

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3期（決算日：2017年3月27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27日に第3期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

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

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客様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)
お客様のお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○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	期中騰落率						
(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
3期(2017年3月27日)	10,697	0		△0.4	32.7	0.9	55.9	—	0.4	1,403

(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 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率					
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%
2016年3月25日	10,742	—	2.9	0.0	76.8	0.1	0.1
3月末	10,726	△0.1	3.0	0.1	79.5	0.1	0.1
4月末	10,780	0.4	9.4	0.3	76.8	—	0.3
5月末	10,772	0.3	5.8	0.1	75.3	0.1	0.2
6月末	10,753	0.1	—	—	74.2	0.2	—
7月末	10,697	△0.4	1.8	0.1	74.4	0.2	0.1
8月末	10,636	△1.0	9.0	0.1	73.7	0.2	0.1
9月末	10,622	△1.1	7.6	0.2	73.8	0.2	0.1
10月末	10,626	△1.1	13.6	0.2	72.6	0.1	0.1
11月末	10,676	△0.6	21.6	0.3	73.7	0.1	0.2
12月末	10,741	△0.0	40.2	0.4	56.1	0.1	0.5
2017年1月末	10,702	△0.4	35.9	0.7	56.8	—	0.4
2月末	10,762	0.2	35.3	0.6	60.7	—	0.4
(期 末)							
2017年3月27日	10,697	△0.4	32.7	0.9	55.9	—	0.4

(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3期：2016/3/26～2017/3/27)

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.4%の下落となりました。



第3期首：10,742円
 第3期末：10,697円
 (既払分配金 0円)
 騰落率：-0.4%

基準価額の主な変動要因

上昇要因	期の後半に株式市況が堅調に推移する中、内外株式の組入比率を引き上げたことが基準価額に対してプラスに寄与しました。
下落要因	組み入れを行った各マザーファンド受益証券のうち、主に国内債券、先進国債券が下落したことや信託報酬等コストが基準価額に対してマイナスに影響しました。

投資環境について

(第3期：2016/3/26～2017/3/27)

【概況】

当期の株式市況では、国内、先進国株式市況ともに上昇しました。債券市場では、国内長期金利は、日本銀行によるイールドカーブコントロール政策が意識される中、米国の長期金利上昇などを背景に小幅に上昇しました。米国やドイツの長期金利は米大統領選に勝利したトランプ氏の打ち出す財政政策によるインフレ見通しの高まりなどから米国金利が上昇したことなどを背景に上昇しました。

【株式】

先進国株式市況は、2016年7月上旬にかけて、英国の欧州連合（EU）離脱を問う国民投票をめぐる不透明感などから軟調に推移しました。その後は過度な懸念が後退したことなどから堅調に推移し、11月の米大統領選以降はトランプ新政権による景気刺激的な政策への期待などを背景とした米国株式市況の上昇が牽引し、期を通じてみると上昇しました。国内株式市況は、期の前半は英国のEU離脱を問う国民投票をめぐる不透明感や、日本銀行の金融政策に左右され上下に振れる展開となりましたが、期の後半は米国株式市況の上昇や、円安の進行などから上昇し、期を通じてみると上昇しました。

【債券】

先進国の長期金利は、期の前半は英国のEU離脱選択などを受け低下基調で推移しましたが、トランプ新政権発足後、財政政策によるインフレ見通しの高まりなどから米国金利が上昇したことなどを背景に上昇しました。国内の長期金利は、2016年7月下旬にかけては、良好な需給動向や英国のEU離脱選択などを背景に低下しました。7月末には日本銀行による国債買入が見送られたことなどから急反発しましたが、その後はイールドカーブコントロール政策が意識される中、米国の長期金利上昇などを背景に小幅に上昇し、期を通じてみると小幅上昇となりました。

【為替】

円は米ドル、ユーロに対して上昇しました。期の前半は英国のEU離脱選択などを背景にリスク回避の動きが強まったことから上昇しました。その後、米大統領選挙に勝利したトランプ氏の打ち出す経済政策を受けて、米国経済の先行きに対する期待が高まったことなどを背景にリスク回避の動きが弱まったことなどから、下落基調で推移しましたが、上昇幅を縮小するにとどまりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

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2016年8月にかけては「株式部分の収益寄与」が低い状態が継続したことから、株式の組み入れを低位に抑えました。その後、12月末にかけて、「株式部分の収益寄与」が拡大し、「投資環境」が改善したことなどから、株式の組入比率を引き上げました。2017年に入っても、「投資環境」が引き続き良好に推移したことなどから、株式の組入比率は高位を維持しました。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。

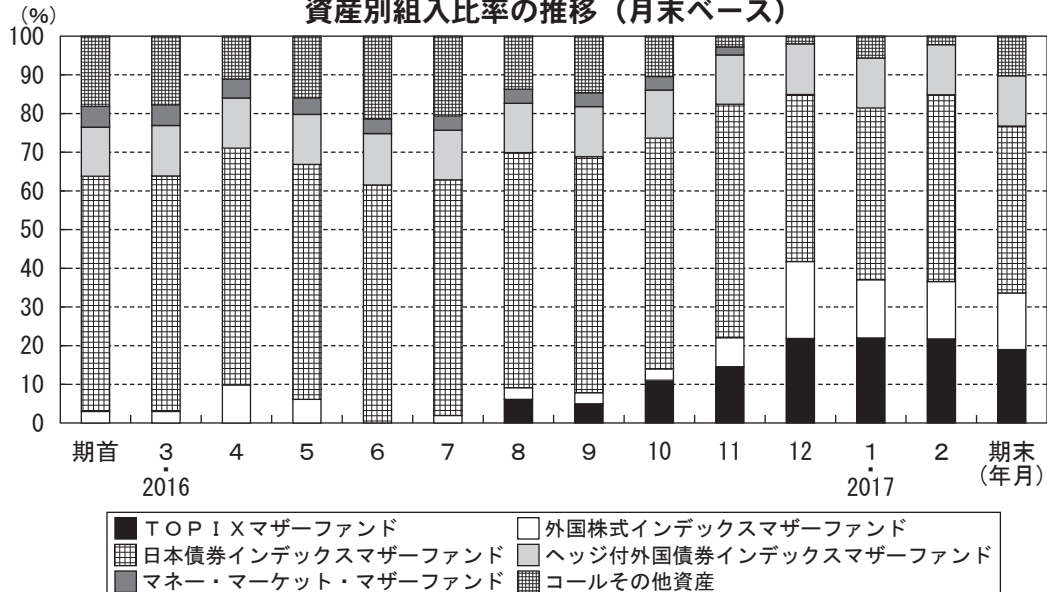
- ・国内株式の「投資環境」はやや良好、「株式部分の収益寄与」は高い局面
- ・先進国株式の「投資環境」はやや良好、「株式部分の収益寄与」はやや高い局面

◎パフォーマンス要因

当期は、世界的な長期金利の上昇を受けて、主に内外債券の組み入れに加え、信託報酬等コストが基準価額にマイナスに影響しました。一方で期の後半は株式市況が堅調に推移する中、株式の組入比率を引き上げたことがプラスに寄与しました。

(ご参考)

資産別組入比率の推移 (月末ベース)



(ご参考)

資産別組入比率および基準価額騰落率

(2017年3月27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%	19.0%	14.1%
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%	14.6%	13.4%
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%	43.1%	△1.4%
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)	13.0%	△1.5%
短期公社債	マネー・マーケット・マザーファンド	—	—	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3期
	2016年3月26日～2017年3月27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	697

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

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

今後の運用方針

- ・三菱UFJ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

(2016年3月26日～2017年3月27日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	70	0.653	(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 ）	(47)	(0.435)	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)	(0.185)	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 ）	(4)	(0.033)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	(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)	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.003	(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)	(0.003)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	1	0.009	(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)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	71	0.667	
期中の平均基準価額は、10,707円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2016年3月26日～2017年3月27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	64,909	83,140	—	—
TOPIXマザーファンド	409,555	592,110	239,519	346,010
外国株式インデックスマザーファンド	475,850	1,008,680	398,076	825,808
日本債券インデックスマザーファンド	546,367	725,760	454,207	597,700
マネー・マーケット・マザーファンド	—	—	42,678	43,463

○株式売買比率

(2016年3月26日～2017年3月27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	317,782,195千円	266,678,788千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	275,258,600千円	279,394,117千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.15	0.95

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年3月26日～2017年3月27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			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	$\frac{D}{C}$	
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	181,579	44,658	24.6	136,202	18,503	13.6
貸付有価証券(株式)	359,800	359,800	100.0	353,818	353,818	100.0

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。

<外国株式インデックスマザーファンド>

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 247,087	百万円 70,480	28.5	百万円 188,359	百万円 109,569	58.2

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 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	$\frac{D}{C}$	%
公社債	百万円 301,923	百万円 65,758	21.8	百万円 336,906	百万円 50,653	15.0

平均保有割合 0.1%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A			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	$\frac{D}{C}$	%
為替先物取引	百万円 1,058,234	百万円 481,039	45.5	百万円 1,085,418	百万円 507,912	46.8
為替直物取引	54,004	36,924	68.4	24,988	12,497	50.0

平均保有割合 0.2%

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

<マネー・マーケット・マザーファンド>

該当事項はございません。

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 4,110	百万円 3,249	百万円 7,418

<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 801	百万円 1,447	百万円 1,732

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 112

<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 4,600

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	18千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.085千円
(B) / (A)	0.5%

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

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

○組入資産の明細

(2017年3月27日現在)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	口 数	評 価 額
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千口 80,135	千口 145,045	千円 182,481	千円 182,481
TOPIXマザーファンド	—	170,036	266,582	266,582
外国株式インデックスマザーファンド	12,013	89,787	205,308	205,308
日本債券インデックスマザーファンド	367,136	459,296	605,306	605,306
マネー・マーケット・マザーファンド	42,678	—	—	—

○投資信託財産の構成

(2017年3月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千円 182,481	% 12.9
TOPIXマザーファンド	266,582	18.9
外国株式インデックスマザーファンド	205,308	14.6
日本債券インデックスマザーファンド	605,306	42.9
コール・ローン等、その他	149,880	10.7
投資信託財産総額	1,409,557	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(86,140,894千円)の投資信託財産総額(87,458,031千円)に対する比率は98.5%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(336,973,265千円)の投資信託財産総額(348,846,858千円)に対する比率は96.6%です。

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

1 アメリカドル=110.44円	1 カナダドル=82.78円	1 メキシコペソ=5.88円	1 ユーロ=119.76円
1 イギリスポンド=138.25円	1 スイスフラン=111.80円	1 スウェーデンクローネ=12.57円	1 ノルウェークローネ=13.04円
1 デンマーククローネ=16.10円	1 ポーランドズロチ=28.07円	1 オーストラリアドル=84.28円	1 ニューージーランドドル=77.85円
1 香港ドル=14.22円	1 シンガポールドル=79.11円	1 イスラエルシェケル=30.37円	1 南アフリカランド=8.90円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年3月27日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,409,557,960
コール・ローン等	29,878,563
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	182,481,569
TOPIXマザーファンド(評価額)	266,582,774
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	205,308,129
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	605,306,925
未収入金	120,000,000
(B) 負債	5,985,555
未払解約金	1,685,676
未払信託報酬	4,274,259
未払利息	36
その他未払費用	25,584
(C) 純資産総額(A-B)	1,403,572,405
元本	1,312,097,054
次期繰越損益金	91,475,351
(D) 受益権総口数	1,312,097,054口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,697円

<注記事項>

- ①期首元本額 751,810,484円
 期中追加設定元本額 815,850,058円
 期中一部解約元本額 255,563,488円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0697円です。

②分配金の計算過程

項 目	2016年3月26日～ 2017年3月27日
費用控除後の配当等収益額	5,853,474円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	79,433,042円
分配準備積立金額	6,188,835円
当ファンドの分配対象収益額	91,475,351円
1万口当たり収益分配対象額	697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】

投資環境等の変化に応じた資産配分比率の変更を行う対応として、市場が下落した場合等の実質組入比率引き下げについて外国債券にも適用する約款変更と交付目録見書の記載において各資産の組入比率の変更を行う予定です。詳細は2017年5月26日にリリースされる当社HPをご参照ください。

○損益の状況 (2016年3月26日～2017年3月27日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 44,486
受取利息	814
支払利息	△ 45,300
(B) 有価証券売買損益	2,774,131
売買益	34,020,179
売買損	△31,246,048
(C) 信託報酬等	△ 7,736,467
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	△ 5,006,822
(E) 前期繰越損益金	6,188,835
(F) 追加信託差損益金	90,293,338
(配当等相当額)	(52,240,153)
(売買損益相当額)	(38,053,185)
(G) 計(D+E+F)	91,475,351
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	91,475,351
追加信託差損益金	90,293,338
(配当等相当額)	(52,853,443)
(売買損益相当額)	(37,439,895)
分配準備積立金	12,042,309
繰越損益金	△10,860,296

- (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。

T O P I X マザーファンド

《第16期》決算日2017年3月27日

〔計算期間：2016年3月26日～2017年3月27日〕

「T O P I X マザーファンド」は、3月27日に第16期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	東証株価指数(T O P I X)と連動する投資成果をめざして運用を行います。T O P I X 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 (T O P I X)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
16期(2017年3月27日)	15,678	14.1	1,524.39	11.6	98.8	1.0	296,391

(注) 東証株価指数(T O P I X)とは、東京証券取引所第一部に上場する国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。T O P I X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、T O P I X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、T O P I Xの算出もしくは公表の方法の変更、T O P I Xの算出もしくは公表の停止またはT O P I X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) 2016年3月25日	13,743	—	1,366.05	—	98.2	1.9
3月末	13,682	△ 0.4	1,347.20	△ 1.4	97.1	2.4
4月末	13,610	△ 1.0	1,340.55	△ 1.9	97.9	1.8
5月末	14,015	2.0	1,379.80	1.0	98.5	1.5
6月末	12,674	△ 7.8	1,245.82	△ 8.8	99.1	1.0
7月末	13,458	△ 2.1	1,322.74	△ 3.2	99.2	0.5
8月末	13,532	△ 1.5	1,329.54	△ 2.7	99.6	0.7
9月末	13,574	△ 1.2	1,322.78	△ 3.2	98.6	1.5
10月末	14,295	4.0	1,393.02	2.0	98.0	1.7
11月末	15,083	9.8	1,469.43	7.6	98.8	1.4
12月末	15,607	13.6	1,518.61	11.2	99.3	0.7
2017年1月末	15,641	13.8	1,521.67	11.4	99.6	0.4
2月末	15,790	14.9	1,535.32	12.4	97.6	1.0
(期 末) 2017年3月27日	15,678	14.1	1,524.39	11.6	98.8	1.0

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

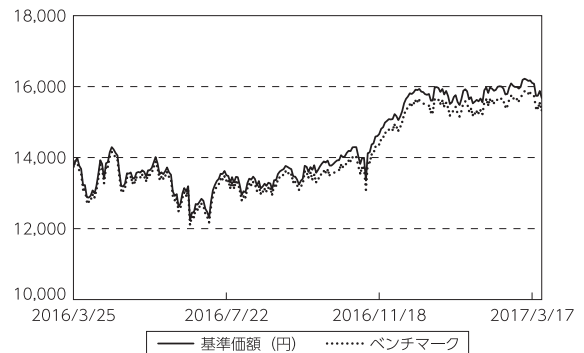
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.1%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(11.6%)を2.5%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内株式市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・株式ポートフォリオはベンチマークである東証株価指数（TOPIX）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11.6%の上昇となったため、カイ離は2.5%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	0.1%程度	△0.0%程度	2.4%程度	2.5%程度

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.1%程度でした。

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

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.4%程度でした。

- ・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

プラス要因	配当収入等	計 2.4%程度
マイナス要因	売買コスト等	計 △0.0%程度

信託財産の収益向上を目的に、保有株式の貸し付けを行っています。貸付契約額は、期末時点で概ね純資産総額の4割程度となり、信託財産に若干の収益寄与となりました。

◎今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2016年3月26日～2017年3月27日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先物・オプション)	円 0 (0) (0)	% 0.002 (0.001) (0.002)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	0	0.002	
期中の平均基準価額は、14,246円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2016年3月26日～2017年3月27日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 142,313 (△ 14,122)	千円 181,579,329 ()	千株 106,766	千円 136,202,866

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円 48,441	百万円 50,244	百万円 -	百万円 -

○株式売買比率

(2016年3月26日～2017年3月27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	317,782,195千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	253,968,319千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.25

(注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年3月26日～2017年3月27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	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	181,579	44,658	24.6	136,202	18,503	13.6
貸付有価証券(株式)	359,800	359,800	100.0	353,818	353,818	100.0

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
	百万円	百万円	百万円
株式	4,110	3,249	7,418

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
	百万円
株式	112

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)	6,356千円
うち利害関係人への支払額 (B)	127千円
(B) / (A)	2.0%

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、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2017年3月27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	51	5.8	18,096	
日本水産	138.6	191.9	108,999	
マルハニチロ	24.6	28	97,300	
カネコ種苗	—	5.1	7,354	
サカタのタネ	17.8	21.8	76,409	
ホクト	12.2	15	31,545	
ホクリヨウ	—	1.6	1,308	
鉱業 (0.3%)				
住石ホールディングス	35.6	41	3,977	
日鉄鉱業	33	4.1	23,657	
三井松島産業	79	9.1	13,431	
国際石油開発帝石	633.7	778.3	837,450	
日本海洋掘削	3.6	5.2	12,131	
石油資源開発	19.1	23.4	59,085	
K&Oエナジーグループ	8.1	9.9	17,691	
建設業 (3.0%)				
ショーボンドホールディングス	12.6	14.3	70,785	
ミライト・ホールディングス	37	45.4	51,165	
タマホーム	9.1	11.1	6,748	
サンヨーホームズ	2.5	3.1	2,142	
ファーストコーポレーション	—	2.4	2,469	
インバスターズクラウド	—	1.4	6,433	
ダイセキ環境ソリューション	2.8	4.1	5,084	
安藤・間	80.3	106.2	82,198	
東急建設	39.1	52.4	45,640	
コムシスホールディングス	51.7	57.7	116,957	
ミサワホーム	14.2	17.4	19,227	
ピーアールホールディングス	—	14.6	6,000	
高松コンストラクショングループ	9.1	11.1	30,047	
東建コーポレーション	4.9	5.5	48,455	
ソネック	—	1.8	1,269	
ヤマウラ	5.7	6.9	4,284	
大成建設	625	751	626,334	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
大林組	360.8	443.1	471,901	
清水建設	368	452	457,424	
飛鳥建設	96.6	142.3	24,617	
長谷工コーポレーション	140.4	172.4	217,741	
松井建設	13.3	16.3	16,463	
銭高組	17	21	8,442	
鹿島建設	564	649	482,207	
不動テトラ	84.9	119.2	24,555	
大末建設	4.6	5.2	5,298	
鉄建建設	73	90	29,340	
西松建設	139	171	97,983	
三井住友建設	460.9	566.1	70,196	
大豊建設	46	54	29,700	
前田建設工業	74	97	98,552	
佐田建設	8.4	10.2	4,416	
ナカノフドー建設	9.2	11.3	7,458	
奥村組	114	122	87,718	
東鉄工業	14.4	17.7	57,171	
イチケン	13	13	5,902	
浅沼組	39	52	17,576	
戸田建設	140	172	117,820	
熊谷組	176	232	69,368	
青木あすなろ建設	7.9	9.7	7,895	
北野建設	25	31	9,827	
植木組	15	18	4,698	
三井ホーム	15	19	11,951	
矢作建設工業	16.4	20.1	20,703	
ビーエス三菱	14.2	15.6	6,786	
日本ハウスホールディングス	24.5	30.1	14,688	
大東建託	45	54.4	878,016	
新日本建設	14.3	17.6	16,878	
N I P P O	28	34	72,624	
東亜道路工業	23	28	9,548	
前田道路	38	46	92,736	

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
日本道路	36	44	22,792	
東亜建設工業	105	12	24,588	
若築建設	69	85	12,750	
東洋建設	37.7	42.5	17,722	
五洋建設	133.5	163.9	90,472	
大林道路	14	15.3	10,373	
世紀東急工業	19	21.5	11,889	
福田組	19	24	24,264	
住友林業	82.8	101.7	178,178	
日本基礎技術	13.5	16.4	5,854	
日成ビルド工業	33	44	25,432	
ヤマダ・エスバイエルホーム	61	75	5,850	
バコーポレーション	14.9	18.4	6,716	
バナホーム	45	55	54,065	
大和ハウス工業	355.3	436.4	1,396,043	
ライト工業	23.1	28.4	32,603	
積水ハウス	402.2	464.9	864,946	
日特建設	13.3	12.6	5,695	
北陸電気工事	4.4	7.2	6,566	
ユアテック	19	23	17,940	
西部電気工業	10	2.5	5,700	
四電工	9	11	4,862	
中電工	17.4	18.7	45,609	
関電工	48	59	60,298	
きんでん	72.7	98.2	153,388	
東京エネシス	14	15	14,475	
トーエネック	17	21	11,508	
住友電設	9.5	10.2	13,464	
日本電設工業	19.6	24.1	47,862	
協和エクシオ	47.1	57.9	94,434	
新日本空調	10.1	11.4	15,743	
NDS	19	2.3	6,881	
九電工	22	28.7	88,970	
三機工業	26.7	32.7	32,667	
日揮	121	137.9	269,180	
中外炉工業	36	45	10,125	
ヤマト	10.9	13.2	7,431	
太平電業	18	20	22,180	
高砂熱学工業	35.9	40.7	65,852	

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
三晃金属工業	12	1.3	4,348	
朝日工業社	14	3.3	11,170	
明星工業	21.8	26.7	17,515	
大氣社	14.7	19.6	54,840	
ダイダシ	16	20	21,320	
日比谷総合設備	14.5	16.5	27,373	
東芝プラントシステム	19.5	24	37,536	
OSJBホールディングス	24.5	45.1	12,582	
東洋エンジニアリング	64	87	24,099	
千代田化工建設	87	107	78,431	
新興ブランテック	24.7	30.3	26,421	
食料品 (4.6%)				
日本製粉	79	43.9	73,532	
日清製粉グループ本社	131.9	162	279,450	
日東富士製粉	9	1	4,020	
昭和産業	49	61	38,003	
鳥越製粉	9.5	11.7	9,441	
中部飼料	11.1	16.2	18,597	
フィード・ワン	72.4	88.9	17,780	
東洋精糖	18	22	2,662	
日本甜菜製糖	61	7.5	18,322	
三井製糖	47	10.4	28,932	
塩水港精糖	12.9	15.8	4,155	
日新製糖	5.1	6.3	12,675	
森永製菓	108	28.8	151,200	
中村屋	28	3.4	17,782	
江崎グリコ	27.8	37	205,350	
名糖産業	5.3	6.4	9,568	
不二家	69	84	21,504	
山崎製パン	88	108.2	256,866	
第一屋製パン	18	23	2,852	
モロゾフ	18	23	13,064	
亀田製菓	6.7	8.2	40,754	
寿スピリッツ	2.9	10.5	29,631	
カルビー	44.6	60.3	235,170	
森永乳業	108	133	129,409	
六甲バター	5.4	6.6	16,486	
ヤクルト本社	64.5	79.2	479,160	
明治ホールディングス	71.3	87.5	835,625	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
雪印メグミルク	28.3	31.9	100,485
ブリマハム	76	93	46,128
日本ハム	88	100	317,000
伊藤ハム	58	—	—
林兼産業	39	4.7	4,103
丸大食品	62	71	36,068
米久	3.8	—	—
S Foods	7.5	7.9	25,438
伊藤ハム米久ホールディングス	—	85.2	92,697
サッポロホールディングス	184	48.4	145,442
アサヒグループホールディングス	225.7	277.2	1,175,050
キリンホールディングス	487.5	636.1	1,320,225
宝ホールディングス	87.1	106.9	130,524
オエノンホールディングス	33	38	9,462
養命酒製造	3.7	4.6	9,618
コカ・コーラウエスト	40.7	50	175,000
コカ・コーライーストジャパン	42.6	57.5	150,420
サントリー食品インターナショナル	82.4	101.2	474,628
ダイドールグループホールディングス	6.1	6.8	36,380
伊藤園	35.7	43.8	181,113
キーコーヒー	10.6	13	30,446
ユニカフェ	3.2	4	3,872
ジャパンフーズ	1.5	1.9	2,772
日清オイリオグループ	64	85	54,655
不二製油グループ本社	32.1	39.4	104,804
かどや製油	1.2	1.4	8,960
J-オイルミルズ	50	6.9	29,221
キッコーマン	91	103	352,775
味の素	258	304.3	685,892
キュービー	61.2	75.2	241,016
ハウス食品グループ本社	41.1	54.7	137,844
カゴメ	43.2	53	156,668
焼津水産化学工業	5.7	6.9	9,156
アリアケジャパン	9.8	12.1	83,611
ビエトロ	1.1	1.7	2,886
エバラ食品工業	2.9	3.5	7,542
ニチレイ	128	72.7	202,905
東洋水産	59.1	72.6	313,269
イートアンド	1.3	1.6	3,713

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大冷	—	1.1	2,035
日清食品ホールディングス	50.9	57.7	374,473
永谷園ホールディングス	11	14	20,692
一正蒲鉾	4.2	5.1	6,456
フジッコ	11.7	14.3	37,208
ロック・フィールド	6.3	14.3	26,569
日本たばこ産業	711.1	818.8	3,050,030
ケンコーマヨネーズ	3.9	6	17,130
わらべや日洋ホールディングス	6.5	8.7	23,307
なとり	6	7.4	14,126
北の達人コーポレーション	1.7	3.2	3,788
ユーグレナ	40.7	47.6	58,881
ミヨシ油脂	41	51	7,191
理研ビタミン	3.5	4.4	18,260
繊維製品 (0.7%)			
片倉工業	14.1	17.3	24,773
グンゼ	91	103	45,320
東洋紡	445	547	108,853
ユニチカ	327	378	37,044
富士紡ホールディングス	55	6.7	20,904
倉敷紡績	115	139	34,611
シキボウ	69	74	11,026
日本毛織	34.6	38.9	34,348
ダイトボウ	16	18	1,386
トーア紡コーポレーション	4.8	5.9	3,203
ダイドーリミテッド	12.7	15.4	6,868
帝国繊維	11.8	14.4	23,673
帝人	460	112.9	241,154
東レ	816	1,002	995,787
サカイオーベックス	30	3.4	6,259
住江織物	28	38	10,792
日本フェルト	6	7.9	4,163
イチカワ	7	9	2,853
日東製網	12	1.5	2,932
芦森工業	24	—	—
アツギ	87	113	15,481
ダイニック	21	26	4,992
セーレン	28	34.4	53,044
ソトー	—	5.1	5,936

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
東海染工	16	19	19	2,755
小松精練	17.3	19.4	19.4	13,832
ワコールホールディングス	67	82	82	114,062
ホギメディカル	7.1	8.7	8.7	58,290
レナウン	30.7	37.3	37.3	4,177
クラウディア	2.9	3.2	3.2	1,721
T S I ホールディングス	50.2	56.9	56.9	43,585
三陽商会	63	72	72	11,952
ナイガイ	41	50	50	2,900
オンワードホールディングス	75	89	89	68,886
ルック	20	25	25	5,450
キムラタン	478	583	583	4,081
ゴールドウイン	4.8	5.9	5.9	35,577
デサント	25.6	31.5	31.5	42,493
キング	5.6	6.8	6.8	2,815
ヤマトインターナショナル	7	8.5	8.5	3,519
パルプ・紙 (0.3%)				
特種東海製紙	65	8	8	36,160
王子ホールディングス	461	540	540	287,820
日本製紙	58.1	61.9	61.9	131,351
三菱製紙	171	19.6	19.6	14,445
北越紀州製紙	69.8	77.1	77.1	60,369
中越パルプ工業	45	55	55	13,035
巴川製紙所	17	21	21	4,977
大王製紙	49.8	55	55	78,980
阿波製紙	—	2.5	2.5	1,535
レンゴー	99	133.2	133.2	87,246
トーモク	35	44	44	15,092
ザ・バック	8	9.8	9.8	31,507
化学 (6.8%)				
クラレ	177.4	232.4	232.4	390,432
旭化成	701	861	861	920,409
共和レザー	7.4	8	8	7,168
昭和電工	749	91.9	91.9	175,712
住友化学	828	1,017	1,017	631,557
日本化成	21	—	—	—
住友精化	23	5.7	5.7	26,305
日産化学工業	67.6	75.7	75.7	249,053
ラサ工業	42	52	52	7,436

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
クレハ	85	10.4	10.4	51,324
多木化学	7	9	9	8,073
テイカ	19	21	21	15,960
石原産業	202	24.8	24.8	27,404
片倉コープアグリ	14	19	19	4,864
日東エフシー	6.6	8.1	8.1	8,432
日本曹達	73	83	83	51,211
東ソー	303	399	399	381,843
トクヤマ	186	215	215	113,305
セントラル硝子	122	141	141	68,385
東亜合成	70.4	86.5	86.5	108,903
大阪ソーダ	48	59	59	29,500
関東電化工業	27	28	28	27,244
デンカ	233	286	286	167,882
信越化学工業	201.7	247.7	247.7	2,367,764
日本カーバイド工業	38	47	47	7,144
堺化学工業	45	52	52	20,436
エア・ウォーター	93	113.9	113.9	232,242
大陽日酸	86.6	106.4	106.4	139,171
日本化学工業	42	51	51	12,393
日本パーカライジング	57.5	70.6	70.6	96,933
高圧ガス工業	17	20.5	20.5	15,088
チタン工業	13	16	16	3,136
四国化成工業	16	20	20	25,080
戸田工業	22	27	27	7,344
ステラ ケミファ	5.7	6.6	6.6	20,691
保土谷化学工業	34	4.8	4.8	17,256
日本触媒	16.3	21.7	21.7	164,920
大日精化工業	43	57	57	42,978
カネカ	152	186	186	157,356
三菱瓦斯化学	193	128.7	128.7	293,049
三井化学	477	628	628	346,028
J S R	105.5	138.8	138.8	269,133
東京応化工業	22.6	25.8	25.8	92,364
大阪有機化学工業	8	8.9	8.9	7,992
三菱ケミカルホールディングス	753.2	930.4	930.4	789,444
KHネオケム	—	16.9	16.9	22,882
日本合成化学工業	26	—	—	—
ダイセル	158.1	186.2	186.2	246,715

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
住友ベークライト	105	122	81,618	
積水化学工業	255.3	313.5	589,693	
日本ゼオン	97	116	142,216	
アイカ工業	33.8	44.3	131,881	
宇部興産	602	696	185,832	
積水樹脂	17.3	21.3	39,383	
タキロン	26	29	17,139	
旭有機材	36	45	10,890	
日立化成	55.6	76.8	238,080	
ニチバン	11	14	12,922	
リケンテクノス	18.3	29.8	16,300	
大倉工業	27	33	18,480	
積水化成成品工業	29	19.6	15,640	
群栄化学工業	30	3.3	11,814	
タイガースポリマー	5.5	6.8	4,916	
ミライアル	4	5	5,120	
ダイキアクシス	2.1	2.3	3,898	
ダイキョーニシカワ	14.5	24.2	34,025	
日本化薬	73	90	137,250	
カーリットホールディングス	10.4	12.8	7,692	
日本精化	9.3	11.4	11,400	
扶桑化学工業	7.1	9.8	31,556	
ADEKA	55.3	59.4	95,574	
日油	86	107	125,618	
新日本理化	17.9	21.8	3,204	
ハリマ化成グループ	9.6	11.7	9,289	
花王	302.4	350.8	2,148,299	
第一工業製薬	25	31	13,392	
日華化学	—	4.4	4,589	
ニイタカ	1.6	2	3,616	
三洋化成工業	35	8.7	40,368	
有機合成薬品工業	—	9	2,709	
大日本塗料	64	79	18,723	
日本ペイントホールディングス	86.8	106.6	412,009	
関西ペイント	127.2	145.1	334,165	
神東塗料	8	10	2,160	
中国塗料	32	39.6	32,036	
日本特殊塗料	7.9	9.7	16,548	
藤倉化成	15.3	18.8	12,238	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
太陽ホールディングス	8.2	11.2	55,328	
D I C	444	54.5	223,450	
サカタインクス	23	28.2	43,033	
東洋インキSCホールディングス	111	136	74,800	
T&K TOKA	8.1	10	10,760	
富士フィルムホールディングス	257.3	273.9	1,208,172	
資生堂	213.3	262	772,114	
ライオン	130	171	348,840	
高砂香料工業	7.4	9.1	32,623	
マンダム	10.5	13.8	72,864	
ミルボン	6.6	7.5	42,750	
ファンケル	26.1	29.4	49,009	
コーセー	18.2	22.3	226,345	
コタ	3.5	5.2	7,670	
シーズ・ホールディングス	14.2	17.9	61,039	
シーボン	1.3	1.6	4,166	
ポーラ・オルビスホールディングス	11.5	14.1	149,601	
ノエビアホールディングス	7.1	8.7	39,498	
アジュバンコスメジャパン	2.1	2.6	2,407	
エステー	7.7	9.4	17,690	
アグロ カネショウ	4.4	5.4	7,268	
コニシ	8.8	21.7	29,598	
長谷川香料	14.2	17.5	38,482	
星光PMC	6.1	7.6	10,351	
小林製薬	17	38.3	207,203	
荒川化学工業	9.6	11.8	23,788	
メック	8.7	10.7	13,171	
日本高純度化学	3.2	3.9	9,878	
タカラバイオ	—	29.6	45,021	
J C U	3.3	4.3	33,110	
新田ゼラチン	7.3	8.3	6,498	
OATアグリオ	1	1.6	2,246	
デクセリアルズ	25.2	36.2	42,390	
アース製薬	8.1	9.9	58,311	
イハラケミカル工業	17.3	19.1	19,233	
北興化学工業	12	14	6,440	
大成ラミック	3.2	4.3	12,289	
クミアイ化学工業	23.2	28.5	18,325	
日本農薬	25.7	31.5	21,892	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
アキレス	92	11.3	19,978	
有沢製作所	16.6	23.3	18,057	
日東電工	86.9	99.6	852,974	
レック	3.5	4.3	20,532	
きもと	18.4	24.7	5,681	
藤森工業	9.6	10.3	32,290	
前澤化成工業	7.9	9	10,665	
J S P	7.3	6.4	16,876	
エフピコ	10	12.2	61,488	
天馬	8.6	9.1	19,009	
信越ポリマー	22	27.1	21,381	
東リ	29	32.8	12,923	
ニフコ	21.5	24.2	136,246	
日本バルカー工業	44	10.7	20,554	
ユニ・チャーム	227.6	279.6	734,229	
医薬品 (4.8%)				
協和発酵キリン	134.5	165.2	288,769	
武田薬品工業	447.8	517.7	2,689,451	
アステラス製薬	1,259	1,410.8	2,116,200	
大日本住友製薬	79.6	97.7	184,555	
塩野義製薬	163.9	175.2	1,014,408	
田辺三菱製薬	131	160.9	371,679	
わかもと製薬	13	16	4,176	
あすか製薬	14.3	15	25,050	
日本新薬	25.8	31.6	182,964	
ビオフェルミン製薬	1.8	2.2	6,831	
中外製薬	111.9	137.5	529,375	
科研製薬	19.4	25.8	167,958	
エーザイ	138.4	170	1,007,760	
ロート製薬	55	67.6	145,880	
小野薬品工業	51.1	313.6	739,155	
久光製薬	34.9	39	246,090	
有機合成薬品工業	7	—	—	
持田製薬	7.7	9.4	80,464	
参天製薬	207	249.4	418,493	
扶桑薬品工業	38	4.6	13,261	
日本ケミファ	16	1.9	10,051	
ツムラ	35.4	46.4	162,632	
日医工	26.3	32.3	55,265	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
キッセイ薬品工業	19.9	24.5	75,215	
生化学工業	21.5	25.6	48,358	
栄研化学	9.4	11.6	35,844	
日水製薬	4.5	5.5	8,200	
鳥居薬品	7.7	9.4	26,790	
J C R ファーマ	8.6	10.6	25,800	
東和薬品	5.2	6.3	35,217	
富士製薬工業	3.1	4.5	14,535	
沢井製薬	19.1	23.4	143,208	
ゼリア新薬工業	23	28.3	50,006	
第一三共	378.1	406.4	1,037,336	
キョーリン製薬ホールディングス	30	33.8	80,883	
大幸薬品	5.5	6.9	13,110	
ダイト	4.7	8.2	18,753	
大塚ホールディングス	241.7	296.9	1,516,862	
大正製薬ホールディングス	27	29.5	268,745	
ペプチドリーム	13.8	25.8	136,224	
石油・石炭製品 (0.5%)				
日本コークス工業	90.7	111.4	11,028	
昭和シェル石油	113.1	123.4	133,518	
ニチレキ	13.7	16.9	15,717	
東燃ゼネラル石油	170	225	297,000	
ユシロ化学工業	6	7.4	10,197	
ビービー・カストロール	4.6	5.6	9,240	
富士石油	26.1	32	11,552	
MORESCO	3.5	4.7	7,896	
出光興産	58.7	65.5	247,917	
J Xホールディングス	1,330.9	1,532.4	807,574	
コスモエネルギーホールディングス	33.9	41.6	78,624	
ゴム製品 (1.0%)				
横浜ゴム	67.8	83.3	182,427	
東洋ゴム工業	50.9	72.9	139,457	
ブリヂストン	379.5	466	2,085,816	
住友ゴム工業	105.2	129.2	238,890	
藤倉ゴム工業	9.5	11.5	7,900	
オカモト	35	42	45,654	
フコク	4.1	5.8	5,533	
ニッタ	12.1	12.4	39,246	
住友理工	24.3	25.6	29,542	

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
三ツ星ベルト	27	34	35,020	
バンドー化学	41	25.1	25,175	
ガラス・土石製品 (1.0%)				
日東紡績	74	112	60,368	
旭硝子	593	680	614,720	
日本板硝子	542	62.9	50,131	
石塚硝子	16	19	4,408	
日本山村硝子	45	55	11,110	
日本電気硝子	232	285	194,655	
オハラ	4.2	5.2	6,692	
住友大阪セメント	223	256	124,416	
太平洋セメント	701	833	317,373	
デイ・シイ	10.5	—	—	
日本ヒューム	10.8	13.2	9,160	
日本コンクリート工業	23.1	30.7	11,236	
三谷セキサン	5.6	6.9	18,498	
アジアバイルホールディングス	13.9	17	10,676	
東海カーボン	97	128.9	62,645	
日本カーボン	55	68	21,624	
東洋炭素	6.2	7.6	14,120	
ノリタケカンパニーリミテド	63	7.8	22,776	
TOTO	82.6	101.4	431,964	
日本碍子	142	174.3	429,300	
日本特殊陶業	96.9	119	295,358	
ダントーホールディングス	13	11	2,013	
MARUWA	4.1	5.1	20,247	
品川リフラクトリーズ	28	35	10,500	
黒崎播磨	24	30	13,560	
ヨータイ	6	8	3,096	
イソライト工業	5.6	6.8	3,060	
東京窯業	13.8	16.8	3,561	
ニッカトー	4	4.5	2,002	
フジミインコーポレーテッド	9.9	11.7	26,172	
エーアンドエーマテリアル	23	29	3,799	
ニチアス	57	72	81,360	
ニチハ	14.9	18.3	59,475	
鉄鋼 (1.3%)				
新日鐵住金	506.8	622.5	1,589,553	
神戸製鋼所	2,065	238.7	238,700	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
中山製鋼所	126	15.5	11,315	
合同製鐵	63	7.7	13,598	
ジェイ エフ イー ホールディングス	307.2	377.3	722,152	
日新製鋼	51.3	63	89,019	
東京製鐵	62	69.8	64,216	
共英製鋼	12	14.7	29,355	
大和工業	24.8	27.7	81,576	
東京鐵鋼	23	29	12,818	
大阪製鐵	7	8.7	17,904	
淀川製鋼所	16.7	19.1	58,637	
東洋鋼板	26.9	33	12,903	
丸一鋼管	37.6	46.2	151,998	
モリ工業	18	4.4	9,737	
大同特殊鋼	188	231	121,044	
日本高周波鋼業	44	48	4,080	
日本冶金工業	82.7	114.2	23,982	
山陽特殊製鋼	67	82	49,692	
愛知製鋼	66	8.1	36,814	
日立金属	128.7	140.5	215,386	
日本金属	29	3.3	4,851	
大平洋金属	78	88	34,232	
新日本電工	63.6	78.1	26,710	
栗本鐵工所	54	6.6	14,394	
虹技	16	19	4,427	
日本鑄鉄管	12	13	2,600	
三菱製鋼	78	96	23,136	
日亜鋼業	15.5	19.1	5,309	
日本精練	8	9	6,048	
シンニッタン	10.1	11.3	7,910	
新家工業	22	30	6,630	
非鉄金属 (1.0%)				
大紀アルミニウム工業所	17	23	11,569	
日本軽金属ホールディングス	254.4	355.3	88,825	
三井金属鉱業	286	375	137,625	
東邦亜鉛	59	78	42,276	
三菱マテリアル	701	86.1	291,018	
住友金属鉱山	310	357	562,810	
DOWAホールディングス	145	152	121,904	
古河機械金属	175	215	46,010	

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
エス・サイエンス	51.5	62.7	2,508	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11	15.1	25,473	
東邦チタニウム	19	23.3	19,735	
UACJ	157	178	49,484	
古河電気工業	353	46.3	180,801	
住友電気工業	449.9	520	948,480	
フジクラ	156	181.7	141,362	
昭和電線ホールディングス	134	164	14,104	
東京特殊電線	1.6	2	3,386	
タツタ電線	23.4	25.8	13,003	
沖電線	13	14	3,262	
カナレ電気	1.8	1.9	4,204	
平河ヒューテック	5.3	6.5	7,436	
リョービ	68	84	40,908	
アーレスティ	13	16	18,464	
アサヒホールディングス	16.9	20.8	42,140	
金属製品 (0.7%)				
稲葉製作所	6	7.3	9,723	
宮地エンジニアリンググループ	35	40	9,000	
トーカロ	7.9	9.1	27,272	
アルファC○	3.7	4.6	8,008	
SUMCO	88	144.1	247,275	
川田テクノロジーズ	2.1	2.6	19,188	
RS Technologies	—	0.5	3,040	
東洋製織グループホールディングス	79.9	98.1	184,231	
ホッカンホールディングス	29	36	18,648	
コロナ	5.9	7.2	8,395	
横河ブリッジホールディングス	21.3	24.2	32,331	
駒井ハルテック	20	2.6	5,881	
高田機工	10	12	3,396	
三和ホールディングス	113.8	137	141,795	
文化シャッター	31.3	38.4	31,910	
三協立山	14.7	18.1	30,335	
アルインコ	6.3	9.5	9,509	
東洋シャッター	2.8	3.4	2,155	
LIXILグループ	156.5	192.2	566,605	
日本フィルコン	8.2	10	5,570	
ノーリツ	22	27	57,240	
長府製作所	12	14.7	39,513	

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
リンナイ	20.9	23.5	218,080	
ダイニチ工業	5.7	7	5,152	
日東精工	16	19.6	9,290	
三洋工業	14	17	3,604	
岡部	23.3	28.6	28,857	
ジーテクト	11.7	14.4	28,612	
中国工業	1.7	2	1,392	
東プレ	21.6	26.5	75,286	
高周波熟練	20.9	25.6	23,628	
東京製綱	76	9.3	16,079	
サンコール	6	7.3	4,109	
モリテック スチール	5.7	6.9	2,118	
パイオラックス	5.7	7	53,690	
日本発條	105.8	129.9	161,076	
中央発條	14	16	5,504	
アドパネクス	2.1	2.4	3,700	
立川ブラインド工業	4.7	5.7	5,221	
三益半導体工業	8.3	11.6	19,522	
機械 (5.2%)				
日本ドライケミカル	1.4	1.8	4,375	
日本製鋼所	186	45.6	83,037	
三浦工業	50.1	56.4	101,181	
タクマ	42	44.2	45,128	
ツガミ	32	37	26,307	
オークマ	73	90	112,320	
東芝機械	61	82	37,556	
アマダホールディングス	163.9	185.8	234,108	
アイダエンジニアリング	29.5	39.2	41,395	
滝澤鉄工所	35	40	7,160	
富士機械製造	36.7	42.1	60,792	
牧野フライス製作所	56	69	68,724	
オーエスジー	51.2	62.9	145,047	
ダイジェット工業	13	16	2,896	
旭ダイヤモンド工業	30.8	39.5	32,982	
DMG森精機	62	81.6	141,494	
ソディック	21.4	35	38,745	
デイスコ	14.3	16.1	269,675	
日東工器	6.5	8	20,608	
パンチ工業	4.4	5	5,920	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
豊和工業	6.3	7.7	5,428	
OKK	43	50	6,100	
石川製作所	28	3.4	2,879	
東洋機械金属	8.4	9.3	5,142	
津田駒工業	27	31	5,270	
エンシュウ	28	34	3,094	
島精機製作所	15.9	18	76,050	
NCホールディングス	—	4.5	4,054	
フリーー	1.7	8.1	12,198	
ヤマシンフィルタ	—	2.7	6,739	
日阪製作所	14.2	18.8	17,972	
やまびこ	20.6	25.3	34,306	
ベガサスミシン製造	11.6	13.2	12,051	
ナプテスコ	58.4	71.7	215,817	
三井海洋開発	13.2	13.9	31,344	
レオン自動車	9.5	11.6	12,052	
SMC	33.7	41.4	1,355,022	
新川	10	11.5	9,407	
ホソカワミクロン	19	23	19,918	
ユニオンツール	4.9	6	21,270	
オイレス工業	14.5	17.8	37,931	
日精エー・エス・ビー機械	4.1	4.4	11,470	
サトーホールディングス	15.1	17.2	41,864	
日本エアーテック	3.9	4.5	4,045	
日精樹脂工業	8.2	10.9	12,240	
オカダアイオン	—	2.9	3,419	
ワイエイシイ	4.5	5.1	6,497	
小松製作所	550.8	636.7	1,873,489	
住友重機械工業	328	403	315,952	
日立建機	50.2	61.6	173,157	
日工	17	4.1	8,441	
巴工業	4.6	5.6	10,091	
井関農機	115	141	32,571	
TOWA	10.8	11.3	22,328	
丸山製作所	23	29	5,394	
北川鉄工所	51	6.3	13,960	
ローツェ	—	4.9	15,631	
タカキタ	2.8	4.6	2,562	
クボタ	539.5	660.5	1,107,988	

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
荏原実業	3.4	3.8	5,392	
三菱化工機	37	45	9,765	
月島機械	21.3	26.2	30,942	
帝国電機製作所	8.2	10	10,730	
東京機械製作所	43	52	3,432	
新東工業	25.5	31.3	30,141	
澁谷工業	9.4	11.5	35,765	
アイチ コーポレーション	15.9	19.5	16,672	
小森コーポレーション	27.3	33.2	48,737	
鶴見製作所	8.3	10.3	16,356	
住友精密工業	18	22	7,788	
酒井重工業	21	26	8,970	
荏原製作所	248	62.5	212,187	
石井鐵工所	16	2	3,512	
西島製作所	12	13.5	14,607	
北越工業	12.1	14.8	15,362	
ダイキン工業	156.3	180	1,999,800	
オルガノ	19	26	13,156	
トーヨーカネツ	60	63	19,530	
栗田工業	67.5	78.1	214,462	
椿本チエイン	64	78	73,788	
大同工業	22	27	8,181	
日本コンベヤ	37	—	—	
木村化工機	9.7	11.8	3,917	
アネスト岩田	18.1	23.9	24,210	
ダイフク	57.7	65.8	181,410	
サムコ	1.8	3.3	3,204	
加藤製作所	25	7.2	20,174	
油研工業	21	26	6,292	
タダノ	52	68.9	94,461	
フジテック	31.3	38.4	48,844	
CKD	29.9	39.5	55,142	
キトー	13.5	16.6	19,090	
平和	33.3	40.9	121,227	
理想科学工業	11.9	13.1	26,828	
SANKYO	29.9	36.7	142,763	
日本金銭機械	9.9	12.1	17,702	
マースエンジニアリング	6.1	7.4	17,626	
福島工業	6.6	8.1	31,914	

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
オーイズミ	4.5	5.5	3,404	
ダイコク電機	4.4	5.4	9,363	
竹内製作所	15.9	24.1	50,176	
アマノ	33.2	40.8	90,004	
JUKI	15.9	20.8	26,291	
サンデンホールディングス	65	80	28,320	
蛇の目ミシン工業	10.4	12.8	10,252	
マックス	17	20	30,920	
グローリー	36.6	42.1	158,717	
新晃工業	7.5	9.2	15,124	
大和冷機工業	17.2	21.2	24,846	
セガサミーホールディングス	115.4	130.8	206,664	
日本ビストンリング	4.5	5.1	13,127	
リケン	50	6.1	30,378	
TPR	13.2	14.8	53,798	
ツバキ・ナカシマ	9.9	14.8	27,616	
ホシザキ	23.5	28.9	251,719	
大豊工業	8.7	10.7	17,087	
日本精工	220.5	270.8	434,092	
NTN	266	305	171,410	
ジェイテクト	114.4	140.5	247,280	
不二越	100	133	75,943	
日本トムソン	37	42.1	25,765	
THK	71.4	93.2	264,222	
ユースン精機	4.2	5.8	17,075	
前澤給装工業	4.4	5	7,940	
イーグル工業	13.3	14.3	21,492	
前澤工業	7.9	8.8	2,904	
日本ビラー工業	10.9	13.3	20,322	
キッツ	52.2	63.3	47,538	
日立工機	28.7	34.9	30,223	
マキタ	70	86	661,340	
日立造船	85.1	104.5	66,357	
三菱重工業	1,912	2,210	1,018,810	
IHI	825	1,013	346,446	
スター精密	—	23.1	38,877	
電気機器 (12.7%)				
日清紡ホールディングス	59.6	73.2	83,082	
イビデン	65.7	92.3	157,648	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
コニカミノルタ	268.1	308.7	312,713	
ブラザー工業	138.8	170.4	393,794	
ミネベアミツミ	173	239.9	362,968	
日立製作所	2,739	3,166	1,920,812	
東芝	2,260	2,949	644,061	
三菱電機	1,145	1,406.5	2,268,684	
富士電機	323	397	256,859	
東洋電機製造	21	5.6	9,632	
安川電機	133.3	152.9	343,260	
シンフォニアテクノロジー	70	85	26,945	
明電舎	99	121	48,158	
オリジン電気	16	19	5,814	
山洋電気	28	35	28,805	
デンヨー	9.9	12.2	21,118	
東芝テック	77	83	51,875	
芝浦メカトロニクス	17	21	5,964	
マブチモーター	30.7	37.2	231,756	
日本電産	129.2	170.9	1,745,743	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	—	1.5	4,695	
東光高岳	6	6.7	13,748	
ダブル・スコープ	3.2	12.7	20,662	
宮越ホールディングス	3.7	4.5	2,200	
ダイヘン	63	72	52,560	
田淵電機	12.2	19.9	6,726	
ヤママン	1.4	1.7	8,959	
JVCケンウッド	78.8	96.7	27,946	
ミマキエンジニアリング	7.2	11.8	7,776	
第一精工	4.5	6.2	10,912	
日新電機	25.2	26.5	33,549	
大崎電気工業	20	26	25,766	
オムロン	121.2	140.1	691,393	
日東工業	17.2	19.4	29,682	
I D E C	14	17.2	21,104	
不二電機工業	1	1.4	1,789	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	207	254	131,826	
サクサホールディングス	27	33	7,194	
メルコホールディングス	5.9	7.3	24,455	
テクノメディカ	2.4	3	6,510	
日本電気	1,476	1,813	502,201	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
富士通	1,035	1,271	844,452	
沖電気工業	465	57.1	94,728	
岩崎通信機	50	58	5,046	
電気興業	28	37	21,201	
サンケン電気	59	77	36,498	
ナカヨ	10	14	5,180	
アイホン	6.1	7.5	13,575	
ルネサスエレクトロニクス	55.6	68.3	81,481	
セイコーエプソン	159.9	196.3	463,268	
ワコム	84.5	102.3	41,738	
アルバック	19.7	22.2	116,328	
アクセル	4.8	5.5	4,460	
E I Z O	10.6	13	42,510	
ジャパンディスプレイ	200.5	246.2	60,811	
日本信号	29.6	36.4	36,472	
京三製作所	25	31	13,299	
能美防災	12.2	14.9	23,035	
ホーチキ	7.8	9.6	14,304	
エレコム	9.3	11.4	24,692	
日本無線	28	8.1	10,740	
パナソニック	1,226.5	1,514.256	1,810,293	
シャープ	907	—	—	
アンリツ	64.5	96.1	83,799	
富士通ゼネラル	33	45	100,665	
日立国際電気	24.6	34.5	85,974	
ソニー	757.5	931	3,330,187	
TDK	64.8	74.3	519,357	
帝国通信工業	25	29	5,684	
ミツミ電機	40.8	—	—	
タムラ製作所	41	51	23,460	
アルプス電気	91.1	121.7	391,265	
池上通信機	34	42	6,174	
パイオニア	173.7	198.1	44,176	
日本電波工業	9.7	12.7	10,337	
鈴木	3.1	5.1	3,299	
日本トリム	2.9	3.2	12,304	
ローランド ディー. ジー.	5.3	6.7	22,478	
フォスター電機	13.5	15.4	28,490	
クラリオン	57	69	31,188	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
SMK	32	34	13,702	
ヨコオ	7.6	9.4	13,724	
東光	22	—	—	
ティアック	78	95	3,800	
ホシデン	32.5	40	43,120	
ヒロセ電機	17.3	21.3	332,067	
日本航空電子工業	31	38	55,442	
TOA	12.7	15.6	14,679	
日立マクセル	17.8	19.7	40,266	
古野電気	12.8	17	12,308	
ユニデンホールディングス	34	39	6,864	
アルパイン	25.6	31.4	50,145	
スミダコーポレーション	8.8	10.8	18,284	
アイコム	5.9	7.3	18,673	
リオン	4.1	5	7,935	
本多通信工業	—	4.2	5,854	
船井電機	10.8	14.8	14,415	
横河電機	107.5	143	254,683	
新電元工業	38	51	24,225	
アズビル	35.1	40	150,600	
東亜ディーケーケー	4.5	6.5	3,718	
日本光電工業	44.9	55.1	139,182	
チノー	3.8	4.7	5,889	
共和電業	13.2	14.9	7,077	
日本電子材料	4.3	5.2	3,281	
堀場製作所	19.8	26.1	159,732	
アドバンテスト	73.2	89.9	175,844	
小野測器	5.2	6.4	5,100	
エスパック	11.1	11.7	16,520	
パナソニック デバイスSUNX	9.4	—	—	
キーエンス	24.3	59.7	2,623,815	
日置電機	5.6	6.9	15,973	
シスメックス	83.3	102.5	691,875	
日本マイクロニクス	14	24.6	22,361	
メガチップス	11.2	12.3	38,130	
OBARA GROUP	7	7.7	36,806	
澤藤電機	6	8	4,616	
コーセル	14.9	18.3	26,974	
イリソ電子工業	—	4.2	29,526	

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
新日本無線	7.9	11.2	5,286	
オブテックスグループ	7.9	10	30,550	
千代田インテグレ	5.7	6.9	16,380	
アイ・オー・データ機器	—	4.1	4,428	
レーザーテック	12.6	14.5	42,543	
スタンレー電気	77	94	297,980	
岩崎電気	37	48	8,448	
ウシオ電機	65.2	80	113,600	
岡谷電機産業	5.8	7	2,912	
ヘリオス テクノ ホールディング	9.2	12.1	7,598	
日本セラミック	6.1	10.8	26,276	
遠藤照明	5.4	6.7	6,157	
日本デジタル研究所	9.1	—	—	
古河電池	8	9	6,840	
双信電機	5.2	6.4	1,952	
山一電機	9.3	12.4	19,269	
図研	7.8	8.6	11,438	
日本電子	42	48	26,112	
カシオ計算機	107.6	106	165,466	
ファナック	109.8	133.7	3,040,338	
日本シイエムケイ	23.1	28.4	19,936	
エンプラス	5.5	6	18,570	
大真空	20	4.8	6,811	
ローム	52.9	63.7	469,469	
浜松ホトニクス	83.8	102.9	333,910	
三井ハイテック	15.6	17.4	19,818	
新光電気工業	40.6	49.8	37,748	
京セラ	176.2	216.4	1,334,322	
太陽誘電	52.2	64.1	89,419	
村田製作所	112.6	138.3	2,156,097	
ユーシン	14.2	17.7	13,044	
双葉電子工業	18.4	21.6	44,668	
北陸電気工業	43	53	7,314	
ニチコン	33.8	41.5	44,031	
日本ケミコン	87	114	41,610	
KOA	14.8	18.2	26,717	
市光工業	26	28	15,988	
小糸製作所	64.3	79	457,410	
ミツバ	18.2	24.3	50,033	

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
スター精密	20.4	—	—	
SCREENホールディングス	110	27	212,490	
キヤノン電子	9.8	12.1	21,586	
キヤノン	578	709.8	2,456,617	
リコー	347.6	396.4	369,048	
MUTOHホールディングス	13	18	4,770	
東京エレクトロン	88.1	87.9	1,024,035	
輸送用機器 (9.2%)				
トヨタ紡織	37.5	46.1	117,370	
芦森工業	—	30	4,800	
鬼怒川ゴム工業	25	—	—	
ユニプレス	22.3	25.4	57,607	
豊田自動織機	97.8	120.1	656,947	
モリタホールディングス	18.8	23	38,939	
三櫻工業	13.6	16.7	13,927	
デンソー	265.2	325.1	1,634,602	
東海理化電機製作所	31.4	34.7	78,630	
三井造船	415	476	86,156	
川崎重工業	835	1,026	346,788	
名村造船所	32.2	39.6	26,967	
サノヤスホールディングス	13.2	16	4,704	
日本車輛製造	44	48	14,592	
ニチユ三菱フォークリフト	12.5	15.7	11,162	
近畿車輛	16	2	5,002	
日産自動車	1,506.9	1,555.1	1,747,932	
いすゞ自動車	311.1	382.1	571,812	
トヨタ自動車	1,335.2	1,603	9,871,274	
日野自動車	153.2	188.2	260,657	
三菱自動車工業	426.3	483.2	324,710	
エフテック	5.6	7	9,989	
レシップホールディングス	3.5	4.3	3,698	
GMB	1.7	2.1	3,244	
ファルテック	1.9	2.3	3,314	
武蔵精密工業	11.4	15.3	43,803	
日産車体	52.4	57.9	60,158	
新明和工業	47	53	58,671	
極東開発工業	21.4	26.2	48,496	
日信工業	24	29.5	58,233	
トビー工業	88	10.8	31,968	

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
ティラド	42	51	17,340	
曙ブレーキ工業	54.4	61.2	21,542	
タチエス	17	22.4	49,011	
NOK	51.9	63.8	164,093	
フタバ産業	32.7	40.2	31,918	
KYB	120	148	86,432	
シロキ工業	27	—	—	
大同メタル工業	15	16.6	16,865	
プレス工業	57	70	38,500	
ミクニ	10.3	16.7	7,865	
カルソニックカンセイ	82	40	51,200	
太平洋工業	23.8	27.1	40,189	
ケーヒン	24.7	30.3	55,236	
河西工業	13.2	17.8	25,258	
アイシン精機	108	120.6	654,858	
富士機工	12.5	13.1	7,322	
マツダ	339.9	417.5	650,673	
ダイハツ工業	128.1	—	—	
今仙電機製作所	9.8	12.1	12,136	
本田技研工業	966.1	1,186.5	4,022,235	
スズキ	224.4	261.3	1,212,170	
富士重工業	339.2	409.4	1,684,271	
安永	3.6	4.8	8,136	
ヤマハ発動機	151.6	186.2	489,147	
ショーワ	27.9	34.2	32,045	
TBK	12.9	16.9	8,669	
エクセディ	14.6	17.9	57,996	
豊田合成	39	42.6	122,347	
愛三工業	18.8	23.1	21,945	
盟和産業	1.3	2	2,558	
ヨロズ	10	12.3	21,586	
エフ・シー・シー	17.5	21.6	48,470	
シマノ	43.3	53.1	900,045	
タカタ	19.4	23.8	10,971	
ティ・エス テック	24.9	30.6	91,953	
ジャムコ	4.7	7.7	18,872	
精密機器 (1.6%)				
テルモ	164.6	202.1	784,148	
クリエートメディック	3.5	4.4	4,228	

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
日機装	38.6	45.6	54,811	
島津製作所	138	169.7	304,272	
JMS	20	24	8,184	
クボテック	2.3	2.8	1,534	
モリテックス	2.3	—	—	
長野計器	6.5	10.3	7,591	
ブイ・テクノロジー	2.6	2.7	45,306	
東京計器	34	45	10,440	
愛知時計電機	14	1.7	6,358	
オーバル	10.6	12.9	3,483	
東京精密	20.7	25.5	90,652	
マニー	9.8	17.5	45,255	
ニコン	200.4	229.8	375,493	
トプコン	36	66.4	138,444	
オリンパス	159.9	210.4	894,200	
理研計器	8.7	11.6	19,430	
タムロン	8.7	11.7	23,470	
HOYA	249.8	271.3	1,465,291	
ノーリツ鋼機	9.7	13.3	11,743	
エー・アンド・デイ	9.8	12	5,664	
シチズン時計	132.1	144.3	105,194	
リズム時計工業	47	53	9,964	
大研医器	8.5	11.7	9,594	
メニコン	5.4	9	31,590	
松風	5.2	6.9	9,356	
セイコーホールディングス	69	93	43,989	
ニプロ	80	91.3	144,345	
その他製品 (1.9%)				
スノーピーク	0.9	2	6,210	
パラマウントベッドホールディングス	11.3	12.6	57,645	
トランザクション	1.6	5.8	6,090	
SHO-BI	3.6	4.4	2,019	
ニホンフラッシュ	3.1	6.2	8,568	
前田工織	11.8	13.2	18,585	
永大産業	15	17	8,976	
アートネイチャー	8.6	14.1	10,998	
ダンロップスポーツ	6.8	8.3	8,698	
パンダイナムコホールディングス	111	145.4	501,630	
アイフィスジャパン	1.8	2.9	1,252	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
共立印刷	17.8	21.9	7,818
SHOEI	5.2	5.9	17,481
フランスベッドホールディングス	15	16.5	15,856
パイロットコーポレーション	18.7	23	103,845
萩原工業	2.2	3.7	9,812
トッパン・フォームズ	19.2	23.5	25,474
フジシールインターナショナル	13	29.6	71,602
タカラトミー	35.3	51.2	59,443
廣済堂	10.1	13.3	5,147
Asmeエステール	2.9	3.5	2,516
アーク	45.6	55.5	5,605
タカノ	4.7	5.8	5,834
プロネクス	10	12.3	15,633
ホクシン	8.6	9.3	1,860
ウッドワン	20	22	6,600
大建工業	42	9.3	19,641
凸版印刷	303	372	425,568
大日本印刷	318	380	458,280
図書印刷	20	18	9,126
共同印刷	36	41	15,170
日本写真印刷	18	22.1	61,504
光村印刷	11	12	3,216
宝印刷	5.2	6.9	11,488
アシックス	100	131	234,883
ツツミ	5.4	4.9	10,206
小松ウオール工業	3.6	4.5	8,563
ヤマハ	78.9	88.8	276,168
河合楽器製作所	4	5.2	12,376
クリナップ	12.6	15.5	12,958
ビジョン	60.8	79.7	284,529
兼松サステック	11	14	3,388
キングジム	8.9	11	9,570
リンテック	25.5	31.3	75,213
TASAKI	2	3.6	7,833
イトーキ	22.6	27.8	19,682
任天堂	66.1	81.2	2,183,062
三菱鉛筆	8	10.9	59,841
タカラスタンダード	44	27.2	49,449
コクヨ	55.8	68.5	98,914

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ナカバヤシ	22	24	6,792
グローブライド	5.2	6.4	12,345
岡村製作所	37.5	46	45,862
美津濃	58	71	42,245
アデランス	18.6	—	—
電気・ガス業 (1.8%)			
東京電力ホールディングス	910.7	1,118.4	466,372
中部電力	328.5	434.4	641,608
関西電力	438.1	538	688,371
中国電力	148.4	182.3	232,614
北陸電力	105.2	129.2	140,957
東北電力	268.2	329.4	491,794
四国電力	96.7	118.7	140,778
九州電力	237.1	291.2	346,528
北海道電力	100.5	123.4	101,188
沖縄電力	11.4	19.4	51,235
電源開発	91.5	104.9	270,642
エフオン	—	4.9	4,385
イーレックス	2.1	16.6	19,936
東京瓦斯	1,198	1,414	720,998
大阪瓦斯	1,111	1,279	560,202
東邦瓦斯	271	330	263,010
北海道瓦斯	26	32	8,992
広島ガス	18.7	27.1	10,216
西部瓦斯	121	148	38,480
静岡ガス	30.5	40.6	31,302
メタウォーター	6.9	7.4	21,356
陸運業 (4.2%)			
SBSホールディングス	10.6	13	10,608
東武鉄道	574	705	415,245
相鉄ホールディングス	184	211	111,619
東京急行電鉄	625	716	582,824
京浜急行電鉄	294	361	463,163
小田急電鉄	344	211.2	472,243
京王電鉄	300	368	337,456
京成電鉄	161	98.8	259,745
富士急行	29	36	36,180
新京成電鉄	14	17	7,089
東日本旅客鉄道	196.3	255.1	2,490,796

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
西日本旅客鉄道	103.3	126.9	945,405	
東海旅客鉄道	96.1	109.6	2,031,436	
西武ホールディングス	85.5	182.1	343,804	
鴻池運輸	15.2	18.6	25,500	
西日本鉄道	139	158	76,156	
ハマキョウレックス	8.2	8.6	19,685	
サカイ引越センター	4.2	4.5	14,377	
近鉄グループホールディングス	1,080	1,327	554,686	
阪急阪神ホールディングス	720	166.6	623,917	
南海電気鉄道	241	279	158,472	
京阪ホールディングス	241	295	207,680	
神戸電鉄	26	32	12,544	
名古屋鉄道	391	480	247,680	
山陽電気鉄道	39	48	28,800	
日本通運	415	510	297,330	
ヤマトホールディングス	198.4	235.8	565,684	
山九	141	174	120,756	
丸運	5.8	7.1	1,838	
丸全昭和運輸	36	44	19,492	
センコー	48	62.6	46,073	
トナミホールディングス	22	27	10,773	
ニッコンホールディングス	35.1	44.7	107,369	
日本石油輸送	12	1.5	3,903	
福山通運	65	80	54,720	
セイノーホールディングス	76.1	93.5	118,090	
神奈川中央交通	13	15	11,040	
日立物流	22.4	27.5	65,340	
丸和運輸機関	2.4	3.3	8,490	
C&F ロジホールディングス	10.3	13.7	21,098	
九州旅客鉄道	—	98.3	354,863	
海運業 (0.2%)				
日本郵船	964	1,114	261,790	
商船三井	523	691	241,850	
川崎汽船	470	500	151,000	
NSユナイテッド海運	48	59	14,691	
明治海運	9.7	11.8	5,664	
飯野海運	55.5	68.2	32,804	
共栄タンカー	9	11	2,662	
乾汽船	8.5	9.6	8,928	

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
空運業 (0.6%)				
日本航空	205.5	237.6	862,250	
ANAホールディングス	1,993	2,447	853,758	
バスコ	10	12	4,332	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
トランコム	3.1	3.8	20,938	
日新	44	54	20,304	
三菱倉庫	76	86	135,450	
三井倉庫ホールディングス	62	76	25,156	
住友倉庫	78	96	60,960	
澁澤倉庫	28	34	12,444	
東陽倉庫	18	22.5	6,840	
日本トランスシティ	25	30	14,580	
ケイヒン	20	24	3,960	
中央倉庫	6.2	7.6	8,580	
安田倉庫	8.3	10.3	7,992	
東洋埠頭	31	38	6,992	
宇徳	8.8	10.7	4,665	
上組	128	157	157,314	
サンリツ	2.6	3.2	1,680	
キムラユニティ	2.7	3.3	3,940	
キューソー流通システム	3	4.2	11,709	
郵船ロジスティクス	9.9	12.1	13,552	
近鉄エクスプレス	19.2	23.6	40,143	
東海運	5.8	7.1	3,294	
ユーアיתי	4.9	8.1	8,059	
内外トランスライン	2.7	3.9	4,325	
情報・通信業 (7.8%)				
NEC ネットエスアイ	13.3	14.3	31,188	
システナ	10.3	10.4	17,825	
デジタルアーツ	5.2	5.8	17,661	
新日鉄住金ソリューションズ	17.7	21.7	51,168	
キューブシステム	4.6	5.6	3,847	
コア	4.5	5.5	7,513	
ソフトクリエイトホールディングス	3.8	6.2	8,066	
T I S	35.1	43.1	124,128	
ネオス	3.1	3.9	1,762	
電算システム	3.7	4.5	7,222	
グリー	64.3	79.2	58,924	

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
コーエーテックモホールディングス	25.1	30.9	67,300	
三菱総合研究所	4.1	5	16,325	
ボルテージ	2.1	2.3	2,789	
電算	1.2	1.4	3,438	
AGS	1.8	3.3	5,854	
ファインデックス	7	9.6	9,580	
ヒト・コミュニケーションズ	2.4	2.9	5,295	
ブレインパッド	1.6	2.8	3,105	
KL a b	16.4	24.9	20,841	
ポルトゥワイン・ピットクルーホールディ	7	9.4	11,110	
イーブックイニシアティブジャパン	2.3	2	2,206	
ネクソン	101.3	142.4	243,504	
アイスタイル	16.1	27.4	24,851	
エムアップ	2.7	3.7	3,285	
エイチーム	3.9	7.2	19,087	
テクノスジャパン	1.1	10	10,620	
e n i s h	3.1	3.8	2,124	
コロブラ	29.4	36.5	37,668	
モバイルクリエイト	7	9.5	3,486	
オルトプラス	3.9	5.4	4,833	
ブロードリーフ	10.9	32.1	22,951	
ハーツユナイテッドグループ	3.2	6.8	10,540	
メディアドゥ	—	2.8	6,731	
ブイキューブ	5.2	7.1	4,338	
サイバーリンクス	1.2	2	2,028	
ディー・エル・イー	—	4.3	2,592	
フィックスターズ	—	1.9	6,232	
VOYAGE GROUP	2.4	4.4	7,686	
オブティム	0.7	1.4	7,896	
セレス	—	2.3	3,417	
ベリサーブ	1.2	1.5	4,234	
ティーガイア	10.5	12.9	25,503	
日本アジアグループ	9	14.7	5,821	
豆蔵ホールディングス	8.3	9.5	8,170	
テクマトリックス	4.5	8.1	10,570	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	185.1	272.8	67,381	
GMOペイメントゲートウェイ	9.2	10.6	59,890	
ザッパラス	6	6.7	3,329	
システムリサーチ	—	1.3	2,719	

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
インターネットイニシアティブ	17.1	19.1	38,257	
さくらインターネット	5.2	10.6	9,752	
GMOクラウド	2.3	2.9	6,452	
SRAホールディングス	6.1	6.9	20,417	
Minor iソリューションズ	1.5	2.9	3,906	
システムインテグレータ	1.5	1.8	1,236	
朝日ネット	9.6	11.8	6,029	
アドソル日進	—	2.6	3,200	
フリービット	—	7.2	6,357	
コムチュア	1.8	2.2	8,602	
サイバーコム	—	1.7	1,667	
メディカル・データ・ビジョン	—	2.2	8,239	
g u m i	10.9	14.7	17,007	
ショーケース・ティービー	—	1.5	1,842	
PCIホールディングス	—	1.5	3,972	
パイプドHD	1.3	2.3	2,589	
アイビーシー	—	1	993	
オープンドア	—	1.3	4,082	
LINE	—	21.8	89,162	
AOI TYO Holdings	—	10.6	8,829	
ソルクシーズ	—	3.7	2,094	
フェイス	2.8	3.4	4,294	
ハイマックス	1.4	1.7	2,590	
野村総合研究所	74.3	97.3	401,362	
サイバネットシステム	8.6	10.6	7,441	
CEホールディングス	1.6	2	2,180	
インテージホールディングス	5.5	7.4	15,303	
東邦システムサイエンス	3.1	4.3	2,975	
ソースネクスト	5.3	7.8	4,547	
ティー・ワイ・オー	14.7	—	—	
フォーカスシステムズ	—	5	3,000	
クレスコ	2.4	2.9	8,024	
フジ・メディア・ホールディングス	110.3	135.5	207,721	
オービック	36.5	44.9	238,868	
ジャストシステム	19.3	21	27,447	
TDCソフトウェアエンジニアリング	2.3	5.7	7,866	
ヤフー	759.4	932.7	478,475	
トレンドマイクロ	51.4	68.9	332,098	
インフォメーション・ディベロップメント	2	3.7	4,551	

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
日本オラクル	17	20.9	131,461	
アルファシステムズ	3.5	4.3	8,539	
フューチャー	12.7	17.6	15,188	
CAC Holdings	7.9	9.7	10,223	
ソフトバンク・テクノロジー	2.9	3.1	11,795	
トーセ	2.8	3.5	2,828	
オービックビジネスコンサルタント	5.4	6.6	36,498	
伊藤忠テクノソリューションズ	24	29.5	95,875	
アイティフォー	13.7	16.9	10,832	
東計電算	1.9	2.3	5,191	
エクスネット	1	1.2	2,432	
大塚商会	28.5	35	204,050	
サイボウズ	14.2	17.3	7,629	
ソフトブレーン	15.6	17.7	9,150	
電通国際情報サービス	6.5	8	19,792	
デジタルガレージ	—	18.9	43,110	
EMシステムズ	1.8	4.4	7,739	
ウェザーニューズ	3.6	4.4	15,818	
C I J	9.7	10.9	6,027	
東洋ビジネスエンジニアリング	1.1	1.3	2,173	
日本エンタープライズ	10.9	13.3	3,737	
WOWOW	5	6.2	24,614	
スカラ	6	9	7,920	
日本コロムビア	3.6	3.9	2,609	
イマジカ・ロボット ホールディングス	9	10.9	7,619	
ネットワンシステムズ	45.9	56.3	52,302	
システムソフト	—	23	3,450	
アルゴグラフィックス	4.8	5.9	14,502	
マーベラス	17.9	21.9	20,060	
エイベックス・グループ・ホールディングス	19.5	23.9	38,502	
日本ユニシス	29.2	35.9	54,065	
兼松エレクトロニクス	6.7	8.2	23,058	
東京放送ホールディングス	63.5	85.8	167,224	
日本テレビホールディングス	96.7	118.8	233,085	
朝日放送	10.5	12.8	10,355	
テレビ朝日ホールディングス	28.9	35.5	76,076	
スカパーJ SATホールディングス	80.4	84.6	40,692	
テレビ東京ホールディングス	9.6	10.6	27,019	
日本BS放送	1.8	2.9	3,079	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ビジョン	—	1.5	6,052	
U-NEXT	2.5	3.4	3,168	
ワイヤレスゲート	—	4.5	6,669	
コネクシオ	9.3	11.4	19,357	
日本通信	56.2	108.8	20,672	
クロップス	1.9	2.8	1,820	
日本電信電話	819	1,044.6	5,149,878	
KDDI	1,076.4	1,287.4	3,826,152	
光通信	12.7	15.6	170,664	
NTTドコモ	817.2	972.4	2,601,656	
エムティーアイ	13.6	19.9	13,551	
GMOインターネット	39.3	47.5	62,367	
カドカワ	33.1	37.7	60,433	
学研ホールディングス	35	43	13,416	
ゼンリン	14	17.2	38,270	
昭文社	5.8	7.1	5,062	
インプレスホールディングス	8.8	10.7	1,476	
アイネット	5.9	7.3	9,198	
松竹	70	86	111,800	
東宝	75.6	85.1	253,427	
東映	39	48	46,176	
AOI Pro.	5.3	—	—	
エス・ティ・ティ・データ	65.5	80.4	422,100	
ビー・シー・エー	1.3	1.9	3,171	
ビジネスブレイン太田昭和	1.6	2.2	2,314	
DTS	11.8	13.4	37,077	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	44.8	50.1	164,578	
シーイーシー	6.9	7.7	15,869	
カブコン	27.1	30.5	68,045	
アイ・エス・ビー	1.3	2.5	2,252	
ジャステック	6.7	8.2	8,519	
SCSK	25.2	35.4	156,114	
日本システムウエア	4	4.3	6,071	
アイネス	15	16.4	18,154	
TKC	9.8	12	38,280	
富士ソフト	15.7	19.3	54,792	
NSD	22.5	27.6	45,760	
コナミホールディングス	47.8	58.7	284,108	
福井コンピュータホールディングス	2.3	3.8	10,377	

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
JBCCHホールディングス	8.9	10.9		8,665
ミロク情報サービス	7.8	9.6		17,520
ソフトバンクグループ	600.3	585.8	4,605,559	
卸売業 (4.5%)				
ハウスイ	8	10		1,280
高千穂交易	4.1	5		5,175
伊藤忠食品	2.6	3.2		15,264
エレマテック	4.9	5.2		10,280
JALUX	3.4	4.2		11,277
あらた	4.8	5.8		17,806
トーメンデバイス	1.6	1.9		4,246
東京エレクトロン デバイス	3.8	4.7		7,750
フィールズ	6.9	9.9		12,345
双日	667.5	768.5		217,485
アルフレッサ ホールディングス	133.2	153.9		300,105
横浜冷凍	26.2	32.2		35,613
神栄	15	18		3,528
山下医科器械	0.9	1		1,829
ラサ商事	5	5.6		4,345
ラクーン	—	6.2		3,019
アルコニックス	6	7.4		13,083
神戸物産	6.8	7		30,450
あい ホールディングス	18.9	18.5		47,841
ディーブイエックス	2.8	4.6		6,118
ダイワボウホールディングス	96	110		37,180
マクニカ・富士エレホールディングス	19.1	24.1		38,945
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18.4	24.4		25,132
八洲電機	8.2	10		6,710
UKCホールディングス	6.8	8.4		17,102
OCHIホールディングス	3.1	3.8		5,445
TOKAIホールディングス	46.6	57.2		49,535
大阪工機	—	1.5		1,170
三洋貿易	5.8	7.1		12,559
ビューティガレージ	—	1.3		2,389
ウイン・パートナーズ	3.8	9.4		9,353
ミタチ産業	2.7	3		1,935
シップヘルスケアホールディングス	21.5	25		77,125
明治電機工業	3.3	4.4		5,825
デリカフーズ	2.2	2.7		2,975

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
スターティア	2	2.9		1,481
コメダホールディングス	—	17.6		31,451
富士興産	4.1	4.7		2,382
協栄産業	14	16		2,656
小野建	9.2	11.3		16,339
佐鳥電機	8.4	9.6		7,833
エコートレーディング	2.4	3		1,995
伯東	8	8.9		9,620
コンドレーテック	8.4	10.3		9,579
中山福	6.6	7.4		6,386
ナガイレーバン	15.3	18.8		42,995
三菱食品	11.6	14.3		50,765
松田産業	7.7	9.5		15,029
第一興商	18.7	21.2		96,566
メディopalホールディングス	106	130.1		227,024
アドヴァン	10.8	—		—
SPK	2.4	2.8		7,176
萩原電気	2.7	4.4		9,477
アズワン	8.3	10.2		50,133
スズデン	3.4	4.7		5,395
尾家産業	3.4	4.2		5,082
シモジマ	7.3	7.9		9,519
ドウシシャ	12.5	15.3		32,130
小津産業	2.3	2.8		6,280
高速	6.3	7.7		8,647
たけびし	3.7	4.5		6,817
黒田電気	19.7	17.8		44,802
リックス	—	2.9		4,895
丸文	9.4	11.5		8,349
ハビネット	9.6	10.8		18,856
橋本総業ホールディングス	2.2	2.7		4,028
日本ライフライン	—	11.1		23,598
エクセル	5.1	5.6		8,422
マルカキカイ	3.4	4.2		7,539
IDOM	28.5	35		24,185
日本エム・ディ・エム	8.8	9.8		7,448
進和	6.2	7.7		14,529
エスケイジャパン	2.6	2.4		744
ダイترون	4.8	5.9		6,584

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
シークス	6.7	9.3	40,734
田中商事	3.2	4	2,784
オーハシテクニカ	6	7.3	10,373
白銅	3	3.3	5,850
伊藤忠商事	831.5	953.1	1,526,389
丸紅	1,042.8	1,280.7	887,012
高島	20	22	4,576
長瀬産業	63.7	78.2	122,383
蝶理	6.7	8.3	16,292
豊田通商	118	144.9	483,241
三共生興	16.1	19.7	8,254
兼松	225	277	54,569
ツカモトコーポレーション	19	23	2,921
三井物産	958.1	1,176.8	1,914,653
日本紙バルブ商事	55	68	26,656
日立ハイテクノロジーズ	36.7	45.1	203,852
カメイ	13.8	16.9	21,412
東都水産	17	2	3,984
OUGホールディングス	15	20	5,300
スターゼン	3.8	5.4	25,542
山善	40.7	49.9	50,997
椿本興業	12	15	6,240
住友商事	667	819.2	1,223,475
内田洋行	26	6.4	16,518
三菱商事	795	976.4	2,365,329
第一実業	24	30	21,450
キャノンマーケティングジャパン	30.2	37.1	81,137
西華産業	35	42	15,498
佐藤商事	9.4	11.6	10,695
菱洋エレクトロ	12.2	12.4	20,571
東京産業	10.6	12.9	6,166
ユアサ商事	10	12.3	38,068
神鋼商事	24	3.3	8,170
小林産業	7.1	9.5	2,631
阪和興業	106	130	104,520
カナデン	10.1	12.4	13,776
菱電商事	17	21	15,687
フルサト工業	5.8	7.2	12,924
岩谷産業	126	144	94,608

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
すてきなイスグループ	45	55	8,580
昭光通商	38	46	3,910
ニチモウ	16	19	3,515
極東貿易	15	20	4,840
イワキ	16	20	6,040
三菱石油	27	34.9	32,875
稲畑産業	25.4	31.2	44,023
G S I クレオス	28	32	4,288
明和産業	9.8	12	4,944
ワキタ	22.5	27.7	29,417
東邦ホールディングス	33.9	41.7	98,120
サンゲツ	36.9	44.6	84,517
ミツウロコグループホールディングス	17	20.9	14,985
シナネンホールディングス	23	5.6	12,644
伊藤忠エネクス	27.3	28.7	26,432
サンリオ	32.7	40.1	85,493
サンワテクノス	6.7	7.7	8,855
リョーサン	16.8	19.3	67,260
新光商事	12.4	14.2	17,835
トーホー	4.8	5.9	15,511
三信電気	14.6	14.4	19,339
東陽テクニカ	15	16	16,176
モスフードサービス	13.9	17	56,780
加賀電子	9.6	11.8	23,529
ソーダニッカ	11	13.4	7,048
立花エレテック	7.8	8.8	12,267
フォーバル	4.2	5.7	3,853
PALTAC	16.9	20.8	65,416
三谷産業	11.3	13.8	5,285
太平洋興発	44	54	5,562
ヤマタネ	49	6.5	10,159
丸紅建材リース	9	13	3,107
日鉄住金物産	70	11.4	52,326
トラスコ中山	12.1	29.7	75,913
オートバックスセブン	40.6	48.2	81,554
モリト	—	10.4	9,599
加藤産業	16.5	20.3	59,763
イノテック	9.8	11.2	7,492
イエローハット	10	12.3	31,770

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
J Kホールディングス	10.6	13	8,723	
日伝	4.4	5.4	18,738	
北沢産業	8.8	10.7	2,332	
杉本商事	6.1	7.5	11,662	
因幡電機産業	14.8	18.3	74,481	
バイテックホールディングス	3.2	5.3	7,340	
ミスミグループ本社	119	146.3	290,551	
アルテック	9.1	11.1	2,331	
タキヒヨー	18	20	9,040	
蔵王産業	1.7	2.1	3,192	
スズケン	48.2	59.2	220,224	
ジェコス	7.3	8.9	9,790	
ルネサスイーストン	6.7	11.9	7,259	
小売業 (4.6%)				
ローソン	40.1	41.1	313,182	
サンエー	7.2	9.8	49,686	
ダイユーエイト	2.8	—	—	
カワチ薬品	8.2	10.1	30,956	
ユービーシー・マート	13.7	23.7	155,946	
ハードオフコーポレーション	5.1	5.7	6,703	
アスクル	12.9	13.6	42,976	
ゲオホールディングス	20.1	21.7	27,559	
アダストリア	19.5	20	56,220	
ジーフット	6.4	7.8	5,959	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	15	1.7	1,200	
くらコーポレーション	6.2	8.5	38,845	
キャンドウ	5.6	6.9	12,213	
パルグループホールディングス	6.2	6.6	17,298	
エディオン	44.8	50.4	54,180	
サーラコーポレーション	9.1	16.2	10,108	
ワッツ	4.2	5.6	7,274	
ハローズ	3.2	4.3	9,636	
あみやき亭	2.1	2.5	11,162	
ひらまつ	14.6	17.9	12,207	
ゲンキー	2.1	2.6	18,200	
サッポロドラッグストアー	1	—	—	
大黒天物産	2.5	3.1	15,484	
ハニースホールディングス	9.3	12.6	14,086	
ファーマライズホールディングス	2.4	3	1,581	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
アルペン	9.4	9.9	19,364	
クオール	10.8	14.7	23,446	
ジェイアイエス	7.2	8.8	51,392	
ビックカメラ	54.7	74.7	78,061	
DCMホールディングス	52.1	79	80,185	
MonotaRO	37.4	46.1	153,513	
東京一番フーズ	1.8	3.2	1,875	
ダイヤモンドダイニング	1.7	2.9	4,756	
きちり	2.8	3.5	2,303	
アークランドサービスホールディングス	3.3	4.1	12,320	
J. フロント リテイリング	134.1	164.6	274,882	
ドトール・日レスホールディングス	18.6	22.8	50,638	
マツモトキヨシホールディングス	21.9	24.6	132,594	
ブロンコビリー	4.1	6.8	19,876	
スタートトゥデイ	32.2	118.8	275,734	
トレジャー・ファクトリー	3	3.7	2,937	
物語コーポレーション	2.8	3.7	18,352	
ココカラファイン	11	13.6	63,172	
三越伊勢丹ホールディングス	210.7	258.9	329,579	
Hamee	—	2.9	2,897	
ウエルシアホールディングス	9.2	25.7	82,625	
クリエイトSDホールディングス	15.6	19.1	51,856	
丸善CHIホールディングス	12.4	15.2	5,411	
ミサワ	1.2	2.3	1,021	
ティーライフ	—	1.2	2,076	
エー・ピーカンパニー	1.7	2.1	1,902	
チムニー	2.6	4	11,204	
シュッピン	3	4.9	8,138	
ネクステージ	1.7	2.5	6,590	
ジョイフル本田	17.2	21.1	78,175	
鳥貴族	—	3.2	7,404	
キリン堂ホールディングス	3.4	4.2	3,452	
ホットランド	2.8	6	7,158	
すかいらく	32.4	55.8	95,920	
綿半ホールディングス	3	5.2	8,860	
ヨシックス	—	1.3	1,753	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	35.1	43.1	44,091	
ブックオフコーポレーション	6	7.4	5,979	
ゴルフダイジェスト・オンライン	2.2	5.2	4,076	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
BEENOS	—	1.5	2,182
あさひ	7.9	9.7	12,697
日本調剤	2.7	4.6	16,790
コスモス薬品	5.3	6.6	144,144
トーエル	5.1	6.3	5,966
一六堂	2.6	2.7	1,058
オンリー	—	1.5	1,290
セブン&アイ・ホールディングス	443.2	544.6	2,373,911
薬王堂	1.5	6.5	17,810
クリエイト・レストランツ・ホールディング	28.4	34.9	35,004
ツルハホールディングス	24.3	26	279,500
サンマルクホールディングス	8.4	8.4	28,812
フェリシモ	3	3.7	3,770
トリドールホールディングス	13	16	37,936
クスリのアオキ	9.4	—	—
サツドラホールディングス	—	1.7	3,564
ダイユー・リックホールディングス	—	4.2	3,053
パロックジャパンリミテッド	—	7.6	10,047
クスリのアオキホールディングス	—	10.3	52,839
メディカルシステムネットワーク	12.1	14.7	7,276
総合メディカル	5.1	6.3	26,995
はるやまホールディングス	4.4	6.1	6,411
ノジマ	—	15.1	21,245
カッパ・クリエイト	14.8	18.2	23,150
ライトオン	7.9	9.7	9,719
ジーンズメイト	3.4	4.1	1,016
良品計画	12.2	17.2	401,104
三城ホールディングス	13.2	16.1	7,744
アドヴァン	—	13.2	15,919
アルビス	2.8	3.4	11,951
コナカ	12.5	16.6	10,009
ハウス オブ ローゼ	1.3	1.6	2,537
G-7ホールディングス	3.1	3.8	9,427
イオン北海道	7.1	13	7,956
コジマ	15.7	19.1	5,653
ヒマラヤ	3.3	4	3,288
コーナン商事	15	18.5	39,109
エコス	3.9	5	5,955
ワタミ	12.5	15.4	20,035

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マルシェ	2.6	2.9	2,453
ドンキホーテホールディングス	68.5	84.2	325,433
西松屋チェーン	20.9	22.8	28,682
ゼンショーホールディングス	54.5	67.4	127,992
幸楽苑ホールディングス	6.7	8.2	14,661
ハークスレイ	2.9	3.2	3,756
サイゼリヤ	17.4	21.4	60,283
V Tホールディングス	35.8	44	26,444
魚力	3.3	4	5,304
ポブラ	2.7	3.2	1,699
フジ・コーポレーション	—	1.9	4,377
ユナイテッドアローズ	15.1	17.3	55,619
ハイデイ日高	9.6	14.2	33,767
京都市もの友禅	7.2	8.2	8,241
コロワイド	35.1	43.1	80,467
ピーシーデポコーポレーション	8.8	17.2	9,081
巻番屋	4.8	9.1	34,398
トップカルチャー	3.8	4.7	2,270
PLANT	2.4	2.9	3,419
スギホールディングス	19	28.5	149,625
ヴィア・ホールディングス	—	9.9	11,741
スクロール	16	19.7	7,052
ヨンドシーホールディングス	8.1	9.9	24,561
ユニー・ファミリーマートホールディングス	32.6	57.1	387,709
木曽路	13	15.9	40,910
サトレストランシステムズ	12.5	15.3	13,571
千趣会	20.9	23.5	19,058
タカキュー	8.2	10	1,970
ケーヨー	17.8	21.9	12,373
上新電機	25	31	35,464
日本瓦斯	12.1	23.9	76,599
ベスト電器	34.4	41.9	6,075
ロイヤルホールディングス	17.6	21.4	47,957
東天紅	8	11	1,804
いなげや	11.8	14.5	23,214
島忠	27.4	33.7	93,247
チヨダ	12.5	15.3	40,193
ライフコーポレーション	6.7	9.8	30,870
リンガーハット	9.6	14.6	33,288

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
さが美	8	12	1,524
MrMax	9.3	16.2	6,512
テンアライド	9.8	12	4,836
AOKIホールディングス	24.2	26	35,048
オークワ	17	19	21,147
コメリ	16.3	20	56,280
青山商事	20.3	27.2	111,248
しまむら	12.3	15.1	223,933
はせがわ	3.8	6.9	3,098
高島屋	154	218	215,602
松屋	21.3	28.4	29,166
エイチ・ツー・オー リテイリング	54.3	66.6	121,744
近鉄百貨店	40	50	16,950
丸栄	22	27	2,295
ニッセンホールディングス	15.7	—	—
バルコ	10.1	12.5	15,550
丸井グループ	130	136.9	211,784
アクシアル リテイリング	8.2	10.1	43,884
井筒屋	57	7	2,842
イオン	436	535.4	866,544
ユニグループ・ホールディングス	101.4	—	—
イズミ	21	25.8	130,290
東武ストア	13	1.6	4,824
平和堂	21.5	26.4	71,438
フジ	11.8	14.5	34,887
ヤオコー	12	14.7	63,945
ゼビオホールディングス	14.4	17.7	30,886
ケーズホールディングス	22.4	60	122,700
Olympicグループ	6.2	7.6	4,598
日産東京販売ホールディングス	17.9	19.1	7,525
アインホールディングス	12.8	17	131,240
元気寿司	3	3.3	7,474
ヤマダ電機	322.2	435.2	250,675
アークランドサカモト	17.9	22	30,800
ニトリホールディングス	45.8	56.2	749,708
グルメ杵屋	8	9	10,008
愛眼	8.5	9.5	1,909
ケーユーホールディングス	5.5	6.8	6,283
吉野家ホールディングス	39.1	45.3	73,567

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
松屋フーズ	5.1	6.2	27,900
サガミチェーン	14.1	16.3	23,798
関西スーパーマーケット	8.6	10.6	16,631
王将フードサービス	7.8	9.5	40,897
プレナス	11.8	14.5	36,685
ミニストップ	7.8	9.6	20,659
アークス	19.8	24.4	64,489
パローホールディングス	22.8	28	74,928
藤久	0.8	1	1,736
ベルク	5.2	5.8	25,810
大庄	4.9	6.9	10,853
ファーストリテイリング	21.2	21.7	754,943
サンドラッグ	22.4	24.7	189,202
サックスパー ホールディングス	10	12.2	15,250
ヤマザワ	2.2	2.7	4,878
やまや	2.2	2.7	4,549
ペルーナ	26.4	32.4	27,540
銀行業 (8.2%)			
島根銀行	2.2	2.7	3,936
じもとホールディングス	76	93.4	18,213
めぶきフィナンシャルグループ	77.8	627.5	283,630
東京TYフィナンシャルグループ	14.6	18.8	64,954
九州フィナンシャルグループ	162.2	213.4	148,953
ゆうちょ銀行	203.6	368.5	518,111
富山第一銀行	—	33.1	17,609
コンコルディア・フィナンシャルグループ	—	851.9	451,336
西日本フィナンシャルホールディングス	—	88.2	100,989
新生銀行	917	1,239	249,039
あおぞら銀行	670	823	343,191
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,501.4	9,861	6,948,060
りそなホールディングス	1,239.5	1,522.4	919,681
三井住友トラスト・ホールディングス	2,212	271.7	1,054,467
三井住友フィナンシャルグループ	848.4	1,042	4,327,426
第四銀行	134	159	72,186
北越銀行	114	14.1	39,931
西日本シティ銀行	345	—	—
千葉銀行	409	502	364,954
横浜銀行	711	—	—
常陽銀行	383	—	—

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
群馬銀行	235	289.2	172,363	
武蔵野銀行	16.9	20.8	70,304	
千葉興業銀行	29	35.7	21,669	
筑波銀行	44	54.1	17,095	
七十七銀行	166	204	99,552	
青森銀行	78	101	39,188	
秋田銀行	69	83	28,469	
山形銀行	60	73	35,040	
岩手銀行	7.4	8.5	39,610	
東邦銀行	95	116	48,140	
東北銀行	54	66	10,362	
みちのく銀行	53	78	14,976	
ふくおかフィナンシャルグループ	459	528	260,832	
静岡銀行	310	354	324,972	
十六銀行	133	175	63,875	
スルガ銀行	100.6	133	314,545	
八十二銀行	192	251.1	164,219	
山梨中央銀行	66	81	41,553	
大垣共立銀行	141	201	67,938	
福井銀行	91	111	29,304	
北國銀行	118	138	58,650	
清水銀行	3.6	4.4	14,718	
富山銀行	2	2.5	10,187	
滋賀銀行	100	122	70,638	
南都銀行	102	12.6	52,920	
百五銀行	95	117	53,118	
京都銀行	202	233	195,487	
紀陽銀行	41.6	48.9	85,086	
三重銀行	47	5.8	13,786	
ほくほくフィナンシャルグループ	721	86.6	154,754	
広島銀行	313	384	184,320	
山陰合同銀行	64.2	78.2	72,100	
中国銀行	75.1	92.2	151,484	
鳥取銀行	34	4.1	7,273	
伊予銀行	113.3	139.2	107,323	
百十四銀行	116	143	54,769	
四国銀行	82	100	29,500	
阿波銀行	87	111	79,698	
大分銀行	61	75	32,925	

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
宮崎銀行	71	87	30,102	
佐賀銀行	64	79	23,463	
十八銀行	65	80	29,040	
沖縄銀行	8.4	12.7	53,022	
琉球銀行	21.8	26.8	42,799	
セブン銀行	397	487.8	179,022	
みずほフィナンシャルグループ	14,934.3	17,667.9	3,676,689	
高知銀行	41	47	6,204	
山口フィナンシャルグループ	99	122	150,426	
長野銀行	35	4.3	8,608	
名古屋銀行	89	10.9	43,600	
北洋銀行	159.6	212.4	91,332	
愛知銀行	3.6	4.4	28,028	
第三銀行	60	7.4	12,668	
中京銀行	43	5.3	12,386	
東日本銀行	51	—	—	
大光銀行	38	45	10,035	
愛媛銀行	62	15.5	21,328	
トマト銀行	41	5	7,880	
みなと銀行	96	11.8	25,027	
京葉銀行	87	106	51,940	
関西アーバン銀行	14.8	18.1	26,353	
栃木銀行	57	71.8	37,407	
北日本銀行	3.3	4.1	13,407	
東和銀行	149	244	29,036	
福島銀行	130	141	13,395	
大東銀行	64	68	11,968	
トモニホールディングス	81.3	107.2	63,462	
フィデアホールディングス	64.8	126.3	26,396	
池田泉州ホールディングス	112.4	138.1	65,597	
証券、商品先物取引業 (1.2%)				
F P G	31.4	46.4	45,889	
S B I ホールディングス	127.3	147.1	236,831	
日本アジア投資	7.2	12.4	5,257	
ジャフコ	17.7	21.7	83,002	
大和証券グループ本社	991	1,218	847,728	
野村ホールディングス	2,038.7	2,660.4	1,852,702	
岡三証券グループ	90	111	79,809	
丸三証券	31.5	41.4	41,607	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東洋証券	41	46	12,098	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	121.6	149.3	91,222	
光世証券	25	31	5,890	
水戸証券	32.8	40.3	12,412	
いちよし証券	23.7	29.1	25,317	
松井証券	53.9	74.3	67,167	
だいに証券ビジネス	5.1	6.3	4,044	
マネックスグループ	124.7	139.6	38,390	
カブドットコム証券	93.9	97.9	36,614	
極東証券	14.2	17.4	29,562	
岩井コスモホールディングス	10	12.3	14,538	
藍澤証券	14.9	24.3	16,110	
マネースクウェアHD	3.6	—	—	
マネーパートナーズグループ	9.8	16.6	7,851	
小林洋行	3.1	3.7	1,102	
保険業 (2.7%)				
かんぽ生命保険	32.3	49.1	130,606	
SOMPOホールディングス	235.4	272.1	1,129,759	
アニコム ホールディングス	7.2	8.8	19,967	
MS&ADインシュアランスグループホール	316.6	388.9	1,420,262	
ソニーフィナンシャルホールディングス	101.5	124.7	232,066	
第一生命ホールディングス	678.9	784.7	1,587,840	
東京海上ホールディングス	429.3	527.2	2,521,070	
T&Dホールディングス	386.2	474.3	782,120	
アドバンスクリエイト	—	3	5,817	
その他金融業 (1.2%)				
全国保証	27.5	36.6	143,472	
クレディセゾン	80.4	98.7	199,768	
アクリーティブ	8.8	10.7	3,873	
芙蓉総合リース	12.1	14.9	76,586	
興銀リース	19.9	24.4	59,755	
東京センチュリー	24.9	26.2	102,049	
日本証券金融	46.7	57.3	34,781	
アイフル	177.4	218.2	70,478	
ポケットカード	10.6	9.7	5,936	
リコーリース	8.3	10.2	37,689	
イオンフィナンシャルサービス	69.5	83.1	181,158	
アコム	212.8	264.4	117,922	
ジャックス	58	72	34,560	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
オリエントコーポレーション	458.1	281.4	56,842	
日立キャピタル	25	30.7	84,946	
アブラスフィナンシャル	50.8	62.4	6,739	
オリックス	750.3	921.5	1,549,041	
三菱UFJリース	268.8	330.1	184,195	
日本取引所グループ	311.1	404.6	653,833	
イー・ギャランティ	3.4	3.8	9,446	
アサックス	1.8	2.3	3,744	
NECキャピタルソリューション	4.3	5.3	9,237	
不動産業 (2.4%)				
いちご	87.9	123.7	41,563	
日本駐車場開発	115.8	156.9	23,221	
ヒューリック	220.9	271.4	290,669	
三栄建築設計	4.2	5.2	7,893	
野村不動産ホールディングス	70.3	86.4	158,976	
三重交通グループホールディングス	18.8	23.1	9,101	
サムティ	5.7	10.4	11,492	
ディア・ライフ	5.4	8.9	3,542	
エー・ディー・ワークス	73.4	119.3	4,772	
日本商業開発	3.5	7.2	13,795	
プレサンスコーポレーション	3.6	20.2	28,320	
ユニゾホールディングス	6.6	10.7	30,805	
THEグローバル社	—	4.5	2,137	
日本管理センター	6.9	9.3	12,824	
サンセイランディック	2.4	2.7	2,114	
エストラスト	1.9	2.3	1,508	
フージャースホールディングス	14.7	16.8	10,466	
オープンハウス	15.3	18.8	51,474	
東急不動産ホールディングス	256.3	314.8	193,602	
飯田グループホールディングス	98.1	108.5	195,083	
ムゲンエステート	—	4.5	3,627	
ファーストブラザーズ	—	1.3	2,285	
ハウスドゥ	—	1.6	2,585	
シーアールイー	—	1.8	2,818	
ケイアイスター不動産	—	2.6	4,206	
エコナックホールディングス	34	49	3,038	
パーク24	53.5	66	193,314	
バラカ	3.7	3.7	8,125	
三井不動産	562	690	1,651,170	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
三菱地所	788	968	2,001,824	
平和不動産	20	24.6	38,031	
東京建物	115.7	151	222,272	
ダイビル	27.3	33.5	33,768	
京阪神ビルディング	17.5	21.6	13,478	
住友不動産	254	312	911,040	
大京	197	242	56,144	
テーオーシー	41.1	50.4	47,577	
東京楽天地	17	21	11,193	
レオパレス21	124.8	164.2	96,057	
スターツコーポレーション	12.1	13.3	31,547	
フジ住宅	13.5	16.6	12,632	
空港施設	12.8	15.7	9,184	
明和地所	5.8	7.1	5,545	
住友不動産販売	7.6	11.7	41,944	
ゴールドクレスト	8.3	11.7	23,388	
日本エスリード	4.1	5.1	8,058	
日神不動産	14.2	15.4	9,009	
日本エスコン	—	17.3	7,041	
タカラレーベン	46.2	56.7	29,030	
サンヨーハウジング名古屋	6	6.7	6,525	
イオンモール	68.4	83.8	144,555	
ファースト住建	3.9	4.8	7,238	
ランド	49.9	123.4	2,221	
トーセイ	16.1	17.8	13,296	
穴吹興産	12	1.4	3,847	
エヌ・ティ・ティ都市開発	65.8	80.8	80,153	
サンフロンティア不動産	12.8	14	14,028	
エフ・ジェー・ネクスト	9.2	11.3	11,831	
インテリックス	—	3	2,439	
ランドビジネス	7.2	7.7	2,233	
グランディハウス	9.3	11.4	4,959	
日本空港ビルデング	33.8	41.5	169,320	
サービス業 (3.7%)				
日本工営	38	9.2	27,563	
ネクスト	31.7	34	25,738	
ジェイエイシーリクルートメント	5.2	8.5	15,062	
日本M&Aセンター	17.3	39.7	145,699	
ノバレーゼ	2.9	—	—	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
アコーディア・ゴルフ	31.1	—	—	
中広	1.1	1.3	904	
タケエイ	9.8	12.1	12,584	
トラスト・テック	2.3	5.6	9,979	
コシダカホールディングス	—	4.7	11,284	
パソナグループ	9.7	10.2	8,109	
CDS	2.5	3.1	3,196	
リンクアンドモチベーション	22.8	32.4	19,796	
GCA	9.9	12.2	11,394	
エス・エム・エス	14	19.5	53,196	
テンブホールディングス	78.6	106.6	216,824	
リニカル	6.6	8.1	12,117	
クックパッド	25	30.7	29,072	
エスクリ	4.7	4.9	3,885	
アイ・ケイ・ケイ	6	6.1	4,867	
学情	4.1	5.7	6,817	
スタジオアリス	5.2	5.6	12,992	
シミックホールディングス	5	7	9,828	
NJS	2.3	3.1	4,185	
総合警備保障	37.4	50.1	211,672	
カカコム	81.3	98.2	150,933	
アイロムグループ	3.2	4.2	5,493	
セントケア・ホールディング	—	1.8	3,036	
サイネックス	—	1	1,132	
ルネサンス	5.7	7	13,181	
ディップ	12.4	17.8	42,186	
オプトホールディング	7	9.9	10,404	
新日本科学	10.7	15.3	8,812	
ツクイ	13.3	32.6	21,483	
キャリアデザインセンター	3.1	2.9	3,297	
エムスリー	97.1	119.3	321,513	
ツカダ・グローバルホールディング	8.2	10	6,130	
アウトソーシング	5.2	8.1	33,048	
ウエルネット	4.2	10.3	13,884	
ワールドホールディングス	—	3.1	6,646	
ディー・エヌ・エー	50.3	61.7	143,761	
博報堂DYホールディングス	155.4	190.9	254,660	
ぐるなび	13	19.9	45,491	
エスアールジータカミヤ	9.1	14.8	8,376	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ジャパンベストレスキューシステム	12.8	17	4,386	
ファンコミュニケーションズ	25.9	35	28,770	
ライク	2.3	2.5	6,475	
ビジネス・ブレイクスルー	—	4.4	1,878	
WDBホールディングス	4	4.9	6,698	
ティア	4.7	6.6	5,141	
バリューコマース	10.4	12.7	5,384	
インフォマート	16.2	58.4	37,376	
J Pホールディングス	27.8	39.6	11,761	
E P Sホールディングス	12.5	17.1	26,727	
レッグス	1.6	3.1	2,325	
ブレステージ・インターナショナル	9.4	19.5	19,071	
アミューズ	3.1	7.6	17,632	
ドリームインキュベータ	3.7	4.2	8,950	
クイック	5.7	7	8,302	
T A C	6.2	7.6	1,748	
ケネディクス	150.5	174.6	78,046	
電通	125	153.5	924,070	
テイクアンドグヴ・ニーズ	5.3	6.4	6,073	
びあ	3.3	4.2	12,936	
イオンファンタジー	3.9	4	10,864	
シーティーエス	2.5	7.3	5,058	
ネクシィーズグループ	4	4.9	8,173	
みらかホールディングス	28.6	35.2	183,392	
アルプス技研	4.1	5.5	20,900	
サニックス	18.1	22	4,136	
ダイオーズ	2	2.5	2,670	
日本空調サービス	5.5	13.2	8,844	
オリエンタルランド	121.2	148.9	942,388	
ダスキン	31.7	35.3	87,791	
明光ネットワークジャパン	13	17.1	21,272	
ファルコホールディングス	4.9	6.5	10,348	
秀英予備校	2	2.7	1,382	
田谷	1.9	2.3	1,564	
ラウンドワン	35	43	38,012	
リゾートトラスト	47	53.3	107,292	
ビー・エム・エル	6.6	18	45,216	
ワタベウェディング	3.3	2	1,180	
りらいあコミュニケーションズ	18.5	22.8	25,102	

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
リソー教育	20.8	23.4	15,093	
早稲田アカデミー	1.5	1.8	2,332	
ユー・エス・エス	135.7	166.7	317,063	
東京個別指導学院	5.4	4.4	7,229	
サイバーエージェント	27.4	72.5	238,887	
楽天	524.6	703.7	755,070	
クリーク・アンド・リバー社	—	4.9	4,723	
テー・オー・ダブリュー	6.7	11	7,843	
セントラルスポーツ	3.8	4.7	17,037	
フルキャストホールディングス	10.3	14.2	15,151	
リソルホールディングス	11	14	5,166	
テクノプロ・ホールディングス	18.2	22.4	93,184	
アトラ	—	1.6	1,081	
インターワークス	1.5	2.8	3,049	
K e e P e r 技研	—	1.5	2,863	
ファーストロジック	—	0.7	1,856	
デザインワン・ジャパン	—	1.8	2,703	
イー・ガーディアン	—	4.5	7,537	
リブセンス	7.6	9.2	4,692	
ジャパンマテリアル	4.7	10	17,030	
バクトル	3.5	11.2	14,884	
ウチヤマホールディングス	5.8	6.2	2,839	
サクセスホールディングス	1	1.3	1,791	
キャリアリンク	1.5	3.1	2,083	
I B J	6.6	10.7	6,206	
アサンテ	4.1	5.1	8,496	
N・フィールド	4	6.5	9,243	
バリューHR	—	1	2,617	
M&Aキャピタルパートナーズ	0.9	1.8	9,198	
ライドオン・エクスプレス	1.8	3.4	3,114	
E R Iホールディングス	2.9	3.5	2,933	
アピスト	1.2	2.1	8,095	
ウィルグループ	2.5	5.5	4,554	
エスクロー・エージェント・ジャパン	—	2.3	3,385	
日本ビューホテル	1.2	2.8	3,827	
リクルートホールディングス	226.1	300.9	1,700,085	
エラン	0.9	1.8	3,493	
土木管理総合試験所	—	1.4	949	
日本郵政	247.3	359.4	514,301	

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
ベルシステム24ホールディングス	16.4	21	20,601	
一蔵	—	1	1,143	
ソラスト	—	6.3	10,243	
リログループ	4.2	5.2	91,468	
東祥	3.4	2.9	14,050	
エイチ・アイ・エス	18.3	22.4	59,046	
ラックランド	1.6	2.4	4,826	
共立メンテナンス	8.4	11.2	74,032	
イチネンホールディングス	11.7	14.4	17,092	
建設技術研究所	6.6	8.7	9,726	
スペース	6	7.4	10,101	
燦ホールディングス	2.2	2.7	4,541	
スバル興業	8	10	4,760	
東京テアトル	43	52	8,164	
タナベ経営	—	2.7	3,825	
ナガワ	2	2.5	9,962	
よみうりランド	22	27	11,961	
東京都競馬	77	94	23,782	
常磐興産	41	5	8,375	
カナモト	15.6	19.2	56,774	
東京ドーム	89	54.9	57,919	
西尾レントオール	9	11.1	35,131	
アゴラ・ホスピタリティー・グループ	56	68	2,516	
トランス・コスモス	13	16	42,096	
乃村工藝社	24	29.5	57,466	

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
藤田観光	41	45	15,660	
KNT-CTホールディングス	54	78	10,686	
日本管財	9.6	11.8	21,629	
トーカイ	5	6.1	24,888	
白洋舎	12	1.3	3,637	
セコム	116.6	143.3	1,145,970	
セントラル警備保障	4.9	6.1	10,412	
丹青社	21	23.8	22,895	
メイテック	14	16.7	77,404	
アサツー ディ・ケイ	19.7	22.4	64,467	
応用地質	11.8	13	18,356	
船井総研ホールディングス	15.6	17.7	36,090	
進学会	5.3	5.7	3,391	
オオバ	6.1	10.7	5,424	
学究社	1.6	3.6	5,860	
ベネッセホールディングス	37.6	46.1	163,655	
イオンデイライト	10.8	15.5	53,397	
ナック	6.9	8.4	8,324	
ニチイ学館	19.5	23.9	20,315	
ダイセキ	21.1	24	54,264	
ステップ	3.8	4.6	6,854	
合 計	株 数・金 額	178,041	199,465	292,922,922
	銘柄数<比率>	1,933	1,997	<98.8%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	
		百万円	百万円
		2,820	—

○有価証券の貸付及び借入の状況

2017年3月27日現在における貸付株数の総株数は32,091,900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、32,091,900株です。

○投資信託財産の構成

(2017年3月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	292,922,922	87.5
コール・ローン等、その他	41,743,013	12.5
投資信託財産総額	334,665,935	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年3月27日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	334,665,935,303	
コール・ローン等	37,346,027,243	
株式(評価額)	292,922,922,728	
未収入金	3,830,495,960	
未収配当金	366,060,940	
その他未収収益	72,744,432	
差入委託証拠金	127,684,000	
(B) 負債	38,274,908,532	
未払金	74,784,980	
未払解約金	3,555,901,019	
未払利息	46,022	
受入担保金	34,644,176,511	
(C) 純資産総額(A-B)	296,391,026,771	
元本	189,052,090,341	
次期繰越損益金	107,338,936,430	
(D) 受益権総口数	189,052,090,341口	
1万円当たり基準価額(C/D)	15,678円	

○損益の状況 (2016年3月26日～2017年3月27日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	5,193,888,085	
受取配当金	4,664,860,608	
受取利息	446,395	
その他収益金	551,034,864	
支払利息	△ 22,453,782	
(B) 有価証券売買損益	30,713,194,538	
売買益	41,607,023,039	
売買損	△ 10,893,828,501	
(C) 先物取引等取引損益	519,753,092	
取引益	1,008,150,856	
取引損	△ 488,397,764	
(D) 保管費用等	△ 53,099	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	36,426,782,616	
(F) 前期繰越損益金	60,132,306,746	
(G) 追加信託差損益金	72,080,253,640	
(H) 解約差損益金	△ 61,300,406,572	
(I) 計(E+F+G+H)	107,338,936,430	
次期繰越損益金(I)	107,338,936,430	

(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。

<注記事項>

①期首元本額	160,669,331,010円	
期中追加設定元本額	173,392,386,291円	
期中一部解約元本額	145,009,626,960円	
また、1口当たり純資産額は、期末1.5678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）		18,684,449,723円
eMAXIS TOPIXインデックス		17,077,512,030円
eMAXIS バランス（8資産均等型）		1,656,580,816円
eMAXIS バランス（波乗り型）		99,802,897円
コアバランス		617,490円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）		3,273,572円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）		1,601,194円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）		4,933,249円
eMAXIS Slim 国内株式インデックス		49,732,237円
国内株式セレクション（ラップ向け）		2,584,584円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）		5,620,761,162円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）		10,565,357,162円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）		144,688,323円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）		170,036,213円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）		1,162,170,087円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）		68,179,843円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）		396,443,708円
eMAXIS バランス（4資産均等型）		43,112,557円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）		6,842,156円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）		11,948,701円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）		43,199,038円
eMAXIS 最適化バランス（マイフワード）		50,861,860円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）		61,420,211円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）		2,934,898,552円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）		12,002,930,294円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）		391,641,922円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）		3,451,440,494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）		36,368,609,266円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）		4,862,627,479円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）		1,846,915,127円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）		415,165,896円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）		274,097,035円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）		131,867,682円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）		507,547,681円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）		1,114,728,295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）		2,408,598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）		4,598,717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）		232,389,465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
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）		1,605,211,676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）		341,328,542円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）		82,293,572円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）		12,529,486円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）		3,492,669,678円
三菱UFJ TOPIX・ファンド		6,517,768,863円
三菱UFJ TOPIX・ライト		299,146,590円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA		7,572,986円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA		37,469,537円

インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	55,884,133円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	48,224,010円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	2,406,819,347円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	593,468,639円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	79,221,728円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	556,207,535円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	63,352,746円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	453,012,795円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	2,007,133,293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)	506,662,947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)	2,004,591,620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)	1,650,942,297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)	1,288,311,636円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	44,465,564,715円
合計	189,052,090,341円

外国株式インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2016年5月12日

[計算期間：2015年5月13日～2016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	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 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	(円換算ベース)	(米ドルベース)				
	円	%			%	%	%	百万円
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
15期(2016年5月12日)	19,726	△14.5	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7	270,065

(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		M S C I K o k u s a i I n d e x (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 組 入 比 率
	円	騰 落 率	(円換算ベース)	騰 落 率			
(期 首) 2015年5月12日	23,063	—	162.29	—	96.5	1.2	2.2
5月末	23,848	3.4	167.17	3.0	94.8	1.2	2.2
6月末	22,902	△ 0.7	160.34	△ 1.2	96.0	1.8	2.2
7月末	23,546	2.1	164.73	1.5	98.2	1.1	2.3
8月末	21,677	△ 6.0	151.30	△ 6.8	94.5	3.0	2.4
9月末	20,196	△12.4	140.71	△13.3	95.4	2.3	2.5
10月末	22,402	△ 2.9	155.86	△ 4.0	95.1	1.4	2.5
11月末	22,647	△ 1.8	157.46	△ 3.0	94.8	5.3	2.4
12月末	22,114	△ 4.1	153.40	△ 5.5	94.3	3.8	2.5
2016年1月末	20,152	△12.6	139.74	△13.9	95.2	2.3	2.6
2月末	19,318	△16.2	133.62	△17.7	95.4	2.1	2.6
3月末	20,436	△11.4	141.17	△13.0	99.9	2.3	2.8
4月末	20,342	△11.8	140.05	△13.7	94.9	3.0	2.6
(期 末) 2016年5月12日	19,726	△14.5	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

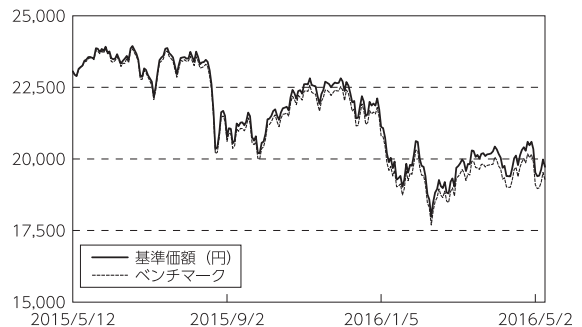
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.5%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(－16.4%)を1.9%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国株式市況

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

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて9.8%の円高・米ドル安、7.5%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16.4%の下落となったため、カイ離は1.9%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	1.9%程度	1.9%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1.9%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入・為替効果等	計 2.0%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料等	計 △0.1%程度

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

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

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

◎今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(2)	(0.011)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.004)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	8	0.036	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(8)	(0.036)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(c) そ の 他 費 用	11	0.051	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保 管 費 用)	(11)	(0.051)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	22	0.103	
期中の平均基準価額は、21,631円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年5月13日～2016年5月12日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 149,154 (4,640)	千アメリカドル 847,454 (923)	百株 76,288 (1,657)	千アメリカドル 423,884 (18,362)
	カナダ	19,381 (233)	千カナダドル 66,300 (0.04604)	9,692 (122)	千カナダドル 31,218 (885)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	10,429 (373)	45,014 (△ 209)	5,261	22,410
	イタリア	33,237 (△ 2,756)	10,796 (△ 9)	14,677	5,484
	フランス	12,402 (-)	46,419 (△ 139)	7,926	23,806
	オランダ	9,130 (474)	17,240 (504)	4,423	8,369
	スペイン	25,143 (43,299)	16,712 (360)	54,758	8,532
	ベルギー	908 (39)	6,786 (-)	474	3,268
	オーストリア	309	836	700	572
	ルクセンブルク	1,438 (684)	1,244 (△ 376)	1,150	595
	フィンランド	4,662	5,426	1,380	2,101
	アイルランド	13,253	2,821	6,013	886
	ポルトガル	22,727	824	7,210	345
	イギリス	139,904 (222,492)	千イギリスポンド 76,169 (△ 180)	65,194 (269,531)	千イギリスポンド 35,516 (996)
	スイス	7,902 (1,054)	千スイスフラン 51,689 (△ 436)	4,980 (-)	千スイスフラン 25,433 (0.02471)
	スウェーデン	10,648 (1,614)	千スウェーデンクローネ 134,262 (-)	6,017	千スウェーデンクローネ 67,764
	ノルウェー	2,690	千ノルウェークローネ 30,441	1,697	千ノルウェークローネ 16,159
	デンマーク	2,403 (52)	千デンマーククローネ 78,242 (-)	1,128	千デンマーククローネ 37,515

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	オーストラリア	百株 37,928 (4,668)	千オーストラリアドル 50,029 (247)	百株 18,319 (412)	千オーストラリアドル 23,475 (370)
	ニュージーランド	2,729	千ニュージーランドドル 1,167	831	千ニュージーランドドル 317
	香港	44,149 (2,980)	千香港ドル 127,962 (-)	20,283 (1,270)	千香港ドル 64,359 (-)
	シンガポール	24,000 (7)	千シンガポールドドル 9,166 (-)	10,988	千シンガポールドドル 4,495
	イスラエル	2,648	千イスラエルシケル 14,127	1,044	千イスラエルシケル 6,150

(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	21	759	10	387
MACERICH CO/THE	6	514	3	302
PROLOGIS INC	24	1,006	10	455
CAMDEN PROPERTY TRUST	4	315	1	155
DIGITAL REALTY TRUST INC	7	589	3	261
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3	691	1	321
EXTRA SPACE STORAGE INC	11	918	2	191
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3	467	1	213
WELLTOWER INC	16	1,096	7	532
BOSTON PROPERTIES INC	6	854	3	414
MID-AMERICA APARTMENT COMM	6	595	0.2	20
REALTY INCOME CORP	12	682	5	262
REGENCY CENTERS CORP	4	288	1	130
SL GREEN REALTY CORP	4	490	2	246
UDR INC	12	445	5	209
VENTAS INC	15	893	6	412
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	46	465	24	242
RAYONIER INC	—	—	7	193
WEYERHAEUSER CO	28 (18)	838 (484)	12	387
AMERICAN TOWER CORP	19	1,866	9	895
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	14	270	7	133
VEREIT INC	38	321	17	147
DUKE REALTY CORP	15	315	6	143
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	17	443	2	58
IRON MOUNTAIN INC	11	346	3	103
EQUINIX INC	2 (0.089)	880 (26)	0.763	226
COMMUNICATIONS SALES & LE	1	23	8	164
CROWN CASTLE INTL CORP	13 (20)	1,183 (1,658)	6	547
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	— (4)	— (—)	4	143
EQUITY RESIDENTIAL	17	1,285	7	562
GENERAL GROWTH PROPERTIES	28	773	11	323
HOST HOTELS & RESORTS INC	33	554	16	280
LIBERTY PROPERTY TRUST	6	195	2	91
PLUM CREEK TIMBER CO	4 (△ 11)	187 (△ 484)	3	153
PUBLIC STORAGE	6	1,589	3	717
SIMON PROPERTY GROUP INC	13	2,670	6	1,264
VORNADO REALTY TRUST	7	697	3	325
KIMCO REALTY CORP	18	488	8	221

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
AVALONBAY COMMUNITIES INC	6	1,127	2	511
小 計	513 (31)	27,136 (1,685)	245	12,357
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	6	195	0.9	27
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	7	147	4	83
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7	192	3	87
小 計	20	536	8	199
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
GECINA SA	1	217	0.714	84
KLEPIERRE	13	543	5	220
UNIBAIL-RODAMCO SE	4	1,067	2	514
FONCIERE DES REGIONS	1	116	0.709	56
ICADE	1	110	1	73
小 計	22	2,056	10	948
ユ ー ロ 計	22	2,056	10	948
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	44	338	20	165
HAMMERSON PLC	36	219	18	113
LAND SECURITIES GROUP PLC	36	429	18	224
INTU PROPERTIES PLC	42	134	18	59
SEGRO PLC	32	137	14	62
小 計	192	1,259	90	625
オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
VICINITY CENTRES	164	486	73	213
SCENTRE GROUP	246	1,037	115	480
FEDERATION CENTRES	— (103)	— (316)	—	—
NOVION PROPERTY GROUP	— (△ 126)	— (△ 316)	6	16
GPT GROUP	92	440	41	196
MIRVAC GROUP	166	307	74	144
STOCKLAND	113	464	53	223
WESTFIELD CORP	90	897	43	420
DEXUS PROPERTY GROUP	44	334	17	135
GOODMAN GROUP	88	564	43	283
小 計	1,007 (△ 22)	4,533 (—)	470	2,113
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	106	4,778	55	2,497
小 計	106	4,778	55	2,497
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	113 (—)	181 (△ 1)	44	68

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	89	126	47	68
	CAPITALAND MALL TRUST	93	193	24	46
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	77 (-)	184 (△0.24159)	15	35
小計		373 (-)	684 (△ 1)	131	218

(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 141,684	百万円 135,556	百万円 -	百万円 -

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

○株式売買比率

(2015年5月13日～2016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	233,432,694千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	224,041,096千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.04

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月13日～2016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 3,670	1.9	%	百万円 7,344	6.4	%
	百万円 192,818			百万円 114,849		

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	698	1,083	1,033	112,050	素材
AMERICAN EXPRESS CO	551	692	4,470	484,457	各種金融
AVON PRODUCTS INC	252	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
ABBOTT LABORATORIES	892	1,233	4,688	508,145	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	198	274	1,165	126,294	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	33	44	740	80,239	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	285	381	3,306	358,302	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	42	58	276	29,970	小売
AES CORP	404	566	641	69,479	公益事業
AFLAC INC	266	352	2,422	262,531	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	829	1,022	5,723	620,234	保険
APACHE CORP	222	313	1,692	183,470	エネルギー
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	37	50	1,039	112,614	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	371	516	5,993	649,553	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	126	169	2,410	261,252	素材
ANTHEM INC	159	215	3,013	326,522	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	300	421	2,018	218,738	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	785	1,112	2,455	266,066	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	320	472	2,190	237,343	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	401	526	7,003	758,941	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	123	174	2,913	315,756	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	177	256	807	87,510	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	983	1,380	9,774	1,059,259	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	78	101	3,595	389,684	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,459	3,367	17,223	1,866,514	電気通信サービス
CR BARD INC	44	61	1,340	145,257	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	77	108	784	84,995	素材
BAKER HUGHES INC	256	361	1,618	175,449	エネルギー
ALLSTATE CORP	248	319	2,154	233,434	保険
VERY DENNISON CORP	53	75	570	61,797	素材
CHUBB LTD	196	380	4,713	510,750	保険
ANALOG DEVICES INC	185	258	1,438	155,922	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	18	25	1,943	210,587	小売
CVS HEALTH CORP	679	916	9,541	1,033,975	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ENTERPRISES	136	178	965	104,598	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	758	978	1,846	200,089	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	2,216	3,045	18,822	2,039,781	銀行
CIGNA CORP	154	212	2,779	301,225	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	340	481	3,490	378,215	資本財
COCA-COLA CO/THE	2,337	3,417	15,535	1,683,562	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	329	440	3,095	335,463	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	121	153	1,005	108,926	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	590	807	2,090	226,506	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	118	166	576	62,437	メディア
CHEVRON CORP	1,120	1,557	15,753	1,707,213	エネルギー
COACH INC	163	229	876	94,977	耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ROCKWELL COLLINS INC	70	108	983	106,593	資本財
COMPUTER SCIENCES CORP	83	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CONOCOPHILLIPS	729	1,022	4,465	483,916	エネルギー
CME GROUP INC	189	265	2,483	269,182	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	195	271	2,093	226,827	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	540	705	5,075	550,003	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION RESOURCES INC/VA	347	495	3,554	385,171	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE	698	930	4,766	516,524	素材
DEVON ENERGY CORP	230	381	1,240	134,378	エネルギー
DEERE & CO	201	258	2,167	234,898	資本財
DANAHER CORP	374	509	4,993	541,125	資本財
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	536	724	4,662	505,265	素材
WALT DISNEY CO/THE	954	1,299	13,288	1,440,107	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC	79	94	599	64,955	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	420	571	4,601	498,711	公益事業
DR HORTON INC	194	280	815	88,376	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC	57	74	311	33,776	小売
TARGET CORP	358	483	3,662	396,857	小売
DUN & BRADSTREET CORP	21	29	351	38,088	商業・専門サービス
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	39	—	—	—	エネルギー
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I	101	140	1,069	115,857	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	98	128	847	91,835	資本財
DTE ENERGY COMPANY	105	150	1,366	148,099	公益事業
EXXON MOBIL CORP	2,510	3,444	30,592	3,315,344	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	63	178	1,874	203,176	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	324	455	3,657	396,349	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	410	541	2,860	310,017	資本財
EXELON CORP	510	763	2,698	292,443	公益事業
ECOLAB INC	159	219	2,564	277,893	素材
EQUIFAX INC	71	98	1,197	129,784	商業・専門サービス
ENSCO PLC-CL A	138	—	—	—	エネルギー
EMC CORP/MA	1,205	1,603	4,352	471,703	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	137	183	1,745	189,167	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	280	382	2,372	257,153	資本財
EDISON INTERNATIONAL	184	271	1,956	212,057	公益事業
ENTERGY CORP	107	149	1,148	124,409	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	26	35	643	69,746	保険
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	36	49	389	42,176	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC	259	382	4,580	496,353	公益事業
MACY'S INC	204	260	815	88,416	小売
FEDEX CORP	159	222	3,581	388,156	運輸
FMC TECHNOLOGIES INC	137	189	532	57,653	エネルギー
FAMILY DOLLAR STORES	60	—	—	—	小売
FORD MOTOR CO	2,127	3,065	4,083	442,505	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	238	322	1,149	124,556	各種金融
FOOT LOCKER INC	84	114	675	73,229	小売
FIRSTENERGY CORP	250	353	1,201	130,201	公益事業
FLUOR CORP	92	117	604	65,513	資本財
FREEPORT-MCMORAN INC	614	957	1,111	120,433	素材
GENERAL MILLS INC	357	494	3,163	342,787	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	166	222	3,218	348,841	資本財
WW GRAINGER INC	36	46	1,079	116,971	資本財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
GENERAL ELECTRIC CO	5,953	7,808	23,691	2,567,458	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	—	111	825	89,460	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	90	124	1,196	129,633	小売
TEGNA INC	—	174	404	43,791	メディア
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	—	222	622	67,415	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	143	200	371	40,296	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	232	317	5,064	548,817	各種金融
HALLIBURTON CO	502	708	2,802	303,682	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	440	605	6,908	748,656	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	126	159	727	78,787	自動車・自動車部品
HP INC	1,106	1,487	1,739	188,493	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	254	338	1,497	162,230	保険
HERSHEY CO/THE	90	122	1,131	122,611	食品・飲料・タバコ
DIRECTV	282	—	—	—	メディア
HOSPIRA INC	100	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARMAN INTERNATIONAL	—	58	435	47,178	耐久消費財・アパレル
HOME DEPOT INC	781	1,048	14,086	1,526,520	小売
HASBRO INC	66	92	784	84,997	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	157	215	1,423	154,273	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	557	762	11,358	1,230,870	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	237	325	1,394	151,162	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	219	270	2,822	305,834	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	246	336	798	86,515	メディア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	48	66	821	88,980	素材
JOHNSON & JOHNSON	1,659	2,288	26,179	2,837,025	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC	394	535	2,196	238,038	自動車・自動車部品
KANSAS CITY SOUTHERN	66	90	830	90,013	運輸
KELLOGG CO	157	219	1,674	181,466	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	221	300	3,869	419,285	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	995	1,314	5,836	632,483	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	276	765	2,655	287,779	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	121	160	622	67,429	小売
ELI LILLY & CO	593	825	6,296	682,334	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	59	83	1,062	115,102	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	101	137	578	62,701	運輸
LENNAR CORP-A	101	148	654	70,963	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	584	758	5,699	617,607	小売
LEGGETT & PLATT INC	81	112	553	60,026	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	147	204	1,378	149,355	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	237	329	1,496	162,140	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	159	228	5,536	599,959	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	154	204	879	95,263	保険
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	50	64	880	95,420	資本財
LEGG MASON INC	61	82	252	27,387	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	134	170	1,172	127,112	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	576	759	9,806	1,062,772	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	160	223	2,354	255,157	各種金融
MEDTRONIC PLC	839	1,169	9,482	1,027,617	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	1,690	2,310	12,550	1,360,132	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	635	899	908	98,413	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	202	280	867	94,056	耐久消費財・アパレル
3M CO	360	509	8,645	936,880	資本財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	133	132	925	100,340	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	234	373	822	89,154	消費者サービス
MASCO CORP	209	279	883	95,704	資本財
MONSANTO CO	286	363	3,287	356,273	素材
MEADWESTVACO CORP	97	—	—	—	素材
M & T BANK CORP	70	118	1,373	148,810	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	320	431	2,757	298,813	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	37	52	1,023	110,869	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	869	1,201	3,168	343,361	各種金融
MCKESSON CORP	137	190	3,215	348,445	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	571	781	3,392	367,601	保険
MANPOWERGROUP INC	47	60	470	50,940	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	111	147	1,400	151,806	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	183	247	2,196	238,007	運輸
BANK OF AMERICA CORP	6,233	8,614	12,232	1,325,653	銀行
NISOURCE INC	188	—	—	—	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	113	143	3,070	332,756	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	265	402	599	64,974	銀行
NEWMONT MINING CORP	292	437	1,482	160,664	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	804	966	2,841	307,972	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	69	96	936	101,529	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	—	11	1,101	119,338	保険
NUCOR CORP	189	264	1,258	136,427	素材
NEWELL BRANDS INC	160	367	1,777	192,661	耐久消費財・アパレル
NOBLE CORP PLC	149	—	—	—	エネルギー
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	259	366	1,083	117,424	メディア
NOBLE ENERGY INC	229	355	1,294	140,241	エネルギー
PALL CORP	62	—	—	—	資本財
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	461	632	4,825	522,935	エネルギー
OMNICARE INC	57	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
OMNICOM GROUP	146	200	1,685	182,658	メディア
PEPSICO INC	887	1,205	12,741	1,380,805	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	—	80	531	57,587	素材
ALTRIA GROUP INC	1,171	1,622	10,481	1,135,913	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	66	94	694	75,293	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,602	2,249	18,482	2,002,994	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	311	419	3,624	392,774	銀行
PFIZER INC	3,735	5,106	16,934	1,835,178	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	269	371	2,828	306,536	保険
PULTEGROUP INC	196	260	471	51,145	耐久消費財・アパレル
PEPCO HOLDINGS LLC	151	—	—	—	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	88	112	1,269	137,606	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	88	133	2,196	238,037	エネルギー
CITIGROUP INC	1,795	2,465	10,962	1,188,003	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	174	242	1,029	111,524	保険
PPG INDUSTRIES INC	81	222	2,392	259,328	素材
PENTAIR PLC	111	149	880	95,381	資本財
PRAXAIR INC	172	235	2,674	289,793	素材
P G & E CORP	282	408	2,418	262,121	公益事業
PPL CORP	396	560	2,171	235,301	公益事業
PROGRESSIVE CORP	330	482	1,600	173,472	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	301	421	1,955	211,904	公益事業

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	106	145	1,184	128,389	消費者サービス
SPX CORP	20	—	—	—	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	98	145	1,093	118,529	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	182	248	3,253	352,542	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	168	200	976	105,789	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	819	1,078	993	107,714	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	27	36	409	44,324	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	59	83	1,468	159,157	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	245	345	760	82,464	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	80	109	428	46,487	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	80	109	1,244	134,837	資本財
SCHLUMBERGER LTD	763	1,152	8,503	921,476	エネルギー
STRYKER CORP	201	279	3,118	337,920	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	695	980	2,724	295,218	各種金融
SEMPRA ENERGY	139	196	2,074	224,784	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	48	65	1,926	208,815	素材
ST JUDE MEDICAL INC	169	234	1,770	191,913	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	88	123	1,398	151,550	資本財
SUNTRUST BANKS INC	308	420	1,741	188,676	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	196	251	2,812	304,762	保険
SOUTHERN CO/THE	535	755	3,802	412,031	公益事業
AT&T INC	3,074	5,089	19,939	2,160,846	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	130	189	697	75,608	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	246	333	2,013	218,189	各種金融
SYSCO CORP	347	466	2,343	254,015	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	119	163	764	82,871	素材
SCANA CORP	81	114	802	86,918	公益事業
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	92	—	—	—	エネルギー
TEXAS INSTRUMENTS INC	625	839	4,835	524,029	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	77	106	704	76,367	小売
TORCHMARK CORP	74	101	596	64,660	保険
TYCO INTERNATIONAL PLC	248	349	1,344	145,752	商業・専門サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	237	330	4,886	529,556	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	164	226	864	93,683	資本財
UNION PACIFIC CORP	527	706	5,972	647,213	運輸
UNUM GROUP	150	201	679	73,679	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	513	696	7,081	767,413	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	569	788	10,303	1,116,544	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,060	1,446	6,054	656,133	銀行
MARATHON OIL CORP	399	682	849	92,105	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	416	576	5,907	640,170	運輸
VALERO ENERGY CORP	308	398	2,226	241,289	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	59	80	656	71,109	ヘルスケア機器・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	284	359	2,003	217,094	メディア
VF CORP	204	282	1,711	185,514	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	78	110	1,271	137,799	素材
TOWERS WATSON & CO-CL A	41	—	—	—	商業・専門サービス
WILLIAMS COS INC	420	590	1,151	124,749	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	516	720	5,780	626,484	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	136	264	1,589	172,220	公益事業
WAL-MART STORES INC	955	1,325	8,803	954,086	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO	2,921	4,013	19,700	2,134,939	銀行

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
WASTE MANAGEMENT INC	257	369	2,263	245,315	商業・専門サービス
WATERS CORP	49	67	910	98,714	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	461	731	410	44,453	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	46	64	1,115	120,913	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	636	754	700	75,954	ソフトウェア・サービス
XL GROUP PLC	178	244	825	89,427	保険
XCEL ENERGY INC	301	424	1,757	190,495	公益事業
KEYCORP	511	684	818	88,732	銀行
CARMAX INC	127	168	856	92,857	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	100	156	1,827	198,084	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	101	139	369	40,046	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	259	356	2,878	311,964	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	410	553	4,097	444,060	小売
CA INC	196	271	814	88,227	ソフトウェア・サービス
CAMERON INTERNATIONAL CORP	116	—	—	—	エネルギー
CLOROX COMPANY	76	106	1,413	153,138	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	91	121	855	92,692	素材
CARNIVAL CORP	228	341	1,715	185,870	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	167	233	1,717	186,168	ソフトウェア・サービス
CHUBB CORP	139	—	—	—	保険
CONAGRA FOODS INC	251	358	1,641	177,913	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	174	244	1,823	197,560	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	487	656	1,158	125,582	銀行
STERICYCLE INC	50	70	665	72,165	商業・専門サービス
INTEL CORP	2,866	3,903	11,734	1,271,637	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	3,030	4,199	11,213	1,215,188	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	59	75	694	75,231	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	76	105	1,067	115,688	電気通信サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	259	361	5,321	576,720	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	721	993	1,987	215,425	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	184	257	1,887	204,538	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	180	244	1,673	181,358	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	408	558	933	101,209	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	124	337	1,835	198,924	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	120	177	855	92,695	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	405	1,121	6,394	692,974	耐久消費財・アパレル
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	—	6	80	8,712	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	450	624	9,621	1,042,726	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	106	145	627	68,002	銀行
NORTHERN TRUST CORP	132	181	1,258	136,407	各種金融
MICROSOFT CORP	4,642	6,278	32,051	3,473,441	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	54	73	635	68,909	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	—	140	806	87,420	ヘルスケア機器・サービス
STAPLES INC	381	538	455	49,346	小売
STARBUCKS CORP	887	1,227	6,903	748,165	消費者サービス
ORACLE CORP	2,101	2,646	10,492	1,137,093	ソフトウェア・サービス
ALTERA CORP	181	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WHOLE FOODS MARKET INC	213	282	861	93,353	食品・生活必需品小売り
NETFLIX INC	33	336	3,024	327,783	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	60	81	2,143	232,244	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	299	423	1,572	170,427	ソフトウェア・サービス
URBAN OUTFITTERS INC	63	—	—	—	小売

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		業種等	業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円			
SKYWORKS SOLUTIONS INC	113	158	1,021	110,740			半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	49	68	1,173	127,221			ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	80	111	1,027	111,298			小売
LAM RESEARCH CORP	94	130	989	107,273			半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	47	67	626	67,858			消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,274	2,054	12,749	1,381,662			メディア
XILINX INC	157	212	914	99,151			半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	209	292	1,665	180,446			資本財
DENTSPLY SIRONA INC	84	199	1,235	133,837			ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	894	1,192	10,002	1,083,968			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	96	127	1,052	114,113			ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	21	30	1,938	210,122			ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	160	207	2,124	230,251			ソフトウェア・サービス
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	246	-	-	-			メディア
NUANCE COMMUNICATIONS INC	152	205	343	37,206			ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	193	268	1,400	151,781			ソフトウェア・サービス
YAHOO! INC	532	741	2,772	300,457			ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	48	72	317	34,387			ヘルスケア機器・サービス
SIGNATURE BANK	-	42	559	60,675			銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	-	57	462	50,164			ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	135	187	1,106	119,913			ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	147	208	776	84,156			メディア
SALESFORCE.COM INC	355	522	3,958	429,008			ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	83	114	518	56,184			小売
ALPHABET INC-CL A	168	240	17,604	1,907,831			ソフトウェア・サービス
JOY GLOBAL INC	58	-	-	-			資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	-	37	408	44,303			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B/E AEROSPACE INC	62	87	412	44,704			資本財
GARMIN LTD	67	94	380	41,180			耐久消費財・アパレル
TRIMBLE NAVIGATION LTD	150	207	490	53,152			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	985	1,243	6,484	702,757			半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	133	199	680	73,737			ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	91	129	622	67,450			ソフトウェア・サービス
LINER TECHNOLOGY CORP	142	197	874	94,744			半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	168	235	855	92,758			半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	233	329	23,514	2,548,264			小売
T ROWE PRICE GROUP INC	153	206	1,558	168,898			各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	85	118	903	97,918			ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	98	128	895	97,076			半導体・半導体製造装置
E*TRADE FINANCIAL CORP	-	242	613	66,466			各種金融
CERNER CORP	182	254	1,384	150,029			ヘルスケア機器・サービス
BROADCOM LTD	-	321	4,622	500,937			半導体・半導体製造装置
ALKERMES PLC	87	124	471	51,056			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	68	83	707	76,670			ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	169	250	1,322	143,361			電気通信サービス
BROADCOM CORP-CL A	320	-	-	-			半導体・半導体製造装置
WASTE CONNECTIONS INC	-	101	701	75,982			商業・専門サービス
EBAY INC	662	893	2,121	229,935			ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	323	445	1,604	173,929			半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	122	184	1,457	157,946			小売
PRICELINE GROUP INC/THE	31	41	5,220	565,696			小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	684	980	14,010	1,518,322			各種金融

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
BB&T CORP	425	670	2,276	246,674	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	666	903	3,601	390,272	各種金融
BORGWARNER INC	135	185	631	68,433	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	163	194	378	40,973	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	60	97	1,266	137,251	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC	496	661	4,903	531,437	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP	129	161	1,227	132,970	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	42	54	470	50,967	保険
AETNA INC	208	288	3,236	350,759	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	146	204	984	106,729	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	291	408	2,666	289,018	公益事業
AON PLC	160	226	2,391	259,177	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	381	493	1,872	202,950	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	56	78	423	45,902	保険
HESS CORP	159	232	1,354	146,747	エネルギー
CROWN CASTLE INTL CORP	197	—	—	—	不動産
JUNIPER NETWORKS INC	231	288	658	71,318	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	160	221	640	69,386	各種金融
RED HAT INC	111	151	1,093	118,550	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	43	58	605	65,629	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	131	186	885	95,952	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	105	147	747	80,980	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	185	242	565	61,244	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	90	138	979	106,186	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	224	342	333	36,117	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	140	184	4,928	534,115	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	84	121	1,683	182,430	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC	280	412	3,968	430,040	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	142	203	1,701	184,359	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC	110	137	600	65,105	小売
CELGENE CORP	473	650	6,517	706,339	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CREE INC	71	—	—	—	半導体・半導体製造装置
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	360	503	3,074	333,222	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	435	559	4,118	446,292	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	116	154	738	80,027	運輸
FASTENAL CO	166	227	1,052	114,083	資本財
FISERV INC	144	189	1,996	216,368	ソフトウェア・サービス
FLEXTRONICS INTL LTD	347	462	556	60,292	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOSSIL GROUP INC	27	—	—	—	耐久消費財・アパレル
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,451	1,745	685	74,323	メディア
SANDISK CORP	130	166	1,265	137,117	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	3,477	4,612	42,674	4,624,644	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	91	128	861	93,387	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	485	659	657	71,206	銀行
SIGMA-ALDRICH	70	—	—	—	素材
NABORS INDUSTRIES LTD	150	—	—	—	エネルギー
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	117	186	2,589	280,604	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHLAND INC	39	52	590	64,014	素材
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	88	118	863	93,588	運輸
CENTURYLINK INC	337	454	1,286	139,420	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	85	114	350	38,005	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	246	345	1,371	148,595	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	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	65	—	—	—	自動車・自動車部品
ONEOK INC	123	173	696	75,518	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC	188	709	3,607	390,945	食品・飲料・タバコ
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	299	—	—	—	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	193	247	463	50,260	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	85	117	721	78,155	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	43	60	897	97,216	小売
CONSOL ENERGY INC	136	—	—	—	エネルギー
NATIONAL OILWELL VARCO INC	255	311	1,006	109,119	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	100	143	2,335	253,054	食品・飲料・タバコ
CHESAPEAKE ENERGY CORP	315	—	—	—	エネルギー
PARTNERRE LTD	26	—	—	—	保険
COOPER COS INC/THE	28	40	624	67,634	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	90	132	929	100,690	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	183	255	1,435	155,538	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	63	81	455	49,330	保険
OWENS-ILLINOIS INC	99	—	—	—	素材
AGCO CORP	52	55	287	31,164	資本財
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	87	122	356	38,584	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP	84	117	1,766	191,402	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA INC	61	102	1,149	124,569	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	29	193	568	61,645	素材
HUDSON CITY BANCORP INC	277	—	—	—	銀行
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	375	495	1,796	194,637	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC	109	144	1,371	148,597	各種金融
TESORO CORP	75	99	775	83,994	エネルギー
FNF GROUP	149	207	693	75,202	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	66	98	2,536	274,895	各種金融
NASDAQ INC	70	94	600	65,084	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	99	149	558	60,507	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	212	288	1,166	126,366	メディア
AUTOLIV INC	53	72	908	98,437	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	178	249	729	79,104	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	18	25	1,170	126,886	消費者サービス
IHS INC-CLASS A	39	56	684	74,132	商業・専門サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	73	95	937	101,638	食品・飲料・タバコ
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	265	367	965	104,617	小売
ARROW ELECTRONICS INC	57	77	470	51,029	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	102	139	1,599	173,329	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	78	101	507	54,977	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP	185	271	480	52,038	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	33	46	868	94,152	素材
RANGE RESOURCES CORP	100	140	606	65,756	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO	226	315	385	41,825	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	51	78	899	97,437	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	35	48	411	44,550	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	66	96	707	76,703	公益事業
OCEANEERING INTL INC	63	80	265	28,719	エネルギー
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	72	96	666	72,272	消費者サービス
HANESBRANDS INC	237	324	871	94,447	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC-CLASS A	593	819	7,900	856,209	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	310	418	801	86,846	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	
AERCAP HOLDINGS NV	—	76	305	33,150	資本財
AVNET INC	82	109	431	46,778	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	190	263	686	74,418	素材
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	—	80	117	12,692	消費者サービス
SPECTRA ENERGY CORP	397	556	1,719	186,357	エネルギー
TRANSIGM GROUP INC	29	44	1,104	119,676	資本財
WILLIS TOWERS WATSON PLC	94	108	1,345	145,765	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	184	253	386	41,832	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	240	319	1,885	204,336	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	268	353	1,959	212,337	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	63	93	576	62,516	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	—	45	481	52,203	資本財
PRECISION CASTPARTS CORP	84	—	—	—	資本財
VMWARE INC-CLASS A	49	65	366	39,693	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	198	234	929	100,733	保険
TIME WARNER CABLE	166	234	5,076	550,133	メディア
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	36	50	1,018	110,419	小売
LKQ CORP	181	252	823	89,292	小売
HORMEL FOODS CORP	86	240	960	104,069	食品・飲料・タバコ
EASTMAN CHEMICAL CO	88	123	927	100,543	素材
GAMESTOP CORP-CLASS A	66	85	248	26,910	小売
HARRIS CORP	62	103	786	85,233	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	90	122	2,084	225,944	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP	99	135	410	44,485	エネルギー
NRG ENERGY INC	203	262	414	44,944	公益事業
INVESCO LTD	254	350	1,018	110,364	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	92	133	1,098	119,013	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	83	115	560	60,705	各種金融
TERADATA CORP	89	113	313	33,963	ソフトウェア・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	99	137	731	79,321	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	70	107	1,248	135,287	エネルギー
MSCI INC	—	81	620	67,230	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	54	76	305	33,124	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	90	153	1,526	165,413	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	921	1,281	13,050	1,414,277	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,169	1,610	12,447	1,348,965	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	115	156	1,479	160,369	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N.V.	26	34	428	46,408	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP	246	380	931	100,925	エネルギー
FLOWSERVE CORP	80	108	505	54,744	資本財
HELMERICH & PAYNE	63	89	532	57,725	エネルギー
MDU RESOURCES GROUP INC	111	—	—	—	公益事業
ENERGEN CORP	43	—	—	—	エネルギー
T-MOBILE US INC	144	237	968	104,907	電気通信サービス
LORILLARD INC	213	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	45	62	416	45,144	メディア
RACKSPACE HOSTING INC	72	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	164	228	641	69,468	メディア
RESMED INC	82	115	664	71,990	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	—	69	675	73,193	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	145	197	924	100,152	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	76	101	727	78,843	保険

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
CHURCH & DWIGHT CO INC	78	108	1,045	113,296	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	56	76	635	68,891	運輸
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	48	—	—	—	公益事業
PERRIGO CO PLC	83	121	1,124	121,832	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUANTA SERVICES INC	126	129	305	33,103	資本財
FMC CORP	79	110	521	56,506	素材
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	72	—	—	—	食品・飲料・タバコ
WABTEC CORP	56	79	635	68,914	資本財
EVERSOURCE ENERGY	189	265	1,524	165,248	公益事業
NETSUITE INC	20	32	257	27,896	ソフトウェア・サービス
ALLERGAN PLC	223	326	7,264	787,286	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRGAS INC	40	53	764	82,889	素材
CROWN HOLDINGS INC	81	116	633	68,642	素材
CALPINE CORP	196	285	429	46,515	公益事業
EATON VANCE CORP	70	95	330	35,773	各種金融
DELTA AIR LINES INC	124	165	702	76,090	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	119	163	1,389	150,630	食品・飲料・タバコ
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	149	—	—	—	半導体・半導体製造装置
AMERICAN WATER WORKS CO INC	107	151	1,127	122,210	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	95	133	1,033	111,955	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	179	243	2,024	219,393	小売
FORTINET INC	—	121	395	42,836	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	55	79	361	39,210	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	17	22	824	89,361	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	108	141	466	50,579	銀行
QEP RESOURCES INC	99	—	—	—	エネルギー
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	599	970	524	56,819	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO	761	1,169	3,635	393,967	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	112	958	103,884	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	252	315	2,586	280,318	素材
HCA HOLDINGS INC	179	270	2,168	235,045	ヘルスケア機器・サービス
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	268	321	283	30,757	運輸
WHITING PETROLEUM CORP	121	—	—	—	エネルギー
ROCK-TENN COMPANY -CL A	83	—	—	—	素材
HOLLYFRONTIER CORP	111	144	421	45,721	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	165	441	1,584	171,733	エネルギー
ZILLOW GROUP INC - A	28	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ATMOS ENERGY CORP	—	87	648	70,268	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	—	132	738	80,018	資本財
XYLEM INC	107	148	636	68,936	資本財
TRIPADVISOR INC	69	97	642	69,664	小売
MEDIVATION INC	46	140	858	92,999	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	35	50	758	82,185	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	77	120	826	89,601	銀行
ALLEGHANY CORP	9	12	670	72,686	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	47	63	2,357	255,492	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	327	441	3,505	379,938	エネルギー
FACEBOOK INC-A	1,186	1,878	22,452	2,433,182	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP	166	235	979	106,096	公益事業
ALBEMARLE CORP	66	92	693	75,202	素材
PVH CORP	48	68	568	61,635	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A	64	95	1,231	133,407	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
KINDER MORGAN INC	1,067	1,570	2,679	290,397	エネルギー
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	166	—	—	—	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	207	286	1,490	161,539	商業・専門サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	175	231	1,630	176,689	自動車・自動車部品
CHARTER COMMUNICATION-A	45	69	1,519	164,639	メディア
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	95	141	492	53,351	資本財
SPLUNK INC	—	106	513	55,700	ソフトウェア・サービス
ADT CORP/THE	103	—	—	—	商業・専門サービス
KRAFT FOODS GROUP INC	348	—	—	—	食品・飲料・タバコ
OGE ENERGY CORP	121	169	520	56,427	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	37	51	442	47,969	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	944	1,352	8,481	919,193	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LIBERTY MEDIA CORP - A	52	—	—	—	メディア
TESLA MOTORS INC	52	81	1,699	184,149	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	133	186	610	66,190	エネルギー
REALOGY HOLDINGS CORP	85	122	387	41,973	不動産
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	74	106	545	59,087	各種金融
ZOETIS INC	296	392	1,804	195,542	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC	69	96	554	60,105	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	224	314	384	41,639	メディア
SPRINT CORP	479	644	224	24,374	電気通信サービス
TECO ENERGY INC	—	197	548	59,450	公益事業
SNAP-ON INC	34	48	782	84,786	資本財
AGL RESOURCES INC	—	102	671	72,758	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	122	152	670	72,618	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	226	481	702	76,092	ソフトウェア・サービス
VANTIV INC - CL A	86	130	723	78,456	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	58	93	666	72,194	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	79	125	860	93,293	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	54	75	1,024	111,050	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	56	76	287	31,164	資本財
PHARMACYCLICS INC	38	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	46	65	988	107,102	ソフトウェア・サービス
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	—	158	376	40,851	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL C	171	257	18,405	1,994,641	ソフトウェア・サービス
IMS HEALTH HOLDINGS INC	—	137	344	37,377	ヘルスケア機器・サービス
NAVIENT CORP	246	300	383	41,571	各種金融
ENDO INTERNATIONAL PLC	102	178	241	26,148	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED RENTALS INC	59	77	476	51,642	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	107	133	437	47,365	運輸
VOYA FINANCIAL INC	135	177	542	58,831	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	28	36	168	18,295	素材
ANTERO RESOURCES CORP	32	67	174	18,954	エネルギー
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	41	77	508	55,060	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIREEYE INC	49	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP - C	124	—	—	—	メディア
ALLY FINANCIAL INC	255	360	612	66,428	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	235	408	911	98,735	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	—	112	580	62,917	ソフトウェア・サービス
JARDEN CORP	108	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	67	133	621	67,316	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	41	67	944	102,384	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

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		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
SIGNET JEWELERS LTD	45	62	649	70,426	小売	
SYNCHRONY FINANCIAL	99	689	2,064	223,770	各種金融	
QORVO INC	86	116	538	58,307	半導体・半導体製造装置	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	70	99	328	35,600	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	—	146	690	74,830	保険	
ACUITY BRANDS INC	—	36	913	98,995	資本財	
JONES LANG LASALLE INC	—	37	417	45,228	不動産	
ARAMARK	—	188	621	67,363	消費者サービス	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	—	435	967	104,862	銀行	
LEAR CORP	—	62	718	77,836	自動車・自動車部品	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	63	340	36,872	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WHITEWAVE FOODS CO	—	146	644	69,883	食品・飲料・タバコ	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	—	119	336	36,459	素材	
RITE AID CORP	—	857	686	74,344	食品・生活必需品小売り	
BAXALTA INC	—	588	2,503	271,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLUMBIA PIPELINE GROUP	—	322	823	89,256	エネルギー	
WESTROCK CO	—	223	955	103,546	素材	
KRAFT HEINZ CO/THE	—	502	4,277	463,512	食品・飲料・タバコ	
PAYPAL HOLDINGS INC	—	909	3,613	391,572	ソフトウェア・サービス	
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	—	42	208	22,570	ソフトウェア・サービス	
ZILLOW GROUP INC - C	—	83	226	24,531	ソフトウェア・サービス	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	—	1,492	2,391	259,164	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MOBILEYE NV	—	65	239	25,950	ソフトウェア・サービス	
AMERCO	—	6	241	26,152	運輸	
CDW CORP/DE	—	119	494	53,599	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MEDNAX INC	—	77	538	58,397	ヘルスケア機器・サービス	
SABRE CORP	—	172	503	54,556	ソフトウェア・サービス	
WR GRACE & CO	—	59	461	49,986	素材	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	—	143	503	54,607	耐久消費財・アパレル	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	—	167	529	57,329	メディア	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	—	74	240	26,018	メディア	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	—	480	294	31,938	不動産	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	—	200	1,066	115,522	資本財	
小計	株数・金額	184,539	260,387	1,520,759	164,804,668	
	銘柄数<比率>	593	596	—	<61.0%>	
(カナダ)			千カナダドル			
ROYAL BANK OF CANADA	855	1,228	9,408	793,455	銀行	
IMPERIAL OIL LTD	176	247	1,000	84,359	エネルギー	
THOMSON REUTERS CORP	213	286	1,508	127,176	メディア	
TRANSCANADA CORP	420	588	3,044	256,756	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	214	301	1,486	125,393	電気通信サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	362	506	2,182	184,082	保険	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	340	470	592	49,940	素材	
BARRICK GOLD CORP	690	965	2,288	192,948	素材	
BCE INC	85	120	715	60,302	電気通信サービス	
AGRIUM INC	85	109	1,213	102,352	素材	
BOMBARDIER INC-B	847	1,596	323	27,321	資本財	
BANK OF MONTREAL	382	530	4,319	364,263	銀行	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	330	733	3,192	269,261	不動産	
BANK OF NOVA SCOTIA	720	995	6,247	526,860	銀行	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	189	268	906	76,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAE INC	160	218	338	28,568	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
CAMECO CORP	237	330	499	42,132	エネルギー
CI FINANCIAL CORP	132	195	527	44,481	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	235	328	3,297	278,068	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	647	907	3,364	283,691	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	483	659	5,040	425,081	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	44	59	820	69,188	小売
ENBRIDGE INC	503	760	3,895	328,465	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	12	18	1,160	97,857	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	133	183	1,067	90,047	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	206	292	442	37,331	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	61	80	297	25,056	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	135	188	1,297	109,392	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,166	1,631	2,984	251,702	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	246	335	1,755	148,061	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	193	284	1,185	99,942	銀行
ONEX CORPORATION	53	71	563	47,480	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	491	691	1,415	119,399	素材
POWER CORP OF CANADA	220	310	894	75,394	保険
POWER FINANCIAL CORP	147	208	650	54,867	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	236	337	810	68,348	メディア
SUNCOR ENERGY INC	860	1,310	4,515	380,798	エネルギー
TRANSALTA CORP	169	—	—	—	公益事業
WESTON (GEORGE) LTD	30	43	473	39,967	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	101	120	2,124	179,116	運輸
ENCANA CORP	492	699	627	52,875	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	124	180	1,078	90,985	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	103	145	318	26,840	資本財
GOLDCORP INC	484	687	1,654	139,506	素材
KINROSS GOLD CORP	689	1,019	686	57,918	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	90	124	638	53,874	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC	179	247	845	71,278	保険
METHANEX CORP	56	73	285	24,088	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	491	849	302	25,488	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	46	70	133	11,298	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	139	192	732	61,753	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	152	211	879	74,181	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	299	424	365	30,785	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELUS CORP	116	116	471	39,735	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	359	571	527	44,444	素材
YAMANA GOLD INC	546	785	484	40,844	素材
FORTIS INC	163	236	959	80,881	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	248	347	1,872	157,929	食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP	431	580	361	30,471	素材
TORONTO-DOMINION BANK	1,091	1,533	8,592	724,602	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	93	145	1,301	109,732	素材
SILVER WHEATON CORP	241	361	893	75,377	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	33	133	285	24,114	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	59	87	360	30,425	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	74	107	390	32,962	公益事業
METRO INC	148	199	851	71,825	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	71	101	719	60,677	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	78	109	964	81,367	保険

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
CRESCENT POINT ENERGY CORP	248	419	853	71,940	エネルギー	
CENOVUS ENERGY INC	489	692	1,314	110,877	エネルギー	
MEG ENERGY CORP	94	—	—	—	エネルギー	
ARC RESOURCES LTD	188	288	592	49,934	エネルギー	
CANADIAN OIL SANDS LTD	289	—	—	—	エネルギー	
BAYTEX ENERGY CORP	121	—	—	—	エネルギー	
TOURMALINE OIL CORP	102	160	491	41,463	エネルギー	
ENERPLUS CORP	118	—	—	—	エネルギー	
NEW GOLD INC	313	—	—	—	素材	
PEMBINA PIPELINE CORP	201	309	1,142	96,388	エネルギー	
VERMILION ENERGY INC	63	93	390	32,892	エネルギー	
CATAMARAN CORP	122	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
DOLLARAMA INC	75	99	903	76,181	小売	
KEYERA CORP	100	143	527	44,522	エネルギー	
ALTAGAS LTD	79	126	374	31,579	エネルギー	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	87	124	395	33,336	エネルギー	
ATCO LTD -CLASS I	47	66	279	23,548	公益事業	
FIRST CAPITAL REALTY INC	60	97	205	17,349	不動産	
INTER PIPELINE LTD	193	280	724	61,085	エネルギー	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	79	151	370	31,261	エネルギー	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	—	133	320	27,030	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	11	16	816	68,825	ソフトウェア・サービス	
CONSTELLATION SOFTWARE INC-RTS	11	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	35	—	—	—	エネルギー	
RESTAURANT BRANDS INTERN	116	168	888	74,962	消費者サービス	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	41	57	247	20,875	素材	
VERESEN INC	—	258	235	19,886	エネルギー	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	—	23	517	43,675	素材	
ELEMENT FINANCIAL CORP	—	323	485	40,912	各種金融	
LINAMAR CORP	—	39	203	17,125	自動車・自動車部品	
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	—	92	395	33,314	商業・専門サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	23,185	32,985	118,114	9,960,633	
	銘柄 数 < 比 率 >	93	90	—	< 3.7% >	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
COMMERZBANK AG	631	882	620	76,814	銀行	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	816	1,141	1,679	207,947	各種金融	
METRO AG	95	147	416	51,589	食品・生活必需品小売り	
SIEMENS AG-REG	469	655	6,184	765,698	資本財	
RWE AG	290	407	466	57,805	公益事業	
BASF SE	544	759	5,194	643,140	素材	
VOLKSWAGEN AG	17	29	408	50,600	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	570	796	4,728	585,485	自動車・自動車部品	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	105	146	1,497	185,453	家庭用品・パーソナル用品	
E.ON SE	1,188	1,661	1,332	164,978	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	196	274	2,107	260,903	自動車・自動車部品	
BAYER AG-REG	490	684	6,841	847,033	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LINDE AG	110	153	1,942	240,552	素材	
ALLIANZ SE-REG	270	377	5,241	648,960	保険	
MAN SE	20	29	278	34,526	資本財	
CONTINENTAL AG	65	90	1,700	210,568	自動車・自動車部品	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	671	933	1,123	139,043	半導体・半導体製造装置	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	90	126	611	75,763	自動車・自動車部品	

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		
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	136	204	255	31,656	運輸	
HUGO BOSS AG -ORD	39	55	309	38,286	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE POST AG-REG	574	801	2,117	262,204	運輸	
SAP SE	546	812	5,541	686,046	ソフトウェア・サービス	
CELESIO AG	31	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	129	181	773	95,727	メディア	
DEUTSCHE BOERSE AG	114	159	1,215	150,532	各種金融	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	129	180	1,353	167,604	ヘルスケア機器・サービス	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	22	34	174	21,612	運輸	
ADIDAS AG	123	173	1,960	242,706	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,881	2,669	4,176	517,039	電気通信サービス	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	102	137	2,181	270,083	保険	
THYSSENKRUPP AG	270	305	581	72,000	素材	
BEIERSDORF AG	58	82	657	81,376	家庭用品・パーソナル用品	
HEIDELBERGCEMENT AG	84	116	883	109,365	素材	
MERCK KGAA	77	106	858	106,315	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VOLKSWAGEN AG-PREF	96	153	1,998	247,389	自動車・自動車部品	
LANXESS AG	53	75	334	41,392	素材	
FRESENIUS SE & CO KGAA	224	315	2,044	253,173	ヘルスケア機器・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	171	279	760	94,121	不動産	
GEA GROUP AG	109	150	608	75,315	資本財	
SYMRISE AG	73	102	584	72,372	素材	
K+S AG-REG	102	158	355	44,066	素材	
HENKEL AG & CO KGAA	68	85	775	95,956	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	73	102	443	54,900	ソフトウェア・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	32	44	309	38,288	自動車・自動車部品	
HANNOVER RUECK SE	35	49	477	59,157	保険	
BRENNTAG AG	92	127	609	75,516	資本財	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	12	—	—	—	メディア	
AXEL SPRINGER SE	24	37	187	23,168	メディア	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	40	57	212	26,257	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	347	625	285	35,341	電気通信サービス	
OSRAM LICHT AG	52	73	337	41,728	資本財	
VONOVIA SE	203	386	1,174	145,390	不動産	
EVONIK INDUSTRIES AG	—	114	331	41,005	素材	
ZALANDO SE	—	69	206	25,546	小売	
小 計	株 数	金 額	12,785	18,327	77,453	9,589,511
	銘柄 数 < 比率 >		52	52	—	< 3.6% >
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	692	961	1,260	156,119	保険	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	2,544	—	—	—	銀行	
INTESA SANPAOLO	7,501	10,499	2,368	293,275	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	5,980	9,508	805	99,707	電気通信サービス	
ENI SPA	1,505	2,105	2,827	350,055	エネルギー	
UNICREDIT SPA	2,601	3,948	1,120	138,745	銀行	
ENEL SPA	3,904	6,331	2,513	311,218	公益事業	
SAIPEM SPA	160	4,956	181	22,465	エネルギー	
ATLANTIA SPA	246	342	823	101,976	運輸	
INTESA SANPAOLO-RSP	556	762	165	20,505	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	99	139	664	82,317	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	360	466	298	37,009	各種金融	
SNAM SPA	1,246	1,760	930	115,227	公益事業	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
TELECOM ITALIA-RSP	3,577	4,971	338	41,914	電気通信サービス	
BANCO POPOLARE SC	214	308	135	16,801	銀行	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	244	350	377	46,698	資本財	
PIRELLI & C.	139	—	—	—	自動車・自動車部品	
UBI BANCA SPA	509	734	232	28,795	銀行	
TERNA SPA	917	1,281	620	76,875	公益事業	
UNIPOLSAI SPA	523	908	173	21,433	保険	
PRYSMIAN SPA	123	160	345	42,738	資本財	
EXOR SPA	56	93	299	37,096	各種金融	
ENEL GREEN POWER SPA	1,081	—	—	—	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	34,788 23	50,592 20	16,484 —	2,040,977 < 0.8% >	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)	109	154	1,402	173,647	自動車・自動車部品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	165	231	3,384	419,048	耐久消費財・アパレル	
PEUGEOT SA	232	366	499	61,849	自動車・自動車部品	
AXA SA	1,077	1,627	3,391	419,891	保険	
DANONE	343	487	2,952	365,563	食品・飲料・タバコ	
CARREFOUR SA	326	458	1,106	137,014	食品・生活必需品小売り	
VIVENDI	719	960	1,580	195,653	メディア	
INGENICO GROUP	—	45	465	57,623	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ALCATEL-LUCENT SA	1,680	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SOCIETE GENERALE SA	429	600	1,981	245,282	銀行	
AIR LIQUIDE SA	204	284	2,711	335,660	素材	
TOTAL SA	1,268	1,816	7,788	964,328	エネルギー	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	266	394	1,517	187,926	資本財	
ZODIAC AEROSPACE	110	168	351	43,524	資本財	
VINCI SA	279	396	2,560	317,049	資本財	
LAFARGE SA	110	—	—	—	素材	
SANOFI	708	971	6,752	836,076	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	254	380	755	93,545	公益事業	
L'OREAL	149	207	3,310	409,841	家庭用品・パーソナル用品	
ACCOR SA	124	175	680	84,200	消費者サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	311	461	2,535	313,981	資本財	
BNP PARIBAS	627	876	3,866	478,694	銀行	
ESSILOR INTERNATIONAL	121	169	1,936	239,786	ヘルスケア機器・サービス	
CAPGEMINI	84	135	1,105	136,853	ソフトウェア・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	32	48	245	30,371	食品・生活必需品小売り	
VALEO SA	45	65	912	112,927	自動車・自動車部品	
HERMES INTERNATIONAL	15	21	697	86,299	耐久消費財・アパレル	
VALLOUREC SA	63	—	—	—	エネルギー	
SODEXO	56	77	691	85,612	消費者サービス	
KERING	44	62	904	111,985	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	76	106	734	90,985	ソフトウェア・サービス	
TECHNIP SA	59	87	411	50,911	エネルギー	
CHRISTIAN DIOR SE	32	45	684	84,698	耐久消費財・アパレル	
ATOS SE	47	72	584	72,428	ソフトウェア・サービス	
ORANGE	1,098	1,644	2,416	299,232	電気通信サービス	
CNP ASSURANCES	100	142	200	24,768	保険	
IMERYS SA	19	29	183	22,704	素材	
SAFRAN SA	173	258	1,548	191,736	資本財	
RENAULT SA	113	158	1,291	159,885	自動車・自動車部品	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
PUBLICIS GROUPE	111	156	982	121,689	メディア
LAGARDERE SCA	71	95	202	25,118	メディア
JC DECAUX SA	40	61	218	27,078	メディア
SOCIETE BIC SA	17	23	294	36,493	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	99	167	487	60,359	資本財
THALES SA	54	86	666	82,567	資本財
PERNOD RICARD SA	125	175	1,679	207,901	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	610	874	795	98,490	銀行
ENGIE	860	1,215	1,595	197,600	公益事業
ALSTOM	127	128	284	35,219	資本財
ARKEMA	39	55	396	49,122	素材
LEGRAND SA	157	220	1,074	133,056	資本財
SCOR SE	91	126	371	45,943	保険
ADP	17	24	263	32,653	運輸
EDF	145	201	228	28,335	公益事業
NATIXIS	554	779	327	40,543	銀行
WENDEL	18	23	247	30,634	各種金融
BUREAU VERITAS SA	157	221	446	55,337	商業・専門サービス
EURAZEO	22	32	202	25,084	各種金融
EURAZEO-NEW	1	—	—	—	各種金融
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	179	255	386	47,864	公益事業
ILIAD SA	15	21	426	52,751	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	92	141	384	47,600	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	282	393	442	54,794	運輸
EDENRED	120	172	295	36,566	商業・専門サービス
REMY COINTREAU	14	19	140	17,357	食品・飲料・タバコ
REXEL SA	163	255	335	41,582	資本財
BOLLORE	511	711	239	29,617	運輸
NUMERICABLE-SFR	58	91	252	31,274	電気通信サービス
小 計	株 数	金 額			
銘柄数 < 比率 >	16,447	20,923	77,814	9,634,233	
(ユーロ…オランダ)					
QIAGEN N.V.	135	183	351	43,569	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV	566	786	490	60,697	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	535	743	499	61,847	自動車・自動車部品
FERRARI NV	—	105	400	49,595	自動車・自動車部品
AIRBUS GROUP SE	348	489	2,714	336,104	資本財
STMICROELECTRONICS NV	371	512	242	29,992	半導体・半導体製造装置
GEMALTO	46	66	380	47,085	ソフトウェア・サービス
WOLTERS KLUWER	180	249	852	105,562	メディア
KONINKLIJKE KPN NV	1,900	2,654	921	114,127	電気通信サービス
AKZO NOBEL	145	204	1,254	155,337	素材
HEINEKEN NV	136	190	1,575	195,012	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV	554	787	1,819	225,240	資本財
RELX NV	414	822	1,221	151,245	メディア
AEGON NV	1,074	1,506	727	90,046	保険
KONINKLIJKE AHOLD NV	530	688	1,327	164,408	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD HOLDING NV	75	105	492	60,973	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV	59	83	602	74,621	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	101	149	788	97,564	素材
ING GROEP NV-CVA	2,287	3,201	3,345	414,151	銀行
ASML HOLDING NV	207	286	2,326	288,076	半導体・半導体製造装置

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UNILEVER NV-CVA	966	1,346	5,282	654,058	家庭用品・パーソナル用品	
VOPAK	41	58	271	33,622	エネルギー	
BOSKALIS WESTMINSTER	51	72	254	31,523	資本財	
DELTA LLOYD NV	130	—	—	—	保険	
TNT EXPRESS NV	259	417	332	41,214	運輸	
OCI NV	49	73	105	13,119	素材	
NN GROUP NV	93	261	776	96,078	保険	
ALTICE NV - B	—	87	121	15,008	メディア	
ALTICE NV - A	—	310	426	52,806	メディア	
小 計	株 数 ・ 金 額	11,264	16,445	29,906	3,702,693	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	28	—	< 1.4% >	
(ユーロ…スペイン)						
BANCO POPULAR ESPANOL	1,061	1,432	297	36,772	銀行	
ENDESA SA	191	265	481	59,643	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	102	158	435	53,896	資本財	
IBERDROLA SA	3,070	4,556	2,751	340,701	公益事業	
TELEFONICA SA	2,651	3,725	3,449	427,117	電気通信サービス	
BANCO SANTANDER SA	8,525	11,932	4,819	596,703	銀行	
BANKINTER SA	403	553	352	43,583	銀行	
REPSOL SA	615	908	1,021	126,497	エネルギー	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,743	5,369	2,960	366,536	銀行	
GAS NATURAL SDG SA	208	293	494	61,215	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	645	898	2,514	311,377	小売	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	239	429	622	77,044	運輸	
MAPPRE SA	539	892	189	23,491	保険	
FERROVIAL SA	246	390	707	87,546	資本財	
FERROVIAL SA-RTS	237	—	—	—	資本財	
ZARDOYA OTIS SA	103	153	139	17,220	資本財	
ENAGAS SA	122	182	478	59,299	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	65	90	705	87,346	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	2,560	4,311	663	82,094	銀行	
CAIXABANK S.A	1,364	2,194	525	65,022	銀行	
GRIFOLS SA	88	245	452	55,979	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	264	361	1,445	178,968	ソフトウェア・サービス	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	493	681	447	55,455	運輸	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	371	486	232	28,794	食品・生活必需品小売り	
BANKIA SA	2,716	3,782	289	35,829	銀行	
AENA SA	36	55	679	84,170	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額	30,669	44,354	27,157	3,362,311	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	25	—	< 1.2% >	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS	128	166	540	66,937	保険	
UCB SA	74	104	697	86,384	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	477	665	7,400	916,197	食品・飲料・タバコ	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	48	66	486	60,178	各種金融	
DELHAIZE GROUP	60	85	787	97,509	食品・生活必需品小売り	
UMICORE	55	78	352	43,607	素材	
COLRUYT SA	42	58	293	36,334	食品・生活必需品小売り	
KBC GROEP NV	149	207	947	117,290	銀行	
SOLVAY SA	34	61	549	67,977	素材	
PROXIMUS	90	126	354	43,869	電気通信サービス	

銘柄	株数	期首(前期末)			業種等	
		当		期末		
		株数	株数			評価額
株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額			
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円		
TELENET GROUP HOLDING NV	30	46	197	24,454	メディア	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,193	1,667	12,605	1,560,740	
		11	11	—	<0.6%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG	166	232	545	67,479	銀行	
OMV AG	85	123	310	38,419	エネルギー	
VOESTALPINE AG	65	93	269	33,338	素材	
IMMOFINANZ AG	554	—	—	—	不動産	
ANDRITZ AG	42	64	291	36,069	資本財	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	69	103	126	15,609	銀行	
VIENNA INSURANCE GROUP AG	24	—	—	—	保険	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,008	616	1,542	190,916	
		7	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP	22	31	235	29,208	メディア	
TENARIS SA	276	386	435	53,885	エネルギー	
SES	180	270	653	80,891	メディア	
ARCELORMITTAL	590	1,408	612	75,848	素材	
ALTICE SA	51	—	—	—	メディア	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,122	2,096	1,937	239,833	
		5	4	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ	2,219	4,772	2,214	274,159	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STORA ENSO OYJ-R SHS	323	452	335	41,518	素材	
NOKIAN RENKAAT OYJ	67	94	304	37,728	自動車・自動車部品	
UPM-KYMMENE OYJ	314	439	731	90,610	素材	
FORTUM OYJ	267	371	473	58,605	公益事業	
KONE OYJ-B	187	277	1,096	135,813	資本財	
METSO OYJ	67	93	189	23,406	資本財	
SAMPO OYJ-A SHS	265	368	1,443	178,680	保険	
WARTSILA OYJ ABP	86	121	446	55,280	資本財	
ELISA OYJ	84	118	384	47,544	電気通信サービス	
NESTE OYJ	73	106	307	38,073	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	60	84	257	31,857	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>	4,019	7,301	8,184	1,013,278	
		12	12	—	<0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A	96	135	1,084	134,317	食品・飲料・タバコ	
PADDY POWER BETFAIR PLC	—	70	792	98,107	消費者サービス	
IRISH BANK RESOLUTION CORPOR	472	472	—	—	銀行	
BANK OF IRELAND	16,439	23,370	574	71,180	銀行	
CRH PLC	490	691	1,765	218,569	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,499	24,739	4,217	522,174	
		4	5	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,362	1,934	601	74,522	公益事業	
JERONIMO MARTINS	149	207	285	35,340	食品・生活必需品小売り	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	21,117	35,849	114	14,203	銀行	

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円		
GALP ENERGIA SGPS SA	227	383	451	55,924		エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	22,857	38,374	1,453	179,990	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.1% >	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	153,656	225,438	258,756	32,036,661	
	銘柄 数 < 比 率 >	237	230	—	< 11.9% >	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC	9,750	13,882	2,271	355,493		銀行
BP PLC	10,812	15,163	5,476	857,241		エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	33,849	47,240	3,103	485,714		銀行
ASTRAZENECA PLC	748	1,045	4,110	643,391		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC	235	326	358	56,078		資本財
NEXT PLC	90	120	640	100,321		小売
DIAGEO PLC	1,490	2,080	3,922	613,952		食品・飲料・タバコ
SKY PLC	611	856	796	124,729		メディア
BAE SYSTEMS PLC	1,867	2,614	1,282	200,685		資本財
UNILEVER PLC	760	1,060	3,341	523,004		家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC	4,811	6,742	1,074	168,167		食品・生活必需品小売り
RELX PLC	671	920	1,130	177,002		メディア
MARKS & SPENCER GROUP PLC	966	1,348	563	88,208		小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	383	526	3,612	565,489		家庭用品・パーソナル用品
PRUDENTIAL PLC	1,521	2,127	2,781	435,312		保険
BG GROUP PLC	2,023	—	—	—		エネルギー
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,519	4,916	1,066	166,975		保険
SAGE GROUP PLC/THE	637	893	535	83,815		ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	11,377	16,192	6,981	1,092,761		銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,105	1,542	6,548	1,024,965		食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	406	581	550	86,227		公益事業
SCHRODERS PLC	74	102	252	39,525		各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,501	2,873	614	96,116		銀行
BHP BILLITON PLC	1,250	1,747	1,461	228,824		素材
IMPERIAL BRANDS PLC	567	793	3,015	472,056		食品・飲料・タバコ
WPP PLC	778	1,070	1,713	268,132		メディア
CENTRICA PLC	2,950	4,221	886	138,743		公益事業
BT GROUP PLC	4,824	7,008	3,062	479,275		電気通信サービス
SSE PLC	587	839	1,270	198,906		公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	1,464	2,708	1,346	210,814		銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,117	1,520	1,001	156,737		資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF C	158,293	112,647	11	1,763		資本財
COMPASS GROUP PLC	987	1,358	1,699	266,069		消費者サービス
KINGFISHER PLC	1,400	1,891	686	107,467		小売
PEARSON PLC	486	678	548	85,816		メディア
SEVERN TRENT PLC	144	203	453	70,994		公益事業
RIO TINTO PLC	753	1,025	2,083	326,161		素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,881	4,027	5,940	929,766		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SABMILLER PLC	573	803	3,398	531,888		食品・飲料・タバコ
PROVIDENT FINANCIAL PLC	—	121	338	53,053		各種金融
3I GROUP PLC	582	793	378	59,256		各種金融
GKN PLC	968	1,415	396	62,118		自動車・自動車部品
VODAFONE GROUP PLC	15,710	21,964	4,882	764,255		電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	1,256	1,835	347	54,409		食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	721	1,109	291	45,685		食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	2,370	3,343	1,415	221,612		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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
CAPITA PLC	394	552	605	94,698	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC	588	806	334	52,320	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	122	159	460	72,090	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	609	841	403	63,187	保険
WHITBREAD PLC	108	150	591	92,514	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	2,230	3,112	3,103	485,719	公益事業
ARM HOLDINGS PLC	831	1,162	1,100	172,192	半導体・半導体製造装置
WOLSELEY PLC	155	210	825	129,143	資本財
BUNZL PLC	199	277	578	90,475	資本財
COBHAM PLC	670	976	157	24,708	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	825	1,160	716	112,109	素材
INTERTEK GROUP PLC	95	134	448	70,198	商業・専門サービス
WILLIAM HILL PLC	518	725	221	34,740	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	265	367	429	67,293	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	140	171	463	72,557	消費者サービス
CARNIVAL PLC	107	156	563	88,196	消費者サービス
PERSIMMON PLC	180	252	494	77,330	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	483	641	263	41,275	資本財
ICAP PLC	332	455	211	33,043	各種金融
ITV PLC	2,282	3,161	680	106,551	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	185	258	667	104,492	各種金融
G4S PLC	933	1,293	249	39,085	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS	—	107	310	48,651	耐久消費財・アパレル
AMEC FOSTER WHEELER PLC	228	—	—	—	エネルギー
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	—	826	432	67,755	耐久消費財・アパレル
IMI PLC	160	225	222	34,870	資本財
REXAM PLC	417	590	371	58,090	素材
SMITH & NEPHEW PLC	531	740	856	134,045	ヘルスケア機器・サービス
TATE & LYLE PLC	276	394	240	37,602	食品・飲料・タバコ
TAYLOR WIMPEY PLC	—	2,685	482	75,505	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,318	3,260	5,655	885,192	エネルギー
PETROFAC LTD	153	209	171	26,912	エネルギー
TRAVIS PERKINS PLC	145	205	373	58,414	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,446	3,280	5,732	897,187	エネルギー
OLD MUTUAL PLC	2,904	4,078	701	109,787	保険
INVESTEC PLC	327	470	226	35,413	各種金融
STANDARD LIFE PLC	1,166	1,628	520	81,408	保険
EXPERIAN PLC	587	799	1,011	158,360	商業・専門サービス
MONDI PLC	—	302	408	63,970	素材
WEIR GROUP PLC/THE	125	181	202	31,759	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	211	294	914	143,084	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC	233	317	135	21,182	素材
TULLOW OIL PLC	532	—	—	—	エネルギー
SHIRE PLC	349	490	2,053	321,403	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INMARSAT PLC	251	374	300	46,960	電気通信サービス
ADMIRAL GROUP PLC	117	174	334	52,426	保険
FRESNILLO PLC	130	178	191	29,992	素材
RANDGOLD RESOURCES LTD	51	76	469	73,409	素材
AGGREKO PLC	151	207	218	34,260	商業・専門サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	148	208	201	31,496	商業・専門サービス
ST JAMES' S PLACE PLC	—	434	376	58,983	保険
GLENCORE PLC	6,585	10,122	1,385	216,827	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		
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	551	759	202	31,755	各種金融	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	140	215	271	42,558	各種金融	
CRODA INTERNATIONAL PLC	79	113	341	53,383	素材	
MELROSE INDUSTRIES PLC	584	—	—	—	資本財	
COCA-COLA HBC AG-DI	115	165	231	36,253	食品・飲料・タバコ	
EASYJET PLC	96	141	210	32,992	運輸	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	886	1,127	427	66,859	保険	
ROYAL MAIL PLC	382	743	370	57,943	運輸	
ASHTREAD GROUP PLC	300	416	374	58,567	資本財	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	165	236	89	13,935	小売	
MERLIN ENTERTAINMENT	418	587	253	39,674	消費者サービス	
TUI AG-DI	269	410	432	67,656	消費者サービス	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	—	304	266	41,705	ヘルスケア機器・サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC	—	792	302	47,320	ソフトウェア・サービス	
WORLDPAY GROUP PLC	—	1,170	307	48,199	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 銘柄 数 < 比 率 >	325,695 104	353,365 109	129,802 —	20,316,680 <7.5%>	
(スイス)			千スイスフラン			
NESTLE SA-REG	1,912	2,637	19,187	2,141,894	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	309	431	2,684	299,657	耐久消費財・アパレル	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	904	1,487	2,034	227,107	各種金融	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	135	376	1,660	185,328	素材	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	416	581	14,184	1,583,383	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GIVAUDAN-REG	5	7	1,473	164,515	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	31	44	602	67,216	ヘルスケア機器・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	88	124	2,686	299,863	保険	
SYNGENTA AG-REG	55	76	3,012	336,333	素材	
LONZA GROUP AG-REG	31	43	739	82,558	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	29	40	257	28,722	耐久消費財・アパレル	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	26	36	643	71,778	資本財	
GEBERIT AG-REG	22	31	1,154	128,925	資本財	
SWISS RE AG	208	290	2,527	282,098	保険	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	18	25	822	91,852	耐久消費財・アパレル	
PARGESA HOLDING SA-BR	19	27	173	19,334	各種金融	
NOVARTIS AG-REG	1,364	1,882	13,788	1,539,227	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	101	137	808	90,222	商業・専門サービス	
SWISSCOM AG-REG	13	21	1,035	115,627	電気通信サービス	
ABB LTD-REG	1,302	1,819	3,681	410,990	資本財	
SGS SA-REG	3	4	951	106,256	商業・専門サービス	
SULZER AG-REG	13	11	100	11,195	資本財	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	12	16	295	32,965	資本財	
ACTELION LTD-REG	60	84	1,329	148,460	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	32	44	605	67,589	運輸	
BALOISE HOLDING AG - REG	28	40	476	53,222	保険	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	18	26	639	71,426	保険	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.06	0.09	648	72,441	食品・飲料・タバコ	
ARYZTA AG	52	74	282	31,577	食品・飲料・タバコ	
JULIUS BAER GROUP LTD	133	185	729	81,450	各種金融	
SIKA AG-BR	1	1	745	83,236	素材	
TRANSOCEAN LTD	211	—	—	—	エネルギー	
SWISS PRIME SITE-REG	34	55	469	52,402	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.55	0.81	491	54,885	食品・飲料・タバコ	

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		
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	10	13	530	59,185	各種金融	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	211	23,628	食品・飲料・タバコ	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	5	6	317	35,414	素材	
UBS GROUP AG-REG	2,164	3,026	4,688	523,404	各種金融	
DUFREY AG-REG	—	33	439	49,023	小売	
GALENICA AG-REG	—	3	435	48,573	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	9,781	13,757	87,547	9,772,976	
	銘柄 数 < 比 率 >	38	39	—	< 3.6% >	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ			
ELECTROLUX AB-SER B	140	199	4,585	61,124	耐久消費財・アパレル	
ERICSSON LM-B SHS	1,804	2,516	15,592	207,847	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ATLAS COPCO AB-B SHS	234	321	6,042	80,541	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	901	1,254	9,429	125,696	銀行	
INVESTOR AB-B SHS	271	375	10,196	135,914	各種金融	
NORDEA BANK AB	1,801	2,509	19,198	255,917	銀行	
GETINGE AB-B SHS	118	166	2,808	37,434	ヘルスケア機器・サービス	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	296	1,239	12,777	170,322	銀行	
ATLAS COPCO AB-A SHS	400	556	11,324	150,954	資本財	
SKF AB-B SHARES	233	329	4,787	63,813	資本財	
ASSA ABLOY AB-B	198	829	13,665	182,161	資本財	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	562	784	20,827	277,636	小売	
SANDVIK AB	635	882	7,035	93,789	資本財	
SWEDBANK AB - A SHARES	537	749	12,938	172,474	銀行	
SECURITAS AB-B SHS	182	259	3,252	43,349	商業・専門サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	348	500	12,647	168,584	家庭用品・パーソナル用品	
SKANSKA AB-B SHS	223	313	5,641	75,201	資本財	
SWEDISH MATCH AB	120	163	4,440	59,197	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	188	255	1,983	26,445	電気通信サービス	
TELIA CO AB	1,536	2,147	8,063	107,485	電気通信サービス	
VOLVO AB-B SHS	909	1,274	11,822	157,592	資本財	
ALFA LAVAL AB	188	242	3,040	40,529	資本財	
ELEKTA AB-B SHS	214	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
LUNDIN PETROLEUM AB	125	179	2,648	35,305	エネルギー	
BOLIDEN AB	159	225	3,064	40,855	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	240	355	2,329	31,056	耐久消費財・アパレル	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	38	55	2,484	33,124	電気通信サービス	
HEXAGON AB-B SHS	150	214	6,676	89,003	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	140	194	4,291	57,199	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	95	129	1,796	23,942	各種金融	
ICA GRUPPEN AB	46	68	1,876	25,016	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額	13,047	19,293	227,270	3,029,520	
	銘柄 数 < 比 率 >	31	30	—	< 1.1% >	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	580	809	7,980	105,982	銀行	
NORSK HYDRO ASA	805	1,105	3,523	46,797	素材	
ORKLA ASA	475	669	5,042	66,958	食品・飲料・タバコ	
STATOIL ASA	662	924	12,477	165,699	エネルギー	
TELENOR ASA	445	621	8,596	114,158	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	105	147	4,314	57,291	素材	
SUBSEA 7 SA	166	—	—	—	エネルギー	
SEADRILL LTD	233	—	—	—	エネルギー	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	119	170	2,335	31,020	保険	

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェークローネ	千円	
SCHIBSTED ASA-CL A	—	64	1,720	22,851	メディア
SCHIBSTED ASA-B SHS	—	76	1,973	26,210	メディア
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,595 9	4,588 9	47,964 —	636,971 <0.2%>
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
NOVO NORDISK A/S-B	1,189	1,621	58,108	966,924	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	142	193	6,093	101,390	素材
DANSKE BANK A/S	388	585	10,730	178,562	銀行
WILLIAM DEMANT HOLDING	12	21	1,401	23,322	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	131	185	8,421	140,137	資本財
TDC A/S	478	675	2,302	38,317	電気通信サービス
CARLSBERG AS-B	63	88	5,494	91,436	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B	66	92	4,528	75,349	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S	105	160	4,525	75,300	運輸
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	4	5	4,926	81,981	運輸
TRYG A/S	13	93	1,160	19,303	保険
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	2	3	2,743	45,643	運輸
PANDORA A/S	68	91	8,649	143,922	耐久消費財・アパレル
ISS A/S	71	123	3,148	52,392	商業・専門サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	—	82	3,376	56,181	素材
GENMAB A/S	—	44	4,400	73,216	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>	2,739 14	4,067 16	130,011 —	2,163,383 <0.8%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
BHP BILLITON LIMITED	1,904	2,662	4,939	394,700	素材
CSL LTD	282	385	4,245	339,254	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINA LTD	1,564	2,146	284	22,729	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	441	618	1,634	130,642	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,639	2,412	5,893	470,988	銀行
RIO TINTO LTD	258	353	1,626	130,010	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	815	1,147	1,344	107,425	保険
LENLEASE GROUP	329	468	633	50,638	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	963	1,416	11,049	882,944	銀行
WESTPAC BANKING CORP	1,848	2,757	8,633	689,904	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,387	2,180	6,298	503,299	銀行
BRAMBLES LTD	940	1,325	1,734	138,565	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	373	494	168	13,476	運輸
BORAL LTD	466	622	428	34,251	素材
WOOLWORTHS LTD	750	1,057	2,410	192,634	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	2,553	3,585	2,047	163,585	電気通信サービス
AMP LTD	1,763	2,496	1,452	116,100	保険
TABCORP HOLDINGS LTD	518	692	297	23,798	消費者サービス
AMCOR LIMITED	722	970	1,559	124,595	素材
COMPUTERSHARE LTD	287	403	419	33,556	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	—	464	487	38,919	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	172	256	1,811	144,769	各種金融
CIMIC GROUP LTD	64	84	318	25,483	資本財
ASX LTD	117	165	742	59,312	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	351	501	460	36,780	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	35	48	563	45,021	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	276	377	743	59,438	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	354	467	218	17,499	小売

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額	金額		
			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		
NEWREST MINING LTD	454	637	1,309	104,632	素材	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,392	2,050	1,240	99,113	保険	
ORIGIN ENERGY LTD	664	1,462	743	59,381	エネルギー	
ORICA LTD	222	312	426	34,094	素材	
SONIC HEALTHCARE LTD	229	332	678	54,231	ヘルスケア機器・サービス	
SANTOS LTD	590	1,400	568	45,443	エネルギー	
SUNCORP GROUP LTD	776	1,080	1,390	111,130	保険	
TRANSURBAN GROUP	1,097	1,714	2,130	170,279	運輸	
WESFARMERS LTD	668	936	4,040	322,915	食品・生活必需品小売り	
TOLL HOLDINGS LTD	412	—	—	—	運輸	
CHALLENGER LTD	—	485	451	36,102	各種金融	
SYDNEY AIRPORT	667	949	693	55,389	運輸	
CALTEX AUSTRALIA LTD	163	227	766	61,229	エネルギー	
OTL SEARCH LTD	—	1,148	774	61,871	エネルギー	
WORLEYPARSONS LTD	128	—	—	—	エネルギー	
AGL ENERGY LTD	405	582	1,101	87,983	公益事業	
TATTS GROUP LTD	891	1,244	491	39,281	消費者サービス	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	911	1,276	371	29,678	素材	
ASCIANO LTD	585	547	487	38,961	運輸	
ILUKA RESOURCES LTD	251	354	216	17,313	素材	
AUSNET SERVICES	1,155	1,718	278	22,250	公益事業	
CROWN RESORTS LTD	212	300	361	28,896	消費者サービス	
INCITEC PIVOT LTD	1,020	1,427	461	36,841	素材	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	270	400	385	30,789	銀行	
AURIZON HOLDINGS LTD	1,304	1,764	802	64,166	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	382	619	634	50,701	食品・飲料・タバコ	
ALS LTD	252	—	—	—	商業・専門サービス	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	79	120	836	66,825	ヘルスケア機器・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	34	47	185	14,860	消費者サービス	
SEEK LTD	190	284	467	37,374	商業・専門サービス	
BANK OF QUEENSLAND LTD	228	328	374	29,917	銀行	
REA GROUP LTD	33	48	259	20,774	メディア	
TPG TELECOM LTD	176	247	286	22,881	電気通信サービス	
HEALTHSCOPE LTD	705	1,457	408	32,609	ヘルスケア機器・サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,652	2,309	729	58,330	保険	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	139	195	120	9,600	各種金融	
SOUTH32 LTD	—	4,430	717	57,356	素材	
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	—	390	346	27,705	電気通信サービス	
小計	株数・金額	39,535	63,400	87,989	7,031,240	
	銘柄数<比率>	61	63	—	<2.6%>	
(ニュージーランド)						
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,069	1,518	560	41,480	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	556	803	537	39,803	運輸	
CONTACT ENERGY LTD	231	630	333	24,659	公益事業	
FLETCHER BUILDING LTD	393	573	492	36,486	素材	
RYMAN HEALTHCARE LTD	213	321	298	22,095	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	797	1,118	306	22,697	公益事業	
MIGHTY RIVER POWER	452	644	197	14,592	公益事業	
小計	株数・金額	3,713	5,610	2,726	201,815	
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>	
(香港)						
WHARF HOLDINGS LTD	900	1,130	千香港ドル	4,661	65,117	不動産

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
HUTCHISON WHAMPOA LTD	1,270	—	—	—	資本財	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	375	490	4,044	56,507	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	820	2,238	20,830	291,007	資本財	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,000	1,440	13,140	183,565	不動産	
MTR CORP	875	1,225	4,704	65,714	運輸	
HONG KONG & CHINA GAS	3,782	5,865	8,481	118,492	公益事業	
NEW WORLD DEVELOPMENT	3,050	4,500	3,244	45,325	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	830	1,165	8,964	125,236	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	658	950	17,651	246,584	各種金融	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	720	1,020	1,240	17,327	運輸	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,310	1,870	2,655	37,095	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	1,135	1,595	11,643	162,659	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	618	958	4,429	61,874	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	698	990	2,742	38,317	銀行	
HANG SENG BANK LTD	452	632	8,664	121,046	銀行	
HYSAN DEVELOPMENT CO	380	540	1,738	24,291	不動産	
SHANGRI-LA ASIA LTD	600	1,080	968	13,533	消費者サービス	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	137	209	1,146	16,014	半導体・半導体製造装置	
SINO LAND CO	1,774	2,514	2,865	40,037	不動産	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	435	610	1,726	24,116	耐久消費財・アパレル	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	370	570	4,283	59,841	公益事業	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,200	3,060	6,854	95,755	銀行	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	805	1,150	3,524	49,240	耐久消費財・アパレル	
PCCW LTD	2,510	3,530	1,803	25,199	電気通信サービス	
LI & FUNG LTD	3,400	4,900	2,146	29,982	耐久消費財・アパレル	
KERRY PROPERTIES LTD	395	520	1,011	14,136	不動産	
NWS HOLDINGS LTD	895	1,285	1,547	21,613	資本財	
SANDS CHINA LTD	1,436	2,008	5,532	77,282	消費者サービス	
WHELOCK & CO LTD	550	750	2,606	36,409	不動産	
WYNN MACAU LTD	904	1,272	1,422	19,866	消費者サービス	
SJM HOLDINGS LTD	1,150	1,660	790	11,038	消費者サービス	
FIRST PACIFIC CO	1,420	2,080	1,002	14,005	各種金融	
AIA GROUP LTD	7,146	9,976	43,345	605,539	保険	
SWIRE PROPERTIES LTD	704	1,004	1,999	27,939	不動産	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,370	1,940	4,811	67,212	消費者サービス	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	552	852	886	12,378	消費者サービス	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,530	2,280	2,576	35,992	電気通信サービス	
WH GROUP LTD	2,240	4,875	2,949	41,202	食品・飲料・タバコ	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	—	2,238	10,532	147,145	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	51,397	76,974	225,171	3,145,651	
	銘柄 数 < 比 率 >	39	39	—	< 1.2% >	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,794	2,561	2,133	169,193	銀行	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	972	1,344	520	41,266	メディア	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	590	801	213	16,961	資本財	
CAPITALAND LTD	1,530	2,156	642	50,955	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	250	360	289	22,955	不動産	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	64	97	330	26,179	小売	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,040	1,461	2,143	169,984	銀行	
KEPPEL CORP LTD	870	1,208	618	49,052	資本財	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	773	1,071	1,880	149,156	銀行	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	950	1,357	428	34,009	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		
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,762	6,613	2,539	201,417	電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	343	479	558	44,294	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	500	671	500	39,699	各種金融	
SEMBCORP MARINE LTD	500	660	100	7,956	資本財	
UOL GROUP LTD	290	391	219	17,396	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,230	1,810	503	39,907	運輸	
NOBLE GROUP LTD	2,710	4,185	146	11,619	資本財	
STARHUB LTD	400	565	187	14,832	電気通信サービス	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	4,393	6,110	223	17,689	食品・飲料・タバコ	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,150	1,606	528	41,905	食品・飲料・タバコ	
GENTING SINGAPORE PLC	3,700	4,988	379	30,065	消費者サービス	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	1,880	2,640	465	36,955	不動産	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	1,150	1,726	155	12,320	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	31,844	44,863	15,707	1,245,773	
	銘柄 数 < 比 率 >	23	23	—	<0.5%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
ISRAEL CHEMICALS LTD	258	406	668	19,270	素材	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	510	755	15,128	436,310	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BANK HAPOALIM BM	616	877	1,704	49,143	銀行	
NICE SYSTEMS LTD	34	48	1,179	34,021	ソフトウェア・サービス	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	777	1,161	1,620	46,732	銀行	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	1	—	—	—	素材	
DELEK GROUP LTD	2	3	275	7,956	エネルギー	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	1,127	1,607	1,301	37,546	電気通信サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	80	120	517	14,938	銀行	
AZRIELI GROUP	—	31	481	13,874	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,409	5,013	22,877	659,793	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.2%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	846,139	1,109,747	—	255,005,772	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,258	1,260	—	<94.4%>	

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

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

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
HCP INC	27	38	1,312	142,236	0.1	
MACERICH CO/THE	8	11	866	93,856	0.0	
PROLOGIS INC	29	43	2,034	220,503	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST	5	7	614	66,590	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	8	12	1,126	122,123	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3	5	1,263	136,895	0.1	
EXTRA SPACE STORAGE INC	—	9	892	96,716	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	4	5	894	96,956	0.0	
WELLTOWER INC	20	29	2,080	225,517	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	9	12	1,666	180,583	0.1	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	6	634	68,737	0.0	
REALTY INCOME CORP	13	20	1,304	141,409	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	5	7	609	66,059	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	5	8	866	93,880	0.0	
UDR INC	15	21	797	86,464	0.0	
VENTAS INC	19	27	1,806	195,778	0.1	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	55	77	856	92,850	0.0	
RAYONIER INC	7	—	—	—	—	
WEYERHAEUSER CO	30	65	2,022	219,215	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	24	35	3,711	402,162	0.1	
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	20	28	536	58,088	0.0	
VEREIT INC	53	75	722	78,319	0.0	
DUKE REALTY CORP	20	28	663	71,873	0.0	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	15	409	44,333	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	9	17	648	70,318	0.0	
EQUINIX INC	3	5	1,881	203,869	0.1	
COMMUNICATIONS SALES & LE	7	—	—	—	—	
CROWN CASTLE INTL CORP	—	27	2,490	269,940	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	20	30	2,103	228,007	0.1	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	31	47	1,318	142,931	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	44	62	997	108,126	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	8	12	448	48,638	0.0	
PLUM CREEK TIMBER CO	10	—	—	—	—	
PUBLIC STORAGE	8	12	3,155	341,926	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	18	25	5,208	564,481	0.2	
VORNADO REALTY TRUST	9	14	1,351	146,500	0.1	
KIMCO REALTY CORP	24	34	1,000	108,451	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	7	11	2,115	229,297	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	592	892	50,416	5,463,644	
	銘柄 数 < 比 率 >	34	35	—	<2.0%>	
(カナダ)				千カナダドル		
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	—	5	181	15,299	0.0	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	7	11	240	20,250	0.0	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		9	13	370	31,252	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	17	29	792	66,802	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	3	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		1	2	359	44,485	0.0
KLEPIERRE		10	18	744	92,180	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		5	8	1,913	236,890	0.1
FONCIERE DES REGIONS		1	2	202	25,025	0.0
ICADE		2	2	186	23,084	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	21	34	3,405	421,666	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.2% >	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		57	80	583	91,374	0.0
HAMMERSON PLC		46	65	377	59,117	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		46	65	752	117,785	0.0
INTU PROPERTIES PLC		54	78	229	35,967	0.0
SEGRO PLC		44	62	262	41,163	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	249	351	2,206	345,408	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.1% >	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		90	285	976	78,011	0.0
SCENTRE GROUP		316	446	2,054	164,143	0.1
NOVION PROPERTY GROUP		132	—	—	—	—
GPT GROUP		102	153	800	63,994	0.0
MIRVAC GROUP		226	317	620	49,577	0.0
STOCKLAND		141	202	929	74,289	0.0
WESTFIELD CORP		117	165	1,779	142,238	0.1
DEXUS PROPERTY GROUP		57	83	711	56,893	0.0
GOODMAN GROUP		104	149	1,082	86,470	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,289	1,803	8,955	715,618	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	8	—	< 0.3% >	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		135	186	8,653	120,890	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	135	186	8,653	120,890	
	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	211	349	27,703	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		131	172	240	19,107	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		146	215	446	35,411	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		122	183	446	35,441	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	542	784	1,483	117,664	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.0% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	2,847	4,083	—	7,251,695	
	銘柄 数 < 比 率 >	60	61	—	< 2.7% >	

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引		百万円	百万円
		SP EMINI	4,951	—
		SP/TSE60	297	—
		SWISS IX	281	—
		EURO ST	1,165	—
		SPI 200	299	—
		FTSE100	594	—

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

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	255,005,772	94.4
投資証券	7,251,695	2.7
コール・ローン等、その他	7,907,174	2.9
投資信託財産総額	270,164,641	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(269,579,000千円)の投資信託財産総額(270,164,641千円)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=108.37円	1 カナダドル=84.33円	1 ユーロ=123.81円	1 イギリスポンド=156.52円
1 スイスフラン=111.63円	1 スウェーデンクローネ=13.33円	1 ノルウェークローネ=13.28円	1 デンマーククローネ=16.64円
1 オーストラリアドル=79.91円	1 ニュージーランドドル=74.03円	1 香港ドル=13.97円	1 シンガポールドル=79.31円
1 イスラエルシェゲル=28.84円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	270,567,377,983
コール・ローン等	5,990,555,724
株式(評価額)	255,005,772,397
投資証券(評価額)	7,251,695,005
未収入金	448,779,016
未収配当金	509,853,785
差入委託証拠金	1,360,722,056
(B) 負債	501,616,589
未払金	489,693,779
未払解約金	11,915,982
未払利息	986
その他未払費用	5,842
(C) 純資産総額(A-B)	270,065,761,394
元本	136,910,588,935
次期繰越損益金	133,155,172,459
(D) 受益権総口数	136,910,588,935口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,726円

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,144,972,744
受取配当金	5,114,973,722
受取利息	605,578
その他収益金	32,650,193
支払利息	△ 3,256,749
(B) 有価証券売買損益	△ 39,922,483,936
売買益	14,666,285,344
売買損	△ 54,588,769,280
(C) 先物取引等取引損益	△ 413,189,353
取引益	1,107,317,888
取引損	△ 1,520,507,241
(D) 保管費用等	△ 120,160,518
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 35,310,861,063
(F) 前期繰越損益金	128,865,980,554
(G) 追加信託差損益金	118,154,658,797
(H) 解約差損益金	△ 78,554,605,829
(I) 計(E+F+G+H)	133,155,172,459
次期繰越損益金(I)	133,155,172,459

<注記事項>

- ①期首元本額 98,648,858,071円
 期中追加設定元本額 105,675,196,642円
 期中一部解約元本額 67,413,465,778円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.9726円です。

- (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）	2,448,719,365円
eMAXIS 先進国株式インデックス	16,378,104,804円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,138,768,930円
eMAXIS バランス（波乗り型）	120,737,094円
コアバランス	219,720円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	5,850,610,646円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,408,019,604円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	823,810,399円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	1,882,465,423円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	85,978,515円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	16,118,943,652円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	16,679,805,595円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	347,095,316円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	2,909,896,008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）	46,542,204,119円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	271,114,613円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	119,808,786円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	2,054,265,694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）	3,180,423,248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）	52,918,604円
MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	6,872,839,069円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	1,903,425,272円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	7,173,466円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	22,285,032円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	51,267,580円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	47,118,237円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	166,480,868円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	36,705,073円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	291,823,087円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	65,215,077円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	523,982,813円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	4,096,664,594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）	196,823,527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）	767,070,036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）	695,163,101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）	581,896,994円
アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）	530,050,843円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	416,410,090円
アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）	92,997,552円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	13,474,781円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	59,237円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	85,793円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	102,421円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	15,891,218円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	464,062円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	3,556,879円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	1,527,502円
eMAXIS 最適化バランス（マイフワード）	4,840,689円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	2,003,954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）	89,261,136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）	18,817円
合計	136,910,588,935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)

日本債券インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2016年5月12日

〔計算期間：2015年5月13日～2016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	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		NOMURA-BPI 総 合 イ ン デ ッ ク ス		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	円	騰 落 中 率		騰 落 中 率			
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
15期(2016年5月12日)	13,473	7.2	387.29	7.2	99.6	—	529,456

(注) NOMURA-BPI総合インデックスとは、野村証券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI総合インデックスは野村証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、野村証券株式会社は一切関係ありません。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		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
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年5月12日	円	%		%	%	%
	12,572	—	361.38	—	99.4	0.3
5月末	12,620	0.4	362.77	0.4	99.2	0.4
6月末	12,613	0.3	362.54	0.3	99.5	0.3
7月末	12,649	0.6	363.58	0.6	99.3	0.4
8月末	12,670	0.8	364.20	0.8	99.3	0.4
9月末	12,707	1.1	365.24	1.1	99.0	0.1
10月末	12,755	1.5	366.65	1.5	98.9	0.1
11月末	12,754	1.4	366.58	1.4	99.4	0.1
12月末	12,832	2.1	368.88	2.1	99.4	—
2016年1月末	12,991	3.3	373.52	3.4	99.0	0.1
2月末	13,214	5.1	379.83	5.1	98.8	0.3
3月末	13,320	5.9	382.91	6.0	101.6	0.1
4月末	13,437	6.9	386.25	6.9	99.8	—
(期 末) 2016年5月12日						
	13,473	7.2	387.29	7.2	99.6	—

(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7.2%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(7.2%)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

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
- ・なお、期末時点では、資金フロー対応のため、債券先物のポジションは保有しておりません。
- ・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7.2%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度と低水準に抑制し、高い運動性を維持しました。

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

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

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

◎その他の要因

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

◎今後の運用方針

- ・ベンチマークである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

(2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、12,880円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年5月13日～2016年5月12日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	240,143,108	110,760,622
	地方債証券	14,052,879	4,085,436
	特殊債券	20,627,787	5,898,067 (523,705)
	社債券	11,239,981	5,506,287 (980,000)

(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	百万円	百万円	百万円
		11,739	12,952	—	—

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 286,063	百万円 84,760	% 29.6	百万円 126,250	百万円 49,856	% 39.5

(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 1,136	百万円 302	百万円 1,990

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 1,600

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

○組入資産の明細

(2016年5月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		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	380,496,000 (100,000)	430,939,878 (100,703)	81.4 (0.0)	— (—)	50.7 (—)	21.3 (0.0)	9.3 (—)
地方債証券	28,006,180 (28,006,180)	30,032,413 (30,032,413)	5.7 (5.7)	— (—)	4.0 (4.0)	1.4 (1.4)	0.2 (0.2)
特殊債券 (除く金融債)	36,130,167 (36,130,167)	39,037,654 (39,037,654)	7.4 (7.4)	— (—)	5.3 (5.3)	1.4 (1.4)	0.7 (0.7)
金融債券	4,340,000 (4,340,000)	4,372,982 (4,372,982)	0.8 (0.8)	— (—)	0.0 (0.0)	0.6 (0.6)	0.2 (0.2)
普通社債券	21,917,000 (21,917,000)	22,919,698 (22,919,698)	4.3 (4.3)	0.2 (0.2)	1.3 (1.3)	2.1 (2.1)	0.9 (0.9)
合 計	470,889,347 (90,493,347)	527,302,626 (96,463,451)	99.6 (18.2)	0.2 (0.2)	61.3 (10.5)	27.0 (5.6)	11.4 (2.0)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第353回利付国債 (2年)	0.1	1,190,000	1,194,843	2017/6/15
第354回利付国債 (2年)	0.1	680,000	682,978	2017/7/15
第355回利付国債 (2年)	0.1	4,850,000	4,872,795	2017/8/15
第356回利付国債 (2年)	0.1	2,250,000	2,261,430	2017/9/15
第357回利付国債 (2年)	0.1	2,750,000	2,764,850	2017/10/15
第358回利付国債 (2年)	0.1	3,800,000	3,821,736	2017/11/15
第359回利付国債 (2年)	0.1	2,000,000	2,012,080	2017/12/15
第360回利付国債 (2年)	0.1	1,150,000	1,157,130	2018/1/15
第361回利付国債 (2年)	0.1	600,000	603,852	2018/2/15
第362回利付国債 (2年)	0.1	2,200,000	2,214,762	2018/3/15
第363回利付国債 (2年)	0.1	2,630,000	2,648,199	2018/4/15
第105回利付国債 (5年)	0.2	240,000	241,226	2017/6/20
第106回利付国債 (5年)	0.2	3,130,000	3,149,875	2017/9/20
第107回利付国債 (5年)	0.2	3,120,000	3,143,493	2017/12/20
第108回利付国債 (5年)	0.1	1,530,000	1,539,072	2017/12/20
第109回利付国債 (5年)	0.1	2,350,000	2,365,886	2018/3/20
第110回利付国債 (5年)	0.3	1,080,000	1,091,296	2018/3/20
第111回利付国債 (5年)	0.4	1,410,000	1,427,371	2018/3/20
第112回利付国債 (5年)	0.4	1,400,000	1,419,460	2018/6/20
第113回利付国債 (5年)	0.3	6,040,000	6,111,272	2018/6/20
第114回利付国債 (5年)	0.3	1,390,000	1,408,375	2018/9/20
第115回利付国債 (5年)	0.2	3,670,000	3,709,856	2018/9/20
第116回利付国債 (5年)	0.2	4,280,000	4,330,889	2018/12/20
第117回利付国債 (5年)	0.2	4,970,000	5,034,013	2019/3/20
第118回利付国債 (5年)	0.2	2,560,000	2,595,532	2019/6/20
第119回利付国債 (5年)	0.1	520,000	525,595	2019/6/20
第120回利付国債 (5年)	0.2	2,690,000	2,730,403	2019/9/20
第121回利付国債 (5年)	0.1	2,580,000	2,610,031	2019/9/20
第122回利付国債 (5年)	0.1	4,310,000	4,363,961	2019/12/20
第123回利付国債 (5年)	0.1	6,170,000	6,251,382	2020/3/20
第124回利付国債 (5年)	0.1	5,430,000	5,506,345	2020/6/20
第125回利付国債 (5年)	0.1	4,260,000	4,322,664	2020/9/20
第126回利付国債 (5年)	0.1	4,460,000	4,529,397	2020/12/20
第127回利付国債 (5年)	0.1	4,570,000	4,644,993	2021/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	385,000	624,543	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	620,000	976,574	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	653,000	1,037,381	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	948,000	1,518,601	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	935,000	1,449,418	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	1,070,000	1,635,270	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	1,110,000	1,629,824	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	1,320,000	1,809,403	2055/3/20
第286回利付国債 (10年)	1.8	1,070,000	1,094,342	2017/6/20
第287回利付国債 (10年)	1.9	2,400,000	2,457,240	2017/6/20

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288回利付国債 (10年)	1.7	2,026,000	2,079,992	2017/9/20
第289回利付国債 (10年)	1.5	2,453,000	2,522,444	2017/12/20
第290回利付国債 (10年)	1.4	1,640,000	1,690,266	2018/3/20
第291回利付国債 (10年)	1.3	940,000	967,072	2018/3/20
第292回利付国債 (10年)	1.7	794,000	822,750	2018/3/20
第293回利付国債 (10年)	1.8	1,081,000	1,127,807	2018/6/20
第294回利付国債 (10年)	1.7	1,570,000	1,634,668	2018/6/20
第295回利付国債 (10年)	1.5	1,240,000	1,285,855	2018/6/20
第296回利付国債 (10年)	1.5	2,020,000	2,103,486	2018/9/20
第297回利付国債 (10年)	1.4	836,000	871,830	2018/12/20
第298回利付国債 (10年)	1.3	2,640,000	2,746,233	2018/12/20
第299回利付国債 (10年)	1.3	2,760,000	2,881,688	2019/3/20
第300回利付国債 (10年)	1.5	957,000	1,004,677	2019/3/20
第301回利付国債 (10年)	1.5	1,872,000	1,973,892	2019/6/20
第302回利付国債 (10年)	1.4	2,850,000	2,996,233	2019/6/20
第303回利付国債 (10年)	1.4	2,325,000	2,453,688	2019/9/20
第304回利付国債 (10年)	1.3	1,170,000	1,230,804	2019/9/20
第305回利付国債 (10年)	1.3	3,808,000	4,020,029	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)	1.4	2,488,000	2,646,286	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)	1.3	1,610,000	1,706,181	2020/3/20
第308回利付国債 (10年)	1.3	1,374,000	1,461,221	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	2,300,000	2,426,983	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	2,886,000	3,041,872	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	2,700,000	2,822,121	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	4,030,000	4,297,753	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	2,969,000	3,191,496	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	1,590,000	1,693,572	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	2,253,000	2,420,352	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	980,000	1,047,747	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	1,557,000	1,670,022	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	2,490,000	2,657,253	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	1,519,000	1,634,474	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	2,850,000	3,050,497	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	2,515,000	2,699,827	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	1,770,000	1,889,581	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	1,675,000	1,793,121	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	3,440,000	3,661,295	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	3,435,000	3,665,248	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	1,360,000	1,445,204	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	2,240,000	2,395,344	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	740,000	782,979	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	3,210,000	3,447,251	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	2,390,000	2,572,070	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	1,480,000	1,570,635	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	3,110,000	3,304,468	2023/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第333回利付国債 (10年)	0.6	4,060,000	4,318,825	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	4,200,000	4,472,790	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	4,240,000	4,484,351	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	1,360,000	1,439,492	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	3,980,000	4,143,180	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	4,440,000	4,663,021	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	5,380,000	5,652,819	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	5,330,000	5,602,576	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	4,820,000	5,018,969	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	3,680,000	3,758,752	2026/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	76,000	104,404	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	98,000	130,290	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	117,000	154,486	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	127,000	179,675	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	108,000	142,701	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	169,000	229,611	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	164,000	221,729	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	142,000	181,231	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	116,000	140,505	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	185,000	215,108	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	137,000	173,261	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	220,000	293,774	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	205,000	270,716	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	493,000	686,965	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	346,000	488,818	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	302,000	427,961	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	327,000	458,454	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	427,000	591,984	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	303,000	420,809	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	495,000	707,726	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	379,000	528,094	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	570,000	817,875	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	554,000	796,319	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	411,000	592,349	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	742,000	1,043,021	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	1,064,000	1,520,211	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	910,000	1,327,635	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	1,191,000	1,747,852	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	1,400,000	2,037,070	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	1,336,000	1,925,763	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	1,228,000	1,752,380	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	1,509,000	2,197,677	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	1,834,000	2,561,786	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	1,626,000	2,359,374	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	1,769,000	2,495,032	2041/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第36回利付国債 (30年)	2.0	1,809,000	2,565,035	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	1,827,000	2,559,517	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	1,425,000	1,970,703	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	1,200,000	1,693,860	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	970,000	1,347,960	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	1,060,000	1,445,596	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	1,010,000	1,380,447	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	1,270,000	1,739,722	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	1,250,000	1,716,162	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	1,130,000	1,493,035	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	1,530,000	2,025,459	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	1,380,000	1,867,567	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	1,580,000	2,054,331	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	1,520,000	1,977,185	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	890,000	1,007,747	2046/3/20
第36回利付国債 (20年)	3.0	201,000	209,890	2017/9/20
第38回利付国債 (20年)	2.7	400,000	421,936	2018/3/20
第40回利付国債 (20年)	2.3	601,000	637,120	2018/9/20
第42回利付国債 (20年)	2.6	869,000	939,797	2019/3/20
第43回利付国債 (20年)	2.9	74,000	81,828	2019/9/20
第44回利付国債 (20年)	2.5	480,000	530,817	2020/3/20
第47回利付国債 (20年)	2.2	114,000	126,145	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	209,000	235,526	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)	2.1	515,000	573,704	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	200,000	223,124	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	214,000	241,075	2021/9/21
第54回利付国債 (20年)	2.2	480,000	546,288	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	241,000	272,930	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	449,000	511,060	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	147,000	167,224	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	589,000	665,145	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	289,000	313,715	2023/3/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	442,000	506,359	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	441,000	510,633	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	318,000	369,659	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	500,000	577,365	2023/12/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	846,000	1,007,391	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	422,000	511,447	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	160,000	191,284	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	534,000	636,645	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	620,000	736,739	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	318,000	380,646	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	575,000	690,644	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	200,000	236,640	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	210,000	250,353	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	486,834	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	50,000	59,830	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	315,000	379,833	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	350,000	420,546	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	662,000	801,695	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	413,000	501,530	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	670,000	807,122	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	490,000	597,167	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	515,000	637,879	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	450,000	552,892	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	804,000	1,000,795	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	410,000	506,173	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	980,000	1,214,406	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	468,000	584,831	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	1,212,000	1,495,183	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	510,000	626,035	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	965,000	1,195,113	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	917,000	1,160,674	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	380,000	472,476	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	853,000	1,073,875	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	620,000	773,450	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	1,695,000	2,122,563	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	1,100,000	1,395,702	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	573,000	740,699	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	680,000	882,204	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	550,000	706,860	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	280,000	353,043	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	1,790,000	2,263,938	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	531,000	678,177	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	607,000	770,483	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	1,230,000	1,530,169	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	700,000	873,061	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	966,000	1,229,708	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	531,000	684,878	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	1,210,000	1,544,782	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	1,792,000	2,294,297	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	1,810,000	2,325,234	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	654,000	849,055	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	746,000	971,858	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	1,260,000	1,624,051	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	666,000	851,953	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	660,000	825,712	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	800,000	978,352	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	1,369,000	1,735,974	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	760,000	952,857	2030/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第123回利付国債 (20年)	2.1	1,748,000	2,273,868	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	700,000	900,417	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	734,000	967,947	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	810,000	1,044,268	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	560,000	713,697	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	1,214,000	1,551,649	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	600,000	757,884	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	1,182,000	1,495,903	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	890,000	1,112,820	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	827,000	1,035,776	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	1,190,000	1,508,789	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	965,000	1,225,636	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	370,000	464,139	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	770,000	953,860	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	472,000	593,039	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	890,000	1,089,965	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	480,000	595,468	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	2,427,000	3,056,515	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	1,550,000	1,954,891	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	840,000	1,073,133	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	1,380,000	1,720,032	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	1,020,000	1,254,467	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	2,790,000	3,528,457	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	2,070,000	2,621,344	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	2,360,000	2,951,746	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	2,170,000	2,679,103	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	2,500,000	3,086,425	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	2,420,000	2,946,979	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	2,620,000	3,098,097	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	2,920,000	3,453,367	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	2,400,000	2,885,568	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	2,290,000	2,708,978	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	2,530,000	2,895,306	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	1,510,000	1,552,808	2036/3/20
第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013)	0.67	100,000	100,703	2018/11/15
小 計		380,496,000	430,939,878	
地方債証券				
第1回東京都公募公債 (20年)	1.54	20,000	22,141	2023/6/20
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	10,000	14,225	2038/9/17
第8回東京都公募公債 (30年)	2.23	80,000	109,130	2038/9/17
第16回東京都公募公債 (20年)	2.01	100,000	123,399	2028/12/20
第20回東京都公募公債 (20年)	2.09	80,000	100,457	2029/9/20
第21回東京都公募公債 (20年)	2.19	80,000	101,831	2029/12/20
第22回東京都公募公債 (20年)	1.92	120,000	149,548	2030/6/20
第24回東京都公募公債 (20年)	1.98	70,000	88,857	2031/6/20

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28回東京都公募公債 (20年)	1.59	100,000	122,170	2033/3/18
第666回東京都公募公債	1.46	150,000	156,177	2019/3/20
第669回東京都公募公債	1.63	50,000	52,511	2019/6/20
第678回東京都公募公債	1.38	100,000	104,916	2019/12/20
第680回東京都公募公債	1.39	100,000	105,319	2020/3/19
第681回東京都公募公債	1.4	100,000	105,349	2020/3/19
第686回東京都公募公債	1.08	100,000	104,369	2020/6/19
第692回東京都公募公債	1.35	100,000	106,165	2020/12/18
第693回東京都公募公債	1.38	100,000	106,670	2021/3/19
第701回東京都公募公債	0.99	120,000	126,288	2021/9/17
第705回東京都公募公債	1.06	170,000	180,438	2022/3/18
第709回東京都公募公債	0.78	100,000	104,731	2022/6/20
第716回東京都公募公債	0.77	100,000	105,018	2022/12/20
第717回東京都公募公債	0.63	100,000	104,217	2023/3/20
第718回東京都公募公債	0.6	100,000	104,012	2023/3/20
第719回東京都公募公債	0.86	250,000	264,480	2023/3/20
第723回東京都公募公債	0.76	200,000	210,802	2023/9/20
第728回東京都公募公債	0.65	300,000	314,115	2023/12/20
第730回東京都公募公債	0.664	100,000	105,089	2024/3/19
平成19年度第2回北海道公募公債	1.84	112,000	114,084	2017/5/31
平成19年度第4回北海道公募公債	1.98	20,000	20,435	2017/6/29
平成19年度第16回北海道公募公債	1.58	100,000	102,857	2018/3/23
平成20年度第6回北海道公募公債	1.72	53,990	56,059	2018/8/29
平成21年度第2回北海道公募公債	1.66	100,000	104,893	2019/5/29
平成21年度第12回北海道公募公債	1.42	100,000	104,897	2019/12/25
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	100,000	103,939	2020/10/29
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	100,000	104,506	2022/10/31
平成24年度第13回北海道公募公債 (5年)	0.23	100,000	100,318	2018/1/31
平成26年度第13回北海道公募公債	0.461	200,000	206,354	2024/12/26
第1回神奈川県公募公債 (20年)	2.55	100,000	120,230	2024/6/20
第2回神奈川県公募公債 (20年)	2.23	80,000	94,514	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債 (30年)	2.87	80,000	116,556	2036/6/20
第3回神奈川県公募公債 (20年)	2.11	100,000	118,721	2025/6/20
第27回神奈川県公募公債 (20年)	1.398	100,000	119,313	2034/9/20
第152回神奈川県公募公債	1.53	110,000	113,100	2018/3/20
第162回神奈川県公募公債	1.62	140,450	147,450	2019/6/20
第163回神奈川県公募公債	1.4	114,000	118,902	2019/6/20
第165回神奈川県公募公債	1.4	54,660	57,210	2019/9/20
第170回神奈川県公募公債	1.38	240,000	252,619	2020/3/20
第171回神奈川県公募公債	1.41	100,000	105,374	2020/3/20
第176回神奈川県公募公債	1.16	128,900	135,261	2020/9/18
第191回神奈川県公募公債	0.83	100,000	104,876	2022/6/20
第192回神奈川県公募公債	0.805	200,000	209,782	2022/9/20
第5回大阪府公募公債 (20年)	2.16	100,000	126,762	2030/5/28
第11回大阪府公募公債 (20年)	1.693	200,000	246,444	2033/9/27

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89回大阪府公募公債（5年）	0.2	100,000	100,219	2017/12/27
第92回大阪府公募公債（5年）	0.14	100,000	100,131	2018/3/28
第306回大阪府公募公債	1.83	30,000	30,727	2017/9/27
第313回大阪府公募公債	1.66	100,000	103,120	2018/4/27
第314回大阪府公募公債	1.8	30,000	31,063	2018/5/29
第316回大阪府公募公債	1.85	100,000	103,951	2018/7/30
第325回大阪府公募公債	1.66	153,000	160,184	2019/4/26
第326回大阪府公募公債	1.66	10,000	10,482	2019/5/28
第331回大阪府公募公債	1.41	100,000	104,606	2019/10/29
第332回大阪府公募公債	1.58	71,600	75,386	2019/11/27
第334回大阪府公募公債	1.47	264,000	277,561	2020/1/28
第337回大阪府公募公債	1.44	110,000	115,897	2020/4/28
第343回大阪府公募公債	0.98	70,000	72,688	2020/10/28
第348回大阪府公募公債	1.32	10,000	10,605	2021/3/30
第351回大阪府公募公債	1.19	100,000	105,761	2021/7/28
第358回大阪府公募公債	0.97	56,000	58,844	2022/2/28
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000	58,948	2022/3/29
第366回大阪府公募公債	0.79	156,000	163,112	2022/11/29
第386回大阪府公募公債	0.585	100,000	104,249	2024/7/30
第389回大阪府公募公債	0.53	100,000	103,915	2024/10/30
平成21年度第5回京都府公募公債	1.35	20,000	20,950	2019/12/24
平成22年度第5回京都府公募公債	1.26	110,000	116,176	2020/12/21
平成23年度第9回京都府公募公債	1.01	140,000	147,919	2022/3/16
平成24年度第3回京都府公募公債（20年）	1.63	200,000	244,844	2032/8/13
平成24年度第10回京都府公募公債	0.67	100,000	104,352	2023/3/22
平成25年度第1回京都府公募公債	0.58	100,000	103,752	2023/4/28
平成25年度第2回京都府公募公債（15年）	1.05	100,000	110,713	2028/4/28
第2回兵庫県公募公債（30年）	2.36	40,000	55,785	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債（15年）	1.31	100,000	113,124	2027/12/24
第8回兵庫県公募公債（15年）	1.09	100,000	111,085	2029/4/16
第16回兵庫県公募公債（20年）	1.7	100,000	122,916	2032/11/19
平成20年度第5回兵庫県公募公債	1.93	50,000	51,984	2018/6/20
平成21年度第1回兵庫県公募公債	1.62	120,000	125,515	2019/4/23
平成21年度第3回兵庫県公募公債	1.62	190,000	198,975	2019/5/22
平成21年度第25回兵庫県公募公債	1.54	100,000	105,176	2019/11/20
平成20年度第1回静岡県公募公債	1.73	14,500	15,009	2018/5/28
平成20年度第2回静岡県公募公債	1.91	100,000	104,035	2018/6/26
平成20年度第4回静岡県公募公債	1.65	100,000	103,788	2018/8/28
平成20年度第5回静岡県公募公債	1.59	11,000	11,427	2018/10/30
平成21年度第4回静岡県公募公債	1.56	52,920	55,604	2019/8/20
平成22年度第1回静岡県公募公債	1.455	101,700	107,458	2020/4/20
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	104,831	2020/7/22
平成22年度第8回静岡県公募公債	1.059	100,000	104,429	2020/8/25
平成23年度第6回静岡県公募公債	1.201	170,000	180,285	2021/7/23
平成24年度第10回静岡県公募公債	0.678	100,000	104,442	2023/3/22

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25年度第1回静岡県公募公債		0.581	100,000	103,782	2023/4/19
平成25年度第5回静岡県公募公債		0.926	100,000	106,325	2023/7/25
平成25年度第8回静岡県公募公債		0.699	100,000	104,897	2023/10/24
平成25年度第9回静岡県公募公債		0.679	300,000	314,514	2023/11/22
平成25年度第11回静岡県公募公債 (5年)		0.204	100,000	100,557	2019/3/26
平成26年度第5回静岡県公募公債		0.61	100,000	104,574	2024/7/25
平成27年度第3回静岡県公募公債		0.544	121,000	126,367	2025/5/21
平成23年度第7回愛知県公募公債		1.11	100,000	105,595	2021/7/29
平成23年度第9回愛知県公募公債		1.019	100,000	105,289	2021/9/30
平成23年度第14回愛知県公募公債		1.006	100,000	105,381	2021/11/30
平成23年度第17回愛知県公募公債		0.996	100,000	105,489	2022/1/31
平成24年度第13回愛知県公募公債		0.772	100,000	104,819	2022/11/30
平成25年度第2回愛知県公募公債		0.576	200,000	207,514	2023/4/26
平成25年度第9回愛知県公募公債		0.849	240,000	253,852	2023/7/25
平成25年度第15回愛知県公募公債		0.699	600,000	629,394	2023/10/25
平成26年度第9回愛知県公募公債		0.576	100,000	104,385	2024/8/26
平成19年度第2回広島県公募公債		1.94	46,050	47,202	2017/8/24
平成20年度第4回広島県公募公債		1.73	60,000	62,601	2018/11/26
平成22年度第8回広島県公募公債		1.33	26,650	28,340	2021/3/25
平成23年度第1回広島県公募公債		1.19	100,000	105,867	2021/5/27
平成25年度第3回広島県公募公債		0.8	100,000	105,589	2023/9/25
平成19年度第3回埼玉県公募公債		1.94	39,100	40,081	2017/8/28
平成19年度第6回埼玉県公募公債		1.63	100,000	102,786	2018/1/30
平成21年度第8回埼玉県公募公債		1.3	100,000	104,633	2019/12/25
平成23年度第1回埼玉県公募公債		1.37	100,000	106,688	2021/4/27
平成23年度第4回埼玉県公募公債		1.2	100,000	106,057	2021/7/27
平成24年度第6回埼玉県公募公債		0.801	100,000	104,938	2022/10/26
平成26年度第6回埼玉県公募公債		0.554	150,000	156,303	2024/9/26
平成26年度第8回埼玉県公募公債		0.335	100,000	102,491	2025/1/28
平成19年度第1回福岡県公募公債 (30年)		2.62	70,000	100,073	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債 (30年)		2.28	80,000	109,944	2038/9/17
平成21年度第11回福岡県公募公債		1.44	100,000	105,464	2020/2/25
平成22年度第3回福岡県公募公債		1.11	100,000	104,734	2020/8/24
平成22年度第5回福岡県公募公債		0.94	20,000	20,825	2020/10/28
平成24年度第11回福岡県公募公債		0.8	550,000	578,946	2023/2/27
平成25年度第11回福岡県公募公債		0.694	300,000	315,363	2024/2/26
第9回千葉県公募公債 (20年)		1.84	80,000	98,802	2030/10/11
平成20年度第2回千葉県公募公債		1.8	90,000	93,280	2018/5/25
平成20年度第3回千葉県公募公債		1.78	80,000	83,119	2018/7/25
平成20年度第5回千葉県公募公債		1.6	80,000	83,026	2018/9/25
平成22年度第7回千葉県公募公債		0.92	120,000	124,717	2020/10/23
平成22年度第11回千葉県公募公債		1.26	80,000	84,612	2021/1/25
平成23年度第6回千葉県公募公債		1.11	200,000	212,056	2021/12/24
平成23年度第9回千葉県公募公債		1.0	20,000	21,130	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債		1.05	20,000	21,206	2022/4/25

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24年度第6回千葉県公募公債	0.81	100,000	105,057	2022/11/25
平成25年度第1回千葉県公募公債	0.58	82,500	85,621	2023/4/25
平成26年度第9回千葉県公募公債	0.465	188,000	195,057	2025/3/25
平成21年度第1回新潟県公募公債	1.42	23,000	24,053	2019/7/29
平成23年度第1回新潟県公募公債	1.02	119,000	125,530	2021/11/30
平成24年度第1回大分県公募公債	0.8	100,260	105,214	2022/10/31
第58回共同発行市場公募地方債	1.59	21,000	21,568	2018/1/25
第59回共同発行市場公募地方債	1.57	100,800	103,619	2018/2/23
第62回共同発行市場公募地方債	1.74	100,000	103,533	2018/5/25
第63回共同発行市場公募地方債	1.88	200,000	207,950	2018/6/25
第64回共同発行市場公募地方債	1.78	100,000	103,856	2018/7/25
第65回共同発行市場公募地方債	1.62	90,000	93,321	2018/8/24
第74回共同発行市場公募地方債	1.57	100,000	104,726	2019/5/24
第75回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	105,084	2019/6/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	10,000	10,500	2019/8/23
第78回共同発行市場公募地方債	1.39	30,000	31,401	2019/9/25
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	109,500	114,673	2019/12/25
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	30,000	31,434	2020/9/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	105,974	2021/2/25
第100回共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	106,124	2021/7/23
第101回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	105,385	2021/8/25
第103回共同発行市場公募地方債	1.0	100,000	105,281	2021/10/25
第104回共同発行市場公募地方債	1.03	200,000	211,058	2021/11/25
第107回共同発行市場公募地方債	1.01	200,000	211,334	2022/2/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	170,000	180,305	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	105,149	2022/5/25
第113回共同発行市場公募地方債	0.77	100,000	104,648	2022/8/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	105,024	2022/9/22
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	250,000	262,565	2022/11/25
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	104,554	2022/12/22
第118回共同発行市場公募地方債	0.84	200,000	210,776	2023/1/25
第119回共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	315,663	2023/2/24
第120回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	104,459	2023/3/24
第128回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	314,214	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	230,000	242,721	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	200,000	209,724	2024/3/25
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	400,000	420,408	2024/4/25
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	200,000	210,018	2024/6/25
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	104,624	2024/7/25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	400,000	417,364	2024/8/23
第138回共同発行市場公募地方債	0.554	300,000	312,732	2024/9/25
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	300,000	311,736	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	205,324	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	100,000	103,752	2025/3/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	103,218	2025/4/25

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146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	209,040	2025/5/23
第148回共同発行市場公募地方債	0.553	300,000	313,971	2025/7/25
第150回共同発行市場公募地方債	0.51	300,000	313,041	2025/9/25
平成19年度第1回堺市公募公債	1.73	100,000	102,753	2017/12/19
平成24年度第2回熊本県公募公債	0.8	50,000	52,483	2022/10/26
平成22年度第1回新潟市公募公債	1.21	54,980	57,959	2020/12/24
平成23年度第1回浜松市公募公債	1.045	38,200	40,343	2021/11/25
平成25年度第1回浜松市公募公債	0.761	61,000	64,376	2024/1/24
第1回大阪市公募公債(15年)	1.753	200,000	232,506	2026/7/17
第5回大阪市公募公債(20年)	2.47	100,000	127,775	2028/9/21
平成19年度第4回大阪市公募公債	1.9	30,000	30,622	2017/6/21
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	125,000	131,766	2019/11/25
平成23年度第10回大阪市公募公債	0.956	10,000	10,519	2022/1/27
平成26年度第5回大阪市公募公債	0.593	100,000	104,529	2024/9/27
第1回名古屋市公募公債(12年)	1.033	100,000	108,957	2025/6/20
第2回名古屋市公募公債(20年)	2.56	100,000	120,310	2024/6/20
第10回名古屋市公募公債(20年)	2.26	80,000	101,690	2029/8/17
第477回名古屋市公募公債	1.034	100,000	105,561	2021/12/20
第5回京都市公募公債(20年)	2.36	50,000	61,661	2026/12/18
平成23年度第2回京都市公募公債	1.049	100,000	105,299	2021/8/26
平成24年度第4回京都市公募公債	0.801	100,000	104,861	2022/10/21
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	2.54	120,000	148,916	2026/6/19
平成22年度第9回神戸市公募公債(20年)	2.09	80,000	101,530	2031/1/24
第7回横浜市公募公債(20年)	2.06	200,000	239,212	2025/12/19
第17回横浜市公募公債(20年)	2.07	80,000	99,007	2028/12/20
平成20年度第4回横浜市公募公債	1.71	100,000	104,222	2018/11/16
第20回横浜市公募公債(20年)	2.1	80,000	100,220	2029/10/19
平成24年度第4回横浜市公募公債	0.81	100,000	105,209	2023/2/20
平成24年度第3回横浜市公募公債	0.729	100,000	104,509	2022/12/22
第25回横浜市公募公債(20年)	1.72	100,000	123,821	2032/7/16
第27回横浜市公募公債(20年)	1.599	60,000	73,401	2033/5/20
平成21年度第5回札幌市公募公債	1.36	112,000	117,075	2019/9/20
平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	2.277	80,000	111,830	2040/9/20
第44回川崎市公募公債(5年)	0.162	130,400	131,131	2020/6/19
第82回川崎市公募公債	1.52	100,000	105,070	2019/9/20
第17回北九州市公募公債(20年)	1.529	100,000	121,211	2034/6/20
平成20年度第3回福岡市公募公債	1.52	100,000	103,166	2018/6/20
平成20年度第5回福岡市公募公債	1.57	91,000	94,502	2018/10/24
平成22年度第9回福岡市公募公債	1.32	106,500	113,040	2021/3/25
平成23年度第6回福岡市公募公債	1.0	100,000	105,261	2021/10/28
平成24年度第1回福岡市公募公債(5年)	0.25	34,700	34,796	2017/6/26
平成24年度第3回福岡市公募公債(5年)	0.25	42,500	42,645	2017/9/28
平成25年度第3回福岡市公募公債(5年)	0.31	31,500	31,731	2018/9/26
平成25年度第4回福岡市公募公債	0.68	50,000	52,378	2023/10/24
平成26年度第6回福岡市公募公債(20年)	1.371	100,000	118,430	2034/9/20

銘柄	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
平成25年度第2回広島市公募公債		0.72	100,000	105,210	2023/12/27
平成24年度第2回千葉市公募公債		0.81	100,000	105,085	2022/11/22
平成26年度第2回千葉市公募公債		0.505	100,000	103,826	2024/11/27
平成22年度第1回三重県公募公債		1.056	87,050	91,089	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債		1.021	98,410	103,787	2021/11/30
平成24年度第1回三重県公募公債		0.801	140,660	147,602	2022/10/25
平成24年度第4回福井県公募公債		0.46	100,000	102,988	2023/4/26
平成20年度第1回徳島県公募公債		1.73	36,000	37,586	2018/11/28
平成24年度第1回徳島県公募公債		0.68	100,000	104,495	2023/3/24
平成26年度第1回徳島県公募公債		0.495	100,000	103,831	2024/11/28
平成20年度第1回岡山県公募公債		1.56	48,700	50,691	2018/12/25
小 計			28,006,180	30,032,413	
特殊債券(除く金融債)					
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	204,682	2017/7/31
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	108,832	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	102,590	2018/1/31
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	100,000	102,616	2018/3/23
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	103,476	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	35,280	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	206,000	213,535	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	224,000	231,945	2018/9/28
第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.6	50,000	51,963	2018/10/31
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	119,656	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	164,736	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	141,000	146,187	2019/3/19
第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	200,000	209,120	2019/5/31
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	250,406	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	210,000	219,819	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	82,464	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	125,662	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	125,749	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	144,989	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	220,096	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	142,066	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	52,494	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	126,997	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	200,000	210,680	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	104,342	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	116,538	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	74,912	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	126,565	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	96,051	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	63,432	2021/7/30
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	128,503	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	105,464	2021/10/29

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	200,000	249,240	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	143,553	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	117,816	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	370,000	389,425	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	105,770	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	124,167	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	268,736	2042/5/30
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.895	12,000	12,658	2022/6/30
第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.839	300,000	315,585	2022/7/29
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	350,000	367,808	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	105,275	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	222,000	232,802	2022/12/28
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.834	200,000	211,194	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	104,576	2023/3/17
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	100,000	119,209	2033/4/28
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.541	153,000	158,765	2023/4/28
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.605	474,000	494,026	2023/5/31
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.882	100,000	106,292	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	128,913	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	398,000	422,126	2023/8/31
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.669	228,000	239,431	2023/11/30
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.693	188,000	197,864	2023/12/28
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.645	322,000	338,093	2024/3/29
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	105,148	2024/6/28
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.601	100,000	104,852	2024/7/31
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.39	100,000	119,327	2034/8/31
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.539	100,000	104,477	2024/10/31
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.466	241,000	250,478	2024/12/27
第344回政府保証道路債券		1.6	100,000	106,646	2020/7/15
第4回政府保証首都高速道路債券		1.7	179,000	183,226	2017/9/25
第7回政府保証東日本高速道路債券		1.9	34,000	34,838	2017/8/24
第13回政府保証東日本高速道路債券		1.6	28,000	29,085	2018/10/19
第17回政府保証中日本高速道路債券		1.7	100,000	102,315	2017/9/15
第20回政府保証中日本高速道路債券		1.4	10,000	10,257	2018/3/16
第23回政府保証中日本高速道路債券		1.5	90,000	93,139	2018/9/14
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.5	280,000	292,913	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	26,104	2019/7/12
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.5	200,000	209,750	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	201,394	2018/1/30
第4回政府保証公営企業債券(15年)		2.0	100,000	111,858	2022/4/22
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.3	200,000	206,932	2019/1/22
第5回政府保証公営企業債券(15年)		2.2	100,000	113,551	2022/7/15
第7回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)		0.25	300,000	301,743	2018/10/29
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.4	100,000	104,062	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	148,000	154,689	2019/5/24

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第9回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	0.32	100,000	100,906	2019/4/25
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	104,965	2020/3/13
第12回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	200,000	210,410	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	104,298	2020/9/14
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	101,000	105,069	2020/11/17
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	15,000	15,939	2021/3/12
第25回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	106,125	2021/6/14
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	21,000	22,141	2021/10/18
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	50,000	53,075	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	105,511	2022/6/17
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	105,012	2022/8/15
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	354,000	373,516	2023/2/17
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	17,000	17,777	2023/3/17
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.541	345,000	357,965	2023/4/21
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	37,526	2023/5/16
第50回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.911	168,000	178,914	2023/7/14
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	150,000	159,033	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	160,000	168,364	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	210,030	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	104,828	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	209,014	2024/8/16
第879回政府保証公営企業債券	1.7	102,000	104,380	2017/9/19
第883回政府保証公営企業債券	1.4	100,000	102,589	2018/3/19
第884回政府保証公営企業債券	1.4	114,000	117,073	2018/4/17
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	110,341	2021/4/16
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	1.3	123,000	128,334	2019/9/17
第23回政府保証日本政策金融公庫債券	0.734	134,000	140,488	2022/12/16
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	105,526	2023/2/24
第26回政府保証日本政策金融公庫債券	0.911	484,000	515,503	2023/7/19
第191回政府保証中小企業債券	1.7	211,000	215,884	2017/9/15
第16回政府保証民間都市開発債券	0.699	197,000	207,173	2023/10/20
第21回政府保証国民生活債券	1.5	2,000	2,048	2017/12/18
第2回政府保証新関西国際空港債券	0.882	202,000	214,833	2023/6/27
第5回政府保証日本政策投資銀行	1.4	50,000	52,031	2019/4/15
第7回政府保証日本政策投資銀行	1.4	100,000	105,252	2020/2/17
第11回政府保証日本政策投資銀行	1.0	179,000	188,556	2021/9/14
第17回政府保証日本政策投資銀行	0.257	200,000	201,222	2018/11/9
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	21,045	2023/12/18
第27回政府保証日本政策投資銀行	0.11	200,000	200,988	2021/2/12
第53回政府保証関西国際空港債券	1.5	151,000	154,871	2018/1/24
第11回政府保証西日本高速道路債券	1.7	31,000	31,821	2017/11/28
第46回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.69	50,000	51,558	2018/3/20
第7回道路債券(財投機関債)	2.7	100,000	116,309	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	24,525	2026/3/19
第9回道路債券(財投機関債)	2.9	100,000	140,278	2032/5/20

銘柄	利 率	当 期 末		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13回道路債券(財投機関債)	2.28	200,000	228,644	2022/9/20
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	47,873	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	156,430	2047/3/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.67	130,000	200,379	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	74,791	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	204,994	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	124,568	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	102,956	2018/3/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.42	300,000	379,848	2028/6/20
第42回道路債券(財投機関債)	2.22	130,000	154,186	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	104,169	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	150,000	191,812	2029/4/20
第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.14	50,000	62,980	2030/5/10
第71回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.17	100,000	105,862	2021/6/18
第73回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.14	100,000	105,709	2021/6/18
第78回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.08	100,000	105,907	2021/12/20
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	62,296	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	121,765	2032/6/18
第92回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.834	110,000	115,425	2022/6/20
第96回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.796	300,000	314,700	2022/9/20
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	104,972	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	104,952	2022/12/20
第110回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.94	300,000	319,131	2023/6/20
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	211,478	2023/6/20
第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.77	100,000	105,416	2023/12/20
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.974	100,000	140,439	2055/3/19
第1回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.648	100,000	105,090	2019/6/28
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.266	50,000	63,094	2029/6/28
第2回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.406	80,000	83,538	2019/7/26
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	20,000	21,363	2023/3/22
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債)	1.176	100,000	111,897	2029/1/26
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	114,961	2023/12/20
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	59,351	2024/9/24
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.092	100,000	125,913	2030/12/27
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.187	80,000	102,351	2031/4/28
第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.164	100,000	104,938	2020/9/28
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.846	80,000	98,595	2031/8/28
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.87	100,000	123,616	2031/9/26
第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.274	50,000	52,852	2020/12/28
第20回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.28	100,000	105,846	2021/1/28
第22回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.687	200,000	243,238	2032/6/28
F23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.075	100,000	102,159	2018/5/29
第23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.418	100,000	106,877	2021/4/28
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	300,000	364,578	2032/7/28
F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.681	70,000	77,872	2023/3/17

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第27回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.034	100,000	105,334	2021/8/27
第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.785	50,000	61,772	2033/1/28
第28回公営企業債券(財投機関債)		1.89	100,000	102,734	2017/10/25
第35回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.006	200,000	211,680	2022/4/28
第42回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.801	100,000	105,039	2022/11/28
第44回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.791	200,000	210,198	2023/1/27
第46回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.678	100,000	104,417	2023/3/28
第49回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.887	200,000	212,040	2023/6/28
第50回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.922	300,000	319,026	2023/7/28
F 89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.602	300,000	348,126	2027/8/20
F 110回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.562	100,000	101,590	2019/4/25
F 123回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.6	100,000	118,194	2030/3/19
F 131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.546	100,000	118,743	2031/7/30
F 147回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.291	150,000	168,373	2027/3/19
F 226回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.096	100,000	110,914	2029/2/28
第10回首都高速道路		0.336	400,000	401,884	2017/9/20
第13回首都高速道路(財投機関債)		0.223	100,000	100,681	2019/9/20
第7回阪神高速道路債券(財投機関債)		2.18	100,000	118,254	2025/3/21
第14回阪神高速道路		0.1	300,000	300,375	2019/12/20
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)		2.167	80,000	100,969	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)		1.911	80,000	98,762	2030/10/29
第21回都市再生債券(財投機関債)		1.72	100,000	103,996	2018/9/20
第68回都市再生債券(財投機関債)		0.854	100,000	105,269	2022/9/20
第100回都市再生債券(財投機関債)		0.569	100,000	104,184	2024/11/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	26,476	28,389	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	22,792	24,547	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.19	28,211	30,404	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	23,341	25,355	2037/11/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.29	27,832	30,105	2042/8/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.76	19,935	21,068	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.26	20,909	22,542	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	27,579	29,673	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	24,467	26,167	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.25	20,973	22,595	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	15,357	15,883	2037/10/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.99	28,382	30,398	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	71,650	2017/9/20
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.52	14,945	15,377	2037/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.19	21,625	23,302	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	26,057	28,002	2039/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.43	31,898	32,856	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.15	22,330	24,061	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.16	31,322	33,746	2043/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	17,578	18,292	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	31,268	32,657	2032/5/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.64	33,743	35,326	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	34,640	36,368	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	103,716	108,350	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	19,211	20,124	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.12	20,163	21,359	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	104,468	2018/9/20
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	24,293	25,519	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	53,618	56,605	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	29,093	30,730	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.88	49,627	53,407	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.87	54,543	58,581	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	56,528	60,561	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.88	27,506	29,274	2040/12/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.61	59,344	63,107	2045/7/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	26,062	27,656	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	65,596	69,098	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.09	28,071	30,162	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	26,132	28,331	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.6	71,444	76,374	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	71,660	77,275	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	66,485	71,562	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.92	63,447	68,618	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	192,858	208,768	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	64,274	69,136	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	64,107	68,668	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.21	25,898	28,036	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	68,941	73,882	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	71,981	76,754	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	73,005	77,763	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.42	76,026	80,855	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	229,284	244,065	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	76,918	81,909	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	77,502	82,101	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	78,949	83,290	2047/7/10
第62回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.13	50,000	63,146	2030/12/13
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.11	79,408	83,325	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	81,224	85,318	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.25	81,265	85,946	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.32	84,702	90,108	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	101,050	2031/6/13
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	240,858	254,290	2048/9/10
第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.751	30,000	34,833	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.08	83,286	87,347	2048/11/10
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	172,376	180,820	2049/1/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	85,891	90,232	2049/2/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	87,869	92,178	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	176,722	185,105	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.02	179,296	187,957	2049/6/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.863	100,000	123,667	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.95	92,290	96,385	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	277,212	288,250	2049/11/10
第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.84	187,136	194,220	2049/12/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	93,706	96,615	2050/1/10
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.6	188,382	192,366	2050/2/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.9	289,818	302,445	2050/7/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.88	193,764	201,933	2050/8/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.892	100,000	124,488	2032/4/16
第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.441	200,000	226,976	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.86	490,020	510,850	2050/12/10
第105回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.472	100,000	114,067	2027/6/18
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	179,354	2042/9/19
第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.801	100,000	123,405	2032/9/17
第144回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.748	300,000	315,747	2023/12/20
第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)		2.04	50,000	58,697	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)		1.991	70,000	88,039	2031/6/13
第11回国際協力機構債券(財投機関債)		1.14	30,000	31,855	2021/12/20
第18回東日本高速道路		0.387	100,000	100,546	2017/9/20
第21回東日本高速道路		0.58	100,000	101,180	2018/6/20
第22回東日本高速道路		0.401	100,000	100,803	2018/6/20
第28回東日本高速道路		0.248	100,000	100,767	2019/12/20
第3回中日本高速道路		1.92	300,000	307,779	2017/9/20
第21回中日本高速道路		0.592	100,000	100,818	2017/9/20
第33回中日本高速道路		1.084	50,000	52,829	2021/9/17
第42回中日本高速道路		0.942	100,000	105,358	2022/3/18
第43回中日本高速道路		0.362	100,000	100,521	2017/9/20
第45回中日本高速道路		0.904	300,000	316,758	2022/9/20
第46回中日本高速道路		0.351	200,000	200,950	2017/9/20
第59回中日本高速道路		0.309	100,000	101,590	2021/12/20
第18回西日本高速道路		0.893	100,000	105,873	2023/3/20
第20回西日本高速道路		0.759	100,000	105,239	2023/9/20
第21回西日本高速道路		0.754	400,000	421,180	2023/12/20
第132回福岡北九州高速道路債券		0.704	100,000	104,909	2024/3/19
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	208,652	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	105,348	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	100,365	2018/6/20
第5回東京都住宅供給公社債券		2.02	100,000	102,579	2017/9/20
小	計		36,130,167	39,037,654	
金融債券					
い第745号商工債券		0.35	100,000	100,388	2017/6/27
い第773号商工債券		0.2	100,000	100,562	2019/10/25

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775号商工債券	0.2	400,000	402,248	2019/12/27
い第776号商工債券	0.17	100,000	100,471	2020/1/27
い第752号農林債券	0.3	150,000	150,742	2018/1/26
い第760号農林債券	0.4	400,000	403,372	2018/9/27
い第761号農林債券	0.3	250,000	251,562	2018/10/26
い第763号農林債券	0.3	340,000	342,227	2018/12/27
い第765号農林債券	0.3	100,000	100,698	2019/2/27
い第769号農林債券	0.3	100,000	100,811	2019/6/27
い第774号農林債券	0.24	100,000	100,659	2019/11/27
い第780号農林債券	0.28	300,000	302,796	2020/5/27
第271回信金中金債	0.35	100,000	100,388	2017/6/27
第279回信金中金債	0.25	300,000	301,293	2018/2/27
第286回信金中金債	0.35	100,000	100,748	2018/9/27
第288回信金中金債	0.3	200,000	201,346	2018/11/27
第291回信金中金債	0.25	100,000	100,586	2019/2/27
第293回信金中金債	0.25	100,000	100,640	2019/4/26
第304回信金中金債	0.225	200,000	201,466	2020/3/27
第8号商工債券(10年)	1.66	100,000	104,221	2018/12/20
第11号商工債券(10年)	0.66	100,000	104,338	2024/9/20
第179号商工債券(3年)	0.14	300,000	300,657	2017/12/27
第184号商工債券(3年)	0.15	300,000	300,762	2018/5/25
小 計		4,340,000	4,372,982	
普通社債券				
第459回東京電力	2.7	80,000	84,946	2019/1/29
第532回東京電力	1.75	120,000	122,343	2017/9/28
第534回東京電力	2.055	100,000	105,307	2019/10/29
第536回東京電力	1.672	100,000	102,283	2018/1/29
第544回東京電力	1.976	100,000	103,434	2018/6/25
第549回東京電力	1.699	150,000	154,881	2018/10/17
第559回東京電力	1.377	60,000	61,788	2019/10/29
第563回東京電力	1.39	100,000	103,512	2020/5/28
第567回東京電力	1.958	100,000	108,825	2030/7/29
第568回東京電力	1.155	100,000	102,730	2020/9/8
第490回中部電力	1.444	70,000	73,003	2019/7/25
第499回中部電力	1.194	50,000	53,392	2023/6/23
第500回中部電力	0.875	100,000	104,921	2024/5/24
第448回関西電力	2.16	100,000	104,233	2018/6/20
第456回関西電力	2.01	100,000	102,331	2017/7/25
第472回関西電力	1.79	100,000	104,096	2018/11/22
第473回関西電力	1.665	100,000	104,322	2019/4/25
第478回関西電力	1.448	200,000	209,038	2020/1/24
第485回関西電力	1.285	100,000	104,733	2020/12/18
第374回中国電力	0.814	100,000	102,595	2020/2/25
第379回中国電力	0.619	100,000	102,153	2021/1/25
第382回中国電力	0.517	100,000	101,759	2021/5/25

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288回北陸電力	1.89	100,000	102,720	2017/10/25
第303回北陸電力	0.756	100,000	102,040	2019/6/25
第448回東北電力	1.608	100,000	104,523	2019/5/24
第456回東北電力	1.176	100,000	104,320	2020/11/25
第473回東北電力	0.597	100,000	101,846	2021/4/23
第245回四国電力	2.0	100,000	109,374	2021/6/25
第400回九州電力	1.777	100,000	106,090	2020/4/24
第408回九州電力	1.672	100,000	104,662	2019/6/25
第422回九州電力	1.164	100,000	103,770	2020/6/25
第423回九州電力	0.959	100,000	102,644	2019/9/25
第429回九州電力	0.909	100,000	104,039	2024/9/25
第430回九州電力	0.54	100,000	101,369	2021/10/25
第261回北海道電力	2.775	24,000	24,981	2017/11/24
第310回北海道電力	1.286	50,000	52,379	2020/12/25
第315回北海道電力	0.82	100,000	101,334	2018/4/25
第316回北海道電力	1.164	100,000	103,854	2020/6/25
第319回北海道電力	0.514	200,000	202,100	2019/9/25
第19回沖縄電力	1.452	80,000	84,532	2020/4/24
第344回東京交通債券	1.67	100,000	110,709	2023/2/17
第347回東京交通債券	2.05	100,000	115,310	2024/3/8
第25回関西国際空港	1.361	400,000	421,824	2020/6/19
第38回関西国際空港	1.112	50,000	53,043	2021/12/20
第10回成田国際空港	1.094	160,000	169,137	2021/9/17
第11回成田国際空港	1.067	100,000	106,007	2022/2/18
第12回成田国際空港	0.879	100,000	105,427	2022/9/20
第13回成田国際空港	0.802	100,000	105,164	2023/2/8
第17回成田国際空港	0.489	100,000	103,325	2025/2/20
第3回セブン&アイ・ホールディングス	1.94	100,000	104,029	2018/6/20
第8回セブン&アイ・ホールディングス	0.383	100,000	100,973	2019/6/20
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	300,000	307,149	2022/6/20
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	105,160	2022/12/2
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	105,453	2021/9/17
第10回小松製作所	0.275	100,000	100,541	2019/6/20
第1回日本電産	0.386	100,000	100,474	2017/9/20
第12回パナソニック	0.387	300,000	303,033	2020/3/19
第1回B号日本生命2011基金	1.12	400,000	404,592	2017/8/5
第1回日本生命2012基金	0.87	100,000	101,584	2018/8/3
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	101,082	2019/8/7
第1回日本生命2015基金	0.406	100,000	100,811	2019/8/5
第53回日産自動車	1.744	100,000	106,558	2020/4/28
第5回凸版印刷	1.397	100,000	105,935	2020/12/16
第3回大日本印刷	1.358	100,000	105,897	2020/12/18
第78回三菱商事	1.155	100,000	105,825	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	102,493	2017/7/27
第7回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	2.5	300,000	321,141	2019/6/3

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8回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)		1.62	100,000	107,406	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	117,435	2026/10/30
第10回みずほコーポレート銀行		1.945	400,000	411,264	2017/10/27
第30回みずほコーポレート銀行		0.34	100,000	100,383	2017/7/25
第31回みずほコーポレート銀行		0.33	200,000	200,910	2017/10/25
第32回みずほコーポレート銀行		0.27	800,000	803,312	2018/1/24
第33回みずほコーポレート銀行		0.41	600,000	604,272	2018/4/20
第7回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)		2.11	400,000	428,364	2019/12/20
第9回三菱東京UFJ銀行		2.69	100,000	110,062	2020/2/27
第12回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)		2.16	100,000	102,523	2017/7/28
第28回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)		1.56	100,000	106,455	2021/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)		2.46	100,000	127,012	2031/1/20
第93回三菱東京UFJ銀行		1.985	200,000	205,632	2017/10/17
第124回三菱東京UFJ銀行		1.51	100,000	107,020	2021/4/16
第6回りそな銀行 (劣後特約付)		2.084	400,000	428,204	2020/3/4
第1回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位)		0.345	100,000	100,352	2017/6/7
第2回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位)		0.26	100,000	100,391	2017/12/20
第5回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位)		0.285	200,000	201,270	2018/11/28
第6回住友信託銀行 (劣後特約付)		2.78	100,000	122,963	2026/4/27
第13回住友信託銀行 (劣後特約付)		2.341	100,000	118,768	2026/6/15
第6回セブン銀行		0.398	100,000	100,439	2017/6/20
第22回三井住友銀行 (劣後特約付)		1.43	100,000	105,443	2020/9/28
第23回三井住友銀行 (劣後特約付)		1.61	100,000	106,536	2020/12/17
第25回三井住友銀行 (劣後特約付)		2.21	200,000	236,008	2026/6/1
第57回三井住友銀行		0.28	200,000	200,790	2017/10/20
第5回みずほ銀行 (劣後特約付)		2.49	100,000	119,382	2026/1/30
第9回みずほ銀行 (劣後特約付)		2.52	100,000	121,555	2027/4/27
第18回みずほ銀行 (劣後特約付)		2.14	100,000	116,686	2026/9/11
第8回芙蓉総合リース		0.318	100,000	100,702	2019/7/30
第11回芙蓉総合リース		0.21	100,000	99,990	2021/5/7
第4回興銀リース		0.36	100,000	100,788	2019/5/23
第5回興銀リース		0.272	100,000	100,581	2019/12/5
第28回日産フィナンシャルサービス		0.253	100,000	100,446	2019/6/20
第10回東京センチュリーリース		0.298	100,000	100,666	2019/11/21
第15回東京センチュリーリース		0.11	100,000	100,031	2019/4/12
第29回ホンダファイナンス		0.428	100,000	101,280	2021/3/19
第62回トヨタファイナンス		0.203	100,000	100,496	2019/12/20
第69回トヨタファイナンス		0.02	200,000	199,982	2019/4/26
第47回日立キャピタル		0.874	100,000	104,591	2023/3/20
第52回日立キャピタル		0.508	200,000	203,656	2021/6/18
第56回日立キャピタル		0.197	100,000	100,390	2019/12/20
第9回三井住友ファイナンス&リース		0.518	200,000	203,426	2021/1/29
第14回三井住友ファイナンス&リース		0.321	200,000	201,674	2020/10/30
第36回三菱UFJリース		0.355	100,000	100,979	2022/1/21
第37回三菱UFJリース		0.07	100,000	99,959	2019/2/21

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38回三菱UFJリース	0.16	200,000	200,128	2021/4/21
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	115,205	2025/9/24
第39回野村ホールディングス	0.853	100,000	101,372	2018/2/26
第43回野村ホールディングス	0.454	300,000	302,874	2019/2/25
第48回野村ホールディングス	0.245	100,000	100,317	2018/6/8
第49回野村ホールディングス	0.437	100,000	101,192	2020/6/10
第2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回	1.98	100,000	103,754	2018/6/20
第98回三菱地所	1.165	100,000	104,297	2020/6/19
第105回三菱地所	1.178	100,000	105,998	2022/3/23
第112回三菱地所	0.577	200,000	204,178	2020/12/25
第116回三菱地所	0.643	100,000	103,301	2024/9/19
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	105,306	2021/9/17
第17回エヌ・ティ・ティ都市開発	0.61	100,000	102,948	2024/9/20
第15回東日本旅客鉄道	2.65	100,000	111,052	2020/8/25
第26回東日本旅客鉄道	1.19	100,000	107,436	2022/12/20
第29回東日本旅客鉄道	2.01	200,000	228,408	2023/9/20
第60回東日本旅客鉄道	1.449	100,000	104,469	2019/7/24
第62回東日本旅客鉄道	1.424	100,000	104,632	2019/9/27
第79回東日本旅客鉄道	1.131	100,000	105,774	2021/9/29
第83回東日本旅客鉄道	1.633	100,000	115,017	2026/12/22
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	133,127	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道	2.28	123,000	139,051	2022/3/25
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	121,166	2030/10/25
第56回東海旅客鉄道	2.083	100,000	125,840	2031/5/26
第74回東海旅客鉄道	1.685	100,000	126,488	2045/3/6
第11回東京地下鉄	1.16	100,000	106,203	2021/12/9
第5回日本通運	1.818	100,000	105,391	2019/5/31
第5回関西高速鉄道	1.238	100,000	105,008	2020/9/10
第59回日本電信電話	1.69	100,000	105,119	2019/6/20
第63回日本電信電話	0.69	100,000	104,271	2023/3/20
第19回KDDI	1.151	100,000	104,368	2020/6/19
第21回KDDI	0.669	100,000	104,026	2024/9/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	104,831	2023/9/20
第29回電源開発	1.405	100,000	104,645	2019/11/20
第38回電源開発	0.978	100,000	105,160	2023/12/20
第40回電源開発	0.889	200,000	209,240	2024/6/20
第23回東京ガス	1.01	200,000	213,162	2023/6/9
第25回エヌ・ティ・ティ・データ	1.47	100,000	105,519	2020/3/19
第2回ファーストリテイリング	0.291	100,000	101,003	2020/12/18
第3回ファーストリテイリング	0.491	100,000	102,191	2022/12/16
第4回ファーストリテイリング	0.749	100,000	104,191	2025/12/18
第5回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.793	100,000	101,548	2018/12/13
第15回GEキャピタルコーポレーション	2.215	100,000	108,615	2020/11/20
第23回GEキャピタルコーポレーション	0.45	200,000	200,148	2016/9/20
第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.32	100,000	100,894	2017/2/9

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8回ナショナル・オーストラリア銀行	1.3	100,000	100,801	2017/1/20
第9回ナショナル・オーストラリア銀行	0.457	100,000	100,814	2019/1/17
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	100,445	2020/1/16
第8回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.407	300,000	302,295	2019/5/2
第8回ウエストパック・バンキング・コーポレーション	1.0	100,000	100,220	2016/8/12
第9回ラボバンク・ネダーランド	1.81	100,000	107,163	2021/1/28
第18回ラボバンク・ネダーランド	0.778	100,000	100,971	2017/11/2
第22回ラボバンク・ネダーランド	0.377	100,000	100,164	2016/12/19
第23回ラボバンク・ネダーランド	0.557	100,000	101,048	2018/12/19
第27回ラボバンク・ネダーランド	0.38	100,000	100,559	2020/5/22
小 計		21,917,000	22,919,698	
合 計		470,889,347	527,302,626	

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 527,302,626	% 99.2
コール・ローン等、その他	4,274,375	0.8
投資信託財産総額	531,577,001	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	531,577,001,301	
コール・ローン等	2,989,676,014	
公社債(評価額)	527,302,626,956	
未収利息	1,167,439,286	
前払費用	117,259,045	
(B) 負債	2,120,379,248	
未払金	1,319,510,540	
未払解約金	800,861,372	
未払利息	6,070	
その他未払費用	1,266	
(C) 純資産総額(A-B)	529,456,622,053	
元本	392,963,515,092	
次期繰越損益金	136,493,106,961	
(D) 受益権総口数	392,963,515.092口	
1万口当たり基準価額(C/D)	13,473円	

<注記事項>

- ①期首元本額 273,489,284,775円
 期中追加設定元本額 230,928,667,279円
 期中一部解約元本額 111,454,436,962円
 また、1口当たり純資産額は、期末13,473円です。

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	4,626,521,224	
受取利息	4,626,717,898	
その他収益金	11,000	
支払利息	△ 207,674	
(B) 有価証券売買損益	27,196,907,264	
売買益	27,869,990,260	
売買損	△ 673,082,996	
(C) 先物取引等取引損益	40,030,720	
取引益	42,200,160	
取引損	△ 2,169,440	
(D) 保管費用等	△ 1,266	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	31,863,457,942	
(F) 前期繰越損益金	70,345,224,180	
(G) 追加信託差損益金	66,710,614,776	
(H) 解約差損益金	△ 32,426,189,937	
(I) 計(E+F+G+H)	136,493,106,961	
次期繰越損益金(I)	136,493,106,961	

- (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（国内債券）	24,560,538,321円
eMAXIS 国内債券インデックス	16,932,463,018円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,513,899,345円
eMAXIS バランス（波乗り型）	318,764,587円
コアバランス	2,495,021円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	24,663,146,879円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	28,138,690,875円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	227,589,648円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	29,184,652,524円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	14,740,056,498円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	2,087,892,777円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	6,373,056,468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）	199,687,055,080円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	6,632,302,396円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）	2,642,591,636円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	1,901,143,295円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	552,810,923円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	174,759,098円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	5,411,642,373円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	4,201,886,464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）	35,492,792円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	58,782,800円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	90,216,225円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	118,748,080円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	73,430,230円
三菱UFJ 日本債券インデックスファンドVA	23,134,363円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	267,175,876円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	641,170,860円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	261,546,394円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	645,178,699円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	2,887,689,697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）	1,614,469,539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）	3,107,456,915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）	1,646,858,018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）	907,309,775円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	6,129,391,967円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	617,588,982円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	713,503,002円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	406,651,573円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	420,126円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	272,141円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	191,413円
eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）	49,079,772円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	22,122,406円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールデンキーパー）	5,351,778円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	16,871,400円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	3,342,258円
eMAXIS 最適化バランス（マイフワード）	2,016,780円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	54,241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）	2,670,099,620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）	466,044円
合計	392,963,515,092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)

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

《第8期》決算日2017年1月26日

[計算期間：2016年1月27日～2017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8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8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
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
8期(2017年1月26日)	12,509	△ 0.8	378.81	△ 0.8	96.9	—	92,179

(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）とは、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 (<small>係(日本、円ヘッジ・円ベース)</small>)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
	円	騰 落 率	騰 落 率	%			
(期 首) 2016年1月26日	12,613	—	381.71	—	95.6	—	—
1月末	12,655	0.3	382.97	0.3	98.1	—	—
2月末	12,795	1.4	387.13	1.4	92.4	—	—
3月末	12,830	1.7	388.21	1.7	107.4	—	—
4月末	12,736	1.0	385.50	1.0	96.1	—	—
5月末	12,820	1.6	388.38	1.7	99.6	—	—
6月末	13,114	4.0	396.92	4.0	91.2	—	—
7月末	13,170	4.4	398.69	4.4	99.9	—	—
8月末	13,197	4.6	399.55	4.7	98.3	—	—
9月末	13,176	4.5	398.82	4.5	96.9	—	—
10月末	12,894	2.2	390.37	2.3	100.9	—	—
11月末	12,650	0.3	382.83	0.3	103.3	—	—
12月末	12,654	0.3	383.04	0.3	101.0	—	—
(期 末) 2017年1月26日	12,509	△0.8	378.81	△0.8	96.9	—	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.8%の下落となりました。

◎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(−0.8%)と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

◎外国債券市況

- ・世界的な景気減速懸念などを背景に、金利は総じて低下傾向にありましたが、その後の米大統領選の結果を受けて、米国を中心に金利が上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。
- ・組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行いました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは0.8%の下落となったため、ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.0$ 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	0.1%程度	$\Delta 0.1\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度

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

◎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0.1%程度でした。

- ・為替ヘッジ効果、カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

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 $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。

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

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

○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

(2016年1月27日～2017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)	(0.015)	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	0.015	
期中の平均基準価額は、12,890円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2016年1月27日～2017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 279,435	千アメリカドル 120,266
	カナダ	千カナダドル 17,490	千カナダドル 6,868
	メキシコ	千メキシコペソ 99,071	千メキシコペソ 38,380
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 40,312	17,258
	イタリア	国債証券 50,523	18,223
	フランス	国債証券 53,619	19,926
	オランダ	国債証券 11,808	5,021
	スペイン	国債証券 30,025	12,180
	ベルギー	国債証券 13,012	4,852
	オーストリア	国債証券 7,420	2,579
	フィンランド	国債証券 3,449	1,488
	アイルランド	国債証券 3,540	998
	イギリス	国債証券 千イギリスポンド 32,091	千イギリスポンド 13,508
スイス	国債証券 千スイスフラン 1,124	千スイスフラン 446	
国	スウェーデン	国債証券 千スウェーデンクローネ 22,854	千スウェーデンクローネ 8,388
	ノルウェー	国債証券 千ノルウェークローネ 12,841	千ノルウェークローネ 5,278
	デンマーク	国債証券 千デンマーククローネ 25,466	千デンマーククローネ 8,974
	ポーランド	国債証券 千ポーランドズロチ 15,461	千ポーランドズロチ 5,272
	オーストラリア	国債証券 千オーストラリアドル 16,817	千オーストラリアドル 5,369
	シンガポール	国債証券 千シンガポールドル 5,380	千シンガポールドル 2,233
	南アフリカ	国債証券 千南アフリカランド 38,085	千南アフリカランド 11,938

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2016年1月27日～2017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	983,021	474,947	48.3	1,020,009	511,226	50.1
為替直物取引	57,076	39,514	69.2	20,030	10,168	50.8

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

○組入資産の明細

(2017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 348,590	千アメリカドル 349,914	千円 39,592,791	% 43.0	% —	% 17.5	% 16.9	% 8.6
カナダ	千カナダドル 20,640	千カナダドル 22,414	1,942,427	2.1	—	1.0	0.7	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 125,700	千メキシコペソ 126,598	679,832	0.7	—	0.4	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	45,850	54,088	6,585,842	7.1	—	3.9	2.3	0.9
イタリア	61,520	70,105	8,535,986	9.3	—	5.5	3.1	0.7
フランス	61,350	71,986	8,765,105	9.5	—	5.9	2.7	0.9
オランダ	14,650	17,187	2,092,732	2.3	—	1.3	0.5	0.4
スペイン	34,660	40,530	4,934,985	5.4	—	3.3	1.6	0.5
ベルギー	15,210	18,331	2,232,030	2.4	—	1.8	0.4	0.2
オーストリア	9,490	11,268	1,372,087	1.5	—	0.9	0.5	0.1
フィンランド	4,000	4,490	546,721	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	4,950	5,671	690,600	0.7	—	0.4	0.3	0.1
イギリス	千イギリスポンド 36,550	千イギリスポンド 45,180	6,460,380	7.0	—	5.0	1.6	0.4
スイス	千スイスフラン 1,550	千スイスフラン 1,842	208,924	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 28,300	千スウェーデンクローネ 32,542	418,172	0.5	—	0.3	0.2	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 17,080	千ノルウェークローネ 18,230	248,663	0.3	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 28,100	千デンマーククローネ 35,298	577,843	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 19,210	千ポーランドズロチ 19,546	546,918	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 20,610	千オーストラリアドル 22,190	1,903,293	2.1	—	1.3	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 6,410	千シンガポールドル 6,637	532,070	0.6	—	0.3	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 62,100	千南アフリカランド 57,568	492,212	0.5	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	89,359,623	96.9	—	50.5	32.6	13.9

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利率	当期			償還年月日
			額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	0.625 T-NOTE 180430	0.625	2,400	2,390	270,435	2018/4/30
	0.625 T-NOTE 180630	0.625	2,500	2,486	281,339	2018/6/30
	0.75 T-NOTE 171231	0.75	1,300	1,298	146,962	2017/12/31
	0.75 T-NOTE 180131	0.75	1,500	1,498	169,559	2018/1/31
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	2,100	2,096	237,243	2018/2/28
	0.75 T-NOTE 180331	0.75	2,000	1,996	225,849	2018/3/31
	0.75 T-NOTE 180415	0.75	600	598	67,728	2018/4/15
	0.75 T-NOTE 180430	0.75	300	299	33,858	2018/4/30
	0.75 T-NOTE 180731	0.75	700	696	78,843	2018/7/31
	0.75 T-NOTE 181031	0.75	400	397	44,936	2018/10/31
	0.75 T-NOTE 190215	0.75	1,800	1,781	201,561	2019/2/15
	0.75 T-NOTE 190715	0.75	1,100	1,083	122,563	2019/7/15
	0.75 T-NOTE 190815	0.75	3,700	3,640	411,868	2019/8/15
	0.875 T-NOTE 180115	0.875	500	500	56,603	2018/1/15
	0.875 T-NOTE 180531	0.875	3,400	3,395	384,153	2018/5/31
	0.875 T-NOTE 180715	0.875	900	897	101,608	2018/7/15
	0.875 T-NOTE 181015	0.875	2,200	2,189	247,792	2018/10/15
	0.875 T-NOTE 190515	0.875	1,100	1,088	123,137	2019/5/15
	0.875 T-NOTE 190615	0.875	500	494	55,931	2019/6/15
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	500	493	55,854	2019/7/31
	0.875 T-NOTE 190915	0.875	1,700	1,675	189,612	2019/9/15
	1 T-NOTE 180215	1.0	1,000	1,001	113,309	2018/2/15
	1 T-NOTE 180315	1.0	2,700	2,702	305,803	2018/3/15
	1 T-NOTE 180515	1.0	3,800	3,800	430,053	2018/5/15
	1 T-NOTE 180531	1.0	1,200	1,200	135,780	2018/5/31
	1 T-NOTE 180815	1.0	1,700	1,698	192,152	2018/8/15
	1 T-NOTE 180915	1.0	1,900	1,896	214,573	2018/9/15
	1 T-NOTE 190315	1.0	1,200	1,192	134,947	2019/3/15
	1 T-NOTE 190630	1.0	400	396	44,871	2019/6/30
	1 T-NOTE 190831	1.0	2,000	1,978	223,886	2019/8/31
	1 T-NOTE 190930	1.0	1,500	1,483	167,802	2019/9/30
	1 T-NOTE 191130	1.0	1,300	1,282	145,118	2019/11/30
	1.125 T-NOTE 180615	1.125	2,200	2,203	249,328	2018/6/15
	1.125 T-NOTE 190115	1.125	2,000	1,995	225,831	2019/1/15
	1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,300	1,293	146,342	2019/5/31
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,800	1,780	201,434	2019/12/31
	1.125 T-NOTE 200430	1.125	2,200	2,167	245,196	2020/4/30
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	3,100	3,011	340,790	2021/2/28
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	2,200	2,126	240,645	2021/6/30
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	2,800	2,702	305,805	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210831	1.125	2,800	2,700	305,558	2021/8/31
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	1,200	1,155	130,741	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 181031	1.25	1,600	1,602	181,308	2018/10/31
	1.25 T-NOTE 181115	1.25	3,400	3,404	385,205	2018/11/15
	1.25 T-NOTE 181130	1.25	400	400	45,307	2018/11/30
	1.25 T-NOTE 181215	1.25	1,300	1,300	147,204	2018/12/15

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	1.25 T-NOTE 190131	1.25	1,800	1,800	203,677	2019/1/31
	1.25 T-NOTE 190430	1.25	2,000	1,996	225,919	2019/4/30
	1.25 T-NOTE 191031	1.25	300	298	33,768	2019/10/31
	1.25 T-NOTE 200131	1.25	900	892	100,967	2020/1/31
	1.25 T-NOTE 200229	1.25	500	495	56,062	2020/2/29
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	1,700	1,658	187,621	2021/3/31
	1.25 T-NOTE 230731	1.25	700	656	74,304	2023/7/31
	1.375 T-NOTE 180630	1.375	600	603	68,232	2018/6/30
	1.375 T-NOTE 180731	1.375	800	803	90,965	2018/7/31
	1.375 T-NOTE 180930	1.375	1,800	1,807	204,529	2018/9/30
	1.375 T-NOTE 181130	1.375	2,400	2,407	272,419	2018/11/30
	1.375 T-NOTE 181231	1.375	4,300	4,313	488,122	2018/12/31
	1.375 T-NOTE 190228	1.375	500	501	56,692	2019/2/28
	1.375 T-NOTE 200131	1.375	400	398	45,061	2020/1/31
	1.375 T-NOTE 200229	1.375	1,600	1,590	179,979	2020/2/29
	1.375 T-NOTE 200331	1.375	900	893	101,150	2020/3/31
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	1,100	1,091	123,502	2020/4/30
	1.375 T-NOTE 200531	1.375	1,800	1,784	201,903	2020/5/31
	1.375 T-NOTE 200831	1.375	1,300	1,284	145,336	2020/8/31
	1.375 T-NOTE 200930	1.375	1,000	986	111,673	2020/9/30
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	2,100	2,070	234,254	2020/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	5,700	5,599	633,617	2021/1/31
	1.375 T-NOTE 210430	1.375	2,600	2,546	288,099	2021/4/30
	1.375 T-NOTE 210531	1.375	2,500	2,445	276,753	2021/5/31
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	1,900	1,798	203,530	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	2,000	1,888	213,676	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	800	754	85,407	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 180831	1.5	2,700	2,717	307,509	2018/8/31
	1.5 T-NOTE 181231	1.5	700	703	79,631	2018/12/31
	1.5 T-NOTE 190131	1.5	600	603	68,229	2019/1/31
	1.5 T-NOTE 190228	1.5	400	401	45,475	2019/2/28
	1.5 T-NOTE 190331	1.5	400	401	45,442	2019/3/31
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	800	802	90,827	2019/5/31
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	3,900	3,903	441,733	2019/10/31
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	2,000	2,000	226,379	2019/11/30
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	1,400	1,393	157,655	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	800	780	88,313	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	1,700	1,630	184,450	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	2,100	2,010	227,479	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	3,000	2,739	309,986	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 190331	1.625	1,400	1,409	159,486	2019/3/31
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	2,000	2,012	227,767	2019/4/30
	1.625 T-NOTE 190630	1.625	1,200	1,207	136,586	2019/6/30
	1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,600	1,608	182,015	2019/7/31
	1.625 T-NOTE 190831	1.625	2,500	2,513	284,355	2019/8/31
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,600	1,605	181,619	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 200630	1.625	1,500	1,497	169,459	2020/6/30

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.625 T-NOTE 200731	1.625	2,600	2,593	293,477	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,500	1,490	168,703	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	400	389	44,071	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	3,200	3,105	351,330	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	4,700	4,529	512,527	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	2,500	2,406	272,289	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	5,200	4,827	546,274	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	2,600	2,408	272,516	2026/5/15
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	300	303	34,293	2018/10/31
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	1,500	1,512	171,104	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	3,100	3,099	350,682	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	1,700	1,696	191,949	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	700	690	78,122	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	1,000	985	111,470	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	1,500	1,476	167,020	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,200	1,180	133,547	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,400	1,369	154,957	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	500	487	55,107	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,500	1,455	164,726	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	1,000	1,006	113,910	2020/6/30
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	700	696	78,771	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	2,700	2,671	302,330	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,700	1,675	189,634	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	1,100	1,082	122,461	2022/10/31
	2 T-NOTE 200731	2.0	1,500	1,516	171,554	2020/7/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	2,200	2,220	251,263	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	1,200	1,209	136,851	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	2,100	2,112	239,044	2021/2/28
	2 T-NOTE 210531	2.0	1,500	1,506	170,441	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,000	1,001	113,370	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	1,100	1,100	124,533	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2.0	2,900	2,900	328,237	2021/11/15
	2 T-NOTE 220215	2.0	1,600	1,598	180,849	2022/2/15
	2 T-NOTE 220731	2.0	4,000	3,975	449,877	2022/7/31
	2 T-NOTE 221130	2.0	200	197	22,400	2022/11/30
	2 T-NOTE 230215	2.0	2,300	2,272	257,113	2023/2/15
	2 T-NOTE 250215	2.0	2,400	2,321	262,691	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	3,400	3,274	370,463	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	1,500	1,432	162,047	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 200831	2.125	1,000	1,013	114,679	2020/8/31
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	700	707	80,089	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,300	1,311	148,416	2021/6/30
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	1,000	1,007	114,011	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,000	1,006	113,927	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	1,500	1,509	170,759	2021/12/31
	2.125 T-NOTE 220630	2.125	1,100	1,101	124,610	2022/6/30
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	2,000	1,977	223,736	2023/11/30

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	2.125 T-NOTE 250515	2.125	3,200	3,118	352,886	2025/5/15
		2.25 T-BOND 460815	2.25	1,250	1,039	117,647	2046/8/15
		2.25 T-NOTE 180731	2.25	600	610	69,101	2018/7/31
		2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,800	1,827	206,836	2021/3/31
		2.25 T-NOTE 210430	2.25	900	913	103,362	2021/4/30
		2.25 T-NOTE 210731	2.25	700	709	80,275	2021/7/31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	4,000	3,952	447,190	2024/11/15
		2.25 T-NOTE 251115	2.25	3,400	3,333	377,166	2025/11/15
		2.375 T-NOTE 180531	2.375	2,300	2,342	265,012	2018/5/31
		2.375 T-NOTE 180630	2.375	900	917	103,764	2018/6/30
		2.375 T-NOTE 201231	2.375	700	715	80,931	2020/12/31
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	3,300	3,298	373,190	2024/8/15
		2.5 T-BOND 450215	2.5	100	88	9,998	2045/2/15
		2.5 T-BOND 460215	2.5	1,600	1,408	159,400	2046/2/15
		2.5 T-BOND 460515	2.5	1,400	1,232	139,437	2046/5/15
		2.5 T-NOTE 230815	2.5	1,500	1,519	171,952	2023/8/15
		2.5 T-NOTE 240515	2.5	2,700	2,727	308,631	2024/5/15
		2.625 T-NOTE 180131	2.625	200	203	23,031	2018/1/31
		2.625 T-NOTE 180430	2.625	500	510	57,766	2018/4/30
		2.625 T-NOTE 200815	2.625	1,400	1,444	163,434	2020/8/15
		2.625 T-NOTE 201115	2.625	2,900	2,991	338,440	2020/11/15
		2.75 T-BOND 420815	2.75	1,300	1,220	138,085	2042/8/15
		2.75 T-BOND 421115	2.75	1,500	1,406	159,103	2042/11/15
		2.75 T-NOTE 180228	2.75	200	203	23,081	2018/2/28
		2.75 T-NOTE 190215	2.75	500	514	58,243	2019/2/15
		2.75 T-NOTE 231115	2.75	2,200	2,261	255,853	2023/11/15
		2.75 T-NOTE 240215	2.75	3,300	3,391	383,721	2024/2/15
		2.875 T-BOND 430515	2.875	2,300	2,205	249,591	2043/5/15
		2.875 T-BOND 450815	2.875	3,100	2,956	334,514	2045/8/15
		2.875 T-BOND 461115	2.875	100	95	10,806	2046/11/15
		2.875 T-NOTE 180331	2.875	1,900	1,943	219,855	2018/3/31
		3 T-BOND 420515	3.0	7,000	6,896	780,354	2042/5/15
		3 T-BOND 441115	3.0	1,200	1,176	133,096	2044/11/15
		3 T-BOND 450515	3.0	3,600	3,521	398,493	2045/5/15
		3 T-BOND 451115	3.0	2,450	2,394	270,936	2045/11/15
		3.125 T-BOND 420215	3.125	4,800	4,837	547,320	2042/2/15
		3.125 T-BOND 430215	3.125	3,050	3,065	346,859	2043/2/15
		3.125 T-BOND 440815	3.125	300	301	34,109	2044/8/15
		3.125 T-NOTE 190515	3.125	690	717	81,236	2019/5/15
		3.125 T-NOTE 210515	3.125	1,300	1,366	154,564	2021/5/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	1,600	1,684	190,601	2044/5/15	
	3.375 T-NOTE 191115	3.375	1,060	1,115	126,174	2019/11/15	
	3.5 T-BOND 390215	3.5	400	433	49,046	2039/2/15	
	3.5 T-NOTE 180215	3.5	970	996	112,756	2018/2/15	
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	1,100	1,166	131,937	2020/5/15	
	3.625 T-BOND 430815	3.625	1,350	1,483	167,896	2043/8/15	
	3.625 T-BOND 440215	3.625	1,500	1,648	186,538	2044/2/15	

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	3.625 T-NOTE 190815	3.625	720	759	85,977	2019/8/15	
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	1,630	1,730	195,803	2020/2/15	
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	3,000	3,211	363,423	2021/2/15	
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,000	1,119	126,621	2041/8/15	
	3.75 T-BOND 431115	3.75	1,600	1,799	203,599	2043/11/15	
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	2,500	2,614	295,814	2018/11/15	
	3.875 T-BOND 400815	3.875	800	912	103,206	2040/8/15	
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	1,130	1,172	132,639	2018/5/15	
	4 T-NOTE 180815	4.0	670	700	79,296	2018/8/15	
	4.25 T-BOND 390515	4.25	600	722	81,722	2039/5/15	
	4.25 T-BOND 401115	4.25	800	963	109,062	2040/11/15	
	4.375 T-BOND 391115	4.375	500	611	69,242	2039/11/15	
	4.375 T-BOND 400515	4.375	650	796	90,107	2040/5/15	
	4.375 T-BOND 410515	4.375	900	1,105	125,105	2041/5/15	
	4.5 T-BOND 360215	4.5	900	1,128	127,651	2036/2/15	
	4.5 T-BOND 390815	4.5	500	622	70,457	2039/8/15	
	4.625 T-BOND 400215	4.625	900	1,140	128,996	2040/2/15	
	4.75 T-BOND 410215	4.75	300	388	43,913	2041/2/15	
	5.25 T-BOND 281115	5.25	900	1,138	128,876	2028/11/15	
	5.25 T-BOND 290215	5.25	200	254	28,745	2029/2/15	
	5.375 T-BOND 310215	5.375	500	661	74,842	2031/2/15	
	5.5 T-BOND 280815	5.5	300	385	43,655	2028/8/15	
	6 T-BOND 260215	6.0	1,220	1,568	177,428	2026/2/15	
	6.125 T-BOND 271115	6.125	390	519	58,837	2027/11/15	
	6.25 T-BOND 230815	6.25	1,560	1,943	219,939	2023/8/15	
	6.25 T-BOND 300515	6.25	500	702	79,443	2030/5/15	
	6.5 T-BOND 261115	6.5	140	188	21,322	2026/11/15	
	8 T-BOND 211115	8.0	500	637	72,186	2021/11/15	
	8.125 T-BOND 190815	8.125	160	187	21,161	2019/8/15	
	8.75 T-BOND 200815	8.75	1,700	2,113	239,136	2020/8/15	
小 計					39,592,791		
カナダ			千カナダドル	千カナダドル			
国債証券	0.25 CAN GOVT 180501	0.25	900	894	77,559	2018/5/1	
	0.5 CAN GOVT 180801	0.5	900	896	77,696	2018/8/1	
	0.5 CAN GOVT 181101	0.5	550	547	47,426	2018/11/1	
	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	500	494	42,862	2020/9/1	
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	700	689	59,755	2021/3/1	
	0.75 CAN GOVT 210901	0.75	350	343	29,766	2021/9/1	
	1 CAN GOVT 270601	1.0	450	411	35,619	2027/6/1	
	1.25 CAN GOVT 180201	1.25	900	905	78,475	2018/2/1	
	1.25 CAN GOVT 180301	1.25	800	805	69,776	2018/3/1	
	1.25 CAN GOVT 180901	1.25	350	352	30,554	2018/9/1	
	1.5 CAN GOVT 200301	1.5	400	406	35,194	2020/3/1	
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	760	762	66,066	2023/6/1	
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	750	729	63,210	2026/6/1	
	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	700	713	61,837	2019/3/1	
	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	1,000	1,022	88,582	2019/9/1	

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日	
			利 率	額面金額	評 価 額			
					外貨建金額	邦貨換算金額		
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
	国債証券	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	650	676	58,620	2025/6/1	
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	750	796	69,011	2024/6/1	
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	980	1,053	91,272	2022/6/1	
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	500	533	46,194	2048/12/1	
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	200	218	18,899	2064/12/1	
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	1,250	1,361	117,945	2021/6/1	
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	950	1,026	88,989	2020/6/1	
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	900	1,088	94,325	2045/12/1	
		3.75 CAN GOVT 190601	3.75	960	1,024	88,803	2019/6/1	
		4 CAN GOVT 410601	4.0	850	1,085	94,047	2041/6/1	
		4.25 CAN GOVT 180601	4.25	600	628	54,444	2018/6/1	
		5 CAN GOVT 370601	5.0	650	917	79,497	2037/6/1	
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	440	613	53,181	2029/6/1	
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	710	1,040	90,191	2033/6/1	
		8 CAN GOVT 270601	8.0	240	376	32,618	2027/6/1	
小	計					1,942,427		
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	13,600	15,604	83,796	2024/12/5	
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	3,400	4,046	21,729	2036/11/20	
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	10,500	10,225	54,911	2018/6/14	
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	13,400	12,712	68,265	2019/12/11	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	4,900	4,304	23,113	2026/3/5	
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	15,100	14,672	78,791	2021/6/10	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	6,100	5,871	31,529	2022/6/9	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	5,100	5,028	27,002	2027/6/3	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	7,700	7,554	40,565	2031/5/29	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	5,100	4,952	26,593	2034/11/23	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	8,500	8,221	44,150	2042/11/13	
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	6,200	6,366	34,189	2020/6/11	
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	5,200	5,345	28,703	2023/12/7	
		8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	11,100	11,426	61,362	2018/12/13	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	4,700	4,945	26,557	2029/5/31	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	5,100	5,320	28,571	2038/11/18	
小	計					679,832		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ			
	ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	900	866	105,555	2026/8/15
			0 OBL 200417	—	1,100	1,121	136,573	2020/4/17
			0 OBL 210409	—	800	815	99,300	2021/4/9
			0 OBL 211008	—	500	509	61,977	2021/10/8
			0 SCHATS 180316	—	1,800	1,813	220,846	2018/3/16
			0 SCHATS 180615	—	200	201	24,581	2018/6/15
			0.25 OBL 180413	0.25	800	809	98,524	2018/4/13
			0.25 OBL 191011	0.25	700	717	87,343	2019/10/11
			0.25 OBL 201016	0.25	900	926	112,824	2020/10/16
			0.5 BUND 250215	0.5	800	823	100,277	2025/2/15
			0.5 BUND 260215	0.5	2,100	2,137	260,273	2026/2/15
			0.5 OBL 180223	0.5	1,100	1,113	135,633	2018/2/23

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	0.5 OBL 190412	0.5	500	513	62,490	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	500	535	65,235	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	1,650	1,760	214,348	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	500	514	62,625	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,400	1,449	176,473	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	900	989	120,442	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	600	661	80,535	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,000	1,104	134,458	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	400	443	53,986	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,500	1,665	202,840	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	900	1,013	123,382	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,100	1,227	149,508	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	900	1,025	124,838	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	700	771	93,983	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,100	1,236	150,577	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,500	1,679	204,534	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,000	1,306	159,096	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,050	1,382	168,298	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,000	1,124	136,892	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	1,100	1,226	149,380	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,300	1,515	184,559	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	800	1,170	142,486	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	2,330	2,569	312,844	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	1,190	1,293	157,436	2019/1/4
		4 BUND 180104	4.0	700	730	89,003	2018/1/4
		4 BUND 370104	4.0	1,300	2,014	245,326	2037/1/4
		4.25 BUND 180704	4.25	620	664	80,883	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	590	967	117,836	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	350	513	62,500	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,050	1,712	208,528	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	810	1,427	173,829	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	800	1,310	159,519	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	650	1,005	122,480	2028/1/4
6.25 BUND 240104	6.25	980	1,408	171,475	2024/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	750	1,274	155,203	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	630	1,020	124,288	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.1 ITALY GOVT 190415	0.1	500	500	60,972	2019/4/15
		0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	400	402	48,969	2018/5/15
		0.3 ITALY GOVT 181015	0.3	800	805	98,068	2018/10/15
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	800	796	97,038	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	700	708	86,278	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	300	286	34,892	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	400	406	49,455	2020/5/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,000	987	120,254	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	500	513	62,472	2019/12/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	750	694	84,526	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,000	1,022	124,515	2022/4/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
イタリア	国債証券	1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	500	512	62,351	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,000	1,035	126,043	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,000	975	118,734	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	1,000	964	117,424	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,050	943	114,892	2032/3/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,000	1,003	122,209	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,300	1,387	168,939	2021/12/15
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	400	370	45,101	2036/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,700	1,793	218,397	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	800	846	103,095	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	650	583	71,105	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	300	250	30,440	2067/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	550	552	67,308	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	900	944	115,012	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,000	1,066	129,833	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,400	1,565	190,649	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	1,600	1,814	220,902	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,450	1,645	200,404	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	1,530	1,744	212,376	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,950	2,240	272,792	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,800	2,037	248,074	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,400	1,642	200,042	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	1,500	1,629	198,393	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	1,400	1,549	188,711	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,130	1,271	154,764	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	800	838	102,095	2018/2/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	1,410	1,508	183,733	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	1,100	1,203	146,508	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	1,600	1,807	220,035	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,700	2,034	247,737	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,400	1,682	204,819	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	800	963	117,328	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	1,200	1,422	173,234	2021/9/1
4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,230	1,498	182,440	2023/8/1		
4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	800	996	121,283	2028/9/1		
4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,000	1,279	155,802	2044/9/1		
5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,400	1,687	205,499	2022/3/1		
5 ITALY GOVT 250301	5.0	780	969	118,105	2025/3/1		
5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,300	1,710	208,245	2034/8/1		
5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,150	1,519	184,962	2039/8/1		
5 ITALY GOVT 400901	5.0	920	1,208	147,101	2040/9/1		
5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	1,650	2,163	263,375	2029/11/1		
5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	550	684	83,357	2022/9/1		
5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	500	623	75,930	2022/11/1		
5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	890	1,247	151,838	2033/2/1		
6 ITALY GOVT 310501	6.0	1,450	2,053	250,091	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	1,300	1,834	223,376	2027/11/1		

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	7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	450	657	80,044	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	680	1,015	123,594	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O. A. T 180225	—	1,200	1,207	146,982	2018/2/25
		0 O. A. T 190225	—	100	101	12,302	2019/2/25
		0 O. A. T 200525	—	1,300	1,313	159,942	2020/5/25
		0 O. A. T 210525	—	800	805	98,027	2021/5/25
		0.25 O. A. T 201125	0.25	1,200	1,222	148,897	2020/11/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	500	466	56,795	2026/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	1,700	1,743	212,244	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	1,800	1,775	216,196	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	800	772	94,017	2026/5/25
		1 O. A. T 180525	1.0	1,100	1,122	136,699	2018/5/25
		1 O. A. T 181125	1.0	950	976	118,893	2018/11/25
		1 O. A. T 190525	1.0	800	827	100,724	2019/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	1,500	1,527	185,933	2025/11/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	850	786	95,816	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	1,600	1,620	197,353	2031/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	1,900	2,079	253,226	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	1,950	2,130	259,390	2024/11/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	200	167	20,402	2066/5/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	1,700	1,907	232,280	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	1,400	1,583	192,829	2024/5/25
		2.5 O. A. T 201025	2.5	2,100	2,319	282,420	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	1,350	1,548	188,544	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	1,550	1,814	220,931	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	1,800	2,082	253,588	2022/4/25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	2,300	2,664	324,435	2021/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	1,380	1,756	213,929	2045/5/25
		3.5 O. A. T 200425	3.5	1,120	1,260	153,430	2020/4/25
		3.5 O. A. T 260425	3.5	2,900	3,586	436,642	2026/4/25
3.75 O. A. T 191025	3.75	1,510	1,684	205,058	2019/10/25		
3.75 O. A. T 210425	3.75	2,700	3,155	384,176	2021/4/25		
4 O. A. T 180425	4.0	1,900	2,007	244,478	2018/4/25		
4 O. A. T 381025	4.0	1,550	2,183	265,915	2038/10/25		
4 O. A. T 550425	4.0	800	1,191	145,050	2055/4/25		
4 O. A. T 600425	4.0	610	918	111,806	2060/4/25		
4.25 O. A. T 181025	4.25	1,680	1,821	221,748	2018/10/25		
4.25 O. A. T 190425	4.25	1,570	1,737	211,527	2019/4/25		
4.25 O. A. T 231025	4.25	2,300	2,909	354,270	2023/10/25		
4.5 O. A. T 410425	4.5	1,200	1,819	221,535	2041/4/25		
4.75 O. A. T 350425	4.75	1,100	1,655	201,525	2035/4/25		
5.5 O. A. T 290425	5.5	1,750	2,617	318,732	2029/4/25		
5.75 O. A. T 321025	5.75	1,820	2,933	357,124	2032/10/25		
6 O. A. T 251025	6.0	910	1,322	161,056	2025/10/25		
8.5 O. A. T 191025	8.5	1,200	1,496	182,169	2019/10/25		
8.5 O. A. T 230425	8.5	900	1,363	166,048	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	700	705	85,853	2018/4/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	300	303	36,894	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	700	716	87,246	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	400	393	47,966	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,000	992	120,858	2026/7/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	800	814	99,165	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	700	725	88,321	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,100	1,221	148,672	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	950	1,073	130,721	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	500	566	68,926	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	700	859	104,614	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	600	811	98,788	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	900	1,046	127,369	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	800	911	111,038	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	200	245	29,934	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	760	1,175	143,183	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	850	907	110,499	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	850	946	115,262	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	800	1,223	148,931	2037/1/15
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	640	966	117,740	2028/1/15		
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	400	581	70,744	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	1,000	1,006	122,603	2018/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25	700	706	85,996	2019/1/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	1,300	1,328	161,719	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	1,100	1,142	139,127	2020/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	700	685	83,442	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	900	938	114,303	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,500	1,539	187,461	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,100	1,146	139,547	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	1,050	1,045	127,313	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	800	850	103,512	2025/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,500	1,599	194,754	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	1,200	1,341	163,382	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	400	403	49,086	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	150	156	19,005	2066/7/30
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	450	482	58,726	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,200	1,431	174,240	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	1,080	1,219	148,519	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	880	938	114,212	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	900	1,149	139,971	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	1,160	1,300	158,292	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,150	1,417	172,600	2023/10/31
		4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	1,000	1,048	127,666	2018/1/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,200	1,342	163,409	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,040	1,317	160,388	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	820	1,121	136,575	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	750	946	115,275	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,100	1,295	157,763	2020/10/31

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄		銘柄	当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	850	1,188	144,709	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	500	678	82,666	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	600	870	106,032	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	900	1,151	140,203	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	1,100	1,347	164,050	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,100	1,631	198,604	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,300	1,650	200,942	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	850	1,179	143,650	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,330	1,931	235,227	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	850	861	104,929	2025/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	750	762	92,900	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	500	478	58,213	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	900	922	112,354	2018/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	300	275	33,588	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	350	365	44,483	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	180	172	20,968	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	800	908	110,611	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	850	987	120,213	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	700	764	93,124	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	600	743	90,531	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	900	1,036	126,188	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	480	680	82,814	2045/6/22
		4 BEL GOVT 180328	4.0	700	737	89,801	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	200	219	26,741	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	850	1,032	125,761	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	500	683	83,278	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	900	1,088	132,574	2021/9/28
4.25 BEL GOVT 220928	4.25	800	993	120,999	2022/9/28		
4.25 BEL GOVT 410328	4.25	750	1,128	137,405	2041/3/28		
4.5 BEL GOVT 260328	4.5	500	669	81,519	2026/3/28		
5 BEL GOVT 350328	5.0	800	1,258	153,242	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,050	1,558	189,784	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	300	306	37,291	2019/10/18
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	300	302	36,856	2026/10/20
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	250	257	31,357	2018/10/19
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	650	689	83,974	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	150	146	17,878	2047/2/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	500	551	67,141	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	600	666	81,170	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	450	477	58,085	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	330	394	48,091	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	400	550	66,996	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	500	600	73,112	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	870	1,022	124,512	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	600	719	87,556	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	190	309	37,721	2062/1/26
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	870	1,000	121,841	2020/7/15		

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	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
オーストリア	国債証券	4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	600	907	110,522	2037/3/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	550	607	73,997	2019/3/15
		4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	630	662	80,611	2018/1/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	450	624	76,041	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	300	470	57,324	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	400	411	50,047	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	350	346	42,173	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	200	192	23,395	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	50	51	6,280	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	250	257	31,301	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	400	435	53,064	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	300	328	40,046	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	150	168	20,548	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	250	319	38,905	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	300	365	44,507	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	250	280	34,211	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	250	290	35,339	2021/4/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	500	649	79,123	2025/7/4
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	350	392	47,777	2019/7/4		
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	200	207	25,224	2022/3/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	400	396	48,279	2026/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	300	288	35,105	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	440	484	59,047	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	350	416	50,700	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	450	545	66,448	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	620	691	84,167	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	350	380	46,288	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	590	679	82,787	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	350	418	50,928	2020/10/18
5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	600	812	98,881	2025/3/13		
5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	300	351	42,738	2019/10/18		
小 計						35,756,092	
イギリス							
国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	300	294	42,067	2022/7/22	
	1.25 GILT 180722	1.25	1,600	1,626	232,514	2018/7/22	
	1.5 GILT 210122	1.5	1,600	1,658	237,136	2021/1/22	
	1.5 GILT 260722	1.5	700	702	100,407	2026/7/22	
	1.5 GILT 470722	1.5	400	352	50,375	2047/7/22	
	1.75 GILT 190722	1.75	1,500	1,554	222,342	2019/7/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	1,300	1,365	195,237	2022/9/7	
	2 GILT 200722	2.0	1,500	1,579	225,844	2020/7/22	
	2 GILT 250907	2.0	900	949	135,801	2025/9/7	
	2.25 GILT 230907	2.25	1,150	1,242	177,710	2023/9/7	
	2.5 GILT 650722	2.5	650	775	110,820	2065/7/22	
	2.75 GILT 240907	2.75	1,100	1,227	175,487	2024/9/7	
	3.25 GILT 440122	3.25	1,200	1,484	212,279	2044/1/22	
	3.5 GILT 450122	3.5	1,130	1,464	209,338	2045/1/22	

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					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
国債証券	3.5 GILT 680722	3.5	910	1,388	198,522	2068/7/22
	3.75 GILT 190907	3.75	820	894	127,935	2019/9/7
	3.75 GILT 200907	3.75	900	1,006	143,973	2020/9/7
	3.75 GILT 210907	3.75	960	1,096	156,787	2021/9/7
	3.75 GILT 520722	3.75	500	726	103,909	2052/7/22
	4 GILT 220307	4.0	900	1,049	150,024	2022/3/7
	4 GILT 600122	4.0	850	1,374	196,593	2060/1/22
	4.25 GILT 271207	4.25	700	887	126,889	2027/12/7
	4.25 GILT 320607	4.25	840	1,110	158,727	2032/6/7
	4.25 GILT 360307	4.25	1,300	1,766	252,568	2036/3/7
	4.25 GILT 390907	4.25	1,050	1,464	209,411	2039/9/7
	4.25 GILT 401207	4.25	710	1,000	143,025	2040/12/7
	4.25 GILT 461207	4.25	1,000	1,484	212,214	2046/12/7
	4.25 GILT 491207	4.25	870	1,336	191,167	2049/12/7
	4.25 GILT 551207	4.25	1,000	1,635	233,867	2055/12/7
	4.5 GILT 190307	4.5	1,000	1,090	155,976	2019/3/7
	4.5 GILT 340907	4.5	1,050	1,451	207,501	2034/9/7
	4.5 GILT 421207	4.5	1,110	1,650	236,057	2042/12/7
	4.75 GILT 200307	4.75	1,000	1,136	162,463	2020/3/7
	4.75 GILT 301207	4.75	900	1,231	176,158	2030/12/7
	4.75 GILT 381207	4.75	670	991	141,735	2038/12/7
	5 GILT 180307	5.0	650	684	97,942	2018/3/7
	5 GILT 250307	5.0	1,100	1,421	203,204	2025/3/7
	6 GILT 281207	6.0	380	560	80,216	2028/12/7
	8 GILT 210607	8.0	350	462	66,144	2021/6/7
小計					6,460,380	
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	200	223	25,344	2021/4/28
	2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	150	166	18,832	2020/7/6
	3 SWISS GOVT 180108	3.0	350	363	41,186	2018/1/8
	3 SWISS GOVT 190512	3.0	280	305	34,631	2019/5/12
	4 SWISS GOVT 230211	4.0	250	319	36,189	2023/2/11
	4 SWISS GOVT 280408	4.0	320	465	52,739	2028/4/8
小計					208,924	
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	3,250	3,330	42,791	2026/11/12
	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	4,200	4,541	58,360	2023/11/13
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	3,700	4,295	55,195	2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 220601	3.5	5,000	5,919	76,066	2022/6/1
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	2,400	3,191	41,012	2039/3/30
	4.25 SWD GOVT 190312	4.25	4,650	5,129	65,911	2019/3/12
	5 SWD GOVT 201201	5.0	5,100	6,134	78,834	2020/12/1
小計					418,172	
ノルウェー			千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	2,000	1,972	26,905	2026/2/19
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	2,100	2,130	29,058	2025/3/13
	2 NORWE GOVT 230524	2.0	2,950	3,068	41,848	2023/5/24

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		
ノルウェー		%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円	
国債証券	3 NORWE GOVT 240314	3.0	2,400	2,652	36,184	2024/3/14
	3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	4,000	4,457	60,794	2021/5/25
	4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	3,630	3,949	53,871	2019/5/22
小計					248,663	
デンマーク			千デンマーククロネ	千デンマーククロネ		
国債証券	0.25 DMK GOVT 181115	0.25	2,500	2,538	41,563	2018/11/15
	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	2,750	3,008	49,249	2023/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	5,000	5,549	90,849	2025/11/15
	3 DMK GOVT 211115	3.0	4,800	5,533	90,581	2021/11/15
	4 DMK GOVT 191115	4.0	5,310	5,968	97,703	2019/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	6,650	11,035	180,650	2039/11/15
	7 DMK GOVT 241110	7.0	1,090	1,664	27,246	2024/11/10
小計					577,843	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	1,500	1,454	40,689	2020/4/25
	1.75 POLAND 210725	1.75	1,200	1,143	31,991	2021/7/25
	2 POLAND 210425	2.0	1,450	1,400	39,191	2021/4/25
	2.5 POLAND 180725	2.5	1,900	1,920	53,725	2018/7/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	1,300	1,171	32,767	2026/7/25
	3.25 POLAND 190725	3.25	1,200	1,229	34,388	2019/7/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	2,250	2,184	61,108	2025/7/25
	3.75 POLAND 180425	3.75	950	974	27,274	2018/4/25
	4 POLAND 231025	4.0	1,300	1,341	37,539	2023/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	900	981	27,453	2020/10/25
	5.5 POLAND 191025	5.5	1,110	1,204	33,688	2019/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	850	953	26,679	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	1,400	1,580	44,221	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	800	945	26,459	2029/4/25
	POLAND 181025	—	1,100	1,062	29,739	2018/10/25
小計					546,918	
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	800	790	67,831	2020/11/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	300	282	24,261	2028/5/21
	2.75 AUST GOVT 191021	2.75	1,400	1,431	122,742	2019/10/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,400	1,421	121,883	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	600	597	51,243	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	350	320	27,460	2035/6/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	300	258	22,172	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 181021	3.25	850	871	74,740	2018/10/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,300	1,360	116,730	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	1,200	1,239	106,327	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	250	237	20,369	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	520	541	46,438	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,700	1,918	164,541	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	1,400	1,509	129,479	2020/4/15
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	600	699	60,005	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,700	2,004	171,957	2027/4/21

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		千円	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル			
	国債証券	5.25 AUST GOVT 190315	5.25	1,330	1,424	122,149	2019/3/15
		5.5 AUST GOVT 180121	5.5	800	829	71,114	2018/1/21
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,200	1,415	121,415	2023/4/21
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,310	1,504	129,042	2021/5/15
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,300	1,531	131,385	2022/7/15
小	計					1,903,293	
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	100	99	7,961	2018/4/1
		1.25 SINGAPORGOVT 211001	1.25	100	97	7,827	2021/10/1
		1.625 SINGAPORGOVT 191001	1.625	250	251	20,156	2019/10/1
		2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	370	375	30,068	2020/7/1
		2.125 SINGAPORGOVT 260601	2.125	250	245	19,704	2026/6/1
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	600	611	49,014	2021/6/1
		2.375 SINGAPORGOVT 250601	2.375	150	150	12,096	2025/6/1
		2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	450	462	37,035	2019/6/1
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	550	570	45,754	2023/7/1
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	370	372	29,837	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	200	200	16,112	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOVT 290701	2.875	350	361	28,967	2029/7/1
		2.875 SINGAPORGOVT 300901	2.875	200	205	16,459	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	500	527	42,244	2024/9/1
		3.125 SINGAPORGOVT 220901	3.125	400	424	33,987	2022/9/1
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	260	274	22,027	2020/9/1
		3.375 SINGAPORGOVT 330901	3.375	450	490	39,282	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	370	405	32,491	2027/3/1
		4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	490	511	41,041	2018/9/1
小	計					532,070	
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	9,200	10,266	87,778	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	4,700	3,410	29,156	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	3,600	2,606	22,284	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	3,400	3,247	27,761	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	5,600	4,651	39,769	2031/2/28
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	2,900	2,851	24,383	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	3,200	3,109	26,585	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	1,900	1,908	16,313	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	4,700	4,295	36,727	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	3,800	3,480	29,760	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	5,100	4,668	39,918	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	4,700	4,369	37,362	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	6,500	6,027	51,531	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRICA 350228	8.875	1,600	1,528	13,068	2035/2/28
		9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	1,200	1,147	9,810	2040/1/31
小	計					492,212	
合	計					89,359,623	

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

○投資信託財産の構成

(2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 89,359,623	% 96.9
コール・ローン等、その他	2,872,912	3.1
投資信託財産総額	92,232,535	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (90,456,093千円) の投資信託財産総額 (92,232,535千円) に対する比率は98.1%です。

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

1 アメリカドル=113.15円	1 カナダドル=86.66円	1 メキシコペソ=5.37円	1 ユーロ=121.76円
1 イギリスポンド=142.99円	1 スイスフラン=113.39円	1 スウェーデンクローネ=12.85円	1 ノルウェークローネ=13.64円
1 デンマーククローネ=16.37円	1 ポーランドズロチ=27.98円	1 オーストラリアドル=85.77円	1 シンガポールドル=80.16円
1 南アフリカランド=8.55円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	183,544,025,876
コール・ローン等	450,478,854
公社債(評価額)	89,359,623,726
未収入金	92,933,013,317
未収利息	746,061,431
前払費用	54,848,548
(B) 負債	91,364,407,437
未払金	91,360,321,640
未払解約金	4,085,578
未払利息	219
(C) 純資産総額(A-B)	92,179,618,439
元本	73,688,743,763
次期繰越損益金	18,490,874,676
(D) 受益権総口数	73,688,743,763口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,509円

<注記事項>

- ①期首元本額 45,472,741,060円
 期中追加設定元本額 36,627,504,520円
 期中一部解約元本額 8,411,501,817円
 また、1口当たり純資産額は、期末12,509円です。

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

eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	17,724,985円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	5,193,352,179円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	5,182,431,336円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	19,509,450円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	139,439,658円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	1,596,138,745円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	66,702,280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)	41,815,849,105円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	14,503,171,426円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	429,836,891円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	499,408,174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)	1,230,227,777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)	179,490,028円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	211,829,180円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	2,603,632,549円
合計	73,688,743,763円

[お知らせ]

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため(分散型に分類)、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2016年3月16日)

○損益の状況 (2016年1月27日~2017年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,987,199,908
受取利息	1,987,449,349
支払利息	△ 249,441
(B) 有価証券売買損益	△ 3,590,820,610
売買益	18,213,147,829
売買損	△21,803,968,439
(C) 保管費用等	△ 12,474,555
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,616,095,257
(E) 前期繰越損益金	11,882,079,061
(F) 追加信託差損益金	10,686,056,557
(G) 解約差損益金	△ 2,461,165,685
(H) 計(D+E+F+G)	18,490,874,676
次期繰越損益金(H)	18,490,874,676

- (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24期》決算日2016年11月21日

[計算期間：2016年5月21日～2016年11月21日]

「マネー・マーケット・マザーファンド」は、11月21日に第24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24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
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
23期(2016年5月20日)	10,183	△0.0	39.0	—	5,562
24期(2016年11月21日)	10,184	0.0	24.4	—	4,420

(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
(期首) 2016年5月20日	10,183	—	39.0	—
5月末	10,184	0.0	37.2	—
6月末	10,185	0.0	29.1	—
7月末	10,184	0.0	27.4	—
8月末	10,183	0.0	17.7	—
9月末	10,184	0.0	17.0	—
10月末	10,184	0.0	21.1	—
(期末) 2016年11月21日	10,184	0.0	24.4	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

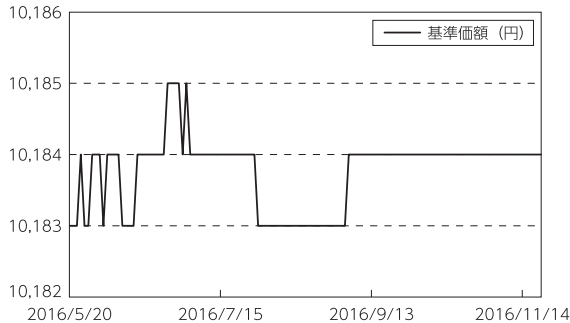
○運用経過

●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0.01%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

- ・当期の短期金融市場を見ると、日銀は2016年9月の金融政策決定会合で金融市場調整方針を、マネタリーベースの年間約80兆円に相当するペースでの増加から、長短金利の操作に変更する決定をしました。コール・レート（無担保・翌日物）は、2016年1月末に日銀が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」で決定した-0.1%金利の適用開始以降であることから、マイナス圏で推移しました。11月21日のコール・レートは-0.051%となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・残存期間の短い国債や社債などを組み入れつつ、コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。その結果、利子等収益が積み上がったことなどから、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

- ・足下の為替は円安方向に推移していますが、1年前と比較すると依然として円高水準であることから、物価を押し上げる効果はまだ期待できない状況です。したがって、今後も金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は低位で推移すると予想しています。

◎今後の運用方針

- ・コール・ローン等短期金融商品や残存期間の短い社債などへの投資を通じて、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

(2016年5月21日～2016年11月21日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2016年5月21日～2016年11月21日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 —	千円 — (183,750)
	特殊債券	—	— (400,000)
	社債券	—	— (500,000)

(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す。

(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。

その他有価証券

		買付額	売付額
国内	コマーシャル・ペーパー	千円 500,099,403	千円 499,999,414

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2016年5月21日～2016年11月21日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2016年11月21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
普通社債券	1,077,900 (1,077,900)	1,079,434 (1,079,434)	24.4 (24.4)	— (—)	— (—)	— (—)	24.4 (24.4)
合 計	1,077,900 (1,077,900)	1,079,434 (1,079,434)	24.4 (24.4)	— (—)	— (—)	— (—)	24.4 (24.4)

(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。

(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	
普通社債券	%	千円	千円		
第300回北陸電力	0.5	177,900	177,907	2016/11/30	
第459回東北電力	0.869	200,000	200,408	2017/2/24	
第282回四国電力	0.35	200,000	200,024	2016/12/22	
第3回コニカミノルタホールディングス	0.61	200,000	200,020	2016/12/2	
第3回興銀リース	0.267	100,000	100,000	2016/12/2	
第113回オリックス	2.19	100,000	100,882	2017/4/18	
第156回オリックス	1.14	100,000	100,193	2017/1/27	
合 計		1,077,900	1,079,434		

国内その他有価証券

区 分	当 期	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 3,099,994	% 70.1

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

○投資信託財産の構成

(2016年11月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	1,079,434	20.9
その他有価証券	3,099,994	60.1
コール・ローン等、その他	978,776	19.0
投資信託財産総額	5,158,204	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年11月21日現在)

項目	当期末
(A) 資産	5,158,204,613
コール・ローン等	976,375,992
公社債(評価額)	1,079,434,116
その他有価証券(評価額)	3,099,994,388
未収利息	2,400,117
(B) 負債	737,658,191
未払解約金	737,656,790
未払利息	1,401
(C) 純資産総額(A-B)	4,420,546,422
元本	4,340,785,954
次期繰越損益金	79,760,468
(D) 受益権総口数	4,340,785,954口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,184円

<注記事項>

- ①期首元本額 5,462,308,836円
 期中追加設定元本額 1,301,104,721円
 期中一部解約元本額 2,422,627,603円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0184円で。

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	260,403,123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)	8,898,354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)	62,265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)	3,078,471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>	309,607,834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)	89,620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	2,016,989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)	26,506,400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)	2,272,200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)	15,211,722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)	393,503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>	6,333,539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
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)	217,654円

○損益の状況 (2016年5月21日~2016年11月21日)

項目	当期
(A) 配当等収益	5,619,165
受取利息	5,706,293
支払利息	△ 87,128
(B) 有価証券売買損益	△ 5,360,511
売買損	△ 5,360,511
(C) 当期損益金(A+B)	258,654
(D) 前期繰越損益金	100,161,728
(E) 追加信託差損益金	23,908,894
(F) 解約差損益金	△ 44,568,808
(G) 計(C+D+E+F)	79,760,468
次期繰越損益金(G)	79,760,468

- (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) (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<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>	25, 034, 575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)	1, 364, 852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)	945, 824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, 491, 685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)	31, 208, 972円
	欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり)	756, 099円
	欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし)	684, 529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
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> (毎月分配型)	12, 561, 714円
PIMCO	ニューワールド円インカムファンド (年2回分配型)	69, 931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)	158, 381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)	40, 278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)	955, 887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)	1, 559, 264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)	442, 974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)	12, 234, 366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
	バリュース・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	1, 936, 118円
	バリュース・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9, 829円
	バリュース・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	9, 829円
	バリュース・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)	9, 834, 580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)	13, 128, 307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)	1, 395, 312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)	163, 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<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> (年2回分配型)	4, 117, 720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> (年2回分配型)	686, 803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> (年2回分配型)	961, 645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> (年2回分配型)	608, 110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> (年2回分配型)	27, 087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> (年2回分配型)	365, 661円
三菱UFJ	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>	977, 814円
三菱UFJ	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>	979, 545円
三菱UFJ	/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)	3, 730, 849円
三菱UFJ	/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)	8, 859, 081円
三菱UFJ	/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UFJ	/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・エマーシング・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・エマーシング・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

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
三菱UFJ/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・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)	1,084,126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)	3,874,252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UFJ/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UFJ 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UFJ 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)	4,824,746円
Navi o インド債券ファンド	885,566円
Navi o マネーボールファンド	2,298,520円
三菱UFJ 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
マネーボールファンド (FOF s 用) (適格機関投資家限定)	9,896,661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 (FOF s 用) (適格機関投資家限定)	6,999,249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)	10,766,608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UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	365,273,064円
三菱UFJ/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UFJ 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UFJ 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)	564,702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)	89,371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)	40,262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)	2,559,476,016円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	42,678,508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 (FOF s 用) (適格機関投資家限定)	133,410,509円
マクロ・トータル・リターン・ファンド	9,820円
合計	4,340,785,954円