

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	2025年2月5日まで（2015年2月20日設定）
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の株式、債券ならびに不動産投資信託証券、商品（コモディティ）、およびヘッジファンド等のオルタナティブ資産に実質的な投資を行います。運用につきましては、安定性と収益性のバランスを重視します。投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産については、為替ヘッジを行う場合があります。
主要運用対象	別に示した投資対象ファンドの投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への直接投資は行いません。 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
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。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）

愛称：ファーストラップ（ちょうわ）

第2期（決算日：2017年2月6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 アドバンスト・バランス（安定成長型）」は、去る2月6日に第2期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

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

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034

(9:00~17:00、土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)

お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			株式組入比率	信用取引比率	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
	(分配)	税込み	期中騰落率							
(設定日)	円	円	%	%	%	%	%	%	%	百万円
2015年2月20日	10,000	—	—	—	—	—	—	—	—	1,018
1期(2016年2月5日)	9,461	0	△5.4	22.6	△6.7	0.2	17.9	0.0	55.1	9,654
2期(2017年2月6日)	9,865	0	4.3	23.6	△7.4	0.2	18.2	—	54.4	8,683

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする外国籍投資信託証券については、前々営業日、その他の投資信託証券は当日の基準価額を基に計算しております。

(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、債券ならびに不動産投資信託証券、商品（コモディティ）、およびヘッジファンド等のオルタナティブ資産を実質的な主要投資対象とし、中長期的な値上がり益の獲得および利子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」、「信用取引比率」、「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) 株式先物比率には不動産投信指数先物を含めて表示しております。

(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	騰 落 率	株 式 組 入 比 率	信 用 取 引 率 比	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
			%	%	%	%	%	%
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%	%
2016年2月5日	9,461	—	22.6	△6.7	0.2	17.9	0.0	55.1
2月末	9,304	△1.7	24.3	△7.6	0.2	17.4	0.0	54.2
3月末	9,587	1.3	23.6	△7.3	0.3	17.9	0.0	54.1
4月末	9,548	0.9	23.4	△7.1	0.2	17.5	—	54.6
5月末	9,600	1.5	23.4	△7.3	0.2	18.0	0.0	55.2
6月末	9,249	△2.2	22.7	△7.1	0.2	18.1	0.0	55.0
7月末	9,481	0.2	23.6	△7.2	0.2	17.7	0.0	54.8
8月末	9,423	△0.4	23.8	△7.3	0.2	18.0	0.0	54.7
9月末	9,378	△0.9	23.4	△7.4	0.2	18.1	0.0	54.5
10月末	9,456	△0.1	24.1	△7.7	0.3	18.1	0.0	54.2
11月末	9,698	2.5	24.2	△7.6	0.2	18.0	0.0	54.5
12月末	9,922	4.9	23.6	△7.6	0.1	18.3	0.0	55.0
2017年1月末	9,885	4.5	23.9	△7.5	0.1	18.1	—	54.8
(期 末)								
2017年2月6日	9,865	4.3	23.6	△7.4	0.2	18.2	—	54.4

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする外国籍投資信託証券については、前々営業日、その他の投資信託証券は当日の基準価額を基に計算しております。

(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」、「信用取引比率」、「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) 株式先物比率には不動産投信指数先物を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

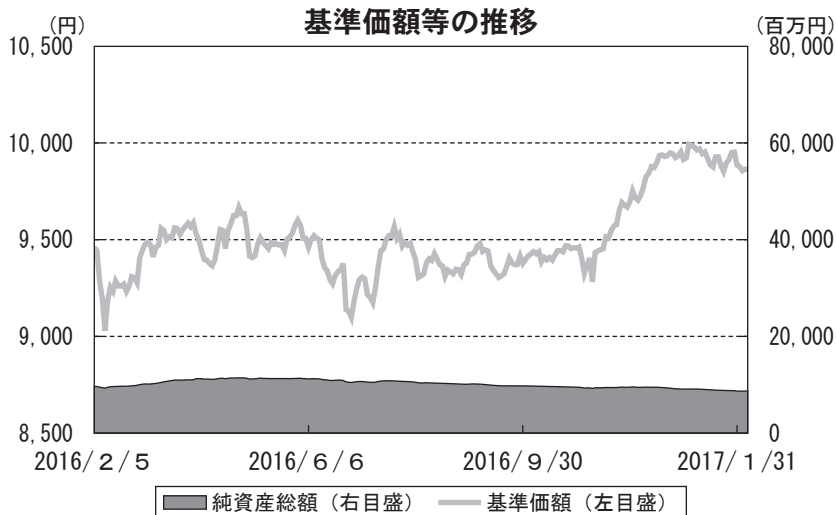
運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第2期：2016/2/6～2017/2/6)

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.3%の上昇となりました。



基準価額の主な変動要因

上昇要因	組み入れを行った投資信託証券のうち、主に国内株式、外国株式などの資産クラスのファンドがプラスに寄与しました。
下落要因	組み入れを行った投資信託証券のうち、外国債券の資産クラスのファンドがマイナスに影響しました。

投資環境について

（第2期：2016/2/6～2017/2/6）

【概況】

当期は国内株式市況、外国株式市況ともに堅調に推移しました。債券市場では、米大統領選に勝利したトランプ氏の打ち出す財政支出拡大策などを受け、先進国の長期金利は上昇しました。国内の長期金利は、金融政策に左右される展開となり、期を通じて見るとほぼ横ばいとなりました。不動産投資信託証券（REIT）市況は、国内、先進国（欧州除く）ともに上昇しました。為替市況は、米ドル、ユーロともに円に対して下落しました。

【株式】

国内株式は、期首から2016年11月頃にかけては、もみ合いの展開となりました。その後期末にかけては、米国株式の上昇や円安・ドル高を受けて上昇基調で推移しました。外国株式は、原油価格の上昇や米大統領選に勝利したトランプ氏の打ち出す財政支出拡大や減税策が好感され、上昇しました。

【債券】

日本の長期金利は、2016年8月にかけて日本銀行の金融緩和策の継続に加え、マイナス金利導入などから低下基調で推移しました。その後、日本銀行の金融政策に対する不透明感などを受けて変動の大きい展開となりましたが、期を通じて見るとほぼ横ばいとなりました。先進国の長期金利は、投資家のリスク回避姿勢の後退や米国経済指標の改善に加えて、トランプ氏の打ち出す財政支出拡大策を受けた米国金利の先高感などを受け上昇しました。

【オルタナティブ】

REIT市況は、日本では日本銀行の金融政策などを受け不安定な動きとなりましたが、期を通じては上昇しました。欧州を除く先進国では、米国の堅調な経済指標などを上げ上昇しました。商品（コモディティ）市況は、投資家のリスク回避姿勢の後退などを背景に原油価格が堅調に推移し、上昇しました。

【為替】

為替市況において、米ドルは期首から2016年9月にかけては、米連邦公開市場委員会（FOMC）での政策金利引き上げに対する慎重な姿勢などから対円で下落しました。その後は、トランプ氏の打ち出す財政支出拡大による米国の金利先高感などから上昇しましたが、期を通じてみると下落しました。ユーロは、英国において欧州連合（EU）離脱が選択されたことや欧州中央銀行（ECB）による追加緩和と期待などを受けて下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

当ファンドにおいては、長期的な市場構造把握と中期投資環境シナリオを融合することにより、安定的な資産配分を策定しました。さらに、1年程度の投資環境シナリオに基づき、より相場動向を踏まえた資産配分を策定しました。また、パフォーマンスの下振れリスク抑制を狙い、先進国の債券・株式にとどまらず、新しい投資対象や運用戦略（オルタナティブ投資含む）を積極的に組み入れ、ポートフォリオの分散を図りました。具体的には、収益向上、リスク抑制のため、インデックスファンドに加え、特徴的なアクティブファンドを選定しました。

このような方針を踏まえ、2016年5月に以下のとおり、ファンドの新規組入および組入比率の変更を行いました。

国内株式においては、リスク抑制、分散効果を高める理由から、「JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド」を組み入れる一方、「好配当日本株マザーファンド」などの比率を減らしました。

国内債券においては、国内金利の魅力低下から「日本債券インデックスマザーファンド」の比率を減らしました。また、ボラティリティ（価格の変動性）抑制を目的に、「AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>（FOFs用）（適格機関投資家限定）」の比率を減らし、「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」、「先進国高格付国債マザーファンド」の比率を増やしました。

外国株式においては、新興国株式のウェイトを引き下げてリスク抑制を図るために、「新興国株式インデックスマザーファンド」、「アセアン真成長株式マザーファンド」の比率を減らし、「外国株式インデックスマザーファンド」の比率を増やしました。また、収益源泉の分散を図るために「AMP グローバル・インフラ株式ファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）」を組み入れる一方、「好配当海外株マザーファンド」の比率を減らしました。

外国債券においては、新興国債券のウェイトを引き下げてリスク抑制を図るために、「新興国債券インデックスマザーファンド」、「アセアン投資適格社債マザーファンド」、「アセアン・ハイイールド社債マザーファンド」の比率を減らし、「外国債券インデックスマザーファンド」の比率を増やしました。

オルタナティブにおいては、リスク抑制、期待リターン改善を目的に「コモディティマザーファンド」の比率を減らし、「東証REIT指数マザーファンド」、「MUAM GR EITマザーファンド」の比率を増やしました。

当期は国内株式市況、外国株式市況ともに堅調に推移しました。債券市場では、米大統領選に勝利したトランプ氏の打ち出す財政支出拡大策などを受け、先進国の長期金利は上昇しました。国内の長期金利は、期を通じて見るとほぼ横ばいとなりました。為替市況は、米ドル、ユーロともに円に対して下落しました。

これらの背景から組み入れを行った投資信託証券のうち、国内株式、外国株式などの資産クラス「外国株式インデックスマザーファンド」、「好配当海外株マザーファンド」、「TOPIXマザーファンド」などのファンドが上昇し、プラスに寄与する一方、外国債券などの資産クラス「外国債券インデックスマザーファンド」などのファンドが下落し、マイナスに影響しました。

◎組入比率

期首より、投資信託証券を高位に組み入れた運用を行いました。なお、当ファンドの各月末での投資信託証券への投資割合は次表をご参照ください。

(ご参考) 投資信託証券別組入比率表

(%)

資産クラス	投資信託証券	組入比率											
		2016年 2月末	3月末	4月末	5月末	6月末	7月末	8月末	9月末	10月末	11月末	12月末	2017年 1月末
国内株	TOPIXマザーファンド	7.98	7.91	7.89	7.88	7.51	7.76	7.82	7.66	7.86	7.83	7.63	7.81
	JPX日経400インデックスマザーファンド	1.87	1.87	1.81	1.85	1.79	1.89	1.85	1.81	1.86	1.92	1.80	1.85
	好配当日本株マザーファンド	7.07	6.94	7.02	5.09	4.82	5.07	5.08	4.93	5.17	5.12	4.93	5.03
	JAPANクオリティ150インデックスマザーファンド	—	—	—	1.64	1.61	1.84	1.85	1.81	1.84	1.88	1.78	1.83
	ヘッジ付外国株式 ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド(※1)	1.84	1.84	1.95	1.96	1.84	1.88	1.79	1.83	1.81	1.85	1.83	1.86
外国株	外国株式インデックスマザーファンド(※1)	9.35	9.51	9.52	11.05	10.59	10.66	10.92	10.72	10.76	10.90	10.81	10.82
	新興国株式インデックスマザーファンド(※1)	1.35	1.46	1.40	0.44	0.38	0.42	0.39	0.37	0.37	0.38	0.35	0.38
	アセアン真成長株式マザーファンド(※1)	1.36	1.42	1.35	0.71	0.74	0.79	0.74	0.75	0.74	0.73	0.74	0.74
	好配当海外株マザーファンド(※1)	6.59	6.62	6.59	5.72	5.29	5.50	5.51	5.48	5.49	5.65	5.49	5.54
	AMP グローバル・インフラ株式ファンド(FOFs用) (適格機関投資家限定)(※2)	—	—	—	0.45	0.94	0.98	0.89	0.93	0.92	0.94	0.93	0.90
国内債券	日本債券インデックスマザーファンド	8.96	8.89	8.95	8.46	8.46	8.38	8.42	8.54	8.51	8.35	8.57	8.52
	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(※1)	4.44	4.45	4.52	6.90	7.31	7.05	7.05	7.16	7.04	6.82	7.13	7.09
	AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(FOFs用) (適格機関投資家限定)(※3)	4.46	4.54	4.50	2.82	2.98	2.83	2.81	2.87	2.81	2.72	2.85	2.83
	先進国高格付国債マザーファンド	8.90	9.09	8.83	9.82	10.10	9.84	9.88	9.99	9.93	9.93	10.10	9.89
外国債券	外国債券インデックスマザーファンド(※1)	5.11	5.09	4.98	6.57	6.64	6.74	6.74	6.65	6.64	6.79	6.74	6.65
	新興国債券インデックスマザーファンド(※1)	1.07	1.12	1.08	0.34	0.12	0.13	0.11	0.11	0.12	0.09	0.10	0.10
	アセアン投資適格社債マザーファンド(※1)	0.53	0.54	0.52	0.35	0.29	0.29	0.26	0.26	0.24	0.26	0.28	0.25
	アセアン・ハイイールド社債マザーファンド(※1)	0.53	0.54	0.52	0.35	0.27	0.28	0.24	0.24	0.26	0.28	0.25	0.25
オルタナティブ	REIT 東証REIT指数マザーファンド	3.03	2.94	2.96	3.00	3.53	3.58	3.52	3.55	3.49	3.51	3.58	3.56
	MUAMGR-REITマザーファンド	2.63	2.54	2.55	3.55	3.64	3.54	3.60	3.48	3.41	3.65	3.54	3.51
	コモディティ コモディティマザーファンド	2.12	2.11	2.33	0.55	0.58	0.55	0.49	0.51	0.54	0.54	0.51	0.51
	ヘッジファンド 日本株マーケットニュートラル・マザーファンド	8.86	8.93	9.01	8.89	9.13	8.76	9.03	9.01	9.00	8.89	8.97	9.12
	ブラックストーン・ダイバーシファイド・マルチストラテジー・ファンドークラスI(JPY)アキュムレーティング	8.97	8.61	9.14	8.84	9.06	9.09	9.01	8.94	8.91	8.73	9.16	9.06

(注) 比率は純資産総額に対する実質組入比率。

(注) 国内株式には、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図る「ヘッジ付外国株式」を含めています。

(注) 国内債券には、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図る「ヘッジ付外国債券」を含めています。

※1 アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)を通じて組入を行います。

※2 AMP グローバル・インフラ株式マザーファンドに投資を行います。

※3 AMP グローバル・インフラ債券マザーファンドに投資を行います。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・当ファンドは、日本を含む世界各国の株式、債券ならびに不動産投資信託証券、商品（コモディティ）、およびヘッジファンド等のオルタナティブ資産を実質的な主要投資対象とし、中長期的な値上がり益の獲得および利子収益の確保をめざしますが、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。
- ・従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

分配金について

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

【分配原資の内訳】

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第2期
	2016年2月6日～2017年2月6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	85

（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

◎今後の運用方針

- ・日本を含む世界各国の株式、債券ならびにREIT、コモディティおよびヘッジファンド等のオルタナティブ資産を実質的な主要投資対象とし、分散投資を行います。
- ・運用につきましては、安定性と収益性のバランスを重視します。
- ・各資産への投資割合、投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年2月6日～2017年2月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	135	1.411	(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 ）	(78)	(0.814)	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 ）	(52)	(0.543)	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 ）	(5)	(0.054)	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	1	0.008	(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 ）	(1)	(0.006)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.002)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.000	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	19	0.202	(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 ）	(0)	(0.004)	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 ）	(18)	(0.194)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	155	1.621	
期中の平均基準価額は、9,544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) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

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

○売買及び取引の状況

(2016年2月6日～2017年2月6日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ブラックストーン・ダイバシファイド・マルチストラテジー・ファンド・クラスI (JPY) アキュムレーション	168	165,000	267	270,549
	アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	1,236,432	1,122,460	1,744,145	1,600,960
	AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり> (FOFs用) (適格機関投資家限定)	44,067	41,970	266,417	269,160
	AMP グローバル・インフラ株式ファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定)	103,733	103,010	29,210	29,850
合計		1,384,400	1,432,440	2,040,040	2,170,519

(注) 金額は受渡代金。

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
好配当日本株マザーファンド		137,575	170,750	331,285	439,130
MUAM G-REITマザーファンド		102,934	149,990	67,269	102,100
東証REIT指数マザーファンド		38,954	106,810	42,917	113,260
先進国高格付国債マザーファンド		268,906	292,690	278,551	306,710
JPX日経400インデックスマザーファンド		35,998	40,670	55,268	66,600
コモディティマザーファンド		52,794	38,700	286,600	223,410
JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド		229,800	202,280	73,116	68,600
TOPIXマザーファンド		140,489	184,760	260,314	371,660
日本債券インデックスマザーファンド		96,863	128,570	211,074	283,000
日本株マーケットニュートラル・マザーファンド		138,860	190,960	202,530	278,100

○株式売買比率

(2016年2月6日～2017年2月6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					
	好配当日本株マザーファンド	MUAM G-REITマザーファンド	JPX日経400インデックスマザーファンド	JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド	TOPIXマザーファンド	日本株マーケットニュートラル・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	2,480,467千円	65,441千円	7,647,210千円	2,481,599千円	296,177,010千円	31,608,189千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,810,810千円	—千円	12,199,359千円	1,238,541千円	247,267,575千円	3,521,921千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.36	—	0.62	2.00	1.19	8.97

(注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年2月6日～2017年2月6日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）>

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	$\frac{D}{C}$ %

<TOPIXマザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %
貸付有価証券(株式)	375,756	375,756	100.0	367,317	367,317	100.0

平均保有割合 0.3%

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

<JPX日経400インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %

平均保有割合 1.5%

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

<好配当日本株マザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %

平均保有割合 30.3%

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

<JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 1,582	百万円 440	% 27.8	百万円 899	百万円 368	% 40.9

平均保有割合 13.9%

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 256,476	百万円 59,019	% 23.0	百万円 280,920	百万円 46,110	% 16.4

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。

(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

<先進国高格付国債マザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 298,670	百万円 -	% -	百万円 384,702	百万円 3,334	% 0.9
為替直物取引	123,368	3,111	2.5	34,989	-	-

平均保有割合 1.3%

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

<東証REIT指数マザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 3,489	百万円 1,314	% 37.7	百万円 3,711	百万円 1,737	% 46.8
不動産投信指数先物取引	5,275	4,823	91.4	5,239	4,493	85.8

平均保有割合 1.8%

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

<MUAM G-REITマザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,243	百万円 674	% 20.8	百万円 2,409	百万円 1,131	% 46.9

平均保有割合 1.8%

※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。

<コモディティマザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 223	百万円 122	% 54.7	百万円 703	百万円 443	% 63.0

平均保有割合 22.6%

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

<日本株マーケットニュートラル・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 3,799	百万円 2,907	百万円 7,886

<JPX日経400インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 88	百万円 87	百万円 243

<好配当日本株マザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 13	百万円 3	百万円 11

＜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 1,134	百万円 2,141

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 99

＜好配当日本株マザーファンド＞

種 類	買 付 額
株式	百万円 4

＜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 4,500

＜東証REIT指数マザーファンド＞

種 類	買 付 額
投資信託証券	百万円 191

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)	844千円
うち利害関係人への支払額 (B)	143千円
(B) / (A)	16.9%

(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2月6日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千口	千円	%
ブラックストーン・ダイバーシファイド・マルチストラテジー・ ファンド-クラスI (JPY) アキュムレーティング	867	768	787,329	9.1
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	3,579,157	3,071,444	2,971,930	34.2
AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり> (FOFs用) (適格機関投資家限定)	467,143	244,793	245,332	2.8
AMP グローバル・インフラ株式ファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定)	—	74,522	79,091	0.9
合 計	4,047,169	3,391,529	4,083,682	47.0

(注) 比率は三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）の純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
好配当日本株マザーファンド	483,112	289,402	430,660
MUAMGREITマザーファンド	163,711	199,376	305,126
東証REIT指数マザーファンド	117,101	113,138	306,425
先進国高格付国債マザーファンド	806,535	796,891	862,554
JPX日経400インデックスマザーファンド	141,413	122,143	160,496
コモディティマザーファンド	283,986	50,179	43,811
JAPANクオリティ150インデックスマザーファンド	—	156,683	158,203
TOPIXマザーファンド	546,762	426,936	667,216
日本債券インデックスマザーファンド	677,434	563,222	737,371
日本株マーケットニュートラル・マザーファンド	619,267	555,596	785,502

○有価証券の貸付及び借入の状況

TOPIXマザーファンドにおいて、2017年2月6日現在における貸付株数の総株数は29,606,300株です。うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUFG証券株式会社に対する貸付は、29,606,300株です。

○投資信託財産の構成

（2017年2月6日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 3,296,353	% 37.4
投資証券	787,329	8.9
好配当日本株マザーファンド	430,660	4.9
MUAM G-R E I Tマザーファンド	305,126	3.5
東証REIT指数マザーファンド	306,425	3.5
先進国高格付国債マザーファンド	862,554	9.8
J P X日経400インデックスマザーファンド	160,496	1.8
コモディティマザーファンド	43,811	0.5
J A P A N クオリティ150インデックスマザーファンド	158,203	1.8
T O P I Xマザーファンド	667,216	7.6
日本債券インデックスマザーファンド	737,371	8.4
日本株マーケットニュートラル・マザーファンド	785,502	8.9
コール・ローン等、その他	263,756	3.0
投資信託財産総額	8,804,802	100.0

(注) MUAM G-R E I Tマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（17,911,675千円）の投資信託財産総額（17,961,795千円）に対する比率は99.7%です。

(注) 先進国高格付国債マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（111,668,718千円）の投資信託財産総額（114,202,039千円）に対する比率は97.8%です。

(注) コモディティマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（291,808千円）の投資信託財産総額（296,918千円）に対する比率は98.3%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=112.37円	1 カナダドル=86.28円	1 ユーロ=121.08円	1 イギリスポンド=140.32円
1 スウェーデンクローネ=12.82円	1 デンマーククローネ=16.28円	1 オーストラリアドル=86.14円	1 ニュージーランドドル=82.20円
1 香港ドル=14.48円	1 シンガポールドル=79.88円	1 イスラエルシェケル=29.96円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年2月6日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,804,802,758
コール・ローン等	248,750,575
投資信託受益証券(評価額)	3,296,353,091
投資証券(評価額)	787,329,639
好配当日本株マザーファンド(評価額)	430,660,345
MUAM G-R E I Tマザーファンド(評価額)	305,126,271
東証REIT指数マザーファンド(評価額)	306,425,001
先進国高格付国債マザーファンド(評価額)	862,554,971
JPX日経400インデックスマザーファンド(評価額)	160,496,681
コモディティマザーファンド(評価額)	43,811,974
JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド(評価額)	158,203,674
T O P I Xマザーファンド(評価額)	667,216,785
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	737,371,042
日本株マーケットニュートラル・マザーファンド(評価額)	785,502,709
未収入金	15,000,000
(B) 負債	121,187,042
未払解約金	53,252,900
未払信託報酬	67,746,255
未払利息	343
その他未払費用	187,544
(C) 純資産総額(A-B)	8,683,615,716
元本	8,802,015,068
次期繰越損益金	△ 118,399,352
(D) 受益権総口数	8,802,015,068口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,865円

<注記事項>

- ①期首元本額 10,204,339,700円
 期中追加設定元本額 3,206,501,941円
 期中一部解約元本額 4,608,826,573円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9865円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は118,399,352円です。

③分配金の計算過程

項 目	2016年2月6日～ 2017年2月6日
費用控除後の配当等収益額	66,252,048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	8,874,552円
分配準備積立金額	－円
当ファンドの分配対象収益額	75,126,600円
1万口当たり収益分配対象額	85円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

- ④「先進国高格付国債マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の12.5以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

○損益の状況（2016年2月6日～2017年2月6日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 62,171
受取利息	3,931
支払利息	△ 66,102
(B) 有価証券売買損益	489,448,644
売買益	572,241,438
売買損	△ 82,792,794
(C) 信託報酬等	△143,259,055
(D) 当期損益金(A+B+C)	346,127,418
(E) 前期繰越損益金	△375,790,490
(F) 追加信託差損益金	△ 88,736,280
(配当等相当額)	(5,558,581)
(売買損益相当額)	(△ 94,294,861)
(G) 計(D+E+F)	△118,399,352
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△118,399,352
追加信託差損益金	△ 88,736,280
(配当等相当額)	(8,874,552)
(売買損益相当額)	(△ 97,610,832)
分配準備積立金	66,252,048
繰越損益金	△ 95,915,120

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

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

【お知らせ】

- ①投資対象とする投資信託証券に「JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド」、「AMP グローバル・インフラ株式ファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）」を追加し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2016年5月3日)
- ②信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める（分散型に分類）ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2016年11月5日)
- ③2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。））の税率が適用されます。

T O P I X マザーファンド

《第15期》決算日2016年3月25日

[計算期間：2015年3月26日～2016年3月25日]

「T O P I X マザーファンド」は、3月25日に第15期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	東証株価指数(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		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	(T O P I X)	期 騰 落 中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
11期(2012年3月26日)	7,888	1.8	851.82	△ 0.6	98.4	1.7	187,797
12期(2013年3月25日)	9,935	26.0	1,047.29	22.9	98.8	1.2	221,229
13期(2014年3月25日)	11,255	13.3	1,163.70	11.1	98.7	1.2	221,564
14期(2015年3月25日)	15,711	39.6	1,592.01	36.8	98.4	1.3	245,366
15期(2016年3月25日)	13,743	△12.5	1,366.05	△14.2	98.2	1.9	220,801

(注) 東証株価指数(T O P I X)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。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) 2015年3月25日	15,711	—	1,592.01	—	98.4	1.3
3月末	15,347	△ 2.3	1,543.11	△ 3.1	98.0	1.5
4月末	15,846	0.9	1,592.79	0.0	97.8	1.4
5月末	16,659	6.0	1,673.65	5.1	96.5	1.7
6月末	16,242	3.4	1,630.40	2.4	99.0	0.8
7月末	16,534	5.2	1,659.52	4.2	99.0	1.0
8月末	15,318	△ 2.5	1,537.05	△ 3.5	98.9	1.2
9月末	14,171	△ 9.8	1,411.16	△11.4	98.2	2.0
10月末	15,649	△ 0.4	1,558.20	△ 2.1	97.7	1.5
11月末	15,873	1.0	1,580.25	△ 0.7	100.1	1.6
12月末	15,560	△ 1.0	1,547.30	△ 2.8	99.2	0.8
2016年1月末	14,404	△ 8.3	1,432.07	△10.0	98.8	1.6
2月末	13,055	△16.9	1,297.85	△18.5	99.1	1.5
(期 末) 2016年3月25日	13,743	△12.5	1,366.05	△14.2	98.2	1.9

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ12.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内株式市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

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

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

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

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.7%程度でした。

- ・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

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

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

◎今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2015年3月26日～2016年3月25日)

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年3月26日～2016年3月25日)

株式

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

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
		75,143	73,705	—	—

○株式売買比率

(2015年3月26日～2016年3月25日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年3月26日～2016年3月25日)

利害関係人との取引状況

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

利害関係人の発行する有価証券等

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

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 294

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	9,191千円
うち利害関係人への支払額 (B)	72千円
(B) / (A)	0.8%

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

○組入資産の明細

(2016年3月25日現在)

国内株式

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
五洋建設	129	133.5	64,747	
大林道路	14	14	10,612	
世紀東急工業	16.9	19	9,462	
福田組	17	19	21,717	
住友林業	85.7	82.8	106,563	
日本基礎技術	14	13.5	5,805	
日成ビルド工業	32	33	13,431	
ヤマダ・エスバイエルホーム	53	61	5,002	
巴コーポレーション	14.4	14.9	5,453	
パナホーム	43	45	38,340	
大和ハウス工業	340.4	355.3	1,151,172	
ライト工業	18.6	23.1	24,301	
積水ハウス	360.7	402.2	780,871	
日特建設	15.6	13.3	5,586	
北陸電気工事	6	4.4	4,298	
ユアテック	18	19	18,183	
西部電気工業	10	10	4,190	
四電工	10	9	3,501	
中電工	16.8	17.4	38,541	
関電工	53	48	38,208	
きんでん	77	72.7	101,053	
東京エネシス	13	14	12,992	
トーエネック	16	17	12,019	
住友電設	9.2	9.5	14,383	
日本電設工業	18.9	19.6	43,139	
協和エクシオ	49.3	47.1	60,240	
新日本空調	9.8	10.1	10,271	
NDS	19	19	5,757	
九電工	21	22	56,804	
三機工業	23.6	26.7	24,350	
日揮	117	121	214,170	
中外炉工業	35	36	7,416	
ヤマト	10	10.9	5,330	
太平電業	16	18	18,018	
高砂熱学工業	32.4	35.9	52,737	
三晃金属工業	11	12	3,828	
朝日工業社	13	14	6,300	
明星工業	20.4	21.8	10,485	
大気社	16.6	14.7	41,439	

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
クラウディア	2.5	2.9	1,557	
T S Iホールディングス	48.5	50.2	38,352	
三陽商会	57	63	16,191	
ナイガイ	40	41	2,009	
オンワードホールディングス	78	75	57,375	
ルック	18	20	3,100	
キムラタン	484	478	2,868	
ゴールドウイン	25	4.8	22,752	
デサント	24.8	25.6	41,472	
キング	5.4	5.6	2,223	
ヤマトインターナショナル	7.1	7	2,737	
パルプ・紙 (0.3%)				
特種東海製紙	63	65	26,065	
王子ホールディングス	446	461	214,826	
日本製紙	52.4	58.1	121,661	
三菱製紙	166	171	14,193	
北越紀州製紙	67.4	69.8	47,813	
中越パルプ工業	41	45	8,775	
巴川製紙所	17	17	3,400	
大王製紙	48	49.8	48,804	
レンゴー	96	99	57,519	
トーモク	34	35	9,695	
ザ・バック	7.7	8	21,352	
化学 (6.1%)				
クラレ	185	177.4	235,587	
旭化成	678	701	510,468	
共和レザー	7.1	7.4	6,578	
コープケミカル	16	—	—	
昭和電工	723	749	84,637	
住友化学	800	828	424,764	
日本化成	20	21	2,499	
住友精化	23	23	14,536	
日産化学工業	71.3	67.6	196,580	
ラサ工業	41	42	4,620	
クレハ	76	85	30,005	
多木化学	7	7	4,697	
テイカ	18	19	10,374	
石原産業	182	202	15,554	
片倉コープアグリ	7	14	3,318	

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

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
タキロン	23	26	14,456
旭有機材工業	38	36	7,776
日立化成	53.7	55.6	112,868
ニチバン	11	11	7,227
リケンテクノス	17.6	18.3	7,411
大倉工業	26	27	8,019
積水化成工業	31	29	9,976
群栄化学工業	29	30	9,000
タイガースポリマー	5.3	5.5	3,360
ミライアル	3.9	4	3,348
ダイキアクシス	1.2	2.1	1,873
ダイキョーニシカワ	2.6	14.5	22,330
日本化薬	71	73	82,563
カーリットホールディングス	8.6	10.4	5,366
日本精化	9	9.3	7,319
扶桑化学工業	—	7.1	11,942
ADEKA	50.1	55.3	88,645
日油	90	86	69,574
新日本理化	17.1	17.9	2,488
ハリマ化成グループ	9.2	9.6	5,299
花王	292.2	302.4	1,846,454
第一工業製薬	24	25	8,625
ニイタカ	—	1.6	2,102
三洋化成工業	34	35	27,895
大日本塗料	62	64	12,864
日本ペイントホールディングス	94	86.8	220,819
関西ペイント	132	127.2	224,889
神東塗料	8	8	1,432
中国塗料	31	32	24,448
日本特殊塗料	8.4	7.9	7,370
藤倉化成	14.8	15.3	7,833
太陽ホールディングス	8.8	8.2	30,709
DIC	435	444	115,440
サカタインクス	22.2	23	27,301
東洋インキSCホールディングス	107	111	50,838
T&K TOKA	3.6	8.1	7,808
富士フイルムホールディングス	248.7	257.3	1,166,598
資生堂	193.3	213.3	543,381
ライオン	125	130	165,620

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

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
天馬	8.4	8.6	16,185
信越ポリマー	21.3	22	13,508
東リ	28	29	8,497
ニフコ	24.2	21.5	116,960
日本バルカー工業	45	44	13,156
ユニ・チャーム	220	227.6	570,024
医薬品 (5.7%)			
協和発酵キリン	130	134.5	239,813
武田薬品工業	407.1	447.8	2,430,210
アステラス製薬	1,237.5	1,259	1,955,856
大日本住友製薬	76.9	79.6	103,559
塩野義製薬	169.7	163.9	896,533
田辺三菱製薬	126.6	131	262,393
わかもと製薬	12	13	3,458
あすか製薬	12.8	14.3	19,691
日本新薬	25	25.8	108,231
ピオフェルミン製薬	1.8	1.8	6,858
中外製薬	108.2	111.9	381,019
科研製薬	37	19.4	133,084
エーザイ	143.3	138.4	962,433
ロート製薬	49.4	55	116,490
小野薬品工業	49.4	51.1	1,190,885
久光製薬	30.7	34.9	174,325
有機合成薬品工業	7	7	1,764
持田製薬	7.8	7.7	62,832
参天製薬	39.9	207	349,623
扶桑薬品工業	37	38	10,602
日本ケミファ	14	16	8,000
ツムラ	34.2	35.4	97,243
日医工	25.4	26.3	69,063
キッセイ薬品工業	20.2	19.9	51,879
生化学工業	20.8	21.5	33,110
栄研化学	9.1	9.4	20,933
日本製薬	4.4	4.5	5,976
鳥居薬品	7.4	7.7	20,227
JCRファーマ	8.4	8.6	20,124
東和薬品	5.5	5.2	24,518
富士製薬工業	3.1	3.1	5,927
沢井製薬	17.2	19.1	135,801

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ゼリア新薬工業	22.2	23	34,132
第一三共	365.4	378.1	957,160
キョーリン製薬ホールディングス	29	30	64,980
大幸薬品	4.8	5.5	7,612
ダイト	4.4	4.7	13,921
大塚ホールディングス	215.6	241.7	1,005,472
大正製薬ホールディングス	26.1	27	243,810
ペプチドリーム	—	13.8	82,524
石油・石炭製品 (0.5%)			
日本コークス工業	97.4	90.7	7,437
昭和シェル石油	97.1	113.1	112,308
コスモ石油	300	—	—
ニチレキ	13	13.7	11,398
東燃ゼネラル石油	164	170	171,360
ユシロ化学工業	6.4	6	8,040
ピーピー・カストロール	4.4	4.6	5,846
富士石油	25.2	26.1	8,117
MORESCO	2.8	3.5	4,718
出光興産	51.5	58.7	115,580
JXホールディングス	1,205.8	1,330.9	595,178
コスモエネルギーホールディングス	—	33.9	42,849
ゴム製品 (1.0%)			
横浜ゴム	121	67.8	131,871
東洋ゴム工業	49.2	50.9	85,664
ブリヂストン	340.5	379.5	1,595,038
住友ゴム工業	84.7	105.2	181,575
藤倉ゴム工業	9.1	9.5	4,227
オカモト	37	35	32,095
フコク	4.5	4.1	3,792
ニッタ	10.7	12.1	34,908
住友理工	20.1	24.3	23,692
三ツ星ベルト	28	27	23,463
パンドー化学	40	41	20,664
ガラス・土石製品 (0.9%)			
日東紡績	80	74	26,936
旭硝子	535	593	357,579
日本板硝子	524	542	43,360
石塚硝子	14	16	3,440
日本山村硝子	43	45	7,830

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本電気硝子	208	232	134,096	
オハラ	4.1	4.2	2,318	
住友大阪セメント	202	223	98,789	
太平洋セメント	678	701	185,064	
デイ・シイ	11.1	10.5	3,811	
日本ヒューム	11.3	10.8	6,404	
日本コンクリート工業	18.6	23.1	6,352	
三谷セキサン	5.4	5.6	9,077	
アジアパイルホールディングス	14.5	13.9	5,838	
東海カーボン	94	97	25,317	
日本カーボン	57	55	13,255	
東洋炭素	6	6.2	8,859	
ノリタケカンパニーリミテド	61	63	16,254	
TOTO	160	82.6	294,882	
日本碍子	137	142	292,946	
日本特殊陶業	93.6	96.9	211,726	
ダントーホールディングス	14	13	2,522	
MARUWA	3.2	4.1	11,389	
品川リフラクトリーズ	27	28	5,768	
黒崎播磨	23	24	6,360	
ヨータイ	6	6	1,812	
イソライト工業	5.4	5.6	1,086	
東京窯業	13	13.8	2,470	
ニッカトー	3.9	4	1,548	
フジミインコーポレーテッド	10.5	9.9	14,701	
エーアンドエーマテリアル	23	23	1,817	
ニチアス	48	57	39,786	
ニチハ	14.4	14.9	26,089	
鉄鋼 (1.2%)				
新日鐵住金	4,592	506.8	1,105,584	
神戸製鋼所	1,878	2,065	214,760	
中山製鋼所	81	126	8,442	
合同製鐵	55	63	12,159	
ジェイ エフ イー ホールディングス	277.1	307.2	475,699	
日新製鋼	46	51.3	68,485	
東京製鐵	54.9	62	41,416	
共英製鋼	11.6	12	21,156	
大和工業	24.7	24.8	61,876	
東京鐵鋼	21	23	8,372	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
大阪製鐵	6.8	7	13,188	
淀川製鋼所	77	16.7	40,664	
東洋鋼板	26	26.9	8,930	
丸一鋼管	33.3	37.6	119,004	
モリ工業	17	18	5,616	
大同特殊鋼	182	188	75,952	
日本高周波鋼業	43	44	3,520	
日本冶金工業	84.9	82.7	11,412	
山陽特殊製鋼	65	67	34,907	
愛知製鋼	64	66	29,238	
日立金属	111	128.7	151,866	
日本金属	28	29	2,958	
大平洋金属	69	78	26,598	
新日本電工	66.2	63.6	11,638	
栗本鐵工所	56	54	8,424	
缸技	15	16	2,688	
日本鑄鉄管	11	12	1,680	
三菱製鋼	71	78	14,508	
日亜鋼業	15	15.5	3,921	
日本精線	8	8	3,800	
シンニッタン	11.2	10.1	6,948	
新家工業	21	22	2,948	
非鉄金属 (0.8%)				
大紀アルミニウム工業所	18	17	4,896	
日本軽金属ホールディングス	263.4	254.4	48,844	
三井金属鉱業	295	286	52,624	
東邦亜鉛	61	59	17,759	
三菱マテリアル	678	701	232,031	
住友金属鉱山	300	310	367,970	
DOWAホールディングス	130	145	99,325	
古河機械金属	169	175	30,625	
エス・サイエンス	52.6	51.5	1,802	
大阪チタニウムテクノロジーズ	10.7	11	17,149	
東邦チタニウム	18.4	19	17,328	
UACJ	124	157	36,738	
古河電気工業	319	353	85,426	
住友電気工業	409.2	449.9	626,485	
フジクラ	151	156	86,736	
昭和電線ホールディングス	119	134	8,710	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
名村造船所	28.9	32.2	27,724	
サノヤスホールディングス	12.6	13.2	3,115	
日本車輛製造	38	44	12,056	
ニチユ三菱フォークリフト	11.9	12.5	5,737	
近畿車輛	16	16	5,312	
日産自動車	1,456.2	1,506.9	1,639,507	
いすゞ自動車	328	311.1	375,964	
トヨタ自動車	1,431.3	1,335.2	8,251,536	
日野自動車	148.1	153.2	192,266	
三菱自動車工業	380.2	426.3	367,044	
エフテック	5.9	5.6	6,070	
レシップホールディングス	3.4	3.5	2,719	
GMB	1.5	1.7	1,368	
ファルテック	1.1	1.9	2,760	
武蔵精密工業	11.1	11.4	26,254	
日産車体	45.6	52.4	59,945	
新明和工業	42	47	37,600	
極東開発工業	19.3	21.4	24,417	
日信工業	19	24	37,032	
トビー工業	85	88	20,856	
ティラド	40	42	8,148	
曙ブレーキ工業	43.8	54.4	14,960	
タチエス	16.4	17	28,594	
NOK	50.2	51.9	100,478	
フタバ産業	31.6	32.7	15,238	
KYB	116	120	38,880	
シロキ工業	23	27	8,694	
大同メタル工業	14.5	15	13,350	
プレス工業	51	57	22,971	
ミクニ	—	10.3	3,924	
カルソニックカンセイ	79	82	67,322	
太平洋工業	21.1	23.8	26,370	
ケーヒン	23.8	24.7	41,471	
河西工業	12.7	13.2	15,985	
アイシン精機	94.9	108	471,960	
富士機工	12	12.5	5,812	
マツダ	309.2	339.9	589,896	
ダイハツ工業	123.8	128.1	207,393	
今仙電機製作所	8.8	9.8	9,770	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
本田技研工業	933.6	966.1	2,988,147	
スズキ	216.9	224.4	675,444	
富士重工業	353.1	339.2	1,377,152	
安永	3.4	3.6	1,918	
ヤマハ発動機	157.8	151.6	273,638	
ショーワ	24.5	27.9	27,676	
TBK	13.3	12.9	5,379	
エクセディ	14.1	14.6	37,157	
豊田合成	33.5	39	86,268	
愛三工業	16.1	18.8	17,164	
盟和産業	8	1.3	1,409	
ヨロズ	9.7	10	24,010	
エフ・シー・シー	15.3	17.5	33,652	
シマノ	44.8	43.3	779,400	
タカタ	18.8	19.4	9,797	
ティ・エス テック	21.9	24.9	65,960	
ジャムコ	—	4.7	13,540	
精密機器 (1.6%)				
テルモ	159	164.6	683,090	
クリエートメディック	3.4	3.5	3,013	
日機装	33.6	38.6	31,150	
島津製作所	124	138	239,016	
JMS	19	20	5,880	
クボテック	2.2	2.3	1,159	
モリテックス	2.4	2.3	657	
長野計器	6.6	6.5	4,251	
ブイ・テクノロジー	2	2.6	13,156	
東京計器	36	34	5,780	
愛知時計電機	14	14	4,326	
オーバル	7.6	10.6	2,692	
東京精密	18.6	20.7	47,547	
マニー	2.9	9.8	18,669	
ニコン	193.7	200.4	361,120	
トプコン	31.3	36	53,928	
オリンパス	154.5	159.9	671,580	
理研計器	9.1	8.7	9,126	
タムロン	8	8.7	16,086	
HOYA	246.9	249.8	1,112,359	
ノーリツ鋼機	9.3	9.7	4,520	

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
大阪瓦斯	1,074	1,111	479,729	
東邦瓦斯	264	271	215,716	
北海道瓦斯	20	26	7,280	
広島ガス	—	18.7	7,236	
西部瓦斯	117	121	31,944	
静岡ガス	29.5	30.5	23,790	
メタウォーター	4.8	6.9	18,623	
陸運業 (4.6%)				
SBSホールディングス	7.7	10.6	7,759	
東武鉄道	554	574	327,180	
相鉄ホールディングス	178	184	127,144	
東京急行電鉄	564	625	593,750	
京浜急行電鉄	284	294	289,884	
小田急電鉄	332	344	424,496	
京王電鉄	290	300	298,800	
京成電鉄	156	161	251,482	
富士急行	28	29	43,036	
新京成電鉄	13	14	6,300	
東日本旅客鉄道	190.1	196.3	1,979,685	
西日本旅客鉄道	99.9	103.3	737,148	
東海旅客鉄道	92.9	96.1	1,964,764	
西武ホールディングス	82.7	85.5	200,326	
鴻池運輸	6.4	15.2	19,684	
西日本鉄道	134	139	106,196	
ハマキョウレックス	3.2	8.2	15,875	
サカイ引越センター	1.8	4.2	14,637	
近鉄グループホールディングス	1,044	1,080	506,520	
阪急阪神ホールディングス	696	720	515,520	
南海電気鉄道	232	241	146,769	
京阪電気鉄道	232	241	194,969	
神戸電鉄	25	26	9,568	
名糖運輸	4.3	—	—	
名古屋鉄道	378	391	207,621	
山陽電気鉄道	38	39	19,188	
日本通運	411	415	225,760	
ヤマトホールディングス	182.4	198.4	459,196	
山九	126	141	73,179	
丸運	5.6	5.8	1,484	
丸全昭和運輸	35	36	14,544	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
センコー	43	48	33,408	
トナミホールディングス	21	22	6,424	
ニッコンホールディングス	33.9	35.1	72,411	
日本石油輸送	12	12	2,880	
福山通運	63	65	36,205	
セイノーホールディングス	80.3	76.1	94,287	
神奈川中央交通	12	13	9,165	
日立物流	21.6	22.4	39,491	
丸和運輸機関	—	2.4	6,216	
C&Fロジホールディングス	—	10.3	8,940	
海運業 (0.2%)				
日本郵船	876	964	212,080	
商船三井	544	523	120,813	
川崎汽船	454	470	104,810	
NSユニテッド海運	45	48	7,872	
明治海運	9.3	9.7	3,579	
飯野海運	53.7	55.5	25,474	
共栄タンカー	9	9	1,341	
第一中央汽船	102	—	—	
乾汽船	—	8.5	7,505	
空運業 (0.7%)				
日本航空	198.6	205.5	866,799	
ANAホールディングス	2,039	1,993	651,312	
バスコ	10	10	4,540	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
トランコム	3	3.1	19,902	
日新	39	44	13,464	
三菱倉庫	68	76	113,240	
三井倉庫ホールディングス	60	62	18,724	
住友倉庫	76	78	44,304	
澁澤倉庫	27	28	8,148	
東陽倉庫	18	18	4,464	
乾汽船	6.9	—	—	
日本トランスシティ	24	25	9,650	
ケイヒン	19	20	3,020	
中央倉庫	6	6.2	6,051	
安田倉庫	8.1	8.3	6,067	
東洋埠頭	32	31	4,774	
宇徳	8.4	8.8	2,992	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東日本銀行	45	51	14,229	
大光銀行	36	38	7,942	
愛媛銀行	60	62	14,694	
トマト銀行	40	41	6,109	
みなと銀行	93	96	15,456	
京葉銀行	84	87	35,931	
関西アーバン銀行	14.3	14.8	16,753	
栃木銀行	51	57	24,909	
北日本銀行	3.2	3.3	9,612	
東和銀行	143	149	14,006	
福島銀行	126	130	11,050	
大東銀行	65	64	11,136	
トモニホールディングス	78.6	81.3	27,154	
フィデアホールディングス	58.9	64.8	11,988	
池田泉州ホールディングス	84.5	112.4	46,084	
証券、商品先物取引業 (1.1%)				
F P G	8.8	31.4	41,416	
S B I ホールディングス	123	127.3	149,195	
日本アジア投資	71	7.2	1,864	
ジャフコ	14	17.7	62,569	
大和証券グループ本社	958	991	697,763	
野村ホールディングス	2,093.3	2,038.7	1,050,949	
岡三証券グループ	87	90	56,700	
丸三証券	32.6	31.5	39,186	
東洋証券	41	41	12,382	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	117.5	121.6	77,459	
光世証券	24	25	3,700	
水戸証券	31.7	32.8	10,824	
いちよし証券	21.5	23.7	24,671	
松井証券	52	53.9	54,007	
だいこう証券ビジネス	4.9	5.1	4,778	
マネックスグループ	120.5	124.7	38,657	
カブドットコム証券	45.4	93.9	35,118	
極東証券	13.7	14.2	20,760	
岩井コスモホールディングス	10.5	10	11,690	
藍澤証券	—	14.9	9,297	
マネースクウェアHD	3.2	3.6	4,078	
マネーパートナーズグループ	10.5	9.8	7,418	
小林洋行	3	3.1	818	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
保険業 (2.4%)				
かんぽ生命保険	—	32.3	85,304	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	227.5	235.4	760,106	
アニコム ホールディングス	4.3	7.2	21,852	
MS&ADインシュアランスグループホール	326.4	316.6	1,002,988	
ソニーフィナンシャルホールディングス	98.1	101.5	156,208	
第一生命保険	656	678.9	948,423	
東京海上ホールディングス	421.4	429.3	1,711,619	
T&Dホールディングス	373.2	386.2	425,206	
その他金融業 (1.4%)				
全国保証	26.6	27.5	103,537	
クレディセゾン	83.6	80.4	158,950	
アクリーティブ	7.1	8.8	3,678	
芙蓉総合リース	10.7	12.1	56,688	
興銀リース	19.2	19.9	40,257	
東京センチュリーリース	24	24.9	100,222	
日本証券金融	48.4	46.7	21,435	
アイフル	171.3	177.4	68,121	
ポケットカード	7.7	10.6	5,639	
リコーリース	8.1	8.3	27,182	
イオンフィナンシャルサービス	67.2	69.5	191,820	
アコム	205.7	212.8	117,678	
ジャックス	56	58	26,100	
オリエントコーポレーション	236.6	458.1	99,865	
日立キャピタル	20.1	25	61,650	
アプラスフィナンシャル	49.1	50.8	5,232	
オリックス	724.8	750.3	1,216,611	
三菱UFJリース	259.7	268.8	133,862	
日本取引所グループ	150.3	311.1	560,291	
イー・ギャランティ	3	3.4	8,598	
アサックス	1.8	1.8	2,534	
NECキャピタルソリューション	4.2	4.3	7,099	
不動産業 (2.8%)				
いちごグループホールディングス	—	87.9	39,906	
日本駐車場開発	111.2	115.8	14,475	
ヒューリック	172.9	220.9	237,688	
東京建物不動産販売	5.3	—	—	
三栄建築設計	4.1	4.2	5,002	
野村不動産ホールディングス	61.5	70.3	148,825	

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
サニックス	12.7	18.1	3,945	
ダイオーズ	2.3	2	2,160	
日本空調サービス	5.3	5.5	6,407	
オリエンタルランド	29.3	121.2	983,659	
ダスキン	30.7	31.7	65,904	
明光ネットワークジャパン	10.7	13	15,847	
ファルコホールディングス	5.1	4.9	6,977	
秀英予備校	2.3	2	900	
田谷	1.8	1.9	1,352	
ラウンドワン	30.7	35	23,625	
リゾートトラスト	40	47	119,521	
ビー・エム・エル	6.4	6.6	29,106	
ワタベウエディング	3.5	3.3	1,369	
りらいあコミュニケーションズ	20.1	18.5	18,592	
リソー教育	16.8	20.8	7,113	
早稲田アカデミー	1.6	1.5	1,380	
ユー・エス・エス	131.2	135.7	245,481	
東京個別指導学院	5.2	5.4	3,607	
サイバーエージェント	19.9	27.4	133,849	
楽天	470.8	524.6	540,600	
テー・オー・ダブリュー	3.3	6.7	4,790	
セントラルスポーツ	3.7	3.8	9,089	
フルキャストホールディングス	11.2	10.3	8,034	
リゾートソリューション	11	11	3,509	
テクノプロ・ホールディングス	11.5	18.2	58,058	
インターワークス	—	1.5	1,161	
リブセンス	6.3	7.6	3,435	
ジャパンマテリアル	4.5	4.7	14,899	
ベクトル	1.8	3.5	10,097	
ウチヤマホールディングス	4.7	5.8	2,975	
サクセスホールディングス	0.9	1	1,382	
キャリアリンク	1.1	1.5	2,436	
I B J	—	6.6	3,042	
アサンテ	2.7	4.1	6,699	
N・フィールド	—	4	5,976	
M&Aキャピタルパートナーズ	0.2	0.9	1,699	
ライドオン・エクスプレス	—	1.8	3,231	
ER Iホールディングス	2.8	2.9	2,433	
アビスト	—	1.2	2,953	

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

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

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	
		百万円	百万円
		4,104	—

○有価証券の貸付及び借入の状況

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

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

○投資信託財産の構成

(2016年3月25日現在)

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年3月25日現在)

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

○損益の状況

(2015年3月26日～2016年3月25日)

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

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

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

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

<注記事項>

①期首元本額	156,174,324,083円		
期中追加設定元本額	90,299,508,544円		
期中一部解約元本額	85,804,501,617円		
また、1口当たり純資産額は、期末1.3743円です。			
②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）			
ファンド・マネジャー（国内株式）	2,419,679,844円	インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	22,906,682円
eMAXIS TOPIXインデックス	21,330,711,385円	インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	76,085,335円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,592,208,146円	インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	142,479,268円
eMAXIS バランス（波乗り型）	111,177,712円	インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	120,583,422円
コアバランス	912,057円	三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	3,150,098,815円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	19,945,917,827円	三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	834,278,300円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	14,790,783,904円	三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	107,865,555円
三菱UFJ バランスファンドVA20型（適格機関投資家限定）	527,242,271円	三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	896,042,538円
三菱UFJ バランスファンドVA40型（適格機関投資家限定）	4,309,348,804円	三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	104,323,312円
MUAM 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	15,138,673,776円	三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	802,533,806円
三菱UFJ バランスファンドVA50型（適格機関投資家限定）	6,747,383,047円	三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	2,128,408,178円
三菱UFJ バランスファンドVA75型（適格機関投資家限定）	2,669,566,608円	三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）	566,144,963円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	636,641,903円	三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）	2,248,685,858円
三菱UFJ バランスファンドVA45型（適格機関投資家限定）	315,038,965円	三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）	1,775,755,051円
三菱UFJ バランスファンドVA30型（適格機関投資家限定）	176,444,031円	三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）	1,347,664,902円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	595,935,508円	三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	44,719,222,766円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	1,406,064,878円	三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	636,768,073円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	26,070,308円	三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	107,973,296円
MJAMトピックスリソースコントロール(5%)インデックスファンド(FOF)用 適格機関投資家限定	1,399,846円	三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	94,918,456円
MJAMトピックスリソースコントロール(10%)インデックスファンド(FOF)用 適格機関投資家限定	143,580,107円	三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	170,809円
MUAMインデックスファンドTOPIXi（適格機関投資家限定）	8,726,654円	三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	255,117円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	7,499,823,663円	三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	298,365円
三菱UFJ TOPIX・ライト	373,640,163円	eMAXIS バランス（4資産均等型）	18,896,736円
		合計	160,669,331,010円

【お知らせ】

- ①2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年7月1日)
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資制限について、買付基準の記載部分の「取得時において」の削除を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年12月2日)
- ③信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため（分散型に分類）、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行うための、所要の約款変更を行いました。
(2016年3月2日)

J P X日経400インデックスマザーファンド

《第3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]

「J P X日経400インデックスマザーファンド」は、1月26日に第3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3期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定株式を含みます。）を主要投資対象とし、J P X日経インデックス400に連動する投資成果をめざして運用を行います。株式の組入比率は原則として高位を保ちます。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株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所上場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は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		J P X日経インデックス400		株組入比率	株先物比率	純資産総額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
(設定日)	円	%		%	%	%	百万円
2014年4月1日	10,000	—	10,901	—	—	—	999
1期(2015年1月26日)	11,815	18.2	12,733	16.8	96.2	3.8	4,866
2期(2016年1月26日)	11,593	△ 1.9	12,274	△ 3.6	97.6	2.4	12,535
3期(2017年1月26日)	13,375	15.4	13,860	12.9	97.2	2.8	12,083

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) J P X日経インデックス400とは、東京証券取引所の第一部、第二部、マザーズ、JASDAQを主たる市場とする普通株式等の中から時価総額、売買代金、ROE等を基に原則400銘柄を選定し算出される株価指数です。「J P X日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループおよび株式会社東京証券取引所（以下、総称して「J P Xグループ」といいます。）と株式会社日本経済新聞社（以下、「日本経済新聞社」といいます。）によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、J P Xグループと日本経済新聞社は、「J P X日経インデックス400」自体および「J P X日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。「J P X日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべてJ P Xグループと日本経済新聞社に帰属しています。ファンドは、委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、J P Xグループと日本経済新聞社は、その運用およびファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。J P Xグループと日本経済新聞社は、「J P X日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。J P Xグループと日本経済新聞社は、「J P X日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「J P X日経インデックス400」の内容を変える権利および公表を停止する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。

(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		J P X日経インデックス400		株 組 入 比 率 %	株 先 物 比 率 %
	騰 落	率	騰 落	率		
(期 首) 2016年1月26日	円 11,593	% —	12,274	% —	97.6	2.4
1月末	12,204	5.3	12,917	5.2	98.0	2.0
2月末	11,104	△ 4.2	11,756	△ 4.2	98.5	1.5
3月末	11,593	0.0	12,162	△ 0.9	98.4	2.4
4月末	11,550	△ 0.4	12,125	△ 1.2	97.7	2.3
5月末	11,871	2.4	12,453	1.5	98.0	2.0
6月末	10,740	△ 7.4	11,250	△ 8.3	98.6	1.4
7月末	11,343	△ 2.2	11,880	△ 3.2	99.3	0.7
8月末	11,432	△ 1.4	11,968	△ 2.5	98.9	1.1
9月末	11,412	△ 1.6	11,846	△ 3.5	97.8	2.2
10月末	12,031	3.8	12,487	1.7	98.0	2.0
11月末	12,701	9.6	13,182	7.4	98.5	1.5
12月末	13,136	13.3	13,615	10.9	99.0	0.9
(期 末) 2017年1月26日	13,375	15.4	13,860	12.9	97.2	2.8

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

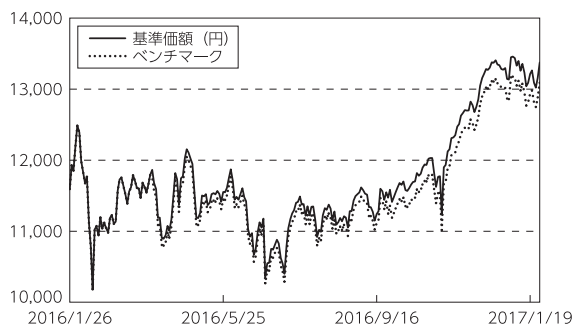
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ15.4%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(12.9%)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J P X日経インデックス400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12.9%の上昇となったため、ベンチマークとの乖離は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
ベンチマークとの乖離	0.1%程度	△0.0%程度	2.3%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、2.0%程度となりました。
- (注) 先物の使用は、「利便性に優れ、売買コストが低い」利点がある反面、必ずしも指数の値動きと一致しないことから、ベンチマークからの乖離を生む可能性があります。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.3%程度でした。配当金等の受取りにより、プラス乖離となりました。

プラス要因	配当・利子収入等	計 2.4%程度
マイナス要因	売買コスト等	計 △0.1%程度

○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1月27日～2017年1月26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 2 (0) (2)	% 0.017 (0.001) (0.017)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) 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	2	0.017	
期中の平均基準価額は、11,759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)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 2,463 (△ 537)	千円 2,981,757 (-)	千株 3,470	千円 5,051,504

(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 7,821	百万円 7,792	百万円 27	百万円 27

○株式売買比率

(2016年1月27日～2017年1月26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	8,033,262千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	12,317,865千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.65

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年1月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 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
株式	百万円 2,981	百万円 433	% 14.5	百万円 5,051	百万円 528	% 10.5

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 93	百万円 87	百万円 240

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	2,158千円
うち利害関係人への支払額 (B)	34千円
(B) / (A)	1.6%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは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、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1月26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 (0.0%)				
日本水産	—	10.2	5,650	
鉱業 (0.4%)				
国際石油開発帝石	48.5	41.5	45,110	
建設業 (3.0%)				
安藤・間	6.1	5.7	4,599	
東急建設	—	2.8	2,536	
コムシスホールディングス	4	3.1	6,581	
ミサワホーム	1.1	—	—	
大成建設	48	40	32,680	
大林組	27.6	23.6	25,488	
清水建設	28	24	25,464	
長谷工コーポレーション	10.7	9.2	11,904	
鹿島建設	43	35	27,685	
三井住友建設	35.3	30.2	3,714	
熊谷組	—	12	3,876	
大東建託	3.4	2.9	46,429	
N I P P O	2	2	4,306	
前田道路	—	2	3,904	
住友林業	6.3	5.4	8,337	
大和ハウス工業	27.2	23.3	72,369	
積水ハウス	30.8	24.8	46,661	
協和エクシオ	3.6	3.1	5,226	
九電工	—	1.5	4,612	
日揮	9	7.3	14,767	
千代田化工建設	7	—	—	
食料品 (4.0%)				
江崎グリコ	—	2	10,280	
カルビー	3.4	3.2	11,600	
ヤクルト本社	4.9	4.2	22,386	
明治ホールディングス	5.5	4.7	41,407	
日本ハム	7	5	15,375	
アサヒグループホールディングス	17.3	14.8	57,853	
キリンホールディングス	37.3	33.9	63,240	

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
伊藤園	2.7	2.3	8,728	
キッコーマン	7	6	21,030	
味の素	20	16.2	36,028	
キュービー	4.7	4	11,596	
ニチレイ	10	3.9	8,981	
東洋水産	4.5	3.9	15,678	
日清食品ホールディングス	3.9	3.1	18,507	
日本たばこ産業	53.5	33.2	122,209	
繊維製品 (0.4%)				
東レ	62	53	52,152	
パルプ・紙 (0.2%)				
王子ホールディングス	35	29	14,819	
大王製紙	3.8	2.9	3,775	
化学 (7.3%)				
クラレ	13.6	12.4	22,555	
旭化成	54	46	49,979	
住友化学	63	54	31,428	
日産化学工業	5.2	4	16,360	
東ソー	23	21	18,459	
デンカ	18	15	8,490	
信越化学工業	15.4	13.2	133,320	
エア・ウォーター	7	6.1	13,145	
大陽日酸	6.6	5.7	7,997	
日本パーカライズニング	4.4	3.8	5,358	
三菱瓦斯化学	—	6.9	15,421	
J S R	8.1	7.4	15,332	
三菱ケミカルホールディングス	57.6	49.3	39,607	
日本合成化学工業	2	—	—	
ダイセル	12.1	9.9	12,513	
積水化学工業	19.9	16.7	33,015	
日本ゼオン	7	6	7,584	
アイカ工業	2.6	2.4	7,440	
宇都興産	46	37	10,286	
日立化成	4.3	4.1	13,509	

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本化薬	6	5	7,455
日油	7	6	7,290
花王	23.1	18.7	103,972
日本ペイントホールディングス	6.6	5.7	19,066
関西ペイント	9.7	7.7	17,217
D I C	34	2.9	10,454
富士フィルムホールディングス	19.7	14.6	64,021
資生堂	16.3	14	43,764
コーセー	1.4	1.2	11,748
シーズ・ホールディングス	1.2	1	3,225
小林製薬	1.3	2	10,080
日東電工	6.6	5.3	49,237
ニフコ	1.6	1.3	7,540
ユニ・チャーム	17.4	14.9	38,509
医薬品 (5.7%)			
協和発酵キリン	10.3	8.8	13,587
武田薬品工業	34.3	27.6	131,872
アステラス製薬	96.4	75.2	115,657
塩野義製薬	12.5	10	55,310
田辺三菱製薬	10	8.6	19,444
中外製薬	8.6	7.3	24,637
科研製薬	1.5	1.4	8,134
エーザイ	10.6	9.1	58,331
ロート製薬	4.2	—	—
小野薬品工業	3.9	16.7	38,819
久光製薬	2.7	2.1	12,537
持田製薬	0.6	—	—
参天製薬	15.8	13.6	18,917
ツムラ	2.7	2.5	8,150
沢井製薬	1.5	1.2	7,164
第一三共	28.9	21.7	54,336
キョーリン製薬ホールディングス	2.3	1.8	4,534
大塚ホールディングス	18.5	15.8	83,834
大正製薬ホールディングス	2.1	1.6	15,328
石油・石炭製品 (-%)			
昭和シェル石油	8.7	—	—
ゴム製品 (1.1%)			
横浜ゴム	5.2	4.4	8,923
東洋ゴム工業	3.9	3.9	5,382

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ブリヂストン	29	24.8	101,456
住友ゴム工業	8.1	6.9	12,330
ガラス・土石製品 (1.0%)			
旭硝子	45	36	30,708
住友大阪セメント	—	14	6,468
太平洋セメント	54	44	17,864
T O T O	6.3	5.4	24,948
日本碍子	11	9.3	21,269
日本特殊陶業	7.4	6.3	15,920
鉄鋼 (1.4%)			
新日鐵住金	38.8	33.2	93,076
神戸製鋼所	158	12.7	14,465
ジェイ エフ イー ホールディングス	23.5	20.1	40,712
日立金属	9.8	7.5	12,277
非鉄金属 (0.9%)			
三井金属鉱業	22	—	—
三菱マテリアル	54	4.6	18,492
住友金属鉱山	24	19	29,573
DOWAホールディングス	11	8	7,872
住友電気工業	34.4	27.7	46,175
アサヒホールディングス	1.3	—	—
金属製品 (0.2%)			
三和ホールディングス	8.7	7.3	8,190
三協立山	1.1	1	1,739
リンナイ	1.6	1.3	12,441
日本発條	8.1	6.9	7,776
機械 (5.4%)			
オーエスジー	3.9	3.4	8,143
DMG森精機	—	4.4	6,890
ディスコ	1.1	0.9	13,104
ニューフレアテクノロジー	0.2	0.2	1,542
ナブテスコ	4.6	3.8	11,331
SMC	2.6	2.2	66,572
小松製作所	42.2	33.9	96,208
住友重機械工業	25	21	16,968
日立建機	3.8	3.3	9,051
クボタ	41.3	35.3	64,193
荏原製作所	19	3.2	11,424
ダイキン工業	12	9.6	109,920

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
椿本チエイン	5	4	3,740
ダイフク	—	3.5	8,830
タダノ	4	3.7	5,527
平和	2.5	2.2	6,080
ユニバーサルエンターテインメント	0.8	—	—
竹内製作所	—	1.3	3,220
セガサミーホールディングス	8.8	—	—
T P R	1	0.8	2,688
ホシザキ	2.4	2.1	20,223
日本精工	16.9	14.4	20,289
ジェイテクト	8.8	7.5	14,385
不二越	8	7	3,892
THK	5.5	5	14,195
イーグル工業	1	0.8	1,257
マキタ	5.4	4.6	36,524
三菱重工業	146	118	62,599
I H I	63	54	16,902
電気機器 (13.5%)			
コニカミノルタ	20.5	16.5	19,882
ブラザー工業	10.6	9.1	19,446
ミネベア	13	11.3	12,972
日立製作所	210	169	114,041
三菱電機	88	75	131,812
富士電機	25	21	14,049
安川電機	10.2	8.1	16,742
日本電産	9.9	9.1	96,824
オムロン	9.4	7.5	36,562
日本電気	113	97	30,749
富士通	79	68	47,450
沖電気工業	36	3	4,926
ルネサスエレクトロニクス	—	3.6	3,697
セイコーエプソン	12.2	10.5	25,179
ワコム	6.5	—	—
エレコム	—	0.6	1,168
パナソニック	93.9	80.3	96,922
アンリツ	4.9	—	—
富士通ゼネラル	3	2	4,610
日立国際電気	2	1.8	4,723
T D K	5	4	32,800

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アルプス電気	7	6.5	19,597
ヒロセ電機	1.3	1.1	16,544
日本航空電子工業	2	2	2,954
横河電機	8.2	7.6	14,310
日本光電工業	3.4	2.9	7,574
堀場製作所	1.5	1.4	8,344
キーエンス	1.9	3.2	140,160
シスメックス	6.4	5.5	36,080
スタンレー電気	5.9	5	15,275
カシオ計算機	8.2	5.7	9,023
ファナック	8.4	7.1	160,815
エンプラス	0.4	0.3	1,033
浜松ホトニクス	6.4	5.5	17,930
京セラ	13.5	11.5	68,321
村田製作所	8.6	7.4	114,515
小糸製作所	4.9	4.2	25,872
ミツバ	1.4	1.3	2,618
S C R E E Nホールディングス	—	1.4	10,164
キャノン	44.2	37.8	127,915
リコー	26.6	21.1	21,796
東京エレクトロン	7.4	4.7	56,329
輸送用機器 (8.6%)			
トヨタ紡織	2.9	—	—
ユニプレス	1.7	—	—
豊田自動織機	7.5	6.4	35,648
デンソー	20.3	17.3	86,378
東海理化電機製作所	2.4	—	—
三井造船	32	—	—
川崎重工業	64	55	20,350
名村造船所	2.5	2.1	1,598
日産自動車	115.3	84.1	96,378
いすゞ自動車	23.8	20.4	31,926
トヨタ自動車	24	28.1	190,068
日野自動車	11.7	10	11,850
三菱自動車工業	32.6	—	—
日信工業	—	1.6	3,001
N O K	4	3.4	8,037
カルソニックカンセイ	6	5	8,985
アイシン精機	8.3	6.4	33,920

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
マツダ	26	22.3	38,556
ダイハツ工業	9.8	—	—
本田技研工業	55.2	56.5	197,863
スズキ	17.2	13.9	61,785
富士重工業	26	21.8	103,702
ヤマハ発動機	11.6	9.9	23,958
エクセディ	1.1	—	—
豊田合成	3	2.3	6,398
日本精機	2	—	—
シマノ	3.3	2.8	50,428
テイ・エス テック	1.9	1.6	4,707
精密機器 (1.8%)			
テルモ	12.6	10.8	45,414
島津製作所	—	9	17,343
ニコン	15.3	12.2	22,789
トプコン	2.8	3.5	6,086
オリンパス	12.2	11.2	44,464
HOYA	19.1	14.5	69,875
朝日インテック	—	1.7	7,947
セイコーホールディングス	5	5	2,090
その他製品 (0.6%)			
バンダイナムコホールディングス	8.5	7.8	24,882
パイロットコーポレーション	1.4	1.2	5,628
アシックス	7.7	7	15,631
ヤマハ	6	4.7	16,732
ビジョン	4.7	4.2	12,915
電気・ガス業 (1.4%)			
中部電力	—	23.2	36,006
東北電力	—	17.6	24,710
電源開発	7	5.6	15,120
東京瓦斯	92	75	39,465
大阪瓦斯	85	68	29,600
東邦瓦斯	—	18	16,182
陸運業 (5.1%)			
東武鉄道	44	38	22,002
相鉄ホールディングス	19	15	8,610
東京急行電鉄	48	38	32,376
小田急電鉄	26	11.3	25,786
京王電鉄	23	20	18,920

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
京成電鉄	12	5.3	14,469
東日本旅客鉄道	15	13.6	141,848
西日本旅客鉄道	7.9	6.8	49,395
東海旅客鉄道	7.4	5.8	109,475
西日本鉄道	14	11	5,687
近鉄グループホールディングス	83	71	31,240
阪急阪神ホールディングス	55	8.9	34,665
南海電気鉄道	25	20	11,420
京阪ホールディングス	25	21	15,813
名古屋鉄道	40	34	19,142
日本通運	32	27	16,929
ヤマトホールディングス	15.2	12.6	30,044
山九	11	9	6,309
海運業 (0.1%)			
日本郵船	74	59	14,396
空運業 (0.8%)			
日本航空	—	12.7	46,405
ANAホールディングス	153	130	42,783
倉庫・運輸関連業 (—%)			
近鉄エクスプレス	1.5	—	—
情報・通信業 (6.9%)			
グリー	4.9	4.2	2,587
ネクソン	7.7	7.6	13,315
コロブラ	—	1.9	1,873
ティーガイア	0.8	0.7	1,291
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	18.9	14.5	3,683
野村総合研究所	5.7	5.1	18,487
フジ・メディア・ホールディングス	8.4	—	—
オービック	2.8	2.4	12,552
ヤフー	58.1	49.7	23,110
トレンドマイクロ	3.9	3.7	16,243
日本オラクル	1.3	1.1	6,754
伊藤忠テクノソリューションズ	1.8	1.6	4,848
大塚商会	2.2	1.9	10,697
USEN	3.7	3.2	1,232
エイベックス・グループ・ホールディングス	1.5	—	—
日本テレビホールディングス	7.4	6.3	13,160
日本電信電話	48.7	31.4	156,246
KDDI	74	46.7	140,193

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
光通信	1	0.8		8,312
N T Tドコモ	62.5	51.8		141,932
GMOインターネット	3	2.5		4,102
東宝	5.8	4.5		14,625
エヌ・ティ・ティ・データ	5	4.3		24,553
S C S K	1.9	1.9		7,970
ソフトバンクグループ	32.5	19.9		178,224
卸売業 (4.8%)				
双日	51.1	41		12,259
アルフレッサ ホールディングス	10.2	8.2		15,653
シブヘルスケアホールディングス	1.6	1.3		3,835
第一興商	1.9	1.5		6,810
メディカルホールディングス	8.1	6.9		12,751
伊藤忠商事	63.6	50.8		80,492
丸紅	79.8	68.3		47,741
豊田通商	9	7.7		24,370
兼松	17	15		2,985
三井物産	73.3	62.7		106,558
日立ハイテクノロジーズ	2.8	2.4		11,424
住友商事	51	43.7		63,845
三菱商事	60.8	52		136,188
阪和興業	—	7		5,509
岩谷産業	10	8		5,088
東邦ホールディングス	2.6	2.2		5,359
サンリオ	2.5	2.1		4,760
日鉄住金物産	7	0.6		2,805
ミスミグループ本社	9.1	7.8		15,919
小売業 (4.3%)				
ローソン	3.1	2.4		19,416
エービーシー・マート	1	1.3		8,567
ゲオホールディングス	1.5	1.2		1,552
セリア	0.9	0.8		6,184
M o n o t a R O	2.9	2.5		6,285
J. フロント リテイリング	10.3	8.8		14,819
マツモトキヨシホールディングス	1.7	1.3		7,306
スタートトゥデイ	2.5	6.3		13,456
三越伊勢丹ホールディングス	16.1	—		—
ウエルシアホールディングス	0.9	0.9		5,553
クリエイトSDホールディングス	—	1		2,479

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
コスモス薬品	0.4	0.3		6,279
セブン&アイ・ホールディングス	33.9	29		131,457
ツルハホールディングス	1.7	1.6		17,296
クスリのアオキホールディングス	—	0.6		2,820
ノジマ	—	1.1		1,369
良品計画	0.9	0.9		19,386
ドンキホーテホールディングス	5.2	4.5		18,877
V Tホールディングス	3.7	3.1		1,742
ユナイテッドアローズ	1.2	0.9		2,880
スギホールディングス	1.5	1.5		7,905
ユニー・ファミリーマートホールディングス	2.5	2.1		15,120
日本瓦斯	1.2	1.3		4,316
A O K Iホールディングス	1.9	—		—
しまむら	0.9	0.8		11,952
高島屋	12	12		11,844
イオン	33.4	28.5		46,982
イズミ	1.6	1.4		6,692
ヤオコー	0.9	0.8		3,644
ケーズホールディングス	1.7	3.2		6,595
アインホールディングス	1	0.8		6,576
ニトリホールディングス	3.5	3		38,130
パローホールディングス	1.7	1.5		4,413
ファーストリテイリング	1.6	1.2		43,824
サンドラッグ	1.7	1.3		10,127
銀行業 (8.4%)				
東京T Yフィナンシャルグループ	—	1		4,050
九州フィナンシャルグループ	—	15.2		12,144
コンコルディア・フィナンシャルグループ	—	45.4		27,571
新生銀行	70	66		13,332
あおぞら銀行	51	44		18,436
三菱UF Jフィナンシャル・グループ	248.6	300.9		223,267
りそなホールディングス	94.9	81.1		49,884
三井住友トラスト・ホールディングス	169	14.5		61,248
三井住友フィナンシャルグループ	42.4	49.6		224,142
西日本シティ銀行	26	—		—
千葉銀行	31	27		20,250
横浜銀行	54	—		—
常陽銀行	29	—		—
群馬銀行	18	15.4		9,702

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
ふくおかフィナンシャルグループ	35	28	14,308	
静岡銀行	24	19	19,057	
十六銀行	14	—	—	
スルガ銀行	8.6	7.1	18,389	
八十二銀行	20	17.8	12,086	
ほくほくフィナンシャルグループ	55	4.6	9,144	
広島銀行	24	20	10,640	
中国銀行	7.7	6.6	11,193	
伊予銀行	11.6	—	—	
セブン銀行	30.4	26	8,346	
みずほフィナンシャルグループ	833.2	937.6	199,615	
山口フィナンシャルグループ	10	9	11,241	
北洋銀行	12.2	11.3	5,243	
京葉銀行	9	—	—	
証券、商品先物取引業 (1.6%)				
F P G	—	2.5	2,622	
S B I ホールディングス	9.7	7.8	12,199	
ジャフコ	1.4	1.2	4,680	
大和証券グループ本社	76	65	48,132	
野村ホールディングス	156	141.8	103,556	
岡三証券グループ	7	6	4,506	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	9.3	8	5,160	
松井証券	4.1	4	4,024	
カブドットコム証券	7.2	5.3	2,114	
保険業 (3.6%)				
S O M P Oホールディングス	18	14.5	60,566	
MS&ADインシュアランスグループホール	24.2	20.7	79,715	
ソニーフィナンシャルホールディングス	7.8	6.6	12,850	
第一生命ホールディングス	52	41.8	87,382	
東京海上ホールディングス	32.9	28.1	134,992	
T & Dホールディングス	29.6	25.3	43,136	
その他金融業 (1.4%)				
全国保証	—	2	7,810	
クレディセゾン	6.2	—	—	
芙蓉総合リース	0.9	0.8	4,448	
興銀リース	1.5	1.3	3,287	
東京センチュリー	1.9	1.4	5,432	
イオンフィナンシャルサービス	5.3	4.4	8,945	
アコム	16.3	—	—	

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	—	15	3,090	
日立キャピタル	1.9	1.6	4,700	
オリックス	57.4	49.1	85,925	
三菱UFJリース	20.6	17.6	10,736	
日本取引所グループ	23.8	21.6	34,128	
不動産業 (3.1%)				
いちご	—	6.6	2,534	
ヒューリック	16.9	14.5	14,703	
野村不動産ホールディングス	5.4	4.6	9,066	
プレサンスコーポレーション	0.3	1.1	1,498	
東急不動産ホールディングス	19.6	16.8	11,356	
飯田グループホールディングス	7.5	5.8	12,574	
パーク24	4.1	3.5	10,780	
三井不動産	43	37	98,420	
三菱地所	60	52	113,958	
東京建物	8.9	8	12,104	
住友不動産	19	17	53,567	
大京	15	13	3,016	
レオパレス21	9.6	8.8	5,755	
スターツコーポレーション	1.2	0.9	1,791	
住友不動産販売	0.6	0.6	1,567	
タカラレーベン	3.6	3	1,959	
イオンモール	5.2	4.5	7,461	
エス・ティ・ティ都市開発	5	4.3	4,308	
サービス業 (3.0%)				
ミクシィ	1.7	2	9,850	
日本M&Aセンター	1.3	2.1	7,339	
テンブホールディングス	6	5.7	11,160	
クックパッド	1.9	1.6	1,616	
総合警備保障	2.9	2.7	12,015	
カカコム	6.2	5.2	10,613	
ディップ	—	0.9	2,069	
エムスリー	7.4	6.4	18,937	
ディー・エヌ・エー	3.8	3.3	8,725	
博報堂DYホールディングス	11.9	10.2	14,443	
ぐるなび	—	1.1	2,736	
電通	9.6	8.2	44,198	
みらかホールディングス	2.2	—	—	
オリエンタルランド	9.3	7.9	50,157	

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
リゾートトラスト	3.6	2.8	5,793	
ユー・エス・エス	10.4	8.9	17,817	
サイバーエージェント	2.1	3.9	11,895	
楽天	40.1	37.5	43,350	
リログループ	0.4	0.4	6,392	
エイチ・アイ・エス	1.4	1.2	3,786	
カナモト	1.2	1	3,020	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
セコム	8.9	7.6	62,692	
ベネッセホールディングス	2.9	—	—	
イオンディライト	0.8	0.8	2,604	
合 計	株 数・金 額	8,709	7,165	11,746,436
	銘柄数<比率>	400	400	<97.2%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	J P X日経400	百万円 338	百万円 —

○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
株式	千円 11,746,436	% 96.9
コール・ローン等、その他	373,774	3.1
投資信託財産総額	12,120,210	100.0

○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	12,120,090,885
コール・ローン等	333,818,999
株式(評価額)	11,746,436,280
未収入金	3,166,756
未収配当金	16,788,850
差入委託証拠金	19,880,000
(B) 負債	36,109,873
未払金	630,400
未払解約金	35,479,000
未払利息	473
(C) 純資産総額(A-B)	12,083,981,012
元本	9,034,957,986
次期繰越損益金	3,049,023,026
(D) 受益権総口数	9,034,957,986口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,375円

<注記事項>

- ①期首元本額 10,813,041,744円
 期中追加設定元本額 3,704,610,160円
 期中一部解約元本額 5,482,693,918円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3375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)

国際 J P X 日経インデックス 4 0 0 オープン (適格機関投資家専用)	83,742,130円
e M A X I S J P X 日経 4 0 0 インデックス	7,625,167,275円
J P X 日経 4 0 0 インデックスファンド (ラップ向け)	1,186,188,046円
三菱 U F J アドバンスト・バランス (安定型)	17,716,942円
三菱 U F J アドバンスト・バランス (安定成長型)	122,143,593円
合計	9,034,957,986円

【お 知 ら せ】

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

(2016年7月1日)

○損益の状況 (2016年1月27日～2017年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	278,447,627
受取配当金	278,307,988
受取利息	14,688
その他収益金	202,470
支払利息	△ 77,519
(B) 有価証券売買損益	1,579,626,655
売買益	2,011,013,204
売買損	△ 431,386,549
(C) 先物取引等取引損益	10,561,036
取引益	130,522,884
取引損	△ 119,961,848
(D) 保管費用等	△ 192
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	1,868,635,126
(F) 前期繰越損益金	1,722,901,232
(G) 追加信託差損益金	534,890,960
(H) 解約差損益金	△1,077,404,292
(I) 計(E+F+G+H)	3,049,023,026
次期繰越損益金(I)	3,049,023,026

(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。

好配当日本株マザーファンド

《第11期》決算日2016年11月7日

[計算期間：2015年11月6日～2016年11月7日]

「好配当日本株マザーファンド」は、11月7日に第11期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	主として東京証券取引所第一部上場株式の中から、予想配当利回りが市場平均と比較して高いと判断される銘柄に投資し、高水準の配当収入と中長期的な株価値上がり益の獲得をめざして運用を行います。なお、東京証券取引所第二部上場株式およびJASDAQ上場株式等に投資する場合があります。銘柄選定にあたっては、予想配当利回りが原則として市場平均以上の銘柄から流動性等を勘案して調査対象銘柄を選定し、その中から財務の健全性や配当の実現性等を勘案して組入候補銘柄を決定します。ポートフォリオの構築にあたっては、銘柄分散を意識し、適宜組入銘柄の入替えを行います。原則として株式の組入比率は高位を維持します。
主 要 運 用 対 象	わが国の株式を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への投資割合に制限を設けません。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		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰 落	中 率			
	円		%	%	%	百万円
7期(2012年11月5日)	7,180		4.0	94.8	—	2,273
8期(2013年11月5日)	10,557		47.0	96.4	—	2,045
9期(2014年11月5日)	12,435		17.8	95.8	—	1,860
10期(2015年11月5日)	14,723		18.4	97.7	—	2,024
11期(2016年11月7日)	13,139		△10.8	97.6	—	1,651

(注) 当ファンドは、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

(注) 「株式先物比率」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	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
(期 首) 2015年11月 5 日	円 14,723	% —	% 97.7
11月末	14,855	0.9	98.0
12月末	14,695	△ 0.2	98.7
2016年1月末	13,845	△ 6.0	98.3
2月末	12,601	△14.4	98.6
3月末	13,234	△10.1	97.7
4月末	13,043	△11.4	97.0
5月末	13,340	△ 9.4	97.2
6月末	11,970	△18.7	98.3
7月末	12,598	△14.4	98.8
8月末	12,601	△14.4	99.2
9月末	12,617	△14.3	97.6
10月末	13,335	△ 9.4	97.6
(期 末) 2016年11月 7 日	13,139	△10.8	97.6

(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10.8%の下落となりました。

基準価額の推移



●投資環境について

◎国内株式市況

- ・期首から2016年2月前半にかけては、中国経済の一層の減速懸念、米国の今後の利上げペースへの懸念、原油価格下落による産油国経済・財政の悪化懸念、中東での地政学リスクのさらなる高まりなど多面的に不透明要因が強まり、投資家のリスク回避が急速に進みました。外国為替市場では「質への逃避」から円が買われる展開となり、国内株式市況は大きく下落しました。
- ・2月後半から期末にかけては、各国の緩和的な金融政策が継続する中、国内でマイナス金利幅の拡大が見送られたことによる金融機関の業績懸念後退、国内での経済対策に対する期待、米国の利上げ再開への期待を受けた円高・ドル安の一巡などが相場の下支えとなる一方、世界経済減速への警戒も引き続き根強いことなどもあり、国内株式市況は本格上昇には至らず、一進一退の展開となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・株式組入比率は、運用の基本方針にしたがい、概ね高水準を維持しました。
- ・銘柄選択にあたっては、予想配当利回りが市場平均を上回る銘柄の中から、株価の値上がり益が期待できる銘柄を厳選して投資しました。
- ・組入銘柄数は概ね75銘柄程度で推移させました。株価水準や予想配当利回り水準等を勘案し、銘柄入替を機動的・継続的に行いました。当期では、予想配当利回りでの相対的な魅力度が高まっていると考えたソニーフィナンシャルホールディングスなど24銘柄を新規に組み入れました。また、住友金属鉱山など24銘柄を全株売却しました。新規組入と全株売却をした主な銘柄のポイントは以下の通りです。

◎新規組入銘柄

- ・ソニーフィナンシャルホールディングス：2016年1月のマイナス金利導入後大きく株価が下落したことで、予想配当利回りでの相対的な魅力度が高まったと考えたことから、新規で組み入れました。

◎全株売却銘柄

- ・住友金属鉱山：予想配当利回り水準等を勘案し、全株売却しました。

以上の投資判断の結果、組入銘柄の株価下落により、基準価額は下落しました。パフォーマンスに寄与・影響した主な銘柄は以下の通りです。

(プラス要因)

◎銘柄

- ・大東建託：積極的な株主還元姿勢などを評価し、期首より保有していました。主力の建築請負において堅調な受注状況が好感され、株価は堅調に推移しプラスに寄与しました。

(マイナス要因)

◎銘柄

- ・トヨタ自動車：堅調な業績と予想配当利回り水準の高さなどから期首より保有していました。円高・ドル安が大きく進行したことで業績悪化が懸念され株価は軟調に推移、マイナスに影響しました。
- ・みずほフィナンシャルグループ：予想配当利回り水準の高さなどから期首より保有していました。日銀のマイナス金利導入による収益悪化懸念などを受け株価は軟調に推移、マイナスに影響しました。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・国内株式市況は、政府・日銀によるデフレ脱却に向けた積極的な政策が、引き続き企業業績のプラス要因として期待できると考えています。加えて、増配や自社株買いなど株主還元の強化により、資本効率の向上を図る企業も徐々に増えていることも国内株式市況にとってプラス要因と考えています。

◎今後の運用方針

- ・今後も企業調査を十分に行い、予想配当利回りの高い銘柄を中心に投資し、「高水準の配当収入」と「中長期的な株価の値上がり益」の獲得をめざす基本方針を継続します。加えて、財務の健全性や株式の流動性に留意しながら、保有銘柄の比率調整や新規銘柄の組み入れを行います。なお、国内株式市況が大幅に上昇する局面においても市況に追随するのではなく、引き続き基本方針に重きを置いた運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2015年11月6日～2016年11月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	円 15 (15)	% 0.115 (0.115)	(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	15	0.115	
期中の平均基準価額は、13,227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11月6日～2016年11月7日)

株式

国 内	上場	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
		千株	千円	千株	千円
		1,460	1,403,214	1,474	1,465,995
		(△ 28)	(-)		

(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。

○株式売買比率

(2015年11月6日～2016年11月7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	2,869,209千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,928,355千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.48

(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11月6日～2016年11月7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	$\frac{D}{C}$
株式	1,403	518	36.9	1,465	220	15.0

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 15	百万円 21	百万円 10

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 16

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	2,261千円
うち利害関係人への支払額 (B)	618千円
(B) / (A)	27.4%

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

○組入資産の明細

(2016年11月7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 (0.2%)				
ホクト	2.5	1.4	2,801	
建設業 (7.2%)				
ミライト・ホールディングス	—	2.9	2,868	
西松建設	17	27	13,365	
奥村組	—	15	9,150	
大東建託	1.7	1.5	26,152	
前田道路	—	1	1,940	
日本道路	10	—	—	
積水ハウス	28.2	19.2	32,870	
中電工	3.6	5	10,630	
協和エクシオ	—	12.1	18,984	
食料品 (3.1%)				
日本たばこ産業	8.9	12.9	50,632	
化学 (2.9%)				
クラレ	8.1	—	—	
デンカ	22	14	6,552	
太陽ホールディングス	4.8	4.3	16,727	
D I C	26	—	—	
東洋インキS Cホールディングス	23	22	10,780	
ファンケル	—	1.9	2,895	
デクセリアルズ	8.4	12.6	10,344	
アース製薬	2.3	—	—	
医薬品 (1.4%)				
武田薬品工業	8.4	4.9	22,246	
第一三共	9.2	—	—	
石油・石炭製品 (2.2%)				
東燃ゼネラル石油	20	19	19,057	
J Xホールディングス	28.3	39.6	16,014	
鉄鋼 (1.7%)				
日新製鋼	12.8	20.6	28,098	
非鉄金属 (1.8%)				
日本軽金属ホールディングス	111.3	125.1	29,648	
住友金属鉱山	19	—	—	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
アサヒホールディングス	3.3	—	—	
機械 (6.5%)				
ツガミ	—	29	16,559	
アマダホールディングス	4	—	—	
小松製作所	9.6	—	—	
平和	6.1	5.8	14,181	
SANKYO	1.8	—	—	
マックス	11	10	12,970	
セガサミーホールディングス	—	6.9	11,240	
ツバキ・ナカシマ	—	8.1	13,818	
日本精工	—	17.3	19,133	
スター精密	—	11.8	17,228	
電気機器 (8.5%)				
I D E C	7.2	5.5	5,318	
セイコーエプソン	18	21.3	45,539	
E I Z O	1.8	1.4	4,438	
アズビル	2.7	—	—	
新光電気工業	5.9	—	—	
スター精密	17.8	—	—	
キヤノン	21.2	17.2	50,765	
リコー	8.7	—	—	
東京エレクトロン	2.5	3.2	30,688	
輸送用機器 (13.4%)				
日産自動車	72.4	71.1	73,161	
トヨタ自動車	16.1	9.7	56,357	
富士重工業	19.8	19.5	76,693	
ヤマハ発動機	—	3.8	9,093	
精密機器 (1.7%)				
セイコーホールディングス	—	36	12,096	
ニプロ	—	12.6	15,901	
その他製品 (0.6%)				
リンテック	—	3.9	8,946	
電気・ガス業 (0.3%)				
中国電力	—	4.1	4,887	

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
陸運業 (0.6%)				
センコー	21	7.2	5,400	
九州旅客鉄道	—	1.5	4,597	
空運業 (2.4%)				
日本航空	13.5	12.5	39,325	
情報・通信業 (4.2%)				
コーエーテクモホールディングス	12.4	10.7	20,629	
ティーガイア	5.3	—	—	
ネットワンシステムズ	5.5	5	3,710	
沖縄セルラー電話	3.4	2.5	8,300	
N T T ドコモ	15.5	13.4	34,243	
卸売業 (11.9%)				
ナガイレーベン	8	—	—	
第一興商	5.5	—	—	
黒田電気	5.6	—	—	
伊藤忠商事	69.6	67.6	92,307	
三井物産	42.2	14.4	20,160	
山善	7.9	7.5	6,180	
住友商事	14.9	12.2	14,926	
阪和興業	42	39	24,960	
稲畑産業	12.1	9.9	11,018	
日鉄住金物産	31	3	11,385	
オートバックスセブン	3.8	3.7	5,394	
因幡電機産業	1.7	1.3	4,836	
小売業 (6.5%)				
ローソン	6.7	5	38,650	
エディオン	10	—	—	
AOKIホールディングス	2.6	3.1	3,971	
青山商事	10.4	10.6	39,750	
ケーズホールディングス	—	10.1	19,745	
ブレナス	2.8	1.3	2,835	

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
銀行業 (13.5%)				
ゆうちょ銀行	2.4	—	—	
あおぞら銀行	198	204	70,380	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	26	—	—	
りそなホールディングス	—	28.3	12,884	
三井住友フィナンシャルグループ	13.2	15.1	53,454	
みずほフィナンシャルグループ	492.2	404.9	70,857	
池田泉州ホールディングス	—	20.7	9,791	
証券・商品先物取引業 (0.6%)				
松井証券	12.7	11.4	9,359	
保険業 (3.8%)				
ソニーフィナンシャルホールディングス	—	28	39,508	
東京海上ホールディングス	—	5.5	22,060	
その他金融業 (2.6%)				
ジャックス	—	24	10,920	
日立キャピタル	3	—	—	
オリックス	15.5	18.8	30,258	
不動産業 (1.1%)				
野村不動産ホールディングス	4	3.7	6,408	
レオパレス21	—	13.9	8,228	
フジ住宅	—	5.2	3,593	
サービス業 (1.3%)				
ラウンドワン	11.4	—	—	
りらいあコミュニケーションズ	—	5.3	5,273	
日本郵政	2.1	12.1	15,536	
メイテック	1.5	—	—	
ベネッセホールディングス	4.1	—	—	
合 計	株 数 ・ 金 額	1,744	1,702	1,611,616
	銘柄数<比率>	76	76	<97.6%>

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

○投資信託財産の構成

(2016年11月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	1,611,616	96.3
コール・ローン等、その他	62,041	3.7
投資信託財産総額	1,673,657	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年11月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,673,657,914
コール・ローン等	14,338,040
株式(評価額)	1,611,616,230
未収入金	24,172,419
未収配当金	23,531,225
(B) 負債	21,948,388
未払金	1,375,801
未払解約金	20,572,567
未払利息	20
(C) 純資産総額(A-B)	1,651,709,526
元本	1,257,127,193
次期繰越損益金	394,582,333
(D) 受益権総口数	1,257,127,193口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,139円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,375,273,001円
 期中追加設定元本額 418,064,725円
 期中一部解約元本額 536,210,533円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3139円です。

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

三菱UFJ 3資産分散ファンド(毎月決算型)	837,188,533円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	63,260,776円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	356,677,884円
合計	1,257,127,193円

[お 知 ら せ]

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

○損益の状況 (2015年11月6日～2016年11月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	69,703,378
受取配当金	69,581,950
受取利息	7,472
その他収益金	120,632
支払利息	△ 6,676
(B) 有価証券売買損益	△304,257,611
売買益	82,000,991
売買損	△386,258,602
(C) 保管費用等	△ 24
(D) 当期損益金(A+B+C)	△234,554,257
(E) 前期繰越損益金	649,515,334
(F) 追加信託差損益金	145,364,633
(G) 解約差損益金	△165,743,377
(H) 計(D+E+F+G)	394,582,333
次期繰越損益金(H)	394,582,333

- (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。

JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド

《第2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]

「JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド」は、1月26日に第2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2期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主としてわが国の金融商品取引所上場株式（上場予定株式を含みます。）に投資を行い、iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックスに連動する投資成果をめざして運用を行います。株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。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株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定株式を含みます。）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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス		株組入比率	株先物比率	純資産総額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
(設定日)	円	%		%	%	%	百万円
2015年11月6日	10,000	—	166.32	—	—	—	299
1期(2016年1月26日)	8,905	△11.0	148.04	△11.0	96.9	3.1	444
2期(2017年1月26日)	10,267	15.3	167.04	12.8	98.2	1.2	1,322

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックスとは、東京証券取引所を主たる市場とする普通株式等の中から時価総額、流動性によりスクリーニングされる投資ユニバースのうち、高ROEかつ、①財務健全性、②キャッシュフロー収益性、③利益安定性の3点に着目し、高ROEの継続性を評価して150銘柄を選定し算出される株価指数です。iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックスは、三菱UFJ信託銀行が有するアクティブ運用機関としてのノウハウとSTOXXリミテッド（以下「STOXX社」）が有する指数提供機関としての経験を活用し、両社で共同開発したものです。2001年6月18日の時価総額を100として、STOXX社が算出・公表しています。STOXX社は、iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス及びそれに含まれるデータの発行元です。STOXX社は、報告された情報の作成に何ら関与するものではなく、かつ報告された情報、又はiSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス若しくはそのデータに関するエラー、遺漏若しくは中断について、何ら保証するものではなく、(過失の有無を問わず)いかなる責任も負うものではありません。これらについては、正確性、妥当性、正当性、完全性、適時性及び目的への適合性を含みますが、これらに限定されません。STOXX社に關係する情報の流布又は再配信は、一切禁止されています。

(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。

(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		i STOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2016年1月26日	円	%		%	%	%
	8,905	—	148.04	—	96.9	3.1
1 月 末	9,371	5.2	155.90	5.3	97.2	3.0
2 月 末	8,555	△ 3.9	142.12	△ 4.0	97.4	2.6
3 月 末	8,986	0.9	147.95	△ 0.1	97.4	2.4
4 月 末	8,895	△ 0.1	146.53	△ 1.0	97.7	2.2
5 月 末	9,200	3.3	151.43	2.3	98.9	1.1
6 月 末	8,438	△ 5.2	138.77	△ 6.3	99.0	1.1
7 月 末	9,006	1.1	147.99	△ 0.0	98.7	1.1
8 月 末	8,882	△ 0.3	145.86	△ 1.5	98.8	1.1
9 月 末	8,930	0.3	145.66	△ 1.6	98.4	1.1
10 月 末	9,444	6.1	154.01	4.0	98.9	1.1
11 月 末	9,813	10.2	159.90	8.0	98.6	1.1
12 月 末	10,127	13.7	164.76	11.3	98.7	1.2
(期 末) 2017年1月26日	10,267	15.3	167.04	12.8	98.2	1.2

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ15.3%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ベンチマークは12.8%の上昇となったため、カ
イ離は2.5%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iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス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12.8%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	2.3%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、1.6%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2.3%程度でした。
- ・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

プラス要因	配当・利子収入等	計 2.3%程度
マイナス要因	売買コスト等	計 △0.0%程度

○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1月27日～2017年1月26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 1 (1) (0)	% 0.015 (0.011) (0.004)	(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	1	0.015	
期中の平均基準価額は、9,137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)

株式

国 内	上場	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
		千株	千円	千株	千円
		799	1,595,213	605	899,296
		(0.44)	()		

(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	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	362	364	27	28

○株式売買比率

(2016年1月27日～2017年1月26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	2,494,510千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	995,695千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.50

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年1月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 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	%
株式	百万円 1,595	百万円 449	% 28.2	百万円 899	百万円 368	% 40.9

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)	153千円
うち利害関係人への支払額 (B)	27千円
(B) / (A)	18.1%

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

○組入資産の明細

(2017年1月26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
建設業 (4.7%)				
安藤・間	0.8	—	—	—
大成建設	—	12	9,804	
大林組	—	7.7	8,316	
清水建設	—	8	8,488	
長谷工コーポレーション	1.4	3.2	4,140	
鹿島建設	—	11	8,701	
西松建設	—	3	1,716	
三井住友建設	3.7	—	—	
前田建設工業	—	2	2,014	
熊谷組	—	4	1,292	
大東建託	0.4	0.8	12,808	
前田道路	—	1	1,952	
九電工	—	0.5	1,537	
食料品 (4.2%)				
森永製菓	—	0.5	2,410	
カルビー	0.4	0.9	3,262	
ヤクルト本社	0.6	—	—	
明治ホールディングス	0.7	1.6	14,096	
キッコーマン	—	2	7,010	
味の素	3	—	—	
ニチレイ	—	1.5	3,454	
日本たばこ産業	—	6.6	24,294	
繊維製品 (—%)				
帝人	5	—	—	
化学 (9.8%)				
旭化成	6	14	15,211	
日産化学工業	0.7	1.6	6,544	
日本曹達	1	—	—	
デンカ	2	—	—	
エア・ウォーター	1	—	—	
日本触媒	0.2	—	—	
三菱瓦斯化学	2	—	—	
三菱ケミカルホールディングス	6.9	—	—	

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
ダイセル	1.7	3.7	4,676	
積水化学工業	2.2	4.9	9,687	
日本ゼオン	1	—	—	
アイカ工業	0.3	0.7	2,170	
宇部興産	5	—	—	
日立化成	—	1.1	3,624	
日本化薬	—	2	2,982	
日油	1	2	2,430	
花王	1.6	4.8	26,688	
日本ペイントホールディングス	1.2	—	—	
関西ペイント	—	2.8	6,260	
ライオン	—	3	5,889	
コーセー	0.2	0.4	3,916	
ポーラ・オルビスホールディングス	—	0.3	3,174	
小林製薬	0.1	0.6	3,024	
日東電工	0.8	1.7	15,793	
ニフコ	—	0.5	2,900	
ユニ・チャーム	—	5	12,922	
医薬品 (6.5%)				
アステラス製薬	5.8	16.4	25,223	
塩野義製薬	1.4	3.3	18,252	
日本新薬	—	0.7	4,186	
中外製薬	—	2.4	8,100	
科研製薬	—	0.4	2,324	
エーザイ	—	3.2	20,512	
ロート製薬	0.5	—	—	
参天製薬	1.9	—	—	
ツムラ	0.3	—	—	
日医工	0.3	—	—	
沢井製薬	0.2	0.4	2,388	
ベプチドリーム	—	0.5	2,915	
ゴム製品 (2.1%)				
ブリヂストン	—	5.9	24,136	
住友ゴム工業	—	2	3,574	

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
ガラス・土石製品 (1.6%)				
住友大阪セメント	2	—	—	—
TOTO	0.8	1.8	8,316	—
日本碍子	1	3.1	7,089	—
日本特殊陶業	0.9	2.1	5,306	—
鉄鋼 (-%)				
日立金属	0.9	—	—	—
非鉄金属 (0.2%)				
三菱マテリアル	6	—	—	—
DOWAホールディングス	1	3	2,952	—
古河機械金属	2	—	—	—
金属製品 (0.2%)				
三和ホールディングス	—	2.6	2,917	—
リンナイ	0.2	—	—	—
日本発條	1	—	—	—
機械 (7.7%)				
オークマ	1	—	—	—
オーエスジー	—	1	2,395	—
ディスコ	—	0.3	4,368	—
ナブテスコ	0.6	1.3	3,876	—
SMC	0.3	0.7	21,182	—
小松製作所	4.4	—	—	—
クボタ	—	12.7	23,094	—
荏原製作所	2	—	—	—
ダイキン工業	1.1	2.4	27,480	—
タダノ	1	—	—	—
平和	0.2	—	—	—
竹内製作所	0.2	—	—	—
ホシザキ	—	0.6	5,778	—
日本精工	2.3	—	—	—
NTN	2	—	—	—
マキタ	—	1.5	11,910	—
電気機器 (14.6%)				
ブラザー工業	—	2.8	5,983	—
ミネベア	2	—	—	—
三菱電機	7	15	26,362	—
安川電機	1.2	—	—	—
日本電産	1.1	2.5	26,600	—
オムロン	1	2.3	11,212	—

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
アルバック	—	0.5	2,057	—
富士通ゼネラル	—	1	2,305	—
アルプス電気	0.9	—	—	—
横河電機	1.1	2.6	4,895	—
日本光電工業	0.4	1	2,612	—
キーエンス	0.1	—	—	—
シスメックス	0.9	1.9	12,464	—
スタンレー電気	—	1.7	5,193	—
カシオ計算機	1.2	2.8	4,432	—
ファナック	0.5	1.2	27,180	—
浜松トホニクス	0.7	—	—	—
太陽誘電	0.6	—	—	—
村田製作所	—	1.6	24,760	—
小糸製作所	0.6	1.4	8,624	—
SCREENホールディングス	1	0.5	3,630	—
東京エレクトロン	0.8	1.8	21,573	—
輸送用機器 (9.4%)				
デンソー	1.7	—	—	—
川崎重工業	8	—	—	—
いすゞ自動車	3	6.6	10,329	—
トヨタ自動車	1.3	3.6	24,350	—
日野自動車	1.3	—	—	—
三菱自動車工業	3.5	—	—	—
NOK	0.6	—	—	—
カルソニックカンセイ	1	2	3,594	—
アイシン精機	—	2.2	11,660	—
ダイハツ工業	1	—	—	—
スズキ	2.1	4.7	20,891	—
富士重工業	2	5.2	24,736	—
ヤマハ発動機	—	3.3	7,986	—
シマノ	—	0.9	16,209	—
テイ・エス テック	0.2	0.6	1,765	—
精密機器 (3.1%)				
テルモ	—	3.8	15,979	—
島津製作所	1	—	—	—
東京精密	0.2	0.4	1,520	—
トプコン	0.3	—	—	—
HOYA	2	4.2	20,239	—
朝日インテック	0.3	0.6	2,805	—

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
その他製品 (1.4%)				
バンダイナムコホールディングス	1	2.4	7,656	
ヤマハ	0.9	2	7,120	
ビジョン	—	1.3	3,997	
電気・ガス業 (0.4%)				
東京瓦斯	10	—	—	
大阪瓦斯	10	—	—	
東邦瓦斯	2	5	4,495	
陸運業 (2.0%)				
東京急行電鉄	5	—	—	
京成電鉄	2	—	—	
東海旅客鉄道	0.5	1.4	26,425	
空運業 (1.1%)				
日本航空	1.7	3.9	14,250	
情報・通信業 (10.1%)				
新日鉄住金ソリューションズ	0.2	—	—	
野村総合研究所	—	1.4	5,075	
オービック	0.3	0.8	4,184	
ヤフー	5.6	13.1	6,091	
トレンドマイクロ	0.6	1.4	6,146	
日本オラクル	0.1	0.3	1,842	
伊藤忠テクノソリューションズ	0.2	0.6	1,818	
大塚商会	0.3	0.7	3,941	
日本電信電話	—	5.5	27,368	
KDD I	3.3	8.6	25,817	
光通信	0.1	0.3	3,117	
NTTドコモ	—	9.6	26,304	
GMOインターネット	—	0.7	1,148	
東宝	0.6	1.5	4,875	
エス・ティ・ティ・データ	—	1.4	7,994	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	—	1	3,285	
S C S K	0.3	0.6	2,517	
卸売業 (1.4%)				
アルフレッサ ホールディングス	—	2.3	4,390	
第一興商	—	0.5	2,270	
伊藤忠商事	6.7	—	—	
日立ハイテクノロジーズ	—	0.7	3,332	
サンリオ	0.3	0.7	1,586	
ミスミグループ本社	1.3	2.9	5,918	

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
小売業 (4.3%)				
ローソン	0.3	0.5	4,045	
エービーシー・マート	0.1	0.3	1,977	
MonotaRO	—	0.7	1,759	
マツモトキヨシホールディングス	0.2	0.5	2,810	
スタートトゥデイ	0.3	2.2	4,699	
ウエルシアホールディングス	—	0.3	1,851	
コスモス薬品	0.1	0.1	2,093	
ツルハホールディングス	0.2	0.5	5,405	
良品計画	0.1	0.3	6,462	
ドンキホーテホールディングス	0.5	—	—	
ユナイテッドアローズ	0.1	—	—	
スギホールディングス	0.2	0.4	2,108	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	0.3	—	—	
しまむら	—	0.3	4,482	
アインホールディングス	0.1	0.3	2,466	
ニトリホールディングス	—	1	12,710	
ファーストリテイリング	0.2	—	—	
サンドラッグ	0.2	0.4	3,116	
銀行業 (0.4%)				
あおぞら銀行	—	13	5,447	
証券・商品先物取引業 (0.1%)				
松井証券	—	1.5	1,509	
保険業 (5.5%)				
SOMPOホールディングス	—	4.4	18,378	
ソニーフィナンシャルホールディングス	0.8	1.8	3,504	
第一生命ホールディングス	4.7	12.6	26,340	
東京海上ホールディングス	2.1	4.7	22,578	
T&Dホールディングス	3.1	—	—	
その他金融業 (0.9%)				
全国保証	0.2	0.6	2,343	
日本取引所グループ	—	5.9	9,322	
不動産業 (0.7%)				
ヒューリック	—	5.2	5,272	
野村不動産ホールディングス	0.6	—	—	
パーク24	0.5	1.2	3,696	
レオパレス21	1.2	—	—	
サービス業 (7.6%)				
日本M&Aセンター	0.1	0.7	2,446	

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
テンブホールディングス	0.7	1.8	3,524	
総合警備保障	0.4	1	4,450	
カカココム	0.6	1.5	3,061	
エムスリー	0.9	2.1	6,213	
博報堂DYホールディングス	—	3.4	4,814	
オリエンタルランド	1.1	2.4	15,237	
ユー・エス・エス	1.2	2.7	5,405	
サイバーエージェント	0.2	1.1	3,355	

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
楽天	3.9	—	—	
リクルートホールディングス	—	5.6	27,832	
リログループ	—	0.1	1,598	
共立メンテナンス	0.1	0.2	1,490	
セコム	1	2.3	18,972	
合 計	株 数・金 額	222	416	1,299,162
	銘柄数<比率>	146	150	<98.2%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 15	百万円 —

○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
株式	千円 1,299,162	% 98.2
コール・ローン等、その他	23,971	1.8
投資信託財産総額	1,323,133	100.0

○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	1,323,028,108
コール・ローン等	20,718,848
株式(評価額)	1,299,162,150
未収入金	394,460
未収配当金	2,212,650
差入委託証拠金	540,000
(B) 負債	496,029
未払解約金	496,000
未払利息	29
(C) 純資産総額(A-B)	1,322,532,079
元本	1,288,103,605
次期繰越損益金	34,428,474
(D) 受益権総口数	1,288,103,605口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,267円

<注記事項>

- ①期首元本額 499,200,258円
 期中追加設定元本額 1,312,784,372円
 期中一部解約元本額 523,881,025円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0267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)

iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックスファンド(ラップ向け)	388,128,213円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	25,222,609円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	159,604,118円
eMAXIS JAPAN クオリティ150インデックス	715,148,665円
合計	1,288,103,605円

○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	18,528,535
受取配当金	18,499,411
受取利息	1,013
その他収益金	37,516
支払利息	△ 9,405
(B) 有価証券売買損益	172,376,329
売買益	231,990,060
売買損	△ 59,613,731
(C) 先物取引等取引損益	3,102,368
取引益	6,594,944
取引損	△ 3,492,576
(D) 保管費用等	△ 11
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	194,007,221
(F) 前期繰越損益金	△ 54,644,836
(G) 追加信託差損益金	△144,301,697
(H) 解約差損益金	39,367,786
(I) 計(E+F+G+H)	34,428,474
次期繰越損益金(I)	34,428,474

(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。

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
国 内	国債証券	千円 240,143,108	千円 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	百万円 11,739	百万円 12,952	百万円 -	百万円 -
債券先物取引				

○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まません。

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		
		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
F89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
F110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
F123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
F131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
F147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
F226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）	6,373,050,568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)

先進国高格付国債マザーファンド

【第4期】決算日2016年12月6日

[計算期間：2015年12月8日～2016年12月6日]

「先進国高格付国債マザーファンド」は、12月6日に第4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4期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	日本を含む先進国の国債等に投資を行い、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。投資する国債等（日本国債を除きます。）は、原則として取得時において最上位格付けを取得しているものに限り、銘柄選定にあたっては、最終利回り、イールドカーブおよび為替ヘッジコスト等を勘案して決定します。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。債券等（為替ヘッジのために行う外国為替予約取引等を含みます。）の運用にあたっては、三菱UFJアセット・マネジメント（UK）に運用の指図に関する権限を委託します。
主 要 運 用 対 象	日本を含む先進国の国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割合に制限を設けません。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		（ 参 考 指 数 ） シティ日本国債インデックス (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			
(設定日) 2012年12月20日	円	%	319.99	%	%	%	百万円 5,124
1期(2013年12月6日)	9,768	△2.3	327.38	2.3	97.7	—	10,848
2期(2014年12月8日)	10,514	7.6	338.14	3.3	97.8	—	12,021
3期(2015年12月7日)	10,599	0.8	343.98	1.7	96.9	—	19,564
4期(2016年12月6日)	10,813	2.0	360.47	4.8	99.1	—	105,627

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

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

(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		(参 考 指 数) シティ日本国債インデックス (円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年12月 7 日	円	%		%	%	%
	10,599	—	343.98	—	96.9	—
12月末	10,589	△0.1	346.66	0.8	95.5	—
2016年 1 月 末	10,743	1.4	351.89	2.3	99.1	—
2 月 末	10,860	2.5	358.99	4.4	95.7	—
3 月 末	10,963	3.4	362.95	5.5	98.0	—
4 月 末	10,866	2.5	367.01	6.7	96.7	—
5 月 末	10,857	2.4	368.61	7.2	97.0	—
6 月 末	11,088	4.6	374.05	8.7	96.0	—
7 月 末	11,166	5.3	370.36	7.7	95.2	—
8 月 末	11,142	5.1	365.78	6.3	97.3	—
9 月 末	11,126	5.0	365.84	6.4	96.4	—
10 月 末	11,073	4.5	364.69	6.0	97.0	—
11 月 末	10,884	2.7	361.95	5.2	97.6	—
(期 末) 2016年12月 6 日	10,813	2.0	360.47	4.8	99.1	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

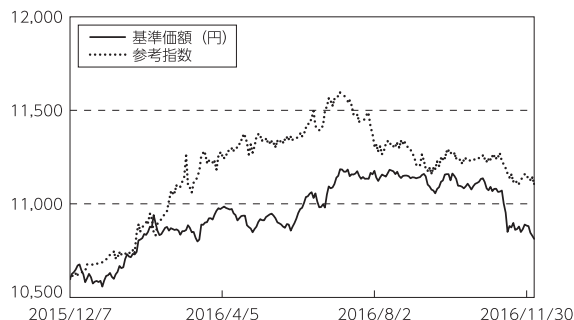
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.0%の上昇となりました。

基準価額の推移



(注) 参考指数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

◎債券市況

先進国高格付国債市場では、期首から2016年6月にかけて、米国の利上げ観測が後退したことや日本や欧州で追加金融緩和策が実施されたことに加え、6月下旬に実施された英国の国民投票において英国のEU（欧州連合）離脱が選択されたことなどを受けて、相対的に安全資産とされる国債への需要が高まったことなどを背景に、米国やドイツの金利は低下（債券価格は上昇）しました。

- ・その後、期末にかけては、米国において労働市場が堅調に推移したことなどを受けて早期の利上げ観測が高まったことや、米国で11月に実施された大統領選挙の結果を受けて、次期政権による積極的な財政出動への期待感が高まったことなどを背景にインフレが加速するとの見通しが広がったことなどから、米国やドイツの金利は上昇しました。
 - ・期を通じてみると、米国の金利は上昇した一方、ドイツの金利は低下しました。
- ◎為替
- ・組入外貨建資産については、為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。
- 当該投資信託のポートフォリオについて
- ・投資対象である国債の各国／満期グループ（ユニバース）の中で、銘柄選定時点の最終利回り、ローリングイールドおよびヘッジコストを基に、金利中立的なシナリオの下で円建ての期待リターンが最も高い5つのグループから選択した銘柄を組み入れました。組入外貨建資産については、為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ったため、為替市況の変動が基準価額に与える影響は限定的となりました。
- 今後の運用方針
- ・投資対象である国債の各国／満期グループの中で、銘柄選定時点の最終利回り、ローリングイールドおよびヘッジコストを基に、金利中立的なシナリオの下で円建ての期待リターンが最も高い5つのグループから選択した銘柄を組み入れる運用を行う方針です。また、組入外貨建資産については、為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図る運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2015年12月8日～2016年12月6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)	7	0.061	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)	(2)	(0.018)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	(5)	(0.043)	
期中の平均基準価額は、10,946円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年12月8日～2016年12月6日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	カナダ	国債証券	千カナダドル -	千カナダドル 40,244
	スイス	国債証券	千スイスフラン 199,505	千スイスフラン 7,002
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 3,291,071	千スウェーデンクローネ 169,709
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 267,888	千デンマーククローネ 274,562
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 653,172	千シンガポールドル 246,217

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2015年12月8日～2016年12月6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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	224,044	—	—	310,151	3,334	1.1
為替直物取引	106,576	3,111	2.9	18,849	—	—

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銀行です。

○組入資産の明細

(2016年12月6日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
スイス	千スイスフラン 165,400	千スイスフラン 187,267	千円 21,118,185	% 20.0	% —	% 20.0	% —	% —
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 2,871,700	千スウェーデンクローネ 3,340,789	41,559,427	39.3	—	39.3	—	—
シンガポール	千シンガポールドル 508,200	千シンガポールドル 524,267	41,988,608	39.8	—	39.8	—	—
合 計	—	—	104,666,220	99.1	—	99.1	—	—

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄			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	
スイス			%	千スイスフラン	千スイスフラン	千円	
	国債証券	1.25 SWISS GOVT 240611	1.25	85,700	95,783	10,801,529	2024/6/11
		1.5 SWISS GOVT 250724	1.5	79,700	91,484	10,316,655	2025/7/24
小	計					21,118,185	
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	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	771,300	842,105	10,475,790	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	704,100	828,004	10,300,378	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	1,396,300	1,670,679	20,783,258	2022/6/1
小	計					41,559,427	
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	2.125 SINGAPORGV 260601	2.125	43,000	42,011	3,364,660	2026/6/1
		2.375 SINGAPORGV 250601	2.375	101,000	100,949	8,085,045	2025/6/1
		2.75 SINGAPORGV 230701	2.75	127,700	132,041	10,575,227	2023/7/1
		3 SINGAPORGV 240901	3.0	108,000	113,184	9,064,906	2024/9/1
		3.125SINGAPORGV 220901	3.125	128,500	136,081	10,898,767	2022/9/1
小	計					41,988,608	
合	計					104,666,220	

(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12月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 104,666,220	% 92.8
コール・ローン等、その他	8,080,844	7.2
投資信託財産総額	112,747,064	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (105,600,937千円) の投資信託財産総額 (112,747,064千円) に対する比率は93.7%です。

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

1 スイスフラン=112.77円	1 スウェーデンクローネ=12.44円	1 シンガポールドル=80.09円
------------------	---------------------	-------------------

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年12月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	210,777,242,087
コール・ローン等	7,269,977,315
公社債(評価額)	104,666,220,955
未収入金	98,035,572,505
未収利息	550,181,820
前払費用	255,289,492
(B) 負債	105,149,529,751
未払金	105,109,519,436
未払解約金	40,000,000
未払利息	10,315
(C) 純資産総額(A-B)	105,627,712,336
元本	97,685,259,651
次期繰越損益金	7,942,452,685
(D) 受益権総口数	97,685,259,651口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,813円

<注記事項>

- ①期首元本額 18,458,347,724円
 期中追加設定元本額 89,225,465,887円
 期中一部解約元本額 9,998,553,960円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0813円です。

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

三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	752,846,558円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	866,311,461円
先進国高格付国債ファンド(ラップ向け)	6,572,010,024円
MUAM 先進国高格付国債ファンド(適格機関投資家転売制限付)	39,031,719,991円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2016-05(適格機関投資家転売制限付)	13,507,756,997円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2016-09(適格機関投資家転売制限付)	16,103,849,275円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2016-10(適格機関投資家転売制限付)	12,388,234,236円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2016-11(適格機関投資家転売制限付)	8,462,531,109円
合計	97,685,259,651円

【お知らせ】

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

○損益の状況 (2015年12月8日～2016年12月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,031,717,577
受取利息	1,032,642,658
支払利息	△ 925,081
(B) 有価証券売買損益	△ 2,160,688,718
売買益	9,539,445,293
売買損	△11,700,134,011
(C) 保管費用等	△ 33,705,610
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,162,676,751
(E) 前期繰越損益金	1,106,031,363
(F) 追加信託差損益金	9,032,044,113
(G) 解約差損益金	△ 1,032,946,040
(H) 計(D+E+F+G)	7,942,452,685
次期繰越損益金(H)	7,942,452,685

- (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。

東証REIT指数マザーファンド

《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]

「東証REIT指数マザーファンド」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	わが国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。対象インデックスとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引を利用し不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。
主要運用対象	東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は行いません。 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証REIT指数 (配当込み)		投資信託証券 組入比率	不動産投 信指比 率	純総 資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
4期(2013年1月28日)	15,186	47.0	1,892.12	47.4	99.0	—	2,449
5期(2014年1月27日)	19,623	29.2	2,454.67	29.7	96.9	2.4	5,919
6期(2015年1月26日)	26,667	35.9	3,336.13	35.9	96.5	3.5	12,810
7期(2016年1月26日)	23,985	△10.1	2,998.39	△10.1	98.1	2.2	15,494
8期(2017年1月26日)	27,236	13.6	3,399.04	13.4	97.9	2.3	16,983

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

(注) 「不動産投信指数先物比率」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 R E I T 指 数		投 資 信 託 不 動 産 組 入 比 率	先 物 指 数 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(配 当 込 み)	騰 落 率		
(期 首) 2016年1月26日	円	%		%	%	%
	23,985	—	2,998.39	—	98.1	2.2
1月末	25,455	6.1	3,182.12	6.1	97.3	2.7
2月末	26,894	12.1	3,361.11	12.1	98.1	1.9
3月末	27,285	13.8	3,409.88	13.7	97.8	2.3
4月末	27,732	15.6	3,465.54	15.6	97.8	2.2
5月末	27,389	14.2	3,422.69	14.2	98.3	1.7
6月末	26,730	11.4	3,340.35	11.4	97.1	2.9
7月末	27,163	13.2	3,394.01	13.2	97.0	3.0
8月末	26,623	11.0	3,325.60	10.9	97.9	2.2
9月末	26,722	11.4	3,336.34	11.3	98.0	2.0
10月末	26,188	9.2	3,269.40	9.0	98.0	2.1
11月末	26,425	10.2	3,298.65	10.0	97.6	2.4
12月末	27,417	14.3	3,422.06	14.1	98.4	1.6
(期 末) 2017年1月26日	27,236	13.6	3,399.04	13.4	97.9	2.3

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「不動産投信指数先物比率」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13.6%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(13.4%)を0.2%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REIT市況

- ・期首から2016年4月中旬にかけては、日本銀行によるマイナス金利政策導入の発表などにより国内REIT市況は上昇しました。
- ・4月下旬から11月上旬にかけては、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REIT市況は下落しました。
- ・11月中旬から期末にかけては、米大統領選後の円安・株高により日本の景況感にも前向きな見方が台頭したことなどを背景に、国内REIT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

- ・資産のほぼ全額を不動産投資信託証券（REIT）（先物を含む）に投資しました。
- ・ポートフォリオはベンチマークである東証REIT指数（配当込み）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13.4%の上昇となったため、カイ離は0.2%程度となりました。カイ離幅を低水準に抑制し、高い流動性を維持しました。

	組入比率 要因	銘柄選択 要因	その他の 要因	合計
ベンチマーク とのカイ離	0.1%程度	0.1%程度	0.1%程度	0.2%程度

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

◎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REIT（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、2.2%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0.1%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は0.1%程度でした。

プラス要因	売買益等	計 0.1%程度
マイナス要因	売買コスト等	計 Δ0.0%程度

○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1月27日～2017年1月26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
(投 資 信 託 証 券)	1	0.004	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	
(b) そ の 他 費 用	(1)	(0.003)	(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
(そ の 他)	0	0.000	
合 計	(0)	(0.000)	
期中の平均基準価額は、26,835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)

投資信託証券

銘柄	買		付		売		付	
	口	数	金	額	口	数	金	額
		千口		千円		千口		千円
日本アコモデーションファンド投資法人		0.11		50,237		0.162		75,289
MCUBS Mid City投資法人		0.06		21,168		0.089		30,171
森ヒルズリート投資法人		0.529		83,773		0.575		87,383
		(0.134)		(18,817)				
産業ファンド投資法人		0.079		43,111		0.118		62,625
大和ハウスリート投資法人		0.065		35,830		0.028		13,796
		(△ 0.56)		(△ 249,103)				
アドバンス・レジデンス投資法人		0.379		105,862		0.451		128,568
ケネディクス・レジデンシャル投資法人		0.08		23,159		0.117		34,986
アクティブア・プロパティーズ投資法人		0.209		111,718		0.204		106,681
		(0.021)		(10,149)				
GLP投資法人		0.948		120,764		0.938		118,466
		(0.068)		(8,116)				
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		0.16		36,818		0.171		40,888
		(0.017)		(3,524)				
日本プロロジスリート投資法人		0.638		156,925		0.582		136,972
星野リゾート・リート投資法人		0.023		29,361		0.046		31,408
		(0.133)		(-)				
SIA不動産投資法人		0.049		19,584		0.03		11,629
イオンリート投資法人		0.585		77,096		0.4		50,566
ヒューリックリート投資法人		0.593		108,700		0.312		56,698
日本リート投資法人		0.09		24,942		0.132		36,221
インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人		0.562		53,482		0.243		22,023
日本ヘルスケア投資法人		0.016		2,903		0.024		4,245
積水ハウス・リート投資法人		0.347		47,547		0.295		41,171
トーセイ・リート投資法人		0.05		5,575		0.061		6,626
		(0.024)		(2,494)				
ケネディクス商業リート投資法人		0.184		50,356		0.13		33,268
ヘルスケア&メディカル投資法人		0.027		2,863		0.04		4,236
サムティ・レジデンシャル投資法人		0.12		10,693		0.085		7,171
		(0.113)		(9,795)				
ジャパン・シニアリビング投資法人		0.019		2,887		0.028		4,032
野村不動産マスターファンド投資法人		0.87		143,198		1		227,824
		(0.736)		(119,647)				
いちごホテルリート投資法人		0.229		34,972		0.079		10,464
ラサールレジポート投資法人		1		197,020		0.304		32,635
スターアジア不動産投資法人		0.566		56,347		0.089		8,178
マリモ地方創生リート投資法人		0.149		13,419		0.023		1,817
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		0.365		118,587		0.055		17,233
大江戸温泉リート投資法人		0.287		25,793		0.043		3,399
さくら総合リート投資法人		0.541		43,597		0.081		6,256
日本ビルファンド投資法人		0.322		206,012		0.475		300,452
ジャパンリアルエステイト投資法人		0.297		188,640		0.439		272,877
日本リテールファンド投資法人		0.582		146,257		0.858		204,115
オリックス不動産投資法人		0.821		144,375		0.835		145,321
		(0.045)		(7,700)				
日本プライムリアルティ投資法人		0.266		120,167		0.294		133,520

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国	プレミアム投資法人	0.301	40,938	0.443	59,312
	東急リアル・エステート投資法人	0.221	33,121	0.327	46,692
	グローバル・ワン不動産投資法人	0.044	18,248	0.065	27,108
	ユナイテッド・アーバン投資法人	1	196,940	0.983	170,677
	森トラスト総合リート投資法人	0.299	58,186	0.442	78,391
	インヴィンシブル投資法人	1	115,838	1	71,550
	フロンティア不動産投資法人	0.113	58,663	0.166	83,059
	平和不動産リート投資法人	0.231	19,830	0.341	27,668
	日本ロジスティクスファンド投資法人	0.201	48,088	0.296	68,873
	福岡リート投資法人	0.17	33,343	0.251	45,501
	ケネディクス・オフィス投資法人	0.091	57,086	0.135	83,541
	積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	0.368	42,879	0.358	42,243
	いちごオフィスリート投資法人	0.515	41,285	0.508	38,859
	大和証券オフィス投資法人	0.131	83,787	0.164	98,322
	阪急リート投資法人	0.137	18,615	0.202	28,851
	スターツプロシード投資法人	0.163	25,432	0.067	10,466
	トップリート投資法人	0.033 (△0.281)	14,125 (△ 119,647)	0.014	6,177
	大和ハウスリート投資法人	0.203 (1)	54,901 (249,103)	0.45	126,290
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	1	130,644	1	98,587
	日本賃貸住宅投資法人	0.374	31,465	0.552	44,371
ジャパンエクセレント投資法人	0.349	50,548	0.429	61,028	
森ヒルズリート投資法人(新)	— (△0.134)	— (△ 18,817)	—	—	
アクティビア・プロパティーズ投資法人(新)	0.021 (△0.021)	10,149 (△ 10,149)	—	—	
GLP投資法人(新)	0.068 (△0.068)	8,116 (△ 8,116)	—	—	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人(新)	0.009 (△0.017)	2,189 (△ 3,524)	—	—	
トーセイ・リート投資法人(新)	0.024 (△0.024)	2,494 (△ 2,494)	—	—	
ヘルスケア&メディカル投資法人(新)	0.085	8,605	—	—	
サムティ・レジデンシャル投資法人(新)	0.113 (△0.113)	9,795 (△ 9,795)	—	—	
オリックス不動産投資法人(新)	0.045 (△0.045)	7,700 (△ 7,700)	—	—	
合 計	21 (1)	3,886,781 (—)	18	3,826,802	

(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
国内	不動産投信指数先物取引	百万円 5,572	百万円 5,579	百万円 —	百万円 —

○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	%
投資信託証券	3,886	1,825	47.0	3,826	1,777	46.4
不動産投信指数先物取引	5,572	4,823	86.6	5,579	4,436	79.5

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
投資信託証券	百万円 224

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)	690千円
うち利害関係人への支払額 (B)	380千円
(B) / (A)	55.1%

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

○組入資産の明細

(2017年1月26日現在)

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千口	千円	%
日本アコモデーションファンド投資法人	0.722	0.67	334,330	2.0
MCUBS MidCity投資法人	0.397	0.368	130,640	0.8
森ヒルズリート投資法人	2	2	377,036	2.2
産業ファンド投資法人	0.526	0.487	258,597	1.5
大和ハウスリート投資法人	0.523	—	—	—
アドバンス・レジデンス投資法人	1	1	554,388	3.3
ケネディクス・レジデンシャル投資法人	0.52	0.483	152,869	0.9
アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.894	0.92	511,520	3.0
GLP投資法人	3	3	504,437	3.0
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.704	0.71	182,470	1.1
日本プロロジスリート投資法人	2	2	629,213	3.7
星野リゾート・リート投資法人	0.116	0.226	137,182	0.8
SIA不動産投資法人	0.112	0.131	51,679	0.3
イオンリート投資法人	1	1	228,422	1.3
ビューリックリート投資法人	1	1	280,763	1.7
日本リート投資法人	0.584	0.542	153,657	0.9
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	0.808	1	111,685	0.7
日本ヘルスケア投資法人	0.111	0.103	18,117	0.1
積水ハウス・リート投資法人	1	1	185,152	1.1
トーセイ・リート投資法人	0.24	0.253	27,703	0.2
ケネディクス商業リート投資法人	0.53	0.584	160,600	0.9
ヘルスケア&メディカル投資法人	0.18	0.167	17,818	0.1
サムティ・レジデンシャル投資法人	0.243	0.391	34,017	0.2
ジャパン・シニアリビング投資法人	0.126	0.117	16,965	0.1
野村不動産マスターファンド投資法人	5	5	1,013,759	6.0
いちごホテルリート投資法人	0.206	0.356	46,315	0.3
ラサールロジポート投資法人	—	1	163,507	1.0
スターアジア不動産投資法人	—	0.477	47,366	0.3
マリモ地方創生リート投資法人	—	0.126	11,163	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	—	0.31	102,610	0.6
大江戸温泉リート投資法人	—	0.244	20,471	0.1
さくら総合リート投資法人	—	0.46	37,766	0.2
日本ビルファンド投資法人	2	1	1,268,800	7.5
ジャパンリアルエステイト投資法人	1	1	1,163,830	6.9
日本リテールファンド投資法人	3	3	855,187	5.0
オリックス不動産投資法人	3	3	641,462	3.8
日本プライムリアルティ投資法人	1	1	583,034	3.4
プレミア投資法人	1	1	239,097	1.4
東急リアル・エステート投資法人	1	1	192,517	1.1
グローバル・ワン不動産投資法人	0.289	0.268	116,580	0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人	4	4	762,854	4.5
森トラスト総合リート投資法人	1	1	329,960	1.9
インヴィンシブル投資法人	4	5	268,329	1.6
フロンティア不動産投資法人	0.739	0.686	348,488	2.1
平和不動産リート投資法人	1	1	121,920	0.7
日本ロジスティクスファンド投資法人	1	1	290,497	1.7

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	口 数	評 価 額	比 率
		千口	千口	千円	%
福岡リート投資法人	1	1	185,630		1.1
ケネディクス・オフィス投資法人	0.604	0.56	369,040		2.2
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	1	1	191,152		1.1
いちごオフィスリート投資法人	2	2	156,520		0.9
大和証券オフィス投資法人	0.721	0.688	399,040		2.3
阪急リート投資法人	0.891	0.826	126,212		0.7
スターツプロシード投資法人	0.259	0.355	55,025		0.3
トップリート投資法人	0.262	—	—		—
大和ハウスリート投資法人	1	2	596,190		3.5
ジャパン・ホテル・リート投資法人	4	5	405,157		2.4
日本賃貸住宅投資法人	2	2	187,934		1.1
ジャパンエクセレント投資法人	1	1	255,768		1.5
森ヒルズリート投資法人(新)	0.134	—	—		—
コンフォリア・レジデンシャル投資法人(新)	0.017	0.009	2,272		0.0
ヘルスケア&メディカル投資法人(新)	—	0.085	8,868		0.1
合 計	口 数 ・ 金 額	76	80	16,623,598	
	銘 柄 数 < 比 率 >	54	58	< 97.9% >	

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

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

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

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	百万円	百万円
不動産投信指数先物取引	391	—
東証REIT指数		

○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
投資証券	千円 16,623,598	% 97.6
コール・ローン等、その他	405,950	2.4
投資信託財産総額	17,029,548	100.0

○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	17,028,819,464
コール・ローン等	260,969,022
投資証券(評価額)	16,623,598,310
未収入金	907,888
未収配当金	126,081,744
差入委託証拠金	17,262,500
(B) 負債	45,614,140
未払金	16,272,500
未払解約金	29,341,270
未払利息	370
(C) 純資産総額(A-B)	16,983,205,324
元本	6,235,686,088
次期繰越損益金	10,747,519,236
(D) 受益権総口数	6,235,686,088口
1万口当たり基準価額(C/D)	27,236円

<注記事項>

- ①期首元本額 6,460,011,075円
 期中追加設定元本額 1,908,286,071円
 期中一部解約元本額 2,132,611,058円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.7236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 国内リートインデックス	4,507,090,853円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	948,051,651円
eMAXIS バランス(波乗り型)	168,337,454円
三菱UFJ <DC> J-REITインデックスファンド	936,645円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	88,294,746円
J-REITインデックスファンド(ラップ向け)	350,360,035円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	40,083,638円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	114,980,036円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	585,496円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	1,526,848円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	5,255,271円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	6,176,899円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	3,313,590円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	692,926円
合計	6,235,686,088円

【お知らせ】

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

(2016年3月2日)

○損益の状況 (2016年1月27日~2017年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	601,055,739
受取配当金	594,303,011
受取利息	11,017
その他収益金	6,869,164
支払利息	△ 127,453
(B) 有価証券売買損益	1,366,906,328
売買益	1,670,388,151
売買損	△ 303,481,823
(C) 先物取引等取引損益	51,149,188
取引益	87,839,044
取引損	△ 36,689,856
(D) 保管費用等	△ 341
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	2,019,110,914
(F) 前期繰越損益金	9,034,049,849
(G) 追加信託差損益金	3,178,524,395
(H) 解約差損益金	△ 3,484,165,922
(I) 計(E+F+G+H)	10,747,519,236
次期繰越損益金(I)	10,747,519,236

(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。

MUAM G-REITマザーファンド

《第11期》決算日2017年1月5日

[計算期間：2016年1月6日～2017年1月5日]

「MUAM G-REITマザーファンド」は、1月5日に第11期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

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

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

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

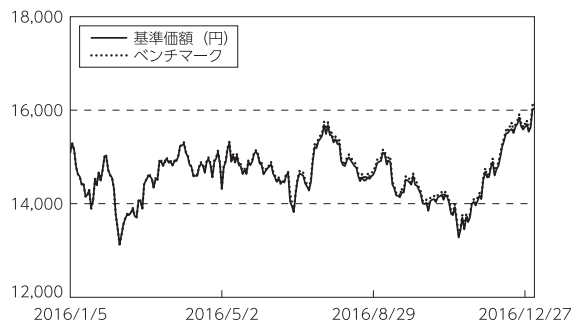
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(6.7%)を0.5%下回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国REIT市況（現地通貨ベース）

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

◎為替市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

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

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

◎売買コスト要因

売買コストによる影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

◎配当課税要因

配当課税による影響は $\Delta 0.5\%$ 程度でした。

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

◎為替評価要因

為替評価による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

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

◎その他の要因

その他の要因による影響は0.1%程度でした。

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

○今後の運用方針

- ・S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とし、同インデックスに連動する投資成果をめざして、運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年1月6日～2017年1月5日)

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2016年1月6日～2017年1月5日)

株式

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

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株式分割・増資割当および合併等による増減分です。

投資信託証券

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

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	1	15	1	19
GETTY REALTY CORP	0.8 (-)	14 (0.31014)	-	-
WELLTOWER INC	11	760	5	384
HIGHWOODS PROPERTIES INC	3	158	1	68
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	6	158	2	72
EQUITY COMMONWEALTH	2	69	1	50
INLAND REAL ESTATE CORP	-	-	-	-
			(12)	(136)
KILROY REALTY CORP	2	155	1	113
KITE REALTY GROUP TRUST	2	56	1	24
LEXINGTON REALTY TRUST	6	48	2	23
LTC PROPERTIES INC	1	83	0.55	25
MACK-CALI REALTY CORP	2	50	0.8	23
BOSTON PROPERTIES INC	4	540	2	316
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	18	254	4	51
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1 (6)	185 (513)	1	145
NATL HEALTH INVESTORS INC	1	137	0.6	44
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	9	310	2	72
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0.5	11	-	-
PARKWAY PROPERTIES INC	1 (△ 12)	18 (△ 191)	-	-
PENN REAL ESTATE INVEST TST	2	52	1	19
POST PROPERTIES INC	1 (△ 8)	79 (△ 513)	-	-
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	1	32	-	-
REALTY INCOME CORP	7	474	3	205
REGENCY CENTERS CORP	4	315	1	97
SAUL CENTERS INC	0.3	20	0.3	19
SENIOR HOUSING PROP TRUST	6	111	3	60
SL GREEN REALTY CORP	2	259	1	138
LIFE STORAGE INC	2	273	0.65	55
SUN COMMUNITIES INC	3	210	0.82	61
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	6 (0.875)	76 (9)	3	54
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	2	94	1	63
TAUBMAN CENTERS INC	1	104	0.75	55
CUBESMART	5	174	2	69
UDR INC	8	304	4	142
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.36	18	-	-
URSTADT BIDDLE - CLASS A	1	20	-	-
VENTAS INC	11	740	4	301
WASHINGTON REIT	3	85	0.8	25
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	3	140	1	58
HERSHA HOSPITALITY TRUST	0.8	17	0.9	18

外

国

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
PS BUSINESS PARKS INC/CA	0.566	51	0.2	22
UMH PROPERTIES INC	1	16	1	18
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1	14	—	—
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	3	39	1	20
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5	179	2	59
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5	62	1	21
WINTHROP REALTY TRUST	—	—	5	46
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	2	95	1	51
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2	16	—	—
DOUGLAS EMMETT INC	4	130	1	69
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	3	125	1	46
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1	37	0.8	25
CHESAPEAKE LODGING TRUST	1	37	0.8	21
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	3	57	2	43
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	9	303	1	58
CORESITE REALTY CORP	1	109	0.55	40
CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	—	—	—	—
			(9)	(64)
AMERICAN ASSETS TRUST INC	1	42	0.5	21
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	3	38	1	24
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	2	33	1	22
RLJ LODGING TRUST	3	56	1	29
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	4	85	1	21
ROUSE PROPERTIES INC	0.933	16	—	—
			(5)	(86)
STAG INDUSTRIAL INC	1	38	—	—
SABRA HEALTH CARE REIT INC	1	28	0.9	21
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	6	105	4	65
SELECT INCOME REIT	1	33	0.82	19
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	5	150	1	31
WP CAREY INC	3	238	1	73
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1	63	0.82	52
CHATHAM LODGING TRUST	0.9	18	—	—
TERRENO REALTY CORP	1	45	0.9	25
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	1	13	—	—
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	19	215	6	74
CORECIVIC INC	2	86	0.9	22
GEO GROUP INC/THE	2	74	1	41
VEREIT INC	33	311	13	115
DUKE REALTY CORP	10	238	4	121
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	3	38	1	18
AMERICAN RESIDENTIAL PROPERT	—	—	—	—
	(△ 4)	(△ 84)		
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	3	65	1	24
PHYSICIANS REALTY TRUST	10	188	1	22

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	9 (5)	191 (84)	3	72
GRAMERCY PROPERTY TRUST	11 (△ 41)	92 (-)	6	53
CYRUSONE INC	2	122	1	44
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	1	15	1	20
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	4	86	2	45
QTS REALTY TRUST INC-CL A	2	125	0.8	38
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	18	502	2	63
COLONY STARWOOD HOMES	2	76	0.76	21
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	3	79	1	27
WASHINGTON PRIME GROUP INC	5	57	2	22
CARETRUST REIT INC	3	43	-	-
NEW YORK REIT INC	6	59	4	39
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	1	15	-	-
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18	604	2	73
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	6	52	-	-
IRON MOUNTAIN INC	14	492	3	127
STORE CAPITAL CORP	15	404	1	32
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	1	17	2	21
URBAN EDGE PROPERTIES	2	60	1	32
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	2	45	1	20
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	4	38	2	21
XENIA HOTELS & RESORTS INC	2	33	1	24
NORTHSTAR REALTY FINANCE	6	71	4	67
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1	41	-	-
NEXPOINT RESIDENTIAL	1	15	1	24
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	2	56	0.8	18
APPLE HOSPITALITY REIT INC	3	72	2	42
GLOBAL NET LEASE INC	4	33	2	19
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	1	14	1	23
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1	82	-	-
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	4 (1)	76 (30)	2	49
FOREST CITY REALTY TRUST- A	3 (32)	66 (575)	3	64
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1	32	-	-
FARMLAND PARTNERS INC	1	20	-	-
MANULIFE US REAL ESTATE INV	90	74	-	-
TIER REIT INC	7	123	-	-
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	10	18	-	-
PARKWAY INC	- (6)	- (-)	-	-
QUALITY CARE PROPERTIES	- (15)	- (-)	1	22
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3	31	-	-

外

国

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
EQUITY RESIDENTIAL	10	774	6	384
FELCOR LODGING TRUST INC	4	28	2	22
GENERAL GROWTH PROPERTIES	17	467	10	262
HOST HOTELS & RESORTS INC	21	321	13	245
ISTAR INC	11	127	1	22
LIBERTY PROPERTY TRUST	3	128	1	70
LASALLE HOTEL PROPERTIES	3	76	1	55
PUBLIC STORAGE	4	1,091	2	506
SIMON PROPERTY GROUP INC	9	1,826	4	891
VORNADO REALTY TRUST	4	450	3	355
KIMCO REALTY CORP	12	336	5	150
AVALONBAY COMMUNITIES INC	4	711	2	385
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	4	172	2	95
小 計	861 (21)	26,194 (615)	313 (56)	11,605 (955)
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	0.6	25	—	—
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	1	51	0.9	28
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1	55	0.7	21
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	1	47	0.6	27
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	3	48	—	—
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1	20	—	—
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3	65	1	24
INNVEST REAL ESTATE INVESTME	4	20	—	—
			(11)	(57)
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	1	21	1	26
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	1	21	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5	130	2	53
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	1	51	0.8	28
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2	30	2	24
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	1	27	—	—
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	3	28	2	25
ONEREIT	7	22	6	23
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	0.6	22	—	—
MILESTONE APARTMENTS REAL ES	9	151	7	134
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	6	35	4	24
CHOICE PROPERTIES REIT	2	26	2	26
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1	22	—	—
PLAZA RETAIL REIT	5	26	5	23
SLATE RETAIL REIT - U-RTS	—	—	2	0.09745
	(2)	(—)		
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	5	51	—	—
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	2	21	—	—
SLATE OFFICE REIT	3	26	—	—
小 計	75 (2)	1,055 (—)	40 (11)	491 (57)

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

外 国

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

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
ASSURA PLC	44	24	27	15
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	19	11	—	—
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	31	35	15	16
REGIONAL REIT LTD	23	24	24	25
CAPITAL & REGIONAL PLC	75	48	—	—
NEWRIVER REIT PLC	37	120	3	11
小 計	636	1,673	193	650
オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
VICINITY CENTRES	92	280	48	141
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	3	24	3	24
ABACUS PROPERTY GROUP	7	21	—	—
INGENIA COMMUNITIES GROUP	10	30	7	20
ALE PROPERTY GROUP	5	24	5	20
CHARTER HALL GROUP	24	119	6	30
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	8	17	—	—
GALILEO JAPAN TRUST	—	—	15	40
CROMWELL PROPERTY GROUP	24	23	—	—
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	21	44	11	25
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	8	25	7	23
NATIONAL STORAGE REIT	45	70	16	23
GDI PROPERTY GROUP	23	22	24	23
INDUSTRIA REIT	10	21	—	—
SCENTRE GROUP	147	661	80	354
ARENA REIT	10	19	—	—
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	7	18	—	—
GENERATION HEALTHCARE REIT	23	50	—	—
VIVA ENERGY REIT	66	147	—	—
CHARTER HALL LONG WALE REIT	23	93	—	—
GPT GROUP	46	229	26	131
MIRVAC GROUP	117	230	62	127
STOCKLAND	58	255	29	131
WESTFIELD CORP	53	530	28	262
DEXUS PROPERTY GROUP	22	179	12	111
BWP TRUST	13	44	8	23
INVESTA OFFICE FUND	16	68	5	22
CHARTER HALL RETAIL REIT	9	39	6	25
GOODMAN GROUP	38	254	19	134
小 計	937	3,550	424	1,700
ニュージーランド		千ニュージーランドドル		千ニュージーランドドル
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	16	36	13	26
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR-RTS	—	—	9	0.29558
	(9)	(—)		
KIWI PROPERTY GROUP LTD	43	58	—	—
GOODMAN PROPERTY TRUST	22	28	17	21
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	15	24	16	25

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

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	44 (-)	70 (△0.07522)	20	32
CACHE LOGISTICS TRUST	26 (-)	22 (△0.53467)	-	-
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	105	157	19	28
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	36	23	-	-
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	35	22	-	-
SABANA SHARIAH COMP IND REIT-RTS	- (46)	- (-)	-	-
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	- (-)	- (△ 1)	-	-
MAPLETREE GREATER CHINA COMM	57 (-)	53 (△ 4)	30	28
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	- (-)	- (△ 1)	-	-
OUE HOSPITALITY TRUST	84	57	39	24
OUE HOSPITALITY TRUST-RTS	- (37)	- (-)	37	4
SPH REIT	20	19	20	19
FRASERS HOSPITALITY TRUST	- (-)	- (△ 2)	92	64
KEPPEL DC REIT	80	94	79	93
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	165 (-)	156 (△ 3)	-	-
CAPITALAND MALL TRUST	77	160	44	86
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	82 (-)	198 (△0.77017)	27	64
小 計	1,359 (84)	1,643 (△ 49)	663	706
イスラエル		千イスラエルシケル		千イスラエルシケル
REIT 1 LTD	6	64	-	-
小 計	6	64	-	-

(注) 金額は受渡代金。

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

○株式売買比率

(2016年1月6日～2017年1月5日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	65,441千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	—千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	—

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年1月6日～2017年1月5日)

利害関係人との取引状況

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

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

○組入資産の明細

(2017年1月5日現在)

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
DDR CORP	41	45	704	82,110	0.4
HCP INC	63	68	2,100	244,778	1.3
MACERICH CO/THE	18	17	1,288	150,185	0.8
ACADIA REALTY TRUST	9	11	400	46,635	0.2
AGREE REALTY CORP	2	3	177	20,708	0.1
ALEXANDER'S INC	0.51	0.5	219	25,573	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9	11	1,337	155,943	0.8
PROLOGIS INC	71	78	4,199	489,520	2.6
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	15	19	980	114,292	0.6
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12	12	95	11,128	0.1
BIOMED REALTY TRUST INC	27	—	—	—	—
BRANDYWINE REALTY TRUST	23	26	449	52,347	0.3
CAMDEN PROPERTY TRUST	11	12	1,095	127,732	0.7
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	20	25	302	35,217	0.2
CEDAR REALTY TRUST INC	10	10	73	8,544	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	18	21	980	114,230	0.6
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	12	14	447	52,180	0.3
COUSINS PROPERTIES INC	28	52	447	52,178	0.3
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	26	29	353	41,217	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	19	23	2,405	280,373	1.5
EASTGROUP PROPERTIES INC	4	4	367	42,868	0.2
EDUCATION REALTY TRUST INC	7	11	463	53,982	0.3
EPR PROPERTIES	8	9	681	79,410	0.4
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	10	12	866	100,976	0.5
EQUITY ONE INC	10	14	438	51,144	0.3
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8	9	2,234	260,482	1.4
EXTRA SPACE STORAGE INC	16	18	1,448	168,855	0.9
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9	10	1,525	177,802	0.9
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	14	17	490	57,224	0.3
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	8	7	88	10,326	0.1
GETTY REALTY CORP	3	4	105	12,304	0.1
WELLTOWER INC	48	53	3,572	416,357	2.2
HIGHWOODS PROPERTIES INC	12	14	780	90,992	0.5
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	20	24	786	91,626	0.5
EQUITY COMMONWEALTH	17	18	571	66,655	0.4
INLAND REAL ESTATE CORP	12	—	—	—	—
KILROY REALTY CORP	12	13	1,005	117,159	0.6
KITE REALTY GROUP TRUST	11	12	298	34,775	0.2
LEXINGTON REALTY TRUST	27	31	353	41,197	0.2
LTC PROPERTIES INC	4	5	282	32,942	0.2

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
MACK-CALI REALTY CORP	11	13	391	45,636	0.2
BOSTON PROPERTIES INC	20	22	2,993	348,909	1.8
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	32	47	586	68,369	0.4
MID-AMERICA APARTMENT COMM	10	16	1,659	193,403	1.0
NATL HEALTH INVESTORS INC	4	5	444	51,864	0.3
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	22	29	937	109,332	0.6
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1	2	58	6,830	0.0
PARKWAY PROPERTIES INC	11	—	—	—	—
PENN REAL ESTATE INVEST TST	9	—	212	24,815	0.1
POST PROPERTIES INC	7	—	—	—	—
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	10	12	211	24,672	0.1
REALTY INCOME CORP	33	38	2,227	259,645	1.4
REGENCY CENTERS CORP	12	15	1,080	125,960	0.7
SAUL CENTERS INC	1	1	110	12,925	0.1
SENIOR HOUSING PROP TRUST	31	34	673	78,524	0.4
SL GREEN REALTY CORP	13	15	1,661	193,654	1.0
LIFE STORAGE INC	4	6	587	68,501	0.4
SUN COMMUNITIES INC	7	9	757	88,259	0.5
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	28	31	495	57,758	0.3
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	13	14	521	60,828	0.3
TAUBMAN CENTERS INC	8	8	679	79,256	0.4
CUBESMART	23	26	717	83,586	0.4
UDR INC	35	39	1,441	168,005	0.9
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1	1	131	15,379	0.1
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3	4	110	12,853	0.1
VENTAS INC	45	52	3,276	381,873	2.0
WASHINGTON REIT	8	11	370	43,159	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	15	17	636	74,182	0.4
HERSHA HOSPITALITY TRUST	6	6	137	16,001	0.1
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2	2	345	40,295	0.2
UMH PROPERTIES INC	2	3	48	5,606	0.0
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2	3	73	8,603	0.0
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	8	9	147	17,184	0.1
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	13	16	521	60,736	0.3
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	12	15	210	24,528	0.1
WINTHROP REALTY TRUST	5	—	—	—	—
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	12	13	648	75,571	0.4
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	16	19	138	16,113	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	19	21	803	93,614	0.5
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	8	11	507	59,206	0.3
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	10	10	329	38,418	0.2
CHESAPEAKE LODGING TRUST	8	8	231	26,997	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	20	21	452	52,704	0.3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	9	17	634	74,002	0.4
CORESITE REALTY CORP	4	5	420	48,971	0.3

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	9	—	—	—	—
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5	5	259	30,227	0.2
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	11	13	211	24,683	0.1
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	9	10	203	23,706	0.1
RLJ LODGING TRUST	17	18	471	54,986	0.3
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	13	16	350	40,801	0.2
ROUSE PROPERTIES INC	5	—	—	—	—
STAG INDUSTRIAL INC	9	11	271	31,666	0.2
SABRA HEALTH CARE REIT INC	9	9	241	28,203	0.1
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	32	34	542	63,282	0.3
SELECT INCOME REIT	8	9	238	27,784	0.1
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	17	21	634	73,948	0.4
WP CAREY INC	13	15	966	112,665	0.6
WHITESTONE REIT	4	4	57	6,711	0.0
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7	7	469	54,709	0.3
CHATHAM LODGING TRUST	5	6	125	14,637	0.1
TERRENO REALTY CORP	5	6	196	22,881	0.1
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	4	5	96	11,199	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	59	71	791	92,232	0.5
CORECIVIC INC	15	17	441	51,413	0.3
GEO GROUP INC/THE	9	11	413	48,174	0.3
VEREIT INC	123	144	1,261	147,018	0.8
DUKE REALTY CORP	47	53	1,446	168,578	0.9
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	3	5	77	9,012	0.0
AMERICAN RESIDENTIAL PROPERT	4	—	—	—	—
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	7	9	236	27,536	0.1
PHYSICIANS REALTY TRUST	11	20	390	45,516	0.2
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	20	32	672	78,371	0.4
GRAMERCY PROPERTY TRUST	56	20	583	67,996	0.4
CYRUSONE INC	9	10	516	60,173	0.3
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	3	3	46	5,395	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	16	18	380	44,346	0.2
QTS REALTY TRUST INC-CL A	5	7	370	43,174	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	22	38	970	113,079	0.6
COLONY STARWOOD HOMES	5	7	209	24,413	0.1
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	16	18	412	48,088	0.3
WASHINGTON PRIME GROUP INC	24	28	306	35,742	0.2
CARETRUST REIT INC	5	9	146	17,105	0.1
NEW YORK REIT INC	22	24	244	28,499	0.2
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	2	3	55	6,435	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	12	28	910	106,133	0.6
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	3	9	88	10,329	0.1
IRON MOUNTAIN INC	25	36	1,231	143,556	0.8
STORE CAPITAL CORP	9	23	588	68,598	0.4
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12	11	121	14,106	0.1

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
URBAN EDGE PROPERTIES	12	13	389	45,447	0.2	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	1	3	67	7,881	0.0	
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	22	24	269	31,374	0.2	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	14	15	311	36,287	0.2	
NORTHSTAR REALTY FINANCE	25	27	443	51,645	0.3	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3	5	117	13,736	0.1	
NEXPOINT RESIDENTIAL	2	2	55	6,519	0.0	
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	11	12	315	36,810	0.2	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	21	22	466	54,347	0.3	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	2	2	39	4,610	0.0	
GLOBAL NET LEASE INC	23	24	196	22,888	0.1	
CITY OFFICE REIT INC	2	2	36	4,198	0.0	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	7	7	98	11,539	0.1	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1	3	153	17,854	0.1	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	5	8	176	20,577	0.1	
FOREST CITY REALTY TRUST- A	—	32	670	78,137	0.4	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	—	1	41	4,882	0.0	
FARMLAND PARTNERS INC	—	1	20	2,366	0.0	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	—	90	75	8,759	0.0	
TIER REIT INC	—	7	133	15,591	0.1	
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	—	10	18	2,124	0.0	
PARKWAY INC	—	6	146	17,063	0.1	
QUALITY CARE PROPERTIES	—	13	216	25,196	0.1	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	—	3	34	4,059	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL	49	54	3,489	406,721	2.1	
FELCOR LODGING TRUST INC	16	18	150	17,530	0.1	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	79	86	2,238	260,881	1.4	
HOST HOTELS & RESORTS INC	101	109	2,110	246,015	1.3	
ISTAR INC	—	10	128	14,971	0.1	
LIBERTY PROPERTY TRUST	19	22	894	104,283	0.6	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	15	16	522	60,913	0.3	
PUBLIC STORAGE	19	22	4,988	581,502	3.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	41	46	8,558	997,570	5.3	
VORNADO REALTY TRUST	24	25	2,745	320,039	1.7	
KIMCO REALTY CORP	56	62	1,625	189,469	1.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	18	20	3,616	421,521	2.2	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	20	23	1,046	121,958	0.6	
小 計	口 数 ・ 金 額	2,674	3,186	117,906	13,743,140	
	銘柄 数 < 比 率 >	157	159	—	<72.5%>	
(カナダ)				千カナダドル		
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2	3	174	15,313	0.1	
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	8	9	306	26,878	0.1	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8	9	304	26,708	0.1	
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	4	5	238	20,936	0.1	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	10	13	203	17,869	0.1	

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

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

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

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

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

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

○投資信託財産の構成

(2017年1月5日現在)

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

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

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年1月5日現在)

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

<注記事項>

- ①期首元本額 10,718,844,576円
 期中追加設定元本額 2,954,569,904円
 期中一部解約元本額 1,859,096,192円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.6039円です。

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

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

[お知らせ]

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

(2016年3月2日)

○損益の状況 (2016年1月6日~2017年1月5日)

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

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 (注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

コモディティマザーファンド

《第2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]

「コモディティマザーファンド」は、1月26日に第2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2期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	主として世界の商品（コモディティ）市況全体の値動きを対象とするS&P GSCI商品指数 [®] エネルギー&メタル・キャップド・コンポーネント35/20・THEAM・イージーUCITS・ETF（クラスA米ドル建受益証券）に投資を行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	世界の商品（コモディティ）市況全体の値動きを対象とする有価証券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割合に制限を設けません。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 騰 落 中 率		投 資 信 託 純 資 産 額	託 券 率	純 資 産 額
		期 騰 落	中 率			
(設定日)	円		%		%	百万円
2015年1月30日	10,000		—		—	99
1期(2016年1月26日)	7,342		△26.6		98.8	621
2期(2017年1月26日)	8,924		21.5		98.9	302

(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、世界の商品（コモディティ）市況全体の値動きを概ねとらえることをめざしますが、特定の指数を上回るまたは運動をめぐ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) 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	騰 落 率		投 資 信 託 組 入 比	託 券 率
	(期 首)		円		%		%
	2016年1月26日		7,342		—		98.8
	1月末		7,823		6.6		99.2
	2月末		7,334	△	0.1		99.1
	3月末		7,641		4.1		99.1
	4月末		7,833		6.7		99.0
	5月末		7,924		7.9		98.9
	6月末		7,818		6.5		98.9
	7月末		7,490		2.0		99.1
	8月末		7,648		4.2		99.1
	9月末		7,560		3.0		99.2
	10月末		7,872		7.2		99.2
	11月末		8,429		14.8		99.1
	12月末		9,159		24.7		99.2
	(期 末)						
	2017年1月26日		8,924		21.5		98.9

(注) 騰落率は期首比。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ21.5%の上昇となりました。

基準価額の推移



●投資環境について

◎商品市況

・2016年11月の石油輸出国機構（OPEC）総会で8年ぶりの原油減産が合意されたことや非OPEC主要産油国も協調減産を表明したことなどを受けて、WTI原油先物市況などが期首に比べて上昇しました。また、欧米経済指標の改善や中国の公共投資拡大観測を背景に工業用金属需要が増大するとの期待が高まったことなどを好感して、銅などが期首に比べて上昇しました。

・為替市況は、期首に比べて4.2%の円高・米ドル安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

・期を通じて世界の商品市況全体の値動きを対象とする上場投資信託証券（ETF）を高位に組み入れました。期末時点でのS&P GSCI商

- 品指数[®]エネルギー&メタル・キャップド・コンポーネント35/20・THEAM・イージーUCITS・ETF（クラスA米ドル建受益証券）の組入比率は、98.9%としています。
- ・当期は、保有するETF（米ドルベース）が上昇したことなどをを受けて基準価額は上昇しました。

○今後の運用方針

- ・米ドル建てのETFであるS&P GSCI商品指数[®]エネルギー&メタル・キャップド・コンポーネント35/20・THEAM・イージーUCITS・ETF（クラスA米ドル建受益証券）の組入比率を高位に維持する方針です。

○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) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券)	円 12 (12)	% 0.152 (0.152)	(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 (保 管 費 用) (そ の 他)	12 (12) (0)	0.150 (0.148) (0.002)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	24	0.302	
期中の平均基準価額は、7,877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)

投資信託証券

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
S&P GSCI商品指数 [®] エネルギー&メタル・ キャップド・コンポーネント35/20・THEAM・ イージークラスA米ドル建受益証券	105	2,667	236	6,470

(注) 金額は受渡代金。

○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 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
為替直物取引	300	193	64.3	701	441	62.9

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

○組入資産の明細

(2017年1月26日現在)

外国投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ) S&P GSCI商品指数®エネルギー&メタル・キャップド・コンポーネント35/20・ THEAM・イージーUCITS・ETF (クラスA米ドル建受益証券)	千口 217	千口 86	千アメリカドル 2,640	千円 298,759	% 98.9
合 計	口 数 ・ 金 額 217	86	2,640	298,759	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	< 98.9% >	

(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) 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。

【ETF (上場投資信託) の概要】

ETFの直近の入手しうるアニュアルレポート等から抜粋して作成しています。

ファンド名	S&P GSCI商品指数®エネルギー&メタル・キャップド・コンポーネント35/20・THEAM・イージーUCITS・ETF (クラスA米ドル建受益証券)
内 容	「S&P GSCI商品指数®エネルギー&メタル・キャップド・コンポーネント35/20 トータル・リターン指数」をベンチマークとし、それと同等のリターンを達成することを目的とするETFです。
ベンチマーク	S&P GSCI商品指数®エネルギー&メタル・キャップド・コンポーネント35/20 トータル・リターン指数
決 算 月	12月

ETFの対象指数について

- S&P GSCI商品指数®エネルギー&メタル・キャップド・コンポーネント35/20 トータル・リターン指数

S&P GSCI商品指数®エネルギー&メタル・キャップド・コンポーネント35/20 トータル・リターン指数は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表する、世界的商品(コモディティ)市況の総合的な動きを表すインデックスです。S&P GSCI商品指数®の構成要素のウェイトとの継続性及びその比率を維持しつつ、四半期ごとにウェイトの最も高い構成要素の上限を35%に制限し、残りの構成要素の上限を20%に制限します。ウェイトの上限を超えた部分は、残りの構成要素に比例配分します。

S&P GSCI® ENERGY & METALS CAPPED COMPONENT 35/20 THEAM Easy UCITS ETF
 (旧名称: S&P GSCI® CAPPED COMPONENT 35/20 THEAM Easy UCITS ETF)

【運用計算書および剰余金計算書】

(2015年1月1日～2015年12月31日)

	米ドル
投資収入および資産	57,487
マネジメント費用	782,078
支払利息	150
その他費用	469,237
保管費用	—
管理費用	—
費用合計	1,251,465
投資純収入	(1,192,978)
実現純利益（損失）:	
投資有価証券	16,776
金融商品	(95,617,830)
実現純利益（損失）	(96,794,032)
未実現評価益（評価損）の純変動:	
投資有価証券	—
金融商品	18,556,511
運用による純資産の増減額	(78,237,521)
設定（償還）	16,453,604
期末時点での純資産の増減額	(61,783,917)
純資産期首	276,850,461
純資産期末	215,066,544

【組入投資有価証券上位10銘柄】

2015年12月31日現在

銘柄	組入比率
UNITED STATES TREASURY BILL 0% 18/02/2016	13.95%
UNITED STATES TREASURY BILL 0% 11/02/2016	13.94
UNITED STATES TREASURY BILL 0% 10/03/2016	13.01
UNITED STATES TREASURY BILL 0% 03/03/2016	11.15
UNITED STATES TREASURY BILL 0% 14/01/2016	10.69
UNITED STATES TREASURY BILL 0% 24/03/2016	10.23
UNITED STATES TREASURY BILL 0% 17/03/2016	9.76
UNITED STATES TREASURY BILL 0% 25/02/2016*	9.30
UNITED STATES TREASURY BILL 0% 04/02/2016	0.93
—	—

○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
投資証券	千円 298,759	% 98.5
コール・ローン等、その他	4,465	1.5
投資信託財産総額	303,224	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (298,803千円) の投資信託財産総額 (303,224千円) に対する比率は98.5%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		
------------------	--	--

○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	304,435,408
コール・ローン等	4,465,248
投資証券(評価額)	298,759,562
未収入金	1,210,598
(B) 負債	2,419,357
未払金	2,419,353
未払利息	4
(C) 純資産総額(A-B)	302,016,051
元本	338,417,729
次期繰越損益金	△ 36,401,678
(D) 受益権総口数	338,417,729口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,924円

<注記事項>

- ①期首元本額 846,851,120円
 期中追加設定元本額 415,218,628円
 期中一部解約元本額 923,652,019円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.8924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)

ワールド・コモディティ・オープン(ラップ向け)	267,410,457円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	20,827,482円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	50,179,790円
合計	338,417,729円

③純資産総額が元本額を下回っており、その差額は36,401,678円です。

[お知らせ]

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

○損益の状況 (2016年1月27日～2017年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 4,442
受取利息	506
支払利息	△ 4,948
(B) 有価証券売買損益	85,724,734
売買益	139,150,581
売買損	△ 53,425,847
(C) 保管費用等	△ 706,492
(D) 当期損益金(A+B+C)	85,013,800
(E) 前期繰越損益金	△225,125,362
(F) 追加信託差損益金	△104,495,334
(G) 解約差損益金	208,205,218
(H) 計(D+E+F+G)	△ 36,401,678
次期繰越損益金(H)	△ 36,401,678

(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。

日本株マーケットニュートラル・マザーファンド

《第25期》決算日2016年8月24日

〔計算期間：2016年2月25日～2016年8月24日〕

「日本株マーケットニュートラル・マザーファンド」は、8月24日に第25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25期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	割安度、成長性といった投資尺度の中から、計量モデルを用いて決定された最適と推測される投資尺度により株式への投資を行います。同時に株式の信用取引等を活用することにより株式市場の価格変動リスクの低減を図りつつ、安定した収益の確保をめざして運用を行います。無担保コール翌日物レート（指数化）をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。
主要運用対象	わが国の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		無担保コール翌日物レート(指数化)		株式組入比率	信用取引率	株式先物比率	純資産総額
	円	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率				
21期(2014年8月25日)	13,053	△2.2	101.81	0.0	82.2	△82.1	—	1,256
22期(2015年2月24日)	13,215	1.2	101.84	0.0	80.5	△80.4	—	1,576
23期(2015年8月24日)	13,625	3.1	101.88	0.0	69.3	△69.1	—	2,118
24期(2016年2月24日)	13,745	0.9	101.91	0.0	84.9	△84.9	—	3,790
25期(2016年8月24日)	13,379	△2.7	101.89	△0.0	80.3	△80.0	—	4,244

(注) 無担保コール翌日物レートとは、金融機関同士が短期資金の貸借を行うコール市場において、翌日返済とした無担保取引の際の金利をいいます。無担保コール翌日物レート（指数化）は無担保コール翌日物レートをもとに委託会社が計算したものです。

(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		無 担 保 日 物 レー	コ ー ル ト (指 数 化)	株 組 入 比 率	信 用 取 引 率 比	株 先 物 比 率
	騰 落 率			騰 落 率			
(期 首) 2016年 2月24日	円	%	101.91	%	%	%	%
2月 末	13,745	—	101.91	—	84.9	△84.9	—
3月 末	13,761	0.1	101.91	△0.0	85.7	△85.6	—
4月 末	13,817	0.5	101.91	△0.0	82.0	△81.8	—
5月 末	13,757	0.1	101.91	△0.0	79.1	△79.2	—
6月 末	13,629	△0.8	101.91	△0.0	81.8	△81.6	—
7月 末	13,654	△0.7	101.90	△0.0	78.1	△77.9	—
(期 末) 2016年 8月24日	13,506	△1.7	101.90	△0.0	82.1	△81.9	—
	13,379	△2.7	101.89	△0.0	80.3	△80.0	—

(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

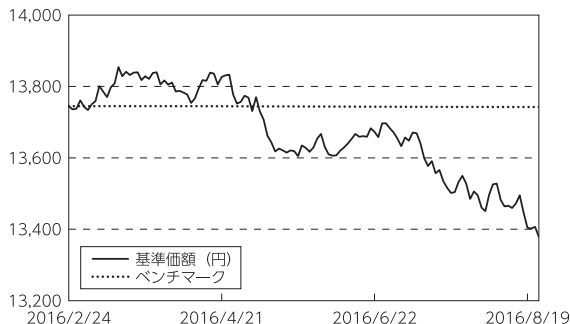
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.7%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−0.0%)を2.7%下回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内株式市況

- ・期首から2016年5月下旬にかけては、原油価格の上昇に加え、米国の経済統計が総じて堅調な内容であったことなどを背景に世界経済の先行きに対する過度な警戒感が徐々に後退し、国内株式市況は上昇しました。
- ・6月上旬から7月初旬にかけては、英国におけるEU（欧州連合）からの脱退の是非を問う国民投票に対する懸念の広がり、また投票の結果、脱退票が過半数を占め、今後の世界経済や政治の秩序が不安定になるとの見方が強まったことなどを背景に、国内株式市況は下落しました。
- ・7月中旬から期末にかけては、参議院選挙での与党の勝利を受けた経済対策への期待の高まりに加えて、日銀の金融政策決定会合においてマイナス金利幅の拡大が見送られたことにより金融機関の業績への懸念が後退したことやETF（上場投資信託）買い入れ増額によって株式市場が下支えされるとの見方などから、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

- ・わが国の株式を主要投資対象とし、割安度、成長性といった投資尺度の中から、計量モデルを用いて決定された最適と推測される投資尺度により株式への投資を行い、同時に株式の信用取引等を活用することにより株式市場の価格変動リスクの低減を図りつつ、ベンチマーク（無担保コール翌日物レート（指数化））を中長期的に上回る投資成果をめざして運用を行いました。当期は、計量モデルによって導き出された結果が妥当と判断し、前半は中小型株を中心にフローバリューファクター（企業収益に対して株価が割安な銘柄に投資する戦略）、ストックバリューファクター（企業の資産価値に対して株価が割安な銘柄に投資する戦略）への投資ウェイトを高めたポートフォリオの構築を行い、後半はフローバリューファクターやストックバリューファクターのウェイトを抑制する一方で長期グロースファクター（企業収益等の過去の成長率が高い銘柄に投資する戦略）やリターンリバーサルファクター（過去株価が下落した銘柄の株価が、その後反転し上昇する傾向に着目した戦略）、クレジットファクター（企業の財務健全性が高い銘柄に投資する戦略）への投資ウェイトを高めたポートフォリオの構築を行いました。
- ・組入比率は、期を通じてロングとショートそれぞれの組入比率を、純資産総額に対して概ね70～90%程度で推移させ、ロングとショート of 金額をほぼ同等とした結果、株式市況が上昇・下落することによる基準価額への影響をほぼ排除することができました。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ファンドの騰落率は、ベンチマーク（無担保コール翌日物レート（指数化））の騰落率（-0.0%）を2.7%下回りました。

- ・期首から2016年4月下旬までは、リターンリバーサルファクターや長期グロースファクターがプラスに寄与するなどファクター戦略が有効に機能した結果、基準価額は上昇しました。5月初旬以降は、中小型株を中心にクレジットファクターやリビジョンファクター（利益予想などの変化が相対的に高い銘柄に投資する戦略）などがマイナスに影響するなどファクター戦略が有効に機能しなかったことに加え、個別銘柄要因（ファクター要因以外の銘柄固有の要因）がマイナスに影響したことから、基準価額は下落しました。期を通じてみるとリターンリバーサルファクターやストックバリューファクターなどがプラスに寄与したものの、フローバリューファクターやリビジョンファクター、クレジットファクターなどがマイナスに影響しファクター戦略が有効に機能しなかったことに加え、個別銘柄要因がマイナスに影響した結果、基準価額は下落し、ベンチマークを下回りました。

○今後の運用方針

- ・信用取引等の活用により、わが国の株式市場全体の上昇・下落に左右されない安定的な収益の確保をめざします。

○1万口当たりの費用明細

(2016年2月25日～2016年8月24日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	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 (信 用 取 引) (そ の 他)	161 (161) (0)	1.179 (1.179) (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 株式信用取引に要する品貸料、配当調整金の支払い等 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	161	1.179	
期中の平均基準価額は、13,687円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2016年2月25日～2016年8月24日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		8,164 (△ 5)	7,308,334 (-)	8,461	7,181,213

(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。

○株式売買比率

(2016年2月25日～2016年8月24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	14,489,547千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,475,767千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	4.16

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年2月25日～2016年8月24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8月24日現在)

国内株式

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.4%)			
マルハニチロ	—	5	12,470
鉱業 (1.1%)			
日鉄鉱業	25	35	12,215
国際石油開発帝石	12	17	15,046
石油資源開発	4	5	11,165
建設業 (6.8%)			
ミライト・ホールディングス	15	13	11,219
ミサワホーム	18	18	13,140
高松コンストラクショングループ	5.5	5	11,850
清水建設	—	15	14,250
長谷工コーポレーション	—	9	8,964
松井建設	17	6	6,726
銭高組	25	—	—
鹿島建設	16	—	—
三井住友建設	—	140	13,300

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ナカノフドー建設	—	20	7,880
東鉄工業	—	5	14,315
イチケン	38	—	—
青木あすなろ建設	—	10	6,350
矢作建設工業	—	15	14,235
東亜道路工業	30	—	—
東亜建設工業	47	—	—
若築建設	100	—	—
大林道路	—	15	9,585
日本基礎技術	28	36	11,808
日成ビルド工業	—	30	13,650
大和ハウス工業	4	—	—
積水ハウス	—	9	14,872
日特建設	28	—	—
北陸電気工事	15	—	—
東京エネシス	12	—	—

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
住友電設	—	5	5	5,415
NDS	40	5	5	1,235
日揮	7	9	9	14,292
明星工業	30	20	20	8,800
ダイダシ	17	7	7	5,509
東芝プラントシステム	—	8	8	13,976
東洋エンジニアリング	48	—	—	—
新興ブランテック	—	16	16	11,168
食料品 (3.6%)				
三井製糖	18	—	—	—
不二家	—	30	30	5,940
寿スピリッツ	—	5	5	11,530
カルビー	—	3.5	3.5	14,420
森永乳業	19	—	—	—
六甲バター	6	3	3	7,275
ヤクルト本社	—	3	3	14,355
雪印メグミルク	3.8	—	—	—
プリマハム	35	—	—	—
日本ハム	—	6	6	13,734
S Foods	4	5	5	12,930
ダイドードリンコ	1.6	—	—	—
日清オイリオグループ	—	30	30	13,230
不二製油グループ本社	5	—	—	—
ハウス食品グループ本社	—	6	6	13,752
エバラ食品工業	5.5	3	3	5,544
東洋水産	2.7	—	—	—
日清食品ホールディングス	2	—	—	—
ケンコーマヨネーズ	4.5	—	—	—
わらべや日洋	4	5	5	9,615
繊維製品 (0.2%)				
日本毛織	9	9	9	6,255
パルプ・紙 (0.7%)				
日本製紙	5.5	6.5	6.5	11,719
中越パルプ工業	70	—	—	—
レンゴー	—	20	20	12,580
化学 (10.2%)				
クラレ	9	10	10	14,350
昭和電工	—	12	12	13,080
テイカ	20	15	15	7,770

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
日本曹達	23	—	—	—
トクヤマ	—	35	35	13,930
日本カーバイド工業	70	—	—	—
堺化学工業	40	10	10	3,050
日本化学工業	60	40	40	8,840
四国化成工業	12	—	—	—
戸田工業	—	10	10	2,700
大日精化工業	27	27	27	12,366
カネカ	14	19	19	14,364
三菱瓦斯化学	19	—	—	—
J S R	—	10	10	14,630
大阪有機化学工業	18	15	15	9,270
日本合成化学工業	16	—	—	—
ダイセル	—	13	13	16,029
積水樹脂	8	—	—	—
ニチバン	17	17	17	13,515
リケンテクノス	33	—	—	—
大倉工業	40	35	35	11,620
積水化成工業	—	8	8	2,544
タイガースポリマー	19	19	19	12,122
ダイキョーニシカワ	—	10	10	10,250
日本化薬	8	13	13	14,131
ADEKA	8	—	—	—
ハリマ化成グループ	20	20	20	9,380
第一工業製薬	—	20	20	6,560
大日本塗料	—	30	30	5,610
関西ペイント	4	—	—	—
中国塗料	15	—	—	—
藤倉化成	23	—	—	—
D I C	—	4.5	4.5	13,203
富士フィルムホールディングス	2.5	4	4	14,972
ライオン	—	9	9	13,068
コーセー	1.2	1.6	1.6	15,360
シーズ・ホールディングス	—	5	5	12,695
荒川化学工業	9	9	9	9,837
J C U	3	3	3	10,665
北興化学工業	25	30	30	8,460
有沢製作所	21	26	26	12,844
藤森工業	—	6	6	13,284

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
天馬	—	4	—	6,260
信越ポリマー	20	—	—	—
ニフコ	2.5	—	—	—
医薬品 (3.2%)				
大日本住友製薬	10	—	—	—
田辺三菱製薬	6	8	15,648	—
科研製薬	1.4	—	—	—
小野薬品工業	—	5	14,360	—
久光製薬	2.5	3	14,850	—
ツムラ	3	—	—	—
日医工	—	6	11,292	—
東和薬品	2.5	—	—	—
沢井製薬	—	1.8	12,438	—
キョーリン製薬ホールディングス	—	7.5	15,697	—
大幸薬品	8	—	—	—
大塚ホールディングス	—	3.3	15,321	—
大正製薬ホールディングス	1.3	—	—	—
ペプチドリーム	—	2	10,100	—
石油・石炭製品 (0.4%)				
ニチレキ	15	18	12,888	—
ユシロ化学工業	10	—	—	—
ゴム製品 (1.1%)				
ブリヂストン	—	4.4	14,960	—
住友ゴム工業	5	9.5	14,392	—
フコク	14	5	3,725	—
ニッタ	—	2	4,834	—
ガラス・土石製品 (1.2%)				
日本電気硝子	20	—	—	—
日本ヒューム	—	7	4,459	—
アジアパイルホールディングス	20	20	8,220	—
東海カーボン	40	—	—	—
日本硝子	5	—	—	—
日本特殊陶業	—	8.5	15,011	—
フジミインコーポレーテッド	—	9	11,853	—
鉄鋼 (1.2%)				
合同製鐵	60	—	—	—
ジェイ エフ イー ホールディングス	5.5	—	—	—
大和工業	4.5	—	—	—
東京鐵鋼	30	—	—	—

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
東洋鋼鈹	40	—	—	—
丸一鋼管	4	4	14,000	—
新日本電工	80	40	6,600	—
栗本鐵工所	70	—	—	—
三菱製鋼	—	60	9,720	—
日本精線	23	23	9,453	—
シンニッタン	21	—	—	—
非鉄金属 (1.6%)				
三井金属鉱業	70	70	14,280	—
三菱マテリアル	—	55	15,180	—
タツタ電線	—	40	13,840	—
カナレ電気	7	7	12,761	—
金属製品 (2.2%)				
トーカロ	5.5	4	8,028	—
東洋製罐グループホールディングス	5.5	7.5	14,227	—
三協立山	—	6	9,402	—
日東精工	40	40	13,320	—
ジーテクト	10	—	—	—
東プレ	6	6.5	12,623	—
日本発條	—	17	16,133	—
三益半導体工業	10	—	—	—
機械 (7.4%)				
タクマ	15	13	11,609	—
アマダホールディングス	11	14	14,616	—
アイダエンジニアリング	—	15	10,635	—
滝澤鐵工所	100	20	2,460	—
富士機械製造	9	6	6,972	—
日東工器	5	—	—	—
やまびこ	14	—	—	—
ペガサスミシン製造	21	12	6,108	—
三井海洋開発	—	8	13,576	—
レオン自動機	20	—	—	—
SMC	0.5	—	—	—
オイレス工業	—	5	8,430	—
日精エー・エス・ピー機械	—	6	9,372	—
住友重機械工業	26	—	—	—
帝国電機製作所	18	—	—	—
新東工業	—	10	7,780	—
アイチ コーポレーション	—	16	12,128	—

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
小森コーポレーション	9	10	12,610	
トーヨーカネツ	50	50	10,150	
栗田工業	—	6	13,716	
椿本チエイン	20	—	—	
加藤製作所	20	—	—	
タダノ	13	15	15,000	
竹内製作所	8	9	12,141	
大和冷機工業	14	14	12,740	
T P R	5	6	14,880	
ツバキ・ナカシマ	—	9	12,825	
ホシザキ	1.5	1.8	14,148	
THK	—	7	13,363	
イーグル工業	7	—	—	
日本ビラー工業	12	—	—	
マキタ	1.7	2.1	15,519	
電気機器 (11.1%)				
コニカミノルタ	12	—	—	
日立製作所	26	—	—	
三菱電機	12	—	—	
東洋電機製造	35	15	4,560	
シンフォニアテックノロジー	—	80	13,120	
山洋電気	20	—	—	
デンヨー	9	9	8,892	
マブチモーター	2.4	—	—	
東光高岳	8	7	13,041	
田淵電機	22	40	13,120	
J V Cケンウッド	—	50	11,900	
第一精工	8	10	9,610	
オムロン	—	4	13,360	
日東工業	—	9	11,322	
日本電気	—	55	14,245	
電気興業	—	8	3,704	
ワコム	28	—	—	
ジャパンディスプレイ	50	70	9,730	
日本信号	9	14	11,956	
京三製作所	35	—	—	
富士通ゼネラル	8	—	—	
タムラ製作所	40	—	—	
ローランド ディー. ジー.	—	6	12,954	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
フォスター電機	4	—	—	
ヒロセ電機	0.9	1.1	13,981	
日本航空電子工業	10	—	—	
アルパイン	10	12	14,112	
船井電機	10	—	—	
新元元工業	30	30	12,060	
堀場製作所	—	3	13,575	
パナソニック デバイスSUNX	18	20	10,920	
キーエンス	—	0.2	14,398	
日置電機	—	7	12,684	
OBARA GROUP	—	3.5	12,687	
オプテックス	—	4	8,656	
千代田インテグレ	—	4	7,720	
スタンレー電気	5	6	14,850	
日本デジタル研究所	6	7	10,122	
図研	8	—	—	
カシオ計算機	—	9.5	13,157	
ファナック	0.7	—	—	
日本シイエムケイ	40	—	—	
ローム	2.5	—	—	
浜松ホトニクス	—	4.5	14,310	
三井ハイテック	22	—	—	
新光電気工業	18	22	11,660	
京セラ	—	3	14,232	
双葉電子工業	—	8	12,656	
日本ケミコン	70	—	—	
キャノン電子	7	9	13,644	
輸送用機器 (4.7%)				
トヨタ紡織	7	6	13,272	
ユニプレス	7	—	—	
豊田自動織機	2.2	—	—	
デンソー	3	—	—	
三井造船	—	90	12,600	
いすゞ自動車	—	12	14,682	
三菱自動車工業	6	—	—	
日信工業	—	9	12,969	
トビー工業	—	65	13,260	
タチエス	—	9	14,445	
NOK	7	—	—	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
河西工業	10	—	—
マツダ	4	10	15,220
今仙電機製作所	12	—	—
本田技研工業	2.8	—	—
富士重工業	—	4	15,204
ショーワ	—	21	11,634
愛三工業	13	—	—
ヨロズ	—	10	12,610
シマノ	0.7	1	15,080
テイ・エス テック	5	4	9,296
精密機器 (1.6%)			
ニコン	—	10	14,880
理研計器	10	—	—
タムロン	4	8	12,144
HOYA	3	3.7	14,518
ノーリツ鋼機	—	18	11,628
シチズンホールディングス	16	—	—
ニプロ	9	—	—
その他製品 (4.5%)			
スノーピーク	3	3.5	13,720
パラマウントベッドホールディングス	2.5	3	11,400
トランザクション	—	7	11,095
ニホンフラッシュ	11	11	11,638
SHOEI	—	9	14,904
フランスベッドホールディングス	11	—	—
パイロットコーポレーション	—	3	12,150
廣済堂	37	34	10,132
凸版印刷	—	16	14,304
大日本印刷	11	14	14,476
小松ウオール工業	6	6	9,510
ヤマハ	3.8	—	—
ビジョン	5	5	13,255
リンテック	—	3	5,751
グローブライド	—	6	8,496
アデランス	—	10	4,400
陸運業 (3.1%)			
東京急行電鉄	—	19	15,124
京浜急行電鉄	—	15	14,565
東日本旅客鉄道	1.2	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
西日本旅客鉄道	1.7	2.5	15,055
東海旅客鉄道	0.6	0.9	15,561
西日本鉄道	14	15	7,245
京阪ホールディングス	14	—	—
山陽電気鉄道	20	—	—
日本通運	23	30	14,400
トナミホールディングス	40	10	2,490
神奈川中央交通	—	14	8,680
丸和運輸機関	—	5	12,145
海運業 (0.4%)			
日本郵船	50	80	14,080
商船三井	20	—	—
川崎汽船	60	—	—
倉庫・運輸関連業 (0.9%)			
日新	30	—	—
三井倉庫ホールディングス	—	40	11,880
上組	10	17	15,385
郵船ロジスティクス	7	5	4,965
情報・通信業 (6.1%)			
NECネットワークス	—	8	13,008
ソフトクリエイティブホールディングス	—	5	4,800
ファインデックス	—	8	10,472
ディー・エル・イー	—	10	5,550
日本アジアグループ	20	—	—
豆蔵ホールディングス	—	15	13,470
コムチュア	—	4	12,280
野村総合研究所	3	4.2	14,154
ソースネクスト	—	20	10,280
フジ・メディア・ホールディングス	3.5	7	8,736
オービック	2.2	—	—
日本オラクル	2.3	—	—
フューチャー	—	18	13,068
CAC Holdings	12	17	13,073
伊藤忠テクノソリューションズ	6	—	—
アイティフォー	—	15	7,800
東計電算	5	6	10,794
大塚商会	—	3.4	14,773
フュージョンパートナー	—	16	11,376
ネットワンシステムズ	18	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アルゴグラフィックス	5.5	6.5	12,824
エイベックス・グループ・ホールディングス	—	10	13,090
兼松エレクトロニクス	—	4	7,452
スカパーJ S A Tホールディングス	10	—	—
テレビ東京ホールディングス	3	—	—
東映	5	—	—
D T S	5	6	12,336
シーイーシー	8	—	—
アイネス	10	—	—
富士ソフト	5	—	—
卸売業 (6.7%)			
J A L U X	6	—	—
あらた	5	5	10,565
アルコニックス	10	8	10,608
神戸物産	2.8	—	—
あい ホールディングス	—	5	11,225
バイタルケーエスケー・ホールディングス	—	8	7,568
U K Cホールディングス	6	6	9,000
三洋貿易	9	8	9,088
シップヘルスケアホールディングス	4	—	—
伯東	—	8	7,104
メディバルホールディングス	6	8.5	14,203
アドヴァン	11	12	10,236
丸文	—	20	11,160
マルカキカイ	8	8	8,976
伊藤忠商事	—	13	15,541
兼松	—	80	11,680
日立ハイテクノロジーズ	4	—	—
カメイ	12	15	11,715
スターゼン	—	3	13,830
山善	—	10	7,870
内田洋行	30	—	—
神鋼商事	50	5	835
菱電商事	20	—	—
稲畑産業	9	12	11,196
ワキタ	15	20	13,780
サンワテクノス	17	17	11,934
三信電気	15	—	—
ヤマタネ	—	40	5,160

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
因幡電機産業	—	4	13,700
スズケン	2.7	—	—
小売業 (10.7%)			
エービーシー・マート	1.8	—	—
ゲオホールディングス	7	—	—
アダストリア	2	5	12,150
パル	—	5	10,900
エディオン	13	—	—
ひらまつ	9	9	5,454
大黒天物産	—	2	9,040
D C Mホールディングス	—	15	11,835
アークランドサービスホールディングス	3	3	9,195
プロンコビリー	3	3	8,727
物語コーポレーション	1.5	1.5	6,532
ココカラフライン	2.6	3.5	12,057
三越伊勢丹ホールディングス	9	—	—
ウエルシアホールディングス	—	2	12,920
エー・ビーカンパニー	5	5	3,545
チムニー	—	2	5,218
ネクステージ	—	5	6,295
ジョイフル本田	5	—	—
鳥貴族	—	3	5,736
ブックオフコーポレーション	12	—	—
あさひ	9	—	—
日本調剤	3.5	3.5	12,215
セブン&アイ・ホールディングス	—	3.3	14,962
クリエイト・レストランツ・ホールディング	2	6	6,168
ツルハホールディングス	—	1.4	15,568
サンマルクホールディングス	2	3	8,211
トリドール	3.8	3.8	8,987
メディカルシステムネットワーク	27	27	12,474
ノジマ	—	9	11,043
良品計画	—	0.7	13,972
G-7ホールディングス	10	—	—
コーナン商事	6	—	—
エコス	—	5	6,055
ハイデイ日高	2.5	3	6,750
スクロール	30	—	—
上新電機	13	15	12,555

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
MrMax	37	—	—	—
しまむら	0.9	1.1	13,398	—
エイチ・ツー・オー リテイリング	6	—	—	—
パルコ	11	14	12,838	—
アクシアル リテイリング	3.5	—	—	—
平和堂	5	—	—	—
ケーズホールディングス	—	7	11,711	—
ヤマダ電機	22	30	15,120	—
アークランドサカモト	9	11	11,803	—
ミニストップ	6	6	9,822	—
アークス	5	—	—	—
バローホールディングス	—	5	14,315	—
サンドラッグ	—	1.8	14,508	—
サクスパー ホールディングス	7	—	—	—
ペルーナ	21	21	13,230	—
不動産業 (3.0%)				
三栄建築設計	10	10	11,250	—
日本商業開発	5	—	—	—
ブレサンスコーポレーション	2.5	—	—	—
日本管理センター	8	—	—	—
フージャースホールディングス	—	15	7,500	—
オープンハウス	6	—	—	—
東急不動産ホールディングス	—	25	14,225	—
飯田グループホールディングス	5	8.2	15,366	—
三井不動産	5	6	12,972	—
東京建物	—	11	12,848	—
京阪神ビルディング	10	—	—	—
大京	—	50	8,250	—
住友不動産販売	—	4.5	8,842	—
イオンモール	7	—	—	—
サンフロンティア不動産	—	10	10,550	—
エフ・ジェー・ネクスト	15	—	—	—
日本空港ビルデング	3	—	—	—

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
サービス業 (5.9%)				
日本工営	30	20	7,980	—
ジェイエイシーリクルートメント	—	11	12,342	—
日本M&Aセンター	—	2	11,980	—
タケエイ	—	15	12,300	—
パソナグループ	19	—	—	—
学情	10	—	—	—
総合警備保障	—	3	15,810	—
エムスリー	—	5	15,650	—
ワールドホールディングス	—	10	14,030	—
E P Sホールディングス	9	10	12,730	—
プレステージ・インターナショナル	9	—	—	—
クイック	—	10	8,730	—
ファルコホールディングス	9	8	10,440	—
ビー・エム・エル	3.3	—	—	—
りらいあコミュニケーションズ	13	—	—	—
M&Aキャピタルパートナーズ	—	3	5,982	—
エスクロー・エージェント・ジャパン	—	4	10,052	—
日本ビューホテル	3	—	—	—
東洋	3	—	—	—
エイチ・アイ・エス	3.5	4.5	12,478	—
建設技術研究所	9	—	—	—
東京都競馬	30	40	8,040	—
トランス・コスモス	4	—	—	—
KNT-CTホールディングス	—	80	9,120	—
トーカイ	3.5	—	—	—
丹青社	18	—	—	—
応用地質	10	10	10,170	—
イオンデイライト	—	4	12,080	—
ダイセキ	7	7	12,425	—
合 計	4,482	4,179	3,406,423	—
	株数・金額			
	銘柄数<比率>	303	303	<80.3%>

(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。

○信用取引の状況

(2016年8月24日現在)

銘柄	信用取引売建残高	
	当 期 末	
	株 数	評 価 額
信用取引売建	千株 4,169	千円 3,394,069

○投資信託財産の構成

(2016年8月24日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 3,406,423	% 40.8
コール・ローン等、その他	4,943,473	59.2
投資信託財産総額	8,349,896	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年8月24日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	10,572,773,059
コール・ローン等	885,604,827
株式(評価額)	3,406,423,400
信用取引預け金	3,321,703,290
未収入金	731,906,342
未収配当金	4,259,100
差入保証金	2,222,876,100
(B) 負債	6,328,040,258
信用売証券	3,394,069,400
未払金	702,643,443
未払解約金	2,931,571
未払利息	1,272
差入保証金代用有価証券	2,222,876,100
その他未払費用	5,518,472
(C) 純資産総額(A-B)	4,244,732,801
元本	3,172,588,604
次期繰越損益金	1,072,144,197
(D) 受益権総口数	3,172,588,604口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,379円

○損益の状況 (2016年2月25日～2016年8月24日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	42,106,001
受取配当金	42,291,577
受取利息	2,851
その他収益金	2,267
支払利息	△ 190,694
(B) 有価証券売買損益	△ 110,801,801
売買益	828,105,283
売買損	△ 938,907,084
(C) 保管費用等	△ 50,368,105
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 119,063,905
(E) 前期繰越損益金	1,032,593,948
(F) 追加信託差損益金	231,021,604
(G) 解約差損益金	△ 72,407,450
(H) 計(D+E+F+G)	1,072,144,197
次期繰越損益金(H)	1,072,144,197

<注記事項>

- ①期首元本額 2,757,551,749円
 期中追加設定元本額 616,498,353円
 期中一部解約元本額 201,461,498円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3379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)

日本株プライムニュートラル・ファンド(ラップ向け)	2,079,828,213円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	335,411,408円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	684,578,257円
MUAM 日本株マーケットニュートラル・ファンド(適格機関投資家限定)	72,770,726円
合計	3,172,588,604円

③担保資産

信用取引に係る差入保証金代用有価証券として以下の通り差入を行っております。
 株式 2,091,767,900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うための、所要の約款変更を行いました。

(2016年7月1日)

<参考> 投資する投資信託証券およびその概要

ファンド名	ブラックストーン・ダイバーシファイド・マルチストラテジー・ファンド - クラス I (JPY) アキュムレーティング
運用方針	信託財産を、非伝統的またはオルタナティブな投資ストラテジーで運用する様々な投資サブアドバイザーに配分することにより、信託財産の成長をめざします。
主要運用対象	世界の株式、債券およびデリバティブ等の幅広い資産
主な組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 同一の発行体が発行する流動性証券への投資比率は、原則として純資産総額の10%以内とします。 ・ 店頭デリバティブ取引のカウンターパーティーへのリスク・エクスポージャーは、原則として純資産総額の10%以内とします。
決算日	毎年12月31日
分配方針	通常ファンド運営過程において分配は宣言されません。

運用計算書、純資産変動計算書、投資有価証券明細表はAnnual Report and Audited Financial Statements for the financial year ended 31 December 2015版から抜粋して作成しています。

なお、開示情報につきましては、シェアクラス分けされたものがないため、クラスを合算したブラックストーン・ダイバーシファイド・マルチストラテジー・ファンドで掲載しています。

(1) 運用計算書

ブラックストーン・ダイバーシファイド・マルチストラテジー・ファンド

(2015年1月1日～2015年12月31日)

ブラックストーン・
ダイバーシファイド・
マルチストラテジー・ファンド
米ドル

投資（損）益：

配当収入	1,266,372
受取利息	11,078,187
投資証券純（損）益	(7,397,429)
投資外貨純（損）益	(352,471)
投資派生商品と金融負債の純（損）益	(11,842,210)
投資（損）益合計	(7,247,551)

運用管理費用	(6,766,774)
管理者報酬	(1,284,230)
成功報酬	(1,995,350)
法務費用	(66,263)
監査、税務関連費用	(102,939)
保管費用	(339,828)
受託者報酬	(126,987)
取締役報酬	(27,894)
その他運用費用	(214,790)
費用合計	(10,925,055)

運用（損）益 (18,172,606)

税控除前（損）益 (18,172,606)

源泉徴収税 (370,488)

運用による純資産の純増加（減少）額 (18,543,094)

(注) データ提供元：三菱UFJ信託銀行

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(2) 純資産変動計算書

ブラックストーン・ダイバーシファイド・マルチストラテジー・ファンド

(2015年1月1日～2015年12月31日)

ブラックストーン・
ダイバーシファイド・
マルチストラテジー・ファンド
米ドル

純資産期首	375,296,759
投資信託証券の発行	560,909,087
投資信託証券の償還	(43,965,294)
純増減取引	516,943,793
運用による増(減)額	(18,543,094)
純資産期末	873,697,458

(注) データ提供元：三菱UFJ信託銀行

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(3) 投資有価証券明細表 (the Schedule of Investments)

ブラックストーン・ダイバーシファイド・マルチストラテジー・ファンド

(2015年12月31日現在)

銘柄	株数	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%)		
Common Stock - 13.58% (2014 - 31.75%)		
Belgium - 0.08% (2014 - 0.04%)		
<u>Insurance - 0.08%</u>		
Ageas	15,269	708,693
Total Belgium		708,693
Bermuda - 0.00% (2014 - 0.09%)		
Brazil - 0.00% (2014 - 0.01%)		
Canada - 0.34% (2014 - 0.61%)		
<u>Asset Management - 0.03%</u>		
Fairfax India Holdings Corp.	26,100	263,610
<u>Automotive - 0.03%</u>		
Magna International, Inc.	6,509	264,005
<u>Banking - 0.11%</u>		
Bank of Nova Scotia	6,444	260,595
Canadian Imperial Bank of Commerce	5,370	353,899
National Bank of Canada	9,750	284,038
		898,532
<u>Chemicals - 0.03%</u>		
Potash Corp. of Saskatchewan, Inc.	15,294	261,834
<u>Media - 0.03%</u>		
Shaw Communications, Inc.	15,611	268,353
<u>Oil, Gas & Coal - 0.06%</u>		
Cenovus Energy, Inc.	21,135	266,724
Encana Corp.	54,015	274,936
		541,660
<u>Renewable Energy - 0.02%</u>		
Canadian Solar, Inc.	7,043	203,965
<u>Transportation & Logistics - 0.03%</u>		
Canadian Pacific Railway Ltd.	2,110	269,236
Total Canada		2,971,195
Chile - 0.00% (2014 - 0.01%)		
China - 0.16% (2014 - 1.33%)		
<u>Media - 0.16%</u>		
Baidu, Inc. ADR	7,516	1,420,825
Total China		1,420,825
Denmark 0.00% (2014 - 0.02%)		
France - 0.12% (2014 - 0.00%)		
<u>Asset Management - 0.07%</u>		
Amundi SA	6,170	289,533
Eurazeo SA	5,477	377,743
		667,276

銘柄	株数	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)		
Common Stock - 13.58% (2014 - 31.75%) (continued)		
France - 0.12% (2014 - 0.00%) (continued)		
<i>Banking - 0.05%</i>		
Credit Agricole SA	34,806	410,158
Total France		1,077,434
Germany 0.00% - (2014 - 1.43%)		
Hong Kong - 0.04% (2014 - 0.07%)		
<i>Insurance - 0.04%</i>		
AIA Group Ltd.	54,600	326,239
Total Hong Kong		326,239
India - 0.04% (2014 - 0.00%)		
<i>Banking - 0.04%</i>		
ICICI Bank Ltd. ADR	44,210	346,164
Total India		346,164
Ireland - 0.21% (2014 - 0.35%)		
<i>Biotechnology & Pharmaceuticals - 0.16%</i>		
Shire PLC ADR	6,917	1,417,985
<i>Insurance - 0.05%</i>		
XL Group PLC	10,646	417,110
Total Ireland		1,835,095
Israel - 0.17% (2014 - 0.26%)		
<i>Biotechnology & Pharmaceuticals - 0.17%</i>		
Teva Pharmaceutical Industries Ltd. ADR	22,250	1,460,490
Total Israel		1,460,490
Italy - 0.13% (2014 - 0.03%)		
<i>Asset Management - 0.05%</i>		
Anima Holding SpA	55,175	476,552
<i>Banking - 0.03%</i>		
Banca Generali SpA	7,390	232,460
<i>Technology Services - 0.05%</i>		
Cerved Information Solutions SpA	50,295	417,770
Total Italy		1,126,782
Japan - 1.74% (2014 - 2.93%)		
<i>Automotive - 0.24%</i>		
Mazda Motor Corp.	101,400	2,092,363
<i>Banking - 0.16%</i>		
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	226,600	1,403,617
<i>Chemicals - 0.15%</i>		
Nitto Denko Corp.	18,200	1,328,703
<i>Consumer Products - 0.09%</i>		
Ajinomoto Co., Inc.	34,000	804,975

銘柄	株数	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)		
Common Stock - 13.58% (2014 - 31.75%) (continued)		
Japan - 1.74% (2014 - 2.93%) (continued)		
<u>Electrical Equipment - 0.25%</u>		
Daikin Industries Ltd.	17,400	1,267,097
SMC Corp.	3,500	909,068
		<u>2,176,165</u>
<u>Engineering & Construction Services - 0.06%</u>		
Taisei Corp.	77,000	507,196
<u>Hardware - 0.07%</u>		
Sony Corp.	24,800	609,504
<u>Machinery - 0.09%</u>		
Kubota Corp.	50,000	772,432
<u>Passenger Transportation - 0.14%</u>		
ANA Holdings, Inc.	433,000	1,249,250
<u>Real Estate - 0.40%</u>		
Mitsubishi Estate Co. Ltd.	79,000	1,642,673
Mitsui Fudosan Co. Ltd.	75,000	1,882,341
		<u>3,525,014</u>
<u>Telecommunications - 0.09%</u>		
KDDI Corp.	28,700	745,344
Total Japan		<u>15,214,563</u>
Mexico - 0.00% (2014 - 0.07%)		
Netherlands - 0.34% (2014 - 0.06%)		
<u>Banking - 0.03%</u>		
ING Groep NV CVA	22,032	298,094
<u>Media - 0.31%</u>		
Altice NV	188,542	2,710,586
Total Netherlands		<u>3,008,680</u>
Norway - 0.00% (2014 - 0.06%)		
Panama - 0.00% (2014 - 0.06%)		
Peru - 0.03% (2014 - 0.00%)		
Credicorp Ltd.	2,726	265,294
Total Peru		<u>265,294</u>
Republic of Korea - 0.00% (2014 - 0.03%)		
Singapore - 0.38% (2014 - 0.02%)		
<u>Semiconductors - 0.38%</u>		
Avago Technologies Ltd.	22,897	3,323,500
Total Singapore		<u>3,323,500</u>
Sweden - 0.00% (2014 - 0.01%)		

銘柄	株数	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)		
Common Stock - 13.58% (2014 - 31.75%) (continued)		
Switzerland - 0.61% (2014 - 1.12%)		
<u>Asset Management - 0.61%</u>		
Leonteq AG	2,546	367,770
UBS Group AG	257,456	4,994,507
Total Switzerland		5,362,277
United Kingdom - 1.08% (2014 - 1.63%)		
<u>Asset Management - 0.07%</u>		
Henderson Group PLC	66,892	304,025
Jupiter Fund Management PLC	43,088	286,355
		590,380
<u>Banking - 0.26%</u>		
HSBC Holdings PLC	272,400	2,150,278
Royal Bank of Scotland Group PLC	2,794	12,420
Standard Chartered PLC	14,322	118,832
		2,281,530
<u>Insurance - 0.06%</u>		
Aviva PLC ADR	60,123	456,362
Saga PLC	37,099	110,203
		566,565
<u>Machinery - 0.03%</u>		
Pentair PLC	5,372	266,075
<u>Media - 0.57%</u>		
Liberty Global PLC	119,197	4,869,973
<u>Real Estate - 0.09%</u>		
Kennedy Wilson Europe Real Estate PLC	46,359	824,435
Total United Kingdom		9,398,958
United States - 8.11% (2014 - 21.51%)		
<u>Aerospace & Defense - 0.03%</u>		
B/E Aerospace, Inc.	6,300	266,931
<u>Apparel & Textile Products - 0.06%</u>		
PVH Corp.	3,650	268,822
Ralph Lauren Corp.	2,379	265,211
		534,033
<u>Asset Management - 0.88%</u>		
Affiliated Managers Group, Inc.	1,667	266,320
American Capital Ltd.	2,857	39,398
Charles Schwab Corp.	178,676	5,883,800
Franklin Resources, Inc.	7,251	266,982
Invesco Ltd.	11,966	400,622
Legg Mason, Inc.	13,940	546,866
Waddell & Reed Financial, Inc. Class A	9,186	263,271
		7,667,259
<u>Automotive - 0.03%</u>		
Harley-Davidson, Inc.	5,893	267,483
<u>Banking - 0.80%</u>		
Bank of the Ozarks, Inc.	3,044	150,556
BankUnited, Inc.	10,902	393,126
Citizens Financial Group, Inc.	181,068	4,742,171

銘柄	株数	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)		
Common Stock - 13.58% (2014 - 31.75%) (continued)		
United States - 8.11% (2014 - 21.51%) (continued)		
<u>Banking - 0.80% (continued)</u>		
FCB Financial Holdings, Inc. Class A	5,628	201,426
First Citizens BancShares, Inc. Class A	1,758	453,863
First Niagara Financial Group, Inc.	14,724	159,755
Talmer Bancorp, Inc. Class A	20,880	378,137
Wells Fargo & Co.	8,716	473,802
		<u>6,952,836</u>
<u>Biotechnology & Pharmaceuticals - 1.51%</u>		
Allergan PLC	15,124	4,726,250
Anacor Pharmaceuticals, Inc.	1,871	211,367
Endo International PLC	54,968	3,365,141
Mallinckrodt PLC	46,349	3,459,026
Valeant Pharmaceuticals International, Inc.	14,138	1,437,127
		<u>13,198,911</u>
<u>Chemicals - 0.06%</u>		
Huntsman Corp.	23,912	271,879
Mosaic Co.	9,393	259,153
		<u>531,032</u>
<u>Consumer Products - 0.20%</u>		
Archer-Daniels-Midland Co.	7,311	268,167
Kraft Heinz Co.	20,377	1,482,631
		<u>1,750,798</u>
<u>Containers & Packaging - 0.06%</u>		
International Paper Co.	7,016	264,503
Owens-Illinois, Inc.	15,328	267,014
		<u>531,517</u>
<u>Distributors - Consumer Staples - 0.03%</u>		
Bunge Ltd.	3,935	268,682
<u>Electrical Equipment - 0.03%</u>		
Tyco International PLC	8,305	264,847
<u>Gaming, Lodging & Restaurants - 0.03%</u>		
Chipotle Mexican Grill, Inc.	554	265,837
<u>Hardware - 0.12%</u>		
Brocade Communications Systems, Inc.	29,378	269,690
F5 Networks, Inc.	2,780	269,549
HP, Inc.	22,863	270,698
NetApp, Inc.	10,088	267,634
		<u>1,077,571</u>
<u>Health Care Facilities/Services - 0.06%</u>		
Brookdale Senior Living, Inc.	14,642	270,291
Team Health Holdings, Inc.	6,112	268,256
		<u>538,547</u>
<u>Industrial Services - 0.03%</u>		
MSC Industrial Direct Co., Inc.	4,721	265,651
<u>Institutional Financial Service - 0.10%</u>		
Evercore Partners, Inc. Class A	4,612	249,371
Northern Trust Corp.	6,497	468,368
Raymond James Financial, Inc.	2,039	118,201
		<u>835,940</u>

銘柄	株数	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)		
Common Stock - 13.58% (2014 - 31.75%) (continued)		
United States - 8.11% (2014 - 21.51%) (continued)		
<u>Insurance - 0.13%</u>		
Hartford Financial Services Group, Inc.	9,128	396,703
Principal Financial Group, Inc.	10,056	452,319
Prudential Financial, Inc.	3,257	265,152
		<hr/> 1,114,174
<u>Leisure Products - 0.03%</u>		
Polaris Industries, Inc.	3,105	266,875
<u>Machinery - 0.12%</u>		
Colfax Corp.	11,638	271,747
Flowserve Corp.	6,325	266,156
Lincoln Electric Holdings	5,161	267,804
Regal-Beloit Corp.	4,630	270,948
		<hr/> 1,076,655
<u>Media - 0.78%</u>		
Discovery Communications, Inc.	10,684	269,450
Time Warner Cable, Inc.	25,134	4,664,619
Time Warner, Inc.	4,182	270,450
Twenty-First Century Fox, Inc. Class A	49,238	1,337,304
Viacom, Inc.	6,561	270,051
		<hr/> 6,811,874
<u>Metals & Mining - 0.03%</u>		
Freeport-McMoRan, Inc.	38,903	263,373
<u>Oil, Gas & Coal - 0.59%</u>		
Anadarko Petroleum Corp.	5,453	264,907
Cheniere Energy, Inc.	7,323	272,782
Cobalt International Energy, Inc.	50,873	274,714
Continental Resources, Inc.	11,846	272,221
Devon Energy Corp.	8,411	269,152
Energen Corp.	6,390	261,926
EQT Corp.	5,118	266,801
FMC Technologies, Inc.	9,287	269,416
Hess Corp.	5,494	266,349
Kinder Morgan, Inc.	17,958	267,933
Marathon Oil Corp.	20,810	261,998
Murphy Oil Corp.	11,956	268,412
ONEOK, Inc.	11,275	278,041
Range Resources Corp.	11,041	271,719
Southwestern Energy Co.	40,112	285,196
Spectra Energy Corp.	11,408	273,108
Weatherford International PLC	31,530	264,537
Whiting Petroleum Corp.	29,699	280,359
Williams Cos., Inc.	10,903	280,207
		<hr/> 5,149,778
<u>Real Estate - 0.93%</u>		
American Tower Corp.	3,546	343,785
Forest City Enterprises, Inc. Class A	24,980	547,811
Lamar Advertising Co. Class A	78,617	4,715,448
New York REIT, Inc.	134,147	1,542,691
NorthStar Realty Europe Corp.	13,705	161,856

銘柄	株数	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)		
Common Stock - 13.58% (2014 - 31.75%) (continued)		
United States - 8.11% (2014 - 21.51%) (continued)		
<u>Real Estate - 0.93% (continued)</u>		
NorthStar Realty Finance Corp.	49,448	842,099
		<u>8,153,690</u>
<u>Retail - Consumer Staples - 0.03%</u>		
Wal-Mart Stores, Inc.	4,402	269,843
<u>Retail Discretionary - 0.28%</u>		
Avis Budget Group, Inc.	7,359	267,058
Bed Bath & Beyond, Inc.	5,547	267,643
Dick's Sporting Goods, Inc.	7,619	269,332
Gap, Inc.	10,580	261,326
Hertz Global Holdings, Inc.	18,688	265,930
Macy's, Inc.	7,596	265,708
Nordstrom, Inc.	5,330	265,487
Office Depot, Inc.	48,507	273,580
Staples, Inc.	28,364	268,607
		<u>2,404,671</u>
<u>Semiconductors - 0.03%</u>		
Micron Technology, Inc.	18,909	267,751
<u>Software - 0.12%</u>		
SS&C Technologies Holdings, Inc.	6,995	477,549
Verint Systems, Inc.	6,552	265,749
VMware, Inc. Class A	4,763	269,443
		<u>1,012,741</u>
<u>Specialty Finance - 0.13%</u>		
American Express Co.	3,844	267,350
MGIC Investment Corp.	38,200	337,306
OneMain Holdings, Inc.	9,369	389,188
Synchrony Financial	5,033	153,054
		<u>1,146,898</u>
<u>Technology Services - 0.08%</u>		
MSCI, Inc.	6,387	460,695
Teradata Corp.	10,017	264,649
		<u>725,344</u>
<u>Telecommunications - 0.03%</u>		
CenturyLink, Inc.	10,478	263,627
<u>Transportation & Logistics - 0.52%</u>		
CSX Corp.	10,279	266,740
Genesee & Wyoming, Inc.	5,010	268,987
Kansas City Southern	3,645	272,172
Kirby Corp.	5,024	264,363
Old Dominion Freight Line, Inc.	4,584	270,777
Ryder System, Inc.	4,739	269,317
Union Pacific Corp.	37,840	2,959,088
		<u>4,571,444</u>
<u>Transportation Equipment - 0.06%</u>		
Cummins, Inc.	3,018	265,614
PACCAR, Inc.	5,605	265,677
		<u>531,291</u>

銘柄	株数	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)		
Common Stock - 13.58% (2014 - 31.75%) (continued)		
United States - 8.11% (2014 - 21.51%) (continued)		
<u>Utilities - 0.16%</u>		
AES Corp.	28,216	270,027
Calpine Corp.	18,598	269,113
Exelon Corp.	9,702	269,425
National Fuel Gas Co.	6,354	271,634
NRG Energy, Inc.	23,477	276,324
		<hr/> 1,356,523
<u>Waste & Environmental Service Equipment & Facility - 0.03%</u>		
Donaldson Co., Inc.	9,389	269,089
Total United States		<hr/> 70,873,516
Total Common Stock		<hr/> 118,719,705
Asset-Backed Securities - 9.18% (2014 - 11.12%)		
	額面 金額	時価 米ドル
Cayman Islands - 4.01% (2014 - 6.61%)		
ALESCO Preferred Funding VII Ltd., Series 7A, Class A1B, 0.99%, 23/07/35	USD 1,351,104	1,101,150
ALESCO Preferred Funding XIII Ltd., Series 13A, Class A2, 0.99%, 23/09/37	975,000	511,875
Allegro CLO II Ltd., Series 2014-1A, Class C, 4.47%, 21/01/27	400,000	373,520
AMMC CLO XII Ltd., Series 2013-12A, Class D1, 4.09%, 10/05/25	600,000	566,820
Atlas Senior Loan Fund II Ltd., Series 2012-2A, Class D, 4.57%, 30/01/24	300,000	295,650
Attentus CDO III Ltd., Series 2007-3A, Class A1B, 0.58%, 11/10/42	163,512	147,161
Babson CLO Ltd., Series 2013-1A, 3.82%, 20/04/25	600,000	567,780
Series 2015-2A, 5.84%, 20/07/27	300,000	261,600
BlueMountain CLO Ltd., Series 2014-1A, Class D, 3.77%, 30/04/26	608,000	562,886
Canyon Capital CLO Ltd., Series 2012-1A, Class D, 4.62%, 15/01/24	300,000	296,970
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd., Series 2014-2A, Class D, 3.86%, 15/05/25	400,000	376,280
Catamaran CLO Ltd., Series 2015-1A, 3.97%, 22/04/27	300,000	271,380
Series 2015-1A, 5.47%, 22/04/27	300,000	245,010
CIFC Funding II Ltd., Series 2013-2A, Class A3L, 2.97%, 21/04/25	300,000	288,420
CIFC Funding Ltd., Series 2012-2A, 6.20%, 05/12/24	211,000	190,638
Series 2014-4A, 3.72%, 17/10/26	800,000	725,280
Series 2015-1A, 4.32%, 22/01/27	400,000	382,440
Cutwater Ltd., Series 2014-1A, 4.02%, 15/07/26	442,000	398,596
Series 2015-1A, 4.22%, 15/07/27	306,000	273,350
Diamond Head Aviation, Series 2015-1, Class B, 5.92%, 17/07/28	947,362	933,341
Dryden 36 Senior Loan Fund, Series 2014-36A, Class D, 4.09%, 09/11/25	700,000	661,290
Eastland CLO Ltd., Series 2007-1A, Class C, 1.83%, 01/05/22	800,000	715,200
Fore CLO Ltd., Series 2007-1A, Class D, 3.32%, 20/07/19	1,411,322	1,393,822
Galaxy XIV CLO Ltd., Series 2012-14A, 4.76%, 15/11/24	1,000,000	1,000,000
Series 2012-14A, 5.76%, 15/11/24	1,086,000	1,006,721
Golub Capital Partners CLO Ltd., Series 2015-22A, Class C, 4.48%, 20/02/27	300,000	276,090
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd., Series 2014-2A, Class C, 3.82%, 28/04/25	1,200,000	1,058,040
Harbourview CDO III Ltd., Series 3A, Class A, 1.00%, 15/09/31	580,282	528,057

銘柄	額面 金額	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)		
Asset-Backed Securities - 9.18% (2014 - 11.12%) (continued)		
Cayman Islands - 4.01% (2014 - 6.61%) (continued)		
ING IM CLO Ltd.,		
Series 2013-1A, 3.82%, 15/04/24	1,250,000	1,183,500
Series 2013-2A, 5.32%, 25/04/25	250,000	219,850
Kingsland VI Ltd., Series 2013-6A, Class D, 3.97%, 28/10/24	500,000	450,550
KKR Financial CLO Ltd., Series 10, Class D, 4.26%, 15/01/26	300,000	270,420
Kodiak CDO Ltd., Series 2006-1A, Class A1, 0.70%, 07/08/37	2,349,278	2,231,814
LCM Ltd. Partnership, Series 9A, Class E, 4.52%, 14/07/22	1,110,000	1,093,905
LCM XI LP, Series 11A, Class D2, 4.27%, 19/04/22	400,000	394,800
Madison Park Funding X Ltd., Series 2012-10A, Class E, 5.57%, 20/01/25	700,000	678,160
Madison Park Funding XIV Ltd., Series 2014-14A, Class E, 5.07%, 20/07/26	1,100,000	938,740
Madison Park Funding XVI Ltd., Series 2015-16A, Class C, 3.97%, 20/04/26	300,000	283,620
Magnetite XV Ltd.,		
Series 2015-15A, 4.54%, 25/10/27	350,000	333,340
Series 2015-15A, 6.99%, 25/10/27	350,000	321,055
Nelder Grove CLO Ltd., Series 2014-1A, Class D1, 4.93%, 28/08/26	900,000	857,520
Ocean Trails CLO V, Series 2014-5A, Class D, 4.25%, 13/10/26	200,000	185,800
Octagon Investment Partners XII Ltd., Series 2012-1AR, Class DR, 4.08%, 05/05/23	800,000	778,000
Octagon Investment Partners XIV Ltd., Series 2012-1A, Class C, 4.32%, 15/01/24	250,000	248,150
Octagon Investment Partners XXII Ltd., Series 2014-1A, Class E1, 5.57%, 25/11/25	400,000	336,720
OHA Loan Funding Ltd., Series 2013-1A, Class E, 5.47%, 23/07/25	366,000	323,947
OZLM Funding V Ltd., Series 2013-5A, Class D, 5.07%, 17/01/26	700,000	588,140
OZLM VII Ltd., Series 2014-7A, Class C, 3.92%, 17/07/26	300,000	277,080
Preferred Term Securities X Ltd. / Preferred Term Securities X, Inc., 1.32%, 03/07/33	482,416	410,054
Preferred Term Securities XIX Ltd./Preferred Term Securities XIX, Inc., 0.94%, 22/12/35	121,114	68,430
Preferred Term Securities XXIV Ltd./Preferred Term Securities XXIV, Inc., 0.89%, 22/03/37	372,062	200,913
Preferred Term Securities XXV Ltd./Preferred Term Securities XXV, Inc., 0.862%, 22/06/37	308,957	165,285
Preferred Term Securities XXVI Ltd./Preferred Term Securities XXVI, Inc., 0.88%, 22/09/37	158,689	86,486
Sound Point CLO I Ltd.,		
Series 2012-1A, 4.90%, 20/10/23	500,000	500,000
Series 2012-1A, 6.32%, 20/10/23	300,000	294,240
Sound Point CLO IX Ltd., Series 2015-2A, Class D, 4.02%, 20/07/27	400,000	359,840
Sound Point CLO V Ltd., Series 2014-1A, Class D, 3.72%, 18/04/26	500,000	453,250
Stone Tower CLO VI Ltd., Series 2007-6A, Class D, 3.92%, 17/04/21	1,300,000	1,245,010
Symphony CLO IX Ltd., Series 2012-9A, Class D, 4.57%, 16/04/22	1,750,000	1,750,000
Symphony CLO XII Ltd., Series 2013-12A, Class D, 3.82%, 15/10/25	250,000	233,375
Trapeza CDO XIII Ltd., Series 2007-13A, Class A2A, 0.67%, 09/11/42	166,000	87,150
Venture CDO Ltd., Series 2014-16A, Class B1L, 3.77%, 15/04/26	300,000	276,330
Venture X CLO Ltd., Series 2012-10A, Class D, 4.52%, 20/07/22	500,000	495,600
Venture XIV CLO Ltd., Series 2013-14A, Class D, 4.16%, 29/08/25	400,000	379,520
Vibrant CLO Ltd., Series 2015-3A, Class C, 3.94%, 20/04/26	418,000	383,390
WhiteHorse VI Ltd., Series 2012-1A, Class B2L, 5.58%, 03/02/25	311,000	254,834
Total Cayman Islands		35,048,185
United States - 5.17% (2014 - 4.51%)		
AMPLIT Trust,		
Series 2015-A, 8.75%, 15/09/21	330,000	329,010
Series 2015-A SEQ, 5.00%, 15/09/21	1,739,000	1,725,436
Associates Manufactured Housing Pass Through Cdfs, Series 1997-2, Class B1, 7.15%, 15/03/28	9,412	11,106
Bayview Opportunity Master Fund IIIa Trust, Series 2014-16RP, Class A, 3.84%, 28/11/29	1,311,121	1,296,174
Bayview Opportunity Master Fund IIb NPL Trust, Series 2015-NPLA, Class A, 3.72%, 28/07/35	1,153,642	1,139,337
Bayview Opportunity Master Fund IIIb RPL Trust, Series 2015-3, Class A1, 3.62%, 28/04/30	1,526,678	1,510,648

銘柄	額面 金額	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)		
Asset-Backed Securities - 9.18% (2014 - 11.12%) (continued)		
United States - 5.17% (2014 - 4.51%) (continued)		
Bayview Opportunity Master Fund Trust, Series 2014-15RP, Class A, 3.72%, 28/10/19	501,522	496,406
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust, Series 2007-2, Class A2, 0.74%, 25/01/47	479,262	445,714
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd., Series 2014-1A, Class D, 3.77%, 17/04/25	300,000	278,880
Countrywide Home Equity Loan Trust, Series 2004-I, 0.62%, 15/02/34	436,737	388,914
Series 2004-P, 0.65%, 15/03/34	5,646	4,856
Series 2006-G, 0.48%, 15/10/36	9,993	8,508
CPS Auto Receivables Trust, Series 2014-B, 4.62%, 15/05/20	411,000	390,450
Series 2014-C, 4.83%, 17/08/20	761,000	725,690
Credit Suisse Mortgage Trust, Series 2015-RPL2, 3.75%, 25/11/57	2,096,818	2,052,575
Series 2015-RPL5, 3.51%, 26/11/55	4,471,363	4,336,328
Credit Suisse Mortgage Trust REG S, Series 2015-RP3X, Class A1, 3.75%, 25/12/56	2,158,129	2,127,267
Drive Auto Receivables Trust, Series 2015-AA, 4.12%, 15/07/22	1,600,000	1,580,800
Series 2015-DA, 4.59%, 17/01/23	500,000	499,050
Drive Auto Receivables Trust 2015-D, Series 2015-DA, Class C, 3.38%, 15/11/21	800,000	794,160
DT Auto Owner Trust, Series 2014-3A, Class D, 4.47%, 25/11/21	100,000	100,080
Education Funding LLC, Series 2006-1A, Class A2, 0.57%, 25/10/29	636,626	585,442
Exeter Automobile Receivables Trust, Series 2013-2A, 6.81%, 17/08/20	1,000,000	1,026,700
Series 2014-1A, 5.53%, 16/02/21	2,700,000	2,701,620
Series 2014-2A, 4.93%, 15/12/20	800,000	788,960
Series 2014-3A, 5.69%, 15/04/21	400,000	400,000
Series 2014-3A., 4.17%, 15/06/20	1,200,000	1,204,080
FCCA Secured Lending Corp., Series 1999-2, Class WA1C, 7.85%, 18/05/26	289,134	293,356
Flagship Credit Auto Trust, Series 2015-2, Class C, 4.08%, 15/12/21	500,000	485,750
Fraser Sullivan CLO II Ltd., Series 2006-2A, Class D, 2.07%, 20/12/20	1,700,000	1,675,520
HOA Funding LLC, Series 2015-1A, Class A2, 5.50%, 20/08/44	1,250,000	1,118,750
LEAF Receivables Funding 9 LLC, Series 2013-1, Class E2, 6.00%, 15/09/21	243,000	241,955
Morgan Stanley ABS Capital I, Inc. Trust, Series 2006-HE3, 0.58%, 25/04/36	137,060	134,113
Series 2006-NC4, 0.57%, 25/06/36	332,484	299,235
Nationstar HECM Loan Trust, Series 2015-2A, Class M2, 6.657%, 25/11/25	323,990	324,000
Nationstar Home Equity Loan Trust, Series 2007-C, Class 2AV2, 0.55%, 25/06/37	504,239	488,759
Pinnacle Park CLO Ltd., Series 2014-1A, Class C, 3.42%, 15/04/26	300,000	298,560
RMAT LLC, Series 2015-RPL1, Class A1, 3.97%, 26/05/20	760,800	751,366
SLM Private Credit Student Loan Trust, Series 2004-A, 1.46%, 15/06/33	120,998	114,186
Series 2005-B, 1.21%, 15/06/39	197,432	181,066
Soundview Home Loan Trust, Series 2007-OPT3, Class 2A2, 0.55%, 25/08/37	140,606	136,345
SpringCastle America Funding LLC, Series 2014-AA, Class C, 5.59%, 25/10/33	5,000,000	4,996,000
Symphony CLO XVI Ltd., Series 2015-16A, Class D, 3.93%, 15/07/28	500,000	457,750
Vericrest Opportunity Loan Trust, Series 2015-NPL4, Class A1, 3.50%, 25/02/55	829,425	821,794
Vericrest Opportunity Loan XXXI LLC, Series 2015-NPL2, Class A1, 3.38%, 25/02/55	949,459	937,496
VOLT XXXVI LLC, Series 2015-NP10, Class A1, 3.63%, 25/07/45	2,996,456	2,953,606
Westgate Resorts LLC, Series 2014-1A, Class C, 5.50%, 20/12/26	1,508,376	1,500,834
Total United States		45,158,632
Total Asset-Backed Securities		80,206,817

銘柄	額面 金額	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)		
Bank Loan - 0.00% (2014 - 0.18%)		
Netherlands - 0.00%		
<i>Exploration & Production - 0.00%</i> Endeavour International Holding BV, 1.00%, 02/01/17	6,050	1,392
Total Netherlands		1,392
United Kingdom - 0.00% (2014 - 0.18%)		
Total Bank Loans		
		1,392
Convertible Bond - 0.00% (2014 - 0.04%)		
Germany - 0.00% (2014 - 0.04%)		
Corporate Bonds & Notes - 3.58% (2014 - 4.15%)		
Brazil - 0.31% (2014 - 0.51%)		
<i>Integrated Oils - 0.31%</i> Petrobras Global Finance BV, 4.88%, 17/03/20 6.85%, 05/06/15	1,614,000 2,328,000	1,210,500 1,507,380
Total Brazil		2,717,880
British Virgin Islands - 0.00% (2014 - 0.06%)		
Canada - 0.09% (2014 - 0.09%)		
<i>Electrical Equipment Manufacturing - 0.04%</i> NCSG Crane & Heavy Haul Services, Inc., 9.50%, 15/08/19	763,000	326,183
<i>Publishing & Broadcasting - 0.05%</i> Postmedia Network, Inc., 12.50%, 15/07/18	533,000	481,033
Total Canada		807,216
Ecuador - 0.10% (2014 - 0.00%)		
<i>Refining & Marketing - 0.10%</i> EP PetroEcuador via Noble Sovereign Funding I Ltd. 24/09/19	1,012,895	830,574
Total Ecuador		830,574
Germany - 0.02% (2014 - 0.02%)		
<i>Banks - 0.02%</i> HSH Nordbank AG REG S, MTN, 0.72%, 14/02/17	EUR 161,000	158,089
Total Germany		158,089
Luxembourg - 0.00% (2014 - 0.12%)		
Mexico - 0.00% (2014 - 0.02%)		
Poland - 0.03% (2014 - 0.05%)		
<i>Food & Beverage - 0.03%</i> CEDC Finance Corp. International, Inc., 10.00%, 30/04/18	USD 295,605	252,742
Total Poland		252,742

銘柄	額面 金額	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)		
Corporate Bonds & Notes - 3.58% (2014 - 4.15%) (continued)		
Sweden - 0.04% (2014 - 0.05%)		
<u>Chemicals - 0.04%</u>		
Perstorp Holding AB, 8.75%, 15/05/17	200,000	198,000
11.00%, 15/08/17	200,000	188,000
Total Sweden		386,000
United Kingdom - 0.34% (2014 - 0.00%)		
<u>Transportation & Logistics - 0.34%</u>		
Algeco Scotsman Global Finance PLC, 8.50%, 15/10/18	2,625,000	2,198,438
9.00%, 15/10/18	EUR 200,000	177,151
10.75%, 15/10/19	USD 37,000	14,430
CEVA Group PLC, 4.00%, 01/05/18	704,403	591,698
Total United Kingdom		2,981,717
United States - 2.54% (2014 - 2.48%)		
<u>Cable & Satellite - 0.15%</u>		
Neptune Finco Corp., 10.13%, 15/01/23	283,000	295,028
WideOpenWest Finance LLC / WideOpenWest Capital Corp., 10.25%, 15/07/19	1,079,000	1,018,846
		1,313,874
<u>Casinos & Gaming - 0.27%</u>		
Caesars Entertainment Operating Co., Inc., 10.00%, 15/12/18	1,975,698	587,770
10.00%, 15/12/18	3,000	893
10.75%, 01/02/16	4,000	1,020
Downstream Development Authority of the Quapaw Tribe of Oklahoma, 10.50%, 01/07/19	856,000	875,260
Golden Nugget Escrow, Inc., 8.50%, 01/12/21	325,000	326,625
Greektown Holdings LLC/Greektown Mothership Corp., 8.88%, 15/03/19	179,000	180,790
International Game Technology PLC, 6.50%, 15/02/25	495,000	435,600
		2,407,958
<u>Commercial Finance - 0.05%</u>		
NewStar Financial, Inc., 7.25%, 01/05/20	481,000	466,570
<u>Construction Materials Manufacturing - 0.01%</u>		
NWH Escrow Corp., 7.50%, 01/08/21	100,000	80,000
<u>Consumer Finance - 0.08%</u>		
DFC Finance Corp., 10.50%, 15/06/20	803,000	473,770
First Data Corp., 7.00%, 01/12/23	237,998	238,000
		711,770
<u>Consumer Services - 0.02%</u>		
Sotheby's, 5.25%, 01/10/22	160,000	145,600
<u>Department Stores - 0.04%</u>		
Neiman Marcus Group LTD, Inc., PIK, 8.75%, 15/10/21	583,000	361,460
<u>Entertainment Contents - 0.14%</u>		
DreamWorks Animation SKG, Inc., 6.88%, 15/08/20	113,000	111,305
Production Resource Group, Inc., 8.88%, 01/05/19	1,512,000	1,118,880
		1,230,185

銘柄	額面 金額	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)		
Corporate Bonds & Notes - 3.58% (2014 - 4.15%) (continued)		
United States - 2.54% (2014 - 2.48%) (continued)		
<u>Financial Services - 0.13%</u>		
MF Global Holdings Ltd., 1.88%, 01/02/16	29,000	6,453
6.25%, 08/08/16	3,000	668
ROC Finance LLC / ROC Finance 1 Corp., 12.13%, 01/09/18	1,051,000	1,098,295
		<u>1,105,416</u>
<u>Forest & Paper Products Manufacturing - 0.04%</u>		
Resolute Forest Products, Inc., 5.88%, 15/05/23	458,000	333,195
<u>Hardware - 0.12%</u>		
Everi Payments, Inc., 10.00%, 15/01/22	682,000	600,160
Real Alloy Holding, Inc., 10.00%, 15/01/19	397,000	402,707
		<u>1,002,867</u>
<u>Health Care Facilities/Services - 0.23%</u>		
inVentiv Health, Inc., 10.00%, 15/08/18	635,000	628,650
Kindred Healthcare, Inc., 8.00%, 15/01/20	302,000	282,370
8.75%, 15/01/23	168,000	154,560
Tenet Healthcare Corp., 8.13%, 01/04/22	37,000	36,907
Universal Hospital Services, Inc., 7.63%, 15/08/20	921,000	864,589
		<u>1,967,076</u>
<u>Manufactured Goods - 0.01%</u>		
Wise Metals Group LLC / Wise Alloys Finance Corp., 8.75%, 15/12/18	85,000	64,388
<u>Metals & Mining - 0.01%</u>		
Aleris International, Inc., 7.63%, 15/02/18	57,000	48,450
<u>Pharmaceuticals - 0.01%</u>		
Valeant Pharmaceuticals International, Inc., 7.25%, 15/07/22	34,000	33,235
7.50%, 15/07/21	37,000	36,908
		<u>70,143</u>
<u>Pipeline - 0.30%</u>		
Energy Transfer Equity LP, 5.50%, 01/06/27	822,000	624,720
Kinder Morgan, Inc., MTN, 8.05%, 15/10/30	983,000	955,977
NGPL PipeCo LLC, 7.12%, 15/12/17	424,000	394,320
Sabine Pass Liquefaction LLC, 5.63%, 15/04/23	543,000	476,482
Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp., 6.75%, 15/03/24	193,000	164,533
		<u>2,616,032</u>
<u>Power Generation - 0.03%</u>		
NRG Energy, Inc., 6.25%, 01/05/24	271,000	227,694
<u>Publishing & Broadcasting - 0.46%</u>		
American Media, Inc., 11.50%, 15/12/17	920,000	906,200
LBI Media, Inc., 10.00%, 15/04/19	442,000	424,320
13.50%, 15/04/20	1,045,383	1,003,568
Lee Enterprises, Inc., 9.50%, 15/03/22	866,000	796,720
McClatchy Co., 9.00%, 15/12/22	141,000	125,490
Time, Inc., 5.75%, 15/04/22	990,000	905,850
		<u>4,162,148</u>

銘柄	額面 金額	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)		
Corporate Bonds & Notes - 3.58% (2014 - 4.15%) (continued)		
United States - 2.54% (2014 - 2.48%) (continued)		
<u>Retail - Consumer Discretionary - 0.24%</u>		
Claire's Stores, Inc., 6.13%, 15/03/20	43,000	23,220
9.00%, 15/03/19	642,000	388,410
DriveTime Automotive Group, Inc. / DT Acceptance Corp., 8.00%, 01/06/21 Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp., 6.50%, 01/05/21	1,258,000	1,119,619
238,000		202,300
6.75%, 15/06/23	447,000	364,305
		<u>2,097,854</u>
<u>Software & Services - 0.07%</u>		
iPayment, Inc., 9.50%, 15/12/19	618,000	641,175
<u>Wireless Telecommunication Services - 0.13%</u>		
Frontier Communications Corp., 9.00%, 15/08/31	1,362,000	1,154,295
Total United States		<u>22,208,150</u>
Venezuela - 0.11% (2014 - 0.75%)		
<u>Integrated Oils - 0.11%</u>		
Petroleos de Venezuela SA REG S, 6.00%, 15/11/26	2,575,000	946,313
Total Venezuela		<u>946,313</u>
Total Corporate Bonds & Notes		<u>31,288,681</u>
Mortgage-Backed Securities - 17.37% (2014 - 14.87%)		
Cayman Islands - 1.21% (2014 - 0.00%)		
<u>Collateralised Debt Obligation (Commercial) - 1.01%</u>		
Cobalt Commercial Mortgage, Series 2005-1A, Class B, 0.83%, 25/05/45	255,179	250,075
Gramercy Real Estate CDO Ltd., Series 2007-1A, Class A1, 0.64%, 15/08/56	1,279,521	1,196,352
Marathon Real Estate CDO Ltd., Series 2006-1A, Class B, 0.85%, 25/05/46	473,000	455,500
N-Star REL CDO VI Ltd., Series 2006-6A, Class B, 0.96%, 16/06/41	586,000	501,030
NCT VI Funding Ltd., Series 2013-6A, Class IMM1, 0.67%, 25/04/40	504,675	492,058
RAIT CRE CDO I Ltd., Series 2006-1A, Class A2, 0.75%, 20/11/46	449,000	395,120
RAIT Preferred Funding II Ltd., Series 2007-2A, Class A2, 0.87%, 25/06/45	557,000	501,300
Resource Capital Corp. Ltd., Series 2015-CRE3, Class D, 4.35%, 13/03/52	700,000	698,670
SRERS Funding Ltd., Series 2011-RS, Class A1B1, 0.54%, 09/05/46	4,482,863	4,352,860
		<u>8,842,965</u>
<u>Commercial Mortgage-Backed Securities - 0.20%</u>		
ACRE Commercial Mortgage Trust, Series 2014-FL2, Class D, 3.75%, 15/08/31	500,000	496,550
PFP III Ltd., Series 2015-2, 4.32%, 14/07/34	550,000	542,465
Series 2015-2, 4.92%, 14/07/34	700,000	694,400
		<u>1,733,415</u>
Total Cayman Islands		<u>10,576,380</u>
United States - 16.16% (2014 - 14.87%)		
<u>Collateralised Mortgage Obligation (Residential) - 4.52%</u>		
Banc of America Funding Corp., Series 2006-I, Class 6A1, 0.59%, 20/10/46	7,918,881	6,137,133
Banc of America Funding Trust, Series 2007-B, Class A1, 0.61%, 20/04/47	5,726,539	4,380,802
Bellemeade Re Ltd., Series 2015-1A, Class M2, 4.72%, 25/07/25	300,000	297,510
Chase Mortgage Finance Trust, Series 2007-A2, Class 3A2, 2.69%, 25/07/35	141,463	132,791

銘柄	額面 金額	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)		
Mortgage-Backed Securities - 17.37% (2014 - 14.87%) (continued)		
United States - 16.16% (2014 - 14.87%) (continued)		
<u>Collateralised Mortgage Obligation (Residential) - 4.52% (continued)</u>		
Connecticut Avenue Securities,		
Series 2014-C01, 4.82%, 25/01/24	27,000	26,652
Series 2014-C02, 3.02%, 25/05/24	4,091,605	3,571,153
Series 2014-C02, 3.02%, 25/05/24	1,233,110	1,101,044
Series 2014-C03, 3.32%, 25/07/24	1,951,216	1,767,607
Series 2014-C03, 3.42%, 25/07/24	522,938	470,540
Series 2014-C04, 5.32%, 25/11/24	519,667	515,666
Series 2014-C04, 5.42%, 25/11/24	692,245	692,245
Series 2015-C02, 4.22%, 25/05/25	150,000	141,750
Series 2015-C02, 4.42%, 25/05/25	101,000	95,384
Countrywide Alternative Loan Trust, Series 2005-21CB, Class A17, 6.00%, 25/06/35	486,469	476,740
Countrywide Asset-Backed Certificates, Series 2005-15, Class 1AF6, 4.40%, 25/04/36	124,471	125,068
Federal Home Loan Mortgage Corporation, Series 2015-HQA1, Class M3, 5.12%, 25/03/28	614,200	598,169
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust, Series 2005-AA9, Class 3A1, 2.34%, 25/11/35	2,903,532	2,441,580
Gramercy Real Estate CDO, Series 2006-1A, Class E, 1.02%, 25/07/41	1,625,000	1,454,375
Invitation Homes Trust, Series 2015-SFR3, Class D, 3.10%, 17/08/32	2,100,000	2,065,560
Invitation Homes 2015-SFR3 Trust, Series 2015-SFR3, Class E, 4.10%, 17/08/32	700,000	686,700
JP Morgan Alternative Loan Trust,		
Series 2005-A2, 0.94%, 25/01/36	532,023	495,686
Series 2006-S4, 5.78%, 25/12/36	191,529	180,554
JP Morgan Mortgage Acquisition Trust, Series 2006-HE2, Class A4 SEQ, 0.57%, 25/07/36	1,311,642	1,250,651
RALI Trust, Series 2005-QA13, Class 2A1, 3.65%, 25/12/35	828,436	703,756
Structured Agency Credit Risk,		
Series 2014-DN1, 4.92%, 25/02/24	1,657,979	1,636,591
Series 2014-HQ2, 4.17%, 25/09/24	2,684,249	2,472,462
Series 2015-DN1, 4.57%, 25/01/25	934,006	912,991
Series 2015-DNA3, 5.12%, 25/04/28	867,088	853,995
Series 2015-HQ1, 4.22%, 25/03/25	981,612	940,090
Series 2015-HQA2, 5.22%, 25/05/28	1,099,800	1,083,193
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust,		
Series 2006-AR12, 2.43%, 25/10/36	578,273	511,714
Series 2007-OA6, 1.07%, 25/07/47	968,987	794,860
Wells Fargo Mortgage Backed Securities Trust, Series 2007-10, Class 2A5, 6.25%, 25/07/37	187,776	187,138
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust, Series 2005-9, Class 1A12, 5.50%, 25/10/35	251,073	251,627
		<u>39,453,777</u>
<u>Commercial Mortgage-Backed Securities - 10.58%</u>		
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust,		
Series 2013-DSNY, 3.83%, 15/09/26	1,200,000	1,200,000
Series 2014-ICTS, 3.28%, 15/06/28	600,000	598,620
Series 2014-INLD, 3.70%, 15/12/29	1,000,000	996,800
Banc of America Commercial Mortgage Trust,		
Series 2006-6, 5.48%, 10/10/45	130,000	128,830
Series 2007-2, 5.63%, 10/04/49	474,153	455,330
Barclays Commercial Mortgage, Series 2015-RR1, Class F, 4.78%, 15/05/32	1,011,000	1,001,598
BBCMS Trust,		
Series 2014-BXO, 3.33%, 15/08/27	900,000	895,320
Series 2014-BXO, 4.08%, 15/08/27	1,000,000	996,100
Series 2015-RRMZ, 6.20%, 15/05/20	1,100,000	1,100,100
Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust,		
Series 2005-PW10, 5.49%, 11/12/40	3,110,655	3,079,548
Series 2006-PW14, 5.33%, 11/12/38	170,000	158,253
Series 2006-T24, 5.60%, 12/10/41	940,558	943,568
Series 2007-PW15, 5.36%, 11/02/44	762,336	775,677

銘柄	額面 金額	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)		
Mortgage-Backed Securities - 17.37% (2014 - 14.87%) (continued)		
United States - 16.16% (2014 - 14.87%) (continued)		
<u>Commercial Mortgage-Backed Securities - 10.58% (continued)</u>		
Series 2007-PW15, 5.36%, 11/02/44	926,143	944,758
CD Commercial Mortgage Trust, Series 2007-CD4, Class AJ, 5.40%, 11/12/49	968,000	793,760
CDGJ Commercial Mortgage Trust, Series 2014-BXCH, Class DPB, 4.18%, 15/12/27	1,200,000	1,176,600
CGBAM Commercial Mortgage Trust, Series 2014-HD, Class E, 3.33%, 15/02/31	160,000	157,536
Citigroup Commercial Mortgage Trust, Series 2006-C5, 5.48%, 15/10/49	780,639	770,959
Series 2007-C6, 5.71%, 10/12/49	213,031	219,379
Series 2015-GC29, 3.11%, 10/04/48	910,000	636,636
Series 2015-GC31, 4.06%, 10/06/48	778,000	579,299
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2015-SHP2, Class E, 4.68%, 15/07/27	300,000	297,330
COBALT CMBS Commercial Mortgage Trust, Series 2006-C1, Class AM SEQ, 5.25%, 15/08/48	862,748	874,395
COMM Mortgage Trust, Series 2015-LC19, Class D, 2.87%, 10/02/48	2,000,000	1,473,000
Commercial Mortgage Loan Trust, Series 2008-LS1, Class AM, 6.04%, 10/12/49	754,901	722,516
Commercial Mortgage Trust, Series 2006-C7, 5.79%, 10/06/46	1,475,886	1,379,953
Series 2006-C8 SEQ, 5.38%, 10/12/46	379,070	375,090
Series 2007-C9, 5.80%, 10/12/49	500,000	488,850
Series 2014-PAT, 3.47%, 13/08/27	600,000	591,600
Series 2015-CR23, Class D, 4.26%, 10/05/48	853,000	657,407
Credit Suisse Commercial Mortgage Trust, Series 2006-C5, 5.37%, 15/12/39	224,397	210,641
Series 2007-C1, 5.42%, 15/02/40	1,096,438	1,115,187
Series 2007-C1, 5.42%, 15/02/40	674,126	687,204
Series 2007-C2, 5.60%, 15/01/49	3,432,868	3,355,285
Series 2007-C5, 5.87%, 15/09/40	321,153	323,594
Series 2007-C5, 5.87%, 15/09/40	306,901	311,351
Series 2015-SAND, 5.03%, 15/08/30	1,100,000	1,096,590
Credit Suisse Mortgage Trust, Series 2006-C4, 5.54%, 15/09/39	1,133,669	1,133,102
Series 2007-C1, 0.54%, 15/02/40	73,000	66,540
Series 2007-C2, 5.60%, 15/01/49	160,000	150,400
Series 2015-DEAL, 4.33%, 15/04/29	1,000,000	995,900
CSMC Trust 2015-DEAL, Series 2015-DEAL, Class D, 3.43%, 15/04/29	600,000	593,580
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series K043, Class X3, 1.64%, 25/02/43	2,723,000	282,375
FREMF Mortgage Trust, Series 2015-K50, 3.78%, 25/08/25	254,746	219,973
Series 2015-K721, 3.68%, 25/11/47	128,894	99,996
Great Wolf Trust, Series 2015-WOLF, 3.83%, 15/05/34	1,242,000	1,212,689
Series 2015-WOLF, 4.78%, 15/05/34	779,000	757,422
Series 2015-WOLF, 5.33%, 15/05/34	1,219,000	1,187,306
GS Mortgage Securities Corp. III, Series 2005-GG4, Class D, 4.94%, 10/07/39	101,000	99,485
GS Mortgage Securities Trust, Series 2006-GG6, 5.67%, 10/04/38	418,000	417,039
Series 2007-GG10, 5.79%, 10/08/45	1,709,124	1,675,112
Series 2015-GC32, 4.41%, 10/07/48	795,000	753,740
Hilton Mortgage Trust, Series 2014-ORL, Class F, 4.08%, 15/07/29	402,188	397,241
Hilton USA Trust, Series 2013-HLF, 4.02%, 05/11/30	1,586,750	1,578,340
Series 2013-HLT, 4.41%, 05/11/30	300,000	300,360
Series 2013-HLT, 5.61%, 05/11/30	400,000	397,240
Series 2014-ORL, 3.58%, 15/07/29	320,000	313,888
Hyatt Hotel Portfolio Trust, Series 2014-HYMZ, Class M, 6.56%, 15/11/16	1,010,000	1,010,000

銘柄	額面 金額	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)		
Mortgage-Backed Securities - 17.37% (2014 - 14.87%) (continued)		
United States - 16.16% (2014 - 14.87%) (continued)		
<u>Commercial Mortgage-Backed Securities - 10.58% (continued)</u>		
Irvine Core Office Trust, Series 2013-IRV, Class F, 3.17%, 15/05/48	105,525	86,636
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp., Series 2004-CB8, Class G, 5.13%, 01/12/39	597,724	602,267
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust,		
Series 2005-CB13, 5.38%, 12/01/43	1,314,810	1,281,940
Series 2006-CB14, 5.54%, 12/12/44	398,960	396,686
Series 2006-CB15, 5.86%, 12/06/43	612,475	615,844
Series 2007-LD11, 5.77%, 15/06/49	1,613,647	1,650,922
Series 2014-BXH, 4.08%, 15/04/27	600,000	598,740
Series 2014-FL5, 3.83%, 15/07/31	3,800,000	3,787,840
Series 2014-INMZ, 6.56%, 15/06/29	1,010,000	1,009,596
Series 2015-C30, 4.31%, 15/07/48	8,232,000	7,071,288
Series 2015-CSMO, 4.28%, 15/01/32	500,000	496,950
Series 2015-CSMO, Class D, 3.63%, 15/01/32	1,200,000	1,189,440
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust, Series 2014-INN, Class E, 3.93%, 15/06/29	550,000	549,010
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust,		
Series 2015-C28, 3.74%, 15/10/48	2,820,000	2,009,814
Series 2015-C30, 3.81%, 15/07/48	1,580,000	1,125,276
JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2014-FRR1, Class B707, 2.01%, 27/01/47	783,000	682,541
LB UBS Commercial Mortgage Trust, Series 2008-C1, Class AM, 6.09%, 15/04/41	320,945	333,109
LSTAR Commercial Mortgage Trust, Series 2015-3, Class D, 3.33%, 20/04/48	2,212,000	1,568,529
Merrill Lynch Mortgage Trust, Series 2007-C1, Class AM, 5.84%, 06/12/50	1,650,044	1,668,855
ML-CFC Commercial Mortgage Trust,		
Series 2006-4, 5.30%, 12/12/49	653,000	644,054
Series 2006-4, 5.32%, 12/12/49	126,000	100,422
Series 2007-7, 5.74%, 12/06/50	1,314,772	1,318,716
Series 2007-8, 5.88%, 12/08/49	1,215,271	1,244,559
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust,		
Series 2014-C19, Class D, 3.25%, 15/12/47	1,925,000	1,401,593
Series 2015-C21, 4.16%, 15/03/48	4,506,000	3,607,954
Series 2015-C23, 4.14%, 15/07/50	1,580,000	1,240,774
Morgan Stanley Capital I Trust,		
Series 2007-IQ14, 5.68%, 15/04/49	1,052,443	1,077,175
Series 2007-IQ14, 5.68%, 15/04/49	583,878	599,292
Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust,		
Series 2005-C22, 5.56%, 15/12/44	103,000	102,876
Series 2005-C22, 5.56%, 15/12/44	149,000	146,393
Series 2006-C25, 5.77%, 15/05/43	446,000	446,089
Series 2006-C27, 5.83%, 15/07/45	761,437	760,447
Series 2006-C29, 5.37%, 15/11/48	416,709	413,292
Series 2006-C29, 5.43%, 15/11/48	121,000	117,019
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust,		
Series 2015-C27, 3.77%, 15/02/48	2,755,000	2,045,588
Series 2015-C31, 3.85%, 15/11/48	389,000	286,343
Series 2015-LC20, 4.37%, 15/04/50	1,135,000	896,764
Series 2015-NXS2, 4.25%, 15/07/58	4,043,000	3,683,577
Series 2015-NXS4, 3.76%, 15/12/48	403,000	275,492
		<hr/>
		92,343,994
<u>Interest Only Commercial Mortgage-Backed Securities - 1.06%</u>		
Citigroup Commercial Mortgage Trust,		
Series 2015-GC29, 1.17%, 10/04/48	8,559,152	626,530
Series 2015-GC35, 1.06%, 10/11/48	1,272,235	76,207

銘柄	額面 金額	時価 米ドル
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)		
Mortgage-Backed Securities - 17.37% (2014 - 14.87%) (continued)		
United States - 16.16% (2014 - 14.87%) (continued)		
<i>Interest Only Commercial Mortgage-Backed Securities - 1.06% (continued)</i>		
Commercial Mortgage Trust,		
Series 2014-UBS5, 1.10%, 10/09/47	4,192,268	244,409
Series 2015-CR23, 1.01%, 10/05/48	3,886,810	239,039
Series 2015-CR27, 1.18%, 10/10/48	1,626,428	121,982
CSAIL Commercial Mortgage Trust,		
Series 2015-C1, 0.97%, 15/04/50	3,605,240	221,722
Series 2015-C2, 0.90%, 15/06/57	12,922,753	739,181
Series 2015-C3, 0.89%, 15/08/48	5,414,997	295,659
Series 2015-C4, 0.96%, 15/11/48	5,161,036	334,951
GS Mortgage Securities Trust,		
Series 2014-GC24, 0.88%, 10/09/47	11,687,337	606,573
Series 2015-GC32, 0.91%, 10/07/48	4,401,566	253,090
Series 2015-GC34, 1.38%, 10/10/48	2,567,411	246,215
Series 2016-GS1, 0.85%, 10/11/48	2,377,659	148,841
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust,		
Series 2015-C30, 0.72%, 15/07/48	9,676,234	407,369
Series 2015-C32, 1.53%, 15/11/48	4,537,047	364,325
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust,		
Series 2014-C17, 1.27%, 15/08/47	3,196,598	213,533
Series 2014-C19, 1.16%, 15/12/47	10,600,230	681,595
Series 2015-C22, 1.18%, 15/04/48	16,788,957	1,220,557
Series 2015-C23, 0.77%, 15/07/50	13,530,563	604,816
Series 2015-C25, 1.16%, 15/10/48	3,920,722	307,385
Series 2015-C27, 1.06%, 15/12/47	1,258,589	88,605
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust,		
Series 2015-C28, 0.78%, 15/05/48	8,288,051	416,889
Series 2015-C29, 0.78%, 15/06/48	13,992,114	699,606
WFRBS Commercial Mortgage Trust, Series 2014-C22, Class XA, 0.95%, 15/09/57	2,144,644	122,674
		<u>9,281,753</u>
Total United States		<u>141,079,524</u>
Total Mortgage-Backed Securities		<u>151,655,904</u>
Sovereign Debt - 3.05% (2014 - 5.29%)		
Argentine Republic Government International Bond,		
7.82%, 31/12/33	EUR 4,303,076	4,921,877
8.28%, 31/12/33	2,016,131	2,318,550
8.28%, 31/12/33	640,646	719,125
8.75%, 02/06/17	1,676,000	1,914,830
Hellenic Republic Government Bond REG S,		
3.00%, 24/02/25	230,000	175,842
3.00%, 24/02/31	230,000	151,559
3.00%, 24/02/28	230,000	162,197
3.00%, 24/02/29	230,000	160,652
3.00%, 24/02/35	230,000	142,248
3.00%, 24/02/36	230,000	140,846
3.00%, 24/02/40	230,000	142,238
3.00%, 24/02/39	230,000	142,370
3.00%, 24/02/37	230,000	139,973
3.00%, 24/02/23	230,000	185,715
3.00%, 24/02/24	510,000	398,777
3.00%, 24/02/30	230,000	156,195
3.00%, 24/02/33	230,000	146,830

銘柄		額面 金額	時価 米ドル		
Investments in Securities - 47.52% (2014 - 69.97%) (continued)					
Sovereign Debt - 3.05% (2014 - 5.29%) (continued)					
3.00%, 24/02/34		230,000	145,855		
3.00%, 24/02/32		230,000	149,807		
3.00%, 24/02/38		230,000	139,341		
3.00%, 24/02/42		230,000	142,173		
3.00%, 24/02/41		230,000	142,403		
3.00%, 24/02/27		230,000	165,743		
3.00%, 24/02/26		230,000	169,968		
3.38%, 17/07/17		2,923,000	2,986,833		
4.75%, 17/04/19		1,299,000	1,294,518		
Kazakhstan Government International Bond REG S, 5.13%, 21/07/25	USD	415,000	408,991		
Mexico Government International Bond, 4.00%, 02/10/23		764,000	773,932		
Pakistan Government International Bond REG S, 6.75%, 03/12/19		867,000	878,279		
Republic of Cyprus REG S, 3.88%, 06/05/22	EUR	804,000	908,265		
Republic of Indonesia REG S, 4.75%, 08/01/26	USD	228,000	225,187		
Republic of Iraq REG S, 5.80%, 15/01/28		910,000	612,466		
Republic of Sri Lanka REG S, 6.85%, 03/11/25		691,000	650,906		
Republic of Venezuela REG S, 5.75%, 26/02/16		2,767,000	2,483,382		
Russian Federation REG S, 5.63%, 04/04/42		2,400,000	2,270,400		
Total Sovereign Debt			26,668,273		
U.S. Government Sponsored Agency Securities - 0.76% (2014 - 2.46%)					
United States - 0.76% (2014 - 2.46%)					
<u>Inverse Interest Only Collateralised Mortgage Obligations - 0.14%</u>					
Government National Mortgage Association, Series 2014-133, Class IB, 5.00%, 20/09/44		6,019,661	1,220,185		
<u>Inverse Interest Only Collateralised Mortgage Obligations - 0.62%</u>					
Federal Home Loan Mortgage Corp.,					
Series 3706, Class BS, 6.27%, 15/08/40		9,007,089	1,705,041		
Series 4111, Class AS, 5.77%, 15/09/42		10,427,769	2,126,222		
Government National Mortgage Association,					
Series 2009-101, 6.05%, 20/08/39		871,038	116,458		
Series 2010-26, Class QS, 5.85%, 20/02/40		7,970,079	1,303,905		
Series 2011-56, 6.25%, 20/04/41		766,574	141,050		
			5,392,676		
Total United States			6,612,861		
Total U.S. Government Sponsored Agency Securities			6,612,861		
Total Financial Assets at Fair Value through Profit or Loss - Investments in Securities (Cost USD 426,053,556)			415,153,633		
Securities purchased under agreement to resell - 21.58% (2014 - 26.33%)					
取引相手	金利	取引日	満期日	額面 米ドル	未収利息込み 額面 米ドル
State Street Bank and Trust Company	0.01%	30/12/015	04/01/16	188,500,000	188,500,000
Total securities purchased under agreement to resell					188,500,000
				契約数	時価 米ドル
Purchased Options - 0.26% (2014 - 0.30%)					
Exchange-Traded Call Options - 0.10% (2014 - 0.15%)					
Bank of America Corp. Strike Price 19.00 USD Expires 15/01/16				193	193
Bank of America Corp. Strike Price 17.00 USD Expires 15/01/16				3,405	88,530
Comerica, Inc. Strike Price 50.00 USD Expires 15/04/16				172	10,406

	契約数	時価 米ドル
Purchased Options - 0.26% (2014 - 0.30%) (continued)		
Exchange-Traded Call Options - 0.10% (2014 - 0.15%) (continued)		
iShares 20+ Year Treasury Bond Strike Price 123.00 USD Expires 19/02/16	178	20,648
Liberty Global PLC Strike Price 62.50 USD Expires 15/01/16	166	-
Liberty Global PLC Strike Price 60.00 USD Expires 15/01/16	285	-
Liberty Global PLC Strike Price 52.50 USD Expires 15/01/16	30	150
Liberty Global PLC Strike Price 55.00 USD Expires 15/01/16	76	380
Liberty Global PLC Strike Price 57.50 USD Expires 15/01/16	83	-
Russell 2000 Index Strike Price 1,210.00 USD Expires 18/03/16	17	15,810
S&P 500 Index Strike Price 2,150.00 USD Expires 18/03/16	24	24,120
S&P 500 Index Strike Price 2,050.00 USD Expires 15/01/16	34	66,640
S&P 500 Index Strike Price 2,095.00 USD Expires 22/01/16	22	16,280
S&P 500 Index Strike Price 2,100.00 USD Expires 19/02/16	13	21,970
S&P 500 Index Strike Price 2,150.00 USD Expires 19/02/16	19	7,695
S&P 500 Index Strike Price 2,115.00 USD Expires 15/01/16	28	3,780
Time Warner Cable, Inc. Strike Price 195.00 USD Expires 15/01/16	48	2,280
Valeant Pharmaceuticals International Strike Price 115.00 USD Expires 15/01/16	82	11,070
Valeant Pharmaceuticals International Strike Price 110.00 USD Expires 15/01/16	185	43,475
Wells Fargo & Co. Strike Price 45.00 USD Expires 15/01/16	350	332,500
Wells Fargo & Co. Strike Price 52.50 USD Expires 15/04/16	284	99,400
		<u>765,327</u>
Exchange-Traded Put Options - 0.06% (2014 - 0.08%)		
Russell 2000 Index Strike Price 1,070.00 USD Expires 17/06/16	24	102,240
S&P 500 Index Strike Price 1,950.00 USD Expires 29/01/16	12	16,800
S&P 500 Index Strike Price 2,055.00 USD Expires 08/01/16	102	242,760
S&P 500 Index Strike Price 1,975.00 USD Expires 18/03/16	13	49,400
S&P 500 Index Strike Price 1,940.00 USD Expires 29/01/16	116	129,920
Valeant Pharmaceuticals International Strike Price 70.00 USD Expires 15/01/16	49	1,225
		<u>542,345</u>
FX OTC Call Options - 0.00% (2014 - 0.04%)		
OTC Call Options - 0.05% (2014 - 0.03%)		
Liberty Global, Inc. Strike Price 45.00 USD Expires 15/01/16 Counterparty Bank of America, N.A.	57,800 USD	14,590
Mallinckrodt PLC Strike Price 80.00 USD Expires 15/01/16 Counterparty Morgan Stanley & Co. International PLC	53,800 USD	91,235
Valeant Pharmaceuticals Strike Price 85.00 USD Expires 15/01/16 Counterparty Morgan Stanley & Co. International PLC	18,100 USD	318,605
		<u>424,430</u>
OTC Put Options - 0.05% (2014 - 0.00%)		
Euro Stoxx 50 Strike Price 2,399.39 EUR Expires 20/01/17 Counterparty J.P. Morgan Chase Bank, N.A.	8,400 EUR	6,371
Euro Stoxx 50 Strike Price 2,428.70 EUR Expires 20/01/17 Counterparty Morgan Stanley Capital Services LLC	8,400 EUR	6,755
Financial Select Sector SPDR Strike Price 1,445.00 USD Expires 13/04/16 Counterparty Morgan Stanley Capital Services LLC	2,517 USD	68,851
iShares PHLX Semiconductor ETF Strike Price 87.00 USD Expires 20/01/17 Counterparty Morgan Stanley & Co. International LLC	6,800 USD	58,336
iShares PHLX Semiconductor ETF Strike Price 87.00 USD Expires 20/01/17 Counterparty Credit Suisse International	28,900 USD	247,929
KOSPI 200 Index Strike Price 171.29 KRW Expires 12/01/17 Counterparty JPMorgan Chase Bank N.A.	5,600,516 KRW	7,205
Schwab (Charles) Corp. Strike Price 31.00 USD Expires 15/01/16 Counterparty Deutsche Bank AG	1,702 USD	38,033
		<u>433,480</u>
Total Purchased Options (Cost USD 3,213,099)		<u>2,165,582</u>

	行使価格	行使期限	契約数	プレミアム (受取) 米ドル	市場価格 米ドル	未実現評価益/ 未実現評価(損) 米ドル
Options Written Contracts Outstanding at 31 December 2015 - (1.19%) (2014 - (0.07%))						
Exchange-Traded Call Options Written 2015 - (0.04%) (2014 - (0.00%))						
Bank of America Corp.	19.00 USD	15/01/16	193	(2,115)	(193)	1,922
iShares 20+ Year Treasury Bond	126.00 USD	19/02/16	178	(21,088)	(9,256)	11,832
Well Fargo & Co.	52.50 USD	15/04/16	284	(91,763)	(99,400)	(7,637)
Well Fargo & Co.	45.00 USD	15/01/16	350	(323,057)	(332,500)	(9,443)
				(438,023)	(441,349)	(3,326)

Exchange-Traded Put Options Written 2015 - (0.01%) (2014 - (0.00%))						
Comerica, Inc.	40.00 USD	15/04/16	59	(9,974)	(11,977)	(2,003)
Russell 2000 Index	900.00 USD	17/06/16	24	(27,623)	(27,960)	(337)
Russell 2000 Index	990.00 USD	18/03/16	17	(19,166)	(13,005)	6,161
S&P 500 Index	1,750.00 USD	18/03/16	13	(26,946)	(14,300)	12,646
S&P 500 Index	1,775.00 USD	18/03/16	24	(41,924)	(30,720)	11,204
				(125,633)	(97,962)	27,671

FX OTC Call Options Written - 0.00% (2014 - (0.04%))

OTC Put Options Written - 0.00% (2014 - (0.01%))

取引相手	行使価格	行使期限	想定元本	通貨	プレミアム (受取) 米ドル	市場価格 米ドル	未実現利益 /(損) 米ドル
OTC Call Options Written 2015 - (1.14%) (2014 - 0.02%)							
Financial Select Sector SPDR	Morgan Stanley Capital Services LLC	1,205.00 USD	13/04/16	2,517 USD	(18,917)	(20,848)	(1,931)
Financial Select Sector SPDR	Morgan Stanley & Co. International PLC	404,500 USD	15/01/16	404,500 USD	(3,474,655)	(3,552,240)	(77,585)
Health Care Select Sector SPDR	Morgan Stanley & Co. International PLC	29,100 USD	15/01/16	29,100 USD	(2,060,280)	(2,096,572)	(36,292)
iShares NASDAQ Biotechnology	Morgan Stanley & Co. International PLC	10,700 USD	15/01/16	10,700 USD	(3,531,642)	(3,618,673)	(87,031)
Shire PLC	Bank of America, N.A.	5,200 USD	15/01/16	5,200 USD	(31,876)	(142)	31,734
Time Warner Cable, Inc.	Bank of America, N.A.	9,600 USD	15/01/16	9,600 USD	(26,112)	(610)	25,502
Valeant Pharmaceuticals	Morgan Stanley & Co. International PLC	125 USD	17/06/16	18,100 USD	(96,654)	(162,529)	(65,875)
					(9,240,136)	(9,451,614)	(211,478)
Total Options Written Outstanding					(9,803,792)	(9,990,925)	(187,133)

Futures Contracts Outstanding at 31 December 2015 - 0.15% (2014 - (0.06%))

銘柄	契約枚数	取引所	想定元本	通貨	行使期限	未実現利益 /(損) 米ドル
Long Futures						
90 Day Eurodollar	1	CME	243,053 USD	USD	16/12/19	1,072
Australian 10-Year Bond	833	SFE	105,308,652 AUD	AUD	15/03/16	286,137
CAC40 10 Euro	122	Euronext	5,597,926 EUR	EUR	15/01/16	66,340
Canada 10-Year Bond	181	CDE	25,197,489 CAD	CAD	21/03/16	232,494
CBOE Volatility Index	12	CFE	234,213 USD	USD	17/02/16	(7,713)
DAX Index	13	Eurex	3,389,443 EUR	EUR	18/03/16	121,126
Euro FX	99	CME	13,645,615 USD	USD	14/03/16	(174,190)
Euro Stoxx 50	93	Eurex	2,990,042 EUR	EUR	18/03/16	67,616
Euro-BTP	420	Eurex	58,221,592 EUR	EUR	08/03/16	(320,800)
FTSE/MIB Index	3	IDEM	315,630 EUR	EUR	18/03/16	6,521
IBEX 35 Index	93	MEFF	8,930,033 EUR	EUR	15/01/16	(76,696)
Japanese Yen Currency	200	CME	20,642,074 USD	USD	14/03/16	189,176
OMXS30 Index	433	Nasdaq OMX	61,375,208 SEK	SEK	15/01/16	156,749
S&P 500 E-Mini	90	CME	9,092,136 USD	USD	18/03/16	67,164
S&P/TSX 60 Index	4	CDE	609,591 CAD	CAD	17/03/16	(629)

Futures Contracts Outstanding at 31 December 2015 - 0.15% (2014 - (0.06%)) (continued)

銘柄	契約枚数	取引所	想定元本	通貨	行使期限	未実現利益 /(損) 米ドル
Long Futures						
SPI 200	148	SFE	18,251,120	AUD	17/03/16	874,279
Swiss Franc Currency	76	CME	9,667,017	USD	14/03/16	(136,618)
Swiss Market Index	44	Eurex	3,715,132	CHF	18/03/16	132,895
U.S. Treasury 10-Year Note	409	CBOT	51,595,795	USD	21/03/16	(100,139)
						<u>1,384,784</u>
Short Futures						
90 Day Eurodollar	7	CME	1,702,532	USD	15/06/20	(4,593)
90 Day Eurodollar	27	CME	6,689,691	USD	13/06/16	441
90 Day Eurodollar	17	CME	4,197,436	USD	19/12/16	(289)
90 Day Eurodollar	17	CME	4,180,100	USD	19/06/17	(4,875)
90 Day Eurodollar	13	CME	3,193,085	USD	18/09/17	(3,127)
90 Day Eurodollar	12	CME	2,938,794	USD	18/06/18	(2,706)
90 Day Eurodollar	9	CME	2,201,989	USD	17/09/18	(2,336)
90 Day Eurodollar	2	CME	490,132	USD	17/12/18	682
90 Day Eurodollar	16	CME	3,889,272	USD	14/09/20	(10,728)
90 Day Eurodollar	12	CME	2,912,957	USD	14/12/20	(10,393)
90 Day Eurodollar	31	CME	7,694,896	USD	14/03/16	1,858
90 Day Eurodollar	30	CME	7,417,461	USD	19/09/16	(2,664)
90 Day Eurodollar	13	CME	3,202,217	USD	13/03/17	(2,933)
90 Day Eurodollar	13	CME	3,190,073	USD	18/12/17	(2,240)
90 Day Eurodollar	13	CME	3,186,429	USD	19/03/18	(2,958)
90 Day Eurodollar	1	CME	244,697	USD	16/09/19	422
90 Day Eurodollar	9	CME	2,190,102	USD	16/03/20	(5,898)
90 Day Eurodollar	2	CME	485,032	USD	15/03/21	(1,968)
AUD/USD Currency	100	CME	7,204,485	USD	14/03/16	(61,515)
Australian 10-Year Bond	78	SFE	9,844,438	AUD	15/03/16	(38,741)
British Pound Currency	180	CME	16,993,481	USD	14/03/16	417,731
Canadian Currency	213	CME	15,529,496	USD	15/03/16	123,206
DAX Index	8	Eurex	2,094,866	EUR	18/03/16	(64,699)
Euro-Bund	129	Eurex	20,517,215	EUR	08/03/16	158,161
Euro-Oat	162	Eurex	24,541,152	EUR	08/03/16	253,269
FTSE 100 Index	163	ICE	9,721,072	GBP	18/03/16	(562,655)
FTSE/JSE Top 40	276	Safex	123,503,130	ZAR	17/03/16	(272,072)
Hang Seng Index	1	HKFE	1,104,258	HKD	28/01/16	1,130
Japan 10-Year Bond	146	OSE	21,720,057,625	JPY	14/03/16	(330,982)
Long Gilt	227	ICE	26,614,197	GBP	29/03/16	158,339
Nasdaq 100 E-Mini	47	CME	4,299,838	USD	18/03/16	(12,647)
Nikkei 225	9	OSE	169,175,800	JPY	10/03/16	(17,423)
S&P 500	8	CME	4,104,277	USD	17/03/16	33,477
S&P 500 E-Mini	397	CME	40,541,666	USD	18/03/16	138,976
SGX CNX Nifty	1,102	SGX	17,475,439	USD	28/01/16	(41,953)
TOPIX Index	100	OSE	1,555,817,090	JPY	10/03/16	69,197
U.S. Treasury 10-Year Note	19	CBOT	2,402,087	USD	21/03/16	9,868
U.S. Treasury 2-Year Note	14	CBOT	3,044,029	USD	31/03/16	2,748
U.S. Treasury Long Bond	12	CBOT	1,839,871	USD	21/03/16	(5,129)
						<u>(96,019)</u>
Unrealised Gain on Futures Contracts Outstanding						3,571,074
Unrealised (Loss) on Futures Contracts Outstanding						(2,282,309)
Net Unrealised Gain on Futures Contracts Outstanding						1,288,765

Forward Foreign Currency Exchange Contracts Outstanding at 31 December 2015 - (0.55%) (2014 - (1.30%))

通貨買い		通貨売り		取引相手	決済日	未実現利益 /(損) 米ドル
AUD	75,000	USD	54,000	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	440
AUD	80,000	USD	57,186	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	884
AUD	200,000	USD	143,036	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	2,138
AUD	8,471,882	USD	6,066,630	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	82,869
AUD	150,000	USD	108,654	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	226
AUD	865,000	USD	624,171	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	3,951
BRL	6,390,000	USD	1,581,683	State Street Bank and Trust Company	02/03/16	4,802
BRL	426,000	USD	106,767	State Street Bank and Trust Company	02/03/16	(1,001)
BRL	1,784,235	USD	464,403	JPMorgan Chase Bank, N.A.	05/01/16	(13,411)
BRL	4,455,163	USD	1,158,690	Morgan Stanley & Co. International PLC	05/01/16	(32,582)
BRL	12,011,000	USD	3,110,852	State Street Bank and Trust Company	02/03/16	(128,806)
CHF	150,000	USD	150,276	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(8)
CHF	55,000	USD	55,929	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(831)
CHF	540,000	USD	551,338	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(10,374)
CHF	6,922,865	USD	7,074,254	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(139,030)
CHF	90,000	USD	91,181	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(1,020)
CHF	350,000	USD	354,481	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(3,856)
CHF	1,252,769	USD	1,276,464	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(21,458)
CHF	865,000	USD	884,322	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(18,089)
CHF	1,970,000	USD	1,996,048	Morgan Stanley Capital Services LLC	16/03/16	(23,240)
CZK	18,220,000	USD	747,487	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(13,235)
EUR	43,556	USD	47,473	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(42)
EUR	341,049	USD	369,908	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	1,476
EUR	214,234,961	USD	236,205,828	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(2,915,265)
EUR	2,154,727	USD	2,346,334	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	50
EUR	331,782	USD	363,152	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(1,859)
EUR	2,499,799	USD	2,754,711	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(32,562)
EUR	147,645,642	USD	162,787,441	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(2,009,131)
EUR	66,000	USD	72,931	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(1,077)
EUR	282,081	USD	308,634	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(1,533)
EUR	298,016	USD	317,852	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	6,598
EUR	131,151	USD	143,296	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(513)
EUR	175,985	USD	193,981	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(2,387)
EUR	757,855	USD	834,950	Morgan Stanley & Co. International PLC	16/03/16	(9,874)
EUR	812,488	USD	895,141	Morgan Stanley & Co. International PLC	16/03/16	(10,586)
GBP	998,658	USD	1,519,388	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(46,970)
GBP	180,000	USD	265,395	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(3)
GBP	50,000	USD	74,495	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(775)
GBP	2,153,000	USD	3,231,666	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(57,337)
GBP	3,744,000	USD	5,630,077	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(110,018)
GBP	443,261	USD	672,135	Morgan Stanley Capital Services LLC	16/03/16	(18,602)
GBP	121,000	USD	183,351	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(4,952)
HUF	573,097,000	USD	1,978,988	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(6,414)
HUF	2,034,712,000	USD	7,078,441	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(75,055)
ILS	3,501,000	USD	910,521	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(9,455)
JPY	37,000,000	USD	302,216	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	6,230
JPY	30,000,000	USD	247,182	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	2,909
JPY	11,144,522,740	USD	92,576,322	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	328,517
JPY	37,000,000	USD	304,941	Morgan Stanley Capital	16/03/16	3,400
JPY	846,297,000	USD	6,965,132	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	87,521
JPY	21,000,000	USD	173,425	Morgan Stanley Capital Services LLC	16/03/16	1,580
JPY	20,000,000	USD	165,886	Morgan Stanley Capital Services LLC	16/03/16	785
JPY	26,000,000	USD	216,486	Morgan Stanley Capital Services LLC	16/03/16	186
JPY	1,558,049,000	USD	12,701,452	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	282,618
KRW	1,419,633,000	USD	1,203,079	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	5,731
KRW	2,548,961,000	USD	2,148,122	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	22,306

Forward Foreign Currency Exchange Contracts Outstanding at 31 December 2015 - (0.55%) (2014 - (1.30%)) (continued)

通貨買い	通貨売り	取引相手	決済日	未実現利益 /(損) 米ドル
MXN	40,272,000 USD	2,319,214 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	5,701
MXN	65,375,000 USD	3,791,941 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(17,822)
MXN	77,109,000 USD	4,521,011 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(69,484)
MXN	35,975,907 USD	2,064,846 Morgan Stanley & Co. International PLC	19/01/16	20,462
NOK	10,000,000 USD	1,154,301 State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(25,396)
NOK	80,455,006 USD	9,239,503 State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(156,898)
NOK	14,143,385 USD	1,638,227 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(41,500)
NZD	2,230,000 USD	1,509,989 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	8,678
RUB	4,482,000 USD	61,821 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(1,437)
RUB	43,276,000 USD	598,810 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(15,770)
RUB	73,221,000 USD	1,026,511 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(40,034)
SEK	7,518,000 USD	886,607 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	5,811
SEK	12,954,000 USD	1,534,323 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	3,369
SEK	545,000 USD	64,968 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(275)
TRY	10,973,000 USD	3,618,140 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	68,240
TRY	25,434,000 USD	8,518,605 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	25,948
ZAR	11,988,000 USD	784,098 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(18,985)
ZAR	29,348,000 USD	1,976,070 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(102,985)
USD	405 AUD	566 State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(6)
USD	109,073 AUD	150,000 State Street Bank and Trust Company	04/01/16	(232)
USD	7,831,849 AUD	10,959,000 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(126,062)
USD	4,026,280 AUD	5,622,000 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(56,153)
USD	777,387 BRL	2,943,186 Morgan Stanley & Co. International PLC	05/01/16	33,453
USD	242,203 BRL	963,000 State Street Bank and Trust Company	02/03/16	3,113
USD	1,146,657 BRL	4,455,163 Morgan Stanley & Co. International PLC	02/02/16	31,622
USD	459,570 BRL	1,784,235 JPMorgan Chase Bank, N.A.	02/02/16	13,013
USD	389,083 BRL	1,511,977 Morgan Stanley & Co. International PLC	05/01/16	6,909
USD	459,499 BRL	1,784,235 JPMorgan Chase Bank, N.A.	05/01/16	8,508
USD	2,401,458 CAD	3,263,534 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	42,444
USD	407,735 CAD	558,000 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	4,390
USD	1,538,812 CAD	2,128,000 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	608
USD	3,668 CHF	3,622 State Street Bank and Trust Company	24/03/16	39
USD	98,392 CHF	96,722 State Street Bank and Trust Company	24/03/16	1,497
USD	154,758 CHF	151,612 State Street Bank and Trust Company	24/03/16	2,876
USD	55,702 CHF	55,000 State Street Bank and Trust Company	04/01/16	790
USD	14,513,092 CHF	14,334,000 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	158,659
USD	845,328 CHF	832,902 Morgan Stanley Capital Services LLC	16/03/16	11,239
USD	7,633,192 CHF	7,502,000 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	120,498
USD	6,406,953 CHF	6,340,000 Morgan Stanley Capital Services LLC	16/03/16	57,915
USD	143,463 CNH	942,265 Morgan Stanley & Co. International PLC	16/03/16	1,487
USD	787,616 CNH	5,232,607 Morgan Stanley & Co. International PLC	16/03/16	(807)
USD	1,264,482 CNH	8,351,906 Morgan Stanley & Co. International PLC	22/08/16	23,441
USD	833,602 CNH	5,540,789 Morgan Stanley & Co. International PLC	22/08/16	10,276
USD	2,248,150 CZK	55,257,274 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	21,323
USD	840,811 CZK	20,628,000 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	9,518
USD	2,462,841 EUR	2,242,855 State Street Bank and Trust Company	24/03/16	20,490
USD	7,925,165 EUR	7,192,599 State Street Bank and Trust Company	24/03/16	92,805
USD	11,162 EUR	10,167 State Street Bank and Trust Company	24/03/16	91
USD	1,098,824 EUR	997,254 State Street Bank and Trust Company	24/03/16	12,867
USD	644,863 EUR	590,000 Morgan Stanley & Co. International PLC	29/01/16	3,299
USD	131,028 EUR	120,233 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	130
USD	2,492,357 EUR	2,276,000 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	14,478
USD	3,660,607 EUR	3,339,208 Morgan Stanley Capital Services LLC	16/03/16	25,215
USD	123,175 EUR	111,692 State Street Bank and Trust Company	16/03/16	1,576
USD	765,632 EUR	695,625 Morgan Stanley & Co. International PLC	16/03/16	8,306
USD	1,377,195 EUR	1,251,268 Morgan Stanley & Co. International PLC	16/03/16	14,941

Forward Foreign Currency Exchange Contracts Outstanding at 31 December 2015 - (0.55%) (2014 - (1.30%)) (continued)

通貨買い		通貨売り		取引相手	決済日	未実現利益 /(損) 米ドル
USD	557,344	EUR	506,382	Morgan Stanley & Co. International PLC	16/03/16	6,047
USD	2,553,731	EUR	2,317,932	Morgan Stanley & Co. International PLC	16/03/16	30,201
USD	1,547,169	EUR	1,404,661	Morgan Stanley & Co. International PLC	16/03/16	17,916
USD	54,923	EUR	49,864	Morgan Stanley & Co. International PLC	16/03/16	636
USD	4,134,197	EUR	3,753,401	Morgan Stanley & Co. International PLC	16/03/16	47,874
USD	1,350,881	EUR	1,231,000	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	10,693
USD	3,984,860	EUR	3,674,666	Morgan Stanley & Co. International PLC	16/03/16	(15,745)
USD	217,667	EUR	200,344	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(447)
USD	155,547	EUR	142,847	Morgan Stanley & Co. International PLC	16/03/16	29
USD	1,780,161	EUR	1,621,000	JPMorgan Chase Bank, N.A.	29/01/16	17,492
USD	558,767	EUR	508,107	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	5,591
USD	37,117	GBP	24,377	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	1,175
USD	329,217	GBP	222,000	Morgan Stanley & Co. International PLC	29/01/16	1,922
USD	581,457	GBP	390,000	JPMorgan Chase Bank, N.A.	29/01/16	6,480
USD	1,723,849	HKD	13,355,000	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	16/03/16	(337)
USD	156,945	HKD	1,216,000	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	16/03/16	(45)
USD	122,615	HKD	950,000	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	16/03/16	(34)
USD	174,214	HKD	1,350,000	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	16/03/16	(77)
USD	3,488,607	HUF	1,005,713,000	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	26,989
USD	8,882,666	ILS	34,256,000	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	66,065
USD	4,415,099	ILS	17,129,000	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	6,541
USD	491,516	JPY	59,895,170	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(7,792)
USD	1,081,752	JPY	130,997,461	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(10,291)
USD	778,244	JPY	93,830,555	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	(3,962)
USD	13,046,866	JPY	1,583,106,743	Morgan Stanley Capital Services LLC	16/03/16	(146,023)
USD	319,033	JPY	38,517,000	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(1,950)
USD	1,282,806	JPY	157,000,000	Morgan Stanley Capital Services LLC	16/03/16	(25,561)
USD	927,128	MXN	16,131,107	Morgan Stanley Capital Services LLC	19/01/16	(7,895)
USD	488,392	NOK	4,241,954	State Street Bank and Trust Company	24/03/16	9,516
USD	6,983,967	NOK	61,028,000	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	94,169
USD	2,987,445	NOK	26,112,000	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	39,513
USD	6,492,307	NZD	9,895,000	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(246,352)
USD	2,872,708	NZD	4,269,000	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(34,552)
USD	2,100,041	PLN	8,361,000	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(28,486)
USD	1,184,407	PLN	4,657,000	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(1,163)
USD	1,873,386	TRY	5,732,000	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	(52,279)
USD	511,391	ZAR	7,823,000	State Street Bank and Trust Company	16/03/16	12,101
Unrealised Gain on Forward Foreign Currency Exchange Contracts Outstanding						2,142,192
Unrealised (Loss) on Forward Foreign Currency Exchange Contracts Outstanding						(6,978,188)
Net Unrealised (Loss) on Forward Foreign Currency Exchange Contracts Outstanding						(4,835,996)

OTC Credit Default Swaps on Single-Name Issues (Sell Protection) - Outstanding at 31 December 2015 - (0.01%) (2014 - 0.00%)

参照債権	固定受取金利	満期日	取引相手	想定元本	通貨	市場価格 米ドル	前払 プレミアム 支払額 米ドル	未実現利益 米ドル
Russia 09/20	1.00%	20/09/20	Morgan Stanley Capital Services LLC	1,363,286	USD	(116,754)	(160,078)	43,324
Total OTC Credit Default Swaps on Single-Name Issues (Sell Protection)						(116,754)	(160,078)	43,324

Centrally Cleared Credit Default Swaps on Single-Name Issues (Buy Protection) - Outstanding at 31 December 2015
- 0.05% (2014 - 0.00%)

参照債権	固定支払金利	満期日	取引相手	想定元本	通貨	市場価格 米ドル	前払 プレミアム 支払額 米ドル	未実現利益 /(損) 米ドル
Brazil 06/20	(1.00%)	20/06/20	Credit Suisse (USA) Securities LLC	1,489,000	USD	216,079	103,504	112,576
Turkey 12/20	(1.00%)	20/12/20	Credit Suisse (USA) Securities LLC	1,256,000	USD	86,773	100,249	(13,476)
Turkey 12/20	(1.00%)	20/12/20	Credit Suisse (USA) Securities LLC	2,017,000	USD	152,593	132,131	20,461
Total Centrally Cleared Credit Default Swaps on Single-Name Issues (Buy Protection)						455,445	335,884	119,561

Centrally Cleared Credit Default Swaps on Single-Name Issues (Sell Protection) - Outstanding at 31 December 2015
- (0.01%) (2014 - 0.00%)

参照債権	固定受取金利	満期日	取引相手	想定元本	通貨	市場価格 米ドル	前払 プレミアム 支払額 米ドル	未実現利益 米ドル
Russia 09/20	1.00%	20/09/20	Credit Suisse (USA) Securities LLC	892,391	USD	(76,097)	(110,235)	34,138
Total Centrally Cleared Credit Default Swaps on Single-Name Issues (Sell Protection)						(76,097)	(110,235)	34,138

OTC Credit Default Swaps on Index (Sell Protection) - Outstanding at 31 December 2015 - (0.02%)
(2014 - 0.00%)

参照債権	固定受取金利	満期日	取引相手	想定元本	通貨	市場価格 米ドル	前払 プレミアム 支払額 米ドル	未実現(損失) 米ドル
CMBX.NA.BBB-8	3.00%	17/10/57	Credit Suisse International	1,545,000	USD	(194,269)	(174,209)	(20,060)
Total OTC Credit Default Swaps on Index (Sell Protection)						(194,269)	(174,209)	(20,060)

OTC Total Return Swaps Outstanding at 31 December 2015 - (0.13%) (2014 - 0.10%)

参照商品	解約日	取引相手	想定元本	通貨	未実現利益 /(損) 米ドル
Buys					
AerCap Holdings NV	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	12,117	USD	17,687
American International Group	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	17,021	USD	34,553
American International Group	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	9,354	USD	16,247
American Realty Capital Prop	15/04/16	Morgan Stanley & Co. International PLC	21,885	USD	65,436
Assured Guaranty Ltd.	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	10,985	USD	(1,251)
Assured Guaranty Ltd.	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	19,858	USD	22,440
Bank of the Ozarks	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	5,165	USD	(5,113)
BankUnited, Inc.	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	6,047	USD	(431)
Bovespa Index	17/02/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	26,028,349	BRL	(281,334)
Citigroup, Inc.	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	10,931	USD	(8,417)
Citigroup, Inc.	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	6,023	USD	(965)
CS Porfolio Swap 3200863	07/11/16	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	907,221	EUR	221,925
CS Porfolio Swap 3210662	25/10/16	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	22,118,280	USD	384,392
Evercore Partners, Inc.	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	653	USD	(1,007)
Evercore Partners, Inc.	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	654	USD	(314)
First Niagara Financial Group, Inc.	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	24,502	USD	7,390
First Niagara Financial Group, Inc.	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	24,983	USD	4,247
First Republic Bank	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	7,066	USD	(9,892)
First Republic Bank	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	3,875	USD	1,567
Healthcor LS Index	03/05/17	Morgan Stanley & Co. International PLC	86,601,449	USD	950,800

OTC Total Return Swaps Outstanding at 31 December 2015 - (0.13%) (2014 - 0.10%) (continued)

参照商品	解約日	取引相手	想定元本 通貨	未実現利益 /(損) 米ドル
Buys (continued)				
iBoxx Liquid High Yield Index	20/03/16	JPMorgan Chase Bank, N.A.	400,000 USD	(6,076)
iBoxx Liquid High Yield Index	20/03/16	JPMorgan Chase Bank, N.A.	600,000 USD	(8,105)
iBoxx Liquid High Yield Index	20/03/16	JPMorgan Chase Bank, N.A.	200,000 USD	(2,595)
iBoxx Liquid High Yield Index	20/03/16	JPMorgan Chase Bank, N.A.	400,000 USD	(3,842)
iBoxx Liquid High Yield Index	20/03/16	JPMorgan Chase Bank, N.A.	200,000 USD	(2,593)
iBoxx Liquid High Yield Index	20/03/16	JPMorgan Chase Bank, N.A.	180,000 USD	(819)
iBoxx Liquid High Yield Index	20/03/16	JPMorgan Chase Bank, N.A.	180,000 USD	1,652
ICICI Bank Ltd. ADR	11/04/16	Deutsche Bank AG	24,985 USD	2,893
Invesco PLC	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	6,622 USD	11,918
Kennedy-Wilson Holdings	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	12,033 USD	1,773
Kennedy-Wilson Holdings	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	22,168 USD	2,168
MSCI, Inc.	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	3,538 USD	1,240
MS Index Swap	12/08/16	Morgan Stanley & Co. International PLC	47,114,633 USD	(208,814)
MS Index Swap	12/08/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	155,702,582 USD	(1,039,145)
MS Portfolio Swap Q77SL	24/05/17	Morgan Stanley Capital Services LLC	1,057,432 EUR	(29,514)
MS Portfolio Swap Q77VK	24/05/17	Morgan Stanley Capital Services LLC	48,905,347 USD	342,144
Numericable SFR	07/11/16	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	1,468,538 EUR	(86,936)
OneMain Holdings, Inc.	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	5,313 USD	9,196
PNC Financial Services	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	5,181 USD	4,384
PNC Financial Services	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	9,328 USD	4,449
Raymond James Financial	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	1,730 USD	17
Raymond James Financial	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	1,730 USD	(1,937)
Royal Bank of Scotland Group	28/12/16	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	3,210,342 GBP	(230,084)
Shire PLC	28/12/16	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	2,698,885 GBP	(356,715)
Synchrony Financial	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	8,540 USD	2,818
Vodafone Group plc	28/12/16	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	3,369,820 GBP	(38,262)
Total Buys				(212,825)
Sells				
Alerian MLP Infrastructure Index	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	59 USD	(2,804)
Alerian MLP Infrastructure Index	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	100 USD	(7,736)
Consumer Discretionary Selt	20/03/16	Bank of America, N.A.	3,218 USD	879
Consumer Discretionary Selt	20/03/16	Bank of America, N.A.	3,198 USD	4,269
Consumer Discretionary Selt	20/03/16	Bank of America, N.A.	3,083 USD	3,407
Consumer Staples Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	846 USD	199
Consumer Staples Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	847 USD	612
Consumer Staples Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	820 USD	554
CS Portfolio Swap 3200864	07/11/16	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	3,004,403 EUR	(11,260)
CS Portfolio Swap 3210662	25/10/16	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	29,851,682 USD	(550,948)
S&P Regional Banks Select Industry Index Total Return	15/04/16	Morgan Stanley & Co. International PLC	755 USD	10,963
Energy Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	36,315 USD	1,990
Energy Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	37,611 USD	20,002
Energy Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	36,032 USD	(771)
Financial SelectSector TR	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	715 USD	3,047
Financial Select Sector SPDR	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	421 USD	(6,760)
Financial Select Sector SPDR	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	134 USD	374
Financial Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	2,443 USD	202
Financial Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	2,443 USD	936
Financial Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	2,357 USD	746

OTC Total Return Swaps Outstanding at 31 December 2015 - (0.13%) (2014 - 0.10%) (continued)

参照商品	解約日	取引相手	想定元本	通貨	未実現利益 /(損) 米ドル
Sells (continued)					
Health Care Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	896	USD	39
Health Care Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	904	USD	811
Health Care Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	863	USD	748
iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	6,171	USD	2,160
iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	3,637	USD	1,533
Industrial Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	3,820	USD	836
Industrial Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	3,832	USD	2,900
Industrial Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	3,699	USD	2,293
K+S N ORD swap	07/11/16	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	673,317	EUR	2,470
KOSPI 200 Index	08/01/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	15,408,403,454	EUR	(85,814)
Materials Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	10,900	USD	3,248
Materials Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	11,040	USD	8,514
Materials Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	10,615	USD	5,804
MSCI AC World Daily TR Net USD	15/04/16	Morgan Stanley & Co. International PLC	9,050	USD	(18,824)
MSCI AC World Daily TR Net USD	15/04/16	Morgan Stanley & Co. International PLC	5,334	USD	(13,777)
MSCI AC World Daily TR Net USD	15/04/16	Morgan Stanley & Co. International PLC	2,179	USD	1,483
MS Portfolio Swap Q77SL	24/05/17	Morgan Stanley Capital Services LLC	2,817,471	EUR	(5,465)
MS Portfolio Swap Q77VN	24/05/17	Morgan Stanley Capital Services LLC	32,201,804	USD	(517,638)
Russell 2000 Total Return Index	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	230	USD	(6,141)
Russell 2000 Total Return Index	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	136	USD	(6,728)
S&P 500 (SPY)	20/03/16	Bank of America, N.A.	37,112	USD	31,382
S&P 500 (SPY)	20/03/16	Bank of America, N.A.	35,828	USD	100,927
S&P 500 (SPY)	20/03/16	Bank of America, N.A.	37,234	USD	124,559
S&P 500 Value	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	840	USD	(3,564)
S&P 500 Value	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	495	USD	(24,695)
S&P Regional Banks Select Industry Index Total Return	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	445	USD	(4,202)
S&P Regional Banks Select Industry Index Total Return	15/04/16	Morgan Stanley Capital Services LLC	167	USD	1,848
Technology Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	988	USD	266
Technology Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	988	USD	916
Technology Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	944	USD	731
UBS Group	06/04/17	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	438,530	CHF	10,596
Utilities Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	5,742	USD	1,204
Utilities Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	5,714	USD	3,060
Utilities Select Sector SPDR ETF	20/03/16	Bank of America, N.A.	5,608	USD	2,939
Total Sells					(907,680)
Unrealised Gain on OTC Total Return Swaps					2,470,783
Unrealised (Loss) on OTC Total Return Swaps					(3,591,288)
Net Unrealised (Loss) on OTC Total Return Swaps					(1,120,505)

Centrally Cleared Interest Rate Swaps - Outstanding at 31 December 2015 - (0.04%) (2014 - (0.04%))

変動金利の 支払/受取	変動金利	固定金利 インデックス	満期日	取引相手	想定元本	通貨	市場価格 米ドル	前払プレミアム 支払額/(受取額) 米ドル	未実現利益 /(損) 米ドル
Pays	Three-Month Libor	2.50%	16/03/26	Credit Suisse (USA) Securities LLC	1,202,000	USD	25,695	35,164	(9,469)
Pays	Three-Month Libor	2.75%	16/03/46	Credit Suisse (USA) Securities LLC	1,197,000	USD	17,145	46,856	(29,711)
Receives	Three-Month Libor	1.30%	13/08/18	Morgan Stanley & Co. LLC	780,000	USD	457	-	457
Receives	Three-Month Libor	1.50%	16/03/18	Credit Suisse (USA) Securities LLC	17,822,000	USD	(74,400)	(123,283)	48,883
Receives	Three-Month Libor	1.92%	30/09/19	Morgan Stanley & Co. LLC	1,515,750	USD	(20,474)	-	(20,474)
Receives	Three-Month Libor	2.00%	16/03/21	Credit Suisse (USA) Securities LLC	5,137,000	USD	(45,102)	(77,614)	32,512
Receives	Three-Month Libor	2.30%	25/03/27	Morgan Stanley & Co. LLC	1,000,000	USD	(936)	-	(936)
Receives	Three-Month Libor	2.30%	27/01/25	Morgan Stanley & Co. LLC	2,800,000	USD	(36,050)	-	(36,050)
Receives	Three-Month Libor	2.33%	26/08/25	Morgan Stanley & Co. LLC	23,450,000	USD	(292,917)	-	(292,917)
Centrally Cleared Interest Rate Swaps at Positive Fair Value							43,297	82,020	(38,723)
Centrally Cleared Interest Rate Swaps at Negative Fair Value							(469,879)	(200,897)	(268,982)
Total Centrally Cleared Interest Rate Swaps							(426,582)	(118,877)	(307,705)

Total Financial Assets and Financial Liabilities at Fair Value Through Profit or Loss - 67.61% (2014 - 95.24%)	590,802,297
Cash and Cash Equivalents - 19.32% (2014 - 3.72%)	168,770,056
Other Net Assets - 13.07% (2014 - 1.04%)	114,125,105
Net Assets Attributable to Holders of Redeemable Participating Shares - 100.00%	873,697,458

Portfolio Analysis	対純資産合計 %
Transferable securities listed on a recognised stock exchange or traded on a regulated market	41.33%
Transferable securities not listed on a recognised stock exchange or traded on a regulated market	3.77%
OTC financial derivative instruments	0.42%
Financial derivative instruments dealt in on a regulated marked	0.76%
Other assets	53.72%
	100.00%

アドバンスト・バランスⅡ（FOFs用）（適格機関投資家限定）

《第2期》決算日2017年2月6日

[計算期間：2016年2月6日～2017年2月6日]

○当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2025年2月5日まで（2015年2月20日設定）
運用方針	マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界各国の株式および債券に実質的な投資を行います。投資対象とするマザーファンド受益証券および各マザーファンド受益証券の組入比率については、安定成長型ファンドの運用に資するよう定性・定量評価等により適宜見直しを行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産については、為替ヘッジを行う場合があります。
主要運用対象	ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド 外国株式インデックスマザーファンド 新興国株式インデックスマザーファンド アセアン真成長株式マザーファンド 好配当海外株マザーファンド 外国債券インデックスマザーファンド 新興国債券インデックスマザーファンド アセアン投資適格社債マザーファンド アセアン・ハイイールド社債マザーファンド
主な組入制限	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。
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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配額)	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	純資産額
		税込分配	み金	期騰落率						
(設定日)	円	円	%	%	%	%	%	%	百万円	
2015年2月20日	10,000	—	—	—	—	—	—	—	10	
1期(2016年2月5日)	9,091	0	△9.1	57.7	1.1	35.1	—	0.9	3,253	
2期(2017年2月6日)	9,676	0	6.4	52.0	1.5	41.0	—	0.9	2,971	

(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、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界各国の株式および債券に実質的な投資を行いますが、特定の指数を上回るまたは運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
	円	騰 落 率					
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%
2016年2月5日	9,091	—	57.7	1.1	35.1	—	0.9
2月末	8,922	△1.9	58.8	1.2	33.8	—	0.9
3月末	9,338	2.7	60.6	1.5	36.1	—	1.0
4月末	9,226	1.5	59.7	1.5	34.0	—	0.9
5月末	9,255	1.8	52.8	1.1	39.8	—	1.0
6月末	8,736	△3.9	51.4	1.9	40.3	—	1.0
7月末	9,069	△0.2	53.0	1.6	41.8	—	1.0
8月末	9,041	△0.5	53.4	1.7	41.0	—	1.0
9月末	8,916	△1.9	52.8	1.5	41.2	—	1.0
10月末	8,974	△1.3	53.8	1.2	41.7	—	0.9
11月末	9,412	3.5	54.8	0.8	41.5	—	0.9
12月末	9,767	7.4	52.5	1.0	41.8	—	0.9
2017年1月末	9,708	6.8	52.9	1.8	40.7	—	0.9
(期 末)							
2017年2月6日	9,676	6.4	52.0	1.5	41.0	—	0.9

(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

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.4%の上昇となりました。

●基準価額の主な変動要因

（上昇要因）

組み入れを行ったマザーファンドのうち、主として、外国株式インデックスマザーファンド、好配当海外株マザーファンドなどがプラスに寄与しました。

（下落要因）

組み入れを行ったマザーファンドのうち、主として、外国債券インデックスマザーファンドなどがマイナスに影響しました。

●投資環境について

【概況】

当期は、米大統領選に勝利したトランプ氏の打ち出す財政支出拡大や減税策を受け外国株式が上昇する一方、金利先高感などから債券市況は下落しました。為替市況は、米ドル、ユーロともに対円で下落しました。

【株式市況】

外国株式は、原油価格の上昇や米大統領選に勝利したトランプ氏の打ち出す財政支出拡大や減税策が好感され、上昇しました。

【債券市況】

外国債券においては、投資家のリスク回避姿勢の後退や米国経済指標の改善に加えて、米国の金利先高感などを受け下落しました。

【為替】

為替市況において、米ドルは期首から2016年9月にかけては、米連邦公開市場委員会（FOMC）での政策金利引き上げに対する慎重な姿勢などから対円で下落しました。その後は、トランプ氏の打ち出す財政支出拡大による米国の金利先高感などから上昇しましたが、期を通じてみると下落しました。ユーロは、英国において欧州連合（EU）離脱が選択されたことや欧州中央銀行（ECB）による追加緩和期待などを受けて下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

◎パフォーマンス要因

当期は、米大統領選に勝利したトランプ氏の打ち出す財政支出拡大や減税策を受け外国株式が上昇しました。一方、金利先高感などから債券市況は下落しました。これらの背景から「外国株式インデックスマザーファンド」、「好配当海外株マザーファンド」などが上昇する一方、「外国債券インデックスマザーファンド」などは下落しました。

◎組入比率

期首より、マザーファンドを高位に組み入れた運用を行いました。なお、当ファンドの期末での各マザーファンドへの投資割合は次表をご参照ください。

マザーファンド別組入比率表「アドバンスト・バランスⅡ（FOFs用）（適格機関投資家限定）」

資産クラス		マザーファンド	期末 (2017年2月6日)
国内株式	ヘッジ付外国株式	ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	5.5
外国株式		外国株式インデックスマザーファンド	31.1
		新興国株式インデックスマザーファンド	1.1
		アセアン真成長株式マザーファンド	2.1
		好配当海外株マザーファンド	16.1
国内債券	ヘッジ付外国債券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	20.7
外国債券		外国債券インデックスマザーファンド	19.3
		新興国債券インデックスマザーファンド	0.3
		アセアン投資適格社債マザーファンド	0.7
		アセアン・ハイイールド社債マザーファンド	0.7

(注) 比率は純資産総額に対する投資比率。

(注) 国内株式には、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図る「ヘッジ付外国株式」を表示しています。

(注) 国内債券には、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図る「ヘッジ付外国債券」を表示しています。

(注) 単位：%

●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。

○分配金

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第2期
	2016年2月6日～ 2017年2月6日
当期分配金	—

○今後の運用方針

- ・日本を除く世界各国の株式、債券などを実質的な主要投資対象とし、中長期的な値上がり益の確保をめざします。
- ・各資産への投資割合、投資対象とするマザーファンドおよびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。

○1万口当たりの費用明細

（2016年2月6日～2017年2月6日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	1 (0) (0) (0)	0.007 (0.001) (0.001) (0.004)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数) ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価 ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	11 (10) (0) (0)	0.115 (0.113) (0.000) (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
(c) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	4 (4) (0)	0.039 (0.039) (0.000)	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (監 査 費 用) (そ の 他)	5 (4) (0) (0)	0.051 (0.046) (0.004) (0.001)	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	21	0.212	
期中の平均基準価額は、9,197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2月6日～2017年2月6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
好配当海外株マザーファンド	106,620	114,850	295,818	323,130
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	20,640	27,000	54,850	77,000
新興国株式インデックスマザーファンド	6,120	11,000	70,746	122,700
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	289,820	371,830	153,095	198,600
新興国債券インデックスマザーファンド	8,241	10,000	92,596	110,150
アセアン投資適格社債マザーファンド	5,907	7,000	32,492	38,000
アセアン・ハイイールド社債マザーファンド	5,856	7,000	32,647	39,000
アセアン真成長株式マザーファンド	14,293	13,000	102,448	91,000
外国株式インデックスマザーファンド	161,355	317,000	211,131	441,000
外国債券インデックスマザーファンド	132,366	262,080	79,819	153,000

○株式売買比率

(2016年2月6日～2017年2月6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				
	好配当海外株 マザーファンド	ヘッジ付外国株式 インデックス マザーファンド	新興国株式 インデックス マザーファンド	アセアン 真成長株式 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	23,215,322千円	37,579,347千円	8,745,913千円	1,751,389千円	246,697,578千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,405,325千円	75,726,145千円	35,992,789千円	1,082,934千円	266,114,868千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	3.62	0.49	0.24	1.61	0.92

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年2月6日～2017年2月6日)

利害関係人との取引状況

<アドバンスト・バランスⅡ（FOFs用）（適格機関投資家限定）>

該当事項はございません。

<ヘッジ付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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	983,410	600,470	61.1	999,737	616,950	61.7
為替直物取引	19,075	16,709	87.6	17,710	16,634	93.9

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。

<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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	1,017,561	480,760	47.2	1,053,328	516,694	49.1
為替直物取引	58,190	39,669	68.2	20,094	10,147	50.5

平均保有割合 0.8%

※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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	241,414	64,396	26.7	159,744	85,817	53.7

平均保有割合 0.4%

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

<新興国株式インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 9,262	百万円 1,181	% 12.8	百万円 6,112	百万円 889	% 14.5

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。

<アセアン真成長株式マザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 751	百万円 75	% 10.0	百万円 1,000	百万円 116	% 11.6
為替直物取引	313	31	9.9	600	54	9.0

平均保有割合 8.1%

※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。

<好配当海外株マザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 11,534	百万円 445	% 3.9	百万円 11,681	百万円 497	% 4.3
為替直物取引	2,840	1,115	39.3	3,458	1,349	39.0

平均保有割合 8.9%

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

<外国債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 20,704	百万円 3,569	% 17.2	百万円 35,807	百万円 12,750	% 35.6

平均保有割合 0.4%

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

<新興国債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 4,186	百万円 1,386	% 33.1	百万円 2,804	百万円 599	% 21.4

平均保有割合 0.3%

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

<アセアン投資適格社債マザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 94	百万円 19	% 20.2	百万円 243	百万円 36	% 14.8

平均保有割合 3.3%

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

<アセアン・ハイイールド社債マザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 109	百万円 23	% 21.1	百万円 294	百万円 46	% 15.6

平均保有割合 3.2%

※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。

売買取手手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買取手手数料総額 (A)	3,986千円
うち利害関係人への支払額 (B)	176千円
(B) / (A)	4.4%

(注) 売買取手手数料総額は、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、三菱UFJモルガン・スタンレー証券です。

○組入資産の明細

(2017年2月6日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
好配当海外株マザーファンド	587,051	397,853	478,975
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	143,207	108,997	162,591
新興国株式インデックスマザーファンド	80,468	15,842	33,007
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	355,477	492,202	615,598
新興国債券インデックスマザーファンド	91,266	6,911	8,822
アセアン投資適格社債マザーファンド	44,051	17,466	21,389
アセアン・ハイイールド社債マザーファンド	43,755	16,964	21,768
アセアン真成長株式マザーファンド	154,853	66,698	63,710
外国株式インデックスマザーファンド	458,341	408,566	925,117
外国債券インデックスマザーファンド	243,326	295,874	572,309

○投資信託財産の構成

（2017年2月6日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
好配当海外株マザーファンド	478,975	16.0
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	162,591	5.4
新興国株式インデックスマザーファンド	33,007	1.1
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	615,598	20.6
新興国債券インデックスマザーファンド	8,822	0.3
アセアン投資適格社債マザーファンド	21,389	0.7
アセアン・ハイイールド社債マザーファンド	21,768	0.7
アセアン真成長株式マザーファンド	63,710	2.1
外国株式インデックスマザーファンド	925,117	31.0
外国債券インデックスマザーファンド	572,309	19.2
コール・ローン等、その他	83,794	2.9
投資信託財産総額	2,987,080	100.0

(注) 好配当海外株マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（6,542,113千円）の投資信託財産総額（6,604,338千円）に対する比率は99.1%です。

(注) ヘッジ付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（81,838,582千円）の投資信託財産総額（87,794,379千円）に対する比率は93.2%です。

(注) 新興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（43,415,012千円）の投資信託財産総額（43,591,900千円）に対する比率は99.6%です。

(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（91,039,601千円）の投資信託財産総額（94,195,372千円）に対する比率は96.6%です。

(注) 新興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（12,604,015千円）の投資信託財産総額（12,706,976千円）に対する比率は99.2%です。

(注) アセアン投資適格社債マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（954,680千円）の投資信託財産総額（960,095千円）に対する比率は99.4%です。

(注) アセアン・ハイイールド社債マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（957,181千円）の投資信託財産総額（964,254千円）に対する比率は99.3%です。

(注) アセアン真成長株式マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（983,757千円）の投資信託財産総額（998,155千円）に対する比率は98.6%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（349,565,237千円）の投資信託財産総額（350,397,776千円）に対する比率は99.8%です。

(注) 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（126,829,361千円）の投資信託財産総額（127,148,493千円）に対する比率は99.7%です。

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

1 アメリカドル=112.37円	1 カナダドル=86.28円	1 メキシコペソ=5.50円	1 ブラジルリアル=35.99円
100チリペソ=17.59円	100コロンビアペソ=3.94円	1ペルーヌエボソル=34.48円	1ユーロ=121.08円
1 イギリスポンド=140.32円	1 スイスフラン=113.26円	1 スウェーデンクローネ=12.82円	1 ノルウェークローネ=13.69円
1 デンマーククローネ=16.28円	1 トルコリラ=30.38円	1 チェココルナ=4.48円	100ハンガリーフォリント=39.10円
1 ボーランドズロチ=28.15円	1 ロシアルーブル=1.91円	1 ルーマニアレイ=26.84円	1 オーストラリアドル=86.14円
1 ニューゼalandドル=82.20円	1 香港ドル=14.48円	1 シンガポールドル=79.88円	1 マレーシアリンギット=25.42円
1 タイバーツ=3.21円	1 フィリピンペソ=2.26円	100インドネシアルピア=0.85円	100韓国ウォン=9.89円
1 ニュー台湾ドル=3.62円	1 インドルピー=1.68円	100ベトナムドン=0.50円	1 アラブディルハム=30.65円
1 イスラエルシェケル=29.96円	1 カタールリアル=30.92円	1 南アフリカランド=8.46円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年2月6日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,987,080,814
コール・ローン等	83,789,555
好配当海外株マザーファンド(評価額)	478,975,627
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	162,591,414
新興国株式インデックスマザーファンド(評価額)	33,007,882
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	615,598,274
新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)	8,822,977
アセアン投資適格社債マザーファンド(評価額)	21,389,746
アセアン・ハイイールド社債マザーファンド(評価額)	21,768,517
アセアン真成長株式マザーファンド(評価額)	63,710,520
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	925,117,209
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	572,309,093
(B) 負債	15,171,920
未払解約金	14,999,998
未払信託報酬	107,396
未払利息	115
その他未払費用	64,411
(C) 純資産総額(A-B)	2,971,908,894
元本	3,071,444,883
次期繰越損益金	△ 99,535,989
(D) 受益権総口数	3,071,444,883口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,676円

<注記事項>

- ①期首元本額 3,579,157,740円
 期中追加設定元本額 1,236,432,298円
 期中一部解約元本額 1,744,145,155円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9676円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は99,535,989円です。

③分配金の計算過程

項 目	2016年2月6日～ 2017年2月6日
費用控除後の配当等収益額	75,546,249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	20,501,588円
分配準備積立金額	34,608,814円
当ファンドの分配対象収益額	130,656,651円
1万口当たり収益分配対象額	425円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況（2016年2月6日～2017年2月6日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 30,567
受取利息	1,718
支払利息	△ 32,285
(B) 有価証券売買損益	181,067,889
売買益	271,025,313
売買損	△ 89,957,424
(C) 信託報酬等	△ 359,827
(D) 当期損益金(A+B+C)	180,677,495
(E) 前期繰越損益金	△185,577,820
(F) 追加信託差損益金	△ 94,635,664
(配当等相当額)	(17,891,360)
(売買損益相当額)	(△112,527,024)
(G) 計(D+E+F)	△ 99,535,989
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△ 99,535,989
追加信託差損益金	△ 94,635,664
(配当等相当額)	(20,501,588)
(売買損益相当額)	(△115,137,252)
分配準備積立金	110,155,063
繰越損益金	△115,055,388

- (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。

[お知らせ]

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める（分散型に分類）ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2016年11月5日)

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

《第9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]

「ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド」は、5月12日に第9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9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) (円ヘッジ・円ベース) 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 (円ヘッジ・円ベース) 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。
主 要 運 用 対 象	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円ヘッジ・円ベース) 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) (円ヘッジ・円ベース)		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
5期(2012年5月14日)	8,628	△ 3.2	216.07	△ 5.7	91.6	5.4	2.0	160,031
6期(2013年5月13日)	10,714	24.2	261.46	21.0	97.8	3.6	2.4	175,865
7期(2014年5月12日)	12,301	14.8	294.15	12.5	92.9	4.5	2.0	153,665
8期(2015年5月12日)	13,927	13.2	325.42	10.6	95.5	2.4	2.2	91,128
9期(2016年5月12日)	13,282	△ 4.6	303.60	△ 6.7	88.4	10.2	2.5	87,141

(注) MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円ヘッジ・円ベース) とは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く先進国で構成されています。MSCI Kokusai Index (円ヘッジ・円ベース) に対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

(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) 株式組入比率には新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		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 券 組 入 比 率
	騰 落 率	(円ヘッジ・円ベース)	騰 落 率				
(期 首) 2015年5月12日	円	%	325.42	%	%	%	%
5月末	13,927	—	328.08	—	95.5	2.4	2.2
6月末	14,071	1.0	328.08	0.8	96.7	3.4	2.2
7月末	13,558	△ 2.6	315.61	△ 3.0	92.9	4.0	2.1
8月末	13,893	△ 0.2	323.09	△ 0.7	94.5	3.1	2.2
9月末	13,090	△ 6.0	303.65	△ 6.7	85.7	10.0	2.1
10月末	12,367	△ 11.2	286.20	△ 12.1	90.0	6.4	2.4
11月末	13,640	△ 2.1	315.38	△ 3.1	93.8	3.6	2.4
12月末	13,694	△ 1.7	315.99	△ 2.9	96.5	1.3	2.5
2016年1月末	13,539	△ 2.8	312.08	△ 4.1	90.1	5.7	2.4
2月末	12,372	△ 11.2	285.22	△ 12.4	89.5	8.1	2.4
3月末	12,609	△ 9.5	289.87	△ 10.9	84.3	7.4	2.3
4月末	13,264	△ 4.8	304.29	△ 6.5	87.9	10.6	2.5
5月末	13,516	△ 3.0	309.60	△ 4.9	89.6	5.6	2.5
(期 末) 2016年5月12日	13,282	△ 4.6	303.60	△ 6.7	88.4	10.2	2.5

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

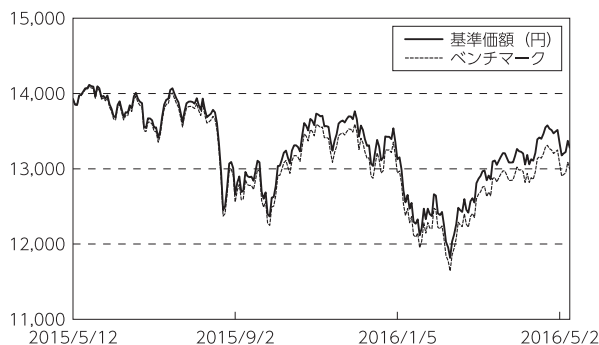
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.6%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(－6.7%)を2.1%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。

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

(注) マルチファクターモデル

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

- ・組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動性を維持するため、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6.7%の下落となったため、カイ離は2.1%程度となりました。

	組入比率 要因	銘柄選択 要因	その他の 要因	合計
ベンチマーク とのカイ離	0.0%程度	△0.1%程度	2.2%程度	2.1%程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.1%程度でした。

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

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

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.2%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入等	計 2.4%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料・為替ヘッジ効果等	計△0.2%程度

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。

◎今後の運用方針

- ・引き続きファンドの資産のほぼ全額を株式 (先物・REITを含む) に投資し、高い株式組入比率を維持します。
- ・売買に係るコストを考慮しつつ、多くの銘柄に分散投資を行います。
- ・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性を維持するため、為替ヘッジを行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年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)	(1)	(0.006)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.005)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	2	0.015	(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)	(2)	(0.015)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	9	0.067	(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)	(9)	(0.066)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	12	0.092	
期中の平均基準価額は、13,301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 21,657 (1,605)	千アメリカドル 122,904 (271)	百株 17,387 (536)	千アメリカドル 97,065 (6,169)
	カナダ	3,054 (92)	千カナダドル 9,950 (-)	2,316 (44)	千カナダドル 7,434 (318)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	1,529 (139)	6,317 (△ 76)	1,203	5,149
	イタリア	5,950 (△ 992)	1,543 (△ 3)	3,314	1,328
	フランス	1,736 (-)	6,399 (△ 41)	1,929	5,397
	オランダ	1,322 (168)	2,493 (179)	990	1,929
	スペイン	3,580 (14,425)	2,293 (119)	16,766	2,048
	ベルギー	125 (11)	941 (-)	108	755
	オーストリア	49	125	294	189
	ルクセンブルク	288 (191)	200 (△ 133)	288	146
	フィンランド	949	924	335	481
	アイルランド	1,913	541	1,339	205
	ポルトガル	3,409	129	1,537	85
	イギリス	20,983 (69,441)	千イギリスポンド 11,247 (△ 3)	14,151 (101,798)	千イギリスポンド 8,123 (380)
	スイス	1,169 (353)	千スイスフラン 7,417 (△ 128)	1,244 (-)	千スイスフラン 5,838 (0.00964)
	スウェーデン	1,492 (637)	千スウェーデンクローネ 18,486 (-)	1,472	千スウェーデンクローネ 16,418
	ノルウェー	399	千ノルウェークローネ 4,731	427	千ノルウェークローネ 4,020
	デンマーク	356 (20)	千デンマーククローネ 12,107 (-)	235	千デンマーククローネ 7,989

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	オーストラリア	百株 5,965 (1,773)	千オーストラリアドル 7,349 (104)	百株 4,101 (166)	千オーストラリアドル 5,116 (149)
	ニュージーランド	169	千ニュージーランドドル 77	196	千ニュージーランドドル 88
	香港	6,483 (1,130)	千香港ドル 17,674 (-)	4,319 (480)	千香港ドル 15,233 (-)
	シンガポール	3,459 (2)	千シンガポールドル 1,242 (-)	2,556	千シンガポールドル 991
	イスラエル	409	千イスラエルシケル 2,226	295	千イスラエルシケル 1,476

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
HCP INC	3	101	2	82
MACERICH CO/THE	0.86	68	0.798	63
PROLOGIS INC	3	155	2	91
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.621	49	0.506	38
DIGITAL REALTY TRUST INC	1	93	0.599	40
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.423	96	0.272	60
EXTRA SPACE STORAGE INC	3	233	0.209	15
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.449	67	0.305	42
WELLTOWER INC	2	156	1	107
BOSTON PROPERTIES INC	0.991	122	0.75	94
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1	174	—	—
REALTY INCOME CORP	2	114	0.98	46
REGENCY CENTERS CORP	0.578	41	0.36	22
SL GREEN REALTY CORP	0.682	67	0.435	50
UDR INC	1	63	1	36
VENTAS INC	2	131	1	87
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	5	58	4	43
RAYONIER INC	—	—	3	80
WEYERHAEUSER CO	4 (5)	134 (148)	2	83
AMERICAN TOWER CORP	2	276	2	191
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	2	44	2	39
VEREIT INC	5	46	3	31
DUKE REALTY CORP	2	44	1	26
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	4	116	0.215	5
IRON MOUNTAIN INC	1	59	0.694	21
EQUINIX INC	0.57 (0.032)	179 (9)	0.226	62
COMMUNICATIONS SALES & LE	0.264	5	3	66
CROWN CASTLE INTL CORP	2 (7)	180 (590)	0.883	73
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	— (1)	— (—)	1	51
EQUITY RESIDENTIAL	2	171	1	97
GENERAL GROWTH PROPERTIES	3	103	1	46
HOST HOTELS & RESORTS INC	4	76	3	67
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.92	29	0.585	20
PLUM CREEK TIMBER CO	0.187 (△ 3)	7 (△ 148)	0.706	30
PUBLIC STORAGE	0.938	241	0.715	150
SIMON PROPERTY GROUP INC	1	385	1	272
VORNADO REALTY TRUST	1	105	0.883	86
KIMCO REALTY CORP	2	70	1	47

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.938	170	0.605	103
小 計	77 (10)	4,244 (600)	53	2,579
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	1	51	—	—
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	0.6	12	0.4	9
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1	29	0.9	24
小 計	3	93	1	33
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
GECINA SA	0.32	37	0.101	11
KLEPIERRE	2	99	1	43
UNIBAIL-RODAMCO SE	0.633	149	0.473	112
FONCIERE DES REGIONS	0.236	18	0.188	15
ICADE	0.272	18	0.295	20
小 計	3	324	2	201
ユ ー ロ 計	3	324	2	201
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	2	17	4	38
HAMMERSON PLC	5	30	4	26
LAND SECURITIES GROUP PLC	5	57	3	49
INTU PROPERTIES PLC	6	19	4	15
SEGRO PLC	4	19	4	17
小 計	23	144	21	147
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	24	74	11	32
SCENTRE GROUP	34	146	25	101
FEDERATION CENTRES	— (40)	— (122)	—	—
NOVION PROPERTY GROUP	— (△ 48)	— (△ 122)	—	—
GPT GROUP	13	66	6	30
MIRVAC GROUP	18	35	10	20
STOCKLAND	17	70	10	42
WESTFIELD CORP	12	118	8	84
DEXUS PROPERTY GROUP	7	57	4	33
GOODMAN GROUP	12	78	7	45
小 計	140 (△ 8)	646 (—)	85	391
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	15	699	12	547
小 計	15	699	12	547
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	19 (—)	30 (△0.49129)	18 (—)	31 (0.00001)

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	15	21	13	18
	CAPITALAND MALL TRUST	16	34	14	29
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	14 (-)	36 (△0.07347)	12	28
小計		65 (-)	123 (△0.56476)	58 (-)	109 (0.00001)

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 68,161	百万円 61,176	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	40,347,650千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	73,386,603千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.54

(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	$\frac{D}{C}$	%
為替先物取引	百万円 940,696	百万円 685,345	72.9	百万円 940,909	百万円 697,331	74.1
為替直物取引	20,282	17,371	85.6	17,479	13,209	75.6

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

○組入資産の明細

(2016年5月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	277	327	312	33,882	素材
AMERICAN EXPRESS CO	218	209	1,352	146,579	各種金融
AVON PRODUCTS INC	105	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
ABBOTT LABORATORIES	353	373	1,418	153,775	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	78	82	352	38,186	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	13	13	223	24,272	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	113	115	999	108,341	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	17	18	84	9,190	小売
AES CORP	163	170	193	20,952	公益事業
AFLAC INC	105	106	733	79,477	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	329	309	1,731	187,638	保険
APACHE CORP	88	94	511	55,387	エネルギー
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	15	15	313	33,990	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	147	156	1,812	196,462	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	50	51	729	79,037	素材
ANTHEM INC	63	65	907	98,313	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	119	127	609	66,087	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	311	336	742	80,485	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	127	136	635	68,853	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	159	159	2,118	229,602	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	49	52	881	95,512	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	69	77	244	26,484	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	390	417	2,956	320,445	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	31	30	1,088	117,944	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	975	1,018	5,209	564,522	電気通信サービス
CR BARD INC	17	18	405	43,974	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	30	27	195	21,207	素材
BAKER HUGHES INC	105	91	408	44,287	エネルギー
ALLSTATE CORP	98	96	652	70,658	保険
EVERETT DENNISON CORP	20	22	172	18,712	素材
CHUBB LTD	77	115	1,426	154,544	保険
ANALOG DEVICES INC	74	78	435	47,166	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	7	7	586	63,609	小売
CVS HEALTH CORP	269	277	2,886	312,762	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ENTERPRISES	53	53	291	31,594	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	301	296	558	60,540	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	879	921	5,694	617,112	銀行
CIGNA CORP	61	64	835	90,517	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	135	145	1,055	114,410	資本財
COCA-COLA CO/THE	926	1,033	4,700	509,385	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	130	133	936	101,435	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	47	46	304	32,958	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	234	244	632	68,543	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	45	50	174	18,865	メディア
CHEVRON CORP	444	471	4,765	516,416	エネルギー
COACH INC	64	69	265	28,735	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	28	32	297	32,241	資本財
COMPUTER SCIENCES CORP	32	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CONOCOPHILLIPS	289	309	1,349	146,291	エネルギー
CME GROUP INC	75	80	752	81,511	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	77	82	633	68,639	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	214	213	1,534	166,329	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION RESOURCES INC/VA	137	149	1,074	116,475	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE	277	281	1,442	156,294	素材
DEVON ENERGY CORP	91	115	374	40,560	エネルギー
DEERE & CO	80	78	655	71,010	資本財
DANAHER CORP	148	154	1,510	163,688	資本財
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	213	219	1,410	152,878	素材
WALT DISNEY CO/THE	378	393	4,020	435,724	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC	31	28	181	19,665	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	166	172	1,392	150,894	公益事業
DR HORTON INC	75	84	246	26,716	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC	21	22	94	10,213	小売
TARGET CORP	142	146	1,108	120,084	小売
DUN & BRADSTREET CORP	8	9	108	11,744	商業・専門サービス
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	16	—	—	—	エネルギー
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I	40	42	322	35,002	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	38	38	256	27,765	資本財
DTE ENERGY COMPANY	41	45	413	44,806	公益事業
EXXON MOBIL CORP	995	1,042	9,255	1,003,039	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	25	53	567	61,481	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	128	137	1,104	119,744	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	162	163	865	93,814	資本財
EXELON CORP	202	231	816	88,468	公益事業
ECOLAB INC	63	66	775	84,032	素材
EQUIFAX INC	28	29	362	39,232	商業・専門サービス
ENSCO PLC-CL A	55	—	—	—	エネルギー
EMC CORP/MA	478	485	1,316	142,711	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	54	55	528	57,219	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	111	115	718	77,812	資本財
EDISON INTERNATIONAL	73	82	591	64,142	公益事業
ENTERGY CORP	42	45	347	37,615	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	10	10	195	21,210	保険
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	14	15	117	12,737	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC	103	115	1,385	150,163	公益事業
MACY'S INC	81	78	246	26,746	小売
FEDEX CORP	63	67	1,083	117,458	運輸
FMC TECHNOLOGIES INC	53	57	160	17,382	エネルギー
FAMILY DOLLAR STORES	24	—	—	—	小売
FORD MOTOR CO	844	927	1,234	133,821	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	95	97	348	37,766	各種金融
FOOT LOCKER INC	34	34	204	22,157	小売
FIRSTENERGY CORP	99	106	363	39,355	公益事業
FLUOR CORP	36	35	182	19,808	資本財
FREEPORT-MCMORAN INC	244	289	336	36,419	素材
GENERAL MILLS INC	141	149	957	103,718	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	66	67	973	105,550	資本財
WW GRAINGER INC	14	14	326	35,384	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	2,361	2,362	7,168	776,839	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	—	32	239	25,967	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	36	37	362	39,239	小売
TEGNA INC	—	52	122	13,235	メディア
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	—	67	188	20,399	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	55	60	112	12,197	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	92	96	1,532	166,025	各種金融
HALLIBURTON CO	199	210	830	89,983	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	174	183	2,090	226,522	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	50	48	219	23,791	自動車・自動車部品
HP INC	438	450	526	57,033	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	101	102	453	49,115	保険
HERSHEY CO/THE	35	37	342	37,075	食品・飲料・タバコ
DIRECTV	115	—	—	—	メディア
HOSPIRA INC	39	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARMAN INTERNATIONAL	—	17	131	14,253	耐久消費財・アパレル
HOME DEPOT INC	310	317	4,261	461,801	小売
HASBRO INC	26	28	237	25,704	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	62	65	430	46,677	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	221	230	3,435	372,357	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	94	98	421	45,720	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	87	81	853	92,497	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	96	101	241	26,185	メディア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	18	20	248	26,900	素材
JOHNSON & JOHNSON	658	692	7,920	858,353	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC	156	162	664	72,019	自動車・自動車部品
KANSAS CITY SOUTHERN	25	27	251	27,249	運輸
KELLOGG CO	62	66	506	54,891	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	88	90	1,169	126,782	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	394	397	1,765	191,348	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	109	231	803	87,045	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	48	48	188	20,395	小売
ELI LILLY & CO	235	249	1,904	206,412	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	23	25	321	34,787	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	39	41	174	18,956	運輸
LENNAR CORP-A	41	44	197	21,444	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	232	229	1,723	186,806	小売
LEGGETT & PLATT INC	32	34	167	18,133	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	58	61	416	45,151	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	94	99	452	49,053	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	63	69	1,673	181,353	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	60	61	265	28,806	保険
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	20	19	266	28,891	資本財
LEGG MASON INC	24	24	74	8,094	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	53	51	354	38,412	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	228	229	2,966	321,434	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	64	67	711	77,080	各種金融
MEDTRONIC PLC	332	353	2,869	310,942	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	670	699	3,797	411,501	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	252	271	274	29,756	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	80	84	262	28,458	耐久消費財・アパレル
3M CO	143	154	2,615	283,457	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	53	39	279	30,298	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	94	112	248	26,950	消費者サービス
MASCO CORP	82	84	266	28,869	資本財
MONSANTO CO	113	110	994	107,769	素材
MEADWESTVACO CORP	39	—	—	—	素材
M & T BANK CORP	27	35	415	45,023	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	127	130	834	90,396	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	14	15	309	33,518	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	345	363	958	103,858	各種金融
MCKESSON CORP	54	57	972	105,423	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	226	236	1,026	111,208	保険
MANPOWERGROUP INC	18	18	142	15,394	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	44	44	423	45,878	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	72	74	664	72,017	運輸
BANK OF AMERICA CORP	2,471	2,606	3,700	401,042	銀行
NISOURCE INC	74	—	—	—	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	45	43	928	100,660	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	101	121	180	19,592	銀行
NEWMONT MINING CORP	117	132	448	48,567	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	318	292	860	93,288	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	26	29	283	30,729	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	—	3	333	36,132	保険
NUCOR CORP	74	79	379	41,162	素材
NEWELL BRANDS INC	63	112	542	58,804	耐久消費財・アパレル
NOBLE CORP PLC	61	—	—	—	エネルギー
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	103	110	326	35,391	メディア
NOBLE ENERGY INC	90	107	390	42,314	エネルギー
PALL CORP	25	—	—	—	資本財
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	183	191	1,459	158,199	エネルギー
OMNICARE INC	23	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
OMNICOM GROUP	58	60	510	55,289	メディア
PEPSICO INC	351	364	3,854	417,706	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	—	24	160	17,422	素材
ALTRIA GROUP INC	465	490	3,170	343,633	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	26	28	209	22,742	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	635	680	5,592	606,035	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	123	126	1,096	118,801	銀行
PFIZER INC	1,481	1,545	5,123	555,232	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	107	112	855	92,755	保険
PULTEGROUP INC	77	78	142	15,465	耐久消費財・アパレル
PEPCO HOLDINGS LLC	60	—	—	—	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	34	34	384	41,620	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	34	40	663	71,898	エネルギー
CITIGROUP INC	711	745	3,315	359,325	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	68	73	311	33,738	保険
PPG INDUSTRIES INC	32	67	723	78,449	素材
PENTAIR PLC	43	45	265	28,806	資本財
PRAXAIR INC	68	71	808	87,632	素材
P G & E CORP	112	120	709	76,908	公益事業
PPL CORP	157	169	656	71,176	公益事業
PROGRESSIVE CORP	130	146	484	52,507	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	119	127	591	64,145	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	41	35	287	31,148	消費者サービス
SPX CORP	8	—	—	—	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	39	44	330	35,843	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	72	75	984	106,674	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	66	60	295	31,975	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	320	325	300	32,531	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	10	10	123	13,411	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	23	25	443	48,113	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	98	104	229	24,908	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	31	33	129	14,041	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	31	33	376	40,789	資本財
SCHLUMBERGER LTD	302	345	2,550	276,366	エネルギー
STRYKER CORP	80	84	943	102,278	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	276	296	824	89,309	各種金融
SEMPRA ENERGY	55	59	627	67,975	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19	19	582	63,116	素材
ST JUDE MEDICAL INC	67	70	535	58,025	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	34	37	422	45,836	資本財
SUNTRUST BANKS INC	122	127	527	57,126	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	77	76	851	92,268	保険
SOUTHERN CO/THE	212	228	1,150	124,659	公益事業
AT&T INC	1,219	1,539	6,031	653,589	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	51	48	178	19,290	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	98	100	609	66,042	各種金融
SYSCO CORP	137	141	709	76,834	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	46	49	230	25,024	素材
SCANA CORP	32	34	242	26,270	公益事業
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	36	—	—	—	エネルギー
TEXAS INSTRUMENTS INC	248	253	1,462	158,538	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	30	32	213	23,104	小売
TORCHMARK CORP	29	30	180	19,571	保険
TYCO INTERNATIONAL PLC	98	105	406	44,094	商業・専門サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	94	99	1,478	160,194	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	64	68	261	28,340	資本財
UNION PACIFIC CORP	209	213	1,807	195,841	運輸
UNUM GROUP	57	60	205	22,302	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	203	210	2,142	232,187	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	225	238	3,117	337,812	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	420	437	1,832	198,540	銀行
MARATHON OIL CORP	158	205	256	27,813	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	165	174	1,787	193,661	運輸
VALERO ENERGY CORP	122	120	673	72,982	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	23	24	198	21,532	ヘルスケア機器・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	112	108	605	65,652	メディア
VF CORP	81	85	517	56,115	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	30	33	384	41,670	素材
TOWERS WATSON & CO-CL A	16	—	—	—	商業・専門サービス
WILLIAMS COS INC	167	178	348	37,739	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	204	217	1,748	189,531	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	53	79	480	52,063	公益事業
WAL-MART STORES INC	379	401	2,663	288,680	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO	1,158	1,214	5,960	645,925	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	102	111	684	74,182	商業・専門サービス
WATERS CORP	19	20	275	29,833	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	179	220	123	13,425	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	18	19	337	36,556	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	256	227	211	22,945	ソフトウェア・サービス
XL GROUP PLC	71	74	249	27,090	保険
XCEL ENERGY INC	119	128	531	57,623	公益事業
KEYCORP	202	174	208	22,611	銀行
CARMAX INC	50	50	258	28,054	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	39	47	552	59,861	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	40	42	111	12,075	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	102	107	870	94,351	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	163	167	1,239	134,346	小売
CA INC	78	82	246	26,685	ソフトウェア・サービス
CAMERON INTERNATIONAL CORP	45	—	—	—	エネルギー
CLOROX COMPANY	30	32	426	46,256	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	35	36	258	28,034	素材
CARNIVAL CORP	90	103	519	56,248	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	66	70	518	56,180	ソフトウェア・サービス
CHUBB CORP	55	—	—	—	保険
CONAGRA FOODS INC	99	108	496	53,818	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	69	74	551	59,801	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	192	198	350	38,004	銀行
STERICYCLE INC	19	21	200	21,774	商業・専門サービス
INTEL CORP	1,137	1,181	3,550	384,732	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	1,203	1,270	3,392	367,685	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	23	22	209	22,712	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	30	31	321	34,860	電気通信サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	102	109	1,610	174,484	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	286	300	601	65,160	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	73	77	570	61,844	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	71	73	506	54,879	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	162	168	282	30,594	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	49	102	555	60,182	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	47	42	205	22,218	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	160	339	1,934	209,656	耐久消費財・アパレル
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	—	2	26	2,904	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	178	188	2,911	315,506	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	42	44	189	20,573	銀行
NORTHERN TRUST CORP	52	54	380	41,286	各種金融
MICROSOFT CORP	1,841	1,899	9,696	1,050,863	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	21	22	191	20,791	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	—	35	203	22,069	ヘルスケア機器・サービス
STAPLES INC	150	160	136	14,745	小売
STARBUCKS CORP	351	371	2,088	226,360	消費者サービス
ORACLE CORP	834	800	3,174	343,968	ソフトウェア・サービス
ALTERA CORP	71	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WHOLE FOODS MARKET INC	84	85	260	28,248	食品・生活必需品小売り
NETFLIX INC	13	101	914	99,154	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	23	24	648	70,248	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	118	128	475	51,500	ソフトウェア・サービス
URBAN OUTFITTERS INC	24	—	—	—	小売

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	44	47	308	33,486	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	19	20	355	38,519	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	31	33	310	33,653	小売
LAM RESEARCH CORP	37	40	302	32,775	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	18	20	189	20,520	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	505	621	3,857	418,019	メディア
XILINX INC	62	64	276	30,000	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	83	88	503	54,591	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	33	60	374	40,550	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	354	360	3,026	327,984	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	37	38	318	34,470	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	8	9	586	63,601	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	63	62	642	69,590	ソフトウェア・サービス
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	98	-	-	-	メディア
NUANCE COMMUNICATIONS INC	60	62	103	11,252	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	76	81	423	45,858	ソフトウェア・サービス
YAHOO! INC	211	224	838	90,917	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	18	21	96	10,418	ヘルスケア機器・サービス
SIGNATURE BANK	-	12	169	18,358	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	-	17	138	14,961	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	53	56	334	36,245	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	58	63	235	25,475	メディア
SALESFORCE.COM INC	140	157	1,196	129,713	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	33	34	156	16,985	小売
ALPHABET INC-CL A	66	72	5,327	577,305	ソフトウェア・サービス
JOY GLOBAL INC	23	-	-	-	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	-	11	123	13,420	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B/E AEROSPACE INC	24	26	124	13,495	資本財
GARMIN LTD	27	28	115	12,466	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE NAVIGATION LTD	61	62	148	16,070	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	390	376	1,962	212,682	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	53	60	205	22,317	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	36	38	187	20,360	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP	56	59	264	28,660	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	66	71	258	28,054	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	92	99	7,113	770,917	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	60	62	472	51,174	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	33	35	273	29,632	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	38	32	227	24,707	半導体・半導体製造装置
E*TRADE FINANCIAL CORP	-	73	185	20,115	各種金融
CERNER CORP	72	77	418	45,385	ヘルスケア機器・サービス
BROADCOM LTD	-	97	1,398	151,540	半導体・半導体製造装置
ALKERMES PLC	34	37	142	15,463	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	26	25	213	23,152	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	67	75	399	43,320	電気通信サービス
BROADCOM CORP-CL A	127	-	-	-	半導体・半導体製造装置
WASTE CONNECTIONS INC	-	26	180	19,559	商業・専門サービス
EBAY INC	263	270	641	69,563	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	128	134	485	52,618	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	48	55	440	47,764	小売
PRICELINE GROUP INC/THE	12	12	1,579	171,123	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	271	296	4,239	459,437	各種金融

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

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	169	201	684	74,194	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	264	273	1,089	118,089	各種金融
BORGWARNER INC	53	56	190	20,685	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	63	58	114	12,398	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	23	29	383	41,509	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC	197	200	1,483	160,779	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP	51	48	370	40,196	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	16	16	142	15,428	保険
AETNA INC	82	86	965	104,624	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	57	61	297	32,236	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	115	123	806	87,451	公益事業
AON PLC	63	68	723	78,415	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	151	149	566	61,409	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	22	23	128	13,958	保険
HESS CORP	63	70	408	44,285	エネルギー
CROWN CASTLE INTL CORP	78	—	—	—	不動産
JUNIPER NETWORKS INC	89	87	199	21,568	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	63	67	193	21,000	各種金融
RED HAT INC	44	45	330	35,802	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	17	17	183	19,846	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	52	56	267	29,023	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	41	44	226	24,498	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	72	73	170	18,514	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	35	41	296	32,112	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	88	103	100	10,920	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	55	55	1,491	161,607	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	33	36	509	55,166	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC	111	124	1,199	130,012	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	56	61	514	55,773	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC	43	41	181	19,702	小売
CELGENE CORP	187	196	1,971	213,685	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CREE INC	26	—	—	—	半導体・半導体製造装置
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	143	152	929	100,764	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	172	169	1,245	135,015	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	45	46	223	24,247	運輸
FASTENAL CO	65	68	318	34,530	資本財
FISERV INC	57	57	602	65,310	ソフトウェア・サービス
FLEXTRONICS INTL LTD	134	139	167	18,200	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOSSIL GROUP INC	10	—	—	—	耐久消費財・アパレル
SIRIUS XM HOLDINGS INC	575	524	206	22,347	メディア
SANDISK CORP	51	50	380	41,278	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	1,378	1,395	12,911	1,399,192	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	36	38	261	28,338	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	187	198	198	21,497	銀行
SIGMA-ALDRICH	28	—	—	—	素材
NABORS INDUSTRIES LTD	62	—	—	—	エネルギー
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	46	56	783	84,887	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHLAND INC	15	15	178	19,333	素材
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	34	36	261	28,351	運輸
CENTURYLINK INC	134	137	388	42,129	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	32	34	105	11,484	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	97	104	414	44,951	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	26	—	—	—	自動車・自動車部品
ONEOK INC	48	52	210	22,845	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC	75	214	1,091	118,267	食品・飲料・タバコ
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	121	—	—	—	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	76	74	140	15,192	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	34	35	218	23,636	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	17	18	271	29,408	小売
CONSOL ENERGY INC	52	—	—	—	エネルギー
NATIONAL OILWELL VARCO INC	101	93	303	32,936	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	39	43	706	76,511	食品・飲料・タバコ
CHESAPEAKE ENERGY CORP	124	—	—	—	エネルギー
PARTNERRE LTD	10	—	—	—	保険
COOPER COS INC/THE	11	12	188	20,461	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	35	38	268	29,069	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	73	77	433	47,023	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	24	24	138	14,958	保険
OWENS-ILLINOIS INC	40	—	—	—	素材
AGCO CORP	20	17	89	9,692	資本財
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	34	37	107	11,663	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP	33	35	534	57,888	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA INC	23	30	347	37,661	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11	58	172	18,641	素材
HUDSON CITY BANCORP INC	110	—	—	—	銀行
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	150	149	543	58,864	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC	43	43	414	44,936	各種金融
TESORO CORP	29	30	234	25,394	エネルギー
FNF GROUP	60	62	209	22,712	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	26	29	767	83,160	各種金融
NASDAQ INC	27	28	182	19,752	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	39	37	140	15,279	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	84	87	352	38,217	メディア
AUTOLIV INC	21	22	274	29,775	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	70	75	220	23,861	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	7	7	354	38,375	消費者サービス
IHS INC-CLASS A	15	17	206	22,396	商業・専門サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	28	28	283	30,759	食品・飲料・タバコ
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	105	111	291	31,621	小売
ARROW ELECTRONICS INC	23	23	142	15,424	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	40	42	484	52,463	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	31	30	153	16,636	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP	72	81	144	15,697	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	13	14	262	28,470	素材
RANGE RESOURCES CORP	39	42	183	19,845	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO	89	96	117	12,772	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	20	23	270	29,357	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	14	14	124	13,479	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	26	29	213	23,131	公益事業
OCEANEERING INTL INC	24	24	80	8,774	エネルギー
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	29	29	201	21,803	消費者サービス
HANESBRANDS INC	93	98	263	28,547	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC-CLASS A	235	247	2,389	258,910	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	122	126	242	26,262	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	—	22	88	9,596	資本財
AVNET INC	31	33	130	14,138	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	75	79	207	22,519	素材
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	—	20	29	3,173	消費者サービス
SPECTRA ENERGY CORP	158	168	519	56,334	エネルギー
TRANSIGM GROUP INC	11	13	333	36,125	資本財
WILLIS TOWERS WATSON PLC	37	32	406	44,002	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	73	76	117	12,690	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	95	96	570	61,786	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	106	107	592	64,210	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	24	28	174	18,904	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	—	13	145	15,762	資本財
PRECISION CASTPARTS CORP	33	—	—	—	資本財
VMWARE INC-CLASS A	19	19	110	11,977	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	79	70	281	30,465	保険
TIME WARNER CABLE	66	70	1,535	166,438	メディア
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	14	15	307	33,369	小売
LKQ CORP	70	76	249	26,987	小売
HORMEL FOODS CORP	33	72	290	31,500	食品・飲料・タバコ
EASTMAN CHEMICAL CO	34	37	280	30,412	素材
GAMESTOP CORP-CLASS A	26	26	76	8,338	小売
HARRIS CORP	24	31	237	25,763	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	36	37	629	68,188	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP	39	41	124	13,501	エネルギー
NRG ENERGY INC	78	79	125	13,564	公益事業
INVESCO LTD	101	106	308	33,382	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	36	40	332	36,006	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	34	35	169	18,370	各種金融
TERADATA CORP	36	33	91	9,949	ソフトウェア・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	40	41	220	23,935	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	28	32	376	40,814	エネルギー
MSCI INC	—	24	183	19,920	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	21	23	93	10,179	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	35	46	461	50,048	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	365	387	3,948	427,856	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	463	487	3,765	408,035	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	45	47	447	48,506	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N.V.	10	10	130	14,139	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP	96	114	280	30,441	エネルギー
FLOWERVE CORP	31	32	152	16,540	資本財
HELMERICH & PAYNE	25	26	160	17,387	エネルギー
MDU RESOURCES GROUP INC	42	—	—	—	公益事業
ENERGEN CORP	17	—	—	—	エネルギー
T-MOBILE US INC	57	71	291	31,615	電気通信サービス
LORILLARD INC	87	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	18	18	125	13,612	メディア
RACKSPACE HOSTING INC	28	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	62	69	193	20,997	メディア
RESMED INC	32	34	201	21,797	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	—	20	202	21,931	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	57	59	279	30,262	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	30	30	220	23,857	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	31	32	316	34,246	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	22	23	192	20,847	運輸
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	19	—	—	—	公益事業
PERRIGO CO PLC	33	36	339	36,838	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUANTA SERVICES INC	50	39	94	10,238	資本財
FMC CORP	30	33	157	17,067	素材
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	28	—	—	—	食品・飲料・タバコ
WABTEC CORP	22	24	192	20,823	資本財
EVERSOURCE ENERGY	75	80	461	49,996	公益事業
NETSUITE INC	8	10	78	8,519	ソフトウェア・サービス
ALLERGAN PLC	88	98	2,197	238,140	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRGAS INC	15	13	192	20,865	素材
CROWN HOLDINGS INC	32	35	191	20,713	素材
CALPINE CORP	79	86	129	14,038	公益事業
EATON VANCE CORP	26	28	99	10,831	各種金融
DELTA AIR LINES INC	49	50	212	22,975	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	47	49	420	45,518	食品・飲料・タバコ
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	59	—	—	—	半導体・半導体製造装置
AMERICAN WATER WORKS CO INC	42	45	341	37,051	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	37	40	312	33,871	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	71	73	612	66,352	小売
FORTINET INC	—	36	119	12,928	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	22	23	109	11,827	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6	6	249	27,017	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	41	42	141	15,311	銀行
QEP RESOURCES INC	41	—	—	—	エネルギー
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	240	292	158	17,138	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO	302	353	1,099	119,161	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	34	291	31,536	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	100	95	782	84,809	素材
HCA HOLDINGS INC	71	81	655	71,069	ヘルスケア機器・サービス
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	104	95	83	9,100	運輸
WHITING PETROLEUM CORP	48	—	—	—	エネルギー
ROCK-TENN COMPANY -CL A	32	—	—	—	素材
HOLLYFRONTIER CORP	43	43	127	13,810	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	65	133	479	51,930	エネルギー
ZILLOW GROUP INC - A	11	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ATMOS ENERGY CORP	—	26	193	20,999	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	—	39	223	24,178	資本財
XYLEM INC	43	44	192	20,859	資本財
TRIPADVISOR INC	27	29	194	21,065	小売
MEDIVATION INC	18	41	250	27,140	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	14	15	229	24,858	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	30	36	250	27,106	銀行
ALLEGHANY CORP	3	3	203	22,009	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	18	19	713	77,292	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	130	133	1,060	114,925	エネルギー
FACEBOOK INC-A	470	568	6,792	736,135	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP	67	70	295	32,010	公益事業
ALBEMARLE CORP	26	28	209	22,748	素材
PVH CORP	19	20	171	18,634	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A	25	28	372	40,357	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	423	475	810	87,839	エネルギー
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	67	—	—	—	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	80	86	450	48,810	商業・専門サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	69	70	492	53,412	自動車・自動車部品
CHARTER COMMUNICATION-A	18	21	456	49,434	メディア
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	37	42	148	16,096	資本財
SPLUNK INC	—	32	155	16,822	ソフトウェア・サービス
ADT CORP/THE	40	—	—	—	商業・専門サービス
KRAFT FOODS GROUP INC	138	—	—	—	食品・飲料・タバコ
OGE ENERGY CORP	45	51	157	17,097	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	14	15	133	14,496	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	374	409	2,566	278,090	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LIBERTY MEDIA CORP - A	22	—	—	—	メディア
TESLA MOTORS INC	20	24	514	55,706	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	53	56	184	19,998	エネルギー
REALOGY HOLDINGS CORP	34	36	116	12,640	不動産
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	29	32	164	17,878	各種金融
ZOETIS INC	117	118	545	59,087	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC	27	29	167	18,180	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	91	95	116	12,609	メディア
SPRINT CORP	192	199	69	7,547	電気通信サービス
TECO ENERGY INC	—	59	165	17,983	公益事業
SNAP-ON INC	13	14	236	25,626	資本財
AGL RESOURCES INC	—	25	167	18,152	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	48	46	202	21,972	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	89	145	212	23,002	ソフトウェア・サービス
VANTIV INC - CL A	33	39	218	23,644	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	23	28	201	21,798	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	31	37	260	28,184	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	21	22	310	33,607	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	22	23	89	9,662	資本財
PHARMACYCLICS INC	15	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	18	19	298	32,335	ソフトウェア・サービス
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	—	46	111	12,065	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL C	68	77	5,568	603,461	ソフトウェア・サービス
IMS HEALTH HOLDINGS INC	—	41	104	11,276	ヘルスケア機器・サービス
NAVIENT CORP	98	90	115	12,566	各種金融
ENDO INTERNATIONAL PLC	40	53	72	7,907	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED RENTALS INC	23	23	143	15,594	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	43	40	132	14,326	運輸
VOYA FINANCIAL INC	53	53	163	17,772	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	11	11	52	5,686	素材
ANTERO RESOURCES CORP	12	20	54	5,865	エネルギー
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	15	23	153	16,602	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIREEYE INC	18	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP - C	48	—	—	—	メディア
ALLY FINANCIAL INC	99	108	184	20,004	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	92	123	275	29,859	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	—	34	175	18,982	ソフトウェア・サービス
JARDEN CORP	42	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	27	40	187	20,341	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	16	20	285	30,943	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

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		
SIGNET JEWELERS LTD	17	18	196	21,285	小売	
SYNCHRONY FINANCIAL	38	208	624	67,711	各種金融	
QORVO INC	34	35	162	17,633	半導体・半導体製造装置	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	27	30	99	10,762	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	—	44	208	22,625	保険	
ACUITY BRANDS INC	—	10	276	29,922	資本財	
JONES LANG LASALLE INC	—	11	125	13,637	不動産	
ARAMARK	—	56	187	20,340	消費者サービス	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	—	131	292	31,662	銀行	
LEAR CORP	—	18	217	23,534	自動車・自動車部品	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	19	103	11,169	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WHITEWAVE FOODS CO	—	44	194	21,099	食品・飲料・タバコ	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	—	35	101	10,984	素材	
RITE AID CORP	—	219	175	19,011	食品・生活必需品小売り	
BAXALTA INC	—	170	725	78,670	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLUMBIA PIPELINE GROUP	—	97	249	27,001	エネルギー	
WESTROCK CO	—	64	275	29,837	素材	
KRAFT HEINZ CO/THE	—	151	1,293	140,214	食品・飲料・タバコ	
PAYPAL HOLDINGS INC	—	275	1,092	118,433	ソフトウェア・サービス	
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	—	13	64	7,041	ソフトウェア・サービス	
ZILLOW GROUP INC - C	—	25	68	7,471	ソフトウェア・サービス	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	—	451	723	78,426	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MOBILEYE NV	—	20	73	7,984	ソフトウェア・サービス	
AMERCO	—	1	72	7,802	運輸	
CDW CORP/DE	—	35	149	16,167	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MEDNAX INC	—	23	162	17,642	ヘルスケア機器・サービス	
SABRE CORP	—	51	151	16,405	ソフトウェア・サービス	
WR GRACE & CO	—	18	140	15,250	素材	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	—	37	132	14,401	耐久消費財・アパレル	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	—	50	159	17,288	メディア	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	—	22	72	7,896	メディア	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	—	120	73	7,984	不動産	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	—	60	319	34,656	資本財	
小 計	株 数	金 額	73,188	78,527	459,203	49,763,830
	銘柄 数 < 比 率 >		593	596	—	< 57.1% >
(カナダ)			千カナダドル			
ROYAL BANK OF CANADA	339	371	2,842	239,716	銀行	
IMPERIAL OIL LTD	70	75	303	25,615	エネルギー	
THOMSON REUTERS CORP	85	86	453	38,241	メディア	
TRANSCANADA CORP	167	178	921	77,725	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	85	91	449	37,909	電気通信サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	144	153	660	55,661	保険	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	133	142	178	15,088	素材	
BARRICK GOLD CORP	275	291	689	58,184	素材	
BCE INC	34	36	214	18,090	電気通信サービス	
AGRIUM INC	34	33	367	30,987	素材	
BOMBARDIER INC-B	333	487	98	8,336	資本財	
BANK OF MONTREAL	152	160	1,304	109,966	銀行	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	134	221	962	81,182	不動産	
BANK OF NOVA SCOTIA	286	301	1,889	159,381	銀行	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	75	81	274	23,115	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAE INC	66	68	105	8,911	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	94	100	151	12,767	エネルギー
CI FINANCIAL CORP	52	59	159	13,458	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	93	99	995	83,929	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	257	274	1,016	85,701	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	192	199	1,522	128,362	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	18	18	250	21,108	小売
ENBRIDGE INC	200	230	1,178	99,403	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	5	6	386	32,619	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	52	55	320	27,063	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	80	88	134	11,300	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	25	25	92	7,830	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	53	57	393	33,166	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	463	493	902	76,081	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	98	101	529	44,639	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	77	86	358	30,264	銀行
ONEX CORPORATION	21	21	166	14,043	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	195	209	428	36,113	素材
POWER CORP OF CANADA	88	94	271	22,861	保険
POWER FINANCIAL CORP	60	63	197	16,618	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	94	102	245	20,686	メディア
SUNCOR ENERGY INC	342	396	1,365	115,111	エネルギー
TRANSALTA CORP	67	—	—	—	公益事業
WESTON (GEORGE) LTD	12	13	143	12,083	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	40	36	637	53,735	運輸
ENCANA CORP	192	211	189	15,960	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	49	54	323	27,295	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	42	43	94	7,959	資本財
GOLDCORP INC	192	208	500	42,237	素材
KINROSS GOLD CORP	272	308	207	17,506	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	36	38	195	16,509	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC	70	75	256	21,643	保険
METHANEX CORP	21	23	89	7,589	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	179	252	89	7,565	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	18	21	40	3,389	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	55	58	221	18,654	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	61	64	266	22,500	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	120	125	107	9,076	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELUS CORP	47	41	166	14,044	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	139	173	159	13,465	素材
YAMANA GOLD INC	219	237	146	12,331	素材
FORTIS INC	66	71	288	24,332	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	98	105	566	47,788	食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP	167	179	111	9,404	素材
TORONTO-DOMINION BANK	433	464	2,600	219,318	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	36	44	394	33,298	素材
SILVER WHEATON CORP	97	101	250	21,088	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	13	41	88	7,433	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	24	26	107	9,092	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	28	32	116	9,857	公益事業
METRO INC	59	60	256	21,655	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	29	30	213	18,023	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	31	33	292	24,634	保険

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
CRESCENT POINT ENERGY CORP	101	126	256	21,633	エネルギー	
CENOVUS ENERGY INC	194	209	397	33,487	エネルギー	
MEG ENERGY CORP	39	—	—	—	エネルギー	
ARC RESOURCES LTD	77	86	176	14,910	エネルギー	
CANADIAN OIL SANDS LTD	110	—	—	—	エネルギー	
BAYTEX ENERGY CORP	39	—	—	—	エネルギー	
TOURMALINE OIL CORP	39	47	144	12,179	エネルギー	
ENERPLUS CORP	46	—	—	—	エネルギー	
NEW GOLD INC	128	—	—	—	素材	
PEMBINA PIPELINE CORP	78	93	344	29,010	エネルギー	
VERMILION ENERGY INC	25	28	117	9,903	エネルギー	
CATAMARAN CORP	49	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
DOLLARAMA INC	29	30	273	23,085	小売	
KEYERA CORP	40	43	158	13,387	エネルギー	
ALTAGAS LTD	30	37	109	9,273	エネルギー	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	33	38	121	10,216	エネルギー	
ATCO LTD -CLASS I	19	20	84	7,136	公益事業	
FIRST CAPITAL REALTY INC	20	28	59	5,008	不動産	
INTER PIPELINE LTD	77	85	219	18,543	エネルギー	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	32	46	112	9,523	エネルギー	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	—	41	98	8,332	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4	5	255	21,507	ソフトウェア・サービス	
CONSTELLATION SOFTWARE INC-RTS	4	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	14	—	—	—	エネルギー	
RESTAURANT BRANDS INTERN	45	50	268	22,653	消費者サービス	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	17	17	73	6,226	素材	
VERESEN INC	—	75	68	5,780	エネルギー	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	—	7	157	13,292	素材	
ELEMENT FINANCIAL CORP	—	97	145	12,286	各種金融	
LINAMAR CORP	—	12	62	5,269	自動車・自動車部品	
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	—	23	98	8,328	商業・専門サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	9,172	9,959	35,713	3,011,704	
	銘柄 数 < 比 率 >	93	90	—	< 3.5% >	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
COMMERZBANK AG	249	266	187	23,195	銀行	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	324	345	508	62,901	各種金融	
METRO AG	37	44	125	15,593	食品・生活必需品小売り	
SIEMENS AG-REG	186	198	1,871	231,711	資本財	
RWE AG	115	123	141	17,481	公益事業	
BASF SE	215	229	1,571	194,628	素材	
VOLKSWAGEN AG	6	8	123	15,336	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	226	240	1,430	177,142	自動車・自動車部品	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	41	44	453	56,199	家庭用品・パーソナル用品	
E.ON SE	471	502	403	49,934	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	78	82	637	78,948	自動車・自動車部品	
BAYER AG-REG	194	207	2,070	256,286	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LINDE AG	43	46	587	72,796	素材	
ALLIANZ SE-REG	107	114	1,586	196,441	保険	
MAN SE	8	7	70	8,770	資本財	
CONTINENTAL AG	25	27	514	63,749	自動車・自動車部品	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	265	282	339	42,060	半導体・半導体製造装置	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	36	38	185	22,953	自動車・自動車部品	

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…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	57	60	75	9,353	運輸	
HUGO BOSS AG -ORD	15	16	93	11,576	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE POST AG-REG	227	242	641	79,380	運輸	
SAP SE	216	245	1,676	207,547	ソフトウェア・サービス	
CELESIO AG	11	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	51	54	233	28,952	メディア	
DEUTSCHE BOERSE AG	45	48	368	45,589	各種金融	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	51	54	409	50,732	ヘルスケア機器・サービス	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	9	10	54	6,697	運輸	
ADIDAS AG	48	52	593	73,448	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	747	806	1,262	156,302	電気通信サービス	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	40	41	661	81,907	保険	
THYSSENKRUPP AG	106	92	175	21,676	素材	
BEIERSDORF AG	23	25	199	24,641	家庭用品・パーソナル用品	
HEIDELBERGCEMENT AG	33	35	267	33,114	素材	
MERCK KGAA	30	32	259	32,122	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VOLKSWAGEN AG-PREF	38	46	604	74,834	自動車・自動車部品	
LANXESS AG	21	22	101	12,536	素材	
FRESENIUS SE & CO KGAA	89	95	618	76,615	ヘルスケア機器・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	69	84	229	28,422	不動産	
GEA GROUP AG	42	45	184	22,840	資本財	
K+S AG-REG	29	30	176	21,894	素材	
HENKEL AG & CO KGAA	40	47	107	13,347	素材	
HENKEL AG & CO KGAA	27	25	234	29,002	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	28	30	133	16,573	ソフトウェア・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	12	13	93	11,568	自動車・自動車部品	
HANNOVER RUECK SE	14	15	145	18,012	保険	
BRENNTAG AG	36	38	184	22,849	資本財	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	5	—	—	—	メディア	
AXEL SPRINGER SE	8	11	55	6,834	メディア	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	15	17	64	7,967	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	137	186	84	10,517	電気通信サービス	
OSRAM LICHT AG	21	22	102	12,645	資本財	
VONOVIA SE	80	116	354	43,875	不動産	
EVONIK INDUSTRIES AG	—	34	100	12,417	素材	
ZALANDO SE	—	21	63	7,907	小売	
小 計	株 数	金 額	5,071	5,538	23,421	2,899,839
銘 柄 数 < 比 率 >	52	52	—	—	< 3.3% >	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	273	291	381	47,257	保険	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	962	—	—	—	銀行	
INTESA SANPAOLO	2,980	3,174	716	88,677	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	2,384	2,874	243	30,140	電気通信サービス	
ENI SPA	598	636	855	105,911	エネルギー	
UNICREDIT SPA	1,033	1,194	338	41,954	銀行	
ENEL SPA	1,551	1,968	781	96,759	公益事業	
SAIPEM SPA	59	1,524	55	6,911	エネルギー	
ATLANTIA SPA	97	103	249	30,885	運輸	
INTESA SANPAOLO-RSP	212	230	50	6,190	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	39	42	201	24,921	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	146	140	90	11,168	各種金融	
SNAM SPA	494	533	282	34,940	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	1,370	1,500	102	12,654	電気通信サービス	
BANCO POPOLARE SC	85	90	39	4,940	銀行	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	96	101	108	13,483	資本財	
PIRELLI & C.	55	—	—	—	自動車・自動車部品	
UBI BANCA SPA	201	226	71	8,872	銀行	
TERNA SPA	364	387	187	23,271	公益事業	
UNIPOLSAI SPA	216	273	52	6,460	保険	
PRYSMIAN SPA	48	48	104	12,954	資本財	
EXOR SPA	22	27	88	10,991	各種金融	
ENEL GREEN POWER SPA	431	—	—	—	公益事業	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	13,728 23	15,372 20	5,002 —	619,349 <0.7%>	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)	43	46	424	52,565	自動車・自動車部品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	65	69	1,024	126,815	耐久消費財・アパレル	
PEUGEOT SA	92	111	151	18,765	自動車・自動車部品	
AXA SA	426	492	1,026	127,103	保険	
DANONE	136	147	893	110,637	食品・飲料・タバコ	
CARREFOUR SA	129	138	334	41,427	食品・生活必需品小売り	
VIVENDI	285	290	478	59,264	メディア	
INGENICO GROUP	—	13	140	17,423	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ALCATEL-LUCENT SA	663	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SOCIETE GENERALE SA	170	181	598	74,111	銀行	
AIR LIQUIDE SA	81	86	820	101,577	素材	
TOTAL SA	503	549	2,356	291,751	エネルギー	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	105	119	459	56,861	資本財	
ZODIAC AEROSPACE	42	50	106	13,147	資本財	
VINCI SA	111	120	775	95,966	資本財	
LAFARGE SA	43	—	—	—	素材	
SANOFI	280	294	2,043	252,978	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	99	114	227	28,172	公益事業	
L'OREAL	59	62	1,002	124,058	家庭用品・パーソナル用品	
ACCOR SA	49	53	205	25,461	消費者サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	123	139	767	95,029	資本財	
BNP PARIBAS	248	265	1,169	144,810	銀行	
ESSILOR INTERNATIONAL	47	51	586	72,597	ヘルスケア機器・サービス	
CAPGEMINI	33	40	333	41,331	ソフトウェア・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	12	14	72	8,969	食品・生活必需品小売り	
VALEO SA	17	19	276	34,192	自動車・自動車部品	
HERMES INTERNATIONAL	6	6	210	26,091	耐久消費財・アパレル	
VALLOUREC SA	26	—	—	—	エネルギー	
SODEXO	22	23	209	25,927	消費者サービス	
KERING	17	18	273	33,885	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	30	32	221	27,453	ソフトウェア・サービス	
TECHNIP SA	23	26	123	15,329	エネルギー	
CHRISTIAN DIOR SE	12	13	206	25,612	耐久消費財・アパレル	
ATOS SE	19	21	176	21,854	ソフトウェア・サービス	
ORANGE	436	496	730	90,441	電気通信サービス	
CNP ASSURANCES	41	43	60	7,502	保険	
IMERYS SA	7	8	55	6,824	素材	
SAFRAN SA	68	78	468	58,007	資本財	
RENAULT SA	45	48	390	48,384	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…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
PUBLICIS GROUPE	44	47	297	36,820	メディア
LAGARDERE SCA	28	29	62	7,768	メディア
JC DECAUX SA	14	18	66	8,193	メディア
SOCIETE BIC SA	6	7	89	11,049	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	39	50	147	18,271	資本財
THALES SA	21	26	202	25,042	資本財
PERNOD RICARD SA	49	53	508	62,920	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	242	264	240	29,781	銀行
ENGIE	341	367	483	59,827	公益事業
ALSTOM	52	38	85	10,581	資本財
ARKEMA	15	16	119	14,836	素材
LEGRAND SA	62	66	325	40,263	資本財
SCOR SE	34	38	112	13,949	保険
ADP	7	7	81	10,102	運輸
EDF	58	62	70	8,713	公益事業
NATIXIS	223	236	99	12,275	銀行
WENDEL	7	7	76	9,429	各種金融
BUREAU VERITAS SA	63	66	134	16,668	商業・専門サービス
EURAZEO	9	10	62	7,708	各種金融
EURAZEO-NEW	0.45	—	—	—	各種金融
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	73	76	116	14,425	公益事業
ILIAD SA	6	6	128	15,873	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	35	42	116	14,389	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	112	118	133	16,544	運輸
EDENRED	50	52	89	11,044	商業・専門サービス
REMY COINTREAU	5	6	44	5,462	食品・飲料・タバコ
REXEL SA	65	75	99	12,315	資本財
BOLLORE	200	219	73	9,147	運輸
NUMERICABLE-SFR	22	27	76	9,432	電気通信サービス
小 計	株 数	金 額			
銘 柄 数 < 比 率 >	67	64	—	< 3.3% >	
(ユーロ…オランダ)					
QIAGEN N. V.	55	55	106	13,172	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV	218	237	148	18,356	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	211	224	151	18,701	自動車・自動車部品
FERRARI NV	—	32	122	15,114	自動車・自動車部品
AIRBUS GROUP SE	138	147	821	101,658	資本財
STMICROELECTRONICS NV	148	159	75	9,345	半導体・半導体製造装置
GEMALTO	18	20	114	14,230	ソフトウェア・サービス
WOLTERS KLUWER	70	75	258	32,044	メディア
KONINKLIJKE KPN NV	753	802	278	34,497	電気通信サービス
AKZO NOBEL	57	61	379	47,032	素材
HEINEKEN NV	54	57	477	59,070	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV	219	238	550	68,153	資本財
RELX NV	165	249	370	45,849	メディア
AEGON NV	426	456	220	27,283	保険
KONINKLIJKE AHOLD NV	210	208	402	49,807	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD HOLDING NV	29	32	149	18,499	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV	23	25	182	22,598	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	40	45	238	29,548	素材
ING GROEP NV-CVA	907	968	1,012	125,327	銀行
ASML HOLDING NV	82	86	704	87,177	半導体・半導体製造装置

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UNILEVER NV-CVA	382	407	1,599	197,980		家庭用品・パーソナル用品
VOPAK	17	17	83	10,303		エネルギー
BOSKALIS WESTMINSTER	19	21	77	9,546		資本財
DELTA LLOYD NV	49	—	—	—		保険
TNT EXPRESS NV	102	105	84	10,434		運輸
OCI NV	19	21	30	3,810		素材
NN GROUP NV	36	79	234	29,067		保険
ALTICE NV - B	—	26	37	4,617		メディア
ALTICE NV - A	—	93	128	15,877		メディア
小計	株数・金額	4,459	4,960	9,038	1,119,109	
	銘柄数<比率>	26	28	—	<1.3%>	
(ユーロ…スペイン)						
BANCO POPULAR ESPANOL	417	431	89	11,083		銀行
ENDESA SA	77	80	146	18,188		公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	39	47	131	16,294		資本財
IBERDROLA SA	1,211	1,380	833	103,189		公益事業
TELEFONICA SA	1,050	1,126	1,043	129,152		電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA	3,381	3,609	1,457	180,501		銀行
BANKINTER SA	162	167	106	13,151		銀行
REPSOL SA	243	274	308	38,240		エネルギー
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,478	1,590	876	108,527		銀行
GAS NATURAL SDG SA	81	89	150	18,575		公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	256	272	761	94,304		小売
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	98	130	188	23,336		運輸
MAPPRE SA	201	261	55	6,880		保険
FERROVIAL SA	99	118	214	26,556		資本財
FERROVIAL SA-RTS	99	—	—	—		資本財
ZARDOYA OTIS SA	41	44	40	5,007		資本財
ENAGAS SA	47	55	145	18,000		公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	26	27	213	26,493		公益事業
BANCO DE SABADELL SA	1,012	1,279	196	24,366		銀行
CAIXABANK S.A	539	663	158	19,645		銀行
GRIFOLS SA	35	74	137	16,974		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	105	109	437	54,134		ソフトウェア・サービス
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	192	207	136	16,839		運輸
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	141	146	70	8,691		食品・生活必需品小売り
BANKIA SA	1,050	1,143	87	10,831		銀行
AENA SA	14	16	206	25,521		運輸
小計	株数・金額	12,109	13,348	8,193	1,014,490	
	銘柄数<比率>	26	25	—	<1.2%>	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS	51	50	163	20,264		保険
UCB SA	29	31	211	26,124		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	189	201	2,238	277,198		食品・飲料・タバコ
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	18	20	148	18,354		各種金融
DELHAIZE GROUP	23	21	200	24,805		食品・生活必需品小売り
UMICORE	21	23	106	13,241		素材
COLRUYT SA	16	17	89	11,055		食品・生活必需品小売り
KBC GROEP NV	59	62	286	35,520		銀行
SOLVAY SA	13	18	165	20,540		素材
PROXIMUS	34	38	106	13,243		電気通信サービス

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
TELENET GROUP HOLDING NV	11	13	57	7,078	メディア
小 計	株数・金額	471	499	3,775	467,426
	銘柄数<比率>	11	11	-	<0.5%>
(ユーロ…オーストリア)					
ERSTE GROUP BANK AG	67	70	164	20,413	銀行
OMV AG	33	37	94	11,660	エネルギー
VOESTALPINE AG	25	28	82	10,191	素材
IMMOFINANZ AG	247	-	-	-	不動産
ANDRITZ AG	16	19	88	10,969	資本財
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	30	29	36	4,485	銀行
VIENNA INSURANCE GROUP AG	9	-	-	-	保険
小 計	株数・金額	430	185	466	57,721
	銘柄数<比率>	7	5	-	<0.1%>
(ユーロ…ルクセンブルク)					
RTL GROUP	8	9	71	8,912	メディア
TENARIS SA	109	117	132	16,404	エネルギー
SES	71	81	197	24,482	メディア
ARCELORMITTAL	233	426	185	22,948	素材
ALTICE SA	20	-	-	-	メディア
小 計	株数・金額	443	635	587	72,748
	銘柄数<比率>	5	4	-	<0.1%>
(ユーロ…フィンランド)					
NOKIA OYJ	880	1,444	670	82,973	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS	131	137	101	12,602	素材
NOKIAN RENKAAT OYJ	25	28	92	11,431	自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ	125	133	221	27,460	素材
FORTUM OYJ	103	112	143	17,753	公益事業
KONE OYJ-B	73	84	332	41,107	資本財
METSO OYJ	27	28	57	7,090	資本財
SAMPO OYJ-A SHS	105	111	437	54,121	保険
WARTSILA OYJ ABP	35	36	135	16,725	資本財
ELISA OYJ	34	35	115	14,266	電気通信サービス
NESTE OYJ	28	32	92	11,480	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	24	25	77	9,648	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	株数・金額	1,595	2,210	2,476	306,661
	銘柄数<比率>	12	12	-	<0.4%>
(ユーロ…アイルランド)					
KERRY GROUP PLC-A	38	40	328	40,651	食品・飲料・タバコ
PADDY POWER BETFAIR PLC	-	20	226	28,030	消費者サービス
BANK OF IRELAND	6,546	7,084	174	21,578	銀行
CRH PLC	195	209	535	66,284	素材
小 計	株数・金額	6,780	7,355	1,264	156,545
	銘柄数<比率>	3	4	-	<0.2%>
(ユーロ…ポルトガル)					
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	558	586	182	22,600	公益事業
JERONIMO MARTINS	58	62	86	10,723	食品・生活必需品小売り
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	8,533	10,346	33	4,099	銀行
GALP ENERGIA SGPS SA	90	116	136	16,941	エネルギー
小 計	株数・金額	9,240	11,112	439	54,364
	銘柄数<比率>	4	4	-	<0.1%>
ユ ー ロ 計	株数・金額	60,858	67,551	78,212	9,683,428
	銘柄数<比率>	236	229	-	<11.1%>

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
BARCLAYS PLC	3,869	4,201	687	107,587	銀行
BP PLC	4,291	4,586	1,656	259,310	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	13,429	14,294	938	146,970	銀行
ASTRAZENECA PLC	296	316	1,243	194,675	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC	91	98	108	16,995	資本財
NEXT PLC	36	36	193	30,345	小売
DIAGEO PLC	591	629	1,187	185,800	食品・飲料・タバコ
SKY PLC	243	259	240	37,714	メディア
BAE SYSTEMS PLC	743	791	388	60,781	資本財
UNILEVER PLC	301	320	1,011	158,265	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC	1,909	2,039	324	50,861	食品・生活必需品小売り
RELX PLC	266	278	342	53,592	メディア
MARKS & SPENCER GROUP PLC	384	408	170	26,699	小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	151	159	1,093	171,162	家庭用品・パーソナル用品
PRUDENTIAL PLC	603	643	841	131,729	保険
BG GROUP PLC	802	—	—	—	エネルギー
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,397	1,488	322	50,552	保険
SAGE GROUP PLC/THE	253	270	161	25,333	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	4,511	4,899	2,112	330,650	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	438	466	1,980	310,041	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	166	175	166	26,047	公益事業
SCHRODERS PLC	28	31	76	12,024	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	598	869	185	29,084	銀行
BHP BILLITON PLC	496	528	442	69,215	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	225	240	912	142,846	食品・飲料・タバコ
WPP PLC	309	323	518	81,185	メディア
CENTRICA PLC	1,169	1,276	268	41,970	公益事業
BT GROUP PLC	1,916	2,118	925	144,898	電気通信サービス
SSE PLC	232	254	384	60,202	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	580	819	407	63,770	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	442	460	303	47,440	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF C	64,630	32,679	3	511	資本財
COMPASS GROUP PLC	392	411	514	80,543	消費者サービス
KINGFISHER PLC	553	572	207	32,542	小売
PEARSON PLC	193	205	166	25,994	メディア
SEVERN TRENT PLC	56	61	136	21,406	公益事業
RIO TINTO PLC	299	310	630	98,669	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,143	1,218	1,797	281,309	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SABMILLER PLC	227	244	1,034	161,878	食品・飲料・タバコ
PROVIDENT FINANCIAL PLC	—	36	102	16,080	各種金融
3I GROUP PLC	226	241	115	18,054	各種金融
GKN PLC	378	428	120	18,826	自動車・自動車部品
VODAFONE GROUP PLC	6,232	6,644	1,477	231,189	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	509	555	105	16,467	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	298	336	88	13,847	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	940	1,011	428	67,069	保険
CAPITA PLC	155	166	182	28,570	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC	222	244	101	15,850	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	48	48	139	21,837	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	232	254	122	19,134	保険
WHITBREAD PLC	42	45	179	28,018	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	888	941	938	146,967	公益事業

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
ARM HOLDINGS PLC	330	351	332	52,088	半導体・半導体製造装置
WOLSELEY PLC	61	63	249	39,099	資本財
BUNZL PLC	77	84	175	27,393	資本財
COBHAM PLC	263	286	46	7,241	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	328	350	216	33,899	素材
INTERTEK GROUP PLC	39	40	135	21,167	商業・専門サービス
WILLIAM HILL PLC	203	220	67	10,557	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	104	111	130	20,383	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	56	49	133	20,895	消費者サービス
CARNIVAL PLC	43	47	170	26,692	消費者サービス
PERSIMMON PLC	71	76	149	23,451	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	193	193	79	12,490	資本財
ICAP PLC	124	138	64	10,046	各種金融
ITV PLC	900	957	206	32,271	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	73	78	202	31,663	各種金融
G4S PLC	360	390	75	11,797	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS	—	32	92	14,550	耐久消費財・アパレル
AMEC FOSTER WHEELER PLC	86	—	—	—	エネルギー
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	—	250	131	20,527	耐久消費財・アパレル
IMI PLC	61	68	67	10,562	資本財
REXAM PLC	163	147	92	14,490	素材
SMITH & NEPHEW PLC	209	224	259	40,612	ヘルスケア機器・サービス
TATE & LYLE PLC	107	116	71	11,122	食品・飲料・タバコ
TAYLOR WIMPEY PLC	—	813	146	22,856	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	920	986	1,711	267,897	エネルギー
PETROFAC LTD	60	64	53	8,356	エネルギー
TRAVIS PERKINS PLC	57	62	113	17,710	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	572	992	1,733	271,333	エネルギー
OLD MUTUAL PLC	1,155	1,233	212	33,216	保険
INVESTEC PLC	127	139	67	10,495	各種金融
STANDARD LIFE PLC	459	493	157	24,659	保険
EXPERIAN PLC	232	242	306	47,931	商業・専門サービス
MONDI PLC	—	91	123	19,395	素材
WEIR GROUP PLC/THE	49	53	60	9,403	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	84	89	276	43,327	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC	89	98	41	6,566	素材
TULLOW OIL PLC	208	—	—	—	エネルギー
SHIRE PLC	138	148	621	97,238	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INMARSAT PLC	99	112	90	14,108	電気通信サービス
ADMIRAL GROUP PLC	47	52	101	15,886	保険
FRESNILLO PLC	49	55	59	9,318	素材
RANDGOLD RESOURCES LTD	20	23	141	22,189	素材
AGGREKO PLC	58	64	67	10,601	商業・専門サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	56	63	60	9,526	商業・専門サービス
ST JAMES' S PLACE PLC	—	131	114	17,867	保険
GLENCORE PLC	2,617	3,062	419	65,601	素材
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	220	230	61	9,634	各種金融
HARGREAVES LANSDOWN PLC	54	65	82	12,885	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC	31	32	98	15,464	素材
MELROSE INDUSTRIES PLC	223	—	—	—	資本財
COCA-COLA HBC AG-DI	49	50	70	10,987	食品・飲料・タバコ
EASYJET PLC	37	41	62	9,726	運輸

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
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	350	343	130	20,351	保険	
ROYAL MAIL PLC	150	225	112	17,590	運輸	
ASHTED GROUP PLC	120	126	113	17,716	資本財	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	60	67	25	3,968	小売	
MERLIN ENTERTAINMENT	164	177	76	12,014	消費者サービス	
TUI AG-DI	107	124	130	20,486	消費者サービス	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	—	92	80	12,621	ヘルスケア機器・サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC	—	239	91	14,292	ソフトウェア・サービス	
WORLDPAY GROUP PLC	—	349	91	14,377	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	130,994	105,469	39,248	6,143,134	
	銘柄 数 < 比 率 >	104	109	—	< 7.0% >	
(スイス)			千スイスフラン			
NESTLE SA-REG	758	798	5,805	648,086	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	122	130	812	90,663	耐久消費財・アパレル	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	359	449	614	68,623	各種金融	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	53	113	502	56,067	素材	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	165	175	4,291	479,057	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GIVAUDAN-REG	2	2	445	49,742	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	12	13	182	20,387	ヘルスケア機器・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	35	37	813	90,811	保険	
SYNGENTA AG-REG	21	23	901	100,619	素材	
LONZA GROUP AG-REG	12	13	223	24,972	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	11	12	79	8,853	耐久消費財・アパレル	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	10	10	192	21,506	資本財	
GEBERIT AG-REG	8	9	348	38,903	資本財	
SWISS RE AG	82	87	765	85,454	保険	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	7	7	248	27,703	耐久消費財・アパレル	
PARGESA HOLDING SA-BR	6	7	50	5,622	各種金融	
NOVARTIS AG-REG	540	569	4,171	465,698	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	40	41	244	27,279	商業・専門サービス	
SWISSCOM AG-REG	5	6	311	34,800	電気通信サービス	
ABB LTD-REG	517	550	1,114	124,363	資本財	
SGS SA-REG	1	1	286	31,993	商業・専門サービス	
SULZER AG-REG	6	3	29	3,286	資本財	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	4	5	92	10,286	資本財	
ACTELION LTD-REG	24	25	402	44,950	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	12	13	184	20,539	運輸	
BALOISE HOLDING AG - REG	11	12	145	16,242	保険	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	7	8	193	21,638	保険	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	0.03	216	24,147	食品・飲料・タバコ	
ARYZTA AG	21	21	83	9,283	食品・飲料・タバコ	
JULIUS BAER GROUP LTD	52	56	220	24,589	各種金融	
SIKA AG-BR	0.49	0.54	226	25,251	素材	
TRANSOCEAN LTD	85	—	—	—	エネルギー	
SWISS PRIME SITE-REG	14	16	141	15,770	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.23	0.25	151	16,939	食品・飲料・タバコ	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	3	4	160	17,939	各種金融	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.53	0.56	65	7,270	食品・飲料・タバコ	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2	2	98	11,003	素材	
UBS GROUP AG-REG	859	915	1,418	158,345	各種金融	
DUFREY AG-REG	—	10	132	14,766	小売	

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額		邦貨換算金額
(スイス) GALENICA AG-REG	百株 —	百株 0.98	千スイスフラン 131	千円 14,692	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 >	3,883 38	4,161 39	26,499 —	2,958,154 < 3.4% >
(スウェーデン) ELECTROLUX AB-SER B	57	60	千スウェーデンクローネ 1,387	18,496	耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS	716	761	4,720	62,921	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS	91	97	1,829	24,382	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	357	380	2,857	38,087	銀行
INVESTOR AB-B SHS	106	113	3,085	41,131	各種金融
NORDEA BANK AB	714	759	5,810	77,454	銀行
GETINGE AB-B SHS	48	50	848	11,308	ヘルスケア機器・サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	117	375	3,866	51,542	銀行
ATLAS COPCO AB-A SHS	157	168	3,426	45,676	資本財
SKF AB-B SHARES	92	99	1,449	19,317	資本財
ASSA ABLOY AB-B	78	250	4,135	55,128	資本財
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	223	237	6,301	84,000	小売
SANDVIK AB	248	267	2,128	28,369	資本財
SWEDBANK AB - A SHARES	213	226	3,913	52,167	銀行
SECURITAS AB-B SHS	72	78	982	13,101	商業・専門サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	137	151	3,828	51,032	家庭用品・パーソナル用品
SKANSKA AB-B SHS	91	94	1,711	22,814	資本財
SWEDISH MATCH AB	46	49	1,341	17,885	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS	77	79	615	8,209	電気通信サービス
TELIA CO AB	608	647	2,431	32,416	電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS	359	385	3,578	47,703	資本財
ALFA LAVAL AB	75	73	921	12,281	資本財
ELEKTA AB-B SHS	88	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
LUNDIN PETROLEUM AB	54	54	809	10,790	エネルギー
BOLIDEN AB	62	68	926	12,349	素材
HUSQVARNA AB-B SHS	94	104	683	9,117	耐久消費財・アパレル
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	15	16	748	9,974	電気通信サービス
HEXAGON AB-B SHS	59	64	2,021	26,949	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	54	58	1,297	17,289	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	36	40	556	7,421	各種金融
ICA GRUPPEN AB	17	20	553	7,381	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	5,179 31	5,836 30	68,770 —	916,705 < 1.1% >
(ノルウェー) DNB ASA	230	245	千ノルウェークローネ 2,416	32,090	銀行
NORSK HYDRO ASA	309	335	1,069	14,203	素材
ORKLA ASA	185	203	1,534	20,381	食品・飲料・タバコ
STATOIL ASA	262	279	3,777	50,164	エネルギー
TELENOR ASA	176	187	2,597	34,500	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	41	44	1,309	17,392	素材
SUBSEA 7 SA	67	—	—	—	エネルギー
SEADRILL LTD	93	—	—	—	エネルギー
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	48	50	688	9,148	保険
SCHIBSTED ASA-CL A	—	18	509	6,761	メディア
SCHIBSTED ASA-B SHS	—	22	576	7,661	メディア
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1,416 9	1,388 9	14,480 —	192,305 < 0.2% >

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

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		
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円		
NOVO NORDISK A/S-B	471	490	17,581	292,558	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	56	58	1,845	30,703	素材	
DANSKE BANK A/S	154	177	3,245	54,002	銀行	
WILLIAM DEMANT HOLDING	4	6	411	6,851	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52	56	2,548	42,405	資本財	
TDC A/S	190	203	693	11,546	電気通信サービス	
CARLSBERG AS-B	24	26	1,663	27,688	食品・飲料・タバコ	
COLOPLAST-B	25	27	1,373	22,850	ヘルスケア機器・サービス	
DSV A/S	43	48	1,372	22,839	運輸	
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	1	1	1,508	25,102	運輸	
TRYG A/S	5	29	365	6,077	保険	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.86	0.96	810	13,482	運輸	
PANDORA A/S	27	27	2,616	43,536	耐久消費財・アパレル	
ISS A/S	30	37	953	15,869	商業・専門サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	—	24	1,018	16,951	素材	
GENMAB A/S	—	13	1,300	21,632	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,089	1,230	39,308	654,098	
	銘柄 数 < 比 率 >	14	16	—	< 0.8% >	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
BHP BILLITON LIMITED	757	805	1,494	119,419	素材	
CSL LTD	111	116	1,284	102,669	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALUMINA LTD	598	659	87	6,988	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	175	186	493	39,423	エネルギー	
AUST AND NZ BANKING GROUP	650	730	1,784	142,586	銀行	
RIO TINTO LTD	103	106	492	39,321	素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD	321	347	407	32,529	保険	
LENDELEASE GROUP	129	141	190	15,261	不動産	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	382	428	3,343	267,148	銀行	
WESTPAC BANKING CORP	731	834	2,612	208,772	銀行	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	558	660	1,906	152,347	銀行	
BRAMBLES LTD	372	400	524	41,889	商業・専門サービス	
QANTAS AIRWAYS LTD	127	147	50	4,009	運輸	
BORAL LTD	192	193	133	10,633	素材	
WOOLWORTHS LTD	297	319	729	58,298	食品・生活必需品小売り	
TELSTRA CORP LTD	1,015	1,082	618	49,390	電気通信サービス	
AMP LTD	703	754	439	35,092	保険	
TABCORP HOLDINGS LTD	198	217	93	7,457	消費者サービス	
AMCOR LIMITED	286	293	471	37,711	素材	
COMPUTERSHARE LTD	113	121	126	10,112	ソフトウェア・サービス	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	—	140	147	11,748	消費者サービス	
MACQUARIE GROUP LTD	68	77	547	43,765	各種金融	
CIMIC GROUP LTD	27	26	99	7,931	資本財	
ASX LTD	45	50	226	18,061	各種金融	
COCA-COLA AMATIL LTD	141	149	136	10,930	食品・飲料・タバコ	
COCHLEAR LTD	13	14	170	13,657	ヘルスケア機器・サービス	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	106	114	225	17,982	素材	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	146	68	5,481	小売	
NEWCREST MINING LTD	181	192	395	31,638	素材	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	553	621	375	30,024	保険	
ORIGIN ENERGY LTD	261	442	224	17,947	エネルギー	
ORICA LTD	89	94	128	10,306	素材	
SONIC HEALTHCARE LTD	92	100	205	16,441	ヘルスケア機器・サービス	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
SANTOS LTD	236	422	171	13,701	エネルギー	
SUNCORP GROUP LTD	304	327	421	33,652	保険	
TRANSURBAN GROUP	432	518	644	51,491	運輸	
WESFARMERS LTD	264	283	1,222	97,707	食品・生活必需品小売り	
TOLL HOLDINGS LTD	166	—	—	—	運輸	
CHALLENGER LTD	—	147	137	10,953	各種金融	
SYDNEY AIRPORT	269	286	209	16,736	運輸	
CALTEX AUSTRALIA LTD	63	69	232	18,575	エネルギー	
OIL SEARCH LTD	—	345	233	18,619	エネルギー	
WORLEYPARSONS LTD	52	—	—	—	エネルギー	
AGL ENERGY LTD	159	176	333	26,629	公益事業	
TATTS GROUP LTD	348	380	150	12,000	消費者サービス	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	376	393	114	9,157	素材	
ASCIANO LTD	234	129	115	9,244	運輸	
ILUKA RESOURCES LTD	91	107	65	5,247	素材	
AUSNET SERVICES	463	514	83	6,665	公益事業	
CROWN RESORTS LTD	88	93	112	8,972	消費者サービス	
INCITEC PIVOT LTD	405	431	139	11,140	素材	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	106	118	114	9,126	銀行	
AURIZON HOLDINGS LTD	519	535	243	19,456	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	159	187	191	15,337	食品・飲料・タバコ	
ALS LTD	105	—	—	—	商業・専門サービス	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	32	36	253	20,265	ヘルスケア機器・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	13	14	56	4,509	消費者サービス	
SEEK LTD	79	84	138	11,057	商業・専門サービス	
BANK OF QUEENSLAND LTD	89	97	111	8,901	銀行	
REA GROUP LTD	13	14	75	6,057	メディア	
TPG TELECOM LTD	68	76	88	7,079	電気通信サービス	
HEALTHSCOPE LTD	286	449	125	10,053	ヘルスケア機器・サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	684	701	221	17,721	保険	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	50	66	40	3,272	各種金融	
SOUTH32 LTD	—	1,342	217	17,380	素材	
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	—	116	103	8,240	電気通信サービス	
小 計	株 数	金 額	15,717	19,187	26,604	2,125,939
銘柄 数 < 比 率 >	61	63	—	< 2.4% >		
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
SPARK NEW ZEALAND LTD	416	380	140	10,399	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	223	202	135	10,043	運輸	
CONTACT ENERGY LTD	88	155	81	6,066	公益事業	
FLETCHER BUILDING LTD	165	144	124	9,223	素材	
RYMAN HEALTHCARE LTD	87	79	73	5,437	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	290	283	77	5,747	公益事業	
MIGHTY RIVER POWER	156	156	47	3,551	公益事業	
小 計	株 数	金 額	1,429	1,402	681	50,468
銘柄 数 < 比 率 >	7	7	—	< 0.1% >		
(香港)			千香港ドル			
WHARF HOLDINGS LTD	360	330	1,361	19,016	不動産	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	500	—	—	—	資本財	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	150	145	1,196	16,721	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	325	683	6,358	88,825	資本財	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	400	440	4,015	56,089	不動産	
MTR CORP	340	365	1,401	19,580	運輸	

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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
HONG KONG & CHINA GAS	1,500	1,767	2,555	35,695	公益事業	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,210	1,370	987	13,799	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	330	340	2,616	36,549	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	260	280	5,202	72,677	各種金融	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	290	320	389	5,436	運輸	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	530	550	781	10,910	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	450	485	3,540	49,460	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	244	276	1,277	17,846	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	282	294	815	11,392	銀行	
HANG SENG BANK LTD	180	194	2,659	37,156	銀行	
HYSAN DEVELOPMENT CO	140	160	515	7,197	不動産	
SHANGRI-LA ASIA LTD	240	320	287	4,009	消費者サービス	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	60	50	274	3,831	半導体・半導体製造装置	
SINO LAND CO	710	750	855	11,944	不動産	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	180	200	566	7,907	耐久消費財・アパレル	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	150	180	1,352	18,897	公益事業	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	870	940	2,105	29,415	銀行	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	325	335	1,026	14,344	耐久消費財・アパレル	
PCCW LTD	960	1,050	536	7,495	電気通信サービス	
LI & FUNG LTD	1,380	1,480	648	9,055	耐久消費財・アパレル	
KERRY PROPERTIES LTD	145	175	340	4,757	不動産	
NWS HOLDINGS LTD	370	360	433	6,055	資本財	
SANDS CHINA LTD	568	588	1,619	22,630	消費者サービス	
WHEELOCK & CO LTD	210	230	799	11,165	不動産	
WYNN MACAU LTD	360	396	442	6,184	消費者サービス	
SJM HOLDINGS LTD	430	510	242	3,391	消費者サービス	
FIRST PACIFIC CO	520	620	298	4,174	各種金融	
AIA GROUP LTD	2,830	3,002	13,043	182,220	保険	
SWIRE PROPERTIES LTD	284	288	573	8,014	不動産	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	550	570	1,413	19,747	消費者サービス	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	224	240	249	3,486	消費者サービス	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	600	680	768	10,734	電気通信サービス	
WH GROUP LTD	850	1,480	895	12,508	食品・飲料・タバコ	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	—	678	3,191	44,585	不動産	
小計	株数・金額	20,308	23,122	67,638	944,913	
	銘柄数<比率>	39	39	—	<1.1%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	713	780	649	51,530	銀行	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	377	414	160	12,706	メディア	
SEBPCORP INDUSTRIES LTD	248	249	66	5,272	資本財	
CAPITALAND LTD	608	648	193	15,315	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	97	110	88	7,014	不動産	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	26	26	88	7,017	小売	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	410	440	645	51,193	銀行	
KEPPEL CORP LTD	352	363	185	14,740	資本財	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	301	329	577	45,819	銀行	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	380	398	125	9,974	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,877	1,998	767	60,849	電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	138	143	166	13,212	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	193	208	155	12,306	各種金融	
SEBPCORP MARINE LTD	214	214	32	2,579	資本財	
UOL GROUP LTD	107	127	71	5,650	不動産	

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	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
COMFORTDELGRO CORP LTD	510	547	152	12,060	運輸	
NOBLE GROUP LTD	1,050	1,188	41	3,300	資本財	
STARHUB LTD	140	162	53	4,252	電気通信サービス	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,661	1,801	65	5,215	食品・飲料・タバコ	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	428	492	161	12,837	食品・飲料・タバコ	
GENTING SINGAPORE PLC	1,488	1,539	116	9,276	消費者サービス	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	766	796	140	11,142	不動産	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	470	487	43	3,476	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	12,555	13,460	4,750	376,744	
	銘柄 数 < 比 率 >	23	23	—	<0.4%>	
(イスラエル)			千イスラエルシケル			
ISRAEL CHEMICALS LTD	110	127	210	6,057	素材	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	202	228	4,581	132,117	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BANK HAPOALIM BM	250	263	511	14,753	銀行	
NICE SYSTEMS LTD	13	14	352	10,153	ソフトウェア・サービス	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	315	348	485	14,001	銀行	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	0.75	—	—	—	素材	
DELEK GROUP LTD	1	1	85	2,472	エネルギー	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	469	481	390	11,253	電気通信サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	31	34	147	4,264	銀行	
AZRIELI GROUP	—	9	137	3,967	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,395	1,508	6,901	199,042	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.2%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	337,188	332,807	—	77,020,470	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,257	1,259	—	<88.4%>	

(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	10	11	396	42,981	0.0	
MACERICH CO/THE	3	3	260	28,278	0.0	
PROLOGIS INC	11	13	614	66,641	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	2	185	20,076	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3	3	340	36,850	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	1	380	41,258	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	—	2	268	29,112	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	1	269	29,183	0.0	
WELLTOWER INC	8	8	628	68,144	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	3	3	502	54,501	0.1	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	1	191	20,730	0.0	
REALTY INCOME CORP	5	6	394	42,723	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	2	2	183	19,856	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	2	2	261	28,304	0.0	
UDR INC	5	6	239	25,994	0.0	
VENTAS INC	7	8	546	59,192	0.1	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	22	23	259	28,079	0.0	
RAYONIER INC	3	—	—	—	—	
WEYERHAEUSER CO	12	19	611	66,264	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	9	10	1,120	121,477	0.1	
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	8	8	163	17,667	0.0	
VEREIT INC	20	22	218	23,661	0.0	
DUKE REALTY CORP	7	8	199	21,635	0.0	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	4	117	12,703	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	3	5	188	20,452	0.0	
EQUINIX INC	1	1	568	61,618	0.1	
COMMUNICATIONS SALES & LE	3	—	—	—	—	
CROWN CASTLE INTL CORP	—	8	752	81,509	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	8	9	635	68,901	0.1	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	12	14	397	43,125	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	17	18	301	32,705	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	3	3	134	14,611	0.0	
PLUM CREEK TIMBER CO	4	—	—	—	—	
PUBLIC STORAGE	3	3	953	103,345	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	7	7	1,573	170,562	0.2	
VORNADO REALTY TRUST	3	4	407	44,211	0.1	
KIMCO REALTY CORP	9	10	301	32,712	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3	3	639	69,296	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	234	269	15,210	1,648,370	
	銘柄 数 < 比 率 >	34	35	—	<1.9%>	
(カナダ)				千カナダドル		
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	—	1	55	4,707	0.0	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3	3	74	6,259	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		3	3	110	9,304	0.0
小 計		口 数 ・ 金 額	口 数	240	20,270	
		銘柄 数 < 比 率 >	3	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		0.643	0.862	108	13,431	0.0
KLEPIERRE		4	5	224	27,832	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		2	2	578	71,613	0.1
FONCIERE DES REGIONS		0.705	0.753	61	7,571	0.0
ICADE		0.852	0.829	55	6,913	0.0
ユ ー ロ 計		口 数 ・ 金 額	10	1,028	127,361	
		銘柄 数 < 比 率 >	5	—	< 0.1% >	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		22	20	147	23,037	0.0
HAMMERSON PLC		18	19	113	17,793	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		18	19	227	35,567	0.0
INTU PROPERTIES PLC		22	23	69	10,831	0.0
SEGRO PLC		17	18	79	12,398	0.0
小 計		口 数 ・ 金 額	102	636	99,629	
		銘柄 数 < 比 率 >	5	—	< 0.1% >	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		33	86	295	23,609	0.0
SCENTRE GROUP		126	135	621	49,694	0.1
NOVION PROPERTY GROUP		48	—	—	—	—
GPT GROUP		39	46	242	19,342	0.0
MIRVAC GROUP		87	95	187	14,965	0.0
STOCKLAND		54	61	281	22,479	0.0
WESTFIELD CORP		46	50	538	42,997	0.0
DEXUS PROPERTY GROUP		21	25	213	17,033	0.0
GOODMAN GROUP		40	45	327	26,131	0.0
小 計		口 数 ・ 金 額	545	2,706	216,254	
		銘柄 数 < 比 率 >	8	—	< 0.2% >	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		54	57	2,668	37,271	0.0
小 計		口 数 ・ 金 額	57	2,668	37,271	
		銘柄 数 < 比 率 >	1	—	< 0.0% >	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		62	62	102	8,152	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		51	53	74	5,874	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		61	63	132	10,490	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		51	54	131	10,464	0.0
小 計		口 数 ・ 金 額	233	441	34,982	
		銘柄 数 < 比 率 >	4	—	< 0.0% >	
合 計		口 数 ・ 金 額	1,227	—	2,184,141	
		銘柄 数 < 比 率 >	61	—	< 2.5% >	

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引		百万円	百万円
		SP EMINI	5,731	—
		SP/TSE60	351	—
		SWISS IX	326	—
		EURO ST	1,317	—
		SPI 200	417	—
		FTSE100	709	—

(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
株式	千円 77,020,470	% 87.1
投資証券	2,184,141	2.5
コール・ローン等、その他	9,272,983	10.4
投資信託財産総額	88,477,594	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (82,826,860千円) の投資信託財産総額 (88,477,594千円) に対する比率は93.6%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=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	171,037,436,269
コール・ローン等	7,392,203,399
株式(評価額)	77,020,470,111
投資証券(評価額)	2,184,141,395
未収入金	82,668,447,892
未収配当金	149,789,802
差入委託証拠金	1,622,383,670
(B) 負債	83,895,702,366
未払金	83,799,612,608
未払解約金	96,075,624
未払利息	11,274
その他未払費用	2,860
(C) 純資産総額(A-B)	87,141,733,903
元本	65,607,671,368
次期繰越損益金	21,534,062,535
(D) 受益権総口数	65,607,671,368口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,282円

<注記事項>

- ①期首元本額 65,433,713,446円
 期中追加設定元本額 17,061,058,936円
 期中一部解約元本額 16,887,101,014円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3282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)

ヘッジ付先進国株式インデックスオープン	1,051,081,178円
三菱UFJ バランスファンド VA50型(適格機関投資家限定)	27,067,467,498円
三菱UFJ バランスファンド VA75型(適格機関投資家限定)	17,672,982,278円
三菱UFJ バランスファンド 55VA(適格機関投資家限定)	2,844,580,299円
三菱UFJ バランスファンド 50VA(適格機関投資家限定)	2,436,864,226円
三菱UFJ バランスファンド 20VA(適格機関投資家限定)	4,290,435,491円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	28,650,357円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	163,847,640円
MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	10,051,762,401円
合計	65,607,671,368円

【お知らせ】

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

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	1,708,257,997
受取配当金	1,673,823,744
受取利息	1,544,378
その他収益金	33,956,315
支払利息	△ 1,066,440
(B) 有価証券売買損益	△ 5,589,684,531
売買益	20,008,114,196
売買損	△25,597,798,727
(C) 先物取引等取引損益	306,294,141
取引益	989,847,414
取引損	△ 683,553,273
(D) 保管費用等	△ 53,641,733
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 3,628,774,126
(F) 前期繰越損益金	25,694,912,156
(G) 追加信託差損益金	5,274,105,570
(H) 解約差損益金	△ 5,806,181,065
(I) 計(E+F+G+H)	21,534,062,535
次期繰越損益金(I)	21,534,062,535

(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。

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		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	除く日本、円ヘッジ・円ベース)	期 騰 落			
	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、カスタディーフィー、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
国	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	千イギリスポンド 32,091	千イギリスポンド 13,508
	スイス	千スイスフラン 1,124	千スイスフラン 446
	スウェーデン	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	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	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	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	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	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	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 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	0.625 T-NOTE 180430	0.625	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	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	1.25 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		当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.625 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

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					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
国債証券	3.625 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

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		

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

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

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			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円		
	国債証券	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。

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	中 率	(円換算ベース)	期 騰 落 中 率				
	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

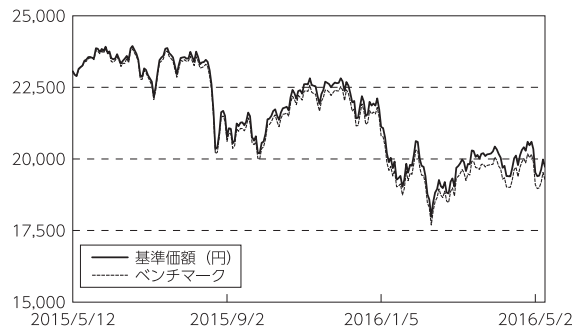
◎基準価額の動き

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	Δ0.0%程度	Δ0.0%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Δ0.0%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Δ0.0%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 Δ0.1%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
EVERETT 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 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	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		期末		業種等
	株数	株数	評価額		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			
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	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		業 種 等	
			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	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
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 >	67	64	—	< 3.6% >	
(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 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円		
TELENET GROUP HOLDING NV	30	46	197	24,454	メディア	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1,193 11	1,667 11	12,605 —	1,560,740 <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 7	616 5	1,542 —	190,916 <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 5	2,096 4	1,937 —	239,833 <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 12	7,301 12	8,184 —	1,013,278 <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 4	24,739 5	4,217 —	522,174 <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 末		業 種 等		
		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	金 額 率 < 比 率 >	325,695	353,365	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 銘柄数<比率>	9,781 38	13,757 39	87,547 —	9,772,976 <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 銘柄数<比率>	13,047 31	19,293 30	227,270 —	3,029,520 <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		
	株数	株数	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)			千ニュージーランドドル			
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)			千香港ドル			
WHARF HOLDINGS LTD	900	1,130	4,661	65,117	不動産	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(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	株 数	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	期末	
	評価額	比率
株式	千円 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

<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。

○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) (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)

新興国株式インデックスマザーファンド

《第7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]

「新興国株式インデックスマザーファンド」は、5月12日に第7期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第7期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	新興国の株式等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 エマージング・マーケット・インデックス (円換算ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
	期騰落	中率	期騰落	中率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
3期(2012年5月14日)	14,047	△15.7	77,807.35	△17.8	96.2	2.9	0.5	14,336
4期(2013年5月13日)	19,772	40.8	107,091.73	37.6	98.2	1.7	—	24,079
5期(2014年5月12日)	19,482	△1.5	102,729.55	△4.1	96.6	3.0	0.4	24,665
6期(2015年5月12日)	23,973	23.1	124,478.28	21.2	94.8	5.0	0.4	39,530
7期(2016年5月12日)	17,338	△27.7	87,559.17	△29.7	92.8	6.4	0.5	35,618

(注) MSCI エマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（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 エマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他の知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

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

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCI エマージング・ マーケット・インデックス (円換算ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率			
(期 首) 2015年5月12日	円	%		%	%	%	%
	23,973	—	124,478.28	—	94.8	5.0	0.4
5月末	24,168	0.8	124,908.28	0.3	94.8	4.8	0.4
6月末	22,860	△4.6	117,480.49	△5.6	94.6	4.6	0.5
7月末	21,655	△9.7	110,900.32	△10.9	93.7	7.1	0.5
8月末	19,362	△19.2	99,398.26	△20.1	94.2	5.5	0.5
9月末	18,263	△23.8	93,131.31	△25.2	94.0	6.3	0.5
10月末	20,102	△16.1	102,297.72	△17.8	94.7	4.9	0.5
11月末	19,854	△17.2	101,493.66	△18.5	94.5	5.1	0.5
12月末	18,950	△21.0	96,451.09	△22.5	96.9	3.2	0.5
2016年1月末	17,182	△28.3	87,296.42	△29.9	96.1	3.5	0.5
2月末	16,532	△31.0	84,080.85	△32.5	94.5	5.3	0.5
3月末	18,566	△22.6	93,973.20	△24.5	92.3	7.1	0.5
4月末	18,355	△23.4	92,537.69	△25.7	92.4	6.9	0.5
(期 末) 2016年5月12日	17,338	△27.7	87,559.17	△29.7	92.8	6.4	0.5

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

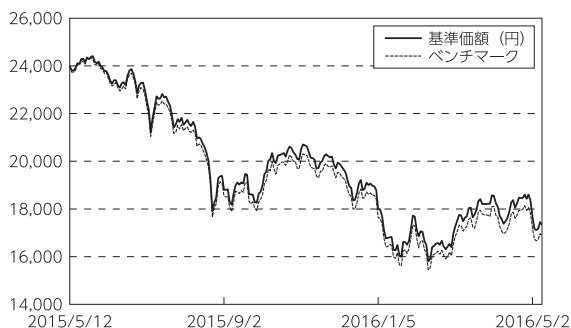
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ27.7%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−29.7%)を2.0%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

◎新興国株式市況

- ・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、新興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9.9%の円高・香港ドル安、20.0%の円高・ブラジルリアル安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に採用されている新興国の株式等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29.7%の下落となったため、カイ離は2.0%程度となりました。

	組入比率 要 因	銘柄選択 要 因	コ ス ト 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	0.3% 程度	△0.2% 程度	1.9% 程度	2.0% 程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は△0.0%程度でした。

- ・期中、ファンドの資産をほぼ全額株式（先物・REIT（不動産投資信託証券）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0.3%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。

◎コスト要因

売買にかかるコストおよび保管料等による影響は△0.2%程度でした。

◎その他の要因

その他配当・利子収入等による影響は1.9%程度でした。

◎今後の運用方針

- ・引き続きファンドの資産のほぼ全額を株式（先物・REITを含む）に投資し、高い株式組入比率を維持します。
- ・売買に係るコストを考慮しつつ、多くの銘柄に分散投資を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(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)	(8)	(0.040)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(2)	(0.009)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	4	0.018	(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)	(4)	(0.018)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	29	0.148	(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)	(26)	(0.134)	
(そ の 他)	(3)	(0.015)	
合 計	41	0.206	
期中の平均基準価額は、19,654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 953,364 (263)	千アメリカドル 11,208 (-)	百株 7,951 (49)	千アメリカドル 579 (133)
	メキシコ	9,917 (2,151)	千メキシコペソ 34,884 (△ 252)	4,808	千メキシコペソ 10,634
	ブラジル	6,753 (1,749)	千ブラジルリアル 11,664 (△ 27)	2,919	千ブラジルリアル 2,708
	チリ	44,542 (20,838)	千チリペソ 361,946 (35,877)	941 (281)	千チリペソ 219,439 (35,877)
	コロンビア	1,096 (67)	千コロンビアペソ 623,636 (246,411)	1,149 (65)	千コロンビアペソ 839,268 (246,411)
	ユーロ ギリシャ	13,260 (△ 5,587)	千ユーロ 832 (△ 1)	74 (5,712)	千ユーロ 33 (-)
	トルコ	1,950 (232)	千トルコリラ 1,840 (-)	236	千トルコリラ 176
	チェコ	83	千チェココルナ 3,641	73	千チェココルナ 1,573
	ハンガリー	56	千ハンガリーフォリント 37,475	4	千ハンガリーフォリント 5,877
	ポーランド	1,245 (423)	千ポーランドズロチ 2,758 (-)	897	千ポーランドズロチ 182
	香港	189,490 (9,807)	千香港ドル 129,744 (△ 103)	75,669	千香港ドル 14,985
	マレーシア	12,259 (1,652)	千マレーシアリングギット 6,998 (-)	2,309	千マレーシアリングギット 688
	タイ	14,983 (111)	千タイバーツ 39,811 (-)	330	千タイバーツ 5,050
	フィリピン	11,150	千フィリピンペソ 42,771	460	千フィリピンペソ 867
	インドネシア	40,206	千インドネシアルピア 20,844,636	1,840	千インドネシアルピア 1,339,828

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	韓国	百株 1,277 (88)	千韓国ウォン 10,186,869 (15,920)	百株 405 (-)	千韓国ウォン 899,042 (25,100)
	台湾	46,319 (4,926)	千ニュー台湾ドル 211,748 (△ 299)	13,102 (-)	千ニュー台湾ドル 33,729 (0.001)
	インド	8,905 (2,147)	千インドルピー 523,006 (10,483)	2,855	千インドルピー 54,172
国	アラブ首長国連邦	5,216	千アラブディルハム 4,258	-	千アラブディルハム -
	カタール	1,232 (70)	千カタールリアル 4,518 (141)	45 (16)	千カタールリアル 242 (56)
	南アフリカ	6,720 (42)	千南アフリカランド 70,658 (△ 60)	1,354 (409)	千南アフリカランド 6,010 (4,720)

(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
外	メキシコ	千口	千メキシコペソ	千口	千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	36 (-)	1,388 (△ 254)	- (-)	- (0.00001)
	小 計	36 (-)	1,388 (△ 254)	- (-)	- (0.00001)
国	トルコ		千トルコリラ		千トルコリラ
	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	29	79	6	15
	小 計	29	79	6	15
国	南アフリカ		千南アフリカランド		千南アフリカランド
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	25	642	-	-
	REDEFINE PROPERTIES LTD	120	1,364	-	-
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	20	2,366	-	-
	RESILIENT REIT LTD	5	637	-	-
	RESILIENT PROPERTY INCOME-RTS	- (2)	- (-)	2	36
小 計	172 (2)	5,011 (-)	2	36	

(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 15,769	百万円 14,911	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	9,679,052千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	34,146,810千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.28

(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 12,177	百万円 204	% 1.7	百万円 4,416	百万円 32	% 0.7

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	
AMBEV SA-ADR	85	85	46	5,011	食品・飲料・タバコ
AMERICA MOVIL-SPN ADR CL L	8	8	10	1,115	電気通信サービス
VALE SA-SP ADR	20	20	9	997	素材
PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	40	40	29	3,216	エネルギー
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	28	42	97	10,603	半導体・半導体製造装置
NETEASE INC-ADR	—	34	500	54,275	ソフトウェア・サービス
CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	—	114	498	53,988	小売
INFOSYS LTD-SP ADR	18	36	67	7,279	ソフトウェア・サービス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	153	168	169	18,333	素材
BAIDU INC - SPON ADR	—	117	1,919	207,972	ソフトウェア・サービス
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	382	453	416	45,115	電気通信サービス
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	—	57	225	24,436	消費者サービス
SOUTHERN COPPER CORP	122	138	384	41,715	素材
BANCO BRADESCO-ADR	35	38	29	3,225	銀行
ITAU UNIBANCO H-SPON PRF ADR	36	39	37	4,055	銀行
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	14	14	13	1,445	エネルギー
SASOL LTD-SPONSORED ADR	11	11	32	3,557	エネルギー
CREDICORP LTD	51	59	847	91,799	銀行
YY INC-ADR	—	13	64	6,976	ソフトウェア・サービス
TAL EDUCATION GROUP- ADR	—	17	94	10,195	消費者サービス
SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR	—	100	59	6,393	ソフトウェア・サービス
AK TRANSNEFT OAO-PREF	1	1	419	45,407	エネルギー
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	980	1,011	162	17,567	各種金融
SBERBANK OF RUSSIA PJSC	500	500	93	10,112	銀行
GAZPROM PAO	360	360	86	9,404	エネルギー
RUSHYDRO PJSC	100,000	104,640	106	11,554	公益事業
MMC NORILSK NICKEL PJSC	42	48	647	70,177	素材
LUKOIL PJSC	19	19	77	8,442	エネルギー
TATNEFT PAO-CLS	1,077	1,241	605	65,657	エネルギー
ROSNEFT OAO	869	1,020	500	54,250	エネルギー
VTB BANK PJSC	3,740,000	4,678,200	491	53,268	銀行
URALKALI PJSC	995	—	—	—	素材
SBERBANK-PREFERENCE	820	—	—	—	銀行
SURGUTNEFTEGAS	5,430	5,930	304	33,013	エネルギー
SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	5,230	6,337	393	42,614	エネルギー
SEVERSTAL PAO	158	184	190	20,690	素材
ROSTELECOM PJSC	650	650	95	10,382	電気通信サービス
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	—	24	89	9,649	小売
DP WORLD LTD	123	146	262	28,439	運輸
ALROSA PAO	1,410	1,597	175	19,000	素材
JD.COM INC-ADR	—	151	349	37,849	小売
QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	—	40	281	30,529	ソフトウェア・サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	—	171	209	22,719	小売
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	—	431	3,443	373,158	ソフトウェア・サービス
58.COM INC-ADR	—	31	160	17,368	ソフトウェア・サービス

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
SAMSUNG ELECTR-GDR	0.8	0.8	44	4,802	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HON HAI PRECISION-GDR REG S	99	104	47	5,178	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
RELIANCE INDS-SPONS GDR 144A	8	8	24	2,685	エネルギー	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	370	422	1,709	185,283	エネルギー	
GAZPROM PAO -SPON ADR	4,359	4,945	2,395	259,638	エネルギー	
SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	120	143	102	11,142	電気通信サービス	
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	69	79	766	83,045	エネルギー	
GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR	620	620	97	10,548	電気通信サービス	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	197	226	763	82,742	食品・生活必需品小売り	
SBERBANK PAO -SPONSORED ADR	1,871	2,126	1,674	181,495	銀行	
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	731	1,044	407	44,164	銀行	
MEGAFON-REG S GDR	64	82	92	10,041	電気通信サービス	
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	760	—	—	—	エネルギー	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	—	420	140	15,183	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,868,940	4,814,567	22,966	2,488,924	
	銘柄 数 < 比 率 >	45	56	—	< 7.0% >	
(メキシコ)			千メキシコペソ			
ALFA S. A. B. -A	2,167	2,474	8,003	48,260	資本財	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	427	503	3,867	23,321	資本財	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	24,980	27,316	31,659	190,905	電気通信サービス	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	1,205	1,339	5,744	34,638	家庭用品・パーソナル用品	
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	3,960	4,574	19,636	118,406	食品・生活必需品小売り	
CEMEX SAB-CPO	9,713	12,234	15,084	90,959	素材	
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	1,938	2,133	20,549	123,912	メディア	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,200	1,449	7,983	48,143	食品・飲料・タバコ	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	1,880	2,177	21,380	128,923	銀行	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	1,473	1,603	26,234	158,195	食品・飲料・タバコ	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	106	118	3,365	20,292	素材	
MEXICHEM SAB DE CV-*	670	906	3,729	22,486	素材	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	323	437	6,502	39,213	食品・飲料・タバコ	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	2,853	3,329	13,655	82,340	素材	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	1,790	2,044	6,595	39,773	銀行	
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	263	268	4,774	28,788	運輸	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	303	353	4,250	25,633	食品・飲料・タバコ	
GENTERA SAB DE CV	780	921	3,100	18,693	各種金融	
MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	547	—	—	—	素材	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	150	165	3,212	19,369	小売	
GRUPO FIN SANTANDER-B	1,385	1,613	5,350	32,262	銀行	
CONTROLADORA COML MEXIC-UBC	300	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	142	186	5,209	31,411	運輸	
OHL MEXICO SAB DE CV	620	670	1,666	10,051	運輸	
GENOMMA LAB INTERNACIONAL-B	580	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	260	290	1,335	8,051	食品・生活必需品小売り	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	209	217	4,626	27,897	運輸	
GRUMA S. A. B. -B	138	171	4,413	26,615	食品・飲料・タバコ	
GRUPO LALA SAB DE CV	420	552	2,550	15,377	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額	60,783	68,043	234,481	1,413,923	
	銘柄 数 < 比 率 >	29	26	—	< 4.0% >	
(ブラジル)			千ブラジルリアル			
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	568	663	424	13,334	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	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジルレアル	千円	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	170	201	262	8,227	公益事業
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR OI SA-PREFERENCE	3,109	3,389	3,473	109,040	エネルギー 電気通信サービス
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP GERDAU SA-PREF	209	—	—	—	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF	252	292	574	24,711	電気通信サービス
VALE SA-PREF	589	729	737	16,773	素材
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	71	91	250	7,855	銀行
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO BRF SA	258	343	1,471	46,182	エネルギー 食品・飲料・タバコ
JBS SA	1,448	1,708	2,223	69,805	食品・飲料・タバコ
NATURA COSMETICOS SA VALE SA	2,050	2,609	8,431	264,660	家庭用品・パーソナル用品 素材
USINAS SIDER MINAS GER-PF A ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	101	101	325	10,208	エネルギー
TRACTEBEL ENERGIA SA PORTO SEGURO SA	495	573	2,706	84,950	公益事業 保険
PETROBRAS - PETROLEO BRAS CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	580	615	535	16,814	エネルギー
LOJAS RENNER S. A. LOJAS AMERICANAS SA-PREF	135	147	351	11,028	小売
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR METALURGICA GERDAU SA-PREF	947	1,082	1,724	54,138	銀行
AES TIETE SA-PREF EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	255	—	—	—	公益事業
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA-RTS EMBRAER SA	276	316	2,300	72,212	公益事業 資本財
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	134	144	526	16,530	公益事業
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA SOUZA CRUZ SA	82	104	275	8,634	耐久消費財・アパレル
CPFL ENERGIA SA CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	2,241	2,547	3,288	103,215	電気通信サービス
CCR SA BM&FBOVESPA SA	106	139	653	20,507	小売
B2W CIA DIGITAL BRASKEM SA-PREF A	93	563	1,199	37,642	小売
BRADESPAR SA -PREF BANCO BRADESCO SA-PREF	382	494	708	22,248	小売
BANCO DO BRASIL S. A. CIELO SA	2,695	3,409	2,642	82,933	銀行
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT DURATEX SA	270	—	—	—	素材
SUZANO PAPEL E CELULO-PREF A FIBRIA CELULOSE SA	67	—	—	—	公益事業
HYPERMARCAS SA BANCO BRADESCO S. A.	180	202	252	7,938	公益事業
WEG SA BR MALLS PARTICIPACOES SA	—	55	6	189	公益事業
	512	586	1,123	35,280	資本財
	185	—	—	—	公益事業
	225	—	—	—	耐久消費財・アパレル
	489	549	546	17,146	素材
	287	—	—	—	食品・飲料・タバコ
	177	171	338	10,616	公益事業
	150	170	239	7,524	公益事業
	683	778	1,288	40,441	運輸
	1,380	1,511	2,656	83,382	各種金融
	85	112	121	3,803	小売
	120	128	263	8,276	素材
	160	—	—	—	素材
	1,902	2,461	6,618	207,742	銀行
	659	756	1,548	48,600	銀行
	644	890	3,082	96,764	ソフトウェア・サービス
	310	369	701	22,007	銀行
	258	258	198	6,233	素材
	230	310	454	14,255	素材
	185	222	691	21,693	素材
	255	309	972	30,524	家庭用品・パーソナル用品
	547	657	1,874	58,839	銀行
	418	488	757	23,766	資本財
	340	508	653	20,518	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		
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジルレアル	千円		
BANCO ESTADO RIO GRAN-PREF B	150	—	—	—	銀行	
LOCALIZA RENT A CAR	113	133	480	15,079	運輸	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	58	67	395	12,418	不動産	
SUL AMERICA SA - UNITS	134	150	236	7,414	保険	
TIM PARTICIPACOES SA	663	749	547	17,180	電気通信サービス	
RAIA DROGASIL SA	155	190	1,056	33,160	食品・生活必需品小売り	
M DIAS BRANCO SA	24	30	269	8,467	食品・飲料・タバコ	
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	158	199	841	26,423	各種金融	
ODONTOPREV S. A.	180	220	246	7,734	ヘルスケア機器・サービス	
TOTVS SA	90	109	317	9,963	ソフトウェア・サービス	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	—	160	716	22,505	公益事業	
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	75	91	178	5,604	公益事業	
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	152	—	—	—	運輸	
ESTACIO PARTICIPACOES SA	215	240	283	8,912	消費者サービス	
LOJAS AMERICANAS SA	125	150	152	4,783	小売	
QUALICORP SA	149	184	276	8,663	ヘルスケア機器・サービス	
KROTON EDUCACIONAL SA	1,026	1,215	1,459	45,801	消費者サービス	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	521	614	1,730	54,312	保険	
AMBEV SA	3,471	4,026	7,593	238,345	食品・飲料・タバコ	
VIA VAREJO SA	87	—	—	—	小売	
KLABIN SA - UNIT	360	477	831	26,112	素材	
RUMO LOGISTICA OPERADORA MUL	—	700	308	9,668	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額	35,878	41,461	77,405	2,429,756	
	銘柄 数 < 比 率 >	70	62	—	< 6.8% >	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO DE CREDITO E INVERSION	25	32	91,263	14,538	銀行	
CENCOSUD SA	1,000	1,121	202,143	32,201	食品・生活必需品小売り	
EMPRESAS CMPC SA	915	1,074	156,401	24,914	素材	
COLBUN SA	6,000	7,017	123,722	19,708	公益事業	
EMPRESAS COPEC SA	343	400	254,672	40,569	エネルギー	
ITAU CORPBANCA	95,000	125,500	70,945	11,301	銀行	
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	98	98	57,665	9,186	電気通信サービス	
S. A. C. I. FALABELLA	720	426	212,684	33,880	小売	
AES GENER SA	1,850	2,201	72,628	11,569	公益事業	
AGUAS ANDINAS SA-A	1,800	2,210	86,331	13,752	公益事業	
LATAM AIRLINES GROUP SA	240	255	115,634	18,420	運輸	
VINA CONCHA Y TORO SA	360	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	2,540	2,881	184,120	29,330	公益事業	
BANCO SANTANDER CHILE	51,300	58,371	185,330	29,523	銀行	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	69	85	122,889	19,576	素材	
ENERSIS AMERICAS SA	15,010	17,259	196,272	31,266	公益事業	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	118	132	96,866	15,430	食品・飲料・タバコ	
BANCO DE CHILE	18,341	20,658	146,817	23,388	銀行	
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	200	220	50,815	8,094	食品・飲料・タバコ	
SONDA SA	400	400	50,728	8,080	ソフトウェア・サービス	
ENDESA AMERICAS SA	—	2,881	88,436	14,087	公益事業	
ENERSIS CHILE SA	—	17,259	140,853	22,437	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	196,329	260,486	2,707,221	431,260	
	銘柄 数 < 比 率 >	20	21	—	< 1.2% >	

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		
(コロンビア)	百株	百株	千コロンビアペソ	千円		
GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	2,754	2,954	347,118	12,808	銀行	
BANCO DAVIVIENDA SA	68	—	—	—	銀行	
BANCOLOMBIA SA-PREF	333	376	1,007,680	37,183	銀行	
ECOPETROL SA	3,420	3,983	557,648	20,577	エネルギー	
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	65	67	260,898	9,627	各種金融	
INTERCONEXION ELECTRICA SA	303	333	293,706	10,837	公益事業	
GRUPO ARGOS SA	225	258	468,609	17,291	素材	
ALMACENES EXITO SA	149	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	179	206	801,244	29,565	各種金融	
CEMENTOS ARGOS SA	308	348	406,119	14,985	素材	
ISAGEN SA ESP	580	—	—	—	公益事業	
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	77	85	327,210	12,074	各種金融	
GRUPO ARGOS SA-PRF	90	—	—	—	素材	
CEMEX LATAM HOLDINGS SA	112	—	—	—	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	8,663	8,612	4,470,234	164,951	
	銘柄 数 < 比 率 >	14	9	—	< 0.5% >	
(ユーロ…ギリシャ)				千ユーロ		
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	191	217	188	23,368	電気通信サービス	
ALPHA BANK AE	2,850	1,224	274	33,962	銀行	
NATIONAL BANK OF GREECE	1,265	4,665	139	17,213	銀行	
EUROBANK ERGASIAS SA	5,770	1,598	156	19,398	銀行	
TITAN CEMENT CO. S.A.	33	38	77	9,581	素材	
PIRAEUS BANK S.A	1,630	5,815	160	19,873	銀行	
PUBLIC POWER CORP	74	100	31	3,912	公益事業	
OPAP SA	159	192	130	16,128	消費者サービス	
FF GROUP	27	27	49	6,184	小売	
JUMBO SA	85	91	102	12,715	小売	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	12,085	13,971	1,311	162,338	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	10	—	< 0.5% >	
(トルコ)				千トルコリラ		
AKBANK T. A. S.	1,700	1,931	1,493	54,814	銀行	
TURKIYE IS BANKASI-C	1,157	1,358	597	21,942	銀行	
TURKIYE GARANTI BANKASI	1,775	2,026	1,535	56,381	銀行	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	663	775	844	30,990	電気通信サービス	
YAPI VE KREDI BANKASI	690	745	298	10,939	銀行	
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	148	182	345	12,681	食品・飲料・タバコ	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	93	107	728	26,756	エネルギー	
HACI OMER SABANCI HOLDING	696	804	740	27,167	各種金融	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	1,059	1,219	556	20,417	素材	
KOC HOLDING AS	468	559	737	27,086	資本財	
ARCELIK AS	160	211	409	15,037	耐久消費財・アパレル	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	499	558	206	7,569	資本財	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	58	64	226	8,319	自動車・自動車部品	
TURK HAVA YOLLARI AO	418	474	314	11,537	運輸	
ULKER BISKUVI SANAYI	107	127	277	10,191	食品・飲料・タバコ	
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	80	110	243	8,948	自動車・自動車部品	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	530	656	302	11,089	銀行	
COCA-COLA ICECEK AS	64	64	222	8,185	食品・飲料・タバコ	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	130	140	221	8,140	運輸	
TURKIYE HALK BANKASI	490	538	514	18,875	銀行	

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		
(トルコ)	百株	百株	千トルコリラ	千円		
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	380	451	208	7,666	資本財	
ENKA INSAAT VE SANAYI AS-NEW	30	—	—	—	資本財	
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	350	384	239	8,782	電気通信サービス	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	155	186	1,110	40,782	食品・生活必需品小売り	
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	348	522	221	8,124	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	12,252 25	14,199 24	12,596 —	462,428 <1.3%>	
(チェコ)			千チェココルナ			
O2 CZECH REPUBLIC AS	68	56	1,321	6,054	電気通信サービス	
CEZ AS	121	141	6,093	27,906	公益事業	
KOMERCNI BANKA AS	12	13	6,164	28,231	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	201 3	211 3	13,579 —	62,191 <0.2%>	
(ハンガリー)			千ハンガリーフォリント			
RICHTER GEDEON NYRT	111	123	68,794	26,967	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
OTP BANK PLC	170	208	148,271	58,122	銀行	
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	30	32	53,097	20,814	エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	311 3	363 3	270,163 —	105,904 <0.3%>	
(ポーランド)			千ポーランドズロチ			
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	244	281	1,902	53,212	エネルギー	
ORANGE POLSKA SA	455	572	335	9,381	電気通信サービス	
PKO BANK POLSKI SA	655	765	1,786	49,971	銀行	
BANK PEKAO SA	96	115	1,725	48,251	銀行	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	108	122	801	22,416	素材	
BANK ZACHODNI WBK SA	25	30	798	22,334	銀行	
MBANK SA	11	13	410	11,480	銀行	
POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	1,312	1,563	811	22,689	エネルギー	
GRUPA LOTOS SA	78	78	234	6,544	エネルギー	
EUROCASH SA	71	71	350	9,790	食品・生活必需品小売り	
BANK MILLENNIUM SA	330	520	241	6,763	銀行	
CYFROWY POLSAT SA	163	163	370	10,353	メディア	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	26	29	216	6,060	銀行	
PGE SA	636	741	922	25,810	公益事業	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	42	491	1,655	46,309	保険	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	730	959	256	7,164	公益事業	
ENEA SA	140	190	206	5,766	公益事業	
SYNTHOS SA	430	430	169	4,738	素材	
GETIN NOBLE BANK SA	820	—	—	—	銀行	
GRUPA AZOTY SA	36	37	288	8,081	素材	
ALIOR BANK SA	38	42	279	7,823	銀行	
ENERGA SA	175	175	193	5,418	公益事業	
LPP SA	0.66	1	611	17,095	耐久消費財・アパレル	
CCC SA	18	20	338	9,453	耐久消費財・アパレル	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,642 24	7,413 23	14,905 —	416,911 <1.2%>	
(香港)			千香港ドル			
PETROCHINA CO LTD-H	15,910	18,430	9,804	136,972	エネルギー	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	19,360	22,240	11,431	159,696	エネルギー	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	4,440	5,240	4,621	64,564	電気通信サービス	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	—	820	1,152	16,106	ソフトウェア・サービス
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	2,280	2,600	1,947	27,205	自動車・自動車部品
CITIC LTD	1,700	3,820	4,117	57,527	資本財
CNOOC LTD	13,500	15,580	13,944	194,799	エネルギー
YANZHOU COAL MINING CO-H	1,360	1,520	609	8,514	エネルギー
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	2,810	2,970	1,087	15,185	素材
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	1,000	1,340	1,072	14,975	運輸
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	980	1,220	891	12,458	運輸
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	880	1,080	1,838	25,679	食品・飲料・タバコ
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	1,480	1,740	1,425	19,908	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	400	440	743	10,388	資本財
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	840	1,020	2,208	30,849	運輸
COSCO PACIFIC LTD	1,340	1,580	1,284	17,945	運輸
BYD CO LTD-H	445	565	2,370	33,111	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD-H	10,560	12,160	4,560	63,703	電気通信サービス
DATANG INTL POWER GEN CO-H	2,100	2,360	493	6,890	公益事業
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	385	455	1,767	24,694	資本財
CHINA EVERBRIGHT LTD	660	800	1,180	16,495	各種金融
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	920	1,080	1,153	16,113	運輸
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	—	1,520	767	10,723	運輸
CHINA MOBILE LTD	4,625	5,350	46,010	642,759	電気通信サービス
HUANENG POWER INTL INC-H	2,720	3,720	2,023	28,270	公益事業
HUADIAN POWER INTL CORP-H	1,280	1,360	524	7,333	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	905	1,090	2,012	28,109	素材
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	3,120	3,640	2,369	33,103	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LENOVO GROUP LTD	5,080	6,320	3,311	46,264	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	840	1,422	2,081	29,082	保険
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	260	320	900	12,584	食品・飲料・タバコ
SINOTRANS LIMITED-H	1,450	1,590	500	6,996	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	3,200	3,420	831	11,609	素材
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	1,000	—	—	—	素材
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	1,560	1,880	981	13,709	資本財
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2,620	4,020	5,370	75,028	保険
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	5,600	6,500	10,881	152,007	保険
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	540	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	19,400	23,390	1,450	20,259	半導体・半導体製造装置
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	1,460	1,700	2,176	30,398	公益事業
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	3,150	3,150	541	7,568	運輸
CHINA MENGNIU DAIRY CO	1,060	2,420	2,995	41,853	食品・飲料・タバコ
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,965	4,545	15,589	217,783	保険
AIR CHINA LTD-H	1,460	1,540	896	12,521	運輸
SINO BIOPHARMACEUTICAL	2,120	3,930	2,145	29,976	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	1,360	1,600	944	13,187	エネルギー
TENCENT HOLDINGS LTD	3,894	4,504	70,487	984,711	ソフトウェア・サービス
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	6,519	7,669	3,550	49,603	銀行
ZTE CORP-H	492	631	648	9,066	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	4,640	4,880	1,268	17,725	素材
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	54,475	73,315	34,604	483,430	銀行
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	700	876	874	12,213	不動産
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	430	490	1,874	26,183	耐久消費財・アパレル

銘柄	株数	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	
CHINA POWER INTERNATIONAL	—	2,890	965	13,484	公益事業
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,100	2,400	1,922	26,855	自動車・自動車部品
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	2,180	2,540	802	11,212	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	2,535	2,980	3,570	49,873	エネルギー
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	1,200	1,360	711	9,936	素材
JIANGXI COPPER CO LTD-H	970	1,170	1,031	14,416	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1,280	1,720	760	10,620	ヘルスケア機器・サービス
BANK OF CHINA LTD-H	60,040	69,220	20,904	292,035	銀行
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	1,900	2,190	1,802	25,179	商業・専門サービス
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	1,090	1,200	1,221	17,065	不動産
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	570	645	3,621	50,594	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS BANK-H	3,475	4,020	6,786	94,808	銀行
IND & COMM BK OF CHINA-H	55,803	64,313	25,403	354,891	銀行
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	580	660	2,560	35,774	公益事業
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	1,880	2,080	738	10,315	電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	3,370	3,870	3,467	48,441	資本財
CHINA COAL ENERGY CO-H	2,920	2,440	773	10,805	エネルギー
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	3,080	3,440	7,619	106,445	不動産
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	1,340	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	6,240	7,150	3,274	45,747	銀行
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	730	860	1,659	23,187	耐久消費財・アパレル
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	3,040	3,520	2,041	28,521	資本財
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	7,900	10,080	897	12,532	小売
HENGAN INTL GROUP CO LTD	560	640	4,326	60,439	家庭用品・パーソナル用品
CHINA RESOURCES LAND LTD	1,720	2,420	4,331	60,515	不動産
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1,480	1,740	1,623	22,679	資本財
GUANGDONG INVESTMENT LTD	1,920	2,480	2,698	37,694	公益事業
FOSUN INTERNATIONAL LTD	1,310	1,840	1,854	25,910	資本財
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	2,520	2,880	936	13,075	不動産
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	2,220	2,480	875	12,229	素材
SHUI ON LAND LTD	3,176	3,276	638	8,924	不動産
WEICHAI POWER CO LTD-H	342	824	730	10,210	資本財
CHINA COSCO HOLDINGS-H	2,040	2,270	626	8,752	運輸
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	3,550	4,080	1,725	24,109	耐久消費財・アパレル
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	4,430	5,120	2,821	39,411	食品・飲料・タバコ
KUNLUN ENERGY CO LTD	2,360	2,860	1,730	24,172	エネルギー
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	4,372	5,032	1,539	21,512	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	640	780	1,731	24,190	公益事業
SOHO CHINA LTD	1,380	1,720	639	8,938	不動産
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	3,220	3,860	1,837	25,667	公益事業
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	4,100	4,700	1,748	24,425	自動車・自動車部品
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	2,180	2,830	1,491	20,834	公益事業
CHINA MINSHENG BANKING-H	4,756	5,151	3,677	51,379	銀行
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2,002	2,300	5,911	82,576	保険
CRRC CORP LTD - H	1,500	3,845	2,799	39,109	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	380	455	1,947	27,205	資本財
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	15,960	20,150	5,400	75,440	銀行
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	4,500	3,640	1,994	27,866	不動産
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	1,626	1,906	1,635	22,854	自動車・自動車部品
SINOPHARM GROUP CO-H	916	1,044	3,523	49,223	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円			
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,560	1,540	1,657	23,148		公益事業	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	3,160	—	—	—		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LONGFOR PROPERTIES	1,160	1,295	1,333	18,633		不動産	
CHINA RESOURCES CEMENT	1,460	—	—	—		素材	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	7,860	11,100	1,298	18,142		半導体・半導体製造装置	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	790	2,745	1,559	21,781		自動車・自動車部品	
BBMG CORP-H	760	—	—	—		素材	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	2,500	3,220	637	8,906		不動産	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	1,260	1,560	1,775	24,800		資本財	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	820	1,900	2,975	41,566		各種金融	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	1,820	2,130	1,092	15,264		食品・生活必需品小売り	
FAR EAST HORIZON LTD	1,020	1,590	941	13,149		各種金融	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	2,000	2,270	860	12,018		銀行	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	5,300	5,700	609	8,520		不動産	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	940	—	—	—		食品・飲料・タバコ	
HATER ELECTRONICS GROUP CO	830	1,110	1,363	19,042		耐久消費財・アパレル	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	520	600	1,008	14,081		ヘルスケア機器・サービス	
CHINA SOUTH CITY HOLDINGS	2,100	—	—	—		不動産	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	992	2,836	3,408	47,621		各種金融	
CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	373	474	487	6,807		資本財	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	—	1,680	787	11,007		不動産	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	530	688	1,682	23,499		保険	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	4,920	5,810	1,731	24,187		保険	
HUANENG RENEWABLES CORP-H	—	3,340	771	10,778		公益事業	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	1,220	2,925	1,845	25,784		各種金融	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	870	930	967	13,511		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	275	335	660	9,228		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	530	530	632	8,840		資本財	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	890	1,105	724	10,126		資本財	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	4,000	3,440	994	13,888		食品・飲料・タバコ	
NEW WORLD CHINA LAND LTD	1,980	—	—	—		不動産	
HANERGY THIN FILM POWER GROU	9,300	9,600	3,753	52,437		半導体・半導体製造装置	
KINGSOFT CORP LTD	510	730	1,268	17,724		ソフトウェア・サービス	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	3,720	7,740	1,888	26,383		各種金融	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	—	1,190	1,792	25,036		資本財	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	1,900	2,040	1,005	14,049		電気通信サービス	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	1,900	2,880	947	13,236		銀行	
CHINA VANKE CO LTD-H	1,029	1,163	2,078	29,030		不動産	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	4,100	8,900	1,548	21,633		メディア	
CHINA CNR CORP LTD-H	1,505	—	—	—		資本財	
CGN POWER CO LTD-H	4,160	7,910	1,945	27,183		公益事業	
DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	—	517	2,649	37,015		不動産	
LUYE PHARMA GROUP LTD	—	1,170	594	8,303		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GF SECURITIES CO LTD-H	—	1,164	1,934	27,025		各種金融	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	—	1,290	1,953	27,284		各種金融	
CAR INC	—	680	533	7,447		運輸	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	590	690	763	10,661		自動車・自動車部品	
小 計	株 数	金 額	541,815	665,443	498,120	6,958,745	
	銘柄 数	< 比 率 >	139	140	—	< 19.5% >	

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	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシアリンギット	千円	
GENTING MALAYSIA BHD	2,189	2,609	1,124	30,327	消費者サービス
GENTING BHD	1,526	1,967	1,664	44,880	消費者サービス
TELEKOM MALAYSIA BHD	820	969	639	17,248	電気通信サービス
TENAGA NASIONAL BHD	2,558	2,959	4,142	111,725	公益事業
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	363	367	847	22,844	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	3,470	4,257	3,767	101,607	銀行
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	449	552	170	4,593	消費者サービス
IOI CORP BHD	2,224	2,569	1,076	29,030	食品・飲料・タバコ
AMMB HOLDINGS BHD	1,530	1,720	779	21,013	銀行
YTL CORP BHD	3,374	3,872	631	17,024	公益事業
GAMUDA BHD	1,390	1,460	693	18,703	資本財
MISC BHD	820	985	751	20,269	運輸
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	3,600	3,600	1,684	45,439	銀行
PETRONAS GAS BHD	509	610	1,299	35,042	公益事業
SIME DARBY BERHAD	2,260	2,714	2,068	55,775	資本財
PUBLIC BANK BERHAD	2,062	2,114	4,008	108,099	銀行
UMW HOLDINGS BHD	440	490	301	8,140	自動車・自動車部品
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	99	111	534	14,405	食品・飲料・タバコ
RHB CAPITAL BHD	360	544	326	8,803	銀行
PPB GROUP BERHAD	368	406	632	17,059	食品・飲料・タバコ
IJM CORP BHD	1,233	2,688	932	25,155	資本財
DIGI.COM BHD	2,700	3,068	1,343	36,241	電気通信サービス
MAXIS BHD	1,460	1,647	920	24,830	電気通信サービス
AXIATA GROUP BERHAD	1,940	2,331	1,272	34,325	電気通信サービス
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	910	1,620	238	6,422	公益事業
HONG LEONG BANK BERHAD	410	580	777	20,961	銀行
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,120	2,459	1,576	42,510	素材
LAFARGE MALAYSIA BHD	335	335	278	7,508	素材
PETRONAS DAGANGAN BHD	183	214	485	13,101	エネルギー
ATRASIA BHD	1,000	1,000	216	5,825	運輸
BUMI ARMADA BERHAD	1,455	2,055	157	4,239	エネルギー
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	740	920	374	10,098	銀行
SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	2,860	2,957	467	12,600	エネルギー
UEM SUNRISE BHD	1,180	—	—	—	不動産
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	670	738	467	12,619	運輸
FELDA GLOBAL VENTURES	820	1,020	144	3,906	食品・飲料・タバコ
IHH HEALTHCARE BHD	1,810	2,160	1,404	37,865	ヘルスケア機器・サービス
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	185	208	310	8,380	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	—	497	381	10,294	資本財
GENTING PLANTATIONS BHD	150	195	207	5,585	食品・飲料・タバコ
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	1,170	1,377	371	10,027	メディア
WESTPORTS HOLDINGS BHD	—	932	391	10,557	運輸
DIALOG GROUP BHD	2,766	3,482	546	14,747	資本財
IOI PROPERTIES GROUP BHD	1,178	1,328	316	8,524	不動産
HARTALEGA HOLDINGS BHD	—	601	234	6,321	ヘルスケア機器・サービス
小 計	株 数	金 額	40,959	1,104,686	
	銘柄 数 < 比 率 >		—	< 3.1% >	
(タイ)			千タイバーツ		
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	970	1,196	6,458	19,827	不動産
KASIKORN BANK PCL-NVDR	1,382	1,537	24,284	74,553	銀行

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(タイ)	百株	百株	千タイバーツ	千円		
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	10,200	11,100	2,419	7,428	銀行	
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	750	830	2,033	6,242	メディア	
CP ALL PCL-NVDR	3,302	3,858	18,229	55,963	食品・生活必需品小売り	
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	426	222	3,474	10,666	銀行	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	787	915	13,587	41,714	電気通信サービス	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,165	1,364	17,186	52,762	銀行	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	313	358	17,423	53,488	素材	
PTT PCL-NVDR	761	875	25,550	78,438	エネルギー	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	1,075	1,226	8,857	27,193	エネルギー	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	313	377	14,627	44,906	運輸	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	720	860	1,161	3,564	エネルギー	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,940	2,640	6,864	21,072	食品・飲料・タバコ	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	900	1,200	3,600	11,052	素材	
IRPC PCL - NVDR	8,300	8,980	4,310	13,232	エネルギー	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,285	1,771	10,231	31,409	素材	
THAI OIL PCL-NVDR	650	692	4,446	13,649	エネルギー	
KRUNG THAI BANK - NVDR	2,610	2,940	4,821	14,802	銀行	
GLOW ENERGY PCL - NVDR	360	435	3,708	11,384	公益事業	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	2,500	3,406	8,140	24,990	ヘルスケア機器・サービス	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	1,460	1,652	3,568	10,954	食品・飲料・タバコ	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	2,980	3,320	2,755	8,459	小売	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	4,250	4,920	4,403	13,518	運輸	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	290	316	6,272	19,256	ヘルスケア機器・サービス	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	320	430	2,816	8,646	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TRUE CORP PCL-NVDR	6,400	7,562	5,558	17,064	電気通信サービス	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,370	1,521	5,855	17,977	消費者サービス	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	970	970	2,075	6,372	エネルギー	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	—	6,040	3,865	11,867	運輸	
小 計	株 数	58,749	73,514	238,587	732,463	
	銘柄 数 < 比 率 >	29	30	—	< 2.1% >	
(フィリピン)				千フィリピンペソ		
PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	74	85	14,910	34,741	電気通信サービス	
SM PRIME HOLDINGS INC	6,405	7,265	18,344	42,741	不動産	
AYALA LAND INC	5,430	6,453	22,746	53,000	不動産	
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	620	660	6,250	14,562	銀行	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	400	450	2,859	6,663	運輸	
MEGAWORLD CORP	8,300	9,990	4,045	9,427	不動産	
JOLLIBEE FOODS CORP	337	379	8,870	20,667	消費者サービス	
ENERGY DEVELOPMENT CORP	6,900	8,000	4,784	11,146	公益事業	
SM INVESTMENTS CORP	117	137	13,264	30,906	資本財	
AYALA CORPORATION	160	189	14,984	34,914	各種金融	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	1,470	1,677	11,739	27,353	資本財	
ABOITIZ POWER CORP	1,100	1,321	5,997	13,973	公益事業	
METROPOLITAN BANK & TRUST	195	265	2,199	5,124	銀行	
BDO UNIBANK INC	1,250	1,436	14,799	34,481	銀行	
DMCI HOLDINGS INC	2,850	3,536	4,476	10,430	資本財	
UNIVERSAL ROBINA CORP	680	763	16,100	37,515	食品・飲料・タバコ	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	1,320	1,820	2,631	6,131	資本財	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	1,850	2,197	19,338	45,059	資本財	
GLOBE TELECOM INC	26	28	6,423	14,966	電気通信サービス	

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピンペソ	千円		
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	9,200	11,200	6,664	15,527		各種金融
ROBINSONS LAND CO	—	1,450	4,234	9,865		不動産
GT CAPITAL HOLDINGS INC	—	69	9,820	22,880		各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額	48,684	59,374	215,485	502,082	
	銘柄 数 < 比 率 >	20	22	—	< 1.4% >	
(インドネシア)			千インドネシアルピア			
KALBE FARMA TBK PT	15,400	18,261	2,392,191	19,615		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	37,500	44,027	16,378,044	134,299		電気通信サービス
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	3,350	3,782	2,713,585	22,251		食品・飲料・タバコ
HM SAMPOERNA TBK PT	—	328	3,230,800	26,492		食品・飲料・タバコ
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	9,360	10,750	14,136,250	115,917		銀行
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	1,060	1,272	2,362,740	19,374		素材
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	15,330	17,669	11,749,885	96,349		自動車・自動車部品
GUDANG GARAM TBK PT	385	415	2,942,350	24,127		食品・飲料・タバコ
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	8,400	9,698	9,698,000	79,523		銀行
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	340	340	527,000	4,321		食品・飲料・タバコ
BANK DANAMON INDONESIA TBK	2,810	2,810	834,570	6,843		銀行
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	2,310	2,554	2,464,610	20,209		素材
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	8,085	9,575	2,288,425	18,765		公益事業
UNITED TRACTORS TBK PT	1,310	1,433	2,016,947	16,538		資本財
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	565	—	—	—		エネルギー
LIPPO KARAWACI TBK PT	15,500	17,464	1,641,616	13,461		不動産
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	7,090	8,177	7,870,362	64,536		銀行
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,120	1,342	5,945,060	48,749		家庭用品・パーソナル用品
ADARO ENERGY TBK PT	10,400	12,400	849,400	6,965		エネルギー
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	1,400	1,700	913,750	7,492		運輸
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	5,650	6,606	3,091,608	25,351		銀行
INDO TAMBANGRAYA MEGAH TBK P	220	—	—	—		エネルギー
AKR CORPORINDO TBK PT	—	1,543	987,520	8,097		資本財
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	5,500	6,403	2,177,020	17,851		食品・飲料・タバコ
XL AXIATA TBK PT	2,250	2,450	810,950	6,649		電気通信サービス
SUMMARECON AGUNG TBK PT	—	8,500	1,219,750	10,001		不動産
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	3,850	4,402	928,822	7,616		メディア
BUMI SERPONG DAMAI PT	6,200	7,017	1,234,992	10,126		不動産
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	910	990	1,534,500	12,582		食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,350	1,756	1,066,770	8,747		電気通信サービス
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	4,650	5,000	1,545,000	12,669		メディア
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	4,400	5,800	646,700	5,302		メディア
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	1,460	2,057	3,805,450	31,204		小売
小 計	株 数 ・ 金 額	178,155	216,521	110,004,668	902,038	
	銘柄 数 < 比 率 >	30	31	—	< 2.5% >	
(韓国)			千韓国ウォン			
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	83	96	12,524,648	1,167,297		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KOREA ELECTRIC POWER CORP	195	224	1,373,328	127,994		公益事業
SHINSEGAE CO LTD	4	6	129,168	12,038		小売
CJ CORP	11	12	312,095	29,087		資本財
SAMSUNG C&T CORP	95	—	—	—		資本財
SK TELECOM	7	17	375,700	35,015		電気通信サービス
HYUNDAI MOTOR CO	117	140	1,946,000	181,367		自動車・自動車部品
POSCO	49	60	1,278,900	119,193		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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	44	52	265,104	24,707	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KT CORP	22	22	71,325	6,647	電気通信サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	45	49	184,001	17,148	各種金融
HYUNDAI MOBIS CO LTD	51	59	1,561,520	145,533	自動車・自動車部品
CHEIL WORLDWIDE INC	66	72	118,933	11,084	メディア
KB FINANCIAL GROUP INC	290	337	1,137,038	105,971	銀行
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	24	31	915,975	85,368	保険
SAMSUNG SDI CO LTD	42	48	538,433	50,182	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	320	372	1,477,237	137,678	銀行
LG ELECTRONICS INC	82	93	516,175	48,107	耐久消費財・アパレル
AMOREPACIFIC GROUP	21	24	416,585	38,825	家庭用品・パーソナル用品
HYUNDAI DEPT STORE CO	10	13	189,040	17,618	小売
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	19	24	197,600	18,416	資本財
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	41	41	127,305	11,864	資本財
KT&G CORP	81	96	1,214,400	113,182	食品・飲料・タバコ
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	82	—	—	—	資本財
NCSOFT CORP	11	15	368,900	34,381	ソフトウェア・サービス
LG DISPLAY CO LTD	179	203	499,310	46,535	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	31	36	371,347	34,609	資本財
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	118	130	121,309	11,306	資本財
AMOREPACIFIC CORP	24	28	1,181,605	110,125	家庭用品・パーソナル用品
HANA FINANCIAL GROUP	218	258	650,882	60,662	銀行
HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	42	50	229,250	21,366	資本財
LG CHEM LTD	34	40	1,172,160	109,245	素材
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	47	41	97,990	9,132	資本財
LS CORP	12	—	—	—	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	7	8	839,876	78,276	家庭用品・パーソナル用品
SK INNOVATION CO LTD	45	56	884,520	82,437	エネルギー
KAKAO CORP	19	25	272,706	25,416	ソフトウェア・サービス
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	31	35	147,525	13,749	各種金融
HANMI SCIENCE CO LTD	—	9	139,018	12,956	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COWAY CO LTD	39	47	473,526	44,132	耐久消費財・アパレル
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	16	66	153,558	14,311	各種金融
S-1 CORPORATION	13	16	165,000	15,378	商業・専門サービス
DOOSAN INFRACORE CO LTD	107	—	—	—	資本財
KIA MOTORS CORP	198	230	1,086,807	101,290	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	441	508	1,332,532	124,191	半導体・半導体製造装置
LG CORP	73	83	544,128	50,712	資本財
SK HOLDINGS CO LTD	19	—	—	—	資本財
HYUNDAI STEEL CO	52	70	389,215	36,274	素材
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	15	16	1,787,974	166,639	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OCI CO LTD	13	14	160,225	14,932	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	213	245	284,432	26,509	銀行
KANGWON LAND INC	92	103	441,945	41,189	消費者サービス
NAVER CORP	21	24	1,693,692	157,852	ソフトウェア・サービス
DAEWOO SECURITIES CO LTD	132	160	123,954	11,552	各種金融
CELLTRION INC	50	60	604,400	56,330	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KOREA GAS CORPORATION	22	22	94,162	8,775	公益事業
LG UPLUS CORP	162	188	213,720	19,918	電気通信サービス
LOTTE SHOPPING CO	8	9	226,775	21,135	小売

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
YUHAN CORP	5	6	205,131	19,118	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONGBU INSURANCE CO LTD	29	37	263,625	24,569	保険
S-OIL CORP	33	38	330,111	30,766	エネルギー
KCC CORP	4	5	208,317	19,415	資本財
POSCO DAEWOO CORP	32	41	97,183	9,057	資本財
SAMSUNG CARD CO	25	30	120,355	11,217	各種金融
LS INDUSTRIAL SYSTEMS	9	—	—	—	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	27	27	267,477	24,928	自動車・自動車部品
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	56	68	244,595	22,796	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	28	30	89,136	8,307	運輸
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	44	69	740,940	69,055	保険
LOTTE CHEMICAL CORP	11	13	405,000	37,746	素材
GS HOLDINGS	38	45	240,750	22,437	エネルギー
NH INVESTMENT & SECURITIES C	113	121	115,563	10,770	各種金融
HANWHA CHEMICAL CORP	86	92	224,334	20,907	素材
HYOSUNG CORPORATION	18	19	233,240	21,737	素材
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	6	—	—	—	資本財
HANWHA CORPORATION	34	40	157,192	14,650	資本財
CJ CHEILJEDANG CORP	5	6	276,660	25,784	食品・飲料・タバコ
BNK FINANCIAL GROUP INC	142	230	204,098	19,021	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	14	16	299,460	27,909	運輸
DGB FINANCIAL GROUP INC	123	143	125,554	11,701	銀行
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	18	18	178,155	16,604	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	6	7	357,600	33,328	素材
E-MART INC	15	18	347,760	32,411	食品・生活必需品小売り
HYUNDAI WIA CORP	12	13	133,996	12,488	自動車・自動車部品
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	9	11	77,855	7,256	素材
DOOSAN CORP	6	6	66,950	6,239	資本財
SK HOLDINGS CO LTD	15	30	660,190	61,529	資本財
ORION CORP	2	3	298,840	27,851	食品・飲料・タバコ
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	44	55	177,444	16,537	保険
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	35	51	332,937	31,029	資本財
SK NETWORKS CO LTD	86	97	58,394	5,442	資本財
HYUNDAI MERCHANT MARINE	70	—	—	—	運輸
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	0.5	0.51	127,398	11,873	食品・飲料・タバコ
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	167	193	127,582	11,890	保険
LG INNOTEK CO LTD	10	12	90,972	8,478	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG CHEM LTD-PREFERENCE	6	6	126,000	11,743	素材
HANKOOK TIRE CO LTD	54	65	337,528	31,457	自動車・自動車部品
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	78	89	51,798	4,827	資本財
HANON SYSTEMS	30	159	170,925	15,930	自動車・自動車部品
HITE JINRO CO LTD	16	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CJ E&M CORP	—	17	131,752	12,279	メディア
DONGSUH COMPANIES INC	—	29	96,105	8,956	食品・生活必需品小売り
PARADISE CO LTD	33	37	62,345	5,810	消費者サービス
CJ KOREA EXPRESS CORP	5	5	117,450	10,946	運輸
HOTEL SHILLA CO LTD	26	29	212,532	19,807	小売
HANSSEM CO LTD	8	8	149,882	13,969	耐久消費財・アパレル
WOORI BANK	232	291	301,671	28,115	銀行
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	16	20	145,248	13,537	商業・専門サービス

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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円		
SAMSUNG SDS CO LTD	20	27	466,120	43,442	ソフトウェア・サービス	
SAMSUNG C&T CORP	11	66	846,472	78,891	資本財	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	—	7	175,875	16,391	家庭用品・パーソナル用品	
HANMI PHARM CO LTD	—	4	267,014	24,885	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BGF RETAIL CO LTD	—	7	159,980	14,910	食品・生活必需品小売り	
GS RETAIL CO LTD	—	23	133,380	12,431	食品・生活必需品小売り	
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	—	0.54	108,432	10,105	食品・飲料・タバコ	
OTTOGI CORPORATION	—	1	90,405	8,425	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額	6,252	7,213	55,658,671	5,187,388	
	銘柄 数 < 比 率 >	107	107	—	<14.6%>	
(台湾)			千ニュー台湾ドル			
COMPAL ELECTRONICS	3,237	3,747	6,708	22,339	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
DELTA ELECTRONICS INC	1,382	1,702	24,001	79,923	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	2,290	2,831	6,526	21,732	資本財	
FORMOSA PLASTICS CORP	3,136	3,616	27,843	92,717	素材	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	9,301	12,337	91,298	304,024	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	9,040	10,650	11,981	39,897	半導体・半導体製造装置	
NAN YA PLASTICS CORP	3,615	4,155	25,639	85,380	素材	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	430	500	11,300	37,629	食品・生活必需品小売り	
SILICONWARE PRECISION INDS	2,230	1,930	8,636	28,760	半導体・半導体製造装置	
TAIWAN CEMENT	2,567	2,907	8,619	28,702	素材	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	18,480	21,230	312,081	1,039,229	半導体・半導体製造装置	
ASUSTEK COMPUTER INC	527	617	16,061	53,483	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	387	387	3,549	11,818	半導体・半導体製造装置	
QUANTA COMPUTER INC	2,021	2,371	12,640	42,091	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	6,203	7,123	25,039	83,382	保険	
ACER INC	2,151	2,591	2,721	9,061	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	5,521	8,537	7,794	25,956	銀行	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	4,735	5,545	16,582	55,218	半導体・半導体製造装置	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	2,404	2,824	23,526	78,342	素材	
WAN HAI LINES LTD	520	—	—	—	運輸	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	5,020	5,810	21,296	70,918	各種金融	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	347	419	3,147	10,482	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MEDIATEK INC	1,072	1,302	26,047	86,737	半導体・半導体製造装置	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	5,876	7,046	8,350	27,806	銀行	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	10,271	13,408	21,520	71,663	銀行	
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,304	1,464	16,250	54,113	電気通信サービス	
CHINA STEEL CORP	9,009	10,329	21,072	70,170	素材	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	430	510	5,508	18,341	半導体・半導体製造装置	
ADVANTECH CO LTD	238	268	5,888	19,609	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	675	802	5,263	17,528	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	490	580	12,180	40,559	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AU OPTRONICS CORP	6,520	7,630	6,546	21,799	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
U-MING MARINE TRANSPORT CORP	270	—	—	—	運輸	
EPICSTAR CORP	760	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
HTC CORP	497	587	3,648	12,147	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KINSUS INTERCONNECT TECH	230	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	493	553	3,544	11,803	半導体・半導体製造装置	
INVENTEC CORP	1,594	1,954	3,986	13,275	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	2,880	3,320	36,686	122,164	電気通信サービス	

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(台湾)	百株	百株	千ニュー台湾ドル	千円		
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	231	231	2,419	8,055	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PHISON ELECTRONICS CORP	100	120	3,000	9,990	半導体・半導体製造装置	
WPG HOLDINGS LTD	1,044	1,274	4,299	14,318	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CLEVO COMPANY	284	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
GIANT MANUFACTURING	220	240	4,284	14,265	耐久消費財・アパレル	
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	370	—	—	—	不動産	
FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS	22	—	—	—	消費者サービス	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	410	470	2,030	6,761	耐久消費財・アパレル	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	981	1,211	3,694	12,303	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	6,668	8,433	8,601	28,644	各種金融	
INNOLUX CORP	6,151	7,291	6,919	23,041	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	4,471	5,643	8,719	29,037	銀行	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	5,949	6,892	4,301	14,322	保険	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	1,240	1,400	10,486	34,918	電気通信サービス	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,264	1,434	9,121	30,373	自動車・自動車部品	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	881	1,011	8,749	29,135	エネルギー	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	7,597	9,517	21,747	72,419	銀行	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	5,760	8,045	12,751	42,463	銀行	
LARGAN PRECISION CO LTD	77	84	22,649	75,423	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	3,456	4,226	24,216	80,640	食品・飲料・タバコ	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	3,755	4,109	6,575	21,894	銀行	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	10,392	12,012	9,297	30,961	銀行	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,624	1,852	7,020	23,378	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASIA CEMENT CORP	1,662	2,072	5,306	17,670	素材	
YULON MOTOR COMPANY	600	790	2,125	7,076	自動車・自動車部品	
POU CHEN	1,585	1,965	7,830	26,075	耐久消費財・アパレル	
WISTRON CORP	1,871	2,049	3,575	11,908	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	620	650	2,710	9,025	素材	
INOTERA MEMORIES INC	1,680	1,960	5,752	19,156	半導体・半導体製造装置	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	1,010	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PEGATRON CORP	1,219	1,719	11,230	37,396	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHINA AIRLINES LTD	2,080	2,260	2,271	7,563	運輸	
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	4,821	6,310	10,570	35,199	銀行	
WALSIN LIHWA CORP	2,700	—	—	—	資本財	
FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	788	—	—	—	小売	
TPK HOLDING CO LTD	204	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	2,176	2,813	6,542	21,786	保険	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	135	170	2,324	7,739	資本財	
TAIWAN GLASS IND CORP	669	—	—	—	資本財	
EVA AIRWAYS CORP	1,290	1,750	2,607	8,682	運輸	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	1,319	1,533	1,755	5,845	運輸	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	5,057	6,320	8,659	28,835	銀行	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	180	220	6,534	21,758	小売	
TECO ELECTRIC & MACHINERY	1,380	1,700	4,190	13,954	資本財	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	335	365	1,802	6,001	半導体・半導体製造装置	
CTCI CORP	460	—	—	—	資本財	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	500	760	2,614	8,705	不動産	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	420	650	3,061	10,194	不動産	
TAIWAN BUSINESS BANK	2,803	3,798	3,050	10,157	銀行	
STANDARD FOODS CORP	278	305	2,376	7,912	食品・飲料・タバコ	

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	
(台湾)	百株	百株	千ニュー台湾ドル	千円		
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	210	340	2,159	7,189	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FORMOSA TAFFETA CO.	660	680	2,006	6,679	耐久消費財・アパレル	
CHALEASE HOLDING CO LTD	716	874	4,408	14,679	各種金融	
SCINOPHARM TAIWAN LTD	163	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRANSCEND INFORMATION INC	140	180	1,562	5,202	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HERMES MICROVISION INC	30	32	3,103	10,335	半導体・半導体製造装置	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	147	177	2,247	7,485	耐久消費財・アパレル	
CHINA MOTOR CORP	360	—	—	—	自動車・自動車部品	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	560	720	3,816	12,707	半導体・半導体製造装置	
YANG MING MARINE TRANSPORT	880	—	—	—	運輸	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	124	164	5,084	16,929	耐久消費財・アパレル	
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	1,400	1,600	1,600	5,328	電気通信サービス	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	—	267	3,500	11,656	耐久消費財・アパレル	
CASETEK HOLDINGS LTD	—	120	1,302	4,335	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
OBI PHARMA INC	—	90	3,262	10,864	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	234,362	272,506	1,155,316	3,847,205	
	銘柄 数 < 比 率 >	101	88	—	< 10.8% >	
(インド)			千インドルピー			
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	1,128	1,307	157,372	258,091	銀行	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	355	412	103,955	170,486	ソフトウェア・サービス	
ITC LTD	1,694	1,962	62,410	102,353	食品・飲料・タバコ	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	575	662	57,126	93,687	家庭用品・パーソナル用品	
JINDAL STEEL & POWER LTD	300	—	—	—	素材	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	450	532	6,726	11,031	資本財	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	575	752	15,445	25,329	エネルギー	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	800	960	8,793	14,421	素材	
COAL INDIA LTD	530	612	17,377	28,498	エネルギー	
GAIL INDIA LTD	230	338	13,115	21,509	公益事業	
AMBUJA CEMENTS LTD	490	606	13,367	21,922	素材	
HERO MOTOCORP LTD	39	44	13,060	21,419	自動車・自動車部品	
BAJAJ AUTO LTD	63	74	18,703	30,673	自動車・自動車部品	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	611	839	66,857	109,646	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADANI ENTERPRISES LTD	108	—	—	—	資本財	
ASIAN PAINTS LTD	212	251	22,868	37,504	素材	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	117	131	14,281	23,421	各種金融	
VEDANTA LTD	900	803	8,007	13,132	素材	
TATA POWER CO LTD	860	930	6,603	10,828	公益事業	
BHARTI AIRTEL LTD	460	1,047	37,605	61,673	電気通信サービス	
CIPLA LTD	260	305	16,387	26,875	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NTPC LTD	1,290	1,018	14,407	23,628	公益事業	
INFOSYS LTD	677	1,563	187,945	308,230	ソフトウェア・サービス	
ULTRATECH CEMENT LTD	28	30	9,629	15,792	素材	
ACC LTD	38	38	5,575	9,143	素材	
DLF LTD	370	—	—	—	不動産	
DR. REDDY'S LABORATORIES	90	103	29,662	48,646	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ICICI BANK LTD	847	971	21,761	35,688	銀行	
LUPIN LTD	—	193	30,819	50,543	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	—	92	36,060	59,139	自動車・自動車部品	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	964	1,112	108,493	177,929	エネルギー	
STATE BANK OF INDIA	1,140	1,363	25,219	41,359	銀行	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円		
TATA STEEL LTD	253	253	8,343	13,684	素材	
LIC HOUSING FINANCE LTD	205	246	11,162	18,306	銀行	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	134	74	6,850	11,235	エネルギー	
IDEA CELLULAR LTD	820	965	10,694	17,538	電気通信サービス	
CAIRN INDIA LTD	330	404	5,479	8,986	エネルギー	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	84	102	14,346	23,527	家庭用品・パーソナル用品	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	202	252	4,145	6,798	各種金融	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	392	507	22,746	37,304	メディア	
POWER FINANCE CORPORATION	185	215	3,512	5,759	各種金融	
DABUR INDIA LTD	380	470	13,787	22,611	家庭用品・パーソナル用品	
JSW STEEL LTD	55	75	9,685	15,883	素材	
LARSEN & TOUBRO LTD	239	277	36,805	60,360	資本財	
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	70	—	—	—	公益事業	
UNITED SPIRITS LTD	34	51	13,816	22,658	食品・飲料・タバコ	
SIEMENS LTD	52	61	7,146	11,719	資本財	
WIPRO LTD	462	540	29,073	47,680	ソフトウェア・サービス	
AXIS BANK LTD	—	523	26,100	42,805	銀行	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	253	326	44,072	72,279	自動車・自動車部品	
TATA MOTORS LTD	617	724	27,535	45,157	自動車・自動車部品	
HCL TECHNOLOGIES LTD	374	493	35,005	57,408	ソフトウェア・サービス	
UNITED BREWERIES LTD	56	56	4,431	7,267	食品・飲料・タバコ	
DIVI'S LABORATORIES LTD	33	71	7,646	12,539	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	375	732	14,128	23,170	運輸	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	52	65	8,581	14,074	ヘルスケア機器・サービス	
OIL INDIA LTD	88	—	—	—	エネルギー	
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	560	760	4,126	6,767	電気通信サービス	
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	8	8	5,119	8,396	食品・飲料・タバコ	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	57	57	7,065	11,587	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADITYA BIRLA NUVO LTD	29	—	—	—	資本財	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	215	233	6,990	11,463	各種金融	
NESTLE INDIA LTD	16	20	11,483	18,832	食品・飲料・タバコ	
TECH MAHINDRA LTD	157	194	9,226	15,132	ソフトウェア・サービス	
AUROBINDO PHARMA LTD	104	232	18,989	31,142	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	167	267	6,839	11,217	自動車・自動車部品	
BOSCH LTD	5	6	13,330	21,862	自動車・自動車部品	
SHREE CEMENT LTD	—	7	9,877	16,199	素材	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	—	30	3,942	6,466	運輸	
MARICO LTD	—	382	9,752	15,994	家庭用品・パーソナル用品	
BHARTI INFRATEL LTD	—	478	17,752	29,113	電気通信サービス	
EICHER MOTORS LTD	—	10	21,475	35,219	資本財	
BHARAT FORGE LTD	—	93	7,298	11,969	自動車・自動車部品	
UPL LTD	—	248	14,731	24,160	素材	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	—	118	10,124	16,604	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	—	259	17,628	28,911	銀行	
ASHOK LEYLAND LTD	—	1,012	10,552	17,305	資本財	
CADILA HEALTHCARE LTD	—	180	6,020	9,873	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	—	310	8,489	13,922	自動車・自動車部品	
小 計	株数	金額	23,268	31,466	1,715,556	2,813,513
	銘柄数	<比率>	64	73	—	<7.9%>

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アラブ首長国連邦)	百株	百株	千アラブディルハム	千円		
EMAAR PROPERTIES PJSC	2,625	3,066	1,919	56,747	不動産	
ALDAR PROPERTIES PJSC	2,340	2,590	681	20,135	不動産	
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	750	1,640	997	29,474	銀行	
NATIONAL BANK OF ABU DHABI	484	584	482	14,259	銀行	
ARABTEC HOLDING CO PJSC	1,774	1,904	293	8,669	資本財	
FIRST GULF BANK	675	761	947	28,006	銀行	
DUBAI FINANCIAL MARKET PJSC	1,520	1,670	222	6,565	各種金融	
DUBAI ISLAMIC BANK	780	830	468	13,862	銀行	
EMAAR MALLS GROUP PJSC	—	1,600	440	13,006	不動産	
EMIRATES TELECOM GROUP CO	—	1,518	2,771	81,923	電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	10,948	16,164	9,223	272,651	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	10	—	< 0.8% >	
(カタール)			千カタールリアル			
MASRAF AL RAYAN	281	307	1,042	31,080	銀行	
OOREDOO QSC	61	66	587	17,516	電気通信サービス	
QATAR NATIONAL BANK	127	183	2,536	75,641	銀行	
INDUSTRIES QATAR	114	126	1,265	37,722	資本財	
VODAFONE QATAR	265	285	319	9,527	電気通信サービス	
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	21	23	481	14,355	公益事業	
QATAR ISLAMIC BANK	43	49	479	14,288	銀行	
BARWA REAL ESTATE CO	77	83	262	7,833	不動産	
COMMERCIAL BANK QSC	67	134	504	15,035	銀行	
DOHA BANK QSC	55	103	371	11,064	銀行	
GULF INTERNATIONAL SERVICES	30	—	—	—	エネルギー	
QATAR INSURANCE CO	—	105	787	23,491	保険	
QATAR INSURANCE CO-NEW	—	16	126	3,768	保険	
EZDAN HOLDING GROUP	—	666	1,189	35,470	不動産	
QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	—	234	535	15,971	エネルギー	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,142	2,384	10,488	312,765	
	銘柄 数 < 比 率 >	11	14	—	< 0.9% >	
(南アフリカ)			千南アフリカランド			
BARLOWORLD LTD	160	180	1,323	9,538	資本財	
SAPPI LIMITED	435	480	3,338	24,069	素材	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	35	45	1,734	12,507	素材	
NEDBANK GROUP LTD	146	173	3,018	21,761	銀行	
SASOL LTD	409	472	21,305	153,611	エネルギー	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	300	355	8,085	58,297	素材	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	410	534	2,700	19,472	素材	
GOLD FIELDS LTD	550	664	4,292	30,945	素材	
MONDI LTD	—	104	3,028	21,834	素材	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	699	865	7,834	56,485	小売	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	280	392	4,106	29,604	小売	
TELKOM SA SOC LTD	190	216	1,287	9,281	電気通信サービス	
TIGER BRANDS LTD	125	143	4,933	35,568	食品・飲料・タバコ	
SANLAM LTD	1,389	1,516	9,877	71,214	保険	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	352	401	6,785	48,922	食品・生活必需品小売り	
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	1,616	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
STANDARD BANK GROUP LTD	914	1,058	12,493	90,076	銀行	
RMB HOLDINGS LTD	519	625	3,344	24,116	各種金融	
REMGRO LTD	364	420	10,351	74,636	各種金融	

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		
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカランド	千円		
PPC LTD	410	—	—	—	素材	
NETCARE LTD	734	810	2,837	20,461	ヘルスケア機器・サービス	
NASPERS LTD-N SHS	300	347	68,785	495,941	メディア	
MTN GROUP LTD	1,259	1,450	19,163	138,166	電気通信サービス	
MASSMART HOLDINGS LTD	86	98	1,195	8,619	食品・生活必需品小売り	
KUMBA IRON ORE LTD	41	—	—	—	素材	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	143	160	2,133	15,385	小売	
INVESTEC LTD	186	214	2,216	15,981	各種金融	
FIRSTSTRAND LTD	2,552	2,941	12,608	90,910	各種金融	
THE FOSCHINI GROUP LTD	154	185	2,698	19,455	小売	
EXXARO RESOURCES LTD	101	121	865	6,237	エネルギー	
BIDVEST GROUP LTD	244	279	10,021	72,255	資本財	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	258	369	5,087	36,681	銀行	
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	75	—	—	—	素材	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	258	299	9,496	68,466	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DISCOVERY LTD	275	314	3,720	26,825	保険	
VODACOM GROUP LTD	271	325	5,450	39,300	電気通信サービス	
PICK N PAY STORES LTD	165	216	1,653	11,920	食品・生活必需品小売り	
MMI HOLDINGS LTD	860	940	2,105	15,181	保険	
SPAR GROUP LIMITED/THE	121	145	3,108	22,409	食品・生活必需品小売り	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	520	565	2,316	16,701	保険	
LIBERTY HOLDINGS LTD	95	95	1,258	9,075	保険	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	680	821	3,118	22,483	ヘルスケア機器・サービス	
MR PRICE GROUP LTD	177	213	3,827	27,595	小売	
ASSORE LTD	23	—	—	—	素材	
SIBANYE GOLD LTD	—	622	3,297	23,772	素材	
NAMPAK LTD	430	—	—	—	素材	
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	290	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	185	204	1,436	10,358	各種金融	
BRAIT SE	240	296	4,413	31,822	各種金融	
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	295	295	763	5,502	消費者サービス	
PSG GROUP LTD	—	74	1,352	9,749	各種金融	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	—	29	1,650	11,903	銀行	
PIONEER FOODS GROUP LTD	—	107	1,795	12,943	食品・飲料・タバコ	
FORTRESS INCOME FUND LTD	—	611	2,235	16,119	不動産	
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	—	798	1,221	8,808	不動産	
NEW EUROPE PROPERTY INVEST	—	197	3,538	25,515	不動産	
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	—	2,523	22,284	160,667	耐久消費財・アパレル	
小計	株数・金額	20,322	25,322	317,498	2,289,165	
	銘柄数<比率>	48	50	—	<6.4%>	
合計	株数・金額	5,383,479	6,668,533	—	33,061,297	
	銘柄数<比率>	842	846	—	<92.8%>	

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

(注) 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	
(メキシコ)		千口	千口	千メキシコペソ	千円	%
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		176	213	8,504	51,282	0.1
小 計		176	213	8,504	51,282	
		銘柄数<比率>	1	1	-	<0.1%>
(トルコ)				千トルコリラ		
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI		144	167	465	17,089	0.0
小 計		144	167	465	17,089	
		銘柄数<比率>	1	1	-	<0.0%>
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		178	203	4,843	34,923	0.1
REDEFINE PROPERTIES LTD		269	389	4,482	32,316	0.1
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS		-	20	2,408	17,367	0.0
RESILIENT REIT LTD		19	24	3,254	23,461	0.1
小 計		466	638	14,988	108,069	
		銘柄数<比率>	3	4	-	<0.3%>
合 計		786	1,019	-	176,441	
		銘柄数<比率>	5	6	-	<0.5%>

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	柄 別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外国	株式先物取引	百万円	百万円
	MINI MS	2,270	-

(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 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円	%
投資証券	33,061,297	91.9
コール・ローン等、その他	176,441	0.5
投資信託財産総額	2,755,866	7.6
	35,993,604	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(35,622,785千円)の投資信託財産総額(35,993,604千円)に対する比率は99.0%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 メキシコペソ=6.03円	1 ブラジルリアル=31.39円	100チリペソ=15.93円
100コロンビアペソ=3.69円	1 ユーロ=123.81円	1 トルコリラ=36.71円	1 チェココルナ=4.58円
100ハンガリーフォリント=39.20円	1 ポーランドズロチ=27.97円	1 香港ドル=13.97円	1 マレーシアリングット=26.97円
1 タイバーツ=3.07円	1 フィリピンペソ=2.33円	100インドネシアルピア=0.82円	100韓国ウォン=9.32円
1 ニュー台湾ドル=3.33円	1 インドルピー=1.64円	1 アラブディルハム=29.56円	1 カタールリアル=29.82円
1 南アフリカランド=7.21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	36,134,249,556
コール・ローン等	2,383,004,222
株式(評価額)	33,061,297,581
投資証券(評価額)	176,441,443
未収入金	141,356,100
未収配当金	35,472,832
差入委託証拠金	336,677,378
(B) 負債	515,877,040
未払金	217,194,246
未払解約金	298,681,966
未払利息	596
その他未払費用	232
(C) 純資産総額(A-B)	35,618,372,516
元本	20,543,703,750
次期繰越損益金	15,074,668,766
(D) 受益権総口数	20,543,703,750口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,338円

<注記事項>

- ①期首元本額 16,489,570,857円
 期中追加設定元本額 6,808,008,459円
 期中一部解約元本額 2,753,875,566円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.7338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 新興国株式インデックス	13,151,327,640円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,293,667,761円
eMAXIS バランス(波乗り型)	411,453,452円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	143,369,205円
コアバランス	60,986円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	3,766,556,674円
新興国株式インデックスオープン	244,268,844円
eMAXIS 全世界株式インデックス	329,035,038円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	44,350,527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)	19,934,320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)	935,495,891円
新興国株式インデックスファンド(ラップ向け)	105,113,054円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	10,273,325円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	80,745,997円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	1,469,087円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	873,232円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	3,162,523円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	2,546,194円
合計	20,543,703,750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	805,647,797
受取配当金	800,525,443
受取利息	3,692,444
その他収益金	1,445,674
支払利息	△ 15,764
(B) 有価証券売買損益	△12,282,545,935
売買益	1,180,186,296
売買損	△13,462,732,231
(C) 先物取引等取引損益	△ 337,204,622
取引益	251,013,746
取引損	△ 588,218,368
(D) 保管費用等	△ 53,491,815
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△11,867,594,575
(F) 前期繰越損益金	23,041,286,420
(G) 追加信託差損益金	6,652,921,879
(H) 解約差損益金	△ 2,751,944,958
(I) 計(E+F+G+H)	15,074,668,766
次期繰越損益金(I)	15,074,668,766

- (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。

【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)

アセアン真成長株式マザーファンド

《第5期》決算日2016年12月12日

[計算期間：2016年6月11日～2016年12月12日]

「アセアン真成長株式マザーファンド」は、12月12日に第5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5期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	アセアン諸国の株式等（預託証書（DR）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、主として中長期的な値上がり益の獲得をめざします。株式等への投資にあたっては、事業の安定性・成長性等に着目して銘柄選定を行います。株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。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。運用にあたっては、三菱UFJ国際投信の香港現地法人であるMitsubishi UFJ Investment Services (HK) Limitedから投資助言を受け、三菱UFJ国際投信が運用します。
主 要 運 用 対 象	アセアン諸国の株式等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。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		（ 参 考 指 数 ） MSCI All Countries South East Asia Index （ 円 換 算 ベース ）		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
(設定日)	円	%		%	%	%	百万円
2014年8月18日	10,000	—	91,834.86	—	—	—	498
1期(2014年12月10日)	10,825	8.3	99,260.51	8.1	98.8	—	1,173
2期(2015年6月10日)	10,882	0.5	96,516.24	△2.8	97.6	—	1,878
3期(2015年12月10日)	9,257	△14.9	79,380.81	△17.8	95.9	—	1,209
4期(2016年6月10日)	9,029	△2.5	75,652.23	△4.7	96.0	—	1,127
5期(2016年12月12日)	9,490	5.1	79,757.44	5.4	97.1	—	1,060

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(注) MSCI All Countries South East Asia Indexとは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、インドネシア、マレーシア、フィリピン、シンガポール、タイの5カ国の株式で構成されています。MSCI All Countries South East Asia Index (円換算ベース)は、MSCI All Countries South East Asia Indexをもとに、委託会社が計算したものです。また、MSCI All Countries South East Asia Indexに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

(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。

(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		(参 考 指 数) MSCI All Countries South East Asia Index (円 換 算 ベ ー ス)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2016年6月10日	円	%		%	%	%
	9,029	—	75,652.23	—	96.0	—
6月末	8,820	△2.3	72,971.42	△3.5	97.0	—
7月末	9,340	3.4	77,240.52	2.1	98.6	—
8月末	9,182	1.7	75,662.93	0.0	96.9	—
9月末	8,933	△1.1	74,216.01	△1.9	95.8	—
10月末	9,014	△0.2	74,431.73	△1.6	96.5	—
11月末	9,015	△0.2	75,211.23	△0.6	95.8	—
(期 末) 2016年12月12日	9,490	5.1	79,757.44	5.4	97.1	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

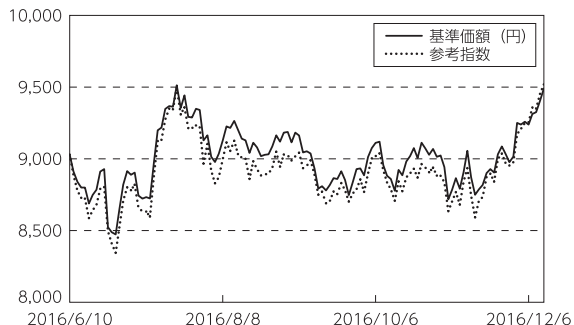
○運用経過

●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5.1%の上昇となりました。

基準価額の推移



(注) 参考指数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

◎アセアン株式市況

- ・期首から2016年11月中旬にかけては、上下に大きく変動しながら概ね横ばい圏で推移しました。2016年7月には米利上げ観測が後退したことで上昇しましたが、9月にECB（欧州中央銀行）のドラギ総裁が追加金融緩和に否定的な発言をしたことや、10月にタイ国王の容態への懸念やフィリピン大統領の発言が嫌気されたことなどが相場の上値を抑える要因となりました。11月中旬から期末にかけては、米大統領選を受けて海外投資資金の流出から相場は弱含みましたが、米国長期金利上昇と米ドル上昇を背景に、各アセアン通貨が対円で強い展開となったことから、上昇基調となりました。
- ・国別では、特に、インドネシアとタイの上昇が大きくなりました。インドネシアは、税恩赦法が成立した事で、資金の国内還流が見込まれ、同国経済の下支えになるとの期待が高まりました。また、タイは、新憲法草案の承認が政情安定化に繋がると好感されました。
- ・為替市況は、株式市況と同様に、インドネシア

ルピアやタイバーツが期首に比べて、対円で大きく上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・アセアン地域に関しては、人口動態や所得増加を背景に、構造的な個人消費の成長やインフラ投資の増加が期待される中、中長期的な業績成長性を重視した銘柄選定を行いました。また、個別銘柄の組入比率は業績成長の確信度も考慮し決定しました。
- ・組入銘柄数は、概ね50銘柄程度で推移させました。期中に、業績減速懸念が高まった銘柄を売却し、業績の改善および拡大が期待できる銘柄への入替を実施しました。
- ・個別に銘柄をみると、インドネシアやシンガポール、タイにおいて消費関連銘柄に重点的に投資を行いました。特にインドネシアの一般消費財メーカーのUNILEVER INDONESIA TBK PTは、安定的な需要拡大が期待できると判断し、期首より組入比率を高位に維持しました。
- ・上記投資行動の結果、特にインドネシアやタイが、株式市況と現地通貨がともに上昇し、全体を牽引したことから、基準価額は上昇しました。
- ・当期の基準価額に影響を与えた主な銘柄は以下の通りです。

(上昇銘柄)

- ・SINGAPORE O&G LTD (シンガポール、ヘルスケア・機器サービス)：シンガポールにおいて、産婦人科医院など、女性向けのクリニックを展開しています。医者やクリニック数の増加による安定した患者数拡大が期待できるほか、婦人腫瘍科や美容皮膚科など新規診療分野からの業績貢献も期待できることから、期首より保有しました。想定通りに業績が堅調に推移し、株価が大きく上昇しました。なお、株価上昇により、ポートフォリオの組入比率が増えたため、期中に一部売却しました。

- ・GP ALL PCL-NVDR (タイ、食品・生活必需品小売)：タイにおいて、大手コンビニエンスストアであるセブンイレブンを運営しています。過去には会員制卸売大手のサイアムマクロを買収するなど、卸売業にも注力しています。政情不安の緩和から市場のセンチメントが改善した中、良好な決算を発表したことから株価が上昇しました。

(下落銘柄)

- ・GLOBE TELECOM INC (フィリピン、電気通信サービス)：フィリピンの通信事業者で、携帯電話、データ通信、ブロードバンド、固定通信サービスなどを提供しています。大手2社による寡占化した国内市場において、新規参入リスクが低下したことや、データ通信量増加などを背景とした安定的な成長を期待し、期首より保有しました。しかし、既存2社間での競争激化への懸念から、株価は下落しました。なお、価格競争が長期化する懸念から、期中に全株売却しました。
- ・MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK (インドネシア、小売)：インドネシアにおいて、衣料品、アクセサリ、バッグ、靴、化粧品などを販売する百貨店を運営しています。米国長期金利上昇と米ドル上昇に伴う海外からの投資資金流出の影響を受けたことに加え、業績面でも想定を若干下回り、株価が下落しました。業績の先行きに対する確信度が低下したため、一部保有ウェイトの売却を実施しました。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・アセアン諸国の経済見通しですが、実体経済の改善が予想されます。アセアン諸国にとって重要な貿易相手国である中国が回復軌道にあることや、政府主導のインフラ政策や景気刺激策の効果が顕在化することが期待できます。また、中長期的には、若年層の構成が高く労働力人口が豊富な人口動態を背景に、構造的に個人消費やインフラ投資の増加が期待され、高い経済成長が期待できます。
- ・アセアン株式市況は、米国での政策金利引き上げなど、当地域にとっての懸念は概ね相場に織り込まれていると考えられます。米国での新たな政策動向が短期的な相場のかく乱要因となる可能性もありますが、中長期的にはアセアン域内での高い経済成長を背景に、株式市況は堅調に推移すると予想しています。

◎今後の運用方針

- ・このような見通しを背景に、安定して成長を遂げる企業群に着目したファンド運用を行う方針です。引き続き、消費、インフラ関連銘柄を中心とした銘柄選別に注力し、運用方針に即した銘柄への投資を継続します。
- ・独自開発のスクリーニングモデルを活用しつつ、財務分析などの定量調査、企業訪問をはじめとする定性調査を実施し、コンセプトとしている将来にわたって安定して事業が成長すると見込まれる銘柄の選定を行うことで、中長期的な値上がり益の獲得をめざす方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年6月11日～2016年12月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	円 20 (20)	% 0.223 (0.223)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式)	7 (7)	0.073 (0.073)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	19 (19) (0)	0.215 (0.214) (0.001)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	46	0.511	
期中の平均基準価額は、9,050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6月11日～2016年12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 12	千アメリカドル 70	百株 16	千アメリカドル 97
	シンガポール	7,036	千シンガポールドル 628	7,045	千シンガポールドル 1,072
	マレーシア	13,711	千マレーシアリンギット 2,258	10,479	千マレーシアリンギット 3,159
	タイ	12,426	千タイバーツ 28,893	15,100	千タイバーツ 35,517
	フィリピン	8,638	千フィリピンペソ 27,675	3,669	千フィリピンペソ 24,036
	インドネシア	57,320 (4,464)	千インドネシアルピア 16,187,390 (-)	94,113 (0.19)	千インドネシアルピア 19,262,858 (8)

(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。

○株式売買比率

(2016年6月11日～2016年12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	874,333千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,053,677千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.82

(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6月11日～2016年12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	$\frac{D}{C}$ %
株式	388	61	15.7	485	58	12.0
為替直物取引	117	1	0.9	212	—	—

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	2,426千円
うち利害関係人への支払額 (B)	358千円
(B) / (A)	14.8%

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モルガン・スタンレー証券です。

○組入資産の明細

(2016年12月12日現在)

外国株式

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	31	27	148	17,147		資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	31	27	148	17,147	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<1.6%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	673	506	468	37,770		銀行
CAPITALAND LTD	948	876	271	21,890		不動産
DBS GROUP HOLDINGS LTD	269	186	331	26,733		銀行
KEPPEL CORP LTD	368	608	360	29,063		資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	822	852	322	26,029		電気通信サービス
FIRST RESOURCES LTD	861	—	—	—		食品・飲料・タバコ
RAFFLES MEDICAL GROUP LTD	2,720	2,594	377	30,424		ヘルスケア機器・サービス
SHENG SIONG GROUP LTD	2,992	2,839	286	23,114		食品・生活必需品小売り
SINGAPORE O&G LTD	2,959	1,985	227	18,321		ヘルスケア機器・サービス
JUMBO GROUP LTD	5,538	4,084	255	20,575		消費者サービス
SECURA GROUP LTD	—	3,611	72	5,821		商業・専門サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	18,150	18,141	2,974	239,744	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	10	—	<22.6%>	
(マレーシア)			千マレーシアリンギット			
DIGI.COM BHD	1,929	—	—	—		電気通信サービス
KPJ HEALTHCARE BERHAD	1,968	1,222	512	13,368		ヘルスケア機器・サービス
HAP SENG CONSOLIDATED	1,156	1,099	868	22,668		資本財
GENTING PLANTATIONS BHD	893	852	915	23,891		食品・飲料・タバコ
MY EG SERVICES BHD	1,786	3,902	897	23,432		ソフトウェア・サービス
DIALOG GROUP BHD	6,040	5,654	865	22,586		資本財
KAREX BHD	2,337	—	—	—		家庭用品・パーソナル用品
QL RESOURCES BHD	2,306	2,306	1,014	26,492		食品・飲料・タバコ
BERMAZ AUTO BHD	3,955	—	—	—		小売
INARI AMERTRON BHD	3,275	3,082	1,017	26,557		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
V. S. INDUSTRY BERHAD	—	4,175	580	15,152		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIONG NAM LOGISTICS HOLDINGS	—	1,656	264	6,918		運輸
SALUTICA BHD	—	4,929	606	15,829		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小 計	株 数 ・ 金 額	25,646	28,877	7,541	196,898	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	10	—	<18.6%>	
(タイ)			千タイバート			
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	841	—	—	—		不動産
CP ALL PCL-NVDR	1,742	1,240	7,440	24,105		食品・生活必需品小売り
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	575	529	7,935	25,709		銀行
PTT PCL-NVDR	334	316	11,660	37,779		エネルギー
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	154	106	4,176	13,531		運輸
THAI OIL PCL-NVDR	—	419	3,037	9,842		エネルギー
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	2,145	1,407	5,172	16,760		消費者サービス
MK RESTAURANTS GROUP - NVDR	—	562	3,259	10,561		消費者サービス
NAMYONG TERMINAL PCL-NVDR	2,031	—	—	—		運輸
ROBINSON DEPT STORE-NVDR	1,263	486	3,159	10,235		小売
CHULARAT HOSPITAL PCL-NVDR	24,968	24,554	7,267	23,548		ヘルスケア機器・サービス
EASTERN WATER RESOURCES-NVDR	4,268	—	—	—		公益事業

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株数	評 価 額		
		株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(タイ)	百株	百株	千タイバーツ	千円	
CH. KARNCHANG PUBLIC CO-NVDR	—	1,621	5,146	16,675	資本財
ASIA SERMIJ LEASING-NVDR	—	2,709	6,041	19,573	各種金融
FORTH SMART SERVICE PCL-NVDR	—	1,698	3,243	10,507	ソフトウェア・サービス
小 計	株数・金額	38,321	67,539	218,829	
	銘柄数<比率>	10	12	<20.6%>	
(フィリピン)			千フィリピンペソ		
AYALA LAND INC	3,280	2,535	8,859	20,554	不動産
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	—	911	6,824	15,833	運輸
JOLLIBEE FOODS CORP	544	759	16,478	38,231	消費者サービス
JG SUMMIT HOLDINGS INC	1,045	—	—	—	資本財
GLOBE TELECOM INC	30	—	—	—	電気通信サービス
GT CAPITAL HOLDINGS INC	65	76	9,701	22,507	各種金融
NICKEL ASIA CORP	—	5,384	4,199	9,742	素材
ROBINSONS RETAIL HOLDINGS IN	1,176	1,444	10,671	24,758	食品・生活必需品小売り
小 計	株数・金額	6,141	11,109	56,736	131,628
	銘柄数<比率>	6	6	—	<12.4%>
(インドネシア)			千インドネシアルピア		
KALBE FARMA TBK PT	18,597	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	4,090	4,154	4,766,715	41,470	銀行
UNILEVER INDONESIA TBK PT	917	821	3,403,045	29,606	家庭用品・パーソナル用品
PAKUWON JATI TBK PT	42,224	45,247	2,918,431	25,390	不動産
NIPPON INDOSARI CORPINDO TBK	16,782	11,683	1,764,133	15,347	食品・飲料・タバコ
BUMI SERPONG DAMAI PT	15,840	—	—	—	不動産
MATAHARI PUTRA PRIMA TBK PT	—	12,639	2,148,630	18,693	食品・生活必需品小売り
MITRA ADIPERKASA TBK PT	—	5,581	2,874,215	25,005	小売
CIPUTRA DEVELOPMENT TBK PT	—	13,401	1,896,241	16,497	不動産
ACE HARDWARE INDONESIA	21,618	—	—	—	小売
SELAMAT SEMPURNA PT	3,778	—	—	—	自動車・自動車部品
WIJAYA KARYA PERSERO TBK PT	—	9,732	2,442,732	21,251	資本財
MALINDO FEEDMILL TBK PT	4,465	—	—	—	食品・飲料・タバコ
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	7,290	—	—	—	資本財
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	1,675	1,689	2,601,060	22,629	小売
小 計	株数・金額	137,276	104,947	24,815,203	215,892
	銘柄数<比率>	11	9	—	<20.4%>
(ベトナム)			千ベトナムドン		
GEMADEPT CORP	500	750	2,017,500	10,289	運輸
GEMADEPT CORP-NEW	250	—	—	—	運輸
小 計	株数・金額	750	750	2,017,500	10,289
	銘柄数<比率>	2	1	—	<1.0%>
合 計	株数・金額	226,315	199,499	—	1,030,430
	銘柄数<比率>	50	49	—	<97.1%>

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

(注) 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。

○投資信託財産の構成

(2016年12月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	1,030,430	94.9
コール・ローン等、その他	55,060	5.1
投資信託財産総額	1,085,490	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(1,053,998千円)の投資信託財産総額(1,085,490千円)に対する比率は97.1%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=115.47円	1 シンガポールドル=80.61円	1 マレーシアリングギット=26.11円	1 タイバーツ=3.24円
1 フィリピンペソ=2.32円	100 インドネシアルピア=0.87円	100 ベトナムドン=0.51円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年12月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,092,017,575
コール・ローン等	42,595,697
株式(評価額)	1,030,430,482
未収入金	17,520,660
未収配当金	1,470,736
(B) 負債	31,323,620
未払金	6,560,367
未払解約金	24,763,209
未払利息	44
(C) 純資産総額(A-B)	1,060,693,955
元本	1,117,750,982
次期繰越損益金	△ 57,057,027
(D) 受益権総口数	1,117,750,982口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,490円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,249,200,159円
期中追加設定元本額 75,678,487円
期中一部解約元本額 207,127,664円
また、1口当たり純資産額は、期末0.9490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)

アセアン真成長株式ファンド	785,396,085円
アセアン真成長株式ファンド(ラップ向け)	247,003,224円
アドバンスト・バランスⅠ(FOF s用)(適格機関投資家限定)	13,431,667円
アドバンスト・バランスⅡ(FOF s用)(適格機関投資家限定)	71,920,006円
合計	1,117,750,982円

③純資産総額が元本額を下回っており、その差額は57,057,027円です。

○損益の状況 (2016年6月11日~2016年12月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	9,182,585
受取配当金	9,188,840
受取利息	120
支払利息	△ 6,375
(B) 有価証券売買損益	43,971,056
売買益	111,945,880
売買損	△ 67,974,824
(C) 保管費用等	△ 2,344,572
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	50,809,069
(E) 前期繰越損益金	△ 121,337,090
(F) 追加信託差損益金	△ 7,188,083
(G) 解約差損益金	20,659,077
(H) 計(D+E+F+G)	△ 57,057,027
次期繰越損益金(H)	△ 57,057,027

- (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。

【お 知 ら せ】

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

(2016年7月1日)

好配当海外株マザーファンド

《第10期》決算日2016年10月25日

[計算期間：2015年10月27日～2016年10月25日]

「好配当海外株マザーファンド」は、10月25日に第10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10期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として、わが国を除く世界主要国の株式等の中から、配当利回りが高い銘柄および配当成長性が高いと判断される銘柄に投資し、高水準の配当収入と中長期的な株価値上がり益の獲得をめざして運用を行います。投資にあたっては、世界を北米、欧州およびアジア・オセアニアの3地域に分け、地域毎の配当利回りの水準、配当成長性の水準および流動性等を勘案し、投資配分を決定します。銘柄選定にあたっては、地域毎に配当利回りが高い銘柄および配当成長性が高いと判断される銘柄の中から流動性等を勘案して調査対象銘柄を決定し、減配リスク等をチェックし、組入銘柄を選定します。株式の組入比率は高位を基本とします。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	わが国を除く世界主要国の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合に制限を設けません。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		(参考指数) MSCI-KOKUSAI インデックス(円換算ベース)		株組入比率	株先物比率	純資産額
	期騰	期中落率	期騰	期中落率			
	円	%		%	%	%	百万円
6期(2012年10月25日)	6,931	13.1	104,759.05	13.8	98.3	—	6,637
7期(2013年10月25日)	10,212	47.3	156,821.88	49.7	99.4	—	7,841
8期(2014年10月27日)	11,556	13.2	182,386.54	16.3	98.7	—	7,254
9期(2015年10月26日)	12,187	5.5	208,059.28	14.1	98.9	—	6,657
10期(2016年10月25日)	10,517	△13.7	179,195.86	△13.9	99.0	—	6,203

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(注) MSCI-KOKUSAI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インデックス(円換算ベース)は、MSCI KOKUSAIインデックス(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インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

(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		(参 考 指 数) MSCI-KOKUSAI インデックス(円換算ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年10月26日	円 12,187	% —	208,059.28	% —	% 98.9	% —
10月末	12,026	△ 1.3	207,645.27	△ 0.2	98.7	—
11月末	12,097	△ 0.7	209,783.19	0.8	98.4	—
12月末	11,837	△ 2.9	204,372.20	△ 1.8	95.7	—
2016年1月末	10,982	△ 9.9	186,165.06	△10.5	95.8	—
2月末	10,456	△14.2	178,016.52	△14.4	97.3	—
3月末	11,170	△ 8.3	188,074.19	△ 9.6	97.2	—
4月末	10,961	△10.1	186,578.18	△10.3	98.3	—
5月末	11,061	△ 9.2	187,789.14	△ 9.7	98.4	—
6月末	9,898	△18.8	169,593.00	△18.5	97.6	—
7月末	10,466	△14.1	180,064.15	△13.5	99.0	—
8月末	10,378	△14.8	179,227.37	△13.9	98.5	—
9月末	10,306	△15.4	174,773.28	△16.0	97.7	—
(期 末) 2016年10月25日	10,517	△13.7	179,195.86	△13.9	99.0	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

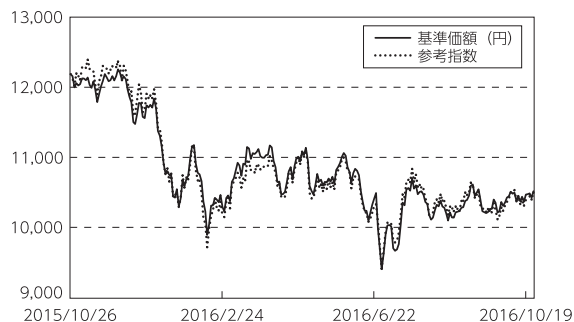
○運用経過

●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13.7%の下落となりました。

基準価額の推移



(注) 参考指数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

◎海外株式市況

- ・2015年10月下旬から2016年2月中旬にかけては、原油をはじめとする資源価格の下落により関連銘柄が大きく調整したことや欧州を中心に金融機関に対する信用不安が再燃したことを受けて市況は大きく調整しました。
- ・2月下旬以降は、6月下旬に行われた英国の国民投票にてEU（欧州連合）離脱派が多数を占めたことによる経済の先行き不透明感から一時的に調整する局面もありましたが、資源価格の下落が落ち着き、業績への警戒感が薄れた関連銘柄を中心に上昇に転じたことなどを背景として株式市況は回復しました。
- ・為替市況は、期首に比べて13.7%の円高・ドル安、14.9%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
 - ・世界を北米、欧州およびアジア・オセアニアの3地域に分け、地域毎の配当利回りの水準、配当成長性の水準および流動性等を勘案し、地域別配分を決定しています。期末時点においては各地域概ね均等の配分としております。
 - ・組入銘柄については地域毎に配当利回りが高い銘柄および配当成長性が高いと判断される銘柄の中から流動性等を勘案して調査対象銘柄を決定し、減配リスク等をチェックし選定しています。組入銘柄数については配当の水準や成長性を勘案して絞り込みを進めた結果、期首の134銘柄から減少し期末は110銘柄となりました。

前記の投資行動の結果、米ドルなどの主要通貨が対円で下落したことなどにより、基準価額は下落しました。パフォーマンスに寄与・影響した主な銘柄は以下の通りです。

(プラス要因)

◎銘柄

- ・PACKAGING CORP OF AMERICA (アメリカ、素材)：米国を拠点とする包装用資材メーカー。電子商取引の拡大によって主力とする段ボールや包装紙の需要拡大が見込まれることから、期を通じて保有しました。当期においては、業界全体で統合・再編が進んだことで需要と供給のバランスが安定化し、製品価格の引き上げが行われたことによる業績回復への期待感が株価の押し上げ要因となりました。

(マイナス要因)

◎銘柄

- ・GAMESTOP CORP—CLASS A (アメリカ、小売)：世界的なゲーム用品チェーン店です。新世代のゲーム機が普及し主力ビジネスであるゲームソフト販売が活性化することを期待して期首より組み入れを行ってきました。しかし、高速ブロードバンド回線の普及などによって顧客が直接

ゲームソフトをインターネット経由でダウンロードして購入する流れが強まり、業績が期待通りに伸びなかったことで株価が低迷しました。なお、このような構造的変化を背景とした業績への不透明感から期中に全株売却しました。

◎今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・米国では2016年中にFRB（米連邦準備制度理事会）が2015年12月の1回目以降、2回目の政策金利引き上げを模索しています。しかし、米国の経済成長は構造的な潜在成長率の低下によって緩やかなものにとどまり、利上げのペースは緩慢なものにならざるを得ないとみています。欧州ではECB（欧州中央銀行）の金融緩和政策による下支えは期待できるものの、引き続きイタリア、スペインなどの不良債権問題が燻っており、経済の先行きに対する不透明感を払拭するには至っておりません。中国においても経済指標は一進一退を繰り返し、力強い経済成長とは程遠い状況であり、金融緩和的な政策運営が続くとみています。このような環境下、引き続き配当の水準や成長性、持続性を定量面だけではなく定性面からも個別企業調査を実施し、クオリティの高い銘柄群に投資することで将来的な配当収入の最大化や中長期的な値上がり益の獲得をめざします。

◎今後の運用方針

- ・高水準の配当収入と中長期的な株価値上がり益の獲得をめざして運用を行います。株式の組入比率については運用の基本方針にしたがい、高位（90%以上）を維持する方針です。
- ・地域別配分および銘柄選択に際しては運用の基本方針に則り、配当利回り、配当成長性、流動性等を勘案して決定します。また、個別銘柄選定にあたっては減配リスク等のチェックを行い、配当実現の確度に留意した運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年10月27日～2016年10月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	円 66 (66)	% 0.599 (0.599)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式)	16 (16)	0.147 (0.147)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	11 (11) (0)	0.101 (0.101) (0.000)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	93	0.847	
期中の平均基準価額は、10,969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10月27日～2016年10月25日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 10,421 (91)	千アメリカドル 37,662 (-)	百株 9,827	千アメリカドル 37,248
	カナダ	3,623	千カナダドル 15,727	3,832	千カナダドル 15,471
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	1,192	2,151	1,229	2,018
	イタリア	7,721 (-)	2,406 (△ 1)	6,550	1,222
	フランス	3,991	5,593	3,519	5,727
	オランダ	850	1,524	691	902
	スペイン	8,647 (1,158)	2,779 (23)	9,504 (550)	3,304 (18)
	ベルギー	116	562	183	707
	フィンランド	1,078	2,498	1,110	2,027
	イギリス	14,153 (325)	千イギリスポンド 6,969 (△ 3)	16,944	千イギリスポンド 6,738
	スイス	281 (-)	千スイスフラン 1,448 (△ 16)	148	千スイスフラン 283
	スウェーデン	1,425	千スウェーデンクローネ 17,241	1,232	千スウェーデンクローネ 13,321
	ノルウェー	935 (-)	千ノルウェークローネ 13,879 (△ 166)	565	千ノルウェークローネ 8,920
	デンマーク	367	千デンマーククローネ 5,395	277	千デンマーククローネ 3,834
	オーストラリア	38,823	千オーストラリアドル 27,057	33,115 (7)	千オーストラリアドル 26,400 (3)
	ニュージーランド	1,686	千ニュージーランドドル 1,120	1,565	千ニュージーランドドル 973
	香港	35,956 (95)	千香港ドル 79,584 (-)	49,240	千香港ドル 72,220
シンガポール	21,166	千シンガポールドル 6,961	20,730	千シンガポールドル 6,999	

(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。

○株式売買比率

(2015年10月27日～2016年10月25日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	26,085,169千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,391,114千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	4.08

(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10月27日～2016年10月25日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$	%
株式	百万円 13,426	百万円 467	3.5	百万円 12,658	百万円 590	4.7
為替直物取引	3,754	2,166	57.7	3,253	1,693	52.0

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)	39,261千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1,641千円
(B) / (A)	4.2%

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

○組入資産の明細

(2016年10月25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		
CME GROUP INC	—	57	590	61,667	各種金融	
DOMINION RESOURCES INC/VA	47	82	599	62,650	公益事業	
DOW CHEMICAL CO/THE	74	76	412	43,073	素材	
DARDEN RESTAURANTS INC	112	91	576	60,198	消費者サービス	
DTE ENERGY COMPANY	83	—	—	—	公益事業	
EATON CORP PLC	—	130	823	86,079	資本財	
NEXTERA ENERGY INC	51	50	621	64,982	公益事業	
MACY'S INC	—	112	410	42,879	小売	
FORD MOTOR CO	468	—	—	—	自動車・自動車部品	
HP INC	—	560	782	81,744	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
INTERNATIONAL PAPER CO	125	—	—	—	素材	
LAS VEGAS SANDS CORP	40	—	—	—	消費者サービス	
LOCKHEED MARTIN CORP	34	36	835	87,330	資本財	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	91	—	—	—	銀行	
OMNICOM GROUP	48	—	—	—	メディア	
PACKAGING CORP OF AMERICA	54	97	801	83,760	素材	
ALTRIA GROUP INC	90	127	824	86,190	食品・飲料・タバコ	
PINNACLE WEST CAPITAL	51	—	—	—	公益事業	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	—	151	800	83,623	保険	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	120	—	—	—	公益事業	
AT&T INC	—	212	781	81,651	電気通信サービス	
WESTERN DIGITAL CORP	—	76	406	42,501	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SCANA CORP	—	58	410	42,913	公益事業	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	33	—	—	—	運輸	
WEC ENERGY GROUP INC	97	107	618	64,622	公益事業	
WELLS FARGO & CO	—	156	710	74,199	銀行	
WASTE MANAGEMENT INC	98	—	—	—	商業・専門サービス	
XCEL ENERGY INC	144	98	393	41,164	公益事業	
CISCO SYSTEMS INC	186	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STAPLES INC	—	540	407	42,544	小売	
PAYCHEX INC	102	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	44	105	423	44,291	半導体・半導体製造装置	
AMEREN CORPORATION	119	116	564	58,967	公益事業	
AMERICAN ELECTRIC POWER	90	94	592	61,908	公益事業	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	92	—	—	—	保険	
REYNOLDS AMERICAN INC	147	111	611	63,907	食品・飲料・タバコ	
ALLIANT ENERGY CORP	—	120	447	46,794	公益事業	
GAMESTOP CORP-CLASS A	116	—	—	—	小売	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	37	—	—	—	素材	
CMS ENERGY CORP	—	142	587	61,397	公益事業	
ABBVIE INC	128	102	623	65,141	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株 数	金 額	2,921	3,606	15,658	1,636,188
	銘柄 数 < 比 率 >		29	26	—	< 26.4% >
(カナダ)			千カナダドル			
ROYAL BANK OF CANADA	59	63	527	41,295	銀行	
THOMSON REUTERS CORP	85	—	—	—	各種金融	

銘柄	株数	当 期		末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
TRANSCANADA CORP	102	87	538	42,156		エネルギー
SUN LIFE FINANCIAL INC	201	239	1,064	83,257		保険
BCE INC	—	88	537	42,083		電気通信サービス
AGRIUM INC	37	—	—	—		素材
BANK OF MONTREAL	—	119	1,026	80,302		銀行
CI FINANCIAL CORP	141	—	—	—		各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	—	53	534	41,777		銀行
ENBRIDGE INC	161	—	—	—		エネルギー
POWER CORP OF CANADA	152	—	—	—		保険
SUNCOR ENERGY INC	120	—	—	—		エネルギー
FORTIS INC	—	126	546	42,730		公益事業
TORONTO-DOMINION BANK	83	157	944	73,889		銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	1,141	932	5,720	447,492	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	8	—	< 7.2% >	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	41	—	—	—		自動車・自動車部品
ALLIANZ SE-REG	27	38	544	61,804		保険
HUGO BOSS AG -ORD	22	—	—	—		耐久消費財・アパレル
HANNOVER RUECK SE	—	52	526	59,839		保険
AXEL SPRINGER SE	36	—	—	—		メディア
小 計	株 数 ・ 金 額	127	90	1,070	121,644	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	2	—	< 2.0% >	
(ユーロ…イタリア)						
SNAM SPA	—	1,402	672	76,352		公益事業
TERNA SPA	—	1,609	706	80,241		公益事業
UNIPOLSAI SPA	1,840	—	—	—		保険
小 計	株 数 ・ 金 額	1,840	3,011	1,378	156,594	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	2	—	< 2.5% >	
(ユーロ…フランス)						
AXA SA	109	252	526	59,763		保険
SOCIETE GENERALE SA	83	—	—	—		銀行
TOTAL SA	58	—	—	—		エネルギー
BNP PARIBAS	87	99	521	59,257		銀行
ORANGE	248	—	—	—		電気通信サービス
LAGARDERE SCA	102	—	—	—		メディア
BOUYGUES SA	—	122	363	41,341		資本財
CREDIT AGRICOLE SA	332	—	—	—		銀行
ENGIE	92	—	—	—		公益事業
SCOR SE	—	182	545	62,004		保険
NATIXIS	—	1,205	553	62,872		銀行
EDENRED	274	—	—	—		商業・専門サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	1,387	1,860	2,510	285,239	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	5	—	< 4.6% >	
(ユーロ…オランダ)						
NN GROUP NV	95	254	707	80,373		保険
小 計	株 数 ・ 金 額	95	254	707	80,373	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 1.3% >	
(ユーロ…スペイン)						
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	85	—	—	—		資本財
TELEFONICA SA	129	—	—	—		電気通信サービス
REPSOL SA	157	—	—	—		エネルギー
GAS NATURAL SDG SA	75	—	—	—		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…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
MAPPRE SA	1,170	1,460	386	43,918	保険
ENAGAS SA	235	273	706	80,307	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	80	355	684	77,752	公益事業
CAIXABANK S.A	404	—	—	—	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	2,337	2,088	1,777	201,978
	銘柄 数 < 比 率 >	8	3	—	< 3.3% >
(ユーロ…ベルギー)					
AGEAS	169	—	—	—	保険
KBC GROEP NV	—	102	547	62,223	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	169	102	547	62,223
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 1.0% >
(ユーロ…フィンランド)					
STORA ENSO OYJ-R SHS	250	—	—	—	素材
NOKIAN RENKAAT OYJ	96	—	—	—	自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ	96	257	487	55,412	素材
METSO OYJ	46	—	—	—	資本財
ELISA OYJ	108	113	362	41,164	電気通信サービス
ORION OYJ-CLASS B	—	194	717	81,542	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	596	564	1,567	178,118
	銘柄 数 < 比 率 >	5	3	—	< 2.9% >
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	6,554	7,970	9,561	1,086,173
	銘柄 数 < 比 率 >	29	17	—	< 17.5% >
(イギリス)					
NEXT PLC	32	—	—	—	小売
BAE SYSTEMS PLC	516	859	463	59,267	資本財
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,864	1,575	330	42,259	保険
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	68	130	608	77,710	食品・飲料・タバコ
IMPERIAL BRANDS PLC	84	—	—	—	食品・飲料・タバコ
AVIVA PLC	796	740	329	42,103	保険
NATIONAL GRID PLC	374	371	389	49,710	公益事業
PERSIMMON PLC	—	173	296	37,930	耐久消費財・アパレル
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	—	128	306	39,136	耐久消費財・アパレル
AMEC FOSTER WHEELER PLC	166	—	—	—	エネルギー
TAYLOR WIMPEY PLC	2,100	—	—	—	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	262	—	—	—	エネルギー
OLD MUTUAL PLC	1,000	—	—	—	保険
INVESTEC PLC	597	—	—	—	各種金融
ADMIRAL GROUP PLC	—	290	567	72,513	保険
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	825	1,303	458	58,535	保険
ROYAL MAIL PLC	—	650	319	40,761	運輸
小 計	株 数 ・ 金 額	8,685	6,219	4,069	519,929
	銘柄 数 < 比 率 >	13	10	—	< 8.4% >
(スイス)					
SWISS RE AG	—	85	778	81,792	保険
SWISS PRIME SITE-REG	—	48	393	41,342	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	—	133	1,171	123,135
	銘柄 数 < 比 率 >	—	2	—	< 2.0% >
(スウェーデン)					
SWEDBANK AB - A SHARES	71	200	4,114	48,174	銀行
SKANSKA AB-B SHS	186	250	5,155	60,365	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	257	450	9,269	108,539
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 1.7% >

銘柄	株数	期首(前期末)			当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェークロネ	千円			
TELENOR ASA	114	240	3,321	42,018	電気通信サービス		
YARA INTERNATIONAL ASA	55	—	—	—	素材		
MARINE HARVEST	—	426	6,334	80,132	食品・飲料・タバコ		
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	126	—	—	—	保険		
小 計	株 数 ・ 金 額	295	666	9,656	122,151		
	銘柄 数 < 比 率 >	3	2	—	<2.0%>		
(デンマーク)			千デンマーククローネ				
DANSKE BANK A/S	96	186	3,915	59,786	銀行		
小 計	株 数 ・ 金 額	96	186	3,915	59,786		
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<1.0%>		
(オーストラリア)			千オーストラリアドル				
WOODSIDE PETROLEUM LTD	—	146	423	33,619	エネルギー		
AUST AND NZ BANKING GROUP	213	—	—	—	銀行		
QBE INSURANCE GROUP LTD	618	—	—	—	保険		
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	—	110	824	65,444	銀行		
WESTPAC BANKING CORP	169	266	813	64,585	銀行		
WESTPAC BANKING CORP-RTS	7	—	—	—	銀行		
BRAMBLES LTD	480	—	—	—	商業・専門サービス		
QANTAS AIRWAYS LTD	—	1,120	361	28,739	運輸		
BORAL LTD	645	1,266	841	66,854	素材		
WOOLWORTHS LTD	147	—	—	—	食品・生活必需品小売り		
TELSTRA CORP LTD	—	1,499	757	60,122	電気通信サービス		
AMP LTD	797	—	—	—	各種金融		
TABCORP HOLDINGS LTD	1,451	—	—	—	消費者サービス		
AMCOR LIMITED	345	388	581	46,196	素材		
COMPUTERSHARE LTD	319	—	—	—	ソフトウェア・サービス		
MACQUARIE GROUP LTD	160	52	434	34,470	各種金融		
CIMIC GROUP LTD	248	126	385	30,603	資本財		
COCA-COLA AMATIL LTD	—	750	708	56,281	食品・飲料・タバコ		
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	—	1,486	780	61,987	小売		
SONIC HEALTHCARE LTD	246	247	524	41,621	ヘルスケア機器・サービス		
WESFARMERS LTD	130	82	366	29,119	食品・生活必需品小売り		
CHALLENGER LTD	—	811	841	66,795	各種金融		
CALTEX AUSTRALIA LTD	130	204	634	50,350	エネルギー		
AGL ENERGY LTD	220	—	—	—	公益事業		
TATTS GROUP LTD	1,160	—	—	—	消費者サービス		
AUSNET SERVICES	4,700	4,899	727	57,775	公益事業		
CROWN RESORTS LTD	575	464	492	39,111	消費者サービス		
INCITEC PIVOT LTD	830	1,500	432	34,305	素材		
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	335	—	—	—	銀行		
AURIZON HOLDINGS LTD	740	1,223	590	46,922	運輸		
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	96	—	—	—	消費者サービス		
BANK OF QUEENSLAND LTD	263	—	—	—	銀行		
HEALTHSCOPE LTD	—	1,833	410	32,615	ヘルスケア機器・サービス		
MEDIBANK PRIVATE LTD	—	2,877	756	60,097	保険		
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	630	—	—	—	各種金融		
小 計	株 数 ・ 金 額	15,655	21,356	12,688	1,007,621		
	銘柄 数 < 比 率 >	26	21	—	<16.2%>		
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル				
SPARK NEW ZEALAND LTD	2,262	2,152	764	56,926	電気通信サービス		

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株数	評 価 額		
		株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(ニュージーランド)		百株	百株	千円	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,090	1,320	900	67,097	運輸
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,352 2	3,473 2	1,664 -	124,024 <2.0%>
(香港)			千香港ドル		
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	-	210	2,077	27,989	資本財
SUN HUNG KAI PROPERTIES	-	390	4,485	60,412	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	6,330	-	-	-	不動産
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	105	-	-	-	各種金融
CLP HOLDINGS LTD	-	610	4,861	65,487	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	-	1,085	4,991	67,228	不動産
HANG SENG BANK LTD	-	260	3,718	50,081	銀行
HYSAN DEVELOPMENT CO	1,000	1,370	4,979	67,079	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	-	425	3,023	40,731	半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO	3,100	-	-	-	不動産
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	1,200	-	-	-	耐久消費財・アパレル
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	730	-	-	-	公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,120	1,950	5,489	73,940	銀行
PCCW LTD	8,490	4,600	2,180	29,369	電気通信サービス
NWS HOLDINGS LTD	-	3,030	4,078	54,935	資本財
WHEELOCK & CO LTD	700	-	-	-	不動産
WYNN MACAU LTD	-	1,816	2,190	29,500	消費者サービス
FIRST PACIFIC CO	5,200	-	-	-	各種金融
SWIRE PROPERTIES LTD	1,820	-	-	-	不動産
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	-	860	4,768	64,234	不動産
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	29,795 11	16,606 12	46,844 -	630,992 <10.2%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	-	908	345	25,860	メディア
CAPITALAND LTD	2,030	2,639	836	62,700	不動産
DBS GROUP HOLDINGS LTD	295	517	781	58,588	銀行
KEPPEL CORP LTD	380	-	-	-	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	239	-	-	-	銀行
SINGAPORE TECH ENGINEERING	-	1,169	372	27,949	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,456	1,013	397	29,762	電気通信サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	-	534	389	29,176	各種金融
SEBACORP MARINE LTD	960	-	-	-	資本財
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,710	2,176	585	43,871	運輸
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,450	-	-	-	食品・飲料・タバコ
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,520 8	8,956 7	3,707 -	277,910 <4.5%>
合 計	株数・金額 銘柄数<比率>	77,273 134	70,554 110	-	6,143,944 <99.0%>

(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。

○投資信託財産の構成

(2016年10月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 6,143,944	% 96.3
コール・ローン等、その他	234,631	3.7
投資信託財産総額	6,378,575	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (6,183,040千円) の投資信託財産総額 (6,378,575千円) に対する比率は96.9%です。

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

1 アメリカドル=104.49円	1 カナダドル=78.23円	1 ユーロ=113.60円	1 イギリスポンド=127.77円
1 スイスフラン=105.10円	1 スウェーデンクローネ=11.71円	1 ノルウェークローネ=12.65円	1 デンマーククローネ=15.27円
1 オーストラリアドル=79.41円	1 ニュージーランドドル=74.50円	1 香港ドル=13.47円	1 シンガポールドル=74.95円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年10月25日現在)

○損益の状況 (2015年10月27日～2016年10月25日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,411,203,033
コール・ローン等	109,539,500
株式(評価額)	6,143,944,807
未収入金	151,863,372
未収配当金	5,855,354
(B) 負債	207,988,154
未払金	199,479,984
未払解約金	8,508,131
未払利息	39
(C) 純資産総額(A-B)	6,203,214,879
元本	5,898,223,015
次期繰越損益金	304,991,864
(D) 受益権総口数	5,898,223,015口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,517円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	254,463,018
受取配当金	252,256,495
受取利息	137,782
その他収益金	2,085,324
支払利息	△ 16,583
(B) 有価証券売買損益	△1,199,207,876
売買益	689,595,277
売買損	△1,888,803,153
(C) 保管費用等	△ 6,625,716
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 951,370,574
(E) 前期繰越損益金	1,194,534,365
(F) 追加信託差損益金	119,734,861
(G) 解約差損益金	△ 57,906,788
(H) 計(D+E+F+G)	304,991,864
次期繰越損益金(H)	304,991,864

<注記事項>

- ①期首元本額 5,462,710,562円
 期中追加設定元本額 1,309,197,355円
 期中一部解約元本額 873,684,902円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0517円です。

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

三菱UFJ バランスインカム・グローバル(毎月決算型)	1,737,367,962円
好配当海外株ファンド(ラップ向け)	1,106,735,073円
世界の好配当利回り株ファンド(毎月決算型)	14,658,724円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	85,903,903円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	502,818,557円
MUAM 好配当海外株ファンド2010-11(適格機関投資家限定)	2,450,738,796円
合計	5,898,223,015円

- (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。

【お 知 ら せ】

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

外国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]

「外国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	シティ世界国債インデックス（除く日本、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。投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）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。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	シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国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、円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
11期(2012年5月14日)	13,365	2.3	74,734.13	2.1	98.7	—	158,535
12期(2013年5月13日)	17,815	33.3	99,491.98	33.1	98.8	—	195,142
13期(2014年5月12日)	18,707	5.0	104,415.94	4.9	98.8	—	185,030
14期(2015年5月12日)	20,959	12.0	117,169.90	12.2	98.8	—	159,683
15期(2016年5月12日)	19,674	△ 6.1	109,931.94	△ 6.2	98.9	—	156,155

(注) シティ世界国債インデックス（除く日本）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。シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、シティ世界国債インデックス（除く日本）をもとに、委託会社が計算したものです。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、 円換算ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年5月12日	円	%	117,169.90	%	%	%
5月末	20,959	—	119,576.28	—	98.8	—
6月末	21,469	2.4	117,821.48	2.1	97.3	—
7月末	21,143	0.9	119,513.99	0.6	98.7	—
8月末	21,435	2.3	119,513.99	2.0	98.8	—
9月末	21,102	0.7	117,759.56	0.5	98.1	—
10月末	21,048	0.4	117,295.48	0.1	98.8	—
11月末	21,064	0.5	117,390.65	0.2	98.7	—
12月末	21,049	0.4	117,622.76	0.4	98.9	—
2016年1月末	20,757	△1.0	115,735.90	△1.2	98.5	—
2月末	21,077	0.6	117,720.03	0.5	97.9	—
3月末	20,000	△4.6	111,665.52	△4.7	98.9	—
4月末	20,359	△2.9	113,814.57	△2.9	101.9	—
5月末	19,703	△6.0	109,994.30	△6.1	98.9	—
(期 末) 2016年5月12日	19,674	△6.1	109,931.94	△6.2	98.9	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

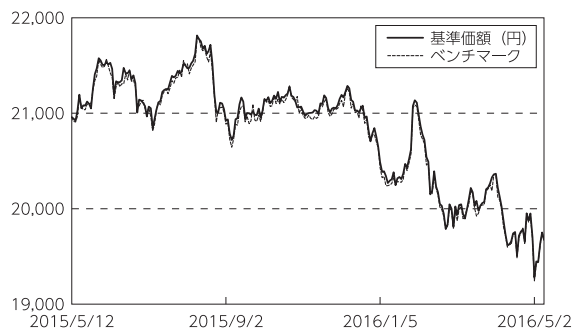
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.1%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−6.2%)を0.1%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

◎債券市況

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

◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、FRB（米連邦準備制度理事会）による政策金利の引き上げが意識されて米ドルが対円で上昇する局面もありましたが、世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に米ドルが対円で売られました。期首との比較では、米ドルは対円で9.8%下落しました。
- ・円・ユーロ相場は、ユーロ圏の景況感の改善などを背景に上昇する局面もありましたが、ECB（欧州中央銀行）が緩和的な金融政策を維持したことなどを背景に、ユーロが対円で売られました。期首との比較では、ユーロは対円で7.5%下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債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。
- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは6.2%の下落となったため、乖離は0.1%程度となりました。

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

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は△0.0%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は△0.0%程度でした。

- ・カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.1%程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。

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

○今後の運用方針

- ・今後の運用についても、運用方針を堅持します。
- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 3	% 0.016	(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)	(3)	(0.016)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	3	0.016	
期中の平均基準価額は、20,850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
外 国	アメリカ	千アメリカドル 250,628	千アメリカドル 207,257
	カナダ	千カナダドル 14,520	千カナダドル 14,197
	メキシコ	千メキシコペソ 82,266	千メキシコペソ 53,859
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 32,612	30,597
	イタリア	国債証券 35,318	27,766
	フランス	国債証券 37,473	27,713
	オランダ	国債証券 8,541	8,739
	スペイン	国債証券 22,125	16,940
	ベルギー	国債証券 8,489	6,442
	オーストリア	国債証券 6,661	5,956
	フィンランド	国債証券 2,703	1,945
	アイルランド	国債証券 2,113	1,069
	イギリス	国債証券 千イギリスポンド 21,088	千イギリスポンド 17,009
	スイス	国債証券 千スイスフラン 488	千スイスフラン 412
	スウェーデン	国債証券 千スウェーデンクローネ 17,764	千スウェーデンクローネ 13,804
	ノルウェー	国債証券 千ノルウェークローネ 9,603	千ノルウェークローネ 3,207
	デンマーク	国債証券 千デンマーククローネ 16,771	千デンマーククローネ 15,452
	ポーランド	国債証券 千ポーランドズロチ 13,057	千ポーランドズロチ 8,331
	オーストラリア	国債証券 千オーストラリアドル 12,624	千オーストラリアドル 7,616
シンガポール	国債証券 千シンガポールドル 2,291	千シンガポールドル 2,103	
マレーシア	国債証券 千マレーシアリンギット 7,692	千マレーシアリンギット 6,702	
南アフリカ	国債証券 千南アフリカランド 28,054	千南アフリカランド 13,988	

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月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 34,058	百万円 1,659	% 4.9	百万円 27,994	百万円 1,524	% 5.4

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)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額		うちBB格以下 組入比率	5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 577,850	千アメリカドル 606,327	千円 65,707,749	% 42.1	% —	% 17.5	% 16.2	% 8.4
カナダ	千カナダドル 33,700	千カナダドル 38,093	3,212,411	2.1	—	1.0	0.6	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 219,600	千メキシコペソ 243,999	1,471,314	0.9	—	0.6	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	77,700	93,979	11,635,561	7.5	—	4.4	2.0	1.0
イタリア	104,600	124,581	15,424,452	9.9	—	6.2	2.8	0.9
フランス	101,500	123,991	15,351,399	9.8	—	6.1	2.8	0.9
オランダ	25,100	30,364	3,759,462	2.4	—	1.5	0.6	0.3
スペイン	58,700	69,178	8,564,969	5.5	—	3.1	1.7	0.7
ベルギー	25,900	32,740	4,053,611	2.6	—	1.9	0.5	0.2
オーストリア	15,950	19,540	2,419,359	1.5	—	1.0	0.4	0.2
フィンランド	6,800	7,768	961,757	0.6	—	0.4	0.2	0.1
アイルランド	8,700	10,254	1,269,585	0.8	—	0.4	0.4	0.0
イギリス	千イギリスポンド 63,885	千イギリスポンド 78,380	12,268,091	7.9	—	5.7	1.7	0.5
スイス	千スイスフラン 3,200	千スイスフラン 3,813	425,649	0.3	—	0.1	0.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 50,300	千スウェーデンクローネ 58,286	776,956	0.5	—	0.3	0.2	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 33,000	千ノルウェークローネ 35,935	477,220	0.3	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 49,500	千デンマーククローネ 63,757	1,060,921	0.7	—	0.5	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 30,900	千ポーランドズロチ 32,499	909,011	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 31,350	千オーストラリアドル 34,943	2,792,339	1.8	—	1.1	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 6,440	千シンガポールドル 6,808	539,944	0.3	—	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 26,250	千マレーシアリンギット 26,441	713,120	0.5	—	0.2	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 102,750	千南アフリカランド 92,584	667,536	0.4	—	0.3	0.1	0.0
合 計	—	—	154,462,427	98.9	—	52.9	31.5	14.5

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	0.5 T-NOTE 170731	0.5	2,800	2,795	302,985	2017/7/31
		0.625 T-NOTE 170531	0.625	3,800	3,801	411,982	2017/5/31
		0.625 T-NOTE 170630	0.625	2,100	2,100	227,639	2017/6/30
		0.625 T-NOTE 170731	0.625	3,500	3,500	379,295	2017/7/31
		0.625 T-NOTE 170831	0.625	6,400	6,398	693,378	2017/8/31
		0.625 T-NOTE 170930	0.625	5,400	5,397	584,900	2017/9/30
		0.625 T-NOTE 171130	0.625	2,800	2,797	303,151	2017/11/30
		0.625 T-NOTE 180430	0.625	2,400	2,395	259,580	2018/4/30
		0.75 T-NOTE 170630	0.75	2,700	2,704	293,079	2017/6/30
		0.75 T-NOTE 171031	0.75	5,500	5,505	596,663	2017/10/31
		0.75 T-NOTE 171231	0.75	3,100	3,101	336,156	2017/12/31
		0.75 T-NOTE 180131	0.75	2,000	2,001	216,900	2018/1/31
		0.75 T-NOTE 180228	0.75	4,000	4,002	433,767	2018/2/28
		0.75 T-NOTE 180331	0.75	2,900	2,901	314,481	2018/3/31
		0.75 T-NOTE 180415	0.75	1,800	1,800	195,165	2018/4/15
		0.75 T-NOTE 190215	0.75	3,000	2,992	324,309	2019/2/15
		0.875 T-NOTE 170430	0.875	3,800	3,812	413,141	2017/4/30
		0.875 T-NOTE 170515	0.875	2,800	2,809	304,419	2017/5/15
		0.875 T-NOTE 170615	0.875	2,700	2,708	293,501	2017/6/15
		0.875 T-NOTE 170715	0.875	1,800	1,805	195,660	2017/7/15
		0.875 T-NOTE 170815	0.875	1,600	1,604	173,913	2017/8/15
		0.875 T-NOTE 171015	0.875	1,800	1,805	195,637	2017/10/15
		0.875 T-NOTE 171115	0.875	2,300	2,306	249,961	2017/11/15
		0.875 T-NOTE 171130	0.875	2,100	2,105	228,190	2017/11/30
		0.875 T-NOTE 180115	0.875	1,400	1,403	152,138	2018/1/15
		0.875 T-NOTE 180131	0.875	2,300	2,306	249,981	2018/1/31
		0.875 T-NOTE 180331	0.875	400	401	43,474	2018/3/31
		0.875 T-NOTE 180715	0.875	2,200	2,205	239,000	2018/7/15
		0.875 T-NOTE 181015	0.875	3,600	3,606	390,878	2018/10/15
		0.875 T-NOTE 190415	0.875	2,800	2,800	303,518	2019/4/15
		0.875 T-NOTE 190731	0.875	900	899	97,456	2019/7/31
		1 T-NOTE 170915	1.0	3,600	3,616	391,945	2017/9/15
		1 T-NOTE 171215	1.0	3,600	3,617	391,975	2017/12/15
		1 T-NOTE 171231	1.0	2,200	2,210	239,559	2017/12/31
		1 T-NOTE 180215	1.0	1,600	1,608	174,265	2018/2/15
		1 T-NOTE 180315	1.0	2,100	2,111	228,777	2018/3/15
		1 T-NOTE 180515	1.0	2,200	2,211	239,652	2018/5/15
		1 T-NOTE 180531	1.0	2,700	2,714	294,153	2018/5/31
		1 T-NOTE 180815	1.0	3,000	3,015	326,773	2018/8/15
		1 T-NOTE 180915	1.0	2,600	2,613	283,225	2018/9/15
		1 T-NOTE 190315	1.0	1,500	1,506	163,221	2019/3/15
		1 T-NOTE 190630	1.0	2,000	2,007	217,527	2019/6/30
		1 T-NOTE 190831	1.0	1,000	1,002	108,628	2019/8/31
		1 T-NOTE 190930	1.0	1,800	1,803	195,492	2019/9/30
		1 T-NOTE 191130	1.0	1,800	1,801	195,233	2019/11/30
		1.125 T-NOTE 180615	1.125	2,200	2,217	240,304	2018/6/15

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ	国債証券					
	1.125 T-NOTE 190115	1.125	1,800	1,814	196,597	2019/1/15
	1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,600	1,612	174,733	2019/5/31
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	2,600	2,612	283,104	2019/12/31
	1.125 T-NOTE 200331	1.125	2,000	2,007	217,501	2020/3/31
	1.125 T-NOTE 200430	1.125	2,700	2,708	293,490	2020/4/30
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	3,300	3,292	356,754	2021/2/28
	1.25 T-NOTE 181031	1.25	2,400	2,426	262,953	2018/10/31
	1.25 T-NOTE 181115	1.25	3,100	3,134	339,634	2018/11/15
	1.25 T-NOTE 181130	1.25	2,500	2,527	273,909	2018/11/30
	1.25 T-NOTE 181215	1.25	2,000	2,022	219,169	2018/12/15
	1.25 T-NOTE 190131	1.25	2,400	2,426	262,993	2019/1/31
	1.25 T-NOTE 190430	1.25	1,500	1,517	164,421	2019/4/30
	1.25 T-NOTE 191031	1.25	2,800	2,828	306,529	2019/10/31
	1.25 T-NOTE 200131	1.25	3,500	3,530	382,554	2020/1/31
	1.25 T-NOTE 200229	1.25	1,800	1,814	196,673	2020/2/29
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	2,300	2,305	249,854	2021/3/31
	1.375 T-NOTE 180630	1.375	1,600	1,621	175,728	2018/6/30
	1.375 T-NOTE 180731	1.375	2,000	2,027	219,669	2018/7/31
	1.375 T-NOTE 180930	1.375	2,500	2,535	274,777	2018/9/30
	1.375 T-NOTE 181130	1.375	1,200	1,217	131,898	2018/11/30
	1.375 T-NOTE 181231	1.375	2,000	2,029	219,931	2018/12/31
	1.375 T-NOTE 190228	1.375	2,100	2,131	230,963	2019/2/28
	1.375 T-NOTE 200131	1.375	2,300	2,330	252,600	2020/1/31
	1.375 T-NOTE 200229	1.375	2,800	2,835	307,252	2020/2/29
	1.375 T-NOTE 200331	1.375	2,800	2,834	307,205	2020/3/31
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	3,700	3,744	405,793	2020/4/30
	1.375 T-NOTE 200531	1.375	2,400	2,428	263,196	2020/5/31
	1.375 T-NOTE 200831	1.375	3,100	3,132	339,463	2020/8/31
	1.375 T-NOTE 200930	1.375	3,500	3,534	383,058	2020/9/30
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	2,500	2,524	273,528	2020/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	3,500	3,530	382,584	2021/1/31
	1.5 T-NOTE 180831	1.5	3,600	3,660	396,715	2018/8/31
	1.5 T-NOTE 181231	1.5	2,900	2,951	319,846	2018/12/31
	1.5 T-NOTE 190131	1.5	2,900	2,952	319,920	2019/1/31
	1.5 T-NOTE 190228	1.5	2,600	2,647	286,890	2019/2/28
	1.5 T-NOTE 190331	1.5	1,000	1,018	110,389	2019/3/31
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	2,800	2,852	309,137	2019/5/31
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	3,100	3,156	342,062	2019/10/31
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	3,100	3,155	342,009	2019/11/30
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	3,200	3,252	352,473	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	3,500	3,530	382,643	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	2,400	2,400	260,169	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	2,200	2,199	238,376	2023/3/31
	1.625 T-NOTE 190331	1.625	3,000	3,065	332,247	2019/3/31
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	2,100	2,146	232,626	2019/4/30
	1.625 T-NOTE 190630	1.625	2,600	2,659	288,189	2019/6/30
	1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,700	1,738	188,431	2019/7/31

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	1.625 T-NOTE 190831	1.625	3,100	3,170	343,584	2019/8/31
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	2,700	2,759	299,091	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 200630	1.625	3,000	3,063	331,967	2020/6/30
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	3,800	3,879	420,460	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	3,700	3,777	409,395	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,700	1,721	186,546	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	2,900	2,931	317,661	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	5,500	5,445	590,074	2026/2/15
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	500	511	55,465	2018/10/31
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	2,800	2,875	311,590	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	3,500	3,590	389,103	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	2,700	2,769	300,165	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	2,700	2,758	298,976	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	2,600	2,655	287,793	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	2,800	2,858	309,765	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	2,500	2,551	276,555	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	2,300	2,342	253,827	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	2,500	2,541	275,475	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	4,300	4,372	473,891	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 170831	1.875	1,900	1,930	209,176	2017/8/31
	1.875 T-NOTE 170930	1.875	1,700	1,728	187,294	2017/9/30
	1.875 T-NOTE 171031	1.875	2,500	2,543	275,655	2017/10/31
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	1,800	1,857	201,245	2020/6/30
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,800	2,885	312,657	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	2,900	2,980	323,013	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	2,200	2,257	244,690	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	3,700	3,795	411,337	2022/10/31
	2 T-NOTE 200731	2.0	1,400	1,450	157,229	2020/7/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	1,600	1,659	179,840	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	1,300	1,348	146,097	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	2,400	2,489	269,800	2021/2/28
	2 T-NOTE 210531	2.0	2,200	2,282	247,391	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	2,400	2,489	269,800	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	2,500	2,592	280,915	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2.0	3,900	4,044	438,327	2021/11/15
	2 T-NOTE 220215	2.0	2,900	3,006	325,812	2022/2/15
	2 T-NOTE 220731	2.0	2,100	2,172	235,399	2022/7/31
	2 T-NOTE 221130	2.0	2,500	2,583	279,920	2022/11/30
	2 T-NOTE 230215	2.0	4,400	4,548	492,958	2023/2/15
	2 T-NOTE 250215	2.0	5,700	5,849	633,923	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	5,900	6,045	655,167	2025/8/15
	2.125 T-NOTE 200831	2.125	3,000	3,124	338,647	2020/8/31
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	2,300	2,398	259,961	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	2,300	2,401	260,233	2021/6/30
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	3,300	3,444	373,322	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	2,500	2,608	282,735	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,800	2,921	316,640	2021/12/31

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	2.125 T-NOTE 220630	2.125	2,600	2,708	293,538	2022/6/30
	2.125 T-NOTE 221231	2.125	2,700	2,811	304,668	2022/12/31
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	5,800	6,008	651,134	2025/5/15
	2.25 T-NOTE 171130	2.25	2,600	2,663	288,596	2017/11/30
	2.25 T-NOTE 180731	2.25	800	826	89,547	2018/7/31
	2.25 T-NOTE 210331	2.25	2,000	2,099	227,509	2021/3/31
	2.25 T-NOTE 210430	2.25	2,800	2,939	318,536	2021/4/30
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	2,300	2,415	261,733	2021/7/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	5,900	6,179	669,703	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	6,300	6,588	714,040	2025/11/15
	2.375 T-NOTE 170731	2.375	2,900	2,961	320,914	2017/7/31
	2.375 T-NOTE 180531	2.375	1,300	1,343	145,553	2018/5/31
	2.375 T-NOTE 180630	2.375	1,000	1,034	112,120	2018/6/30
	2.375 T-NOTE 201231	2.375	1,500	1,580	171,305	2020/12/31
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	5,900	6,239	676,197	2024/8/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	3,400	3,343	362,297	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	3,400	3,343	362,355	2046/2/15
	2.5 T-NOTE 170630	2.5	2,400	2,451	265,645	2017/6/30
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	3,700	3,952	428,347	2023/8/15
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	5,800	6,195	671,365	2024/5/15
	2.625 T-NOTE 180131	2.625	1,500	1,549	167,882	2018/1/31
	2.625 T-NOTE 180430	2.625	1,500	1,556	168,638	2018/4/30
	2.625 T-NOTE 200815	2.625	2,500	2,655	287,815	2020/8/15
	2.625 T-NOTE 201115	2.625	4,200	4,469	484,330	2020/11/15
	2.75 T-BOND 420815	2.75	2,100	2,192	237,604	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	3,400	3,543	384,031	2042/11/15
	2.75 T-NOTE 170531	2.75	1,100	1,124	121,898	2017/5/31
	2.75 T-NOTE 171231	2.75	1,700	1,756	190,374	2017/12/31
	2.75 T-NOTE 180228	2.75	1,500	1,554	168,441	2018/2/28
	2.75 T-NOTE 190215	2.75	1,300	1,368	148,337	2019/2/15
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	5,800	6,302	683,052	2023/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	4,400	4,781	518,215	2024/2/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	4,200	4,472	484,667	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	3,400	3,609	391,141	2045/8/15
	2.875 T-NOTE 180331	2.875	1,400	1,456	157,863	2018/3/31
	3 T-BOND 420515	3.0	1,500	1,642	178,010	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	3,300	3,592	389,359	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	3,900	4,244	459,987	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	3,200	3,481	377,317	2045/11/15
	3.125 T-BOND 411115	3.125	1,100	1,234	133,828	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	1,500	1,683	182,391	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	3,500	3,914	424,188	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	3,200	3,571	386,989	2044/8/15
	3.125 T-NOTE 170430	3.125	2,100	2,151	233,204	2017/4/30
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	2,700	2,882	312,406	2019/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	2,200	2,402	260,392	2021/5/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	3,900	4,559	494,063	2044/5/15

銘柄	銘柄	利 率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	3.375 T-NOTE 191115	3.375	3,300	3,575	387,460	2019/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	1,000	1,201	130,255	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 180215	3.5	1,600	1,678	181,865	2018/2/15
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	2,400	2,629	284,918	2020/5/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	4,500	5,512	597,427	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	3,600	4,404	477,363	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	1,700	1,848	200,363	2019/8/15
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	4,700	5,158	558,999	2020/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	3,700	4,115	445,984	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,300	1,615	175,066	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	3,600	4,510	488,823	2043/11/15
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	2,800	3,006	325,790	2018/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	1,400	1,771	191,958	2040/8/15
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	1,400	1,489	161,419	2018/5/15
	4 T-NOTE 180815	4.0	900	967	104,855	2018/8/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	800	1,068	115,820	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	1,400	1,870	202,745	2040/11/15
	4.25 T-NOTE 171115	4.25	1,500	1,580	171,273	2017/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	500	681	73,860	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	1,300	1,765	191,323	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	1,300	1,765	191,367	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,700	2,316	251,055	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	1,300	1,797	194,845	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	800	1,108	120,134	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	1,100	1,520	164,775	2039/8/15
	4.5 T-NOTE 170515	4.5	1,100	1,143	123,900	2017/5/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	1,800	2,529	274,159	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	1,600	2,292	248,478	2041/2/15
	4.75 T-NOTE 170815	4.75	2,400	2,524	273,569	2017/8/15
	5 T-BOND 370515	5.0	600	884	95,856	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	900	1,235	133,925	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	700	964	104,560	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	1,100	1,582	171,443	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815	5.5	600	837	90,751	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	700	971	105,319	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	650	939	101,800	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	600	797	86,403	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	700	1,070	116,040	2030/5/15
	6.5 T-BOND 261115	6.5	500	728	78,902	2026/11/15
	8 T-BOND 211115	8.0	1,200	1,629	176,616	2021/11/15
	8.125 T-BOND 190815	8.125	600	738	80,053	2019/8/15
	8.75 T-BOND 170515	8.75	1,500	1,624	176,041	2017/5/15
	8.75 T-BOND 200815	8.75	700	922	99,997	2020/8/15
	8.875 T-BOND 190215	8.875	1,000	1,221	132,325	2019/2/15
小	計				65,707,749	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.25 CAN GOVT 170501	0.25	800	797	67,281	2017/5/1

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		
		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
カナダ							
	国債証券	0.25 CAN GOVT 171101	0.25	1,100	1,095	92,378	2017/11/1
		0.25 CAN GOVT 180501	0.25	800	795	67,092	2018/5/1
		0.75 CAN GOVT 200901	0.75	1,300	1,307	110,228	2020/9/1
		0.75 CAN GOVT 210301	0.75	1,300	1,304	110,023	2021/3/1
		0.75 CAN GOVT 210901	0.75	400	400	33,735	2021/9/1
		1.25 CAN GOVT 170801	1.25	1,500	1,513	127,592	2017/8/1
		1.25 CAN GOVT 180201	1.25	1,600	1,619	136,580	2018/2/1
		1.25 CAN GOVT 180301	1.25	900	911	76,891	2018/3/1
		1.25 CAN GOVT 180901	1.25	1,100	1,118	94,311	2018/9/1
		1.5 CAN GOVT 170901	1.5	1,100	1,113	93,924	2017/9/1
		1.5 CAN GOVT 200301	1.5	700	723	61,043	2020/3/1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	1,200	1,243	104,873	2023/6/1
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	1,100	1,120	94,530	2026/6/1
		1.75 CAN GOVT 190301	1.75	900	930	78,492	2019/3/1
		1.75 CAN GOVT 190901	1.75	900	934	78,833	2019/9/1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,100	1,199	101,154	2025/6/1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,350	1,496	126,196	2024/6/1
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	1,200	1,334	112,507	2022/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	650	769	64,888	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	350	439	37,051	2064/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	1,000	1,126	94,968	2021/6/1
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	1,200	1,338	112,863	2020/6/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,400	1,882	158,734	2045/12/1
		3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,600	1,753	147,889	2019/6/1
		4 CAN GOVT 170601	4.0	950	984	83,025	2017/6/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	1,500	2,096	176,821	2041/6/1
		4.25 CAN GOVT 180601	4.25	1,100	1,183	99,808	2018/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	1,150	1,754	147,985	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	950	1,413	119,164	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,200	1,887	159,180	2033/6/1
		8 CAN GOVT 270601	8.0	300	502	42,355	2027/6/1
小	計					3,212,411	
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	22,400	28,726	173,220	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	5,200	7,219	43,533	2036/11/20
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	17,700	17,787	107,258	2018/6/14
		5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	9,700	9,794	59,061	2017/6/15
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	12,700	12,658	76,330	2019/12/11
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	5,200	5,134	30,962	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	20,900	21,925	132,209	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	9,700	10,160	61,265	2022/6/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	7,700	8,575	51,707	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	14,300	15,120	91,179	2017/12/14
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	12,200	13,782	83,108	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	7,400	8,367	50,453	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	12,800	14,575	87,888	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	10,900	12,025	72,513	2020/6/11

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		
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
国債証券	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	8,200	9,328	56,252	2023/12/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	23,400	25,565	154,162	2018/12/13	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	9,100	10,924	65,875	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	10,100	12,326	74,331	2038/11/18	
小 計					1,471,314		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 OBL 200417	—	1,700	1,732	214,455	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	1,200	1,222	151,409	2021/4/9
		0 SCHATS 170616	—	1,400	1,407	174,287	2017/6/16
		0 SCHATS 170915	—	1,300	1,309	162,071	2017/9/15
		0 SCHATS 171215	—	1,100	1,108	137,294	2017/12/15
		0 SCHATS 180316	—	900	908	112,482	2018/3/16
		0.25 OBL 180413	0.25	1,500	1,522	188,491	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	1,800	1,847	228,696	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	1,600	1,649	204,236	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	2,200	2,298	284,543	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	1,500	1,554	192,447	2026/2/15
		0.5 OBL 171013	0.5	1,300	1,318	163,262	2017/10/13
		0.5 OBL 180223	0.5	1,900	1,934	239,532	2018/2/23
		0.5 OBL 190412	0.5	1,400	1,442	178,560	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	1,700	1,852	229,314	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	2,000	2,174	269,212	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	1,300	1,348	166,940	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,400	1,460	180,778	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	1,500	1,671	206,988	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,600	1,790	221,709	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,500	1,683	208,427	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,700	1,921	237,902	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	2,100	2,367	293,112	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,600	1,837	227,453	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	2,100	2,380	294,698	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	1,600	1,859	230,187	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	1,400	1,566	193,908	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,300	1,483	183,647	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,700	1,933	239,428	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,550	2,208	273,436	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,300	1,876	232,319	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,800	2,061	255,216	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	2,100	2,390	295,920	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,700	2,021	250,257	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	1,300	2,056	254,635	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	2,000	2,254	279,092	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	2,300	2,562	317,254	2019/1/4
		4 BUND 180104	4.0	1,700	1,827	226,273	2018/1/4
		4 BUND 370104	4.0	2,200	3,620	448,272	2037/1/4
		4.25 BUND 170704	4.25	1,500	1,581	195,855	2017/7/4
		4.25 BUND 180704	4.25	1,900	2,095	259,445	2018/7/4

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	4.25 BUND 390704	4.25	1,000	1,752	216,933	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	1,150	1,773	219,538	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,850	3,190	394,971	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,600	3,016	373,430	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,400	2,414	298,914	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,350	2,194	271,708	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	900	1,345	166,608	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	900	1,617	200,237	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	900	1,532	189,758	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	1,900	1,911	236,638	2018/5/15
		0.3 ITALY GOVT 181015	0.3	700	705	87,299	2018/10/15
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	900	912	112,961	2020/11/1
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	1,200	1,222	151,313	2020/5/1
		0.75 ITALY GOVT 180115	0.75	1,500	1,520	188,259	2018/1/15
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	600	601	74,468	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	1,900	1,961	242,848	2019/12/1
		1.15 ITALY GOVT 170515	1.15	1,200	1,215	150,436	2017/5/15
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,800	1,869	231,404	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	1,500	1,561	193,329	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,300	1,358	168,220	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,900	1,920	237,732	2025/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,300	1,238	153,339	2032/3/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,300	1,361	168,558	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,500	1,627	201,491	2021/12/15
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	550	541	67,016	2036/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,200	1,286	159,254	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	2,200	2,411	298,557	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	900	897	111,089	2047/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,200	1,340	165,954	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 171101	3.5	1,500	1,578	195,465	2017/11/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	2,300	2,466	305,365	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,600	1,742	215,776	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	2,000	2,381	294,865	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	2,000	2,317	286,892	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,400	1,625	201,258	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,600	3,034	375,648	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,800	2,149	266,148	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	2,000	2,316	286,843	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,300	2,894	358,359	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	2,300	2,565	317,596	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	2,600	2,953	365,685	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	2,400	2,770	342,978	2020/3/1
4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	2,200	2,372	293,736	2018/2/1		
4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	2,200	2,420	299,661	2018/8/1		
4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	2,000	2,250	278,646	2019/3/1		
4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	2,400	2,785	344,835	2020/2/1		
4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,400	1,737	215,081	2023/5/1		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,200	2,746	340,055	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,600	2,036	252,186	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 170501	4.75	1,300	1,361	168,558	2017/5/1
		4.75 ITALY GOVT 170601	4.75	1,200	1,261	156,134	2017/6/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	2,300	2,807	347,624	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	2,100	2,652	328,368	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	2,000	2,642	327,192	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,400	1,977	244,868	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,800	2,242	277,681	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	2,400	3,122	386,614	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,100	2,956	366,055	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,700	2,437	301,845	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	2,000	2,862	354,418	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 170801	5.25	1,800	1,917	237,366	2017/8/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,500	3,486	431,632	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	2,100	2,709	335,466	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	2,000	2,587	320,321	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,350	2,027	250,991	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,650	3,997	494,949	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,450	3,653	452,347	2027/11/1
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	1,000	1,544	191,162	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,100	1,725	213,595	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O. A. T 180225	—	2,300	2,318	287,055	2018/2/25
		0 O. A. T 190225	—	500	505	62,597	2019/2/25
		0 O. A. T 200525	—	2,100	2,125	263,147	2020/5/25
		0.25 O. A. T 201125	0.25	2,000	2,044	253,129	2020/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	2,900	2,987	369,892	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	3,000	3,044	376,964	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	400	400	49,628	2026/5/25
		1 BTAN 170725	1.0	1,600	1,628	201,612	2017/7/25
		1 O. A. T 180525	1.0	2,000	2,058	254,875	2018/5/25
		1 O. A. T 181125	1.0	1,900	1,968	243,766	2018/11/25
		1 O. A. T 190525	1.0	2,000	2,085	258,143	2019/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	2,100	2,217	274,535	2025/11/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	600	601	74,494	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	900	970	120,103	2031/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	2,700	3,028	375,003	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	2,500	2,818	348,927	2024/11/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	250	244	30,282	2066/5/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	2,600	2,985	369,676	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	3,300	3,850	476,784	2024/5/25
		2.5 O. A. T 201025	2.5	3,300	3,708	459,154	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	2,500	3,045	377,063	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	3,900	4,818	596,596	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	3,700	4,386	543,119	2022/4/25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	4,000	4,745	587,527	2021/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	1,650	2,352	291,322	2045/5/25

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	3.5 O.A.T 200425	3.5	3,200	3,685	456,254	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	3,300	4,288	530,940	2026/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	3,000	3,429	424,581	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	3,100	3,711	459,556	2021/4/25
		4 O.A.T 180425	4.0	3,200	3,479	430,739	2018/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	2,450	3,755	464,996	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,400	2,362	292,466	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	1,050	1,799	222,742	2060/4/25
		4.25 O.A.T 171025	4.25	3,400	3,634	449,957	2017/10/25
		4.25 O.A.T 181025	4.25	2,700	3,011	372,880	2018/10/25
		4.25 O.A.T 190425	4.25	2,500	2,845	352,347	2019/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	3,700	4,855	601,160	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	2,300	3,850	476,764	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	2,300	3,736	462,554	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	2,500	3,977	492,392	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	2,700	4,673	578,650	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	2,100	3,210	397,541	2025/10/25
		8.5 O.A.T 191025	8.5	1,000	1,308	161,993	2019/10/25
8.5 O.A.T 230425	8.5	900	1,433	177,472	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	900	908	112,437	2018/4/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	1,400	1,436	177,814	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,400	1,405	173,957	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	500	507	62,876	2026/7/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	1,500	1,543	191,147	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	1,500	1,569	194,350	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,400	1,582	195,954	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,400	1,620	200,573	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,400	1,611	199,516	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,100	1,413	174,991	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	1,000	1,468	181,852	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,500	1,776	219,951	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	1,300	1,513	187,389	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	400	504	62,412	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,300	2,158	267,222	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	1,300	1,427	176,726	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	1,300	1,485	183,945	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,300	2,099	259,914	2037/1/15
4.5 NETH GOVT 170715	4.5	1,300	1,376	170,417	2017/7/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,200	1,897	234,974	2028/1/15		
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	700	1,058	131,036	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	1,600	1,610	199,344	2018/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25	400	402	49,860	2019/1/31
		0.5 SPAIN GOVT 171031	0.5	1,600	1,613	199,809	2017/10/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	200	202	25,019	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	1,600	1,654	204,860	2020/7/30
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	2,200	2,296	284,339	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,800	1,825	226,033	2025/4/30

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,100	1,135	140,535	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	750	740	91,682	2030/7/30
		2.1 SPAIN GOVT 170430	2.1	1,400	1,430	177,104	2017/4/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	1,900	2,004	248,141	2025/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,900	2,051	253,975	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,500	2,774	343,448	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	500	503	62,285	2046/10/31
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	1,700	1,859	230,177	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,900	2,261	279,969	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	2,000	2,292	283,834	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	1,800	1,966	243,416	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,500	1,901	235,412	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	2,000	2,286	283,042	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,600	1,978	244,985	2023/10/31
		4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	2,200	2,372	293,777	2018/1/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,700	1,944	240,733	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,700	2,161	267,642	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,250	1,702	210,794	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,500	1,901	235,440	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,600	1,914	237,091	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,200	1,672	207,079	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	1,500	2,034	251,922	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	1,150	1,680	208,104	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	2,000	2,587	320,407	2023/1/31
5.5 SPAIN GOVT 170730	5.5	1,900	2,029	251,329	2017/7/30		
5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	2,100	2,617	324,078	2021/4/30		
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,650	2,454	303,865	2032/7/30		
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	2,100	2,716	336,363	2022/1/31		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,200	1,678	207,829	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	2,000	2,917	361,228	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,500	1,556	192,688	2025/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	600	627	77,740	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	100	99	12,365	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	1,100	1,140	141,202	2018/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	350	349	43,294	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	250	276	34,208	2038/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,200	1,388	171,957	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,400	1,668	206,588	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	1,300	1,450	179,551	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	750	978	121,151	2034/6/22
		3.5 BEL GOVT 170628	3.5	1,300	1,358	168,203	2017/6/28
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,600	1,887	233,634	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	800	1,229	152,212	2045/6/22
		4 BEL GOVT 180328	4.0	1,000	1,084	134,271	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	1,100	1,242	153,780	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,300	1,619	200,450	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	800	1,152	142,718	2032/3/28

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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,500	1,860	230,388	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,500	1,915	237,167	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,450	2,333	288,908	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	900	1,256	155,532	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,800	2,978	368,718	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 170928	5.5	600	649	80,436	2017/9/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,700	2,636	326,439	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	700	715	88,595	2019/10/18
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	300	307	38,032	2026/10/20
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	600	623	77,186	2018/10/19
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	800	863	106,947	2025/10/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	1,000	1,124	139,205	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	800	904	111,934	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	600	643	79,731	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	500	618	76,539	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	650	946	117,201	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	900	1,106	137,013	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,350	1,620	200,588	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	800	981	121,576	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	300	539	66,747	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	1,200	1,414	175,166	2020/7/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,050	1,655	204,906	2037/3/15
		4.3 AUSTRIA GOVT 170915	4.3	700	744	92,235	2017/9/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	1,000	1,136	140,672	2019/3/15
4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	1,200	1,303	161,408	2018/1/15		
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	800	1,147	142,054	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	700	1,143	141,613	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	500	514	63,703	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	400	403	49,947	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	300	297	36,881	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	300	314	38,998	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	300	311	38,532	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	400	441	54,696	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	500	554	68,615	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	400	458	56,813	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	400	547	67,825	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	500	626	77,622	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	500	573	70,967	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	500	592	73,363	2021/4/15
		3.875 FINNISH GOVT170915	3.875	600	635	78,672	2017/9/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	600	803	99,520	2025/7/4
		4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	600	691	85,596	2019/7/4
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	500	517	64,059	2022/3/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	400	405	50,172	2026/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	450	467	57,884	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	700	799	98,956	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	700	849	105,161	2024/3/18

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	
アイルランド	国債証券	3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	500	617	76,502	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	700	800	99,138	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	750	838	103,763	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	1,000	1,180	146,139	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	800	977	121,051	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,100	1,533	189,897	2025/3/13
		5.5 IRISH GOVT 171018	5.5	500	542	67,120	2017/10/18
		5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	600	724	89,737	2019/10/18
小 計						63,440,158	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	1 GILT 170907	1.0	2,600	2,621	410,329	2017/9/7	
	1.25 GILT 180722	1.25	2,600	2,649	414,724	2018/7/22	
	1.5 GILT 210122	1.5	1,900	1,960	306,874	2021/1/22	
	1.5 GILT 260722	1.5	500	498	78,083	2026/7/22	
	1.75 GILT 190722	1.75	2,100	2,180	341,231	2019/7/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	2,200	2,301	360,218	2022/9/7	
	2 GILT 200722	2.0	2,500	2,633	412,156	2020/7/22	
	2 GILT 250907	2.0	2,000	2,105	329,615	2025/9/7	
	2.25 GILT 230907	2.25	2,000	2,153	337,003	2023/9/7	
	2.5 GILT 650722	2.5	350	392	61,492	2065/7/22	
	2.75 GILT 240907	2.75	2,100	2,341	366,475	2024/9/7	
	3.25 GILT 440122	3.25	2,200	2,642	413,539	2044/1/22	
	3.5 GILT 450122	3.5	2,150	2,705	423,491	2045/1/22	
	3.5 GILT 680722	3.5	1,750	2,524	395,128	2068/7/22	
	3.75 GILT 190907	3.75	1,800	1,994	312,149	2019/9/7	
	3.75 GILT 200907	3.75	1,500	1,698	265,794	2020/9/7	
	3.75 GILT 210907	3.75	1,700	1,958	306,555	2021/9/7	
	3.75 GILT 520722	3.75	1,300	1,821	285,110	2052/7/22	
	4 GILT 220307	4.0	1,300	1,532	239,857	2022/3/7	
	4 GILT 600122	4.0	1,150	1,775	277,934	2060/1/22	
	4.25 GILT 271207	4.25	1,100	1,410	220,733	2027/12/7	
	4.25 GILT 320607	4.25	1,800	2,368	370,708	2032/6/7	
	4.25 GILT 360307	4.25	1,885	2,527	395,589	2036/3/7	
	4.25 GILT 390907	4.25	1,300	1,780	278,741	2039/9/7	
	4.25 GILT 401207	4.25	1,750	2,422	379,132	2040/12/7	
	4.25 GILT 461207	4.25	1,550	2,238	350,310	2046/12/7	
	4.25 GILT 491207	4.25	1,250	1,862	291,557	2049/12/7	
	4.25 GILT 551207	4.25	1,600	2,524	395,144	2055/12/7	
	4.5 GILT 190307	4.5	1,500	1,673	261,967	2019/3/7	
	4.5 GILT 340907	4.5	2,000	2,740	428,864	2034/9/7	
	4.5 GILT 421207	4.5	1,700	2,470	386,753	2042/12/7	
	4.75 GILT 200307	4.75	1,800	2,083	326,095	2020/3/7	
	4.75 GILT 301207	4.75	1,600	2,192	343,242	2030/12/7	
4.75 GILT 381207	4.75	1,350	1,963	307,307	2038/12/7		
5 GILT 180307	5.0	1,900	2,063	323,052	2018/3/7		
5 GILT 250307	5.0	1,550	2,030	317,777	2025/3/7		
6 GILT 281207	6.0	1,100	1,652	258,662	2028/12/7		

銘	柄	当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券	8 GILT 210607	8.0	1,100	1,494	233,912	2021/6/7
		8.75 GILT 170825	8.75	350	388	60,769	2017/8/25
小 計						12,268,091	
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	320	364	40,708	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	450	508	56,751	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 180108	3.0	550	584	65,270	2018/1/8
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	490	548	61,180	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	440	578	64,623	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	500	754	84,194	2028/4/8
		4.25 SWISS GOVT 170605	4.25	450	474	52,920	2017/6/5
小 計						425,649	
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	4,300	4,419	58,918	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	6,800	7,382	98,409	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	5,500	6,469	86,240	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	7,700	9,265	123,506	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	4,000	5,400	71,990	2039/3/30
		3.75 SWD GOVT 170812	3.75	5,700	6,011	80,135	2017/8/12
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	8,100	9,185	122,437	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	8,200	10,151	135,318	2020/12/1
	小 計						776,956
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	2,030	26,959	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	3,400	3,540	47,023	2025/3/13
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	4,600	4,887	64,912	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	4,200	4,779	63,467	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	6,600	7,532	100,028	2021/5/25
		4.25 NORWE GOVT 170519	4.25	5,800	6,015	79,889	2017/5/19
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	6,400	7,149	94,940	2019/5/22
小 計						477,220	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	0.25 DMK GOVT 181115	0.25	3,000	3,048	50,728	2018/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	5,200	5,743	95,565	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	6,500	7,321	121,826	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	8,200	9,609	159,910	2021/11/15
		4 DMK GOVT 171115	4.0	4,700	5,020	83,533	2017/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	8,400	9,685	161,161	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	11,400	20,004	332,878	2039/11/15
		7 DMK GOVT 241110	7.0	2,100	3,324	55,316	2024/11/10
小 計						1,060,921	
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	2,600	2,553	71,416	2020/4/25
		1.75 POLAND 210725	1.75	1,100	1,069	29,917	2021/7/25
		2 POLAND 210425	2.0	2,400	2,377	66,486	2021/4/25
		2.5 POLAND 180725	2.5	2,200	2,241	62,681	2018/7/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	2,000	1,909	53,403	2026/7/25

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ポーランド			%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
	国債証券	3.25 POLAND 190725	3.25	1,900	1,985	55,542	2019/7/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	2,600	2,674	74,812	2025/7/25
		3.75 POLAND 180425	3.75	1,700	1,771	49,546	2018/4/25
		4 POLAND 231025	4.0	2,400	2,610	73,015	2023/10/25
		5.25 POLAND 171025	5.25	2,100	2,212	61,882	2017/10/25
		5.25 POLAND 201025	5.25	1,500	1,706	47,732	2020/10/25
		5.5 POLAND 191025	5.5	1,800	2,020	56,508	2019/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	1,400	1,647	46,081	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	2,000	2,383	66,674	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	5.75	800	1,003	28,076	2029/4/25
		POLAND 170725	—	1,200	1,179	32,991	2017/7/25
		POLAND 181025	—	1,200	1,152	32,241	2018/10/25
小	計					909,011	
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	1,100	1,100	87,904	2020/11/21
		2.75 AUST GOVT 191021	2.75	1,700	1,764	140,980	2019/10/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	2,200	2,291	183,096	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	800	825	65,998	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	500	486	38,890	2035/6/21
		3.25 AUST GOVT 181021	3.25	1,300	1,351	107,968	2018/10/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	2,300	2,484	198,553	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	800	862	68,913	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	400	411	32,883	2039/6/21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	750	839	67,052	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 170721	4.25	1,550	1,596	127,603	2017/7/21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,500	2,929	234,096	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 200415	4.5	2,100	2,326	185,907	2020/4/15
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	950	1,173	93,772	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	2,300	2,825	225,824	2027/4/21
		5.25 AUST GOVT 190315	5.25	2,200	2,422	193,582	2019/3/15
		5.5 AUST GOVT 180121	5.5	2,100	2,235	178,656	2018/1/21
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,900	2,321	185,483	2023/4/21
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,900	2,256	180,318	2021/5/15
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	2,000	2,438	194,850	2022/7/15
小	計					2,792,339	
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	600	594	47,129	2018/4/1
		1.375 SINGAPORGOV 171001	1.375	100	100	7,985	2017/10/1
		1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	150	152	12,057	2019/10/1
		2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	250	256	20,343	2020/7/1
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	600	618	49,091	2021/6/1
		2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	150	154	12,283	2025/6/1
		2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	600	624	49,498	2019/6/1
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	400	422	33,516	2023/7/1
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	450	475	37,723	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	150	157	12,462	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	150	160	12,722	2029/7/1

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
シンガポール		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
	国債証券	2.875SINGAPORGOVT 300901	400	425	33,779	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	600	646	51,259	2024/9/1
		3.125SINGAPORGOVT 220901	470	508	40,306	2022/9/1
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	400	430	34,157	2020/9/1
		3.375 SINGAPORGOVT 330901	200	227	18,050	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	470	531	42,177	2027/3/1
		4 SINGAPORGOVT 180901	300	320	25,399	2018/9/1
小	計				539,944	
マレーシア			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	3.26 MALAYSIAGOV 180301	900	903	24,360	2018/3/1
		3.314 MALAYSIA 171031	1,100	1,105	29,819	2017/10/31
		3.418MALAYSIAGOV 220815	900	879	23,730	2022/8/15
		3.48 MALAYSIAGOV 230315	1,200	1,173	31,654	2023/3/15
		3.492 MALAYSIAGOV 200331	900	899	24,256	2020/3/31
		3.502MALAYSIAGOV 270531	800	750	20,252	2027/5/31
		3.58 MALAYSIAGOV 180928	800	806	21,742	2018/9/28
		3.654 MALAYSIAGOV 191031	700	705	19,027	2019/10/31
		3.659 MALAYSIAGOV 201015	1,000	1,007	27,185	2020/10/15
		3.733 MALAYSIAGO 280615	600	572	15,435	2028/6/15
		3.759 MALAYSIAGOV 190315	450	456	12,311	2019/3/15
		3.795 MALAYSIAGOV 220930	900	898	24,244	2022/9/30
		3.8 MALAYSIAGOV 230817	200	200	5,400	2023/8/17
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	300	281	7,590	2033/4/15
		3.889 MALAYSIAGO 200731	700	710	19,154	2020/7/31
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	500	488	13,177	2027/3/15
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	1,150	1,154	31,131	2025/9/15
		4.012 MALAYSIAGOV 170915	1,500	1,520	40,997	2017/9/15
		4.048 MALAYSIA 210930	900	915	24,688	2021/9/30
		4.127 MALAYSIA 320415	700	682	18,399	2032/4/15
		4.16 MALAYSIAGOV 210715	1,200	1,228	33,138	2021/7/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	1,400	1,423	38,381	2024/7/15
		4.232MALAYSIAGOV 310630	300	301	8,128	2031/6/30
		4.24 MALAYSIAGOV 180207	1,200	1,224	33,022	2018/2/7
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	350	347	9,376	2035/5/31
		4.378MALAYSIAGOV 191129	1,900	1,960	52,866	2019/11/29
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	1,000	1,026	27,696	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	1,200	1,229	33,155	2030/4/15
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	600	619	16,699	2043/9/30
		5.248 MALAYSIA 280915	200	219	5,909	2028/9/15
		5.734MALAYSIAGOV 190730	700	748	20,186	2019/7/30
小	計				713,120	
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	15,000	16,338	117,800	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	7,350	5,129	36,980	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	7,200	4,977	35,889	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	5,700	5,267	37,981	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	8,000	6,367	45,912	2031/2/28

銘	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
南アフリカ		%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円		
	国債証券	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	5,500	5,280	38,069	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	5,000	4,701	33,899	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	4,100	4,074	29,374	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	8,500	7,491	54,016	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	5,000	5,021	36,207	2017/9/15
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	5,800	5,123	36,938	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	7,000	6,179	44,556	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	5,000	4,440	32,014	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	9,700	8,597	61,984	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	2,500	2,308	16,641	2035/2/28
		9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	1,400	1,285	9,268	2040/1/31
小	計					667,536	
合	計					154,462,427	

(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 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	154,462,427	98.7
コール・ローン等、その他	2,009,882	1.3
投資信託財産総額	156,472,309	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (156,139,125千円) の投資信託財産総額 (156,472,309千円) 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 メキシコペソ=6.03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 ポーランドズロチ=27.97円	1 オーストラリアドル=79.91円	1 シンガポールドル=79.31円
1 マレーシアリングgit=26.97円	1 南アフリカランド=7.21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	156,494,614,094
コール・ローン等	682,983,499
公社債(評価額)	154,462,427,243
未収入金	22,304,800
未収利息	1,211,101,821
前払費用	115,796,731
(B) 負債	338,964,146
未払金	312,238,067
未払解約金	26,725,867
未払利息	87
その他未払費用	125
(C) 純資産総額(A-B)	156,155,649,948
元本	79,369,567,734
次期繰越損益金	76,786,082,214
(D) 受益権総口数	79,369,567,734口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,674円

<注記事項>

- ①期首元本額 76,187,578,939円
 期中追加設定元本額 20,858,565,795円
 期中一部解約元本額 17,676,577,000円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.9674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(海外債券)	1,807,611,362円
eMAXIS 先進国債券インデックス	11,534,490,043円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,137,218,484円
eMAXIS バランス(波乗り型)	226,352,324円
コアバランス	1,700,783円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	6,437,009,006円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	16,634,896,304円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,373,592,301円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	2,212,693,687円
MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	13,634,758,617円
三菱UFJ バランスファンドVA50型(適格機関投資家限定)	9,105,298,351円
三菱UFJ バランスファンドVA75型(適格機関投資家限定)	2,745,502,453円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	650,178,523円
三菱UFJ バランスファンドVA45型(適格機関投資家限定)	218,583,584円
三菱UFJ バランスファンドVA30型(適格機関投資家限定)	80,427,144円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	2,835,690,297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)	43,989,417円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	7,156,437円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	14,999,999円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	25,991,372円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	9,528,671円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	164,114,246円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	72,157,907円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	148,729,507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	3,659,008,119
受取利息	3,659,020,893
支払利息	△ 12,774
(B) 有価証券売買損益	△13,252,708,283
売買益	3,569,021,473
売買損	△16,821,729,756
(C) 保管費用等	△ 24,140,834
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 9,617,840,998
(E) 前期繰越損益金	83,496,410,946
(F) 追加信託差損益金	22,468,546,126
(G) 解約差損益金	△19,561,033,860
(H) 計(D+E+F+G)	76,786,082,214
次期繰越損益金(H)	76,786,082,214

- (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。

三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	134,129,874円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	267,768,500円
外国債券インデックスファンドi (適格機関投資家限定)	2,079,264,410円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	2,023,133,189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)	197,198,794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)	514,854,998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)	351,395,677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)	116,981,812円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	240,934,647円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	294,341,698円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	24,926円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	24,156円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	23,736円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	15,888,517円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	2,317,658円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	6,470,155円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	954,709円
eMAXIS 最適化バランス (マイフoward)	1,152,296円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	37,163円
合計	79,369,567,734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)

新興国債券インデックスマザーファンド

《第7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]

「新興国債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第7期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第7期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、J PモルガンG B I - E Mグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債、および新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価額等が連動する債券に投資することがあります。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、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	新興国の現地通貨建て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 円	J PモルガンG B I - E M グローバル・ダイバーシファイド (円換算ベース)		債 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %	純 資 産 額 百万円
		期騰落率 %	期騰落率 %			
3期(2013年1月28日)	12,776	28.5	29,209.25	30.9	—	2,679
4期(2014年1月27日)	12,503	△2.1	28,701.99	△1.7	—	3,441
5期(2015年1月26日)	14,203	13.6	32,849.46	14.5	—	7,742
6期(2016年1月26日)	11,515	△18.9	26,826.64	△18.3	—	9,861
7期(2017年1月26日)	12,647	9.8	29,442.31	9.8	—	12,443

(注) J PモルガンG B I - E Mグローバル・ダイバーシファイドとは、J. P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ. P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。J PモルガンG B I - E Mグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)とは、J. P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているJ PモルガンG B I - E Mグローバル・ダイバーシファイド(ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。

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

(注) 「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		J P モ ル ガ ン G B I - E M グ ロー バ ル ・ ダ イ バ ー シ フ ァ イ ド (円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2016年 1 月 26 日	円	%		%	%	%
	11,515	—	26,826.64	—	95.9	—
1 月 末	12,017	4.4	27,906.59	4.0	95.9	—
2 月 末	11,489	△ 0.2	26,825.00	△ 0.0	95.3	—
3 月 末	12,390	7.6	28,931.38	7.8	94.7	—
4 月 末	12,335	7.1	28,630.48	6.7	95.3	—
5 月 末	11,944	3.7	27,810.88	3.7	93.9	—
6 月 末	11,694	1.6	27,198.29	1.4	94.9	—
7 月 末	11,832	2.8	27,623.27	3.0	95.5	—
8 月 末	11,833	2.8	27,617.06	2.9	95.1	—
9 月 末	11,781	2.3	27,583.31	2.8	94.6	—
10 月 末	12,084	4.9	28,233.03	5.2	95.1	—
11 月 末	12,089	5.0	28,136.25	4.9	95.7	—
12 月 末	12,787	11.0	29,797.09	11.1	95.0	—
(期 末) 2017年 1 月 26 日	12,647	9.8	29,442.31	9.8	96.1	—

(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

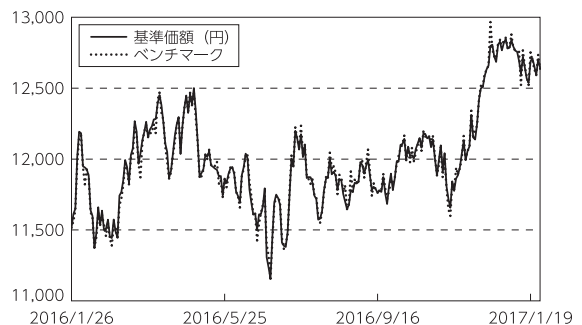
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ9.8%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(9.8%)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

◎債券市況

- ・2016年11月に行われた米国大統領選挙の結果を受けて主要国の金利が総じて上昇する局面もありましたが、利金が相応に積みあがったことなどから、新興国の現地通貨建て債券市況は期首に比べて上昇しました。

◎為替市況

- ・2016年11月に行われた米国大統領選挙の結果を受けて、ロシアルーブルなど一部の新興国通貨は対円で上昇しました。
- ・一方で、米国との関係悪化が懸念されたメキシコペソや、国内の政治的混乱などの影響によりトルコリラが対円で大きく下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるJPMORGANGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは9.8%の上昇となったため、ベンチマークとのカイ離は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	△0.4%程度	△0.2%程度	0.6%程度	0.0%程度

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は△0.4%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△0.2%程度でした。

- ・カストディーフィー、取引コスト、税金等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.6%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。
- ・新興国の現地通貨建て国際機関債、および新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価額などが連動する債券に投資することがあります。

○ 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 14	% 0.120	(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 ）	(13)	(0.109)	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 ）	(1)	(0.011)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	14	0.120	
期中の平均基準価額は、12,022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	メキシコ	千メキシコペソ 118,876	千メキシコペソ 32,510
	ブラジル	千ブラジルレアル 9,724	千ブラジルレアル 14,455
	コロンビア	千コロンビアペソ 7,438,279	千コロンビアペソ 893,708
	ペルー	千ペルーヌエボソル 2,742	千ペルーヌエボソル 804
	トルコ	千トルコリラ 13,290	千トルコリラ 3,381
	ハンガリー	千ハンガリーフォリント 537,850	千ハンガリーフォリント 718,897
	ポーランド	千ポーランドズロチ 20,331	千ポーランドズロチ 14,075
	ロシア	千ロシアルーブル 127,874	千ロシアルーブル 67,893
	ルーマニア	千ルーマニアレイ 15,263	千ルーマニアレイ 2,473
	マレーシア	千マレーシアリングギット 21,397	千マレーシアリングギット 14,417
国	タイ	千タイバーツ 106,640	千タイバーツ 94,592
	フィリピン	千フィリピンペソ 5,225	千フィリピンペソ -
	インドネシア	千インドネシアルピア 46,234,775	千インドネシアルピア 20,174,740
	南アフリカ	千南アフリカランド 49,645	千南アフリカランド 35,653

(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 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 4,201	百万円 1,359	% 32.3	百万円 2,725	百万円 599	% 22.0

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

○組入資産の明細

(2017年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	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
メキシコ	千メキシコペソ 214,300	千メキシコペソ 216,184	千円 1,160,908	% 9.3	% —	% 5.2	% 2.7	% 1.4
ブラジル	千ブラジルレアル 39,320	千ブラジルレアル 35,619	1,271,243	10.2	10.2	2.9	3.7	3.6
チリ	千チリペソ 50,000	千チリペソ 53,075	9,250	0.1	—	—	0.1	—
コロンビア	千コロンビアペソ 22,500,000	千コロンビアペソ 24,038,152	930,276	7.5	—	5.3	1.3	1.0
ペルー	千ペルーヌエボソル 6,850	千ペルーヌエボソル 7,186	246,841	2.0	—	1.8	0.2	—
トルコ	千トルコリラ 35,500	千トルコリラ 33,047	975,892	7.8	7.8	3.0	3.5	1.3
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 1,373,300	千ハンガリーフォリント 1,572,309	618,232	5.0	—	2.2	2.2	0.5
ポーランド	千ポーランドズロチ 43,200	千ポーランドズロチ 43,423	1,214,978	9.8	—	3.4	4.7	1.6
ロシア	千ロシアルーブル 402,900	千ロシアルーブル 393,458	747,570	6.0	—	3.1	2.5	0.4
ルーマニア	千ルーマニアレイ 11,300	千ルーマニアレイ 12,557	339,818	2.7	—	1.2	1.3	0.2
マレーシア	千マレーシアリンギット 41,720	千マレーシアリンギット 41,772	1,067,279	8.6	—	4.3	3.7	0.6
タイ	千タイバーツ 268,200	千タイバーツ 287,039	921,395	7.4	—	3.3	4.0	0.1
フィリピン	千フィリピンペソ 20,000	千フィリピンペソ 21,175	48,067	0.4	—	0.2	0.2	—
インドネシア	千インドネシアルピア 136,920,000	千インドネシアルピア 141,907,061	1,206,210	9.7	—	7.8	1.8	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 151,600	千南アフリカランド 139,976	1,196,797	9.6	—	8.3	1.1	0.2
合 計	—	—	11,954,762	96.1	18.1	52.1	32.8	11.2

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
	国債証券						
		10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	26,000	29,832	160,198	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	4,200	4,998	26,842	2036/11/20
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	10,100	9,836	52,819	2018/6/14
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	23,700	22,483	120,737	2019/12/11
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	5,200	4,567	24,529	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	32,200	31,288	168,019	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	9,300	8,951	48,068	2022/6/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	7,200	7,098	38,120	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	15,400	15,108	81,131	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	9,200	8,933	47,971	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	17,100	16,540	88,820	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	9,600	9,858	52,939	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	8,500	8,737	46,918	2023/12/7
		8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	21,300	21,927	117,749	2018/12/13
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	6,800	7,155	38,423	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	8,500	8,867	47,619	2038/11/18
小	計					1,160,908	
ブラジル				千ブラジルレアル	千ブラジルレアル		
	国債証券						
		10 (IN)BRAZIL NT 270101	10.0	2,220	2,134	76,189	2027/1/1
		10 (IN)BRAZIL NTN 190101	10.0	1,700	1,702	60,778	2019/1/1
		10 (IN)BRAZIL NTN 250101	10.0	3,550	3,438	122,723	2025/1/1
		10(IN)BRAZIL NTN-F210101	10.0	8,300	8,244	294,263	2021/1/1
		10(IN)BRAZIL NTN-F230101	10.0	4,550	4,455	159,031	2023/1/1
		BRAZIL-LTN 180401	—	1,200	1,066	38,047	2018/4/1
		BRAZIL-LTN 180701	—	4,500	3,904	139,366	2018/7/1
		BRAZIL-LTN 190101	—	7,300	6,037	215,471	2019/1/1
		BRAZIL-LTN 190701	—	3,700	2,914	104,004	2019/7/1
		BRAZIL-LTN 200101	—	2,300	1,719	61,366	2020/1/1
小	計					1,271,243	
チリ				千チリペソ	千チリペソ		
	国債証券						
		5.5 CHILE (GL) 200805	5.5	50,000	53,075	9,250	2020/8/5
小	計					9,250	
コロンビア				千コロンビアペソ	千コロンビアペソ		
	国債証券						
		10 TITULOS DE TES 240724	10.0	4,250,000	5,087,624	196,891	2024/7/24
		11 TITULOS DE TES 200724	11.0	2,120,000	2,429,920	94,037	2020/7/24
		4.375 COLOMBI (GL) 230321	4.375	1,680,000	1,511,596	58,498	2023/3/21
		5 TITULOS DE TESO 181121	5.0	3,100,000	3,056,125	118,272	2018/11/21
		6 TITULOS DE TESO 280428	6.0	1,850,000	1,725,717	66,785	2028/4/28
		7 TITULOS DE TESO 190911	7.0	550,000	561,932	21,746	2019/9/11
		7 TITULOS DE TESO 220504	7.0	1,610,000	1,656,599	64,110	2022/5/4
		7.5 TITULOS DE TE 260826	7.5	3,000,000	3,161,895	122,365	2026/8/26
		7.75 COLOMBI (GL) 210414	7.75	1,000,000	1,053,549	40,772	2021/4/14
		7.75 TITULOS DE T 300918	7.75	2,050,000	2,202,534	85,238	2030/9/18

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		
コロンビア		%	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ	千円	
国債証券	9.85 COLOMBI (GL) 270628	9.85	1,290,000	1,590,657	61,558	2027/6/28
小計					930,276	
ペルー			千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル		
国債証券	5.7 PERU 240812	5.7	1,000	1,000	34,380	2024/8/12
	6.35 PERU 280812	6.35	1,600	1,611	55,337	2028/8/12
	6.9 PERU 370812	6.9	900	920	31,606	2037/8/12
	6.95 PERU 310812	6.95	1,400	1,448	49,766	2031/8/12
	7.84 PERU 200812	7.84	750	821	28,221	2020/8/12
	8.2 PERU 260812	8.2	1,200	1,383	47,528	2026/8/12
小計					246,841	
トルコ			千トルコリラ	千トルコリラ		
国債証券	10.4 TURKEY GOVT 190327	10.4	1,100	1,088	32,141	2019/3/27
	10.4 TURKEY GOVT 240320	10.4	1,200	1,167	34,479	2024/3/20
	10.5 TURKEY GOVT 200115	10.5	1,600	1,585	46,822	2020/1/15
	10.6 TURKEY GOVT 260211	10.6	1,400	1,367	40,391	2026/2/11
	10.7 TURKEY GOVT 210217	10.7	3,100	3,075	90,810	2021/2/17
	6.3 TURKEY GOVT 180214	6.3	1,000	955	28,215	2018/2/14
	7.1 TURKEY GOVT 230308	7.1	2,900	2,408	71,121	2023/3/8
	7.4 TURKEY GOVT 200205	7.4	1,700	1,546	45,657	2020/2/5
	8 TURKEY GOVT 250312	8.0	3,600	3,037	89,702	2025/3/12
	8.3 TURKEY GOVT 180620	8.3	2,000	1,934	57,125	2018/6/20
	8.5 TURKEY GOVT 190710	8.5	2,600	2,464	72,785	2019/7/10
	8.5 TURKEY GOVT 220914	8.5	1,600	1,436	42,428	2022/9/14
	8.7 TURKEY GOVT 180711	8.7	600	582	17,212	2018/7/11
	8.8 TURKEY GOVT 181114	8.8	2,100	2,027	59,873	2018/11/14
	8.8 TURKEY GOVT 230927	8.8	1,800	1,618	47,785	2023/9/27
	9 TURKEY GOVT 240724	9.0	2,000	1,814	53,567	2024/7/24
	9.2 TURKEY GOVT 210922	9.2	900	843	24,902	2021/9/22
	9.4 TURKEY GOVT 200708	9.4	2,800	2,674	78,963	2020/7/8
	9.5 TURKEY GOVT 220112	9.5	1,500	1,419	41,903	2022/1/12
小計					975,892	
ハンガリー			千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント		
国債証券	2 HUNGARY 191030	2.0	50,000	51,609	20,292	2019/10/30
	2.5 HUNGARY 180622	2.5	59,000	60,888	23,941	2018/6/22
	2.5 HUNGARY 211027	2.5	40,000	41,124	16,169	2021/10/27
	3 HUNGARY 240626	3.0	25,000	25,036	9,844	2024/6/26
	3 HUNGARY 271027	3.0	45,000	43,282	17,018	2027/10/27
	3.5 HUNGARY 200624	3.5	154,000	165,011	64,882	2020/6/24
	5.5 HUNGARY 181220	5.5	103,000	113,068	44,458	2018/12/20
	5.5 HUNGARY 250624	5.5	169,000	197,730	77,747	2025/6/24
	6 HUNGARY 231124	6.0	209,000	253,186	99,553	2023/11/24
	6.5 HUNGARY 190624	6.5	201,800	229,497	90,238	2019/6/24
	7 HUNGARY 220624	7.0	153,500	191,706	75,378	2022/6/24
	7.5 HUNGARY 201112	7.5	164,000	200,170	78,706	2020/11/12
小計					618,232	

銘柄	当期末						償還年月日
	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			
ポーランド		%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円		
国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	3,300	3,199	89,517	2020/4/25	
	1.75 POLAND 210725	1.75	4,600	4,382	122,632	2021/7/25	
	2 POLAND 210425	2.0	2,700	2,608	72,977	2021/4/25	
	2.5 POLAND 180725	2.5	3,300	3,334	93,312	2018/7/25	
	2.5 POLAND 260725	2.5	4,600	4,143	115,946	2026/7/25	
	2.5 POLAND 270725	2.5	700	623	17,431	2027/7/25	
	3.25 POLAND 190725	3.25	3,000	3,072	85,971	2019/7/25	
	3.25 POLAND 250725	3.25	3,600	3,494	97,773	2025/7/25	
	3.75 POLAND 180425	3.75	1,600	1,641	45,936	2018/4/25	
	4 POLAND 231025	4.0	3,300	3,405	95,293	2023/10/25	
	5.25 POLAND 201025	5.25	2,600	2,834	79,309	2020/10/25	
	5.5 POLAND 191025	5.5	2,400	2,603	72,839	2019/10/25	
	5.75 POLAND 211025	5.75	2,000	2,243	62,775	2021/10/25	
	5.75 POLAND 220923	5.75	3,200	3,612	101,077	2022/9/23	
	POLAND 181025	—	2,300	2,222	62,182	2018/10/25	
小計					1,214,978		
ロシア			千ロシアルーブル	千ロシアルーブル			
国債証券	6.4 RUSSIA OFZ 200527	6.4	28,500	27,374	52,011	2020/5/27	
	6.7 RUSSIA GOVT B 190515	6.7	35,200	34,460	65,475	2019/5/15	
	6.8 RUSSIA GOVT 191211	6.8	22,000	21,417	40,692	2019/12/11	
	7 RUSSIA GOVT 230125	7.0	26,500	25,426	48,310	2023/1/25	
	7 RUSSIA GOVT BON 230816	7.0	36,200	34,426	65,409	2023/8/16	
	7.05 RUSSIA GOVT 280119	7.05	40,800	37,648	71,531	2028/1/19	
	7.5 RUSSIA GOVT 180315	7.5	4,000	3,986	7,573	2018/3/15	
	7.5 RUSSIA GOVT 190227	7.5	22,800	22,697	43,125	2019/2/27	
	7.5 RUSSIA OFZ 210818	7.5	32,500	31,996	60,792	2021/8/18	
	7.6 RUSSIA GOVT 210414	7.6	23,000	22,735	43,197	2021/4/14	
	7.6 RUSSIA GOVT 220720	7.6	27,000	26,718	50,764	2022/7/20	
	7.75 RUSSIA OFZ 260916	7.75	13,900	13,563	25,771	2026/9/16	
	7.85 RUSSIA (GL) 180310	7.85	25,000	24,847	47,210	2018/3/10	
	8.15 RUSSIA GOVT 270203	8.15	40,500	40,797	77,515	2027/2/3	
	8.5 RUSSIA OFZ 310917	8.5	25,000	25,362	48,188	2031/9/17	
小計					747,570		
ルーマニア			千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ			
国債証券	4.75 ROMANIA GOVE 190624	4.75	1,100	1,181	31,959	2019/6/24	
	4.75 ROMANIA GOVE 250224	4.75	2,800	3,053	82,621	2025/2/24	
	5.6 ROMANIA GO 181128	5.6	1,000	1,079	29,203	2018/11/28	
	5.75 ROMANIA GOVE 200429	5.75	4,000	4,472	121,027	2020/4/29	
	5.8 ROMANIA GOVT 270726	5.8	600	703	19,036	2027/7/26	
	5.85 ROMANIA GOVE 230426	5.85	1,500	1,727	46,743	2023/4/26	
	5.95 ROMANIA 210611	5.95	300	340	9,226	2021/6/11	
小計					339,818		
マレーシア			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット			
国債証券	3.26 MALAYSIAGOVT 180301	3.26	1,100	1,102	28,178	2018/3/1	
	3.418MALAYSIAGOVT 220815	3.418	1,900	1,854	47,381	2022/8/15	

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
マレーシア		%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
国債証券	3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	2,000	1,941	49,616	2023/3/15
	3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	1,700	1,697	43,378	2020/3/31
	3.58 MALAYSIAGOV 180928	3.58	1,800	1,810	46,265	2018/9/28
	3.654 MALAYSIAGOV 191031	3.654	1,800	1,811	46,287	2019/10/31
	3.659 MALAYSIAGOV 201015	3.659	2,000	2,005	51,250	2020/10/15
	3.759 MALAYSIAGOV 190315	3.759	1,400	1,413	36,118	2019/3/15
	3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	1,600	1,592	40,675	2022/9/30
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	1,900	1,884	48,154	2023/8/17
	3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	1,200	1,213	31,000	2020/7/31
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	2,100	2,069	52,879	2025/9/15
	4.048 MALAYSIA 210930	4.048	2,520	2,556	65,330	2021/9/30
	4.07 MALAYSIA INV 260930	4.07	2,000	1,964	50,180	2026/9/30
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	1,700	1,735	44,334	2021/7/15
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,600	1,612	41,190	2024/7/15
	4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	1,900	1,835	46,902	2031/6/30
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	800	758	19,374	2035/5/31
	4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	3,200	3,283	83,902	2019/11/29
	4.39 MALAYSIA INV 230707	4.39	1,400	1,428	36,488	2023/7/7
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	1,600	1,614	41,262	2026/4/15
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	2,500	2,475	63,239	2030/4/15
	5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	2,000	2,109	53,886	2019/7/30
小 計					1,067,279	
タイ			千タイバーツ	千タイバーツ		
国債証券	1.875 THAILAND 220617	1.875	5,500	5,396	17,321	2022/6/17
	2.125 THAILAND 261217	2.125	6,000	5,709	18,327	2026/12/17
	2.55 THAILAND 200626	2.55	29,900	30,549	98,063	2020/6/26
	3.4 THAILAND 360617	3.4	9,000	9,041	29,023	2036/6/17
	3.45 THAILAND 190308	3.45	10,700	11,098	35,626	2019/3/8
	3.625 THAILAND 230616	3.625	32,200	34,446	110,574	2023/6/16
	3.65 THAILAND 211217	3.65	59,200	63,296	203,180	2021/12/17
	3.85 THAILAND 251212	3.85	29,100	31,844	102,219	2025/12/12
	3.875 THAILAND 190613	3.875	48,000	50,433	161,890	2019/6/13
	4.875 THAILAND 290622	4.875	34,400	40,857	131,152	2029/6/22
	5.125 THAILAND 180313	5.125	4,200	4,366	14,015	2018/3/13
小 計					921,395	
フィリピン			千フィリピンペソ	千フィリピンペソ		
国債証券	4.95 PHILIPPI (GL) 210115	4.95	10,000	10,250	23,267	2021/1/15
	6.25 PHILIPPI (GL) 360114	6.25	10,000	10,925	24,799	2036/1/14
小 計					48,067	
インドネシア			千インドネシアルピア	千インドネシアルピア		
国債証券	10.5 INDONESIA 300815	10.5	3,550,000	4,276,848	36,353	2030/8/15
	11 INDONESIA 201115	11.0	2,550,000	2,875,635	24,442	2020/11/15
	11 INDONESIA 250915	11.0	3,450,000	4,167,472	35,423	2025/9/15
	12.8 INDONESIA 210615	12.8	2,590,000	3,109,499	26,430	2021/6/15
	5.25 INDONESIA 180515	5.25	1,150,000	1,131,025	9,613	2018/5/15

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
インドネシア			%	千インドネシアルピア	千インドネシアルピア	千円	
	国債証券	5.625 INDONESIA 230515	5.625	4,800,000	4,367,356	37,122	2023/5/15
		6.125 INDONESIA 280515	6.125	5,050,000	4,411,972	37,501	2028/5/15
		6.625 INDONESIA 330515	6.625	6,400,000	5,589,708	47,512	2033/5/15
		7 INDONESIA 220515	7.0	5,650,000	5,635,976	47,905	2022/5/15
		7 INDONESIA 270515	7.0	4,050,000	3,907,573	33,214	2027/5/15
		7.875 INDONESIA 190415	7.875	4,700,000	4,810,450	40,888	2019/4/15
		8.25 INDONESIA 210715	8.25	15,000,000	15,539,835	132,088	2021/7/15
		8.25 INDONESIA 320615	8.25	7,000,000	7,126,280	60,573	2032/6/15
		8.25 INDONESIA 360515	8.25	4,500,000	4,589,613	39,011	2036/5/15
		8.375 INDONESIA 240315	8.375	16,700,000	17,501,600	148,763	2024/3/15
		8.375 INDONESIA 260915	8.375	15,230,000	16,044,805	136,380	2026/9/15
		8.375 INDONESIA 340315	8.375	12,100,000	12,426,700	105,626	2034/3/15
		8.75 INDONESIA 310515	8.75	6,800,000	7,236,900	61,513	2031/5/15
		9 INDONESIA 290315	9.0	11,500,000	12,502,800	106,273	2029/3/15
		9.5 INDONESIA 310715	9.5	4,150,000	4,655,009	39,567	2031/7/15
	小 計					1,206,210	
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	21,700	24,215	207,042	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	11,700	8,488	72,580	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	10,700	7,746	66,235	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	8,000	7,640	65,322	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	12,300	10,216	87,351	2031/2/28
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	7,900	7,768	66,423	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	7,900	7,676	65,632	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	3,600	3,615	30,909	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	12,700	11,607	99,242	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	9,300	8,518	72,833	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	11,300	10,344	88,446	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	14,100	13,109	112,086	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	16,400	15,206	130,018	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	4,000	3,821	32,671	2035/2/28
	小 計					1,196,797	
	合 計					11,954,762	

(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 11,954,762	% 96.0
コール・ローン等、その他	497,826	4.0
投資信託財産総額	12,452,588	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (12,435,786千円) の投資信託財産総額 (12,452,588千円) に対する比率は99.9%です。

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

1 アメリカドル=113.15円	1 メキシコペソ=5.37円	1 ブラジルレアル=35.69円	100チリペソ=17.43円
100コロンビアペソ=3.87円	1 ベルヌエボソル=34.35円	1 トルコリラ=29.53円	100ハンガリーフォリント=39.32円
1 ポーランドズロチ=27.98円	1 ロシアルーブル=1.90円	1 ルーマニアレイ=27.06円	1 マレーシアリングギット=25.55円
1 タイバーツ=3.21円	1 フィリピンペソ=2.27円	100インドネシアルピア=0.85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	12,457,373,028
コール・ローン等	295,723,840
公社債(評価額)	11,954,762,413
未収入金	4,785,240
未収利息	192,344,208
前払費用	9,757,327
(B) 負債	13,836,972
未払金	9,139,208
未払解約金	4,697,747
未払利息	17
(C) 純資産総額(A-B)	12,443,536,056
元本	9,838,910,954
次期繰越損益金	2,604,625,102
(D) 受益権総口数	9,838,910,954口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,647円

<注記事項>

- ①期首元本額 8,564,024,345円
 期中追加設定元本額 2,423,895,407円
 期中一部解約元本額 1,149,008,798円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.2647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 バランス(8資産均等型)	2,025,757,388円
eMAXIS バランス(波乗り型)	362,197,161円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	252,265,861円
コアバランス	1,449,710円
eMAXIS 新興国債券インデックス	4,920,515,190円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	2,188,596,618円
新興国債券インデックスファンド(ラップ向け)	2,453,011円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	3,288,707円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	15,091,598円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	17,736,686円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	1,423,716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)	4,646,370円
三菱UFJ 新興国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	27,159,975円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	7,437,903円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	6,911,309円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	1,979,751円
合計	9,838,910,954円

【お知らせ】

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

(2016年3月2日)

○損益の状況 (2016年1月27日~2017年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	755,928,490
受取利息	755,770,323
その他収益金	174,877
支払利息	△ 16,710
(B) 有価証券売買損益	337,893,428
売買益	1,173,662,485
売買損	△ 835,769,057
(C) 保管費用等	△ 13,620,267
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,080,201,651
(E) 前期繰越損益金	1,297,287,853
(F) 追加信託差損益金	463,044,457
(G) 解約差損益金	△ 235,908,859
(H) 計(D+E+F+G)	2,604,625,102
次期繰越損益金(H)	2,604,625,102

- (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。

アセアン投資適格社債マザーファンド

《第5期》決算日2016年12月15日

[計算期間：2016年6月16日～2016年12月15日]

「アセアン投資適格社債マザーファンド」は、12月15日に第5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5期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	アセアン諸国の企業が発行する米ドル建ての投資適格社債等を主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。なお、市況動向などに応じて、一部、米国国債やアセアン諸国の現地通貨建ての公社債等に投資する場合があります。投資する債券は、原則として取得時においてBBB一格相当以上の格付けを取得しているもの、もしくは委託者の格付基準によりBBB一格相当以上の格付けを付与されているものに限ります。デュレーション調整等のため、先物取引等を利用し債券の実質投資比率が100%を超える場合があります。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
主 要 運 用 対 象	アセアン諸国の企業が発行する米ドル建ての投資適格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割合に制限を設けません。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率			
(設定日)	円	%	%	%	百万円
2014年6月27日	10,000	—	—	—	480
1期(2014年12月15日)	12,012	20.1	97.9	—	960
2期(2015年6月15日)	12,536	4.4	97.8	—	1,160
3期(2015年12月15日)	12,344	△ 1.5	97.7	—	1,089
4期(2016年6月15日)	11,567	△ 6.3	98.5	—	1,021
5期(2016年12月15日)	12,721	10.0	98.5	—	1,020

(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、アセアン諸国の企業が発行する米ドル建ての投資適格社債等に投資を行い、信託財産の成長と収益の確保をめざすことを目標としておりますが、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

(注) 「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	騰 落 率	債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
(期 首) 2016年6月15日	円 11,567	% —	% 98.5	% —	% —
6月末	11,326	△ 2.1	98.2	—	—
7月末	11,638	0.6	98.0	—	—
8月末	11,631	0.6	97.7	—	—
9月末	11,392	△ 1.5	97.6	—	—
10月末	11,668	0.9	98.0	—	—
11月末	12,195	5.4	97.7	—	—
(期 末) 2016年12月15日	12,721	10.0	98.5	—	—

(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10.0%の上昇となりました。

基準価額の推移



●投資環境について

◎アセアン投資適格社債市況

・アセアン投資適格社債市況は、米国の長期金利が上昇（債券価格は下落）したことなどから下落しました。期初は英国のEU（欧州連合）離脱を巡る国民投票で離脱支持が勝利したことから世界的に先行き不透明感が高まり、投資家のリスク回避姿勢が強まるなか、米国の長期金利は大きく低下する展開となりました。しかし、2016年11月上旬に実施された米国大統領選の結果を受けた2017年以降の財政政策に対する期待の高まりなどから、米国の長期金利は上昇しました。また、社債のスプレッド（国債に対する上乗せ金利）は、商品市況の反発や世界的に景気の先行き悪化懸念が和らいだことから、投資家のリスク回避姿勢が後退したことなどを背景に縮小基調で推移しました。

◎為替市況

・為替市況は、米ドルは対円で上昇しました。前記大統領選の結果を受けて米国金利が上昇して日米の金利差が拡大したことなどから米ドルは対円で上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・当期においては、商品市況が反発した局面や世界的に景気の先行き悪化懸念が和らいだ局面で、債券格付別ではA A格相当やA格相当の組入比率を引き下げ、B B B格相当の組入比率を引き上げました。また、セクター別では業況が安定している金融セクターへ多めの配分を維持しました。
- ・前記のような運用を行った結果、金利の上昇によって債券価格が下落したことなどが基準価額の下落要因となった一方で、債券利子収入を獲得したことに加え、米ドルが対円で上昇し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

- ・米国において、新興国を中心とした外部環境への不透明感や米ドル上昇に伴いインフレ動向が落ち着いていることが金利低下要因となるものの、トランプ新政権が公約している財政出動や減税に対する期待などが金利上昇要因となり、長期金利は当面もみ合う展開が想定されます。一方で、日欧などの先進国に加えて中国の金融緩和策は維持されています。
- ・アセアン各国については、インフラの整備・拡充を通じた投資拡大や中間層・富裕層の増加を通じた消費拡大などを背景に今後も相対的に高い経済成長が見込めると考えます。特に、インドネシアではインフラ関連投資を中心とした政府による歳出実行の加速、フィリピンにおいては海外就労者からの本国送金を背景とした旺盛な個人消費の継続などが期待されます。一方、マレーシアについては政治情勢や財政収支動向、タイについては政治情勢や景気動向などに留意が必要と考えます。

- ・短期的には中国を中心とした新興国景気の先行き不透明感を背景とした投資家のリスク回避姿勢の強まりや、米国の財政・貿易政策などを受けた新興国からの資金流出などは懸念されますが、前述のアセアン各国の成長を背景に、アセアン各国の社債スプレッドは全体では概ね底堅く推移するものと予想します。

◎今後の運用方針

- ・国別では輸出依存度が高く資源価格低迷に伴う景気や財政収支悪化の懸念が高まりやすいマレーシア、個別では過剰な米ドル建て債務から為替差損を抱えやすい企業については留意が必要と考え、慎重に分析・銘柄選択を行ってまいります。以上の見通しの下、割安で相対的に業況が安定していると判断されるB B B格相当や金融セクターへの配分を多めに維持する方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2016年6月16日～2016年12月15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)	(2)	(0.014)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	(0)	(0.001)	
期中の平均基準価額は、11,641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6月16日～2016年12月15日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	社債券	千アメリカドル 411	千アメリカドル 1,096

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分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。

○利害関係人との取引状況等

(2016年6月16日～2016年12月15日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3	百万円 3	% 100.0	百万円 97	百万円 20	% 20.6

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

○組入資産の明細

(2016年12月15日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	8,150	8,532	1,004,500	98.5	—	74.1	17.4	7.0
合 計	8,150	8,532	1,004,500	98.5	—	74.1	17.4	7.0

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	特殊債券	2.375	250	243	28,682	2023/1/23
	普通社債券	2.5	200	187	22,108	2026/4/12
	2.7 SP POWERASSET 220914	2.7	400	398	46,963	2022/9/14
	2.95 BANK RAKYAT 180328	2.95	200	200	23,602	2018/3/28
	3 KASIKORN BANK PC 180320	3.0	400	404	47,638	2018/3/20
	3.25 OPTUS FINAN 250630	3.25	200	200	23,581	2025/6/30
	3.5 SIAM COMMERCIAL 190407	3.5	400	411	48,396	2019/4/7
	3.875 GLOBAL LOGI 250604	3.875	400	390	45,962	2025/6/4
	4.25 OVERSEA-CHINA 240619	4.25	200	202	23,810	2024/6/19
	4.25 PT PELABUHAN 250505	4.25	400	383	45,133	2025/5/5
	4.25 PTT GLOBAL C 220919	4.25	200	208	24,552	2022/9/19
	4.25 RIZAL COMMERCIAL 200122	4.25	200	208	24,542	2020/1/22
	4.3 PERTAMINA PER 230520	4.3	200	200	23,596	2023/5/20
	4.5 PETRONAS CAPI 450318	4.5	200	200	23,649	2045/3/18
	4.5 SINGTEL GROUP 210908	4.5	200	216	25,439	2021/9/8
	4.875 PERTAMINA P 220503	4.875	200	207	24,391	2022/5/3
	4.875 THAI OIL PC 430123	4.875	200	198	23,353	2043/1/23
	5.5 DEV BANK PHIL 210325	5.5	200	221	26,126	2021/3/25
	5.692 PTTEP CANADA 210405	5.692	200	221	26,052	2021/4/5
	6 PERTAMINA PERSE 420503	6.0	200	195	23,059	2042/5/3
	6.35 PTTEP CANADA 420612	6.35	200	238	28,017	2042/6/12
	6.5 PERTAMINA PT 410527	6.5	200	208	24,520	2041/5/27
	7.39 POWER SECTOR 241202	7.39	200	256	30,161	2024/12/2
	7.625 PETROLIUM N 261015	7.625	100	131	15,525	2026/10/15
	7.75 MAJAPAHIT HO 200120	7.75	200	225	26,545	2020/1/20
	7.875 MAJAPAHIT H 370629	7.875	300	360	42,379	2037/6/29
	7.875 PETRONAS CA 220522	7.875	200	246	29,020	2022/5/22
	7.875 TELEKOM MAL 250801	7.875	200	250	29,502	2025/8/1
	VAR DBS BANK LTD/ 220921	3.625	200	201	23,760	2022/9/21
	VAR MALAYAN BANKI 220920	3.25	300	301	35,505	2022/9/20
	VAR OVERSEA-CHINA 230311	3.15	400	403	47,531	2023/3/11
	VAR UNITED OVERSEA 221017	2.875	400	402	47,372	2022/10/17
	VAR UNITED OVERSEA 240919	3.75	200	203	24,011	2024/9/19
合	計				1,004,500	

(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12月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	1,004,500	98.4
コール・ローン等、その他	16,224	1.6
投資信託財産総額	1,020,724	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (1,018,305千円) の投資信託財産総額 (1,020,724千円) 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=117.72円		
------------------	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年12月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,020,724,470
コール・ローン等	6,638,539
公社債(評価額)	1,004,500,292
未収利息	9,486,754
前払費用	98,885
(B) 負債	568,824
未払解約金	568,822
未払利息	2
(C) 純資産総額(A-B)	1,020,155,646
元本	801,924,486
次期繰越損益金	218,231,160
(D) 受益権総口数	801,924,486口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,721円

<注記事項>

①期首元本額 883,298,561円
 期中追加設定元本額 17,974,613円
 期中一部解約元本額 99,348,688円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.2721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)

アセアン社債ファンド(毎月決算型)	237,912,800円
アセアン社債ファンド(ラップ向け)	99,419,388円
MUAM アセアン社債ファンド	428,940,059円
アドバンスト・バランスⅠ(FOFs用)(適格機関投資家限定)	15,774,330円
アドバンスト・バランスⅡ(FOFs用)(適格機関投資家限定)	19,877,909円
合計	801,924,486円

【お知らせ】

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

(2016年7月1日)

○損益の状況

(2016年6月16日~2016年12月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	23,262,105
受取利息	23,263,073
支払利息	△ 968
(B) 有価証券売買損益	70,584,996
売買益	104,161,599
売買損	△ 33,576,603
(C) 保管費用等	△ 151,509
(D) 当期損益金(A+B+C)	93,695,592
(E) 前期繰越損益金	138,393,409
(F) 追加信託差損益金	2,729,367
(G) 解約差損益金	△ 16,587,208
(H) 計(D+E+F+G)	218,231,160
次期繰越損益金(H)	218,231,160

(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。

アセアン・ハイイールド社債マザーファンド

《第5期》決算日2016年12月15日

[計算期間：2016年6月16日～2016年12月15日]

「アセアン・ハイイールド社債マザーファンド」は、12月15日に第5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5期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	アセアン諸国の企業が発行する米ドル建てのハイイールド社債等を主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。なお、市況動向などに応じて、一部、米国国債やアセアン諸国の現地通貨建ての公社債等に投資する場合があります。投資する債券は、原則として取得時においてB-格相当以上の格付けを取得しているもの、もしくは委託者の格付基準によりB-格相当以上の格付けを付与されているものに限ります。 デュレーション調整等のため、先物取引等を利用し債券の実質投資比率が100%を超える場合があります。 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
主要運用対象	アセアン諸国の企業が発行する米ドル建てのハイイールド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割合に制限を設けません。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	円	騰落率			
(設定日)	円	%	%	%	百万円
2014年6月27日	10,000	—	—	—	480
1期(2014年12月15日)	11,882	18.8	97.4	—	962
2期(2015年6月15日)	12,675	6.7	96.9	—	1,169
3期(2015年12月15日)	12,534	△ 1.1	97.2	—	1,092
4期(2016年6月15日)	11,650	△ 7.1	96.6	—	1,018
5期(2016年12月15日)	13,232	13.6	96.1	—	1,026

(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、アセアン諸国の企業が発行する米ドル建てのハイイールド社債等に投資を行い、信託財産の成長と収益の確保をめざすことを目標としておりますが、特定の指数を上回るまたは運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) 「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 騰 落 率	債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
(期 首) 2016年6月15日	円 11,650	% —	% 96.6	% —
6月末	11,345	△ 2.6	95.9	—
7月末	11,709	0.5	97.6	—
8月末	11,657	0.1	97.0	—
9月末	11,459	△ 1.6	96.9	—
10月末	11,928	2.4	96.9	—
11月末	12,619	8.3	93.2	—
(期 末) 2016年12月15日	円 13,232	% 13.6	% 96.1	% —

(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13.6%の上昇となりました。

基準価額の推移



●投資環境について

◎アセアン・ハイイールド社債市況

・アセアン・ハイイールド社債市況は、米国の長期金利が上昇（債券価格は下落）した一方、社債のスプレッド（国債に対する上乘せ金利）が縮小したことなどから上昇しました。期初は英国のEU（欧州連合）離脱を巡る国民投票で離脱支持が勝利したことから世界的に先行き不透明感が高まり、投資家のリスク回避姿勢が強まるなか、米国の長期金利は大きく低下する展開となりました。しかし、2016年11月上旬に実施された米国大統領選の結果を受けた2017年以降の財政政策に対する期待の高まりなどから、米国の長期金利は上昇しました。また、社債のスプレッドは、商品市況の反発や世界的に景気の先行き悪化懸念が和らいだことから、投資家のリスク回避姿勢が後退したことなどを背景に縮小基調で推移しました。

◎為替市況

・為替市況は、米ドルは対円で上昇しました。前記大統領選の結果を受けて米国金利が上昇して日米の金利差が拡大したことなどから米ドルは対円で上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・当期においては、米国の長期金利が上昇する局面で、債券格付別ではBB格相当の組入比率を引き下げ、BB格相当の組入比率を引き上げました。また、セクター別では業況が安定している金融セクターへ多めの配分を維持しました。
- ・前記のような運用を行った結果、債券利子収入を獲得したことに加え、米ドルが対円で上昇し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

- ・米国において、新興国を中心とした外部環境への不透明感や米ドル上昇に伴いインフレ動向が落ち着いていることが金利低下要因となるものの、トランプ新政権が公約している財政出動や減税に対する期待などが金利上昇要因となり、長期金利は当面もみ合う展開が想定されます。一方で、日欧などの先進国に加えて中国の金融緩和策は維持されています。
- ・アセアン各国については、インフラの整備・拡充を通じた投資拡大や中間層・富裕層の増加を通じた消費拡大などを背景に今後も相対的に高い経済成長が見込めると考えます。特に、インドネシアではインフラ関連投資を中心とした政府による歳出実行の加速、フィリピンにおいては海外就労者からの本国送金を背景とした旺盛な個人消費の継続などが期待されます。一方、マレーシアについては政治情勢や財政収支動向、タイについては政治情勢や景気動向などに留意が必要と考えます。

- ・短期的には中国を中心とした新興国景気の先行き不透明感を背景とした投資家のリスク回避姿勢の強まりや、米国の財政・貿易政策などを受けた新興国からの資金流出などは懸念されますが、前述のアセアン各国の成長を背景に、アセアン各国の社債スプレッドは全体では概ね底堅く推移するものと予想します。

◎今後の運用方針

- ・個別で過剰な米ドル建て債務から為替差損を抱えやすい企業については留意が必要と考え、慎重に分析・銘柄選択を行ってまいります。以上の見通しの下、割安で相対的に業況が安定していると判断されるBB格相当や金融セクターへの配分を多めに維持する方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2016年6月16日～2016年12月15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	0.018	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)	(2)	(0.016)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	(0)	(0.001)	
期中の平均基準価額は、11,786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6月16日～2016年12月15日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	社債券	千アメリカドル 2,742	千アメリカドル 2,983 (612)

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2016年6月16日～2016年12月15日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 15	百万円 8	% 53.3	百万円 131	百万円 26	% 19.8

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信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年12月15日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 8,100	千アメリカドル 8,385	千円 987,189	% 96.1	% 73.8	% 47.0	% 42.1	% 7.1
合 計	8,100	8,385	987,189	96.1	73.8	47.0	42.1	7.1

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利 率	当 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	
	普通社債券					
	4.076 CAPITALAND 220920	4.076	200	205	24,201	2022/9/20
	4.25 MEGAWORLD CO 230417	4.25	200	200	23,651	2023/4/17
	4.25 SM INVESTMEN 191017	4.25	500	513	60,487	2019/10/17
	4.375 JGSH PHILIP 230123	4.375	600	613	72,213	2023/1/23
	4.5 FPC TREASURY 230416	4.5	200	198	23,417	2023/4/16
	4.5 OLAM INTE 210412	4.5	400	395	46,511	2021/4/12
	4.625 TBG GLOBAL 180403	4.625	400	406	47,850	2018/4/3
	4.875 SM INVESTME 240610	4.875	200	207	24,450	2024/6/10
	4.95 LISTRINDO 260914	4.95	200	193	22,742	2026/9/14
	5.5 GLOBAL PRIME 231018	5.5	400	404	47,656	2023/10/18
	6 FPC FINANCE LTD 190628	6.0	200	210	24,723	2019/6/28
	6.25 SOLUSI TUNAS 200224	6.25	200	207	24,377	2020/2/24
	6.375 FPT FINANCE 200928	6.375	200	215	25,353	2020/9/28
	6.5 ENERGY DEVELO 210120	6.5	400	451	53,150	2021/1/20
	6.5 FIRST GEN COR 231009	6.5	400	430	50,680	2023/10/9
	6.5 JABABEKA INTE 231005	6.5	200	197	23,268	2023/10/5
	6.75 MEGAWORLD CO 180415	6.75	200	210	24,745	2018/4/15
	6.75 MPM GLOBAL 190919	6.75	400	410	48,326	2019/9/19
	6.95 ALAM SYNERGY 200327	6.95	200	203	23,956	2020/3/27
	7 THETA CAPITAL 220411	7.0	200	206	24,261	2022/4/11
	7.125 PAKUWON PRI 190702	7.125	400	422	49,720	2019/7/2
	7.375 INTERNATIONAL 200317	7.375	100	112	13,273	2020/3/17
	7.375 VLL INTERNA 220618	7.375	200	213	25,074	2022/6/18
	7.5 OLAM INTERNAT 200812	7.5	300	326	38,458	2020/8/12
	8.25 GOLDEN LEGAC 210607	8.25	200	203	23,940	2021/6/7
	VAR KRUNG THAI BA 241226	5.2	200	207	24,482	2024/12/26
	VAR PETRON CORP 490206	7.5	400	420	49,442	2049/2/6
	VAR ROYAL CAPITAL 491229	4.875	200	187	22,024	2049/12/29
	VAR SMC GLOBAL PO 491107	7.5	200	210	24,745	2049/11/7
合	計				987,189	

(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12月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	987,189	96.1
コール・ローン等、その他	40,477	3.9
投資信託財産総額	1,027,666	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (1,024,846千円) の投資信託財産総額 (1,027,666千円) に対する比率は99.7%です。
 (注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=117.72円		
------------------	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年12月15日現在)

○損益の状況 (2016年6月16日～2016年12月15日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,027,666,498
コール・ローン等	25,849,615
公社債(評価額)	987,189,913
未収利息	13,983,581
前払費用	643,389
(B) 負債	861,107
未払解約金	861,104
未払利息	3
(C) 純資産総額(A-B)	1,026,805,391
元本	776,010,860
次期繰越損益金	250,794,531
(D) 受益権総口数	776,010,860口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,232円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	31,716,598
受取利息	31,482,081
その他収益金	235,440
支払利息	△ 923
(B) 有価証券売買損益	95,217,921
売買益	112,647,395
売買損	△ 17,429,474
(C) 保管費用等	△ 175,995
(D) 当期損益金(A+B+C)	126,758,524
(E) 前期繰越損益金	144,323,877
(F) 追加信託差損益金	3,981,989
(G) 解約差損益金	△ 24,269,859
(H) 計(D+E+F+G)	250,794,531
次期繰越損益金(H)	250,794,531

<注記事項>

①期首元本額 874,567,609円
 期中追加設定元本額 26,786,754円
 期中一部解約元本額 125,343,503円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3232円です。

(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。

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)
 アセアン社債ファンド(毎月決算型) 229,622,534円
 アセアン社債ファンド(ラップ向け) 95,552,984円
 MUAM アセアン社債ファンド 414,338,467円
 アドバンスト・バランスⅠ(FOFs用)(適格機関投資家限定) 15,739,004円
 アドバンスト・バランスⅡ(FOFs用)(適格機関投資家限定) 20,757,871円
 合計 776,010,860円

【お知らせ】

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

AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり> (FOFs用) (適格機関投資家限定)

《第3期》

[計算期間：2016年5月11日～2016年11月10日]

○当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2025年2月5日まで (2015年2月20日設定)	
運用方針	AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券に実質的な投資を行います。なお、インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要な不可欠なサービスを提供する企業をいいます。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。	
主要運用対象	ベビーファンド	AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	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。
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。	

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額		債権比率		純資産額		
		税金 分	込 配	み 金	期 騰		落 率	先 物
(設定日)	円			円	%	%	百万円	
2015年2月20日	10,000	—	—	—	—	—	10	
1期(2015年11月10日)	9,582			0	△4.2	96.1	△1.5	656
2期(2016年5月10日)	10,037			0	4.7	90.1	△4.6	968
3期(2016年11月10日)	10,105			0	0.7	92.9	1.9	486

(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、世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券に実質的な投資を行い、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざしますが、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、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「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		債 組	入 比	券 率	債 先	物 比	券 率
				騰	落						
	(期 首)		円					%			%
	2016年	5月	10,037					90.1			△ 4.6
		5月末	9,994		△0.4			96.3			△10.8
		6月末	10,254		2.2			92.9			△ 6.8
		7月末	10,397		3.6			93.5			△11.1
		8月末	10,458		4.2			96.1			△10.3
		9月末	10,463		4.2			91.4			△ 6.9
		10月末	10,315		2.8			91.9			△ 4.5
	(期 末)										
	2016年	11月	10,105		0.7			92.9			1.9

(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、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(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0.7%の上昇となりました。

●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

インフラ債券市況が上昇（利回りは低下）したことなどが基準価額の上昇要因となりました。

(下落要因)

信託報酬等の費用などが基準価額の下落要因となりました。

●投資環境について

◎債券市況

- ・期首から2016年7月上旬にかけては、英国のEU（欧州連合）離脱による影響が懸念されたことなどを背景に、米国金利が低下したことなどを受けて、インフラ債券市況は上昇しました。
- ・7月中旬から期末にかけては、米国で発表された経済指標が概ね堅調な内容であったことや米国の大統領選挙で財政出動に積極的と見られるトランプ氏が勝利したことでインフレ期待が高まったことなどを背景に、米国金利が上昇したことなどを受けて、インフラ債券市況は下落しました。
- ・期を通じて見ると、主に債券利子収入を享受したことがプラスとなり、インフラ債券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

<AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり> (FOFs用) (適格機関投資家限定) >

- ・AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を高位に組み入れるとともに、為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図る運用を行いました。
- ・当期は、米ドルが対円で下落したことなどからマザーファンドの基準価額が下落したものの、当ファンドでは為替ヘッジの実施により為替変動の基準価額への影響は限定的となりました。信託報酬等コストがマイナス要因となったものの、インフラ債券市況が上昇したことなどから、当ファンドの基準価額は上昇しました。

<AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド>

基準価額は期首に比べ0.8%の下落となりました。

- ・世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を高位に組み入れる運用を行いました。
- ・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）については、期首から2016年10月下旬にかけては、市場平均に比べてやや短めの水準としました。その後は、米国の大統領選挙など政治リスクの高まりを想定して市場平均並みの水準としました。格付別では、投資適格の中でも相対的に利回りが高いBBB格相当の組入比率を市場対比多めとしました。セクター別では、運輸を市場対比多めの配分とし、公益を少なめとしました。
- ・前記のような運用を行った結果、インフラ債券市況が上昇したことなどがプラスとなったものの、米

ドルが対円で下落したことなどがマイナスとなり、基準価額は期首と比べて下落しました。

●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。

○分配金

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第3期
	2016年5月11日～ 2016年11月10日
当期分配金	—

○今後の運用方針

<AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり> (FOFs用) (適格機関投資家限定) >

◎今後の運用方針

- ・マザーファンドへの投資を通じて、主として世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を高位に組み入れるとともに、為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図る運用を行います。

<AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド>

◎運用環境の見通し

- ・米国で直近発表された経済指標は概ね堅調で、基調としては緩やかな経済回復が継続すると見ています。これは企業の経営環境、ひいてはインフラ債券市況のサポート要因になると考えます。一方、中国をはじめとした新興国経済に対する不透明感の高まりや、原油など国際商品市況の動向などが金利に及ぼす影響については、引き続き注意を払う必要があると考えます。

◎今後の運用方針

- ・こうした環境下、デュレーションについては、適宜債券先物を活用しつつ、状況に応じて機動的に対応する方針です。格付配分においては、投資適格の中では相対的に利回りが高いBBB格相当の組入比率を市場対比多めとする方針を維持します。

○ 1万口当たりの費用明細

(2016年5月11日～2016年11月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 19	% 0.185	(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)	(19)	(0.182)	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)	(0)	(0.001)	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)	(0)	(0.002)	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	0.004	(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
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.004)	有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(c) そ の 他 費 用	1	0.009	(c) 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)	(0.007)	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)	(0.002)	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	20	0.198	
期中の平均基準価額は、10,313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5月11日～2016年11月10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
AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド	千口 21,385	千円 33,000	千口 310,830	千円 489,000

○利害関係人との取引状況等

(2016年5月11日～2016年11月10日)

利害関係人との取引状況

<AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり> (FOFs用) (適格機関投資家限定) >

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	
		百万円	B A		百万円	D C
為替先物取引	百万円 4,768	百万円 3,239	% 67.9	百万円 4,342	百万円 3,233	% 74.5

<AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
		百万円	B A		百万円	D C
為替直物取引	百万円 1,317	百万円 589	% 44.7	百万円 1,619	百万円 264	% 16.3

平均保有割合 5.7%

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

利害関係人とは、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MUF G証券です。

○組入資産の明細

(2016年11月10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
AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド	千口 597,655	千口 308,210	千円 481,547	

○投資信託財産の構成

(2016年11月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド	千円 481,547	% 96.9
コール・ローン等、その他	15,468	3.1
投資信託財産総額	497,015	100.0

(注) AMP グローバル・インフラ債券マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産 (9,642,867千円) の投資信託財産総額 (9,766,438千円) に対する比率は98.7%です。

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

1 アメリカドル=105.63円			
------------------	--	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年11月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	975,291,300
コール・ローン等	15,467,172
AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド(評価額)	481,547,868
未収入金	478,276,260
(B) 負債	489,108,815
未払金	488,085,162
未払信託報酬	1,012,847
未払利息	21
その他未払費用	10,785
(C) 純資産総額(A-B)	486,182,485
元本	481,112,876
次期繰越損益金	5,069,609
(D) 受益権総口数	481,112,876口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,105円

<注記事項>

- ①期首元本額 964,801,821円
 期中追加設定元本額 0円
 期中一部解約元本額 483,688,945円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0105円です。

②分配金の計算過程

項 目	2016年5月11日～ 2016年11月10日
費用控除後の配当等収益額	10,617,148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	4,609,269円
分配準備積立金額	17,525,742円
当ファンドの分配対象収益額	32,752,159円
1万口当たり収益分配対象額	680円
1万口当たり分配金額	-円
収益分配金金額	-円

- ③「AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の33の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

○損益の状況 (2016年5月11日～2016年11月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 5,037
受取利息	45
支払利息	△ 5,082
(B) 有価証券売買損益	4,318,265
売買益	78,118,914
売買損	△73,800,649
(C) 信託報酬等	△ 1,023,632
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	3,289,596
(E) 前期繰越損益金	13,404,450
(F) 追加信託差損益金	△11,624,437
(配当等相当額)	(4,609,269)
(売買損益相当額)	(△16,233,706)
(G) 計(D+E+F)	5,069,609
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	5,069,609
追加信託差損益金	△11,624,437
(配当等相当額)	(4,609,269)
(売買損益相当額)	(△16,233,706)
分配準備積立金	28,142,890
繰越損益金	△11,448,844

- (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。

【お 知 ら せ】

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める(分散型に分類)ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2016年11月5日)

AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド

《第4期》決算日2016年5月10日

[計算期間：2015年5月12日～2016年5月10日]

「AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド」は、5月10日に第4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4期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。なお、インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要なサービスを提供する企業をいいます。債券への投資にあたっては、マクロ要因分析、業種分析、個別企業の財務・業務分析等の信用リスク分析に基づき、銘柄選定を行います。 組入公社債の格付けは、原則として取得時においてBBB一格相当以上の格付を有しているものに限り、ます。 デュレーション調整等のため、債券先物取引等を利用する場合があります。また、ファンドの流動性等を勘案して、一部、米国公債等に投資する場合があります。 債券等の運用にあたっては、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
主要運用対象	世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		(参考指数)		債 組 入 比	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	合 成 イ ン デ ク ス (円換算ベース)	期 騰 落 率			
(設定日)	円	%		%	%	%	百万円
2012年6月1日	10,000	—	10,000	—	—	—	8,978
1期(2013年5月10日)	13,547	35.5	13,615	36.1	96.9	△19.0	23,938
2期(2014年5月12日)	14,017	3.5	13,966	2.6	96.1	△22.5	11,593
3期(2015年5月11日)	16,906	20.6	16,909	21.1	96.6	△15.1	10,005
4期(2016年5月10日)	15,743	△6.9	15,761	△6.8	92.7	△4.8	10,038

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(注) 参考指数は、パークレイズ米国総合社債インデックスの公益、通信、エネルギー、運輸セクターの合成インデックス（円換算ベース）です。パークレイズ米国総合社債インデックスは、パークレイズ・バンク・ビーエルシーおよび関連会社（パークレイズ）が開発、算出、公表をおこなうインデックスであり、当該インデックスに関する知的財産権およびその他の一切の権利はパークレイズに帰属します。合成インデックス（円換算ベース）は、パークレイズ米国総合社債インデックスの公益、通信、エネルギー、運輸セクターの各インデックス（米ドルベース）を合成したものをもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせる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。

(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		(参 考 指 数) 合 成 イ ン デ ッ ク ス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(円換算ベース)	騰 落 率		
(期 首) 2015年 5月11日	円	%		%	%	%
	16,906	—	16,909	—	96.6	△15.1
5 月 末	17,454	3.2	17,442	3.1	97.6	△15.3
6 月 末	16,939	0.2	16,886	△0.1	93.5	△11.1
7 月 末	17,226	1.9	17,191	1.7	95.7	△ 4.4
8 月 末	16,704	△1.2	16,652	△1.5	96.4	△ 3.5
9 月 末	16,637	△1.6	16,584	△1.9	97.2	△ 4.0
10 月 末	16,771	△0.8	16,777	△0.8	95.2	0.0
11 月 末	16,981	0.4	16,969	0.4	95.3	△ 2.0
12 月 末	16,309	△3.5	16,299	△3.6	95.6	△ 3.3
2016年 1 月 末	16,259	△3.8	16,243	△3.9	89.7	0.4
2 月 末	15,342	△9.3	15,433	△8.7	88.5	6.1
3 月 末	15,909	△5.9	15,965	△5.6	93.8	3.2
4 月 末	15,823	△6.4	15,892	△6.0	92.9	△ 4.0
(期 末) 2016年 5月10日	15,743	△6.9	15,761	△6.8	92.7	△ 4.8

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

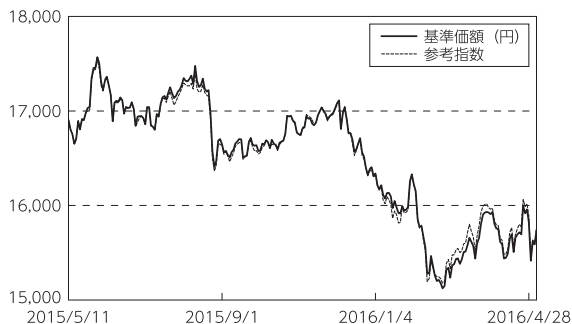
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.9%の下落となりました。

基準価額の推移



(注) 参考指数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

◎債券市況

- ・期首から2016年2月中旬にかけては、中国経済に対する懸念が高まったこと、原油をはじめとした国際商品市況や株式市況が下落したことなどを背景に、相対的に安全資産とされる国債への需要が高まったことなどから、米国金利は低下しました。しかし、この間、インフラ債券市況のスプレッド(国債に対する上乗せ金利)が拡大したことから、インフラ債券市況はほぼ横ばいとなりました。
- ・2月下旬から期末にかけては、米国金利はほぼ横ばいとなったものの、国際商品市況や株式市況が反発したことなどを背景にスプレッドが縮小したことなどをを受けて、インフラ債券市況は上昇しました。
- ・期を通じて見ると、米国金利が低下したことや債券利子収入を享受したことなどがプラスとなり、インフラ債券市況は上昇しました。

◎為替市況

- ・中国経済に対する懸念を背景に投資家のリスク回避的な姿勢が強まったこと、イエレンFRB（米連邦準備制度理事会）議長が利上げを慎重に進めると発言したことなどを受けて、米ドルは対円で下落しました。
- 当該投資信託のポートフォリオについて
 - ・世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を高位に組み入れる運用を行いました。
 - ・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）については、期首から2015年7月中旬にかけては、米国経済が回復基調にあるとの見方から、市場平均に比べて短めの水準としました。その後、11月下旬にかけては、中国をはじめとした新興国経済に関する懸念などから、市場平均に比べて長めの水準としました。その後は、グローバル経済の回復見通しなどを背景に市場平均並みの水準としました。格付別では、投資適格の中でも相対的に利回りが高いBBB格相当の組入比率を市場対比多めとしました。セクター別では、運輸を市場対比多めの配分とし、公益を少なめとしました。
 - ・前記のような運用を行った結果、インフラ債券市況が上昇したことなどがプラスとなったものの、米ドルが対円で下落したことなどがマイナスとなり、基準価額は期首と比べて下落しました。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・米国で直近発表された経済指標は概ね堅調で、基調としては緩やかな経済回復が継続すると見えています。これは企業の経営環境、ひいてはインフラ債券市況のサポート要因になると考えます。一方、中国をはじめとした新興国経済に対する不透明感の高まりや、原油など国際商品市況の動向などが金利に及ぼす影響については、引き続き注意を払う必要があると考えます。

◎今後の運用方針

- ・こうした環境下、デュレーションについては、適宜債券先物を活用しつつ、状況に応じて機動的に対応する方針です。格付配分においては、投資適格の中では相対的に利回りが高いBBB格相当の組入比率を市場対比多めとする方針を維持します。

○1万口当たりの費用明細

(2015年5月12日～2016年5月10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 1 (1)	% 0.004 (0.004)	(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 (保 管 費 用) (そ の 他)	2 (2) (0)	0.012 (0.012) (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 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	3	0.016	
期中の平均基準価額は、16,529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12日～2016年5月10日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ		千アメリカドル	千アメリカドル
		国債証券	4,217	—
		社債券	12,121	9,684

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分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
外 国	債券先物取引	百万円 4,157	百万円 3,438	百万円 7,438	百万円 7,763

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月12日～2016年5月10日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %
為替直物取引	百万円 2,372	百万円 577	24.3	百万円 1,754	百万円 406	23.1

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

○組入資産の明細

(2016年5月10日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 76,133	千アメリカドル 85,836	千円 9,309,807	% 92.7	% —	% 62.4	% 27.2	% 3.1
合 計	76,133	85,836	9,309,807	92.7	—	62.4	27.2	3.1

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.125 T-NOTE 210228	1.125	1,505	1,501	162,845	2021/2/28
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	1,700	1,679	182,192	2026/2/15
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	1,000	1,044	113,247	2025/11/15
普通社債券	2.25 DEVON ENERGY 181215	2.25	400	385	41,821	2018/12/15
	2.45 VERIZON COMM 221101	2.45	350	349	37,931	2022/11/1
	3.05 KINDER MORG 191201	3.05	900	896	97,181	2019/12/1
	3.2 PENSKE TRUCK 200715	3.2	500	506	54,940	2020/7/15
	3.35 CSX CORP 251101	3.35	250	261	28,397	2025/11/1
	3.375 CBS CORP 220301	3.375	1,000	1,048	113,736	2022/3/1
	3.45 DISCOVERY CO 250315	3.45	300	291	31,625	2025/3/15
	3.5 PACIFIC GAS 201001	3.5	500	533	57,847	2020/10/1
	3.5 PPL CAPITAL F 221201	3.5	250	263	28,619	2022/12/1
	3.5 SPECTRA ENERG 250315	3.5	350	349	37,888	2025/3/15
	3.5 VERIZON COMMU 241101	3.5	500	522	56,624	2024/11/1
	3.579 CCO SAFARI 200723	3.579	220	227	24,678	2020/7/23
	3.75 PACIFIC GAS 240215	3.75	500	544	59,068	2024/2/15
	3.875 APT PIPELIN 221011	3.875	1,600	1,626	176,463	2022/10/11
	3.875 VIACOM INC 211215	3.875	260	271	29,419	2021/12/15
	3.9 AT&T INC 240311	3.9	500	529	57,459	2024/3/11
	3.95 HUSKY ENERGY 220415	3.95	1,000	1,014	110,063	2022/4/15
	3.95 PPL CAPITAL 240315	3.95	850	915	99,319	2024/3/15
	4 EXELON GENERATI 201001	4.0	500	526	57,091	2020/10/1
	4 WILLIAMS PARTNE 250915	4.0	300	258	28,048	2025/9/15
	4.2 ENBRIDGE ENER 210915	4.2	400	399	43,326	2021/9/15
	4.2 PPL CAPITAL 220615	4.2	700	763	82,778	2022/6/15
	4.3 KINDER MORGAN 250601	4.3	350	342	37,166	2025/6/1
	4.4 VERIZON COMMU 341101	4.4	200	203	22,018	2034/11/1
	4.464 CCO SAFARI 220723	4.464	390	411	44,611	2022/7/23
	4.5 21ST CENTURY 210215	4.5	700	779	84,544	2021/2/15
	4.5 BP CAPITAL MA 201001	4.5	1,100	1,213	131,664	2020/10/1
	4.5 VIACOM INC 210301	4.5	1,000	1,088	118,088	2021/3/1
	4.522 VERIZON COM 480915	4.522	1,424	1,437	155,959	2048/9/15
	4.625 OPTUS FINAN 191015	4.625	1,316	1,424	154,463	2019/10/15
	4.7 AMERICAN TOWE 220315	4.7	400	438	47,583	2022/3/15
	4.75 AT&T INC 460515	4.75	250	248	26,928	2046/5/15
	4.75 UNION PACIFI 410915	4.75	550	628	68,135	2041/9/15
	4.8 TELSTRA CORP 211012	4.8	2,500	2,818	305,669	2021/10/12
	4.85 ENTERPRISE P 420815	4.85	250	245	26,632	2042/8/15
	4.875 DISCOVERY C 430401	4.875	200	179	19,418	2043/4/1
	4.875 HEATHROW 210715	4.875	2,100	2,287	248,105	2021/7/15
	4.875 PENSKE TRUCK 220711	4.875	1,300	1,417	153,777	2022/7/11
	4.908 CCO SAFARI 250723	4.908	380	405	44,010	2025/7/23
	4.95 DISCOVERY CO 420515	4.95	100	88	9,639	2042/5/15
	5 AMERICAN TO 240215	5.0	800	894	97,063	2024/2/15

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
普通社債券	5 PLAINS ALL AMER 210201	5.0	500	516	55,974	2021/2/1
	5.05 VERIZON COMM 340315	5.05	250	272	29,587	2034/3/15
	5.125 MARATHON PE 210301	5.125	500	546	59,228	2021/3/1
	5.125 SYDNEY AIRP 210222	5.125	1,830	2,029	220,108	2021/2/22
	5.2 ENERGY TRANSF 220201	5.2	1,050	1,045	113,446	2022/2/1
	5.25 WILLIAMS PAR 200315	5.25	500	495	53,736	2020/3/15
	5.35 SUNOCO LOGIS 450515	5.35	500	448	48,622	2045/5/15
	5.55 AT&T INC 410815	5.55	1,050	1,149	124,621	2041/8/15
	5.55 KINDER MORG 450601	5.55	300	273	29,631	2045/6/1
	5.75 BURLINGTN NO 180315	5.75	500	542	58,827	2018/3/15
	5.75 BURLINGTN NO 400501	5.75	650	835	90,657	2040/5/1
	5.75 CANADIAN PAC 420115	5.75	800	958	103,978	2042/1/15
	5.8 MIDAMERICAN 361015	5.8	400	517	56,095	2036/10/15
	5.8 PACIFIC GAS & 370301	5.8	300	382	41,532	2037/3/1
	5.85 DEVON ENERGY 251215	5.85	400	413	44,856	2025/12/15
	5.9 AMERICAN TOWE 211101	5.9	600	691	74,960	2021/11/1
	5.95 NBCUNIVERSAL 410401	5.95	400	525	56,977	2041/4/1
	6 AT&T INC 400815	6.0	1,000	1,150	124,761	2040/8/15
	6 CONOCOPHILLIPS 200115	6.0	1,600	1,808	196,176	2020/1/15
	6 NOBLE ENERGY 410301	6.0	700	710	77,071	2041/3/1
	6 SEMPRA ENERGY 391015	6.0	950	1,164	126,345	2039/10/15
	6.05 DUKE ENERGY 380415	6.05	1,000	1,346	146,061	2038/4/15
	6.05 PACIFIC GAS 340301	6.05	300	394	42,816	2034/3/1
	6.1 TRANS-CANADA 400601	6.1	500	588	63,820	2040/6/1
	6.125 NISOURCE FI 220301	6.125	600	711	77,188	2022/3/1
	6.125 VALERO ENER 170615	6.125	500	523	56,727	2017/6/15
	6.15 BURLINGTN NO 370501	6.15	695	906	98,284	2037/5/1
	6.15 ONEOK PARTNE 161001	6.15	250	253	27,495	2016/10/1
	6.221 TELEFONICA 170703	6.221	500	527	57,211	2017/7/3
	6.3 DEVON ENERGY 190115	6.3	1,000	1,052	114,180	2019/1/15
	6.4 AT&T INC 380515	6.4	237	281	30,527	2038/5/15
	6.45 ENTERPRISE 400901	6.45	250	285	31,012	2040/9/1
	6.5 ENTERPRISE PR 190131	6.5	700	781	84,774	2019/1/31
	6.5 MARATHON PETR 410301	6.5	600	606	65,823	2041/3/1
	6.55 COMCAST CORP 390701	6.55	500	691	74,982	2039/7/1
	6.55 VERIZON COMM 430915	6.55	1,000	1,313	142,498	2043/9/15
	6.6 MARATHON OIL 371001	6.6	600	566	61,390	2037/10/1
	6.625 VALERO ENER 370615	6.625	700	741	80,413	2037/6/15
	6.65 21ST CENTURY 371115	6.65	700	907	98,480	2037/11/15
	6.75 CONS EDISON 380401	6.75	500	691	74,992	2038/4/1
	6.85 KINDER MORG 200215	6.85	500	551	59,813	2020/2/15
	6.85 ONEOK PARTN 371015	6.85	550	550	59,740	2037/10/15
	6.85 SUNCOR ENERG 390601	6.85	500	599	65,053	2039/6/1
	6.9 21ST CENTURY 190301	6.9	550	628	68,201	2019/3/1
	6.95 COMCAST CORP 370815	6.95	750	1,054	114,390	2037/8/15

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	普通社債券	7.05 COMCAST CORP 330315	7.05	500	694	75,280	2033/3/15
		7.05 PROGRESS ENE 190315	7.05	1,200	1,366	148,185	2019/3/15
		7.25 WILLIAMS PAR 170201	7.25	1,000	1,033	112,116	2017/2/1
		7.4 KINDER MORGAN 310315	7.4	500	535	58,107	2031/3/15
		7.45 HALLIBURTON 390915	7.45	600	784	85,087	2039/9/15
		7.5 ANADARKO FINA 310501	7.5	1,266	1,465	158,971	2031/5/1
		7.875 CBS CORP 300730	7.875	800	1,128	122,372	2030/7/30
		8.125 HESS CORP 190215	8.125	500	554	60,182	2019/2/15
		8.25 NOBLE ENERGY 190301	8.25	600	675	73,290	2019/3/1
		8.375 TIME WARN 230315	8.375	1,400	1,833	198,881	2023/3/15
		8.375 TIME WARNER 330715	8.375	700	928	100,749	2033/7/15
		8.75 WOODSIDE FIN 190301	8.75	2,000	2,304	249,902	2019/3/1
		9 ENERGY TRANSFER 190415	9.0	1,760	1,966	213,300	2019/4/15
		9.375 VALERO ENER 190315	9.375	700	833	90,348	2019/3/15
		STEP BRITISH TEL 301215	9.625	700	1,124	121,919	2030/12/15
		STEP DEUTSCHE TEL 300615	8.75	800	1,209	131,166	2030/6/15
		STEP FRANCETELECOM310301	9.0	700	1,095	118,765	2031/3/1
合 計						9,309,807	

(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。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
			百万円	百万円
外 国	債券先物取引	NOTE5Y	—	1,131
		NOTE2Y	—	166
		NOTE10Y	—	212
		T-BOND	71	—
		ULTR10Y	245	—
		BOND30Y	714	—

(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10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 9,309,807	% 92.5
コール・ローン等、その他	751,806	7.5
投資信託財産総額	10,061,613	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (9,986,566千円) の投資信託財産総額 (10,061,613千円) に対する比率は99.3%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=108.46円			
------------------	--	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	10,059,937,486
コール・ローン等	591,258,679
公社債(評価額)	9,309,807,633
未収利息	89,763,540
前払費用	7,468,819
差入委託証拠金	61,638,815
(B) 負債	21,191,762
未払金	21,191,626
未払利息	114
その他未払費用	22
(C) 純資産総額(A-B)	10,038,745,724
元本	6,376,666,064
次期繰越損益金	3,662,079,660
(D) 受益権総口数	6,376,666,064口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,743円

<注記事項>

- ①期首元本額 5,918,548,259円
 期中追加設定元本額 2,345,774,522円
 期中一部解約元本額 1,887,656,717円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.5743円です。

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

三菱UFJ/AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(毎月決算型)	3,040,416,801円
三菱UFJ/AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	1,730,548,086円
AMP ヘッジ付グローバル・インフラ債券ファンド(ラップ向け)	1,008,045,827円
AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(FOF s用)(適格機関投資家限定)	597,655,350円
合計	6,376,666,064円

【お知らせ】

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

○損益の状況 (2015年5月12日～2016年5月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	443,558,859
受取利息	443,451,431
その他収益金	108,460
支払利息	△ 1,032
(B) 有価証券売買損益	△1,083,922,868
売買益	189,511,498
売買損	△1,273,434,366
(C) 先物取引等取引損益	27,760,592
取引益	88,154,937
取引損	△ 60,394,345
(D) 保管費用等	△ 1,052,292
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 613,655,709
(F) 前期繰越損益金	4,087,113,174
(G) 追加信託差損益金	1,463,375,478
(H) 解約差損益金	△1,274,753,283
(I) 計(E+F+G+H)	3,662,079,660
次期繰越損益金(I)	3,662,079,660

(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。

AMP グローバル・インフラ株式ファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）

「AMP グローバル・インフラ株式ファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）」は、初回決算を迎えておりませんので、開示すべき情報はありません。