

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	無期限（2014年5月30日設定）	
運用方針	各マザーファンド受益証券等への投資を通じて、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。株式の実質組入比率は、株式組入れを比較的抑えつつ、相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。債券の実質組入比率は、原則として、先進国債券を一定の比率とし、残りの部分は国内債券等を組入れます。国内の債券市場が下落した場合等に国内債券の実質組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等の組入れを行う場合があります。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な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。三菱UFJ信託銀行株式会社の投資助言・情報提供に基づき、ファンドの運用を行います。	
主要運用対象	ベビーファンド	TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券およびマネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	TOPIXマザーファンド	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
	外国株式インデックスマザーファンド	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円換算ベース) に採用されている株式を主要投資対象とします。
	日本債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI 総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。
	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
	マネー・マーケット・マザーファンド	わが国の公社債等を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	TOPIXマザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	外国株式インデックスマザーファンド	株式および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
	日本債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
	マネー・マーケット・マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ
DCバランス・イノベーション
(KAKUSHIN)

第2期（決算日：2016年3月25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 DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）」は、去る3月25日に第2期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

三菱UFJ投信株式会社は2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、「三菱UFJ国際投信株式会社」となりました。



三菱UFJ国際投信

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

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034

(9:00~17:00、土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)

お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目次

三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN) のご報告

◇設定以来の運用実績	1
◇当期中の基準価額と市況等の推移	2
◇運用経過	3
◇今後の運用方針	6
◇1万口当たりの費用明細	7
◇売買及び取引の状況	8
◇株式売買比率	8
◇利害関係人との取引状況等	8
◇自社による当ファンドの設定・解約状況	10
◇組入資産の明細	11
◇投資信託財産の構成	11
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	12
◇損益の状況	12
◇お知らせ	13

マザーファンドのご報告

◇TOPIXマザーファンド	14
◇外国株式インデックスマザーファンド	47
◇日本債券インデックスマザーファンド	89
◇ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	118
◇マネー・マーケット・マザーファンド	141

本資料の表記にあたって

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

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		税金	込み	期中騰落						
(設定日)	円	円		%	%	%	%	%	%	百万円
2014年5月30日	10,000	—		—	—	—	—	—	—	10
1期(2015年3月25日)	10,752	0		7.5	32.4	0.5	61.7	—	0.4	35
2期(2016年3月25日)	10,742	0		△0.1	2.9	0.0	76.8	0.1	0.1	807

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 当ファンドは、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産を実質的な主要投資対象とし、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざしますが、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) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		株組入比率	株先物比率	債組入比率	債先物比率	投資信託組入比率
	円	騰落率					
(期首) 2015年3月25日	10,752	—	32.4	0.5	61.7	—	0.4
3月末	10,674	△0.7	30.2	0.5	66.5	—	0.4
4月末	10,741	△0.1	29.9	0.4	66.8	0.1	0.3
5月末	10,861	1.0	31.8	0.5	64.1	0.2	0.3
6月末	10,709	△0.4	33.4	0.4	63.1	0.2	0.4
7月末	10,778	0.2	31.7	0.3	63.0	0.2	0.3
8月末	10,485	△2.5	—	—	95.7	0.3	—
9月末	10,510	△2.3	—	—	86.4	0.1	—
10月末	10,532	△2.0	—	—	95.5	0.1	—
11月末	10,524	△2.1	7.8	0.3	83.3	0.1	0.1
12月末	10,506	△2.3	7.6	0.3	82.5	—	0.2
2016年1月末	10,556	△1.8	—	—	81.6	0.1	—
2月末	10,676	△0.7	—	—	76.4	0.2	—
(期末) 2016年3月25日	10,742	△0.1	2.9	0.0	76.8	0.1	0.1

(注) 騰落率は期首比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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2期：2015/3/26～2016/3/25)

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.1%の下落となりました。



基準価額の主な変動要因

上昇要因	主に国内債券市況が上昇したことが、プラスに寄与しました。
下落要因	2015年8月の株式市況の下落局面において、主に国内株式の組み入れが、マイナスに影響しました。

投資環境について

(第2期：2015/3/26～2016/3/25)

【概況】

当期の株式市況では、国内、先進国株式市況は軟調に推移しました。債券市場では、マイナス金利導入の決定などから日本の長期金利は低下しました。一方、米国やドイツの長期金利は期を通じてみるとほぼ横ばいとなりました。

【株式】

国内株式および先進国株式は、中国株式市況の不安定な値動きや原油価格の下落などから投資家のリスク回避姿勢が強まり下落しました。

【債券】

国内の長期金利は、日銀の金融緩和策の継続に加え、マイナス金利導入の決定などから低下しました。先進国では、米国やドイツの長期金利は、米国の良好な経済指標や景気回復などを受けて2015年年央にかけて上昇しました。その後は、中国株式市況の急落や原油価格の下落に伴うインフレ期待の低下などから、長期金利は低下しました。

【為替】

円は米ドル、ユーロに対して上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

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

◎組入比率

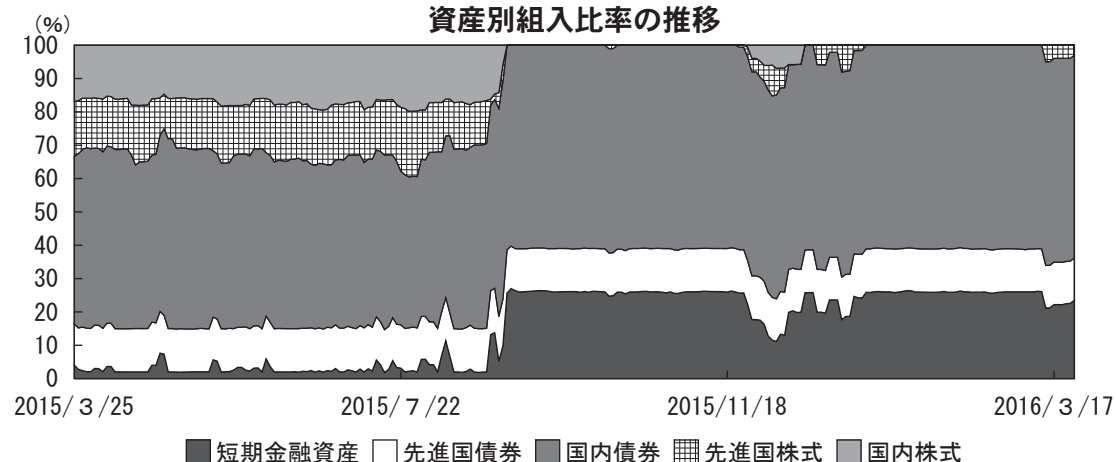
期首から2015年8月にかけて「株式部分の収益寄与」が高水準で推移したことから、株式の組み入れを行いました。その後は、「株式部分の収益寄与」が低下したことや「投資環境」の悪化などを受けて、株式の組入比率を引き下げ、株式の組み入れを行わないもしくは概ね低水準での組み入れを行いました。なお、当期末の『株式ウエイトマトリクス』の状況は以下のようになっています。

- ・国内株式の「投資環境」は中立、「株式部分の収益寄与」は低い局面
- ・先進国株式の「投資環境」は中立、「株式部分の収益寄与」はやや低い局面

◎パフォーマンス要因

当期は、2015年8月の株式市況の下落局面において、主に国内株式の組み入れが基準価額にマイナスに影響しました。一方で国内債券利回りが低下したことは、プラスに寄与しました。

(ご参考)



(注) 比率は各資産に対応するマザーファンドの純資産総額に対する割合です。
 なお、マネー・マーケット・マザーファンドの組み入れがある場合は短期金融資産に含みます。

(ご参考)

資産別組入比率および基準価額騰落率

(2016年3月25日)

		組入可能範囲	組入比率	期中の基準価額騰落率
国内株式	TOPIXマザーファンド	0.0%~22.0%	—	△12.5%
先進国株式	外国株式インデックスマザーファンド	0.0%~22.0%	3.0%	△11.2%
国内債券	日本債券インデックスマザーファンド	0.0%~61.0%	60.8%	5.3%
先進国債券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	13.0% (原則、固定)	12.7%	0.6%
短期公社債	マネー・マーケット・マザーファンド	—	5.4%	0.0%

(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

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、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産を実質的な主要投資対象とし、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざしますが、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2期
	2015年3月26日～2016年3月25日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	742

(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

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

○ 1万口当たりの費用明細

(2015年3月26日～2016年3月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	69	0.648	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
（ 投 信 会 社 ）	(46)	(0.432)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(20)	(0.184)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(3)	(0.032)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（ 株 式 ）	(0)	(0.001)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.000)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.002	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	(0)	(0.002)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	1	0.012	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(1)	(0.005)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.003)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	70	0.663	
期中の平均基準価額は、10,629円です。			

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

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2015年3月26日～2016年3月25日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	82,354	103,660	5,670	7,030
TOPIXマザーファンド	72,795	118,150	76,603	116,996
外国株式インデックスマザーファンド	106,683	237,050	97,260	214,108
日本債券インデックスマザーファンド	438,765	563,050	85,702	108,500
マネー・マーケット・マザーファンド	126,355	128,680	83,676	85,220

○株式売買比率

(2015年3月26日～2016年3月25日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	TOPIXマザーファンド	外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	152,631,624千円	201,251,620千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	241,754,857千円	223,894,017千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.63	0.89

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年3月26日～2016年3月25日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN) >

該当事項はございません。

<TOPIXマザーファンド>

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株式	百万円 81,253	百万円 18,121	% 22.3	百万円 71,378	百万円 8,859	% 12.4

平均保有割合 0.0%

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

＜外国株式インデックスマザーファンド＞

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 152,861	百万円 29	% 0.0	百万円 101,040	百万円 1,024	% 1.0

平均保有割合 0.0%

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

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 237,929	百万円 74,099	% 31.1	百万円 102,724	百万円 47,865	% 46.6

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まません。

＜ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド＞

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 563,313	百万円 230,979	% 41.0	百万円 589,569	百万円 254,647	% 43.2
為替直物取引	33,636	24,059	71.5	8,808	5,554	63.1

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。

＜マネー・マーケット・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 41,960	百万円 18,199	% 43.4	百万円 23,930	百万円 4,100	% 17.1
現先取引(公社債)	95,510	11,003	11.5	95,510	11,003	11.5

平均保有割合 0.5%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

利害関係人の発行する有価証券等

<TOPIXマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 2,092	百万円 1,952	百万円 4,875

<日本債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 1,037	百万円 302	百万円 1,693

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<TOPIXマザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 294

<日本債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額
公社債	百万円 1,300

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)	2千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.003千円
(B) / (A)	0.1%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 10	百万円 —	百万円 10	百万円 —	当初設定時における取得とその処分

○組入資産の明細

(2016年3月25日現在)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	3,452	80,135	102,405
TOPIXマザーファンド	3,808	—	—
外国株式インデックスマザーファンド	2,590	12,013	24,219
日本債券インデックスマザーファンド	14,073	367,136	490,897
マネー・マーケット・マザーファンド	—	42,678	43,459

○投資信託財産の構成

(2016年3月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	102,405	12.7
外国株式インデックスマザーファンド	24,219	3.0
日本債券インデックスマザーファンド	490,897	60.6
マネー・マーケット・マザーファンド	43,459	5.4
コール・ローン等、その他	148,510	18.3
投資信託財産総額	809,490	100.0

(注) ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産 (60,187,242千円) の投資信託財産総額 (60,317,422千円) に対する比率は99.8%です。

(注) 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産 (252,037,074千円) の投資信託財産総額 (252,641,119千円) 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=113.31円	1 カナダドル=85.53円	1 メキシコペソ=6.43円	1 ユーロ=126.42円
1 イギリスポンド=160.33円	1 スイスフラン=116.13円	1 スウェーデンクローネ=13.63円	1 ノルウェークローネ=13.33円
1 デンマーククローネ=16.96円	1 ポーランドズロチ=29.61円	1 オーストラリアドル=85.29円	1 ニューージーランドドル=75.92円
1 香港ドル=14.60円	1 シンガポールドル=82.69円	1 イスラエルシェケル=29.55円	1 南アフリカランド=7.35円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年3月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	809,490,605
コール・ローン等	141,138,078
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	102,405,545
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	24,219,857
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	490,897,601
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	43,459,524
未収入金	7,370,000
(B) 負債	1,878,325
未払解約金	277,534
未払信託報酬	1,591,303
その他未払費用	9,488
(C) 純資産総額(A-B)	807,612,280
元本	751,810,484
次期繰越損益金	55,801,796
(D) 受益権総口数	751,810,484口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,742円

<注記事項>

- ①期首元本額 33,066,582円
 期中追加設定元本額 897,344,061円
 期中一部解約元本額 178,600,159円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0742円です。

○損益の状況 (2015年3月26日～2016年3月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	11,256
受取利息	11,256
(B) 有価証券売買損益	9,483,253
売買益	21,361,887
売買損	△11,878,634
(C) 信託報酬等	△ 2,339,272
(D) 当期損益金(A+B+C)	7,155,237
(E) 前期繰越損益金	594,166
(F) 追加信託差損益金	48,052,393
(配当等相当額)	(25,014,948)
(売買損益相当額)	(23,037,445)
(G) 計(D+E+F)	55,801,796
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	55,801,796
追加信託差損益金	48,052,393
(配当等相当額)	(25,741,892)
(売買損益相当額)	(22,310,501)
分配準備積立金	7,749,403

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

②分配金の計算過程

項 目	2015年3月26日～ 2016年3月25日
費用控除後の配当等収益額	3,033,403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	4,121,834円
収益調整金額	48,052,393円
分配準備積立金額	594,166円
当ファンドの分配対象収益額	55,801,796円
1万口当たり収益分配対象額	742円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

*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】

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

TOPIXマザーファンド

《第15期》決算日2016年3月25日

[計算期間：2015年3月26日～2016年3月25日]

「TOPIXマザーファンド」は、3月25日に第15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15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)と連動する投資成果をめざして運用を行います。TOPIXからカイ離するリスクと運用コストの極小化を目的として、定量的なリスク管理に基づいたポートフォリオ構築と適切な売買執行を行います。株式の実質投資比率(組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)は、原則として高位を維持します。
主要運用対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数 (TOPIX)		株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
11期(2012年3月26日)	7,888	1.8	851.82	△0.6	98.4	1.7	187,797
12期(2013年3月25日)	9,935	26.0	1,047.29	22.9	98.8	1.2	221,229
13期(2014年3月25日)	11,255	13.3	1,163.70	11.1	98.7	1.2	221,564
14期(2015年3月25日)	15,711	39.6	1,592.01	36.8	98.4	1.3	245,366
15期(2016年3月25日)	13,743	△12.5	1,366.05	△14.2	98.2	1.9	220,801

(注) 東証株価指数(TOPIX)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

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

(注) 「株式先物比率」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) 2015年3月25日	15,711	—	1,592.01	—	98.4	1.3
3月末	15,347	△ 2.3	1,543.11	△ 3.1	98.0	1.5
4月末	15,846	0.9	1,592.79	0.0	97.8	1.4
5月末	16,659	6.0	1,673.65	5.1	96.5	1.7
6月末	16,242	3.4	1,630.40	2.4	99.0	0.8
7月末	16,534	5.2	1,659.52	4.2	99.0	1.0
8月末	15,318	△ 2.5	1,537.05	△ 3.5	98.9	1.2
9月末	14,171	△ 9.8	1,411.16	△11.4	98.2	2.0
10月末	15,649	△ 0.4	1,558.20	△ 2.1	97.7	1.5
11月末	15,873	1.0	1,580.25	△ 0.7	100.1	1.6
12月末	15,560	△ 1.0	1,547.30	△ 2.8	99.2	0.8
2016年1月末	14,404	△ 8.3	1,432.07	△10.0	98.8	1.6
2月末	13,055	△16.9	1,297.85	△18.5	99.1	1.5
(期 末) 2016年3月25日	13,743	△12.5	1,366.05	△14.2	98.2	1.9

(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

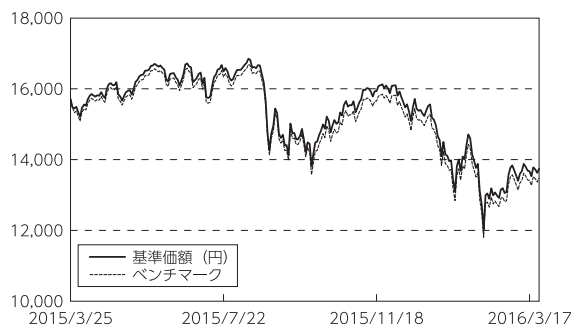
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ12.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−14.2%)を1.7%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内株式市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは14.2%の下落となったため、カイ離は1.7%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

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

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

- ・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・期中における先物組入比率の平均は、1.5%程度となりました。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.7%程度でした。

- ・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

プラス要因	配当・利子収入等	計 1.9%程度
マイナス要因	売買コスト等	計 △0.2%程度

信託財産の収益向上を目的に、保有株式の貸し付けを行っています。貸付契約額は、期末時点で概ね純資産総額の5割程度となり、信託財産に若干の収益寄与となりました。

◎今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2015年3月26日～2016年3月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	1	0.004	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
	(1)	(0.004)	
合 計	1	0.004	
期中の平均基準価額は、15,388円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年3月26日～2016年3月25日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		60,807	81,253,363	52,180	71,378,260
		(△ 2,998)	()		

(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	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
内		75,143	73,705	—	—

○株式売買比率

(2015年3月26日～2016年3月25日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	152,631,624千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	230,566,570千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.66

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年3月26日～2016年3月25日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	%
株式	百万円 81,253	百万円 18,121	22.3	百万円 71,378	百万円 8,859	12.4

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 2,092	百万円 1,952	百万円 4,875

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 294

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)	9,191千円
うち利害関係人への支払額 (B)	72千円
(B) / (A)	0.8%

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

○組入資産の明細

(2016年3月25日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				
極洋	49	51	13,770	
日本水産	142.9	138.6	77,200	
マルハニチロ	22.3	24.6	54,562	
サカタのタネ	18.7	17.8	50,819	
ホクト	12.9	12.2	26,876	
鉱業 (0.3%)				
住石ホールディングス	32.2	35.6	3,560	
日鉄鉱業	32	33	14,421	
三井松島産業	76	79	9,796	
国際石油開発帝石	612.4	633.7	561,711	
日本海洋掘削	3.5	3.6	8,913	
石油資源開発	16.6	19.1	48,628	
K&Oエナジーグループ	7.8	8.1	11,340	
建設業 (3.2%)				
ショーボンドホールディングス	11.2	12.6	51,723	
ミライト・ホールディングス	35.8	37	34,151	
タマホーム	8.7	9.1	3,922	
サンヨーホームズ	1.2	2.5	1,385	
ダイセキ環境ソリューション	1.4	2.8	3,038	
安藤・間	77.6	80.3	43,683	
東急建設	41.3	39.1	36,636	
コムシスホールディングス	51.7	51.7	91,560	
ミサワホーム	13.7	14.2	11,076	
高松コンストラクショングループ	8.8	9.1	22,194	
東建コーポレーション	4.3	4.9	45,129	
ヤマウラ	5.5	5.7	2,764	
大成建設	604	625	473,125	
大林組	349	360.8	406,621	
清水建設	356	368	352,912	
飛鳥建設	75.7	96.6	18,354	
長谷工コーポレーション	145.3	140.4	145,314	
松井建設	13	13.3	9,881	
銭高組	17	17	8,415	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
鹿島建設	511	564	406,080	
不動産トラ	88	84.9	10,867	
大末建設	4.4	4.6	3,822	
鉄建建設	71	73	20,951	
日鉄住金テックスエンジ	22	—	—	
西松建設	125	139	68,805	
三井住友建設	471.6	460.9	48,394	
大豊建設	32	46	22,908	
前田建設工業	78	74	61,346	
佐田建設	40	8.4	3,679	
ナカノフド一建設	8.9	9.2	5,354	
奥村組	110	114	69,312	
大和小田急建設	6.3	—	—	
東鉄工業	14	14.4	49,320	
イチケン	13	13	4,394	
浅沼組	37	39	12,168	
戸田建設	146	140	77,140	
熊谷組	146	176	50,160	
青木あすなろ建設	7	7.9	6,004	
北野建設	24	25	7,325	
植木組	14	15	3,555	
三井ホーム	15	15	8,115	
矢作建設工業	14.4	16.4	13,218	
ピーエス三菱	12.3	14.2	5,651	
日本ハウスホールディングス	14.4	24.5	10,045	
大東建託	44.1	45	727,650	
新日本建設	13.8	14.3	8,008	
N I P P O	27	28	51,044	
東亜道路工業	22	23	8,786	
前田道路	36	38	70,680	
日本道路	35	36	19,260	
東亜建設工業	87	105	27,930	
若築建設	67	69	9,039	
東洋建設	34.8	37.7	18,925	

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
五洋建設	129	133.5	64,747	
大林道路	14	14	10,612	
世紀東急工業	16.9	19	9,462	
福田組	17	19	21,717	
住友林業	85.7	82.8	106,563	
日本基礎技術	14	13.5	5,805	
日成ビルド工業	32	33	13,431	
ヤマダ・エスバイエルホーム	53	61	5,002	
巴コーポレーション	14.4	14.9	5,453	
パナホーム	43	45	38,340	
大和ハウス工業	340.4	355.3	1,151,172	
ライト工業	18.6	23.1	24,301	
積水ハウス	360.7	402.2	780,871	
日特建設	15.6	13.3	5,586	
北陸電気工事	6	4.4	4,298	
ユアテック	18	19	18,183	
西部電気工業	10	10	4,190	
四電工	10	9	3,501	
中電工	16.8	17.4	38,541	
関電工	53	48	38,208	
きんでん	77	72.7	101,053	
東京エネシス	13	14	12,992	
トーエネック	16	17	12,019	
住友電設	9.2	9.5	14,383	
日本電設工業	18.9	19.6	43,139	
協和エクシオ	49.3	47.1	60,240	
新日本空調	9.8	10.1	10,271	
NDS	19	19	5,757	
九電工	21	22	56,804	
三機工業	23.6	26.7	24,350	
日揮	117	121	214,170	
中外炉工業	35	36	7,416	
ヤマト	10	10.9	5,330	
太平電業	16	18	18,018	
高砂熱学工業	32.4	35.9	52,737	
三晃金属工業	11	12	3,828	
朝日工業社	13	14	6,300	
明星工業	20.4	21.8	10,485	
大気社	16.6	14.7	41,439	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ダイダシ	16	16	12,432	
日比谷総合設備	15	14.5	23,751	
東芝プラントシステム	18.9	19.5	28,099	
OSJBホールディングス	15.8	24.5	6,198	
東洋エンジニアリング	56	64	18,880	
千代田化工建設	84	87	75,342	
新興ブランテック	23.9	24.7	21,365	
食料品 (5.0%)				
日本製粉	71	79	74,576	
日清製粉グループ本社	127.5	131.9	250,478	
日東富士製粉	9	9	3,339	
昭和産業	48	49	24,402	
鳥越製粉	9.2	9.5	6,194	
中部飼料	11.1	11.1	9,690	
フィード・ワン	69.9	72.4	9,267	
東洋精糖	18	18	1,872	
日本甜菜製糖	59	61	12,017	
三井製糖	46	47	24,158	
塩水港精糖	12.4	12.9	3,366	
日新製糖	—	5.1	7,558	
森永製菓	105	108	64,368	
中村屋	27	28	13,412	
江崎グリコ	26.8	27.8	160,406	
名糖産業	5.1	5.3	7,197	
不二家	66	69	13,317	
山崎製パン	85	88	206,008	
第一屋製パン	16	18	1,872	
モロゾフ	18	18	7,686	
亀田製菓	6.5	6.7	30,150	
寿スピリッツ	2.8	2.9	20,590	
カルビー	43	44.6	205,606	
森永乳業	104	108	64,800	
六甲バター	5.2	5.4	9,849	
ヤクルト本社	62.3	64.5	336,690	
明治ホールディングス	34.4	71.3	645,265	
雪印メグミルク	27.3	28.3	81,673	
プリマハム	65	76	21,584	
日本ハム	85	88	226,248	
伊藤ハム	64	58	43,152	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
林兼産業	37	39	3,978
丸大食品	60	62	28,520
米久	3.7	3.8	10,263
S Foods	7.3	7.5	18,757
サッポロホールディングス	190	184	105,800
アサヒグループホールディングス	233.7	225.7	773,022
キリンホールディングス	497.4	487.5	774,150
宝ホールディングス	91.2	87.1	80,219
オエノンホールディングス	30	33	6,765
養命酒製造	7	3.7	7,396
コカ・コーラウエスト	39.4	40.7	111,721
コカ・コーライーストジャパン	35.3	42.6	81,706
サントリー食品インターナショナル	69.7	82.4	400,876
ダイドードリンコ	5.9	6.1	32,452
伊藤園	34.5	35.7	127,627
キーコーヒー	10.2	10.6	20,691
ユニカフェ	3.1	3.2	3,072
ジャパンフーズ	1.5	1.5	1,795
日清オイリオグループ	56	64	30,528
不二製油グループ本社	31	32.1	66,093
かどや製油	1.1	1.2	3,567
J-オイルミルズ	49	50	18,450
キッコーマン	95	91	343,980
味の素	268	258	705,888
キュービー	59.1	61.2	157,528
ハウス食品グループ本社	43	41.1	89,762
カゴメ	44.9	43.2	94,176
焼津水産化学工業	5.5	5.7	5,853
アリアケジャパン	10.6	9.8	65,072
ピエトロ	—	1.1	2,251
エバラ食品工業	1.9	2.9	5,988
ニチレイ	124	128	117,632
東洋水産	60.7	59.1	244,378
イートアンド	1.3	1.3	3,035
日清食品ホールディングス	49.2	50.9	280,968
永谷園ホールディングス	11	11	12,397
一正蒲鉾	2	4.2	4,170
フジッコ	11	11.7	28,126
ロック・フィールド	6	6.3	22,239

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本たばこ産業	644.2	711.1	3,290,970
ケンコーマヨネーズ	3.8	3.9	9,192
わらべや日洋	6.8	6.5	16,061
なとり	5.3	6	10,206
北の達人コーポレーション	—	1.7	799
ユーグレナ	25.3	40.7	65,852
ミヨシ油脂	40	41	5,166
理研ビタミン	3.4	3.5	14,350
繊維製品 (0.7%)			
片倉工業	13.6	14.1	16,186
グンゼ	88	91	30,303
東洋紡	430	445	76,095
ユニチカ	316	327	18,312
富士紡ホールディングス	53	55	12,375
日清紡ホールディングス	69	—	—
倉敷紡績	111	115	23,805
シキボウ	62	69	7,866
日本毛織	34	34.6	26,884
大東紡織	16	16	960
トーア紡コーポレーション	49	4.8	2,448
ダイドーリミテッド	12.1	12.7	6,197
帝国繊維	11.4	11.8	18,349
帝人	444	460	180,320
東レ	841	816	776,016
サカイオーベックス	29	30	5,370
住江織物	27	28	9,072
日本フェルト	5.8	6	2,802
イチカワ	7	7	2,002
日本バイリーン	15	—	—
日東製網	13	12	1,692
芦森工業	23	24	3,960
アツギ	91	87	10,005
ダイニック	21	21	3,360
セーレン	27.1	28	36,232
東海染工	15	16	2,160
小松精練	18.1	17.3	11,072
ワコールホールディングス	65	67	93,130
ホギメディカル	6.8	7.1	42,955
レナウン	26.3	30.7	3,499

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
クラウディア	2.5	2.9	1,557	
T S Iホールディングス	48.5	50.2	38,352	
三陽商会	57	63	16,191	
ナイガイ	40	41	2,009	
オンワードホールディングス	78	75	57,375	
ルック	18	20	3,100	
キムラタン	484	478	2,868	
ゴールドウイン	25	4.8	22,752	
デサント	24.8	25.6	41,472	
キング	5.4	5.6	2,223	
ヤマトインターナショナル	7.1	7	2,737	
パルプ・紙 (0.3%)				
特種東海製紙	63	65	26,065	
王子ホールディングス	446	461	214,826	
日本製紙	52.4	58.1	121,661	
三菱製紙	166	171	14,193	
北越紀州製紙	67.4	69.8	47,813	
中越パルプ工業	41	45	8,775	
巴川製紙所	17	17	3,400	
大王製紙	48	49.8	48,804	
レンゴー	96	99	57,519	
トーモク	34	35	9,695	
ザ・バック	7.7	8	21,352	
化学 (6.1%)				
クラレ	185	177.4	235,587	
旭化成	678	701	510,468	
共和レザー	7.1	7.4	6,578	
コープケミカル	16	—	—	
昭和電工	723	749	84,637	
住友化学	800	828	424,764	
日本化成	20	21	2,499	
住友精化	23	23	14,536	
日産化学工業	71.3	67.6	196,580	
ラサ工業	41	42	4,620	
クレハ	76	85	30,005	
多木化学	7	7	4,697	
テイカ	18	19	10,374	
石原産業	182	202	15,554	
片倉コープアグリ	7	14	3,318	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日東エフシー	—	6.6	5,867	
日本曹達	70	73	41,099	
東ソー	271	303	146,955	
トクヤマ	169	186	31,806	
セントラル硝子	111	122	74,908	
東亜合成	136	70.4	64,627	
大阪ソーダ	43	48	20,112	
関東電化工業	26	27	21,789	
デンカ	225	233	107,646	
信越化学工業	194.9	201.7	1,189,626	
日本カーバイド工業	37	38	4,978	
堺化学工業	44	45	13,860	
エア・ウォーター	96	93	156,798	
大陽日酸	140	86.6	92,575	
日本化学工業	40	42	9,030	
日本パーカラライジング	25.6	57.5	58,477	
高圧ガス工業	16	17	11,118	
チタン工業	13	13	2,483	
四国化成工業	16	16	15,408	
戸田工業	22	22	6,798	
ステラ ケミファ	5.5	5.7	12,431	
保土谷化学工業	33	34	6,460	
日本触媒	85	16.3	94,377	
大日精化工業	45	43	20,425	
カネカ	147	152	146,072	
三菱瓦斯化学	187	193	117,923	
三井化学	494	477	178,398	
J S R	107.3	105.5	172,809	
東京応化工業	22.5	22.6	65,110	
大阪有機化学工業	7.8	8	4,688	
三菱ケミカルホールディングス	679.3	753.2	454,857	
日本合成化学工業	25	26	18,356	
ダイセル	152.8	158.1	236,359	
住友ベークライト	102	105	46,830	
積水化学工業	252	255.3	350,782	
日本ゼオン	94	97	70,907	
アイカ工業	32.7	33.8	77,334	
宇部興産	547	602	121,002	
積水樹脂	16.8	17.3	25,880	

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
タキロン	23	26	14,456	
旭有機材工業	38	36	7,776	
日立化成	53.7	55.6	112,868	
ニチバン	11	11	7,227	
リケンテクノス	17.6	18.3	7,411	
大倉工業	26	27	8,019	
積水化成成品工業	31	29	9,976	
群栄化学工業	29	30	9,000	
タイガースポリマー	5.3	5.5	3,360	
ミライアル	3.9	4	3,348	
ダイキアクシス	1.2	2.1	1,873	
ダイキョーニシカワ	2.6	14.5	22,330	
日本化薬	71	73	82,563	
カーリットホールディングス	8.6	10.4	5,366	
日本精化	9	9.3	7,319	
扶桑化学工業	—	7.1	11,942	
ADEKA	50.1	55.3	88,645	
日油	90	86	69,574	
新日本理化	17.1	17.9	2,488	
ハリマ化成グループ	9.2	9.6	5,299	
花王	292.2	302.4	1,846,454	
第一工業製薬	24	25	8,625	
ニイタカ	—	1.6	2,102	
三洋化成工業	34	35	27,895	
大日本塗料	62	64	12,864	
日本ペイントホールディングス	94	86.8	220,819	
関西ペイント	132	127.2	224,889	
神東塗料	8	8	1,432	
中国塗料	31	32	24,448	
日本特殊塗料	8.4	7.9	7,370	
藤倉化成	14.8	15.3	7,833	
太陽ホールディングス	8.8	8.2	30,709	
D I C	435	444	115,440	
サカタインクス	22.2	23	27,301	
東洋インキＳＣホールディングス	107	111	50,838	
T&K TOKA	3.6	8.1	7,808	
富士フイルムホールディングス	248.7	257.3	1,166,598	
資生堂	193.3	213.3	543,381	
ライオン	125	130	165,620	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
高砂香料工業	36	7.4	18,773	
マンダム	10.9	10.5	51,922	
ミルボン	6.4	6.6	29,898	
ファンケル	25.2	26.1	41,786	
コーセー	17.6	18.2	198,380	
コタ	3.1	3.5	4,704	
シーズ・ホールディングス	7.4	14.2	33,100	
シーボン	1.2	1.3	3,307	
ポーラ・オルビスホールディングス	12.9	11.5	107,985	
ノエビアホールディングス	6.9	7.1	23,607	
アジupanコスメジャパン	2	2.1	1,955	
エステー	7.4	7.7	8,870	
アグロ カネショウ	2.9	4.4	4,637	
コニシ	8.5	8.8	23,865	
長谷川香料	13.8	14.2	24,140	
星光PMC	5.9	6.1	6,996	
小林製薬	17.8	17	169,320	
荒川化学工業	9.2	9.6	9,264	
メック	8.4	8.7	7,447	
日本高純度化学	3.1	3.2	6,688	
J C U	3	3.3	12,391	
新田ゼラチン	6.5	7.3	5,526	
OATアグリオ	—	1	1,430	
デクセリアルズ	—	25.2	29,509	
アース製薬	7.8	8.1	36,612	
イハラケミカル工業	16.7	17.3	24,444	
北興化学工業	12	12	3,660	
大成ラミック	3	3.2	9,712	
クミアイ化学工業	22.4	23.2	23,501	
日本農薬	24.8	25.7	14,623	
アキレス	92	92	13,708	
有沢製作所	18.2	16.6	9,910	
日東電工	84	86.9	560,765	
レック	3.7	3.5	4,669	
きもと	19.4	18.4	3,201	
藤森工業	9.3	9.6	25,238	
前澤化成工業	7.6	7.9	8,405	
J S P	8.1	7.3	15,716	
エフビコ	9.6	10	47,350	

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
天馬	8.4	8.6	16,185	
信越ポリマー	21.3	22	13,508	
東リ	28	29	8,497	
ニフコ	24.2	21.5	116,960	
日本バルカー工業	45	44	13,156	
ユニ・チャーム	220	227.6	570,024	
医薬品 (5.7%)				
協和発酵キリン	130	134.5	239,813	
武田薬品工業	407.1	447.8	2,430,210	
アステラス製薬	1,237.5	1,259	1,955,856	
大日本住友製薬	76.9	79.6	103,559	
塩野義製薬	169.7	163.9	896,533	
田辺三菱製薬	126.6	131	262,393	
わかもと製薬	12	13	3,458	
あすか製薬	12.8	14.3	19,691	
日本新薬	25	25.8	108,231	
ピオフェルミン製薬	1.8	1.8	6,858	
中外製薬	108.2	111.9	381,019	
科研製薬	37	19.4	133,084	
エーザイ	143.3	138.4	962,433	
ロート製薬	49.4	55	116,490	
小野薬品工業	49.4	51.1	1,190,885	
久光製薬	30.7	34.9	174,325	
有機合成薬品工業	7	7	1,764	
持田製薬	7.8	7.7	62,832	
参天製薬	39.9	207	349,623	
扶桑薬品工業	37	38	10,602	
日本ケミファ	14	16	8,000	
ツムラ	34.2	35.4	97,243	
日医工	25.4	26.3	69,063	
キッセイ薬品工業	20.2	19.9	51,879	
生化学工業	20.8	21.5	33,110	
栄研化学	9.1	9.4	20,933	
日水製薬	4.4	4.5	5,976	
鳥居薬品	7.4	7.7	20,227	
JCRファーマ	8.4	8.6	20,124	
東和薬品	5.5	5.2	24,518	
富士製薬工業	3.1	3.1	5,927	
沢井製薬	17.2	19.1	135,801	

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
ゼリア新薬工業	22.2	23	34,132	
第一三共	365.4	378.1	957,160	
キョーリン製薬ホールディングス	29	30	64,980	
大幸薬品	4.8	5.5	7,612	
ダイト	4.4	4.7	13,921	
大塚ホールディングス	215.6	241.7	1,005,472	
大正製薬ホールディングス	26.1	27	243,810	
ペプチドリーム	—	13.8	82,524	
石油・石炭製品 (0.5%)				
日本コークス工業	97.4	90.7	7,437	
昭和シェル石油	97.1	113.1	112,308	
コスモ石油	300	—	—	
ニチレキ	13	13.7	11,398	
東燃ゼネラル石油	164	170	171,360	
ユシロ化学工業	6.4	6	8,040	
ピーピー・カストロール	4.4	4.6	5,846	
富士石油	25.2	26.1	8,117	
MORESCO	2.8	3.5	4,718	
出光興産	51.5	58.7	115,580	
JXホールディングス	1,205.8	1,330.9	595,178	
コスモエネルギーホールディングス	—	33.9	42,849	
ゴム製品 (1.0%)				
横浜ゴム	121	67.8	131,871	
東洋ゴム工業	49.2	50.9	85,664	
ブリヂストン	340.5	379.5	1,595,038	
住友ゴム工業	84.7	105.2	181,575	
藤倉ゴム工業	9.1	9.5	4,227	
オカモト	37	35	32,095	
フコク	4.5	4.1	3,792	
ニッタ	10.7	12.1	34,908	
住友理工	20.1	24.3	23,692	
三ツ星ベルト	28	27	23,463	
パンドー化学	40	41	20,664	
ガラス・土石製品 (0.9%)				
日東紡績	80	74	26,936	
旭硝子	535	593	357,579	
日本板硝子	524	542	43,360	
石塚硝子	14	16	3,440	
日本山村硝子	43	45	7,830	

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
日本電気硝子	208	232	134,096	
オハラ	4.1	4.2	2,318	
住友大阪セメント	202	223	98,789	
太平洋セメント	678	701	185,064	
デイ・シイ	11.1	10.5	3,811	
日本ヒューム	11.3	10.8	6,404	
日本コンクリート工業	18.6	23.1	6,352	
三谷セキサン	5.4	5.6	9,077	
アジアパイルホールディングス	14.5	13.9	5,838	
東海カーボン	94	97	25,317	
日本カーボン	57	55	13,255	
東洋炭素	6	6.2	8,859	
ノリタケカンパニーリミテド	61	63	16,254	
TOTO	160	82.6	294,882	
日本碍子	137	142	292,946	
日本特殊陶業	93.6	96.9	211,726	
ダントーホールディングス	14	13	2,522	
MARUWA	3.2	4.1	11,389	
品川リフラクトリーズ	27	28	5,768	
黒崎播磨	23	24	6,360	
ヨータイ	6	6	1,812	
イソライト工業	5.4	5.6	1,086	
東京窯業	13	13.8	2,470	
ニッカトー	3.9	4	1,548	
フジミインコーポレーテッド	10.5	9.9	14,701	
エーアンドエーマテリアル	23	23	1,817	
ニチアス	48	57	39,786	
ニチハ	14.4	14.9	26,089	
鉄鋼 (1.2%)				
新日鐵住金	4,592	506.8	1,105,584	
神戸製鋼所	1,878	2,065	214,760	
中山製鋼所	81	126	8,442	
合同製鐵	55	63	12,159	
ジェイ エフ イー ホールディングス	277.1	307.2	475,699	
日新製鋼	46	51.3	68,485	
東京製鐵	54.9	62	41,416	
共英製鋼	11.6	12	21,156	
大和工業	24.7	24.8	61,876	
東京鐵鋼	21	23	8,372	

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
大阪製鐵	6.8	7	13,188	
淀川製鋼所	77	16.7	40,664	
東洋鋼板	26	26.9	8,930	
丸一鋼管	33.3	37.6	119,004	
モリ工業	17	18	5,616	
大同特殊鋼	182	188	75,952	
日本高周波鋼業	43	44	3,520	
日本冶金工業	84.9	82.7	11,412	
山陽特殊製鋼	65	67	34,907	
愛知製鋼	64	66	29,238	
日立金属	111	128.7	151,866	
日本金属	28	29	2,958	
大平洋金属	69	78	26,598	
新日本電工	66.2	63.6	11,638	
栗本鐵工所	56	54	8,424	
缸技	15	16	2,688	
日本鑄鐵管	11	12	1,680	
三菱製鋼	71	78	14,508	
日亜鋼業	15	15.5	3,921	
日本精線	8	8	3,800	
シンニッタン	11.2	10.1	6,948	
新家工業	21	22	2,948	
非鉄金属 (0.8%)				
大紀アルミニウム工業所	18	17	4,896	
日本軽金属ホールディングス	263.4	254.4	48,844	
三井金属鋁業	295	286	52,624	
東邦亜鉛	61	59	17,759	
三菱マテリアル	678	701	232,031	
住友金属鋁山	300	310	367,970	
DOWAホールディングス	130	145	99,325	
古河機械金属	169	175	30,625	
エス・サイエンス	52.6	51.5	1,802	
大阪チタニウムテクノロジーズ	10.7	11	17,149	
東邦チタニウム	18.4	19	17,328	
UACJ	124	157	36,738	
古河電気工業	319	353	85,426	
住友電気工業	409.2	449.9	626,485	
フジクラ	151	156	86,736	
昭和電線ホールディングス	119	134	8,710	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東京特殊電線	1.5	1.6	1,452	
タツタ電線	20.3	23.4	8,564	
沖電線	11	13	2,795	
カナレ電気	1.7	1.8	3,330	
平河ヒューテック	2.6	5.3	4,971	
リョービ	61	68	30,056	
アーレスティ	9.4	13	9,880	
アサヒホールディングス	16.3	16.9	25,907	
金属製品 (0.7%)				
稲葉製作所	4.6	6	7,806	
宮地エンジニアリンググループ	31	35	5,145	
トーカロ	7.1	7.9	16,977	
アルファC o	3.6	3.7	4,236	
SUMCO	74.7	88	65,120	
川田テクノロジーズ	2	2.1	7,518	
東洋製織グループホールディングス	77.2	79.9	171,305	
ホッカンホールディングス	26	29	9,048	
コロナ	5.7	5.9	6,478	
横河ブリッジホールディングス	20.5	21.3	24,984	
駒井ハルテック	19	20	4,800	
高田機工	9	10	2,070	
三和ホールディングス	104.7	113.8	94,681	
文化シャッター	30	31.3	29,860	
三協立山	14.2	14.7	21,535	
アルインコ	4.6	6.3	6,419	
東洋シャッター	2.7	2.8	1,584	
L I X I Lグループ	161.3	156.5	365,114	
日本フィルコン	7.9	8.2	3,526	
ノーリツ	21.3	22	39,974	
長府製作所	11.6	12	30,612	
リンナイ	20.2	20.9	212,135	
ダイニチ工業	5.5	5.7	3,511	
日東精工	15	16	4,608	
三洋工業	14	14	2,212	
岡部	21.4	23.3	18,057	
ジーテクト	7.4	11.7	15,572	
中国工業	1.7	1.7	1,190	
東プレ	20.9	21.6	46,396	
高周波熱練	18.7	20.9	16,448	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東京製綱	73	76	12,540	
サンコール	7	6	3,132	
モリテック スチール	5.5	5.7	1,556	
バイオラックス	5.5	5.7	32,034	
日本発條	94.3	105.8	115,216	
中央発條	14	14	4,116	
アドバネクス	20	2.1	2,727	
立川ブラインド工業	—	4.7	3,275	
三益半導体工業	8	8.3	8,640	
機械 (4.6%)				
日本ドライケミカル	1.5	1.4	3,224	
日本製鋼所	156	186	69,750	
三浦工業	48.4	50.1	104,608	
タクマ	37	42	45,192	
ツガミ	31	32	13,344	
オークマ	71	73	59,568	
東芝機械	59	61	21,411	
アマダホールディングス	161.9	163.9	182,420	
アイダエンジニアリング	23.7	29.5	29,087	
滝澤鉄工所	34	35	4,585	
富士機械製造	35.5	36.7	43,416	
牧野フライス製作所	54	56	39,984	
オーエスジー	49.5	51.2	106,342	
ダイジェット工業	13	13	1,872	
旭ダイヤモンド工業	29.7	30.8	31,323	
DMG森精機	68.5	62	64,852	
ソディック	—	21.4	18,297	
ディスコ	12.6	14.3	134,849	
日東工器	6.3	6.5	14,397	
パンチ工業	2.9	4.4	3,467	
豊和工業	6.1	6.3	3,578	
OKK	42	43	5,203	
石川製作所	27	28	2,212	
東洋機械金属	7.4	8.4	2,923	
津田駒工業	26	27	2,862	
エンシュウ	27	28	2,128	
島精機製作所	15.3	15.9	29,971	
フリーユー	—	1.7	4,991	
日阪製作所	13.7	14.2	11,644	

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
やまびこ	4.3	20.6	16,830
ベガサスミシン製造	9.5	11.6	6,159
ナブテスコ	66.1	58.4	140,627
三井海洋開発	10.9	13.2	22,255
レオン自動車	8.3	9.5	6,697
SMC	32.6	33.7	879,401
新川	9	10	4,920
ホソカワミクロン	18	19	10,944
ユニオンツール	5.4	4.9	13,911
オイレス工業	13.6	14.5	25,244
日精エー・エス・ビー機械	3.5	4.1	8,954
サトーホールディングス	13.5	15.1	35,318
日本エアータック	3.2	3.9	2,453
日精樹脂工業	7.9	8.2	5,756
ワイエイシイ	4.4	4.5	4,077
小松製作所	538.4	550.8	1,068,276
住友重機械工業	297	328	156,128
日立建機	48.5	50.2	90,159
日工	15	17	5,882
巴工業	4.1	4.6	6,693
井関農機	111	115	25,990
TOWA	8.9	10.8	7,754
丸山製作所	24	23	4,140
北川鉄工所	50	51	11,118
タカキタ	—	2.8	1,442
クボタ	524	539.5	835,955
荏原実業	3.2	3.4	4,059
三菱化工機	36	37	8,843
月島機械	19.1	21.3	20,724
帝国電機製作所	7.2	8.2	6,002
東京機械製作所	41	43	1,849
新東工業	25.5	25.5	25,041
澁谷工業	9.1	9.4	12,267
アイチ コーポレーション	15.4	15.9	12,131
小森コーポレーション	26.4	27.3	35,899
鶴見製作所	8.1	8.3	14,002
住友精密工業	17	18	6,426
酒井重工業	21	21	3,948
荏原製作所	225	248	117,304

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
石井鐵工所	16	16	2,624
西島製作所	10.6	12	11,928
北越工業	8	12.1	8,639
ダイキン工業	151.1	156.3	1,313,076
オルガノ	21	19	8,189
トーヨーカネツ	63	60	14,940
栗田工業	61.4	67.5	171,855
椿本チエイン	55	64	43,072
大同工業	21	22	4,488
日本コンパヤ	34	37	5,550
木村化工機	10	9.7	3,783
アネスト岩田	16.2	18.1	19,095
ダイフク	51.3	57.7	110,610
サムコ	1.4	1.8	1,672
加藤製作所	23	25	11,375
油研工業	20	21	4,242
タダノ	50	52	54,392
フジテック	30.2	31.3	35,713
CKD	29.1	29.9	28,285
キトー	11.3	13.5	11,596
平和	22.5	33.3	80,286
理想科学工業	12.6	11.9	21,122
SANKYO	31.4	29.9	128,121
日本金銭機械	9.6	9.9	9,266
マースエンジニアリング	5.9	6.1	12,120
福島工業	5.7	6.6	16,671
オーイズミ	3.6	4.5	2,286
ダイコク電機	4.3	4.4	6,226
竹内製作所	—	15.9	25,392
アマノ	34.6	33.2	57,436
JUKI	77	15.9	16,170
サンデンホールディングス	63	65	22,425
蛇の目シン工業	101	10.4	6,520
マックス	16	17	20,961
グローリー	33.2	36.6	138,348
新晃工業	7.2	7.5	12,652
大和冷機工業	15	17.2	16,494
セガサミーホールディングス	111.5	115.4	145,057
日本ビストンリング	40	4.5	7,159

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
リケン	45	50	18,550	
T P R	11.6	13.2	39,006	
ツバキ・ナカシマ	—	9.9	15,156	
ホシザキ電機	22.7	23.5	224,190	
大豊工業	8.4	8.7	9,909	
日本精工	213	220.5	227,997	
NTN	240	266	96,292	
ジェイテクト	110.6	114.4	170,570	
不二越	96	100	39,800	
日本トムソン	36	37	14,689	
THK	69	71.4	144,442	
ユーシン精機	4.6	4.2	8,001	
前澤給装工業	3.9	4.4	6,569	
イーグル工業	14.4	13.3	20,482	
前澤工業	7.6	7.9	2,377	
日本ビラー工業	11.3	10.9	10,605	
キッツ	46.5	52.2	26,778	
日立工機	27.8	28.7	21,266	
マキタ	67.7	70	495,600	
日立造船	81.1	85.1	45,954	
三菱重工業	1,739	1,912	823,116	
I H I	747	825	187,275	
電気機器 (11.5%)				
日清紡ホールディングス	—	59.6	69,732	
イビデン	68	65.7	90,206	
コニカミノルタ	247.2	268.1	265,955	
ブラザー工業	134.1	138.8	183,632	
ミネベア	154	173	153,105	
日立製作所	2,491	2,739	1,447,561	
東芝	2,184	2,260	470,758	
三菱電機	1,037	1,145	1,356,252	
富士電機	289	323	127,262	
東洋電機製造	20	21	7,917	
安川電機	122.1	133.3	171,023	
シンフォニアテクノロジー	72	70	11,200	
明電舎	95	99	51,579	
オリジン電気	15	16	4,544	
山洋電気	23	28	14,644	
デンヨー	9.4	9.9	11,454	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東芝テック	74	77	33,418	
芝浦メカトロニクス	17	17	3,740	
マブチモーター	31.7	30.7	158,412	
日本電産	112.2	129.2	1,044,065	
東光高岳	5.2	6	8,724	
ダブル・スコープ	—	3.2	16,352	
宮越ホールディングス	3.5	3.7	1,435	
ダイヘン	57	63	32,634	
田淵電機	8.8	12.2	6,478	
ヤーマン	1.3	1.4	3,010	
J V Cケンウッド	76.1	78.8	22,930	
ミマキエンジニアリング	—	7.2	4,485	
第一精工	3.8	4.5	5,602	
日新電機	24	25.2	31,374	
大崎電気工業	17	20	15,700	
オムロン	112	121.2	412,080	
日東工業	16.6	17.2	31,114	
I D E C	12.3	14	15,316	
不二電機工業	1	1	1,397	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	200	207	100,395	
サクサホールディングス	26	27	5,886	
メルコホールディングス	5.7	5.9	13,988	
テクノメディカ	2.3	2.4	5,090	
日本電気	1,342	1,476	413,280	
富士通	1,000	1,035	431,595	
沖電気工業	359	465	73,005	
岩崎通信機	45	50	3,700	
電気興業	29	28	14,840	
サンケン電気	53	59	20,532	
ナカヨ	10	10	3,600	
アイホン	6	6.1	11,791	
ルネサスエレクトロニクス	53.7	55.6	41,422	
セイコーエプソン	70.8	159.9	300,292	
ワコム	81.7	84.5	42,250	
アルバック	17.7	19.7	68,063	
アクセル	4.8	4.8	4,276	
E I Z O	9.5	10.6	30,157	
ジャパンディスプレイ	159.8	200.5	42,907	
日本信号	28.6	29.6	26,995	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
京三製作所	24	25	9,000	
能美防災	13.7	12.2	19,995	
ホーチキ	7.5	7.8	10,311	
エレコム	3.2	9.3	17,251	
日本無線	22	28	8,400	
パナソニック	1,264.3	1,226.5	1,225,886	
シャープ	877	907	114,282	
アンリツ	64.9	64.5	43,795	
富士通ゼネラル	32	33	55,968	
日立国際電気	27	24.6	32,472	
ソニー	678	757.5	2,193,720	
TDK	62.6	64.8	415,368	
帝国通信工業	25	25	4,450	
ミツミ電機	36.6	40.8	23,460	
タムラ製作所	40	41	12,341	
アルプス電気	81.9	91.1	189,396	
池上通信機	35	34	4,862	
バイオニア	155.9	173.7	46,725	
日本電波工業	9.4	9.7	7,275	
鈴木	1.3	3.1	1,596	
日本トリム	2.5	2.9	15,979	
ローランド ディー. ジー.	4.2	5.3	11,850	
フォスター電機	10.6	13.5	32,319	
クラリオン	55	57	19,380	
SMK	31	32	18,656	
ヨコオ	8.1	7.6	4,020	
東光	24	22	8,272	
ティアック	56	78	3,354	
ホシデン	31.4	32.5	21,255	
ヒロセ電機	16.8	17.3	219,191	
日本航空電子工業	30	31	40,362	
TOA	11.1	12.7	13,944	
日立マクセル	15.5	17.8	30,669	
古野電気	12.3	12.8	8,601	
ユニデンホールディングス	28	34	4,488	
アルパイン	24.7	25.6	33,024	
スミダコーポレーション	9.3	8.8	6,512	
アイコム	5.7	5.9	12,649	
リオン	2.9	4.1	6,629	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
船井電機	10.5	10.8	10,530	
横河電機	103.8	107.5	124,055	
新元元工業	40	38	15,618	
アズビル	33.9	35.1	99,719	
東亜ディーケーケー	4.3	4.5	2,389	
日本光電工業	22.1	44.9	130,524	
チノー	3.7	3.8	4,176	
共和電業	12.7	13.2	5,029	
日本電子材料	4.4	4.3	1,909	
堀場製作所	19.2	19.8	82,269	
アドバンテスト	70.7	73.2	77,592	
小野測器	5.2	5.2	3,764	
エスベック	11.5	11.1	16,372	
パナソニック デバイスSUNX	9.1	9.4	5,724	
キーエンス	23.5	24.3	1,470,150	
日置電機	5.4	5.6	13,636	
シスメックス	80.3	83.3	588,098	
日本マイクロニクス	—	14	15,750	
メガチップス	10.8	11.2	14,739	
OBARA GROUP	6.7	7	28,490	
澤藤電機	6	6	1,116	
コーセル	15.1	14.9	16,509	
新日本無線	8	7.9	3,476	
オブテックス	7.1	7.9	26,465	
千代田インテグレ	4.6	5.7	14,478	
レーザーテック	10.6	12.6	19,479	
スタンレー電気	74.5	77	194,425	
岩崎電気	35	37	6,919	
ウシオ電機	63	65.2	97,474	
岡谷電機産業	5.6	5.8	2,262	
ヘリオス テクノ ホールディング	9.6	9.2	3,864	
日本セラミック	5.9	6.1	11,962	
遠藤照明	4.8	5.4	5,659	
日本デジタル研究所	8.7	9.1	14,596	
古河電池	7	8	5,312	
双信電機	5.1	5.2	1,450	
山一電機	12	9.3	5,440	
図研	7.5	7.8	9,375	
日本電子	44	42	22,554	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
カシオ計算機	104	107.6	243,391	
ファナック	108	109.8	1,930,833	
日本シイエムケイ	26.4	23.1	10,140	
エンブラス	4.7	5.5	23,045	
大真空	19	20	4,880	
ローム	51.1	52.9	262,384	
浜松ホトニクス	43.2	83.8	262,294	
三井ハイテック	13.7	15.6	10,935	
新光電気工業	39.2	40.6	26,633	
京セラ	170.3	176.2	888,048	
太陽誘電	54.3	52.2	61,074	
村田製作所	108.8	112.6	1,587,660	
ユーシン	14.4	14.2	9,741	
双葉電子工業	17.7	18.4	29,495	
北陸電気工業	45	43	6,020	
ニチコン	32.7	33.8	27,141	
日本ケミコン	84	87	14,181	
KOA	14.3	14.8	12,876	
市光工業	25	26	5,902	
小糸製作所	62.2	64.3	327,287	
ミツバ	19.1	18.2	30,903	
スター精密	19.7	20.4	24,949	
SCREENホールディングス	98	110	91,300	
キャノン電子	9.5	9.8	16,513	
キャノン	601.5	578	1,949,594	
リコー	311.9	347.6	410,168	
MUTOHホールディングス	14	13	3,289	
東京エレクトロン	87.3	88.1	643,570	
輸送用機器 (9.9%)				
トヨタ紡織	36.3	37.5	70,387	
鬼怒川ゴム工業	24	25	19,225	
ユニプレス	19.9	22.3	44,689	
豊田自動織機	94.5	97.8	497,802	
モリタホールディングス	18.1	18.8	25,756	
三櫻工業	13.2	13.6	8,704	
デンソー	256.3	265.2	1,197,908	
東海理化電機製作所	27.3	31.4	67,070	
三井造船	402	415	70,550	
川崎重工業	754	835	268,870	

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
名村造船所	28.9	32.2	27,724	
サノヤスホールディングス	12.6	13.2	3,115	
日本車輛製造	38	44	12,056	
ニチユ三菱フォークリフト	11.9	12.5	5,737	
近畿車輛	16	16	5,312	
日産自動車	1,456.2	1,506.9	1,639,507	
いすゞ自動車	328	311.1	375,964	
トヨタ自動車	1,431.3	1,335.2	8,251,536	
日野自動車	148.1	153.2	192,266	
三菱自動車工業	380.2	426.3	367,044	
エフテック	5.9	5.6	6,070	
レシップホールディングス	3.4	3.5	2,719	
GMB	1.5	1.7	1,368	
ファルテック	1.1	1.9	2,760	
武蔵精密工業	11.1	11.4	26,254	
日産車体	45.6	52.4	59,945	
新明和工業	42	47	37,600	
極東開発工業	19.3	21.4	24,417	
日信工業	19	24	37,032	
トビー工業	85	88	20,856	
ティラド	40	42	8,148	
曙ブレーキ工業	43.8	54.4	14,960	
タチエス	16.4	17	28,594	
NOK	50.2	51.9	100,478	
フタバ産業	31.6	32.7	15,238	
KYB	116	120	38,880	
シロキ工業	23	27	8,694	
大同メタル工業	14.5	15	13,350	
プレス工業	51	57	22,971	
ミクニ	—	10.3	3,924	
カルソニックカンセイ	79	82	67,322	
太平洋工業	21.1	23.8	26,370	
ケーヒン	23.8	24.7	41,471	
河西工業	12.7	13.2	15,985	
アイシン精機	94.9	108	471,960	
富士機工	12	12.5	5,812	
マツダ	309.2	339.9	589,896	
ダイハツ工業	123.8	128.1	207,393	
今仙電機製作所	8.8	9.8	9,770	

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
本田技研工業	933.6	966.1	2,988,147	
スズキ	216.9	224.4	675,444	
富士重工業	353.1	339.2	1,377,152	
安永	3.4	3.6	1,918	
ヤマハ発動機	157.8	151.6	273,638	
ショーワ	24.5	27.9	27,676	
TBK	13.3	12.9	5,379	
エクセディ	14.1	14.6	37,157	
豊田合成	33.5	39	86,268	
愛三工業	16.1	18.8	17,164	
盟和産業	8	1.3	1,409	
ヨロズ	9.7	10	24,010	
エフ・シー・シー	15.3	17.5	33,652	
シマノ	44.8	43.3	779,400	
タカタ	18.8	19.4	9,797	
ティ・エス テック	21.9	24.9	65,960	
ジャムコ	—	4.7	13,540	
精密機器 (1.6%)				
テルモ	159	164.6	683,090	
クリエートメディック	3.4	3.5	3,013	
日機装	33.6	38.6	31,150	
島津製作所	124	138	239,016	
JMS	19	20	5,880	
クボテック	2.2	2.3	1,159	
モリテックス	2.4	2.3	657	
長野計器	6.6	6.5	4,251	
ブイ・テクノロジー	2	2.6	13,156	
東京計器	36	34	5,780	
愛知時計電機	14	14	4,326	
オーバル	7.6	10.6	2,692	
東京精密	18.6	20.7	47,547	
マニー	2.9	9.8	18,669	
ニコン	193.7	200.4	361,120	
トプコン	31.3	36	53,928	
オリンパス	154.5	159.9	671,580	
理研計器	9.1	8.7	9,126	
タムロン	8	8.7	16,086	
HOYA	246.9	249.8	1,112,359	
ノーリツ鋼機	9.3	9.7	4,520	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
エー・アンド・デイ	9.4	9.8	3,900	
シチズンホールディングス	127.7	132.1	86,393	
リズム時計工業	45	47	7,144	
大研医器	7.2	8.5	7,624	
メニコン	—	5.4	21,141	
松風	5.1	5.2	7,462	
セイコーホールディングス	73	69	31,395	
ニプロ	66.3	80	86,240	
その他製品 (1.6%)				
スノーピーク	—	0.9	3,163	
パラマウントベッドホールディングス	10.9	11.3	47,064	
トランザクション	—	1.6	1,043	
SHO-BI	3.5	3.6	1,418	
ニホンフラッシュ	—	3.1	3,437	
前田工織	10.3	11.8	13,216	
永大産業	15	15	6,270	
アートネイチャー	7.5	8.6	8,892	
ダンロップスポーツ	6.5	6.8	6,514	
バンダイナムコホールディングス	114.4	111	266,733	
アイフィスジャパン	—	1.8	766	
共立印刷	18.8	17.8	5,126	
SHOEI	—	5.2	9,495	
フランスベッドホールディングス	72	15	15,360	
パイロットコーポレーション	9	18.7	80,129	
萩原工業	2.2	2.2	4,985	
トッパン・フォームズ	18.5	19.2	24,019	
フジシールインターナショナル	12.6	13	51,350	
タカラトミー	37.2	35.3	30,463	
廣済堂	9.6	10.1	3,373	
A s o m e エステール	2.8	2.9	1,914	
アーク	32.7	45.6	4,058	
タカノ	4.6	4.7	2,965	
プロネクス	10.5	10	12,090	
ホクシン	8.4	8.6	1,014	
ウツドワン	17	20	5,100	
大建工業	42	42	13,020	
凸版印刷	293	303	297,243	
大日本印刷	316	318	332,628	
図書印刷	17	20	10,780	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
共同印刷	32	36	12,132	
日本写真印刷	17.4	18	30,438	
光村印刷	9	11	2,442	
宝印刷	5.4	5.2	6,910	
アシックス	103.1	100	204,300	
ツツミ	5.2	5.4	13,489	
小松ウオール工業	3.2	3.6	6,739	
ヤマハ	76.2	78.9	276,544	
河合楽器製作所	3.6	4	7,988	
クリナップ	9.5	12.6	9,651	
ビジョン	19.6	60.8	176,441	
兼松日産農林	13	11	1,672	
キングジム	8.6	8.9	7,431	
リンテック	24.7	25.5	53,805	
TASAKI	1.9	2	3,464	
イトーキ	21.8	22.6	18,238	
任天堂	63.9	66.1	1,111,471	
三菱鉛筆	8.5	8	37,960	
タカラスタンダード	43	44	46,288	
コクヨ	53.9	55.8	72,986	
ナカバヤシ	22	22	6,028	
グローブライド	50	5.2	7,472	
岡村製作所	39.8	37.5	40,200	
美津濃	56	58	31,204	
アデランス	12	18.6	12,331	
電気・ガス業 (2.1%)				
東京電力	880	910.7	533,670	
中部電力	317.4	328.5	511,967	
関西電力	423.3	438.1	434,770	
中国電力	143.4	148.4	226,755	
北陸電力	101.6	105.2	167,583	
東北電力	259.2	268.2	389,694	
四国電力	93.4	96.7	144,179	
九州電力	229.1	237.1	249,429	
北海道電力	97.1	100.5	94,369	
沖縄電力	6.8	11.4	33,356	
電源開発	75.2	91.5	318,420	
イーレックス	—	2.1	3,460	
東京瓦斯	1,261	1,198	630,866	

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
大阪瓦斯	1,074	1,111	479,729	
東邦瓦斯	264	271	215,716	
北海道瓦斯	20	26	7,280	
広島ガス	—	18.7	7,236	
西部瓦斯	117	121	31,944	
静岡ガス	29.5	30.5	23,790	
メタウォーター	4.8	6.9	18,623	
陸運業 (4.6%)				
SBSホールディングス	7.7	10.6	7,759	
東武鉄道	554	574	327,180	
相鉄ホールディングス	178	184	127,144	
東京急行電鉄	564	625	593,750	
京浜急行電鉄	284	294	289,884	
小田急電鉄	332	344	424,496	
京王電鉄	290	300	298,800	
京成電鉄	156	161	251,482	
富士急行	28	29	43,036	
新京成電鉄	13	14	6,300	
東日本旅客鉄道	190.1	196.3	1,979,685	
西日本旅客鉄道	99.9	103.3	737,148	
東海旅客鉄道	92.9	96.1	1,964,764	
西武ホールディングス	82.7	85.5	200,326	
鴻池運輸	6.4	15.2	19,684	
西日本鉄道	134	139	106,196	
ハマキョウレックス	3.2	8.2	15,875	
サカイ引越センター	1.8	4.2	14,637	
近鉄グループホールディングス	1,044	1,080	506,520	
阪急阪神ホールディングス	696	720	515,520	
南海電気鉄道	232	241	146,769	
京阪電気鉄道	232	241	194,969	
神戸電鉄	25	26	9,568	
名糖運輸	4.3	—	—	
名古屋鉄道	378	391	207,621	
山陽電気鉄道	38	39	19,188	
日本通運	411	415	225,760	
ヤマトホールディングス	182.4	198.4	459,196	
山九	126	141	73,179	
丸運	5.6	5.8	1,484	
丸全昭和運輸	35	36	14,544	

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
センコー	43	48	33,408	
トナミホールディングス	21	22	6,424	
ニッコンホールディングス	33.9	35.1	72,411	
日本石油輸送	12	12	2,880	
福山通運	63	65	36,205	
セイノーホールディングス	80.3	76.1	94,287	
神奈川中央交通	12	13	9,165	
日立物流	21.6	22.4	39,491	
丸和運輸機関	—	2.4	6,216	
C&Fロジホールディングス	—	10.3	8,940	
海運業 (0.2%)				
日本郵船	876	964	212,080	
商船三井	544	523	120,813	
川崎汽船	454	470	104,810	
NSユニテッド海運	45	48	7,872	
明治海運	9.3	9.7	3,579	
飯野海運	53.7	55.5	25,474	
共栄タンカー	9	9	1,341	
第一中央汽船	102	—	—	
乾汽船	—	8.5	7,505	
空運業 (0.7%)				
日本航空	198.6	205.5	866,799	
ANAホールディングス	2,039	1,993	651,312	
バスコ	10	10	4,540	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
トランコム	3	3.1	19,902	
日新	39	44	13,464	
三菱倉庫	68	76	113,240	
三井倉庫ホールディングス	60	62	18,724	
住友倉庫	76	78	44,304	
澁澤倉庫	27	28	8,148	
東陽倉庫	18	18	4,464	
乾汽船	6.9	—	—	
日本トランスシティ	24	25	9,650	
ケイヒン	19	20	3,020	
中央倉庫	6	6.2	6,051	
安田倉庫	8.1	8.3	6,067	
東洋埠頭	32	31	4,774	
宇徳	8.4	8.8	2,992	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
上組	124	128	135,552	
サンリツ	2.5	2.6	1,393	
キムラユニティー	2.6	2.7	3,129	
キューソー流通システム	2.9	3	7,368	
郵船ロジスティクス	9.5	9.9	12,711	
近鉄エクスプレス	9.3	19.2	29,356	
東海運	5.6	5.8	1,664	
エーアイテイー	4.8	4.9	4,650	
内外トランスライン	—	2.7	2,840	
情報・通信業 (8.2%)				
NECネットエスアイ	12.8	13.3	24,339	
システナ	10	10.3	17,849	
デジタルアーツ	5.5	5.2	12,084	
新日鉄住金ソリューションズ	8.5	17.7	39,506	
キューブシステム	4.4	4.6	3,289	
コア	4.3	4.5	6,786	
ソフトクリエイトホールディングス	3.3	3.8	3,138	
ITホールディングス	33.9	35.1	91,856	
ネオス	2.7	3.1	1,608	
電算システム	3.5	3.7	6,019	
グリー	62	64.3	37,744	
コーエーテクモホールディングス	23.1	25.1	45,255	
三菱総合研究所	4	4.1	14,657	
ボルテージ	1.8	2.1	2,610	
電算	1.1	1.2	2,988	
AGS	1.7	1.8	1,776	
ファインデックス	1.5	7	8,890	
ヒト・コミュニケーションズ	1.4	2.4	4,860	
ブレインパッド	1.5	1.6	1,161	
KL a b	10.8	16.4	10,348	
ポルトウウィン・ビットクルーホールディ	6.7	7	6,405	
イーブックイニシアティブジャパン	2.3	2.3	1,474	
ネクソン	97.3	101.3	191,659	
アイスタイル	4.3	16.1	17,597	
エムアップ	2.7	2.7	1,674	
エイチーム	1.2	3.9	6,372	
テクノスジャパン	—	1.1	3,685	
e n i s h	2.7	3.1	1,918	
コロブラ	18	29.4	69,795	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
モバイルクリエイト	6	7	3,269
オルトプラス	1.9	3.9	1,532
ブロードリーフ	8.4	10.9	14,834
ハーツユナイテッドグループ	3.1	3.2	7,532
ブイキューブ	—	5.2	8,002
サイバーリンクス	—	1.2	1,098
VOYAGE GROUP	—	2.4	3,434
オブティム	—	0.7	3,507
ベリサーブ	1.2	1.2	4,536
ティーガイア	10.2	10.5	14,595
日本アジアグループ	—	9	5,031
豆蔵ホールディングス	8	8.3	6,200
テクマトリックス	4.4	4.5	8,356
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	—	185.1	56,085
GMOペイメントゲートウェイ	8.9	9.2	68,172
ザッパラス	5.7	6	2,364
インターネットイニシアティブ	16.7	17.1	38,936
さくらインターネット	—	5.2	7,144
GMOクラウド	1.7	2.3	2,295
ビットアイル	11.6	—	—
SRAホールディングス	5.4	6.1	16,152
Minor iソリューションズ	—	1.5	1,408
システムインテグレータ	1.5	1.5	1,275
パイブドビッツ	1	—	—
朝日ネット	10.5	9.6	4,771
コムチュア	1.7	1.8	4,230
gumi	7.7	10.9	7,139
パイブドHD	—	1.3	1,518
パナソニック インフォメーションシステム	2.4	—	—
フェイス	3.1	2.8	3,712
ハイマックス	—	1.4	1,692
野村総合研究所	58	74.3	280,111
サイバネットシステム	8.4	8.6	7,980
CEホールディングス	1.2	1.6	1,316
インターージホールディングス	5.8	5.5	8,112
東邦システムサイエンス	3	3.1	1,990
ソースネクスト	5.1	5.3	2,321
ディー・ワイ・オー	10	14.7	2,366
クレスコ	2.3	2.4	4,408

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
フジ・メディア・ホールディングス	106.6	110.3	143,059
オービック	35.3	36.5	217,540
ジャストシステム	14	19.3	17,447
TDCソフトウェアエンジニアリング	2.2	2.3	3,270
ヤフー	733.8	759.4	360,715
トレンドマイクロ	54.2	51.4	215,880
インフォメーション・ディベロプメント	1.9	2	1,836
日本オラクル	16.4	17	106,080
アルファシステムズ	3.3	3.5	6,076
フューチャーアーキテクト	10.7	12.7	11,226
CAC Holdings	6.9	7.9	6,375
ソフトバンク・テクノロジー	2.7	2.9	4,329
トーセ	2.5	2.8	1,985
オービックビジネスコンサルタント	6.5	5.4	26,082
伊藤忠テクノソリューションズ	11.6	24	53,184
アイティフォー	12.4	13.7	7,110
東計電算	1.8	1.9	3,775
エクスネット	0.9	1	1,580
大塚商会	27.5	28.5	169,290
サイボウズ	13.7	14.2	4,884
ソフトブレーン	14	15.6	2,511
電通国際情報サービス	6.3	6.5	14,683
EMシステムズ	1.2	1.8	4,696
ウェザーニューズ	3.1	3.6	14,706
C I J	9.3	9.7	4,297
東洋ビジネスエンジニアリング	1	1.1	1,502
日本エンタープライズ	6.9	10.9	2,365
WOWOW	2.4	5	12,870
フュージョンパートナー	4.3	6	3,036
日本コロムビア	3.6	3.6	1,630
イマジカ・ロボット ホールディングス	5.4	9	3,708
ネットワンシステムズ	41.6	45.9	28,320
アルゴグラフィックス	4.2	4.8	8,313
マーベラス	17.3	17.9	17,935
エイベックス・グループ・ホールディングス	20.3	19.5	27,651
日本ユニシス	28.3	29.2	42,252
兼松エレクトロニクス	6.5	6.7	12,957
東京放送ホールディングス	61.3	63.5	110,998
日本テレビホールディングス	93.5	96.7	179,088

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
朝日放送	10.1	10.5	7,392
テレビ朝日ホールディングス	28	28.9	59,273
スカパーJ SATホールディングス	77.7	80.4	52,581
テレビ東京ホールディングス	8.3	9.6	19,372
日本BS放送	—	1.8	1,913
U-NEXT	—	2.5	2,827
コネクシオ	7.2	9.3	11,094
日本通信	—	56.2	11,071
クロップス	0.9	1.9	1,031
日本電信電話	400.7	819	4,047,498
KDDI	346.7	1,076.4	3,321,770
光通信	9.2	12.7	107,569
NTTドコモ	843.6	817.2	2,155,773
エムティーアイ	—	13.6	10,186
GMOインターネット	34.2	39.3	53,998
カドカワ	25.1	33.1	55,905
学研ホールディングス	34	35	8,610
ゼンリン	13.5	14	31,220
昭文社	6.1	5.8	3,775
インプレスホールディングス	7.3	8.8	1,302
アイネット	5.2	5.9	6,849
松竹	67	70	73,080
東宝	73.1	75.6	226,497
東映	38	39	36,465
AOI Pro.	4.7	5.3	5,162
エヌ・ティ・ティ・データ	63.2	65.5	369,420
ピー・シー・エー	1.3	1.3	1,994
ビジネスブレイン太田昭和	—	1.6	1,572
DTS	10.6	11.8	25,523
スクウェア・エニックス・ホールディングス	39.4	44.8	136,192
シーイーシー	6.7	6.9	8,914
カブコン	26.2	27.1	73,088
アイ・エス・ピー	—	1.3	972
ジャステック	5.9	6.7	6,076
CSK	24.3	25.2	111,888
日本システムウエア	3.8	4	3,748
アイネス	13.9	15	17,175
TKC	8.6	9.8	30,282
富士ソフト	14.1	15.7	38,402

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
NSD	23.9	22.5	38,227
コナミホールディングス	41.6	47.8	146,746
福井コンピュータホールディングス	2.8	2.3	2,757
JBCホールディングス	8.6	8.9	6,230
ミロク情報サービス	6.7	7.8	7,761
ソフトバンクグループ	541.5	600.3	3,323,260
卸売業 (4.3%)			
ハウスイ	8	8	952
高千穂交易	3.9	4.1	3,944
伊藤忠食品	2.5	2.6	11,362
エレマテック	4.8	4.9	10,363
JALUX	2.9	3.4	7,837
あらた	23	4.8	12,187
トーメンデバイス	1.5	1.6	2,880
東京エレクトロン デバイス	2	3.8	5,977
フィールズ	—	6.9	13,489
双日	685.3	667.5	156,862
アルフレッサ ホールディングス	121.1	133.2	291,175
横浜冷凍	25.3	26.2	28,767
神栄	15	15	1,620
山下医科器械	0.8	0.9	1,594
ラサ商事	4.8	5	2,935
アルコニックス	5.8	6	9,696
神戸物産	3.4	6.8	18,645
あい ホールディングス	16.4	18.9	58,306
ディーブイエックス	3	2.8	3,200
ダイワボウホールディングス	93	96	21,120
マクニカ・富士エレホールディングス	—	19.1	26,587
バイタルケーエスケー・ホールディングス	19.2	18.4	16,228
八洲電機	7.9	8.2	4,674
UKCホールディングス	6.6	6.8	15,986
OCHIホールディングス	2.6	3.1	3,379
TOKAIホールディングス	50	46.6	28,146
三洋貿易	6.1	5.8	8,607
ウイン・パートナーズ	3.3	3.8	5,833
ミタチ産業	2.4	2.7	1,722
シップヘルスケアホールディングス	18.7	21.5	62,651
明治電機工業	2.9	3.3	3,801
デリカフーズ	1.8	2.2	2,105

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
スターティア	0.9	2	1,100	
富士興産	3.9	4.1	1,767	
協栄産業	12	14	1,918	
小野建	8.9	9.2	9,301	
佐鳥電機	8.1	8.4	6,081	
エコートレーディング	2.3	2.4	1,394	
伯東	7	8	8,024	
コンドーテック	7.4	8.4	7,072	
中山福	5.9	6.6	5,200	
ナガイレーベン	14.8	15.3	34,272	
三菱食品	11.2	11.6	34,544	
松田産業	7.4	7.7	9,732	
第一興商	—	18.7	91,630	
メディバルホールディングス	102.4	106	191,754	
アドヴァン	5.2	10.8	11,070	
SPK	2.2	2.4	4,963	
萩原電気	2.8	2.7	5,467	
アズワン	7.3	8.3	34,818	
スズデン	3.3	3.4	3,852	
尾家産業	3.3	3.4	3,151	
シモジマ	6.3	7.3	8,285	
ドウシシャ	13.2	12.5	27,275	
小津産業	2	2.3	5,135	
高速	6.1	6.3	5,556	
たけびし	3.6	3.7	3,751	
黒田電気	17.2	19.7	34,140	
丸文	9	9.4	7,463	
ハビネット	6.2	9.6	9,753	
橋本総業	1.9	2.2	3,473	
エクセル	4.7	5.1	7,252	
マルカキカイ	3.3	3.4	5,205	
ガリバーインターナショナル	31	28.5	37,306	
日本エム・ディ・エム	8.5	8.8	5,350	
進和	6	6.2	9,262	
エスケイジャパン	2.6	2.6	1,016	
ダイトエレクトロン	4.7	4.8	3,628	
シークス	6.5	6.7	23,282	
田中商事	3.1	3.2	2,121	
オーハシテクニカ	6.3	6	7,512	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
マクニカ	5.3	—	—	
白銅	3.3	3	3,387	
伊藤忠商事	857.1	831.5	1,199,854	
丸紅	895.7	1,042.8	620,883	
高島	19	20	3,800	
長瀬産業	62.4	63.7	80,389	
蝶理	6.5	6.7	9,889	
豊田通商	114.1	118	309,514	
三共生興	17.4	16.1	6,584	
兼松	204	225	38,025	
ツカモトコーポレーション	18	19	2,166	
三井物産	868.1	958.1	1,287,686	
日本紙パルプ商事	53	55	18,315	
日立ハイテクノロジーズ	35.5	36.7	114,504	
カメイ	13.3	13.8	15,801	
東都水産	17	17	3,077	
OUGホールディングス	16	15	3,525	
スターゼン	40	3.8	12,844	
山善	39.3	40.7	36,100	
椿本興業	12	12	3,780	
住友商事	604.3	667	780,390	
内田洋行	25	26	11,154	
三菱商事	784.7	795	1,574,895	
第一実業	25	24	11,880	
キヤノンマーケティングジャパン	29.2	30.2	60,611	
西華産業	34	35	8,295	
佐藤商事	9.1	9.4	6,420	
菱洋エレクトロ	11.8	12.2	16,274	
東京産業	10.2	10.6	4,515	
ユアサ商事	9	10	26,730	
神鋼商事	26	24	5,064	
小林産業	7.4	7.1	1,434	
阪和興業	102	106	51,516	
カナデン	10	10.1	9,009	
菱電商事	16	17	11,237	
フルサト工業	5.6	5.8	9,871	
岩谷産業	113	126	82,152	
すてきナイスグループ	44	45	6,570	
昭光通商	36	38	2,964	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ニチモウ	16	16	16	2,944
極東貿易	12	15	15	3,735
イワキ	15	16	16	3,024
三菱石油	26	27	27	22,815
稲畑産業	24.5	25.4	25.4	28,067
G S Iクレオス	27	28	28	3,528
明和産業	8.2	9.8	9.8	3,567
ワキタ	21.8	22.5	22.5	20,902
東邦ホールディングス	35.3	33.9	33.9	79,834
サンゲツ	18.4	36.9	36.9	77,342
ミツウロコグループホールディングス	16.5	17	17	9,775
シナネンホールディングス	22	23	23	10,511
伊藤忠エネクス	22.6	27.3	27.3	25,088
サンリオ	28.7	32.7	32.7	74,719
サンワテクノス	6.5	6.7	6.7	4,917
リョーサン	17.2	16.8	16.8	49,761
新光商事	12	12.4	12.4	14,272
トーヨー	23	4.8	4.8	11,769
三信電気	14.1	14.6	14.6	13,928
東陽テクニカ	15	15	15	17,430
モスフードサービス	13.4	13.9	13.9	42,047
加賀電子	9.2	9.6	9.6	14,620
ソーダニッカ	11	11	11	5,335
立花エレテック	6.3	7.8	7.8	9,461
フォーバル	2	4.2	4.2	3,024
PAL TAC	16.4	16.9	16.9	35,067
三谷産業	—	11.3	11.3	4,101
太平洋興発	40	44	44	3,476
ヤマタネ	51	49	49	7,742
丸紅建材リース	9	9	9	1,791
日鉄住金物産	67	70	70	26,600
トラスコ中山	12.8	12.1	12.1	53,663
オートバックスセブン	37.7	40.6	40.6	78,764
加藤産業	14.7	16.5	16.5	48,031
イノテック	9.4	9.8	9.8	4,429
イエローハット	9.6	10	10	22,670
富士エレクトロニクス	5.3	—	—	—
J Kホールディングス	10.3	10.6	10.6	5,300
日伝	4.2	4.4	4.4	12,949

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
北沢産業	8.6	8.8	8.8	1,592
杉本商事	5.5	6.1	6.1	7,838
因幡電機産業	15.2	14.8	14.8	52,392
バイテックホールディングス	3.5	3.2	3.2	3,452
ミスミグループ本社	38.2	119	119	190,043
江守グループホールディングス	4.4	—	—	—
アルテック	7.7	9.1	9.1	1,419
タキヒヨー	17	18	18	8,532
蔵王産業	—	1.7	1.7	2,339
スズケン	42.4	48.2	48.2	187,257
ジェコス	7	7.3	7.3	7,599
ルネサスイーストン	4.8	6.7	6.7	3,075
小売業 (5.0%)				
ローソン	38.8	40.1	40.1	378,945
サンエー	7.7	7.2	7.2	38,304
ダイユーエイト	2.1	2.8	2.8	1,979
カワチ薬品	7.9	8.2	8.2	16,908
エービーシー・マート	14.6	13.7	13.7	97,407
ハードオフコーポレーション	4.9	5.1	5.1	8,052
アスクル	10.6	12.9	12.9	58,953
ゲオホールディングス	19.3	20.1	20.1	40,179
アダストリア	8.6	19.5	19.5	66,982
ジーフット	—	6.4	6.4	5,120
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	13	15	15	1,350
くらコーポレーション	6	6.2	6.2	32,736
キャンドウ	4.9	5.6	5.6	8,624
バル	6	6.2	6.2	17,347
エディオン	46.9	44.8	44.8	40,544
サーラコーポレーション	8.8	9.1	9.1	6,024
ワッツ	4	4.2	4.2	3,628
ハローズ	—	3.2	3.2	7,356
あみやき亭	1.8	2.1	2.1	9,555
ひらまつ	14.1	14.6	14.6	10,366
ゲンキー	1	2.1	2.1	8,557
サッポロドラッグストアー	0.9	1	1	2,400
大黒天物産	2.4	2.5	2.5	11,775
ハニーズ	9	9.3	9.3	12,108
ファーマライズホールディングス	1.7	2.4	2.4	1,459
アルバン	9.1	9.4	9.4	17,361

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
クオール	10.4		10.8	18,565
ジェイアイエヌ	7		7.2	31,032
ビックカメラ	44.4		54.7	55,356
DCMホールディングス	49.5		52.1	43,034
MonotaRO	20		37.4	119,680
東京一番フーズ	—		1.8	1,107
ダイヤモンドダイニング	—		1.7	1,700
きちり	2		2.8	1,867
アークランドサービス	1.2		3.3	9,966
J. フロント リテイリング	129.6		134.1	193,908
ドトール・日レスホールディングス	17.9		18.6	34,503
マツモトキヨシホールディングス	22.9		21.9	130,305
ブロンコビリー	1.8		4.1	10,754
スタートトゥデイ	31.9		32.2	145,383
トレジャー・ファクトリー	0.9		3	3,456
物語コーポレーション	2.9		2.8	15,512
ココカラファイン	10.7		11	54,175
三越伊勢丹ホールディングス	203.5		210.7	278,966
ウエルシアホールディングス	9.2		9.2	59,800
クリエイトSDホールディングス	5		15.6	43,898
丸善CHIホールディングス	11.9		12.4	4,451
ミサワ	—		1.2	637
エー・ピーカンパニー	1.4		1.7	1,968
チムニー	1.9		2.6	7,677
シュッピン	—		3	3,573
ネクステージ	1		1.7	933
ジョイフル本田	5.6		17.2	43,378
キリン堂ホールディングス	3.3		3.4	3,468
ホットランド	—		2.8	3,318
すかいらく	37.5		32.4	47,725
綿半ホールディングス	—		3	4,209
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	33.6		35.1	36,679
ブックオフコーポレーション	5.8		6	5,598
ゴルフダイジェスト・オンライン	—		2.2	1,738
あさひ	6.8		7.9	11,929
日本調剤	1.3		2.7	11,610
コスモス薬品	5.2		5.3	100,011
トーエル	5.4		5.1	4,151
一六堂	2.5		2.6	910

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
セブン&アイ・ホールディングス	428.3		443.2	2,134,451
薬王堂	1.4		1.5	4,792
クリエイト・レストランツ・ホールディング	7.1		28.4	29,223
ツルハホールディングス	21.8		24.3	274,590
サンマルクホールディングス	3.7		8.4	26,628
フェリシモ	2.6		3	3,105
トリドール	11		13	28,795
クスリのアオキ	4		9.4	57,998
メディカルシステムネットワーク	9.2		12.1	5,795
総合メディカル	2.5		5.1	19,380
はるやま商事	4.2		4.4	3,366
カップ・クリエイト	16		14.8	18,766
ライトオン	7.6		7.9	14,251
ジーンズメイト	3.3		3.4	710
良品計画	12.7		12.2	291,946
三城ホールディングス	12.6		13.2	6,098
アルビス	—		2.8	5,622
コナカ	12		12.5	7,187
ハウス オブ ローゼ	1.1		1.3	1,933
G-7ホールディングス	2.1		3.1	4,026
イオン北海道	6.5		7.1	3,777
コジマ	15.2		15.7	3,752
ヒマラヤ	2.4		3.3	3,217
コーナン商事	15.6		15	25,965
エコス	3.5		3.9	4,699
ワタミ	12.1		12.5	12,812
マルシェ	2.5		2.6	2,194
ドンキホーテホールディングス	33		68.5	273,315
西松屋チェーン	20.2		20.9	23,449
ゼンショーホールディングス	52.7		54.5	79,079
幸楽苑ホールディングス	6.4		6.7	10,733
ハークスレイ	2.8		2.9	3,390
サイゼリヤ	15.2		17.4	40,576
VTホールディングス	—		35.8	24,236
魚力	—		3.3	4,303
ポプラ	2.6		2.7	1,287
ユナイテッドアローズ	13.4		15.1	75,349
ハイデイ日高	7.8		9.6	27,187
京都きもの友禅	6.4		7.2	6,530

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コロワイド	34	35.1	62,864
ビーシーデポコーポレーション	—	8.8	9,653
栲番屋	4.6	4.8	31,824
トップカルチャー	4.1	3.8	1,748
PLANT	2.6	2.4	2,968
スギホールディングス	18.4	19	114,380
スクロール	13.3	16	6,656
ヨンドシーホールディングス	7.8	8.1	23,149
ファミリーマート	34.6	32.6	190,058
木曽路	12.5	13	29,471
サトレストランシシステムズ	9.5	12.5	10,200
千趣会	18.4	20.9	14,964
タカキュー	7.3	8.2	1,525
ケーヨー	19.2	17.8	9,006
上新電機	22	25	22,100
日本瓦斯	16.4	12.1	30,806
ベスト電器	33.3	34.4	4,128
ロイヤルホールディングス	17.1	17.6	39,547
東天紅	7	8	1,088
いなげや	11.4	11.8	16,944
島忠	24.8	27.4	73,706
チョダ	12.1	12.5	39,875
ライフコーポレーション	6.5	6.7	18,297
リンガーハット	10	9.6	23,529
さが美	8	8	744
MrMax	10.3	9.3	2,687
テンアライド	8.7	9.8	3,704
AOKIホールディングス	23.5	24.2	33,783
オークワ	16	17	17,850
コメリ	17.5	16.3	38,044
青山商事	25.7	20.3	89,726
しまむら	11.9	12.3	174,045
CFSコーポレーション	6.7	—	—
はせがわ	3.6	3.8	1,729
高島屋	149	154	141,680
松屋	20.6	21.3	20,639
エイチ・ツー・オー リテイリング	48.4	54.3	106,373
近鉄百貨店	39	40	11,840
丸栄	17	22	1,980

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニッセンホールディングス	21.5	15.7	2,182
バルコ	9.8	10.1	9,201
丸井グループ	123.2	130	204,360
アクシアル リテイリング	7.9	8.2	30,750
井筒屋	55	57	3,135
イオン	422.3	436	716,348
ユニグループ・ホールディングス	98	101.4	81,018
イズミ	22.9	21	101,535
東武ストア	13	13	3,731
平和堂	20.7	21.5	52,911
フジ	11.4	11.8	27,199
ヤオコー	5.8	12	58,620
ゼビオホールディングス	13.9	14.4	26,020
ケーズホールディングス	23.6	22.4	87,808
Olympicグループ	6	6.2	3,155
日産東京販売ホールディングス	17.2	17.9	5,208
アインホールディングス	12.3	12.8	75,392
元気寿司	3.1	3	6,885
ヤマダ電機	404.7	322.2	175,921
アークランドサカモト	7.3	17.9	21,551
ニトリホールディングス	44.2	45.8	447,008
グルメ軒屋	7	8	8,240
愛眼	8.2	8.5	1,929
ケユーホールディングス	5.3	5.5	4,218
吉野家ホールディングス	28.8	39.1	53,645
松屋フーズ	4.9	5.1	14,545
サガミチェーン	13	14.1	18,358
関西スーパーマーケット	7.6	8.6	6,991
王将フードサービス	7.5	7.8	33,423
プレナス	11.4	11.8	24,331
ミニストップ	7.6	7.8	15,943
アークス	17.8	19.8	50,133
パローホールディングス	22.1	22.8	64,569
藤久	0.8	0.8	1,356
ベルク	4.5	5.2	22,334
大庄	5.5	4.9	7,193
ファーストリテイリング	20.5	21.2	771,892
サンドラッグ	21.6	22.4	190,848
サックスパー ホールディングス	7.7	10	15,690

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ヤマザワ	2.1	2.2	3,729	
やまや	1.7	2.2	4,415	
ペルーナ	25.5	26.4	15,153	
銀行業 (7.5%)				
島根銀行	2.2	2.2	2,739	
じもとホールディングス	73.5	76	11,400	
足利ホールディングス	64.4	77.8	25,051	
東京TYフィナンシャルグループ	13.2	14.6	40,646	
九州フィナンシャルグループ	—	162.2	107,538	
ゆうちょ銀行	—	203.6	289,519	
新生銀行	975	917	139,384	
あおぞら銀行	691	670	268,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,215.4	8,501.4	4,554,199	
りそなホールディングス	1,197.8	1,239.5	499,518	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,263	2,212	739,914	
三井住友フィナンシャルグループ	774.4	848.4	2,996,548	
第四銀行	130	134	52,930	
北越銀行	111	114	21,432	
西日本シティ銀行	359	345	69,345	
千葉銀行	395	409	224,950	
横浜銀行	708	711	370,857	
常陽銀行	370	383	151,285	
群馬銀行	243	235	114,680	
武蔵野銀行	16.3	16.9	49,483	
千葉興業銀行	21.2	29	14,790	
筑波銀行	42.5	44	13,376	
七十七銀行	173	166	65,736	
青森銀行	80	78	26,988	
秋田銀行	68	69	20,631	
山形銀行	62	60	25,080	
岩手銀行	7.2	7.4	31,043	
東邦銀行	92	95	34,675	
東北銀行	55	54	7,722	
みちのく銀行	51	53	9,805	
ふくおかフィナンシャルグループ	415	459	170,289	
静岡銀行	300	310	254,510	
十六銀行	128	133	44,555	
スルガ銀行	108.1	100.6	198,081	
八十二銀行	185	192	96,960	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
山梨中央銀行	65	66	27,786	
大垣共立銀行	128	141	48,363	
福井銀行	87	91	18,473	
北國銀行	114	118	35,518	
清水銀行	3.5	3.6	8,593	
富山銀行	—	2	7,860	
滋賀銀行	103	100	48,200	
南都銀行	99	102	30,906	
百五銀行	98	95	40,945	
京都銀行	195	202	148,470	
紀陽銀行	40.2	41.6	54,828	
三重銀行	46	47	9,494	
ほくほくフィナンシャルグループ	697	721	113,197	
広島銀行	302	313	132,086	
山陰合同銀行	63	64.2	46,095	
中国銀行	73.7	75.1	89,969	
鳥取銀行	33	34	5,848	
伊予銀行	109.5	113.3	84,181	
百十四銀行	112	116	37,468	
四国銀行	79	82	17,958	
阿波銀行	84	87	47,850	
鹿児島銀行	71	—	—	
大分銀行	63	61	21,777	
宮崎銀行	68	71	19,880	
肥後銀行	84	—	—	
佐賀銀行	62	64	14,016	
十八銀行	63	65	16,445	
沖縄銀行	8.1	8.4	30,702	
琉球銀行	21.1	21.8	27,577	
セブン銀行	345.3	397	190,163	
みずほフィナンシャルグループ	14,189.5	14,934.3	2,583,633	
高知銀行	40	41	4,879	
山口フィナンシャルグループ	102	99	101,970	
長野銀行	33	35	6,580	
名古屋銀行	92	89	33,108	
北洋銀行	154.3	159.6	45,964	
愛知銀行	3.7	3.6	17,046	
第三銀行	58	60	9,480	
中京銀行	42	43	8,514	

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
東日本銀行	45	51	14,229	
大光銀行	36	38	7,942	
愛媛銀行	60	62	14,694	
トマト銀行	40	41	6,109	
みなと銀行	93	96	15,456	
京葉銀行	84	87	35,931	
関西アーバン銀行	14.3	14.8	16,753	
栃木銀行	51	57	24,909	
北日本銀行	3.2	3.3	9,612	
東和銀行	143	149	14,006	
福島銀行	126	130	11,050	
大東銀行	65	64	11,136	
トモニホールディングス	78.6	81.3	27,154	
フィデアホールディングス	58.9	64.8	11,988	
池田泉州ホールディングス	84.5	112.4	46,084	
証券・商品先物取引業 (1.1%)				
F P G	8.8	31.4	41,416	
S B I ホールディングス	123	127.3	149,195	
日本アジア投資	71	7.2	1,864	
ジャフコ	14	17.7	62,569	
大和証券グループ本社	958	991	697,763	
野村ホールディングス	2,093.3	2,038.7	1,050,949	
岡三証券グループ	87	90	56,700	
丸三証券	32.6	31.5	39,186	
東洋証券	41	41	12,382	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	117.5	121.6	77,459	
光世証券	24	25	3,700	
水戸証券	31.7	32.8	10,824	
いちよし証券	21.5	23.7	24,671	
松井証券	52	53.9	54,007	
だいこう証券ビジネス	4.9	5.1	4,778	
マネックスグループ	120.5	124.7	38,657	
カブドットコム証券	45.4	93.9	35,118	
極東証券	13.7	14.2	20,760	
岩井コスモホールディングス	10.5	10	11,690	
藍澤証券	—	14.9	9,297	
マネースクウェアHD	3.2	3.6	4,078	
マネーパートナーズグループ	10.5	9.8	7,418	
小林洋行	3	3.1	818	

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
保険業 (2.4%)				
かんぽ生命保険	—	32.3	85,304	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	227.5	235.4	760,106	
アニコム ホールディングス	4.3	7.2	21,852	
MS&ADインシュアランスグループホール	326.4	316.6	1,002,988	
ソニーフィナンシャルホールディングス	98.1	101.5	156,208	
第一生命保険	656	678.9	948,423	
東京海上ホールディングス	421.4	429.3	1,711,619	
T&Dホールディングス	373.2	386.2	425,206	
その他金融業 (1.4%)				
全国保証	26.6	27.5	103,537	
クレディセゾン	83.6	80.4	158,950	
アクリーティブ	7.1	8.8	3,678	
芙蓉総合リース	10.7	12.1	56,688	
興銀リース	19.2	19.9	40,257	
東京センチュリーリース	24	24.9	100,222	
日本証券金融	48.4	46.7	21,435	
アイフル	171.3	177.4	68,121	
ポケットカード	7.7	10.6	5,639	
リコーリース	8.1	8.3	27,182	
イオンフィナンシャルサービス	67.2	69.5	191,820	
アコム	205.7	212.8	117,678	
ジャックス	56	58	26,100	
オリエントコーポレーション	236.6	458.1	99,865	
日立キャピタル	20.1	25	61,650	
アプラスフィナンシャル	49.1	50.8	5,232	
オリックス	724.8	750.3	1,216,611	
三菱UFJリース	259.7	268.8	133,862	
日本取引所グループ	150.3	311.1	560,291	
イー・ギャランティ	3	3.4	8,598	
アサックス	1.8	1.8	2,534	
NECキャピタルソリューション	4.2	4.3	7,099	
不動産業 (2.8%)				
いちごグループホールディングス	—	87.9	39,906	
日本駐車場開発	111.2	115.8	14,475	
ヒューリック	172.9	220.9	237,688	
東京建物不動産販売	5.3	—	—	
三栄建築設計	4.1	4.2	5,002	
野村不動産ホールディングス	61.5	70.3	148,825	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
三重交通グループホールディングス	—	18.8	10,076	
サムティ	—	5.7	6,760	
ディア・ライフ	—	5.4	1,960	
ユー・ディー・ワークス	—	73.4	3,229	
日本商業開発	3.1	3.5	7,763	
ブレサンスコーポレーション	3.5	3.6	14,706	
ユニゾホールディングス	4.2	6.6	30,822	
日本管理センター	5	6.9	12,882	
サンセイランディック	1.1	2.4	2,196	
エストラスト	1	1.9	1,056	
フージャースホールディングス	15.2	14.7	7,835	
オープンハウス	6.5	15.3	31,793	
東急不動産ホールディングス	268.4	256.3	190,687	
飯田グループホールディングス	66.4	98.1	217,880	
エコナックホールディングス	36	34	1,700	
パーク24	51.5	53.5	167,722	
バラカ	3.8	3.7	5,257	
三井不動産	543	562	1,550,558	
三菱地所	761	788	1,670,560	
平和不動産	19.4	20	27,980	
東京建物	223	115.7	162,558	
ダイビル	26.3	27.3	26,535	
京阪神ビルディング	17	17.5	10,815	
住友不動産	245	254	836,676	
大京	163	197	35,854	
テーオーシー	35.3	41.1	39,332	
東京楽天地	17	17	8,177	
レオパレス21	112	124.8	83,491	
スターツコーポレーション	11.7	12.1	29,499	
フジ住宅	13.1	13.5	9,423	
空港施設	12.4	12.8	6,758	
明和地所	5.9	5.8	3,944	
住友不動産販売	7.4	7.6	16,925	
ゴールドクレスト	9.2	8.3	14,002	
日本エスリード	4	4.1	4,596	
日神不動産	13.7	14.2	5,467	
タカラレーベン	45.4	46.2	31,878	
サンヨーハウジング名古屋	5.8	6	5,760	
イオンモール	66.1	68.4	114,570	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ファースト住建	3.8	3.9	5,120	
ランド	39.6	49.9	698	
トーセイ	14	16.1	12,719	
穴吹興産	9	12	3,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	63.6	65.8	72,314	
サンフロンティア不動産	11	12.8	14,425	
エフ・ジェー・ネクスト	7.8	9.2	4,912	
ランドビジネス	5.2	7.2	1,980	
グランディハウス	8.9	9.3	3,534	
日本空港ビルデング	35.4	33.8	136,383	
サービス業 (3.8%)				
日本工営	36	38	13,642	
ネクスト	12.7	31.7	40,893	
ジェイエエシーリクルートメント	—	5.2	6,593	
日本M&Aセンター	16.7	17.3	108,298	
ノバレーゼ	2.8	2.9	2,407	
アコーディア・ゴルフ	40.7	31.1	34,085	
中広	—	1.1	663	
タケエイ	10.6	9.8	8,986	
トラスト・テック	1.9	2.3	6,635	
パソナグループ	8.1	9.7	7,837	
CDS	2.5	2.5	2,195	
リンクアンドモチベーション	14.9	22.8	3,192	
GCAサヴィアン	8.5	9.9	11,375	
エス・エム・エス	12.1	14	29,470	
テンブホールディングス	21.3	78.6	123,637	
リニカル	2.8	6.6	12,177	
クックパッド	6.9	25	45,975	
エスクリ	3.8	4.7	2,998	
アイ・ケイ・ケイ	2.9	6	4,044	
学情	4	4.1	5,047	
スタジオアリス	5	5.2	13,010	
シミックホールディングス	4.3	5	7,080	
NJS	2.4	2.3	2,718	
総合警備保障	36.2	37.4	233,750	
カカコム	71.4	81.3	169,510	
アイロムグループ	2.6	3.2	3,638	
ルネサンス	5.5	5.7	7,301	
ディップ	2.4	12.4	32,798	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
オプトホールディング	4.8	7	4,130	
新日本科学	10.3	10.7	4,461	
ツクイ	12.8	13.3	19,763	
総合臨床ホールディングス	5	—	—	
キャリアデザインセンター	3.2	3.1	3,003	
エムスリー	93.8	97.1	265,956	
ツカダ・グローバルホールディング	7.9	8.2	6,051	
アウトソーシング	4.1	5.2	19,630	
ウェルネット	2.8	4.2	14,952	
ディー・エヌ・エー	53.4	50.3	99,091	
博報堂DYホールディングス	150.2	155.4	196,114	
ぐるなび	12.5	13	33,449	
エスアールジータカミヤ	8.7	9.1	3,931	
一休	8.5	—	—	
ジャパンバストレスキューシステム	8.9	12.8	2,969	
ファンコミュニケーションズ	18.7	25.9	21,652	
ジェイコムホールディングス	2.5	2.3	6,074	
PGMホールディングス	15.3	—	—	
WDBホールディングス	3.9	4	4,100	
ティア	2.9	4.7	3,026	
バリューコマース	8.9	10.4	3,910	
インフォマート	—	16.2	16,572	
J Pホールディングス	26.9	27.8	9,424	
E P Sホールディングス	13.6	12.5	17,562	
レッグス	—	1.6	1,072	
プレスステージ・インターナショナル	8.2	9.4	12,248	
アミューズ	3.3	3.1	14,275	
ドリームインキュベータ	3.5	3.7	9,009	
クイック	3.7	5.7	4,628	
TAC	5.4	6.2	1,233	
ケネディクス	154	150.5	73,293	
電通	120.8	125	700,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4.2	5.3	2,528	
びあ	3.2	3.3	6,999	
イオンファンタジー	3.5	3.9	8,556	
シーティーエス	—	2.5	1,985	
ネクシィーズ	3.9	4	3,600	
みらかホールディングス	28.5	28.6	135,707	
アルプス技研	4.3	4.1	9,430	

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
サニックス	12.7	18.1	3,945	
ダイオーズ	2.3	2	2,160	
日本空調サービス	5.3	5.5	6,407	
オリエンタルランド	29.3	121.2	983,659	
ダスキン	30.7	31.7	65,904	
明光ネットワークジャパン	10.7	13	15,847	
ファルコホールディングス	5.1	4.9	6,977	
秀英予備校	2.3	2	900	
田谷	1.8	1.9	1,352	
ラウンドワン	30.7	35	23,625	
リゾートトラスト	40	47	119,521	
ビー・エム・エル	6.4	6.6	29,106	
ワタベウエディング	3.5	3.3	1,369	
りらいあコミュニケーションズ	20.1	18.5	18,592	
リソー教育	16.8	20.8	7,113	
早稲田アカデミー	1.6	1.5	1,380	
ユー・エス・エス	131.2	135.7	245,481	
東京個別指導学院	5.2	5.4	3,607	
サイバーエージェント	19.9	27.4	133,849	
楽天	470.8	524.6	540,600	
テー・オー・ダブリュー	3.3	6.7	4,790	
セントラルスポーツ	3.7	3.8	9,089	
フルキャストホールディングス	11.2	10.3	8,034	
リゾートソリューション	11	11	3,509	
テクノプロ・ホールディングス	11.5	18.2	58,058	
インターワークス	—	1.5	1,161	
リブセンス	6.3	7.6	3,435	
ジャパンマテリアル	4.5	4.7	14,899	
ベクトル	1.8	3.5	10,097	
ウチヤマホールディングス	4.7	5.8	2,975	
サクセスホールディングス	0.9	1	1,382	
キャリアリンク	1.1	1.5	2,436	
I B J	—	6.6	3,042	
アサンテ	2.7	4.1	6,699	
N・フィールド	—	4	5,976	
M&Aキャピタルパートナーズ	0.2	0.9	1,699	
ライドオン・エクスプレス	—	1.8	3,231	
ER Iホールディングス	2.8	2.9	2,433	
アビスト	—	1.2	2,953	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ウィルグループ	0.9	2.5	2,507
日本ビューホテル	—	1.2	2,191
リクルートホールディングス	122.9	226.1	782,306
エラン	—	0.9	855
日本郵政	—	247.3	381,831
ベルシステム24ホールディングス	—	16.4	19,450
リロ・ホールディング	3.7	4.2	61,698
東祥	2.3	3.4	14,807
エイチ・アイ・エス	17.7	18.3	56,821
ラックランド	—	1.6	2,596
共立メンテナンス	5.4	8.4	81,816
イチネンホールディングス	11.3	11.7	12,179
建設技術研究所	6.4	6.6	6,388
スペース	5.8	6	8,160
燦ホールディングス	2.2	2.2	3,231
スバル興業	8	8	3,024
東京テアトル	41	43	5,375
ナガワ	—	2	5,506
よみうりランド	22	22	11,066
東京都競馬	74	77	17,094
常磐興産	40	41	6,396
カナモト	15.1	15.6	42,416
東京ドーム	74	89	47,437
西尾レントオール	8.7	9	23,778
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	45	56	2,240
トランス・コスモス	14.1	13	36,634

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
乃村工藝社	21.2	24	39,240
藤田観光	39	41	23,083
KNT-CTホールディングス	52	54	9,990
日本管財	5.3	9.6	16,992
トーカイ	4.8	5	16,750
白洋舎	11	12	3,096
セコム	105.2	116.6	1,009,173
セントラル警備保障	4.8	4.9	12,823
丹青社	12.5	21	17,304
メイテック	14.7	14	56,070
アサツー デイ・ケイ	20.4	19.7	55,810
応用地質	11.4	11.8	13,994
船井総研ホールディングス	11.7	15.6	27,144
進学会	4.5	5.3	3,455
オオバ	—	6.1	2,671
学究社	—	1.6	2,112
ベネッセホールディングス	39.6	37.6	127,276
イオンディライト	10.5	10.8	40,338
ナック	7.2	6.9	6,430
ニチイ学館	21.2	19.5	15,502
ダイセキ	17.4	21.1	39,963
ステップ	3.6	3.8	3,826
合 計	株数・金額 172,412	178,041	216,833,264
	銘柄数<比率> 1,858	1,933	<98.2%>

(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 4,104	百万円 —

○有価証券の貸付及び借入の状況

2016年3月25日現在における貸付株数の総株数は24,569,000株です。

うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUF G証券株式会社に対する貸付は、24,569,000株です。

○投資信託財産の構成

(2016年3月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	216,833,264	86.4
コール・ローン等、その他	34,136,616	13.6
投資信託財産総額	250,969,880	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年3月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	250,966,747,126
コール・ローン等	31,712,659,281
株式(評価額)	216,833,264,380
未収入金	1,935,172,170
未収配当金	234,829,742
未収利息	42
その他未収収益	61,909,511
差入委託証拠金	188,912,000
(B) 負債	30,165,109,370
未払解約金	2,156,728,768
未払利息	19,375
受入担保金	28,008,361,227
(C) 純資産総額(A-B)	220,801,637,756
元本	160,669,331,010
次期繰越損益金	60,132,306,746
(D) 受益権総口数	160,669,331,010口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,743円

○損益の状況

(2015年3月26日～2016年3月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,410,669,755
受取配当金	4,088,217,414
受取利息	19,554,385
その他収益金	311,787,362
支払利息	△ 8,889,406
(B) 有価証券売買損益	△34,472,113,100
売買益	10,330,677,364
売買損	△44,802,790,464
(C) 先物取引等取引損益	△ 530,199,280
取引益	1,141,323,840
取引損	△ 1,671,523,120
(D) 当期損益金(A+B+C)	△30,591,642,625
(E) 前期繰越損益金	89,192,588,551
(F) 追加信託差損益金	48,019,670,206
(G) 解約差損益金	△46,488,309,386
(H) 計(D+E+F+G)	60,132,306,746
次期繰越損益金(H)	60,132,306,746

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

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

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

<注記事項>

①期首元本額 156,174,324,083円
 期中追加設定元本額 90,299,508,544円
 期中一部解約元本額 85,804,501,617円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3743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）

ファンド・マネジャー（国内株式）	2,419,679,844円	インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	22,906,682円
eMAXIS TOPIXインデックス	21,330,711,385円	インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	76,085,335円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,592,208,146円	インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	142,479,268円
eMAXIS バランス（波乗り型）	111,177,712円	インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	120,583,422円
コアバランス	912,057円	三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	3,150,098,815円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	19,945,917,827円	三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	834,278,300円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	14,790,783,904円	三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	107,865,555円
三菱UFJ バランスファンドVA20型（適格機関投資家限定）	527,242,271円	三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	896,042,538円
三菱UFJ バランスファンドVA40型（適格機関投資家限定）	4,309,348,804円	三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	104,323,312円
MUAM 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	15,138,673,776円	三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	802,533,806円
三菱UFJ バランスファンドVA50型（適格機関投資家限定）	6,747,383,047円	三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	2,128,408,178円
三菱UFJ バランスファンドVA75型（適格機関投資家限定）	2,669,566,608円	三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）	566,144,963円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	636,641,903円	三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）	2,248,685,858円
三菱UFJ バランスファンドVA45型（適格機関投資家限定）	315,038,965円	三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）	1,775,755,051円
三菱UFJ バランスファンドVA30型（適格機関投資家限定）	176,444,031円	三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）	1,347,664,902円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	595,935,508円	三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	44,719,222,766円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	1,406,064,878円	三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	636,768,073円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	26,070,308円	三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	107,973,296円
MJAMトピックスリソースコントロール(5%)インデックスファンド(FOF)用（適格機関投資家限定）	1,399,846円	三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	94,918,456円
MJAMトピックスリソースコントロール(10%)インデックスファンド(FOF)用（適格機関投資家限定）	143,580,107円	三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	170,809円
MUAMインデックスファンドTOPIXi（適格機関投資家限定）	8,726,654円	三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	255,117円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	7,499,823,663円	三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	298,365円
三菱UFJ TOPIX・ライト	373,640,163円	eMAXIS バランス（4資産均等型）	18,896,736円
		合計	160,669,331,010円

【お知らせ】

- ①2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2015年7月1日)
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資制限について、買付基準の記載部分の「取得時において」の削除を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2015年12月2日)
- ③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うための、所要の約款変更を行いました。
 (2016年3月2日)

外国株式インデックスマザーファンド

《第14期》決算日2015年5月12日

[計算期間：2014年5月13日～2015年5月12日]

「外国株式インデックスマザーファンド」は、5月12日に第14期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	(円換算ベース)	期 騰 落				
	円	%			%	%	%	百万円
10期(2011年5月12日)	10,647	7.3	82.70	5.0	95.3	2.9	1.6	141,974
11期(2012年5月14日)	9,921	△ 6.8	74.99	△ 9.3	95.2	2.6	2.0	142,226
12期(2013年5月13日)	15,535	56.6	114.32	52.4	96.3	1.0	2.3	199,188
13期(2014年5月12日)	18,176	17.0	130.71	14.3	96.7	1.1	2.1	197,280
14期(2015年5月12日)	23,063	26.9	162.29	24.2	96.5	1.2	2.2	227,514

(注) MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) とは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCI Kokusai Index (円換算ベース) は、MSCI Kokusai Index (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 Kokusai Index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) 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) 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 Kokusai Index (MSCIコクサイインデックス)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(円換算ベース)	騰 落 率			
(期 首)	円	%		%	%	%	%
2014年5月12日	18,176	—	130.71	—	96.7	1.1	2.1
5月末	18,457	1.5	132.39	1.3	96.8	1.0	2.1
6月末	18,691	2.8	133.82	2.4	96.4	1.5	2.1
7月末	18,954	4.3	135.55	3.7	96.6	1.2	2.1
8月末	19,245	5.9	137.34	5.1	96.7	0.6	2.1
9月末	19,806	9.0	141.15	8.0	96.2	1.5	2.0
10月末	19,703	8.4	140.33	7.4	96.6	1.9	2.2
11月末	22,081	21.5	157.01	20.1	96.6	1.3	2.2
12月末	22,369	23.1	158.82	21.5	95.1	3.3	2.2
2015年1月末	21,419	17.8	151.94	16.2	96.1	1.7	2.5
2月末	22,648	24.6	160.26	22.6	95.9	1.1	2.2
3月末	22,610	24.4	159.52	22.0	96.2	1.4	2.3
4月末	22,826	25.6	160.95	23.1	96.2	1.3	2.2
(期 末)							
2015年5月12日	23,063	26.9	162.29	24.2	96.5	1.2	2.2

(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

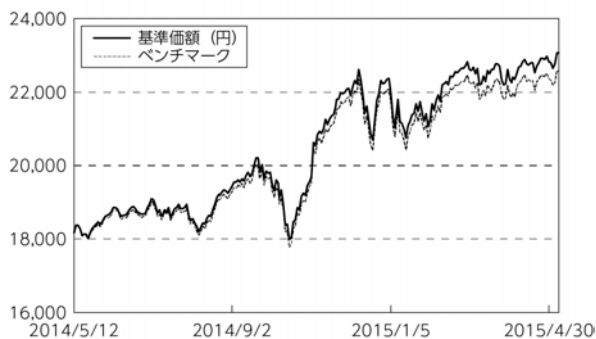
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ26.9%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(24.2%)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

◎外国株式市況

- ・欧州経済の先行き不透明感やギリシャ債務問題などを受けて下落する局面もありましたが、欧米での緩和的な金融政策や米国の良好な企業決算発表などを受けて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17.8%の円安・米ドル高、4.6%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

- ・MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円換算ベース) に採用されている株式 (先物・REIT (不動産投資信託証券) を含む) を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。

- ・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

(注) マルチファクターモデル

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

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは24.2%の上昇となったため、カイ離は2.7%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	△0.0%程度	2.7%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△0.0%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2.7%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入等	計 2.8%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

- ・引き続き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

(2014年5月13日～2015年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 1 (1) (0) (0)	% 0.006 (0.004) (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 有価証券等を売買する際に発生する費用
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	2 (2) (0)	0.008 (0.008) (0.000)	(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)	7 (6) (0)	0.032 (0.030) (0.002)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 外国での資産の保管等に要する費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	10	0.046	
期中の平均基準価額は、20,734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) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(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

(2014年5月13日～2015年5月12日)

株式

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外	アメリカ	百株 27,271 (6,230)	千アメリカドル 157,660 (△ 89)	百株 43,545 (255)	千アメリカドル 252,034 (3,213)	
	カナダ	3,854 (474)	千カナダドル 14,155 (ー)	6,571 (79)	千カナダドル 20,326 (475)	
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ	
	ドイツ	2,638 (1,120)	9,716 (△ 99)	3,651 (ー)	12,025 (92)	
	イタリア	8,252 (△ 478)	2,588 (△ 407)	7,076	2,857	
	フランス	2,592 (447)	8,687 (△ 132)	3,482 (0.01)	11,748 (0.31526)	
	オランダ	1,615 (541)	2,998 (407)	2,527	4,774	
	スペイン	7,591 (66,817)	5,830 (671)	62,134 (9,591)	5,294 (109)	
	ベルギー	151	1,046	257	1,674	
	オーストリア	194	163	437	342	
	ルクセンブルク	187	504	228	379	
	フィンランド	476	693	834	1,229	
	アイルランド	4,274	406	2,497	321	
	ポルトガル	27,129 (1,173)	554 (ー)	8,667	388	
	国	イギリス	27,479 (262,007)	千イギリスポンド 14,125 (△ 125)	34,291 (270,239)	千イギリスポンド 20,763 (41)
		スイス	3,470 (2,261)	千スイスフラン 12,034 (2,998)	4,241 (2,261)	千スイスフラン 17,501 (3,860)
		スウェーデン	1,790	千スウェーデンクローネ 24,841	2,823	千スウェーデンクローネ 40,550
		ノルウェー	564 (94)	千ノルウェークローネ 5,549 (ー)	974	千ノルウェークローネ 8,624
		デンマーク	575	千デンマーククローネ 19,180	507	千デンマーククローネ 14,562
オーストラリア		8,526 (42)	千オーストラリアドル 9,385 (△ 53)	9,640 (40)	千オーストラリアドル 13,180 (2)	

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ニュージーランド	百株 1,459 (-)	千ニュージーランドドル 477 (39)	百株 416	千ニュージーランドドル 264
	香港	10,199 (4,548)	千香港ドル 26,771 (-)	15,356	千香港ドル 38,323
	シンガポール	4,711 (201)	千シンガポールドル 2,099 (-)	9,321	千シンガポールドル 3,548
	イスラエル	289 (11)	千イスラエルシェケル 1,901 (-)	601	千イスラエルシェケル 3,023

(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	3	143	5	243
MACERICH CO/THE	0.952	72	1	116
PROLOGIS INC	2	126	5	216
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.515	39	0.797	60
DIGITAL REALTY TRUST INC	1	114	1	125
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.559	119	0.661	137
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.512	69	0.568	77
HEALTH CARE REIT INC	5	406	3	262
BOSTON PROPERTIES INC	1	161	2	260
REALTY INCOME CORP	1	75	2	121
REGENCY CENTERS CORP	0.798	53	1	67
SL GREEN REALTY CORP	0.733	90	0.979	116
UDR INC	2	75	3	106
VENTAS INC	4	303	3	274
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	7	83	13	151
RAYONIER INC	1	41	2	59
WEYERHAEUSER CO	4	154	10	364
AMERICAN TOWER CORP	4	393	4	438
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	1	33	5	122
AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	17	193	10	100
DUKE REALTY CORP	2	51	2	55
WP GLIMCHER INC	—	—	9	194
	(9)	(—)		
RAYONIER ADVANCED MATERIALS	—	—	2	115
	(2)	(—)		
IRON MOUNTAIN INC	0.353	14	1	62
	(11)	(310)		
URBAN EDGE PROPERTIES	—	—	4	120
	(4)	(—)		
EQUINIX INC	0.268	63	0.224	51
	(3)	(626)		
COMMUNICATIONS SALES & LE	—	—	—	—
	(7)	(244)		
EQUITY RESIDENTIAL	2	168	3	271
GENERAL GROWTH PROPERTIES	2	71	6	171
HOST HOTELS & RESORTS INC	2	66	6	151
LIBERTY PROPERTY TRUST	1	56	2	75
PLUM CREEK TIMBER CO	1	56	2	94
PUBLIC STORAGE	1	191	1	336
SIMON PROPERTY GROUP INC	2	389	3	658
VORNADO REALTY TRUST	1	148	2	246
KIMCO REALTY CORP	3	80	5	129

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
	AVALONBAY COMMUNITIES INC		1	170	1	181
	小計		85 (38)	4,281 (1,181)	138	6,341
	カナダ			千カナダドル		千カナダドル
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		0.6	17	0.9	24
	小計		0.6	17	0.9	24
	ユーロ			千ユーロ		千ユーロ
	フランス					
	GECINA SA		0.644	73	0.369	42
	KLEPIERRE		5	214	1	47
	UNIBAIL-RODAMCO SE		0.689	155	1	246
	FONCIERE DES REGIONS		0.392 (-)	33 (△ 4)	0.352 (-)	29 (0.00001)
	FONCIERE DES REGIONS-RTS		- (1)	- (-)	1	2
	ICADE		0.148	11	0.287	19
	小計		7 (1)	487 (△ 4)	4 (-)	388 (0.00001)
	オランダ					
	CORTIO NV		0.692	27	4	212
	小計		0.692	27	4	212
	ユーロ計		7 (1)	514 (△ 4)	9 (-)	601 (0.00001)
	イギリス			千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC		9	71	12	99
	HAMMERSON PLC		12	76	11	70
	LAND SECURITIES GROUP PLC		6	72	9	110
	INTU PROPERTIES PLC		10	35	12	43
	SEGRO PLC		11	45	15	61
	小計		49	300	62	385
	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
	FEDERATION CENTRES		14	41	13	40
WESTFIELD RETAIL TRUST		-	-	(190)	(613)	
SCENTRE GROUP		24 (331)	87 (558)	39	140	
NOVION PROPERTY GROUP		24	58	24	58	
GPT GROUP		14	58	22	91	
MIRVAC GROUP		41	76	57	104	
STOCKLAND		13	54	23	96	
WESTFIELD CORP		14	126	24	215	
DEXUS PROPERTY GROUP		40 (△ 297)	79 (-)	47	101	

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	オーストラリア	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
	GOODMAN GROUP	3	17	8	45
	小計	189 (34)	600 (558)	261 (190)	893 (613)
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	20	975	32	1,507
	小計	20	975	32	1,507
	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	153 (-)	296 (△0.2574)	10	19
	CAPITALAND MALL TRUST	14 (-)	29 (△0.1872)	33	67
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	- (-)	- (△0.0759)	9	21
小計	167 (-)	325 (△0.5205)	52	107	

(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 61,990	百万円 61,960	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

(2014年5月13日～2015年5月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	76,575,341千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	205,745,833千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.37

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2014年5月13日～2015年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 36,995	百万円 313	% 0.8	百万円 58,387	百万円 4,094	% 7.0

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

(2015年5月12日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ALCOA INC	693	698	953	114,526	素材
AMERICAN EXPRESS CO	618	551	4,397	528,334	各種金融
AVON PRODUCTS INC	272	252	178	21,421	家庭用品・パーソナル用品
ABBOTT LABORATORIES	994	892	4,223	507,509	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	211	198	844	101,448	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	33	33	738	88,729	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	310	285	2,488	298,987	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	—	42	270	32,450	小売
AES CORP	443	404	553	66,543	公益事業
AFLAC INC	300	266	1,703	204,721	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	897	829	4,910	590,041	保険
ALLERGAN INC	190	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
APACHE CORP	256	222	1,407	169,116	エネルギー
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	31	37	1,140	137,021	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	408	371	3,568	428,812	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	136	126	1,848	222,060	素材
ANTHEM INC	190	159	2,540	305,220	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	322	300	2,591	311,358	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	854	785	1,372	164,905	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	349	320	2,223	267,144	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	458	401	5,857	703,759	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	124	123	1,754	210,849	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	176	177	656	78,848	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,057	983	6,697	804,740	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	85	78	2,877	345,688	各種金融
VERTIZON COMMUNICATIONS INC	2,653	2,459	12,250	1,471,849	電気通信サービス
CR BARD INC	47	44	753	90,474	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	86	77	559	67,247	素材
BAKER HUGHES INC	285	256	1,704	204,736	エネルギー
ALLSTATE CORP	293	248	1,661	199,583	保険
AVERY DENNISON CORP	63	53	313	37,621	素材
ACE LTD	218	196	2,127	255,617	保険
ANALOG DEVICES INC	200	185	1,164	139,896	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	21	18	1,285	154,477	小売
CVS HEALTH CORP	763	679	6,830	820,649	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ENTERPRISES	157	136	624	74,999	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	931	758	1,617	194,285	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	2,413	2,216	14,503	1,742,629	銀行
CIGNA CORP	177	154	1,988	238,874	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	409	340	3,023	363,231	資本財
COCA-COLA CO/THE	2,550	2,337	9,568	1,149,640	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	370	329	2,741	329,359	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	130	121	555	66,771	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	650	590	2,128	255,701	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	122	118	237	28,548	メディア
CHEVRON CORP	1,234	1,120	12,029	1,445,379	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	
COACH INC	178	163	626	75,243	耐久消費財・アパレル
ROCKWELL COLLINS INC	82	70	683	82,138	資本財
COMPUTER SCIENCES CORP	93	83	544	65,427	ソフトウェア・サービス
CONOCOPHILLIPS	746	729	4,763	572,363	エネルギー
CME GROUP INC	203	189	1,807	217,164	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	218	195	1,692	203,351	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	594	540	3,665	440,364	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION RESOURCES INC/VA	374	347	2,466	296,362	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE	779	698	3,624	435,513	素材
DEVON ENERGY CORP	248	230	1,530	183,842	エネルギー
DEERE & CO	235	201	1,837	220,794	資本財
DANAHER CORP	379	374	3,130	376,128	資本財
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	595	536	4,048	486,430	素材
WALT DISNEY CO/THE	1,070	954	10,370	1,246,033	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC	84	79	510	61,377	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	455	420	3,220	387,002	公益事業
DR HORTON INC	189	194	495	59,582	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC	63	57	319	38,412	小売
TARGET CORP	383	358	2,888	347,014	小売
DENBURY RESOURCES INC	239	—	—	—	エネルギー
DUN & BRADSTREET CORP	24	21	273	32,819	商業・専門サービス
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	42	39	132	15,912	エネルギー
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I	115	101	830	99,755	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	109	98	738	88,737	資本財
DTE ENERGY COMPANY	113	105	834	100,210	公益事業
EXXON MOBIL CORP	2,804	2,510	21,784	2,617,435	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	69	63	810	97,330	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	350	324	2,976	357,593	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	452	410	2,434	292,484	資本財
EXELON CORP	552	510	1,704	204,833	公益事業
ECOLAB INC	174	159	1,816	218,209	素材
EQUIFAX INC	77	71	709	85,224	商業・専門サービス
ENSCO PLC-CL A	149	138	361	43,479	エネルギー
EMC CORP/MA	1,324	1,205	3,233	388,546	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	152	137	1,206	144,942	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	304	280	2,028	243,781	資本財
EDISON INTERNATIONAL	200	184	1,111	133,582	公益事業
ENTERGY CORP	115	107	819	98,425	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	30	26	483	58,144	保険
ENERGIZER HOLDINGS INC	39	36	510	61,340	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC	281	259	2,597	312,072	公益事業
MACY'S INC	237	204	1,350	162,208	小売
FEDEX CORP	192	159	2,780	334,065	運輸
FMC TECHNOLOGIES INC	153	137	569	68,464	エネルギー
FAMILY DOLLAR STORES	66	60	478	57,466	小売
FORD MOTOR CO	2,370	2,127	3,328	399,970	自動車・自動車部品
FOREST LABORATORIES INC	154	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FRANKLIN RESOURCES INC	263	238	1,237	148,638	各種金融
FOOT LOCKER INC	—	84	519	62,381	小売
FIRSTENERGY CORP	271	250	874	105,060	公益事業
FLUOR CORP	104	92	554	66,637	資本財
FREEMPORT-MCMORAN INC	663	614	1,411	169,564	素材

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
GENERAL MILLS INC	408	357	2,004	240,867	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	191	166	2,338	281,015	資本財
WW GRAINGER INC	37	36	907	109,055	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	6,497	5,953	16,026	1,925,625	資本財
GENUINE PARTS CO	99	90	851	102,326	小売
GAP INC/THE	157	143	570	68,531	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	276	232	4,684	562,900	各種金融
HALLIBURTON CO	545	502	2,370	284,775	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	479	440	4,525	543,695	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	143	126	720	86,540	自動車・自動車部品
HEWLETT-PACKARD CO	1,234	1,106	3,727	447,878	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	274	254	1,059	127,275	保険
HERSHEY CO/THE	99	90	845	101,627	食品・飲料・タバコ
DIRECTV	320	282	2,526	303,570	メディア
HOSPIRA INC	105	100	884	106,233	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HOME DEPOT INC	904	781	8,739	1,050,091	小売
HASBRO INC	73	66	480	57,709	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	188	157	1,058	127,150	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	662	557	9,536	1,145,853	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	270	237	1,256	150,991	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	270	219	2,105	253,002	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	266	246	518	62,281	メディア
IRON MOUNTAIN INC	89	—	—	—	商業・専門サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	52	48	575	69,089	素材
INTERNATIONAL GAME TECHNOLOG	152	—	—	—	消費者サービス
JOHNSON & JOHNSON	1,811	1,659	16,764	2,014,256	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC	439	394	1,985	238,553	自動車・自動車部品
KANSAS CITY SOUTHERN	70	66	666	80,078	運輸
KELLOGG CO	163	157	1,004	120,648	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	245	221	2,435	292,638	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,071	995	3,915	470,399	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	318	276	1,986	238,628	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	133	121	902	108,375	小売
ELI LILLY & CO	652	593	4,363	524,278	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	56	59	698	83,971	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	114	101	437	52,531	運輸
LENNAR CORP-A	106	101	475	57,187	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	672	584	4,281	514,479	小売
LEGGETT & PLATT INC	88	81	379	45,564	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	158	147	1,314	157,913	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	263	237	1,229	147,782	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	175	159	3,031	364,191	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	167	154	910	109,385	保険
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	56	50	588	70,716	資本財
LEGG MASON INC	71	61	334	40,200	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	152	134	1,071	128,694	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	639	576	5,624	675,815	消費者サービス
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	164	160	1,728	207,710	各種金融
MEDTRONIC PLC	642	839	6,383	766,919	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	1,875	1,690	10,140	1,218,407	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	677	635	1,764	212,009	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	216	202	554	66,652	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	
3M CO	410	360	5,769	693,206	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	150	133	795	95,567	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	251	234	454	54,577	消費者サービス
MASCO CORP	230	209	558	67,156	資本財
MONSANTO CO	337	286	3,385	406,729	素材
MEADWESTVACO CORP	114	97	482	57,945	素材
M & T BANK CORP	75	70	856	102,924	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	353	320	1,856	223,021	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	39	37	675	81,206	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	937	869	3,326	399,700	各種金融
MCKESSON CORP	147	137	3,141	377,452	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	612	571	3,047	366,109	保険
MANPOWERGROUP INC	50	47	402	48,311	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	123	111	1,184	142,327	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	199	183	1,837	220,743	運輸
BANK OF AMERICA CORP	6,847	6,233	10,279	1,235,064	銀行
NISOURCE INC	201	188	837	100,657	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	135	113	1,775	213,383	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	287	265	455	54,729	銀行
NEWMONT MINING CORP	318	292	772	92,772	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	948	804	2,638	317,056	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	77	69	538	64,675	食品・飲料・タバコ
NUCOR CORP	204	189	928	111,511	素材
SAFEWAY INC	155	—	—	—	食品・生活必需品小売り
NEWELL RUBBERMAID INC	184	160	644	77,425	耐久消費財・アパレル
NOBLE CORP PLC	160	149	256	30,812	エネルギー
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	288	259	843	101,358	メディア
NOBLE ENERGY INC	230	229	1,055	126,836	エネルギー
PALL CORP	71	62	622	74,790	資本財
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	518	461	3,541	425,534	エネルギー
OMNICARE INC	65	57	516	62,069	ヘルスケア機器・サービス
OMNICOM GROUP	166	146	1,126	135,323	メディア
PEPSICO INC	984	887	8,549	1,027,259	食品・飲料・タバコ
ALTRIA GROUP INC	1,285	1,171	6,016	722,861	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	72	66	395	47,524	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,744	1,602	12,859	1,545,126	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	340	311	2,918	350,636	銀行
PFIZER INC	4,160	3,735	12,684	1,524,079	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	296	269	2,341	281,350	保険
PULTEGROUP INC	216	196	383	46,062	耐久消費財・アパレル
PEPCO HOLDINGS INC	160	151	376	45,225	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	95	88	1,078	129,549	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	89	88	1,349	162,163	エネルギー
CITIGROUP INC	1,948	1,795	9,690	1,164,310	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	189	174	911	109,558	保険
PPG INDUSTRIES INC	91	81	1,847	221,923	素材
PEABODY ENERGY CORP	172	—	—	—	エネルギー
PENTAIR PLC	127	111	692	83,147	資本財
PRAAIR INC	189	172	2,056	247,034	素材
P G & E CORP	290	282	1,471	176,829	公益事業
PPL CORP	406	396	1,336	160,608	公益事業
PROGRESSIVE CORP	368	330	895	107,535	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	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	323	301	1,266	152,145	公益事業
STARWOOD HOTELS & RESORTS	122	106	896	107,745	消費者サービス
SPX CORP	26	20	160	19,239	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	98	98	717	86,169	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	204	182	1,948	234,151	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	189	168	673	80,888	商業・専門サービス
ROWAN COMPANIES PLC-A	82	—	—	—	エネルギー
REGIONS FINANCIAL CORP	879	819	825	99,210	銀行
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	28	27	290	34,851	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	63	59	1,017	122,209	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	260	245	503	60,495	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	87	80	457	54,998	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	88	80	972	116,867	資本財
SCHLUMBERGER LTD	844	763	7,003	841,439	エネルギー
STRYKER CORP	193	201	1,902	228,538	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	747	695	2,229	267,905	各種金融
SEMPRA ENERGY	149	139	1,463	175,859	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	55	48	1,386	166,627	素材
ST JUDE MEDICAL INC	187	169	1,226	147,344	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	94	88	915	109,995	資本財
SUNTRUST BANKS INC	344	308	1,313	157,831	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	233	196	2,005	240,967	保険
SOUTHERN CO/THE	567	535	2,334	280,496	公益事業
AT&T INC	3,380	3,074	10,295	1,237,003	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	136	130	1,254	150,675	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	280	246	1,926	231,437	各種金融
SYSCO CORP	373	347	1,268	152,467	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	121	119	580	69,787	素材
SCANA CORP	86	81	426	51,184	公益事業
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	100	92	221	26,595	エネルギー
TEXAS INSTRUMENTS INC	704	625	3,407	409,412	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	81	77	675	81,112	小売
TORCHMARK CORP	57	74	428	51,478	保険
TYCO INTERNATIONAL PLC	299	248	979	117,742	商業・専門サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	231	237	3,077	369,811	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	182	164	748	89,949	資本財
UNION PACIFIC CORP	296	527	5,628	676,251	運輸
UNUM GROUP	166	150	523	62,875	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	559	513	6,041	725,877	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	646	569	6,531	784,711	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,173	1,060	4,639	557,437	銀行
MARATHON OIL CORP	448	399	1,134	136,316	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	461	416	4,190	503,511	運輸
VALERO ENERGY CORP	347	308	1,798	216,083	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	67	59	521	62,716	ヘルスケア機器・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	361	284	1,695	203,760	メディア
VF CORP	225	204	1,466	176,174	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	84	78	717	86,201	素材
TOWERS WATSON & CO-CL A	42	41	548	65,847	商業・専門サービス
WILLIAMS COS INC	440	420	2,088	250,886	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	579	516	4,355	523,259	食品・生活必需品小売り
WISCONSIN ENERGY CORP	146	136	652	78,403	公益事業

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
WAL-MART STORES INC	1,044	955	7,461	896,491	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO	3,211	2,921	16,219	1,948,748	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	288	257	1,270	152,644	商業・専門サービス
WATERS CORP	55	49	651	78,282	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	492	461	657	78,996	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	50	46	866	104,083	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	753	636	715	85,955	ソフトウェア・サービス
XL GROUP PLC	183	178	657	78,968	保険
XCEL ENERGY INC	328	301	1,009	121,241	公益事業
KEYCORP	576	511	754	90,665	銀行
CARMAX INC	142	127	911	109,524	小売
ZIMMER HOLDINGS INC	110	100	1,133	136,230	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	105	101	368	44,304	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	285	259	2,325	279,389	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	458	410	2,741	329,448	小売
CA INC	203	196	610	73,333	ソフトウェア・サービス
CAMERON INTERNATIONAL CORP	153	116	602	72,426	エネルギー
CLOROX COMPANY	82	76	818	98,315	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	100	91	604	72,654	素材
CARNIVAL CORP	248	228	1,056	126,926	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	185	167	1,081	129,941	ソフトウェア・サービス
CHUBB CORP	162	139	1,389	166,895	保険
CONAGRA FOODS INC	272	251	939	112,851	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	190	174	1,074	129,155	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	566	487	989	118,905	銀行
STERICYCLE INC	54	50	669	80,466	商業・専門サービス
INTEL CORP	3,192	2,866	9,369	1,125,789	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	3,434	3,030	8,853	1,063,750	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	65	59	496	59,636	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	82	76	884	106,264	電気通信サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	281	259	3,743	449,766	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	770	721	1,436	172,575	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	196	184	1,153	138,619	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	174	180	748	89,908	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	442	408	1,037	124,688	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	138	124	1,267	152,274	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	129	120	594	71,422	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	457	405	4,164	500,381	耐久消費財・アパレル
AMGEN INC	484	450	7,262	872,614	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	118	106	518	62,255	銀行
NORTHERN TRUST CORP	146	132	995	119,659	各種金融
MICROSOFT CORP	5,092	4,642	21,991	2,642,218	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	59	54	474	56,988	ソフトウェア・サービス
STAPLES INC	412	381	634	76,290	小売
STARBUCKS CORP	484	887	4,390	527,548	消費者サービス
ORACLE CORP	2,340	2,101	9,212	1,106,907	ソフトウェア・サービス
ALTERA CORP	205	181	803	96,541	半導体・半導体製造装置
WHOLE FOODS MARKET INC	225	213	911	109,511	食品・生活必需品小売り
PETSMART INC	63	—	—	—	小売
NETFLIX INC	34	33	2,000	240,360	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	68	60	1,323	159,049	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	288	299	737	88,663	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	
URBAN OUTFITTERS INC	73	63	256	30,853	小売
SKYWORKS SOLUTIONS INC	—	113	1,101	132,322	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	54	49	678	81,525	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	90	80	701	84,315	小売
LAM RESEARCH CORP	103	94	739	88,865	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	51	47	545	65,559	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,373	1,274	7,362	884,610	メディア
XILINX INC	171	157	691	83,047	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	227	209	1,397	167,858	資本財
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	93	84	425	51,070	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	984	894	9,367	1,125,451	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	120	96	638	76,732	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	24	21	1,066	128,163	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	174	160	1,642	197,312	ソフトウェア・サービス
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	298	246	1,422	170,865	メディア
NUANCE COMMUNICATIONS INC	162	152	255	30,737	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	210	193	948	114,006	ソフトウェア・サービス
YAHOO! INC	618	532	2,323	279,203	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	53	48	224	27,017	ヘルスケア機器・サービス
AUTODESK INC	143	135	776	93,350	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	137	147	744	89,455	メディア
SALESFORCE.COM INC	368	355	2,528	303,776	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	97	83	645	77,544	小売
GOOGLE INC-CL A	177	168	9,215	1,107,241	ソフトウェア・サービス
JOY GLOBAL INC	69	58	259	31,139	資本財
B/E AEROSPACE INC	64	62	371	44,674	資本財
GARMIN LTD	75	67	315	37,868	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE NAVIGATION LTD	165	150	384	46,251	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	1,084	985	6,803	817,406	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	173	133	456	54,875	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	97	91	442	53,190	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP	148	142	659	79,220	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	183	168	555	66,799	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	235	233	10,098	1,213,321	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	168	153	1,256	150,920	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	93	85	603	72,457	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	108	98	588	70,740	半導体・半導体製造装置
CERNER CORP	200	182	1,242	149,325	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC	—	87	518	62,306	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	86	68	437	52,535	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	98	169	958	115,180	電気通信サービス
BROADCOM CORP-CL A	334	320	1,474	177,143	半導体・半導体製造装置
EBAY INC	748	662	3,865	464,389	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	367	323	667	80,225	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	132	122	967	116,188	小売
PRICELINE GROUP INC/THE	33	31	3,680	442,170	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	712	684	10,010	1,202,755	各種金融
BB&T CORP	453	425	1,661	199,654	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	740	666	2,882	346,382	各種金融
BORGWARNER INC	145	135	822	98,848	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	172	163	516	62,021	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	67	60	703	84,531	食品・飲料・タバコ

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	
TIME WARNER INC	582	496	4,125	495,630	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP	146	129	1,488	178,820	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	45	42	273	32,870	保険
AETNA INC	236	208	2,277	273,587	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	155	146	589	70,834	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	314	291	1,614	194,003	公益事業
AON PLC	184	160	1,606	193,062	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	424	381	1,966	236,278	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	65	56	313	37,691	保険
HESS CORP	195	159	1,142	137,231	エネルギー
CROWN CASTLE INTL CORP	214	197	1,635	196,522	不動産
JUNIPER NETWORKS INC	326	231	628	75,457	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	142	160	597	71,729	各種金融
RED HAT INC	120	111	853	102,526	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	50	43	547	65,742	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	140	131	875	105,165	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	115	105	801	96,325	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	219	185	646	77,722	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	—	90	943	113,383	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	249	224	315	37,950	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	151	140	5,556	667,642	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	81	84	1,661	199,654	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC	304	280	2,155	258,956	ソフトウェア・サービス
EQUINIX INC	32	—	—	—	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	150	142	1,768	212,501	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC	138	110	776	93,317	小売
CELGENE CORP	264	473	5,369	645,116	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CREE INC	75	71	223	26,844	半導体・半導体製造装置
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	388	360	2,260	271,545	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	518	435	3,746	450,118	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	132	116	558	67,132	運輸
FASTENAL CO	181	166	705	84,711	資本財
FISERV INC	164	144	1,156	138,901	ソフトウェア・サービス
FLEXTRONICS INTL LTD	388	347	418	50,273	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOSSIL GROUP INC	31	27	221	26,669	耐久消費財・アパレル
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,986	1,451	555	66,786	メディア
SANDISK CORP	145	130	885	106,358	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	577	3,477	43,923	5,277,467	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	99	91	467	56,118	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	—	485	538	64,753	銀行
SIGMA-ALDRICH	76	70	981	117,891	素材
SEARS HOLDINGS CORP	24	—	—	—	小売
NABORS INDUSTRIES LTD	189	150	240	28,930	エネルギー
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	125	117	1,892	227,350	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHLAND INC	47	39	517	62,165	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	98	88	575	69,097	運輸
CENTURYLINK INC	378	337	1,159	139,349	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	88	85	268	32,212	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	245	246	1,762	211,716	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	72	65	689	82,859	自動車・自動車部品
ONEOK INC	131	123	537	64,546	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC	207	188	1,426	171,439	食品・飲料・タバコ

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	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	—	299	251	30,266	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	208	193	1,099	132,056	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	94	85	769	92,490	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	46	43	634	76,191	小売
CONSOL ENERGY INC	147	136	440	52,872	エネルギー
NATIONAL OILWELL VARCO INC	275	255	1,309	157,290	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	106	100	1,177	141,431	食品・飲料・タバコ
CHESAPEAKE ENERGY CORP	343	315	478	57,464	エネルギー
PARTNERRE LTD	30	26	352	42,406	保険
COOPER COS INC/THE	—	28	519	62,441	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	96	90	810	97,440	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	102	183	1,046	125,775	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	74	63	314	37,820	保険
OWENS-ILLINOIS INC	101	99	239	28,830	素材
AGCO CORP	61	52	267	32,174	資本財
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	94	87	269	32,331	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP	90	84	1,132	136,034	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA INC	68	61	635	76,358	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	36	29	909	109,232	素材
HUDSON CITY BANCORP INC	295	277	260	31,307	銀行
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	340	375	1,820	218,783	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC	124	109	1,367	164,299	各種金融
TESORO CORP	86	75	665	79,960	エネルギー
FNF GROUP	157	149	569	68,448	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	73	66	1,601	192,364	各種金融
NASDAQ OMX GROUP/THE	77	70	359	43,138	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	106	99	780	93,803	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	254	212	1,389	166,960	メディア
AUTOLIV INC	60	53	646	77,657	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	177	178	684	82,242	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	19	18	1,170	140,607	消費者サービス
IHS INC-CLASS A	40	39	501	60,272	商業・専門サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	78	73	678	81,533	食品・飲料・タバコ
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	307	265	726	87,342	小売
ARROW ELECTRONICS INC	65	57	353	42,490	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	114	102	1,456	175,008	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	84	78	341	41,080	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP	196	185	445	53,521	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	30	33	515	61,878	素材
RANGE RESOURCES CORP	104	100	632	75,961	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO	227	226	651	78,217	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	55	51	597	71,805	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	38	35	484	58,156	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	72	66	399	47,982	公益事業
OCEANEERING INTL INC	70	63	338	40,691	エネルギー
WINDSTREAM HOLDINGS INC	382	—	—	—	電気通信サービス
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	82	72	636	76,467	消費者サービス
HANESBRANDS INC	—	237	757	90,972	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC-CLASS A	668	593	5,492	659,873	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	356	310	674	81,050	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	47	—	—	—	ソフトウェア・サービス
KBR INC	91	—	—	—	資本財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AVNET INC	90	82	366	44,071	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	191	190	855	102,787	素材
SPECTRA ENERGY CORP	430	397	1,430	171,874	エネルギー
TRANSDIGM GROUP INC	32	29	655	78,765	資本財
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	109	94	450	54,154	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	200	184	282	33,975	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	262	240	1,674	201,141	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COVIDIEN PLC	289	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	307	268	1,593	191,454	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	63	63	418	50,292	耐久消費財・アパレル
PRECISION CASTPARTS CORP	93	84	1,765	212,072	資本財
VMWARE INC-CLASS A	55	49	445	53,529	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	212	198	817	98,171	保険
TIME WARNER CABLE	180	166	2,571	308,986	メディア
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	37	36	555	66,727	小売
LKQ CORP	196	181	499	60,046	小売
HORMEL FOODS CORP	94	86	483	58,120	食品・飲料・タバコ
EASTMAN CHEMICAL CO	98	88	707	84,999	素材
GAMESTOP CORP-CLASS A	73	66	265	31,854	小売
HARRIS CORP	68	62	486	58,495	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	99	90	1,513	181,816	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP	114	99	448	53,841	エネルギー
NRG ENERGY INC	206	203	528	63,477	公益事業
INVESCO LTD	287	254	1,048	125,978	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	92	92	1,118	134,360	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	91	83	391	47,036	各種金融
TERADATA CORP	105	89	357	42,968	ソフトウェア・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	106	99	407	48,932	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	66	70	816	98,082	エネルギー
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	29	54	258	31,005	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	96	90	681	81,907	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,029	921	7,749	931,068	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	324	1,169	8,071	969,746	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	128	115	880	105,843	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N.V.	29	26	332	39,911	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP	272	246	862	103,641	エネルギー
FLOWSERVE CORP	89	80	445	53,571	資本財
HELMERICH & PAYNE	68	63	479	57,631	エネルギー
MDU RESOURCES GROUP INC	114	111	226	27,204	公益事業
ENERGEN CORP	46	43	296	35,626	エネルギー
T-MOBILE US INC	155	144	492	59,124	電気通信サービス
LORILLARD INC	237	213	1,520	182,676	食品・飲料・タバコ
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	53	45	305	36,654	メディア
RACKSPACE HOSTING INC	78	72	383	46,108	ソフトウェア・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	54	164	468	56,344	メディア
RESMED INC	90	82	538	64,678	ヘルスケア機器・サービス
AMETEK INC	157	145	768	92,305	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	86	76	482	57,954	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	88	78	655	78,774	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	60	56	490	58,879	運輸
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	52	48	346	41,643	公益事業
PERRIGO CO PLC	86	83	1,613	193,860	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	
QUANTA SERVICES INC	136	126	370	44,466	資本財
FMC CORP	85	79	482	57,961	素材
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	79	72	729	87,709	食品・飲料・タバコ
WABTEC CORP	—	56	560	67,380	資本財
EVERSOURCE ENERGY	202	189	917	110,210	公益事業
NETSUITE INC	22	20	197	23,680	ソフトウェア・サービス
ACTAVIS PLC	111	223	6,735	809,263	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRGAS INC	42	40	403	48,459	素材
CROWN HOLDINGS INC	86	81	450	54,136	素材
CALPINE CORP	227	196	419	50,419	公益事業
EATON VANCE CORP	76	70	290	34,900	各種金融
DELTA AIR LINES INC	137	124	581	69,892	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	129	119	1,141	137,097	食品・飲料・タバコ
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	158	149	1,840	221,098	半導体・半導体製造装置
AMERICAN WATER WORKS CO INC	117	107	564	67,846	公益事業
CAREFUSION CORP	134	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
OCWEN FINANCIAL CORP	75	—	—	—	銀行
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	97	95	702	84,347	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	198	179	1,343	161,370	小売
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	61	55	348	41,871	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	19	17	555	66,777	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	120	108	500	60,124	銀行
QEP RESOURCES INC	116	99	204	24,540	エネルギー
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	646	599	350	42,083	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO	785	761	2,681	322,196	自動車・自動車部品
LYONDELLBASELL INDU-CL A	301	252	2,607	313,282	素材
HCA HOLDINGS INC	202	179	1,396	167,759	ヘルスケア機器・サービス
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	291	268	553	66,550	運輸
WHITING PETROLEUM CORP	76	121	420	50,486	エネルギー
ROCK-TENN COMPANY -CL A	45	83	533	64,071	素材
HOLLYFRONTIER CORP	122	111	461	55,499	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	193	165	1,697	203,910	エネルギー
ZILLOW GROUP INC - CL A	—	28	284	34,142	ソフトウェア・サービス
XYLEM INC	118	107	395	47,500	資本財
HERBALIFE LTD	56	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
TRIPADVISOR INC	75	69	570	68,596	小売
MEDIVATION INC	—	46	572	68,727	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	—	35	627	75,350	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	57	77	458	55,087	銀行
ALLEGHANY CORP	10	9	462	55,533	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	49	47	2,257	271,229	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	365	327	2,640	317,237	エネルギー
FACEBOOK INC-A	1,184	1,186	9,256	1,112,179	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP	173	166	558	67,133	公益事業
ALBEMARLE CORP	51	66	418	50,331	素材
PVH CORP	51	48	513	61,690	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A	64	64	1,284	154,376	ソフトウェア・サービス
KINDER MORGAN INC	431	1,067	4,550	546,783	エネルギー
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	182	166	176	21,254	エネルギー
NIELSEN NV	184	207	931	111,949	商業・専門サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	187	175	1,487	178,672	自動車・自動車部品
CHARTER COMMUNICATION-A	40	45	806	96,919	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		
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	95	95	540	64,957	資本財	
ADT CORP/THE	124	103	389	46,751	商業・専門サービス	
KRAFT FOODS GROUP INC	381	348	3,008	361,446	食品・飲料・タバコ	
OGE ENERGY CORP	126	121	386	46,466	公益事業	
POLARIS INDUSTRIES INC	42	37	539	64,871	耐久消費財・アパレル	
ABBVIE INC	1,022	944	6,157	739,822	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LIBERTY MEDIA CORP - A	63	52	195	23,531	メディア	
TESLA MOTORS INC	55	52	1,248	149,973	自動車・自動車部品	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	72	—	—	—	エネルギー	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC-NEW	1	—	—	—	エネルギー	
CHENIERE ENERGY INC	131	133	1,032	124,102	エネルギー	
REALOGY HOLDINGS CORP	95	85	390	46,901	不動産	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	81	74	435	52,367	各種金融	
ZOETIS INC	325	296	1,367	164,326	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MALLINCKRODT PLC	—	69	856	102,954	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NEWS CORP - CLASS A	240	224	353	42,430	メディア	
SPRINT CORP	638	479	225	27,062	電気通信サービス	
SNAP-ON INC	—	34	540	64,976	資本財	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	125	122	772	92,770	耐久消費財・アパレル	
TWITTER INC	—	226	844	101,459	ソフトウェア・サービス	
VANTIV INC - CL A	91	86	349	42,033	ソフトウェア・サービス	
WORKDAY INC-CLASS A	54	58	531	63,853	ソフトウェア・サービス	
SERVICENOW INC	80	79	589	70,825	ソフトウェア・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	57	54	667	80,222	ヘルスケア機器・サービス	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	61	56	277	33,371	資本財	
PHARMACYCLICS INC	40	38	970	116,629	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	45	46	710	85,358	ソフトウェア・サービス	
GOOGLE INC-CL C	177	171	9,184	1,103,462	ソフトウェア・サービス	
NAVIENT CORP	286	246	491	59,109	各種金融	
ENDO INTERNATIONAL PLC	—	102	889	106,829	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UNITED RENTALS INC	—	59	605	72,790	資本財	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	—	107	532	64,014	運輸	
VOYA FINANCIAL INC	—	135	613	73,738	各種金融	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	—	28	195	23,547	素材	
ANTERO RESOURCES CORP	—	32	143	17,196	エネルギー	
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	—	41	264	31,820	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FIREEYE INC	—	49	209	25,149	ソフトウェア・サービス	
LIBERTY MEDIA CORP - C	—	124	458	55,123	メディア	
ALLY FINANCIAL INC	—	255	576	69,294	各種金融	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	—	235	698	83,908	消費者サービス	
JARDEN CORP	—	108	569	68,425	耐久消費財・アパレル	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	—	67	357	42,939	消費者サービス	
PALO ALTO NETWORKS INC	—	41	622	74,843	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SIGNET JEWELERS LTD	—	45	613	73,662	小売	
SYNCHRONY FINANCIAL	—	99	327	39,296	各種金融	
QORVO INC	—	86	643	77,346	半導体・半導体製造装置	
ISIS PHARMACEUTICALS INC	—	70	434	52,246	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株 数	194,839	184,539	1,136,085	136,500,690	
	銘柄 数 < 比率 >	579	593	—	< 60.0% >	
(カナダ)			千カナダドル			
ROYAL BANK OF CANADA	924	855	6,769	671,894	銀行	
IMPERIAL OIL LTD	190	176	879	87,331	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
THOMSON REUTERS CORP	239	213	1,047	103,978	メディア
TRANSCANADA CORP	455	420	2,264	224,746	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	233	214	930	92,358	電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	388	362	1,482	147,142	保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B	364	340	591	58,755	素材
BARRICK GOLD CORP	748	690	1,068	106,021	素材
BCE INC	164	85	455	45,222	電気通信サービス
AGRIUM INC	93	85	1,114	110,627	素材
BOMBARDIER INC-B	905	847	220	21,859	資本財
BANK OF MONTREAL	414	382	2,982	296,058	銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	353	330	2,183	216,777	不動産
BANK OF NOVA SCOTIA	776	720	4,723	468,824	銀行
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	204	189	5,120	508,230	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC	166	160	240	23,917	資本財
CAMECO CORP	255	237	486	48,296	エネルギー
CI FINANCIAL CORP	98	132	474	47,050	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	258	235	2,240	222,391	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	698	647	2,467	244,875	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	541	483	3,783	375,582	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	50	44	559	55,545	小売
ENBRIDGE INC	507	503	3,132	310,950	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	14	12	760	75,517	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	135	133	695	69,031	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	219	206	514	51,098	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	67	61	265	26,308	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	139	135	860	85,398	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,180	1,166	2,691	267,121	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	144	246	1,686	167,409	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	208	193	946	93,965	銀行
ONEX CORPORATION	57	53	363	36,115	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	553	491	1,922	190,804	素材
POWER CORP OF CANADA	224	220	737	73,241	保険
POWER FINANCIAL CORP	158	147	547	54,366	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	248	236	641	63,670	メディア
SUNCOR ENERGY INC	958	860	3,167	314,394	エネルギー
TRANSALTA CORP	169	169	191	18,989	公益事業
TALISMAN ENERGY INC	668	—	—	—	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	32	30	303	30,099	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	113	101	2,286	226,931	運輸
ENCANA CORP	478	492	827	82,142	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	112	124	486	48,297	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	107	103	262	26,009	資本財
GOLDCORP INC	521	484	1,089	108,094	素材
KINROSS GOLD CORP	749	689	210	20,858	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	99	90	401	39,860	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC	190	179	658	65,384	保険
METHANEX CORP	62	56	391	38,898	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	539	491	252	25,099	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	—	46	105	10,428	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	76	139	528	52,415	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	79	152	538	53,409	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	293	299	378	37,602	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	株数	当 期		末 額		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		
TELUS CORP	140	116	491	48,797		電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	356	359	647	64,284		素材
YAMANA GOLD INC	492	546	257	25,526		素材
FORTIS INC	137	163	641	63,682		公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	270	248	1,149	114,146		食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP	457	431	263	26,182		素材
TORONTO-DOMINION BANK	1,182	1,091	6,068	602,323		銀行
FRANCO-NEVADA CORP	96	93	600	59,605		素材
SILVER WHEATON CORP	225	241	583	57,890		素材
EMPIRE CO LTD 'A'	37	33	291	28,956		食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	64	59	252	25,094		保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	81	74	272	27,067		公益事業
METRO INC	61	148	518	51,446		食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	76	71	417	41,403		ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	84	78	694	68,890		保険
CRESCENT POINT ENERGY CORP	255	248	741	73,554		エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	483	489	1,023	101,590		エネルギー
TIM HORTONS INC	95	—	—	—		消費者サービス
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	199	—	—	—		エネルギー
ATHABASCA OIL CORP	199	—	—	—		エネルギー
MEG ENERGY CORP	90	94	178	17,737		エネルギー
PENN WEST PETROLEUM LTD	317	—	—	—		エネルギー
ARC RESOURCES LTD	203	188	442	43,946		エネルギー
CANADIAN OIL SANDS LTD	311	289	345	34,279		エネルギー
BAYTEX ENERGY CORP	78	121	262	26,038		エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	104	102	404	40,113		エネルギー
ENERPLUS CORP	128	118	157	15,636		エネルギー
NEW GOLD INC	321	313	126	12,520		素材
PEMBINA PIPELINE CORP	199	201	831	82,558		エネルギー
VERMILION ENERGY INC	61	63	350	34,775		エネルギー
PENGROWTH ENERGY CORP	337	—	—	—		エネルギー
CATAMARAN CORP	131	122	883	87,722		ヘルスケア機器・サービス
BELL ALIANT INC	48	—	—	—		電気通信サービス
DOLLARAMA INC	44	75	531	52,759		小売
KEYERA CORP	52	100	406	40,329		エネルギー
ALTAGAS LTD	77	79	317	31,468		エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	92	87	293	29,179		エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	50	47	208	20,722		公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	66	60	115	11,416		不動産
INTER PIPELINE LTD	195	193	592	58,812		エネルギー
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	—	79	264	26,269		エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	—	11	535	53,173		ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION SOFTWARE INC-RTS	—	11	0.1815	18		ソフトウェア・サービス
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	—	35	111	11,023		エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	—	116	575	57,090		消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	—	41	267	26,542		素材
小 計	株数・金額	25,507	23,185	93,048	9,235,979	
	銘柄数<比率>	93	93	—	<4.1%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
COMMERZBANK AG	625	631	783	104,759		銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	656	816	2,374	317,730		各種金融
METRO AG	84	95	295	39,544		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…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
SIEMENS AG-REG	509	469	4,547	608,363	資本財
RWE AG	314	290	676	90,473	公益事業
BASF SE	589	544	4,766	637,705	素材
VOLKSWAGEN AG	18	17	393	52,580	自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	618	570	5,026	672,549	自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	114	105	1,114	149,136	家庭用品・パーソナル用品
E. ON SE	1,156	1,188	1,664	222,732	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	213	196	2,145	287,010	自動車・自動車部品
BAYER AG-REG	531	490	6,490	868,401	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINDE AG	119	110	1,965	262,933	素材
ALLIANZ SE-REG	292	270	4,046	541,319	保険
MAN SE	22	20	195	26,170	資本財
CONTINENTAL AG	70	65	1,399	187,256	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	692	671	767	102,714	半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	98	90	770	103,028	自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	151	136	186	24,995	運輸
HUGO BOSS AG -ORD	20	39	421	56,339	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE POST AG-REG	580	574	1,708	228,603	運輸
SAP SE	591	546	3,713	496,853	ソフトウェア・サービス
CELESIO AG	31	31	84	11,290	ヘルスケア機器・サービス
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	141	129	611	81,852	メディア
DEUTSCHE BOERSE AG	123	114	871	116,643	各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	139	129	989	132,451	ヘルスケア機器・サービス
ADIDAS AG	25	22	135	18,165	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	134	123	915	122,432	耐久消費財・アパレル
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,855	1,881	3,172	424,414	電気通信サービス
THYSSENKRUPP AG	115	102	1,778	237,995	保険
BEIERSDORF AG	291	270	673	90,136	素材
HEIDELBERGCEMENT AG	64	58	476	63,724	家庭用品・パーソナル用品
MERCK KGAA	89	84	630	84,383	素材
VOLKSWAGEN AG-PREF	41	77	766	102,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUEDZUCKER AG	93	96	2,191	293,156	自動車・自動車部品
LANXESS AG	54	—	—	—	食品・飲料・タバコ
FRESENIUS SE & CO KGAA	54	53	275	36,825	素材
SKY DEUTSCHLAND AG	80	224	1,238	165,739	ヘルスケア機器・サービス
HOCHTIEF AG	282	—	—	—	メディア
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	20	—	—	—	資本財
GEA GROUP AG	183	171	403	54,044	不動産
SYMRISE AG	117	109	492	65,878	資本財
K+S AG-REG	—	73	426	57,124	素材
HENKEL AG & CO KGAA	111	102	327	43,829	素材
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	83	68	625	83,645	家庭用品・パーソナル用品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	70	73	299	40,089	ソフトウェア・サービス
HANNOVER RUECK SE	33	32	271	36,281	自動車・自動車部品
BRENNTAG AG	37	35	311	41,686	保険
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	33	92	516	69,134	資本財
AXEL SPRINGER SE	14	12	156	20,956	メディア
FUCHS PETROLUB SE -PREF	24	24	124	16,668	メディア
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	22	40	152	20,344	素材
OSRAM LICHT AG	180	347	192	25,795	電気通信サービス
	54	52	245	32,894	資本財

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIE	—	203	603	80,778		不動産
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	12,678 53	12,785 52	65,416 —	8,752,113 <3.8%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	752	692	1,208	161,691		保険
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	42	2,544	152	20,459		銀行
INTESA SANPAOLO	7,450	7,501	2,404	321,745		銀行
TELECOM ITALIA SPA	6,542	5,980	622	83,289		電気通信サービス
ENI SPA	1,630	1,505	2,571	344,038		エネルギー
UNICREDIT SPA	2,786	2,601	1,697	227,109		銀行
ENEL SPA	4,229	3,904	1,641	219,614		公益事業
SAIPEM SPA	166	160	202	27,114		エネルギー
FIAT SPA	564	—	—	—		自動車・自動車部品
ATLANTIA SPA	243	246	584	78,254		運輸
INTESA SANPAOLO-RSP	—	556	159	21,404		銀行
LUXOTTICA GROUP SPA	108	99	599	80,268		耐久消費財・アパレル
MEDIOBANCA SPA	324	360	323	43,229		各種金融
SNAM SPA	1,317	1,246	584	78,218		公益事業
TELECOM ITALIA-RSP	3,901	3,577	300	40,202		電気通信サービス
BANCO POPOLARE SC	221	214	310	41,501		銀行
FINMECCANICA SPA	267	244	279	37,423		資本財
PIRELLI & C.	156	139	214	28,732		自動車・自動車部品
UBI BANCA SCPA	550	509	366	49,048		銀行
TERNA SPA	962	917	387	51,788		公益事業
UNIPOLSAI SPA	587	523	130	17,435		保険
PRYSMIAN SPA	130	123	250	33,465		資本財
EXOR SPA	64	56	241	32,268		各種金融
ENEL GREEN POWER SPA	1,092	1,081	192	25,709		公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	34,091 23	34,788 23	15,427 —	2,064,012 <0.9%>	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)	119	109	1,106	148,104		自動車・自動車部品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	163	165	2,620	350,558		耐久消費財・アパレル
PEUGEOT SA	251	232	400	53,535		自動車・自動車部品
AXA SA	1,152	1,077	2,404	321,720		保険
DANONE	364	343	2,162	289,257		食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	395	326	1,007	134,775		食品・生活必需品小売り
VIVENDI	769	719	1,631	218,264		メディア
ALCATEL-LUCENT	1,785	1,680	581	77,741		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA	460	429	1,894	253,474		銀行
AIR LIQUIDE SA	201	204	2,430	325,190		素材
TOTAL SA	1,373	1,268	6,029	806,675		エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	267	266	1,098	147,016		資本財
ZODIAC AEROSPACE	112	110	360	48,262		資本財
VINCI SA	310	279	1,485	198,762		資本財
LAFARGE SA	119	110	721	96,571		素材
SANOFI	767	708	6,296	842,469		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	226	254	475	63,583		公益事業
L'OREAL	155	149	2,539	339,712		家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA	100	124	608	81,377		消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	353	311	2,116	283,111		資本財
BNP PARIBAS	640	627	3,570	477,662		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…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ESSILOR INTERNATIONAL	131	121	1,329	177,890	ヘルスケア機器・サービス	
CAP GEMINI	92	84	683	91,384	ソフトウェア・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	36	32	261	35,016	食品・生活必需品小売り	
VALEO SA	47	45	662	88,680	自動車・自動車部品	
HERMES INTERNATIONAL	—	15	531	71,168	耐久消費財・アパレル	
VALLOUREC SA	67	63	139	18,634	資本財	
SODEXO	60	56	521	69,760	消費者サービス	
KERING	48	44	736	98,599	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	40	76	526	70,456	ソフトウェア・サービス	
TECHNIP SA	65	59	369	49,387	エネルギー	
CHRISTIAN DIOR SE	35	32	575	76,937	耐久消費財・アパレル	
ATOS	45	47	336	44,963	ソフトウェア・サービス	
ORANGE	1,191	1,098	1,591	212,957	電気通信サービス	
CNP ASSURANCES	106	100	153	20,503	保険	
IMERYS SA	22	19	129	17,301	素材	
SAFRAN SA	173	173	1,152	154,230	資本財	
RENAULT SA	123	113	1,085	145,287	自動車・自動車部品	
PUBLICIS GROUPE	117	111	837	112,027	メディア	
LAGARDERE SCA	69	71	191	25,680	メディア	
JC DECAUX SA	41	40	141	18,911	メディア	
SOCIETE BIC SA	19	17	255	34,191	商業・専門サービス	
BOUYGUES SA	120	99	365	48,849	資本財	
THALES SA	58	54	293	39,331	資本財	
PERNOD RICARD SA	136	125	1,390	186,088	食品・飲料・タバコ	
CREDIT AGRICOLE SA	640	610	848	113,553	銀行	
GDF SUEZ	857	860	1,584	211,923	公益事業	
ALSTOM	135	127	359	48,143	資本財	
ARKEMA	39	39	281	37,677	素材	
LEGRAND SA	171	157	790	105,706	資本財	
SCOR SE	99	91	281	37,605	保険	
ADP	18	17	202	27,053	運輸	
EDF	155	145	327	43,878	公益事業	
CGG	104	—	—	—	エネルギー	
NATIXIS	596	554	400	53,542	銀行	
WENDEL	20	18	200	26,759	各種金融	
BUREAU VERITAS SA	140	157	333	44,677	商業・専門サービス	
EURAZEO	20	22	135	18,110	各種金融	
EURAZEO-NEW	—	1	6	899	各種金融	
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	178	179	331	44,331	公益事業	
ILIAD SA	16	15	324	43,418	電気通信サービス	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	89	92	286	38,341	メディア	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	355	282	391	52,369	運輸	
EDENRED	133	120	294	39,440	商業・専門サービス	
REMY COINTREAU	16	14	92	12,429	食品・飲料・タバコ	
REXEL SA	155	163	265	35,508	資本財	
BOLLORE	—	511	258	34,629	運輸	
NUMERICABLE-SFR	—	58	300	40,269	メディア	
小 計	株数	金額	16,890	16,447	64,103	8,576,340
	銘柄数 < 比率 >		64	67	—	< 3.8% >
(ユーロ…オランダ)						
QIAGEN N.V.	153	135	296	39,684	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CNH INDUSTRIAL NV	602	566	444	59,513	資本財	

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	—	535	720	96,381	自動車・自動車部品	
AIRBUS GROUP NV	377	348	2,166	289,798	資本財	
STMICROELECTRONICS NV	411	371	261	34,958	半導体・半導体製造装置	
GEMALTO	51	46	377	50,445	ソフトウェア・サービス	
WOLTERS KLUWER	193	180	522	69,911	メディア	
KONINKLIJKE KPN NV	2,042	1,900	648	86,774	電気通信サービス	
AKZO NOBEL	153	145	997	133,499	素材	
HEINEKEN NV	146	136	975	130,496	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	601	554	1,372	183,638	資本財	
REED ELSEVIER NV	449	414	910	121,755	メディア	
AEGON NV	1,166	1,074	776	103,912	保険	
KONINKLIJKE AHOLD NV	593	530	964	129,014	食品・生活必需品小売り	
RANDSTAD HOLDING NV	79	75	401	53,748	商業・専門サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	65	59	370	49,606	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	98	101	512	68,537	素材	
ING GROEP NV-CVA	2,462	2,287	3,281	439,059	銀行	
ASML HOLDING NV	229	207	2,024	270,846	半導体・半導体製造装置	
UNILEVER NV-CVA	1,046	966	3,794	507,694	食品・飲料・タバコ	
FUGRO NV-CVA	46	—	—	—	エネルギー	
VOPAK	45	41	187	25,139	エネルギー	
BOSKALIS WESTMINSTER	50	51	240	32,224	資本財	
DELTA LLOYD NV	121	130	221	29,664	保険	
TNT EXPRESS NV	285	259	198	26,499	運輸	
ZIGGO NV	96	—	—	—	電気通信サービス	
OCI NV	62	49	132	17,766	素材	
NN GROUP NV	—	93	243	32,621	保険	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	11,634	11,264	23,045	3,083,194	
(ユーロ…スペイン)						
BANCO POPULAR ESPANOL	1,048	1,061	513	68,677	銀行	
ENDESA SA	—	191	331	44,396	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	114	102	319	42,679	資本財	
IBERDROLA SA	3,095	3,070	1,877	251,173	公益事業	
TELEFONICA SA	2,631	2,651	3,673	491,505	電気通信サービス	
BANCO SANTANDER SA	7,603	8,525	5,789	774,634	銀行	
BANKINTER SA	—	403	274	36,667	銀行	
REPSOL SA	556	615	1,119	149,775	エネルギー	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,790	3,743	3,403	455,413	銀行	
GAS NATURAL SDG SA	223	208	457	61,185	公益事業	
INDITEX	140	645	1,867	249,823	小売	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	254	239	384	51,497	運輸	
MAPPRE SA	709	539	173	23,262	保険	
FERROVIAL SA	255	246	486	65,097	資本財	
FERROVIAL SA-RTS	—	237	7	948	資本財	
ZARDOYA OTIS SA	103	103	120	16,164	資本財	
ENAGAS SA	123	122	334	44,731	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	70	65	491	65,751	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	2,208	2,560	606	81,077	銀行	
CAIXABANK S. A	1,117	1,364	607	81,301	銀行	
GRIFOLS SA	95	88	318	42,660	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	243	264	1,079	144,385	ソフトウェア・サービス	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	668	493	389	52,061	運輸	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	372	371	276	36,942	食品・生活必需品小売り	
BANKIA SA	2,561	2,716	334	44,735	銀行	
AENA SA	—	36	319	42,777	運輸	
小計	株数・金額	27,986	30,669	25,557	3,419,330	
	銘柄数<比率>	22	26	—	<1.5%>	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS	143	128	430	57,540	保険	
UCB SA	71	74	460	61,594	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	516	477	5,221	698,603	食品・飲料・タバコ	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	51	48	364	48,750	各種金融	
DELHAIZE GROUP	65	60	501	67,101	食品・生活必需品小売り	
UMICORE	72	55	251	33,639	素材	
COLRUYT SA	47	42	179	24,035	食品・生活必需品小売り	
KBC GROEP NV	160	149	869	116,369	銀行	
SOLVAY SA	38	34	449	60,118	素材	
BELGACOM SA	97	90	299	40,084	電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	33	30	162	21,724	メディア	
小計	株数・金額	1,299	1,193	9,190	1,229,561	
	銘柄数<比率>	11	11	—	<0.5%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG	165	166	434	58,088	銀行	
OMV AG	96	85	260	34,794	エネルギー	
TELEKOM AUSTRIA AG	134	—	—	—	電気通信サービス	
VOESTALPINE AG	73	65	254	33,984	素材	
IMMOFINANZ AG	635	554	145	19,423	不動産	
ANDRITZ AG	45	42	238	31,900	資本財	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	75	69	106	14,248	銀行	
VIENNA INSURANCE GROUP AG	24	24	89	11,993	保険	
小計	株数・金額	1,251	1,008	1,528	204,431	
	銘柄数<比率>	8	7	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP	24	22	188	25,228	メディア	
TENARIS SA	304	276	373	50,018	エネルギー	
SES	195	180	554	74,220	メディア	
ARCELORMITTAL	639	590	560	75,052	素材	
ALTICE SA	—	51	499	66,799	メディア	
小計	株数・金額	1,164	1,122	2,177	291,318	
	銘柄数<比率>	4	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ	2,416	2,219	1,386	185,471	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STORA ENSO OYJ-R SHS	341	323	301	40,308	素材	
NOKIAN RENKAAT OYJ	72	67	212	28,458	自動車・自動車部品	
UPM-KYMMENE OYJ	341	314	500	66,985	素材	
FORTUM OYJ	292	267	481	64,354	公益事業	
KONE OYJ-B	200	187	734	98,249	資本財	
METSO OYJ	80	67	175	23,517	資本財	
SAMPO OYJ-A SHS	288	265	1,169	156,475	保険	
WARTSILA OYJ ABP	113	86	346	46,398	資本財	
ELISA OYJ	87	84	231	31,007	電気通信サービス	
NESTE OIL OYJ	79	73	168	22,598	エネルギー	

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フィンランド) ORION OYJ-CLASS B	百株 64	百株 60	千ユーロ 178	千円 23,893		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	4,377 12	4,019 12	5,887 -	787,719 <0.3%>	
(ユーロ…アイルランド) KERRY GROUP PLC-A IRISH BANK RESOLUTION CORP BANK OF IRELAND CRH PLC	98 472 14,675 476	96 472 16,439 490	614 - 585 1,261	82,202 - 78,301 168,800		食品・飲料・タバコ 銀行 銀行 素材
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	15,722 4	17,499 4	2,461 -	329,303 <0.1%>	
(ユーロ…ポルトガル) EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA JERONIMO MARTINS PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R BANCO ESPIRITO SANTO-REG GALP ENERGIA SGPSS SA	1,279 168 380 - 1,173 219	1,362 149 - 21,117 - 227	497 198 - 189 - 271	66,622 26,555 - 25,314 - 36,310		公益事業 食品・生活必需品小売り 電気通信サービス 銀行 銀行 エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	3,221 5	22,857 4	1,157 -	154,802 <0.1%>	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	130,318 232	153,656 237	215,951 -	28,892,130 <12.7%>	
(イギリス) BARCLAYS PLC BP PLC LLOYDS BANKING GROUP PLC ASTRAZENECA PLC SMITHS GROUP PLC NEXT PLC DIAGEO PLC SKY PLC BAE SYSTEMS PLC UNILEVER PLC TESCO PLC REED ELSEVIER PLC MARKS & SPENCER GROUP PLC RECKITT BENCKISER GROUP PLC PRUDENTIAL PLC BG GROUP PLC LEGAL & GENERAL GROUP PLC SAGE GROUP PLC/THE HSBC HOLDINGS PLC BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC UNITED UTILITIES GROUP PLC SCHRODERS PLC ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP BHP BILLITON PLC IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC WPP PLC CENTRICA PLC BT GROUP PLC SSE PLC STANDARD CHARTERED PLC	9,843 11,969 32,082 806 257 99 1,613 658 2,057 822 5,192 756 1,032 415 1,642 2,191 3,795 706 12,032 1,213 434 63 1,408 1,356 618 867 3,313 5,078 621 1,564	9,750 10,812 33,849 748 235 90 1,490 611 1,867 760 4,811 671 966 383 1,521 2,023 3,519 637 11,377 1,105 406 74 1,501 1,250 567 778 2,950 4,824 587 1,464	千イギリスポンド 2,542 4,948 2,931 3,389 270 667 2,659 659 952 2,172 1,118 728 544 2,223 2,507 2,397 945 354 7,193 4,001 406 252 537 1,965 1,847 1,199 828 2,267 961 1,534	475,666 925,737 548,333 634,095 50,528 124,952 497,418 123,425 178,176 406,347 209,260 136,255 101,927 415,929 468,981 448,474 176,774 66,273 1,345,663 748,560 76,028 47,143 100,454 367,714 345,666 224,385 154,893 424,180 179,826 287,122		銀行 エネルギー 銀行 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス 資本財 小売 食品・飲料・タバコ メディア 資本財 食品・飲料・タバコ 食品・生活必需品小売り メディア 小売 家庭用品・パーソナル用品 保険 エネルギー 保険 ソフトウェア・サービス 銀行 食品・飲料・タバコ 公益事業 各種金融 銀行 素材 食品・飲料・タバコ メディア 公益事業 電気通信サービス 公益事業 銀行

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,209	1,117	1,139	213,201	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF C	163,471	158,293	15	2,961	資本財
COMPASS GROUP PLC	1,149	987	1,163	217,652	消費者サービス
KINGFISHER PLC	1,534	1,400	518	97,079	小売
PEARSON PLC	529	486	641	119,909	メディア
SEVERN TRENT PLC	153	144	308	57,729	公益事業
RIO TINTO PLC	816	753	2,283	427,083	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	3,121	2,881	4,257	796,436	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SABMILLER PLC	617	573	2,063	386,050	食品・飲料・タバコ
3I GROUP PLC	623	582	300	56,189	各種金融
GKN PLC	1,047	968	343	64,333	自動車・自動車部品
VODAFONE GROUP PLC	16,967	15,710	3,687	689,873	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	1,428	1,256	229	42,997	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	785	721	203	37,984	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	1,895	2,370	1,282	239,911	保険
CAPITA PLC	425	394	491	91,920	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC	—	588	269	50,352	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	130	122	412	77,254	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	3,285	609	263	49,330	保険
WHITBREAD PLC	115	108	565	105,795	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	2,402	2,230	2,019	377,723	公益事業
ARM HOLDINGS PLC	900	831	950	177,884	半導体・半導体製造装置
WOLSELEY PLC	171	155	618	115,624	資本財
SERCO GROUP PLC	307	—	—	—	商業・専門サービス
BUNZL PLC	217	199	377	70,659	資本財
COBHAM PLC	706	670	200	37,499	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	893	825	930	174,141	素材
INTERTEK GROUP PLC	102	95	253	47,467	商業・専門サービス
WILLIAM HILL PLC	541	518	202	37,889	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	287	265	471	88,253	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	168	140	391	73,220	消費者サービス
CARNIVAL PLC	117	107	333	62,448	消費者サービス
PERSIMMON PLC	193	180	318	59,572	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	513	483	252	47,244	資本財
ICAP PLC	341	332	187	35,109	各種金融
ITV PLC	2,478	2,282	604	113,083	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	111	185	469	87,805	各種金融
G4S PLC	991	933	274	51,420	商業・専門サービス
AMEC FOSTER WHEELER PLC	187	228	198	37,093	エネルギー
IMI PLC	172	160	191	35,842	資本財
REXAM PLC	514	417	237	44,397	素材
SMITH & NEPHEW PLC	567	531	603	112,863	ヘルスケア機器・サービス
TATE & LYLE PLC	293	276	166	31,205	食品・飲料・タバコ
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,480	2,318	4,756	889,776	エネルギー
PETROFAC LTD	168	153	130	24,454	エネルギー
TRAVIS PERKINS PLC	156	145	310	58,032	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,590	1,446	3,015	564,113	エネルギー
OLD MUTUAL PLC	3,165	2,904	675	126,436	保険
INVESTEC PLC	379	327	199	37,264	各種金融
STANDARD LIFE PLC	1,525	1,166	553	103,593	保険
EXPERIAN PLC	651	587	691	129,276	商業・専門サービス
TUI TRAVEL PLC	294	—	—	—	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				
			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			
WEIR GROUP PLC/THE	136	125	241	45,107	資本財		
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	228	211	608	113,918	食品・飲料・タバコ		
ANTOFAGASTA PLC	255	233	182	34,222	素材		
TULLOW OIL PLC	581	532	216	40,556	エネルギー		
SHIRE PLC	377	349	1,832	342,865	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
INMARSAT PLC	290	251	255	47,836	電気通信サービス		
ADMIRAL GROUP PLC	123	117	176	33,063	保険		
FRESNILLO PLC	117	130	91	17,119	素材		
RANDGOLD RESOURCES LTD	57	51	241	45,217	素材		
FRIENDS LIFE GROUP LTD	906	—	—	—	保険		
AGGREKO PLC	172	151	249	46,743	商業・専門サービス		
BABCOCK INTL GROUP PLC	324	148	160	30,067	商業・専門サービス		
GLENCORE PLC	6,814	6,585	2,015	376,980	素材		
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	618	551	248	46,413	各種金融		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	132	140	173	32,536	各種金融		
CRODA INTERNATIONAL PLC	85	79	225	42,200	素材		
MELROSE INDUSTRIES PLC	685	584	153	28,773	資本財		
COCA-COLA HBC AG-CDI	129	115	163	30,666	食品・飲料・タバコ		
EASYJET PLC	105	96	176	33,074	運輸		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	728	886	286	53,591	保険		
ASOS PLC	35	—	—	—	小売		
ROYAL MAIL PLC	416	382	190	35,649	運輸		
ASHTREAD GROUP PLC	—	300	353	66,075	資本財		
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	—	165	107	20,184	小売		
MERLIN ENTERTAINMENT	—	418	192	35,941	消費者サービス		
TUI AG-DI	—	269	342	64,128	消費者サービス		
小 計	株 数	金 額	340,739	325,695	104,932	19,628,581	
	銘柄 数 < 比 率 >		103	104	—	< 8.6% >	
(スイス)			千スイスフラン				
NESTLE SA-REG	2,071	1,912	13,893	1,783,519	食品・飲料・タバコ		
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	336	309	2,539	325,943	耐久消費財・アパレル		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	974	904	2,226	285,876	各種金融		
HOLCIM LTD-REG	146	135	1,017	130,630	素材		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	451	416	11,126	1,428,353	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
GIVAUDAN-REG	5	5	954	122,473	素材		
SONOVA HOLDING AG-REG	33	31	430	55,261	ヘルスケア機器・サービス		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	95	88	2,637	338,593	保険		
SYNGENTA AG-REG	59	55	2,219	284,945	素材		
LONZA GROUP AG-REG	33	31	420	53,934	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	27	29	228	29,379	耐久消費財・アパレル		
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	29	26	428	55,044	資本財		
GEBERIT AG-REG	24	22	733	94,138	資本財		
SWISS RE AG	225	208	1,715	220,255	保険		
SWATCH GROUP AG/THE-BR	19	18	713	91,541	耐久消費財・アパレル		
PARGESA HOLDING SA-BR	18	19	125	16,142	各種金融		
NOVARTIS AG-REG	1,477	1,364	13,053	1,675,675	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ADECCO SA-REG	84	101	741	95,236	商業・専門サービス		
UBS AG-REG	2,348	—	—	—	各種金融		
SWISSCOM AG-REG	14	13	761	97,698	電気通信サービス		
ABB LTD-REG	1,407	1,302	2,668	342,518	資本財		
SGS SA-REG	3	3	598	76,775	商業・専門サービス		
SULZER AG-REG	15	13	153	19,741	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		
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円		
SCHINDLER HOLDING AG-REG	13	12	197	25,395	資本財	
ACTELION LTD-REG	65	60	777	99,868	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	34	32	439	56,478	運輸	
BALOISE HOLDING AG - REG	30	28	338	43,471	保険	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	20	18	429	55,126	保険	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.07	0.06	354	45,493	食品・飲料・タバコ	
ARYZTA AG	55	52	323	41,497	食品・飲料・タバコ	
JULIUS BAER GROUP LTD	142	133	648	83,290	各種金融	
SIKA AG-BR	1	1	394	50,637	素材	
TRANSOCEAN LTD	229	211	381	48,951	エネルギー	
SWISS PRIME SITE-REG	35	34	282	36,227	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.55	0.55	278	35,795	食品・飲料・タバコ	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	10	10	302	38,869	各種金融	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	146	18,817	食品・飲料・タバコ	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	5	5	200	25,698	素材	
UBS GROUP AG	—	2,164	4,289	550,689	各種金融	
小 計	株 数 ・ 金 額	10,553	9,781	69,174	8,879,988	
	銘柄 数 < 比 率 >	38	38	—	< 3.9% >	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ			
ELECTROLUX AB-SER B	158	140	3,563	51,450	耐久消費財・アパレル	
ERICSSON LM-B SHS	1,948	1,804	16,913	244,227	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ATLAS COPCO AB-B SHS	246	234	5,362	77,431	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	970	901	9,111	131,563	銀行	
INVESTOR AB-B SHS	291	271	9,157	132,236	各種金融	
NORDEA BANK AB	1,945	1,801	19,332	279,165	銀行	
GETINGE AB-B SHS	125	118	2,455	35,450	ヘルスケア機器・サービス	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	322	296	11,184	161,500	銀行	
ATLAS COPCO AB-A SHS	437	400	10,180	146,999	資本財	
SKF AB-B SHARES	251	233	4,727	68,259	資本財	
ASSA ABLOY AB-B	216	198	9,596	138,578	資本財	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	611	562	18,771	271,063	小売	
SANDVIK AB	692	635	6,491	93,742	資本財	
SWEDBANK AB - A SHARES	581	537	10,326	149,120	銀行	
SECURITAS AB-B SHS	196	182	2,129	30,753	商業・専門サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	378	348	7,623	110,085	家庭用品・パーソナル用品	
SKANSKA AB-B SHS	241	223	3,976	57,419	資本財	
SWEDISH MATCH AB	131	120	3,019	43,597	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	201	188	2,089	30,176	電気通信サービス	
TELIASONERA AB	1,535	1,536	7,891	113,959	電気通信サービス	
VOLVO AB-B SHS	977	909	9,986	144,203	資本財	
ALFA LAVAL AB	199	188	2,993	43,230	資本財	
SCANIA AB-B SHS	202	—	—	—	資本財	
ELEKTA AB-B SHS	231	214	1,652	23,868	ヘルスケア機器・サービス	
LUNDIN PETROLEUM AB	140	125	1,774	25,623	エネルギー	
BOLIDEN AB	171	159	2,866	41,394	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	254	240	1,465	21,167	耐久消費財・アパレル	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	41	38	2,551	36,848	電気通信サービス	
HEXAGON AB-B SHS	153	150	4,480	64,700	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	142	140	3,828	55,280	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	81	95	1,594	23,027	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		
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円		
ICA GRUPPEN AB	—	46	1,458	21,057	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額	14,081	13,047	198,558	2,867,185	
	銘柄 数 < 比 率 >	31	31	—	< 1.3% >	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	623	580	8,038	127,408	銀行	
NORSK HYDRO ASA	861	805	2,916	46,229	素材	
ORKLA ASA	501	475	2,863	45,378	食品・飲料・タバコ	
STATOIL ASA	718	662	10,394	164,755	エネルギー	
TELENOR ASA	441	445	8,131	128,879	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	115	105	4,294	68,072	素材	
SEBSEA 7 SA	172	166	1,413	22,411	エネルギー	
SEADRILL LTD	241	233	2,438	38,645	エネルギー	
AKASTOR ASA	107	—	—	—	エネルギー	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	128	119	1,501	23,806	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,911	3,595	41,992	665,586	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	9	—	< 0.3% >	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
NOVO NORDISK A/S-B	1,279	1,189	44,752	801,971	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	143	142	4,416	79,145	素材	
DANSKE BANK A/S	419	388	7,581	135,868	銀行	
WILLIAM DEMANT HOLDING	16	12	693	12,435	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	—	131	4,354	78,029	資本財	
TDC A/S	530	478	2,394	42,905	電気通信サービス	
CARLSBERG AS-B	68	63	4,039	72,393	食品・飲料・タバコ	
COLOPLAST-B	71	66	3,444	61,725	ヘルスケア機器・サービス	
DSV A/S	120	105	2,443	43,793	運輸	
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	4	4	5,825	104,397	運輸	
TRYG A/S	14	13	970	17,384	保険	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	1	2	3,084	55,281	運輸	
PANDORA A/S	—	68	4,851	86,944	耐久消費財・アパレル	
ISS A/S	—	71	1,610	28,856	商業・専門サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,671	2,739	90,465	1,621,132	
	銘柄 数 < 比 率 >	11	14	—	< 0.7% >	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
BHP BILLITON LIMITED	2,063	1,904	6,061	574,571	素材	
CSL LTD	314	282	2,513	238,259	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALUMINA LTD	1,621	1,564	267	25,357	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	423	441	1,522	144,309	エネルギー	
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,766	1,639	5,232	495,960	銀行	
RIO TINTO LTD	281	258	1,515	143,632	素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD	787	815	1,125	106,670	保険	
LEND LEASE GROUP	357	329	535	50,744	不動産	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	1,036	963	7,915	750,350	銀行	
WESTPAC BANKING CORP	2,000	1,848	6,227	590,332	銀行	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,513	1,387	4,884	462,984	銀行	
BRAMBLES LTD	1,009	940	1,028	97,534	商業・専門サービス	
QANTAS AIRWAYS LTD	846	373	124	11,759	運輸	
BORAL LTD	491	466	289	27,479	素材	
WOOLWORTHS LTD	809	750	2,037	193,091	食品・生活必需品小売り	
TELSTRA CORP LTD	2,821	2,553	1,544	146,412	電気通信サービス	
AMP LTD	1,900	1,763	1,120	106,166	保険	
TABCORP HOLDINGS LTD	508	518	236	22,374	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			
			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		
AMCOR LIMITED	781	722	980	92,973	素材	
COMPUTERSHARE LTD	310	287	350	33,210	ソフトウェア・サービス	
MACQUARIE GROUP LTD	187	172	1,356	128,583	各種金融	
CIMIC GROUP LTD	113	64	139	13,179	資本財	
ASX LTD	127	117	485	46,051	各種金融	
COCA-COLA AMATIL LTD	365	351	344	32,636	食品・飲料・タバコ	
COCHLEAR LTD	38	35	282	26,799	ヘルスケア機器・サービス	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	281	276	407	38,638	素材	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	320	354	155	14,745	小売	
NEWCREST MINING LTD	483	454	626	59,424	素材	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,459	1,392	761	72,210	保険	
ORIGIN ENERGY LTD	710	664	848	80,385	エネルギー	
ORICA LTD	234	222	449	42,635	素材	
SONIC HEALTHCARE LTD	250	229	445	42,244	ヘルスケア機器・サービス	
SANTOS LTD	624	590	507	48,106	エネルギー	
SUNCORP GROUP LTD	828	776	1,005	95,285	保険	
TRANSURBAN GROUP	1,117	1,097	1,070	101,457	運輸	
WESFARMERS LTD	734	668	2,896	274,589	食品・生活必需品小売り	
TOLL HOLDINGS LTD	469	412	370	35,135	運輸	
SYDNEY AIRPORT	705	667	348	33,038	運輸	
CALTEX AUSTRALIA LTD	86	163	540	51,237	エネルギー	
WORLEYPARSONS LTD	128	128	128	12,162	エネルギー	
AGL ENERGY LTD	365	405	595	56,471	公益事業	
TATTS GROUP LTD	958	891	349	33,138	消費者サービス	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,006	911	234	22,197	素材	
ASCIANO LTD	658	585	373	35,381	運輸	
ILUKA RESOURCES LTD	282	251	216	20,565	素材	
AUSNET SERVICES	1,215	1,155	167	15,831	公益事業	
CROWN RESORTS LTD	265	212	271	25,761	消費者サービス	
INCITEC PIVOT LTD	1,031	1,020	385	36,560	素材	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	273	270	327	31,023	銀行	
METCASH LTD	551	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
AURIZON HOLDINGS LTD	1,321	1,304	636	60,338	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	425	382	193	18,333	食品・飲料・タバコ	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	549	—	—	—	消費者サービス	
ALS LTD	252	252	139	13,270	商業・専門サービス	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	85	79	491	46,569	ヘルスケア機器・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	36	34	151	14,396	消費者サービス	
SEEK LTD	203	190	297	28,169	商業・専門サービス	
BANK OF QUEENSLAND LTD	210	228	296	28,122	銀行	
REA GROUP LTD	36	33	139	13,269	メディア	
TPG TELECOM LTD	—	176	159	15,090	電気通信サービス	
HEALTHSCOPE LTD	—	705	198	18,861	ヘルスケア機器・サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	—	1,652	358	33,984	保険	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	—	139	101	9,631	各種金融	
小 計	株 数	金 額	40,647	39,535	64,771	6,139,693
	銘柄 数 < 比率 >		59	61	—	< 2.7% >
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,138	1,069	302	26,658	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	592	556	257	22,677	運輸	
CONTACT ENERGY LTD	260	231	128	11,308	公益事業	
FLETCHER BUILDING LTD	437	393	334	29,448	素材	

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランドドル	千円		
RYMAN HEALTHCARE LTD	239	213	175	15,475		ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD	—	797	194	17,103		公益事業
MIGHTY RIVER POWER	—	452	131	11,552		公益事業
小計	株数・金額	2,669	3,713	1,523	134,223	
	銘柄数<比率>	5	7	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
WHARF HOLDINGS LTD	970	900	5,076	78,678		不動産
HUTCHISON WHAMPOA LTD	1,370	1,270	14,071	218,109		資本財
SWIRE PACIFIC LTD-A	430	375	3,926	60,856		不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	890	820	13,341	206,791		不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,030	1,000	13,150	203,825		不動産
MTR CORP	965	875	3,298	51,130		運輸
HONG KONG & CHINA GAS	3,702	3,782	7,027	108,933		公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT	3,260	3,050	3,251	50,395		不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	890	830	6,449	99,961		公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	710	658	19,029	294,955		各種金融
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	790	720	1,386	21,494		運輸
HOPEWELL HOLDINGS LTD	380	—	—	—		資本財
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,460	1,310	3,248	50,356		不動産
CLP HOLDINGS LTD	1,150	1,135	7,746	120,068		公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	678	618	3,873	60,042		不動産
BANK OF EAST ASIA	784	698	2,363	36,632		銀行
HANG SENG BANK LTD	491	452	6,856	106,281		銀行
HYSAN DEVELOPMENT CO	420	380	1,362	21,115		不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD	1,040	600	696	10,788		消費者サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	146	137	1,188	18,421		半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO	1,854	1,774	2,441	37,835		不動産
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	495	435	1,298	20,126		耐久消費財・アパレル
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	400	370	2,395	37,134		公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,365	2,200	6,622	102,641		銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	—	805	2,173	33,689		耐久消費財・アパレル
PCCW LTD	2,470	2,510	1,297	20,113		電気通信サービス
LI & FUNG LTD	3,740	3,400	2,512	38,945		耐久消費財・アパレル
KERRY PROPERTIES LTD	420	395	1,260	19,530		不動産
NWS HOLDINGS LTD	895	895	1,215	18,838		資本財
SANDS CHINA LTD	1,544	1,436	4,738	73,451		消費者サービス
WHELOCK & CO LTD	600	550	2,389	37,041		不動産
WYNN MACAU LTD	980	904	1,421	22,026		消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD	1,260	1,150	1,168	18,110		消費者サービス
FIRST PACIFIC CO	1,560	1,420	1,050	16,287		各種金融
AIA GROUP LTD	7,758	7,146	36,766	569,875		保険
SWIRE PROPERTIES LTD	762	704	1,883	29,189		不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,360	1,370	5,144	79,737		消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	608	552	824	12,782		消費者サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,380	1,530	1,542	23,904		電気通信サービス
WH GROUP LTD	—	2,240	1,223	18,957		食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	52,007	51,397	196,713	3,049,056	
	銘柄数<比率>	38	39	—	<1.3%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,670	1,794	1,885	169,166		銀行
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	1,042	972	402	36,122		メディア
KEPPEL LAND LTD	420	—	—	—		不動産

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	660	590	253	22,709	資本財	
CAPITALAND LTD	1,710	1,530	547	49,143	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	270	250	257	23,125	不動産	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	70	64	263	23,651	小売	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,110	1,040	2,197	197,161	銀行	
KEPPEL CORP LTD	940	870	763	68,533	資本財	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	820	773	1,886	169,222	銀行	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,050	950	348	31,280	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	5,122	4,762	2,076	186,303	電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	373	343	406	36,478	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	580	500	431	38,714	各種金融	
SEMBCORP MARINE LTD	570	500	148	13,278	資本財	
UOL GROUP LTD	290	290	219	19,670	不動産	
COMFORTDELGO CORP LTD	1,380	1,230	378	33,989	運輸	
NOBLE GROUP LTD	2,770	2,710	233	20,917	資本財	
STARHUB LTD	420	400	172	15,467	電気通信サービス	
OLAM INTERNATIONAL LTD	920	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	4,793	4,393	184	16,556	食品・飲料・タバコ	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,220	1,150	368	33,016	食品・飲料・タバコ	
GENTING SINGAPORE PLC	3,920	3,700	381	34,192	消費者サービス	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	2,020	1,880	503	45,204	不動産	
CAPITAMALLS ASIA LTD	840	—	—	—	不動産	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	1,270	1,150	166	14,960	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	36,253	31,844	14,476	1,298,866	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	23	—	<0.6%>	
(イスラエル)						
ISRAEL CHEMICALS LTD	278	258	695	21,636	素材	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	546	510	12,110	376,522	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BANK HAPUALIM BM	698	616	1,188	36,943	銀行	
NICE SYSTEMS LTD	34	34	848	26,372	ソフトウェア・サービス	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	783	777	1,168	36,333	銀行	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	1	1	241	7,496	素材	
DELEK GROUP LTD	2	2	318	9,888	エネルギー	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	1,282	1,127	785	24,427	電気通信サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	80	80	343	10,693	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,708	3,409	17,700	550,314	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.2%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	857,907	846,139	—	219,463,429	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,234	1,258	—	<96.5%>	

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

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

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
HCP INC	29	27	1,061	127,502	0.1	
MACERICH CO/THE	8	8	687	82,616	0.0	
PROLOGIS INC	31	29	1,200	144,279	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST	5	5	380	45,719	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	8	8	518	62,263	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3	3	840	100,940	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	4	4	537	64,527	0.0	
HEALTH CARE REIT INC	18	20	1,452	174,458	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	9	9	1,182	142,112	0.1	
REALTY INCOME CORP	14	13	611	73,510	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	5	5	356	42,873	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	6	5	698	83,917	0.0	
UDR INC	16	15	500	60,112	0.0	
VENTAS INC	18	19	1,298	156,041	0.1	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	61	55	554	66,645	0.0	
RAYONIER INC	8	7	195	23,456	0.0	
WEYERHAEUSER CO	37	30	998	120,024	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	25	24	2,327	279,624	0.1	
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	24	20	424	50,979	0.0	
AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	47	53	480	57,702	0.0	
DUKE REALTY CORP	20	20	402	48,339	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	—	9	348	41,914	0.0	
EQUINIX INC	—	3	859	103,210	0.0	
COMMUNICATIONS SALES & LE	—	7	193	23,217	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL	21	20	1,491	179,181	0.1	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	35	31	850	102,213	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	48	44	901	108,255	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	9	8	306	36,793	0.0	
PLUM CREEK TIMBER CO	11	10	445	53,576	0.0	
PUBLIC STORAGE	9	8	1,683	202,326	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	19	18	3,388	407,177	0.2	
VORNADO REALTY TRUST	10	9	1,004	120,698	0.1	
KIMCO REALTY CORP	26	24	585	70,335	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	7	7	1,291	155,218	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	606	592	30,060	3,611,768	
	銘柄 数 < 比 率 >	31	34	—	< 1.6% >	
(カナダ)			千カナダドル			
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	7	7	179	17,776	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9	9	265	26,348	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	17	17	444	44,125	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)			千ユーロ			
GECINA SA	1	1	199	26,629	0.0	

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
KLEPIERRE		6	10	431	57,704	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		6	5	1,397	187,018	0.1
FONCIERE DES REGIONS		1	1	142	19,007	0.0
ICADE		2	2	154	20,708	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	17	21	2,325	311,068	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…オランダ)						
CORIO NV		4	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	4	—	—	—	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	—	—	<—%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	22	21	2,325	311,068	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	5	—	<0.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		60	57	482	90,347	0.0
HAMMERSON PLC		45	46	313	58,695	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		50	46	590	110,470	0.0
INTU PROPERTIES PLC		56	54	186	34,807	0.0
SEGRO PLC		48	44	184	34,529	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	262	249	1,757	328,850	
	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		
FEDERATION CENTRES		90	90	270	25,663	0.0
WESTFIELD RETAIL TRUST		190	—	—	—	—
SCENTRE GROUP		—	316	1,208	114,565	0.1
NOVION PROPERTY GROUP		132	132	333	31,569	0.0
GPT GROUP		110	102	445	42,182	0.0
MIRVAC GROUP		241	226	439	41,679	0.0
STOCKLAND		151	141	614	58,254	0.0
WESTFIELD CORP		128	117	1,116	105,826	0.0
DEXUS PROPERTY GROUP		361	57	419	39,770	0.0
GOODMAN GROUP		109	104	645	61,223	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,517	1,289	5,493	520,734	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.2%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		147	135	6,375	98,816	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	147	135	6,375	98,816	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		—	143	251	22,580	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		131	131	212	19,099	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		165	146	313	28,163	0.0

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポールドル	千円	%
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		131	122	298	26,817	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	427	542	1,077	96,660	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	4	—	< 0.0% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	2,999	2,847	—	5,012,024	
	銘柄 数 < 比 率 >	57	60	—	< 2.2% >	

(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です。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
外 国 株式先物取引		
SP EMINI	1,676	—
SP/TSE60	105	—
SWISS IX	93	—
EURO ST	398	—
SPI 200	184	—
FTSE100	222	—

(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

(2015年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	219,463,429	95.0
投資証券	5,012,024	2.2
コール・ローン等、その他	6,425,180	2.8
投資信託財産総額	230,900,633	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(225,608,909千円)の投資信託財産総額(230,900,633千円)に対する比率は97.7%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=120.15円	1 カナダドル=99.26円	1 ユーロ=133.79円	1 イギリスポンド=187.06円
1 スイスフラン=128.37円	1 スウェーデンクローネ=14.44円	1 ノルウェークローネ=15.85円	1 デンマーククローネ=17.92円
1 オーストラリアドル=94.79円	1 ニュージーランドドル=88.11円	1 香港ドル=15.50円	1 シンガポールドル=89.72円
1 イスラエルシェケル=31.09円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	232,923,528,071
コール・ローン等	5,051,491,441
株式(評価額)	219,463,429,626
投資証券(評価額)	5,012,024,726
未収入金	2,131,637,175
未収配当金	412,041,597
未収利息	3,132
差入委託証拠金	852,900,374
(B) 負債	5,408,689,446
未払金	5,076,339,990
未払株式払込金	3,512,065
未払解約金	328,837,391
(C) 純資産総額(A-B)	227,514,838,625
元本	98,648,858,071
次期繰越損益金	128,865,980,554
(D) 受益権総口数	98,648,858,071口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,063円

<注記事項>

①期首元本額	108,538,790,996円
期中追加設定元本額	32,543,405,938円
期中一部解約元本額	42,433,338,863円

○損益の状況 (2014年5月13日～2015年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,000,513,320
受取配当金	4,984,629,439
受取利息	1,903,384
その他収益金	15,272,016
支払利息	△ 1,291,519
(B) 有価証券売買損益	46,136,068,440
売買益	55,351,288,385
売買損	△ 9,215,219,945
(C) 先物取引等取引損益	259,343,651
取引益	828,688,860
取引損	△ 569,345,209
(D) 保管費用等	△ 68,171,160
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	51,327,754,251
(F) 前期繰越損益金	88,741,619,618
(G) 追加信託差損益金	35,951,545,914
(H) 解約差損益金	△ 47,154,939,229
(I) 計(E+F+G+H)	128,865,980,554
次期繰越損益金(I)	128,865,980,554

(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。

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）

ファンド・マネジャー（海外株式）	419,237,124円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,438,419,729円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	678,058,866円
eMAXIS バランス（波乗り型）	65,607,142円
コアバランス	396,376円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	3,852,279,678円
eMAXIS 全世界株式インデックス	1,973,979,341円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	1,585,466,737円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	3,398,728,270円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	45,953,259円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	20,636,787,211円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	17,061,005,058円
三菱UFJ バランスファンドVA20型（適格機関投資家限定）	363,096,767円
三菱UFJ バランスファンドVA40型（適格機関投資家限定）	2,966,673,917円
MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	9,671,569,256円
三菱UFJ バランスファンドVA45型（適格機関投資家限定）	362,510,423円
三菱UFJ バランスファンドVA30型（適格機関投資家限定）	136,711,379円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	2,018,111,151円
MSCI コクサイインデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	2,594,914,963円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	76,098,141円
MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	7,059,629,747円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,104,557,887円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	11,183,462円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	46,103,861円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	70,135,069円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	62,920,676円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	404,785,459円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	45,567,189円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	442,825,166円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	103,397,229円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	806,099,405円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	3,904,644,158円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	166,069,238円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	696,246,579円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	623,188,698円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	536,974,536円
アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）	130,270,986円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	53,480,918円
アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）	26,261,389円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	8,911,631円
合計	98,648,858,071円

【お知らせ】

- ①新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ②デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)

日本債券インデックスマザーファンド

《第14期》決算日2015年5月12日

[計算期間：2014年5月13日～2015年5月12日]

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第14期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		N O M U R A - B P I 総 合 イ ン デ ッ ク ス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
10期(2011年5月12日)	11,540	1.9	331.63	1.9	99.4	—	207,058
11期(2012年5月14日)	11,862	2.8	340.97	2.8	99.4	0.1	203,547
12期(2013年5月13日)	12,036	1.5	345.99	1.5	98.9	0.8	269,276
13期(2014年5月12日)	12,299	2.2	353.58	2.2	99.4	0.2	283,162
14期(2015年5月12日)	12,572	2.2	361.38	2.2	99.4	0.3	343,834

(注) NOMURA-BPI総合インデックスとは、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総合インデックスは野村證券株式会社の知的財産であり、当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。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I S 総 合 イン デ ッ ク ス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2014年5月12日	円	%		%	%	%
	12,299	—	353.58	—	99.4	0.2
5月末	12,328	0.2	354.39	0.2	99.5	0.1
6月末	12,364	0.5	355.41	0.5	99.7	0.1
7月末	12,384	0.7	356.01	0.7	99.6	0.1
8月末	12,424	1.0	357.15	1.0	99.3	0.3
9月末	12,433	1.1	357.41	1.1	99.5	0.4
10月末	12,491	1.6	359.08	1.6	98.3	1.1
11月末	12,565	2.2	361.19	2.2	98.9	0.7
12月末	12,695	3.2	364.96	3.2	99.2	0.2
2015年1月末	12,699	3.3	365.07	3.2	100.2	0.2
2月末	12,630	2.7	363.04	2.7	99.5	0.1
3月末	12,637	2.7	363.28	2.7	100.1	—
4月末	12,678	3.1	364.50	3.1	99.7	0.2
(期 末) 2015年5月12日	円	%		%	%	%
	12,572	2.2	361.38	2.2	99.4	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2.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(2.2%)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

- ・日銀による大規模国債買い入れオペの効果や世界景気に対する慎重な見方を受けて、債券市況は緩やかな上昇（利回りは低下）基調となっていました。日銀が2014年10月末に「量的・質的金融緩和」の拡大を決定したことから、2015年1月中旬にかけて一段の上昇となりました。
- ・その後は、日銀の追加金融緩和観測の後退や米国金利の上昇などから市況は下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
- ・ベンチマーク（NOMURA-BPI総合インデックス）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2.2%の上昇となったため、カイ離は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 とのカイ離	0.0%程度	△0.0%程度	0.0%程度	0.0%程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

- ・年限構成、種別構成、デュレーション（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

- ・ベンチマークであるNOMURA-BPI総合インデックスに連動する成果をめざすべく、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

(2014年5月13日～2015年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等を売買する際に発生する費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、12,527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

(2014年5月13日～2015年5月12日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 124,120,865	千円 73,164,875
	地方債証券	4,545,751	2,079,656
	特殊債券	6,813,914	3,855,323 (421,588)
	社債券	4,840,919	2,808,070 (100,000)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債券先物取引	百万円 15,425	百万円 14,852	百万円 -	百万円 -

○利害関係人との取引状況等

(2014年5月13日～2015年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 140,321	百万円 38,627	% 27.5	百万円 81,907	百万円 24,091	% 29.4

(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 200	百万円 518	百万円 1,151

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 300

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

○組入資産の明細

(2015年5月12日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	259,668,000 (100,000)	276,063,134 (100,693)	80.3 (0.0)	— (—)	47.8 (—)	22.4 (0.0)	10.2 (—)
地方債証券	18,432,040 (18,432,040)	19,456,471 (19,456,471)	5.7 (5.7)	— (—)	3.6 (3.6)	1.6 (1.6)	0.5 (0.5)
特殊債券 (除く金融債)	23,778,319 (23,778,319)	25,080,571 (25,080,571)	7.3 (7.3)	— (—)	4.7 (4.7)	2.1 (2.1)	0.5 (0.5)
金融債券	3,190,000 (3,190,000)	3,205,684 (3,205,684)	0.9 (0.9)	— (—)	— (—)	0.7 (0.7)	0.2 (0.2)
普通社債券	17,347,000 (17,347,000)	17,990,217 (17,990,217)	5.2 (5.2)	0.2 (0.2)	1.9 (1.9)	2.3 (2.3)	1.1 (1.1)
合 計	322,415,359 (62,847,359)	341,796,080 (65,833,638)	99.4 (19.1)	0.2 (0.2)	58.0 (10.3)	29.0 (6.7)	12.4 (2.2)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	利 率	当 期 末		償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	
国債証券	%	千円	千円	
第341回利付国債 (2年)	0.1	800,000	800,864	2016/6/15
第342回利付国債 (2年)	0.1	1,110,000	1,111,287	2016/7/15
第343回利付国債 (2年)	0.1	1,400,000	1,401,750	2016/8/15
第344回利付国債 (2年)	0.1	1,430,000	1,431,901	2016/9/15
第345回利付国債 (2年)	0.1	940,000	941,334	2016/10/15
第346回利付国債 (2年)	0.1	1,250,000	1,251,875	2016/11/15
第347回利付国債 (2年)	0.1	350,000	350,553	2016/12/15
第348回利付国債 (2年)	0.1	1,050,000	1,051,753	2017/1/15
第349回利付国債 (2年)	0.1	1,220,000	1,222,135	2017/2/15
第350回利付国債 (2年)	0.1	1,200,000	1,202,196	2017/3/15
第351回利付国債 (2年)	0.1	1,240,000	1,242,380	2017/4/15
第97回利付国債 (5年)	0.4	1,210,000	1,215,396	2016/6/20
第98回利付国債 (5年)	0.3	1,000,000	1,003,350	2016/6/20
第99回利付国債 (5年)	0.4	990,000	995,355	2016/9/20
第100回利付国債 (5年)	0.3	1,360,000	1,365,521	2016/9/20
第101回利付国債 (5年)	0.4	850,000	855,448	2016/12/20
第102回利付国債 (5年)	0.3	2,990,000	3,004,352	2016/12/20
第103回利付国債 (5年)	0.3	1,360,000	1,367,534	2017/3/20
第104回利付国債 (5年)	0.2	1,150,000	1,154,243	2017/3/20
第105回利付国債 (5年)	0.2	2,640,000	2,650,533	2017/6/20
第106回利付国債 (5年)	0.2	3,130,000	3,143,991	2017/9/20
第107回利付国債 (5年)	0.2	1,570,000	1,577,755	2017/12/20
第108回利付国債 (5年)	0.1	2,130,000	2,134,984	2017/12/20
第109回利付国債 (5年)	0.1	2,450,000	2,455,929	2018/3/20
第110回利付国債 (5年)	0.3	1,080,000	1,088,758	2018/3/20
第111回利付国債 (5年)	0.4	1,410,000	1,425,453	2018/3/20
第112回利付国債 (5年)	0.4	1,200,000	1,213,944	2018/6/20
第113回利付国債 (5年)	0.3	2,700,000	2,723,004	2018/6/20
第114回利付国債 (5年)	0.3	1,390,000	1,402,329	2018/9/20
第115回利付国債 (5年)	0.2	2,170,000	2,181,978	2018/9/20
第116回利付国債 (5年)	0.2	3,780,000	3,800,374	2018/12/20
第117回利付国債 (5年)	0.2	3,990,000	4,010,668	2019/3/20
第118回利付国債 (5年)	0.2	1,690,000	1,698,281	2019/6/20
第119回利付国債 (5年)	0.1	1,670,000	1,671,352	2019/6/20
第120回利付国債 (5年)	0.2	2,440,000	2,451,102	2019/9/20
第121回利付国債 (5年)	0.1	2,360,000	2,360,495	2019/9/20
第122回利付国債 (5年)	0.1	3,580,000	3,578,353	2019/12/20
第123回利付国債 (5年)	0.1	1,960,000	1,957,628	2020/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	275,000	335,368	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	500,000	584,480	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	493,000	576,593	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	708,000	828,367	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	645,000	719,826	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	690,000	750,292	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	700,000	720,216	2054/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第8回利付国債(40年)	1.4	170,000	159,781	2055/3/20
第280回利付国債(10年)	1.9	600,000	612,588	2016/6/20
第281回利付国債(10年)	2.0	1,053,000	1,076,250	2016/6/20
第282回利付国債(10年)	1.7	1,790,000	1,831,295	2016/9/20
第283回利付国債(10年)	1.8	1,732,000	1,774,312	2016/9/20
第284回利付国債(10年)	1.7	2,866,000	2,944,299	2016/12/20
第285回利付国債(10年)	1.7	3,468,000	3,577,346	2017/3/20
第286回利付国債(10年)	1.8	1,070,000	1,110,349	2017/6/20
第287回利付国債(10年)	1.9	2,400,000	2,495,544	2017/6/20
第288回利付国債(10年)	1.7	1,596,000	1,659,456	2017/9/20
第289回利付国債(10年)	1.5	1,593,000	1,654,760	2017/12/20
第290回利付国債(10年)	1.4	350,000	363,856	2018/3/20
第291回利付国債(10年)	1.3	940,000	974,535	2018/3/20
第292回利付国債(10年)	1.7	794,000	832,215	2018/3/20
第293回利付国債(10年)	1.8	521,000	549,743	2018/6/20
第294回利付国債(10年)	1.7	940,000	988,945	2018/6/20
第295回利付国債(10年)	1.5	1,040,000	1,087,704	2018/6/20
第296回利付国債(10年)	1.5	1,600,000	1,678,224	2018/9/20
第297回利付国債(10年)	1.4	836,000	876,579	2018/12/20
第298回利付国債(10年)	1.3	1,240,000	1,295,738	2018/12/20
第299回利付国債(10年)	1.3	1,260,000	1,319,749	2019/3/20
第300回利付国債(10年)	1.5	957,000	1,009,721	2019/3/20
第301回利付国債(10年)	1.5	1,512,000	1,600,089	2019/6/20
第302回利付国債(10年)	1.4	1,250,000	1,317,712	2019/6/20
第303回利付国債(10年)	1.4	1,615,000	1,706,732	2019/9/20
第304回利付国債(10年)	1.3	800,000	841,976	2019/9/20
第305回利付国債(10年)	1.3	2,938,000	3,098,796	2019/12/20
第306回利付国債(10年)	1.4	2,488,000	2,641,534	2020/3/20
第307回利付国債(10年)	1.3	1,260,000	1,331,681	2020/3/20
第308回利付国債(10年)	1.3	1,474,000	1,561,393	2020/6/20
第309回利付国債(10年)	1.1	2,190,000	2,297,638	2020/6/20
第310回利付国債(10年)	1.0	2,036,000	2,128,454	2020/9/20
第311回利付国債(10年)	0.8	1,230,000	1,272,791	2020/9/20
第312回利付国債(10年)	1.2	2,430,000	2,571,037	2020/12/20
第313回利付国債(10年)	1.3	1,859,000	1,981,229	2021/3/20
第314回利付国債(10年)	1.1	950,000	1,001,452	2021/3/20
第315回利付国債(10年)	1.2	2,013,000	2,136,900	2021/6/20
第316回利付国債(10年)	1.1	830,000	876,081	2021/6/20
第317回利付国債(10年)	1.1	657,000	694,527	2021/9/20
第318回利付国債(10年)	1.0	1,790,000	1,881,003	2021/9/20
第319回利付国債(10年)	1.1	719,000	760,917	2021/12/20
第320回利付国債(10年)	1.0	2,100,000	2,208,759	2021/12/20
第321回利付国債(10年)	1.0	1,575,000	1,656,774	2022/3/20
第322回利付国債(10年)	0.9	750,000	783,877	2022/3/20
第323回利付国債(10年)	0.9	1,875,000	1,959,337	2022/6/20
第324回利付国債(10年)	0.8	1,250,000	1,297,062	2022/6/20

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325回利付国債 (10年)	0.8	2,885,000	2,992,004	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	1,000,000	1,029,350	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	1,110,000	1,150,825	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	2,330,000	2,379,931	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	3,210,000	3,327,710	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	1,990,000	2,062,674	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	1,480,000	1,510,029	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	3,260,000	3,323,896	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	3,650,000	3,717,123	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	3,170,000	3,225,665	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	2,810,000	2,831,496	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	1,360,000	1,368,772	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	2,100,000	2,073,855	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	2,210,000	2,199,568	2025/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	76,000	96,564	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	98,000	119,266	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	117,000	140,809	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	127,000	163,934	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	108,000	128,372	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	169,000	205,754	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	164,000	197,152	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	142,000	159,177	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	116,000	122,577	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	185,000	186,110	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	137,000	150,658	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	220,000	255,939	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	205,000	234,759	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	493,000	596,781	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	346,000	424,804	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	302,000	370,348	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	327,000	395,228	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	427,000	507,997	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	303,000	360,185	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	435,000	531,852	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	379,000	449,349	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	370,000	452,099	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	354,000	432,577	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	341,000	417,060	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	412,000	488,487	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	834,000	1,003,769	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	650,000	794,729	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	801,000	980,688	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	850,000	1,024,845	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	926,000	1,099,578	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	888,000	1,037,743	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	1,079,000	1,284,063	2040/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第33回利付国債 (30年)	2.0	1,204,000	1,358,232	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	1,206,000	1,411,900	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	1,259,000	1,420,831	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	1,069,000	1,204,741	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	1,157,000	1,279,005	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	885,000	956,888	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	900,000	993,753	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	700,000	756,063	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	660,000	696,880	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	760,000	801,906	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	900,000	947,979	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	850,000	894,667	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	970,000	972,987	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	580,000	581,194	2045/3/20
第33回利付国債 (20年)	3.8	36,000	37,851	2016/9/20
第35回利付国債 (20年)	3.3	117,000	124,139	2017/3/20
第36回利付国債 (20年)	3.0	201,000	215,164	2017/9/20
第38回利付国債 (20年)	2.7	400,000	430,648	2018/3/20
第40回利付国債 (20年)	2.3	601,000	646,591	2018/9/20
第42回利付国債 (20年)	2.6	869,000	953,762	2019/3/20
第43回利付国債 (20年)	2.9	74,000	83,016	2019/9/20
第44回利付国債 (20年)	2.5	480,000	535,464	2020/3/20
第47回利付国債 (20年)	2.2	114,000	126,551	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	209,000	236,234	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)	2.1	515,000	572,947	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	200,000	222,110	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	214,000	239,744	2021/9/21
第54回利付国債 (20年)	2.2	480,000	542,380	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	241,000	269,956	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	449,000	503,472	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	147,000	164,157	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	589,000	650,291	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	289,000	304,163	2023/3/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	442,000	493,457	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	441,000	496,676	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	318,000	359,161	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	500,000	560,545	2023/12/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	846,000	979,075	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	422,000	496,769	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	160,000	185,534	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	534,000	616,401	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	620,000	710,749	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	318,000	367,480	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	575,000	666,045	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	200,000	227,780	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	210,000	241,266	2025/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第78回利付国債 (20年)	1.9	410,000	467,666	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	50,000	57,543	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	315,000	365,570	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	200,000	230,438	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	662,000	769,674	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	293,000	341,060	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	670,000	773,133	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	330,000	384,532	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	515,000	610,707	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	250,000	293,887	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	504,000	598,782	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	410,000	482,799	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	670,000	790,244	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	468,000	557,303	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	902,000	1,055,060	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	270,000	313,027	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	665,000	778,794	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	677,000	809,123	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	380,000	445,310	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	853,000	1,010,540	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	220,000	257,952	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	1,075,000	1,261,706	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	620,000	735,704	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	573,000	693,971	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	680,000	824,166	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	550,000	659,961	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	280,000	329,016	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	690,000	810,936	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	381,000	452,445	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	607,000	713,874	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	630,000	724,796	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	940,000	1,081,723	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	246,000	289,480	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	381,000	453,473	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	860,000	1,012,572	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	1,252,000	1,473,879	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	1,020,000	1,200,438	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	494,000	588,270	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	596,000	709,567	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	890,000	1,047,031	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	296,000	344,088	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	460,000	521,626	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	800,000	884,440	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	929,000	1,065,813	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	620,000	702,850	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	828,000	973,256	2030/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第124回利付国債 (20年)	2.0	500,000	580,405	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	724,000	861,719	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	220,000	255,336	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	520,000	595,842	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	644,000	737,154	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	600,000	677,844	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	852,000	961,303	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	400,000	445,296	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	827,000	919,243	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	650,000	732,381	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	965,000	1,085,711	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	170,000	188,654	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	330,000	361,152	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	812,000	899,606	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	410,000	441,549	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	150,000	163,860	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	1,507,000	1,666,681	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	1,200,000	1,324,728	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	620,000	694,238	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	990,000	1,075,080	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	610,000	652,730	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	1,670,000	1,836,499	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	1,580,000	1,734,018	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	1,800,000	1,941,966	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	1,610,000	1,706,535	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	1,800,000	1,903,122	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	1,600,000	1,660,688	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	1,630,000	1,630,000	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	1,250,000	1,246,000	2035/3/20
第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013)	0.67	100,000	100,693	2018/11/15
小 計		259,668,000	276,063,134	
地方債証券				
第1回東京都公募公債 (20年)	1.54	20,000	21,818	2023/6/20
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	10,000	11,941	2038/9/17
第8回東京都公募公債 (30年)	2.23	80,000	91,089	2038/9/17
第16回東京都公募公債 (20年)	2.01	100,000	115,474	2028/12/20
第20回東京都公募公債 (20年)	2.09	80,000	93,284	2029/9/20
第21回東京都公募公債 (20年)	2.19	80,000	94,324	2029/12/20
第22回東京都公募公債 (20年)	1.92	120,000	136,918	2030/6/20
第24回東京都公募公債 (20年)	1.98	70,000	80,186	2031/6/20
第28回東京都公募公債 (20年)	1.59	100,000	107,314	2033/3/18
第638回東京都公募公債	1.9	100,000	102,485	2016/9/20
第648回東京都公募公債	1.84	100,000	103,745	2017/6/20
第666回東京都公募公債	1.46	100,000	105,141	2019/3/20
第669回東京都公募公債	1.63	50,000	53,065	2019/6/20
第678回東京都公募公債	1.38	100,000	105,579	2019/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第680回東京都公募公債	1.39	100,000	105,871	2020/3/19
第681回東京都公募公債	1.4	100,000	105,920	2020/3/19
第692回東京都公募公債	1.35	100,000	106,312	2020/12/18
第693回東京都公募公債	1.38	100,000	106,702	2021/3/19
第701回東京都公募公債	0.99	120,000	125,587	2021/9/17
第705回東京都公募公債	1.06	70,000	73,669	2022/3/18
第717回東京都公募公債	0.63	100,000	101,944	2023/3/20
第719回東京都公募公債	0.86	150,000	155,554	2023/3/20
第728回東京都公募公債	0.65	200,000	203,816	2023/12/20
第730回東京都公募公債	0.664	100,000	101,948	2024/3/19
第733回東京都公募公債	0.581	100,000	101,095	2024/6/20
平成18年度第6回北海道公募公債	2.1	118,000	121,034	2016/8/31
平成19年度第2回北海道公募公債	1.84	112,000	115,952	2017/5/31
平成19年度第4回北海道公募公債	1.98	20,000	20,790	2017/6/29
平成19年度第16回北海道公募公債	1.58	100,000	104,165	2018/3/23
平成20年度第6回北海道公募公債	1.72	53,990	56,774	2018/8/29
平成21年度第2回北海道公募公債	1.66	100,000	105,926	2019/5/29
平成21年度第12回北海道公募公債	1.42	100,000	105,512	2019/12/25
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	100,000	103,769	2020/10/29
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	100,000	102,826	2022/10/31
第1回神奈川県公募公債(20年)	2.55	100,000	118,668	2024/6/20
第2回神奈川県公募公債(20年)	2.23	80,000	92,696	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債(30年)	2.87	80,000	100,556	2036/6/20
第3回神奈川県公募公債(20年)	2.11	100,000	115,375	2025/6/20
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	102,446	2034/9/20
第152回神奈川県公募公債	1.53	110,000	114,592	2018/3/20
第162回神奈川県公募公債	1.62	140,450	149,002	2019/6/20
第165回神奈川県公募公債	1.4	54,660	57,630	2019/9/20
第170回神奈川県公募公債	1.38	100,000	105,827	2020/3/20
第176回神奈川県公募公債	1.16	128,900	135,453	2020/9/18
第5回大阪府公募公債(20年)	2.16	100,000	116,776	2030/5/28
第74回大阪府公募公債(5年)	0.46	100,000	100,407	2016/6/29
第285回大阪府公募公債	1.5	50,000	50,434	2015/12/25
第300回大阪府公募公債	1.8	135,000	139,306	2017/3/29
第306回大阪府公募公債	1.83	30,000	31,231	2017/9/27
第313回大阪府公募公債	1.66	100,000	104,596	2018/4/27
第314回大阪府公募公債	1.8	30,000	31,540	2018/5/29
第316回大阪府公募公債	1.85	100,000	105,553	2018/7/30
第325回大阪府公募公債	1.66	53,000	56,125	2019/4/26
第326回大阪府公募公債	1.66	10,000	10,600	2019/5/28
第331回大阪府公募公債	1.41	100,000	105,423	2019/10/29
第332回大阪府公募公債	1.58	71,600	76,083	2019/11/27
第334回大阪府公募公債	1.47	44,000	46,609	2020/1/28
第337回大阪府公募公債	1.44	110,000	116,631	2020/4/28
第343回大阪府公募公債	0.98	70,000	72,790	2020/10/28
第348回大阪府公募公債	1.32	10,000	10,616	2021/3/30

銘柄	当 期 末			償還年月日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	
地方債証券	%	千円	千円	
第351回大阪府公募公債	1.19	100,000	105,584	2021/7/28
第358回大阪府公募公債	0.97	56,000	58,444	2022/2/28
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000	58,522	2022/3/29
平成21年度第5回京都府公募公債	1.35	20,000	21,081	2019/12/24
平成22年度第5回京都府公募公債	1.26	110,000	116,339	2020/12/21
平成23年度第9回京都府公募公債	1.01	140,000	146,763	2022/3/16
平成25年度第2回京都府公募公債 (15年)	1.05	100,000	103,545	2028/4/28
第2回兵庫県公募公債 (30年)	2.36	40,000	46,217	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債 (15年)	1.31	100,000	106,535	2027/12/24
第8回兵庫県公募公債 (15年)	1.09	100,000	102,886	2029/4/16
第16回兵庫県公募公債 (20年)	1.7	100,000	108,559	2032/11/19
平成20年度第5回兵庫県公募公債	1.93	50,000	52,826	2018/6/20
平成21年度第1回兵庫県公募公債	1.62	20,000	21,149	2019/4/23
平成21年度第3回兵庫県公募公債	1.62	90,000	95,278	2019/5/22
平成21年度第25回兵庫県公募公債	1.54	100,000	106,080	2019/11/20
平成18年度第2回静岡県公募公債	2.0	41,300	42,197	2016/6/27
平成19年度第1回静岡県公募公債	1.77	66,900	69,232	2017/5/30
平成20年度第1回静岡県公募公債	1.73	14,500	15,227	2018/5/28
平成20年度第4回静岡県公募公債	1.65	100,000	105,114	2018/8/28
平成20年度第5回静岡県公募公債	1.59	11,000	11,563	2018/10/30
平成21年度第4回静岡県公募公債	1.56	52,920	56,104	2019/8/20
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	105,045	2020/7/22
平成22年度第8回静岡県公募公債	1.059	100,000	104,473	2020/8/25
平成23年度第5回静岡県公募公債	1.158	100,000	105,540	2021/6/28
平成25年度第9回静岡県公募公債	0.679	100,000	102,131	2023/11/22
平成26年度第5回静岡県公募公債	0.61	100,000	101,277	2024/7/25
平成18年度第4回愛知県公募公債	1.8	110,700	113,449	2016/10/17
平成23年度第7回愛知県公募公債	1.11	100,000	105,323	2021/7/29
平成23年度第17回愛知県公募公債	0.996	100,000	104,776	2022/1/31
平成25年度第2回愛知県公募公債	0.576	200,000	202,944	2023/4/26
平成25年度第9回愛知県公募公債	0.849	140,000	145,052	2023/7/25
平成19年度第2回広島県公募公債	1.94	46,050	48,005	2017/8/24
平成20年度第4回広島県公募公債	1.73	60,000	63,398	2018/11/26
平成22年度第8回広島県公募公債	1.33	26,650	28,338	2021/3/25
平成23年度第1回広島県公募公債	1.19	100,000	105,599	2021/5/27
平成18年度第3回埼玉県公募公債	2.1	107,600	110,243	2016/7/28
平成18年度第5回埼玉県公募公債	1.9	62,100	63,861	2016/11/29
平成18年度第7回埼玉県公募公債	1.85	112,600	116,197	2017/2/27
平成19年度第3回埼玉県公募公債	1.94	39,100	40,776	2017/8/28
平成19年度第6回埼玉県公募公債	1.63	100,000	104,236	2018/1/30
平成23年度第1回埼玉県公募公債	1.37	100,000	106,687	2021/4/27
平成23年度第4回埼玉県公募公債	1.2	100,000	105,837	2021/7/27
平成24年度第6回埼玉県公募公債	0.801	100,000	103,277	2022/10/26
平成26年度第6回埼玉県公募公債	0.554	150,000	150,996	2024/9/26
平成18年度第3回福岡県公募公債	1.9	100,000	102,683	2016/10/31
平成19年度第1回福岡県公募公債 (30年)	2.62	70,000	84,812	2037/9/18

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1回福岡県公募公債 (30年)	2.28	80,000	91,792	2038/9/17
平成21年度第11回福岡県公募公債	1.44	100,000	105,986	2020/2/25
平成22年度第3回福岡県公募公債	1.11	100,000	104,711	2020/8/24
平成22年度第5回福岡県公募公債	0.94	20,000	20,782	2020/10/28
第9回千葉県公募公債 (20年)	1.84	80,000	90,235	2030/10/11
平成20年度第2回千葉県公募公債	1.8	90,000	94,692	2018/5/25
平成20年度第3回千葉県公募公債	1.78	80,000	84,326	2018/7/25
平成20年度第5回千葉県公募公債	1.6	80,000	84,033	2018/9/25
平成22年度第7回千葉県公募公債	0.92	120,000	124,586	2020/10/23
平成22年度第11回千葉県公募公債	1.26	80,000	84,688	2021/1/25
平成23年度第9回千葉県公募公債	1.0	20,000	20,962	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債	1.05	20,000	21,025	2022/4/25
平成24年度第6回千葉県公募公債	0.81	100,000	103,337	2022/11/25
平成25年度第1回千葉県公募公債	0.58	82,500	83,706	2023/4/25
平成21年度第1回新潟県公募公債	1.42	23,000	24,210	2019/7/29
平成23年度第1回新潟県公募公債	1.02	119,000	124,632	2021/11/30
第45回共同発行市場公募地方債	1.7	37,500	38,482	2016/12/22
第47回共同発行市場公募地方債	1.8	117,000	120,605	2017/2/24
第50回共同発行市場公募地方債	1.7	29,100	30,066	2017/5/25
第52回共同発行市場公募地方債	1.9	102,000	106,112	2017/7/25
第53回共同発行市場公募地方債	1.8	300	311	2017/8/25
第58回共同発行市場公募地方債	1.59	21,000	21,859	2018/1/25
第59回共同発行市場公募地方債	1.57	100,800	104,990	2018/2/23
第62回共同発行市場公募地方債	1.74	100,000	105,032	2018/5/25
第63回共同発行市場公募地方債	1.88	100,000	105,603	2018/6/25
第64回共同発行市場公募地方債	1.78	100,000	105,408	2018/7/25
第65回共同発行市場公募地方債	1.62	90,000	94,500	2018/8/24
第74回共同発行市場公募地方債	1.57	100,000	105,778	2019/5/24
第75回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	106,168	2019/6/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	10,000	10,594	2019/8/23
第78回共同発行市場公募地方債	1.39	30,000	31,615	2019/9/25
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	109,500	115,299	2019/12/25
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	30,000	31,458	2020/9/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	106,030	2021/2/25
第101回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	104,949	2021/8/25
第104回共同発行市場公募地方債	1.03	200,000	209,850	2021/11/25
第107回共同発行市場公募地方債	1.01	100,000	104,873	2022/2/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	70,000	73,590	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	104,000	2022/5/25
第113回共同発行市場公募地方債	0.77	100,000	103,094	2022/8/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	103,451	2022/9/22
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	250,000	258,160	2022/11/25
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	102,623	2022/12/22
第118回共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	103,519	2023/1/25
第119回共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	309,645	2023/2/24
第120回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	102,290	2023/3/24

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128回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	305,799	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	130,000	133,598	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	200,000	203,660	2024/3/25
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	100,000	101,737	2024/6/25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	300,000	302,556	2024/8/23
第138回共同発行市場公募地方債	0.554	100,000	100,664	2024/9/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	197,120	2025/1/24
平成18年度第1回堺市公募公債	1.84	30,000	30,839	2016/12/26
平成19年度第1回堺市公募公債	1.73	100,000	104,195	2017/12/19
平成18年度第2回熊本県公募公債	1.8	84,540	86,661	2016/10/27
平成24年度第2回熊本県公募公債	0.8	50,000	51,597	2022/10/26
平成22年度第1回新潟市公募公債	1.21	54,980	57,984	2020/12/24
平成23年度第1回浜松市公募公債	1.045	38,200	40,079	2021/11/25
平成25年度第1回浜松市公募公債	0.761	61,000	62,614	2024/1/24
第1回大阪市公募公債(15年)	1.753	200,000	223,658	2026/7/17
第5回大阪市公募公債(20年)	2.47	100,000	120,746	2028/9/21
平成18年度第6回大阪市公募公債	2.0	75,000	77,080	2016/10/26
平成19年度第4回大阪市公募公債	1.9	30,000	31,143	2017/6/21
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	125,000	132,791	2019/11/25
平成23年度第10回大阪市公募公債	0.956	10,000	10,429	2022/1/27
平成26年度第5回大阪市公募公債	0.593	100,000	100,788	2024/9/27
第1回名古屋市公募公債(12年)	1.033	100,000	104,846	2025/6/20
第2回名古屋市公募公債(20年)	2.56	100,000	118,600	2024/6/20
第10回名古屋市公募公債(20年)	2.26	80,000	95,127	2029/8/17
第477回名古屋市公募公債	1.034	100,000	104,958	2021/12/20
第5回京都市公募公債(20年)	2.36	50,000	59,417	2026/12/18
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	2.54	120,000	144,304	2026/6/19
平成22年度第9回神戸市公募公債(20年)	2.09	80,000	92,712	2031/1/24
第7回横浜市公募公債(20年)	2.06	100,000	115,190	2025/12/19
第17回横浜市公募公債(20年)	2.07	80,000	93,031	2028/12/20
平成20年度第4回横浜市公募公債	1.71	100,000	105,572	2018/11/16
第20回横浜市公募公債(20年)	2.1	80,000	93,384	2029/10/19
平成24年度第4回横浜市公募公債	0.81	100,000	103,247	2023/2/20
平成24年度第3回横浜市公募公債	0.729	100,000	102,651	2022/12/22
第25回横浜市公募公債(20年)	1.72	100,000	109,989	2032/7/16
第27回横浜市公募公債(20年)	1.599	60,000	64,356	2033/5/20
平成21年度第5回札幌市公募公債	1.36	112,000	117,815	2019/9/20
平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	2.277	80,000	91,835	2040/9/20
第82回川崎市公募公債	1.52	100,000	105,931	2019/9/20
第17回北九州市公募公債(20年)	1.529	100,000	104,779	2034/6/20
平成17年度第3回福岡市公募公債	1.6	60,000	60,502	2015/11/30
平成18年度第6回福岡市公募公債	1.8	70,000	71,954	2016/12/26
平成20年度第5回福岡市公募公債	1.57	91,000	95,546	2018/10/24
平成24年度第1回福岡市公募公債(5年)	0.25	34,700	34,828	2017/6/26
平成24年度第3回福岡市公募公債(5年)	0.25	42,500	42,671	2017/9/28
平成25年度第3回福岡市公募公債(5年)	0.31	31,500	31,706	2018/9/26

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
平成25年度第4回福岡市公募公債	0.68	50,000	51,018	2023/10/24
平成26年度第6回福岡市公募公債 (20年)	1.371	100,000	102,183	2034/9/20
平成18年度第1回千葉市公募公債	1.8	50,000	51,250	2016/10/25
平成24年度第2回千葉市公募公債	0.81	100,000	103,258	2022/11/22
平成22年度第1回三重県公募公債	1.056	87,050	91,065	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債	1.021	12,750	13,371	2021/11/30
平成24年度第1回三重県公募公債	0.801	40,400	41,723	2022/10/25
平成24年度第4回福井県公募公債	0.46	100,000	100,457	2023/4/26
平成20年度第1回徳島県公募公債	1.73	36,000	38,022	2018/11/28
平成26年度第1回徳島県公募公債	0.495	100,000	99,815	2024/11/28
平成20年度第1回岡山県公募公債	1.56	48,700	51,218	2018/12/25
小 計		18,432,040	19,456,471	
特殊債券(除く金融債)				
第16回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	120,000	122,833	2016/7/28
第17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	102,542	2016/8/31
第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	100,000	102,680	2016/12/28
第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	200,000	208,214	2017/7/31
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	112,000	116,757	2017/8/31
第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	90,000	93,519	2017/9/28
第42回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	106,000	110,565	2017/10/31
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	103,929	2018/1/31
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	56,000	58,216	2018/4/20
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	100,000	104,996	2018/5/30
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	34,000	35,783	2018/7/31
第64回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	56,000	58,803	2018/8/29
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	124,000	129,913	2018/9/28
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	115,000	121,123	2018/11/28
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	159,000	166,185	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	123,000	128,638	2019/3/19
第81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	234,080	2029/5/31
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	110,000	116,260	2019/6/28
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	79,000	83,011	2019/9/30
第90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	116,982	2029/9/28
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	100,000	116,988	2029/10/31
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	139,000	145,703	2019/12/27
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	210,000	221,323	2020/1/31
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	117,538	2040/2/29
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	50,000	52,757	2020/3/19
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	116,986	2030/4/30
第110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	105,749	2020/6/30
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	104,316	2020/9/30
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	112,000	116,334	2020/11/30
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	71,000	74,972	2020/12/28
第127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	115,387	2031/1/31
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	91,000	95,785	2021/5/31
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	60,000	63,216	2021/7/30

銘柄	利 率	当 期 末		評 価 額	償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額		
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円		
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	122,000	127,834	2021/8/31	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	104,856	2021/10/29	
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	112,027	2031/10/31	
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	136,000	142,630	2021/11/30	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	112,000	116,756	2022/2/28	
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	270,000	281,529	2022/3/18	
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.977	100,000	104,778	2022/4/28	
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.737	100,000	110,690	2032/4/30	
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.83	200,000	214,782	2042/5/30	
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	150,000	155,040	2022/10/31	
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.805	100,000	103,421	2022/11/30	
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	117,000	120,376	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	207,276	2023/1/31	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	100,000	102,350	2023/3/17	
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	300,000	305,388	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	104,005	2023/6/30	
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.911	121,000	126,124	2023/7/31	
第197回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.835	100,000	103,581	2023/8/31	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	100,000	101,787	2024/6/28	
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.39	100,000	102,962	2034/8/31	
第344回政府保証道路債券	1.6	100,000	107,303	2020/7/15	
第3回政府保証首都高速道路債券	1.7	9,000	9,278	2017/3/27	
第4回政府保証首都高速道路債券	1.7	179,000	185,998	2017/9/25	
第1回政府保証阪神高速道路債券	1.6	5,000	5,068	2016/3/31	
第2回政府保証成田国際空港債券	1.6	38,000	38,461	2016/2/22	
第4回政府保証東日本高速道路債券	1.9	75,000	76,562	2016/6/27	
第6回政府保証東日本高速道路債券	1.8	62,000	63,662	2016/11/24	
第7回政府保証東日本高速道路債券	1.9	34,000	35,432	2017/8/24	
第10回政府保証東日本高速道路債券	1.5	107,000	111,045	2017/12/21	
第13回政府保証東日本高速道路債券	1.6	28,000	29,452	2018/10/19	
第3回政府保証中日本高速道路債券	1.6	27,000	27,328	2016/2/24	
第17回政府保証中日本高速道路債券	1.7	100,000	103,853	2017/9/15	
第20回政府保証中日本高速道路債券	1.4	10,000	10,383	2018/3/16	
第23回政府保証中日本高速道路債券	1.5	46,000	48,178	2018/9/14	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	10,000	10,564	2019/6/14	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	25,000	26,325	2019/7/12	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	100,000	105,816	2019/8/16	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	0.4	200,000	201,900	2018/1/30	
第4回政府保証公営企業債券(15年)	2.0	100,000	111,791	2022/4/22	
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	0.093	200,000	200,154	2017/2/24	
第5回政府保証公営企業債券(15年)	2.2	100,000	113,403	2022/7/15	
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.4	100,000	105,043	2019/4/15	
第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.5	48,000	50,669	2019/5/24	
第12回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	105,642	2020/5/22	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	104,311	2020/9/14	
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	21,000	22,015	2021/10/18	

銘柄	当 期 末			償還年月日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	50,000	52,774	2021/12/14
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	100,000	104,170	2022/6/17
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	254,000	262,834	2023/2/17
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	36,643	2023/5/16
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	150,000	155,404	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	39,000	39,932	2023/12/18
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.645	200,000	203,830	2024/3/15
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.601	100,000	101,372	2024/7/16
第63回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.556	200,000	201,882	2024/8/16
第864回政府保証公営企業債券	1.9	14,000	14,287	2016/6/22
第866回政府保証公営企業債券	2.0	63,000	64,553	2016/8/18
第870回政府保証公営企業債券	1.7	52,000	53,381	2016/12/21
第879回政府保証公営企業債券	1.7	102,000	105,948	2017/9/19
第883回政府保証公営企業債券	1.4	100,000	103,845	2018/3/19
第884回政府保証公営企業債券	1.4	114,000	118,482	2018/4/17
第885回政府保証公営企業債券	1.7	104,000	109,159	2018/5/22
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	111,094	2021/4/16
第23回政府保証日本政策金融公庫債券	0.734	30,000	30,873	2022/12/16
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	103,487	2023/2/24
第190回政府保証中小企業債券	1.8	13,000	13,386	2017/1/24
第191回政府保証中小企業債券	1.7	211,000	219,129	2017/9/15
第16回政府保証民間都市開発債券	0.699	80,000	81,985	2023/10/20
第17回政府保証国民生活債券	1.6	41,000	41,537	2016/3/17
第21回政府保証国民生活債券	1.5	2,000	2,075	2017/12/18
第201回政府保証預金保険機構債券	0.1	200,000	199,956	2019/2/13
第7回政府保証日本政策投資銀行	1.4	100,000	105,894	2020/2/17
第11回政府保証日本政策投資銀行	1.0	137,000	143,591	2021/9/14
第17回政府保証日本政策投資銀行	0.257	200,000	201,140	2018/11/9
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	20,478	2023/12/18
第27回政府保証日本政策投資銀行	0.11	200,000	198,904	2021/2/12
第53回政府保証関西国際空港債券	1.5	151,000	156,892	2018/1/24
第11回政府保証中部国際空港債券	0.7	100,000	101,160	2017/2/23
第5回政府保証西日本高速道路債券	1.8	41,000	42,220	2017/1/25
第6回政府保証西日本高速道路債券	1.8	51,000	52,597	2017/2/27
第8回政府保証西日本高速道路債券	1.7	100,000	103,335	2017/5/19
第11回政府保証西日本高速道路債券	1.7	31,000	32,297	2017/11/28
第21回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	0.46	100,000	100,645	2017/3/17
第27回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.98	100,000	102,538	2016/9/20
第46回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.69	50,000	52,248	2018/3/20
第7回道路債券(財投機関債)	2.7	100,000	116,153	2022/6/20
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.45	20,000	23,733	2026/3/19
第9回道路債券(財投機関債)	2.9	100,000	127,051	2032/5/20
第13回道路債券(財投機関債)	2.28	100,000	113,501	2022/9/20
第15回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.05	100,000	102,626	2016/9/20
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.87	30,000	37,329	2046/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.75	100,000	121,296	2047/3/20

銘柄	当期			評価額	償還年月日
	利率	額面金額	期末		
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円		
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	130,000	155,048	2047/3/20	
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.39	60,000	71,344	2027/7/20	
第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.82	200,000	208,046	2017/9/20	
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.34	100,000	118,428	2027/10/20	
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.61	100,000	104,269	2018/3/20	
第42回道路債券(財投機関債)	2.22	30,000	34,696	2025/3/21	
第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.63	100,000	105,290	2018/12/20	
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	119,837	2029/4/20	
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.9	50,000	55,923	2032/3/19	
第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.711	100,000	108,787	2032/6/18	
第100回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.784	100,000	102,675	2022/12/20	
第101回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.781	100,000	102,653	2022/12/20	
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.85	200,000	206,176	2023/6/20	
第1回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.648	100,000	106,038	2019/6/28	
第1回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.266	50,000	58,985	2029/6/28	
第2回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.406	80,000	84,087	2019/7/26	
第3回回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	20,000	20,921	2023/3/22	
第3回回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債)	1.176	100,000	104,017	2029/1/26	
第6回回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	112,975	2023/12/20	
第9回回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	58,157	2024/9/24	
第10回回地方公共団体金融機構債券(5年)(財投機関債)	0.28	100,000	100,353	2017/5/26	
第14回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.187	80,000	93,330	2031/4/28	
第16回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.164	100,000	104,823	2020/9/28	
第16回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.846	80,000	89,291	2031/8/28	
第17回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.87	100,000	111,924	2031/9/26	
第19回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.274	50,000	52,797	2020/12/28	
第20回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.28	100,000	105,683	2021/1/28	
F23回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.075	100,000	102,903	2018/5/29	
第23回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.418	100,000	106,658	2021/4/28	
第23回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	250,000	270,955	2032/7/28	
F24回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.681	70,000	76,715	2023/3/17	
第27回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.034	100,000	104,530	2021/8/27	
第35回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.006	100,000	104,476	2022/4/28	
第44回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.791	200,000	205,534	2023/1/27	
第49回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.887	200,000	206,936	2023/6/28	
F89回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.602	100,000	109,856	2027/8/20	
F110回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.562	100,000	101,538	2019/4/25	
F123回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.6	100,000	108,916	2030/3/19	
F131回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	100,000	107,221	2031/7/30	
F147回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.291	100,000	106,371	2027/3/19	
F226回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.096	100,000	102,926	2029/2/28	
第10回回首都高速道路	0.336	100,000	100,531	2017/9/20	
第13回回首都高速道路(財投機関債)	0.223	100,000	100,072	2019/9/20	
第10回回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167	80,000	93,266	2030/3/19	
第15回回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911	80,000	90,296	2030/10/29	
第21回回都市再生債券(財投機関債)	1.72	100,000	105,283	2018/9/20	

銘柄	当 期 末			償還年月日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第54回都市再生債券(財投機関債)	0.434	100,000	100,440	2016/9/20
第100回都市再生債券(財投機関債)	0.569	100,000	100,306	2024/11/20
第10回福祉医療機構債券(財投機関債)	2.16	100,000	102,267	2016/6/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	32,819	35,277	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	26,188	28,163	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	33,979	36,637	2042/6/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	27,045	29,348	2037/11/10
第2回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.8	100,000	103,124	2017/3/17
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	33,693	36,484	2042/8/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	23,189	24,578	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	24,112	26,089	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	33,025	35,528	2042/10/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.94	28,402	30,302	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	24,166	26,126	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	17,570	18,324	2037/10/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	34,639	37,050	2042/12/10
第8回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.73	70,000	72,667	2017/9/20
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.52	17,044	17,673	2037/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	24,831	26,818	2037/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.24	30,322	32,544	2039/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	36,536	37,860	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	25,613	27,630	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	37,789	40,676	2043/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	20,521	21,504	2039/1/10
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.7	37,850	39,671	2032/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.64	40,542	42,526	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	41,354	43,507	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	124,686	130,478	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8	22,501	23,728	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	23,671	25,265	2039/7/10
第21回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.92	100,000	105,952	2018/9/20
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	29,877	31,544	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	66,990	70,915	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	36,000	38,080	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	58,191	62,006	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	63,751	67,895	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	65,022	69,161	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	34,177	36,474	2040/12/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	32,392	34,496	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.36	73,698	76,709	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	34,607	37,297	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	31,839	34,696	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	77,865	82,248	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	78,179	83,439	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	74,823	79,857	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.92	73,034	78,474	2046/4/10

銘柄	当期末			償還年月日
	利率	額面金額	評価額	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	147,680	158,442	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	73,895	78,672	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	73,997	78,379	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21	31,992	34,726	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	78,221	82,760	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	79,876	83,896	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	80,668	84,586	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	82,694	86,420	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	249,591	261,164	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	83,868	87,747	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	84,153	87,561	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	85,975	88,657	2047/7/10
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.11	86,049	88,151	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	87,646	89,851	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	88,406	91,504	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.32	90,881	94,518	2048/7/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.066	80,000	91,754	2031/6/13
第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.751	30,000	33,429	2026/6/19
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	185,814	189,844	2049/1/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	92,875	94,877	2049/2/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	94,357	96,113	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	190,094	193,221	2049/5/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.863	100,000	111,360	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	97,714	98,741	2049/10/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	98,541	97,884	2050/1/10
第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.441	200,000	215,914	2027/3/19
第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.227	130,000	144,517	2042/9/19
第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)	2.04	50,000	57,075	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)	1.991	70,000	79,722	2031/6/13
第11回国際協力機構債券(財投機関債)	1.14	30,000	31,622	2021/12/20
第16回国際協力機構債券(財投機関債)	0.3	85,800	86,229	2018/12/26
第18回東日本高速道路	0.387	100,000	100,639	2017/9/20
第22回東日本高速道路	0.401	100,000	100,838	2018/6/20
第28回東日本高速道路	0.248	100,000	100,122	2019/12/20
第21回中日本高速道路	0.592	100,000	101,134	2017/9/20
第42回中日本高速道路	0.942	100,000	103,852	2022/3/18
第46回中日本高速道路	0.351	200,000	201,134	2017/9/20
第20回西日本高速道路	0.759	100,000	102,156	2023/9/20
第21回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)	1.86	200,000	211,502	2018/9/20
第43回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)	1.026	100,000	104,586	2021/9/17
第64回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)	0.193	100,000	100,225	2018/6/20
第5回東京都住宅供給公社債券	2.02	100,000	104,053	2017/9/20
小計		23,778,319	25,080,571	
金融債券				
い第733号商工債券	0.55	100,000	100,450	2016/6/27
い第735号商工債券	0.4	100,000	100,322	2016/8/26

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
金融債券	%	千円	千円	
い第736号商工債券	0.45	100,000	100,413	2016/9/27
い第745号商工債券	0.35	100,000	100,433	2017/6/27
い第773号商工債券	0.2	100,000	99,818	2019/10/25
い第734号農林債券	0.6	50,000	50,253	2016/7/27
い第740号農林債券	0.5	100,000	100,547	2017/1/27
い第741号農林債券	0.5	100,000	100,573	2017/2/27
い第744号農林債券	0.4	100,000	100,454	2017/5/26
い第749号農林債券	0.3	200,000	200,586	2017/10/27
い第752号農林債券	0.3	150,000	150,465	2018/1/26
い第760号農林債券	0.4	200,000	201,236	2018/9/27
い第761号農林債券	0.3	250,000	250,707	2018/10/26
い第763号農林債券	0.3	340,000	340,843	2018/12/27
い第765号農林債券	0.3	100,000	100,242	2019/2/27
い第769号農林債券	0.3	100,000	100,201	2019/6/27
い第774号農林債券	0.24	100,000	99,837	2019/11/27
第263回信金中金債	0.5	100,000	100,525	2016/10/27
第269回信金中金債	0.4	50,000	50,255	2017/4/27
第270回信金中金債	0.35	50,000	50,217	2017/5/26
第271回信金中金債	0.35	100,000	100,454	2017/6/27
第286回信金中金債	0.35	100,000	100,586	2018/9/27
第288回信金中金債	0.3	200,000	200,812	2018/11/27
第291回信金中金債	0.25	100,000	100,204	2019/2/27
第8号商工債券（10年）	1.66	100,000	105,247	2018/12/20
第175号商工債券（3年）	0.15	100,000	100,003	2017/8/25
小 計		3,190,000	3,205,684	
普通社債券				
第459回東京電力	2.7	80,000	84,313	2019/1/29
第524回東京電力	1.795	100,000	101,508	2017/3/14
第532回東京電力	1.75	120,000	122,220	2017/9/28
第534回東京電力	2.055	100,000	103,028	2019/10/29
第536回東京電力	1.672	100,000	101,630	2018/1/29
第544回東京電力	1.976	100,000	102,765	2018/6/25
第559回東京電力	1.377	60,000	60,063	2019/10/29
第567回東京電力	1.958	100,000	97,149	2030/7/29
第490回中部電力	1.444	70,000	73,271	2019/7/25
第498回中部電力	0.566	100,000	100,888	2017/9/25
第499回中部電力	1.194	50,000	52,176	2023/6/23
第448回関西電力	2.16	100,000	105,482	2018/6/20
第456回関西電力	2.01	100,000	103,703	2017/7/25
第473回関西電力	1.665	100,000	104,658	2019/4/25
第485回関西電力	1.285	100,000	103,539	2020/12/18
第374回中国電力	0.814	100,000	102,063	2020/2/25
第376回中国電力	0.628	100,000	101,138	2018/6/25
第379回中国電力	0.619	100,000	100,989	2021/1/25
第288回北陸電力	1.89	100,000	104,179	2017/10/25
第303回北陸電力	0.756	100,000	101,710	2019/6/25

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383回東北電力	2.9	100,000	106,945	2017/12/25
第445回東北電力	1.792	100,000	105,218	2018/11/22
第448回東北電力	1.608	100,000	105,129	2019/5/24
第456回東北電力	1.176	100,000	103,863	2020/11/25
第245回四国電力	2.0	100,000	109,362	2021/6/25
第279回四国電力	0.579	100,000	100,994	2018/2/23
第394回九州電力	1.86	100,000	103,773	2017/9/25
第400回九州電力	1.777	100,000	106,365	2020/4/24
第408回九州電力	1.672	100,000	105,199	2019/6/25
第423回九州電力	0.959	100,000	102,310	2019/9/25
第429回九州電力	0.909	100,000	99,463	2024/9/25
第256回北海道電力	3.7	80,000	82,175	2016/2/25
第261回北海道電力	2.775	24,000	25,482	2017/11/24
第310回北海道電力	1.286	50,000	52,118	2020/12/25
第315回北海道電力	0.82	100,000	101,427	2018/4/25
第19回沖縄電力	1.452	80,000	84,653	2020/4/24
第7回新関西国際空港	0.217	200,000	200,298	2016/12/20
第344回東京交通債券	1.67	100,000	109,292	2023/2/17
第347回東京交通債券	2.05	100,000	113,118	2024/3/8
第25回関西国際空港	1.361	100,000	105,493	2020/6/19
第38回関西国際空港	1.112	50,000	52,476	2021/12/20
第10回成田国際空港	1.094	160,000	167,808	2021/9/17
第11回成田国際空港	1.067	100,000	104,752	2022/2/18
第12回成田国際空港	0.879	100,000	103,351	2022/9/20
第13回成田国際空港	0.802	100,000	102,707	2023/2/8
第3回セブン&アイ・ホールディングス	1.94	100,000	105,540	2018/6/20
第8回旭化成	1.455	100,000	105,530	2019/12/11
第48回住友化学	0.623	100,000	101,208	2018/6/12
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	103,375	2022/12/2
第18回豊田自動織機	2.109	100,000	107,364	2019/3/20
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	104,973	2021/9/17
第10回小松製作所	0.275	100,000	100,346	2019/6/20
第1回日本電産	0.386	100,000	100,536	2017/9/20
第12回パナソニック	0.387	100,000	99,857	2020/3/19
第22回三菱重工業	2.03	100,000	104,428	2017/9/12
第29回三菱重工業	0.662	100,000	100,232	2024/9/3
第1回B号日本生命2011基金	1.12	100,000	101,780	2017/8/5
第1回日本生命2012基金	0.87	100,000	101,580	2018/8/3
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,158	2019/8/7
第55回日産自動車	0.415	100,000	100,605	2018/3/20
第57回日産自動車	0.314	100,000	100,229	2019/3/20
第5回凸版印刷	1.397	100,000	105,949	2020/12/16
第3回大日本印刷	1.358	100,000	105,728	2020/12/18
第48回伊藤忠商事	1.9	100,000	104,353	2017/11/20
第59回三井物産	2.11	100,000	107,225	2019/3/20
第69回三菱商事	1.99	100,000	105,488	2018/5/22

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第78回三菱商事	1.155	100,000	105,100	2022/3/9
第7回みずほコーポレート銀行 (同順位特約付)	2.08	100,000	104,164	2017/7/27
第7回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	2.5	100,000	108,521	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	106,950	2021/10/29
第9回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	2.2	100,000	113,366	2026/10/30
第27回みずほコーポレート銀行	0.515	200,000	200,950	2016/10/20
第28回みずほコーポレート銀行	0.515	200,000	201,124	2017/1/25
第29回みずほコーポレート銀行	0.46	100,000	100,532	2017/4/21
第30回みずほコーポレート銀行	0.34	100,000	100,336	2017/7/25
第31回みずほコーポレート銀行	0.33	200,000	200,690	2017/10/25
第32回みずほコーポレート銀行	0.27	100,000	100,213	2018/1/24
第9回三菱東京UFJ銀行	2.69	100,000	111,596	2020/2/27
第12回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	2.16	100,000	104,286	2017/7/28
第28回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	1.56	100,000	106,366	2021/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	2.46	100,000	117,405	2031/1/20
第87回三菱東京UFJ銀行	1.87	100,000	103,330	2017/4/20
第124回三菱東京UFJ銀行	1.51	100,000	106,882	2021/4/16
第126回三菱東京UFJ銀行	0.545	200,000	200,926	2016/7/14
第1回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位)	0.345	100,000	100,401	2017/6/7
第5回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位)	0.285	200,000	200,656	2018/11/28
第6回住友信託銀行 (劣後特約付)	2.78	100,000	119,577	2026/4/27
第6回セブン銀行	0.398	100,000	100,519	2017/6/20
第22回三井住友銀行 (劣後特約付)	1.43	100,000	105,449	2020/9/28
第23回三井住友銀行 (劣後特約付)	1.61	100,000	106,585	2020/12/17
第25回三井住友銀行 (劣後特約付)	2.21	100,000	114,182	2026/6/1
第54回三井住友銀行	0.49	100,000	100,405	2016/7/20
第57回三井住友銀行	0.28	200,000	200,614	2017/10/20
第5回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.49	100,000	116,154	2026/1/30
第6回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.25	100,000	102,894	2016/11/4
第8回みずほ銀行 (劣後特約付)	1.99	100,000	103,321	2017/4/27
第9回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.52	100,000	117,021	2027/4/27
第28回日産フィナンシャルサービス	0.253	100,000	100,151	2019/6/20
第29回ホンダファイナンス	0.428	100,000	100,359	2021/3/19
第62回トヨタファイナンス	0.203	100,000	99,871	2019/12/20
第52回日立キャピタル	0.508	200,000	201,196	2021/6/18
第152回オリックス	0.92	100,000	100,944	2016/8/31
第176回オリックス	0.354	100,000	100,095	2019/2/27
第9回三井住友ファイナンス&リース	0.518	200,000	202,120	2021/1/29
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	110,948	2025/9/24
第39回野村ホールディングス	0.853	100,000	101,585	2018/2/26
第43回野村ホールディングス	0.454	100,000	100,394	2019/2/25
第2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回	1.98	100,000	104,812	2018/6/20
第87回三菱地所	1.77	100,000	104,135	2017/11/15
第98回三菱地所	1.165	100,000	104,646	2020/6/19
第105回三菱地所	1.178	100,000	105,457	2022/3/23
第112回三菱地所	0.577	100,000	101,682	2020/12/25

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114回三菱地所	0.187	100,000	100,156	2018/3/15
第116回三菱地所	0.643	100,000	100,764	2024/9/19
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	104,628	2021/9/17
第17回エヌ・ティ・ティ都市開発	0.61	100,000	99,713	2024/9/20
第54回小田急電鉄	0.956	100,000	102,136	2017/12/15
第25回京王電鉄	1.695	100,000	104,007	2017/11/29
第5回東日本旅客鉄道	3.3	100,000	105,705	2017/2/25
第15回東日本旅客鉄道	2.65	100,000	112,391	2020/8/25
第26回東日本旅客鉄道	1.19	100,000	105,714	2022/12/20
第56回東日本旅客鉄道	1.7	100,000	105,466	2018/12/20
第58回東日本旅客鉄道	1.58	100,000	105,258	2019/3/20
第60回東日本旅客鉄道	1.449	100,000	105,128	2019/7/24
第62回東日本旅客鉄道	1.424	100,000	105,173	2019/9/27
第79回東日本旅客鉄道	1.131	100,000	105,002	2021/9/29
第83回東日本旅客鉄道	1.633	100,000	110,172	2026/12/22
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	105,096	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道	2.28	123,000	138,980	2022/3/25
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	111,096	2030/10/25
第56回東海旅客鉄道	2.083	100,000	114,968	2031/5/26
第11回東京地下鉄	1.16	100,000	105,312	2021/12/9
第5回日本通運	1.818	100,000	106,440	2019/5/31
第5回関西高速鉄道	1.238	100,000	105,114	2020/9/10
第52回日本電信電話	1.77	100,000	103,059	2017/3/17
第59回日本電信電話	1.69	100,000	106,093	2019/6/20
第63回日本電信電話	0.69	100,000	101,818	2023/3/20
第19回KDDI	1.151	100,000	104,260	2020/6/19
第21回KDDI	0.669	100,000	100,636	2024/9/20
第15回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	1.96	100,000	105,570	2018/6/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	101,936	2023/9/20
第29回電源開発	1.405	100,000	104,613	2019/11/20
第40回電源開発	0.889	100,000	101,301	2024/6/20
第23回東京ガス	1.01	100,000	104,448	2023/6/9
第9回大阪ガス	2.9	100,000	107,510	2018/1/30
第25回エヌ・ティ・ティ・データ	1.47	100,000	105,925	2020/3/19
第14回GEキャピタルコーポレーション	1.84	100,000	100,901	2015/11/20
第23回GEキャピタルコーポレーション	0.45	200,000	200,758	2016/9/20
第8回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.05	100,000	100,670	2016/2/22
第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.32	100,000	101,873	2017/2/9
第5回パークレイズ・バンク	1.29	100,000	100,364	2015/9/9
第5回ナショナル・オーストラリア銀行	1.01	100,000	100,636	2016/2/4
第8回ナショナル・オーストラリア銀行	1.3	100,000	101,919	2017/1/20
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	99,795	2020/1/16
第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.89	200,000	201,606	2016/6/10
第7回ウエストバック・バンキング・コーポレーション	1.07	100,000	100,295	2015/9/3
第8回ウエストバック・バンキング・コーポレーション	1.0	100,000	101,070	2016/8/12
第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行	0.98	200,000	201,164	2016/1/21

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9回ラボバンク・ネダーランド	1.81	100,000	106,490	2021/1/28
第17回ラボバンク・ネダーランド	0.563	100,000	100,192	2015/11/2
第22回ラボバンク・ネダーランド	0.377	100,000	100,246	2016/12/19
第23回ラボバンク・ネダーランド	0.557	100,000	100,544	2018/12/19
第4回ウォルマート・ストアーズ・インク	0.94	100,000	100,179	2015/7/28
第2回エイチエスビーシー・バンク・ビーエルシー	1.01	100,000	100,286	2015/9/10
小 計		17,347,000	17,990,217	
合 計		322,415,359	341,796,080	

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 1,172	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2015年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 341,796,080	% 99.0
コール・ローン等、その他	3,417,894	1.0
投資信託財産総額	345,213,974	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年5月12日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	345,213,974,303
コール・ローン等	2,445,886,194
公社債(評価額)	341,796,080,298
未収利息	901,049,847
前払費用	63,447,964
差入委託証拠金	7,510,000
(B) 負債	1,379,465,348
未払金	1,049,268,240
未払解約金	330,197,108
(C) 純資産総額(A-B)	343,834,508,955
元本	273,489,284,775
次期繰越損益金	70,345,224,180
(D) 受益権総口数	273,489,284,775口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,572円

<注記事項>

①期首元本額	230,228,174,698円
期中追加設定元本額	135,484,008,244円
期中一部解約元本額	92,222,898,167円

○損益の状況 (2014年5月13日～2015年5月12日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	3,580,137,465
受取利息	3,580,137,465
(B) 有価証券売買損益	2,569,001,889
売買益	3,955,960,885
売買損	△ 1,386,958,996
(C) 先物取引等取引損益	20,317,520
取引益	37,611,520
取引損	△ 17,294,000
(D) 当期損益金(A+B+C)	6,169,456,874
(E) 前期繰越損益金	52,934,367,849
(F) 追加信託差損益金	35,101,089,484
(G) 解約差損益金	△ 23,859,690,027
(H) 計(D+E+F+G)	70,345,224,180
次期繰越損益金(H)	70,345,224,180

(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。

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）

ファンド・マネジャー（国内債券）	11,743,442,447円
eMAXIS 国内債券インデックス	15,203,434,833円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,125,523,640円
eMAXIS バランス（波乗り型）	68,871,133円
コアバランス	2,230,302円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	10,259,490,415円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	5,114,470,182円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	159,053,540円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	44,439,863,200円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	18,281,244,331円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	2,609,072,273円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	7,926,797,815円
MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	113,326,227,570円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	8,784,466,902円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）	3,742,701,820円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	2,524,370,601円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	915,214,832円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	241,721,037円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	6,553,563,529円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	4,817,510,263円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	63,861,023円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	114,650,402円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	231,532,019円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	202,662,382円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	122,882,547円
三菱UFJ 日本債券インデックスファンドVA	26,872,804円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	409,759,981円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	1,194,737,135円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	494,881,793円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	1,203,556,358円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	2,494,686,393円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	1,702,858,889円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	3,505,625,283円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	1,792,846,196円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	1,044,074,228円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	533,454,470円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	228,713,599円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	224,657,170円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	57,701,438円
合計	273,489,284,775円

【お知らせ】

①新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。

（2014年12月1日）

②デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。

（2014年12月1日）

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

《第7期》決算日2016年1月26日

[計算期間：2015年1月27日～2016年1月26日]

「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第7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7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、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。 組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。
主 要 運 用 対 象	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
3期(2012年1月26日)	10,886	6.3	328.49	6.6	99.9	—	15,380
4期(2013年1月28日)	11,375	4.5	343.56	4.6	103.8	—	22,835
5期(2014年1月27日)	11,480	0.9	346.93	1.0	94.3	—	21,815
6期(2015年1月26日)	12,640	10.1	382.26	10.2	91.3	—	33,121
7期(2016年1月26日)	12,613	△ 0.2	381.71	△ 0.1	95.6	—	57,354

(注) シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・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、円ヘッジ・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年1月26日	円	%		%	%	%
	12,640	—	382.26	—	91.3	—
1 月 末	12,656	0.1	382.74	0.1	92.3	—
2 月 末	12,602	△0.3	381.07	△0.3	96.4	—
3 月 末	12,687	0.4	383.58	0.3	96.7	—
4 月 末	12,581	△0.5	380.53	△0.5	98.1	—
5 月 末	12,448	△1.5	376.31	△1.6	100.2	—
6 月 末	12,241	△3.2	370.37	△3.1	97.6	—
7 月 末	12,412	△1.8	375.40	△1.8	97.5	—
8 月 末	12,408	△1.8	375.47	△1.8	96.9	—
9 月 末	12,519	△1.0	378.64	△0.9	96.8	—
10 月 末	12,526	△0.9	378.92	△0.9	97.9	—
11 月 末	12,546	△0.7	379.61	△0.7	97.9	—
12 月 末	12,443	△1.6	376.44	△1.5	102.4	—
(期 末) 2016年1月26日	12,613	△0.2	381.71	△0.1	95.6	—

(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0.2%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−0.1%)を0.1%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

- ・外国債券市況は、2015年6月まではFRB（米連邦準備制度理事会）による政策金利の引き上げ期待やユーロ圏の景況感の改善などを背景に低下しましたが、6月以降は新興国の景気減速懸念や原油をはじめとする商品市況の悪化によるインフレ期待の低下などを背景に上昇しました。

◎為替

- ・為替変動の影響を回避するため、組入外貨建資産は原則として100%程度の為替ヘッジを行いました。

●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、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

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

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

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

- ・カストディーフィー、取引コスト、為替ヘッジ効果等による要因です。

為替ヘッジ効果：為替変動に伴う外貨建資産の価格変動リスクの低減効果が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.0%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。
- ・組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年1月27日～2016年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.017)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	2	0.017	
期中の平均基準価額は、12,505円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年1月27日～2016年1月26日)

公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカドル 151,877	千アメリカドル 56,200
	カナダ	千カナダドル 9,385	千カナダドル 3,590
	メキシコ	千メキシコペソ 56,446	千メキシコペソ 16,287
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 21,331	6,579
	イタリア	国債証券 27,141	7,997
	フランス	国債証券 27,439	7,759
	オランダ	国債証券 6,689	1,813
	スペイン	国債証券 16,085	4,658
	ベルギー	国債証券 7,097	2,030
	オーストリア	国債証券 3,880	839
	フィンランド	国債証券 1,739	489
	アイルランド	国債証券 1,931	518
	国	イギリス	千イギリスポンド 16,875
スイス		千スイスフラン 676	千スイスフラン 275
スウェーデン		千スウェーデンクローネ 12,336	千スウェーデンクローネ 3,411
ノルウェー		千ノルウェークローネ 6,957	千ノルウェークローネ 911
デンマーク		千デンマーククローネ 11,821	千デンマーククローネ 3,943
ポーランド		千ポーランドズロチ 6,136	千ポーランドズロチ 1,471
オーストラリア		千オーストラリアドル 8,287	千オーストラリアドル 2,052
シンガポール		千シンガポールドル 1,920	千シンガポールドル 342
南アフリカ		千南アフリカランド 19,677	千南アフリカランド 3,292

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2015年1月27日～2016年1月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	518,378	188,601	36.4	544,849	212,708	39.0
為替直物取引	34,580	24,867	71.9	8,576	5,260	61.3

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

(2016年1月26日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区分	額面金額	当 期		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		評 価 額				5年以上	2年以上	2年未満
		外貨建金額	邦貨換算金額					
アメリカ	千アメリカドル 197,140	千アメリカドル 203,768	千円 24,073,185	% 42.0	% —	% 17.0	% 15.9	% 9.1
カナダ	千カナダドル 11,240	千カナダドル 12,793	1,058,028	1.8	—	0.9	0.5	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 71,600	千メキシコペソ 78,936	501,248	0.9	—	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	27,360	32,378	4,149,241	7.2	—	4.0	2.1	1.1
イタリア	34,850	41,563	5,326,399	9.3	—	5.9	2.4	0.9
フランス	34,670	41,289	5,291,272	9.2	—	5.7	2.6	0.9
オランダ	9,280	10,842	1,389,435	2.4	—	1.4	0.7	0.4
スペイン	19,720	23,230	2,976,976	5.2	—	3.0	1.6	0.7
ベルギー	8,740	10,878	1,394,060	2.4	—	1.7	0.5	0.2
オーストリア	5,590	6,736	863,280	1.5	—	0.9	0.3	0.2
フィンランド	2,300	2,616	335,283	0.6	—	0.4	0.1	0.1
アイルランド	2,790	3,340	428,116	0.7	—	0.3	0.4	0.0
イギリス	千イギリスポンド 21,680	千イギリスポンド 26,242	4,406,615	7.7	—	5.5	1.7	0.5
スイス	千スイスフラン 1,010	千スイスフラン 1,236	144,006	0.3	—	0.1	0.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 16,280	千スウェーデンクローネ 18,853	259,995	0.5	—	0.3	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 10,300	千ノルウェークローネ 11,248	151,633	0.3	—	0.2	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 15,430	千デンマーククローネ 19,654	337,463	0.6	—	0.4	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 9,450	千ポーランドズロチ 10,032	286,937	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 10,430	千オーストラリアドル 11,386	933,880	1.6	—	1.0	0.4	0.3
シンガポール	千シンガポールドル 3,490	千シンガポールドル 3,603	297,267	0.5	—	0.3	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 33,300	千南アフリカランド 28,987	206,969	0.4	—	0.3	0.0	0.0
合 計	—	—	54,811,296	95.6	—	50.0	30.3	15.3

(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	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	0.5 T-NOTE 170131	0.5	3,200	3,194	377,398	2017/1/31
	0.5 T-NOTE 170731	0.5	700	696	82,297	2017/7/31
	0.625 T-NOTE 161231	0.625	1,100	1,099	129,928	2016/12/31
	0.625 T-NOTE 170215	0.625	1,200	1,199	141,673	2017/2/15
	0.625 T-NOTE 170531	0.625	1,600	1,596	188,603	2017/5/31
	0.625 T-NOTE 170831	0.625	1,400	1,395	164,820	2017/8/31
	0.625 T-NOTE 170930	0.625	1,600	1,593	188,293	2017/9/30
	0.625 T-NOTE 171130	0.625	900	895	105,844	2017/11/30
	0.625 T-NOTE 180430	0.625	1,400	1,389	164,129	2018/4/30
	0.75 T-NOTE 170115	0.75	2,200	2,201	260,141	2017/1/15
	0.75 T-NOTE 170315	0.75	900	900	106,371	2017/3/15
	0.75 T-NOTE 170630	0.75	1,000	999	118,056	2017/6/30
	0.75 T-NOTE 171031	0.75	2,700	2,694	318,317	2017/10/31
	0.75 T-NOTE 171231	0.75	2,800	2,793	329,965	2017/12/31
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	1,100	1,096	129,486	2018/2/28
	0.75 T-NOTE 180331	0.75	2,000	1,992	235,366	2018/3/31
	0.875 T-NOTE 161231	0.875	800	801	94,715	2016/12/31
	0.875 T-NOTE 170131	0.875	700	701	82,869	2017/1/31
	0.875 T-NOTE 170228	0.875	3,400	3,406	402,444	2017/2/28
	0.875 T-NOTE 170415	0.875	1,100	1,101	130,162	2017/4/15
	0.875 T-NOTE 170430	0.875	1,600	1,602	189,304	2017/4/30
	0.875 T-NOTE 170515	0.875	1,000	1,001	118,301	2017/5/15
	0.875 T-NOTE 170615	0.875	700	700	82,791	2017/6/15
	0.875 T-NOTE 170715	0.875	400	400	47,294	2017/7/15
	0.875 T-NOTE 170815	0.875	900	900	106,388	2017/8/15
	0.875 T-NOTE 180715	0.875	900	897	105,981	2018/7/15
	0.875 T-NOTE 181015	0.875	500	497	58,795	2018/10/15
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	500	493	58,350	2019/7/31
	1 T-NOTE 170331	1.0	800	802	94,811	2017/3/31
	1 T-NOTE 180531	1.0	1,200	1,200	141,812	2018/5/31
	1 T-NOTE 180815	1.0	700	699	82,656	2018/8/15
	1 T-NOTE 180915	1.0	1,900	1,897	224,229	2018/9/15
	1 T-NOTE 190630	1.0	400	397	46,938	2019/6/30
	1 T-NOTE 190831	1.0	700	694	82,000	2019/8/31
	1 T-NOTE 190930	1.0	500	495	58,523	2019/9/30
	1 T-NOTE 191130	1.0	300	296	35,040	2019/11/30
	1.125 T-NOTE 180615	1.125	2,200	2,207	260,831	2018/6/15
	1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,300	1,297	153,234	2019/5/31
	1.25 T-NOTE 181031	1.25	300	301	35,616	2018/10/31
	1.25 T-NOTE 181115	1.25	3,800	3,818	451,124	2018/11/15
	1.25 T-NOTE 181130	1.25	400	401	47,479	2018/11/30
	1.25 T-NOTE 181215	1.25	1,300	1,306	154,307	2018/12/15
	1.25 T-NOTE 190430	1.25	2,300	2,305	272,348	2019/4/30
	1.25 T-NOTE 191031	1.25	300	299	35,425	2019/10/31
	1.25 T-NOTE 200131	1.25	900	897	106,010	2020/1/31
	1.375 T-NOTE 180630	1.375	600	605	71,562	2018/6/30

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	1.375 T-NOTE 180731	1.375	800	807	95,390	2018/7/31
	1.375 T-NOTE 180930	1.375	600	605	71,498	2018/9/30
	1.375 T-NOTE 181130	1.375	500	504	59,563	2018/11/30
	1.375 T-NOTE 181231	1.375	300	302	35,717	2018/12/31
	1.375 T-NOTE 190228	1.375	500	503	59,496	2019/2/28
	1.375 T-NOTE 200131	1.375	400	400	47,337	2020/1/31
	1.375 T-NOTE 200229	1.375	1,600	1,602	189,289	2020/2/29
	1.375 T-NOTE 200331	1.375	900	900	106,417	2020/3/31
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	1,500	1,500	177,251	2020/4/30
	1.375 T-NOTE 200930	1.375	1,000	997	117,863	2020/9/30
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	1,300	1,296	153,114	2020/10/31
	1.5 T-NOTE 180831	1.5	1,200	1,214	143,529	2018/8/31
	1.5 T-NOTE 181231	1.5	700	707	83,634	2018/12/31
	1.5 T-NOTE 190131	1.5	800	808	95,567	2019/1/31
	1.5 T-NOTE 190228	1.5	600	606	71,653	2019/2/28
	1.5 T-NOTE 190331	1.5	400	404	47,758	2019/3/31
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	800	808	95,468	2019/5/31
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	1,100	1,109	131,020	2019/10/31
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	900	906	107,148	2019/11/30
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	1,400	1,407	166,274	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	800	792	93,581	2022/1/31
	1.625 T-NOTE 190331	1.625	300	304	35,948	2019/3/31
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	2,000	2,028	239,658	2019/4/30
	1.625 T-NOTE 190630	1.625	2,700	2,738	323,488	2019/6/30
	1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,600	1,621	191,608	2019/7/31
	1.625 T-NOTE 190831	1.625	1,100	1,114	131,725	2019/8/31
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,600	1,619	191,298	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 200630	1.625	1,500	1,514	178,940	2020/6/30
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	1,400	1,413	166,985	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,300	1,311	154,913	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	3,100	3,072	362,929	2022/11/15
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	300	305	36,096	2018/10/31
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	800	814	96,188	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	400	405	47,857	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	800	803	94,873	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	400	401	47,403	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	1,600	1,603	189,437	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,200	1,202	142,089	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,300	1,293	152,826	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 170831	1.875	500	508	60,027	2017/8/31
	1.875 T-NOTE 170930	1.875	600	610	72,071	2017/9/30
	1.875 T-NOTE 171031	1.875	600	610	72,116	2017/10/31
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	1,000	1,020	120,567	2020/6/30
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	500	506	59,856	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,700	1,712	202,328	2022/8/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	1,500	1,537	181,681	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	500	512	60,495	2020/11/30

銘柄	当	期	末		償還年月日		
			利率	額面金額		評価額	
						外貨建金額	邦貨換算金額
アメリカ	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
国債証券							
	2 T-NOTE 210228	2.0	1,400	1,433	169,388	2021/2/28	
	2 T-NOTE 210531	2.0	1,500	1,534	181,280	2021/5/31	
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,000	1,021	120,632	2021/8/31	
	2 T-NOTE 211031	2.0	1,100	1,122	132,553	2021/10/31	
	2 T-NOTE 211115	2.0	600	611	72,285	2021/11/15	
	2 T-NOTE 220215	2.0	600	612	72,345	2022/2/15	
	2 T-NOTE 220731	2.0	2,100	2,133	252,009	2022/7/31	
	2 T-NOTE 221130	2.0	200	202	23,965	2022/11/30	
	2 T-NOTE 230215	2.0	1,400	1,420	167,773	2023/2/15	
	2 T-NOTE 250215	2.0	2,000	2,000	236,353	2025/2/15	
	2 T-NOTE 250815	2.0	2,000	1,996	235,818	2025/8/15	
	2.125 T-NOTE 200831	2.125	1,000	1,030	121,730	2020/8/31	
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	700	721	85,204	2021/1/31	
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,500	1,543	182,304	2021/6/30	
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	1,200	1,234	145,832	2021/8/15	
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	700	719	84,972	2021/9/30	
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	700	718	84,894	2021/12/31	
	2.125 T-NOTE 220630	2.125	900	921	108,867	2022/6/30	
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	2,400	2,423	286,304	2025/5/15	
	2.25 T-NOTE 171130	2.25	600	614	72,636	2017/11/30	
	2.25 T-NOTE 180731	2.25	300	309	36,557	2018/7/31	
	2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,800	1,864	220,294	2021/3/31	
	2.25 T-NOTE 210430	2.25	700	724	85,650	2021/4/30	
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	700	724	85,598	2021/7/31	
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	1,800	1,839	217,353	2024/11/15	
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	1,100	1,122	132,593	2025/11/15	
	2.375 T-NOTE 170731	2.375	800	818	96,682	2017/7/31	
	2.375 T-NOTE 180531	2.375	1,300	1,342	158,567	2018/5/31	
	2.375 T-NOTE 180630	2.375	900	930	109,906	2018/6/30	
	2.375 T-NOTE 201231	2.375	700	729	86,206	2020/12/31	
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	2,400	2,479	292,905	2024/8/15	
	2.5 T-BOND 450215	2.5	800	750	88,641	2045/2/15	
	2.5 T-NOTE 170630	2.5	700	716	84,658	2017/6/30	
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	1,100	1,152	136,106	2023/8/15	
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	2,100	2,191	258,928	2024/5/15	
	2.625 T-NOTE 180131	2.625	200	206	24,441	2018/1/31	
	2.625 T-NOTE 200815	2.625	1,400	1,473	174,105	2020/8/15	
	2.625 T-NOTE 201115	2.625	2,300	2,421	286,019	2020/11/15	
	2.75 T-BOND 420815	2.75	1,000	996	117,733	2042/8/15	
	2.75 T-BOND 421115	2.75	1,400	1,391	164,426	2042/11/15	
	2.75 T-NOTE 170531	2.75	600	615	72,725	2017/5/31	
	2.75 T-NOTE 180228	2.75	200	207	24,515	2018/2/28	
	2.75 T-NOTE 190215	2.75	500	524	61,954	2019/2/15	
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	1,600	1,703	201,266	2023/11/15	
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	2,300	2,446	288,980	2024/2/15	
	2.875 T-BOND 430515	2.875	900	915	108,195	2043/5/15	
	2.875 T-BOND 450815	2.875	1,500	1,519	179,522	2045/8/15	

銘柄	銘柄	利率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	3 T-BOND 420515	3.0	1,200	1,257	148,513	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	700	727	85,992	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	600	623	73,636	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	850	884	104,443	2045/11/15
	3 T-NOTE 170228	3.0	550	563	66,606	2017/2/28
	3.125 T-BOND 411115	3.125	1,500	1,611	190,403	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	1,500	1,611	190,431	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	600	641	75,746	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	700	746	88,189	2044/8/15
	3.125 T-NOTE 170131	3.125	880	901	106,533	2017/1/31
	3.125 T-NOTE 170430	3.125	3,000	3,088	364,872	2017/4/30
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	690	733	86,662	2019/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	500	539	63,781	2021/5/15
	3.25 T-NOTE 170331	3.25	1,050	1,081	127,715	2017/3/31
	3.375 T-BOND 440515	3.375	1,300	1,454	171,879	2044/5/15
	3.375 T-NOTE 191115	3.375	1,060	1,142	134,982	2019/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	400	460	54,344	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 180215	3.5	470	494	58,406	2018/2/15
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	1,100	1,196	141,350	2020/5/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	900	1,056	124,775	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	700	820	96,937	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	720	779	92,141	2019/8/15
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	1,130	1,232	145,596	2020/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	900	991	117,162	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,100	1,312	155,061	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	1,600	1,920	226,828	2043/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	800	970	114,669	2040/8/15
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	230	245	28,979	2018/5/15
	4 T-NOTE 180815	4.0	670	721	85,238	2018/8/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	800	1,026	121,263	2040/11/15
	4.25 T-NOTE 171115	4.25	480	508	60,109	2017/11/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	500	652	77,067	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	650	848	100,200	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	600	785	92,777	2041/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	500	663	78,401	2039/8/15
	4.5 T-NOTE 170515	4.5	730	765	90,402	2017/5/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	500	675	79,774	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	800	1,102	130,201	2041/2/15
	4.75 T-NOTE 170815	4.75	290	307	36,340	2017/8/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	320	428	50,628	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	100	134	15,866	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	450	627	74,137	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815	5.5	500	681	80,524	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	120	163	19,284	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	440	623	73,602	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	260	341	40,344	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	100	148	17,584	2030/5/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
	国債証券	6.5 T-BOND 261115	6.5	140	199	23,610	2026/11/15
		8.125 T-BOND 190815	8.125	160	198	23,446	2019/8/15
小 計						24,073,185	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル			
	国債証券	0.25 CAN GOVT 170501	0.25	400	399	33,006	2017/5/1
		0.25 CAN GOVT 171101	0.25	300	299	24,733	2017/11/1
		0.75 CAN GOVT 200901	0.75	350	352	29,138	2020/9/1
		1.25 CAN GOVT 170801	1.25	500	506	41,861	2017/8/1
		1.25 CAN GOVT 180201	1.25	200	203	16,813	2018/2/1
		1.25 CAN GOVT 180301	1.25	500	508	42,059	2018/3/1
		1.25 CAN GOVT 180901	1.25	350	357	29,552	2018/9/1
		1.5 CAN GOVT 170201	1.5	600	606	50,155	2017/2/1
		1.5 CAN GOVT 170301	1.5	400	404	33,465	2017/3/1
		1.5 CAN GOVT 170901	1.5	200	203	16,821	2017/9/1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	560	577	47,787	2023/6/1
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	100	100	8,352	2026/6/1
		1.75 CAN GOVT 190901	1.75	700	730	60,439	2019/9/1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	500	543	44,920	2025/6/1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	250	276	22,880	2024/6/1
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	430	478	39,585	2022/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	300	346	28,640	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	100	121	10,058	2064/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	400	452	37,404	2021/6/1
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	450	506	41,895	2020/6/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	480	632	52,279	2045/12/1
		3.75 CAN GOVT 190601	3.75	560	620	51,316	2019/6/1
		4 CAN GOVT 170601	4.0	400	419	34,663	2017/6/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	470	647	53,585	2041/6/1
		4.25 CAN GOVT 180601	4.25	400	435	36,019	2018/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	450	680	56,262	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	340	504	41,741	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	410	642	53,138	2033/6/1
		8 CAN GOVT 270601	8.0	140	235	19,447	2027/6/1
小 計						1,058,028	
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	7,500	9,537	60,564	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	1,700	2,271	14,423	2036/11/20
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	5,800	5,840	37,089	2018/6/14
		5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	3,200	3,251	20,645	2017/6/15
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	4,600	4,579	29,079	2019/12/11
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	800	770	4,889	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	4,900	5,122	32,527	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	3,000	3,120	19,813	2022/6/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	2,700	2,940	18,671	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	5,200	5,564	35,336	2017/12/14
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	4,200	4,600	29,212	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	2,700	2,942	18,683	2034/11/23

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利率	当期末			償還年月日	
			額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
	国債証券	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	4,000	4,351	27,630	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	3,500	3,878	24,630	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	3,000	3,378	21,454	2023/12/7
		8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	7,900	8,706	55,285	2018/12/13
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	3,100	3,621	22,997	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	3,800	4,458	28,311	2038/11/18
小	計					501,248	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 OBL 200417	—	400	405	51,905	2020/4/17
		0 SCHATS 170310	—	400	401	51,508	2017/3/10
		0 SCHATS 170616	—	300	301	38,681	2017/6/16
		0 SCHATS 170915	—	300	302	38,727	2017/9/15
		0 SCHATS 171215	—	300	302	38,771	2017/12/15
		0.25 OBL 180413	0.25	500	507	65,061	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	700	715	91,750	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	700	716	91,763	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	700	710	91,059	2025/2/15
		0.5 OBL 170407	0.5	600	606	77,747	2017/4/7
		0.5 OBL 171013	0.5	1,000	1,016	130,232	2017/10/13
		0.5 OBL 180223	0.5	600	611	78,404	2018/2/23
		0.5 OBL 190412	0.5	500	514	65,939	2019/4/12
		0.75 OBL 170224	0.75	500	506	64,891	2017/2/24
		1 BUND 240815	1.0	500	532	68,185	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	700	739	94,750	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	400	415	53,251	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	400	417	53,476	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	700	770	98,801	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	400	441	56,562	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	500	552	70,802	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	600	664	85,178	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	500	558	71,514	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	900	1,014	129,965	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	600	675	86,508	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	500	571	73,269	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	500	558	71,542	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	500	567	72,731	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	400	453	58,162	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	350	460	58,976	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	400	528	67,691	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	600	687	88,115	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	700	799	102,434	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	950	1,126	144,410	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	600	882	113,120	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	1,030	1,167	149,675	2019/7/4
		3.75 BUND 170104	3.75	520	540	69,270	2017/1/4
		3.75 BUND 190104	3.75	490	550	70,507	2019/1/4
		4 BUND 180104	4.0	560	608	77,989	2018/1/4

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄		利 率	当 額面金額	期 末		償還年月日
					評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	4 BUND 370104	4.0	480	739	94,805	2037/1/4
		4.25 BUND 170704	4.25	430	459	58,835	2017/7/4
		4.25 BUND 180704	4.25	620	691	88,554	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	400	655	84,025	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	450	670	85,970	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	600	978	125,457	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	710	1,254	160,777	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	500	827	106,044	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	450	710	91,039	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	340	504	64,655	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	250	433	55,504	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	330	548	70,228	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	500	502	64,414	2018/5/15
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	300	301	38,671	2020/11/1
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	300	303	38,925	2020/5/1
		0.75 ITALY GOVT 180115	0.75	800	811	104,042	2018/1/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	500	514	65,913	2019/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	700	719	92,162	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	500	514	65,962	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,000	1,044	133,820	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	600	602	77,205	2025/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	500	475	60,996	2032/3/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	400	416	53,343	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	450	484	62,058	2021/12/15
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	500	537	68,919	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	500	545	69,844	2024/12/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	400	447	57,349	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 171101	3.5	750	796	102,081	2017/11/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	600	648	83,133	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	600	658	84,375	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	500	594	76,214	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	700	810	103,802	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	550	638	81,766	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	1,130	1,314	168,485	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	750	892	114,436	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 170201	4.0	850	885	113,415	2017/2/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	600	696	89,238	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	860	1,083	138,868	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	700	787	100,873	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	900	1,028	131,839	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,130	1,309	167,769	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	800	872	111,798	2018/2/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	710	789	101,176	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	500	567	72,712	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	300	349	44,842	2020/2/1
4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	500	617	79,167	2023/5/1		
4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	750	933	119,655	2024/3/1		

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	500	636	81,586	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 170501	4.75	1,000	1,060	135,883	2017/5/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	800	975	124,982	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	730	918	117,755	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	900	1,191	152,738	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	500	710	90,996	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	600	747	95,728	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	780	1,015	130,198	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	500	706	90,550	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	700	1,009	129,341	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	470	674	86,478	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 170801	5.25	520	561	71,975	2017/8/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	800	1,118	143,276	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	450	579	74,298	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	500	645	82,727	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	640	965	123,749	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	850	1,287	164,959	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	800	1,197	153,508	2027/11/1
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	300	465	59,622	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	380	598	76,756	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O. A. T 180225	—	900	906	116,176	2018/2/25
		0.25 O. A. T 201125	0.25	600	608	77,989	2020/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	1,200	1,231	157,778	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	200	196	25,181	2025/5/25
		1 BTAN 170725	1.0	1,100	1,122	143,890	2017/7/25
		1 O. A. T 180525	1.0	600	618	79,296	2018/5/25
		1 O. A. T 181125	1.0	750	777	99,649	2018/11/25
		1 O. A. T 190525	1.0	700	728	93,405	2019/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	800	816	104,637	2025/11/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	300	305	39,140	2031/5/25
		1.75 BTAN 170225	1.75	600	613	78,673	2017/2/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	1,000	1,101	141,093	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	1,700	1,868	239,389	2024/11/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	1,000	1,133	145,264	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	1,400	1,598	204,823	2024/5/25
		2.5 O. A. T 201025	2.5	900	1,009	129,371	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	1,050	1,217	156,019	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	700	833	106,798	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	800	941	120,619	2022/4/25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	1,500	1,772	227,190	2021/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	500	659	84,527	2045/5/25
		3.5 O. A. T 200425	3.5	1,120	1,293	165,717	2020/4/25
		3.5 O. A. T 260425	3.5	1,400	1,769	226,747	2026/4/25
		3.75 O. A. T 170425	3.75	910	957	122,651	2017/4/25
		3.75 O. A. T 191025	3.75	1,510	1,733	222,164	2019/10/25
		3.75 O. A. T 210425	3.75	1,100	1,316	168,678	2021/4/25
		4 O. A. T 180425	4.0	800	878	112,561	2018/4/25

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	4 O. A. T 381025	4.0	750	1,081	138,647	2038/10/25
		4 O. A. T 550425	4.0	450	701	89,834	2055/4/25
		4 O. A. T 600425	4.0	380	599	76,768	2060/4/25
		4.25 O. A. T 171025	4.25	1,160	1,253	160,694	2017/10/25
		4.25 O. A. T 181025	4.25	680	765	98,095	2018/10/25
		4.25 O. A. T 190425	4.25	770	883	113,185	2019/4/25
		4.25 O. A. T 231025	4.25	1,050	1,359	174,238	2023/10/25
		4.5 O. A. T 410425	4.5	820	1,286	164,843	2041/4/25
		4.75 O. A. T 350425	4.75	840	1,291	165,500	2035/4/25
		5.5 O. A. T 290425	5.5	850	1,304	167,111	2029/4/25
		5.75 O. A. T 321025	5.75	770	1,271	162,982	2032/10/25
		6 O. A. T 251025	6.0	510	766	98,194	2025/10/25
		8.5 O. A. T 191025	8.5	300	398	51,010	2019/10/25
		8.5 O. A. T 230425	8.5	200	317	40,724	2023/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	200	201	25,841	2018/4/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	700	713	91,454	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	500	484	62,133	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 170415	0.5	500	505	64,799	2017/4/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	400	413	52,941	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	400	418	53,687	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	400	444	56,913	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	400	453	58,082	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	500	569	72,962	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 170115	2.5	300	308	39,536	2017/1/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	400	485	62,186	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	300	404	51,806	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	500	590	75,624	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	360	419	53,755	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	400	499	64,008	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	490	758	97,138	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	630	698	89,469	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	450	517	66,294	2019/7/15
4 NETH GOVT 370115	4.0	400	606	77,689	2037/1/15		
4.5 NETH GOVT 170715	4.5	560	600	76,974	2017/7/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	390	599	76,791	2028/1/15		
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	100	150	19,343	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	500	501	64,292	2018/4/30
		0.5 SPAIN GOVT 171031	0.5	700	705	90,471	2017/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	600	622	79,754	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	500	499	63,956	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	300	289	37,053	2030/7/30
		2.1 SPAIN GOVT 170430	2.1	400	410	52,626	2017/4/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	600	623	79,904	2025/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	600	648	83,056	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	600	656	84,113	2024/10/31
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	550	604	77,495	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 170131	3.8	720	748	95,861	2017/1/31

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日	
			利 率	額面金額	評 価 額			
					外貨建金額	邦貨換算金額		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ユーロ								
スペイン	国債証券	3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	900	1,058	135,605	2024/4/30	
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	780	893	114,495	2020/4/30	
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	380	417	53,544	2018/7/30	
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	470	583	74,830	2037/1/31	
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	960	1,099	140,923	2019/10/31	
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	550	671	86,115	2023/10/31	
		4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	600	653	83,737	2018/1/31	
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	600	689	88,373	2019/7/30	
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	840	1,059	135,720	2025/7/30	
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	420	560	71,869	2041/7/30	
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	390	488	62,658	2024/1/31	
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	800	956	122,629	2020/10/31	
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	500	684	87,683	2040/7/30	
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	550	736	94,435	2028/10/31	
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	350	501	64,298	2044/10/31	
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	600	767	98,380	2023/1/31	
		5.5 SPAIN GOVT 170730	5.5	970	1,050	134,610	2017/7/30	
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	700	870	111,525	2021/4/30	
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	560	819	104,972	2032/7/30	
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	700	899	115,288	2022/1/31			
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	500	693	88,865	2026/7/30			
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	530	763	97,824	2029/1/31			
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	500	502	64,344	2025/6/22	
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	300	311	39,936	2018/6/22	
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	350	397	50,977	2023/6/22	
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	550	641	82,256	2024/6/22	
		3 BEL GOVT 190928	3.0	200	223	28,670	2019/9/28	
		3 BEL GOVT 340622	3.0	200	246	31,610	2034/6/22	
		3.5 BEL GOVT 170628	3.5	350	369	47,337	2017/6/28	
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	600	708	90,760	2020/9/28	
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	330	473	60,664	2045/6/22	
		4 BEL GOVT 170328	4.0	360	378	48,519	2017/3/28	
		4 BEL GOVT 180328	4.0	400	438	56,145	2018/3/28	
		4 BEL GOVT 190328	4.0	500	568	72,824	2019/3/28	
		4 BEL GOVT 220328	4.0	480	593	76,090	2022/3/28	
		4 BEL GOVT 320328	4.0	350	480	61,537	2032/3/28	
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	450	556	71,360	2021/9/28	
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	500	632	81,106	2022/9/28	
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	510	773	99,132	2041/3/28	
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	400	544	69,716	2026/3/28	
		5 BEL GOVT 350328	5.0	600	943	120,951	2035/3/28	
5.5 BEL GOVT 170928	5.5	310	340	43,655	2017/9/28			
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	500	752	96,461	2028/3/28			
オーストリア	国債証券	0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	300	305	39,154	2019/10/18	
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	150	156	20,010	2018/10/19	
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	150	156	20,115	2025/10/20	
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	400	438	56,165	2024/10/21	

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄		当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	200	221	28,359	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	300	322	41,339	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	230	268	34,439	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	200	273	35,019	2044/6/20
		3.2 AUSTRIA GOVT 170220	3.2	240	249	31,940	2017/2/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	300	364	46,739	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	370	443	56,787	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	400	488	62,557	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	80	134	17,181	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	270	319	40,901	2020/7/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	350	523	67,132	2037/3/15
		4.3 AUSTRIA GOVT 170915	4.3	320	344	44,173	2017/9/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	400	458	58,743	2019/3/15
		4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	330	362	46,509	2018/1/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	250	350	44,870	2026/3/15
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	350	555	71,138	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	100	102	13,107	2020/9/15
		0.75 FINNISH GOV 310415	0.75	100	93	11,963	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	50	50	6,497	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	150	155	19,976	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	150	162	20,883	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	100	109	14,038	2022/9/15
		1.875 FINNISH GOV 170415	1.875	200	205	26,350	2017/4/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	150	168	21,581	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	100	127	16,311	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	200	240	30,877	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	200	230	29,479	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	250	296	37,969	2021/4/15
		3.875 FINNISH GOVT170915	3.875	100	107	13,717	2017/9/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	300	391	50,220	2025/7/4
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	150	174	22,308	2019/7/4		
アイルランド	国債証券	2 IRISH GOVT 450218	2.0	150	149	19,140	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	240	268	34,429	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	300	362	46,422	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	250	309	39,656	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	320	369	47,298	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	250	282	36,173	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	240	285	36,602	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	350	431	55,321	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	340	472	60,592	2025/3/13
		5.5 IRISH GOVT 171018	5.5	150	165	21,157	2017/10/18
		5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	200	244	31,322	2019/10/18
小計						22,154,065	
イギリス	国債証券	1 GILT 170907	1.0	900	908	152,548	2017/9/7
		1.25 GILT 180722	1.25	800	812	136,492	2018/7/22
		1.75 GILT 170122	1.75	400	405	68,104	2017/1/22

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末			償還年月日	
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額		邦貨換算金額
イギリス			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券	1.75 GILT 190722	1.75	600	618	103,880	2019/7/22
		1.75 GILT 220907	1.75	500	512	86,067	2022/9/7
		2 GILT 200722	2.0	800	833	139,971	2020/7/22
		2 GILT 250907	2.0	700	719	120,799	2025/9/7
		2.25 GILT 230907	2.25	650	685	115,178	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	150	158	26,689	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	800	874	146,862	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	550	637	107,017	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	380	461	77,525	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	540	736	123,701	2068/7/22
		3.75 GILT 190907	3.75	420	464	77,935	2019/9/7
		3.75 GILT 200907	3.75	700	787	132,195	2020/9/7
		3.75 GILT 210907	3.75	860	980	164,628	2021/9/7
		3.75 GILT 520722	3.75	400	536	90,115	2052/7/22
		4 GILT 220307	4.0	700	815	136,885	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	310	456	76,588	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	410	515	86,551	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	940	1,210	203,201	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	300	391	65,765	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	640	849	142,643	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	760	1,017	170,907	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	420	587	98,631	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	500	717	120,528	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	700	1,056	177,426	2055/12/7
		4.5 GILT 190307	4.5	700	782	131,443	2019/3/7
		4.5 GILT 340907	4.5	480	641	107,784	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	1,010	1,420	238,507	2042/12/7
		4.75 GILT 200307	4.75	700	808	135,839	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75	560	753	126,543	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	470	664	111,619	2038/12/7
		5 GILT 180307	5.0	650	712	119,686	2018/3/7
		5 GILT 250307	5.0	400	516	86,720	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	330	486	81,735	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	350	475	79,794	2021/6/7
		8.75 GILT 170825	8.75	200	226	38,094	2017/8/25
小	計					4,406,615	
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	120	137	16,013	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	120	136	15,914	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 180108	3.0	120	129	15,067	2018/1/8
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	150	169	19,765	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	200	264	30,819	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	180	270	31,467	2028/4/8
		4.25 SWISS GOVT 170605	4.25	120	128	14,959	2017/6/5
小	計					144,006	
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	900	904	12,467	2026/11/12

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
スウェーデン		%	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ	千円	
国債証券	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	2,400	2,583	35,619	2023/11/13
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	1,950	2,265	31,234	2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 220601	3.5	2,650	3,183	43,904	2022/6/1
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	1,400	1,853	25,553	2039/3/30
	3.75 SWD GOVT 170812	3.75	2,060	2,196	30,291	2017/8/12
	4.25 SWD GOVT 190312	4.25	2,450	2,802	38,641	2019/3/12
	5 SWD GOVT 201201	5.0	2,470	3,066	42,283	2020/12/1
小 計					259,995	
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	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	1,000	1,025	13,821	2025/3/13
	2 NORWE GOVT 230524	2.0	1,750	1,840	24,803	2023/5/24
	3 NORWE GOVT 240314	3.0	1,300	1,464	19,746	2024/3/14
	3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	2,350	2,686	36,207	2021/5/25
	4.25 NORWE GOVT 170519	4.25	1,970	2,061	27,795	2017/5/19
	4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	1,930	2,170	29,258	2019/5/22
小 計					151,633	
デンマーク			千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
国債証券	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	1,800	1,944	33,395	2023/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	2,200	2,407	41,336	2025/11/15
	3 DMK GOVT 211115	3.0	2,600	3,026	51,965	2021/11/15
	4 DMK GOVT 171115	4.0	1,500	1,616	27,751	2017/11/15
	4 DMK GOVT 191115	4.0	2,710	3,133	53,798	2019/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	3,830	6,291	108,025	2039/11/15
	7 DMK GOVT 241110	7.0	790	1,234	21,191	2024/11/10
小 計					337,463	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	850	823	23,546	2020/4/25
	2 POLAND 210425	2.0	700	681	19,491	2021/4/25
	2.5 POLAND 180725	2.5	700	714	20,425	2018/7/25
	3.25 POLAND 190725	3.25	600	625	17,892	2019/7/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	950	958	27,410	2025/7/25
	3.75 POLAND 180425	3.75	600	628	17,970	2018/4/25
	4 POLAND 231025	4.0	800	855	24,477	2023/10/25
	4.75 POLAND 170425	4.75	400	416	11,903	2017/4/25
	5.25 POLAND 171025	5.25	890	946	27,072	2017/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	500	564	16,144	2020/10/25
	5.5 POLAND 191025	5.5	560	629	18,007	2019/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	450	525	15,018	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	600	707	20,247	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	500	613	17,532	2029/4/25
	POLAND 170725	—	350	342	9,794	2017/7/25
小 計					286,937	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	1.75	350	343	28,184	2020/11/21
	2.75 AUST GOVT 191021	2.75	400	410	33,684	2019/10/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	600	605	49,692	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	200	184	15,138	2035/6/21

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日	
		利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
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 181021	3.25	350	362	29,700	2018/10/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	900	941	77,210	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	300	308	25,327	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	200	196	16,084	2039/6/21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	220	234	19,261	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 170721	4.25	650	671	55,108	2017/7/21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	650	737	60,448	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 200415	4.5	650	714	58,584	2020/4/15
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	290	341	28,028	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	700	829	68,066	2027/4/21
		5.25 AUST GOVT 190315	5.25	780	857	70,348	2019/3/15
		5.5 AUST GOVT 180121	5.5	800	854	70,100	2018/1/21
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	700	838	68,793	2023/4/21
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	660	775	63,631	2021/5/15
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	650	780	64,007	2022/7/15
		6 AUST GOVT 170215	6.0	380	395	32,476	2017/2/15
小	計					933,880	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル			
	国債証券	0.5 SINGAPORGOVT 180401	0.5	200	196	16,245	2018/4/1
		1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	100	100	8,260	2019/10/1
		2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	400	402	33,199	2020/7/1
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	200	201	16,648	2021/6/1
		2.375 SINGAPORGOV 170401	2.375	400	406	33,556	2017/4/1
		2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	50	49	4,118	2025/6/1
		2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	100	103	8,518	2019/6/1
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	200	206	17,030	2023/7/1
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	270	265	21,931	2042/4/1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	100	102	8,456	2029/7/1
		2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	200	203	16,793	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	200	210	17,339	2024/9/1
		3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	150	158	13,108	2022/9/1
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	110	116	9,623	2020/9/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	300	326	26,902	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	270	295	24,359	2027/3/1
		4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	240	256	21,173	2018/9/1
小	計					297,267	
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	5,100	5,396	38,527	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	2,700	1,808	12,912	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	2,800	1,863	13,304	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	1,400	1,255	8,965	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	2,500	1,920	13,715	2031/2/28
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	1,900	1,783	12,733	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	2,400	2,188	15,627	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	1,500	1,467	10,475	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	2,600	2,215	15,816	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	1,300	1,296	9,259	2017/9/15

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	
南アフリカ		%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円	
	国債証券	8.25 SOUTH AFRICA 320331	2,700	2,306	16,465	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	2,500	2,129	15,201	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	700	600	4,287	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	2,800	2,399	17,132	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	400	356	2,544	2035/2/28
小	計				206,969	
合	計				54,811,296	

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

○投資信託財産の構成

(2016年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	54,811,296	95.4
コール・ローン等、その他	2,670,705	4.6
投資信託財産総額	57,482,001	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(55,640,906千円)の投資信託財産総額(57,482,001千円)に対する比率は96.8%です。

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

1 アメリカドル=118.14円	1 カナダドル=82.70円	1 メキシコペソ=6.35円	1 ユーロ=128.15円
1 イギリスポンド=167.92円	1 スイスフラン=116.51円	1 スウェーデンクローネ=13.79円	1 ノルウェークローネ=13.48円
1 デンマーククローネ=17.17円	1 ポーランドズロチ=28.60円	1 オーストラリアドル=82.02円	1 シンガポールドル=82.49円
1 南アフリカランド=7.14円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	112,479,821,880
コール・ローン等	418,058,424
公社債(評価額)	54,811,296,824
未収入金	56,751,650,466
未収利息	429,104,276
前払費用	69,711,890
(B) 負債	55,125,001,759
未払金	54,998,177,800
未払解約金	126,823,959
(C) 純資産総額(A-B)	57,354,820,121
元本	45,472,741,060
次期繰越損益金	11,882,079,061
(D) 受益権総口数	45,472,741,060口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,613円

<注記事項>

- ①期首元本額 26,203,208,067円
 期中追加設定元本額 26,366,591,851円
 期中一部解約元本額 7,097,058,858円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.2613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 バランス・イノベーション(株式抑制型)	5,069,577,478円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	6,280,361,977円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	327,327,497円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	50,864,041円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	805,655,070円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	213,069,613円
MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド(適格機関投資家転売制限付)	16,974,419,433円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	14,951,816,138円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	288,533,978円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	355,477,673円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	155,535,118円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	103,044円
合計	45,472,741,060円

[お知らせ]

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

○損益の状況 (2015年1月27日～2016年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,062,184,568
受取利息	1,062,184,568
(B) 有価証券売買損益	△ 640,874,450
売買益	7,913,002,727
売買損	△ 8,553,877,177
(C) 保管費用等	△ 7,222,062
(D) 当期損益金(A+B+C)	414,088,056
(E) 前期繰越損益金	6,918,703,275
(F) 追加信託差損益金	6,409,673,417
(G) 解約差損益金	△ 1,860,385,687
(H) 計(D+E+F+G)	11,882,079,061
次期繰越損益金(H)	11,882,079,061

- (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。

マネー・マーケット・マザーファンド

《第22期》決算日2015年11月20日

[計算期間：2015年5月21日～2015年11月20日]

「マネー・マーケット・マザーファンド」は、11月20日に第22期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第22期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主要運用対象	わが国の公社債等を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	純資産額
		期騰	落中率			
	円		%	%	%	百万円
18期(2013年11月20日)	10,178		0.0	87.7	—	2,850
19期(2014年5月20日)	10,180		0.0	84.7	—	2,716
20期(2014年11月20日)	10,183		0.0	84.3	—	2,373
21期(2015年5月20日)	10,183		0.0	89.3	—	1,959
22期(2015年11月20日)	10,185		0.0	91.2	—	27,834

(注) 当ファンドは主として短期債券、コール・ローンなどによる運用を行い、安定的な収益の確保をめざすファンドであり、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) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	債券率
		騰	落率			
(期首)	円		%	%	%	%
2015年5月20日	10,183		—	89.3	—	—
5月末	10,183		0.0	90.6	—	—
6月末	10,183		0.0	93.0	—	—
7月末	10,183		0.0	95.8	—	—
8月末	10,184		0.0	95.3	—	—
9月末	10,184		0.0	56.4	—	—
10月末	10,184		0.0	91.0	—	—
(期末)						
2015年11月20日	10,185		0.0	91.2	—	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

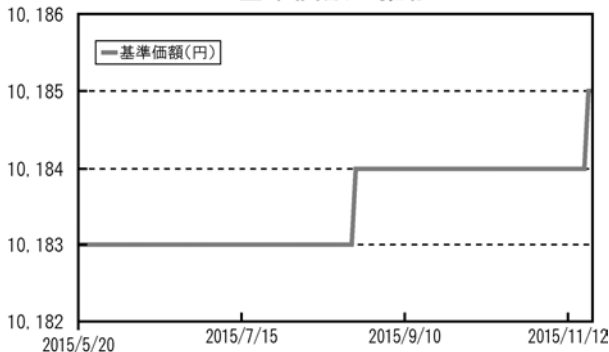
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.02%の上昇となりました。

基準価額の推移



●投資環境について

◎国内短期金融市場

・期中の短期金融市場を見ると、日銀は「量的・質的金融緩和」をめざし、マネタリーベースを操作目標として金融市場調節を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）は安定的に推移し、2015年11月20日のコール・レートは0.077%となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

・コール・ローン等短期金融商品を活用しつつ、残存期間の短い国債を中心に組み入れ、利子等収益の確保を図りました。その結果、利子等収益を獲得したことにより基準価額は上昇しました。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

・国内景気は緩やかな回復局面に向かうものと思われませんが、デフレ脱却に向けて日銀は「量的・質的金融緩和政策」を当面維持することが見込まれます。そうした環境下、短期金利は低位安定推移になると予想しています。

◎今後の運用方針

・運用の基本方針および前述の見通しに基づき、短期金融商品を活用しつつ、残存期間の短い国債を中心に投資し安定した収益の確保をめざしていく方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2015年5月21日～2015年11月20日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2015年5月21日～2015年11月20日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 131,267,396	千円 98,511,004 (9,120,000)

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月21日～2015年11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	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 36,256	百万円 17,599	% 48.5	百万円 3,500	百万円 2,100	% 60.0
現先取引(公社債)	95,010	11,003	11.6	95,010	11,003	11.6

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

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

○組入資産の明細

(2015年11月20日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	25,386,350 (24,840,000)	25,387,817 (24,841,225)	91.2 (89.2)	— (—)	— (—)	— (—)	91.2 (89.2)
合 計	25,386,350 (24,840,000)	25,387,817 (24,841,225)	91.2 (89.2)	— (—)	— (—)	— (—)	91.2 (89.2)

(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
	%	千円	千円	
国債証券	—	3,110,000	3,110,000	2015/11/30
第554回国庫短期証券	—	3,500,000	3,500,000	2015/12/7
第557回国庫短期証券	—	3,640,000	3,640,000	2015/12/14
第561回国庫短期証券	—	90,000	90,004	2016/1/12
第563回国庫短期証券	—	5,000,000	5,000,280	2016/1/18
第564回国庫短期証券	—	3,000,000	3,000,210	2016/1/25
第566回国庫短期証券	—	3,000,000	3,000,261	2016/2/1
第567回国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,090	2016/2/8
第568回国庫短期証券	—	2,500,000	2,500,380	2016/2/15
第336回利付国債(2年)	0.1	300,000	300,051	2016/1/15
第340回利付国債(2年)	0.1	62,600	62,636	2016/5/15
第342回利付国債(2年)	0.1	100,000	100,079	2016/7/15
第343回利付国債(2年)	0.1	83,750	83,825	2016/8/15
合 計		25,386,350	25,387,817	

○投資信託財産の構成

(2015年11月20日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	25,387,817	91.2
コール・ローン等、その他	2,446,214	8.8
投資信託財産総額	27,834,031	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年11月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	27,834,031,140
コール・ローン等	2,446,046,790
公社債(評価額)	25,387,817,093
未収利息	58,164
前払費用	109,093
(B) 負債	562
未払解約金	562
(C) 純資産総額(A-B)	27,834,030,578
元本	27,329,169,583
次期繰越損益金	504,860,995
(D) 受益権総口数	27,329,169,583口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,185円

＜注記事項＞

- ①期首元本額 1,924,361,734円
 期中追加設定元本額 26,414,042,501円
 期中一部解約元本額 1,009,234,652円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0185円です。

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

三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンド	297,790,994円
三菱UFJ 新興国通貨建て債券ファンド(毎月決算型)	5,226,135円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	14,525,380円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	1,628,029円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース>(毎月分配型)	101,543円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	47,179,877円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	94,134,350円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>(毎月分配型)	233,263円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(毎月分配型)	4,757,576円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	414,316,230円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<中国元コース>(毎月分配型)	128,906円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<インドネシアルピアコース>(毎月分配型)	1,033,322円
ブラデスコ ブラジル成長株オープン・マネーボール・ファンド	2,017,196円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	212,322円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(毎月分配型)	42,384,248円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド(毎月分配型)	3,558,532円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース>(毎月分配型)	23,960,741円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	457,302円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	358,088円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	2,100,667円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	3,836,590円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	383,682円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	8,771,978円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	13,745,897円

○損益の状況 (2015年5月21日～2015年11月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	985,144
受取利息	985,144
(B) 有価証券売買損益	1,172,965
売買益	1,359,890
売買損	△ 186,925
(C) 当期損益金(A+B)	2,158,109
(D) 前期繰越損益金	35,231,293
(E) 追加信託差損益金	485,984,607
(F) 解約差損益金	△ 18,513,014
(G) 計(C+D+E+F)	504,860,995
次期繰越損益金(G)	504,860,995

(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せん。

(注) (E)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) (F)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	新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	3,037,917円
三菱UFJ	新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	1,970,066円
三菱UFJ	新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	43,682,881円
三菱UFJ	新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース> (毎月分配型)	374,779円
三菱UFJ	新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<アジアバスケット通貨コース> (毎月分配型)	407,171円
三菱UFJ	新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド>	38,911,455円
三菱UFJ	欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)	2,221,253円
三菱UFJ	欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース> (毎月分配型)	1,784,459円
三菱UFJ	欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	2,576,702円
三菱UFJ	欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	3,148,614円
三菱UFJ	欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース> (毎月分配型)	67,305円
三菱UFJ	欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド>	3,492,263円
三菱UFJ	欧州ハイイールド債券ファンド ユーロ円プレミアム (毎月分配型)	78,483,503円
	欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり)	1,285,463円
	欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし)	1,147,224円
	新興国ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり)	1,068円
	新興国ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし)	20,706円
三菱UFJ	米国リートファンドA<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	491,836円
三菱UFJ	米国リートファンドB<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	98,368円
三菱UFJ	UBS グローバル好利回CBファンド2012-11 (円ヘッジ) (限定追加型)	0円
PIMCO	ニューワールドインカムファンド<メキシコペソ> (毎月分配型)	31,229,335円
PIMCO	ニューワールド円インカムファンド (年2回分配型)	168,137円
PIMCO	ニューワールド米ドルインカムファンド (年2回分配型)	276,237円
PIMCO	ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース> (年2回分配型)	20,660円
PIMCO	ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース> (年2回分配型)	89,380円
PIMCO	ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース> (年2回分配型)	1,554,984円
三菱UFJ	新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	2,668,957円
三菱UFJ	新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	688,506円
	ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	19,658円
	ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	19,658円
	ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	19,658円
三菱UFJ	米国高配当株式プラス<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	491,449円
三菱UFJ	米国高配当株式プラス<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9,828,976円
PIMCO	ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	19,255,183円
PIMCO	ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	554,804円
	バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	1,936,118円
	バリュー・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9,829円
	バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	9,829円
	バリュー・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	9,829円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)	15,049,666円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	20,551,717円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	3,730,759円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	5,059,469円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	3,653,886円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	252,058円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース> (毎月分配型)	3,908,079円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (年2回分配型)	3,737,703円

三菱UF J 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (年2回分配型)	6,435,081円
三菱UF J 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (年2回分配型)	686,803円
三菱UF J 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (年2回分配型)	627,788円
三菱UF J 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (年2回分配型)	608,110円
三菱UF J 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (年2回分配型)	46,726円
三菱UF J 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース> (年2回分配型)	581,687円
三菱UF J 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドA>	112,318,894円
三菱UF J 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドB>	980,017円
三菱UF J / ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (毎月決算型)	1,423,307円
三菱UF J / ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	3,270,787円
三菱UF J / ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (年1回決算型)	1,168,184円
三菱UF J / ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	2,065,331円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Cコース (為替ヘッジなし) (年1回決算型)	983円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Dコース (為替ヘッジあり) (年1回決算型)	983円
三菱UF J / UBS グローバル好利回CBファンド2013-11 (円ヘッジ) (限定追加型)	982,608円
三菱UF J / ビムコ トータル・リターン・ファンド2014	256,356円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり> (毎月分配型)	2,827,156円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし> (毎月分配型)	9,387,547円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	3,545,187円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	8,124,755円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり> (年1回決算型)	2,990,177円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	3,377,211円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム> (毎月分配型)	151,268円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム> (年2回分配型)	168,922円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム> (毎月分配型)	1,674,507円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム> (年2回分配型)	658,018円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	9,991,470円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	1,616,484円
三菱UF J / AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド 豪ドル円プレミアム (毎月決算型)	25,537,767円
三菱UF J 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム (毎月分配型)	42,906,570円
三菱UF J 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム (年2回分配型)	8,585,548円
N a v i o インド債券ファンド	885,566円
N a v i o マネープールファンド	1,883,381円
三菱UF J インド債券オープン (毎月決算型)	39,351円
バンクローンファンドUSA (為替ヘッジあり) 2014-08	11,276,260円
マネープールファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定)	102,821円
MUAM トピックスリスクコントロール (5%) インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定)	7,644,146円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Aコース (為替ヘッジなし)	16,982,851円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Bコース (為替ヘッジあり)	21,620,196円
三菱UF J バランス・イノベーション (債券重視型)	1,242,825,788円
三菱UF J / AMP オーストラリアREITファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	11,293,333円
三菱UF J Jリート不動産株ファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	6,324,266円
三菱UF J Jリート不動産株ファンド<米ドル投資型> (3ヵ月決算型)	3,063,931円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム> (毎月分配型)	1,375,824円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム> (年2回分配型)	1,071,396円
マルチストラテジー・ファンド (ラップ向け)	491,015円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	918,198円

PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	138,468円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (年2回分配型)	10,804円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (毎月分配型)	10,804円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	983円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	10,531,117,458円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	112,195,605円
MUAM トピックスリスクコントロール (10%) インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定)	195,410,633円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	0円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	13,274,970,563円
三菱UFJ グローバル好利回りCBファンド2013-03 (円ヘッジ) (限定追加型)	343,676,356円
合計	27,329,169,583円

[お 知 ら せ]

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