-
MAPLETREE GREATER CHINA COMM	57 (-)	53 (△ 4)	30	28
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	- (-)	- (△ 1)	-	-
OUE HOSPITALITY TRUST	84	57	39	24
OUE HOSPITALITY TRUST-RTS	- (37)	- (-)	37	4
SPH REIT	20	19	20	19
FRASERS HOSPITALITY TRUST	- (-)	- (△ 2)	92	64
KEPPEL DC REIT	80	94	79	93
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	165 (-)	156 (△ 3)	-	-
CAPITALAND MALL TRUST	77	160	44	86
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	82 (-)	198 (△0.77017)	27	64
小 計	1,359 (84)	1,643 (△ 49)	663	706
イスラエル		千イスラエルシケル		千イスラエルシケル
REIT 1 LTD	6	64	-	-
小 計	6	64	-	-

(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。

○株式売買比率

(2016年1月6日～2017年1月5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	65,441千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	—千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	—

(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1月6日～2017年1月5日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 3,644	百万円 598	% 16.4	百万円 2,239	百万円 1,022	% 45.6

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

○組入資産の明細

(2017年1月5日現在)

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	%
DDR CORP	41	45	704	82,110	0.4
HCP INC	63	68	2,100	244,778	1.3
MACERICH CO/THE	18	17	1,288	150,185	0.8
ACADIA REALTY TRUST	9	11	400	46,635	0.2
AGREE REALTY CORP	2	3	177	20,708	0.1
ALEXANDER'S INC	0.51	0.5	219	25,573	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9	11	1,337	155,943	0.8
PROLOGIS INC	71	78	4,199	489,520	2.6
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	15	19	980	114,292	0.6
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12	12	95	11,128	0.1
BIOMED REALTY TRUST INC	27	—	—	—	—
BRANDYWINE REALTY TRUST	23	26	449	52,347	0.3
CAMDEN PROPERTY TRUST	11	12	1,095	127,732	0.7
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	20	25	302	35,217	0.2
CEDAR REALTY TRUST INC	10	10	73	8,544	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	18	21	980	114,230	0.6
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	12	14	447	52,180	0.3
COUSINS PROPERTIES INC	28	52	447	52,178	0.3
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	26	29	353	41,217	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	19	23	2,405	280,373	1.5
EASTGROUP PROPERTIES INC	4	4	367	42,868	0.2
EDUCATION REALTY TRUST INC	7	11	463	53,982	0.3
EPR PROPERTIES	8	9	681	79,410	0.4
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	10	12	866	100,976	0.5
EQUITY ONE INC	10	14	438	51,144	0.3
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8	9	2,234	260,482	1.4
EXTRA SPACE STORAGE INC	16	18	1,448	168,855	0.9
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9	10	1,525	177,802	0.9
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	14	17	490	57,224	0.3
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	8	7	88	10,326	0.1
GETTY REALTY CORP	3	4	105	12,304	0.1
WELLTOWER INC	48	53	3,572	416,357	2.2
HIGHWOODS PROPERTIES INC	12	14	780	90,992	0.5
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	20	24	786	91,626	0.5
EQUITY COMMONWEALTH	17	18	571	66,655	0.4
INLAND REAL ESTATE CORP	12	—	—	—	—
KILROY REALTY CORP	12	13	1,005	117,159	0.6
KITE REALTY GROUP TRUST	11	12	298	34,775	0.2
LEXINGTON REALTY TRUST	27	31	353	41,197	0.2
LTC PROPERTIES INC	4	5	282	32,942	0.2

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	%
MACK-CALI REALTY CORP	11	13	391	45,636	0.2
BOSTON PROPERTIES INC	20	22	2,993	348,909	1.8
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	32	47	586	68,369	0.4
MID-AMERICA APARTMENT COMM	10	16	1,659	193,403	1.0
NATL HEALTH INVESTORS INC	4	5	444	51,864	0.3
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	22	29	937	109,332	0.6
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1	2	58	6,830	0.0
PARKWAY PROPERTIES INC	11	—	—	—	—
PENN REAL ESTATE INVEST TST	9	—	212	24,815	0.1
POST PROPERTIES INC	7	—	—	—	—
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	10	12	211	24,672	0.1
REALTY INCOME CORP	33	38	2,227	259,645	1.4
REGENCY CENTERS CORP	12	15	1,080	125,960	0.7
SAUL CENTERS INC	1	1	110	12,925	0.1
SENIOR HOUSING PROP TRUST	31	34	673	78,524	0.4
SL GREEN REALTY CORP	13	15	1,661	193,654	1.0
LIFE STORAGE INC	4	6	587	68,501	0.4
SUN COMMUNITIES INC	7	9	757	88,259	0.5
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	28	31	495	57,758	0.3
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	13	14	521	60,828	0.3
TAUBMAN CENTERS INC	8	8	679	79,256	0.4
CUBESMART	23	26	717	83,586	0.4
UDR INC	35	39	1,441	168,005	0.9
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1	1	131	15,379	0.1
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3	4	110	12,853	0.1
VENTAS INC	45	52	3,276	381,873	2.0
WASHINGTON REIT	8	11	370	43,159	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	15	17	636	74,182	0.4
HERSHA HOSPITALITY TRUST	6	6	137	16,001	0.1
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2	2	345	40,295	0.2
UMH PROPERTIES INC	2	3	48	5,606	0.0
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2	3	73	8,603	0.0
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	8	9	147	17,184	0.1
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	13	16	521	60,736	0.3
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	12	15	210	24,528	0.1
WINTHROP REALTY TRUST	5	—	—	—	—
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	12	13	648	75,571	0.4
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	16	19	138	16,113	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	19	21	803	93,614	0.5
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	8	11	507	59,206	0.3
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	10	10	329	38,418	0.2
CHESAPEAKE LODGING TRUST	8	8	231	26,997	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	20	21	452	52,704	0.3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	9	17	634	74,002	0.4
CORESITE REALTY CORP	4	5	420	48,971	0.3

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	%
CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	9	—	—	—	—
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5	5	259	30,227	0.2
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	11	13	211	24,683	0.1
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	9	10	203	23,706	0.1
RLJ LODGING TRUST	17	18	471	54,986	0.3
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	13	16	350	40,801	0.2
ROUSE PROPERTIES INC	5	—	—	—	—
STAG INDUSTRIAL INC	9	11	271	31,666	0.2
SABRA HEALTH CARE REIT INC	9	9	241	28,203	0.1
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	32	34	542	63,282	0.3
SELECT INCOME REIT	8	9	238	27,784	0.1
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	17	21	634	73,948	0.4
WP CAREY INC	13	15	966	112,665	0.6
WHITESTONE REIT	4	4	57	6,711	0.0
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7	7	469	54,709	0.3
CHATHAM LODGING TRUST	5	6	125	14,637	0.1
TERRENO REALTY CORP	5	6	196	22,881	0.1
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	4	5	96	11,199	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	59	71	791	92,232	0.5
CORECIVIC INC	15	17	441	51,413	0.3
GEO GROUP INC/THE	9	11	413	48,174	0.3
VEREIT INC	123	144	1,261	147,018	0.8
DUKE REALTY CORP	47	53	1,446	168,578	0.9
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	3	5	77	9,012	0.0
AMERICAN RESIDENTIAL PROPERT	4	—	—	—	—
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	7	9	236	27,536	0.1
PHYSICIANS REALTY TRUST	11	20	390	45,516	0.2
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	20	32	672	78,371	0.4
GRAMERCY PROPERTY TRUST	56	20	583	67,996	0.4
CYRUSONE INC	9	10	516	60,173	0.3
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	3	3	46	5,395	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	16	18	380	44,346	0.2
QTS REALTY TRUST INC-CL A	5	7	370	43,174	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	22	38	970	113,079	0.6
COLONY STARWOOD HOMES	5	7	209	24,413	0.1
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	16	18	412	48,088	0.3
WASHINGTON PRIME GROUP INC	24	28	306	35,742	0.2
CARETRUST REIT INC	5	9	146	17,105	0.1
NEW YORK REIT INC	22	24	244	28,499	0.2
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	2	3	55	6,435	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	12	28	910	106,133	0.6
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	3	9	88	10,329	0.1
IRON MOUNTAIN INC	25	36	1,231	143,556	0.8
STORE CAPITAL CORP	9	23	588	68,598	0.4
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12	11	121	14,106	0.1

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	%	
URBAN EDGE PROPERTIES	12	13	389	45,447	0.2	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	1	3	67	7,881	0.0	
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	22	24	269	31,374	0.2	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	14	15	311	36,287	0.2	
NORTHSTAR REALTY FINANCE	25	27	443	51,645	0.3	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3	5	117	13,736	0.1	
NEXPOINT RESIDENTIAL	2	2	55	6,519	0.0	
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	11	12	315	36,810	0.2	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	21	22	466	54,347	0.3	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	2	2	39	4,610	0.0	
GLOBAL NET LEASE INC	23	24	196	22,888	0.1	
CITY OFFICE REIT INC	2	2	36	4,198	0.0	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	7	7	98	11,539	0.1	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1	3	153	17,854	0.1	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	5	8	176	20,577	0.1	
FOREST CITY REALTY TRUST- A	—	32	670	78,137	0.4	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	—	1	41	4,882	0.0	
FARMLAND PARTNERS INC	—	1	20	2,366	0.0	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	—	90	75	8,759	0.0	
TIER REIT INC	—	7	133	15,591	0.1	
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	—	10	18	2,124	0.0	
PARKWAY INC	—	6	146	17,063	0.1	
QUALITY CARE PROPERTIES	—	13	216	25,196	0.1	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	—	3	34	4,059	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL	49	54	3,489	406,721	2.1	
FELCOR LODGING TRUST INC	16	18	150	17,530	0.1	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	79	86	2,238	260,881	1.4	
HOST HOTELS & RESORTS INC	101	109	2,110	246,015	1.3	
ISTAR INC	—	10	128	14,971	0.1	
LIBERTY PROPERTY TRUST	19	22	894	104,283	0.6	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	15	16	522	60,913	0.3	
PUBLIC STORAGE	19	22	4,988	581,502	3.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	41	46	8,558	997,570	5.3	
VORNADO REALTY TRUST	24	25	2,745	320,039	1.7	
KIMCO REALTY CORP	56	62	1,625	189,469	1.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	18	20	3,616	421,521	2.2	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	20	23	1,046	121,958	0.6	
小 計	口 数	口 数	金額	金額		
	2,674	3,186	117,906	13,743,140		
	銘柄 数 < 比率 >	157	159	—	< 72.5% >	
(カナダ)			千カナダドル			
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2	3	174	15,313	0.1	
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	8	9	306	26,878	0.1	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8	9	304	26,708	0.1	
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	4	5	238	20,936	0.1	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	10	13	203	17,869	0.1	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)	千口	千口	千カナダドル	千円	%	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	7	8	164	14,427	0.1	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	19	21	476	41,778	0.2	
INNVEST REAL ESTATE INVESTME	7	—	—	—	—	
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	4	3	52	4,565	0.0	
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	3	4	82	7,255	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	20	24	646	56,676	0.3	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	5	5	206	18,139	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	10	10	133	11,733	0.1	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	4	6	89	7,888	0.0	
BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO	2	2	52	4,623	0.0	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	4	4	47	4,172	0.0	
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	7	8	78	6,873	0.0	
ONEREIT	1	2	8	730	0.0	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3	3	165	14,516	0.1	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5	5	42	3,704	0.0	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	4	4	39	3,508	0.0	
MILESTONE APARTMENTS REAL ES	3	5	106	9,351	0.0	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2	2	35	3,093	0.0	
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	14	16	93	8,189	0.0	
CHOICE PROPERTIES REIT	5	5	78	6,910	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	3	5	74	6,540	0.0	
PLAZA RETAIL REIT	4	5	26	2,280	0.0	
SLATE RETAIL REIT - U	2	2	36	3,237	0.0	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	—	5	59	5,237	0.0	
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	—	2	22	1,943	0.0	
SLATE OFFICE REIT	—	3	24	2,178	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	184	210	4,072	357,263	
	銘柄 数 < 比 率 >	28	30	—	<1.9%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	13	15	188	23,108	0.1	
HAMBORNER REIT AG	8	10	98	12,128	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	21	26	287	35,237	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.2%>	
(ユーロ…イタリア)						
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	36	55	41	5,086	0.0	
BENI STABILI SPA	147	135	74	9,110	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	184	191	115	14,196	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)						
GECINA SA	4	6	792	97,284	0.5	
KLEPIERRE	25	30	1,135	139,306	0.7	
UNIBAIL-RODAMCO SE	13	14	3,289	403,643	2.1	
AFFINE	1	—	—	—	—	
FONCIERE DES REGIONS	5	7	604	74,150	0.4	
MERCIALYS	2	7	150	18,426	0.1	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
ANF IMMOBILIER		1	—	—	—	—
ICADE		4	6	448	55,073	0.3
ALTAREA		0.28	0.36	67	8,222	0.0
FONCIERE DES MURS		1	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	60	73	6,488	796,107	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	7	—	<4.2%>	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPRIETE-CV		6	7	264	32,424	0.2
NSI NV		19	22	82	10,130	0.1
VASTNED RETAIL NV		2	2	107	13,203	0.1
WERELDHAVE NV		5	5	258	31,757	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	33	39	713	87,515	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.5%>	
(ユーロ…スペイン)						
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		8	14	100	12,283	0.1
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		41	69	723	88,830	0.5
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA		7	8	110	13,608	0.1
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI		—	15	169	20,785	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	56	107	1,104	135,507	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	4	—	<0.7%>	
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO		2	3	176	21,649	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES		1	2	52	6,381	0.0
RETAIL ESTATES		0.78	1	76	9,398	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA		1	2	196	24,140	0.1
WERELDHAVE BELGIUM NV		0.32	0.32	35	4,375	0.0
AEDIFICA		2	2	146	17,947	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV		—	0.5	17	2,177	0.0
MONTEA		—	0.98	45	5,579	0.0
COFINIMMO		2	3	330	40,501	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	11	15	1,077	132,151	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	9	—	<0.7%>	
(ユーロ…アイルランド)						
GREEN REIT PLC		89	96	132	16,214	0.1
HIBERNIA REIT PLC		90	103	127	15,691	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		53	53	61	7,576	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	233	252	321	39,482	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.2%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	601	706	10,107	1,240,197	
	銘柄 数 < 比 率 >	31	31	—	<6.5%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		139	152	955	137,515	0.7
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		46	49	327	47,191	0.2
HAMMERSON PLC		105	115	652	93,938	0.5
LAND SECURITIES GROUP PLC		108	118	1,233	177,492	0.9

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		
(イギリス)	千口	千口	千イギリスポンド	千円	%	
INTU PROPERTIES PLC	109	132	368	53,011	0.3	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	60	91	102	14,679	0.1	
SEGRO PLC	98	122	564	81,161	0.4	
WORKSPACE GROUP PLC	16	18	140	20,204	0.1	
MCKAY SECURITIES PLC-ORD	11	15	28	4,066	0.0	
SHAFTESBURY PLC	37	41	370	53,246	0.3	
BIG YELLOW GROUP PLC	19	21	146	21,081	0.1	
DERWENT LONDON PLC	14	16	441	63,541	0.3	
MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	—	9	43	6,250	0.0	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	83	88	136	19,602	0.1	
HANSTEEN HOLDINGS PLC	102	108	121	17,456	0.1	
REDEFINE INTERNATIONAL PLC	138	197	76	11,005	0.1	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	28	31	113	16,281	0.1	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	92	164	229	33,034	0.2	
ASSURA PLC	218	235	133	19,275	0.1	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70	89	51	7,388	0.0	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	51	68	71	10,334	0.1	
REGIONAL REIT LTD	25	24	26	3,754	0.0	
CAPITAL & REGIONAL PLC	—	75	41	5,935	0.0	
NEWRIVER REIT PLC	—	33	115	16,570	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,578	2,022	6,490	934,022	
銘 柄 数 < 比 率 >		21	24	—	<4.9%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES	440	485	1,445	122,881	0.6	
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	6	6	43	3,702	0.0	
ABACUS PROPERTY GROUP	36	43	130	11,072	0.1	
ASPEN GROUP	11	11	12	1,056	0.0	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	19	22	61	5,244	0.0	
360 CAPITAL GROUP LTD	34	34	30	2,581	0.0	
ALE PROPERTY GROUP	25	25	110	9,369	0.0	
CHARTER HALL GROUP	41	59	280	23,865	0.1	
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	27	35	92	7,859	0.0	
GALILEO JAPAN TRUST	15	—	—	—	—	
CROMWELL PROPERTY GROUP	174	198	193	16,423	0.1	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	92	101	222	18,954	0.1	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	26	26	87	7,417	0.0	
NATIONAL STORAGE REIT	35	64	95	8,132	0.0	
GDI PROPERTY GROUP	66	65	64	5,443	0.0	
INDUSTRIA REIT	13	23	47	4,067	0.0	
360 CAPITAL OFFICE FUND	7	7	16	1,439	0.0	
SCENTRE GROUP	723	790	3,634	309,038	1.6	
ARENA REIT	27	37	70	6,025	0.0	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	16	23	65	5,594	0.0	
GENERATION HEALTHCARE REIT	—	23	44	3,791	0.0	
VIVA ENERGY REIT	—	66	161	13,764	0.1	

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		
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリアドル	千円	%	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	—	23	92	7,821	0.0	
GPT GROUP	245	265	1,320	112,243	0.6	
MIRVAC GROUP	488	543	1,158	98,467	0.5	
STOCKLAND	324	353	1,602	136,243	0.7	
WESTFIELD CORP	260	284	2,665	226,593	1.2	
DEXUS PROPERTY GROUP	131	142	1,357	115,401	0.6	
BWP TRUST	65	70	211	18,016	0.1	
INVESTA OFFICE FUND	80	92	439	37,324	0.2	
CHARTER HALL RETAIL REIT	46	49	210	17,866	0.1	
GOODMAN GROUP	215	234	1,665	141,621	0.7	
小 計	口 数 ・ 金 額	3,697	4,211	17,635	1,499,328	
	銘柄 数 < 比 率 >	29	31	—	< 7.9% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	40	43	88	7,223	0.0	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	156	199	276	22,532	0.1	
GOODMAN PROPERTY TRUST	143	147	180	14,707	0.1	
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	63	62	99	8,068	0.0	
STRIDE PROPERTY LTD	48	—	—	—	—	
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	143	141	171	13,995	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	108	127	129	10,560	0.1	
STRIDE PROPERTY GROUP	—	59	102	8,356	0.0	
INVESTORE PROPERTY LTD	—	21	29	2,417	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	704	803	1,078	87,863	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	8	—	< 0.5% >	
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	306	329	16,795	252,435	1.3	
CHAMPION REIT	280	310	1,302	19,569	0.1	
PROSPERITY REIT	178	178	553	8,320	0.0	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	150	148	606	9,120	0.0	
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	115	115	239	3,595	0.0	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	153	153	693	10,417	0.1	
FORTUNE REIT	177	205	1,826	27,453	0.1	
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	90	137	435	6,547	0.0	
NEW CENTURY REIT	63	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,512	1,575	22,452	337,458	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	8	—	< 1.8% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
SUNTEC REIT	333	379	626	50,797	0.3	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	263	324	488	39,563	0.2	
KEPPEL REIT	223	263	268	21,761	0.1	
FRASERS COMMERCIAL TRUST	83	84	106	8,657	0.0	
ASCOTT RESIDENCE TRUST	120	126	145	11,834	0.1	
CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	144	180	97	7,900	0.0	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	95	111	151	12,302	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	78	90	173	14,080	0.1	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポールドル	千円	%	
STARHILL GLOBAL REIT	186	190	143	11,628	0.1	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	191	215	219	17,801	0.1	
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	86	99	138	11,204	0.1	
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	82	82	105	8,562	0.0	
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	83	83	111	9,058	0.0	
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	234	255	95	7,757	0.0	
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	48	59	142	11,585	0.1	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	153	177	291	23,668	0.1	
CACHE LOGISTICS TRUST	101	127	103	8,390	0.0	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	178	264	373	30,280	0.2	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	99	135	80	6,511	0.0	
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	75	110	39	3,165	0.0	
SABANA SHARIAH COMP IND REIT-RTS	—	46	4	340	0.0	
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	121	121	84	6,865	0.0	
MAPLETREE GREATER CHINA COMM	237	264	249	20,222	0.1	
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	97	97	63	5,150	0.0	
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	76	76	52	4,281	0.0	
OUE HOSPITALITY TRUST	115	160	109	8,911	0.0	
SPH REIT	105	105	100	8,182	0.0	
FRASERS HOSPITALITY TRUST	92	—	—	—	—	
KEPPEL DC REIT	111	112	135	10,943	0.1	
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	—	165	155	12,572	0.1	
CAPITALAND MALL TRUST	364	397	766	62,124	0.3	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	292	346	800	64,919	0.3	
小 計	口 数 ・ 金 額	4,471	5,250	6,427	521,026	
	銘柄 数 < 比 率 >	30	31	—	< 2.7% >	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
REIT 1 LTD		20	26	301	9,103	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	20	26	301	9,103	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	15,444	17,993	—	18,729,404	
	銘柄 数 < 比 率 >	313	323	—	< 98.8% >	

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

○投資信託財産の構成

(2017年1月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資証券	千円 18,729,404	% 98.4
コール・ローン等、その他	296,303	1.6
投資信託財産総額	19,025,707	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (18,959,638千円) の投資信託財産総額 (19,025,707千円) に対する比率は99.7%です。

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

1 アメリカドル=116.56円	1 カナダドル=87.73円	1 ユーロ=122.70円	1 イギリスポンド=143.90円
1 オーストラリアドル=85.02円	1 ニュージーランドドル=81.46円	1 香港ドル=15.03円	1 シンガポールドル=81.06円
1 イスラエルシェケル=30.22円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年1月5日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	19,116,219,049
コール・ローン等	216,744,971
投資証券(評価額)	18,729,404,789
未収入金	90,699,815
未収配当金	79,369,353
未収利息	121
(B) 負債	166,814,636
未払金	90,511,400
未払解約金	76,303,236
(C) 純資産総額(A-B)	18,949,404,413
元本	11,814,318,288
次期繰越損益金	7,135,086,125
(D) 受益権総口数	11,814,318,288口
1万口当たり基準価額(C/D)	16.039円

<注記事項>

- ①期首元本額 10,718,844,576円
 期中追加設定元本額 2,954,569,904円
 期中一部解約元本額 1,859,096,192円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.6039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 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	207,226,514円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	144,605,089円
三菱UFJ 資産設計ファンド(分配型)	23,778,003円
三菱UFJ 資産設計ファンド(バランス型)	44,763,077円
三菱UFJ 資産設計ファンド(株式重視型)	19,539,829円
ファンド・マネジャー(海外リート)	639,345,452円
eMAXIS 先進国リートインデックス	7,047,079,004円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,635,566,781円
eMAXIS バランス(波乗り型)	299,396,604円
三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド	1,284,832,035円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	154,360,698円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	73,157,420円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	205,681,187円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	1,117,108円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	2,925,339円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	12,051,341円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	10,917,808円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	7,641,517円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	333,482円
合計	11,814,318,288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ため(分散型に分類)、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3月2日)

○損益の状況 (2016年1月6日~2017年1月5日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	780,147,469
受取配当金	776,760,344
受取利息	269,095
その他収益金	3,132,101
支払利息	△ 14,071
(B) 有価証券売買損益	490,982,336
売買益	1,549,784,268
売買損	△1,058,801,932
(C) 保管費用等	△ 11,001,215
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,260,128,590
(E) 前期繰越損益金	5,472,381,055
(F) 追加信託差損益金	1,334,569,568
(G) 解約差損益金	△ 931,993,088
(H) 計(D+E+F+G)	7,135,086,125
次期繰越損益金(H)	7,135,086,125

- (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。