

## 当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合／インデックス型	
信託期間	無期限（2016年3月30日設定）	
運用方針	各マザーファンド受益証券への投資を通じて、最適化バランス（12%）指数に連動する成果をめざして運用を行います。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。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、公社債および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。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要運用対象	ベビーファンド	TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。
	TOPIXマザーファンド	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
	外国株式インデックスマザーファンド	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円換算ベース) に採用されている株式を主要投資対象とします。
	新興国株式インデックスマザーファンド	新興国の株式等 (DR (預託証券) を含みます。) を主要投資対象とします。
	日本債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI 総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。
	外国債券インデックスマザーファンド	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。
	新興国債券インデックスマザーファンド	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。
	東証REIT指数マザーファンド	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。
	MUAM G-REITマザーファンド	S&P先進国REITインデックス (除く日本、配当込み、円換算ベース) に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
	主な組入制限	ベビーファンド
TOPIXマザーファンド		株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
外国株式インデックスマザーファンド		株式および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
新興国株式インデックスマザーファンド		株式および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
日本債券インデックスマザーファンド		外貨建資産への投資は行いません。
外国債券インデックスマザーファンド		外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
新興国債券インデックスマザーファンド		外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
東証REIT指数マザーファンド		株式および外貨建資産への投資は行いません。投資信託証券への投資割合に制限を設けません。
MUAM G-REITマザーファンド		株式への直接投資は行いません。投資信託証券および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、分配対象収益が小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)

**eMAXIS**  
 イーマックス

## eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)

第1期 (決算日: 2017年1月26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「eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)」は、去る1月26日に第1期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。  
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

**MUFG**

**三菱UFJ国際投信**

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

eMAXIS専用サイト URL:<http://emaxis.muam.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客様専用フリーダイヤル **TEL. 0120-151034**  
 (9:00~17:00、土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)  
 お客様のお取引内容につきましては、お取引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			最適化バランス (12%) 指数		株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	債券 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率						
(設定日)	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
2016年3月30日	10,000	—	—	170.40	—	—	—	—	—	—	10
1期(2017年1月26日)	10,516	0	5.2	179.20	5.2	40.7	1.5	41.0	—	15.0	239

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 最適化バランス指数は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンがeMAXISシリーズのファンド\*を参照して算出する指数であり、5つの目標リスク水準別指数の総称です。目標リスク水準別の指数は、eMAXISシリーズにおける各ファンドのベンチマークの長期間にわたるデータを用いて期待収益率、リスク（標準偏差）等をそれぞれ推計した上で最適化（目標リスク水準に対してリターンが最大化される）を行い決定される資産クラス別比率に応じて、eMAXISシリーズのファンドの基準価額（分配金再投資）の騰落率を乗じることで算出されます。指数の資産クラス別比率の決定は、原則として年1回行います。

\*最適化バランス（12%）指数を算出するために参照したファンド

eMAXIS TOPIXインデックス、eMAXIS 先進国株式インデックス、eMAXIS 新興国株式インデックス、  
eMAXIS 国内債券インデックス、eMAXIS 先進国債券インデックス、eMAXIS 新興国債券インデックス、  
eMAXIS 国内リートインデックスおよびeMAXIS 先進国リートインデックス

(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) 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		最 適 化 バ ラ ン ス ( 1 2 % ) 指 数		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
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率					
(設定日)	円	%		%	%	%	%	%	%
2016年3月30日	10,000	—	170.40	—	—	—	—	—	—
3月末	10,015	0.2	170.60	0.1	40.7	1.5	42.1	0.0	15.4
4月末	9,965	△0.4	169.70	△0.4	39.7	1.5	41.7	—	15.2
5月末	10,010	0.1	170.50	0.1	41.0	1.0	41.1	0.0	15.3
6月末	9,550	△4.5	162.70	△4.5	40.7	1.6	40.7	0.1	15.4
7月末	9,875	△1.3	168.30	△1.2	40.2	1.3	41.3	0.1	15.3
8月末	9,818	△1.8	167.30	△1.8	40.9	1.4	40.9	0.1	15.3
9月末	9,733	△2.7	165.90	△2.6	40.4	1.2	41.3	0.1	15.2
10月末	9,837	△1.6	167.70	△1.6	40.7	1.2	41.4	0.0	15.1
11月末	10,189	1.9	173.70	1.9	40.6	0.9	41.4	0.1	15.4
12月末	10,522	5.2	179.30	5.2	40.3	0.6	41.4	0.1	15.3
(期 末)									
2017年1月26日	10,516	5.2	179.20	5.2	40.7	1.5	41.0	—	15.0

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

(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) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## 運用経過

## 当期中の基準価額等の推移について

(第1期：2016/3/30～2017/1/26)

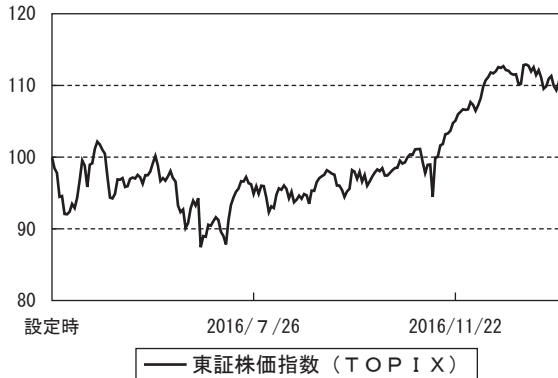
基準価額の動き	基準価額は設定時に比べ5.2%の上昇となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(5.2%)と同程度となりました。



## 基準価額の主な変動要因

上昇要因	原油価格の安定などから企業業績に回復の兆しがみられたことや、トランプ新米大統領の政策への期待感などから内外株式が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	世界的にインフレ圧力が上昇し、新興国を除く内外債券が下落したことが基準価額の下落要因となりました。

## 投資環境について

市況の推移  
(設定時を100として指数化)

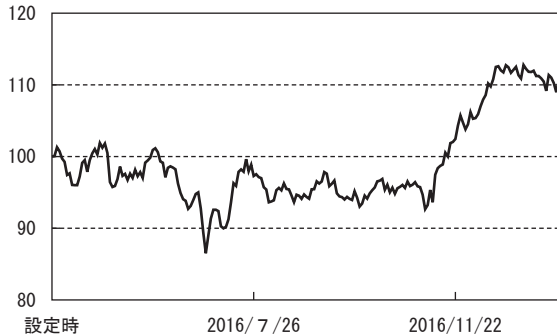
(注) 東証株価指数 (TOPIX) とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

(第1期：2016/3/30～2017/1/26)

## ◎国内株式市況

- ・ 設定時から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。

### 市況の推移 (設定時を100として指数化)



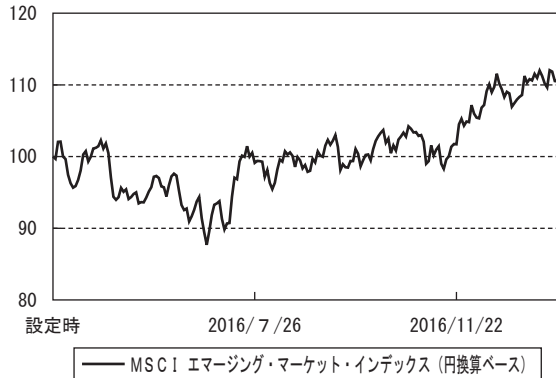
— MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイ  
インデックス) (円換算ベース)

#### ◎外国株式市況

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

(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 (MSCIコクサイ インデックス) (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 (MSCIコクサイ インデックス) に対する著作権及びその他の知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

市況の推移  
（設定時を100として指数化）

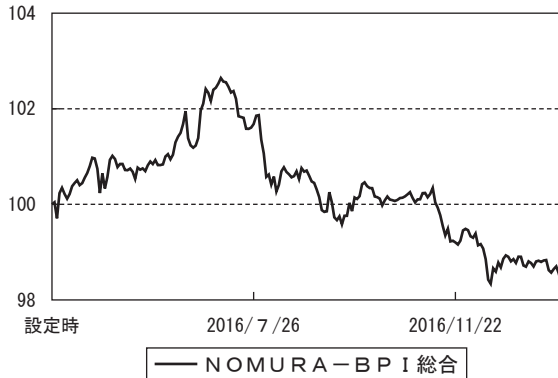


◎新興国株式市況

- ・米国の利上げが緩やかなものになるとの思惑に加え、原油価格の上昇などから新興国株式市況は上昇しました。

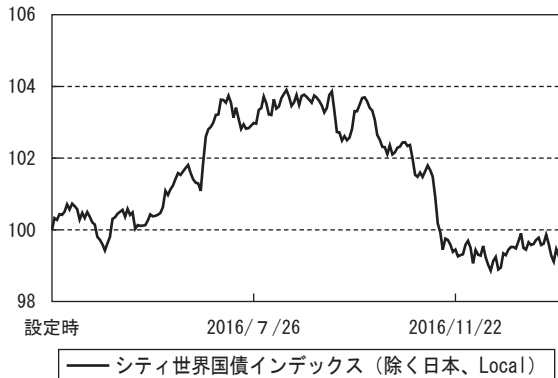
（注）MSCI エマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（米ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。また、MSCI エマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

**市況の推移**  
(設定時を100として指数化)



(注) NOMURA-BPI総合とは、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。

**市況の推移**  
(設定時を100として指数化)



(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。

◎国内債券市況

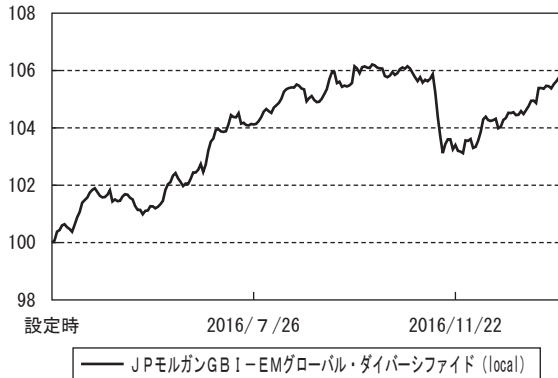
- ・設定時から2016年7月上旬にかけては、日本銀行が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」を継続したことや、イギリスのEU離脱をめぐる国民投票で離脱派が過半数を占めたことにより、世界的な景気の先行きに対する不透明感が高まったことから、国内債券市況は上昇しました。
- ・その後、期末にかけては、日本銀行が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を導入したことや、次期米国大統領にトランプ氏が選出され米国の金利が上昇したことなどから、国内債券市況は下落しました。

◎外国債券市況

- ・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。



市況の推移  
(設定時を100として指数化)



(注) JPMorgan GBI-EM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。

#### ◎新興国債券市況

- ・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設定時に比べ上昇しました。

市況の推移  
（設定時を100として指数化）



（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。

#### ◎国内REIT市況

- ・ 設定時から2016年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。

市況の推移  
（設定時を100として指数化）



◎外国REIT市況

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

(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。

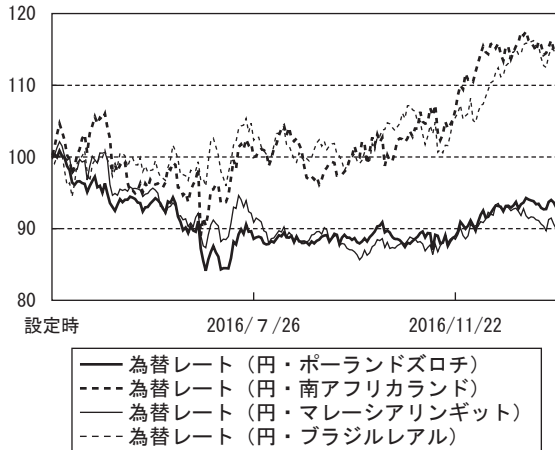
為替市況の推移  
（設定時を100として指数化）



◎為替市況

- ・2016年10月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、米ドルとユーロは対円で売られました。
- ・その後、米大統領選の結果を受けて対円で上昇したものの、期を通じて見るとユーロなどの主要通貨は対円で下落しました。
- ・設定時との比較では、米ドルは対円でほぼ横ばいとなり、ユーロは対円で4.0%下落しました。

為替市況の推移  
（設定時を100として指数化）



◎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

＜eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）＞

- ・日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券の値動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・当期末の資産クラス別比率は以下の通りです。

（ご参考）

### ベンチマークの資産クラス別比率（当期末）

マザーファンド	アセット	
新興国株式インデックスマザーファンド	新興国株式	8%
外国株式インデックスマザーファンド	先進国株式	16%
TOPIXマザーファンド	国内株式	18%
MUAM G-REITマザーファンド	先進国REIT	9%
東証REIT指数マザーファンド	国内REIT	6%
新興国債券インデックスマザーファンド	新興国債券	8%
外国債券インデックスマザーファンド	先進国債券	10%
日本債券インデックスマザーファンド	国内債券	25%

＜TOPIXマザーファンド＞

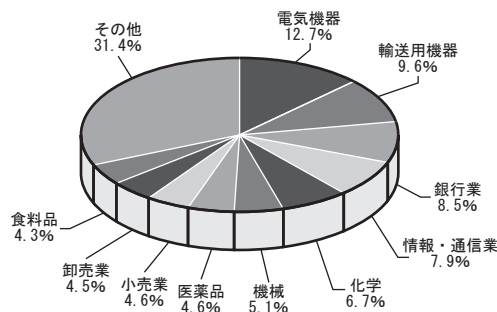
基準価額は設定時に比べ13.5%の上昇となりました。

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

（ご参考）

### 組入上位10業種

期末（2017年1月26日）



（注）比率は現物株式評価額に対する割合です。

### ＜外国株式インデックスマザーファンド＞

基準価額は設定時に比べ13.1%の上昇となりました。

- ・ M S C I Kokusai Index（M S C I 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・不動産投資信託証券（R E I T）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

### ＜新興国株式インデックスマザーファンド＞

基準価額は設定時に比べ14.4%の上昇となりました。

- ・ M S C I 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（先物・不動産投資信託証券（R E I T）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

### ＜日本債券インデックスマザーファンド＞

基準価額は設定時に比べ1.7%の下落となりました。

- ・ 資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
- ・ 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いません。
- ・ ベンチマーク（N O M U R A - B P I 総合）の構成銘柄を種別や年限などの属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました※。

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

（ご参考）

**利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）**

期末（2017年1月26日）

最終利回り	0.2%
直接利回り	1.0%
デュレーション	8.6年

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

**<外国債券インデックスマザーファンド>**

基準価額は設定時に比べ3.9%の下落となりました。

- ・日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）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。

（ご参考）

**利回り・デュレーション**

期末（2017年1月26日）

最終利回り	1.4%
直接利回り	2.4%
デュレーション	6.8年

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

### ＜新興国債券インデックスマザーファンド＞

基準価額は設定時に比べ3.0%の上昇となりました。

- ・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JPモルガンGBIー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。

（ご参考）

### 利回り・デュレーション

期末（2017年1月26日）

最終利回り	6.4%
直接利回り	6.1%
デュレーション	4.8年

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

### ＜東証REIT指数マザーファンド＞

基準価額は設定時に比べ横ばいとなりました。

- ・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。

### ＜MUAM GーREITマザーファンド＞

基準価額は設定時に比べ2.8%の上昇となりました。

- ・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（REIT）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。
- ・REIT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。



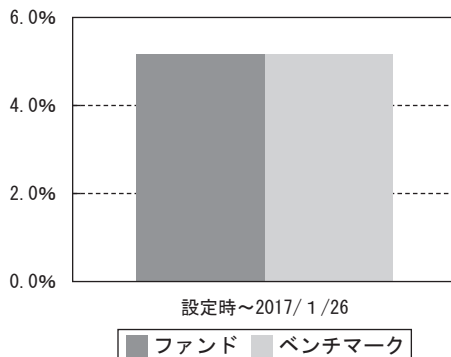
当該投資信託のベンチマークとの差異について

< eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー） >

基準価額の騰落率は5.2%の上昇となり、ベンチマークの5.2%の上昇と同程度となりました。  
差異の内訳は以下の通りです。

（内訳）  
資産配分要因  $\Delta 0.1\%$ 程度  
その他  $0.1\%$ 程度

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



< TOPIXマザーファンド >

ベンチマークは12.2%の上昇となったため、カイ離は1.3%程度となりました。  
配当要因を除くと低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	1.3%程度	1.3%程度

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

- ・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・期中における先物組入比率の平均は、1.3%程度となりました。

（注）先物の使用は、「利便性に優れ、売買コストが低い」利点がある反面、必ずしも指数の値動きと一致しないことから、ベンチマークからの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 $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.3%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	1.3%程度
マイナス要因	売買コスト等	計	$\Delta 0.0\%$ 程度

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

<外国株式インデックスマザーファンド>

ベンチマークは11.0%の上昇となったため、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・為替効果等	計	2.3%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料等	計	△0.1%程度

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

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

ベンチマーク：株価（現地通貨建て前日終値）を同日ロンドン時間の16時時点の為替レートを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。

<新興国株式インデックスマザーファンド>

ベンチマークは12.1%の上昇となったため、カイ離は2.3%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	△0.1%程度	△0.1%程度	△0.1%程度	2.6%程度	2.3%程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

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

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

◎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 $\Delta 0.1\%$ 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 $2.6\%$ 程度でした。

<日本債券インデックスマザーファンド>

ベンチマークは $1.7\%$ の下落となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	$\Delta 0.0\%$ 程度	$0.0\%$ 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 $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

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

◎その他の要因

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

<外国債券インデックスマザーファンド>

ベンチマークは4.1%の下落となったため、カイ離は0.2%程度となりました。

	ポートフォリオ 要因	管理コスト等 要因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	△0.0%程度	0.2%程度	0.2%程度

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は0.0%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は△0.0%程度でした。

- ・ カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.2%程度でした。

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

<新興国債券インデックスマザーファンド>

ベンチマークは3.2%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.2\%$ 程度となりました。

	ポートフォリオ要因	管理コスト等要因	評価時価差異に基づく要因	合計
ベンチマークとのカイ離	$\Delta 0.2\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度	0.1%程度	$\Delta 0.2\%$ 程度

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は $\Delta 0.2\%$ 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0.1%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。

<東証REIT指数マザーファンド>

ベンチマークは0.2%の下落となったため、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	0.0%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0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は0.0%程度でした。

プラス要因	売買益等	計	0.0%程度
マイナス要因	売買コスト等	計	△0.0%程度

<MUAM G-REITマザーファンド>

ベンチマークは3.2%の上昇となったため、カイ離は△0.4%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	△0.0%程度	△0.4%程度	△0.0%程度	0.1%程度	△0.4%程度

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

◎売買コスト要因

売買コストによる影響は△0.0%程度でした。

◎配当課税要因

配当課税による影響は△0.4%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△0.0%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。

## 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1期
	2016年3月30日～2017年1月26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	515

(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

< eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー） >

◎今後の運用方針

- ・資産配分方針は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンが算出する最適化バランス（12%）指数の資産クラス別比率を維持します。また、目標リスク水準に沿うように原則、年1回資産クラス別比率の変更を行い、各資産の組入比率は、期を通じて同比率に準ずるよう調整を行います。

< TOPIXマザーファンド >

◎今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

< 外国株式インデックスマザーファンド >

◎今後の運用方針

- ・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。

## &lt;新興国株式インデックスマザーファンド&gt;

## ◎今後の運用方針

- ・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。

## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

## ◎今後の運用方針

- ・ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を公社債（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持します。
- ・組入銘柄の見直しと投資比率の調整を適宜行い、種別構成比についてもベンチマークの比率に近づけるように運用します。

## &lt;外国債券インデックスマザーファンド&gt;

## ◎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。

## &lt;新興国債券インデックスマザーファンド&gt;

## ◎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等が連動する債券に投資することがあります。

## &lt;東証REIT指数マザーファンド&gt;

## ◎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。

## &lt;MUAM G-REITマザーファンド&gt;

## ◎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REIT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3月30日～2017年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	49	0.493	(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 ）	(22)	(0.217)	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 ）	(22)	(0.217)	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 ）	( 6 )	(0.059)	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	0.007	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（ 株 式 ）	( 0 )	(0.003)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	(0.002)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0 )	(0.002)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.006	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	( 1 )	(0.005)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	(0.001)	
(d) そ の 他 費 用	4	0.040	(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 ）	( 3 )	(0.031)	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 )	(0.003)	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 ）	( 1 )	(0.006)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	55	0.546	
期中の平均基準価額は、9,951円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

## ○売買及び取引の状況

(2016年3月30日～2017年1月26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
MUAM G-R E I Tマザーファンド	14,672	21,844	845	1,284
新興国株式インデックスマザーファンド	9,714	18,472	445	879
東証R E I T指数マザーファンド	5,573	14,817	318	854
新興国債券インデックスマザーファンド	15,887	19,417	795	986
T O P I Xマザーファンド	29,144	42,325	1,520	2,245
外国株式インデックスマザーファンド	17,904	37,397	954	2,068
日本債券インデックスマザーファンド	45,867	61,089	2,616	3,469
外国債券インデックスマザーファンド	12,766	24,683	581	1,133

## ○株式売買比率

(2016年3月30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		
	新興国株式インデックス マザーファンド	T O P I X 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	7,974,796千円	265,238,388千円	196,336,354千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	36,066,685千円	245,412,649千円	265,134,971千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.22	1.08	0.74

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2016年3月30日～2017年1月26日)

## 利害関係人との取引状況

&lt; eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー） &gt;

該当事項はございません。

&lt; T O P I Xマザーファンド &gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	162,733	42,051	25.8	102,504	12,894	12.6
貸付有価証券(株式)	303,377	303,377	100.0	280,368	280,368	100.0

平均保有割合 0.0%

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

## ＜外国株式インデックスマザーファンド＞

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 204,302	百万円 63,296	% 31.0	百万円 129,964	百万円 65,596	% 50.5

平均保有割合 0.0%

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

## ＜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 7,443	百万円 1,056	% 14.2	百万円 5,996	百万円 889	% 14.8

平均保有割合 0.0%

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

## ＜日本債券インデックスマザーファンド＞

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 213,361	百万円 49,680	% 23.3	百万円 257,228	百万円 40,640	% 15.8

平均保有割合 0.0%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

## ＜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 16,166	百万円 3,298	% 20.4	百万円 33,265	百万円 12,173	% 36.6

平均保有割合 0.0%

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

## ＜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 3,144	百万円 1,211	% 38.5	百万円 2,271	百万円 599	% 26.4

平均保有割合 0.1%

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

## ＜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 3,205	百万円 1,274	% 39.8	百万円 3,163	百万円 1,631	% 51.6
不動産投信指数先物取引	4,140	4,140	100.0	4,258	4,258	100.0

平均保有割合 0.0%

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

## ＜MUAMG-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 2,017	百万円 649	% 32.2	百万円 2,388	百万円 1,131	% 47.4

平均保有割合 0.0%

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

## 利害関係人の発行する有価証券等

## &lt;TOPIXマザーファンド&gt;

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 3,616	百万円 2,376	百万円 8,222

## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 801	百万円 1,032	百万円 2,143

## 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

## &lt;TOPIXマザーファンド&gt;

種 類	買 付 額
株式	百万円 97

## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

種 類	買 付 額
公社債	百万円 4,100

## &lt;東証REIT指数マザーファンド&gt;

種 類	買 付 額
投資信託証券	百万円 134

## 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	5千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.138千円
(B) / (A)	2.5%

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

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

## ○自社による当ファンドの設定・解約状況

設定時残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 10	百万円 —	百万円 —	百万円 10	当初設定時における取得

## ○組入資産の明細

(2017年1月26日現在)

## 親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
		千口	千円
MUAM G-R E I Tマザーファンド		13,827	21,341
新興国株式インデックスマザーファンド		9,269	19,311
東証R E I T指数マザーファンド		5,255	14,313
新興国債券インデックスマザーファンド		15,091	19,086
T O P I Xマザーファンド		27,623	43,866
外国株式インデックスマザーファンド		16,949	38,703
日本債券インデックスマザーファンド		43,251	56,819
外国債券インデックスマザーファンド		12,184	23,723

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「参考情報」または「運用報告書」をご参照ください。

## ○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
	千円	%
MUAM G-R E I Tマザーファンド	21,341	8.5
新興国株式インデックスマザーファンド	19,311	7.7
東証R E I T指数マザーファンド	14,313	5.7
新興国債券インデックスマザーファンド	19,086	7.6
T O P I Xマザーファンド	43,866	17.6
外国株式インデックスマザーファンド	38,703	15.5
日本債券インデックスマザーファンド	56,819	22.7
外国債券インデックスマザーファンド	23,723	9.5
コール・ローン等、その他	12,612	5.2
投資信託財産総額	249,774	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（18,041,793千円）の投資信託財産総額（18,064,831千円）に対する比率は99.9%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（43,056,805千円）の投資信託財産総額（43,253,340千円）に対する比率は99.5%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（12,435,786千円）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（361,760,229千円）の投資信託財産総額（362,581,312千円）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（128,890,434千円）の投資信託財産総額（128,982,879千円）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 カナダドル=86.66円	1 メキシコペソ=5.37円	1 ブラジルリアル=35.69円
100チリペソ=17.43円	100コロンビアペソ=3.87円	1ペルーヌエボソル=34.35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 トルコリラ=29.53円	1 チェココルナ=4.51円	100ハンガリーフォリント=39.32円
1 ボーランドズロチ=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 オーストラリアドル=85.77円
1 ニューゼalandドル=82.57円	1 香港ドル=14.59円	1 シンガポールドル=80.16円	1 マレーシアリンギット=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	100韓国ウォン=9.81円
1 ニュー台湾ドル=3.61円	1 インドルピー=1.67円	1 アラブディルハム=30.86円	1 イスラエルシェケル=29.91円
1 カタールリアル=31.14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	249,774,203
コール・ローン等	4,816,427
MUAMG-REITマザーファンド(評価額)	21,341,236
新興国株式インデックスマザーファンド(評価額)	19,311,322
東証REIT指数マザーファンド(評価額)	14,313,256
新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)	19,086,343
TOPIXマザーファンド(評価額)	43,866,011
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	38,703,223
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	56,819,387
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	23,723,165
未収入金	7,793,833
(B) 負債	10,187,787
未払解約金	9,927,738
未払信託報酬	258,223
未払利息	6
その他未払費用	1,820
(C) 純資産総額(A-B)	239,586,416
元本	227,836,215
次期繰越損益金	11,750,201
(D) 受益権総口数	227,836,215口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,516円

## &lt;注記事項&gt;

- ①設定元本額 10,000,000円  
 期中追加設定元本額 250,488,787円  
 期中一部解約元本額 32,652,572円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0516円です。

## ②分配金の計算過程

項 目	2016年3月30日～ 2017年1月26日
費用控除後の配当等収益額	1,656,538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	6,925,093円
収益調整金額	3,168,570円
分配準備積立金額	－円
当ファンドの分配対象収益額	11,750,201円
1万口当たり収益分配対象額	515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3月30日～2017年1月26日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 335
受取利息	7
支払利息	△ 342
(B) 有価証券売買損益	8,947,824
売買益	10,894,056
売買損	△ 1,946,232
(C) 信託報酬等	△ 365,858
(D) 当期損益金(A+B+C)	8,581,631
(E) 追加信託差損益金	3,168,570
(配当等相当額)	(△ 359)
(売買損益相当額)	( 3,168,929)
(F) 計(D+E)	11,750,201
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	11,750,201
追加信託差損益金	3,168,570
(配当等相当額)	( 424,316)
(売買損益相当額)	( 2,744,254)
分配準備積立金	8,581,631

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



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

【お知らせ】

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

## ○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2017年1月26日現在）

## &lt; T O P I X マザーファンド &gt;

下記は、T O P I X マザーファンド全体(197,761,894千口)の内容です。

## 国内株式

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)		
極洋	6.1	16,671
日本水産	201.6	111,686
マルハニチロ	29.5	93,367
カネコ種苗	5.3	8,018
サカタのタネ	22.9	74,654
ホクト	15.8	32,137
ホクリヨウ	1.6	1,177
鉱業 (0.3%)		
住石ホールディングス	43.1	4,310
日鉄鉱業	4.3	24,854
三井松島産業	9.5	13,176
国際石油開発帝石	817.9	889,057
日本海洋掘削	5.4	12,781
石油資源開発	24.6	62,238
K&Oエナジーグループ	10.4	18,574
建設業 (3.0%)		
ショーボンドホールディングス	16.3	79,462
ミライト・ホールディングス	47.8	50,190
タマホーム	11.6	6,345
サンヨーホームズ	3.3	2,154
ダイセキ環境ソリューション	3.6	5,824
安藤・間	111.6	90,061
東急建設	55.1	49,920
コムシスホールディングス	60.7	128,866
ミサワホーム	18.3	20,221
ピーアールホールディングス	15.4	4,481
高松コンストラクショングループ	11.7	29,203
東建コーポレーション	6.4	51,200
ソネック	1.9	1,193
ヤマウラ	7.3	4,234
大成建設	789	644,613
大林組	465.6	502,848

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
清水建設	475	503,975
飛島建設	149.6	27,376
長谷工コーポレーション	181.2	234,472
松井建設	17.1	19,254
銭高組	22	10,846
鹿島建設	682	539,462
不動テトラ	125.3	26,688
大末建設	5.5	5,412
鉄建建設	94	31,584
西松建設	179	102,388
三井住友建設	594.9	73,172
大豊建設	56	29,736
前田建設工業	96	96,672
佐田建設	10.7	4,718
ナカノフドー建設	11.9	7,021
奥村組	128	86,656
東鉄工業	18.6	60,636
イチケン	14	6,258
浅沼組	50	18,300
戸田建設	180	112,140
熊谷組	244	78,812
青木あすなろ建設	10.2	8,119
北野建設	32	10,208
植木組	19	4,883
三井ホーム	20	11,220
矢作建設工業	21.1	23,083
ピーエス三菱	16.3	6,291
日本ハウスホールディングス	31.6	16,590
大東建託	57.1	914,171
新日本建設	18.5	16,576
N I P P O	36	77,508
東亜道路工業	29	10,092
前田道路	49	95,648

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
日本道路	46	21,022
東亜建設工業	12.6	22,843
若築建設	89	13,706
東洋建設	44.7	18,371
五洋建設	172.3	97,004
大林道路	16.1	11,205
世紀東急工業	22.6	11,277
福田組	25	27,450
住友林業	106.9	165,053
日本基礎技術	17.3	6,106
日成ビルド工業	46	25,760
ヤマダ・エスバイエルホーム	79	6,320
巴コーポレーション	19.3	7,005
パナホーム	58	56,608
大和ハウス工業	458.6	1,424,411
ライト工業	29.8	35,462
積水ハウス	488.6	919,300
日特建設	13.2	6,322
北陸電気工事	7.5	6,930
ユアテック	24	19,200
西部電気工業	2.6	5,954
四電工	12	5,400
中電工	19.6	49,372
関電工	62	65,596
きんでん	103.2	151,807
東京エネシス	16	16,400
トーエネック	22	12,386
住友電設	10.7	14,059
日本電設工業	25.3	47,943
協和エクシオ	60.8	102,508
新日本空調	12	15,408
NDS	2.4	7,024
九電工	30.1	92,557
三機工業	34.4	33,505
日揮	144.9	293,132
中外炉工業	47	10,481
ヤマト	13.9	7,978
太平電業	21	23,709
高砂熱学工業	42.7	66,953
三晃金属工業	1.4	4,550

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
朝日工業社	3.5	10,430
明星工業	28.1	16,803
大気社	20.6	58,854
ダイダン	21	20,160
日比谷総合設備	17.3	29,410
東芝プラントシステム	25.2	42,739
OSJBホールディングス	47.4	11,897
東洋エンジニアリング	91	27,755
千代田化工建設	112	93,632
新興プランテック	31.9	26,285
<b>食料品 (4.3%)</b>		
日本製粉	46.2	73,319
日清製粉グループ本社	170.2	292,063
日東富士製粉	1	3,910
昭和産業	64	38,848
鳥越製粉	12.3	9,753
中部飼料	17	17,629
フィード・ワン	93.4	16,251
東洋精糖	23	2,668
日本甜菜製糖	7.9	18,738
三井製糖	11	27,456
塩水港精糖	16.6	4,133
日新製糖	6.6	11,101
森永製菓	30.3	146,046
中村屋	3.6	18,072
江崎グリコ	38.8	199,432
名糖産業	6.7	9,433
不二家	89	19,847
山崎製パン	113.7	256,279
第一屋製パン	24	3,168
モロゾフ	24	12,000
亀田製菓	8.6	44,892
寿スピリッツ	11	29,458
カルビー	63.3	229,462
森永乳業	139	106,613
六甲バター	6.9	16,297
ヤクルト本社	83.3	443,989
明治ホールディングス	92	810,520
雪印メグミルク	33.5	95,843
プリマハム	98	39,984

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
日本ハム	105	322,875
林兼産業	5	4,295
丸大食品	74	36,186
S Foods	8.3	25,149
伊藤ハム米久ホールディングス	89.6	88,166
サッポロホールディングス	50.9	150,969
アサヒグループホールディングス	291.3	1,138,691
キリンホールディングス	668.5	1,247,086
宝ホールディングス	112.4	115,884
オエノンホールディングス	40	10,760
養命酒製造	4.8	9,100
コカ・コーラウエスト	52.6	172,528
コカ・コーライーストジャパン	60.4	147,798
サントリー食品インターナショナル	106.4	512,848
ダイドールグループホールディングス	7.1	42,032
伊藤園	46.1	174,949
キーコーヒー	13.7	29,824
ユニカフェ	4.2	4,116
ジャパンフーズ	2	2,632
日清オイリオグループ	89	47,348
不二製油グループ本社	41.4	94,267
かどや製油	1.5	6,322
J-オイルミルズ	7.2	28,188
キッコーマン	109	382,045
味の素	319.9	711,457
キューピー	79	229,021
ハウス食品グループ本社	57.5	137,942
カゴメ	55.7	158,020
焼津水産化学工業	7.3	8,708
アリアケジャパン	12.7	74,549
ビエトロ	1.8	2,986
エバラ食品工業	3.7	7,696
ニチレイ	76.4	175,949
東洋水産	76.3	306,726
イートアンド	1.7	3,733
大冷	1.2	2,113
日清食品ホールディングス	60.6	361,782
永谷園ホールディングス	15	21,495
一正蒲鉾	5.4	6,150
フジッコ	15.1	35,001

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
ロック・フィールド	16.1	26,484
日本たばこ産業	860.5	3,167,500
ケンコーマヨネーズ	5.5	16,296
わらべや日洋ホールディングス	9.1	22,012
なとり	7.8	14,063
北の達人コーポレーション	3.3	1,917
ユーグレナ	50	59,050
ミヨシ油脂	53	7,526
理研ビタミン	4.6	20,516
<b>繊維製品 (0.7%)</b>		
片倉工業	18.2	24,406
グンゼ	108	41,472
東洋紡	575	108,675
ユニチカ	398	32,636
富士紡ホールディングス	7.1	25,276
倉敷紡績	146	35,040
シキボウ	78	12,324
日本毛織	40.9	36,973
ダイトウボウ	19	1,349
トーア紡コーポレーション	6.2	3,428
ダイドーリミテッド	16.2	7,079
帝国繊維	15.2	23,864
帝人	118.6	291,281
東レ	1,053	1,036,152
サカイオーボックス	3.5	6,331
住江織物	36	9,972
日本フェルト	8.3	4,274
イチカワ	10	3,000
日東製網	1.6	3,451
アツギ	119	14,875
ダイニック	27	5,238
セーレン	36.2	51,548
ソトー	5.4	6,301
東海染工	20	2,860
小松精練	20.4	14,871
ワコールホールディングス	86	116,272
ホギメディカル	9.1	62,517
レナウン	39.2	4,625
クラウドディア	3.3	1,778
T S I ホールディングス	59.8	49,215

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
三陽商会	76	13,072
ナイガイ	53	3,180
オンワードホールディングス	94	79,242
ルック	26	4,628
キムラタン	611	4,277
ゴールドウイン	6.2	32,674
デサント	33.1	44,122
キング	7.2	2,952
ヤマトインターナショナル	8.9	3,649
<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>		
特種東海製紙	8.4	33,768
王子ホールディングス	567	289,737
日本製紙	65	134,940
三菱製紙	20.6	16,583
北越紀州製紙	81	55,728
中越パルプ工業	57	14,136
巴川製紙所	22	5,126
大王製紙	57.8	75,255
阿波製紙	2.6	1,588
レンゴー	139.9	97,370
トーモク	46	15,410
ザ・バック	10.3	30,848
<b>化学 (6.7%)</b>		
クラレ	244.3	444,381
旭化成	905	983,282
共和レザー	8.4	7,425
昭和電工	96.6	182,863
住友化学	1,068	621,576
住友精化	6	27,480
日産化学工業	79.5	325,155
ラサ工業	55	7,920
クレハ	10.9	52,538
多木化学	10	8,270
テイカ	22	16,082
石原産業	26.1	24,455
片倉コープアグリ	20	4,740
日東エフシー	8.5	7,939
日本曹達	87	47,850
東ソー	420	369,180
トクヤマ	226	117,068

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
セントラル硝子	148	82,288
東亜合成	90.9	110,988
大阪ソーダ	63	31,185
関東電化工業	30	33,030
デンカ	301	170,366
信越化学工業	260.3	2,629,030
日本カーバイド工業	49	7,644
堺化学工業	54	21,384
エア・ウォーター	119.7	257,953
大陽日酸	111.8	156,855
日本化学工業	54	13,014
日本バーカライジング	74.2	104,622
高圧ガス工業	21.5	15,931
チタン工業	17	3,332
四国化成工業	21	23,100
戸田工業	29	8,410
ステラ ケミファ	6.9	24,667
保土谷化学工業	5.1	14,514
日本触媒	22.8	182,856
大日精化工業	60	41,520
カネカ	196	196,000
三菱瓦斯化学	135.2	302,172
三井化学	660	354,420
J S R	145.9	302,304
東京応化工業	27.2	112,608
大阪有機化学工業	9.4	8,836
三菱ケミカルホールディングス	977.8	785,564
KHネオケム	17.8	24,439
ダイセル	195.7	247,364
住友パークライト	128	88,320
積水化学工業	329.5	651,421
日本ゼオン	122	154,208
アイカ工業	46.5	144,150
宇部興産	731	203,218
積水樹脂	22.4	40,611
タキロン	30	16,440
旭有機材	47	10,763
日立化成	80.7	265,906
ニチバン	14	12,040
リケンテクノス	31.3	17,590

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
大倉工業	35	18,410
積水化成工業	20.6	17,159
群栄化学工業	3.5	11,812
タイガースポリマー	7.1	5,793
ミライアル	5.2	5,148
ダイキアクシス	2.4	2,757
ダイキョーニシカワ	25.4	39,039
日本化薬	94	140,154
カーリットホールディングス	13.5	7,560
日本精化	12	10,704
扶桑化学工業	10.3	26,007
ADEKA	62.4	104,083
日油	117	142,155
新日本理化	22.9	3,686
ハリマ化成グループ	12.3	9,778
花王	368.6	2,049,416
第一工業製薬	32	12,672
ニイタカ	2.1	3,045
三洋化成工業	9.1	46,592
有機合成薬品工業	9.5	2,536
大日本塗料	83	20,418
日本ペイントホールディングス	112	374,640
関西ペイント	152.5	340,990
神東塗料	11	2,398
中国塗料	41.6	36,857
日本特殊塗料	10.2	18,360
藤倉化成	19.7	13,356
太陽ホールディングス	11.8	54,988
D I C	57.3	206,566
サカティンクス	29.6	45,376
東洋インキS Cホールディングス	143	79,222
T & K TOKA	10.5	11,119
富士フイルムホールディングス	287.8	1,262,003
資生堂	275.4	860,900
ライオン	180	353,340
高砂香料工業	9.5	29,592
マンダム	14.5	75,835
ミルボン	7.8	36,270
ファンケル	30.8	53,222
コーセー	23.5	230,065

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
コタ	5.5	7,298
シーズ・ホールディングス	18.8	60,630
シーボン	1.7	4,231
ポーラ・オルビスホールディングス	14.8	156,584
ノエビアホールディングス	9.2	35,558
アジュバンコスメジャパン	2.7	2,554
エステー	9.9	16,958
アグロ カネショウ	5.6	6,921
コニシ	22.8	30,278
長谷川香料	18.4	35,972
星光PMC	7.9	9,788
小林製薬	40.3	203,112
荒川化学工業	12.4	23,212
メック	11.2	11,502
日本高純度化学	4.1	10,209
タカラバイオ	31.1	50,195
J C U	4.6	27,784
新田ゼラチン	8.7	6,559
O A Tアグリオ	1.7	2,313
デクセリアルズ	38	44,498
アース製薬	10.4	50,076
イハラケミカル工業	20.1	21,728
北興化学工業	14	6,832
大成ラミック	4.1	12,710
クミアイ化学工業	29.9	20,391
日本農薬	33.1	20,654
アキレス	11.9	20,456
有沢製作所	24.5	16,562
日東電工	104.7	972,663
レック	4.5	15,525
きもと	25.9	6,449
藤森工業	10.8	33,156
前澤化成工業	9.5	11,523
J S P	6.8	17,979
エフビコ	12.9	70,047
天馬	9.6	19,872
信越ポリマー	28.4	26,014
東リ	34.5	13,834
ニフコ	25.4	147,320
日本バルカー工業	11.3	19,040

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
ユニ・チャーム	293.8	759,326
<b>医薬品 (4.6%)</b>		
協和発酵キリン	173.6	268,038
武田薬品工業	544.1	2,599,709
アステラス製薬	1,482.7	2,280,392
大日本住友製薬	102.7	206,529
塩野義製薬	196.4	1,086,288
田辺三菱製薬	169.1	382,335
わかもと製薬	16	4,048
あすか製薬	15.8	27,365
日本新薬	33.2	198,536
ビオフェルミン製薬	2.4	6,842
中外製薬	144.5	487,687
科研製薬	27.1	157,451
エーザイ	178.6	1,144,826
ロート製薬	71	138,805
小野薬品工業	329.6	766,155
久光製薬	40.9	244,173
持田製薬	9.9	80,289
参天製薬	267.4	371,953
扶桑薬品工業	4.9	13,969
日本ケミファ	2	11,200
ツムラ	48.7	158,762
日医工	33.9	55,257
キッセイ薬品工業	25.7	72,242
生化学工業	26.9	45,407
栄研化学	12.2	38,125
日水製薬	5.8	7,528
鳥居薬品	9.9	24,928
JCRファーマ	11.2	31,214
東和薬品	6.6	29,700
富士製薬工業	4.7	13,014
沢井製薬	24.6	146,862
ゼリア新薬工業	29.7	53,608
第一三共	427.1	1,069,458
キョーリン製薬ホールディングス	35.5	89,424
大幸薬品	7.2	13,060
ダイト	8.1	18,459
大塚ホールディングス	312	1,655,472
大正製薬ホールディングス	31	296,980

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
ペプチドリーム	24.6	143,418
<b>石油・石炭製品 (0.5%)</b>		
日本コークス工業	117.1	13,349
昭和シェル石油	129.7	145,523
ニチレキ	17.7	16,514
東燃ゼネラル石油	236	310,340
ユシロ化学工業	7.8	11,395
ビービー・カストロール	5.9	9,091
富士石油	33.6	13,876
MORESCO	5	8,790
出光興産	68.8	237,360
JXホールディングス	1,610.5	851,793
コスモエネルギーホールディングス	43.8	84,183
<b>ゴム製品 (0.9%)</b>		
横浜ゴム	87.5	177,450
東洋ゴム工業	76.6	105,708
ブリヂストン	489.8	2,003,771
住友ゴム工業	135.8	242,674
藤倉ゴム工業	12.1	8,010
オカモト	44	47,080
フコク	6.1	5,691
ニッタ	13	40,690
住友理工	26.9	29,428
三ツ星ベルト	35	35,420
バンドー化学	26.4	27,112
<b>ガラス・土石製品 (1.0%)</b>		
日東紡績	117	53,820
旭硝子	715	609,895
日本板硝子	66.1	62,332
石塚硝子	20	4,140
日本山村硝子	58	11,774
日本電気硝子	300	199,200
オハラ	5.5	4,713
住友大阪セメント	269	124,278
太平洋セメント	875	355,250
日本ヒューム	13.9	9,757
日本コンクリート工業	32.3	11,111
三谷セキサン	7.3	21,345
アジアパイルホールディングス	17.8	10,217
東海カーボン	135.5	55,826

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
日本カーボン	71	20,022
東洋炭素	8	15,480
ノリタケカンパニーリミテド	8.2	23,862
TOTO	106.6	492,492
日本碍子	183.2	418,978
日本特殊陶業	125	315,875
ダントーホールディングス	12	2,292
MARUWA	5.3	19,663
品川リフラクトリーズ	37	10,027
黒崎播磨	31	10,261
ヨータイ	8	2,872
イソライト工業	7.1	2,293
東京窯業	17.6	3,396
ニッカトー	4.7	1,964
フジインコーポレーテッド	12.3	30,171
エーアンドエーマテリアル	30	4,020
ニチアス	76	90,896
ニチハ	19.3	56,452
<b>鉄鋼 (1.4%)</b>		
新日鐵住金	654.2	1,834,049
神戸製鋼所	250.8	285,661
中山製鋼所	16.3	12,534
合同製鐵	8.1	17,220
ジェイ エフ イー ホールディングス	396.5	803,110
日新製鋼	66.2	100,955
東京製鐵	73.4	75,969
共英製鋼	15.5	35,975
大和工業	29.1	100,249
東京鐵鋼	30	14,400
大阪製鐵	9.1	20,238
淀川製鋼所	20	65,700
東洋鋼板	34.7	14,296
丸一鋼管	48.5	185,027
モリ工業	4.6	9,480
大同特殊鋼	243	127,089
日本高周波鋼業	51	4,539
日本冶金工業	120	23,280
山陽特殊製鋼	86	51,772
愛知製鋼	8.6	43,774
日立金属	147.6	241,621

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
日本金属	3.5	4,504
大平洋金属	93	33,945
新日本電工	82.1	24,383
栗本鐵工所	6.9	16,194
虹技	20	5,300
日本鑄鉄管	14	2,814
三菱製鋼	101	25,957
日亜鋼業	20	5,480
日本精線	10	6,130
シンニッタン	11.8	8,248
新家工業	31	5,053
<b>非鉄金属 (0.9%)</b>		
大紀アルミニウム工業所	24	12,816
日本軽金属ホールディングス	328.4	92,280
三井金属鋁業	394	126,868
東邦亜鉛	82	42,230
三菱マテリアル	90.5	363,810
住友金属鋁山	375	583,687
DOWAホールディングス	160	157,440
古河機械金属	226	52,432
エス・サイエンス	65.9	2,504
大阪チタニウムテクノロジーズ	15.8	27,555
東邦チタニウム	24.5	19,796
UACJ	184	65,320
古河電気工業	48.6	191,241
住友電気工業	546.6	911,182
フジクラ	190.9	138,402
昭和電線ホールディングス	172	15,824
東京特殊電線	2.1	3,080
タツタ電線	27.2	12,892
沖電線	15	3,630
カナレ電気	2	4,502
平河ヒューテック	6.8	8,738
リョービ	88	43,912
アーレスティ	16.8	20,630
アサヒホールディングス	21.8	48,526
<b>金属製品 (0.7%)</b>		
稲葉製作所	7.7	10,472
宮地エンジニアリンググループ	42	8,400
トーカロ	9.5	24,519



銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
アルファCo	4.8	5,467
SUMCO	151.4	269,340
川田テクノロジーズ	2.7	22,194
RS Technologies	0.5	2,085
東洋製罐グループホールディングス	103.1	221,046
ホッカンホールディングス	38	17,936
コロナ	7.6	8,770
横河ブリッジホールディングス	25.5	35,980
駒井ハルテック	2.8	6,025
高田機工	13	3,107
三和ホールディングス	144	161,568
文化シャッター	40.4	37,168
三協立山	19	33,041
アルインコ	10	10,570
東洋シャッター	3.6	2,311
LIXILグループ	202	552,874
日本フィルコン	10.5	6,079
ノーリツ	28.4	56,232
長府製作所	15.5	40,362
リンナイ	24.7	236,379
ダイニチ工業	7.4	5,409
日東精工	20.6	8,590
三洋工業	18	3,600
岡部	30.1	28,896
ジーテクト	15.1	32,434
中国工業	2.1	1,474
東プレ	27.9	80,045
高周波熱錬	26.9	24,398
東京製綱	9.8	19,168
サンコール	7.7	4,150
モリテック スチール	7.3	2,124
バイオラックス	7.3	53,947
日本発條	136.5	153,835
中央発條	16	5,248
アドバネクス	2.5	4,817
立川ブラインド工業	6	5,496
三益半導体工業	10.7	19,998
<b>機械 (5.1%)</b>		
日本ドライケミカル	1.9	4,497
日本製鋼所	47.9	104,517

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
三浦工業	59.3	107,273
タクマ	46.4	46,539
ツガミ	39	27,924
オークマ	94	115,244
東芝機械	86	43,086
アマダホールディングス	195.2	265,081
アイダエンジニアリング	41.2	46,391
滝澤鉄工所	42	7,098
富士機械製造	44.2	62,498
牧野フライス製作所	72	73,296
オーエスジー	66.1	158,309
ダイジェット工業	17	3,060
旭ダイヤモンド工業	41.5	35,939
DMG森精機	85.8	134,362
ソディック	36.8	36,432
ディスコ	17	247,520
日東工器	8.4	21,252
パンチ工業	5.2	4,825
豊和工業	8.1	5,435
OKK	53	6,784
石川製作所	3.6	2,656
東洋機械金属	9.8	4,635
津田駒工業	32	5,664
エンシュウ	36	3,636
島精機製作所	18.9	76,261
NCホールディングス	4.7	4,375
フリュー	2.8	13,202
ヤマシンフィルタ	2.8	4,972
日阪製作所	19.7	18,419
やまびこ	26.6	43,491
ベガサスミシン製造	13.9	9,813
ナブテスコ	75.4	224,842
三井海洋開発	14.6	28,849
レオン自動機	12.2	12,907
SMC	43.5	1,316,310
新川	12.1	10,406
ホソカワミクロン	24	18,936
ユニオンツール	6.3	20,002
オイレス工業	18.7	38,110
日精エー・エス・ビー機械	4.6	10,202

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
サトーホールディングス	18	42,678
日本エアータック	4.7	3,031
日精樹脂工業	11.5	11,983
オカダアイヨン	3	3,360
ワイエイシイ	5.4	8,391
小松製作所	669.1	1,898,905
住友重機械工業	423	341,784
日立建機	64.8	177,746
日工	4.4	9,640
巴工業	5.9	11,298
井関農機	148	33,448
TOWA	11.8	20,921
丸山製作所	30	5,820
北川鉄工所	6.6	16,328
ローツェ	5.1	11,883
タカキタ	4.8	2,644
クボタ	696.3	1,266,221
荏原実業	4	5,400
三菱化工機	48	10,560
月島機械	27.5	33,467
帝国電機製作所	10.5	10,930
東京機械製作所	54	4,212
新東工業	32.9	34,150
澁谷工業	12.1	28,822
アイチ コーポレーション	20.5	17,404
小森コーポレーション	34.8	53,383
鶴見製作所	10.8	17,874
住友精密工業	23	8,096
酒井重工業	28	9,688
荏原製作所	63.8	227,766
石井鐵工所	2.1	3,824
西島製作所	14.1	16,200
北越工業	15.6	12,651
ダイキン工業	189.2	2,166,340
オルガノ	27	13,176
トーヨーカネツ	66	22,242
栗田工業	82	221,810
椿本チエイン	82	76,670
大同工業	28	7,392
木村化工機	12.4	4,216

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
アネスト岩田	25.1	28,337
ダイフク	69.1	174,339
サムコ	3.5	4,102
加藤製作所	7.6	22,800
油研工業	27	6,129
タダノ	72.4	108,165
フジテック	40.3	55,049
CKD	41.5	65,072
キトー	17.5	22,942
平和	42.9	118,575
理想科学工業	13.8	28,207
SANKYO	38.5	145,530
日本金銭機械	12.8	19,776
マースエンジニアリング	7.8	17,082
福島工業	8.5	30,515
オーイズミ	5.8	4,100
ダイコク電機	5.7	9,769
竹内製作所	25.3	62,668
アマノ	42.9	94,079
JUKI	21.9	26,915
サンデンホールディングス	85	31,025
蛇の目ミシン工業	13.4	11,443
マックス	21	30,849
グローリー	44.3	159,037
新晃工業	9.7	13,793
大和冷機工業	22.3	22,188
セガサミーホールディングス	137.5	249,150
日本ビストンリング	5.4	11,345
リケン	6.4	26,944
T P R	15.5	52,080
ツバキ・ナカシマ	15.5	27,946
ホシザキ	30.4	292,752
大豊工業	11.2	18,659
日本精工	284.6	401,001
NTN	321	159,537
ジェイテクト	147.7	283,288
不二越	139	77,284
日本トムソン	44.3	23,168
THK	97.9	277,938
ユーション精機	6.1	18,031

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
前澤給装工業	5.2	7,945
イーグル工業	15	23,580
前澤工業	10.1	3,747
日本ビラー工業	14	18,858
キッツ	66.5	44,422
日立工機	37.1	32,165
マキタ	90.4	717,776
日立造船	109.9	67,808
三菱重工業	2,322	1,231,821
I H I	1,065	333,345
スター精密	24.3	42,014
<b>電気機器 (12.7%)</b>		
日清紡ホールディングス	76.9	84,743
イビデン	97	161,602
コニカミノルタ	324.4	390,902
ブラザー工業	179.1	382,736
ミネベア	223.4	256,463
日立製作所	3,327	2,245,059
東芝	3,100	801,350
三菱電機	1,478.1	2,597,760
富士電機	418	279,642
東洋電機製造	5.4	8,883
安川電機	160.6	331,960
シンフォニアテクノロジー	90	26,550
明電舎	127	50,292
オリジン電気	20	6,320
山洋電気	36	32,508
デンヨー	12.8	21,286
東芝テック	87	55,506
芝浦メカトロニクス	22	6,512
マブチモーター	39.1	237,337
日本電産	179.6	1,910,944
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1.6	5,056
東光高岳	7	15,036
ダブル・スコープ	13.3	22,583
宮越ホールディングス	4.7	2,354
ダイヘン	76	57,456
田淵電機	20.9	8,380
ヤーマン	1.8	10,044
JVCケンウッド	101.7	32,035

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
ミマキエンジニアリング	12.4	9,052
第一精工	6.5	8,970
日新電機	27.8	38,725
大崎電気工業	28	33,208
オムロン	147.3	718,087
日東工業	20.4	31,926
I D E C	18.1	20,615
不二電機工業	1.5	2,127
ジーエス・ユアサ コーポレーション	267	126,291
サクサホールディングス	35	8,435
メルコホールディングス	7.7	24,717
テクノメディカ	3.1	6,324
日本電気	1,905	603,885
富士通	1,336	932,260
沖電気工業	60	98,520
岩崎通信機	61	5,368
電気興業	39	22,893
サンケン電気	81	45,036
ナカヨ	14	5,656
アイホン	7.8	15,100
ルネサスエレクトロニクス	71.7	73,635
セイコーエプソン	206.3	494,707
ワコム	107.5	37,410
アルバック	25.5	104,932
アクセル	5.8	5,684
E I Z O	13.7	47,128
ジャパンディスプレイ	258.8	85,662
日本信号	38.2	41,217
京三製作所	32	12,960
能美防災	15.7	27,475
ホーチキ	10	14,340
エレコム	12	23,376
日本無線	8.5	11,262
パナソニック	1,583.2	1,910,922
アンリツ	101	70,397
富士通ゼネラル	47	108,335
日立国際電気	36.2	94,988
ソニー	978.4	3,443,968
TDK	78.1	640,420
帝国通信工業	31	5,549

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
ミツミ電機	48.8	31,036
タムラ製作所	53	23,426
アルプス電気	127.9	385,618
池上通信機	44	7,172
バイオニア	208.2	52,882
日本電波工業	13.4	12,261
鈴木	5.3	2,745
日本トリム	3.4	14,348
ローランド ディー. ジー.	7.1	24,069
フォスター電機	16.2	31,168
クラリオン	73	32,339
SMK	35	15,085
ヨコオ	9.9	11,325
ティアック	100	4,800
ホシデン	42	38,304
ヒロセ電機	22.4	336,896
日本航空電子工業	44	64,988
TOA	16.3	16,935
日立マクセル	20.7	44,153
古野電気	17.8	13,652
ユニデンホールディングス	41	6,806
アルパイン	33	50,787
スミダコーポレーション	11.3	12,938
アイコム	7.7	17,070
リオン	5.3	8,469
本多通信工業	4.4	5,596
船井電機	15.5	14,058
横河電機	150.2	282,826
新電元工業	53	22,684
アズビル	42	143,640
東亜ディーケーケー	6.8	3,746
日本光電工業	57.9	151,234
チノー	4.9	5,556
共和電業	15.7	6,531
日本電子材料	5.5	3,393
堀場製作所	27.4	163,304
アドバンテスト	94.5	205,065
小野測器	6.7	5,855
エスベック	12.3	15,928
パナソニック デバイスSUNX	12.1	9,909

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
キーエンス	62.8	2,750,640
日置電機	7.2	15,573
シスメックス	107.7	706,512
日本マイクロニクス	25.8	28,767
メガチップス	12.9	34,236
OBARA GROUP	8.1	44,469
澤藤電機	8	1,760
コーセル	19.2	25,228
イリソ電子工業	4.4	29,392
新日本無線	11.8	4,885
オブテックスグループ	10.5	27,541
千代田インテグレ	7.3	17,928
アイ・オー・データ機器	4.3	5,534
レーザーテック	16.2	38,377
スタンレー電気	98.8	301,834
岩崎電気	50	9,450
ウシオ電機	84.1	120,935
岡谷電機産業	7.4	3,085
ヘリオス テクノ ホールディング	12.8	6,976
日本セラミック	11.3	23,956
遠藤照明	7	6,363
古河電池	10	7,610
双信電機	6.7	1,963
山一電機	13	17,329
図研	9	11,835
日本電子	50	28,950
カシオ計算機	111.4	176,346
ファナック	140.5	3,182,325
日本シイエムケイ	29.8	20,651
エンプラス	6.3	21,703
大真空	5.1	7,481
ローム	67	492,450
浜松ホトニクス	108.1	352,406
三井ハイテック	18.3	15,902
新光電気工業	52.3	45,657
京セラ	227.5	1,351,577
太陽誘電	67.4	94,899
村田製作所	145.4	2,250,065
ユーシン	18.4	15,842
双葉電子工業	22.7	44,832

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
北陸電気工業	56	7,728
ニチコン	43.6	47,524
日本ケミコン	119	31,416
KOA	19.2	25,017
市光工業	29	12,209
小糸製作所	83	511,280
ミツバ	25.5	51,357
SCREENホールディングス	28.4	206,184
キャノン電子	12.7	22,352
キャノン	746	2,524,464
リコー	416.7	430,451
MUTOHホールディングス	19	4,902
東京エレクトロン	92.4	1,107,414
<b>輸送用機器 (9.6%)</b>		
トヨタ紡織	48.4	125,259
芦森工業	31	5,022
ユニプレス	26.7	65,628
豊田自動織機	126.2	702,934
モリタホールディングス	24.2	39,470
三桜工業	17.6	14,344
デンソー	341.7	1,706,108
東海理化電機製作所	36.5	82,417
三井造船	501	94,188
川崎重工業	1,078	398,860
名村造船所	41.6	31,657
サノヤスホールディングス	16.8	4,653
日本車輛製造	51	13,719
ニチユ三菱フォークリフト	16	13,184
近畿車輛	2.1	5,611
日産自動車	1,658.4	1,900,526
いすゞ自動車	401.5	628,347
トヨタ自動車	1,684.7	11,395,310
日野自動車	197.8	234,393
三菱自動車工業	507.8	322,453
エフテック	7.3	9,541
レシップホールディングス	4.5	4,005
GMB	2.2	2,571
ファルテック	2.4	3,264
武蔵精密工業	16.1	50,393
日産車体	60.9	66,563

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
新明和工業	56	60,816
極東開発工業	27.6	43,939
日信工業	31	58,156
トビー工業	11.4	36,594
ティラド	54	15,822
曙ブレーキ工業	64.4	20,350
タチエス	23.5	44,720
NOK	67	158,388
フタバ産業	42.2	29,413
KYB	155	88,195
大同メタル工業	17.4	18,913
プレス工業	73.6	37,462
ミクニ	17.6	6,987
カルソニックカンセイ	94	168,918
太平洋工業	28.4	40,526
ケーヒン	31.8	65,317
河西工業	18.7	25,170
アイシン精機	126.8	672,040
富士機工	13.7	6,274
マツダ	438.8	758,685
今仙電機製作所	12.7	12,687
本田技研工業	1,247	4,366,994
スズキ	274.6	1,220,597
富士重工業	430.2	2,046,461
安永	5	8,580
ヤマハ発動機	195.7	473,594
ショーワ	36	28,692
TBK	17.7	8,832
エクセディ	18.8	60,254
豊田合成	44.7	124,355
愛三工業	24.3	23,133
盟和産業	2.1	2,490
ヨロズ	12.9	20,149
エフ・シー・シー	22.7	46,217
シマノ	55.9	1,006,759
タカタ	25	15,475
テイ・エス テック	32.2	94,732
ジャムコ	8.1	21,432
<b>精密機器 (1.5%)</b>		
テルモ	212.4	893,142

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
クリエートメディック	4.6	4,420
日機装	47.9	51,779
島津製作所	178.3	343,584
JMS	26	8,086
クボテック	3	1,812
長野計器	10.9	7,673
ブイ・テクノロジー	2.8	48,076
東京計器	48	12,096
愛知時計電機	1.8	6,984
オーバル	13.5	3,901
東京精密	26.7	101,460
マニー	18.4	51,980
ニコン	241.5	451,122
トプコン	69.8	121,382
オリンパス	221.2	878,164
理研計器	12.2	20,813
タムロン	12.3	25,079
HOYA	285.1	1,373,896
ノーリツ鋼機	14	12,404
ユー・アンド・デイ	12.6	6,161
シチズン時計	151.6	106,574
リズム時計工業	55	10,065
大研医器	12.3	9,901
メニコン	9.5	32,062
松風	7.3	10,059
セイコーホールディングス	98	40,964
ニプロ	95.9	122,368
<b>その他製品 (1.7%)</b>		
スノーピーク	2.1	6,285
パラマウントベッドホールディングス	13.3	59,185
トランザクション	3	6,168
SHO-BI	4.6	1,955
ニホンフラッシュ	6.5	8,515
前田工繊	13.9	18,070
永大産業	18	9,108
アートネイチャー	14.8	10,493
ダンロップスポーツ	8.7	9,178
バンダイナムコホールディングス	152.8	487,432
アイフィスジャパン	3.1	1,329
共立印刷	23	7,590

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
SHOEI	6.2	13,565
フランスベッドホールディングス	17.4	16,216
パイロットコーポレーション	24.2	113,498
萩原工業	3.8	10,153
トッパン・フォームズ	24.7	29,096
フジシールインターナショナル	31.1	75,355
タカラトミー	53.9	66,836
廣済堂	13.9	5,712
Asmeエステール	3.7	2,556
アーク	58.3	7,287
タカノ	6.1	5,380
プロネクス	13	14,105
ホクシン	9.8	2,234
ウッドワン	23	6,417
大建工業	9.7	21,126
凸版印刷	391	439,484
大日本印刷	400	465,200
図書印刷	19	8,892
共同印刷	43	17,286
日本写真印刷	23.2	74,472
光村印刷	12	3,096
宝印刷	6.7	10,184
アシックス	137.7	307,484
ツツミ	5.2	10,145
小松ウオール工業	4.7	9,193
ヤマハ	93.4	332,504
河合楽器製作所	5.4	12,268
クリナップ	16.2	14,596
ピジョン	83.7	257,377
兼松サステック	14	2,800
キングジム	11.5	9,821
リンテック	32.9	84,585
TASAKI	3.8	5,935
イトーキ	29.2	21,170
任天堂	85.3	2,010,521
三菱鉛筆	11.4	69,312
タカラスタンダード	28.6	55,369
コクヨ	72	98,064
ナカバヤシ	25	6,800
グロープライド	6.7	12,321

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
岡村製作所	48.4	49,706
美津濃	74	43,882
<b>電気・ガス業 (1.8%)</b>		
東京電力ホールディングス	1,175.4	524,228
中部電力	456.6	708,643
関西電力	565.5	705,178
中国電力	191.6	251,570
北陸電力	135.7	172,474
東北電力	346.2	486,064
四国電力	124.8	139,276
九州電力	306	395,352
北海道電力	129.7	111,542
沖縄電力	20.4	54,549
電源開発	110.3	297,810
エフオン	5.7	5,802
イーレックス	5.8	19,633
東京瓦斯	1,486	781,933
大阪瓦斯	1,345	585,478
東邦瓦斯	349	313,751
北海道瓦斯	34	9,384
広島ガス	28.5	10,545
西部瓦斯	156	40,560
静岡ガス	42.6	32,248
メタウォーター	7.8	20,982
<b>陸運業 (4.3%)</b>		
SBSホールディングス	13.7	11,083
東武鉄道	740	428,460
相鉄ホールディングス	222	127,428
東京急行電鉄	753	641,556
京浜急行電鉄	380	513,760
小田急電鉄	222	506,604
京王電鉄	387	366,102
京成電鉄	103.9	283,647
富士急行	38	41,914
新京成電鉄	18	7,560
東日本旅客鉄道	268.1	2,796,283
西日本旅客鉄道	133.4	969,017
東海旅客鉄道	115.2	2,174,400
西武ホールディングス	191.4	366,339
鴻池運輸	19.6	29,439

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
西日本鉄道	166	85,822
ハマキョウレックス	9	19,017
サカイ引越センター	4.8	14,736
近鉄グループホールディングス	1,395	613,800
阪急阪神ホールディングス	175	681,625
南海電気鉄道	293	167,303
京阪ホールディングス	310	233,430
神戸電鉄	34	13,192
名古屋鉄道	505	284,315
山陽電気鉄道	50	30,850
日本通運	536	336,072
ヤマトホールディングス	247.8	590,879
山九	182	127,582
丸運	7.5	1,905
丸全昭和運輸	46	21,114
センコー	62.3	47,908
トナミホールディングス	28	10,276
ニッコンホールディングス	47	110,826
日本石油輸送	1.6	3,968
福山通運	84	53,256
セイノーホールディングス	98.3	127,986
神奈川中央交通	16	11,712
日立物流	28.9	69,244
丸和運輸機関	3.5	9,772
C&Fロジホールディングス	14.4	18,979
九州旅客鉄道	103.3	315,065
<b>海運業 (0.3%)</b>		
日本郵船	1,171	285,724
商船三井	727	273,352
川崎汽船	525	149,100
NSユナイテッド海運	62	13,392
明治海運	12.4	5,369
飯野海運	71.7	34,129
共栄タンカー	12	2,724
乾汽船	10.1	9,736
<b>空運業 (0.6%)</b>		
日本航空	249.7	912,403
ANAホールディングス	2,572	846,445
パスコ	13	5,330

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>		
トランコム	4	22,520
日新	57	21,261
三菱倉庫	91	149,240
三井倉庫ホールディングス	80	27,200
住友倉庫	101	61,408
滋澤倉庫	36	12,636
東陽倉庫	23.7	6,967
日本トランスシティ	32	13,984
ケイヒン	25	3,850
中央倉庫	8	8,632
安田倉庫	10.8	8,164
東洋埠頭	40	7,480
宇徳	11.2	4,603
上組	165	182,820
サンリツ	3.4	1,795
キムラユニティ	3.5	4,263
キューソー流通システム	4.4	10,916
郵船ロジスティクス	12.7	15,011
近鉄エクスプレス	24.8	38,861
東海運	7.5	3,435
ユーアイティ	8.5	9,052
内外トランスライン	4.1	4,411
<b>情報・通信業 (7.9%)</b>		
NECネットエスアイ	15	32,760
システナ	10.9	19,881
デジタルアーツ	6.1	17,378
新日鉄住金ソリューションズ	22.8	47,925
キューブシステム	5.9	4,130
コア	5.7	6,959
ソフトクリエイトホールディングス	6.5	9,002
T I S	45.3	113,431
ネオス	4	1,776
電算システム	4.8	8,097
グリー	83.1	51,189
コーエーテクモホールディングス	32.4	64,605
三菱総合研究所	5.3	17,251
ボルテージ	2.7	3,161
電算	1.5	3,594
AGS	3.4	5,674

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
ファインデックス	10.1	9,372
ヒト・コミュニケーションズ	3.1	4,863
ブレインパッド	2	3,332
K L a b	26.1	16,782
ポールトゥウィン・ビットクルーホールディ	9.8	10,378
イーブックイニシアティブジャパン	2.1	1,908
ネクソン	149.7	262,274
アイスタイル	20.8	16,036
エムアップ	3.8	2,496
エイチーム	7.5	16,312
テクノスジャパン	10.5	13,965
e n i s h	4	2,280
コロブラ	38	37,468
モバイルクリエイト	9	3,969
オルトプラス	5.6	3,427
ブロードリーフ	33.7	23,151
ハーツユナイテッドグループ	7.2	12,420
メディアドゥ	2.9	4,286
ブイキューブ	7.5	5,040
サイバーリンクス	2.1	2,207
ディー・エル・イー	4.2	2,986
フィックスターズ	1.9	7,467
VOYAGE GROUP	4.6	6,642
オブティム	1.4	8,176
ベリサーブ	1.6	4,708
ティーガイア	13.6	25,092
日本アジアグループ	15.5	6,804
豆蔵ホールディングス	10	10,370
テクマトリックス	4.3	9,060
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	286.8	72,847
GMOペイメントゲートウェイ	11.2	60,368
ザッパラス	7.6	3,389
インターネットイニシアティブ	20.1	36,823
さくらインターネット	10.5	12,159
GMOクラウド	3	4,962
SRAホールディングス	7.2	18,403
M i n o r i ソリューションズ	3	3,336
システムインテグレーター	1.9	1,257
朝日ネット	12.4	6,299
アドソル日進	2.7	3,763



銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
フリービット	7.6	7,524
コムチュア	2.3	8,015
サイバーコム	1.8	1,783
メディカル・データ・ビジョン	2.3	6,308
gumi	14.1	15,566
PCIホールディングス	1.6	4,257
パイブドHD	2.4	2,712
アイビーシー	1.1	1,133
LINE	22.8	85,614
AOI TYO Holdings	11.1	9,423
ソルクシーズ	3.9	2,145
フェイス	3.6	4,622
ハイマックス	1.8	2,678
野村総合研究所	102.2	370,475
サイバネットシステム	11.2	7,560
CEホールディングス	2.1	2,322
インテージホールディングス	7.8	16,754
東邦システムサイエンス	4.5	3,028
ソースネクスト	8.2	5,731
フォーカスシステムズ	5.3	3,052
クレスコ	3.1	7,895
フジ・メディア・ホールディングス	142.4	234,532
オービック	47.1	246,333
ジャストシステム	22.1	27,337
TDCソフトウェアエンジニアリング	5.9	7,510
ヤフー	980.2	455,793
トレンドマイクロ	72.4	317,836
インフォメーション・ディベロプメント	3.9	4,750
日本オラクル	22	135,080
アルファシステムズ	4.5	8,977
フューチャー	18.5	14,356
CAC Holdings	10.2	9,567
ソフトバンク・テクノロジー	3.3	13,777
トーセ	3.7	3,041
オービックビジネスコンサルタント	6.9	37,329
伊藤忠テクノソリューションズ	31	93,930
アイティフォー	17.7	10,903
東計電算	2.4	5,239
エックスネット	1.2	2,230
大塚商会	36.8	207,184

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
サイボウズ	18.2	8,244
ソフトブレーン	18.6	8,016
電通国際情報サービス	8.4	16,220
デジタルガレージ	21.4	44,833
EMシステムズ	4.6	7,557
ウェザーニューズ	4.6	16,146
C I J	12.4	6,472
東洋ビジネスエンジニアリング	1.4	2,160
日本エンタープライズ	14	3,864
WOWOW	6.5	22,555
スカラ	8.5	6,808
日本コロムビア	4.1	2,648
イマジカ・ロボット ホールディングス	11.5	8,452
ネットワンシステムズ	59.2	44,992
システムソフト	24.1	3,904
アルゴグラフィックス	6.3	14,483
マーベラス	23.1	18,249
エイベックス・グループ・ホールディングス	25.2	43,268
日本ユニシス	37.7	54,702
兼松エレクトロニクス	8.6	22,308
東京放送ホールディングス	90.1	174,794
日本テレビホールディングス	124.9	260,916
朝日放送	13.5	10,192
テレビ朝日ホールディングス	37.4	84,935
スカパーJ SATホールディングス	89	45,568
テレビ東京ホールディングス	11.1	25,863
日本BS放送	3.1	3,267
U-NEXT	3.5	2,320
ワイヤレスゲート	4.7	8,276
コネクシオ	12	17,880
日本通信	114.4	19,104
クロップス	2.9	1,676
日本電信電話	1,097.9	5,463,150
KDDI	1,353	4,061,706
光通信	16.4	170,396
NTTドコモ	1,021.9	2,800,006
エムティーアイ	20.9	14,692
GMOインターネット	49.9	81,885
カドカワ	39.7	68,879
学研ホールディングス	46	14,490

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
ゼンリン	18.1	41,014
昭文社	7.4	5,165
インプレスホールディングス	11.3	1,661
アイネット	7.7	9,216
松竹	90	122,220
東宝	89.4	290,550
東映	51	50,949
エヌ・ティ・ティ・データ	84.5	482,495
ビー・シー・エー	2	2,920
ビジネスブレイン太田昭和	2.3	2,456
D T S	14.1	35,870
スクウェア・エニックス・ホールディングス	52.6	172,791
シーイーシー	8.1	15,130
カプコン	32.1	83,010
アイ・エス・ピー	2.6	2,420
ジャステック	8.7	9,509
S C S K	37.2	156,054
日本システムウエア	4.5	7,150
アイネス	17.2	20,984
T K C	12.7	42,989
富士ソフト	20.3	57,205
N S D	29	52,954
コナミホールディングス	61.7	297,085
福井コンピュータホールディングス	4	12,160
J B C Cホールディングス	11.4	9,405
ミロク情報サービス	10.1	17,149
ソフトバンクグループ	615.6	5,513,313
<b>卸売業 (4.5%)</b>		
ハウスイ	11	1,430
高千穂交易	5.3	5,416
伊藤忠食品	3.4	14,739
エレマテック	5.5	10,868
J A L U X	4.4	9,042
あらた	6.1	16,415
トーマンデバイス	2	4,206
東京エレクトロン デバイス	4.9	7,825
フィールズ	10.5	13,135
双日	807.7	241,502
アルフレッサ ホールディングス	161.8	308,876
横浜冷凍	33.9	35,222

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
神栄	19	3,420
山下医科器械	1.1	1,985
ラサ商事	5.9	3,728
ラクーン	5.9	2,920
アルコニックス	7.8	14,071
神戸物産	7.4	27,454
あい ホールディングス	24.3	53,119
ディーブイエックス	4.9	6,345
ダイワボウホールディングス	116	33,176
マクニカ・富士エレホールディングス	25.3	41,061
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25.7	25,982
八洲電機	10.5	6,741
U K Cホールディングス	8.8	20,644
O C H Iホールディングス	4	5,272
T O K A Iホールディングス	60.1	48,440
大阪工機	1.6	1,169
三洋貿易	7.5	12,150
ビューティガレージ	1.2	1,350
ウイン・パートナーズ	9.8	9,731
ミタチ産業	3.5	2,180
シップヘルスケアホールディングス	26.2	77,290
明治電機工業	4.7	5,781
デリカフーズ	2.9	3,050
スターティア	3.1	1,667
コメダホールディングス	18.5	34,502
富士興産	4.9	2,249
協栄産業	16	2,800
小野建	11.9	16,148
佐島電機	10.8	8,013
エコートレーディング	3.1	2,173
伯東	9.3	9,551
コンドレーテック	10.8	9,244
中山福	7.8	6,411
ナガイレーベン	19.7	50,471
三菱食品	15	49,875
松田産業	10	15,500
第一興商	22.2	100,788
メディアバルホールディングス	136.8	252,806
S P K	2.9	7,232
萩原電気	4.7	10,325

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
アズワン	10.7	54,998
スズデン	4.9	5,071
尾家産業	4.4	5,011
シモジマ	8.3	9,702
ドウシシャ	16.1	34,953
小津産業	3	6,513
高速	8.1	8,893
たけびし	4.8	6,177
黒田電気	18.7	44,244
リックス	3.1	4,941
丸文	12.1	8,385
ハビネット	11.4	14,614
橋本総業ホールディングス	2.8	4,272
日本ライフライン	11.7	24,183
エクセル	5.9	9,115
マルカキカイ	4.4	7,488
I DOM	36.8	26,569
日本エム・ディ・エム	10.3	9,167
進和	8.1	14,596
エスケイジャパン	2.6	793
ダイترون	6.2	6,007
シークス	9.8	40,915
田中商事	4.2	2,986
オーハシテクニカ	7.7	11,149
白銅	3.4	5,103
伊藤忠商事	1,001.7	1,587,193
丸紅	1,346	940,854
高島	24	4,800
長瀬産業	82.2	129,876
蝶理	8.7	16,173
豊田通商	152.3	482,029
三共生興	20.7	8,652
兼松	291	57,909
ツカモトコーポレーション	25	3,150
三井物産	1,236.7	2,101,771
日本紙パルプ商事	71	25,844
日立ハイテクノロジーズ	47.4	225,624
カメイ	17.8	22,143
東都水産	2.1	4,046
OUGホールディングス	22	5,742

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
スターゼン	5.7	26,932
山善	52.5	51,187
椿本興業	15	5,715
住友商事	860.9	1,257,774
内田洋行	6.8	16,653
三菱商事	1,026.2	2,687,617
第一実業	31	20,956
キャノンマーケティングジャパン	39	76,284
西華産業	44	15,312
佐藤商事	12.2	10,565
菱洋エレクトロ	13.1	19,204
東京産業	13.6	6,528
ユアサ商事	13	39,195
神鋼商事	3.4	8,401
小林産業	9.9	2,583
阪和興業	137	107,819
カナデン	13	13,104
菱電商事	22	16,434
フルサト工業	7.5	12,885
岩谷産業	151	96,036
すてきナイスグループ	58	8,816
昭光通商	48	4,992
ニチモウ	20	3,580
極東貿易	21	5,124
イワキ	21	5,901
三愛石油	36.7	32,259
稲畑産業	32.8	43,328
G S I クレオス	33	4,455
明和産業	12.6	5,014
ワキタ	29.1	30,380
東邦ホールディングス	43.8	106,696
サンゲツ	46.9	95,160
ミツウロコグループホールディングス	22	15,884
シナネンホールディングス	5.9	12,950
伊藤忠エネクス	30.2	28,176
サンリオ	42.2	95,667
サンワテクノス	8.1	7,824
リョーサン	20.3	72,572
新光商事	15	18,525
トーヨー	6.2	15,388

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
三信電気	15.1	18,467
東陽テクニカ	18.1	18,190
モスフードサービス	17.9	59,428
加賀電子	12.3	24,009
ソーダニッカ	14.1	7,233
立花エレテック	9.2	12,788
フォーバル	6	4,416
PALTAC	21.9	63,794
三谷産業	14.5	5,553
太平洋興発	57	6,042
ヤマタネ	6.8	11,172
丸紅建材リース	13	2,925
日鉄住金物産	12	56,100
トラスコ中山	31.2	81,213
オートバックスセブン	50.6	89,410
加藤産業	21.3	57,701
イノテック	11.8	7,375
イエローハット	12.9	33,372
J Kホールディングス	13.7	8,151
日伝	5.7	18,411
北沢産業	11.3	2,271
杉本商事	7.8	12,058
因幡電機産業	19.2	76,032
バイテックホールディングス	5.6	7,067
ミスミグループ本社	153.7	313,701
アルテック	11.7	2,492
タキヒヨー	21	9,954
蔵王産業	2.2	3,280
スズケン	62.2	233,561
ジェコス	9.4	10,123
ルネサスイーストン	12.5	7,475
<b>小売業 (4.6%)</b>		
ローソン	47.5	384,275
サンエー	10.3	53,663
カワチ薬品	10.6	31,789
エービーシー・マート	24.9	164,091
ハードオフコーポレーション	6	7,134
アスクル	16.6	59,179
ゲオホールディングス	22.9	29,632
アダストリア	21	62,874

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
ジーフット	8.2	6,633
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1.7	1,203
くらコーポレーション	8.9	42,141
キャンドウ	7.2	13,132
パルグループホールディングス	7	19,957
エディオン	53	57,876
サーラコーポレーション	17	10,693
ワッツ	5.9	6,678
ハローズ	4.5	10,480
あみやき亭	2.7	10,611
ひらまつ	18.8	12,370
ゲンキー	2.7	16,497
大黒天物産	3.3	16,698
ハニーズ	12	12,828
ファーマライズホールディングス	3.1	1,571
アルペン	12.2	24,912
クオール	15.4	22,638
ジェイアイエヌ	9.3	52,731
ビックカメラ	78.5	87,920
DCMホールディングス	83	84,577
MonotaRO	48.4	121,677
東京一番フーズ	3.4	1,931
ダイヤモンドダイニング	3	4,317
きちり	3.6	2,314
アークランドサービスホールディングス	4.3	13,179
J. フロント リテイリング	173	291,332
ドトール・日レスホールディングス	24	50,736
マツモトキヨシホールディングス	25.9	145,558
ブロンコビリー	7.1	19,730
スタートトゥデイ	124.8	266,572
トレジャー・ファクトリー	3.9	3,233
物語コーポレーション	3.6	14,508
ココカラファイン	14.2	61,628
三越伊勢丹ホールディングス	272	353,056
Hamee	2	1,768
ウエルシアホールディングス	13.5	83,295
クリエイトSDホールディングス	20.1	49,827
丸善CHIホールディングス	15.9	5,755
ミサワ	2.4	1,231
ティーライフ	1.2	1,762

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
エー・ピーカンパニー	2.2	1,707
チムニー	4.2	11,915
シュッピン	5.2	7,321
ネクステージ	2.7	6,709
ジョイフル本田	22.2	70,263
鳥貴族	3.4	7,993
キリン堂ホールディングス	4.4	3,713
ホットランド	6.3	6,766
すかいらく	58.7	89,282
綿半ホールディングス	5.5	8,954
ヨシックス	1.3	1,727
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	45.3	44,620
ブックオフコーポレーション	7.8	6,427
ゴルフダイジェスト・オンライン	5.4	4,930
BEENOS	1.6	2,308
あさひ	10.2	13,545
日本調剤	4.8	20,856
コスモス薬品	6.9	144,417
トーエル	6.6	6,276
一六堂	2.9	1,148
オンリー	1.5	1,212
セブン&アイ・ホールディングス	572.4	2,594,689
薬王堂	6.8	14,062
クリエイト・レストランツ・ホールディング	36.7	35,635
ツルハホールディングス	31.5	340,515
サンマルクホールディングス	8.8	29,788
フェリシモ	3.9	3,962
トリドールホールディングス	16.8	41,899
サツドラホールディングス	1.8	3,580
ダイユー・リックホールディングス	4.4	3,489
パロックジャパンリミテッド	8	11,832
クスリのアオキホールディングス	12.2	57,340
メディカルシステムネットワーク	15.4	6,622
総合メディカル	6.6	27,753
はるやまホールディングス	6.4	5,715
ノジマ	15.8	19,671
カップ・クリエイト	19.1	25,231
ライトオン	10.2	9,588
ジーンズメイト	4.4	1,170
良品計画	18.1	389,874

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
三城ホールディングス	16.9	7,723
アドヴァン	13.9	15,609
アルビス	3.6	11,394
コナカ	17.4	9,987
ハウス オブ ローゼ	1.7	2,672
G-7ホールディングス	4	7,624
イオン北海道	13.7	8,384
コジマ	20.1	5,587
ヒマラヤ	4.2	3,633
コーナン商事	19.4	40,352
エコス	5.3	6,487
ワタミ	16.1	17,967
マルシェ	3	2,478
ドンキホーテホールディングス	88.5	371,257
西松屋チェーン	24	33,360
ゼンショーホールディングス	70.8	135,511
幸楽苑ホールディングス	8.7	14,389
ハークスレイ	3.3	3,610
サイゼリヤ	22.5	58,657
V Tホールディングス	46.2	25,964
魚力	4.2	5,443
ポブラ	3.4	1,757
フジ・コーポレーション	2	4,018
ユナイテッドアローズ	18.2	58,240
ハイデイ日高	12.4	33,393
京都きもの友禅	8.7	8,700
コロワイド	45.3	86,341
ピーシーデポコーポレーション	18.1	11,167
沓番屋	12.4	46,438
トップカルチャー	4.9	2,371
P L A N T	3.1	3,723
スギホールディングス	30	158,100
スクロール	20.7	7,162
ヨンドシーホールディングス	10.4	25,105
ユニー・ファミリーマートホールディングス	60	432,000
木曽路	16.7	39,495
サトレストランシステムズ	16.1	13,298
千趣会	24.7	17,981
タカキュー	10.5	2,215
ケーヨー	23	13,202

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
上新電機	32	34,176
日本瓦斯	25.1	83,332
ベスト電器	44	6,248
ロイヤルホールディングス	22.7	43,584
東天紅	11	1,837
いなげや	15.2	23,499
島忠	35.4	98,659
チョダ	16.1	43,148
ライフコーポレーション	10.3	33,475
リンガーハット	15.4	36,005
さが美	12	1,476
MrMax	17	6,936
テンアライド	12.6	4,926
AOKIホールディングス	27.3	39,148
オークワ	19	22,116
コメリ	21.1	56,970
青山商事	28.6	113,113
しまむら	15.9	237,546
はせがわ	7.2	3,196
高島屋	229	226,023
松屋	29.8	29,114
エイチ・ツー・オー リテイリング	70	124,950
近鉄百貨店	52	18,564
丸栄	28	2,492
バルコ	13.1	14,331
丸井グループ	143.9	238,874
アクシアル リテイリング	10.6	44,838
井筒屋	7.4	2,945
イオン	562.7	927,610
イズミ	27.1	129,538
東武ストア	1.6	4,640
平和堂	27.7	72,823
フジ	15.2	36,069
ヤオコー	15.5	70,602
ゼビオホールディングス	18.6	33,182
ケーズホールディングス	63	129,843
Olympicグループ	8	4,960
日産東京販売ホールディングス	20.1	6,834
アインホールディングス	16.5	135,630
元氣寿司	3.4	7,330

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
ヤマダ電機	457.4	293,193
アークランドサカモト	23.1	31,623
ニトリホールディングス	59.1	751,161
グルメ杵屋	10	10,120
愛眼	10	1,980
ケーユーホールディングス	7.1	6,106
吉野家ホールディングス	47.6	76,350
松屋フーズ	6.6	25,509
サガミチェーン	17.1	22,452
関西スーパーマーケット	11.1	16,916
王将フードサービス	10	43,900
ブレナス	15.3	36,918
ミニストップ	10.1	20,412
アークス	25.6	65,536
パローホールディングス	29.5	86,789
藤久	1.1	1,886
ベルク	6.1	25,620
大庄	7.3	11,519
ファーストリテイリング	22.8	832,656
サンドラッグ	26	202,540
サックスパー ホールディングス	12.8	14,208
ヤマザワ	2.8	5,157
やまや	2.8	4,832
ベルーナ	34.1	25,336
<b>銀行業 (8.5%)</b>		
島根銀行	2.9	4,033
じもとホールディングス	98.1	19,227
めぶきフィナンシャルグループ	659.5	290,839
東京T Yフィナンシャルグループ	19.8	80,190
九州フィナンシャルグループ	224.3	179,215
ゆうちょ銀行	387.2	538,982
富山第一銀行	34.8	18,304
コンコルディア・フィナンシャルグループ	895.4	543,776
西日本フィナンシャルホールディングス	92.7	112,815
新生銀行	1,302	263,004
あおぞら銀行	865	362,435
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,363.5	7,689,717
りそなホールディングス	1,599.9	984,098
三井住友トラスト・ホールディングス	285.5	1,205,952
三井住友フィナンシャルグループ	1,095.1	4,948,756

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
第四銀行	168	87,696
北越銀行	14.8	39,782
千葉銀行	527	395,250
群馬銀行	303.9	191,457
武蔵野銀行	21.8	74,447
千葉興業銀行	37.5	21,900
筑波銀行	56.8	20,050
七十七銀行	214	118,770
青森銀行	106	40,492
秋田銀行	89	32,663
山形銀行	77	37,884
岩手銀行	9	41,625
東邦銀行	122	53,314
東北銀行	70	11,130
みちのく銀行	68	13,056
ふくおかフィナンシャルグループ	555	283,605
静岡銀行	372	373,116
十六銀行	184	73,600
スルガ銀行	139.8	362,082
八十二銀行	263.9	179,188
山梨中央銀行	85	46,495
大垣共立銀行	182	81,354
福井銀行	117	34,866
北國銀行	145	65,540
清水銀行	4.6	17,204
富山銀行	2.6	10,881
滋賀銀行	128	81,664
南都銀行	13.2	61,578
百五銀行	123	57,933
京都銀行	245	219,520
紀陽銀行	51.4	94,730
三重銀行	6.1	14,548
ほくほくフィナンシャルグループ	91	180,908
広島銀行	404	214,928
山陰合同銀行	82.2	78,912
中国銀行	96.9	164,342
鳥取銀行	4.3	8,225
伊予銀行	146.3	111,626
百十四銀行	150	57,600
四国銀行	106	30,634

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
阿波銀行	117	81,432
大分銀行	79	34,286
宮崎銀行	91	35,035
佐賀銀行	83	24,983
十八銀行	84	29,904
神縄銀行	13.3	54,663
琉球銀行	28.2	42,976
セブン銀行	512.7	164,576
みずほフィナンシャルグループ	18,568.3	3,953,191
高知銀行	50	6,800
山口フィナンシャルグループ	128	159,872
長野銀行	4.5	8,991
名古屋銀行	11.5	48,012
北洋銀行	223.2	103,564
愛知銀行	4.6	30,360
第三銀行	7.7	13,813
中京銀行	5.6	13,092
大光銀行	48	12,240
愛媛銀行	16.2	22,145
トマト銀行	5.3	8,501
みなと銀行	12.4	26,945
京葉銀行	111	58,941
関西アーバン銀行	19	27,398
栃木銀行	75.5	44,092
北日本銀行	4.3	13,437
東和銀行	256	29,696
福島銀行	148	14,652
大東銀行	71	11,999
トモニホールディングス	112.7	69,761
フィデアホールディングス	132.7	27,734
池田泉州ホールディングス	145.1	78,644
証券・商品先物取引業 (1.3%)		
F P G	48.8	51,191
S B I ホールディングス	154.6	241,794
日本アジア投資	13.1	6,261
ジャフコ	22.9	89,310
大和証券グループ本社	1,280	947,840
野村ホールディングス	2,795.9	2,041,845
岡三証券グループ	116	87,116
丸三証券	43.5	42,543

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
東洋証券	49	13,573
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	156.9	101,200
光世証券	33	6,699
水戸証券	42.3	13,324
いちよし証券	30.6	27,815
松井証券	78.1	78,568
だいきこう証券ビジネス	6.6	4,118
マネックスグループ	146.7	46,503
カブドットコム証券	101.7	40,578
極東証券	18.3	31,677
岩井コスモホールディングス	12.9	13,777
藍澤証券	25.6	17,024
マネーパートナーズグループ	17.4	9,657
小林洋行	3.9	1,131
<b>保険業 (2.7%)</b>		
かんぽ生命保険	51.6	131,992
SOMPOホールディングス	285.9	1,194,204
アニコム ホールディングス	9.3	21,669
MS&ADインシュアランスグループホール	408.7	1,573,903
ソニーフィナンシャルホールディングス	131	255,057
第一生命ホールディングス	824.7	1,724,035
東京海上ホールディングス	554.1	2,661,896
T&Dホールディングス	498.5	849,942
アドバンスクリエイト	3.2	6,320
<b>その他金融業 (1.3%)</b>		
全国保証	38.5	150,342
クレディセゾン	103.7	217,666
アクリーティブ	11.2	4,838
芙蓉総合リース	15.6	86,736
興銀リース	25.7	64,995
東京センチュリー	27.5	106,700
日本証券金融	60.2	36,782
アイフル	229.4	79,143
ポケットカード	10.2	6,140
リコーリース	10.8	38,502
イオンフィナンシャルサービス	87.3	177,480
アコム	273.8	133,066
ジャックス	75	39,375
オリエントコーポレーション	295.7	60,914
日立キャピタル	32.2	94,603

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
アプラスフィナンシャル	65.6	7,937
オリックス	968.5	1,694,875
三菱UFJリース	346.9	211,609
日本取引所グループ	425.2	671,816
イー・ギャランティ	4	10,972
アサックス	2.4	3,849
NECキャピタルソリューション	5.6	9,895
<b>不動産業 (2.5%)</b>		
いちご	129.9	49,881
日本駐車場開発	164.8	25,544
ヒューリック	285.2	289,192
三栄建築設計	5.5	8,717
野村不動産ホールディングス	90.8	178,966
三重交通グループホールディングス	24.2	9,559
サムティ	11	12,694
ディア・ライフ	9.2	3,542
エー・ディー・ワークス	125.2	5,634
日本商業開発	7.6	15,032
プレサンスコーポレーション	21.2	28,874
ユニゾホールディングス	11.3	34,408
THEグローバル社	4.8	2,174
日本管理センター	9.8	12,593
サンセイランディック	2.8	2,044
エストラスト	2.4	1,816
フージャースホールディングス	17.6	10,665
オープンハウス	19.8	52,331
東急不動産ホールディングス	330.9	223,688
飯田グループホールディングス	114	247,152
ムゲンエステート	4.7	3,487
ファーストブラザーズ	1.4	2,504
シーアールイー	1.9	2,861
エコナックホールディングス	51	2,601
パーク24	69.3	213,444
バラカ	3.9	7,764
三井不動産	725	1,928,500
三菱地所	1,017	2,228,755
平和不動産	25.9	41,077
東京建物	158.7	240,113
ダイビル	35.2	35,094
京阪神ビルディング	22.7	13,756



銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
住友不動産	328	1,033,528
大京	254	58,928
テーオーシー	53	49,290
東京楽天地	22	11,770
レオパレス21	172.6	112,880
スターツコーポレーション	13.9	27,674
フジ住宅	17.4	13,137
空港施設	16.5	9,718
明和地所	7.5	5,430
住友不動産販売	12.3	32,139
ゴールドクレスト	12.3	26,260
日本エスリード	5.3	7,139
日神不動産	16.2	8,699
日本エスコン	18.2	6,970
タカラレーベン	59.6	38,918
サンヨーハウジング名古屋	7	7,168
イオンモール	88.1	146,069
ファースト住建	5.1	7,242
ランド	117.6	1,764
トーセイ	18.7	14,305
穴吹興産	1.5	3,915
エス・ティ・ティ都市開発	85	85,170
サンフロンティア不動産	14.7	14,744
エフ・ジェー・ネクスト	11.9	8,865
インテリックス	2.8	2,212
ランドビジネス	8.1	2,332
グランディハウス	11.9	4,974
日本空港ビルデング	43.6	179,414
<b>サービス業 (3.6%)</b>		
日本工営	9.7	24,773
ネクスト	35.8	29,356
ジェイエイシーリクルートメント	8.9	12,023
日本M&Aセンター	41.8	146,091
中広	1.4	975
タケエイ	12.7	12,763
トラスト・テック	5.9	10,655
コシダカホールディングス	5	11,400
バソナグループ	12.6	9,865
CDS	3.3	3,435
リンクアンドモチベーション	34.1	15,549

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
GCA	12.8	10,547
エス・エム・エス	20.5	57,420
テンブホールディングス	111.9	219,100
リニカル	8.5	10,990
クックパッド	32.3	32,623
エスクリ	5.1	3,141
アイ・ケイ・ケイ	6.4	4,480
学情	6	7,302
スタジオアリス	5.9	12,584
シミックホールディングス	7.3	11,037
NJS	3.2	4,352
総合警備保障	52.7	234,515
カカコム	103.3	210,835
アイロムグループ	4.4	5,913
ルネサンス	7.4	11,077
ディップ	18.7	42,991
オプトホールディング	10.3	7,508
新日本科学	16.1	9,144
ツクイ	34.3	27,817
キャリアデザインセンター	3	3,726
エムスリー	125.4	371,058
ツカダ・グローバルホールディング	10.5	6,898
アウトソーシング	8.3	32,038
ウエルネット	10.9	13,930
ワールドホールディングス	3.3	6,755
ディー・エヌ・エー	64.9	171,595
博報堂DYホールディングス	200.6	284,049
ぐるなび	20.9	51,999
エスアールジータカミヤ	15.6	9,516
ジャパンバストレスキューシステム	17.9	4,349
ファンコムコミュニケーションズ	36.8	27,305
ライク	3	7,452
WDBホールディングス	5.2	6,624
ティア	6.9	4,395
バリュウコマース	13.3	4,468
インフォマート	61.4	38,559
J Pホールディングス	41.6	10,982
E P Sホールディングス	17.9	25,793
レッグス	3.3	2,824
プレステージ・インターナショナル	20.5	16,994

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
アミューズ	8	14,264
ドリームインキュベータ	4.4	9,028
クイック	7.4	8,199
TAC	8	1,840
ケネディクス	194.3	83,354
電通	161.3	869,407
テイクアンドギヴ・ニーズ	6.7	5,085
びあ	4.4	12,474
イオンファンタジー	4.2	12,831
シーティーエス	3.9	5,151
ネクシィーズグループ	5.2	7,732
みらかホールディングス	37	194,620
アルプス技研	5.8	15,027
サニックス	23.2	4,268
ダイオーズ	2.6	2,776
日本空調サービス	13.9	8,631
オリエンタルランド	156.5	993,618
ダスキン	37.1	87,964
明光ネットワークジャパン	17.9	22,052
ファルコホールディングス	6.8	10,070
秀英予備校	2.9	1,374
田谷	2.4	1,574
ラウンドワン	45.2	35,979
リゾートトラスト	56	115,864
ビー・エム・エル	18.9	51,483
ワタベウェディング	2.1	926
りらいあコミュニケーションズ	23.9	28,154
リソー教育	24.6	14,809
早稲田アカデミー	1.9	2,147
ユー・エス・エス	175.2	350,750
東京個別指導学院	4.7	4,620
サイバーエージェント	76.2	232,410
楽天	739.5	854,862
クリーク・アンド・リバー社	5.1	5,385
テー・オー・ダブリュー	11.6	7,493
セントラルスポーツ	4.9	14,489
フルキャストホールディングス	14.9	14,378
リソルホールディングス	14	4,886
テクノプロ・ホールディングス	23.5	91,180
アトラ	1.6	1,222

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
インターワークス	2.9	3,497
Ke e P e r 技研	1.6	3,184
ファーストロジック	0.8	1,676
デザインワン・ジャパン	1	2,798
イー・ガーディアン	4.7	9,371
リブセンス	9.7	4,374
ジャパンマテリアル	10.6	18,051
ベクトル	11.7	12,975
ウチヤマホールディングス	6.5	2,808
サクセスホールディングス	1.1	1,510
キャリアリンク	3.2	2,432
I B J	11.2	6,888
アサンテ	5.3	9,094
N・フィールド	6.8	9,894
M&Aキャピタルパートナーズ	1.9	6,165
ライドオン・エクスプレス	3.6	3,049
E R I ホールディングス	3.7	2,963
アピスト	2.2	8,437
ウィルグループ	5.7	4,166
エスクロー・エージェント・ジャパン	2.4	4,264
日本ビューホテル	2.1	2,916
リクルートホールディングス	316.2	1,571,514
エラン	1.9	2,426
土木管理総合試験所	1.4	1,023
日本郵政	377.7	543,888
バルシステム24ホールディングス	22	21,912
ソラスト	6.6	8,824
リログループ	5.4	86,292
東祥	3.1	16,089
エイチ・アイ・エス	23.6	74,458
ラックランド	2.5	4,770
共立メンテナンス	11.7	87,165
イチネンホールディングス	15.2	17,282
建設技術研究所	9.1	9,500
スペース	7.8	9,594
燦ホールディングス	2.9	4,570
スバル興業	10	5,400
東京テアトル	55	9,405
タナベ経営	2.8	3,626
ナガワ	2.6	11,531

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
よみうりランド	29	13,630
東京都競馬	99	26,433
常磐興産	5.3	8,485
カナモト	20.2	61,004
東京ドーム	57.7	63,123
西尾レントオール	11.7	39,019
アゴラ・ホスピタリティ・グループ	71	2,698
トランス・コスモス	16.8	48,804
乃村工藝社	31	60,419
藤田観光	47	16,356
KNT-CTホールディングス	82	11,972
日本管財	12.4	21,700
トーカイ	6.4	25,952
白洋舎	1.4	3,746
セコム	150.6	1,242,299
セントラル警備保障	6.4	12,742
丹青社	25	22,125

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
メイテック	17.5	75,775
アサツー ディ・ケイ	23.6	71,036
応用地質	13.7	19,495
船井総研ホールディングス	18.6	33,201
進学会	6	3,402
オオバ	10.5	4,872
学究社	3.8	5,677
ベネッセホールディングス	48.5	158,352
イオンディライト	16.3	53,056
ナック	8.9	8,606
ニチイ学館	25.1	20,707
ダイセキ	25.2	57,657
ステップ	4.8	6,652
合 計	209,541	312,182,586
	株数・金額 銘柄数<比率>	1,982 <99.4%>

(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、親投資信託の純資産総額に対する評価額の比率。

### 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	
		百万円	百万円
		2,080	—

### <有価証券の貸付及び借入の状況>

2017年1月26日現在における貸付株数の総株数は38,627,000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、38,627,000株です。

## &lt;外国株式インデックスマザーファンド&gt;

下記は、外国株式インデックスマザーファンド全体(157,553,049千口)の内容です。

## 外国株式

銘柄	株数	当期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカドル	千円	
AMERICAN EXPRESS CO	744	5,722	647,453	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	1,627	6,559	742,228	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	308	1,493	169,043	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	51	743	84,078	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	432	4,437	502,063	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	67	356	40,376	小売
AES CORP	636	723	81,917	公益事業
AFLAC INC	387	2,727	308,577	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,013	6,662	753,898	保険
APACHE CORP	359	2,209	250,034	エネルギー
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	55	1,266	143,358	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	589	6,931	784,267	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	194	2,893	327,384	素材
ANTHEM INC	249	3,832	433,624	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	524	3,708	419,590	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,289	3,040	343,984	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	462	2,135	241,600	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	561	9,398	1,063,414	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	201	3,463	391,951	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	274	1,228	138,960	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,583	7,846	887,880	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	115	4,478	506,798	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,864	19,235	2,176,463	電気通信サービス
CR BARD INC	69	1,603	181,409	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	157	1,207	136,681	素材
BAKER HUGHES INC	385	2,450	277,246	エネルギー
ALLSTATE CORP	351	2,648	299,706	保険
AVERY DENNISON CORP	84	625	70,808	素材
CHUBB LTD	440	5,857	662,818	保険
ANALOG DEVICES INC	291	2,171	245,654	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	27	2,041	231,033	小売
CVS HEALTH CORP	1,010	8,031	908,810	食品・生活必需品小売り
CORNING INC	982	2,620	296,471	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	3,423	29,451	3,332,418	銀行
CIGNA CORP	243	3,610	408,567	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	554	5,437	615,265	資本財
COCA-COLA CO/THE	3,885	16,367	1,851,972	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	479	4,239	479,729	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	190	1,199	135,762	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	897	4,287	485,177	運輸
CHEVRON CORP	1,788	20,968	2,372,544	エネルギー
COACH INC	263	955	108,125	耐久消費財・アパレル
ROCKWELL COLLINS INC	123	1,118	126,528	資本財
COMPUTER SCIENCES CORP	133	813	92,045	ソフトウェア・サービス
CONOCOPHILLIPS	1,173	5,948	673,075	エネルギー
CME GROUP INC	320	3,847	435,378	各種金融

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカドル	千円	
CARDINAL HEALTH INC	301	2,288	259,000	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	803	5,498	622,177	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION RESOURCES INC/VA	598	4,536	513,250	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE	1,067	6,427	727,289	素材
DEVON ENERGY CORP	446	2,075	234,854	エネルギー
DEERE & CO	253	2,741	310,186	資本財
DANAHER CORP	588	4,768	539,523	ヘルスケア機器・サービス
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	828	6,352	718,784	素材
WALT DISNEY CO/THE	1,446	15,626	1,768,111	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC	112	828	93,791	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	655	5,052	571,709	公益事業
DR HORTON INC	334	1,048	118,646	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC	84	450	50,937	小売
TARGET CORP	517	3,361	380,314	小売
DUN & BRADSTREET CORP	34	424	48,063	商業・専門サービス
DAVITA INC	157	1,008	114,139	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	147	1,199	135,677	資本財
DTE ENERGY COMPANY	172	1,687	190,930	公益事業
EXXON MOBIL CORP	3,930	33,546	3,795,792	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	201	1,937	219,252	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	545	5,672	641,787	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	609	3,673	415,684	資本財
EXELON CORP	878	3,104	351,231	公益事業
ECOLAB INC	248	3,048	344,927	素材
EQUIFAX INC	113	1,341	151,760	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	208	1,713	193,930	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	430	3,065	346,902	資本財
EDISON INTERNATIONAL	311	2,236	253,113	公益事業
ENTERGY CORP	172	1,216	137,640	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	39	861	97,511	保険
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	55	439	49,744	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC	439	5,231	591,946	公益事業
MACY'S INC	292	881	99,730	小売
FEDEX CORP	239	4,616	522,315	運輸
FORD MOTOR CO	3,516	4,497	508,918	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	353	1,480	167,538	各種金融
FOOT LOCKER INC	127	883	99,949	小売
FIRSTENERGY CORP	407	1,215	137,538	公益事業
FLUOR CORP	131	749	84,760	資本財
FREPORT-MCMORAN INC	1,196	1,974	223,463	素材
GENERAL MILLS INC	568	3,579	404,988	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	245	4,305	487,148	資本財
WW GRAINGER INC	54	1,376	155,769	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	8,495	25,800	2,919,371	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	146	1,144	129,548	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	140	1,377	155,914	小売
TEGNA INC	191	429	48,644	メディア
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	248	786	88,948	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	227	553	62,578	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	346	8,212	929,287	各種金融
HALLIBURTON CO	816	4,688	530,478	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	684	8,068	912,994	資本財

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカドル	千円	
HARLEY-DAVIDSON INC	169	1,019	115,329	自動車・自動車部品
HP INC	1,621	2,463	278,774	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	365	1,764	199,700	保険
HERSHEY CO/THE	137	1,459	165,130	食品・飲料・タバコ
HARMAN INTERNATIONAL	66	733	83,009	耐久消費財・アパレル
HOME DEPOT INC	1,171	16,103	1,822,151	小売
HASBRO INC	106	926	104,824	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	244	1,964	222,282	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	860	15,344	1,736,253	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	370	2,147	243,007	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	302	3,893	440,562	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	378	899	101,763	メディア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	75	903	102,238	素材
JOHNSON & JOHNSON	2,592	29,246	3,309,209	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KANSAS CITY SOUTHERN	102	910	103,040	運輸
KELLOGG CO	249	1,802	204,006	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	341	4,165	471,292	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,473	6,645	751,943	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	854	2,860	323,651	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	173	699	79,191	小売
ELI LILLY & CO	941	7,046	797,323	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	97	1,311	148,375	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	149	739	83,705	運輸
LENNAR CORP-A	173	815	92,268	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	834	6,099	690,132	小売
LEGGETT & PLATT INC	126	614	69,519	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	232	1,435	162,410	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	414	2,345	265,410	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	250	6,287	711,436	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	220	1,521	172,161	保険
L3 TECHNOLOGIES INC	73	1,104	124,942	資本財
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	313	2,685	303,815	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	808	9,848	1,114,308	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	250	3,020	341,742	各種金融
MEDTRONIC PLC	1,320	9,833	1,112,702	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	2,620	16,005	1,811,045	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	984	2,319	262,502	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	322	1,017	115,083	耐久消費財・アパレル
3M CO	572	10,119	1,145,048	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	143	1,221	138,263	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	429	1,272	143,957	消費者サービス
MASCO CORP	314	1,057	119,658	資本財
MONSANTO CO	414	4,597	520,223	素材
M & T BANK CORP	133	2,165	244,993	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	491	3,377	382,182	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	59	1,283	145,246	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	1,359	5,964	674,900	各種金融
MCKESSON CORP	213	3,231	365,686	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	884	4,965	561,898	保険
MANPOWERGROUP INC	64	619	70,111	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	164	1,709	193,438	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	278	3,356	379,803	運輸

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカドル	千円	
BANK OF AMERICA CORP	9,672	22,603	2,557,592	銀行
NISOURCE INC	314	697	78,965	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	160	3,710	419,793	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	464	699	79,096	銀行
NEWMONT MINING CORP	502	1,755	198,643	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	1,004	3,045	344,548	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	108	1,043	118,032	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	13	1,236	139,917	保険
NUCOR CORP	301	1,798	203,516	素材
NEWELL BRANDS INC	410	1,928	218,173	耐久消費財・アパレル
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	419	1,251	141,588	メディア
NOBLE ENERGY INC	407	1,620	183,367	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	724	4,936	558,533	エネルギー
OMNICOM GROUP	224	1,935	219,013	メディア
PEPSICO INC	1,364	14,270	1,614,716	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	89	845	95,634	素材
ALTRIA GROUP INC	1,852	13,146	1,487,483	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	107	830	93,978	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	2,422	21,113	2,389,037	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	465	5,631	637,225	銀行
PFIZER INC	5,747	17,985	2,035,054	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	413	4,441	502,541	保険
PULTEGROUP INC	293	599	67,829	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP	126	1,897	214,674	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	160	2,893	327,401	エネルギー
CITIGROUP INC	2,753	15,884	1,797,296	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	272	1,623	183,691	保険
PPG INDUSTRIES INC	252	2,551	288,674	素材
PENTAIR PLC	163	1,005	113,747	資本財
PRAXAIR INC	270	3,237	366,293	素材
P G & E CORP	480	2,925	331,053	公益事業
PPL CORP	649	2,242	253,682	公益事業
PROGRESSIVE CORP	551	2,081	235,560	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	482	2,095	237,098	公益事業
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	163	1,429	161,802	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	279	4,103	464,316	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	227	1,316	148,923	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	1,187	1,735	196,402	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	39	540	61,198	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	96	1,832	207,317	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	396	1,029	116,433	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	123	613	69,379	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	122	1,876	212,362	資本財
SCHLUMBERGER LTD	1,317	11,269	1,275,089	エネルギー
STRYKER CORP	318	3,862	437,089	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,127	4,769	539,689	各種金融
SEMPRA ENERGY	226	2,325	263,103	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	74	2,107	238,496	素材
STANLEY BLACK & DECKER INC	142	1,770	200,277	資本財
SUNTRUST BANKS INC	468	2,724	308,330	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	272	3,207	362,909	保険
SOUTHERN CO/THE	931	4,515	510,976	公益事業

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカドル	千円	
AT&T INC	5,829	24,128	2,730,089	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	269	2,156	244,057	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	369	2,872	325,079	各種金融
SYSCO CORP	500	2,653	300,286	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	187	922	104,382	素材
SCANA CORP	131	912	103,297	公益事業
TEXAS INSTRUMENTS INC	950	7,468	845,067	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	118	949	107,440	小売
TORCHMARK CORP	107	802	90,748	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	884	3,907	442,133	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	373	5,321	602,140	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	255	1,194	135,116	資本財
UNION PACIFIC CORP	789	8,718	986,465	運輸
UNUM GROUP	221	1,020	115,459	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	753	8,357	945,601	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	902	14,551	1,646,548	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,620	8,500	961,845	銀行
MARATHON OIL CORP	802	1,424	161,233	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	656	7,675	868,440	運輸
VALERO ENERGY CORP	437	2,987	338,084	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	88	814	92,160	ヘルスケア機器・サービス
VALSPAR CORP/THE	72	779	88,237	素材
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	385	2,428	274,837	メディア
VF CORP	313	1,651	186,912	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	126	1,705	192,974	素材
WILLIAMS COS INC	773	2,228	252,185	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	871	7,150	809,094	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	302	1,761	199,290	公益事業
WAL-MART STORES INC	1,465	9,802	1,109,140	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO	4,542	25,722	2,910,490	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	419	2,921	330,588	商業・専門サービス
WATERS CORP	76	1,101	124,660	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	875	474	53,696	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	71	1,358	153,725	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	816	571	64,646	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XCEL ENERGY INC	487	1,985	224,682	公益事業
KEYCORP	1,024	1,884	213,205	銀行
CARMAX INC	182	1,243	140,677	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	189	2,199	248,820	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	151	498	56,460	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	351	2,302	260,549	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	621	4,688	530,495	小売
CA INC	296	929	105,158	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	123	1,496	169,385	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	137	1,188	134,426	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	277	727	82,305	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	338	1,888	213,633	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	295	2,362	267,293	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	395	1,553	175,725	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	291	2,118	239,697	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	725	1,952	220,874	銀行
STERICYCLE INC	80	655	74,225	商業・専門サービス



銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカドル	千円	
INTEL CORP	4,474	16,914	1,913,886	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	4,765	14,631	1,655,540	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	78	920	104,136	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	118	1,229	139,162	電気通信サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	414	6,810	770,663	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	1,024	3,525	398,891	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	284	2,320	262,588	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	281	1,763	199,565	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	583	1,590	179,923	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	377	2,492	282,033	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	204	1,406	159,197	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	1,277	6,879	778,425	耐久消費財・アパレル
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	14	142	16,178	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	709	10,929	1,236,660	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	164	1,139	128,960	銀行
NORTHERN TRUST CORP	203	1,710	193,560	各種金融
MICROSOFT CORP	7,016	44,682	5,055,865	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	82	783	88,613	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	161	1,042	117,967	ヘルスケア機器・サービス
STAPLES INC	615	578	65,483	小売
STARBUCKS CORP	1,388	8,151	922,314	消費者サービス
ORACLE CORP	2,930	11,766	1,331,381	ソフトウェア・サービス
WHOLE FOODS MARKET INC	301	931	105,438	食品・生活必需品小売り
NETFLIX INC	406	5,669	641,539	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	89	2,391	270,591	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	561	2,222	251,491	ソフトウェア・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	177	1,631	184,564	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	77	1,239	140,251	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	126	951	107,714	小売
LAM RESEARCH CORP	151	1,775	200,850	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	77	746	84,464	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	2,276	16,718	1,891,728	メディア
XILINX INC	240	1,430	161,882	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	332	2,274	257,344	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	220	1,254	141,949	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	68	635	71,871	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	1,250	8,991	1,017,369	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	147	1,412	159,808	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	36	2,548	288,306	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	230	2,763	312,727	ソフトウェア・サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	253	405	45,884	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	306	1,891	213,973	ソフトウェア・サービス
YAHOO! INC	855	3,846	435,206	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	79	331	37,479	ヘルスケア機器・サービス
SIGNATURE BANK	50	817	92,539	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	122	1,178	133,390	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	189	1,567	177,320	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	235	831	94,040	メディア
SALESFORCE.COM INC	610	4,787	541,727	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	123	555	62,902	小売
ALPHABET INC-CL A	279	23,979	2,713,330	ソフトウェア・サービス
UNITED THERAPEUTICS CORP	41	648	73,414	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカドル	千円	
B/E AEROSPACE INC	97	598	67,672	資本財
GARMIN LTD	107	536	60,711	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	236	710	80,449	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	1,396	7,945	898,990	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	236	953	107,899	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	142	894	101,263	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP	227	1,428	161,657	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	268	1,134	128,398	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	381	31,951	3,615,336	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	234	1,738	196,709	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	131	1,208	136,772	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	148	1,256	142,144	半導体・半導体製造装置
E*TRADE FINANCIAL CORP	258	956	108,243	各種金融
CERNER CORP	287	1,504	170,179	ヘルスケア機器・サービス
BROADCOM LTD	374	7,589	858,758	半導体・半導体製造装置
ALKERMES PLC	143	799	90,501	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	91	745	84,338	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	289	1,716	194,209	電気通信サービス
WASTE CONNECTIONS INC	166	1,309	148,197	商業・専門サービス
EBAY INC	1,016	3,072	347,600	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	507	5,465	618,457	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	223	1,718	194,438	小売
PRICELINE GROUP INC/THE	46	7,395	836,766	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,154	18,958	2,145,123	各種金融
BB&T CORP	771	3,623	409,953	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	1,010	4,539	513,634	各種金融
BORGWARNER INC	202	838	94,835	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	212	491	55,602	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	110	1,488	168,437	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC	737	7,054	798,234	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP	180	1,550	175,460	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	57	562	63,646	保険
AETNA INC	332	3,958	447,868	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	233	1,213	137,333	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	469	2,933	331,978	公益事業
AON PLC	251	2,842	321,634	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	551	2,490	281,853	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	85	555	62,846	保険
HESS CORP	270	1,524	172,494	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	326	918	103,968	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	249	1,166	131,951	各種金融
RED HAT INC	171	1,313	148,651	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	62	912	103,286	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	215	1,339	151,557	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	165	1,137	128,682	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	263	1,000	113,208	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	160	1,941	219,716	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	412	630	71,297	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	207	5,673	641,993	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	139	2,238	253,328	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC	472	5,393	610,327	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	234	2,001	226,464	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカドル	千円	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	865	2,913	329,642	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC	145	590	66,780	小売
CELGENE CORP	734	8,375	947,659	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	575	3,309	374,434	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	596	4,156	470,279	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	171	903	102,278	運輸
FASTENAL CO	273	1,388	157,148	資本財
FISERV INC	208	2,265	256,372	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	518	785	88,831	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,646	769	87,080	メディア
APPLE INC	5,107	62,250	7,043,680	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	147	1,050	118,832	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,026	1,439	162,906	銀行
COSTAR GROUP INC	31	633	71,685	ソフトウェア・サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	212	2,751	311,381	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	135	1,009	114,168	運輸
CENTURYLINK INC	517	1,329	150,462	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	131	464	52,530	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	430	1,571	177,813	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	200	1,113	125,954	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC	811	4,872	551,318	食品・飲料・タバコ
SEAGATE TECHNOLOGY	284	1,213	137,268	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	132	919	103,985	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	69	1,168	132,213	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC	358	1,422	160,963	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	167	2,587	292,738	食品・飲料・タバコ
NEWFIELD EXPLORATION CO	188	799	90,517	エネルギー
COOPER COS INC/THE	45	826	93,539	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	163	1,047	118,520	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	293	1,964	222,277	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	93	632	71,511	保険
AGCO CORP	60	388	43,905	資本財
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	141	391	44,282	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP	378	1,633	184,782	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA INC	116	1,412	159,809	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	221	809	91,554	素材
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	585	1,998	226,109	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC	153	1,789	202,529	各種金融
TESORO CORP	112	924	104,651	エネルギー
FNF GROUP	232	799	90,444	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	563	3,265	369,526	各種金融
NASDAQ INC	108	743	84,123	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	173	509	57,652	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	329	1,350	152,818	メディア
AUTOLIV INC	83	971	109,877	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	285	881	99,797	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	27	1,155	130,782	消費者サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	200	922	104,381	食品・飲料・タバコ
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	402	779	88,149	小売
ARROW ELECTRONICS INC	86	638	72,300	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	151	2,241	253,582	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	114	710	80,352	資本財

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカドル	千円	
LEUCADIA NATIONAL CORP	308	739	83,710	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	57	1,381	156,298	素材
RANGE RESOURCES CORP	175	594	67,267	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO	472	454	51,400	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	89	1,256	142,155	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	53	490	55,456	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	220	812	91,880	公益事業
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	104	835	94,491	消費者サービス
HANESBRANDS INC	358	853	96,548	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A	918	10,125	1,145,659	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	462	928	105,098	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	152	665	75,347	資本財
AVNET INC	120	575	65,097	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	315	1,048	118,595	素材
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	180	318	36,049	消費者サービス
SPECTRA ENERGY CORP	665	2,884	326,340	エネルギー
TRANSDIGM GROUP INC	50	1,127	127,566	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	112	756	85,642	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	124	1,585	179,406	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	291	556	62,919	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	336	2,532	286,566	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	383	2,650	299,955	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	103	712	80,673	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	50	551	62,369	資本財
MERCADOLIBRE INC	38	696	78,847	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A	70	601	68,042	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	272	1,282	145,130	保険
SEATTLE GENETICS INC	94	549	62,157	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	56	1,525	172,571	小売
LKQ CORP	290	919	104,052	小売
HORMEL FOODS CORP	275	1,005	113,748	食品・飲料・タバコ
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	75	620	70,223	運輸
EASTMAN CHEMICAL CO	140	1,113	125,959	素材
HARRIS CORP	118	1,195	135,229	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	141	2,849	322,406	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP	156	504	57,035	エネルギー
INVESCO LTD	388	1,207	136,636	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	161	1,358	153,680	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	129	660	74,772	各種金融
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	156	811	91,807	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	133	1,907	215,801	エネルギー
MSCI INC	86	711	80,494	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	90	470	53,226	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	178	1,729	195,706	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,471	14,179	1,604,404	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,787	14,994	1,696,649	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	175	1,601	181,161	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N. V.	42	530	59,983	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP	440	1,009	114,281	エネルギー
FLOWSERVE CORP	123	641	72,637	資本財
HELMERICH & PAYNE	102	830	93,987	エネルギー
T-MOBILE US INC	273	1,660	187,831	電気通信サービス

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカドル	千円	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	77	579	65,624	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	216	585	66,221	メディア
RESMED INC	133	930	105,267	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	79	800	90,534	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	220	1,154	130,593	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	116	1,028	116,396	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	242	1,120	126,828	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	85	844	95,531	運輸
PERRIGO CO PLC	135	988	111,879	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FMC CORP	127	792	89,640	素材
WABTEC CORP	85	753	85,246	資本財
EVERSOURCE ENERGY	304	1,653	187,141	公益事業
INGREDION INC	68	872	98,770	食品・飲料・タバコ
ALLERGAN PLC	375	8,015	906,977	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CROWN HOLDINGS INC	134	723	81,814	素材
CALPINE CORP	327	387	43,814	公益事業
EATON VANCE CORP	104	460	52,119	各種金融
DELTA AIR LINES INC	180	907	102,653	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	175	1,316	148,935	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC	171	1,232	139,482	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	152	1,260	142,665	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	266	1,919	217,227	小売
FORTINET INC	137	450	50,960	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	78	576	65,206	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	25	1,053	119,237	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	191	829	93,817	銀行
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	1,106	380	43,059	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO	1,323	5,065	573,180	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	279	2,720	307,796	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	334	3,225	364,992	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	44	847	95,947	資本財
HCA HOLDINGS INC	288	2,320	262,582	ヘルスケア機器・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	160	495	56,099	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	501	2,491	281,907	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	101	757	85,688	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	145	830	94,015	資本財
DEXCOM INC	80	647	73,230	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP	55	754	85,401	資本財
XYLEM INC	169	850	96,256	資本財
TRIPADVISOR INC	114	600	67,979	小売
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	57	695	78,670	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	142	1,352	152,987	銀行
ALLEGHANY CORP	14	894	101,200	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	73	2,563	290,109	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	446	3,794	429,355	エネルギー
FACEBOOK INC-A	2,201	28,944	3,275,059	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP	271	1,135	128,526	公益事業
ALBEMARLE CORP	106	1,002	113,465	素材
PVH CORP	76	725	82,078	耐久消費財・アパレル
KINDER MORGAN INC	1,800	4,069	460,434	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	339	1,391	157,392	商業・専門サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	258	1,898	214,817	自動車・自動車部品

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカドル	千円	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	162	695	78,665	資本財
SPLUNK INC	126	738	83,604	ソフトウェア・サービス
OGЕ ENERGY CORP	192	652	73,777	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	58	522	59,078	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	1,544	9,477	1,072,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA MOTORS INC	122	3,106	351,450	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	191	925	104,713	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	120	912	103,193	各種金融
ZOETIS INC	446	2,413	273,066	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC	103	485	54,891	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	358	441	49,909	メディア
SPRINT CORP	756	695	78,666	電気通信サービス
SNAP-ON INC	54	983	111,321	資本財
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	159	683	77,334	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	536	898	101,614	ソフトウェア・サービス
VANTIV INC - CL A	149	938	106,217	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	113	958	108,459	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	156	1,349	152,652	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	85	973	110,106	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	87	1,324	149,890	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL C	293	24,501	2,772,289	ソフトウェア・サービス
NAVIENT CORP	305	480	54,391	各種金融
ENDO INTERNATIONAL PLC	200	238	26,997	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED RENTALS INC	81	936	105,987	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	128	615	69,698	運輸
VOYA FINANCIAL INC	189	771	87,349	各種金融
ANTERO RESOURCES CORP	144	371	42,091	エネルギー
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	140	1,060	120,006	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	413	811	91,796	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	187	1,103	124,845	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	121	760	86,007	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	84	883	99,912	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C	101	809	91,642	メディア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	150	725	82,056	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	85	1,242	140,633	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIGNET JEWELERS LTD	67	563	63,799	小売
SYNCHRONY FINANCIAL	790	2,839	321,282	各種金融
QORVO INC	121	775	87,757	半導体・半導体製造装置
ARTHUR J GALLAGHER & CO	167	902	102,171	保険
ACUTY BRANDS INC	41	876	99,186	資本財
JONES LANG LASALLE INC	42	436	49,381	不動産
ARAMARK	220	740	83,794	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	491	1,843	208,622	銀行
LEAR CORP	67	993	112,439	自動車・自動車部品
WHITEWAVE FOODS CO	168	930	105,321	食品・飲料・タバコ
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	207	607	68,733	素材
RITE AID CORP	999	689	78,053	食品・生活必需品小売り
TARGA RESOURCES CORP	158	939	106,300	エネルギー
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	106	237	26,919	メディア
WESTROCK CO	238	1,324	149,845	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	577	5,126	580,024	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	1,029	4,292	485,724	ソフトウェア・サービス

銘柄	当 期 末			業 種 等		
	株 数	評 価 額				
		外貨建金額	邦貨換算金額			
(アメリカ)	百株	千アメリカドル	千円			
ZILLOW GROUP INC - C	108	397	44,932	ソフトウェア・サービス		
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,574	3,618	409,386	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
MOBILEYE NV	167	735	83,274	ソフトウェア・サービス		
AMERCO	6	255	28,939	運輸		
CDW CORP/DE	140	725	82,035	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
MEDNAX INC	88	618	69,929	ヘルスケア機器・サービス		
SABRE CORP	202	497	56,278	ソフトウェア・サービス		
FIRST DATA CORP- CLASS A	290	462	52,347	ソフトウェア・サービス		
WR GRACE & CO	67	476	53,916	素材		
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	179	459	52,032	耐久消費財・アパレル		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	189	661	74,898	メディア		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	88	312	35,312	メディア		
DOMINO'S PIZZA INC	46	784	88,779	消費者サービス		
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	205	6,374	721,297	メディア		
IDEXX LABORATORIES INC	85	1,031	116,759	ヘルスケア機器・サービス		
SMITH (A.O.) CORP	140	691	78,270	資本財		
UGI CORP	168	777	88,012	公益事業		
WESTAR ENERGY INC	138	754	85,318	公益事業		
FORTIVE CORP	294	1,625	183,953	資本財		
IHS MARKIT LTD	341	1,357	153,548	商業・専門サービス		
XL GROUP LTD	259	984	111,385	保険		
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	211	1,267	143,391	ソフトウェア・サービス		
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	59	687	77,773	素材		
COTY INC-CL A	460	898	101,700	家庭用品・パーソナル用品		
ARCONIC INC	416	945	106,964	資本財		
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	171	623	70,546	エネルギー		
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	61	764	86,532	保険		
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	26	319	36,167	家庭用品・パーソナル用品		
TELEFLEX INC	42	699	79,130	ヘルスケア機器・サービス		
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	152	484	54,794	電気通信サービス		
ENVISION HEALTHCARE CORP	111	767	86,848	ヘルスケア機器・サービス		
TECHNIPFMC PLC	423	1,494	169,142	エネルギー		
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,110	757	85,656	不動産		
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	240	1,466	165,896	資本財		
小 計	株 数	金 額	294,690	1,924,206	217,724,018	
銘 柄 数 < 比 率 >	600	-			<60.5%>	
(カナダ)		千カナダドル				
ROYAL BANK OF CANADA	1,406	13,214	1,145,211	銀行		
IMPERIAL OIL LTD	283	1,251	108,424	エネルギー		
THOMSON REUTERS CORP	316	1,872	162,253	各種金融		
TRANSCANADA CORP	813	5,241	454,220	エネルギー		
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	344	1,808	156,746	電気通信サービス		
SUN LIFE FINANCIAL INC	580	3,022	261,919	保険		
TECK RESOURCES LTD-CLS B	537	1,845	159,899	素材		
BARRICK GOLD CORP	1,104	2,605	225,787	素材		
BCE INC	139	810	70,274	電気通信サービス		
AGRIUM INC	124	1,774	153,805	素材		
BOMBARDIER INC-B	1,857	482	41,841	資本財		
BANK OF MONTREAL	609	6,105	529,131	銀行		
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	821	3,747	324,789	各種金融		
BANK OF NOVA SCOTIA	1,137	8,897	771,016	銀行		
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	308	564	48,898	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	千カナダドル	千円	
CAE INC	253	477	41,350	資本財
CAMECO CORP	374	628	54,450	エネルギー
CI FINANCIAL CORP	233	653	56,658	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	372	4,181	362,381	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,043	4,172	361,545	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	734	6,707	581,253	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	65	925	80,195	小売
ENBRIDGE INC	888	5,132	444,794	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	22	1,353	117,329	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	205	1,298	112,543	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	332	576	49,919	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	91	371	32,222	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	211	1,474	127,740	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,868	4,740	410,853	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	368	2,119	183,659	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	318	1,794	155,536	銀行
ONEX CORPORATION	81	721	62,508	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	795	2,064	178,919	素材
POWER CORP OF CANADA	356	1,120	97,118	保険
POWER FINANCIAL CORP	238	828	71,754	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	393	1,100	95,326	メディア
SUNCOR ENERGY INC	1,579	6,661	577,311	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	49	554	48,030	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	133	2,680	232,255	運輸
ENCANA CORP	907	1,628	141,166	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	211	1,264	109,546	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	159	432	37,506	資本財
GOLDCORP INC	806	1,689	146,401	素材
KINROSS GOLD CORP	1,167	567	49,150	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	142	816	70,720	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC	282	1,028	89,125	保険
METHANEX CORP	86	527	45,730	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	948	452	39,187	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	80	168	14,621	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	209	706	61,200	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	242	1,168	101,293	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	469	448	38,895	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELUS CORP	116	509	44,170	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	653	1,119	97,050	素材
YAMANA GOLD INC	910	387	33,594	素材
FORTIS INC	383	1,592	137,974	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	398	2,424	210,082	食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP	698	321	27,824	素材
TORONTO-DOMINION BANK	1,756	11,940	1,034,789	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	168	1,415	122,629	素材
SILVER WHEATON CORP	416	1,179	102,239	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	153	250	21,718	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	96	540	46,829	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	124	462	40,060	公益事業
METRO INC	223	897	77,745	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	248	1,111	96,304	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	124	1,167	101,215	保険



銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	千カナダドル	千円	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	512	819	70,991	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	793	1,487	128,921	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	334	716	62,085	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	202	627	54,354	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	374	1,566	135,736	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	111	611	52,954	エネルギー
DOLLARAMA INC	107	1,075	93,208	小売
KEYERA CORP	178	703	60,976	エネルギー
ALTAGAS LTD	157	523	45,333	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	155	451	39,087	エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	78	359	31,174	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	123	258	22,384	不動産
INTER PIPELINE LTD	343	989	85,725	エネルギー
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	191	600	52,013	エネルギー
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	230	629	54,553	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	18	1,079	93,555	ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN	211	1,364	118,251	消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	61	277	24,020	素材
VERESEN INC	301	415	35,970	エネルギー
CCL INDUSTRIES INC - CL B	26	696	60,384	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	371	483	41,860	各種金融
LINAMAR CORP	45	266	23,066	自動車・自動車部品
HYDRO ONE LTD	182	443	38,420	公益事業
EMERA INC	52	239	20,778	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	38,709 91	158,486 — < 3.8% >	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ	
COMMERZBANK AG	1,008	830	101,086	銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	1,308	2,538	309,067	各種金融
METRO AG	170	541	65,924	食品・生活必需品小売り
SIEMENS AG-REG	724	8,675	1,056,328	資本財
RWE AG	471	597	72,707	公益事業
BASF SE	869	7,855	956,437	素材
VOLKSWAGEN AG	30	483	58,862	自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	912	6,601	803,772	自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	167	1,924	234,312	家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE	1,911	1,405	171,161	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	314	2,791	339,873	自動車・自動車部品
BAYER AG-REG	783	8,169	994,749	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINDE AG	176	2,691	327,665	素材
ALLIANZ SE-REG	432	7,027	855,645	保険
MAN SE	33	318	38,743	資本財
CONTINENTAL AG	104	1,953	237,875	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,073	1,810	220,386	半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	144	840	102,309	自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	229	288	35,172	運輸
HUGO BOSS AG -ORD	62	379	46,188	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE POST AG-REG	919	2,937	357,716	運輸
SAP SE	931	7,882	959,734	ソフトウェア・サービス
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	221	878	106,961	メディア
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	203	1,524	185,630	ヘルスケア機器・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	41	232	28,331	運輸

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG	178	2,742	333,930	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	3,103	5,066	616,908	電気通信サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	151	2,689	327,481	保険
THYSSENKRUPP AG	349	848	103,304	素材
BEIERSDORF AG	94	779	94,852	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	140	1,285	156,576	素材
MERCK KGAA	122	1,240	150,996	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOLKSWAGEN AG-PREF	175	2,704	329,316	自動車・自動車部品
LANXESS AG	87	592	72,085	素材
FRESENIUS SE & CO KGAA	388	2,865	348,938	ヘルスケア機器・サービス
HOCHTIEF AG	20	272	33,138	資本財
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	319	937	114,092	不動産
GEA GROUP AG	173	672	81,838	資本財
SYMRISE AG	117	673	81,967	素材
K+S AG-REG	178	443	54,020	素材
HENKEL AG & CO KGAA	99	983	119,747	家庭用品・パーソナル用品
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	115	446	54,326	ソフトウェア・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	51	373	45,504	自動車・自動車部品
HANNOVER RUECK SE	56	587	71,529	保険
BRENTAG AG	146	791	96,364	資本財
AXEL SPRINGER SE	39	193	23,525	メディア
FUCHS PETROLUB SE -PREF	65	286	34,836	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	704	290	35,361	電気通信サービス
OSRAM LICHT AG	82	436	53,145	資本財
VONOVIA SE	442	1,326	161,572	不動産
EVONIK INDUSTRIES AG	151	454	55,329	素材
ZALANDO SE	82	296	36,076	小売
COVESTRO AG	66	465	56,703	素材
SCHAEFFLER AG	163	255	31,090	自動車・自動車部品
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	182	1,502	182,959	各種金融
INNOGY SE	137	438	53,412	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	21,438 56	104,119 —	12,677,578 < 3.5% >
(ユーロ…イタリア)				
ASSICURAZIONI GENERALI	1,105	1,720	209,499	保険
INTESA SANPAOLO	12,012	2,762	336,419	銀行
TELECOM ITALIA SPA	9,645	793	96,658	電気通信サービス
ENI SPA	2,412	3,654	445,032	エネルギー
UNICREDIT SPA	497	1,461	177,953	銀行
ENEL SPA	7,255	2,910	354,433	公益事業
SAIPEM SPA	5,772	305	37,249	エネルギー
ATLANTIA SPA	392	863	105,193	運輸
INTESA SANPAOLO-RSP	899	193	23,601	銀行
LUXOTTICA GROUP SPA	159	803	97,869	耐久消費財・アパレル
MEDIOBANCA SPA	532	467	56,971	銀行
SNAM SPA	2,332	855	104,182	エネルギー
TELECOM ITALIA-RSP	5,629	384	46,849	電気通信サービス
LEONARDO SPA	385	495	60,367	資本財
TERNA SPA	1,468	620	75,512	公益事業
UNIPOLSAI SPA	1,080	225	27,410	保険
PRYSMIAN SPA	182	454	55,324	資本財

銘柄	株数	期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)	百株	千ユーロ	千円	
POSTE ITALIANE SPA	490	302	36,811	保険
小計	株数・金額	52,255	19,278	2,347,342
	銘柄数 < 比率 >	18	-	< 0.7% >
(ユーロ…フランス)				
MICHELIN (CGDE)	172	1,761	214,528	自動車・自動車部品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	264	5,060	616,133	耐久消費財・アパレル
PEUGEOT SA	457	813	99,074	自動車・自動車部品
AXA SA	1,834	4,281	521,338	保険
DANONE	559	3,295	401,236	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	538	1,264	153,961	食品・生活必需品小売り
VIVENDI	973	1,704	207,536	メディア
INGENICO GROUP	52	413	50,295	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA	726	3,470	422,585	銀行
AIR LIQUIDE SA	368	3,817	464,772	素材
TOTAL SA	2,135	10,254	1,248,548	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	472	2,257	274,825	資本財
ZODIAC AEROSPACE	190	539	65,721	資本財
VINCI SA	479	3,196	389,169	資本財
SANOFI	1,099	8,159	993,482	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	464	737	89,758	公益事業
L'OREAL	238	4,086	497,550	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA	162	626	76,296	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	532	3,657	445,318	資本財
BNP PARIBAS	1,004	6,264	762,805	銀行
ESSILOR INTERNATIONAL	196	2,113	257,340	ヘルスケア機器・サービス
CAPGEMINI	154	1,186	144,415	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	54	279	34,005	食品・生活必需品小売り
VALEO SA	225	1,308	159,355	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	24	1,022	124,504	耐久消費財・アパレル
SODEXO	87	903	109,974	消費者サービス
KERING	71	1,651	201,140	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	122	873	106,340	ソフトウェア・サービス
CHRISTIAN DIOR SE	51	1,054	128,439	耐久消費財・アパレル
ATOS SE	84	848	103,307	ソフトウェア・サービス
ORANGE	1,889	2,745	334,253	電気通信サービス
CNP ASSURANCES	165	293	35,696	保険
IMERYS SA	34	263	32,024	素材
SAFRAN SA	296	1,922	234,033	資本財
RENAULT SA	181	1,595	194,285	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	181	1,181	143,878	メディア
LAGARDERE SCA	111	269	32,786	メディア
JCDECAUX SA	72	221	26,926	メディア
SOCIETE BIC SA	26	328	39,960	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	196	689	83,918	資本財
THALES SA	99	871	106,094	資本財
PERNOD RICARD SA	201	2,191	266,867	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	1,067	1,335	162,550	銀行
ENGIE	1,500	1,723	209,892	公益事業
ALSTOM	144	381	46,433	資本財
ARKEMA	64	611	74,479	素材
LEGRAND SA	253	1,376	167,658	資本財
SCOR SE	156	507	61,740	保険

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	千ユーロ	千円	
ADP	29	307	37,440	運輸
EDF	250	242	29,565	公益事業
NATIXIS	909	517	62,974	銀行
WENDEL	28	320	39,044	各種金融
BUREAU VERITAS SA	259	477	58,115	商業・専門サービス
EURAZEO	37	214	26,091	各種金融
SUEZ	319	452	55,102	公益事業
EIFFAGE	57	390	47,520	資本財
ILIAD SA	24	481	58,683	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	166	288	35,066	メディア
GROUPE EURO TUNNEL SE - REGR	448	394	48,059	運輸
EDENRED	199	414	50,466	商業・専門サービス
REMY COINTREAU	20	172	21,039	食品・飲料・タバコ
REXEL SA	291	480	58,498	資本財
BOLLORE	841	321	39,107	運輸
SFR GROUP SA	86	237	28,894	電気通信サービス
DASSAULT AVIATION SA	2	221	26,986	資本財
SEB SA	21	255	31,126	耐久消費財・アパレル
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	24,434 66	101,601 —	12,371,027 < 3.4% >
(ユーロ…オランダ)				
QIAGEN N.V.	204	527	64,178	ヘルスケア機器・サービス
CNH INDUSTRIAL NV	970	842	102,585	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	853	871	106,128	自動車・自動車部品
FERRARI NV	118	686	83,548	自動車・自動車部品
EXOR NV	104	449	54,757	各種金融
AIRBUS SE	549	3,594	437,712	資本財
STMICROELECTRONICS NV	605	678	82,587	半導体・半導体製造装置
GEMALTO	76	408	49,795	ソフトウェア・サービス
WOLTERS KLUWER	286	997	121,431	商業・専門サービス
KONINKLIJKE KPN NV	3,246	871	106,073	電気通信サービス
AKZO NOBEL	234	1,507	183,594	素材
HEINEKEN NV	218	1,540	187,612	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV	897	2,488	302,977	資本財
RELX NV	944	1,461	177,989	商業・専門サービス
AEGON NV	1,736	904	110,185	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	1,212	2,415	294,120	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD HOLDING NV	112	622	75,797	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV	96	636	77,479	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	171	1,027	125,124	素材
ING GROEP NV	3,675	5,018	611,022	銀行
ASML HOLDING NV	349	3,981	484,841	半導体・半導体製造装置
UNILEVER NV-CVA	1,542	6,072	739,332	家庭用品・パーソナル用品
VOPAK	68	292	35,602	エネルギー
BOSKALIS WESTMINSTER	85	301	36,655	資本財
NN GROUP NV	296	987	120,216	保険
ALTICE NV - B	96	190	23,162	メディア
ALTICE NV - A	359	705	85,933	メディア
ABN AMRO GROUP NV-CVA	272	597	72,778	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	19,384 28	40,680 —	4,953,227 < 1.4% >

銘柄	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	千ユーロ	千円		
BANCO POPULAR ESPANOL	3,179	320	38,986	銀行	
ENDESA SA	303	583	71,049	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	179	528	64,297	資本財	
ACS ACTIVIDADES CONS Y-RTS	179	7	958	資本財	
IBERDROLA SA	5,131	3,048	371,135	公益事業	
TELEFONICA SA	4,407	4,038	491,743	電気通信サービス	
BANCO SANTANDER SA	13,831	7,428	904,532	銀行	
BANKINTER SA	643	493	60,147	銀行	
REPSOL SA	1,040	1,482	180,538	エネルギー	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	6,223	4,023	489,905	銀行	
GAS NATURAL SDG SA	336	589	71,735	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	1,030	3,206	390,364	小売	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	613	827	100,781	運輸	
MAPPRE SA	996	286	34,846	保険	
FERROVIAL SA	463	798	97,187	資本財	
ZARDOYA OTIS SA	171	135	16,549	資本財	
ENAGAS SA	221	503	61,269	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	418	703	85,698	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	5,008	692	84,279	銀行	
CAIXABANK S.A	3,110	1,106	134,710	銀行	
GRIFOLS SA	285	557	67,942	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMADEUS IT GROUP SA	414	1,792	218,286	ソフトウェア・サービス	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	803	468	57,060	運輸	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	591	285	34,780	食品・生活必需品小売り	
BANKIA SA	4,283	427	52,108	銀行	
AENA SA	64	857	104,418	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	53,933 26	35,194 —	4,285,315 < 1.2% >	
(ユーロ…ベルギー)					
AGEAS	184	736	89,615	保険	
UCB SA	119	754	91,868	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	76	614	74,839	各種金融	
UMICORE	90	472	57,540	素材	
COLRUYT SA	62	283	34,485	食品・生活必需品小売り	
KBC GROEP NV	237	1,444	175,904	銀行	
SOLVAY SA	70	778	94,770	素材	
PROXIMUS	141	382	46,534	電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	52	260	31,669	メディア	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	722	7,156	871,369	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1,757 10	12,882 —	1,568,599 < 0.4% >	
(ユーロ…オーストリア)					
ERSTE GROUP BANK AG	287	827	100,806	銀行	
OMV AG	141	482	58,734	エネルギー	
VOESTALPINE AG	105	425	51,829	素材	
ANDRITZ AG	68	346	42,130	資本財	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	111	238	29,052	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	715 5	2,320 —	282,553 < 0.1% >	
(ユーロ…ルクセンブルク)					
RTL GROUP	36	258	31,485	メディア	
TENARIS SA	446	767	93,450	エネルギー	

銘柄	株数	期末		業種等	
		評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ルクセンブルク)	百株	千ユーロ	千円		
SES	346	687	83,682	メディア	
EUROFINS SCIENTIFIC	10	436	53,184	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARCELORMITTAL	1,743	1,313	159,916	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,582	3,463	421,720	
		5	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)					
NOKIA OYJ	5,530	2,354	286,722	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STORA ENSO OYJ-R SHS	526	582	70,959	素材	
NOKIAN RENKAAT OYJ	109	387	47,175	自動車・自動車部品	
UPM-KYMMENE OYJ	504	1,235	150,466	素材	
FORTUM OYJ	427	643	78,375	公益事業	
KONE OYJ-B	318	1,437	175,005	資本財	
METSO OYJ	107	311	37,877	資本財	
SAMPO OYJ-A SHS	422	1,809	220,289	保険	
WARTSILA OYJ ABP	140	620	75,498	資本財	
ELISA OYJ	134	428	52,140	電気通信サービス	
NESTE OYJ	124	404	49,294	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	96	414	50,450	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>	8,444	10,629	1,294,255	
		12	—	<0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)					
KERRY GROUP PLC-A	154	1,009	122,859	食品・飲料・タバコ	
PADDY POWER BETFAIR PLC	80	743	90,579	消費者サービス	
IRISH BANK RESOLUTION CORPOR	472	—	—	銀行	
BANK OF IRELAND	26,598	694	84,527	銀行	
CRH PLC	794	2,704	329,292	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	28,099	5,151	627,259	
		5	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)					
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,239	605	73,676	公益事業	
JERONIMO MARTINS	235	368	44,842	食品・生活必需品小売り	
GALP ENERGIA SGPS SA	476	667	81,229	エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,951	1,640	199,748	
		3	—	<0.1%>	
(ユーロ…イギリス)					
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	208	675	82,284	食品・飲料・タバコ	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	208	675	82,284	
		1	—	<0.0%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	216,204	337,638	41,110,912	
		235	—	<11.4%>	
(イギリス)					
BARCLAYS PLC	16,038	千イギリスポンド	3,702	529,416	銀行
BP PLC	17,812	8,693	1,243,076	エネルギー	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	60,897	3,991	570,704	銀行	
ASTRAZENECA PLC	1,198	5,107	730,302	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SMITHS GROUP PLC	374	559	79,949	資本財	
NEXT PLC	132	511	73,161	小売	
DIAGEO PLC	2,386	5,109	730,597	食品・飲料・タバコ	
SKY PLC	982	985	140,881	メディア	
BAE SYSTEMS PLC	3,008	1,806	258,308	資本財	
UNILEVER PLC	1,215	4,070	582,003	家庭用品・パーソナル用品	
TESCO PLC	7,760	1,462	209,127	食品・生活必需品小売り	

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	千イギリスポンド	千円	
RELX PLC	1,035	1,459	208,674	商業・専門サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,536	525	75,210	小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	598	4,075	582,802	家庭用品・パーソナル用品
PRUDENTIAL PLC	2,444	3,858	551,733	保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	5,639	1,361	194,678	保険
SAGE GROUP PLC/THE	1,026	650	92,971	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	18,847	12,774	1,826,662	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,768	8,654	1,237,507	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	670	600	85,907	公益事業
SCHRODERS PLC	125	376	53,883	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	3,348	761	108,938	銀行
BHP BILLITON PLC	2,001	2,917	417,213	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	909	3,328	475,928	食品・飲料・タバコ
WPP PLC	1,214	2,250	321,773	メディア
CENTRICA PLC	5,223	1,180	168,785	公益事業
BT GROUP PLC	7,992	2,416	345,530	電気通信サービス
SSE PLC	965	1,449	207,277	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	3,114	2,456	351,298	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,743	1,195	170,985	資本財
COMPASS GROUP PLC	1,556	2,182	312,006	消費者サービス
KINGFISHER PLC	2,120	700	100,169	小売
PEARSON PLC	777	475	67,968	メディア
SEVERN TRENT PLC	234	519	74,244	公益事業
RIO TINTO PLC	1,171	4,187	598,699	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	4,623	7,036	1,006,178	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PROVIDENT FINANCIAL PLC	142	391	55,930	各種金融
3I GROUP PLC	911	632	90,467	各種金融
GKN PLC	1,619	569	81,363	自動車・自動車部品
VODAFONE GROUP PLC	25,209	4,862	695,338	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	2,110	499	71,465	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	1,526	391	55,997	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	3,844	1,838	262,820	保険
CAPITA PLC	628	316	45,304	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC	912	289	41,442	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	183	594	85,045	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	966	557	79,646	保険
WHITBREAD PLC	172	702	100,391	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	3,592	3,312	473,660	公益事業
WOLSELEY PLC	239	1,179	168,679	資本財
BUNZL PLC	319	665	95,208	資本財
COBHAM PLC	1,613	223	31,923	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	1,328	1,809	258,678	素材
INTERTEK GROUP PLC	154	534	76,439	商業・専門サービス
WILLIAM HILL PLC	818	216	30,902	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	419	698	99,833	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	178	663	94,853	消費者サービス
CARNIVAL PLC	179	761	108,937	消費者サービス
PERSIMMON PLC	290	551	78,863	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	724	315	45,095	資本財
ITV PLC	3,423	700	100,150	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	298	919	131,418	各種金融
G4S PLC	1,465	370	53,003	商業・専門サービス

銘柄	当 期 末			業 種 等		
	株 数	評 価 額				
		外貨建金額	邦貨換算金額			
(イギリス)	百株	千イギリスポンド	千円			
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	121	338	48,427	耐久消費財・アパレル		
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	952	452	64,694	耐久消費財・アパレル		
IMI PLC	256	288	41,272	資本財		
SMITH & NEPHEW PLC	843	995	142,330	ヘルスケア機器・サービス		
TATE & LYLE PLC	437	292	41,838	食品・飲料・タバコ		
TAYLOR WIMPEY PLC	3,088	510	72,950	耐久消費財・アパレル		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	4,101	9,034	1,291,783	エネルギー		
PETROFAC LTD	248	234	33,536	エネルギー		
TRAVIS PERKINS PLC	235	348	49,791	資本財		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	3,550	8,165	1,167,638	エネルギー		
OLD MUTUAL PLC	4,672	992	141,848	保険		
INVESTEC PLC	617	356	51,017	各種金融		
STANDARD LIFE PLC	1,872	654	93,583	保険		
EXPERIAN PLC	908	1,404	200,793	商業・専門サービス		
MONDI PLC	346	623	89,135	素材		
WEIR GROUP PLC/THE	208	419	60,018	資本財		
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	337	831	118,908	食品・飲料・タバコ		
ANTOFAGASTA PLC	869	317	45,329	素材		
SHIRE PLC	352	3,755	537,002	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
INMARSAT PLC	423	268	38,379	電気通信サービス		
ADMIRAL GROUP PLC	197	353	50,548	保険		
FRESNILLO PLC	212	301	43,086	素材		
RANDGOLD RESOURCES LTD	88	587	84,061	素材		
BABCOCK INTL GROUP PLC	240	219	31,371	商業・専門サービス		
ST JAMES' S PLACE PLC	500	547	78,253	保険		
GLENCORE PLC	11,595	3,791	542,161	素材		
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	872	233	33,444	各種金融		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	250	332	47,614	各種金融		
CRODA INTERNATIONAL PLC	125	426	60,992	素材		
COCA-COLA HBC AG-DI	170	309	44,194	食品・飲料・タバコ		
EASYJET PLC	152	153	21,924	運輸		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,301	458	65,594	保険		
ROYAL MAIL PLC	835	344	49,214	運輸		
ASHTREAD GROUP PLC	475	758	108,458	資本財		
MERLIN ENTERTAINMENT	670	325	46,562	消費者サービス		
TUI AG-DI	471	542	77,563	消費者サービス		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	137	255	36,495	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	352	282	40,366	ヘルスケア機器・サービス		
AUTO TRADER GROUP PLC	931	362	51,832	ソフトウェア・サービス		
WORLDPAY GROUP PLC	1,736	491	70,323	ソフトウェア・サービス		
DCC PLC	85	517	74,018	資本財		
小 計	株 数	金 額	281,616	169,842	24,285,786	
	銘柄 数 < 比 率 >		104	—	< 6.8% >	
(スイス)			千スイスフラン			
NESTLE SA-REG	2,949	21,764	2,467,868	食品・飲料・タバコ		
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	494	3,868	438,696	耐久消費財・アパレル		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,884	2,997	339,921	各種金融		
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	432	2,372	269,024	素材		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	665	15,635	1,772,943	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
GIVAUDAN-REG	8	1,611	182,766	素材		
SONOVA HOLDING AG-REG	50	650	73,755	ヘルスケア機器・サービス		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	142	4,101	465,060	保険		



銘柄	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	千スイスフラン	千円	
SYNGENTA AG-REG	87	3,764	426,805	素材
LONZA GROUP AG-REG	50	936	106,139	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	48	334	37,905	耐久消費財・アパレル
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	37	711	80,707	資本財
GEBERIT AG-REG	35	1,505	170,671	資本財
SWISS RE AG	306	2,884	327,105	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR	28	1,031	116,942	耐久消費財・アパレル
PARGESA HOLDING SA-BR	35	235	26,741	各種金融
NOVARTIS AG-REG	2,115	15,075	1,709,451	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	154	1,118	126,782	商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG	24	1,078	122,274	電気通信サービス
ABB LTD-REG	1,783	4,188	474,921	資本財
SGS SA-REG	5	1,096	124,358	商業・専門サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	20	377	42,835	資本財
ACTELION LTD-REG	91	2,090	237,040	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	51	696	79,006	運輸
BALOISE HOLDING AG - REG	47	612	69,484	保険
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	30	915	103,792	保険
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.1	660	74,888	食品・飲料・タバコ
ARYZTA AG	82	238	27,067	食品・飲料・タバコ
JULIUS BAER GROUP LTD	212	1,001	113,609	各種金融
SIKA AG-BR	2	1,026	116,351	素材
SWISS PRIME SITE-REG	68	567	64,325	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.93	524	59,528	食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG	16	816	92,624	各種金融
BARRY CALLEBAUT AG-REG	2	264	30,040	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	7	394	44,745	素材
UBS GROUP AG-REG	3,470	5,979	677,999	各種金融
DUFREY AG-REG	44	639	72,538	小売
GALENICA AG-REG	3	396	44,984	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>	15,493 38	104,168 -	11,811,709 <3.3%>
(スウェーデン)		千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-SER B	229	5,432	69,803	耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS	2,905	15,091	193,925	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS	369	9,613	123,534	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,444	14,195	182,411	銀行
INVESTOR AB-B SHS	428	15,278	196,324	各種金融
NORDEA BANK AB	2,884	30,570	392,829	銀行
GETINGE AB-B SHS	191	2,963	38,080	ヘルスケア機器・サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,450	19,012	244,307	銀行
ATLAS COPCO AB-A SHS	635	18,395	236,381	資本財
SKF AB-B SHARES	376	6,766	86,953	資本財
ASSA ABLOY AB-B	948	15,980	205,349	資本財
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	898	21,572	277,201	小売
SANDVIK AB	1,009	12,225	157,102	資本財
SWEDBANK AB - A SHARES	861	19,128	245,797	銀行
SECURITAS AB-B SHS	293	4,149	53,314	商業・専門サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	573	14,516	186,532	家庭用品・パーソナル用品
SKANSKA AB-B SHS	319	7,038	90,450	資本財
SWEDISH MATCH AB	181	5,195	66,767	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS	330	2,401	30,854	電気通信サービス

銘柄	株数	期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)	百株	千スウェーデンクローネ	千円	
TELIA CO AB	2,445	8,909	114,486	電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS	1,458	16,680	214,345	資本財
ALFA LAVAL AB	273	4,282	55,025	資本財
LUNDIN PETROLEUM AB	179	3,471	44,612	エネルギー
BOLIDEN AB	257	6,706	86,179	素材
HUSQVARNA AB-B SHS	395	2,817	36,211	耐久消費財・アパレル
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	63	2,712	34,850	電気通信サービス
HEXAGON AB-B SHS	246	8,628	110,882	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINNEVIK AB - B	223	5,040	64,770	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	154	2,612	33,570	各種金融
ICA GRUPPEN AB	77	2,157	27,723	食品・生活必需品小売り
LUNDBERGS AB-B SHS	36	2,026	26,044	各種金融
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	22,142 31	305,573 -	3,926,622 <1.1%>
(ノルウェー)		千ノルウェークローネ		
DNB ASA	927	12,885	175,755	銀行
NORSK HYDRO ASA	1,264	6,107	83,299	素材
ORKLA ASA	768	5,958	81,274	食品・飲料・タバコ
STATOIL ASA	1,068	17,050	232,562	エネルギー
TELENOR ASA	709	9,366	127,765	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	167	6,031	82,268	素材
MARINE HARVEST	360	5,482	74,785	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	189	2,655	36,220	保険
SCHIBSTED ASA-CL A	71	1,517	20,701	メディア
SCHIBSTED ASA-B SHS	84	1,698	23,168	メディア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,611 10	68,753 -	937,803 <0.3%>
(デンマーク)		千デンマーククローネ		
NOVO NORDISK A/S-B	1,811	43,912	718,850	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	218	5,529	90,523	素材
DANSKE BANK A/S	652	14,928	244,377	銀行
WILLIAM DEMANT HOLDING	116	1,440	23,577	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	209	9,844	161,158	資本財
TDC A/S	765	2,930	47,973	電気通信サービス
CARLSBERG AS-B	101	6,282	102,842	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B	111	5,509	90,188	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S	179	5,936	97,172	運輸
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	6	7,175	117,459	運輸
TRYG A/S	107	1,401	22,942	保険
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	3	4,248	69,552	運輸
PANDORA A/S	105	9,304	152,320	耐久消費財・アパレル
ISS A/S	160	3,848	63,003	商業・専門サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	95	3,839	62,854	素材
GENMAB A/S	53	6,974	114,166	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONG ENERGY A/S	85	2,176	35,635	公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,784 17	135,283 -	2,214,599 <0.6%>
(オーストラリア)		千オーストラリアドル		
BHP BILLITON LIMITED	3,050	8,508	729,770	素材
CSL LTD	434	4,881	418,682	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINA LTD	2,350	479	41,127	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	722	2,316	198,661	エネルギー

銘柄	当 期 末			業 種 等
	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	千オーストラリアドル	千円	
AUST AND NZ BANKING GROUP	2,787	8,213	704,474	銀行
RIO TINTO LTD	405	2,726	233,887	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	1,312	1,587	136,162	保険
LENLEASE GROUP	535	733	62,887	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	1,632	13,422	1,151,267	銀行
WESTPAC BANKING CORP	3,185	10,120	868,012	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,531	7,660	657,061	銀行
BRAMBLES LTD	1,529	1,624	139,346	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	551	192	16,543	運輸
BORAL LTD	1,126	655	56,210	素材
WOOLWORTHS LTD	1,220	3,008	257,999	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	4,109	2,083	178,723	電気通信サービス
AMP LTD	2,843	1,424	122,167	各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD	817	388	33,293	消費者サービス
AMCOR LIMITED	1,112	1,603	137,538	素材
COMPUTERSHARE LTD	450	578	49,589	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	527	806	69,157	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	293	2,472	212,044	各種金融
CIMIC GROUP LTD	92	324	27,798	資本財
ASX LTD	188	925	79,364	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	556	551	47,280	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	56	722	61,995	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	431	892	76,564	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	539	263	22,629	小売
NEWCREST MINING LTD	729	1,588	136,236	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	2,352	1,371	117,620	保険
ORIGIN ENERGY LTD	1,681	1,218	104,546	エネルギー
ORICA LTD	368	708	60,770	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	384	810	69,554	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	1,551	622	53,365	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	1,245	1,622	139,197	保険
TRANSURBAN GROUP	1,983	2,027	173,910	運輸
WESFARMERS LTD	1,072	4,366	374,521	食品・生活必需品小売り
CHALLENGER LTD	566	631	54,122	各種金融
SYDNEY AIRPORT	1,118	679	58,320	運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD	254	749	64,254	エネルギー
OIL SEARCH LTD	1,314	918	78,806	エネルギー
AGL ENERGY LTD	658	1,463	125,530	公益事業
TATTS GROUP LTD	1,395	595	51,115	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,484	978	83,904	素材
AUSNET SERVICES	2,078	325	27,898	公益事業
CROWN RESORTS LTD	352	405	34,793	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD	1,608	608	52,153	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	441	563	48,296	銀行
AURIZON HOLDINGS LTD	1,987	987	84,739	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	715	797	68,375	食品・飲料・タバコ
RAMSAY HEALTH CARE LTD	138	939	80,572	ヘルスケア機器・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	54	165	14,227	消費者サービス
SEEK LTD	321	466	40,031	商業・専門サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	375	452	38,791	銀行
REA GROUP LTD	54	292	25,110	メディア
TPG TELECOM LTD	322	217	18,619	電気通信サービス

銘柄	株数	期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	千オーストラリアドル	千円	
HEALTHSCOPE LTD	1,702	384	33,006	ヘルスケア機器・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,670	720	61,832	保険
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	60	363	31,191	消費者サービス
SOUTH32 LTD	5,065	1,443	123,831	素材
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	486	206	17,674	電気通信サービス
小計	株数・金額	71,992	108,862	9,337,166
	銘柄数<比率>	61	—	<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	1,699	592	48,897	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	899	612	50,572	運輸
CONTACT ENERGY LTD	718	358	29,597	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD	661	686	56,719	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD	367	315	26,018	ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD	1,274	349	28,844	公益事業
MERCURY NZ LTD	710	218	18,075	公益事業
小計	株数・金額	6,331	3,133	258,726
	銘柄数<比率>	7	—	<0.1%>
(香港)		千香港ドル		
WHARF HOLDINGS LTD	1,290	7,559	110,291	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	520	4,043	58,987	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,568	23,541	343,477	資本財
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,370	14,563	212,475	不動産
MTR CORP	1,415	5,532	80,721	運輸
HONG KONG & CHINA GAS	7,403	10,749	156,837	公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT	5,430	4,821	70,350	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,335	9,638	140,628	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,096	20,363	297,106	各種金融
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	1,230	1,289	18,807	運輸
HANG LUNG GROUP LTD	850	2,465	35,964	不動産
HANG LUNG PROPERTIES LTD	2,170	4,083	59,584	不動産
CLP HOLDINGS LTD	1,585	11,990	174,941	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,043	4,440	64,783	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	1,174	3,763	54,906	銀行
HANG SENG BANK LTD	723	11,264	164,346	銀行
HYSAN DEVELOPMENT CO	600	2,130	31,076	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD	1,220	1,029	15,023	消費者サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	239	2,203	32,150	半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO	2,874	3,678	53,672	不動産
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	715	2,027	29,574	耐久消費財・アパレル
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	650	3,968	57,896	公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,495	10,694	156,035	銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	1,330	3,557	51,907	耐久消費財・アパレル
PCCW LTD	4,250	2,001	29,205	電気通信サービス
LI & FUNG LTD	5,780	1,947	28,419	耐久消費財・アパレル
KERRY PROPERTIES LTD	615	1,322	19,291	不動産
NWS HOLDINGS LTD	1,505	2,031	29,643	資本財
SANDS CHINA LTD	2,300	8,130	118,623	消費者サービス
WHEELOCK & CO LTD	790	3,716	54,230	不動産
WYNN MACAU LTD	1,524	2,084	30,417	消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD	1,830	1,129	16,473	消費者サービス
FIRST PACIFIC CO	2,060	1,194	17,432	各種金融
AIA GROUP LTD	11,432	54,644	797,269	保険

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
SWIRE PROPERTIES LTD	1,110	2,419	35,304	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	2,230	8,128	118,592	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	952	1,431	20,890	消費者サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	2,540	2,743	40,023	電気通信サービス
WH GROUP LTD	7,700	4,543	66,282	食品・飲料・タバコ
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	2,548	12,832	187,227	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	91,493	279,703	4,080,876
(シンガポール)		千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,995	2,797	224,233	銀行
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	1,526	531	42,582	メディア
SEMCORP INDUSTRIES LTD	1,002	323	25,943	資本財
CAPITALAND LTD	2,492	799	64,122	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	383	343	27,508	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	96	399	32,058	小売
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,681	3,168	254,001	銀行
KEPPEL CORP LTD	1,394	874	70,062	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,233	2,588	207,459	銀行
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,507	497	39,864	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	7,589	2,929	234,835	電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	546	548	43,974	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	761	563	45,141	各種金融
UOL GROUP LTD	481	310	24,869	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	2,063	499	40,019	運輸
STARHUB LTD	627	185	14,877	電気通信サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	6,602	277	22,229	食品・飲料・タバコ
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,878	745	59,764	食品・飲料・タバコ
GENTING SINGAPORE PLC	5,757	552	44,302	消費者サービス
SATS LTD	670	351	28,196	運輸
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	2,536	661	53,057	不動産
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	1,945	158	12,706	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	45,766	20,107	1,611,812
(イスラエル)		千イスラエルシェケル		
ISRAEL CHEMICALS LTD	473	858	25,664	素材
BANK HAPOALIM BM	1,005	2,322	69,472	銀行
NICE LTD	56	1,482	44,339	ソフトウェア・サービス
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,369	2,191	65,552	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD	22	894	26,748	資本財
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	1,959	1,304	39,027	電気通信サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	138	814	24,373	銀行
AZRIELI GROUP LTD	39	680	20,349	不動産
FRUTAROM	36	734	21,976	素材
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	5,101	11,284	337,504
合 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1,099,937	—	331,372,006
	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1,265	—	<92.1% >

(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、親投資信託の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	口数	当期末		比率
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千アメリカドル	千円	%
HCP INC	44	1,323	149,734	0.0
MACERICH CO/THE	11	803	90,925	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7	839	94,950	0.0
PROLOGIS INC	49	2,582	292,216	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	8	682	77,236	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	13	615	69,641	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	15	1,621	183,422	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6	1,399	158,312	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	11	877	99,305	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6	948	107,339	0.0
WELLTOWER INC	33	2,248	254,467	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	14	1,897	214,668	0.1
MID-AMERICA APARTMENT COMM	10	1,034	117,050	0.0
REALTY INCOME CORP	24	1,455	164,710	0.0
REGENCY CENTERS CORP	9	690	78,080	0.0
SL GREEN REALTY CORP	9	1,033	116,962	0.0
UDR INC	25	890	100,723	0.0
VENTAS INC	33	2,038	230,602	0.1
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	93	955	108,164	0.0
WEYERHAEUSER CO	70	2,281	258,162	0.1
AMERICAN TOWER CORP	40	4,192	474,351	0.1
AGNC INVESTMENT CORP	30	591	66,918	0.0
VEREIT INC	91	786	89,023	0.0
DUKE REALTY CORP	33	862	97,615	0.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	28	712	80,601	0.0
IRON MOUNTAIN INC	23	840	95,100	0.0
EQUINIX INC	6	2,586	292,699	0.1
CROWN CASTLE INTL CORP	31	2,784	315,089	0.1
EQUITY RESIDENTIAL	34	2,132	241,296	0.1
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	49	709	80,224	0.0
GENERAL GROWTH PROPERTIES	54	1,352	153,009	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	70	1,296	146,732	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	13	563	63,733	0.0
PUBLIC STORAGE	13	3,050	345,115	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	29	5,437	615,235	0.2
VORNADO REALTY TRUST	16	1,737	196,619	0.1
KIMCO REALTY CORP	39	996	112,752	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	12	2,250	254,635	0.1
小計	口数	金額		
	銘柄数	<比率>		
(カナダ)		千カナダドル		
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	6	192	16,701	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	13	300	26,071	0.0

銘柄	口数	当期末		比率
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	千口	千カナダドル	千円	%
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15	391	33,940	0.0
小計	口数・金額	34	885	76,712
	銘柄数 < 比率 >	3	—	< 0.0% >
(ユーロ…フランス)		千ユーロ		
GECINA SA	3	469	57,120	0.0
KLEPIERRE	20	727	88,634	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE	9	1,988	242,095	0.1
FONCIERE DES REGIONS	3	261	31,834	0.0
ICADE	3	237	28,969	0.0
ユーロ計	口数・金額	41	3,684	448,654
	銘柄数 < 比率 >	5	—	< 0.1% >
(イギリス)		千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC	92	538	77,063	0.0
HAMMERSON PLC	75	411	58,829	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	74	739	105,732	0.0
INTU PROPERTIES PLC	90	243	34,800	0.0
SEGRO PLC	77	351	50,318	0.0
小計	口数・金額	409	2,285	326,744
	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	325	926	79,460	0.0
SCENTRE GROUP	509	2,242	192,357	0.1
GPT GROUP	174	810	69,538	0.0
MIRVAC GROUP	361	725	62,263	0.0
STOCKLAND	233	1,011	86,774	0.0
WESTFIELD CORP	189	1,688	144,798	0.0
DEXUS PROPERTY GROUP	93	839	71,971	0.0
GOODMAN GROUP	172	1,181	101,355	0.0
小計	口数・金額	2,059	9,426	808,519
	銘柄数 < 比率 >	8	—	< 0.2% >
(香港)		千香港ドル		
LINK REIT	212	11,034	160,994	0.0
小計	口数・金額	212	11,034	160,994
	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	235	399	32,038	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	203	305	24,456	0.0
CAPITALAND MALL TRUST	238	461	36,978	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	228	548	43,959	0.0
小計	口数・金額	906	1,714	137,433
	銘柄数 < 比率 >	4	—	< 0.0% >
合計	口数・金額	4,785	—	8,646,491
	銘柄数 < 比率 >	64	—	< 2.4% >

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

## 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期	
			買建額	売建額
外国	株式先物取引	SP EMINI	12,991	—
		SP/TSE60	799	—
		SWISS IX	657	—
		EURO ST	2,857	—
		SPI 200	1,010	—
		FTSE100	1,402	—

(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。



## <新興国株式インデックスマザーファンド>

下記は、新興国株式インデックスマザーファンド全体(20,724,821千口)の内容です。

### 外国株式

銘柄	株数	当期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカドル	千円	
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	42	131	14,929	半導体・半導体製造装置
SINA CORP	50	351	39,794	ソフトウェア・サービス
NETEASE INC-ADR	68	1,713	193,863	ソフトウェア・サービス
CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	322	1,406	159,173	小売
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	168	220	24,997	素材
BAIDU INC - SPON ADR	235	4,166	471,408	ソフトウェア・サービス
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	436	453	51,365	電気通信サービス
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	116	556	62,962	消費者サービス
SOUTHERN COPPER CORP	70	270	30,635	素材
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	14	13	1,498	エネルギー
CREDICORP LTD	59	1,000	113,172	銀行
YY INC-ADR	26	112	12,776	ソフトウェア・サービス
TAL EDUCATION GROUP- ADR	36	295	33,423	消費者サービス
TRANSNEFT PJSC	1	485	54,912	エネルギー
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	1,231	274	31,008	各種金融
SBERBANK OF RUSSIA PJSC	500	143	16,260	銀行
GAZPROM PJSC	360	89	10,152	エネルギー
RUSHYDRO PJSC	104,640	181	20,588	公益事業
MMC NORILSK NICKEL PJSC	47	769	87,054	素材
LUKOIL PJSC	19	105	11,974	エネルギー
TATNEFT PJSC	1,221	845	95,634	エネルギー
ROSNEFT OIL CO PJSC	1,003	649	73,530	エネルギー
VTB BANK PJSC	4,667,800	539	61,071	銀行
SURGUTNEFTEGAS OJSC	6,280	337	38,132	エネルギー
SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	5,822	321	36,374	エネルギー
SEVERSTAL PJSC	184	291	33,010	素材
ROSTELECOM PJSC	790	109	12,420	電気通信サービス
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	31	94	10,687	小売
DP WORLD LTD	146	283	32,092	運輸
ALROSA PJSC	2,207	386	43,714	素材
JD.COM INC-ADR	578	1,652	186,980	小売
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	343	381	43,196	小売
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	974	10,135	1,146,825	ソフトウェア・サービス
WEIBO CORP-SPON ADR	24	116	13,197	ソフトウェア・サービス
58.COM INC-ADR	69	204	23,190	ソフトウェア・サービス
YUM CHINA HOLDINGS INC	352	950	107,537	消費者サービス
INTER RAO UES PJSC	25,000	167	18,902	公益事業
HON HAI PRECISION-GDR REG S	114	60	6,810	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LUKOIL PJSC-SPON ADR	348	1,888	213,664	エネルギー
GAZPROM PAO -SPON ADR	4,920	2,431	275,175	エネルギー
SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR	155	152	17,275	電気通信サービス
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	80	1,013	114,688	エネルギー
GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR	420	77	8,767	電気通信サービス
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	267	1,025	116,032	食品・生活必需品小売り
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	2,183	2,548	288,362	銀行
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	814	329	37,254	銀行

銘柄	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	千アメリカドル	千円		
PHOSAGRO OAO-GDR REG S	77	120	13,679	素材	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	756	109	12,377	不動産	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,831,410	39,969	4,522,539	
		48	—	<10.5%>	
(メキシコ)		千メキシコペソ			
ALFA S. A. B. -A	2,406	6,594	35,414	資本財	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	503	4,425	23,767	資本財	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	28,670	39,077	209,844	電気通信サービス	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	1,388	5,257	28,234	家庭用品・パーソナル用品	
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	4,508	16,296	87,511	食品・生活必需品小売り	
CEMEX SAB-CPO	12,142	24,138	129,622	素材	
GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO	2,118	20,258	108,789	メディア	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,413	6,836	36,709	食品・飲料・タバコ	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	2,160	21,846	117,314	銀行	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	1,591	26,346	141,483	食品・飲料・タバコ	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	126	6,520	35,013	素材	
MEXICHEM SAB DE CV-*	982	5,062	27,184	素材	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	449	6,051	32,497	食品・飲料・タバコ	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	3,324	21,464	115,263	素材	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	1,997	6,356	34,134	銀行	
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	296	4,985	26,772	運輸	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	381	4,445	23,872	食品・飲料・タバコ	
GENTERA SAB DE CV	901	2,759	14,819	各種金融	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	165	2,271	12,195	小売	
GRUPO FIN SANTANDER-B	1,613	4,816	25,864	銀行	
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	186	5,833	31,326	運輸	
OHL MEXICO SAB DE CV	670	1,450	7,789	運輸	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	242	4,574	24,565	運輸	
GRUMA S. A. B. -B	191	5,272	28,315	食品・飲料・タバコ	
GRUPO LALA SAB DE CV	552	1,712	9,195	食品・飲料・タバコ	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	440	4,087	21,948	公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	69,416	258,742	1,389,448	
		26	—	<3.2%>	
(ブラジル)		千ブラジルレアル			
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	663	605	21,627	公益事業	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	201	527	18,816	公益事業	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	3,360	5,389	192,349	エネルギー	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	292	952	33,984	公益事業	
GERDAU SA-PREF	809	1,016	36,264	素材	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	91	292	10,435	公益事業	
TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF	385	1,787	63,798	電気通信サービス	
VALE SA-PREF	1,704	5,517	196,921	素材	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	2,795	10,551	376,587	銀行	
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	112	457	16,316	エネルギー	
BRF SA	526	2,467	88,082	食品・飲料・タバコ	
JBS SA	621	747	26,662	食品・飲料・タバコ	
NATURA COSMETICOS SA	157	403	14,411	家庭用品・パーソナル用品	
VALE SA	1,082	3,692	131,798	素材	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	311	2,076	74,100	エネルギー	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	144	511	18,260	公益事業	
PORTO SEGURO SA	104	277	9,921	保険	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	2,615	4,636	165,472	エネルギー	

銘柄	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	千ブラジルレアル	千円	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	139	826	29,512	食品・生活必需品小売り
LOJAS RENNER S.A.	555	1,344	47,994	小売
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	524	937	33,458	小売
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	3,356	3,104	110,794	銀行
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	260	357	12,759	公益事業
EMBRAER SA	586	1,094	39,067	資本財
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	180	405	14,473	公益事業
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	549	680	24,276	素材
CPFL ENERGIA SA	185	470	16,792	公益事業
CCR SA	760	1,173	41,880	運輸
BM&FBOVESPA SA	1,492	2,702	96,434	各種金融
BRASKEM SA-PREF A	134	460	16,437	素材
BANCO BRADESCO SA-PREF	2,468	7,927	282,942	銀行
BANCO DO BRASIL S.A.	742	2,233	79,710	銀行
CIELO SA	877	2,274	81,161	ソフトウェア・サービス
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	369	1,148	40,983	銀行
DURATEX SA	258	196	7,014	素材
SUZANO PAPEL E CELULO-PREF A	355	516	18,434	素材
FIBRIA CELULOSE SA	222	712	25,433	素材
HYPERMARCAS SA	309	860	30,713	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANCO BRADESCO S.A.	657	2,125	75,866	銀行
WEG SA	484	758	27,078	資本財
BR MALLS PARTICIPACOES SA	508	714	25,488	不動産
LOCALIZA RENT A CAR	145	545	19,458	運輸
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	73	464	16,570	不動産
SUL AMERICA SA - UNITS	150	281	10,036	保険
TIM PARTICIPACOES SA	749	678	24,217	電気通信サービス
RAIA DROGASIL SA	200	1,304	46,568	食品・生活必需品小売り
M DIAS BRANCO SA	30	387	13,833	食品・飲料・タバコ
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	199	923	32,947	各種金融
ODONTOPREV S.A.	245	294	10,492	ヘルスケア機器・サービス
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	175	1,018	36,337	公益事業
LOJAS AMERICANAS SA	150	206	7,377	小売
QUALICORP SA	202	420	14,995	ヘルスケア機器・サービス
KROTON EDUCACIONAL SA	1,194	1,664	59,406	消費者サービス
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	604	1,652	58,979	保険
AMBEV SA	4,091	7,077	252,593	食品・飲料・タバコ
KLABIN SA - UNIT	476	772	27,572	素材
RUMO LOGISTICA OPERADORA MUL	700	525	18,737	運輸
AES TIETE ENERGIA SA-UNIT	141	202	7,231	公益事業
小 計	株 数	金 額		
	銘柄 数 < 比率 >			
		41,473	93,356	3,331,878
		58	-	< 7.7% >
(チリ)		千チリペソ		
BANCO DE CREDITO E INVERSION	32	114,264	19,916	銀行
CENCOSUD SA	1,226	236,621	41,243	食品・生活必需品小売り
EMPRESAS CMPC SA	1,061	153,787	26,805	素材
COLBUN SA	7,017	92,165	16,064	公益事業
EMPRESAS COPEC SA	388	271,499	47,322	エネルギー
ITAU CORPBANCA	141,923	78,611	13,701	銀行
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	129	92,903	16,193	電気通信サービス
S.A.C.I. FALABELLA	524	275,913	48,091	小売
AES GENER SA	2,201	50,854	8,863	公益事業

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(チリ)	百株	千チリペソ	千円	
AGUAS ANDINAS SA-A	2,393	85,626	14,924	公益事業
LATAM AIRLINES GROUP SA	274	165,835	28,905	運輸
ENEL GENERACION CHILE SA	2,881	126,858	22,111	公益事業
BANCO SANTANDER CHILE	58,371	208,971	36,423	銀行
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	85	186,817	32,562	素材
ENEL AMERICAS SA	17,259	200,225	34,899	公益事業
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	132	96,265	16,779	食品・飲料・タバコ
BANCO DE CHILE	20,782	163,266	28,457	銀行
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	220	55,000	9,586	食品・飲料・タバコ
ENEL CHILE SA	17,259	113,980	19,866	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	274,163	2,769,465	482,717
	銘柄 数 < 比 率 >	19	-	< 1.1% >
(コロンビア)		千コロンビアペソ		
GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	2,954	357,458	13,833	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF	398	1,105,644	42,788	銀行
ECOPETROL SA	3,983	551,673	21,349	エネルギー
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	68	248,948	9,634	各種金融
INTERCONEXION ELECTRICA SA	333	341,658	13,222	公益事業
GRUPO ARGOS SA	258	507,444	19,638	素材
GRUPO DE INV SURAMERICANA	206	802,483	31,056	各種金融
CEMENTOS ARGOS SA	393	461,650	17,865	素材
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	85	324,481	12,557	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額	8,681	4,701,440	181,945
	銘柄 数 < 比 率 >	9	-	< 0.4% >
(ユーロ…ギリシャ)		千ユーロ		
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	217	192	23,431	電気通信サービス
ALPHA BANK AE	1,142	218	26,558	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE	4,665	121	14,769	銀行
EUROBANK ERGASIAS SA	1,598	109	13,373	銀行
TITAN CEMENT CO. S.A.	38	85	10,388	素材
PIRAEUS BANK S. A	5,815	127	15,508	銀行
OPAP SA	192	168	20,530	消費者サービス
FF GROUP	27	49	6,039	小売
JUMBO SA	91	127	15,508	小売
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	13,789	1,199	146,107
	銘柄 数 < 比 率 >	9	-	< 0.3% >
(トルコ)		千トルコリラ		
AKBANK T. A. S.	1,897	1,491	44,034	銀行
TURKIYE IS BANKASI-C	1,438	804	23,745	銀行
TURKIYE GARANTI BANKASI	1,989	1,535	45,350	銀行
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	775	855	25,272	電気通信サービス
YAPI VE KREDI BANKASI	745	260	7,699	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	182	396	11,714	食品・飲料・タバコ
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	113	889	26,260	エネルギー
HACI OMER SABANCI HOLDING	804	788	23,278	各種金融
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	1,219	683	20,170	素材
KOC HOLDING AS	559	811	23,969	資本財
ARCELIK AS	211	472	13,940	耐久消費財・アパレル
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	602	236	6,979	資本財
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	64	215	6,356	自動車・自動車部品
TURK HAVA YOLLARI AO	474	254	7,514	運輸
ULKER BISKUVI SANAYI	127	215	6,368	食品・飲料・タバコ

銘柄	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	千トルコリラ	千円		
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	110	286	8,452	自動車・自動車部品	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	656	304	8,998	銀行	
COCA-COLA ICECEK AS	64	242	7,159	食品・飲料・タバコ	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	140	221	6,532	運輸	
TURKIYE HALK BANKASI	538	563	16,630	銀行	
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	384	216	6,384	電気通信サービス	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	186	995	29,389	食品・生活必需品小売り	
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	627	255	7,535	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	13,912	12,994	383,734	
		23	—	<0.9%>	
(チェコ)		千チェココルナ			
O2 CZECH REPUBLIC AS	56	1,513	6,827	電気通信サービス	
CEZ AS	141	6,022	27,160	公益事業	
KOMERCNI BANKA AS	67	5,971	26,932	銀行	
MONETA MONEY BANK AS	320	2,624	11,834	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	585	16,131	72,754	
		4	—	<0.2%>	
(ハンガリー)		千ハンガリーフォリント			
RICHTER GEDEON NYRT	123	77,492	30,470	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
OTP BANK PLC	205	183,188	72,029	銀行	
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	32	65,253	25,657	エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	360	325,934	128,157	
		3	—	<0.3%>	
(ポーランド)		千ポーランドズロチ			
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	282	2,324	65,047	エネルギー	
ORANGE POLSKA SA	572	313	8,760	電気通信サービス	
PRO BANK POLSKI SA	769	2,422	67,791	銀行	
BANK PEKAO SA	138	1,902	53,226	銀行	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	122	1,507	42,176	素材	
BANK ZACHODNI WBK SA	30	1,083	30,322	銀行	
MBANK SA	13	510	14,284	銀行	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	1,563	870	24,359	エネルギー	
GRUPA LOTOS SA	78	292	8,186	エネルギー	
EUROCASH SA	71	281	7,886	食品・生活必需品小売り	
BANK MILLENNIUM SA	520	308	8,627	銀行	
CYFROWY POLSAT SA	163	400	11,219	メディア	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	29	230	6,438	銀行	
PGE SA	741	780	21,837	公益事業	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	491	1,753	49,075	保険	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	959	278	7,784	公益事業	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	40	278	7,789	素材	
SYNTHOS SA	430	254	7,134	素材	
GRUPA AZOTY SA	37	260	7,289	素材	
ALIOR BANK SA	78	487	13,642	銀行	
LPP SA	1	614	17,192	耐久消費財・アパレル	
CCC SA	23	485	13,575	耐久消費財・アパレル	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,154	17,642	493,649	
		22	—	<1.1%>	
(香港)		千香港ドル			
PETROCHINA CO LTD-H	18,270	11,418	166,599	エネルギー	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	22,060	13,809	201,481	エネルギー	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	5,180	4,594	67,036	電気通信サービス	

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	820	1,446	21,104	ソフトウェア・サービス
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	2,620	2,882	42,048	自動車・自動車部品
CITIC LTD	3,760	4,278	62,428	資本財
CNOOC LTD	15,430	14,936	217,919	エネルギー
YANZHOU COAL MINING CO-H	1,720	1,021	14,906	エネルギー
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	3,010	1,450	21,167	素材
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	1,340	995	14,526	運輸
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	1,320	1,030	15,041	運輸
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	1,380	2,083	30,402	食品・飲料・タバコ
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	1,740	1,541	22,492	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	440	941	13,737	資本財
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	1,120	2,324	33,907	運輸
COSCO SHIPPING PORTS LTD	1,440	1,108	16,177	運輸
BYD CO LTD-H	545	2,338	34,112	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD-H	12,020	4,399	64,186	電気通信サービス
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	455	1,781	25,989	資本財
CHINA EVERBRIGHT LTD	780	1,159	16,910	各種金融
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	1,080	1,074	15,678	運輸
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1,700	770	11,235	運輸
CHINA MOBILE LTD	5,325	46,221	674,364	電気通信サービス
HUANENG POWER INTL INC-H	3,720	1,867	27,245	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	1,090	2,784	40,632	素材
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	3,760	3,312	48,330	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LENOVO GROUP LTD	6,260	3,148	45,940	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	1,422	2,425	35,394	保険
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	320	947	13,819	食品・飲料・タバコ
SINOTRANS LIMITED-H	1,870	604	8,812	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	3,420	1,395	20,358	素材
AVICHA INDUSTRY & TECH-H	1,880	1,079	15,744	資本財
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	3,980	4,680	68,288	保険
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	6,430	13,728	200,292	保険
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,349	2,565	37,424	半導体・半導体製造装置
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	1,700	2,264	33,037	公益事業
CHINA MENGNIU DAIRY CO	2,380	3,422	49,933	食品・飲料・タバコ
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	4,525	18,122	264,409	保険
AIR CHINA LTD-H	1,680	954	13,922	運輸
SINO BIOPHARMACEUTICAL	3,930	2,471	36,066	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	1,600	1,326	19,352	エネルギー
TENCENT HOLDINGS LTD	4,927	98,934	1,443,449	ソフトウェア・サービス
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	7,599	4,323	63,084	銀行
ZTE CORP-H	631	772	11,274	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	4,780	1,271	18,550	素材
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	72,925	41,713	608,598	銀行
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	876	862	12,589	不動産
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	490	2,398	34,994	耐久消費財・アパレル
CHINA POWER INTERNATIONAL	2,890	812	11,848	公益事業
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,400	1,956	28,538	自動車・自動車部品
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	2,540	904	13,192	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	2,920	4,747	69,272	エネルギー
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	1,510	1,359	19,827	素材
JIANGXI COPPER CO LTD-H	1,050	1,360	19,854	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1,720	889	12,974	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
BANK OF CHINA LTD-H	68,760	24,134	352,126	銀行
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	2,190	2,080	30,354	商業・専門サービス
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	1,100	1,148	16,755	不動産
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	635	5,080	74,117	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS BANK-H	3,365	6,522	95,160	銀行
IND & COMM BK OF CHINA-H	63,893	30,157	440,001	銀行
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	640	2,448	35,716	公益事業
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	2,080	1,104	16,114	電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	3,800	3,572	52,115	資本財
CHINA COAL ENERGY CO-H	1,860	768	11,207	エネルギー
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	3,320	7,536	109,956	不動産
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	7,680	3,916	57,146	銀行
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	850	2,137	31,189	耐久消費財・アパレル
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	3,520	2,432	35,487	資本財
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	11,280	1,082	15,799	小売
HENGAN INTL GROUP CO LTD	630	3,931	57,356	家庭用品・パーソナル用品
CHINA RESOURCES LAND LTD	2,400	4,588	66,950	不動産
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1,740	1,910	27,874	資本財
GUANGDONG INVESTMENT LTD	2,440	2,388	34,852	公益事業
FOSUN INTERNATIONAL LTD	2,215	2,626	38,327	資本財
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	2,480	838	12,229	不動産
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	2,480	1,125	16,427	素材
WEICHAI POWER CO LTD-H	824	1,145	16,710	資本財
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	5,490	2,558	37,326	耐久消費財・アパレル
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	5,050	2,631	38,387	食品・飲料・タバコ
KUNLUN ENERGY CO LTD	2,860	1,770	25,829	エネルギー
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	4,732	2,101	30,655	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	780	1,922	28,052	公益事業
SOHO CHINA LTD	1,930	770	11,235	不動産
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	3,860	2,076	30,298	公益事業
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	4,600	4,232	61,744	自動車・自動車部品
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	2,830	1,831	26,714	公益事業
CHINA MINSHENG BANKING-H	5,111	4,313	62,936	銀行
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2,286	6,332	92,387	保険
CRRC CORP LTD - H	3,655	2,741	40,000	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	480	2,052	29,938	資本財
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	21,300	6,901	100,688	銀行
CHINA EVERGRANDE GROUP	3,640	1,961	28,624	不動産
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	1,846	1,972	28,776	自動車・自動車部品
SINOPHARM GROUP CO-H	1,040	3,712	54,169	ヘルスケア機器・サービス
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,540	1,746	25,479	公益事業
LONGFOR PROPERTIES	1,295	1,445	21,085	不動産
SUNNY OPTICAL TECH	600	2,574	37,554	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	11,950	1,183	17,260	半導体・半導体製造装置
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2,745	2,217	32,360	自動車・自動車部品
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	3,220	737	10,758	不動産
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	1,560	1,996	29,133	資本財
CITIC SECURITIES CO LTD-H	1,865	2,931	42,774	各種金融
SUN ART RETAIL GROUP LTD	2,130	1,642	23,960	食品・生活必需品小売り
FAR EAST HORIZON LTD	1,740	1,216	17,745	各種金融
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	2,270	1,085	15,831	銀行
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	1,110	1,529	22,316	耐久消費財・アパレル

銘柄	株数	期末		業種等		
		評価額				
		外貨建金額	邦貨換算金額			
(香港)	百株	千香港ドル	千円			
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	600	1,224	17,858	ヘルスケア機器・サービス		
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	2,644	3,627	52,926	各種金融		
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1,680	1,162	16,961	不動産		
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	688	2,600	37,943	保険		
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	6,160	1,866	27,231	保険		
HUANENG RENEWABLES CORP-H	3,660	911	13,296	公益事業		
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	2,605	1,867	27,250	各種金融		
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS	1,100	1,408	20,542	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	375	980	14,307	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	590	962	14,048	資本財		
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	1,105	685	9,995	資本財		
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	3,720	1,075	15,685	食品・飲料・タバコ		
HANERGY THIN FILM POWER GROU	9,600	3,753	54,765	半導体・半導体製造装置		
KINGSOFT CORP LTD	670	1,100	16,051	ソフトウェア・サービス		
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	7,740	2,097	30,603	各種金融		
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	1,190	1,758	25,661	資本財		
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	3,000	1,083	15,800	ヘルスケア機器・サービス		
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	2,880	1,068	15,589	銀行		
CHINA VANKE CO LTD-H	1,163	2,275	33,204	不動産		
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	10,000	1,340	19,550	メディア		
CGN POWER CO LTD-H	9,090	1,999	29,177	公益事業		
GF SECURITIES CO LTD-H	1,154	1,915	27,949	各種金融		
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	1,290	1,909	27,855	各種金融		
3SBIO INC	940	724	10,573	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	400	946	13,802	自動車・自動車部品		
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	4,200	1,251	18,260	各種金融		
FULLSHARE HOLDINGS LTD	5,800	1,931	28,179	不動産		
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	18,000	367	5,357	耐久消費財・アパレル		
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	690	756	11,033	自動車・自動車部品		
小計	株数	金額	659,563	580,532	8,469,972	
銘柄数 < 比率 >	136	-	-	-	< 19.6% >	
(マレーシア)			千マレーシアリンギット			
GENTING MALAYSIA BHD	2,689	1,336	34,145	消費者サービス		
GENTING BHD	2,039	1,712	43,761	消費者サービス		
TELEKOM MALAYSIA BHD	1,028	638	16,310	電気通信サービス		
TENAGA NASIONAL BHD	2,987	4,122	105,318	公益事業		
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	390	948	24,233	食品・飲料・タバコ		
MALAYAN BANKING BHD	3,093	2,576	65,828	銀行		
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	552	164	4,209	消費者サービス		
IOI CORP BHD	1,994	897	22,926	食品・飲料・タバコ		
AMMB HOLDINGS BHD	1,657	748	19,136	銀行		
YTL CORP BHD	3,872	596	15,237	公益事業		
GAMUDA BHD	1,540	759	19,398	資本財		
MISC BHD	985	732	18,724	運輸		
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	3,600	1,785	45,622	銀行		
PETRONAS GAS BHD	626	1,270	32,468	公益事業		
SIME DARBY BERHAD	2,063	1,794	45,857	資本財		
PUBLIC BANK BERHAD	2,114	4,270	109,105	銀行		
UMW HOLDINGS BHD	490	265	6,785	自動車・自動車部品		
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	126	585	14,963	食品・飲料・タバコ		
PPB GROUP BERHAD	435	713	18,227	食品・飲料・タバコ		
IJM CORP BHD	2,529	857	21,904	資本財		



銘柄	株数	期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(マレーシア)	百株	千マレーシアリンギット	千円	
DIGI.COM BHD	3,178	1,560	39,868	電気通信サービス
MAXIS BHD	1,647	996	25,458	電気通信サービス
AXIATA GROUP BERHAD	2,331	1,144	29,242	電気通信サービス
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	1,910	275	7,027	公益事業
HONG LEONG BANK BERHAD	580	765	19,561	銀行
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,169	1,553	39,679	素材
LAFARGE MALAYSIA BHD	335	233	5,965	素材
PETRONAS DAGANGAN BHD	184	430	11,000	エネルギー
AIASIA BHD	1,000	249	6,361	運輸
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	920	354	9,049	銀行
SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	3,578	604	15,449	エネルギー
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	692	429	10,979	運輸
FELDA GLOBAL VENTURES	1,201	208	5,339	食品・飲料・タバコ
IHH HEALTHCARE BHD	2,612	1,653	42,244	ヘルスケア機器・サービス
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	208	311	7,960	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	497	439	11,225	資本財
GENTING PLANTATIONS BHD	195	216	5,540	食品・飲料・タバコ
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	1,377	384	9,815	メディア
WESTPORTS HOLDINGS BHD	932	396	10,120	運輸
DIALOG GROUP BHD	2,921	447	11,421	資本財
IOI PROPERTIES GROUP BHD	1,328	281	7,193	不動産
HARTALEGA HOLDINGS BHD	601	283	7,232	ヘルスケア機器・サービス
RHB BANK BHD	709	351	8,973	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	65,916 43	40,347 -	1,030,876 <2.4%>
(タイ)		千タイバーツ		
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	1,196	6,727	21,595	不動産
KASIKORNBANK PCL-NVDR	1,512	28,879	92,702	銀行
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	11,100	2,597	8,337	銀行
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	830	1,543	4,955	メディア
CP ALL PCL-NVDR	4,248	24,957	80,111	食品・生活必需品小売り
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	222	3,896	12,506	銀行
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	897	14,486	46,501	電気通信サービス
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,500	22,800	73,188	銀行
SIAM CEMENT PCL-NVDR	352	17,907	57,481	素材
PTT PCL-NVDR	862	35,342	113,447	エネルギー
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	1,226	11,585	37,190	エネルギー
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	370	14,726	47,270	運輸
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,370	2,740	8,795	エネルギー
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	2,388	7,044	22,613	食品・飲料・タバコ
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	1,200	4,290	13,770	素材
IRPC PCL - NVDR	8,980	4,804	15,421	エネルギー
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,871	12,820	41,153	素材
THAI OIL PCL-NVDR	692	4,999	16,049	エネルギー
KRUNG THAI BANK - NVDR	3,180	6,073	19,496	銀行
GLOW ENERGY PCL - NVDR	435	3,447	11,066	公益事業
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	3,406	7,629	24,490	ヘルスケア機器・サービス
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	1,652	3,419	10,977	食品・飲料・タバコ
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	3,320	3,452	11,083	小売
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	127	2,590	8,316	公益事業
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	5,320	4,522	14,515	運輸
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	316	5,751	18,461	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	株数	期末		業種等	
		評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(タイ)	百株	千タイバーツ	千円		
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	430	3,676	11,801	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TRUE CORP PCL-NVDR	9,108	6,011	19,297	電気通信サービス	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,956	6,846	21,975	消費者サービス	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	1,000	5,075	16,290	資本財	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	970	2,788	8,951	エネルギー	
KCE ELECTRONICS - NVDR	200	2,370	7,607	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ROBINSON DEPT STORE-NVDR	459	2,708	8,693	小売	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	5,740	4,132	13,266	運輸	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	78,436	292,643	939,385	
(フィリピン)		千フィリピンペソ		<2.2%>	
PLDT INC	88	13,156	29,865	電気通信サービス	
SM PRIME HOLDINGS INC	7,065	21,230	48,192	不動産	
AYALA LAND INC	6,252	22,444	50,949	不動産	
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	660	6,039	13,708	銀行	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	450	3,501	7,947	運輸	
MEGAWORLD CORP	9,990	3,606	8,186	不動産	
JOLLIBEE FOODS CORP	379	7,861	17,844	消費者サービス	
ENERGY DEVELOPMENT CORP	8,000	4,536	10,296	公益事業	
SM INVESTMENTS CORP	217	15,446	35,063	資本財	
AYALA CORPORATION	209	17,077	38,766	各種金融	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	1,771	13,265	30,112	資本財	
ABOITIZ POWER CORP	1,321	5,799	13,164	公益事業	
METROPOLITAN BANK & TRUST	541	4,211	9,560	銀行	
BDO UNIBANK INC	1,491	16,708	37,927	銀行	
DMCI HOLDINGS INC	3,536	4,547	10,322	資本財	
UNIVERSAL ROBINA CORP	763	12,801	29,058	食品・飲料・タバコ	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	1,820	2,340	5,312	資本財	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	2,438	18,630	42,292	資本財	
GLOBE TELECOM INC	30	5,307	12,046	電気通信サービス	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	12,027	8,178	18,564	各種金融	
SECURITY BANK CORP	109	2,332	5,294	銀行	
ROBINSONS LAND CO	1,450	3,770	8,557	不動産	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	69	9,306	21,125	各種金融	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	60,680	222,098	504,162	
(インドネシア)		千インドネシアルピア		<1.2%>	
KALBE FARMA TBK PT	18,161	2,715,069	23,078	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	43,639	17,019,210	144,663	電気通信サービス	
INDOFOOD SUKSES MARBUR TBK P	3,782	3,025,600	25,717	食品・飲料・タバコ	
HM SAMPOERNA TBK PT	8,200	3,271,800	27,810	食品・飲料・タバコ	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	10,646	15,915,770	135,284	銀行	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	1,272	1,917,540	16,299	素材	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	17,467	14,148,270	120,260	自動車・自動車部品	
GUDANG GARAM TBK PT	415	2,614,500	22,223	食品・飲料・タバコ	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	9,599	11,230,830	95,462	銀行	
BANK DANAMON INDONESIA TBK	2,810	1,183,010	10,055	銀行	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	2,554	2,304,985	19,592	素材	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	9,575	2,537,375	21,567	公益事業	
UNITED TRACTORS TBK PT	1,423	3,219,537	27,366	エネルギー	
LIPPO KARAWACI TBK PT	17,464	1,266,140	10,762	不動産	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	8,065	8,871,500	75,407	銀行	

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(インドネシア)	百株	千インドネシアルピア	千円	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,323	5,543,370	47,118	家庭用品・パーソナル用品
ADARO ENERGY TBK PT	12,400	2,157,600	18,339	エネルギー
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	1,700	710,600	6,040	運輸
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	6,606	3,633,300	30,883	銀行
AKR CORPORINDO TBK PT	1,543	1,056,955	8,984	資本財
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	6,403	2,042,557	17,361	食品・飲料・タバコ
XL AXIATA TBK PT	3,200	905,600	7,697	電気通信サービス
PAKUWON JATI TBK PT	19,000	1,092,500	9,286	不動産
SUMMARECON AGUNG TBK PT	8,500	1,168,750	9,934	不動産
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	4,402	761,546	6,473	メディア
BUMI SERPONG DAMAI PT	7,017	1,305,162	11,093	不動産
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	1,980	1,702,800	14,473	食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	2,126	1,068,315	9,080	電気通信サービス
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	5,000	1,375,000	11,687	メディア
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	4,365	1,113,075	9,461	資本財
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	2,057	3,116,355	26,489	小売
小 計	株 数	金 額		
	銘柄 数 < 比 率 >			
	242,694	119,994,622	1,019,954	
	31	-	< 2.4% >	
(韓国)		千韓国ウォン		
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	85	16,752,880	1,643,457	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KOREA ELECTRIC POWER CORP	222	968,792	95,038	公益事業
SHINSEGAE INC	6	107,952	10,590	小売
CJ CORP	12	229,862	22,549	資本財
SK TELECOM	17	387,192	37,983	電気通信サービス
HYUNDAI MOTOR CO	137	1,956,760	191,958	自動車・自動車部品
POSCO	61	1,650,475	161,911	素材
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	49	277,906	27,262	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KT CORP	22	65,025	6,378	電気通信サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	49	157,644	15,464	各種金融
HYUNDAI MOBIS CO LTD	58	1,560,850	153,119	自動車・自動車部品
CHEIL WORLDWIDE INC	61	103,796	10,182	メディア
KB FINANCIAL GROUP INC	343	1,591,794	156,154	銀行
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	28	769,062	75,445	保険
SAMSUNG SDI CO LTD	47	534,262	52,411	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	368	1,687,272	165,521	銀行
LG ELECTRONICS INC	92	499,236	48,975	耐久消費財・アパレル
AMOREPACIFIC GROUP	24	332,520	32,620	家庭用品・パーソナル用品
HYUNDAI DEPT STORE CO	13	130,424	12,794	小売
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	24	202,787	19,893	資本財
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	46	119,370	11,710	資本財
KT&G CORP	101	1,021,110	100,170	食品・飲料・タバコ
NCSOFT CORP	15	473,525	46,452	ソフトウェア・サービス
LG DISPLAY CO LTD	201	611,344	59,972	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	36	489,375	48,007	資本財
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	180	191,118	18,748	資本財
AMOREPACIFIC CORP	27	900,250	88,314	家庭用品・パーソナル用品
HANA FINANCIAL GROUP	256	870,817	85,427	銀行
HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	50	217,500	21,336	資本財
LG CHEM LTD	39	1,051,365	103,138	素材
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	41	111,930	10,980	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	8	705,318	69,191	家庭用品・パーソナル用品
SK INNOVATION CO LTD	55	903,960	88,678	エネルギー

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	千韓国ウォン	千円	
KAKAO CORP	27	211,558	20,753	ソフトウェア・サービス
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	35	155,575	15,261	各種金融
HANMI SCIENCE CO LTD	9	56,292	5,522	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COWAY CO LTD	46	402,480	39,483	耐久消費財・アパレル
S-1 CORPORATION	16	143,715	14,098	商業・専門サービス
KIA MOTORS CORP	227	854,625	83,838	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	503	2,605,163	255,566	半導体・半導体製造装置
LG CORP	82	485,570	47,634	資本財
HYUNDAI STEEL CO	70	410,368	40,257	素材
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	16	2,616,628	256,691	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OCI CO LTD	14	129,920	12,745	素材
HANWHA TECHWIN CO LTD	25	104,250	10,226	資本財
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	220	277,956	27,267	銀行
KANGWON LAND INC	103	340,373	33,390	消費者サービス
NAVER CORP	24	1,845,697	181,062	ソフトウェア・サービス
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	359	302,600	29,685	各種金融
CELLTRION INC	65	656,400	64,392	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELLTRION INC-NEW	3	34,200	3,355	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KOREA GAS CORPORATION	25	116,790	11,457	公益事業
LG UPLUS CORP	188	215,603	21,150	電気通信サービス
LOTTE SHOPPING CO	9	216,160	21,205	小売
YUHAN CORP	7	134,545	13,198	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONGBU INSURANCE CO LTD	43	256,014	25,114	保険
S-OIL CORP	38	321,984	31,586	エネルギー
KCC CORP	5	175,872	17,253	資本財
POSCO DAEWOO CORP	41	113,346	11,119	資本財
SAMSUNG CARD CO	30	121,128	11,882	各種金融
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	27	266,664	26,159	自動車・自動車部品
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	63	248,136	24,342	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	30	80,160	7,863	運輸
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	61	688,800	67,571	保険
LOTTE CHEMICAL CORP	13	527,850	51,782	素材
GS HOLDINGS	45	231,300	22,690	エネルギー
NH INVESTMENT & SECURITIES C	121	132,922	13,039	各種金融
HANWHA CHEMICAL CORP	92	248,436	24,371	素材
HYOSUNG CORPORATION	18	250,675	24,591	素材
HANWHA CORPORATION	40	141,152	13,847	資本財
CJ CHEILJEDANG CORP	6	242,208	23,760	食品・飲料・タバコ
BNK FINANCIAL GROUP INC	230	198,116	19,435	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	16	261,625	25,665	運輸
DGB FINANCIAL GROUP INC	143	143,000	14,028	銀行
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	18	175,935	17,259	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	7	377,715	37,053	素材
E-MART INC	17	324,900	31,872	食品・生活必需品小売り
HYUNDAI WIA CORP	13	99,246	9,736	自動車・自動車部品
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	15	126,015	12,362	素材
SK HOLDINGS CO LTD	39	842,415	82,640	資本財
ORION CORP	3	202,120	19,827	食品・飲料・タバコ
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	55	174,654	17,133	保険
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	52	326,304	32,010	資本財
SK NETWORKS CO LTD	97	62,953	6,175	資本財
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	5	99,195	9,731	食品・飲料・タバコ

銘柄	期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	千韓国ウォン	千円	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	193	124,097	12,173	保険
LG INNOTEK CO LTD	12	124,866	12,249	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG CHEM LTD-PREFERENCE	6	109,305	10,722	素材
HANKOOK TIRE CO LTD	65	374,670	36,755	自動車・自動車部品
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	117	59,787	5,865	資本財
HANON SYSTEMS	171	164,160	16,104	自動車・自動車部品
CJ E&M CORP	17	149,468	14,662	メディア
DONGSUH COMPANIES INC	29	77,480	7,600	食品・生活必需品小売り
CJ KOREA EXPRESS CORP	5	95,990	9,416	運輸
HOTEL SHILLA CO LTD	29	137,459	13,484	小売
HANSSEM CO LTD	9	190,272	18,665	耐久消費財・アパレル
WOORI BANK	267	345,552	33,898	銀行
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	20	111,996	10,986	商業・専門サービス
SAMSUNG SDS CO LTD	30	380,765	37,353	ソフトウェア・サービス
SAMSUNG C&T CORP	66	834,875	81,901	資本財
AMOREPACIFIC CORP-PREF	8	149,850	14,700	家庭用品・パーソナル用品
HANMI PHARM CO LTD	4	131,217	12,872	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BGF RETAIL CO LTD	17	157,122	15,413	食品・生活必需品小売り
GS RETAIL CO LTD	23	117,000	11,477	食品・生活必需品小売り
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	0.54	76,734	7,527	食品・飲料・タバコ
OTTOGI CORPORATION	1	66,885	6,561	食品・飲料・タバコ
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	1	99,560	9,766	家庭用品・パーソナル用品
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	13	201,500	19,767	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	7,380	61,691,398	6,051,926
	銘柄数<比率>	108	-	<14.0%>
(台湾)		千ニュー台湾ドル		
COMPAL ELECTRONICS	3,747	7,064	25,502	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA ELECTRONICS INC	1,682	29,270	105,665	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	2,831	7,361	26,575	資本財
FORMOSA PLASTICS CORP	3,576	32,255	116,442	素材
HON HAI PRECISION INDUSTRY	13,188	110,386	398,496	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNITED MICROELECTRONICS CORP	10,550	11,974	43,227	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	4,115	30,249	109,200	素材
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	490	11,441	41,303	食品・生活必需品小売り
SILICONWARE PRECISION INDS	1,880	8,967	32,373	半導体・半導体製造装置
TAIWAN CEMENT	2,867	10,149	36,639	素材
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	21,150	392,332	1,416,320	半導体・半導体製造装置
ASUSTEK COMPUTER INC	617	16,864	60,880	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	417	4,545	16,409	半導体・半導体製造装置
QUANTA COMPUTER INC	2,331	14,828	53,530	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	7,063	33,552	121,124	保険
ACER INC	2,591	3,732	13,472	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	8,964	8,265	29,836	銀行
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	5,475	18,782	67,804	半導体・半導体製造装置
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	2,784	26,952	97,296	素材
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	5,750	29,099	105,048	各種金融
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	481	3,550	12,818	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDIATEK INC	1,292	27,591	99,606	半導体・半導体製造装置
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	7,556	8,916	32,189	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	15,189	27,037	97,605	銀行
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,384	14,462	52,210	電気通信サービス
CHINA STEEL CORP	10,209	25,829	93,246	素材

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	千ニュー台湾ドル	千円	
NOVATECH MICROELECTRONICS COR	510	5,635	20,344	半導体・半導体製造装置
ADVANTECH CO LTD	278	7,390	26,680	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	810	7,123	25,716	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	560	14,280	51,550	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AU OPTRONICS CORP	7,630	9,842	35,532	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HTC CORP	587	4,658	16,816	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
POWERTECH TECHNOLOGY INC	603	5,155	18,611	半導体・半導体製造装置
INVENTEC CORP	2,204	5,180	18,700	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	3,290	33,558	121,144	電気通信サービス
PHISON ELECTRONICS CORP	140	3,458	12,483	半導体・半導体製造装置
WPG HOLDINGS LTD	1,364	5,101	18,415	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	550	4,158	15,010	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GIANT MANUFACTURING	260	5,330	19,241	耐久消費財・アパレル
RUENTEX INDUSTRIES LTD	470	2,716	9,806	耐久消費財・アパレル
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	1,271	4,146	14,968	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	8,273	10,258	37,034	各種金融
INNOLUX CORP	7,881	10,403	37,555	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	6,373	10,484	37,850	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	7,012	5,631	20,328	保険
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	1,370	10,192	36,796	電気通信サービス
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,674	10,413	37,591	自動車・自動車部品
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	1,011	10,772	38,888	エネルギー
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	9,407	21,919	79,129	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	8,197	14,304	51,638	銀行
LARGAN PRECISTON CO LTD	88	39,249	141,688	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	4,176	22,342	80,657	食品・飲料・タバコ
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	4,355	7,557	27,283	銀行
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	12,012	9,586	34,605	銀行
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,861	8,786	31,720	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASIA CEMENT CORP	2,072	5,544	20,016	素材
YULON MOTOR COMPANY	790	2,176	7,856	自動車・自動車部品
POU CHEN	1,965	7,771	28,055	耐久消費財・アパレル
WISTRON CORP	2,090	5,571	20,112	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	650	2,645	9,550	素材
PEGATRON CORP	1,699	12,765	46,082	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA AIRLINES LTD	2,260	2,124	7,669	運輸
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	6,802	12,551	45,309	銀行
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	2,986	9,138	32,990	保険
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	193	3,118	11,256	資本財
EVA AIRWAYS CORP	1,837	2,774	10,016	運輸
EVERGREEN MARINE CORP LTD	1,533	1,977	7,139	運輸
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	6,673	9,542	34,449	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	220	7,876	28,432	小売
TECO ELECTRIC & MACHINERY	1,700	4,794	17,306	資本財
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	760	2,891	10,439	不動産
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	750	3,498	12,630	不動産
TAIWAN BUSINESS BANK	3,694	3,018	10,897	銀行
STANDARD FOODS CORP	339	2,607	9,411	食品・飲料・タバコ
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	340	2,223	8,027	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FORMOSA TAFFETA CO.	680	2,046	7,388	耐久消費財・アパレル
CHAILEASE HOLDING CO LTD	944	5,289	19,096	各種金融
TRANSCEND INFORMATION INC	180	1,539	5,555	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	株数	期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	千ニュー台湾ドル	千円	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	177	2,876	10,383	耐久消費財・アパレル
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	790	4,447	16,056	半導体・半導体製造装置
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	164	5,330	19,241	耐久消費財・アパレル
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	1,990	2,019	7,291	電気通信サービス
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	299	4,069	14,692	耐久消費財・アパレル
CASETEK HOLDINGS LTD	120	1,149	4,150	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OBI PHARMA INC	100	2,900	10,469	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NANYA TECHNOLOGY CORP	640	3,072	11,089	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	130	3,802	13,727	耐久消費財・アパレル
TAIMED BIOLOGICS INC	150	2,407	8,691	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	278,139	1,370,665	4,948,102	
銘柄数 < 比率 >	88	-	< 11.5% >	
(インド)		千インドルピー		
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	1,303	174,276	291,041	銀行
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	409	96,378	160,952	ソフトウェア・サービス
ITC LTD	2,934	77,901	130,095	食品・飲料・タバコ
HINDUSTAN UNILEVER LTD	559	48,649	81,244	家庭用品・パーソナル用品
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	532	7,024	11,731	資本財
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	1,128	23,128	38,623	エネルギー
HINDALCO INDUSTRIES LTD	958	18,273	30,517	素材
COAL INDIA LTD	612	19,422	32,435	エネルギー
GAIL INDIA LTD	280	13,358	22,308	公益事業
AMBUJA CEMENTS LTD	526	12,055	20,132	素材
HERO MOTOCORP LTD	44	14,321	23,916	自動車・自動車部品
BAJAJ AUTO LTD	74	21,172	35,358	自動車・自動車部品
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	846	53,837	89,908	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASIAN PAINTS LTD	245	24,041	40,149	素材
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	131	12,529	20,923	各種金融
VEDANTA LTD	888	22,979	38,375	素材
TATA POWER CO LTD	930	7,449	12,440	公益事業
BHARTI AIRTEL LTD	861	26,810	44,773	電気通信サービス
CIPLA LTD	305	17,885	29,869	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NTPC LTD	1,449	24,844	41,489	公益事業
INFOSYS LTD	1,589	148,825	248,538	ソフトウェア・サービス
ULTRATECH CEMENT LTD	72	26,719	44,621	素材
ACC LTD	38	5,317	8,880	素材
DR. REDDY'S LABORATORIES	101	30,262	50,538	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ICICI BANK LTD	952	24,765	41,358	銀行
LUPIN LTD	190	28,865	48,205	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	91	52,977	88,472	自動車・自動車部品
RELIANCE INDUSTRIES LTD	1,126	114,629	191,431	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	1,373	35,593	59,440	銀行
TATA STEEL LTD	276	12,958	21,640	素材
LIC HOUSING FINANCE LTD	271	14,848	24,796	銀行
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	426	30,297	50,596	エネルギー
IDEA CELLULAR LTD	1,075	8,187	13,673	電気通信サービス
CAIRN INDIA LTD	404	11,355	18,964	エネルギー
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	107	16,611	27,742	家庭用品・パーソナル用品
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	507	25,298	42,248	メディア
POWER FINANCE CORPORATION	560	7,767	12,971	各種金融
DABUR INDIA LTD	470	13,230	22,094	家庭用品・パーソナル用品
JSW STEEL LTD	750	14,711	24,567	素材

銘柄	株数	期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)	百株	千インドルピー	千円	
LARSEN & TOUBRO LTD	273	39,592	66,119	資本財
UNITED SPIRITS LTD	57	12,572	20,996	食品・飲料・タバコ
TITAN CO LTD	273	10,174	16,991	耐久消費財・アパレル
SIEMENS LTD	61	7,257	12,120	資本財
WIPRO LTD	540	25,584	42,726	ソフトウェア・サービス
AXIS BANK LTD	1,445	66,987	111,869	銀行
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	321	39,938	66,697	自動車・自動車部品
TATA MOTORS LTD	1,366	75,029	125,298	自動車・自動車部品
HCL TECHNOLOGIES LTD	487	41,002	68,474	ソフトウェア・サービス
DIVI'S LABORATORIES LTD	71	4,834	8,073	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	732	22,301	37,244	運輸
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	65	7,942	13,263	ヘルスケア機器・サービス
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	71	12,152	20,295	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	257	7,357	12,287	各種金融
YES BANK LTD	268	37,730	63,009	銀行
NESTLE INDIA LTD	20	12,230	20,424	食品・飲料・タバコ
TECH MAHINDRA LTD	207	9,671	16,151	ソフトウェア・サービス
AUROBINDO PHARMA LTD	232	16,392	27,375	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	292	9,696	16,192	自動車・自動車部品
BOSCH LTD	6	15,213	25,407	自動車・自動車部品
SHREE CEMENT LTD	7	11,686	19,517	素材
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	30	3,617	6,040	運輸
MARICO LTD	414	10,592	17,688	家庭用品・パーソナル用品
BHARTI INFRATEL LTD	513	18,062	30,164	電気通信サービス
EICHER MOTORS LTD	11	26,439	44,154	資本財
BHARAT FORGE LTD	93	8,907	14,875	自動車・自動車部品
UPL LTD	311	23,035	38,468	素材
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	118	10,315	17,226	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAVELLS INDIA LTD	221	9,367	15,643	資本財
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	259	19,566	32,675	銀行
ASHOK LEYLAND LTD	1,012	8,764	14,637	資本財
CADILA HEALTHCARE LTD	180	6,462	10,792	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	10,575	17,661	自動車・自動車部品
BAJAJ FINANCE LTD	141	14,097	23,543	各種金融
BAJAJ FINSERV LTD	30	9,509	15,880	保険
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	300	16,333	27,276	エネルギー
IDFC BANK LTD	1,000	6,560	10,955	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	37,411 76	2,027,120 —	3,385,290 <7.8%>
(アラブ首長国連邦)			千アラブディルハム	
EMAAR PROPERTIES PJSC	3,066	2,296	70,884	不動産
ALDAR PROPERTIES PJSC	2,590	670	20,701	不動産
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	1,640	1,180	36,439	銀行
NATIONAL BANK OF ABU DHABI	584	610	18,833	銀行
FIRST GULF BANK	761	1,012	31,234	銀行
DUBAI ISLAMIC BANK	1,037	637	19,658	銀行
EMAAR MALLS PJSC	1,600	417	12,887	不動産
EMIRATES TELECOM GROUP CO	1,518	2,756	85,058	電気通信サービス
DXB ENTERTAINMENTS PJSC	2,600	296	9,146	消費者サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15,397 9	9,878 —	304,843 <0.7%>



銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(カタール)	百株	千カタールリアル	千円	
MASRAF AL RAYAN	307	1,326	41,299	銀行
OOREDOO QSC	66	705	21,970	電気通信サービス
QATAR NATIONAL BANK	183	3,152	98,166	銀行
INDUSTRIES QATAR	126	1,511	47,073	資本財
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	23	547	17,046	公益事業
QATAR ISLAMIC BANK	49	544	16,940	銀行
BARWA REAL ESTATE CO	83	303	9,446	不動産
COMMERCIAL BANK QSC	134	463	14,448	銀行
DOHA BANK QSC	103	402	12,521	銀行
QATAR INSURANCE CO	122	1,069	33,312	保険
EZDAN HOLDING GROUP	666	1,054	32,850	不動産
QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	234	575	17,920	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	2,099	11,656	362,996
	銘柄 数 < 比 率 >	12	-	< 0.8% >
(南アフリカ)		千南アフリカランド		
SAPPI LIMITED	480	4,142	35,417	素材
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	49	1,764	15,082	素材
NEDBANK GROUP LTD	173	4,159	35,559	銀行
SASOL LTD	478	20,196	172,683	素材
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	353	5,751	49,176	素材
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	568	3,042	26,009	素材
GOLD FIELDS LTD	693	3,209	27,445	素材
MONDI LTD	104	3,129	26,752	素材
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	854	6,427	54,950	小売
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	392	3,242	27,724	小売
TELKOM SA SOC LTD	244	1,841	15,746	電気通信サービス
TIGER BRANDS LTD	139	5,755	49,206	食品・飲料・タバコ
SANLAM LTD	1,243	8,210	70,202	保険
SHOPRITE HOLDINGS LTD	367	6,376	54,520	食品・生活必需品小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	1,116	16,736	143,101	銀行
RMB HOLDINGS LTD	625	4,251	36,349	各種金融
REMGRO LTD	461	10,614	90,758	各種金融
NETCARE LTD	819	2,606	22,284	ヘルスケア機器・サービス
NASPERS LTD-N SHS	380	81,149	693,823	メディア
MTN GROUP LTD	1,437	18,314	156,589	電気通信サービス
MASSMART HOLDINGS LTD	98	1,304	11,152	食品・生活必需品小売り
IMPERIAL HOLDINGS LTD	134	2,363	20,209	小売
INVESTEC LTD	214	2,090	17,873	各種金融
FIRSTRAND LTD	2,899	15,284	130,678	各種金融
THE FOSCHINI GROUP LTD	185	3,047	26,058	小売
EXXARO RESOURCES LTD	121	1,319	11,281	エネルギー
BIDVEST GROUP LTD	279	4,725	40,405	資本財
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	364	6,011	51,398	銀行
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	308	9,661	82,607	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DISCOVERY LTD	314	3,679	31,461	保険
VODACOM GROUP LTD	322	4,869	41,636	電気通信サービス
PICK N PAY STORES LTD	321	2,171	18,568	食品・生活必需品小売り
MMI HOLDINGS LTD	940	2,406	20,574	保険
SPAR GROUP LIMITED/THE	163	3,225	27,576	食品・生活必需品小売り
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	613	2,410	20,613	保険
LIBERTY HOLDINGS LTD	95	1,159	9,917	保険
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	878	3,025	25,868	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	株数	当期末		業種等	
		評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(南アフリカ)	百株	千南アフリカランド	千円		
MR PRICE GROUP LTD	213	3,463	29,608	小売	
SIBANYE GOLD LTD	673	1,896	16,217	素材	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	204	1,401	11,979	各種金融	
BRAIT SE	291	2,325	19,880	各種金融	
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	295	792	6,772	消費者サービス	
PSG GROUP LTD	84	1,870	15,995	各種金融	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	36	2,635	22,534	銀行	
PIONEER FOODS GROUP LTD	117	1,988	17,004	食品・飲料・タバコ	
FORTRESS INCOME FUND LTD	671	2,348	20,079	不動産	
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	798	1,408	12,042	不動産	
NEW EUROPE PROPERTY INVEST	206	3,216	27,502	不動産	
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	2,567	17,370	148,521	耐久消費財・アパレル	
BID CORP LTD	288	6,771	57,895	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額	25,682	327,169	2,797,301	
	銘柄数<比率>	50	—	<6.5%>	
合計	株数・金額	6,734,351	—	40,947,746	
	銘柄数<比率>	831	—	<94.8%>	

(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、親投資信託の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	口数	当期末		比率	
		評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(メキシコ)	千口	千メキシコペソ	千円	%	
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	224	6,905	37,081	0.1	
小計	口数・金額	224	6,905	37,081	
	銘柄数<比率>	1	—	<0.1%>	
(トルコ)		千トルコリラ			
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	167	505	14,934	0.0	
小計	口数・金額	167	505	14,934	
	銘柄数<比率>	1	—	<0.0%>	
(南アフリカ)		千南アフリカランド			
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	180	4,775	40,830	0.1	
REDEFINE PROPERTIES LTD	384	4,312	36,868	0.1	
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	22	2,687	22,978	0.1	
RESILIENT REIT LTD	25	3,009	25,729	0.1	
小計	口数・金額	613	14,784	126,407	
	銘柄数<比率>	4	—	<0.3%>	
合計	口数・金額	1,004	—	178,423	
	銘柄数<比率>	6	—	<0.4%>	

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

## 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	MINI MS	百万円 1,998	百万円 —

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

## <日本債券インデックスマザーファンド>

下記は、日本債券インデックスマザーファンド全体(325,711,127千円)の内容です。

### 国内公社債

#### (A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	319,586,000 ( 100,000)	349,528,665 ( 100,252)	81.7 ( 0.0)	— ( —)	51.7 ( —)	20.3 ( —)	9.8 ( 0.0)
地方債証券	23,613,370 ( 23,613,370)	25,080,161 ( 25,080,161)	5.9 ( 5.9)	— ( —)	3.6 ( 3.6)	1.7 ( 1.7)	0.5 ( 0.5)
特殊債券 (除く金融債)	26,494,197 ( 26,494,197)	28,415,579 ( 28,415,579)	6.6 ( 6.6)	— ( —)	4.5 ( 4.5)	1.4 ( 1.4)	0.7 ( 0.7)
金融債券	2,690,000 ( 2,690,000)	2,709,848 ( 2,709,848)	0.6 ( 0.6)	— ( —)	0.0 ( 0.0)	0.4 ( 0.4)	0.2 ( 0.2)
普通社債券	19,373,000 ( 19,373,000)	20,009,260 ( 20,009,260)	4.7 ( 4.7)	0.2 ( 0.2)	1.3 ( 1.3)	3.0 ( 3.0)	0.4 ( 0.4)
合 計	391,756,567 ( 72,270,567)	425,743,514 ( 76,315,101)	99.5 ( 17.8)	0.2 ( 0.2)	61.1 ( 9.4)	26.8 ( 6.5)	11.6 ( 1.9)

(注) ( )内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、親投資信託の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
	%	千円	千円
国債証券			
第361回利付国債 (2年)	0.1	600,000	602,448
第362回利付国債 (2年)	0.1	700,000	702,947
第363回利付国債 (2年)	0.1	1,630,000	1,637,188
第364回利付国債 (2年)	0.1	2,000,000	2,009,160
第365回利付国債 (2年)	0.1	400,000	401,872
第366回利付国債 (2年)	0.1	680,000	683,270
第368回利付国債 (2年)	0.1	1,400,000	1,407,294
第369回利付国債 (2年)	0.1	1,000,000	1,005,390
第370回利付国債 (2年)	0.1	1,600,000	1,609,056
第109回利付国債 (5年)	0.1	2,350,000	2,360,011
第110回利付国債 (5年)	0.3	1,080,000	1,087,063
第111回利付国債 (5年)	0.4	1,410,000	1,420,828
第112回利付国債 (5年)	0.4	1,400,000	1,412,558
第113回利付国債 (5年)	0.3	2,440,000	2,458,495
第114回利付国債 (5年)	0.3	2,090,000	2,107,681
第115回利付国債 (5年)	0.2	3,670,000	3,694,735
第116回利付国債 (5年)	0.2	2,080,000	2,095,953
第117回利付国債 (5年)	0.2	3,320,000	3,347,356
第118回利付国債 (5年)	0.2	2,260,000	2,280,294
第119回利付国債 (5年)	0.1	850,000	855,593
第120回利付国債 (5年)	0.2	2,390,000	2,413,111
第121回利付国債 (5年)	0.1	1,580,000	1,591,091
第122回利付国債 (5年)	0.1	3,970,000	3,999,338
第123回利付国債 (5年)	0.1	2,360,000	2,378,195
第124回利付国債 (5年)	0.1	4,230,000	4,263,797
第125回利付国債 (5年)	0.1	3,560,000	3,589,263
第126回利付国債 (5年)	0.1	2,960,000	2,985,426
第127回利付国債 (5年)	0.1	2,950,000	2,976,343
第128回利付国債 (5年)	0.1	4,700,000	4,743,475
第129回利付国債 (5年)	0.1	2,000,000	2,018,620
第130回利付国債 (5年)	0.1	1,800,000	1,817,226
第1回利付国債 (40年)	2.4	405,000	577,311
第2回利付国債 (40年)	2.2	600,000	826,344
第3回利付国債 (40年)	2.2	593,000	821,192
第4回利付国債 (40年)	2.2	878,000	1,222,325
第5回利付国債 (40年)	2.0	835,000	1,115,919
第6回利付国債 (40年)	1.9	770,000	1,010,255
第7回利付国債 (40年)	1.7	950,000	1,191,366
第8回利付国債 (40年)	1.4	940,000	1,090,456
第9回利付国債 (40年)	0.4	870,000	724,188
第290回利付国債 (10年)	1.4	1,640,000	1,671,242
第291回利付国債 (10年)	1.3	940,000	956,844
第292回利付国債 (10年)	1.7	794,000	811,841
第293回利付国債 (10年)	1.8	1,081,000	1,111,743
第294回利付国債 (10年)	1.7	1,570,000	1,612,468

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第295回利付国債 (10年)	1.5	1,240,000	1,270,094	2018/6/20
第296回利付国債 (10年)	1.5	2,020,000	2,076,782	2018/9/20
第297回利付国債 (10年)	1.4	1,636,000	1,685,587	2018/12/20
第298回利付国債 (10年)	1.3	2,640,000	2,715,028	2018/12/20
第299回利付国債 (10年)	1.3	2,760,000	2,847,795	2019/3/20
第300回利付国債 (10年)	1.5	957,000	991,547	2019/3/20
第301回利付国債 (10年)	1.5	2,072,000	2,154,900	2019/6/20
第302回利付国債 (10年)	1.4	2,250,000	2,334,622	2019/6/20
第303回利付国債 (10年)	1.4	2,325,000	2,421,417	2019/9/20
第304回利付国債 (10年)	1.3	1,170,000	1,215,419	2019/9/20
第305回利付国債 (10年)	1.3	308,000	320,997	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)	1.4	2,488,000	2,609,016	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)	1.3	1,610,000	1,683,238	2020/3/20
第308回利付国債 (10年)	1.3	1,374,000	1,440,817	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	2,300,000	2,396,209	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	2,886,000	3,004,095	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	1,600,000	1,653,776	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	4,030,000	4,236,094	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	2,969,000	3,142,181	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	1,590,000	1,669,547	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	1,853,000	1,959,121	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	780,000	821,230	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	1,557,000	1,643,288	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	1,730,000	1,817,832	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	1,519,000	1,607,345	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	1,980,000	2,085,435	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	2,515,000	2,655,010	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	1,170,000	1,229,108	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	1,675,000	1,763,306	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	2,650,000	2,775,398	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	2,935,000	3,078,668	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	1,360,000	1,420,642	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	2,440,000	2,563,220	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	2,150,000	2,235,978	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	3,410,000	3,594,515	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	2,930,000	3,092,761	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	1,360,000	1,417,460	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	3,410,000	3,555,811	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	2,620,000	2,732,136	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	3,950,000	4,120,482	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	3,450,000	3,574,924	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	1,530,000	1,586,579	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	2,190,000	2,236,515	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	3,910,000	4,025,736	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	4,100,000	4,223,328	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	3,280,000	3,380,171	2025/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第341回利付国債（10年）	0.3	2,770,000	2,831,272	2025/12/20
第342回利付国債（10年）	0.1	3,770,000	3,783,685	2026/3/20
第343回利付国債（10年）	0.1	3,710,000	3,722,094	2026/6/20
第344回利付国債（10年）	0.1	3,690,000	3,698,819	2026/9/20
第345回利付国債（10年）	0.1	1,100,000	1,101,617	2026/12/20
第1回利付国債（30年）	2.8	76,000	100,419	2029/9/20
第2回利付国債（30年）	2.4	98,000	125,275	2030/2/20
第3回利付国債（30年）	2.3	117,000	148,449	2030/5/20
第4回利付国債（30年）	2.9	127,000	172,140	2030/11/20
第5回利付国債（30年）	2.2	108,000	136,513	2031/5/20
第6回利付国債（30年）	2.4	169,000	219,309	2031/11/20
第7回利付国債（30年）	2.3	164,000	210,905	2032/5/20
第8回利付国債（30年）	1.8	142,000	172,459	2032/11/22
第9回利付国債（30年）	1.4	116,000	133,727	2032/12/20
第10回利付国債（30年）	1.1	185,000	204,626	2033/3/20
第11回利付国債（30年）	1.7	137,000	164,261	2033/6/20
第12回利付国債（30年）	2.1	220,000	277,910	2033/9/20
第13回利付国債（30年）	2.0	205,000	255,872	2033/12/20
第14回利付国債（30年）	2.4	493,000	647,471	2034/3/20
第15回利付国債（30年）	2.5	346,000	460,743	2034/6/20
第16回利付国債（30年）	2.5	302,000	402,837	2034/9/20
第17回利付国債（30年）	2.4	327,000	431,133	2034/12/20
第18回利付国債（30年）	2.3	427,000	556,176	2035/3/20
第19回利付国債（30年）	2.3	303,000	394,833	2035/6/20
第20回利付国債（30年）	2.5	495,000	662,656	2035/9/20
第21回利付国債（30年）	2.3	379,000	494,174	2035/12/20
第22回利付国債（30年）	2.5	570,000	763,748	2036/3/20
第23回利付国債（30年）	2.5	554,000	743,246	2036/6/20
第24回利付国債（30年）	2.5	411,000	551,578	2036/9/20
第25回利付国債（30年）	2.3	742,000	968,695	2036/12/20
第26回利付国債（30年）	2.4	884,000	1,171,945	2037/3/20
第27回利付国債（30年）	2.5	860,000	1,160,071	2037/9/20
第28回利付国債（30年）	2.5	1,031,000	1,395,788	2038/3/20
第29回利付国債（30年）	2.4	1,030,000	1,379,788	2038/9/20
第30回利付国債（30年）	2.3	1,246,000	1,650,202	2039/3/20
第31回利付国債（30年）	2.2	788,000	1,031,066	2039/9/20
第32回利付国債（30年）	2.3	1,319,000	1,758,424	2040/3/20
第33回利付国債（30年）	2.0	1,424,000	1,814,176	2040/9/20
第34回利付国債（30年）	2.2	1,376,000	1,819,030	2041/3/20
第35回利付国債（30年）	2.0	1,599,000	2,048,734	2041/9/20
第36回利付国債（30年）	2.0	1,419,000	1,823,017	2042/3/20
第37回利付国債（30年）	1.9	1,547,000	1,956,908	2042/9/20
第38回利付国債（30年）	1.8	865,000	1,076,397	2043/3/20
第39回利付国債（30年）	1.9	1,160,000	1,471,668	2043/6/20
第40回利付国債（30年）	1.8	1,000,000	1,245,570	2043/9/20
第41回利付国債（30年）	1.7	760,000	929,867	2043/12/20

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42回利付国債 (30年)	1.7	800,000	979,072	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	1,010,000	1,236,421	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	1,080,000	1,322,449	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	870,000	1,022,841	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	1,260,000	1,481,256	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	1,050,000	1,261,827	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	1,250,000	1,439,837	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	1,290,000	1,487,318	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	1,080,000	1,077,451	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)	0.3	1,270,000	1,101,864	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)	0.5	1,170,000	1,074,317	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)	0.6	300,000	282,798	2046/12/20
第38回利付国債 (20年)	2.7	400,000	413,536	2018/3/20
第40回利付国債 (20年)	2.3	601,000	625,743	2018/9/20
第42回利付国債 (20年)	2.6	869,000	920,757	2019/3/20
第43回利付国債 (20年)	2.9	74,000	79,999	2019/9/20
第44回利付国債 (20年)	2.5	480,000	519,806	2020/3/20
第47回利付国債 (20年)	2.2	114,000	123,671	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	209,000	230,267	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)	2.1	515,000	562,210	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	200,000	218,466	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	214,000	235,840	2021/9/21
第54回利付国債 (20年)	2.2	480,000	533,827	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	241,000	266,856	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	449,000	499,516	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	147,000	163,439	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	589,000	650,438	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	289,000	307,860	2023/3/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	442,000	494,067	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	441,000	497,611	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	318,000	360,233	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	500,000	562,955	2023/12/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	846,000	979,126	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	422,000	496,255	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	160,000	185,793	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	534,000	618,473	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	620,000	716,112	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	318,000	369,795	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	575,000	671,306	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	200,000	230,254	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	210,000	243,469	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)	1.9	410,000	473,738	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	50,000	58,191	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	315,000	369,236	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	350,000	408,702	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	662,000	778,723	2025/9/20



銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第83回利付国債（20年）	2.1	413,000	487,914	2025/12/20
第84回利付国債（20年）	2.0	670,000	785,601	2025/12/20
第85回利付国債（20年）	2.1	490,000	581,071	2026/3/20
第86回利付国債（20年）	2.3	515,000	620,075	2026/3/20
第87回利付国債（20年）	2.2	450,000	537,727	2026/3/20
第88回利付国債（20年）	2.3	804,000	971,642	2026/6/20
第89回利付国債（20年）	2.2	410,000	491,663	2026/6/20
第90回利付国債（20年）	2.2	1,100,000	1,324,312	2026/9/20
第91回利付国債（20年）	2.3	468,000	567,913	2026/9/20
第92回利付国債（20年）	2.1	1,432,000	1,715,765	2026/12/20
第93回利付国債（20年）	2.0	510,000	607,517	2027/3/20
第94回利付国債（20年）	2.1	715,000	858,893	2027/3/20
第95回利付国債（20年）	2.3	917,000	1,123,792	2027/6/20
第96回利付国債（20年）	2.1	520,000	626,584	2027/6/20
第97回利付国債（20年）	2.2	743,000	905,330	2027/9/20
第98回利付国債（20年）	2.1	70,000	84,558	2027/9/20
第99回利付国債（20年）	2.1	1,345,000	1,629,454	2027/12/20
第100回利付国債（20年）	2.2	910,000	1,115,514	2028/3/20
第101回利付国債（20年）	2.4	573,000	714,972	2028/3/20
第102回利付国債（20年）	2.4	530,000	663,872	2028/6/20
第103回利付国債（20年）	2.3	550,000	682,759	2028/6/20
第104回利付国債（20年）	2.1	520,000	633,869	2028/6/20
第105回利付国債（20年）	2.1	1,110,000	1,356,031	2028/9/20
第106回利付国債（20年）	2.2	431,000	531,457	2028/9/20
第107回利付国債（20年）	2.1	687,000	841,492	2028/12/20
第108回利付国債（20年）	1.9	580,000	696,916	2028/12/20
第109回利付国債（20年）	1.9	700,000	842,968	2029/3/20
第110回利付国債（20年）	2.1	976,000	1,198,518	2029/3/20
第111回利付国債（20年）	2.2	711,000	883,943	2029/6/20
第112回利付国債（20年）	2.1	740,000	911,036	2029/6/20
第113回利付国債（20年）	2.1	1,432,000	1,767,374	2029/9/20
第114回利付国債（20年）	2.1	880,000	1,088,692	2029/12/20
第115回利付国債（20年）	2.2	654,000	817,303	2029/12/20
第116回利付国債（20年）	2.2	606,000	758,681	2030/3/20
第117回利付国債（20年）	2.1	1,160,000	1,437,460	2030/3/20
第118回利付国債（20年）	2.0	666,000	818,021	2030/6/20
第119回利付国債（20年）	1.8	660,000	793,531	2030/6/20
第120回利付国債（20年）	1.6	530,000	623,481	2030/6/20
第121回利付国債（20年）	1.9	819,000	997,222	2030/9/20
第122回利付国債（20年）	1.8	760,000	915,359	2030/9/20
第123回利付国債（20年）	2.1	1,048,000	1,306,457	2030/12/20
第124回利付国債（20年）	2.0	700,000	863,254	2030/12/20
第125回利付国債（20年）	2.2	734,000	926,865	2031/3/20
第126回利付国債（20年）	2.0	810,000	1,000,098	2031/3/20
第127回利付国債（20年）	1.9	590,000	720,437	2031/3/20
第128回利付国債（20年）	1.9	1,064,000	1,300,569	2031/6/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第129回利付国債 (20年)	1.8	100,000	120,853	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	1,112,000	1,344,952	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	580,000	693,372	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	477,000	570,539	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	1,190,000	1,440,268	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	85,000	102,935	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	600,000	717,966	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	550,000	650,215	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	472,000	565,031	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	450,000	525,555	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	480,000	567,600	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	1,297,000	1,553,144	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	1,550,000	1,857,938	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	840,000	1,019,474	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	880,000	1,041,620	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	830,000	969,108	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	2,160,000	2,589,818	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	1,780,000	2,134,326	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	2,030,000	2,400,150	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	1,520,000	1,772,472	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	2,060,000	2,401,033	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	1,990,000	2,285,853	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	2,100,000	2,339,421	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	1,930,000	2,147,472	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	1,900,000	2,145,100	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	2,220,000	2,461,846	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	1,810,000	1,941,044	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	1,530,000	1,472,410	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	2,230,000	2,057,219	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	1,690,000	1,645,840	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	100,000	99,032	2036/12/20
第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013)	0.67	100,000	100,252	2018/11/15
小 計		319,586,000	349,528,665	
<b>地方債証券</b>				
第1回東京都公募公債 (20年)	1.54	20,000	21,872	2023/6/20
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	10,000	13,163	2038/9/17
第8回東京都公募公債 (30年)	2.23	80,000	100,884	2038/9/17
第16回東京都公募公債 (20年)	2.01	100,000	119,300	2028/12/20
第20回東京都公募公債 (20年)	2.09	80,000	96,796	2029/9/20
第21回東京都公募公債 (20年)	2.19	80,000	97,979	2029/12/20
第22回東京都公募公債 (20年)	1.92	120,000	143,367	2030/6/20
第24回東京都公募公債 (20年)	1.98	70,000	84,535	2031/6/20
第28回東京都公募公債 (20年)	1.59	100,000	115,326	2033/3/18
第666回東京都公募公債	1.46	150,000	154,612	2019/3/20
第669回東京都公募公債	1.63	50,000	51,929	2019/6/20
第678回東京都公募公債	1.38	100,000	103,925	2019/12/20

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
地方債証券	%	千円	千円
第680回東京都公募公債	1.39	100,000	104,303
第681回東京都公募公債	1.4	100,000	104,334
第686回東京都公募公債	1.08	100,000	103,579
第692回東京都公募公債	1.35	100,000	105,155
第693回東京都公募公債	1.38	100,000	105,609
第705回東京都公募公債	1.06	170,000	178,938
第709回東京都公募公債	0.78	100,000	103,956
第716回東京都公募公債	0.77	100,000	104,172
第718回東京都公募公債	0.6	100,000	103,270
第721回東京都公募公債	0.84	100,000	104,900
第722回東京都公募公債	0.8	100,000	104,645
第728回東京都公募公債	0.65	100,000	103,841
第729回東京都公募公債	0.69	100,000	104,076
第750回東京都公募公債	0.444	300,000	307,341
第751回東京都公募公債	0.37	300,000	305,391
平成19年度第16回北海道公募公債	1.58	100,000	101,799
平成20年度第6回北海道公募公債	1.72	53,990	55,444
平成21年度第2回北海道公募公債	1.66	100,000	103,828
平成21年度第12回北海道公募公債	1.42	100,000	104,061
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	100,000	103,508
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	100,000	104,102
平成26年度第13回北海道公募公債	0.461	200,000	204,626
第1回神奈川県公募公債（20年）	2.55	100,000	117,702
第2回神奈川県公募公債（20年）	2.23	80,000	92,629
第2回神奈川県公募公債（30年）	2.87	80,000	109,184
第3回神奈川県公募公債（20年）	2.11	100,000	116,172
第27回神奈川県公募公債（20年）	1.398	100,000	111,739
第152回神奈川県公募公債	1.53	110,000	111,901
第162回神奈川県公募公債	1.62	140,450	145,834
第163回神奈川県公募公債	1.4	114,000	117,769
第165回神奈川県公募公債	1.4	54,660	56,650
第170回神奈川県公募公債	1.38	240,000	250,260
第171回神奈川県公募公債	1.41	100,000	104,369
第176回神奈川県公募公債	1.16	128,900	134,224
第191回神奈川県公募公債	0.83	100,000	104,169
第5回大阪府公募公債（20年）	2.16	100,000	121,969
第11回大阪府公募公債（20年）	1.693	200,000	233,258
第92回大阪府公募公債（5年）	0.14	100,000	100,139
第313回大阪府公募公債	1.66	100,000	102,048
第314回大阪府公募公債	1.8	30,000	30,713
第316回大阪府公募公債	1.85	100,000	102,753
第325回大阪府公募公債	1.66	153,000	158,622
第326回大阪府公募公債	1.66	10,000	10,382
第331回大阪府公募公債	1.41	100,000	103,815
第332回大阪府公募公債	1.58	71,600	74,755
第337回大阪府公募公債	1.44	110,000	115,068

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
第343回大阪府公募公債	0.98	70,000	72,506	2020/10/28
第348回大阪府公募公債	1.32	10,000	10,539	2021/3/30
第351回大阪府公募公債	1.19	100,000	105,238	2021/7/28
第358回大阪府公募公債	0.97	56,000	58,615	2022/2/28
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000	58,696	2022/3/29
第389回大阪府公募公債	0.53	100,000	102,797	2024/10/30
第404回大阪府公募公債	0.4	113,000	115,079	2026/1/28
平成21年度第5回京都府公募公債	1.35	20,000	20,770	2019/12/24
平成22年度第5回京都府公募公債	1.26	110,000	115,295	2020/12/21
平成23年度第9回京都府公募公債	1.01	140,000	146,918	2022/3/16
平成24年度第3回京都府公募公債 (20年)	1.63	200,000	231,406	2027/8/13
平成24年度第10回京都府公募公債	0.67	100,000	103,638	2023/3/22
平成25年度第1回京都府公募公債	0.58	100,000	103,137	2023/4/28
平成25年度第2回京都府公募公債 (15年)	1.05	100,000	107,851	2028/4/28
第1回兵庫県公募公債 (18年)	1.26	200,000	219,484	2032/8/6
第2回兵庫県公募公債 (30年)	2.36	40,000	51,723	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債 (15年)	1.31	100,000	110,257	2027/12/24
第8回兵庫県公募公債 (15年)	1.09	100,000	108,149	2029/4/16
第15回兵庫県公募公債 (20年)	1.64	300,000	346,146	2032/7/23
第16回兵庫県公募公債 (20年)	1.7	100,000	116,288	2032/11/19
平成20年度第5回兵庫県公募公債	1.93	50,000	51,334	2018/6/20
平成21年度第1回兵庫県公募公債	1.62	120,000	124,286	2019/4/23
平成21年度第3回兵庫県公募公債	1.62	190,000	197,035	2019/5/22
平成21年度第25回兵庫県公募公債	1.54	100,000	104,264	2019/11/20
平成20年度第1回静岡県公募公債	1.73	14,500	14,830	2018/5/28
平成20年度第2回静岡県公募公債	1.91	100,000	102,671	2018/6/26
平成20年度第4回静岡県公募公債	1.65	100,000	102,578	2018/8/28
平成20年度第5回静岡県公募公債	1.59	11,000	11,302	2018/10/30
平成21年度第4回静岡県公募公債	1.56	52,920	55,004	2019/8/20
平成22年度第1回静岡県公募公債	1.455	101,700	106,405	2020/4/20
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	104,015	2020/7/22
平成22年度第8回静岡県公募公債	1.059	100,000	103,695	2020/8/25
平成25年度第1回静岡県公募公債	0.581	100,000	103,131	2023/4/19
平成25年度第5回静岡県公募公債	0.926	100,000	105,441	2023/7/25
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	130,000	135,288	2023/10/24
平成25年度第11回静岡県公募公債 (5年)	0.204	100,000	100,386	2019/3/26
平成26年度第5回静岡県公募公債	0.61	100,000	103,449	2024/7/25
平成27年度第3回静岡県公募公債	0.544	121,000	124,763	2025/5/21
平成23年度第7回愛知県公募公債	1.11	100,000	104,881	2021/7/29
平成23年度第9回愛知県公募公債	1.019	100,000	104,640	2021/9/30
平成23年度第14回愛知県公募公債	1.006	100,000	104,744	2021/11/30
平成23年度第17回愛知県公募公債	0.996	100,000	104,861	2022/1/31
平成24年度第13回愛知県公募公債	0.772	100,000	104,085	2022/11/30
平成26年度第9回愛知県公募公債	0.576	100,000	103,195	2024/8/26
平成20年度第4回広島県公募公債	1.73	60,000	61,873	2018/11/26
平成22年度第8回広島県公募公債	1.33	26,650	28,095	2021/3/25

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23年度第1回広島県公募公債	1.19	100,000	105,042	2021/5/27
平成27年度第4回広島県公募公債	0.476	100,000	102,618	2025/11/25
平成21年度第1回埼玉県公募公債	1.53	200,000	206,740	2019/4/23
平成21年度第8回埼玉県公募公債	1.3	100,000	103,711	2019/12/25
平成23年度第1回埼玉県公募公債	1.37	100,000	105,711	2021/4/27
平成23年度第4回埼玉県公募公債	1.2	100,000	105,279	2021/7/27
平成24年度第6回埼玉県公募公債	0.801	100,000	104,215	2022/10/26
平成26年度第6回埼玉県公募公債	0.554	150,000	154,594	2024/9/26
平成26年度第8回埼玉県公募公債	0.335	100,000	101,383	2025/1/28
平成19年度第1回福岡県公募公債	2.62	70,000	92,970	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債	2.28	80,000	101,716	2038/9/17
平成21年度第11回福岡県公募公債	1.44	100,000	104,371	2020/2/25
平成22年度第3回福岡県公募公債	1.11	100,000	103,875	2020/8/24
平成22年度第5回福岡県公募公債	0.94	20,000	20,686	2020/10/28
平成25年度第11回福岡県公募公債	0.694	300,000	312,132	2024/2/26
第9回千葉県公募公債（20年）	1.84	80,000	94,714	2030/10/11
平成20年度第2回千葉県公募公債	1.8	90,000	92,124	2018/5/25
平成20年度第3回千葉県公募公債	1.78	80,000	82,099	2018/7/25
平成20年度第5回千葉県公募公債	1.6	80,000	82,094	2018/9/25
平成22年度第7回千葉県公募公債	0.92	120,000	124,011	2020/10/23
平成22年度第11回千葉県公募公債	1.26	80,000	83,945	2021/1/25
平成23年度第9回千葉県公募公債	1.0	20,000	20,982	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債	1.05	20,000	21,049	2022/4/25
平成24年度第6回千葉県公募公債	0.81	100,000	104,296	2022/11/25
平成25年度第1回千葉県公募公債	0.58	82,500	85,084	2023/4/25
平成26年度第9回千葉県公募公債	0.465	188,000	192,619	2025/3/25
平成21年度第1回新潟県公募公債	1.42	23,000	23,804	2019/7/29
平成24年度第1回大分県公募公債	0.8	100,260	104,489	2022/10/31
第62回共同発行市場公募地方債	1.74	100,000	102,280	2018/5/25
第63回共同発行市場公募地方債	1.88	200,000	205,246	2018/6/25
第64回共同発行市場公募地方債	1.78	100,000	102,624	2018/7/25
第65回共同発行市場公募地方債	1.62	90,000	92,262	2018/8/24
第74回共同発行市場公募地方債	1.57	100,000	103,595	2019/5/24
第75回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	103,903	2019/6/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	10,000	10,389	2019/8/23
第78回共同発行市場公募地方債	1.39	30,000	31,089	2019/9/25
第79回共同発行市場公募地方債	1.34	200,000	207,216	2019/10/25
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	109,500	113,628	2019/12/25
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	30,000	31,201	2020/9/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	105,119	2021/2/25
第100回共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	105,311	2021/7/23
第101回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	104,685	2021/8/25
第103回共同発行市場公募地方債	1.0	100,000	104,618	2021/10/25
第107回共同発行市場公募地方債	1.01	200,000	209,836	2022/2/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	170,000	178,918	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	104,441	2022/5/25

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
第113回共同発行市場公募地方債	0.77	100,000	103,948	2022/8/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	104,255	2022/9/22
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	103,820	2022/12/22
第120回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	103,703	2023/3/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	230,000	240,352	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	200,000	207,596	2024/3/25
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	200,000	207,618	2024/6/25
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	103,456	2024/7/25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	200,000	206,310	2024/8/23
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	300,000	308,127	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	202,920	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	100,000	102,497	2025/3/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	101,960	2025/4/25
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	206,372	2025/5/23
第148回共同発行市場公募地方債	0.553	300,000	309,672	2025/7/25
第150回共同発行市場公募地方債	0.51	300,000	308,709	2025/9/25
第152回共同発行市場公募地方債	0.496	500,000	513,960	2025/11/25
第153回共同発行市場公募地方債	0.469	100,000	102,578	2025/12/25
平成24年度第2回熊本県公募公債	0.8	50,000	52,104	2022/10/26
平成22年度第1回新潟市公募公債	1.21	54,980	57,525	2020/12/24
平成23年度第1回浜松市公募公債	1.045	38,200	40,079	2021/11/25
平成25年度第1回浜松市公募公債	0.761	61,000	63,749	2024/1/24
第1回大阪市公募公債（15年）	1.753	200,000	229,212	2026/7/17
第5回大阪市公募公債（20年）	2.47	100,000	124,154	2028/9/21
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	125,000	130,462	2019/11/25
平成23年度第10回大阪市公募公債	0.956	10,000	10,465	2022/1/27
平成26年度第5回大阪市公募公債	0.593	100,000	103,360	2024/9/27
第1回名古屋市公募公債（12年）	1.033	100,000	107,195	2025/6/20
第2回名古屋市公募公債（20年）	2.56	100,000	117,775	2024/6/20
第10回名古屋市公募公債（20年）	2.26	80,000	98,256	2029/8/17
第477回名古屋市公募公債	1.034	100,000	104,935	2021/12/20
第484回名古屋市公募公債	0.801	100,000	104,732	2023/9/20
第5回京都市公募公債（20年）	2.36	50,000	60,193	2026/12/18
平成23年度第2回京都市公募公債	1.049	100,000	104,683	2021/8/26
平成24年度第4回京都市公募公債	0.801	100,000	104,205	2022/10/21
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	2.54	120,000	146,182	2026/6/19
平成22年度第9回神戸市公募公債（20年）	2.09	80,000	97,527	2031/1/24
第7回横浜市公募公債（20年）	2.06	200,000	233,150	2025/12/19
第17回横浜市公募公債（20年）	2.07	80,000	95,880	2028/12/20
平成20年度第3回横浜市公募公債	1.56	200,000	204,954	2018/9/7
平成20年度第4回横浜市公募公債	1.71	100,000	103,040	2018/11/16
第20回横浜市公募公債（20年）	2.1	80,000	96,817	2029/10/19
平成24年度第4回横浜市公募公債	0.81	100,000	104,437	2023/2/20
平成24年度第3回横浜市公募公債	0.729	100,000	103,873	2022/12/22
第25回横浜市公募公債（20年）	1.72	100,000	117,092	2032/7/16
第27回横浜市公募公債（20年）	1.599	60,000	69,159	2033/5/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
平成21年度第5回札幌市公募公債		1.36	112,000	115,959	2019/9/20
平成22年度第8回札幌市公募公債（30年）		2.277	80,000	102,664	2040/9/20
第3回川崎市公募公債（15年）		1.82	100,000	106,998	2020/12/21
第44回川崎市公募公債（5年）		0.162	130,400	131,005	2020/6/19
第82回川崎市公募公債		1.52	100,000	103,958	2019/9/20
第17回北九州市公募公債（20年）		1.529	100,000	114,085	2034/6/20
平成20年度第3回福岡市公募公債		1.52	100,000	102,095	2018/6/20
平成20年度第5回福岡市公募公債		1.57	91,000	93,447	2018/10/24
平成22年度第9回福岡市公募公債		1.32	106,500	112,230	2021/3/25
平成23年度第6回福岡市公募公債		1.0	100,000	104,626	2021/10/28
平成25年度第3回福岡市公募公債（5年）		0.31	31,500	31,649	2018/9/26
平成25年度第4回福岡市公募公債		0.68	50,000	51,970	2023/10/24
平成26年度第6回福岡市公募公債（20年）		1.371	100,000	111,311	2034/9/20
平成25年度第2回広島市公募公債		0.72	100,000	104,259	2023/12/27
平成24年度第2回千葉市公募公債		0.81	100,000	104,290	2022/11/22
平成26年度第2回千葉市公募公債		0.505	100,000	102,711	2024/11/27
平成22年度第1回三重県公募公債		1.056	87,050	90,497	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債		1.021	98,410	103,150	2021/11/30
平成24年度第4回福井県公募公債		0.46	100,000	102,388	2023/4/26
平成20年度第1回徳島県公募公債		1.73	36,000	37,127	2018/11/28
平成24年度第1回徳島県公募公債		0.68	100,000	103,703	2023/3/24
平成26年度第1回徳島県公募公債		0.495	100,000	102,634	2024/11/28
平成20年度第1回岡山県公募公債		1.56	48,700	50,127	2018/12/25
小	計		23,613,370	25,080,161	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>					
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	101,515	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	101,609	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	102,272	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	34,869	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	211,207	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	229,577	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	51,400	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	118,359	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	163,280	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	144,895	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	206,998	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	242,702	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	217,595	2019/6/28
第85回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	100,000	103,495	2019/7/31
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	81,727	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	121,669	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	121,743	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	143,827	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	218,179	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	129,732	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	52,035	2020/3/19

銘柄	利 率	当 期 末		償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	122,097	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	208,834	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	103,638	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	115,830	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	74,311	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	121,309	2031/1/31
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	91,000	95,306	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	62,946	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	127,543	2021/8/31
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	104,704	2021/10/29
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	200,000	237,662	2031/10/31
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	136,000	142,515	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	117,070	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	109,000	113,981	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	105,064	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	117,953	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	242,058	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	12,572	2022/6/30
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	104,612	2022/11/30
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	103,961	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	112,841	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	157,960	2023/4/28
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.882	100,000	105,524	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	223,000	235,869	2023/7/31
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	237,808	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	196,403	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	335,218	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	104,162	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	103,853	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	112,560	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	103,423	2024/10/31
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	100,000	101,750	2025/1/31
第243回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.391	100,000	102,342	2025/4/30
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	130,000	132,291	2026/1/30
第344回政府保証道路債券	1.6	100,000	105,510	2020/7/15
第13回政府保証東日本高速道路債券	1.6	28,000	28,769	2018/10/19
第20回政府保証中日本高速道路債券	1.4	10,000	10,158	2018/3/16
第23回政府保証中日本高速道路債券	1.5	90,000	92,189	2018/9/14
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	25,000	25,856	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	207,618	2019/8/16
第4回政府保証公営企業債券(15年)	2.0	100,000	110,406	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	205,128	2019/1/22
第5回政府保証公営企業債券(15年)	2.2	100,000	111,938	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	301,260	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	103,083	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	153,135	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	100,699	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	104,046	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	208,570	2020/5/22
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	100,000	103,782	2020/7/17
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	103,594	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	104,421	2020/11/17
第21回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	104,825	2021/2/15
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	30,000	31,595	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	105,212	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	21,981	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	52,659	2021/12/14
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	100,000	104,739	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	104,360	2022/8/15
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	17,000	17,673	2023/3/17
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	37,321	2023/5/16
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	150,000	157,969	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	167,187	2023/12/18
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.601	100,000	103,832	2024/7/16
第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.466	200,000	205,806	2024/12/13
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.379	400,000	409,280	2025/12/12
第84回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	138,000	136,578	2026/5/22
第883回政府保証公営企業債券	1.4	100,000	101,595	2018/3/19
第884回政府保証公営企業債券	1.4	114,000	115,944	2018/4/17
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	108,816	2021/4/16
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	1.3	123,000	127,190	2019/9/17
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	104,818	2023/2/24
第37回政府保証日本政策金融公庫債券	0.425	100,000	102,695	2025/9/16
第194回政府保証中小企業債券	1.5	120,000	122,940	2018/9/18
第201回政府保証預金保険機構債券	0.1	200,000	200,364	2019/2/13
第5回政府保証日本政策投資銀行	1.4	50,000	51,541	2019/4/15
第7回政府保証日本政策投資銀行	1.4	100,000	104,265	2020/2/17
第17回政府保証日本政策投資銀行	0.257	200,000	200,880	2018/11/9
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	20,898	2023/12/18
第46回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.69	50,000	50,959	2018/3/20
第7回道路債券(財投機関債)	2.7	100,000	114,206	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	24,055	2026/3/19
第9回道路債券(財投機関債)	2.9	100,000	134,067	2032/5/20
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	43,067	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	140,710	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	180,294	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	72,801	2027/7/20
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	121,148	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	101,826	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	368,856	2028/6/20
第42回道路債券(財投機関債)	2.22	130,000	151,374	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	103,054	2018/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円	
第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	186,024	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	60,898	2030/5/10
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	59,643	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	116,639	2032/6/18
第100回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.784	100,000	104,254	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	104,237	2022/12/20
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	104,557	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	121,761	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	103,949	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	61,256	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	82,772	2019/7/26
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	20,000	21,162	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	109,248	2029/1/26
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	113,231	2023/12/20
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	58,173	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	121,582	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	98,476	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	104,177	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	94,830	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	118,879	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	52,446	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	104,981	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	232,480	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	101,416	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	105,873	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	348,393	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	76,843	2023/3/17
第27回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.034	100,000	104,521	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	58,905	2033/1/28
第42回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.801	100,000	104,311	2022/11/28
第46回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.678	100,000	103,665	2023/3/28
F89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.602	300,000	339,858	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	101,219	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	114,837	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	114,293	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	165,514	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	108,325	2029/2/28
第7回阪神高速道路債券(財投機関債)	2.18	100,000	116,121	2025/3/21
第3回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.43	200,000	207,468	2019/9/20
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167	80,000	97,655	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911	80,000	95,256	2030/10/29
第21回都市再生債券(財投機関債)	1.72	100,000	102,803	2018/9/20
第68回都市再生債券(財投機関債)	0.854	100,000	104,472	2022/9/20
第100回都市再生債券(財投機関債)	0.569	100,000	103,000	2024/11/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	22,097	23,426	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	20,401	21,745	2037/11/10

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2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.19	23,302	24,820	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	20,909	22,458	2037/11/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.29	23,108	24,708	2042/8/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.76	17,854	18,678	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.26	18,695	19,926	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	22,294	23,686	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	21,673	22,972	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.25	18,713	19,941	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	13,854	14,243	2037/10/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.99	23,900	25,338	2042/12/10
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.52	13,345	13,644	2037/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.19	19,507	20,803	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	23,254	24,834	2039/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.43	28,568	29,263	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.15	20,121	21,456	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.16	25,542	27,215	2043/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	15,468	15,969	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	26,986	27,979	2032/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.64	29,483	30,632	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	30,175	31,423	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	90,729	94,065	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	16,766	17,423	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.12	17,990	18,943	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	103,133	2018/9/20
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	19,751	20,526	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	42,988	44,857	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	23,484	24,534	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.88	42,708	45,605	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.87	45,961	48,958	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	47,321	50,292	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.88	22,462	23,617	2040/12/10
第37回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.4	200,000	207,310	2019/9/20
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.61	49,850	52,588	2045/7/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	21,490	22,544	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	53,720	56,112	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.09	23,094	24,513	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	21,255	22,706	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.6	60,639	64,207	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	60,278	64,362	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	53,051	56,522	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.92	48,497	51,891	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	152,640	163,419	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	50,232	53,446	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	49,960	52,948	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.21	20,633	21,974	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	54,719	58,016	2046/8/10

銘柄	当 期 末		
	利 率	額 面 金 額	評 価 額
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	57,210	60,364
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	58,877	62,054
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	64,142	67,476
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	193,410	203,658
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	65,849	69,358
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	67,196	70,416
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	68,148	71,044
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	61,051
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.11	68,975	71,533
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	71,602	74,304
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	67,496	70,624
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.32	72,677	76,447
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	97,192
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	452,606	472,783
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	34,277
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	68,267	70,836
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	145,324	150,754
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	72,331	75,052
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	75,440	78,147
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	151,048	156,224
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	154,156	159,526
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	118,765
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	80,069	82,512
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	242,271	248,504
第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	165,546	169,399
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	83,018	84,641
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	169,812	171,484
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.81	268,212	274,858
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	271,221	279,476
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	181,362	186,585
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	119,265
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	223,658
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.86	471,465	484,185
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	111,856
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	164,559
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	117,917
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	313,218
第6回沖繩振興開発金融公庫債券 (財投機関債)	2.04	50,000	57,700
第7回国際協力機構債券 (財投機関債)	1.991	70,000	84,335
第11回国際協力機構債券 (財投機関債)	1.14	30,000	31,605
第21回東日本高速道路	0.58	100,000	100,788
第22回東日本高速道路	0.401	100,000	100,538
第28回東日本高速道路	0.248	100,000	100,616
第33回中日本高速道路	1.084	50,000	52,355
第18回西日本高速道路	0.893	100,000	104,647
第20回西日本高速道路	0.759	100,000	104,076

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券 (除く金融債)</b>	%	千円	千円	
第29回西日本高速道路	0.31	400,000	401,832	2026/2/12
第132回福岡北九州高速道路債券	0.704	100,000	102,431	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	206,068	2018/9/20
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	100,248	2018/6/20
小 計		26,494,197	28,415,579	
<b>金融債券</b>				
い第773号商工債券	0.2	100,000	100,452	2019/10/25
い第775号商工債券	0.2	400,000	401,928	2019/12/27
い第776号商工債券	0.17	100,000	100,411	2020/1/27
い第761号農林債券	0.3	250,000	251,177	2018/10/26
い第763号農林債券	0.3	340,000	341,751	2018/12/27
い第765号農林債券	0.3	100,000	100,551	2019/2/27
い第769号農林債券	0.3	100,000	100,651	2019/6/27
い第774号農林債券	0.24	100,000	100,566	2019/11/27
い第780号農林債券	0.28	300,000	302,256	2020/5/27
第286回信金中金債	0.35	100,000	100,542	2018/9/27
第288回信金中金債	0.3	200,000	201,006	2018/11/27
第291回信金中金債	0.25	100,000	100,457	2019/2/27
第293回信金中金債	0.25	100,000	100,497	2019/4/26
第304回信金中金債	0.225	200,000	201,230	2020/3/27
第8号商工債券 (10年)	1.66	100,000	103,101	2018/12/20
第11号商工債券 (10年)	0.66	100,000	103,272	2024/9/20
小 計		2,690,000	2,709,848	
<b>普通社債券</b>				
第459回東京電力	2.7	80,000	83,856	2019/1/29
第534回東京電力	2.055	100,000	104,726	2019/10/29
第544回東京電力	1.976	100,000	102,469	2018/6/25
第549回東京電力	1.699	150,000	153,702	2018/10/17
第559回東京電力	1.377	60,000	61,724	2019/10/29
第563回東京電力	1.39	100,000	103,364	2020/5/28
第567回東京電力	1.958	100,000	109,287	2030/7/29
第568回東京電力	1.155	100,000	102,745	2020/9/8
第490回中部電力	1.444	70,000	72,309	2019/7/25
第499回中部電力	1.194	50,000	52,907	2023/6/23
第500回中部電力	0.875	100,000	103,861	2024/5/24
第518回中部電力	0.19	200,000	199,398	2023/1/25
第478回関西電力	1.448	200,000	207,442	2020/1/24
第485回関西電力	1.285	100,000	104,011	2020/12/18
第374回中国電力	0.814	100,000	102,002	2020/2/25
第379回中国電力	0.619	100,000	101,621	2021/1/25
第381回中国電力	0.953	100,000	104,335	2024/4/25
第382回中国電力	0.517	100,000	101,294	2021/5/25
第304回北陸電力	0.989	100,000	104,610	2023/10/25
第456回東北電力	1.176	100,000	103,611	2020/11/25
第473回東北電力	0.597	100,000	101,476	2021/4/23
第245回四国電力	2.0	100,000	107,895	2021/6/25

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券	%	千円	千円	
第371回九州電力	1.43	100,000	106,369	2022/12/22
第400回九州電力	1.777	100,000	105,055	2020/4/24
第422回九州電力	1.164	100,000	103,213	2020/6/25
第429回九州電力	0.909	100,000	103,477	2024/9/25
第430回九州電力	0.54	100,000	101,261	2021/10/25
第310回北海道電力	1.286	50,000	52,057	2020/12/25
第315回北海道電力	0.82	100,000	100,963	2018/4/25
第316回北海道電力	1.164	400,000	412,924	2020/6/25
第319回北海道電力	0.514	200,000	201,850	2019/9/25
第19回沖縄電力	1.452	80,000	83,395	2020/4/24
第344回東京交通債券	1.67	100,000	108,964	2023/2/17
第347回東京交通債券	2.05	100,000	112,829	2024/3/8
第38回関西国際空港	1.112	50,000	52,555	2021/12/20
第10回成田国際空港	1.094	160,000	167,612	2021/9/17
第12回成田国際空港	0.879	100,000	104,436	2022/9/20
第13回成田国際空港	0.802	100,000	104,021	2023/2/8
第17回成田国際空港	0.489	100,000	102,011	2025/2/20
第7回大和ハウス工業	0.06	200,000	198,162	2021/6/18
第3回セブン&アイ・ホールディングス	1.94	100,000	102,676	2018/6/20
第8回セブン&アイ・ホールディングス	0.383	100,000	100,572	2019/6/20
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	300,000	302,925	2022/6/20
第21回三菱ケミカルホールディングス	0.12	100,000	99,647	2021/6/9
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	103,399	2022/12/2
第9回資生堂	0.001	100,000	99,885	2019/12/17
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	104,272	2021/9/17
第5回日本電産	0.001	300,000	299,283	2019/11/25
第12回パナソニック	0.387	300,000	302,067	2020/3/19
第15回パナソニック	0.19	300,000	299,688	2021/9/17
第30回ソニー	0.05	400,000	399,100	2019/9/20
第12回デンソー	0.01	100,000	99,395	2021/9/17
第1回日本生命2012基金	0.87	100,000	100,846	2018/8/3
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,415	2019/8/7
第1回日本生命2015基金	0.406	100,000	100,204	2019/8/5
第53回日産自動車	1.744	100,000	105,135	2020/4/28
第5回凸版印刷	1.397	100,000	104,760	2020/12/16
第3回大日本印刷	1.358	100,000	104,456	2020/12/18
第78回三菱商事	1.155	100,000	104,207	2022/3/9
第8回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	1.62	100,000	106,276	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	114,753	2026/10/30
第9回三菱東京UFJ銀行	2.69	100,000	108,202	2020/2/27
第28回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	1.56	100,000	105,230	2021/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	2.46	100,000	121,943	2031/1/20
第124回三菱東京UFJ銀行	1.51	100,000	106,081	2021/4/16
第5回三菱UFJ信託銀行（特定社債間限定同順位）	0.285	200,000	200,988	2018/11/28
第6回住友信託銀行（劣後特約付）	2.78	100,000	119,586	2026/4/27
第13回住友信託銀行（劣後特約付）	2.341	100,000	115,729	2026/6/15

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22回三井住友銀行 (劣後特約付)	1.43	100,000	104,393	2020/9/28
第23回三井住友銀行 (劣後特約付)	1.61	100,000	105,303	2020/12/17
第25回三井住友銀行 (劣後特約付)	2.21	200,000	230,032	2026/6/1
第5回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.49	100,000	116,465	2026/1/30
第9回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.52	100,000	118,369	2027/4/27
第18回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.14	100,000	114,067	2026/9/11
第11回芙蓉総合リース	0.21	100,000	99,363	2021/5/7
第12回芙蓉総合リース	0.12	300,000	298,821	2020/9/18
第38回日産フィナンシャルサービス	0.001	200,000	199,128	2019/6/20
第40回日産フィナンシャルサービス	0.001	500,000	498,030	2020/3/19
第41回日産フィナンシャルサービス	0.03	200,000	198,686	2021/9/17
第10回東京センチュリーリース	0.298	100,000	100,287	2019/11/21
第15回東京センチュリーリース	0.11	100,000	99,949	2019/4/12
第29回ホンダファイナンス	0.428	200,000	201,082	2021/3/19
第35回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,625	2019/12/20
第37回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,825	2020/3/19
第38回ホンダファイナンス	0.01	300,000	299,187	2021/3/19
第39回ホンダファイナンス	0.001	100,000	100,015	2019/12/20
第47回日立キャピタル	0.874	100,000	102,986	2023/3/20
第52回日立キャピタル	0.508	200,000	201,702	2021/6/18
第56回日立キャピタル	0.197	100,000	100,018	2019/12/20
第62回日立キャピタル	0.001	300,000	299,295	2019/9/20
第9回三井住友ファイナンス&リース	0.518	200,000	201,886	2021/1/29
第14回三井住友ファイナンス&リース	0.321	200,000	200,722	2020/10/30
第34回三菱UFJリース	0.301	100,000	100,187	2020/9/3
第36回三菱UFJリース	0.355	100,000	100,275	2022/1/21
第38回三菱UFJリース	0.16	200,000	199,028	2021/4/21
第39回三菱UFJリース	0.12	100,000	99,302	2021/6/9
第41回三菱UFJリース	0.06	200,000	198,030	2021/7/23
第47回三菱UFJリース	0.001	100,000	99,865	2020/1/24
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	113,584	2025/9/24
第39回野村ホールディングス	0.853	100,000	100,862	2018/2/26
第43回野村ホールディングス	0.454	300,000	302,160	2019/2/25
第48回野村ホールディングス	0.245	100,000	100,240	2018/6/8
第49回野村ホールディングス	0.437	100,000	100,903	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	102,499	2018/6/20
第51回三井不動産	0.001	100,000	100,015	2019/12/6
第98回三菱地所	1.165	100,000	103,175	2020/6/19
第105回三菱地所	1.178	100,000	104,249	2022/3/23
第112回三菱地所	0.577	200,000	202,380	2020/12/25
第116回三菱地所	0.643	100,000	101,392	2024/9/19
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	103,908	2021/9/17
第17回エヌ・ティ・ティ都市開発	0.61	100,000	101,074	2024/9/20
第15回東日本旅客鉄道	2.65	100,000	109,111	2020/8/25
第26回東日本旅客鉄道	1.19	100,000	105,987	2022/12/20
第29回東日本旅客鉄道	2.01	200,000	224,272	2023/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第79回東日本旅客鉄道	1.131	100,000	104,695	2021/9/29
第83回東日本旅客鉄道	1.633	100,000	113,211	2026/12/22
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	122,275	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道	2.28	123,000	136,515	2022/3/25
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	117,883	2030/10/25
第56回東海旅客鉄道	2.083	100,000	121,978	2031/5/26
第74回東海旅客鉄道	1.685	100,000	115,382	2045/3/6
第11回東京地下鉄	1.16	100,000	104,956	2021/12/9
第5回関西高速鉄道	1.238	100,000	103,720	2020/9/10
第60回日本電信電話	1.31	200,000	208,860	2020/12/18
第63回日本電信電話	0.69	100,000	102,657	2023/3/20
第19回KDDI	1.151	100,000	103,163	2020/6/19
第21回KDDI	0.669	100,000	101,736	2024/9/20
第20回エス・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	102,449	2023/9/20
第38回電源開発	0.978	100,000	104,487	2023/12/20
第40回電源開発	0.889	200,000	207,786	2024/6/20
第23回東京ガス	1.01	200,000	210,440	2023/6/9
第25回エス・ティ・ティ・データ	1.47	100,000	103,933	2020/3/19
第2回ファーストリテイリング	0.291	300,000	300,363	2020/12/18
第3回ファーストリテイリング	0.491	100,000	100,835	2022/12/16
第4回ファーストリテイリング	0.749	100,000	102,247	2025/12/18
第5回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.793	100,000	100,854	2018/12/13
第7回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.55	100,000	100,477	2019/7/10
第15回GEキャピタルコーポレーション	2.215	100,000	106,499	2020/11/20
第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.32	100,000	100,037	2017/2/9
第9回ナショナル・オーストラリア銀行	0.457	100,000	100,531	2019/1/17
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	100,217	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	301,398	2019/5/2
第9回ラボバンク・ネダーランド	1.81	100,000	105,584	2021/1/28
第18回ラボバンク・ネダーランド	0.778	100,000	100,420	2017/11/2
第23回ラボバンク・ネダーランド	0.557	100,000	100,414	2018/12/19
第27回ラボバンク・ネダーランド	0.38	100,000	100,001	2020/5/22
小 計		19,373,000	20,009,260	
合 計		391,756,567	425,743,514	



## <外国債券インデックスマザーファンド>

下記は、外国債券インデックスマザーファンド全体(65,998,579千口)の内容です。

### 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	492,200	494,536	55,956,749	43.5	—	17.7	17.6	8.2
カナダ	千カナダドル	千カナダドル						
	29,300	31,751	2,751,626	2.1	—	1.0	0.7	0.5
メキシコ	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
	178,100	179,604	964,478	0.8	—	0.4	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	65,720	76,963	9,371,057	7.3	—	4.0	2.2	1.1
イタリア	87,350	99,609	12,128,458	9.4	—	5.6	2.9	0.9
フランス	87,290	102,128	12,435,155	9.7	—	5.9	2.9	0.9
オランダ	20,700	24,299	2,958,760	2.3	—	1.4	0.5	0.4
スペイン	49,250	57,676	7,022,733	5.5	—	3.3	1.5	0.6
ベルギー	21,300	25,977	3,163,066	2.5	—	1.8	0.5	0.2
オーストリア	13,500	16,051	1,954,486	1.5	—	1.0	0.4	0.1
フィンランド	5,550	6,231	758,703	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	6,950	7,981	971,800	0.8	—	0.4	0.3	0.1
イギリス	千イギリスポンド	千イギリスポンド						
	51,765	64,076	9,162,359	7.1	—	5.1	1.6	0.4
スイス	千スイスフラン	千スイスフラン						
	2,290	2,701	306,326	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	千スウェーデンクローネ						
	40,350	46,279	594,689	0.5	—	0.3	0.2	—
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						
	24,200	25,832	352,350	0.3	—	0.1	0.1	—
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						
	40,050	50,278	823,054	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
	27,600	27,748	776,389	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	千オーストラリアドル						
	29,550	31,676	2,716,868	2.1	—	1.3	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
	5,860	6,049	484,920	0.4	—	0.2	0.1	0.1
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						
	21,950	21,780	556,504	0.4	—	0.2	0.2	0.0
南アフリカ	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
	88,050	81,640	698,025	0.5	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	126,908,564	98.8	—	51.3	33.4	14.1

(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、親投資信託の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	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	
	0.75 T-NOTE 171231	0.75	2,300	2,297	260,011	2017/12/31	
	0.75 T-NOTE 180131	0.75	2,000	1,998	226,079	2018/1/31	
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	3,500	3,494	395,406	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	1,800	1,795	203,184	2018/4/15	
	0.75 T-NOTE 180430	0.75	200	199	22,572	2018/4/30	
	0.75 T-NOTE 180831	0.75	2,700	2,685	303,846	2018/8/31	
	0.75 T-NOTE 180930	0.75	2,800	2,782	314,877	2018/9/30	
	0.75 T-NOTE 181031	0.75	1,000	992	112,341	2018/10/31	
	0.75 T-NOTE 190215	0.75	700	692	78,385	2019/2/15	
	0.75 T-NOTE 190715	0.75	3,000	2,954	334,265	2019/7/15	
	0.75 T-NOTE 190815	0.75	2,800	2,754	311,684	2019/8/15	
	0.875 T-NOTE 180115	0.875	1,400	1,400	158,490	2018/1/15	
	0.875 T-NOTE 180131	0.875	2,000	2,000	226,344	2018/1/31	
	0.875 T-NOTE 180331	0.875	1,800	1,799	203,582	2018/3/31	
	0.875 T-NOTE 180531	0.875	1,600	1,597	180,778	2018/5/31	
	0.875 T-NOTE 180715	0.875	2,200	2,195	248,375	2018/7/15	
	0.875 T-NOTE 181015	0.875	2,500	2,488	281,582	2018/10/15	
	0.875 T-NOTE 190415	0.875	2,000	1,980	224,063	2019/4/15	
	0.875 T-NOTE 190515	0.875	2,000	1,978	223,886	2019/5/15	
	0.875 T-NOTE 190615	0.875	1,800	1,779	201,354	2019/6/15	
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	900	888	100,538	2019/7/31	
	0.875 T-NOTE 190915	0.875	3,400	3,351	379,224	2019/9/15	
	1 T-NOTE 171231	1.0	2,200	2,203	249,318	2017/12/31	
	1 T-NOTE 180215	1.0	1,500	1,502	169,963	2018/2/15	
	1 T-NOTE 180315	1.0	2,100	2,102	237,847	2018/3/15	
	1 T-NOTE 180515	1.0	1,700	1,700	192,392	2018/5/15	
	1 T-NOTE 180531	1.0	2,600	2,600	294,190	2018/5/31	
	1 T-NOTE 180815	1.0	2,700	2,697	305,182	2018/8/15	
	1 T-NOTE 180915	1.0	2,600	2,595	293,626	2018/9/15	
	1 T-NOTE 181130	1.0	300	298	33,829	2018/11/30	
	1 T-NOTE 190315	1.0	1,400	1,391	157,438	2019/3/15	
	1 T-NOTE 190630	1.0	1,100	1,090	123,395	2019/6/30	
	1 T-NOTE 190831	1.0	600	593	67,166	2019/8/31	
	1 T-NOTE 190930	1.0	1,800	1,779	201,362	2019/9/30	
	1 T-NOTE 191015	1.0	1,700	1,679	190,048	2019/10/15	
	1 T-NOTE 191130	1.0	1,800	1,775	200,933	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	1,800	1,796	203,248	2019/1/15	
	1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,600	1,591	180,113	2019/5/31	
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,700	1,681	190,243	2019/12/31	
	1.125 T-NOTE 200331	1.125	1,600	1,577	178,522	2020/3/31	
	1.125 T-NOTE 200430	1.125	1,000	985	111,452	2020/4/30	

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		
		%	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 210228	1.125	2,700	2,623	296,817	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	2,200	2,123	240,275	2021/7/31
		1.125 T-NOTE 210831	1.125	3,000	2,893	327,383	2021/8/31
		1.125 T-NOTE 210930	1.125	2,700	2,599	294,167	2021/9/30
		1.25 T-NOTE 181031	1.25	2,400	2,403	271,963	2018/10/31
		1.25 T-NOTE 181115	1.25	1,900	1,902	215,262	2018/11/15
		1.25 T-NOTE 181130	1.25	2,500	2,502	283,173	2018/11/30
		1.25 T-NOTE 181215	1.25	2,400	2,401	271,761	2018/12/15
		1.25 T-NOTE 190131	1.25	2,400	2,400	271,570	2019/1/31
		1.25 T-NOTE 190430	1.25	600	598	67,775	2019/4/30
		1.25 T-NOTE 191031	1.25	1,400	1,392	157,587	2019/10/31
		1.25 T-NOTE 200131	1.25	2,700	2,677	302,903	2020/1/31
		1.25 T-NOTE 200229	1.25	1,600	1,585	179,399	2020/2/29
		1.25 T-NOTE 210331	1.25	1,900	1,853	209,694	2021/3/31
		1.25 T-NOTE 211031	1.25	600	580	65,678	2021/10/31
		1.25 T-NOTE 230731	1.25	1,500	1,407	159,223	2023/7/31
		1.375 T-NOTE 180630	1.375	1,800	1,809	204,696	2018/6/30
		1.375 T-NOTE 180731	1.375	2,300	2,311	261,525	2018/7/31
		1.375 T-NOTE 180930	1.375	3,200	3,213	363,607	2018/9/30
		1.375 T-NOTE 181130	1.375	1,100	1,103	124,858	2018/11/30
		1.375 T-NOTE 181231	1.375	2,000	2,006	227,033	2018/12/31
		1.375 T-NOTE 190228	1.375	1,200	1,202	136,061	2019/2/28
		1.375 T-NOTE 200131	1.375	1,900	1,891	214,044	2020/1/31
		1.375 T-NOTE 200229	1.375	2,500	2,485	281,217	2020/2/29
		1.375 T-NOTE 200331	1.375	2,100	2,085	236,018	2020/3/31
		1.375 T-NOTE 200430	1.375	2,000	1,984	224,549	2020/4/30
		1.375 T-NOTE 200531	1.375	2,000	1,982	224,337	2020/5/31
		1.375 T-NOTE 200831	1.375	2,700	2,667	301,853	2020/8/31
		1.375 T-NOTE 200930	1.375	2,600	2,566	290,351	2020/9/30
		1.375 T-NOTE 201031	1.375	2,600	2,563	290,029	2020/10/31
		1.375 T-NOTE 210131	1.375	2,300	2,259	255,670	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	3,200	3,130	354,244	2021/5/31
		1.375 T-NOTE 230630	1.375	2,500	2,366	267,803	2023/6/30
		1.375 T-NOTE 230831	1.375	2,800	2,643	299,147	2023/8/31
		1.375 T-NOTE 230930	1.375	2,300	2,170	245,545	2023/9/30
		1.5 T-NOTE 180831	1.5	3,400	3,422	387,234	2018/8/31
		1.5 T-NOTE 181231	1.5	2,900	2,915	329,903	2018/12/31
		1.5 T-NOTE 190131	1.5	2,600	2,613	295,660	2019/1/31
		1.5 T-NOTE 190228	1.5	2,400	2,411	272,854	2019/2/28
	1.5 T-NOTE 190331	1.5	1,000	1,004	113,605	2019/3/31	
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	2,800	2,809	317,896	2019/5/31	
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	2,000	2,002	226,529	2019/10/31	
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	2,900	2,901	328,250	2019/11/30	

銘柄		当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.5 T-NOTE 200531	1.5	2,300	2,289	259,004	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	2,400	2,341	264,940	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	2,200	2,109	238,700	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	1,800	1,723	194,982	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	5,000	4,566	516,644	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 190331	1.625	2,700	2,718	307,581	2019/3/31
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	1,100	1,107	125,272	2019/4/30
	1.625 T-NOTE 190630	1.625	1,700	1,710	193,497	2019/6/30
	1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,700	1,709	193,391	2019/7/31
	1.625 T-NOTE 190831	1.625	3,100	3,116	352,601	2019/8/31
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,200	1,203	136,214	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 200630	1.625	2,700	2,695	305,027	2020/6/30
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	3,300	3,292	372,490	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	2,400	2,385	269,926	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,600	1,558	176,287	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	2,400	2,328	263,498	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	2,200	2,120	239,906	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	1,600	1,540	174,265	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	1,000	957	108,394	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	4,700	4,363	493,747	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	4,800	4,446	503,107	2026/5/15
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	700	707	80,018	2018/10/31
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	2,300	2,318	262,359	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	2,300	2,299	260,184	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	2,500	2,494	282,278	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 211130	1.75	1,300	1,286	145,612	2021/11/30
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	2,100	2,071	234,366	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	2,200	2,167	245,234	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	2,000	1,968	222,693	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,800	1,770	200,320	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	2,000	1,956	221,367	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	2,100	2,045	231,451	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	4,000	3,882	439,269	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	1,300	1,308	148,083	2020/6/30
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,300	2,287	258,821	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	2,200	2,177	246,343	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	2,000	1,971	223,099	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	2,000	1,967	222,657	2022/10/31
	2 T-NOTE 200731	2.0	1,100	1,111	125,806	2020/7/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	1,600	1,615	182,737	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	1,300	1,310	148,255	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	2,000	2,012	227,661	2021/2/28
	2 T-NOTE 210531	2.0	2,200	2,209	249,980	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	2,300	2,304	260,753	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	2,500	2,501	283,029	2021/10/31

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ						
国債証券						
2 T-NOTE 211115	2.0	3,400	3,401	384,830	2021/11/15	
2 T-NOTE 220215	2.0	2,200	2,197	248,667	2022/2/15	
2 T-NOTE 220731	2.0	2,000	1,987	224,938	2022/7/31	
2 T-NOTE 221130	2.0	2,000	1,979	224,001	2022/11/30	
2 T-NOTE 230215	2.0	4,000	3,951	447,154	2023/2/15	
2 T-NOTE 250215	2.0	4,900	4,739	536,329	2025/2/15	
2 T-NOTE 250815	2.0	4,700	4,525	512,111	2025/8/15	
2 T-NOTE 261115	2.0	2,600	2,482	280,882	2026/11/15	
2.125 T-NOTE 200831	2.125	2,200	2,229	252,294	2020/8/31	
2.125 T-NOTE 210131	2.125	1,600	1,617	183,062	2021/1/31	
2.125 T-NOTE 210630	2.125	2,600	2,623	296,833	2021/6/30	
2.125 T-NOTE 210815	2.125	3,300	3,325	376,239	2021/8/15	
2.125 T-NOTE 210930	2.125	2,500	2,517	284,819	2021/9/30	
2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,300	2,314	261,830	2021/12/31	
2.125 T-NOTE 220630	2.125	2,000	2,002	226,565	2022/6/30	
2.125 T-NOTE 221231	2.125	2,100	2,091	236,649	2022/12/31	
2.125 T-NOTE 231130	2.125	1,700	1,680	190,175	2023/11/30	
2.125 T-NOTE 250515	2.125	4,700	4,580	518,302	2025/5/15	
2.25 T-BOND 460815	2.25	3,100	2,578	291,765	2046/8/15	
2.25 T-NOTE 180731	2.25	800	814	92,135	2018/7/31	
2.25 T-NOTE 210331	2.25	2,000	2,031	229,818	2021/3/31	
2.25 T-NOTE 210430	2.25	2,300	2,334	264,148	2021/4/30	
2.25 T-NOTE 210731	2.25	2,100	2,128	240,826	2021/7/31	
2.25 T-NOTE 241115	2.25	4,800	4,742	536,628	2024/11/15	
2.25 T-NOTE 251115	2.25	4,900	4,803	543,562	2025/11/15	
2.375 T-NOTE 180531	2.375	1,300	1,323	149,789	2018/5/31	
2.375 T-NOTE 180630	2.375	1,000	1,018	115,293	2018/6/30	
2.375 T-NOTE 201231	2.375	800	817	92,493	2020/12/31	
2.375 T-NOTE 240815	2.375	4,300	4,297	486,278	2024/8/15	
2.5 T-BOND 450215	2.5	3,100	2,739	309,961	2045/2/15	
2.5 T-BOND 460215	2.5	2,650	2,333	264,006	2046/2/15	
2.5 T-BOND 460515	2.5	2,850	2,508	283,855	2046/5/15	
2.5 T-NOTE 230815	2.5	3,600	3,647	412,686	2023/8/15	
2.5 T-NOTE 240515	2.5	5,300	5,354	605,832	2024/5/15	
2.625 T-NOTE 180131	2.625	1,100	1,119	126,672	2018/1/31	
2.625 T-NOTE 180430	2.625	1,500	1,531	173,298	2018/4/30	
2.625 T-NOTE 200815	2.625	2,500	2,579	291,847	2020/8/15	
2.625 T-NOTE 201115	2.625	4,200	4,331	490,155	2020/11/15	
2.75 T-BOND 420815	2.75	1,700	1,595	180,573	2042/8/15	
2.75 T-BOND 421115	2.75	1,800	1,687	190,924	2042/11/15	
2.75 T-NOTE 171231	2.75	1,300	1,322	149,686	2017/12/31	
2.75 T-NOTE 180228	2.75	900	917	103,867	2018/2/28	
2.75 T-NOTE 190215	2.75	1,300	1,338	151,433	2019/2/15	
2.75 T-NOTE 231115	2.75	4,900	5,036	569,855	2023/11/15	
2.75 T-NOTE 240215	2.75	3,500	3,596	406,977	2024/2/15	

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			
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ	国債証券	2.875	T-BOND 430515	2.875	3,200	3,069	347,257	2043/5/15
		2.875	T-BOND 450815	2.875	3,200	3,051	345,305	2045/8/15
		2.875	T-BOND 461115	2.875	1,400	1,337	151,293	2046/11/15
		2.875	T-NOTE 180331	2.875	1,000	1,022	115,713	2018/3/31
		3.0	T-BOND 420515	3.0	1,300	1,280	144,923	2042/5/15
		3.0	T-BOND 441115	3.0	3,200	3,136	354,923	2044/11/15
		3.0	T-BOND 450515	3.0	3,150	3,081	348,681	2045/5/15
		3.0	T-BOND 451115	3.0	3,200	3,127	353,876	2045/11/15
		3.125	T-BOND 411115	3.125	1,200	1,209	136,904	2041/11/15
		3.125	T-BOND 420215	3.125	1,400	1,410	159,635	2042/2/15
		3.125	T-BOND 430215	3.125	1,900	1,909	216,076	2043/2/15
		3.125	T-BOND 440815	3.125	3,200	3,215	363,833	2044/8/15
		3.125	T-NOTE 190515	3.125	2,700	2,809	317,880	2019/5/15
		3.125	T-NOTE 210515	3.125	2,400	2,521	285,350	2021/5/15
		3.375	T-BOND 440515	3.375	3,200	3,369	381,202	2044/5/15
		3.375	T-NOTE 191115	3.375	3,300	3,471	392,808	2019/11/15
		3.5	T-BOND 390215	3.5	1,000	1,083	122,617	2039/2/15
		3.5	T-NOTE 180215	3.5	1,600	1,643	185,990	2018/2/15
		3.5	T-NOTE 200515	3.5	2,300	2,438	275,869	2020/5/15
		3.625	T-BOND 430815	3.625	2,500	2,747	310,919	2043/8/15
		3.625	T-BOND 440215	3.625	3,300	3,626	410,384	2044/2/15
		3.625	T-NOTE 190815	3.625	2,200	2,321	262,708	2019/8/15
		3.625	T-NOTE 200215	3.625	2,900	3,078	348,361	2020/2/15
		3.625	T-NOTE 210215	3.625	3,700	3,961	448,222	2021/2/15
		3.75	T-BOND 410815	3.75	1,100	1,230	139,284	2041/8/15
		3.75	T-BOND 431115	3.75	2,950	3,317	375,386	2043/11/15
		3.75	T-NOTE 181115	3.75	2,700	2,823	319,479	2018/11/15
		3.875	T-BOND 400815	3.875	1,200	1,368	154,810	2040/8/15
		3.875	T-NOTE 180515	3.875	500	518	58,689	2018/5/15
		4.0	T-NOTE 180815	4.0	900	941	106,517	2018/8/15
		4.25	T-BOND 390515	4.25	800	963	108,963	2039/5/15
		4.25	T-BOND 401115	4.25	1,400	1,686	190,859	2040/11/15
		4.375	T-BOND 380215	4.375	500	616	69,719	2038/2/15
		4.375	T-BOND 391115	4.375	900	1,101	124,636	2039/11/15
		4.375	T-BOND 400515	4.375	1,500	1,837	207,939	2040/5/15
		4.375	T-BOND 410515	4.375	1,100	1,351	152,907	2041/5/15
		4.5	T-BOND 360215	4.5	1,100	1,378	156,018	2036/2/15
		4.5	T-BOND 380515	4.5	700	876	99,179	2038/5/15
		4.5	T-BOND 390815	4.5	650	809	91,595	2039/8/15
		4.625	T-BOND 400215	4.625	1,500	1,900	214,993	2040/2/15
		4.75	T-BOND 410215	4.75	1,500	1,940	219,568	2041/2/15
		5.0	T-BOND 370515	5.0	400	532	60,195	2037/5/15
		5.25	T-BOND 281115	5.25	750	949	107,397	2028/11/15
		5.25	T-BOND 290215	5.25	400	508	57,490	2029/2/15
		5.375	T-BOND 310215	5.375	1,000	1,322	149,685	2031/2/15

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	
国債証券	5.5 T-BOND 280815	5.5	600	771	87,310	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	700	899	101,803	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	600	799	90,519	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	600	747	84,592	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	500	702	79,443	2030/5/15
	6.5 T-BOND 261115	6.5	500	673	76,150	2026/11/15
	8 T-BOND 211115	8.0	800	1,020	115,497	2021/11/15
	8.125 T-BOND 190815	8.125	600	701	79,354	2019/8/15
	8.75 T-BOND 200815	8.75	700	870	98,467	2020/8/15
	8.875 T-BOND 190215	8.875	1,000	1,157	130,940	2019/2/15
小 計					55,956,749	
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	1,100	1,093	94,795	2018/5/1
	0.5 CAN GOVT 180801	0.5	800	796	69,063	2018/8/1
	0.5 CAN GOVT 181101	0.5	1,200	1,194	103,475	2018/11/1
	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	600	578	50,112	2022/3/1
	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	1,200	1,187	102,869	2020/9/1
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	1,300	1,280	110,974	2021/3/1
	0.75 CAN GOVT 210901	0.75	1,000	981	85,048	2021/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	300	274	23,746	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 180201	1.25	1,200	1,207	104,633	2018/2/1
	1.25 CAN GOVT 180301	1.25	700	704	61,054	2018/3/1
	1.25 CAN GOVT 180901	1.25	1,200	1,208	104,757	2018/9/1
	1.5 CAN GOVT 200301	1.5	700	710	61,590	2020/3/1
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	1,000	1,003	86,929	2023/6/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	900	875	75,853	2026/6/1
	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	900	917	79,504	2019/3/1
	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	1,100	1,124	97,440	2019/9/1
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,100	1,144	99,203	2025/6/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	950	1,008	87,414	2024/6/1
	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	950	1,020	88,478	2022/6/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	850	906	78,529	2048/12/1
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	250	272	23,624	2064/12/1
	3.25 CAN GOVT 210601	3.25	800	871	75,485	2021/6/1
	3.5 CAN GOVT 200601	3.5	1,100	1,189	103,040	2020/6/1
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,250	1,511	131,008	2045/12/1
	3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,600	1,707	148,005	2019/6/1
	4 CAN GOVT 410601	4.0	1,100	1,404	121,708	2041/6/1
	4.25 CAN GOVT 180601	4.25	1,000	1,047	90,740	2018/6/1
	5 CAN GOVT 370601	5.0	1,000	1,411	122,303	2037/6/1
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	900	1,255	108,781	2029/6/1
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	950	1,392	120,678	2033/6/1
	8 CAN GOVT 270601	8.0	300	470	40,773	2027/6/1
小 計					2,751,626	

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	19,200	22,029	118,300	2024/12/5	
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	4,700	5,593	30,037	2036/11/20	
	4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	13,600	13,244	71,123	2018/6/14	
	5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	16,900	16,032	86,095	2019/12/11	
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	6,900	6,061	32,548	2026/3/5	
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	22,700	22,057	118,448	2021/6/10	
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	8,300	7,988	42,900	2022/6/9	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	6,600	6,507	34,943	2027/6/3	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	10,200	10,006	53,736	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	7,000	6,797	36,500	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	12,300	11,897	63,888	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	9,800	10,063	54,041	2020/6/11	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	7,100	7,298	39,190	2023/12/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	18,400	18,941	101,717	2018/12/13	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	6,900	7,260	38,988	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	7,500	7,824	42,017	2038/11/18	
小 計					964,478		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	1,300	1,252	152,469	2026/8/15
		0 OBL 200417	—	1,500	1,529	186,235	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	1,700	1,733	211,013	2021/4/9
		0 OBL 211008	—	1,000	1,018	123,955	2021/10/8
		0 SCHATS 180316	—	1,100	1,108	134,961	2018/3/16
		0 SCHATS 180615	—	1,300	1,312	159,779	2018/6/15
		0.25 OBL 180413	0.25	1,500	1,517	184,732	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	1,400	1,434	174,687	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	1,600	1,647	200,577	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	2,000	2,058	250,692	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	2,100	2,137	260,273	2026/2/15
		0.5 OBL 180223	0.5	1,200	1,215	147,963	2018/2/23
		0.5 OBL 190412	0.5	1,400	1,437	174,972	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	1,350	1,446	176,136	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	1,900	2,027	246,825	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	1,200	1,234	150,300	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,400	1,449	176,473	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	1,300	1,428	173,972	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,200	1,322	161,070	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,300	1,435	174,795	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,300	1,441	175,456	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,700	1,888	229,885	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,300	1,463	178,219	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,500	1,674	203,875	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	1,500	1,708	208,064	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	1,300	1,433	174,541	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,100	1,236	150,577	2021/9/4



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	2.5 BUND 210104	2.5	1,600	1,791	218,169	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,400	1,829	222,735	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,400	1,842	224,397	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,600	1,798	219,028	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	1,300	1,449	176,540	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,500	1,748	212,953	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	1,100	1,609	195,918	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	1,800	1,984	241,682	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	1,900	2,064	251,368	2019/1/4
		4 BUND 180104	4.0	1,400	1,461	178,006	2018/1/4
		4 BUND 370104	4.0	1,700	2,634	320,811	2037/1/4
		4.25 BUND 180704	4.25	1,700	1,821	221,776	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	870	1,427	173,758	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	800	1,173	142,859	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,500	2,446	297,897	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,300	2,291	278,985	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,300	2,128	259,218	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,250	1,934	235,539	2028/1/4
6.25 BUND 240104	6.25	600	862	104,984	2024/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	550	934	113,816	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	700	1,134	138,098	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.05 ITALY GOVT 191015	0.05	200	199	24,306	2019/10/15
		0.1 ITALY GOVT 190415	0.1	600	600	73,166	2019/4/15
		0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	1,300	1,307	159,150	2018/5/15
		0.3 ITALY GOVT 181015	0.3	500	503	61,292	2018/10/15
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	1,100	1,095	133,427	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	900	911	110,929	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	400	382	46,523	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	1,100	1,116	136,003	2020/5/1
		0.75 ITALY GOVT 180115	0.75	900	908	110,648	2018/1/15
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,100	1,086	132,279	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	900	923	112,451	2019/12/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	1,100	1,018	123,971	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,300	1,329	161,869	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	1,300	1,331	162,114	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,200	1,242	151,252	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,500	1,462	178,102	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	1,400	1,350	164,393	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,600	1,437	175,074	2032/3/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,300	1,304	158,872	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	900	960	116,957	2021/12/15
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	700	648	78,927	2036/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,300	1,371	167,009	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,400	1,481	180,417	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	900	808	98,454	2047/3/1

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	2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	400	333	40,587	2067/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,050	1,055	128,497	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	2,200	2,308	281,142	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,400	1,492	181,766	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	2,100	2,381	289,933	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,500	1,702	207,314	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,600	2,964	360,901	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,500	1,723	209,840	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,700	1,924	234,292	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,000	2,347	285,774	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	2,300	2,498	304,203	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	2,100	2,324	283,067	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,900	2,137	260,222	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	700	733	89,333	2018/2/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	2,200	2,354	286,676	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	2,000	2,187	266,379	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	1,700	1,920	233,788	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,600	1,914	233,165	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,750	2,102	256,024	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,300	1,565	190,658	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	2,000	2,371	288,724	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	2,100	2,558	311,482	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	1,500	1,867	227,405	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,100	1,407	171,382	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,400	1,687	205,499	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,900	2,362	287,692	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,750	2,302	280,329	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,400	1,849	225,171	2039/8/1
5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,650	2,166	263,823	2040/9/1		
5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,100	2,753	335,205	2029/11/1		
5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,700	2,116	257,651	2022/9/1		
5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	1,200	1,496	182,232	2022/11/1		
5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,200	1,681	204,725	2033/2/1		
6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,450	3,470	422,568	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	1,900	2,681	326,473	2027/11/1		
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	700	1,022	124,514	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,000	1,492	181,756	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O.A.T 180225	—	700	704	85,739	2018/2/25
		0 O.A.T 190225	—	700	707	86,118	2019/2/25
		0 O.A.T 200525	—	1,700	1,717	209,155	2020/5/25
		0 O.A.T 210525	—	1,600	1,610	196,054	2021/5/25
		0.25 O.A.T 201125	0.25	1,900	1,936	235,754	2020/11/25
		0.25 O.A.T 261125	0.25	900	839	102,232	2026/11/25
		0.5 O.A.T 191125	0.5	2,200	2,255	274,669	2019/11/25

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	0.5 O.A.T 250525	0.5	2,400	2,367	288,261	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	2,100	2,026	246,795	2026/5/25
		1 O.A.T 180525	1.0	1,700	1,735	211,263	2018/5/25
		1 O.A.T 181125	1.0	1,700	1,747	212,757	2018/11/25
		1 O.A.T 190525	1.0	2,200	2,274	276,991	2019/5/25
		1 O.A.T 251125	1.0	1,900	1,934	235,515	2025/11/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	950	879	107,089	2036/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	1,850	1,874	228,189	2031/5/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	2,400	2,627	319,865	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	2,400	2,621	319,250	2024/11/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	350	293	35,704	2066/5/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	2,300	2,580	314,261	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	2,100	2,375	289,244	2024/5/25
		2.5 O.A.T 201025	2.5	2,500	2,761	336,214	2020/10/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	2,350	2,695	328,207	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	2,200	2,575	313,580	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	3,200	3,702	450,823	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	3,000	3,475	423,176	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	1,700	2,164	263,536	2045/5/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	2,800	3,150	383,575	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	2,800	3,462	421,586	2026/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	2,600	2,899	353,081	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	3,000	3,505	426,863	2021/4/25
		4 O.A.T 180425	4.0	2,700	2,853	347,416	2018/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	2,000	2,817	343,116	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,090	1,623	197,631	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	850	1,279	155,796	2060/4/25
		4.25 O.A.T 181025	4.25	2,000	2,168	263,986	2018/10/25
4.25 O.A.T 190425	4.25	2,500	2,766	336,826	2019/4/25		
4.25 O.A.T 231025	4.25	3,300	4,174	508,301	2023/10/25		
4.5 O.A.T 410425	4.5	2,200	3,335	406,147	2041/4/25		
4.75 O.A.T 350425	4.75	2,100	3,159	384,730	2035/4/25		
5.5 O.A.T 290425	5.5	2,400	3,590	437,118	2029/4/25		
5.75 O.A.T 321025	5.75	2,150	3,464	421,877	2032/10/25		
6 O.A.T 251025	6.0	2,000	2,907	353,969	2025/10/25		
8.5 O.A.T 191025	8.5	900	1,122	136,627	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	—	900	906	110,382	2018/4/15
		0 NETH GOVT 220115	—	300	303	36,894	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	1,400	1,433	174,493	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,000	984	119,916	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,100	1,091	132,943	2026/7/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	1,100	1,119	136,352	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	1,200	1,243	151,408	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,000	1,110	135,156	2023/7/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	2 NETH GOVT 240715	2.0	1,100	1,243	151,361	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,300	1,471	179,207	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	950	1,166	141,976	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	850	1,149	139,950	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,400	1,627	198,130	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	700	797	97,158	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	400	491	59,868	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,100	1,702	207,238	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	1,100	1,174	142,999	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	1,100	1,225	149,162	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,100	1,681	204,781	2037/1/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	900	1,359	165,572	2028/1/15
		7.5 NETH GOVT 230115	7.5	700	1,016	123,802	2023/1/15
		スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	1,400	1,409
0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25			600	605	73,711	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			1,400	1,454	177,070	2020/7/30
1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3			1,000	979	119,204	2026/10/31
1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4			1,600	1,668	203,205	2020/1/31
1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6			1,600	1,642	199,958	2025/4/30
1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95			1,400	1,458	177,606	2026/4/30
1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95			1,400	1,394	169,751	2030/7/30
2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15			1,600	1,700	207,025	2025/10/31
2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75			1,900	2,026	246,689	2019/4/30
2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75			1,800	2,012	245,074	2024/10/31
2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9			600	604	73,629	2046/10/31
3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45			300	312	38,011	2066/7/30
3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75			1,500	1,607	195,753	2018/10/31
3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8			1,500	1,788	217,800	2024/4/30
4 SPAIN GOVT 200430	4.0			1,600	1,807	220,029	2020/4/30
4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1			1,600	1,705	207,658	2018/7/30
4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2			1,200	1,532	186,628	2037/1/31
4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3			1,600	1,793	218,334	2019/10/31
4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4			1,500	1,848	225,130	2023/10/31
4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5			1,400	1,467	178,733	2018/1/31
4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6			1,500	1,677	204,261	2019/7/30
4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65			1,800	2,279	277,595	2025/7/30
4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7			1,100	1,504	183,210	2041/7/30
4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8			1,200	1,514	184,440	2024/1/31
4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85			1,450	1,707	207,961	2020/10/31
4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9			1,300	1,817	221,320	2040/7/30
5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15			750	1,018	123,999	2028/10/31
5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15			850	1,233	150,212	2044/10/31
5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4			1,600	2,047	249,250	2023/1/31
5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5			1,800	2,204	268,446	2021/4/30

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	5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,450	2,150	261,796	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,700	2,158	262,770	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,100	1,526	185,900	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,850	2,687	327,196	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,400	1,419	172,825	2025/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	900	915	111,480	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	700	669	81,499	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	800	820	99,870	2018/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	450	413	50,383	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	150	156	19,064	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	200	191	23,298	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,100	1,249	152,091	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,200	1,393	169,712	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	1,000	1,092	133,034	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	350	433	52,809	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,400	1,612	196,293	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	750	1,062	129,397	2045/6/22
		4 BEL GOVT 180328	4.0	800	842	102,630	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	900	988	120,335	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,100	1,336	162,749	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	550	752	91,605	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,300	1,572	191,496	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,200	1,490	181,499	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,350	2,031	247,329	2041/3/28
4.5 BEL GOVT 260328	4.5	700	937	114,127	2026/3/28		
5 BEL GOVT 350328	5.0	1,600	2,517	306,484	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,400	2,078	253,045	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	—	100	99	12,074	2023/7/15
		0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	500	510	62,152	2019/10/18
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	700	706	85,998	2026/10/20
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	500	515	62,715	2018/10/19
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	700	742	90,434	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	200	195	23,838	2047/2/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	600	661	80,569	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	900	999	121,756	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	500	530	64,539	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	450	538	65,579	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	500	687	83,746	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	700	840	102,358	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,150	1,351	164,585	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	700	838	102,149	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	250	407	49,633	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	1,000	1,150	140,047	2020/7/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	900	1,361	165,783	2037/3/15
4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	900	994	121,086	2019/3/15		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	900	945	115,159	2018/1/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	800	1,110	135,185	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	550	863	105,094	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 230915	—	200	197	24,091	2023/9/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	400	411	50,047	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	400	395	48,198	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	300	288	35,093	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	100	103	12,560	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	200	205	25,041	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	400	435	53,064	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	400	438	53,395	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	300	337	41,097	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	350	447	54,467	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	400	487	59,342	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	500	561	68,422	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	500	580	70,678	2021/4/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	600	779	94,948	2025/7/4
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	500	560	68,253	2019/7/4		
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	400	414	50,449	2022/3/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	400	396	48,279	2026/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	450	432	52,658	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	650	716	87,229	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	600	713	86,915	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	400	485	59,065	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	500	557	67,877	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	650	706	85,965	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	800	921	112,253	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	600	717	87,306	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	900	1,218	148,322	2025/3/13
		5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	600	702	85,476	2019/10/18
		小 計					
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	1.25 GILT 180722	1.25	2,400	2,439	348,771	2018/7/22	
	1.5 GILT 210122	1.5	2,150	2,228	318,652	2021/1/22	
	1.5 GILT 260722	1.5	1,400	1,404	200,814	2026/7/22	
	1.5 GILT 470722	1.5	100	88	12,593	2047/7/22	
	1.75 GILT 190722	1.75	2,100	2,176	311,279	2019/7/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	2,200	2,310	330,401	2022/9/7	
	2 GILT 200722	2.0	2,100	2,211	316,181	2020/7/22	
	2 GILT 250907	2.0	1,600	1,688	241,424	2025/9/7	
	2.25 GILT 230907	2.25	1,700	1,837	262,702	2023/9/7	
	2.5 GILT 650722	2.5	900	1,073	153,444	2065/7/22	
	2.75 GILT 240907	2.75	1,500	1,673	239,300	2024/9/7	
	3.25 GILT 440122	3.25	1,730	2,140	306,036	2044/1/22	
	3.5 GILT 450122	3.5	1,800	2,332	333,459	2045/1/22	

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	1,500	2,288	327,234	2068/7/22
		3.75 GILT 190907	3.75	1,100	1,200	171,620	2019/9/7
		3.75 GILT 200907	3.75	1,200	1,342	191,964	2020/9/7
		3.75 GILT 210907	3.75	1,200	1,370	195,984	2021/9/7
		3.75 GILT 520722	3.75	1,300	1,889	270,164	2052/7/22
		4 GILT 220307	4.0	1,050	1,224	175,029	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	930	1,504	215,096	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	950	1,204	172,206	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	1,300	1,717	245,649	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	1,685	2,289	327,367	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	1,050	1,464	209,411	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	1,200	1,690	241,733	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	1,350	2,003	286,488	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	1,130	1,736	248,297	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	1,330	2,175	311,043	2055/12/7
		4.5 GILT 190307	4.5	1,300	1,418	202,769	2019/3/7
		4.5 GILT 340907	4.5	1,550	2,142	306,312	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	1,270	1,888	270,084	2042/12/7
		4.75 GILT 200307	4.75	1,400	1,590	227,448	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75	1,100	1,505	215,305	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	1,290	1,908	272,893	2038/12/7
		5 GILT 180307	5.0	1,200	1,264	180,817	2018/3/7
		5 GILT 250307	5.0	1,050	1,356	193,968	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	750	1,107	158,321	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	900	1,189	170,084	2021/6/7
小計						9,162,359	
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	270	301	34,215	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	340	376	42,686	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 180108	3.0	500	518	58,837	2018/1/8
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	420	458	51,947	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	330	421	47,770	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	430	625	70,868	2028/4/8
小計						306,326	
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	5,300	5,430	69,783	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	5,750	6,217	79,898	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	4,800	5,572	71,604	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	6,950	8,228	105,733	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,450	4,587	58,955	2039/3/30
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	7,200	7,942	102,056	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	6,900	8,300	106,657	2020/12/1
小計						594,689	
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	2,700	2,662	36,322	2026/2/19

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		
ノルウェー		%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円		
	国債証券	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	3,000	3,043	41,512	2025/3/13
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	4,200	4,368	59,580	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	3,300	3,647	49,754	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	5,400	6,017	82,073	2021/5/25
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	5,600	6,092	83,107	2019/5/22
小	計					352,350	
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	3,700	3,757	61,513	2018/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	4,700	5,141	84,171	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	6,300	6,992	114,470	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	7,000	8,069	132,097	2021/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	7,400	8,317	136,159	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	9,650	16,013	262,146	2039/11/15
		7 DMK GOVT 241110	7.0	1,300	1,985	32,495	2024/11/10
小	計					823,054	
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	2,200	2,132	59,678	2020/4/25
		1.75 POLAND 210725	1.75	2,300	2,191	61,316	2021/7/25
		2 POLAND 210425	2.0	2,000	1,932	54,057	2021/4/25
		2.5 POLAND 180725	2.5	1,900	1,920	53,725	2018/7/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	2,800	2,522	70,576	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	2.5	500	445	12,451	2027/7/25
		3.25 POLAND 190725	3.25	2,000	2,048	57,314	2019/7/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	2,100	2,038	57,034	2025/7/25
		3.75 POLAND 180425	3.75	1,100	1,128	31,581	2018/4/25
		4 POLAND 231025	4.0	2,250	2,322	64,972	2023/10/25
		5.25 POLAND 201025	5.25	1,000	1,090	30,503	2020/10/25
		5.5 POLAND 191025	5.5	1,500	1,627	45,524	2019/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	1,300	1,458	40,804	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	1,650	1,862	52,117	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	5.75	600	709	19,844	2029/4/25
		POLAND 181025	—	2,400	2,319	64,885	2018/10/25
小	計					776,389	
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	1,350	1,334	114,465	2020/11/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	950	895	76,827	2028/5/21
		2.75 AUST GOVT 191021	2.75	1,700	1,737	149,044	2019/10/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,950	1,979	169,766	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	1,350	1,344	115,297	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	500	457	39,229	2035/6/21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	550	473	40,650	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 181021	3.25	1,200	1,230	105,515	2018/10/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	2,000	2,093	179,585	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	1,000	1,033	88,606	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	300	284	24,443	2039/6/21



銘柄		当 期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
国債証券	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	700	728	62,513	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,400	2,708	232,293	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	2,000	2,156	184,971	2020/4/15
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	800	932	80,006	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	2,100	2,476	212,417	2027/4/21
	5.25 AUST GOVT 190315	5.25	1,700	1,820	156,130	2019/3/15
	5.5 AUST GOVT 180121	5.5	1,400	1,450	124,450	2018/1/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,650	1,946	166,946	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	2,150	2,469	211,786	2021/5/15
5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,800	2,120	181,918	2022/7/15	
小 計					2,716,868	
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	500	496	39,807	2018/4/1
	1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	350	352	28,218	2019/10/1
	2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	150	152	12,189	2020/7/1
	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	100	98	7,881	2026/6/1
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	600	611	49,014	2021/6/1
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	300	301	24,192	2025/6/1
	2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	450	462	37,035	2019/6/1
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	400	415	33,276	2023/7/1
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	400	402	32,256	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	150	150	12,084	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	100	103	8,276	2029/7/1
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	300	308	24,689	2030/9/1
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	400	421	33,795	2024/9/1
	3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	350	371	29,739	2022/9/1
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	400	422	33,888	2020/9/1
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	230	250	20,077	2033/9/1
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	380	416	33,369	2027/3/1
4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	300	313	25,127	2018/9/1	
小 計					484,920	
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	3.26	900	902	23,054	2018/3/1
	3.418MALAYSIAGOV 220815	3.418	900	878	22,443	2022/8/15
	3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	1,200	1,165	29,769	2023/3/15
	3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	900	898	22,965	2020/3/31
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	300	275	7,040	2027/5/31
	3.58 MALAYSIAGOV 180928	3.58	800	804	20,562	2018/9/28
	3.654 MALAYSIAGOV 191031	3.654	1,100	1,107	28,286	2019/10/31
	3.659 MALAYSIAGOV 201015	3.659	1,000	1,002	25,625	2020/10/15
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	600	559	14,300	2028/6/15
	3.759 MALAYSIAGOV 190315	3.759	600	605	15,479	2019/3/15
	3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	900	895	22,880	2022/9/30
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	200	198	5,068	2023/8/17
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	600	539	13,791	2033/4/15

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	3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	700	707	18,083	2020/7/31
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	500	481	12,306	2027/3/15
	3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	100	98	2,507	2026/11/30
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	1,150	1,133	28,957	2025/9/15
	4.048 MALAYSIA 210930	4.048	900	913	23,332	2021/9/30
	4.127 MALAYSIA 320415	4.127	600	558	14,266	2032/4/15
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	1,050	1,071	27,383	2021/7/15
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,000	1,007	25,744	2024/7/15
	4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	800	772	19,748	2031/6/30
	4.24 MALAYSIAGOV 180207	4.24	400	404	10,344	2018/2/7
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	350	331	8,476	2035/5/31
	4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	1,200	1,231	31,463	2019/11/29
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	1,000	1,009	25,789	2026/4/15
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	900	891	22,766	2030/4/15
	4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	200	198	5,066	2046/3/15
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	600	605	15,471	2043/9/30
	5.248 MALAYSIA 280915	5.248	200	213	5,443	2028/9/15
	5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	300	316	8,082	2019/7/30
小計					556,504	
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	13,100	14,618	124,988	2026/12/21
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	6,550	4,752	40,632	2036/3/31
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	5,800	4,199	35,903	2041/2/28
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	3,900	3,724	31,844	2021/3/31
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	7,200	5,980	51,132	2031/2/28
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	4,600	4,523	38,677	2020/1/15
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	4,400	4,275	36,554	2023/2/28
	8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	3,000	3,012	25,758	2018/12/21
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	6,900	6,306	53,919	2030/1/31
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	5,300	4,854	41,507	2032/3/31
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	6,900	6,316	54,006	2037/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	5,900	5,485	46,901	2044/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	9,400	8,716	74,523	2048/2/28
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	2,700	2,579	22,053	2035/2/28
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	2,400	2,294	19,621	2040/1/31
小計					698,025	
合計					126,908,564	

(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。

## <MUAM G-REITマザーファンド>

下記は、MUAM G-REITマザーファンド全体(11,695,691千口)の内容です。

### 外国投資信託証券

銘柄	口数	当期末		比率
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千アメリカドル	千円	%
DDR CORP	45	692	78,366	0.4
HCP INC	67	2,025	229,189	1.3
MACERICH CO/THE	17	1,212	137,190	0.8
ACADIA REALTY TRUST	11	380	43,058	0.2
AGREE REALTY CORP	3	175	19,817	0.1
ALEXANDER'S INC	0.5	220	24,946	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11	1,302	147,430	0.8
PROLOGIS INC	76	3,976	449,927	2.5
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	19	941	106,494	0.6
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12	95	10,816	0.1
BRANDYWINE REALTY TRUST	25	418	47,301	0.3
CAMDEN PROPERTY TRUST	12	1,065	120,505	0.7
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	25	269	30,446	0.2
CEDAR REALTY TRUST INC	10	67	7,618	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	21	963	109,054	0.6
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	14	456	51,630	0.3
COUSINS PROPERTIES INC	49	425	48,097	0.3
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	29	348	39,407	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	23	2,474	280,023	1.6
EASTGROUP PROPERTIES INC	4	347	39,297	0.2
EDUCATION REALTY TRUST INC	10	441	49,999	0.3
EPR PROPERTIES	9	697	78,911	0.4
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11	866	98,074	0.5
EQUITY ONE INC	13	419	47,517	0.3
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9	2,143	242,592	1.3
EXTRA SPACE STORAGE INC	18	1,342	151,933	0.8
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10	1,462	165,445	0.9
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	17	474	53,670	0.3
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	7	85	9,664	0.1
GETTY REALTY CORP	4	105	11,990	0.1
WELLTOWER INC	52	3,493	395,254	2.2
HIGHWOODS PROPERTIES INC	14	782	88,530	0.5
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	23	747	84,525	0.5
EQUITY COMMONWEALTH	18	582	65,873	0.4
KILROY REALTY CORP	14	1,081	122,353	0.7
KITE REALTY GROUP TRUST	12	302	34,244	0.2
LEXINGTON REALTY TRUST	31	340	38,511	0.2
LTC PROPERTIES INC	5	281	31,810	0.2
MACK-CALI REALTY CORP	13	389	44,058	0.2
BOSTON PROPERTIES INC	22	2,905	328,804	1.8

銘柄	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千アメリカドル	千円	%
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	47	620	70,198	0.4
MID-AMERICA APARTMENT COMM	16	1,608	181,975	1.0
NATL HEALTH INVESTORS INC	5	441	49,922	0.3
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	28	923	104,538	0.6
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2	55	6,314	0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST	10	191	21,675	0.1
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	11	181	20,547	0.1
REALTY INCOME CORP	37	2,234	252,813	1.4
REGENCY CENTERS CORP	15	1,058	119,776	0.7
SAUL CENTERS INC	1	107	12,203	0.1
SENIOR HOUSING PROP TRUST	34	668	75,673	0.4
SL GREEN REALTY CORP	14	1,595	180,494	1.0
LIFE STORAGE INC	6	561	63,589	0.4
SUN COMMUNITIES INC	9	755	85,444	0.5
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	31	475	53,847	0.3
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	14	481	54,505	0.3
TAUBMAN CENTERS INC	8	638	72,233	0.4
CUBESMART	26	683	77,326	0.4
UDR INC	38	1,362	154,184	0.9
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1	112	12,739	0.1
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4	105	11,902	0.1
VENTAS INC	51	3,147	356,181	2.0
WASHINGTON REIT	11	362	40,963	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	17	635	71,893	0.4
HERSHA HOSPITALITY TRUST	6	134	15,207	0.1
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2	346	39,192	0.2
UMH PROPERTIES INC	3	47	5,416	0.0
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3	70	8,022	0.0
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	9	146	16,550	0.1
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	16	513	58,097	0.3
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15	206	23,343	0.1
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	13	638	72,274	0.4
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	19	132	14,946	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	20	784	88,796	0.5
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	11	524	59,373	0.3
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	10	314	35,602	0.2
CHESAPEAKE LODGING TRUST	8	230	26,047	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	21	461	52,189	0.3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	21	763	86,340	0.5
CORESITE REALTY CORP	4	420	47,551	0.3
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5	256	29,022	0.2
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13	209	23,711	0.1
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	10	202	22,967	0.1
RLJ LODGING TRUST	18	436	49,430	0.3
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	16	342	38,757	0.2

銘柄	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千アメリカドル	千円	%
STAG INDUSTRIAL INC	11	274	31,008	0.2
SABRA HEALTH CARE REIT INC	9	252	28,556	0.2
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	34	524	59,305	0.3
SELECT INCOME REIT	9	235	26,638	0.1
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	20	608	68,797	0.4
WP CAREY INC	15	961	108,812	0.6
WHITESTONE REIT	4	55	6,334	0.0
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7	474	53,667	0.3
CHATHAM LODGING TRUST	6	127	14,420	0.1
TERRENO REALTY CORP	6	189	21,493	0.1
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	5	93	10,616	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	71	764	86,536	0.5
CORECIVIC INC	16	494	55,979	0.3
GEO GROUP INC/THE	11	458	51,909	0.3
VEREIT INC	140	1,211	137,059	0.8
DUKE REALTY CORP	51	1,355	153,369	0.8
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	5	74	8,472	0.0
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	9	236	26,798	0.1
PHYSICIANS REALTY TRUST	19	363	41,115	0.2
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	32	685	77,603	0.4
GRAMERCY PROPERTY TRUST	20	566	64,134	0.4
CYRUSONE INC	10	537	60,782	0.3
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	3	46	5,303	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	17	365	41,343	0.2
QTS REALTY TRUST INC-CL A	7	358	40,515	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	38	941	106,479	0.6
COLONY STARWOOD HOMES	7	213	24,100	0.1
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	17	398	45,079	0.2
WASHINGTON PRIME GROUP INC	28	276	31,331	0.2
CARETRUST REIT INC	9	144	16,403	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	3	53	6,015	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	28	877	99,289	0.6
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	7	69	7,896	0.0
IRON MOUNTAIN INC	35	1,251	141,594	0.8
STORE CAPITAL CORP	22	562	63,702	0.4
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	11	122	13,868	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES	13	371	41,994	0.2
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	3	66	7,508	0.0
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	24	252	28,625	0.2
XENIA HOTELS & RESORTS INC	15	303	34,326	0.2
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	5	132	15,032	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	2	57	6,511	0.0
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	12	311	35,282	0.2
APPLE HOSPITALITY REIT INC	22	467	52,887	0.3
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	2	38	4,314	0.0

銘柄	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千アメリカドル	千円	%
GLOBAL NET LEASE INC	24	194	22,051	0.1
CITY OFFICE REIT INC	2	34	3,895	0.0
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	7	96	10,875	0.1
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3	156	17,697	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8	180	20,458	0.1
FOREST CITY REALTY TRUST- A	32	712	80,607	0.4
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1	40	4,584	0.0
FARMLAND PARTNERS INC	1	19	2,230	0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INV	90	77	8,757	0.0
TIER REIT INC	6	118	13,438	0.1
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	10	18	2,074	0.0
PARKWAY INC	6	144	16,383	0.1
QUALITY CARE PROPERTIES	13	221	25,047	0.1
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3	34	3,886	0.0
EQUITY RESIDENTIAL	53	3,275	370,598	2.1
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	80	1,139	128,951	0.7
FELCOR LODGING TRUST INC	18	147	16,743	0.1
GENERAL GROWTH PROPERTIES	84	2,097	237,346	1.3
HOST HOTELS & RESORTS INC	107	1,981	224,225	1.2
ISTAR INC	10	120	13,612	0.1
LIBERTY PROPERTY TRUST	21	867	98,129	0.5
LASALLE HOTEL PROPERTIES	16	509	57,609	0.3
PUBLIC STORAGE	21	4,743	536,684	3.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	45	8,332	942,831	5.2
VORNADO REALTY TRUST	24	2,686	303,998	1.7
KIMCO REALTY CORP	61	1,545	174,848	1.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	19	3,458	391,314	2.2
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23	1,026	116,146	0.6
小 計	口 数	金額		
	銘柄	数 < 比 率 >		
		3,171	115,210	13,036,028
		158	-	<72.2%>
(カナダ)			千カナダドル	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3	167	14,521	0.1
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	9	305	26,443	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9	307	26,634	0.1
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	5	241	20,945	0.1
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13	202	17,591	0.1
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	8	159	13,855	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	19	448	38,830	0.2
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	3	53	4,643	0.0
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	4	84	7,282	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23	602	52,200	0.3
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	5	199	17,290	0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	10	130	11,317	0.1
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6	91	7,908	0.0
BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO	2	62	5,442	0.0

銘柄	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	千口	千カナダドル	千円	%
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	4	47	4,138	0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	8	79	6,919	0.0
ONEREIT	2	8	743	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3	138	12,035	0.1
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5	41	3,618	0.0
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	4	40	3,539	0.0
MILESTONE APARTMENTS REAL ES	5	117	10,166	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2	36	3,134	0.0
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	16	94	8,162	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	5	82	7,132	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	5	73	6,356	0.0
PLAZA RETAIL REIT	5	26	2,284	0.0
SLATE RETAIL REIT - U	2	35	3,106	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	5	60	5,221	0.0
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	2	24	2,083	0.0
SLATE OFFICE REIT	3	24	2,138	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	207	3,989	345,689
	銘柄 数 < 比 率 >	30	-	<1.9%>
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ	
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	14	165	20,207	0.1
HAMBORNER REIT AG	10	97	11,874	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	25	263	32,081
	銘柄 数 < 比 率 >	2	-	<0.2%>
(ユーロ…イタリア)				
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	55	40	4,935	0.0
BENI STABILI SPA	135	73	8,908	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	191	113	13,843
	銘柄 数 < 比 率 >	2	-	<0.1%>
(ユーロ…フランス)				
GECINA SA	5	707	86,120	0.5
KLEPIERRE	29	1,046	127,437	0.7
UNIBAIL-RODAMCO SE	14	3,054	371,930	2.1
FONCIERE DES REGIONS	7	564	68,763	0.4
MERCIALYS	7	141	17,221	0.1
ICADE	6	434	52,923	0.3
ALTAREA	0.36	62	7,594	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	72	6,011	731,991
	銘柄 数 < 比 率 >	7	-	<4.1%>
(ユーロ…オランダ)				
EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	7	246	30,016	0.2
NSI NV	18	70	8,628	0.0
VASTNED RETAIL NV	2	100	12,180	0.1
WERELDHAVE NV	5	239	29,142	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	34	656	79,967
	銘柄 数 < 比 率 >	4	-	<0.4%>

銘柄	口数	当 期 末		
		評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)	千口	千ユーロ	千円	%
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14	98	12,016	0.1
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	67	699	85,124	0.5
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	8	110	13,438	0.1
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	15	174	21,282	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	105	1,082	131,862
	銘柄 数 < 比 率 >	4	—	<0.7%>
(ユーロ…ベルギー)				
BEFIMMO	3	166	20,252	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	2	49	6,057	0.0
RETAIL ESTATES	0.77	56	6,886	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA	2	193	23,589	0.1
WERELDHAVE BELGIUM NV	0.32	33	4,034	0.0
AEDIFICA	2	141	17,253	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV	0.5	17	2,188	0.0
MONTEA	0.98	43	5,280	0.0
COFINIMMO	2	300	36,639	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	15	1,003	122,182
	銘柄 数 < 比 率 >	9	—	<0.7%>
(ユーロ…アイルランド)				
GREEN REIT PLC	96	126	15,349	0.1
HIBERNIA REIT PLC	103	124	15,193	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	53	61	7,505	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	252	312	38,048
	銘柄 数 < 比 率 >	3	—	<0.2%>
ユーロ計	口 数 ・ 金 額	697	9,444	1,149,976
	銘柄 数 < 比 率 >	31	—	<6.4%>
(イギリス)		千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC	149	873	124,847	0.7
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	49	307	43,899	0.2
HAMMERSON PLC	112	615	88,013	0.5
LAND SECURITIES GROUP PLC	115	1,150	164,446	0.9
INTU PROPERTIES PLC	132	356	51,012	0.3
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	91	98	14,027	0.1
SEGRE PLC	118	543	77,739	0.4
WORKSPACE GROUP PLC	18	136	19,574	0.1
MCKAY SECURITIES PLC-ORD	15	30	4,384	0.0
SHAFESBURY PLC	41	359	51,473	0.3
BIG YELLOW GROUP PLC	21	148	21,193	0.1
DERWENT LONDON PLC	16	403	57,649	0.3
MUCKLOW ( A & J ) GROUP PLC	9	43	6,237	0.0
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	88	130	18,593	0.1
HANSTEEN HOLDINGS PLC	108	120	17,190	0.1
REDEFINE INTERNATIONAL PLC	197	77	11,034	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	31	115	16,583	0.1
TRITAX BIG BOX REIT PLC	164	228	32,660	0.2



銘柄	口数	当期末		比率
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	千口	千イギリスポンド	千円	%
ASSURA PLC	235	128	18,330	0.1
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	64	36	5,240	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	68	73	10,514	0.1
REGIONAL REIT LTD	24	25	3,644	0.0
CAPITAL & REGIONAL PLC	75	42	6,006	0.0
NEWRIVER REIT PLC	33	109	15,717	0.1
小計	口数・金額	1,985	6,154	880,017
	銘柄数 < 比率 >	24	—	< 4.9% >
(オーストラリア)		千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES	472	1,345	115,380	0.6
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	6	42	3,620	0.0
ABACUS PROPERTY GROUP	43	122	10,499	0.1
ASPEN GROUP	11	11	1,026	0.0
INGENIA COMMUNITIES GROUP	22	59	5,074	0.0
360 CAPITAL GROUP LTD	34	30	2,603	0.0
ALE PROPERTY GROUP	25	108	9,342	0.1
CHARTER HALL GROUP	59	273	23,464	0.1
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	35	89	7,686	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP	198	192	16,483	0.1
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	101	222	19,121	0.1
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	26	81	6,988	0.0
NATIONAL STORAGE REIT	64	92	7,929	0.0
GDI PROPERTY GROUP	65	63	5,463	0.0
INDUSTRIA REIT	23	47	4,063	0.0
CENTURIA URBAN REIT	7	17	1,458	0.0
SCENTRE GROUP	772	3,398	291,529	1.6
ARENA REIT	29	54	4,676	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	23	64	5,542	0.0
GENERATION HEALTHCARE REIT	23	44	3,844	0.0
VIVA ENERGY REIT	66	151	13,025	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	23	88	7,594	0.0
GPT GROUP	259	1,204	103,336	0.6
MIRVAC GROUP	543	1,092	93,739	0.5
STOCKLAND	353	1,535	131,680	0.7
WESTFIELD CORP	280	2,496	214,160	1.2
DEXUS PROPERTY GROUP	138	1,237	106,104	0.6
BWP TRUST	70	204	17,571	0.1
INVESTA OFFICE FUND	92	414	35,592	0.2
CHARTER HALL RETAIL REIT	49	210	18,067	0.1
GOODMAN GROUP	230	1,577	135,296	0.7
小計	口数・金額	4,154	16,578	1,421,971
	銘柄数 < 比率 >	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	43	90	7,467	0.0
KIWI PROPERTY GROUP LTD	179	259	21,443	0.1

銘柄	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(ニュージーランド)	千口	千ニュージーランドドル	千円	%
GOODMAN PROPERTY TRUST	147	184	15,274	0.1
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	62	99	8,178	0.0
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	141	175	14,479	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD	127	134	11,073	0.1
STRIDE PROPERTY GROUP	59	104	8,666	0.0
INVESTORE PROPERTY LTD	21	30	2,522	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	783	1,079	89,105
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	—	<0.5%>
(香港)		千香港ドル		
LINK REIT	323	16,838	245,668	1.4
CHAMPION REIT	310	1,305	19,041	0.1
PROSPERITY REIT	178	562	8,206	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	148	624	9,112	0.1
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	115	239	3,489	0.0
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	153	719	10,491	0.1
FORTUNE REIT	205	1,847	26,948	0.1
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	137	431	6,296	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,569	22,567	329,255
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	—	<1.8%>
(シンガポール)		千シンガポールドル		
SUNTEC REIT	362	614	49,294	0.3
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	305	458	36,721	0.2
KEPPEL REIT	263	267	21,414	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST	84	108	8,662	0.0
ASCOTT RESIDENCE TRUST	126	149	12,006	0.1
CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	180	101	8,174	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS	89	124	9,983	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	77	156	12,549	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	190	144	11,575	0.1
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	215	229	18,380	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	99	141	11,359	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	82	105	8,467	0.0
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	83	113	9,058	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	255	98	7,875	0.0
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	59	143	11,504	0.1
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	177	292	23,476	0.1
CACHE LOGISTICS TRUST	127	103	8,296	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	264	390	31,320	0.2
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	135	81	6,492	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	110	41	3,306	0.0
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	121	85	6,886	0.0
MAPLETREE GREATER CHINA COMM	264	253	20,315	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	97	63	5,054	0.0
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	76	53	4,264	0.0
QUE HOSPITALITY TRUST	160	109	8,812	0.0

銘柄	口数	当 期 末		
		評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)	千口	千シンガポールドル	千円	%
SPH REIT	105	102	8,176	0.0
KEPPEL DC REIT	112	135	10,821	0.1
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	165	154	12,366	0.1
CAPITALAND MALL TRUST	397	768	61,594	0.3
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	346	832	66,699	0.4
小 計	口数・金額	5,134	6,423	514,913
	銘柄数 < 比率 >	30	—	<2.9%>
(イスラエル)			千イスラエルシェケル	
REIT 1 LTD	26	297	8,905	0.0
小 計	口数・金額	26	297	8,905
	銘柄数 < 比率 >	1	—	<0.0%>
合 計	口数・金額	17,730	—	17,775,865
	銘柄数 < 比率 >	321	—	<98.5%>

(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、親投資信託の純資産総額に対する評価額の比率。

## 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 組 入 比 率	株 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

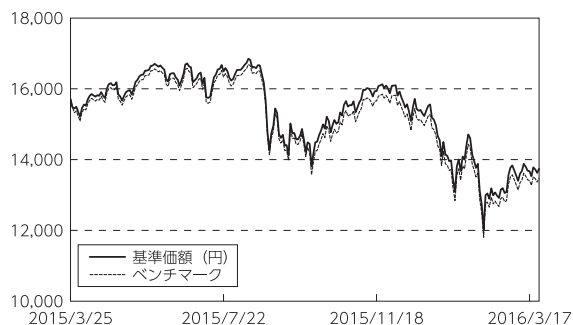
#### ◎基準価額の動き

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)	
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	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>				
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	
<b>鉱業 (0.3%)</b>				
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	
<b>建設業 (3.2%)</b>				
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	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	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	
<b>食料品 (5.0%)</b>				
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
<b>繊維製品 (0.7%)</b>			
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	
<b>パルプ・紙 (0.3%)</b>				
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	
<b>化学 (6.1%)</b>				
クラレ	185	177.4	235,587	
旭化成	678	701	510,468	
共和レザー	7.1	7.4	6,578	
コープケミカル	16	—	—	
昭和電工	723	749	84,637	
住友化学	800	828	424,764	
日本化成	20	21	2,499	
住友精化	23	23	14,536	
日産化学工業	71.3	67.6	196,580	
ラサ工業	41	42	4,620	
クレハ	76	85	30,005	
多木化学	7	7	4,697	
テイカ	18	19	10,374	
石原産業	182	202	15,554	
片倉コープアグリ	7	14	3,318	

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ゼリア新薬工業	22.2	23	34,132	
第一三共	365.4	378.1	957,160	
キョーリン製薬ホールディングス	29	30	64,980	
大幸薬品	4.8	5.5	7,612	
ダイト	4.4	4.7	13,921	
大塚ホールディングス	215.6	241.7	1,005,472	
大正製薬ホールディングス	26.1	27	243,810	
ペプチドリーム	—	13.8	82,524	
<b>石油・石炭製品 (0.5%)</b>				
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	
<b>ゴム製品 (1.0%)</b>				
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	
<b>ガラス・土石製品 (0.9%)</b>				
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	
<b>鉄鋼 (1.2%)</b>				
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	
<b>非鉄金属 (0.8%)</b>				
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	
<b>金属製品 (0.7%)</b>				
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	
<b>機械 (4.6%)</b>				
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	
掘場製作所	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	
<b>輸送用機器 (9.9%)</b>				
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	
<b>精密機器 (1.6%)</b>				
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	
<b>その他製品 (1.6%)</b>				
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	
<b>電気・ガス業 (2.1%)</b>				
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	
<b>陸運業 (4.6%)</b>				
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	
<b>海運業 (0.2%)</b>				
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	
<b>空運業 (0.7%)</b>				
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	
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>				
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	
<b>情報・通信業 (8.2%)</b>				
NECネットエスアイ	12.8	13.3	24,339	
システナ	10	10.3	17,849	
デジタルアーツ	5.5	5.2	12,084	
新日鉄住金ソリューションズ	8.5	17.7	39,506	
キューブシステム	4.4	4.6	3,289	
コア	4.3	4.5	6,786	
ソフトクリエイトホールディングス	3.3	3.8	3,138	
ITホールディングス	33.9	35.1	91,856	
ネオス	2.7	3.1	1,608	
電算システム	3.5	3.7	6,019	
グリー	62	64.3	37,744	
コーエーテクモホールディングス	23.1	25.1	45,255	
三菱総合研究所	4	4.1	14,657	
ボルテージ	1.8	2.1	2,610	
電算	1.1	1.2	2,988	
AGS	1.7	1.8	1,776	
ファインデックス	1.5	7	8,890	
ヒト・コミュニケーションズ	1.4	2.4	4,860	
ブレインパッド	1.5	1.6	1,161	
KL a b	10.8	16.4	10,348	
ポルトウウィン・ビットクルーホールディ	6.7	7	6,405	
イーブックイニシアティブジャパン	2.3	2.3	1,474	
ネクソン	97.3	101.3	191,659	
アイスタイル	4.3	16.1	17,597	
エムアップ	2.7	2.7	1,674	
エイチーム	1.2	3.9	6,372	
テクノスジャパン	—	1.1	3,685	
e n i s h	2.7	3.1	1,918	
コロブラ	18	29.4	69,795	

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

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



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

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
NSD	23.9	22.5	38,227
コナミホールディングス	41.6	47.8	146,746
福井コンピュータホールディングス	2.8	2.3	2,757
J BCC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
<b>卸売業 (4.3%)</b>			
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	
SPK	2.2	2.4	4,963	
萩原電気	2.8	2.7	5,467	
アズワン	7.3	8.3	34,818	
スズデン	3.3	3.4	3,852	
尾家産業	3.3	3.4	3,151	
シモジマ	6.3	7.3	8,285	
ドウシシャ	13.2	12.5	27,275	
小津産業	2	2.3	5,135	
高速	6.1	6.3	5,556	
たけびし	3.6	3.7	3,751	
黒田電気	17.2	19.7	34,140	
丸文	9	9.4	7,463	
ハビネット	6.2	9.6	9,753	
橋本総業	1.9	2.2	3,473	
エクセル	4.7	5.1	7,252	
マルカキカイ	3.3	3.4	5,205	
ガリバーインターナショナル	31	28.5	37,306	
日本エム・ディ・エム	8.5	8.8	5,350	
進和	6	6.2	9,262	
エスケイジャパン	2.6	2.6	1,016	
ダイトエレクトロン	4.7	4.8	3,628	
シークス	6.5	6.7	23,282	
田中商事	3.1	3.2	2,121	
オーハシテクニカ	6.3	6	7,512	

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
クオール	10.4		10.8	18,565
ジェイアイエヌ	7		7.2	31,032
ビックカメラ	44.4		54.7	55,356
DCMホールディングス	49.5		52.1	43,034
MonotaRO	20		37.4	119,680
東京一番フーズ	—		1.8	1,107
ダイヤモンドダイニング	—		1.7	1,700
きちり	2		2.8	1,867
アークランドサービス	1.2		3.3	9,966
J. フロント リテイリング	129.6		134.1	193,908
ドトール・日レスホールディングス	17.9		18.6	34,503
マツモトキヨシホールディングス	22.9		21.9	130,305
ブロンコビリー	1.8		4.1	10,754
スタートトゥデイ	31.9		32.2	145,383
トレジャー・ファクトリー	0.9		3	3,456
物語コーポレーション	2.9		2.8	15,512
ココカラファイン	10.7		11	54,175
三越伊勢丹ホールディングス	203.5		210.7	278,966
ウエルシアホールディングス	9.2		9.2	59,800
クリエイトSDホールディングス	5		15.6	43,898
丸善CHIホールディングス	11.9		12.4	4,451
ミサワ	—		1.2	637
エー・ピーカンパニー	1.4		1.7	1,968
チムニー	1.9		2.6	7,677
シュッピン	—		3	3,573
ネクステージ	1		1.7	933
ジョイフル本田	5.6		17.2	43,378
キリン堂ホールディングス	3.3		3.4	3,468
ホットランド	—		2.8	3,318
すかいらーく	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
P L A N T	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
Mr M a x	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
C F S 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
パルコ	9.8	10.1	9,201
丸井グループ	123.2	130	204,360
アクシアル リテイリング	7.9	8.2	30,750
井筒屋	55	57	3,135
イオン	422.3	436	716,348
ユニグループ・ホールディングス	98	101.4	81,018
イズミ	22.9	21	101,535
東武ストア	13	13	3,731
平和堂	20.7	21.5	52,911
フジ	11.4	11.8	27,199
ヤオコー	5.8	12	58,620
ゼビオホールディングス	13.9	14.4	26,020
ケーズホールディングス	23.6	22.4	87,808
O l y m p i c 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
元氣寿司	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	
<b>銀行業 (7.5%)</b>				
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	
<b>証券、商品先物取引業 (1.1%)</b>				
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
<b>保険業 (2.4%)</b>				
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	
<b>その他金融業 (1.4%)</b>				
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	
<b>不動産業 (2.8%)</b>				
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	
<b>サービス業 (3.8%)</b>				
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	
ファンコムコミュニケーションズ	18.7	25.9	21,652	
ジェイコムホールディングス	2.5	2.3	6,074	
PGMホールディングス	15.3	—	—	
WDBホールディングス	3.9	4	4,100	
ティア	2.9	4.7	3,026	
バリューコマース	8.9	10.4	3,910	
インフォマート	—	16.2	16,572	
J Pホールディングス	26.9	27.8	9,424	
E P Sホールディングス	13.6	12.5	17,562	
レッグス	—	1.6	1,072	
プレスステージ・インターナショナル	8.2	9.4	12,248	
アミューズ	3.3	3.1	14,275	
ドリームインキュベータ	3.5	3.7	9,009	
クイック	3.7	5.7	4,628	
TAC	5.4	6.2	1,233	
ケネディクス	154	150.5	73,293	
電通	120.8	125	700,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4.2	5.3	2,528	
びあ	3.2	3.3	6,999	
イオンファンタジー	3.5	3.9	8,556	
シーティーエス	—	2.5	1,985	
ネクシィーズ	3.9	4	3,600	
みらかホールディングス	28.5	28.6	135,707	
アルプス技研	4.3	4.1	9,430	

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

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

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

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

### 先物取引の銘柄別期末残高

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

## ○有価証券の貸付及び借入の状況

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

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

## ○投資信託財産の構成

(2016年3月25日現在)

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

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年3月25日現在)

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

## ○損益の状況

(2015年3月26日～2016年3月25日)

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

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

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

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

<注記事項>

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

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

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

【お知らせ】

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

## 外国株式インデックスマザーファンド

### 《第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	信 託 券 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	2.2
5月末	23,848	3.4	167.17	3.0	94.8	1.2	2.2	2.2
6月末	22,902	△ 0.7	160.34	△ 1.2	96.0	1.8	2.2	2.2
7月末	23,546	2.1	164.73	1.5	98.2	1.1	2.3	2.3
8月末	21,677	△ 6.0	151.30	△ 6.8	94.5	3.0	2.4	2.4
9月末	20,196	△12.4	140.71	△13.3	95.4	2.3	2.5	2.5
10月末	22,402	△ 2.9	155.86	△ 4.0	95.1	1.4	2.5	2.5
11月末	22,647	△ 1.8	157.46	△ 3.0	94.8	5.3	2.4	2.4
12月末	22,114	△ 4.1	153.40	△ 5.5	94.3	3.8	2.5	2.5
2016年1月末	20,152	△12.6	139.74	△13.9	95.2	2.3	2.6	2.6
2月末	19,318	△16.2	133.62	△17.7	95.4	2.1	2.6	2.6
3月末	20,436	△11.4	141.17	△13.0	99.9	2.3	2.8	2.8
4月末	20,342	△11.8	140.05	△13.7	94.9	3.0	2.6	2.6
(期 末) 2016年5月12日	19,726	△14.5	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7	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

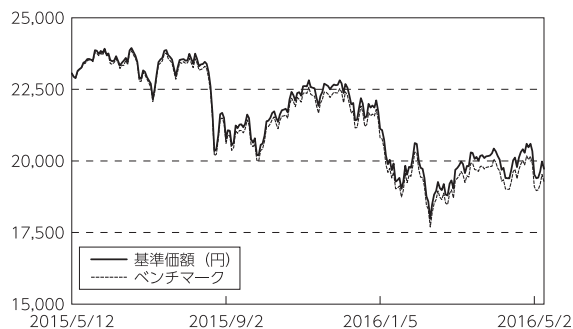
#### ◎基準価額の動き

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。





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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	136	204	255	31,656	運輸	
HUGO BOSS AG -ORD	39	55	309	38,286	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE POST AG-REG	574	801	2,117	262,204	運輸	
SAP SE	546	812	5,541	686,046	ソフトウェア・サービス	
CELESIO AG	31	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	129	181	773	95,727	メディア	
DEUTSCHE BOERSE AG	114	159	1,215	150,532	各種金融	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	129	180	1,353	167,604	ヘルスケア機器・サービス	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	22	34	174	21,612	運輸	
ADIDAS AG	123	173	1,960	242,706	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,881	2,669	4,176	517,039	電気通信サービス	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	102	137	2,181	270,083	保険	
THYSSENKRUPP AG	270	305	581	72,000	素材	
BEIERSDORF AG	58	82	657	81,376	家庭用品・パーソナル用品	
HEIDELBERGCEMENT AG	84	116	883	109,365	素材	
MERCK KGAA	77	106	858	106,315	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VOLKSWAGEN AG-PREF	96	153	1,998	247,389	自動車・自動車部品	
LANXESS AG	53	75	334	41,392	素材	
FRESENIUS SE & CO KGAA	224	315	2,044	253,173	ヘルスケア機器・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	171	279	760	94,121	不動産	
GEA GROUP AG	109	150	608	75,315	資本財	
SYMRISE AG	73	102	584	72,372	素材	
K+S AG-REG	102	158	355	44,066	素材	
HENKEL AG & CO KGAA	68	85	775	95,956	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	73	102	443	54,900	ソフトウェア・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	32	44	309	38,288	自動車・自動車部品	
HANNOVER RUECK SE	35	49	477	59,157	保険	
BRENNTAG AG	92	127	609	75,516	資本財	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	12	—	—	—	メディア	
AXEL SPRINGER SE	24	37	187	23,168	メディア	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	40	57	212	26,257	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	347	625	285	35,341	電気通信サービス	
OSRAM LICHT AG	52	73	337	41,728	資本財	
VONOVIA SE	203	386	1,174	145,390	不動産	
EVONIK INDUSTRIES AG	—	114	331	41,005	素材	
ZALANDO SE	—	69	206	25,546	小売	
小 計	株 数	金 額	12,785	18,327	77,453	9,589,511
銘柄 数 < 比率 >	52	52	—	—	—	< 3.6% >
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	692	961	1,260	156,119	保険	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	2,544	—	—	—	銀行	
INTESA SANPAOLO	7,501	10,499	2,368	293,275	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	5,980	9,508	805	99,707	電気通信サービス	
ENI SPA	1,505	2,105	2,827	350,055	エネルギー	
UNICREDIT SPA	2,601	3,948	1,120	138,745	銀行	
ENEL SPA	3,904	6,331	2,513	311,218	公益事業	
SAIPEM SPA	160	4,956	181	22,465	エネルギー	
ATLANTIA SPA	246	342	823	101,976	運輸	
INTESA SANPAOLO-RSP	556	762	165	20,505	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	99	139	664	82,317	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	360	466	298	37,009	各種金融	
SNAM SPA	1,246	1,760	930	115,227	公益事業	

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

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
PUBLICIS GROUPE	111	156	982	121,689	メディア
LAGARDERE SCA	71	95	202	25,118	メディア
JC DECAUX SA	40	61	218	27,078	メディア
SOCIETE BIC SA	17	23	294	36,493	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	99	167	487	60,359	資本財
THALES SA	54	86	666	82,567	資本財
PERNOD RICARD SA	125	175	1,679	207,901	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	610	874	795	98,490	銀行
ENGIE	860	1,215	1,595	197,600	公益事業
ALSTOM	127	128	284	35,219	資本財
ARKEMA	39	55	396	49,122	素材
LEGRAND SA	157	220	1,074	133,056	資本財
SCOR SE	91	126	371	45,943	保険
ADP	17	24	263	32,653	運輸
EDF	145	201	228	28,335	公益事業
NATIXIS	554	779	327	40,543	銀行
WENDEL	18	23	247	30,634	各種金融
BUREAU VERITAS SA	157	221	446	55,337	商業・専門サービス
EURAZEO	22	32	202	25,084	各種金融
EURAZEO-NEW	1	—	—	—	各種金融
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	179	255	386	47,864	公益事業
ILIAD SA	15	21	426	52,751	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	92	141	384	47,600	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	282	393	442	54,794	運輸
EDENRED	120	172	295	36,566	商業・専門サービス
REMY COINTREAU	14	19	140	17,357	食品・飲料・タバコ
REXEL SA	163	255	335	41,582	資本財
BOLLORE	511	711	239	29,617	運輸
NUMERICABLE-SFR	58	91	252	31,274	電気通信サービス
小 計	株数	金額	77,814	9,634,233	
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		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円		
GALP ENERGIA SGPS SA	227	383	451	55,924		エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	22,857	38,374	1,453	179,990	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.1% >	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	153,656	225,438	258,756	32,036,661	
	銘柄 数 < 比 率 >	237	230	—	< 11.9% >	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC	9,750	13,882	2,271	355,493		銀行
BP PLC	10,812	15,163	5,476	857,241		エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	33,849	47,240	3,103	485,714		銀行
ASTRAZENECA PLC	748	1,045	4,110	643,391		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC	235	326	358	56,078		資本財
NEXT PLC	90	120	640	100,321		小売
DIAGEO PLC	1,490	2,080	3,922	613,952		食品・飲料・タバコ
SKY PLC	611	856	796	124,729		メディア
BAE SYSTEMS PLC	1,867	2,614	1,282	200,685		資本財
UNILEVER PLC	760	1,060	3,341	523,004		家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC	4,811	6,742	1,074	168,167		食品・生活必需品小売り
RELX PLC	671	920	1,130	177,002		メディア
MARKS & SPENCER GROUP PLC	966	1,348	563	88,208		小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	383	526	3,612	565,489		家庭用品・パーソナル用品
PRUDENTIAL PLC	1,521	2,127	2,781	435,312		保険
BG GROUP PLC	2,023	—	—	—		エネルギー
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,519	4,916	1,066	166,975		保険
SAGE GROUP PLC/THE	637	893	535	83,815		ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	11,377	16,192	6,981	1,092,761		銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,105	1,542	6,548	1,024,965		食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	406	581	550	86,227		公益事業
SCHRODERS PLC	74	102	252	39,525		各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,501	2,873	614	96,116		銀行
BHP BILLITON PLC	1,250	1,747	1,461	228,824		素材
IMPERIAL BRANDS PLC	567	793	3,015	472,056		食品・飲料・タバコ
WPP PLC	778	1,070	1,713	268,132		メディア
CENTRICA PLC	2,950	4,221	886	138,743		公益事業
BT GROUP PLC	4,824	7,008	3,062	479,275		電気通信サービス
SSE PLC	587	839	1,270	198,906		公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	1,464	2,708	1,346	210,814		銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,117	1,520	1,001	156,737		資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF C	158,293	112,647	11	1,763		資本財
COMPASS GROUP PLC	987	1,358	1,699	266,069		消費者サービス
KINGFISHER PLC	1,400	1,891	686	107,467		小売
PEARSON PLC	486	678	548	85,816		メディア
SEVERN TRENT PLC	144	203	453	70,994		公益事業
RIO TINTO PLC	753	1,025	2,083	326,161		素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,881	4,027	5,940	929,766		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SABMILLER PLC	573	803	3,398	531,888		食品・飲料・タバコ
PROVIDENT FINANCIAL PLC	—	121	338	53,053		各種金融
3I GROUP PLC	582	793	378	59,256		各種金融
GKN PLC	968	1,415	396	62,118		自動車・自動車部品
VODAFONE GROUP PLC	15,710	21,964	4,882	764,255		電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	1,256	1,835	347	54,409		食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	721	1,109	291	45,685		食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	2,370	3,343	1,415	221,612		保険

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
CAPITA PLC	394	552	605	94,698	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC	588	806	334	52,320	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	122	159	460	72,090	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	609	841	403	63,187	保険
WHITBREAD PLC	108	150	591	92,514	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	2,230	3,112	3,103	485,719	公益事業
ARM HOLDINGS PLC	831	1,162	1,100	172,192	半導体・半導体製造装置
WOLSELEY PLC	155	210	825	129,143	資本財
BUNZL PLC	199	277	578	90,475	資本財
COBHAM PLC	670	976	157	24,708	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	825	1,160	716	112,109	素材
INTERTEK GROUP PLC	95	134	448	70,198	商業・専門サービス
WILLIAM HILL PLC	518	725	221	34,740	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	265	367	429	67,293	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	140	171	463	72,557	消費者サービス
CARNIVAL PLC	107	156	563	88,196	消費者サービス
PERSIMMON PLC	180	252	494	77,330	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	483	641	263	41,275	資本財
ICAP PLC	332	455	211	33,043	各種金融
ITV PLC	2,282	3,161	680	106,551	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	185	258	667	104,492	各種金融
G4S PLC	933	1,293	249	39,085	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS	—	107	310	48,651	耐久消費財・アパレル
AMEC FOSTER WHEELER PLC	228	—	—	—	エネルギー
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	—	826	432	67,755	耐久消費財・アパレル
IMI PLC	160	225	222	34,870	資本財
REXAM PLC	417	590	371	58,090	素材
SMITH & NEPHEW PLC	531	740	856	134,045	ヘルスケア機器・サービス
TATE & LYLE PLC	276	394	240	37,602	食品・飲料・タバコ
TAYLOR WIMPEY PLC	—	2,685	482	75,505	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,318	3,260	5,655	885,192	エネルギー
PETROFAC LTD	153	209	171	26,912	エネルギー
TRAVIS PERKINS PLC	145	205	373	58,414	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,446	3,280	5,732	897,187	エネルギー
OLD MUTUAL PLC	2,904	4,078	701	109,787	保険
INVESTEC PLC	327	470	226	35,413	各種金融
STANDARD LIFE PLC	1,166	1,628	520	81,408	保険
EXPERIAN PLC	587	799	1,011	158,360	商業・専門サービス
MONDI PLC	—	302	408	63,970	素材
WEIR GROUP PLC/THE	125	181	202	31,759	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	211	294	914	143,084	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC	233	317	135	21,182	素材
TULLOW OIL PLC	532	—	—	—	エネルギー
SHIRE PLC	349	490	2,053	321,403	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INMARSAT PLC	251	374	300	46,960	電気通信サービス
ADMIRAL GROUP PLC	117	174	334	52,426	保険
FRESNILLO PLC	130	178	191	29,992	素材
RANDGOLD RESOURCES LTD	51	76	469	73,409	素材
AGGREKO PLC	151	207	218	34,260	商業・専門サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	148	208	201	31,496	商業・専門サービス
ST JAMES' S PLACE PLC	—	434	376	58,983	保険
GLENCORE PLC	6,585	10,122	1,385	216,827	素材

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	551	759	202	31,755	各種金融	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	140	215	271	42,558	各種金融	
CRODA INTERNATIONAL PLC	79	113	341	53,383	素材	
MELROSE INDUSTRIES PLC	584	—	—	—	資本財	
COCA-COLA HBC AG-DI	115	165	231	36,253	食品・飲料・タバコ	
EASYJET PLC	96	141	210	32,992	運輸	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	886	1,127	427	66,859	保険	
ROYAL MAIL PLC	382	743	370	57,943	運輸	
ASHTREAD GROUP PLC	300	416	374	58,567	資本財	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	165	236	89	13,935	小売	
MERLIN ENTERTAINMENT	418	587	253	39,674	消費者サービス	
TUI AG-DI	269	410	432	67,656	消費者サービス	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	—	304	266	41,705	ヘルスケア機器・サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC	—	792	302	47,320	ソフトウェア・サービス	
WORLDPAY GROUP PLC	—	1,170	307	48,199	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 銘柄 数 < 比 率 >	325,695 104	353,365 109	129,802 —	20,316,680 <7.5%>	
(スイス)			千スイスフラン			
NESTLE SA-REG	1,912	2,637	19,187	2,141,894	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	309	431	2,684	299,657	耐久消費財・アパレル	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	904	1,487	2,034	227,107	各種金融	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	135	376	1,660	185,328	素材	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	416	581	14,184	1,583,383	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GIVAUDAN-REG	5	7	1,473	164,515	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	31	44	602	67,216	ヘルスケア機器・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	88	124	2,686	299,863	保険	
SYNGENTA AG-REG	55	76	3,012	336,333	素材	
LONZA GROUP AG-REG	31	43	739	82,558	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	29	40	257	28,722	耐久消費財・アパレル	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	26	36	643	71,778	資本財	
GEBERIT AG-REG	22	31	1,154	128,925	資本財	
SWISS RE AG	208	290	2,527	282,098	保険	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	18	25	822	91,852	耐久消費財・アパレル	
PARGESA HOLDING SA-BR	19	27	173	19,334	各種金融	
NOVARTIS AG-REG	1,364	1,882	13,788	1,539,227	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	101	137	808	90,222	商業・専門サービス	
SWISSCOM AG-REG	13	21	1,035	115,627	電気通信サービス	
ABB LTD-REG	1,302	1,819	3,681	410,990	資本財	
SGS SA-REG	3	4	951	106,256	商業・専門サービス	
SULZER AG-REG	13	11	100	11,195	資本財	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	12	16	295	32,965	資本財	
ACTELION LTD-REG	60	84	1,329	148,460	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	32	44	605	67,589	運輸	
BALOISE HOLDING AG - REG	28	40	476	53,222	保険	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	18	26	639	71,426	保険	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.06	0.09	648	72,441	食品・飲料・タバコ	
ARYZTA AG	52	74	282	31,577	食品・飲料・タバコ	
JULIUS BAER GROUP LTD	133	185	729	81,450	各種金融	
SIKA AG-BR	1	1	745	83,236	素材	
TRANSOCEAN LTD	211	—	—	—	エネルギー	
SWISS PRIME SITE-REG	34	55	469	52,402	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.55	0.81	491	54,885	食品・飲料・タバコ	

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(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	3,595	4,588	47,964	636,971	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	< 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	2,739	4,067	130,011	2,163,383	
	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	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	51,397	76,974	225,171	3,145,651	
	銘柄 数 < 比 率 >	39	39	—	< 1.2% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,794	2,561	2,133	169,193	銀行	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	972	1,344	520	41,266	メディア	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	590	801	213	16,961	資本財	
CAPITALAND LTD	1,530	2,156	642	50,955	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	250	360	289	22,955	不動産	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	64	97	330	26,179	小売	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,040	1,461	2,143	169,984	銀行	
KEPPEL CORP LTD	870	1,208	618	49,052	資本財	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	773	1,071	1,880	149,156	銀行	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	950	1,357	428	34,009	資本財	



銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,762	6,613	2,539	201,417	電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	343	479	558	44,294	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	500	671	500	39,699	各種金融	
SEMBCORP MARINE LTD	500	660	100	7,956	資本財	
UOL GROUP LTD	290	391	219	17,396	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,230	1,810	503	39,907	運輸	
NOBLE GROUP LTD	2,710	4,185	146	11,619	資本財	
STARHUB LTD	400	565	187	14,832	電気通信サービス	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	4,393	6,110	223	17,689	食品・飲料・タバコ	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,150	1,606	528	41,905	食品・飲料・タバコ	
GENTING SINGAPORE PLC	3,700	4,988	379	30,065	消費者サービス	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	1,880	2,640	465	36,955	不動産	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	1,150	1,726	155	12,320	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	31,844	44,863	15,707	1,245,773	
	銘柄 数 < 比 率 >	23	23	—	<0.5%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
ISRAEL CHEMICALS LTD	258	406	668	19,270	素材	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	510	755	15,128	436,310	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BANK HAPOLIM BM	616	877	1,704	49,143	銀行	
NICE SYSTEMS LTD	34	48	1,179	34,021	ソフトウェア・サービス	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	777	1,161	1,620	46,732	銀行	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	1	—	—	—	素材	
DELEK GROUP LTD	2	3	275	7,956	エネルギー	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	1,127	1,607	1,301	37,546	電気通信サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	80	120	517	14,938	銀行	
AZRIELI GROUP	—	31	481	13,874	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,409	5,013	22,877	659,793	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.2%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	846,139	1,109,747	—	255,005,772	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,258	1,260	—	<94.4%>	

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

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

外国投資信託証券

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

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		9	13	370	31,252	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	17	29	792	66,802	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	3	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		1	2	359	44,485	0.0
KLEPIERRE		10	18	744	92,180	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		5	8	1,913	236,890	0.1
FONCIERE DES REGIONS		1	2	202	25,025	0.0
ICADE		2	2	186	23,084	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	21	34	3,405	421,666	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.2% >	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		57	80	583	91,374	0.0
HAMMERSON PLC		46	65	377	59,117	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		46	65	752	117,785	0.0
INTU PROPERTIES PLC		54	78	229	35,967	0.0
SEGRO PLC		44	62	262	41,163	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	249	351	2,206	345,408	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.1% >	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		90	285	976	78,011	0.0
SCENTRE GROUP		316	446	2,054	164,143	0.1
NOVION PROPERTY GROUP		132	—	—	—	—
GPT GROUP		102	153	800	63,994	0.0
MIRVAC GROUP		226	317	620	49,577	0.0
STOCKLAND		141	202	929	74,289	0.0
WESTFIELD CORP		117	165	1,779	142,238	0.1
DEXUS PROPERTY GROUP		57	83	711	56,893	0.0
GOODMAN GROUP		104	149	1,082	86,470	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,289	1,803	8,955	715,618	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	8	—	< 0.3% >	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		135	186	8,653	120,890	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	135	186	8,653	120,890	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		143	211	349	27,703	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		131	172	240	19,107	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		146	215	446	35,411	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		122	183	446	35,441	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	542	784	1,483	117,664	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.0% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	2,847	4,083	—	7,251,695	
	銘柄 数 < 比 率 >	60	61	—	< 2.7% >	

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

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

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

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

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

(注) 期末における外貨建純資産(269,579,000千円)の投資信託財産総額(270,164,641千円)に対する比率は99.8%です。

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

1 アメリカドル=108.37円	1 カナダドル=84.33円	1 ユーロ=123.81円	1 イギリスポンド=156.52円
1 スイスフラン=111.63円	1 スウェーデンクローネ=13.33円	1 ノルウェークローネ=13.28円	1 デンマーククローネ=16.64円
1 オーストラリアドル=79.91円	1 ニュージーランドドル=74.03円	1 香港ドル=13.97円	1 シンガポールドル=79.31円
1 イスラエルシェゲル=28.84円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

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

<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	期中率	期騰落	期中率				
	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	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

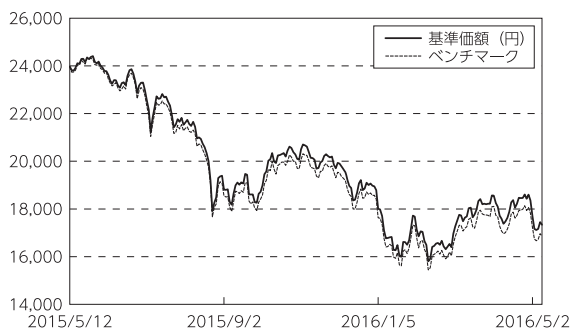
## ◎基準価額の動き

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。



		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	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	
(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	787	24,711	電気通信サービス
VALE SA-PREF	589	729	534	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 素材
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	運輸 各種金融
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	素材
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	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	
(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	12,252	14,199	12,596	462,428	
	銘柄 数 < 比 率 >	25	24	—	< 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	201	211	13,579	62,191	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 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	311	363	270,163	105,904	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 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	6,642	7,413	14,905	416,911	
	銘柄 数 < 比 率 >	24	23	—	< 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	株数	当 期 末			業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
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	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	
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
GEEELY 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 AUTOMOBILI-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	57,687	69,289	40,959	1,104,686	
	銘柄数<比率>	42	44	—	<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	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		
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 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 銘柄数<比率>	234,362	272,506	1,155,316	3,847,205	
		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	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	
REMORO LTD	364	420	10,351	74,636	各種金融	

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	
(南アフリカ)	百株	百株	千円	千円		
PPC LTD	410	—	—	—	—	素材
NETCARE LTD	734	810	2,837	20,461	20,461	ヘルスケア機器・サービス
NASPERS LTD-N SHS	300	347	68,785	495,941	495,941	メディア
MTN GROUP LTD	1,259	1,450	19,163	138,166	138,166	電気通信サービス
MASSMART HOLDINGS LTD	86	98	1,195	8,619	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	15,385	小売
INVESTEC LTD	186	214	2,216	15,981	15,981	各種金融
FIRSTSTRAND LTD	2,552	2,941	12,608	90,910	90,910	各種金融
THE FOSCHINI GROUP LTD	154	185	2,698	19,455	19,455	小売
EXXARO RESOURCES LTD	101	121	865	6,237	6,237	エネルギー
BIDVEST GROUP LTD	244	279	10,021	72,255	72,255	資本財
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	258	369	5,087	36,681	36,681	銀行
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	75	—	—	—	—	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	258	299	9,496	68,466	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	26,825	保険
VODACOM GROUP LTD	271	325	5,450	39,300	39,300	電気通信サービス
PICK N PAY STORES LTD	165	216	1,653	11,920	11,920	食品・生活必需品小売り
MMI HOLDINGS LTD	860	940	2,105	15,181	15,181	保険
SPAR GROUP LIMITED/THE	121	145	3,108	22,409	22,409	食品・生活必需品小売り
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	520	565	2,316	16,701	16,701	保険
LIBERTY HOLDINGS LTD	95	95	1,258	9,075	9,075	保険
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	680	821	3,118	22,483	22,483	ヘルスケア機器・サービス
MR PRICE GROUP LTD	177	213	3,827	27,595	27,595	小売
ASSORE LTD	23	—	—	—	—	素材
SIBANYE GOLD LTD	—	622	3,297	23,772	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	10,358	各種金融
BRAIT SE	240	296	4,413	31,822	31,822	各種金融
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	295	295	763	5,502	5,502	消費者サービス
PSG GROUP LTD	—	74	1,352	9,749	9,749	各種金融
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	—	29	1,650	11,903	11,903	銀行
PIONEER FOODS GROUP LTD	—	107	1,795	12,943	12,943	食品・飲料・タバコ
FORTRESS INCOME FUND LTD	—	611	2,235	16,119	16,119	不動産
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	—	798	1,221	8,808	8,808	不動産
NEW EUROPE PROPERTY INVEST	—	197	3,538	25,515	25,515	不動産
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	—	2,523	22,284	160,667	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 マレーシアリングギット=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)

## 日本債券インデックスマザーファンド

### 《第15期》決算日2016年5月12日

〔計算期間：2015年5月13日～2016年5月12日〕

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第15期の決算を行いました。  
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

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

### ○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		NOMURA-BPI 総 合 イン デ ッ ク ス		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	円	騰 落 中 率		騰 落 中 率			
11期(2012年5月14日)	11,862	2.8	340.97	2.8	99.4	0.1	203,547
12期(2013年5月13日)	12,036	1.5	345.99	1.5	98.9	0.8	269,276
13期(2014年5月12日)	12,299	2.2	353.58	2.2	99.4	0.2	283,162
14期(2015年5月12日)	12,572	2.2	361.38	2.2	99.4	0.3	343,834
15期(2016年5月12日)	13,473	7.2	387.29	7.2	99.6	—	529,456

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I 総 合 イ ン デ ッ ク ス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年5月12日	円	%		%	%	%
	12,572	—	361.38	—	99.4	0.3
5月末	12,620	0.4	362.77	0.4	99.2	0.4
6月末	12,613	0.3	362.54	0.3	99.5	0.3
7月末	12,649	0.6	363.58	0.6	99.3	0.4
8月末	12,670	0.8	364.20	0.8	99.3	0.4
9月末	12,707	1.1	365.24	1.1	99.0	0.1
10月末	12,755	1.5	366.65	1.5	98.9	0.1
11月末	12,754	1.4	366.58	1.4	99.4	0.1
12月末	12,832	2.1	368.88	2.1	99.4	—
2016年1月末	12,991	3.3	373.52	3.4	99.0	0.1
2月末	13,214	5.1	379.83	5.1	98.8	0.3
3月末	13,320	5.9	382.91	6.0	101.6	0.1
4月末	13,437	6.9	386.25	6.9	99.8	—
(期 末) 2016年5月12日						
	13,473	7.2	387.29	7.2	99.6	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

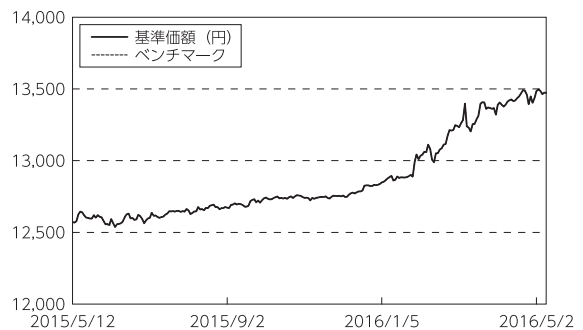
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ7.2%の上昇となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(7.2%)とほぼ同程度となりました。

## 基準価額の推移



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

## ●投資環境について

## ◎国内債券市況

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

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
- ・なお、期末時点では、資金フロー対応のため、債券先物のポジションは保有しておりません。
- ・ベンチマーク（NOMURA-BPI総合インデックス）の構成銘柄を種別や年限などの属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました\*。

\*一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

## ●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは7.2%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度と低水準に抑制し、高い運動性を維持しました。

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

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

## ◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

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

## ◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

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

## ◎その他の要因

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

## ◎今後の運用方針

- ・ベンチマークであるNOMURA-BPI総合インデックスに連動する成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を公社債（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持します。
- ・組入銘柄の見直しと投資比率の調整を適宜行い、種別構成比についてもベンチマークの比率に近づけるように運用します。



## ○1万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016年5月12日)

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2015年5月13日～2016年5月12日)

## 公社債

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

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

## 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債券先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
		11,739	12,952	—	—

## ○利害関係人との取引状況等

(2015年5月13日～2016年5月12日)

## 利害関係人との取引状況

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

(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

## 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
<b>国債証券</b>	%	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
<b>国債証券</b>	%	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
<b>国債証券</b>	%	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
<b>国債証券</b>	%	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
<b>国債証券</b>	%	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
<b>国債証券</b>	%	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	
<b>地方債証券</b>				
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
<b>地方債証券</b>	%	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
<b>地方債証券</b>		%	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
<b>地方債証券</b>		%	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	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>					
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
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	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
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円	
第13回道路債券(財投機関債)	2.28	200,000	228,644	2022/9/20
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.87	30,000	47,873	2046/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.75	100,000	156,430	2047/3/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.67	130,000	200,379	2047/3/20
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.39	60,000	74,791	2027/7/20
第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.82	200,000	204,994	2017/9/20
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.34	100,000	124,568	2027/10/20
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.61	100,000	102,956	2018/3/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.42	300,000	379,848	2028/6/20
第42回道路債券(財投機関債)	2.22	130,000	154,186	2025/3/21
第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.63	100,000	104,169	2018/12/20
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.41	150,000	191,812	2029/4/20
第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.14	50,000	62,980	2030/5/10
第71回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.17	100,000	105,862	2021/6/18
第73回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.14	100,000	105,709	2021/6/18
第78回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.08	100,000	105,907	2021/12/20
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.9	50,000	62,296	2032/3/19
第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.711	100,000	121,765	2032/6/18
第92回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.834	110,000	115,425	2022/6/20
第96回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.796	300,000	314,700	2022/9/20
第100回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.784	100,000	104,972	2022/12/20
第101回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.781	100,000	104,952	2022/12/20
第110回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.94	300,000	319,131	2023/6/20
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.85	200,000	211,478	2023/6/20
第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.77	100,000	105,416	2023/12/20
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.974	100,000	140,439	2055/3/19
第1回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.648	100,000	105,090	2019/6/28
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.266	50,000	63,094	2029/6/28
第2回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.406	80,000	83,538	2019/7/26
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	20,000	21,363	2023/3/22
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債)	1.176	100,000	111,897	2029/1/26
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	114,961	2023/12/20
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	59,351	2024/9/24
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.092	100,000	125,913	2030/12/27
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.187	80,000	102,351	2031/4/28
第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.164	100,000	104,938	2020/9/28
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.846	80,000	98,595	2031/8/28
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.87	100,000	123,616	2031/9/26
第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.274	50,000	52,852	2020/12/28
第20回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.28	100,000	105,846	2021/1/28
第22回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.687	200,000	243,238	2032/6/28
F23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.075	100,000	102,159	2018/5/29
第23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.418	100,000	106,877	2021/4/28
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	300,000	364,578	2032/7/28
F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.681	70,000	77,872	2023/3/17

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第27回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.034	100,000	105,334	2021/8/27
第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.785	50,000	61,772	2033/1/28
第28回公営企業債券(財投機関債)		1.89	100,000	102,734	2017/10/25
第35回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.006	200,000	211,680	2022/4/28
第42回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.801	100,000	105,039	2022/11/28
第44回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.791	200,000	210,198	2023/1/27
第46回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.678	100,000	104,417	2023/3/28
第49回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.887	200,000	212,040	2023/6/28
第50回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.922	300,000	319,026	2023/7/28
F 89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.602	300,000	348,126	2027/8/20
F 110回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.562	100,000	101,590	2019/4/25
F 123回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.6	100,000	118,194	2030/3/19
F 131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.546	100,000	118,743	2031/7/30
F 147回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.291	150,000	168,373	2027/3/19
F 226回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.096	100,000	110,914	2029/2/28
第10回首都高速道路		0.336	400,000	401,884	2017/9/20
第13回首都高速道路(財投機関債)		0.223	100,000	100,681	2019/9/20
第7回阪神高速道路債券(財投機関債)		2.18	100,000	118,254	2025/3/21
第14回阪神高速道路		0.1	300,000	300,375	2019/12/20
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)		2.167	80,000	100,969	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)		1.911	80,000	98,762	2030/10/29
第21回都市再生債券(財投機関債)		1.72	100,000	103,996	2018/9/20
第68回都市再生債券(財投機関債)		0.854	100,000	105,269	2022/9/20
第100回都市再生債券(財投機関債)		0.569	100,000	104,184	2024/11/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	26,476	28,389	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		2.08	22,792	24,547	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.19	28,211	30,404	2042/6/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		2.27	23,341	25,355	2037/11/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.29	27,832	30,105	2042/8/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.76	19,935	21,068	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.26	20,909	22,542	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	27,579	29,673	2042/10/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.94	24,467	26,167	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.25	20,973	22,595	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	15,357	15,883	2037/10/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.99	28,382	30,398	2042/12/10
第8回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.73	70,000	71,650	2017/9/20
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.52	14,945	15,377	2037/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.19	21,625	23,302	2037/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		2.24	26,057	28,002	2039/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.43	31,898	32,856	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.15	22,330	24,061	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.16	31,322	33,746	2043/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	17,578	18,292	2039/1/10
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.7	31,268	32,657	2032/5/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.64	33,743	35,326	2032/11/10
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.71	34,640	36,368	2032/11/10
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.57	103,716	108,350	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	19,211	20,124	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.12	20,163	21,359	2039/7/10
第21回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.92	100,000	104,468	2018/9/20
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	24,293	25,519	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	53,618	56,605	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	29,093	30,730	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.88	49,627	53,407	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.87	54,543	58,581	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	56,528	60,561	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.88	27,506	29,274	2040/12/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.61	59,344	63,107	2045/7/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	26,062	27,656	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	65,596	69,098	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.09	28,071	30,162	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	26,132	28,331	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.6	71,444	76,374	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	71,660	77,275	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	66,485	71,562	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.92	63,447	68,618	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	192,858	208,768	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	64,274	69,136	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	64,107	68,668	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.21	25,898	28,036	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	68,941	73,882	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	71,981	76,754	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	73,005	77,763	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.42	76,026	80,855	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	229,284	244,065	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	76,918	81,909	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	77,502	82,101	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	78,949	83,290	2047/7/10
第62回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.13	50,000	63,146	2030/12/13
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.11	79,408	83,325	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	81,224	85,318	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.25	81,265	85,946	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.32	84,702	90,108	2048/7/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.066	80,000	101,050	2031/6/13
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	240,858	254,290	2048/9/10
第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.751	30,000	34,833	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.08	83,286	87,347	2048/11/10
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	172,376	180,820	2049/1/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	85,891	90,232	2049/2/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>		%	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	
<b>金融債券</b>					
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
<b>金融債券</b>	%	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	
<b>普通社債券</b>				
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	

## &lt;注記事項&gt;

- 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)

## 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

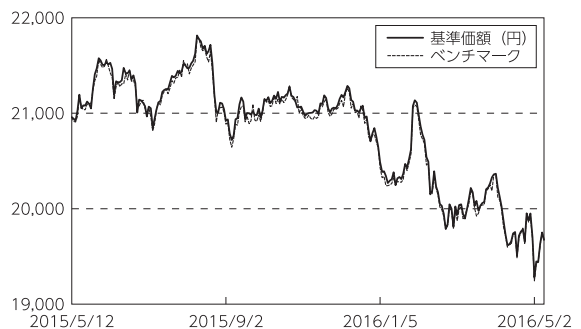
◎基準価額の動き

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。



## ○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	2,800	2,795	302,985	2017/7/31
	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	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	1.625 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		
		%	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 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	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	3.375 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		
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
	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	
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						
	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	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					
	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	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	2.875	400	425	33,779	2030/9/1
		3.SINGAPORGOVT 240901	3.0	600	646	51,259	2024/9/1
		3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	470	508	40,306	2022/9/1
		3.25.SINGAPORGOVT 200901	3.25	400	430	34,157	2020/9/1
		3.375.SINGAPORGOVT 330901	3.375	200	227	18,050	2033/9/1
		3.5.SINGAPORGOVT 270301	3.5	470	531	42,177	2027/3/1
		4.SINGAPORGOVT 180901	4.0	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	3.26	900	903	24,360	2018/3/1
		3.314.MALAYSIA 171031	3.314	1,100	1,105	29,819	2017/10/31
		3.418.MALAYSIAGOV 220815	3.418	900	879	23,730	2022/8/15
		3.48.MALAYSIAGOV 230315	3.48	1,200	1,173	31,654	2023/3/15
		3.492.MALAYSIAGOV 200331	3.492	900	899	24,256	2020/3/31
		3.502.MALAYSIAGOV 270531	3.502	800	750	20,252	2027/5/31
		3.58.MALAYSIAGOV 180928	3.58	800	806	21,742	2018/9/28
		3.654.MALAYSIAGOV 191031	3.654	700	705	19,027	2019/10/31
		3.659.MALAYSIAGOV 201015	3.659	1,000	1,007	27,185	2020/10/15
		3.733.MALAYSIAGO 280615	3.733	600	572	15,435	2028/6/15
		3.759.MALAYSIAGOV 190315	3.759	450	456	12,311	2019/3/15
		3.795.MALAYSIAGOV 220930	3.795	900	898	24,244	2022/9/30
		3.8.MALAYSIAGOV 230817	3.8	200	200	5,400	2023/8/17
		3.844.MALAYSIAGOV 330415	3.844	300	281	7,590	2033/4/15
		3.889.MALAYSIAGO 200731	3.889	700	710	19,154	2020/7/31
		3.892.MALAYSIAGOV 270315	3.892	500	488	13,177	2027/3/15
		3.955.MALAYSIAGOV 250915	3.955	1,150	1,154	31,131	2025/9/15
		4.012.MALAYSIAGOV 170915	4.012	1,500	1,520	40,997	2017/9/15
		4.048.MALAYSIA 210930	4.048	900	915	24,688	2021/9/30
		4.127.MALAYSIA 320415	4.127	700	682	18,399	2032/4/15
		4.16.MALAYSIAGOV 210715	4.16	1,200	1,228	33,138	2021/7/15
		4.181.MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,400	1,423	38,381	2024/7/15
		4.232.MALAYSIAGOV 310630	4.232	300	301	8,128	2031/6/30
		4.24.MALAYSIAGOV 180207	4.24	1,200	1,224	33,022	2018/2/7
		4.254.MALAYSIAGOV 350531	4.254	350	347	9,376	2035/5/31
		4.378.MALAYSIAGOV 191129	4.378	1,900	1,960	52,866	2019/11/29
		4.392.MALAYSIAGOV 260415	4.392	1,000	1,026	27,696	2026/4/15
		4.498.MALAYSIAGOV 300415	4.498	1,200	1,229	33,155	2030/4/15
		4.935.MALAYSIAGOV 430930	4.935	600	619	16,699	2043/9/30
		5.248.MALAYSIA 280915	5.248	200	219	5,909	2028/9/15
		5.734.MALAYSIAGOV 190730	5.734	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	10.5	15,000	16,338	117,800	2026/12/21
		6.25.SOUTH AFRICA 360331	6.25	7,350	5,129	36,980	2036/3/31
		6.5.SOUTH AFRICA 410228	6.5	7,200	4,977	35,889	2041/2/28
		6.75.SOUTH AFRICA 210331	6.75	5,700	5,267	37,981	2021/3/31
		7.SOUTH AFRICA 310228	7.0	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 AFRICA 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 マレーシアリンギット=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	騰落率		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 %	中 率 %	期 騰 落 率 %	中 率 %			
3期(2013年1月28日)	12,776	28.5		29,209.25	30.9	96.5	—	2,679
4期(2014年1月27日)	12,503	△2.1		28,701.99	△1.7	95.2	—	3,441
5期(2015年1月26日)	14,203	13.6		32,849.46	14.5	95.0	—	7,742
6期(2016年1月26日)	11,515	△18.9		26,826.64	△18.3	95.9	—	9,861
7期(2017年1月26日)	12,647	9.8		29,442.31	9.8	96.1	—	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git 21,397	千マレーシアリングgit 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	利率	当期末				償還年月日
			額面金額	評価額		債換算金額	
				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。

# 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 先物比 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 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 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

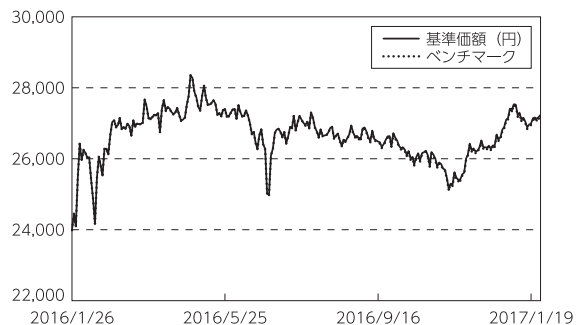
## ◎基準価額の動き

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	0.1%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 ( 0.134)	83,773 ( 18,817)	0.575	87,383
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 (△ 0.56)	35,830 (△ 249,103)	0.028	13,796
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 ( 0.021)	111,718 ( 10,149)	0.204	106,681
GLP投資法人	0.948 ( 0.068)	120,764 ( 8,116)	0.938	118,466
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.16 ( 0.017)	36,818 ( 3,524)	0.171	40,888
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 ( 0.133)	29,361 ( -)	0.046	31,408
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 ( 0.024)	5,575 ( 2,494)	0.061	6,626
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 ( 0.113)	10,693 ( 9,795)	0.085	7,171
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 ( 0.736)	143,198 ( 119,647)	1	227,824
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 ( 0.045)	144,375 ( 7,700)	0.835	145,321
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 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国	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
SI A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
インバスコ・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
スタート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 Mid City投資法人、森ヒルズリート投資法人、産業ファンド投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、ケネディクス・レジデンシャル投資法人、アクティビア・プロパティーズ投資法人、GLP投資法人、コンフォリア・レジデンシャル投資法人、日本プロロジスリート投資法人、星野リゾート・リート投資法人、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、スタートプロシード投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、日本賃貸住宅投資法人、ジャパンエクセレント投資法人につきましては、委託会社の利害関係人である三菱UFJ信託銀行、三菱東京UFJ銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUFJ証券が当該ファンドの一般事務受託会社となっています。(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

## &lt;注記事項&gt;

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

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

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



○当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

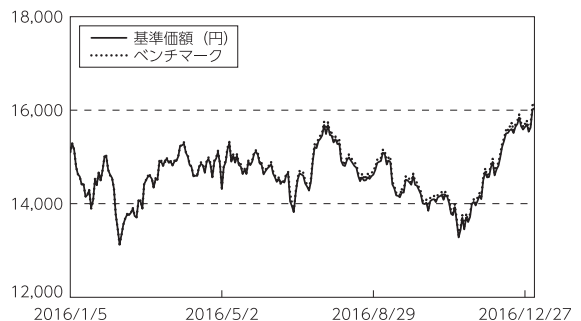
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国REIT市況（現地通貨ベース）

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

◎為替市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

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

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

◎売買コスト要因

売買コストによる影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

◎配当課税要因

配当課税による影響は $\Delta 0.5\%$ 程度でした。

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

◎為替評価要因

為替評価による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

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

◎その他の要因

その他の要因による影響は0.1%程度でした。

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

○今後の運用方針

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

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年1月6日～2017年1月5日)

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2016年1月6日～2017年1月5日)

## 株式

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

(注) 金額は受渡代金。

(注) ( )内は株式分割・増資割当および合併等による増減分です。

## 投資信託証券

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

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

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

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

外

国

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



銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外 国	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	

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)
4	273	4	65	
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	( 25)	(△ 30)	( 2)	( 1)
192	2,940	111	1,030	
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)	—	—

外

国

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。