

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（2002年11月8日設定）	
運 用 方 針	三菱UFJ 国内債券マザーファンド受益証券、三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド受益証券、三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券、三菱UFJ 外国株式マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、リスク軽減に努めつつ中長期的に着実な成長を図ることを目標として運用を行います。 三菱UFJ 国内債券マザーファンド受益証券42%、三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド受益証券33%、三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券5%、三菱UFJ 外国株式マザーファンド受益証券17%、短期金融資産3%の比率配分として基準ポートフォリオを構築します。	
主要運用対象	ベ ビー フ ァ ン ド	三菱UFJ 国内債券マザーファンド受益証券、三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド受益証券、三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券および三菱UFJ 外国株式マザーファンド受益証券に主として投資します。なお、株式、公社債に直接投資することもできます。
	三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
	三菱UFJ 外国株式マザーファンド	日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。
	三菱UFJ 国内債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	三菱UFJ 外国債券マザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベ ビー フ ァ ン ド	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とし、外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
	三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	三菱UFJ 外国株式マザーファンド	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）並びに外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	三菱UFJ 国内債券マザーファンド	外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
	三菱UFJ 外国債券マザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分 配 方 針	毎年1回決算（原則として5月20日。ただし、5月20日が休業日の場合は翌営業日とします。）を行い基準価額水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。ただし、分配対象収益等が少額の場合には分配を行わないこともあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）」およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ プライムバランス （安定成長型）（確定拠出年金）

第15期（決算日：2017年5月22日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、お手持ちの「三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）」は、去る5月22日に第15期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

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

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034

（9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近５期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			ベンチマーク		株 式	株 式	債 券	債 券	投資信託	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率	組 入 比 率	先 物 比 率	組 入 比 率	先 物 比 率	証 券 組 入 比 率	
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
11期(2013年5月20日)	15,124	0	35.8	148.65	35.0	51.0	0.8	44.3	0.2	0.4	89,848
12期(2014年5月20日)	15,293	0	1.1	149.61	0.6	48.7	0.7	46.9	—	0.4	93,510
13期(2015年5月20日)	18,366	0	20.1	178.86	19.6	49.7	0.7	45.9	—	0.4	121,438
14期(2016年5月20日)	17,279	0	△ 5.9	167.40	△ 6.4	48.1	1.2	46.9	0.1	0.4	131,448
15期(2017年5月22日)	18,782	0	8.7	181.06	8.2	49.1	0.9	46.2	0.1	0.4	155,725

(注) 当ファンドのベンチマークは、NOMURA－BPI総合指数42%、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）5%、東証株価指数（TOPIX）33%、MSCIコクサイインデックス（除く日本 円換算ベース）17%、短期金融資産（有担保コール（翌日物））3%を合成した指数です。ベンチマークは、設定日を100.00として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) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 組入比率	株 先物比率	債 組入比率	債 先物比率	投資信託 証入比率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率					
(期 首)	円	%		%	%	%	%	%	%
2016年5月20日	17,279	—	167.40	—	48.1	1.2	46.9	0.1	0.4
5月末	17,568	1.7	170.24	1.7	49.0	0.8	46.4	0.1	0.4
6月末	16,765	△3.0	162.39	△3.0	47.2	0.9	47.7	0.2	0.5
7月末	17,240	△0.2	167.08	△0.2	49.8	0.8	45.7	0.1	0.5
8月末	17,181	△0.6	166.45	△0.6	49.1	0.7	46.3	0.1	0.5
9月末	17,116	△0.9	165.47	△1.2	48.1	1.2	46.9	0.1	0.5
10月末	17,454	1.0	168.71	0.8	49.2	0.9	46.2	0.1	0.4
11月末	18,030	4.3	174.29	4.1	49.2	1.2	45.8	0.2	0.4
12月末	18,412	6.6	177.87	6.3	49.3	0.8	46.2	0.2	0.4
2017年1月末	18,347	6.2	177.32	5.9	49.0	0.5	46.7	0.2	0.4
2月末	18,481	7.0	178.64	6.7	48.9	1.0	46.5	0.2	0.4
3月末	18,461	6.8	177.94	6.3	48.4	1.2	46.7	0.2	0.4
4月末	18,602	7.7	179.31	7.1	48.6	0.9	46.6	0.2	0.4
(期 末)									
2017年5月22日	18,782	8.7	181.06	8.2	49.1	0.9	46.2	0.1	0.4

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第15期：2016/5/21～2017/5/22）

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ8.7%の上昇となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（8.2%）を0.5%上回りました。



基準価額の主な変動要因

上昇要因	主として内外株式市況が好調であったことなどが基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	国内債券市況が下落したことなどが基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

（第15期：2016/5/21～2017/5/22）

市況の推移 （期首を100として指数化）

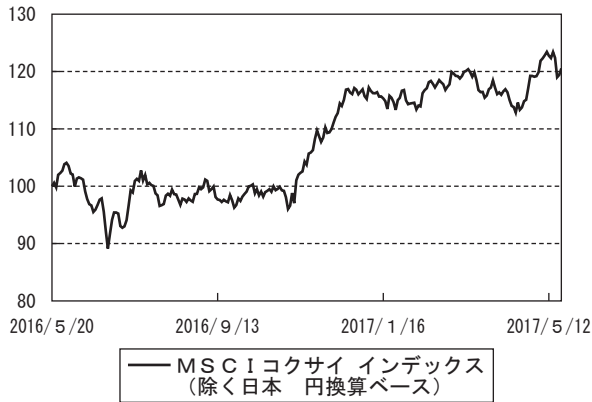


◎国内株式市況

- ・米国のトランプ政権下における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や、フランス大統領選挙で親欧州連合（EU）派のマクロン氏が勝利したことを受け世界的に株価が上昇したことなどから、国内株式市況は上昇しました。

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

市況の推移
(期首を100として指数化)



◎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。

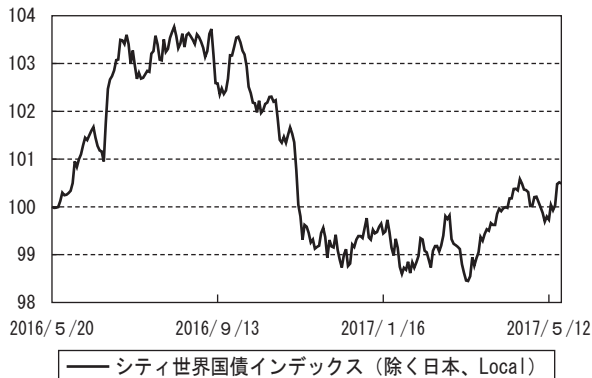
・MSCI コクサイ インデックスは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCI コクサイ インデックス (除く日本 円換算ベース) は、MSCI コクサイ インデックス (除く日本 米ドルベース) をもとに、委託会社が計算したものです。またMSCI コクサイ インデックスに対する著作権及びその他の知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

市況の推移
(期首を100として指数化)



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

市況の推移
(期首を100として指数化)



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

◎国内債券市況

・期の前半は、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、一時、国内債券市況は上昇しました。その後、日本銀行が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を導入したことや、次期米国大統領にトランプ氏が選出され米国の金利が上昇したことなどから、国内債券市況は下落しました。

◎外国債券市況

・先進国の債券市況は、2016年6月にかけて世界的な景気減速懸念が強まったことなどを背景に上昇しましたが、その後は米連邦準備制度理事会（FRB）の利上げに対する期待が高まったことなどから下落しました。

為替市況の推移
(期首を100として指数化)



◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、2016年6月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、米ドルが対円で下落しましたが、その後、FRBの利上げに対する期待が高まったことなどから、米ドルが対円で買われました。期首との比較では、米ドルは対円で1.3%上昇しました。
- ・円・ユーロ相場は、2016年6月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、ユーロが対円で下落しましたが、米国大統領選挙以降、大半の主要通貨に対して円安が進行し、ユーロは対円で上昇しました。期首との比較では、ユーロは対円で1.2%上昇しました。

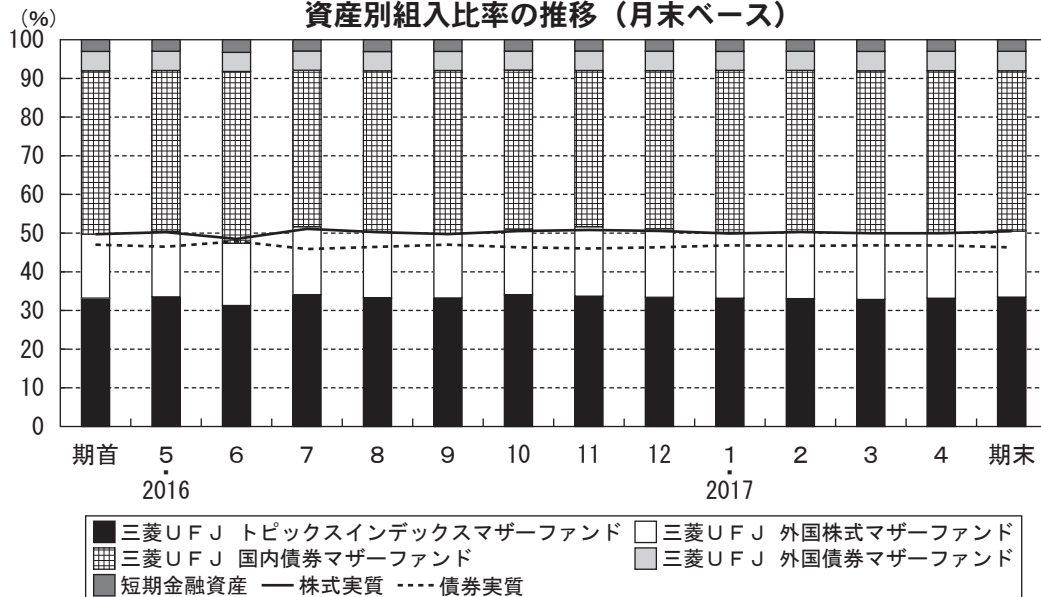
当該投資信託のポートフォリオについて

＜三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）＞

- ・内外の株式・債券に投資し、リスク軽減に努めつつ中長期的に着実な成長を図るため各資産の指数を独自に合成した指数に連動する投資成果をめざした運用を行いました。その結果、当期は、国内債券市況が下落したものの、主に内外株式市況が上昇したことなどを背景に基準価額は上昇しました。
- ・当期の資産配分の推移は以下の通りです。

（ご参考）

資産別組入比率の推移（月末ベース）



<三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド>

基準価額は期首に比べ19.3%の上昇となりました。

- ・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・株式ポートフォリオは、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）と業種別比率などがほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いて構築しました。

（注）マルチファクターモデル

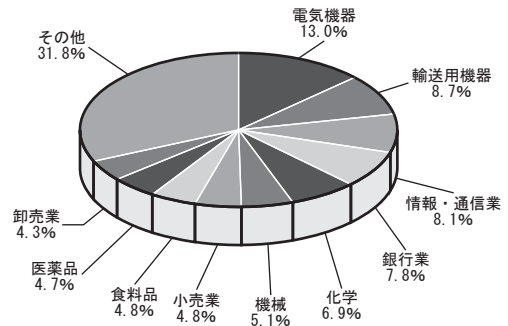
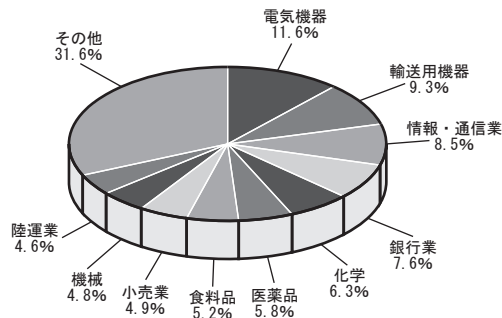
株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

（ご参考）

組入上位10業種

期首（2016年5月20日）

期末（2017年5月22日）



（注）比率は現物株式評価額に対する割合です。

<三菱UFJ 外国株式マザーファンド>

基準価額は期首に比べ20.8%の上昇となりました。

- ・ベンチマークであるMSCIコクサイインデックス（除く日本 円換算ベース）に採用されている株式（先物・不動産投資信託証券（REIT）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。
- ・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

（注）マルチファクターモデル

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

＜三菱UFJ 国内債券マザーファンド＞

基準価額は期首に比べ2.0%の下落となりました。

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

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

（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）

期首（2016年5月20日）

期末（2017年5月22日）

最終利回り	-0.0%	→	最終利回り	0.1%
直接利回り	1.1%		直接利回り	1.0%
デュレーション	8.8年		デュレーション	8.7年

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

＜三菱UFJ 外国債券マザーファンド＞

基準価額は期首に比べ0.8%の上昇となりました。

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

（ご参考）

利回り・デュレーション

期首（2016年5月20日）

期末（2017年5月22日）

最終利回り	1.1%	➡	最終利回り	1.3%
直接利回り	2.5%		直接利回り	2.5%
デュレーション	6.9年		デュレーション	7.0年

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

当該投資信託のベンチマークとの差異について

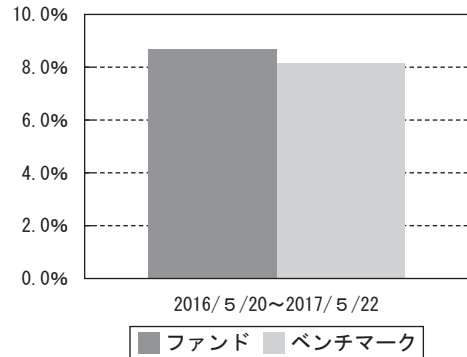
＜三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）＞

基準価額の騰落率は、8.7%の上昇となり、ベンチマークの8.2%の上昇を0.5%上回りました。差異の内訳は以下の通りです。

（内訳）

三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	0.8%程度
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	0.0%程度
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	0.0%程度
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	0.0%程度
その他（信託報酬等）	△0.3%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）



＜三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド＞

ベンチマークは16.7%の上昇となったため、カイ離は2.6%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	2.6%程度	2.6%程度

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

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

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.6%程度でした。

- ・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

プラス要因	配当収入等	計	2.6%程度
マイナス要因	売買コスト等	計	△0.0%程度

信託財産の収益向上を目的に、保有株式の貸し付けを行っています。貸付契約額は、期末時点で概ね純資産総額の7割程度となり、信託財産に若干の収益寄与となりました。

＜三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド＞

ベンチマークは20.5%の上昇となったため、カイ離は0.3%程度となりました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	△0.1%程度	0.4%程度	0.3%程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.1%程度でした。

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

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

◎その他の要因

その他の要因による影響は0.4%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入等	計	0.5%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料・為替効果等	計	△0.1%程度

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

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

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

＜三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド＞

ベンチマークは2.0%下落となったため、カイ離は△0.0%程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	△0.0%程度	△0.0%程度	0.0%程度	△0.0%程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は△0.0%程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

- ・年限構成、種別構成、デュレーション、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。

＜三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド＞

ベンチマークは1.0%の上昇となったため、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。

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15期
	2016年5月21日～2017年5月22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	9,315

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

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

今後の運用方針

＜三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）＞

- ・資産配分方針は、従前通り基準ポートフォリオを維持します。また、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。

＜基準ポートフォリオ＞

国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期金融資産
33%	17%	42%	5%	3%

＜三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド＞

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

＜三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド＞

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

＜三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド＞

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

＜三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド＞

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年5月21日～2017年5月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 44	% 0.250	(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)	(23)	(0.130)	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)	(14)	(0.076)	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)	(8)	(0.043)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(0)	(0.001)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.001)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	2	0.012	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.012)	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	46	0.265	
期中の平均基準価額は、17,804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です。

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

○売買及び取引の状況

(2016年5月21日～2017年5月22日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	7,922,959	8,627,969	7,879,295	8,845,567
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	11,864,401	16,555,295	4,464,975	6,291,368
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	675,421	1,684,063	211,474	532,335
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	3,074,872	5,328,204	2,959,355	5,459,659

○株式売買比率

(2016年5月21日～2017年5月22日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	三菱ＵＦＪ トピックス インデックスマザーファンド	三菱ＵＦＪ 外国株式 マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	66,120,100千円	36,212,721千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	204,328,462千円	105,056,647千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.32	0.34

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年5月21日～2017年5月22日)

利害関係人との取引状況

<三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）>

該当事項はございません。

<三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A			売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
		うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	15,795	254	1.6	50,324	8,567	17.0
貸付有価証券(株式)	465,186	313,919	67.5	469,036	319,066	68.0

平均保有割合 22.9%

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

＜三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド＞

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 8,932	百万円 6,530	% 73.1	百万円 39,062	百万円 26,169	% 67.0

平均保有割合 22.0%

※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。

＜三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド＞

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 61,673	百万円 17,875	% 29.0	百万円 61,755	百万円 9,091	% 14.7

平均保有割合 27.8%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

＜三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド＞

区 分	買付額等 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 4,020	百万円 2,560	% 63.7	百万円 23,107	百万円 12,940	% 56.0

平均保有割合 11.6%

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

利害関係人の発行する有価証券等

＜三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド＞

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 278	百万円 1,326	百万円 4,921

＜三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド＞

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 300	百万円 102	百万円 824

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

＜三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド＞

種 類	買 付 額
株式	百万円 6

＜三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド＞

種 類	買 付 額
公社債	百万円 2,500

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	2,932千円
うち利害関係人への支払額 (B)	77千円
(B) / (A)	2.6%

(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MUFG証券、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2017年5月22日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	41,147,870	41,191,534	52,094,933
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	39,433,106	46,832,531	64,619,527
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	2,567,222	3,031,169	7,856,792
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	12,696,753	12,812,269	26,531,648

○有価証券の貸付及び借入の状況

三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンドにおいて、2017年5月22日現在における貸付株数の総株数は25,609,700株です。

うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUFG証券に対する貸付は、22,532,300株です。

○投資信託財産の構成

(2017年5月22日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	52,094,933	33.4
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	64,619,527	41.4
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	7,856,792	5.0
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	26,531,648	17.0
コール・ローン等、その他	5,029,559	3.2
投資信託財産総額	156,132,459	100.0

(注) 三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（54,562,124千円）の投資信託財産総額（54,680,933千円）に対する比率は99.8%です。

(注) 三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（105,755,144千円）の投資信託財産総額（106,201,274千円）に対する比率は99.6%です。

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

1 アメリカドル＝111.54円	1 カナダドル＝82.39円	1 メキシコペソ＝5.95円	1 ユーロ＝124.79円
1 イギリスポンド＝144.76円	1 スイスフラン＝114.49円	1 スウェーデンクローネ＝12.77円	1 ノルウェークローネ＝13.31円
1 デンマーククローネ＝16.76円	1 ポーランドズロチ＝29.76円	1 オーストラリアドル＝83.03円	1 ニュージーランドドル＝77.24円
1 香港ドル＝14.33円	1 シンガポールドル＝80.41円	1 マレーシアリングgit＝25.88円	1 イスラエルシェケル＝31.13円
1 南アフリカランド＝8.42円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年5月22日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	156,132,459,783
コール・ローン等	4,933,012,897
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド(評価額)	52,094,933,766
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド(評価額)	64,619,527,643
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド(評価額)	7,856,792,165
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド(評価額)	26,531,648,034
未収入金	96,545,278
(B) 負債	406,519,750
未払解約金	219,189,550
未払信託報酬	187,322,016
未払利息	8,184
(C) 純資産総額(A－B)	155,725,940,033
元本	82,912,241,966
次期繰越損益金	72,813,698,067
(D) 受益権総口数	82,912,241,966口
1万口当たり基準価額(C／D)	18,782円

<注記事項>

- ①期首元本額 76,074,807,451円
 期中追加設定元本額 13,914,837,955円
 期中一部解約元本額 7,077,403,440円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.8782円です。

②分配金の計算過程

項 目	2016年5月21日～ 2017年5月22日
費用控除後の配当等収益額	2,344,666,375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	890,760,704円
収益調整金額	45,685,413,474円
分配準備積立金額	28,316,955,664円
当ファンドの分配対象収益額	77,237,796,217円
1万口当たり収益分配対象額	9,315円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

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

【お 知 ら せ】

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

(2016年8月20日)

○損益の状況（2016年5月21日～2017年5月22日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,972,333
受取利息	34,158
支払利息	△ 2,006,491
(B) 有価証券売買損益	12,094,659,560
売買益	13,941,652,840
売買損	△ 1,846,993,280
(C) 信託報酬等	△ 356,151,597
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	11,736,535,630
(E) 前期繰越損益金	19,815,847,113
(F) 追加信託差損益金	41,261,315,324
(配当等相当額)	(45,661,027,990)
(売買損益相当額)	(△ 4,399,712,666)
(G) 計(D＋E＋F)	72,813,698,067
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G＋H)	72,813,698,067
追加信託差損益金	41,261,315,324
(配当等相当額)	(45,685,413,474)
(売買損益相当額)	(△ 4,424,098,150)
分配準備積立金	31,552,382,743

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

三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド

《第17期》決算日2017年2月20日

〔計算期間：2016年2月23日～2017年2月20日〕

「三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド」は、2月20日に第17期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 株式（株価指数先物取引等を含む）の組入比率は、高位を保ちます。 運用の効率化を図るためおよび当該株価指数への連動をめざすため、株価指数先物取引等を利用します。
主 要 運 用 対 象	わが国の株式を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		東 証 株 価 指 数		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰 落 中 率	(ＴＯＰＩＸ)	期 騰 落 中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
13期(2013年2月20日)	7,172	21.8	973.70	18.9	98.9	1.1	312,556
14期(2014年2月20日)	8,968	25.0	1,194.56	22.7	98.5	1.5	285,064
15期(2015年2月20日)	11,495	28.2	1,500.33	25.6	99.1	0.5	276,171
16期(2016年2月22日)	10,155	△11.7	1,300.00	△13.4	99.0	1.0	199,359
17期(2017年2月20日)	12,356	21.7	1,547.01	19.0	98.6	1.3	209,506

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

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

(注) 株式組入比率には新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 株 価 指 数 (T O P I X)	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率			
(期 首) 2016年2月22日	円 10,155	% —	1,300.00	% 99.0	% 1.0
2月末	10,141	△ 0.1	1,297.85	101.8	1.0
3月末	10,627	4.6	1,347.20	97.3	1.8
4月末	10,573	4.1	1,340.55	97.7	1.6
5月末	10,888	7.2	1,379.80	98.0	1.5
6月末	9,845	△ 3.1	1,245.82	101.1	0.9
7月末	10,455	3.0	1,322.74	98.1	1.1
8月末	10,512	3.5	1,329.54	98.8	1.1
9月末	10,545	3.8	1,322.78	97.2	2.0
10月末	11,105	9.4	1,393.02	96.8	1.6
11月末	11,717	15.4	1,469.43	97.8	1.1
12月末	12,124	19.4	1,518.61	98.7	0.8
2017年1月末	12,150	19.6	1,521.67	98.6	0.8
(期 末) 2017年2月20日	12,356	21.7	1,547.01	98.6	1.3

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

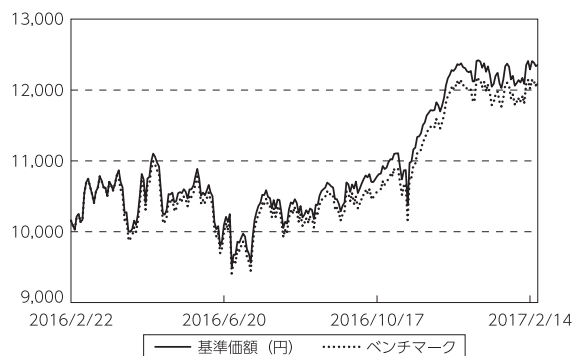
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ21.7%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(19.0%)を2.7%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内株式市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・株式ポートフォリオは、ベンチマークである東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）と業種別比率などがほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いて構築しました。

（注）マルチファクターモデル

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

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは19.0%の上昇となったため、カイ離は2.7%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い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	2.6%程度	2.7%程度

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

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

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.6%程度でした。配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

プラス要因	配当収入等	計 2.6%程度
マイナス要因	売買コスト等	計 △0.0%程度

信託財産の収益向上を目的に、保有株式の貸し付けを行っています。貸付契約額は、期末時点で概ね純資産総額の7割程度となり、信託財産に若干の収益寄与となりました。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

(2016年２月23日～2017年２月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.003	(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)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(b) そ の 他 費 用	0	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
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	0	0.003	
期中の平均基準価額は、10,890円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2016年２月23日～2017年２月20日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 19,571 (△11,967)	千円 23,416,677 ()	千株 39,723	千円 50,850,857

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円 48,641	百万円 48,368	百万円 —	百万円 —

○株式売買比率

(2016年2月23日～2017年2月20日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	74,267,535千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	205,001,407千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.36

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年2月23日～2017年2月20日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 23,416	百万円 785	% 3.4	百万円 50,850	百万円 9,040	% 17.8
貸付有価証券(株式)	457,988	320,630	70.0	433,318	304,812	70.3

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 437	百万円 1,315	百万円 5,617

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 5

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	5,764千円
うち利害関係人への支払額 (B)	338千円
(B) / (A)	5.9%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは中京銀行、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ＭＵＦＧ証券、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2017年2月20日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
極洋	49	4.1	11,689
日本水産	132.6	133.3	74,914
マルハニチロ	23.5	19.5	64,057
カネコ種苗	—	3.6	5,166
サカタのタネ	16.9	15.1	48,093
ホクト	11.7	10.4	22,214
ホクリョウ	—	1.2	924
鉱業 (0.3%)			
住石ホールディングス	35.3	33.3	3,296
日鉄鉱業	32	2.8	16,884
三井松島産業	76	6.5	9,815
国際石油開発帝石	606	540.7	604,772
日本海洋掘削	3.4	3.8	9,169
石油資源開発	18.2	16.3	44,091
K&Oエナジーグループ	7.6	6.9	12,185
建設業 (2.9%)			
ショーボンドホールディングス	12	9.9	49,500
ミライト・ホールディングス	35.3	31.6	33,274
タマホーム	9.8	8.2	4,551
サンヨーホームズ	3.5	2.6	1,726
ファーストコーポレーション	—	1.1	1,019
インベスターズクラウド	—	0.7	3,167
ダイセキ環境ソリューション	2.7	2.4	3,818
安藤・間	76.8	73.8	62,730
東急建設	37.6	36.6	30,561
コムシスホールディングス	49.4	40.1	81,202
ミサワホーム	13.8	12.4	13,069
ビーアールホールディングス	—	10.9	3,291
高松コンストラクショングループ	8.6	7.7	20,389
東建コーポレーション	4.7	3.8	30,476
ソネック	—	1.4	910
ヤマウラ	5.8	5	3,040
大成建設	597	522	420,732

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大林組	345	307.8	327,807
清水建設	352	314	327,188
飛鳥建設	88.7	99.8	17,465
長谷工コーポレーション	134.2	119.8	154,302
松井建設	12.8	11.5	12,213
銭高組	16	15	6,420
鹿島建設	539	451	334,191
不動テトラ	82.3	84	17,052
鉄建建設	70	63	21,231
西松建設	133	119	69,615
三井住友建設	443.5	394.3	48,498
大豊建設	44	37	19,462
前田建設工業	71	65	65,130
佐田建設	8.3	7.5	3,172
ナカノフドー建設	8.9	8	4,464
奥村組	109	84	59,304
東鉄工業	13.7	12.4	38,998
イチケン	14	10	4,870
浅沼組	37	33	11,847
戸田建設	134	119	79,492
熊谷組	168	161	51,359
青木あすなろ建設	7.6	6.4	5,248
北野建設	25	21	6,720
植木組	16	12	3,156
三井ホーム	15	13	7,488
矢作建設工業	15.8	14.1	14,819
ビーエス三菱	14.1	11.5	4,646
日本ハウスホールディングス	24	21	10,857
大東建託	43	37.8	596,295
新日本建設	13.9	12.5	11,612
N I P O	26	24	52,224
東亜道路工業	22	19	6,555
前田道路	36	32	64,384
日本道路	34	31	14,911

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
東亜建設工業	100	8.4	16,413	
若築建設	68	61	9,272	
東洋建設	36.2	30	12,720	
五洋建設	127.6	113.9	58,772	
大林道路	13.6	10.7	7,340	
世紀東急工業	18.3	14.7	7,585	
福田組	18	17	17,748	
住友林業	79.2	70.6	113,454	
日本基礎技術	13	11.5	4,174	
日成ビルド工業	31	31	17,081	
ヤマダ・エスバイエルホーム	63	58	4,640	
巴コーポレーション	15	13	4,654	
パナホーム	43	38	40,166	
大和ハウス工業	339.8	303.2	942,648	
ライト工業	22.2	19.8	22,888	
積水ハウス	384.6	323	580,754	
日特建設	12.7	9.1	4,022	
北陸電気工事	4.3	5	4,425	
ユアテック	18	16	12,864	
西部電気工業	10	1.7	3,901	
四電工	10	8	3,400	
中電工	16.5	12.9	30,534	
関電工	46	41	37,925	
きんでん	69.5	68.3	101,425	
東京エネシス	13	11	10,461	
トーエネック	16	14	7,826	
住友電設	9.2	7	8,946	
日本電設工業	18.8	16.7	33,249	
協和エクシオ	45.1	40.2	63,998	
新日本空調	9.8	7.9	10,862	
NDS	19	1.4	4,088	
九電工	21	19.9	58,665	
三機工業	25.7	22.6	22,645	
日揮	116	95.8	196,677	
中外炉工業	36	31	7,440	
ヤマト	10.6	9.1	4,923	
太平電業	16	14	14,728	
高砂熱学工業	34.3	28.1	46,336	
三晃金属工業	13	0.9	2,893	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
朝日工業社	14	2.3	6,980
明星工業	21.1	18.8	11,524
大気社	14.1	13.6	39,317
ダイダン	15	14	13,454
日比谷総合設備	14	11.4	19,619
東芝プラントシステム	18.5	16.7	26,903
ＯＳＪＢホールディングス	—	32.7	8,207
東洋エンジニアリング	61	61	16,470
千代田化工建設	83	75	54,000
新興ブランテック	23.6	20.8	19,364
食料品 (4.4%)			
日本製粉	76	30.3	51,358
日清製粉グループ本社	126.1	112.5	189,562
日東富士製粉	9	0.6	2,397
昭和産業	47	42	25,578
鳥越製粉	8.9	7.9	6,391
中部飼料	10.6	11.1	12,809
フィード・ワン	69.6	61.8	11,124
東洋精糖	23	17	2,023
日本甜菜製糖	59	5.3	13,043
三井製糖	45	7.2	19,137
塩水港精糖	13.9	12.4	3,174
日新製糖	1.6	4.2	7,711
森永製菓	104	20	94,200
中村屋	27	2.4	12,312
江崎グリコ	26.6	25.7	136,210
名糖産業	5.2	4.4	6,111
不二家	65	60	13,380
山崎製パン	84	75.2	167,244
第一屋製パン	23	18	2,268
モロゾフ	18	16	8,128
亀田製菓	6.4	5.8	28,797
寿スビリッツ	2.7	7.4	19,195
カルビー	42.6	41.9	157,125
森永乳業	103	92	68,080
六甲バター	5.1	4.6	11,274
ヤクルト本社	61.7	55	344,850
明治ホールディングス	68.1	60.8	527,136
雪印メグミルク	27.1	22.1	65,128

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ブリタハム	72	65	29,185	
日本ハム	85	70	214,550	
伊藤ハム	55	—	—	
丸大食品	59	49	24,353	
米久	3.6	—	—	
S F o o d s	7.1	5.5	17,820	
伊藤ハム米久ホールディングス	—	59.2	64,764	
サッポロホールディングス	176	33.6	95,793	
アサヒグループホールディングス	215.8	192.6	791,586	
キリンホールディングス	466.2	442	843,557	
宝ホールディングス	83.3	74.3	82,398	
オエノンホールディングス	32	26	6,890	
養命酒製造	3.5	3	5,610	
コカ・コーラウエスト	39	34.8	110,142	
コカ・コーライーストジャパン	40.7	39.9	94,044	
サントリー食品インターナショナル	78.8	70.3	326,895	
ダイドーグループホールディングス	5.8	4.7	26,508	
伊藤園	34.1	30.5	113,002	
キーコーヒー	10	9.1	19,992	
ユニカフェ	3.3	2.9	2,830	
ジャパンフーズ	1.9	1.4	1,934	
日清オイリオグループ	61	59	34,220	
不二製油グループ本社	30.7	27.4	66,280	
かどや製油	1	1	4,685	
Jーオイルミルズ	48	4.8	19,680	
キッコーマン	87	72	244,440	
味の素	246	211.5	490,574	
キュービー	58.5	52.2	153,572	
ハウス食品グループ本社	39.3	38	90,896	
カゴメ	41.3	36.8	105,910	
焼津水産化学工業	5.4	4.8	5,899	
アリアケジャパン	9.4	8.4	52,416	
ビエトロ	1.2	1.3	2,151	
エバラ食品工業	2.8	2.5	5,247	
ニチレイ	123	50.5	129,532	
東洋水産	56.6	50.5	200,990	
イートアンド	1.3	1.2	2,744	
大冷	—	0.8	1,444	
日清食品ホールディングス	48.7	40.1	246,214	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
永谷園ホールディングス	11	10	14,250
一正蒲鉾	4.2	3.7	4,373
フジッコ	11.2	10	24,500
ロック・フィールド	6	10.1	17,069
日本たばこ産業	680.1	568.9	2,147,028
ケンコーマヨネーズ	3.7	3.8	10,298
わらべや日洋ホールディングス	6.2	6	15,318
なとり	5.7	5.2	9,698
北の達人コーポレーション	1.8	2.5	1,620
ユーグレナ	38.8	33.2	41,168
ミヨシ油脂	42	38	5,396
理研ビタミン	3.3	3.1	13,454
繊維製品 (0.7%)			
片倉工業	13.7	12.2	18,434
グンゼ	87	72	30,384
東洋紡	426	380	74,860
ユニチカ	324	267	24,030
富士紡ホールディングス	54	4.8	16,152
倉敷紡績	111	98	23,226
シキボウ	74	56	8,568
日本毛織	33	27.2	24,616
トーア紡コーポレーション	6.5	5.1	2,769
ダイドーリミテッド	13.6	12.8	5,798
帝国繊維	11.2	10	16,990
帝人	439	78.4	169,265
東レ	780	696	676,860
サカイオーベックス	30	2.5	4,900
住江織物	28	27	7,857
日本フェルト	5.1	5.5	2,882
イチカワ	7	7	2,107
芦森工業	25	—	—
アツギ	87	83	10,541
ダイニック	22	19	3,667
セーレン	26.9	23.9	37,738
ソトー	—	4.2	4,897
東海染工	19	18	2,646
小松精練	16.8	14.3	10,510
ワコールホールディングス	64	57	80,940
ホギメディカル	6.7	6.1	41,297

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
クラウドディア	3.6	3.4	1,866
T S I ホールディングス	48	40.1	33,122
三陽商会	61	53	9,116
オンワードホールディングス	71	62	53,196
ルック	21	20	4,180
キムラタン	510	—	—
ゴールドウイン	4.5	4.1	23,575
デサント	24.6	22	27,434
キング	6.8	5.7	2,365
ヤマトインターナショナル	7.6	7.5	3,097
パルプ・紙 (0.2%)			
特種東海製紙	62	5.6	23,548
王子ホールディングス	441	375	195,000
日本製紙	55.6	43	85,183
三菱製紙	166	13.7	10,412
北越紀州製紙	66.6	53.3	40,028
中越パルプ工業	44	38	9,196
巴川製紙所	18	16	4,016
大王製紙	47.5	38.1	49,339
阿波製紙	—	1.9	1,151
レンゴー	95	92.5	60,217
トーモク	34	30	10,050
ザ・バック	7.5	6.8	20,910
化学 (6.7%)			
クラレ	169.7	161.5	277,295
旭化成	671	598	654,810
共和レザー	7	5.5	5,093
昭和電工	716	63.9	126,649
住友化学	792	706	450,428
日本化成	22	—	—
住友精化	22	4	18,900
日産化学工業	64.6	52.6	205,929
ラサ工業	42	39	5,733
クレハ	81	7.2	34,992
多木化学	7	7	6,608
ティカ	18	15	10,875
石原産業	195	17.3	19,376
片倉コープアグリ	14	13	3,107
日東エフシー	6.3	5.5	5,263

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本曹達	69	58	38,860
東ソー	290	277	278,108
トクヤマ	180	149	85,377
セントラル硝子	116	98	53,606
東亜合成	67.3	60.1	76,447
大阪ソーダ	46	41	20,295
関東電化工業	25	20	23,180
デンカ	223	199	121,390
信越化学工業	192.8	172.1	1,697,766
日本カーバイド工業	39	35	5,670
堺化学工業	43	36	14,796
エア・ウォーター	89	79.1	171,014
大陽日酸	82.8	73.9	105,381
日本化学工業	41	36	8,676
日本パーカライズニング	55	49	68,992
高圧ガス工業	16	14.2	10,863
チタン工業	14	14	2,660
四国化成工業	15	14	16,590
戸田工業	23	20	5,700
ステラ ケミファ	5.5	4.6	15,778
保土谷化学工業	34	3.4	12,410
日本触媒	15.6	15.1	112,797
大日精化工業	41	39	28,236
カネカ	145	129	116,100
三菱瓦斯化学	185	89.4	207,855
三井化学	456	436	241,108
J S R	100.9	96.5	194,833
東京応化工業	21.6	18	68,130
大阪有機化学工業	7.8	6.5	6,318
三菱ケミカルホールディングス	720.2	646.4	555,451
K H ネオケム	—	11.9	15,946
日本合成化学工業	25	—	—
ダイセル	151.2	129.4	181,289
住友ベークライト	100	85	56,525
積水化学工業	244.1	217.8	408,375
日本ゼオン	93	81	105,138
アイカ工業	32.3	30.8	89,258
宇部興産	576	483	137,655
積水樹脂	16.5	14.6	27,477

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タキロン	25	20	10,880
旭有機材	34	30	7,260
日立化成	53.1	53.3	171,892
ニチバン	11	10	9,300
リケンテクノス	17.4	20.9	11,432
大倉工業	26	23	12,972
積水化成成品工業	27	13.6	11,288
群栄化学工業	28	2.3	8,705
タイガースポリマー	5.3	4.7	3,769
ミライアル	4.2	3.7	3,478
ダイキアクシス	2.2	1.7	2,281
ダイキョーニシカワ	13.8	16.9	24,572
日本化薬	70	62	98,022
カーリットホールディングス	10.3	9.1	5,405
日本精化	9	7.7	7,291
扶桑化学工業	6.8	6.8	21,352
ADEKA	52.9	41.3	64,510
日油	82	77	97,328
新日本理化	18.3	16.6	2,539
ハリマ化成グループ	9.4	8.2	6,453
花王	289.2	243.7	1,395,669
第一工業製薬	24	21	9,534
日華化学	—	2	2,576
ニイタカ	1.7	1.5	2,257
三洋化成工業	33	5.9	27,789
有機合成薬品工業	—	6.3	1,719
大日本塗料	62	56	13,048
日本ペイントホールディングス	83	74	266,030
関西ペイント	121.7	100.8	221,760
神東塗料	9	8	1,776
中国塗料	30	27.4	23,399
日本特殊塗料	7.6	6.8	11,920
藤倉化成	14.6	12.7	8,661
太陽ホールディングス	7.9	7.8	37,245
D I C	431	37.9	149,705
サカタインクス	21.9	19.5	31,473
東洋インキＳＣホールディングス	105	93	51,615
T&K T O K A	7.6	6.8	7,357
富士フィルムホールディングス	246.1	190.3	829,708

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
資生堂	204	182	522,886
ライオン	124	119	223,006
高砂香料工業	7.1	6.3	22,711
マンダム	9.9	9.6	49,920
ミルボン	6.3	5.2	27,508
ファンケル	24.9	20.4	32,925
コーセー	17.4	15.5	142,445
コタ	3.4	3.6	4,780
シーズ・ホールディングス	13.5	12.5	38,937
シーボン	1.3	1.1	2,810
ポーラ・オルビスホールディングス	11	9.8	107,016
ノエビアホールディングス	6.8	6	25,680
アジupanコスメジャパン	2	1.9	1,850
エステー	7.3	6.6	11,431
アグロ カネショウ	4.2	3.8	4,978
コニシ	8.4	15.2	20,672
長谷川香料	13.6	12.2	23,875
星光PMC	6.1	5.5	6,226
小林製薬	16.3	26.6	138,586
荒川化学工業	9.2	8.2	16,744
メック	8.5	7.5	9,285
日本高純度化学	3.1	2.8	6,944
タカラバイオ	—	20.7	31,960
J C U	3.1	3	22,500
新田ゼラチン	7.2	5.8	4,379
O A Tアグリオ	1	1.2	1,761
デクセリアルズ	24.1	25.1	32,328
アース製薬	7.7	6.9	35,259
イハラケミカル工業	16.6	13.4	14,137
北興化学工業	12	9	4,365
大成ラミック	3	2.7	8,491
クミアイ化学工業	22.3	20	13,460
日本農薬	24.6	22	15,400
アキレス	88	7.7	14,060
有沢製作所	16	16	12,624
日東電工	83.1	69.2	659,337
レック	3.3	3	13,605
きもと	19.3	18.6	4,631
藤森工業	9.2	7.1	21,442

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
前澤化成工業	7.5	6.2	7,495
J S P	7	4.4	11,369
エフビコ	9.5	8.5	43,775
天馬	8.2	6.3	13,513
信越ポリマー	21	18.8	15,698
東リ	28	23.2	9,581
ニフコ	20.6	16.8	95,928
日本バルカー工業	40	7.4	13,638
ユニ・チャーム	217.7	194.2	474,721
医薬品 (4.7%)			
協和発酵キリン	128.6	114.8	188,157
武田薬品工業	428.2	359.7	1,885,547
アステラス製薬	1,204	980.2	1,483,042
大日本住友製薬	76.1	67.9	133,559
塩野義製薬	156.7	129.8	712,602
田辺三菱製薬	125.3	111.8	256,581
わかもと製薬	13	11	2,805
あすか製薬	13.8	10.5	18,060
日本新薬	24.6	22	134,420
バイオフェルミン製薬	1.7	1.5	4,627
中外製薬	107	95.5	366,720
科研製薬	18.5	17.9	105,431
エーザイ	132.4	118.1	722,063
ロート製薬	52.6	47	103,118
小野薬品工業	48.8	217.9	549,761
久光製薬	33.4	27.1	166,123
有機合成薬品工業	8	—	—
持田製薬	7.4	6.6	55,638
参天製薬	197.9	173.2	281,103
扶桑薬品工業	36	3.2	9,180
日本ケミファ	15	1.3	7,202
ツムラ	33.8	32.2	109,158
日医工	25.1	22.4	38,617
キッセイ薬品工業	19	16.8	48,115
生化学工業	20.6	17.8	30,740
栄研化学	9	8.1	24,624
日水製薬	4.4	3.7	5,057
鳥居薬品	7.3	6.5	18,908
J C R ファーマ	8.3	7.4	21,134

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東和薬品	4.9	4.4	23,144
富士製薬工業	3	3.2	9,872
沢井製薬	18.2	16.3	99,919
ゼリア新薬工業	22.1	19.8	33,778
第一三共	361.6	282.3	723,676
キョーリン製薬ホールディングス	28.7	23.4	55,200
大幸薬品	5.2	5	8,985
ダイト	4.5	5.8	13,195
大塚ホールディングス	231.2	206.3	1,063,476
大正製薬ホールディングス	25.9	20.5	189,215
ペプチドリーム	13.2	17.9	95,407
石油・石炭製品 (0.5%)			
日本コークス工業	90.4	80.9	8,413
昭和シェル石油	108.1	85.8	93,007
ニチレキ	13	11.8	10,797
東燃ゼネラル石油	162	156	205,452
ユシロ化学工業	5.7	5	7,260
ビービー・カストロール	4.3	3.9	6,438
富士石油	25.4	22.7	8,943
MORESCO	3.4	3.4	5,956
出光興産	56.1	45.5	161,752
J Xホールディングス	1,272.8	1,064.7	561,096
コスモエネルギーホールディングス	32.5	28.9	55,863
ゴム製品 (1.0%)			
横浜ゴム	64.9	57.9	127,148
東洋ゴム工業	48.6	50.6	86,374
ブリヂストン	362.9	323.8	1,472,966
住友ゴム工業	100.6	89.8	162,627
藤倉ゴム工業	9.2	8.3	5,884
オカモト	33	29	29,841
フコク	3.7	3.5	3,286
ニッタ	11.6	8.6	25,714
住友理工	23.1	17.7	20,514
三ツ星ベルト	26	23	23,115
パンドー化学	39	17.2	18,266
ガラス・土石製品 (1.0%)			
日東紡績	71	77	38,962
旭硝子	567	473	434,214
日本板硝子	521	43.9	37,534

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
石塚硝子	16	14	3,374
日本山村硝子	44	37	7,548
日本電気硝子	222	198	139,590
オハラ	3.8	3.8	4,297
住友大阪セメント	213	178	82,058
太平洋セメント	671	579	236,811
デイ・シイ	10.5	—	—
日本ヒューム	10.3	9	6,390
日本コンクリート工業	22.8	21.7	7,443
三谷セキサン	5.3	4.8	12,254
アジアパイルホールディングス	13.5	11.9	6,890
東海カーボン	93	89.4	41,839
日本カーボン	54	48	14,352
東洋炭素	6	5.4	10,546
ノリタケカンパニーリミテド	60	5.3	15,502
ＴＯＴＯ	79	70.5	297,510
日本碍子	136	121.1	297,300
日本特殊陶業	92.6	82.7	213,696
ダントーホールディングス	15	9	1,719
MARUWA	3.9	3.5	13,002
品川リフラクトリーズ	26	24	7,248
黒崎播磨	24	21	9,744
ヨータイ	6	5	1,930
イソライト工業	6	5.1	2,131
東京窯業	12	11.7	2,445
ニッカトー	3.6	2.8	1,190
フジミインコーポレーテッド	9.4	8.2	21,229
エーアンドエーマテリアル	27	23	3,082
ニチアス	54	50	54,950
ニチハ	14.4	12.8	40,384
鉄鋼 (1.4%)			
新日鐵住金	484.7	432.5	1,218,785
神戸製鋼所	1,975	165.8	188,846
中山製鋼所	125	10.8	8,434
合同製鐵	61	5.3	9,990
ジェイ エフ イー ホールディングス	293.8	262.2	561,632
日新製鋼	49	43.7	68,740
東京製鐵	59.4	48.5	50,585
共英製鋼	11.3	10.2	21,889

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大和工業	23.7	19.2	63,744
東京鐵鋼	22	20	9,480
大阪製鐵	6.7	6	13,164
淀川製鋼所	15.9	13.2	44,352
東洋鋼板	26	22.7	10,510
丸一鋼管	36	32.1	115,399
モリ工業	17	3.1	7,188
大同特殊鋼	180	161	91,770
日本高周波鋼業	45	37	3,256
日本冶金工業	81.7	80.4	18,652
山陽特殊製鋼	63	57	34,998
愛知製鋼	63	5.6	27,272
日立金属	123.1	97.6	163,675
日本金属	31	2.4	3,134
大平洋金属	76	61	25,437
新日本電工	61.5	55	18,535
栗本鐵工所	52	4.6	10,966
缸技	16	15	3,795
日本鑄鉄管	13	11	2,233
三菱製鋼	76	67	17,487
日亜鋼業	14.9	13.4	3,819
日本精線	8	6	3,666
シンニッタ	9.8	7.7	5,467
新家工業	24	20	3,580
非鉄金属 (1.0%)			
大紀アルミニウム工業所	17	16	8,496
日本軽金属ホールディングス	242.7	233.8	66,866
三井金属鉱業	275	261	99,441
東邦亜鉛	58	54	34,290
三菱マテリアル	671	59.8	229,632
住友金属鉱山	297	248	401,388
DOWAホールディングス	138	106	100,064
古河機械金属	168	150	35,700
大阪チタニウムテクノロジーズ	10.6	10.6	20,839
東邦チタニウム	18.4	16.3	16,202
ＵＡＣＪ	150	122	39,162
古河電気工業	338	32.2	132,181
住友電気工業	430.2	361.3	679,244
フジクラ	150	126.2	107,648

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
昭和電線ホールディングス	135	119	10,829
東京特殊電線	1.8	1.5	2,358
タツタ電線	22.3	17.8	8,205
沖電線	14	11	2,739
カナレ電気	1.7	1.3	2,935
平河ヒューテック	5.2	4.7	5,259
リョービ	65	58	29,638
アーレスティ	12.6	11.2	13,216
アサヒホールディングス	16.1	14.5	28,710
金属製品 (0.7%)			
稲葉製作所	5.7	5	6,655
宮地エンジニアリンググループ	35	28	6,748
トーカロ	7.5	6.3	17,148
アルファC o	3.5	3.2	4,348
SUMCO	84.1	100.1	177,877
川田テクノロジーズ	2.1	1.8	14,094
R S T e c h n o l o g i e s	—	0.4	2,380
東洋製鐵グループホールディングス	76.4	68.1	140,967
ホッカンホールディングス	29	25	13,625
コロナ	5.7	5.1	5,936
横河ブリッジホールディングス	20.5	16.9	23,727
駒井ハルテック	21	1.9	3,974
高田機工	12	9	2,187
三和ホールディングス	108.9	95.2	103,292
文化シャッター	29.8	26.6	22,902
三協立山	14.1	12.7	22,440
アルインコ	5.9	6.3	6,615
東洋シャッター	3.1	2.9	1,879
L I X I Lグループ	149.7	133.6	370,072
日本フィルコン	8.1	6.3	3,521
ノーリツ	21	18.7	40,709
長府製作所	11.6	10.2	27,784
リンナイ	20	16.3	142,299
ダイニチ工業	5.6	4.6	3,367
日東精工	16	14	5,992
三洋工業	15	12	2,376
岡部	22.2	19.8	19,720
ジーテクト	11.1	10	21,510
東プレ	20.6	18.4	53,764

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
高周波熱練	20	17.7	16,248
東京製鋼	74	6.6	12,005
サンコール	5.6	4.7	2,603
モリテック スチール	5.5	5.5	1,650
パイオラックス	5.4	4.8	37,392
日本発條	101.1	90.2	116,358
中央発條	14	10	3,400
アドバネクス	2.2	1.7	3,228
立川ブラインド工業	4.7	3.9	3,603
三益半導体工業	8	8.1	14,256
機械 (5.1%)			
日本ドライケミカル	1.3	1.3	3,003
日本製鋼所	178	31.7	64,224
三浦工業	47.9	39.2	67,698
タクマ	39	30.7	31,375
ツガミ	31	26	17,992
オークマ	70	62	75,330
東芝機械	59	57	27,987
アマダホールディングス	156.7	129.1	163,182
アイダエンジニアリング	28.1	27.4	27,756
滝澤鉄工所	35	29	5,423
富士機械製造	35	29.1	44,610
牧野フライス製作所	53	48	51,168
オーエスジー	48.9	43.7	104,748
ダイジェット工業	14	14	2,562
旭ダイヤモンド工業	29.4	27.5	25,520
DMG森精機	59.3	56.7	97,353
ソディック	20.6	24.3	26,365
ディスコ	13.7	11.2	191,296
日東工器	6.3	5.6	14,274
パンチ工業	4.4	3.6	3,679
豊和工業	6.5	5.9	3,935
OKK	44	37	4,662
石川製作所	32	2.9	2,215
東洋機械金属	8	6.6	3,781
津田駒工業	29	23	4,094
島精機製作所	15.1	12.5	47,937
NCホールディングス	—	3.4	3,185
フリーー	1.6	1.9	8,854

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ヤマシンフィルタ	—	2	3,540	
日阪製作所	13.6	13.2	12,157	
やまびこ	19.7	17.6	25,520	
ベガサスミシン製造	11.1	9.3	7,867	
ナブテスコ	55.8	49.8	160,107	
三井海洋開発	12.5	9.6	23,424	
レオン自動機	9.1	8.2	8,905	
SMC	32.2	28.7	909,790	
新川	9.9	8.2	6,732	
ホソカワミクロン	18	16	13,152	
ユニオンツール	4.6	4.1	14,739	
オイレス工業	14	12.3	25,325	
日精エー・エス・ビー機械	4	3.1	7,452	
サトーホールディングス	14.5	12	29,988	
日本エアーテック	4.4	3.2	2,092	
日精樹脂工業	8	7.6	8,550	
オカダアイヨン	—	2.1	2,452	
ワイエイシイ	4.5	3.7	4,983	
小松製作所	526.7	442.3	1,238,882	
住友重機械工業	313	280	230,440	
日立建機	48	42.8	113,976	
日工	16	2.9	6,101	
巴工業	4.4	4	7,508	
井関農機	111	98	25,284	
TOWA	10.6	7.9	16,432	
丸山製作所	24	22	4,290	
北川鉄工所	49	4.4	10,824	
ローツェ	—	3.4	8,619	
タカキタ	2.8	3.3	1,890	
クボタ	515.9	458.9	848,965	
荏原実業	3.1	2.5	3,425	
三菱化工機	36	32	7,168	
月島機械	20.2	18.1	23,457	
帝国電機製作所	7.9	7	7,329	
新東工業	24.5	21.9	22,710	
澁谷工業	9	8	23,304	
アイチ コーポレーション	15.2	13.6	12,049	
小森コーポレーション	26	23	35,006	
鶴見製作所	8	7.1	10,934	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
住友精密工業	18	15	5,520	
酒井重工業	21	19	6,460	
荏原製作所	238	43.4	146,041	
石井鐵工所	17	1.6	2,856	
西島製作所	11.6	9.6	10,992	
北越工業	11.4	10.1	9,847	
ダイキン工業	149.5	125.1	1,341,072	
オルガノ	19	18	8,964	
トーヨーカネツ	58	45	14,310	
栗田工業	64.6	54.2	148,237	
椿本チエイン	60	54	53,298	
大同工業	22	19	5,377	
日本コンベヤ	38	—	—	
木村化工機	9.6	8.9	3,097	
アネスト岩田	17.3	16.7	18,269	
ダイフク	55.2	45.7	123,664	
サムコ	1.8	2.3	2,612	
加藤製作所	24	5	15,325	
油研工業	21	19	4,256	
タダノ	50	47.9	69,934	
フジテック	29.7	26.5	34,715	
CKD	28.7	27.5	41,140	
キトー	13	11.7	14,636	
平和	31.8	28.4	83,410	
理想科学工業	11.4	9.1	19,310	
SANKYO	28.6	25.5	101,107	
日本金銭機械	9.5	8.7	13,084	
マースエンジニアリング	5.7	5.2	11,944	
福島工業	6.3	5.7	21,175	
オーイズミ	4.6	4.3	2,936	
ダイコク電機	4.2	4.1	7,654	
竹内製作所	15.2	16.7	38,844	
アマノ	31.7	28.3	64,467	
JUKI	15.4	14.5	18,603	
サンデンホールディングス	63	56	21,672	
蛇の目シン工業	10.2	9.1	7,243	
マックス	16	14	21,378	
グローリー	35	29.3	111,633	
新晃工業	7.2	6.5	9,496	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大和冷機工業	16.5	14.6	14,979
セガサミーホールディングス	110.3	90.9	152,530
日本ビストンリング	4.4	3.5	8,263
リケン	47	4.2	17,997
T P R	12.6	10.2	37,332
ツバキ・ナカシマ	9.5	10.3	20,023
ホシザキ	22.5	20.1	175,071
大豊工業	8.4	7.5	11,550
日本精工	210.9	188.2	304,131
NTN	255	212	115,752
ジェイテクト	109.4	97.6	184,073
不二越	95	92	56,488
日本トムソン	35	29.4	16,464
THK	68.3	64.7	192,935
ユースン精機	4	4.1	11,988
前澤給装工業	4.3	3.5	5,351
イーグル工業	12.7	9.9	15,929
前澤工業	7.9	6.2	2,077
日本ビラー工業	10.4	9.3	14,591
キッツ	49.5	44	32,736
日立工機	27.6	25	21,675
マキタ	66.9	59.7	462,078
日立造船	81.2	72.2	46,569
三菱重工業	1,828	1,535	683,228
I H I	789	704	238,656
スター精密	—	16	26,736
電気機器 (12.6%)			
日清紡ホールディングス	57	50.9	58,840
イビデン	62.9	64.1	123,007
コニカミノルタ	256.4	214.5	237,022
ブラザー工業	132.7	118.4	243,193
ミネベアミツミ	165	166.7	235,213
日立製作所	2,619	2,200	1,378,740
東芝	2,161	2,049	381,728
三菱電機	1,095	977.2	1,642,673
富士電機	309	276	173,604
東洋電機製造	21	3.9	6,762
安川電機	127.5	106.2	227,799
シンフォニアテクノロジー	68	60	18,360

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
明電舎	94	84	32,004	
オリジン電気	15	13	4,121	
山洋電気	27	24	21,216	
デンヨー	9.4	8.4	14,994	
東芝テック	74	58	34,858	
芝浦メカトロニクス	18	15	4,230	
マブチモーター	29.4	25.9	161,357	
日本電産	123.6	118.7	1,268,903	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	—	1.1	3,227	
東光高岳	5.7	4.7	10,325	
ダブル・スコープ	3	8.9	16,393	
ダイヘン	60	50	36,050	
田淵電機	11.8	14.4	4,982	
ヤーマン	1.4	1.2	7,392	
J V C ケンウッド	76.6	67.8	20,611	
ミマキエンジニアリング	7.2	8.5	6,562	
第一精工	4.5	4.3	7,722	
日新電機	24.1	18.5	25,400	
大崎電気工業	19	18	19,638	
オムロン	117.8	97.4	472,877	
日東工業	16.4	13.3	21,080	
I D E C	13.1	12	14,244	
不二電機工業	0.9	0.9	1,237	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	198	176	88,176	
サクサホールディングス	29	24	5,544	
メルコホールディングス	5.8	5.1	17,110	
テクノメディカ	2.4	2.1	4,592	
日本電気	1,412	1,259	347,484	
富士通	990	883	582,603	
沖電気工業	445	39.7	63,202	
岩崎通信機	56	44	4,004	
電気興業	27	26	14,612	
サンケン電気	56	54	27,756	
ナカヨ	11	10	4,200	
アイホン	5.8	5.2	9,661	
ルネサスエレクトロニクス	53.1	47.2	48,096	
セイコーエプソン	152.9	136.4	349,184	
ワコム	80.9	71.6	29,284	
アルバック	18.9	15.4	78,694	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
アクセル	4.7	4	3,356	
E I Z O	10.2	9.1	29,711	
ジャパンディスプレイ	192.2	171.7	48,419	
日本信号	28.3	25.4	27,000	
京三製作所	24	21	8,589	
能美防災	11.7	10.6	15,815	
ホーチキ	7.6	6.7	9,487	
エレコム	8.9	8	16,208	
日本無線	26	5.7	8,059	
パナソニック	1,173	1,046.6	1,305,110	
シャープ	868	—	—	
アンリツ	61.4	66.8	58,116	
富士通ゼネラル	31	31	66,960	
日立国際電気	23	23.9	57,001	
ソニー	724.4	646.8	2,268,974	
T D K	62	51.6	404,544	
帝国通信工業	27	21	3,948	
ミツミ電機	39.6	—	—	
タムラ製作所	40	35	15,925	
アルプス電気	87.1	84.6	293,139	
バイオニア	167	138.4	31,693	
日本電波工業	9.6	8.9	7,529	
鈴木	3	3.7	2,127	
日本トリム	2.7	2.3	9,292	
ローランド ディー. ジー.	5.1	4.7	16,685	
フォスター電機	12.8	10.7	20,533	
クラリオン	54	49	21,364	
SMK	30	23	9,706	
ヨコオ	7.4	6.6	8,712	
東光	21	—	—	
ホシデン	31.4	27.9	28,039	
ヒロセ電機	16.6	14.8	219,040	
日本航空電子工業	29	26	40,014	
T O A	12.2	10.7	10,796	
日立マクセル	17	13.7	30,783	
古野電気	12.5	12	9,240	
ユニデンホールディングス	36	30	5,040	
アルパイン	24.6	21.9	36,770	
スミダコーポレーション	8.8	7.5	9,742	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
アイコム	5.7	5.2	12,370	
リオン	3.9	3.7	5,823	
本多通信工業	—	3	3,912	
船井電機	10.9	10.4	9,880	
横河電機	102.8	99.3	171,491	
新電元工業	36	35	16,800	
アズビル	33.5	27.8	98,829	
東亜ディーケーケー	4.5	4.5	2,506	
日本光電工業	42.9	38.3	95,098	
チノー	3.5	3.4	4,144	
共和電業	12.6	10	4,490	
日本電子材料	4.4	3.7	2,345	
堀場製作所	19	18.1	112,944	
アドバンテスト	70	62.4	123,364	
小野測器	5.1	4.5	3,946	
エスベック	10.6	8.2	10,537	
パナソニック デバイスSUNX	8.8	8.1	6,828	
キーエンス	23.3	41.5	1,836,375	
日置電機	5.4	4.7	10,471	
シスメックス	79.7	71.2	454,968	
日本マイクロニクス	13.5	17.3	15,587	
メガチップス	10.8	8.6	23,598	
OBARA GROUP	6.6	5.4	26,973	
澤藤電機	7	6	1,500	
コーセル	14.3	12.7	17,729	
イリソ電子工業	—	2.9	20,706	
新日本無線	7.7	8	3,768	
オプテックスグループ	7.6	7	22,015	
千代田インテグレ	5.4	4.8	11,553	
アイ・オー・データ機器	—	3	3,759	
レーザーテック	12.1	10.1	29,178	
スタンレー電気	73.7	65.3	206,348	
岩崎電気	37	35	6,090	
ウシオ電機	62.3	55.6	80,953	
岡谷電機産業	5.8	5.2	2,184	
ヘリオス テクノ ホールディング	8.8	8.6	5,246	
日本セラミック	5.8	7.5	18,217	
遠藤照明	5.3	4.7	4,394	
日本デジタル研究所	8.6	—	—	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
古河電池	8	7	5,313
双信電機	5.9	5.8	1,774
山一電機	9.1	8.7	13,424
図研	7.6	6.1	7,887
日本電子	40	34	18,258
カシオ計算機	102.9	73.7	114,456
ファナック	105	92.9	2,075,850
日本シイエムケイ	22.7	20	13,120
エンブラス	5.2	4.1	14,452
大真空	21	3.4	5,086
ローム	50.6	44.3	329,592
浜松ホトニクス	80.1	71.5	241,670
三井ハイテック	14.9	12.2	10,858
新光電気工業	38.8	34.9	27,361
京セラ	168.5	150.4	936,691
太陽誘電	49.9	44.6	68,238
村田製作所	107.7	96.1	1,575,079
ユーシン	13.7	12.3	9,876
双葉電子工業	17.5	15	30,270
北陸電気工業	43	37	5,254
ニチコン	32.3	29.1	30,933
日本ケミコン	84	79	25,201
KOA	14.2	12.6	16,770
市光工業	26	19	9,861
小糸製作所	61.5	54.9	319,518
ミツバ	17.4	16.9	38,008
スター精密	19.5	—	—
S C R E E Nホールディングス	105	18.8	143,632
キャノン電子	9.5	8.2	14,645
キャノン	552.7	493.2	1,622,134
リコー	332.4	275.4	275,950
MUTOHホールディングス	13	14	3,752
東京エレクトロン	92.1	61.1	683,098
輸送用機器 (9.3%)			
トヨタ紡織	35.9	32	78,464
芦森工業	—	21	3,570
鬼怒川ゴム工業	23	—	—
ユニプレス	21.2	17.6	41,113
豊田自動織機	93.5	83.4	462,870

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
モリタホールディングス	17.8	16.2	24,948
三機工業	12.9	12	10,368
デンソー	253.6	225.9	1,148,701
東海理化電機製作所	30	24	53,568
三井造船	397	331	58,918
川崎重工業	799	713	253,115
名村造船所	30.8	27.5	21,807
サノヤスホールディングス	13.6	11.4	3,397
日本車輛製造	43	34	10,336
ニチユ三菱フォークリフト	11.5	10.8	7,743
近畿車輛	17	1.4	3,795
日産自動車	1,441.1	1,080.5	1,206,378
いすゞ自動車	297.5	265.5	409,002
トヨタ自動車	1,276.9	1,113.7	7,163,318
日野自動車	146.5	130.7	172,654
三菱自動車工業	407.6	335.7	228,611
エフテック	5.5	5	6,695
レシップホールディングス	3.4	3.3	2,818
GMB	1.9	1.6	2,270
ファルテック	1.8	1.5	2,113
武蔵精密工業	10.8	10.7	30,131
日産車体	50.1	40.1	43,668
新明和工業	44	37	43,586
極東開発工業	20.3	18.1	32,308
日信工業	22.8	20.3	40,295
トビー工業	85	7.5	24,412
ティラド	41	36	11,196
曙ブレーキ工業	53.7	43.6	12,382
タチエス	16.2	15.5	32,565
NOK	49.7	44.3	113,186
フタバ産業	31.7	28.1	22,283
KYB	114	103	64,684
シロキ工業	25	—	—
大同メタル工業	14.4	11.7	12,062
プレス工業	54.2	48.5	27,257
ミクニ	10.2	11.7	5,066
カルソニックカンセイ	78	62	79,670
太平洋工業	22.7	18.8	27,222
ケーヒン	23.5	21	41,391

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
河西工業	12.6	12.3	17,047
アイシン精機	103.3	83.8	474,308
富士機工	12	9.1	4,950
マツダ	325.1	290.1	460,823
ダイハツ工業	122.5	—	—
今仙電機製作所	9.5	8.2	8,265
本田技研工業	923.9	824.4	2,946,405
スズキ	214.6	181.6	799,766
富士重工業	324.4	284.4	1,217,800
安永	4	3.4	5,637
ヤマハ発動機	145	129.4	334,757
ショーワ	26.5	24.1	23,304
T B K	12.9	12.2	6,453
エクセディ	13.8	12.4	39,556
豊田合成	37.3	29.6	84,123
愛三工業	17.9	16	15,632
盟和産業	1.5	1.5	1,827
ヨロズ	9.5	8.5	14,926
エフ・シー・シー	16.7	15	33,810
シマノ	41.4	36.9	611,433
タカタ	18.9	16.7	9,151
ティ・エス テック	23.8	21.3	62,153
ジャムコ	4.5	5.4	14,169
精密機器 (1.5%)			
テルモ	157.4	140.4	546,858
クリエートメディック	3.5	2.8	2,660
日機装	38.5	31.7	38,547
島津製作所	132	117.9	221,534
J M S	19	15	4,875
モリテックス	3.4	—	—
長野計器	6.7	6.8	4,794
ブイ・テクノロジー	2.5	1.9	32,946
東京計器	33	32	7,680
愛知時計電機	14	1.2	4,470
オーバル	11.2	9.5	2,584
東京精密	19.7	17.7	67,879
マニー	9.3	12.2	33,171
ニコン	191.7	159.6	272,437
トプコン	34.8	46.1	93,260

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
オリンパス	152.9	146.2	576,028
理研計器	8.3	8.1	13,251
タムロン	8.2	8.1	17,131
HOYA	238.9	188.5	953,810
ノーリツ鋼機	9.4	9.4	9,127
エー・アンド・デイ	9.4	8.4	3,931
シチズン時計	126.4	100.2	73,947
リズム時計工業	45	36	6,732
大研医器	8.1	8.2	6,560
メニコン	5.1	6.3	22,176
松風	5.1	4.8	6,571
セイコーホールディングス	66	65	30,160
ニプロ	76.5	63.4	87,428
その他製品 (1.7%)			
スノーピーク	0.9	1.4	3,977
パラマウントベッドホールディングス	10.8	8.8	36,564
トランザクション	1.6	2.1	4,389
SHO-B I	3.8	3.8	1,668
ニホンフラッシュ	3	4.4	5,645
前田工織	11.3	9.4	12,464
永大産業	15	12	6,396
アートネイチャー	8.1	10	7,480
ダンロップスポーツ	6.8	5.9	6,130
バンダイナムコホールディングス	106.2	101	314,110
アイフィスジャパン	2.4	2.5	1,050
共立印刷	16.9	14.9	5,021
SHOE I	4.9	4.1	10,479
フランスベッドホールディングス	14.3	11.2	10,528
パイロットコーポレーション	17.9	16	73,440
萩原工業	2.2	2.7	7,063
トッパン・フォームズ	18.3	16.1	17,227
フジシールインターナショナル	12.4	20.5	46,555
タカラトミー	34	35.8	42,888
廣済堂	10	9.8	3,831
A s - m e エステール	3.1	2.4	1,660
アーク	45.5	41.8	4,514
タカノ	4.6	3.7	3,696
プロネクス	9.7	8.7	10,744
ホクシン	10.8	7.9	1,738

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

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
北海道電力	96.1	85.7	69,159
沖縄電力	10.9	13.5	35,289
電源開発	87.5	72.9	196,101
エフオン	—	3.5	3,503
イーレックス	2.1	3.9	14,313
東京瓦斯	1,146	983	507,424
大阪瓦斯	1,063	889	383,603
東邦瓦斯	259	231	183,414
北海道瓦斯	24	21	5,838
広島ガス	18.1	18.4	6,844
西部瓦斯	114	102	26,724
静岡ガス	28.8	28	20,188
メタウォーター	6.6	5.2	15,314
陸運業 (4.1%)			
SBSホールディングス	10.4	9.2	7,663
東武鉄道	549	489	280,197
相鉄ホールディングス	176	147	83,496
東京急行電鉄	598	498	411,348
京浜急行電鉄	281	251	306,471
小田急電鉄	329	146.7	327,434
京王電鉄	287	256	226,048
京成電鉄	154	68.7	182,329
富士急行	27	25	25,275
新京成電鉄	13	11	4,620
東日本旅客鉄道	187.7	177.2	1,820,730
西日本旅客鉄道	98.8	88.2	648,270
東海旅客鉄道	91.9	76.2	1,418,844
西武ホールディングス	81.8	126.5	248,572
鴻池運輸	14.5	13	18,525
西日本鉄道	133	110	53,790
ハマキョウレックス	7.8	6.1	12,706
サカイ引越センター	4	3.2	9,920
近鉄グループホールディングス	1,033	922	387,240
阪急阪神ホールディングス	689	115.7	435,032
南海電気鉄道	230	194	107,088
京阪ホールディングス	230	205	146,985
神戸電鉄	25	22	8,382
名古屋鉄道	374	334	174,348
山陽電気鉄道	37	33	20,031

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本通運	397	354	201,426
ヤマトホールディングス	189.7	163.8	368,304
山九	135	121	86,636
丸運	5.6	3.8	969
丸全昭和運輸	34	30	13,470
センコー	46	41.7	30,024
トナミホールディングス	22	18	6,336
ニッコンホールディングス	33.6	31.1	74,951
日本石油輸送	12	1	2,510
福山通運	62	55	35,695
セイノーホールディングス	72.8	65	81,120
神奈川中央交通	12	10	7,220
日立物流	21.2	19	44,574
丸和運輸機関	2.4	2.3	5,913
C＆F ロジホールディングス	9.8	9.6	15,139
九州旅客鉄道	—	68.3	231,195
海運業 (0.3%)			
日本郵船	922	774	191,178
商船三井	500	480	174,720
川崎汽船	449	347	102,712
N Sユニテッド海運	47	41	9,430
明治海運	9.5	8.4	3,704
飯野海運	53.5	47.6	24,276
共栄タンカー	11	9	2,061
乾汽船	8.2	6.9	6,851
空運業 (0.6%)			
日本航空	196.6	165.1	604,266
A N Aホールディングス	1,906	1,700	556,580
バスコ	10	9	3,708
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	2.9	2.7	14,850
日新	42	38	13,832
三菱倉庫	73	60	94,920
三井倉庫ホールディングス	60	54	18,090
住友倉庫	75	66	41,844
澁澤倉庫	28	24	8,424
東陽倉庫	18	16.1	4,797
日本トランスシティ	24	20	9,220
ケイヒン	21	18	2,826

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
中央倉庫	5.9	5.3	5,808
安田倉庫	8	7.5	5,865
東洋埠頭	32	29	5,481
宇徳	8.8	7.5	3,180
上組	122	109	114,995
サンリツ	2.4	2.4	1,250
キムラユニティ	2.7	2.2	2,644
キューソー流通システム	2.8	2.9	7,667
郵船ロジスティクス	9.3	8.4	9,886
近鉄エクスプレス	18.3	16.4	27,912
東海運	5.5	5.6	2,531
エーアイテイ	4.6	5.8	6,351
内外トランスライン	2.5	2.7	2,956
情報・通信業 (7.8%)			
NECネットエスアイ	12.7	9.8	20,815
システナ	9.9	7.3	11,899
デジタルアーツ	4.9	4	13,240
新日鉄住金ソリューションズ	16.8	15	34,275
キューブシステム	4.1	3.9	2,667
コア	4.4	3.9	5,401
ソフトクリエイトホールディングス	3.5	4.4	5,874
T I S	33.6	30	80,880
ネオス	3.6	3.3	1,508
電算システム	3.6	3.2	5,456
グリー	61.5	54.9	37,002
コーエーテクモホールディングス	24	21.6	47,088
三菱総合研究所	3.9	3.5	11,147
ボルテージ	2.2	1.7	1,708
電算	1.1	0.9	2,189
AGS	1.5	2.3	4,406
ファインデックス	6.8	6.9	6,644
ヒト・コミュニケーションズ	2.3	2.1	3,517
ブレインパッド	1.8	2	2,378
KL a b	15.8	17.6	14,220
ポルトゥウィン・ビッドクルーホールディ	6.7	6.7	7,349
イーブックイニシアティブジャパン	2.3	1.6	1,512
ネクソン	96.9	99	190,575
アイスタイル	15.5	19.1	18,698
エムアップ	2.9	2.8	2,522

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
エイチーム	3.7	5.1	10,893	
テクノスジャパン	1.2	7.1	8,804	
e n i s h	3.3	—	—	
コロブラ	28	25.6	26,240	
モバイルクリエイト	6.8	6.9	2,808	
オルトプラス	4.1	—	—	
ブロードリーフ	10.5	22.5	14,242	
ハーツユナイテッドグループ	3.1	4.9	7,369	
メディアドゥ	—	2	3,432	
ブイキューブ	5	5.3	3,296	
サイバーリンクス	1.3	1.5	1,567	
ディー・エル・イー	—	3.1	1,931	
フィックスターズ	—	1.3	4,745	
VOYAGE GROUP	2.4	3.2	5,283	
オブティム	0.7	1	5,260	
セレス	—	1	1,682	
ベリサーチ	1.3	1.1	3,263	
ティーガイア	10.2	8.9	16,607	
日本アジアグループ	8.9	10.6	4,377	
豆蔵ホールディングス	8	6.9	6,106	
テクマトリックス	4.4	2.9	7,461	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	177	191.2	48,947	
GMOベイメントゲートウェイ	8.8	7.4	47,952	
ザッパラス	6.4	5.2	2,376	
システムリサーチ	—	0.6	1,301	
インターネットイニシアティブ	16.4	13.3	26,945	
さくらインターネット	4.9	7	7,966	
GMOクラウド	2.4	2.1	3,836	
SRAホールディングス	5.8	4.7	13,136	
Minor i ソリューションズ	1.4	2	2,424	
システムインテグレータ	1.6	1.5	1,038	
朝日ネット	8.4	8	4,200	
アドソル日進	—	1.9	2,471	
フリービット	—	5.1	4,962	
コムチュア	1.7	1.6	5,632	
サイバーコム	—	1.3	1,336	
メディカル・データ・ビジョン	—	1.5	4,018	
gumi	10.9	10.4	13,041	
ショークース・ティービー	—	0.7	992	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
PCIホールディングス	—	1.1	3,163	
パイブドHD	1.4	1.7	1,885	
アイビーシー	—	0.7	704	
オープンドア	—	0.6	1,926	
LINE	—	15.1	53,454	
AOI TYO Holdings	—	7.4	6,230	
ソルクシーズ	—	2.8	1,534	
フェイス	2.8	2.4	3,237	
ハイマックス	1.3	1.2	1,789	
野村総合研究所	71	67.6	263,302	
サイバネットシステム	8.4	7.5	6,172	
CEホールディングス	1.8	1.5	1,702	
インテージホールディングス	5.4	5.2	11,294	
東邦システムサイエンス	3	2.9	1,876	
ソースネクスト	5.4	5.8	3,775	
ティー・ワイ・オー	15.3	—	—	
フォーカスシステムズ	—	3.6	2,116	
クレスコ	2.2	2.1	5,235	
フジ・メディア・ホールディングス	105.5	94.1	144,631	
オービック	34.9	31.2	166,920	
ジャストシステム	18.4	14.7	17,860	
TDCソフトウェアエンジニアリング	2.2	4.1	5,108	
ヤフー	726.2	648	341,496	
トレンドマイクロ	49.2	47.9	231,836	
インフォメーション・ディベロプメント	1.8	2.7	3,156	
日本オラクル	16.2	14.5	95,700	
アルファシステムズ	3.3	2.8	5,530	
フューチャー	12	12	10,788	
CAC Holdings	7.4	6.5	7,052	
ソフトバンク・テクノロジー	2.8	2.2	9,075	
トーセ	2.9	2.9	2,404	
オービックビジネスコンサルタント	5.1	4.6	25,576	
伊藤忠テクノソリューションズ	22.9	20.5	64,575	
アイティフォー	13.2	11.7	7,663	
東計電算	1.8	1.3	2,879	
エックスネット	0.9	0.9	1,855	
大塚商会	27.3	24.3	143,127	
サイボウズ	14.1	12.5	5,537	
ソフトブレーン	16.1	12.6	5,745	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
電通国際情報サービス	6.2	5.6	12,426
デジタルガレージ	—	13.2	27,218
EMシステムズ	1.8	3.1	5,043
ウェザーニューズ	3.4	3	10,695
C I J	9	6.7	3,564
東洋ビジネスエンジニアリング	1.1	0.9	1,391
日本エンタープライズ	10.5	10	2,810
WOWOW	4.8	4.3	15,781
スカラ	6	6.3	5,399
日本コロムビア	4	3.1	2,092
イマジカ・ロボット ホールディングス	8.9	7.8	6,193
ネットワンシステムズ	44.2	39.4	34,790
システムソフト	—	17.2	2,631
アルゴグラフィックス	4.7	4.3	10,590
マーベラス	17.1	15.5	14,942
エイベックス・グループ・ホールディングス	18.7	16.8	27,048
日本ユニシス	27.7	24.9	37,848
兼松エレクトロニクス	6.3	5.7	14,688
東京放送ホールディングス	60.7	59.6	121,822
日本テレビホールディングス	92.5	82.5	166,650
朝日放送	10.4	8.5	6,630
テレビ朝日ホールディングス	27.7	24.7	57,131
スカパーJ SATホールディングス	76.5	58.3	29,150
テレビ東京ホールディングス	9.1	7.4	19,047
日本BS放送	1.5	2.1	2,202
ビジョン	—	0.7	2,726
U-NEXT	2.6	2.5	2,912
ワイヤレスゲート	—	3.2	4,931
コネクシオ	8.8	7.9	12,395
日本通信	55.2	77.2	13,896
クロップス	2.1	1.8	1,083
日本電信電話	783.2	725.8	3,462,791
KDDI	1,029.3	894.4	2,625,511
光通信	12.2	10.9	119,573
NTTドコモ	781.5	675.6	1,818,039
エムティーアイ	13	13.7	9,398
GMOインターネット	37.6	32.9	50,073
カドカワ	31.6	26.3	42,606
学研ホールディングス	34	31	9,548

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ゼンリン	13.4	12.1	26,547
昭文社	5.7	5	3,550
インプレスホールディングス	10	8.5	1,249
アイネット	5.7	5	6,140
松竹	67	59	77,821
東宝	72.3	59.1	192,666
東映	37	34	34,136
AOI Pro.	5.1	—	—
エヌ・ティ・ティ・データ	62.6	55.8	299,088
ビー・シー・エー	1.2	1.3	2,028
ビジネスブレイン太田昭和	1.4	1.4	1,471
DTS	11.2	9.3	24,059
スクウェア・エニックス・ホールディングス	42.9	34.8	118,494
シーイーシー	6.6	5.4	9,930
カプコン	25.9	21.4	51,167
アイ・エス・ビー	1.5	1.9	1,702
ジャステック	6.4	5.5	5,692
SCSK	24.1	24.6	102,459
日本システムウエア	4	3.1	5,003
アイネス	14.5	11.3	12,927
TKC	9.4	8.3	28,386
富士ソフト	15	13.3	37,559
NSD	21.3	19.1	33,444
コナミホールディングス	45.7	40.8	187,884
福井コンピュータホールディングス	2.3	2.7	7,641
JBCホールディングス	8.5	7.2	5,803
ミロク情報サービス	7.5	6.8	12,165
ソフトバンクグループ	574.1	407	3,577,123
卸売業 (4.6%)			
ハウスイ	10	10	1,260
高千穂交易	3.7	3.8	4,005
伊藤忠食品	2.5	2.1	9,481
エレマテック	4.7	3.5	6,867
JALUX	3.3	2.9	6,432
あらた	4.5	4	11,356
トーメンデバイス	1.4	1.2	2,592
東京エレクトロン デバイス	3.5	2.9	4,637
フィールズ	6.6	7.1	8,875
双日	638.3	534	155,928

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
アルフレッサ ホールディングス	127.4	107	213,893	
横浜冷凍	24.9	22.3	23,526	
山下医科器械	0.8	0.9	1,617	
ラサ商事	4.8	4.1	2,853	
ラクーン	—	4.4	2,235	
アルコニックス	5.8	5.2	9,250	
神戸物産	6.5	4.9	18,399	
あい ホールディングス	18	13.3	29,911	
ディーブイエックス	2.7	3.4	4,297	
ダイワボウホールディングス	92	78	23,010	
マクニカ・富士エレホールディングス	18	16.6	27,971	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	17.4	16.8	17,035	
八洲電機	8.2	6.5	4,186	
UKCホールディングス	6.5	5.7	12,756	
OCHIホールディングス	3.1	2.7	3,666	
TOKAIホールディングス	44.3	39.7	33,268	
大阪工機	—	1.1	804	
三洋貿易	5.4	5	9,085	
ビューティガレージ	—	0.9	1,048	
ウイン・パートナーズ	3.8	6.6	6,520	
ミタチ産業	2.2	2.1	1,356	
シップヘルスケアホールディングス	20.6	17.3	51,519	
明治電機工業	2.9	3.1	3,803	
デリカフーズ	2.4	2.2	2,334	
スターティア	2	2.4	1,324	
コメダホールディングス	—	12.2	23,485	
富士興産	4	3.2	1,584	
協栄産業	16	13	2,236	
小野建	8.6	7.9	11,225	
佐鳥電機	8.1	6.1	4,867	
エコートレーディング	2.5	2.1	1,478	
伯東	7.6	5.9	6,354	
コンドーテック	7.8	7.3	6,380	
中山福	6.2	4.6	3,933	
ナガイレーベン	14.7	13.2	32,617	
三菱食品	11.1	9.8	34,006	
松田産業	7.3	6.5	10,374	
第一興商	17.9	14.7	69,604	
メディバルホールディングス	101.3	90.4	166,155	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
アドヴァン	10.3	—	—	
S P K	2.2	1.9	4,803	
萩原電気	2.6	2.9	6,313	
アズワン	7.9	7	35,070	
スズデン	3.4	3.2	3,388	
尾家産業	3.3	2.8	3,259	
シモジマ	6.9	5.3	6,354	
ドウシシャ	11.9	10.8	23,004	
小津産業	2.1	2	4,346	
高速	6	5.2	5,798	
たけびし	3.4	3.1	4,371	
黒田電気	18.7	12.2	27,877	
リックス	—	2.2	3,682	
丸文	8.8	7.5	5,512	
ハビネット	9.2	7.7	11,226	
橋本総業ホールディングス	2.2	2	3,004	
日本ライフライン	—	7.8	15,912	
エクセル	5	3.8	5,696	
マルカキカイ	3.3	2.9	5,486	
I D O M	27.3	24.5	18,375	
日本エム・ディ・エム	8.6	7	5,355	
進和	6	5.4	9,628	
エスケイジャパン	3.1	2.2	675	
ダイトロン	4.9	4.2	4,061	
シークス	6.4	6.4	27,136	
田中商事	3.3	3	2,172	
オーハシテクニカ	5.6	5.1	7,338	
白銅	2.8	2.2	3,929	
伊藤忠商事	795.1	662.2	1,078,723	
丸紅	997.2	889.8	649,909	
高島	20	17	3,638	
長瀬産業	60.9	54.4	89,705	
蝶理	6.4	5.8	11,588	
豊田通商	112.9	100.7	335,834	
三共生興	15.6	14.3	5,920	
兼松	215	193	37,635	
ツカモトコーポレーション	25	22	2,816	
三井物産	916.3	817.6	1,392,372	
日本紙パルプ商事	51	46	17,112	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
日立ハイテクノロジーズ	35.1	31.3	150,709	
カメイ	13.2	11.7	15,853	
東都水産	17	1.4	2,749	
OUGホールディングス	15	14	3,682	
スターゼン	3.7	3.8	18,563	
山善	38.8	34.5	36,708	
椿本興業	11	10	3,970	
住友商事	637.9	569.1	850,519	
内田洋行	25	4.4	11,246	
三菱商事	760.3	678.4	1,770,284	
第一実業	22	21	16,443	
キヤノンマーケティングジャパン	28.9	25.8	58,824	
西華産業	33	29	10,556	
佐藤商事	9	7.6	6,688	
菱洋エレクトロ	11.6	8.5	13,481	
東京産業	10.3	9.5	4,503	
ユアサ商事	9.5	8.6	28,208	
神鋼商事	23	2.3	5,674	
小林産業	6.5	7.4	2,049	
阪和興業	101	90	70,110	
カナデン	9.7	8.4	8,803	
菱電商事	16	14	10,290	
フルサト工業	5.5	4.8	8,337	
岩谷産業	120	100	66,500	
すてきなイスグループ	45	39	5,928	
昭光通商	42	36	3,636	
ニチモウ	17	14	2,646	
極東貿易	16	14	3,332	
イワキ	17	14	4,270	
三愛石油	26	24	21,456	
稲畑産業	24.2	21.5	32,486	
G S I クレオス	30	24	3,624	
明和産業	9.2	8.7	3,697	
ワキタ	21.5	19.3	20,689	
東邦ホールディングス	32.4	28.9	71,643	
サンゲツ	36.6	31	59,799	
ミツウロコグループホールディングス	16.2	14.3	10,639	
シナネンホールディングス	22	3.6	8,272	
伊藤忠エネクス	26	19.9	18,785	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
サンリオ	31.2	27.9	61,101	
サンワテクノス	6.4	5.1	5,513	
リョーサン	16	13.3	48,877	
新光商事	11.7	9.8	13,230	
トーヨー	4.6	4	10,140	
三信電気	14	10	13,500	
東陽テクニカ	14.9	11.9	12,126	
モスフードサービス	13.2	11.8	39,294	
加賀電子	9.2	8.1	16,540	
ソーダニッカ	10.4	8.8	4,576	
立花エレテック	7.4	5.8	7,667	
フォーバル	4.3	4.1	2,849	
P A L T A C	16.1	14.4	45,144	
三谷産業	11.2	9.7	3,676	
太平洋興発	49	43	4,644	
ヤマタネ	49	4.7	7,651	
丸紅建材リース	10	9	2,160	
日鉄住金物産	65	7.8	38,142	
トラスコ中山	11.5	20.7	53,157	
オートバックスセブン	38.8	33.5	60,367	
モリト	—	4.4	4,285	
加藤産業	15.7	14	41,048	
イノテック	9.5	7.8	5,428	
イエローハット	9.5	8.5	23,706	
J Kホールディングス	10.2	8.8	5,913	
日伝	4.1	3.7	12,950	
北沢産業	10.4	8.7	1,905	
杉本商事	5.9	5.1	7,945	
因幡電機産業	14.1	12.5	50,000	
バイテックホールディングス	3.2	3.6	4,950	
ミスミグループ本社	113.7	101.6	210,820	
アルテック	10.6	8.9	1,931	
タキヒヨー	17	14	6,762	
蔵王産業	1.7	1.4	2,109	
スズケン	46.1	41.2	158,002	
ジェコス	7	6.3	7,119	
ルネサスイーストン	6.6	8	4,920	
小売業 (4.6%)				
ローソン	38.4	31.4	251,514	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
サンエー	6.8	6.8	35,156	
ダイユーエイト	2.8	—	—	
カワチ薬品	7.9	7	20,979	
エービーシー・マート	12.9	16.4	110,044	
ハードオフコーポレーション	4.9	4	4,684	
アスクル	12.3	9.4	31,161	
ゲオホールディングス	19.2	15	20,475	
アダストリア	9.3	13.9	41,088	
ジーフット	6.2	5.6	4,586	
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	20	1.6	1,168	
くらコーポレーション	5.9	5.9	27,376	
キャンドウ	5.4	4.9	8,888	
バルグループホールディングス	5.9	4.6	12,783	
エディオン	42.8	34.9	35,947	
サーラコーポレーション	8.9	11.3	7,062	
ワッツ	4.1	4.2	5,447	
ハローズ	3	3	7,077	
あみやき亭	1.9	1.7	6,919	
ひらまつ	14	12.7	8,382	
ゲンキー	2	1.8	11,592	
サッポロドラッグストア	1.1	—	—	
大黒天物産	2.4	2.2	11,066	
ハニーズ	8.9	8.9	9,905	
ファーマライズホールディングス	2.5	2.6	1,339	
アルペン	9	7	13,748	
クオール	10.3	10.3	15,800	
ジェイアイエヌ	6.8	6.2	37,014	
ビックカメラ	52.4	51.9	55,740	
DCMホールディングス	49.7	54.9	54,515	
Monotaro	35.7	32	103,520	
東京一番フーズ	2	2.4	1,406	
ダイヤモンドダイニング	1.8	2.1	3,521	
きちり	2.9	3	1,980	
アークランドサービスホールディングス	3.1	2.8	8,974	
J・フロント リテイリング	128.2	114.4	196,768	
ドトール・日レスホールディングス	17.6	15.7	35,152	
マツモトキヨシホールディングス	20.9	17.1	90,288	
プロコンビリー	3.9	4.8	13,459	
スタートトゥデイ	30.8	82.5	205,177	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
トレジャー・ファクトリー	2.9	2.7	2,268	
物語コーポレーション	2.6	2.6	11,596	
ココカラファイン	10.5	9.4	43,992	
三越伊勢丹ホールディングス	201.5	179.9	248,801	
Hamee	—	2.1	2,003	
ウエルシアホールディングス	8.8	9	56,610	
クリエイトSDホールディングス	14.9	13.3	34,207	
丸善CH I ホールディングス	11.7	10.3	3,749	
ミサワ	1.4	2.2	1,016	
ティーライフ	—	0.9	1,314	
エー・ピーカンパニー	1.7	1.8	1,479	
チムニー	2.4	2.7	7,719	
シュッピン	2.9	3.5	5,145	
ネクステージ	1.9	1.8	5,097	
ジョイフル本田	16.4	14.6	50,589	
鳥貴族	—	2.3	5,582	
キリン堂ホールディングス	3.5	3	2,559	
ホットランド	2.8	4.3	4,437	
すかいらーく	30.9	38.8	62,235	
綿半ホールディングス	3	3.7	5,997	
ヨシックス	—	1	1,321	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	33.3	29.6	29,896	
ブックオフコーポレーション	5.9	5.6	4,799	
ゴルフダイジェスト・オンライン	2.3	3.7	2,923	
BEENOS	—	1.1	1,617	
あさひ	7.5	6.8	8,914	
日本調剤	2.5	3.2	11,936	
コスモス薬品	5.1	4.6	97,566	
トーエル	4.9	4.4	4,087	
一六堂	2.6	3	1,218	
オンリー	—	1.8	1,476	
セブン&アイ・ホールディングス	423.9	378.4	1,665,338	
薬王堂	1.5	4.6	11,168	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	9	24.2	24,950	
ツルハホールディングス	23.3	18.1	189,688	
サンマルクホールディングス	7.9	5.8	20,242	
フェリシモ	3.1	2.7	2,791	
トリドールホールディングス	12.4	11.1	26,262	
クスリのアオキ	9	—	—	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
サツドラホールディングス	—	1.2	2,409	
ダイユー・リックホールディングス	—	2.7	2,141	
バロックジャパンリミテッド	—	5.5	7,727	
クスリのアオキホールディングス	—	7.2	34,380	
メディカルシステムネットワーク	11.8	10.5	4,767	
総合メディカル	4.9	4.4	17,578	
はるやまホールディングス	4.1	3.5	3,437	
ノジマ	—	10.5	14,763	
カッパ・クリエイト	14.1	12.5	15,987	
ライトオン	7.6	6.8	6,684	
ジーンズメイト	4.8	—	—	
良品計画	11.6	12	269,160	
三城ホールディングス	11.4	10.5	4,998	
アドヴァン	—	9.2	10,662	
アルビス	2.6	2.4	7,812	
コナカ	11.9	11	6,600	
ハウス オブ ローゼ	1.3	1.2	1,860	
G-7ホールディングス	3.1	2.6	5,462	
イオン北海道	6.7	8.1	4,997	
コジマ	15.6	13.8	3,795	
ヒマラヤ	3.2	3	2,571	
コーナン商事	14.3	12.7	27,711	
エコス	3.9	3.6	4,356	
ワタミ	12.1	10.9	12,469	
マルシェ	2.5	2.6	2,184	
ドンキホーテホールディングス	65.5	58.5	230,197	
西松屋チェーン	19.9	16	20,800	
ゼンショーホールディングス	52.1	46.8	88,639	
幸楽苑ホールディングス	6.4	5.8	9,726	
ハークスレイ	3	1.9	2,126	
サイゼリヤ	16.7	14.8	39,072	
V Tホールディングス	34.4	30.6	16,034	
魚力	3.2	2.7	3,510	
ポブラ	4	3.4	1,768	
フジ・コーポレーション	—	1.4	3,201	
ユナイテッドアローズ	14.5	12.1	42,289	
ハイデイ日高	7.5	8.2	23,698	
京都きもの友禅	7.2	5.8	5,771	
コロワイド	33.6	30	55,980	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ビーシーデポコーポレーション	8.4	12.3	6,875	
壳番屋	4.5	7.2	27,180	
トップカルチャー	4	3.4	1,638	
P L A N T	2.4	2.1	2,515	
スギホールディングス	18.2	19.8	105,930	
ヴィア・ホールディングス	—	4.2	4,859	
スクロール	15.8	13.6	4,787	
ヨンドシーホールディングス	7.7	7	17,899	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	31.1	39.6	279,180	
木曽路	12.3	11.1	26,295	
サトレストランシシステムズ	11.7	10.5	9,082	
千趣会	19.8	16.2	12,862	
タカキュー	9.1	7.8	1,669	
ケーヨー	16.8	14.2	8,307	
上新電機	24	21	22,869	
日本瓦斯	11.7	16.6	55,527	
ベスト電器	34.8	29.4	4,174	
ロイヤルホールディングス	16.8	14.9	29,978	
東天紅	9	10	1,690	
いなげや	11.3	9.9	15,513	
島忠	26.2	23.4	66,549	
チヨダ	11.9	10.6	29,118	
ライフコーポレーション	6.4	6.8	22,542	
リンガーハット	9.1	10.3	23,617	
さが美	12	10	1,210	
M r M a x	9.7	11.3	4,723	
テンアライド	10.1	9.2	3,624	
A O K I ホールディングス	22.9	17.8	25,293	
オークワ	16	13	14,534	
コメリ	15.6	13.9	38,086	
青山商事	19.4	18.9	78,435	
しまむら	11.8	10.5	152,460	
はせがわ	3.9	5	2,235	
高島屋	147	152	152,000	
松屋	20.6	19.8	19,938	
エイチ・ツー・オー リテイリング	51.9	46.3	86,581	
近鉄百貨店	39	34	12,138	
丸栄	25	26	2,314	
ニッセンホールディングス	16.4	—	—	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
パルコ	9.8	8.2	9,331
丸井グループ	124.4	95.1	148,451
アクシアル リテイリング	7.8	7	31,500
イオン	416.9	372	633,516
ユニーグループ・ホールディングス	97	—	—
イズミ	20.1	17.9	87,799
東武ストア	13	1.1	3,322
平和堂	20.5	18.2	48,776
フジ	11.3	10	24,010
ヤオコー	11.5	10.2	46,512
ゼビオホールディングス	13.7	12.3	22,078
ケーズホールディングス	21.4	41.7	87,069
O l y m p i c グループ	6.5	5.2	3,312
日産東京販売ホールディングス	17.1	13.5	4,752
アインホールディングス	12.2	11.8	100,654
元気寿司	2.9	2.3	5,218
ヤマダ電機	308.1	302.4	174,484
アークランドサカモト	17	15.1	21,487
ニトリホールディングス	43.8	39.1	478,975
グルメ杵屋	8	6	6,246
愛眼	9.7	8	1,576
ケーユーホールディングス	5.2	4.1	3,747
吉野家ホールディングス	37.3	31.4	52,312
松屋フーズ	4.8	4.4	18,348
サガミチェーン	13.4	11.1	15,273
関西スーパーマーケット	8	7.6	11,658
王将フードサービス	7.3	6.5	27,592
プレナス	11.3	10.1	25,199
ミニストップ	7.5	6.6	14,295
アークス	18.8	16.8	43,428
パローホールディングス	21.8	19.5	54,093
藤久	0.7	0.8	1,396
ベルク	4.9	4	18,120
大庄	4.8	4.9	7,815
ファーストリテイリング	20.3	15.1	528,349
サンドラッグ	21.4	17.2	127,968
サックスパー ホールディングス	9.5	8.6	10,793
ヤマザワ	2.1	1.8	3,346
やまや	2.1	1.7	2,925

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ペルーナ	25.3	22.5	19,102
銀行業 (8.7%)			
島根銀行	2.2	2	2,820
じもとホールディングス	71.6	65.9	12,916
めぶきフィナンシャルグループ	74.4	436	212,768
東京T Yフィナンシャルグループ	13.9	13.1	52,400
九州フィナンシャルグループ	155.1	148.3	117,750
ゆうちょ銀行	194.7	256	364,800
富山第一銀行	—	22.7	12,507
コンコルディア・フィナンシャルグループ	—	591.9	363,367
西日本フィナンシャルホールディングス	—	61.3	77,176
新生銀行	877	861	179,949
あおぞら銀行	641	572	238,524
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,130	6,851.2	5,260,351
りそなホールディングス	1,185.4	1,057.7	665,716
三井住友トラスト・ホールディングス	2,115	188.8	797,680
三井住友フィナンシャルグループ	811.4	724	3,293,476
第四銀行	128	111	59,607
北越銀行	110	9.7	26,616
西日本シティ銀行	330	—	—
千葉銀行	391	349	275,012
横浜銀行	680	—	—
常陽銀行	366	—	—
群馬銀行	225	200.9	134,603
武蔵野銀行	16.2	14.3	53,053
千葉興業銀行	28.1	25	15,750
筑波銀行	41.8	38.3	13,519
七十七銀行	159	142	76,396
青森銀行	74	71	27,974
秋田銀行	67	58	21,344
山形銀行	57	51	25,245
岩手銀行	7.1	5.9	28,231
東邦銀行	90	80	35,280
東北銀行	52	46	7,360
みちのく銀行	48	48	9,168
ふくおかフィナンシャルグループ	439	367	185,335
静岡銀行	297	246	250,428
十六銀行	126	121	49,973
スルガ銀行	96.2	92.4	236,728

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
八十二銀行	183	174.5	126,163	
山梨中央銀行	63	56	31,192	
大垣共立銀行	135	121	54,813	
福井銀行	87	78	22,152	
北國銀行	113	95	45,505	
清水銀行	3.5	3.1	11,718	
富山銀行	2	1.8	7,524	
滋賀銀行	94	85	53,890	
南都銀行	98	8.7	41,151	
百五銀行	91	80	41,600	
京都銀行	193	162	156,168	
紀陽銀行	39.8	34	65,382	
三重銀行	46	4.1	10,377	
ほくほくフィナンシャルグループ	689	60.1	123,385	
広島銀行	299	267	146,850	
山陰合同銀行	61.5	54.3	55,874	
中国銀行	71.8	64.1	116,213	
鳥取銀行	34	2.9	5,614	
伊予銀行	108.4	96.7	81,421	
百十四銀行	111	99	39,699	
四国銀行	79	70	22,050	
阿波銀行	82	77	58,520	
大分銀行	58	52	23,400	
宮崎銀行	67	60	22,680	
佐賀銀行	61	55	17,215	
十八銀行	63	56	20,384	
沖縄銀行	8.1	8.8	37,224	
琉球銀行	20.8	18.4	30,599	
セブン銀行	379.7	338.9	112,175	
みずほフィナンシャルグループ	14,274.5	12,275.4	2,582,744	
高知銀行	42	35	4,830	
山口フィナンシャルグループ	95	85	112,285	
長野銀行	33	2.9	5,863	
名古屋銀行	86	7.5	32,737	
北洋銀行	152.7	147.6	70,700	
愛知銀行	3.4	3	21,360	
第三銀行	57	5.1	8,960	
中京銀行	42	3.8	8,759	
東日本銀行	48	—	—	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大光銀行	37	32	8,064
愛媛銀行	58	10.7	15,183
トマト銀行	39	3.6	5,871
みなと銀行	92	8.2	19,991
京葉銀行	84	73	40,004
関西アーバン銀行	13.6	12.5	19,737
栃木銀行	54	49.6	29,412
北日本銀行	3.2	2.8	8,876
東和銀行	144	170	21,590
福島銀行	125	104	10,088
大東銀行	61	49	8,428
トモニホールディングス	78.6	74.3	48,592
フィデアホールディングス	63	87.1	18,900
池田泉州ホールディングス	106.1	95.3	49,651
証券・商品先物取引業 (1.3%)			
F P G	30.2	32.4	36,061
S B I ホールディングス	121.7	102.2	158,103
ジャフコ	16.9	15.1	59,494
大和証券グループ本社	948	846	601,506
野村ホールディングス	1,949.7	1,848.4	1,386,300
岡三証券グループ	86	77	58,366
丸三証券	30.1	29	27,898
東洋証券	39	33	8,976
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	116.3	103.8	67,158
光世証券	27	24	4,584
水戸証券	31.8	28.9	9,016
いちよし証券	22.6	20.6	18,540
松井証券	50.6	51.1	47,676
だいこう証券ビジネス	5.1	4.6	2,939
マネックスグループ	119.1	97.9	28,782
カブドットコム証券	89.8	68.7	26,861
極東証券	13.6	12.2	20,508
岩井コスモホールディングス	9.9	8.5	9,409
藍澤證券	14.3	16.8	10,869
マネースクウェアHD	3.5	—	—
マネーパートナーズグループ	10.3	11.8	6,265
保険業 (2.8%)			
かんぽ生命保険	30.9	34.1	94,798
S O M P Oホールディングス	225.1	189	809,109

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アニコム ホールディングス	6.9	6.2	14,012
MS&ADインシュアランスグループホール	302.8	270.2	1,038,919
ソニーフィナンシャルホールディングス	97.1	86.6	174,672
第一生命ホールディングス	649.2	545.2	1,202,983
東京海上ホールディングス	410.5	366.3	1,864,100
T&Dホールディングス	369.3	329.5	595,736
アドバンスクリエイト	－	2.2	4,580
その他金融業 (1.3%)			
全国保証	26.3	25.5	92,310
クレディセゾン	76.8	68.6	149,205
アクリーティブ	－	7.5	2,985
芙蓉総合リース	11.6	10.4	55,120
興銀リース	19.1	17	42,534
東京センチュリー	23.8	18.2	70,980
日本証券金融	45.6	39.8	25,153
アイフル	169.6	153	54,315
ポケットカード	10.6	7.2	4,370
リコーリース	8.1	7.2	26,280
イオンフィナンシャルサービス	66.5	57.7	122,554
アコム	203.5	184.2	90,994
ジャックス	57	50	25,400
オリエントコーポレーション	438.1	197.6	42,484
日立キャピタル	23.9	21.3	62,728
アブラスフィナンシャル	51.6	46.4	5,521
オリックス	717.5	640.3	1,128,208
三菱UFJリース	257	229.3	142,166
日本取引所グループ	297.5	281.1	450,322
イー・ギャランティ	3.4	2.8	7,316
アサックス	2.2	1.5	2,461
NECキャピタルソリューション	4.4	3.8	6,927
不動産業 (2.5%)			
いちご	84.4	86.6	31,695
日本駐車場開発	111.5	110.7	16,937
ヒューリック	211.2	188.6	205,196
三栄建築設計	4.2	3.8	5,950
野村不動産ホールディングス	67.2	60	115,500
三重交通グループホールディングス	17.9	16.4	6,396
サムディ	5.7	7.5	8,962
ディア・ライフ	5.6	6.4	2,572

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
エー・ディー・ワークス	77.5	93.5	4,020	
日本商業開発	3.3	5.1	9,904	
プレサンスコーポレーション	3.4	14.2	19,979	
ユニゾホールディングス	6.3	7.5	23,212	
THEグローバル社	—	4.1	1,861	
日本管理センター	6.7	6.6	9,154	
サンセイランディック	2.7	2.2	1,667	
エストラスト	2.2	2	1,548	
フージャースホールディングス	14.6	12.1	7,417	
オープンハウス	14.7	13.1	35,579	
東急不動産ホールディングス	245.1	218.7	143,248	
飯田グループホールディングス	93.9	75.4	137,152	
ムゲンエステート	—	3.5	2,530	
ファーストブラザーズ	—	1	1,708	
ハウスドゥ	—	0.8	1,142	
シーアールイー	—	1.4	2,356	
ケイアイスター不動産	—	1.2	1,921	
パーク 2 4	51.1	45.9	142,060	
バラカ	3.6	2.7	5,373	
三井不動産	537	479	1,256,177	
三菱地所	753	672	1,517,712	
平和不動産	19.5	17.3	27,887	
東京建物	110.7	104.9	166,686	
ダイビル	26.4	23.5	25,074	
京阪神ビルディング	17.4	15.2	9,956	
住友不動産	243	217	704,382	
大京	191	169	39,208	
テアオーシー	39.6	35.2	33,932	
東京楽天地	17	15	7,920	
レオパレス 2 1	119.4	114.1	69,144	
スターツコーポレーション	11.7	9.3	22,626	
フジ住宅	13.3	11.5	8,579	
空港施設	12.9	11.2	6,641	
住友不動産販売	7.3	8.2	23,345	
ゴールドクレスト	8.2	8.3	17,737	
日本エスリード	4.1	3.7	5,642	
日神不動産	13.9	10.9	6,005	
日本エスコン	—	12.6	5,052	
タカラレーベン	45.4	39.8	23,919	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サンヨーハウジング名古屋	5.9	4.9	4,953
イオンモール	65.4	58.2	100,802
ファースト住建	3.9	3.5	5,015
トーセイ	15.8	12.4	9,622
穴吹興産	12	1	2,669
エヌ・ティ・ティ都市開発	62.9	56.2	59,178
サンフロンティア不動産	12.3	10.1	10,362
エフ・ジェー・ネクスト	8.9	8.3	6,698
インテリックス	－	2.2	1,815
グランディハウス	9	8.2	3,427
日本空港ビルデング	32.3	28.8	113,904
サービス業 (3.6%)			
日本工営	36	6.4	17,497
ネクスト	30.4	23.8	17,564
ジェイエシシーリクルートメント	4.9	6	9,282
日本M&Aセンター	16.6	27.6	94,806
ノバレーゼ	2.6	－	－
アコーディア・ゴルフ	30	－	－
中広	1	1.1	764
タケエイ	9.3	8.6	8,815
トラスト・テック	2.2	4	6,880
コシダカホールディングス	－	3.3	8,190
パソナグループ	9.4	7.3	5,927
C D S	2.5	2.4	2,412
リンクアンドモチベーション	21.9	23.1	10,071
G C A	9.8	8.7	8,308
エス・エム・エス	13.4	13.6	34,897
テンブホールディングス	75.2	74	143,338
リニカル	6.4	5.7	8,225
クックパッド	23.9	21.4	20,865
エスクリ	4.5	3.6	2,739
アイ・ケイ・ケイ	5.8	4.2	3,015
学情	4.1	4.1	4,936
スタジオアリス	4.7	4	8,996
シミックホールディングス	4.9	5	7,435
N J S	2.4	2.2	3,075
総合警備保障	35.8	34.8	150,684
カカコム	77.8	68.3	110,167
セントケア・ホールディング	－	0.8	1,344

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
サイネックス	—	0.4	474	
ルネサンス	5.5	4.9	8,349	
ディップ	11.9	12.3	28,548	
オプトホールディング	6.8	7	6,517	
新日本科学	—	11	6,182	
ツクイ	12.7	23.3	15,913	
キャリアデザインセンター	3	2.2	2,558	
エムスリー	92.9	82.9	235,850	
ツカダ・グローバルホールディング	7.7	7.2	4,485	
アウトソーシング	5	5.5	20,542	
ウェルネット	4.1	7.3	9,438	
ワールドホールディングス	—	2.2	4,246	
ディー・エヌ・エー	48.1	42.9	105,662	
博報堂DYホールディングス	148.6	132.6	177,286	
ぐるなび	12.4	14	31,038	
エスアールジータカミヤ	9.1	10.7	6,259	
ジャパンバストレスキューシステム	13	13.6	3,440	
ファンコミュニケーションズ	24.7	24.4	18,910	
ライク	2.3	1.8	4,410	
ビジネス・ブレークスルー	—	2	896	
WDBホールディングス	3.9	3.5	4,788	
ティア	4.7	4.6	3,201	
バリューコマース	10	8.8	3,379	
インフォマート	15.5	40.7	24,135	
J Pホールディングス	27	28.3	7,301	
E P Sホールディングス	12	12	18,300	
レッグス	1.9	2.4	1,932	
プレステージ・インターナショナル	9	13.7	12,193	
アミューズ	2.9	5.3	10,721	
ドリームインキュベータ	3.7	3	6,363	
クイック	5.6	5	5,820	
TAC	7.6	7.1	1,625	
ケネディクス	144	121.3	53,493	
電通	119.5	106.6	636,402	
テイクアンドギヴ・ニーズ	5.1	4.6	4,402	
びあ	2.9	3	8,766	
イオンファンタジー	3.9	2.9	9,048	
シーティーエス	2.5	2.7	4,198	
ネクシィーズグループ	4.1	3.5	5,561	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
みらかホールディングス	27.4	24.4	123,708	
アルプス技研	4	3.8	11,609	
ダイオーズ	2	1.6	1,718	
日本空調サービス	5.2	9.1	6,060	
オリエンタルランド	115.9	103.4	653,177	
ダスキン	30.4	24.5	59,804	
明光ネットワークジャパン	12.2	12	14,508	
ファルコホールディングス	4.8	4.5	6,727	
秀英予備校	2.5	2.1	1,010	
田谷	2.6	—	—	
ラウンドワン	33.8	30.2	26,576	
リゾートトラスト	45	37	81,437	
ビー・エム・エル	6.3	12.6	31,210	
ワタベウェディング	3.8	1.8	1,031	
りらいあコミュニケーションズ	17.8	16	17,440	
リソー教育	20.4	16.4	10,266	
早稲田アカデミー	1.2	1.3	1,557	
ユー・エス・エス	129.8	115.8	223,841	
東京個別指導学院	5.4	3.2	3,308	
サイバーエージェント	26.2	50.3	151,403	
楽天	501.6	488.9	502,589	
クリーク・アンド・リバー社	—	3.5	3,797	
テー・オー・ダブリュー	6.8	7.7	5,274	
セントラルスポーツ	3.6	3.2	11,456	
フルキャストホールディングス	10.1	9.9	10,632	
リソルホールディングス	12	10	3,500	
テクノプロ・ホールディングス	17.4	15.6	60,138	
アトラ	—	1.2	870	
インターワークス	1.6	2.1	2,368	
Keeper 技研	—	1.1	2,370	
ファーストロジック	—	0.5	1,205	
デザインワン・ジャパン	—	0.7	1,995	
イー・ガーディアン	—	3.2	5,692	
リブセンス	7.6	7.1	3,131	
ジャパンマテリアル	4.4	7.1	10,813	
ベクトル	3.3	7.9	9,859	
ウチヤマホールディングス	5.6	4.6	2,019	
サクセスホールディングス	1.1	0.9	1,242	
キャリアリンク	1.6	2.4	1,764	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
I B J	6.6	7.8	4,680	
アサンテ	4	3.5	6,076	
N・フィールド	3.9	4.7	6,913	
バリュエーHR	—	0.4	1,028	
M&Aキャピタルパートナーズ	1.1	1.3	5,356	
ライドオン・エクスプレス	1.8	2.5	2,337	
ERIホールディングス	2.9	2.8	2,310	
アビスト	1.3	1.5	5,940	
ウィルグループ	2.5	4	2,836	
エスクロー・エージェント・ジャパン	—	1.7	2,830	
日本ビューホテル	1.3	2	2,700	
リクルートホールディングス	216.3	209	1,113,970	
エラン	1.1	1.4	1,955	
土木管理総合試験所	—	1.1	774	
日本郵政	236.5	249.7	368,057	
ベルシステム24ホールディングス	15.8	14.7	14,700	
一蔵	—	0.4	521	
ソラスト	—	4.6	6,941	
リログループ	4	3.6	56,880	
東洋	3.2	2.1	10,815	
エイチ・アイ・エス	17.5	15.6	45,661	
ラックランド	1.7	1.7	3,396	
共立メンテナンス	8.1	7.8	54,054	
イチネンホールディングス	11.3	10.1	12,079	
建設技術研究所	6.3	6	6,564	
スペース	5.8	4.9	6,296	
燦ホールディングス	2.1	1.7	2,703	
スバル興業	8	7	3,640	
東京テアトル	44	41	6,232	
タナベ経営	—	2	2,790	
ナガワ	2	1.8	8,190	
よみうりランド	21	20	9,240	
東京都競馬	73	66	17,028	
常磐興産	40	3.4	5,487	
カナモト	14.9	13.3	38,370	
東京ドーム	85	38.3	41,900	
西尾レントオール	8.6	7.7	25,410	
トランス・コスモス	12.4	11.1	29,048	
乃村工藝社	23.1	20.5	39,196	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
藤田観光	39	32	11,840
KNT-CTホールディングス	52	56	7,728
日本管財	9.2	8.1	14,490
トーカイ	4.7	4.2	17,220
白洋舎	12	0.9	2,430
セコム	111.5	99.5	815,303
セントラル警備保障	4.7	4.3	8,161
丹青社	20.2	16.5	14,305
メイテック	13.3	11.5	50,025
アサツー ディ・ケイ	18.8	15.6	45,099
応用地質	11.3	9.1	13,340
船井総研ホールディングス	15	12.3	24,083

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
進学会	5	3.8	2,169
オオバ	6	7.6	3,663
学究社	1.6	2.6	4,230
ベネッセホールディングス	35.9	32.1	107,214
イオンディライト	10.3	10.7	37,129
ナック	6.7	5.9	5,846
ニチイ学館	18.8	16.9	14,905
ダイセキ	20.1	16.7	38,693
ステップ	3.6	3.2	4,486
合 計	株 数 ・ 金 額	170,037	137,918
	銘柄数<比率>	1,905	1,968
			206,646,912
			<98.6%>

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	百万円 2,769	百万円 —
	TOPIX		

〇有価証券の貸付及び借入の状況

2017年2月20日現在における貸付株数の総株数は34,597,300株です。
うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUF G証券株式会社に対する貸付は、22,631,300株です。

〇投資信託財産の構成

(2017年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	206,646,912	77.1
コール・ローン等、その他	61,484,778	22.9
投資信託財産総額	268,131,690	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年2月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	268,121,156,164
コール・ローン等	59,005,889,657
株式(評価額)	206,646,912,100
未収入金	2,004,392,372
未収配当金	293,303,471
その他未収収益	62,053,564
差入委託証拠金	108,605,000
(B) 負債	58,614,387,208
未払解約金	628,299,580
未払利息	74,719
受入担保金	57,986,012,909
(C) 純資産総額(A－B)	209,506,768,956
元本	169,558,946,817
次期繰越損益金	39,947,822,139
(D) 受益権総口数	169,558,946,817口
1万口当たり基準価額(C／D)	12.356円

<注記事項>

- ①期首元本額 196,312,695,095円
期中追加設定元本額 29,546,207,319円
期中一部解約元本額 56,299,955,597円
また、1口当たり純資産額は、期末1.2356円です。

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

三菱ＵＦＪ トピックスインデックスオープン	12,445,144,834円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	1,074,326,259円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	3,933,881,466円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	3,690,933,846円
三菱ＵＦＪ トピックスオープン（確定拠出年金）	5,046,113,528円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	8,671,080,698円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	40,454,924,530円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	36,916,056,088円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	260,993,311円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（成長型）	558,464,368円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	1,070,569,534円
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスファンドV A（適格機関投資家限定）	55,431,778,742円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）V A（適格機関投資家限定）	364,613円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）V A（適格機関投資家限定）	4,315,000円
合計	169,558,946,817円

【お 知 ら せ】

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

○損益の状況 (2016年2月23日～2017年2月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,622,881,913
受取配当金	3,947,611,188
受取利息	525,719
その他収益金	697,400,400
支払利息	△ 22,655,394
(B) 有価証券売買損益	36,688,374,655
売買益	41,718,484,886
売買損	△ 5,030,110,231
(C) 先物取引等取引損益	523,517,812
取引益	871,255,888
取引損	△ 347,738,076
(D) 保管費用等	△ 52,131
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	41,834,722,249
(F) 前期繰越損益金	3,046,824,571
(G) 追加信託差損益金	1,347,955,635
(H) 解約差損益金	△ 6,281,680,316
(I) 計(E＋F＋G＋H)	39,947,822,139
次期繰越損益金(I)	39,947,822,139

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

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

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

三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド

《第17期》決算日2017年5月22日

〔計算期間：2016年5月21日～2017年5月22日〕

「三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド」は、5月22日に第17期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とし、ベンチマーク（MSCI コクサイ インデックス（除く日本 円換算ベース））に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主 要 運 用 対 象	日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）並びに外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		MSCI コクサイ インデックス (除 く 日 本 円換算ベース)		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
13期(2013年5月20日)	13,762	70.2	445,900.88	69.8	95.9	1.3	2.3	235,276
14期(2014年5月20日)	15,742	14.4	508,902.69	14.1	96.3	1.5	2.1	182,512
15期(2015年5月20日)	20,323	29.1	655,211.07	28.7	96.7	0.9	2.2	160,903
16期(2016年5月20日)	17,145	△15.6	550,658.40	△16.0	95.4	1.8	2.7	114,202
17期(2017年5月22日)	20,708	20.8	663,775.10	20.5	95.7	1.7	2.5	105,751

(注) MSCI コクサイ インデックスは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。

MSCI コクサイ インデックス（除く日本 円換算ベース）は、MSCI コクサイ インデックス（除く日本 米ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。またMSCI コクサイ インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

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

(注) 株式組入比率には新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSC I コクサイ インデックス (除 く 日 本 円換算ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率
(期 首) 2016年5月20日	円	%	円	%	%	%	%
	17,145	—	550,658.40	—	95.4	1.8	2.7
5月末	17,851	4.1	573,123.36	4.1	95.3	1.9	2.6
6月末	16,144	△ 5.8	518,418.59	△ 5.9	96.5	3.7	2.9
7月末	17,165	0.1	550,901.12	0.0	93.3	2.3	2.8
8月末	17,112	△ 0.2	549,564.64	△ 0.2	95.3	2.1	2.7
9月末	16,705	△ 2.6	536,569.52	△ 2.6	95.1	3.0	2.7
10月末	17,051	△ 0.5	546,782.82	△ 0.7	95.3	2.1	2.6
11月末	18,627	8.6	597,345.24	8.5	90.3	4.7	2.4
12月末	19,802	15.5	634,475.83	15.2	92.0	3.2	2.4
2017年1月末	19,740	15.1	633,078.14	15.0	95.8	1.2	2.5
2月末	20,124	17.4	646,138.07	17.3	93.6	3.8	2.5
3月末	20,320	18.5	652,220.38	18.4	93.9	3.6	2.4
4月末	20,460	19.3	655,740.71	19.1	95.1	2.2	2.5
(期 末) 2017年5月22日	20,708	20.8	663,775.10	20.5	95.7	1.7	2.5

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

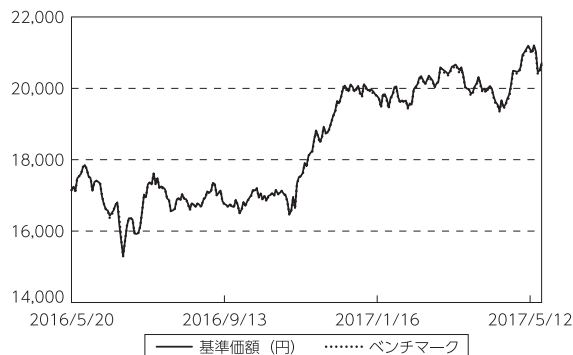
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ20.8%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(20.5%)を0.3%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国株式市況

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

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて1.3%の円安・米ドル高、1.2%の円安・ユーロ高となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ベンチマークであるMSCIコクサイインデックス（除く日本 円換算ベース）に採用されている株式（先物・不動産投資信託証券（REIT）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。
- ・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

（注）マルチファクターモデル

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

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは20.5%の上昇となったため、カ
イ離は0.3%程度となりました。

	組入比率 要 因	銘柄選択 要 因	その他の 要 因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	0.0%程度	△0.1%程度	0.4%程度	0.3%程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.1%程度でした。

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

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

◎その他の要因

その他の要因による影響は0.4%程度でした。

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

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

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

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

◎今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年5月21日～2017年5月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 1	% 0.007	(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)	(0.005)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.003	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(1)	(0.003)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	11	0.058	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(10)	(0.056)	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)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	13	0.068	
期中の平均基準価額は、18,425円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2016年5月21日～2017年5月22日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 6,143 (645)	千アメリカドル 31,470 (670)	百株 29,982 (661)	千アメリカドル 183,943 (3,481)
	カナダ	929 (188)	千カナダドル 3,785 (ー)	3,533	千カナダドル 13,799
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	660 (470)	2,333 (△ 139)	2,378	9,419
	イタリア	1,848 (△ 1,143)	953 (△ 119)	6,036	2,020
	フランス	470 (225)	1,906 (△ 205)	2,395	8,880
	オランダ	416 (191)	663 (367)	1,917	3,651
	スペイン	1,411 (17,690)	526 (172)	21,952	3,039
	ベルギー	17 (△ 36)	130 (△ 333)	173	1,294
	オーストリア	12	32	59	186
	ルクセンブルク	79 (△ 349)	216 (ー)	206	265
	フィンランド	99	109	736	924
	アイルランド	654	131	2,852	554
	ポルトガル	48	28	16,051	173
	イギリス	78 (66)	276 (164)	82	269
	イギリス	6,389 (66,854)	千イギリスポンド 3,074 (63)	25,575 (76,257)	千イギリスポンド 16,363 (695)
	スイス	201 (ー)	千スイスフラン 1,127 (△ 238)	1,483	千スイスフラン 9,596
	スウェーデン	332 (218)	千スウェーデンクローネ 4,406 (ー)	2,183 (84)	千スウェーデンクローネ 27,245 (151)
	ノルウェー	185 (ー)	千ノルウェークローネ 2,532 (△ 103)	486	千ノルウェークローネ 5,739

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	デンマーク	百株 130 (36)	千デンマーククローネ 3,705 (ー)	百株 458	千デンマーククローネ 13,417
	オーストラリア	1,061 (138)	千オーストラリアドル 1,435 (ー)	6,824 (211)	千オーストラリアドル 9,718 (187)
	ニュージーランド	45	千ニュージーランドドル 28	492	千ニュージーランドドル 256
	香港	2,722 (282)	千香港ドル 5,906 (ー)	8,779	千香港ドル 27,893
	シンガポール	2,194 (1,738)	千シンガポールドル 383 (ー)	7,819 (1,738)	千シンガポールドル 1,875 (13)
	イスラエル	147	千イスラエルシェケル 954	750	千イスラエルシェケル 6,388

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口	千口	千アメリカドル
	HCP INC	0.54	19	3
	MACERICH CO/THE	0.101	8	1
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2	277	0.742
	PROLOGIS INC	0.804	40	4
	CAMDEN PROPERTY TRUST	0.135	11	0.756
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4	201	0.531
	DIGITAL REALTY TRUST INC	0.598	59	1
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.038	8	0.535
	EXTRA SPACE STORAGE INC	0.34	31	0.848
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.052	8	0.466
	WELLTOWER INC	0.361	26	2
	BOSTON PROPERTIES INC	0.092	12	1
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1	126	0.886
	REALTY INCOME CORP	0.561	37	2
	REGENCY CENTERS CORP	1	129	0.879
	SL GREEN REALTY CORP	0.096	9	0.713
	UDR INC	—	—	1
	VENTAS INC	0.75	48	2
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	5	57	9
	WEYERHAEUSER CO	0.643	18	7
	AMERICAN TOWER CORP	0.31	35	3
	AGNC INVESTMENT CORP	0.55	10	3
	VEREIT INC	4	48	9
	DUKE REALTY CORP	0.465	11	2
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	4	119	1
	IRON MOUNTAIN INC	1	73	2
	EQUINIX INC	0.13	47	0.431
	CROWN CASTLE INTL CORP	1	103	2
	QUALITY CARE PROPERTIES	—	—	3
		(3)	(—)	
	PARK HOTELS & RESORTS INC	—	—	3
		(3)	(83)	
	EQUITY RESIDENTIAL	0.333	22	3
	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	16	235	1
	GGP INC	0.506	15	4
	HOST HOTELS & RESORTS INC	0.954	15	6
	LIBERTY PROPERTY TRUST	—	—	1
	PUBLIC STORAGE	0.098	24	1
	SIMON PROPERTY GROUP INC	0.335	68	2
	VORNADO REALTY TRUST	0.177	17	1
	KIMCO REALTY CORP	0.522	16	3

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.111	19	1	200
	小計	53 (6)	2,019 (83)	105	5,180
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	—	—	0.5	15
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	0.8	16	0.7	15
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.6	16	2	56
	小計	1	33	3	87
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	GECINA SA	0.239	30	0.287	35
	KLEPIERRE	0.192	7	1	59
	UNIBAIL-RODAMCO SE	0.125	29	0.785	175
	FONCIERE DES REGIONS	0.171 (—)	13 (△0.97615)	0.259	19
	ICADE	0.353	23	0.393	25
	小計	1 (—)	104 (△0.97615)	3	316
	ユーロ計	1 (—)	104 (△0.97615)	3	316
	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC	0.976	5	9	63
	HAMMERSON PLC	1	6	6	35
	LAND SECURITIES GROUP PLC	0.596	6	7	77
	INTU PROPERTIES PLC	2	6	11	32
	SEGRO PLC	1	6	4	21
	SEGRO PLC -RTS	— (4)	— (—)	4	4
	小計	6 (4)	31 (—)	44	235
	オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
	VICINITY CENTRES	5	18	31	95
	SCENTRE GROUP	3	16	46	204
	GPT GROUP	2	10	15	74
	MIRVAC GROUP	5	10	32	67
	STOCKLAND	2	10	18	83
	WESTFIELD CORP	2	26	19	178
	DEXUS	2	23	9	86
	GOODMAN GROUP	1	13	16	116
	小計	25	130	188	906
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	3	161	19	1,004
	小計	3	161	19	1,004

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	SUNTEC REIT	8 (-)	13 (△0.73695)	26	43
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	16	24	32	48
	CAPITALAND MALL TRUST	5	11	21	42
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	— (-)	— (△ 0.4084)	6	13
	小 計	29 (-)	50 (△ 1)	87	148

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	株式先物取引	百万円 38,472	百万円 39,374	百万円 —	百万円 —

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

○株式売買比率

(2016年5月21日～2017年5月22日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	36,212,721千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	105,056,647千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.34

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年5月21日～2017年5月22日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			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 8,932	百万円 6,530	% 73.1	百万円 39,062	百万円 26,169	% 67.0

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

○組入資産の明細

(2017年5月22日現在)

外国株式

銘 柄	株 数	期首(前期末)	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	百株	千アメリカドル	千円	
ALCOA INC	464	—	—	—	素材
AMERICAN EXPRESS CO	296	218	1,680	187,455	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	527	484	2,092	233,371	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	117	89	499	55,751	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	19	15	238	26,585	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	163	126	1,244	138,809	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	26	20	79	8,907	小売
AES CORP	241	178	199	22,242	公益事業
AFLAC INC	150	112	834	93,097	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	437	288	1,766	197,046	保険
APACHE CORP	133	104	534	59,563	エネルギー
ADVANCED MICRO DEVICES	—	223	254	28,431	半導体・半導体製造装置
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	21	14	348	38,847	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	220	174	2,108	235,229	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	72	57	817	91,235	素材
ANTHEM INC	92	73	1,302	145,234	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	179	155	828	92,404	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	475	380	1,004	111,998	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	192	135	775	86,509	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	225	165	2,984	332,894	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	74	59	1,093	121,933	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	110	81	416	46,403	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	598	469	2,535	282,789	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	43	33	1,336	149,117	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,440	1,143	5,193	579,268	電気通信サービス
CR BARD INC	26	20	622	69,431	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	46	94	379	42,329	素材
BAKER HUGHES INC	156	111	647	72,172	エネルギー
ALLSTATE CORP	136	102	859	95,846	保険
AVERY DENNISON CORP	32	24	206	23,003	素材
CHUBB LTD	163	130	1,807	201,555	保険
ANALOG DEVICES INC	110	102	834	93,052	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	10	7	536	59,810	小売
CVS HEALTH CORP	391	299	2,285	254,896	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ENTERPRISES	76	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	419	263	765	85,419	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	1,303	1,002	8,502	948,397	銀行
CIGNA CORP	91	71	1,144	127,702	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	206	164	1,685	188,044	資本財
COCA-COLA CO/THE	1,481	1,148	5,044	562,610	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	188	135	1,083	120,887	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	65	53	300	33,478	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	345	263	1,324	147,789	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	71	—	—	—	メディア
CHEVRON CORP	666	529	5,643	629,491	エネルギー
COACH INC	97	78	356	39,813	耐久消費財・アパレル

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
ROCKWELL COLLINS INC		47	44	454	50,664	資本財
CONOCOPHILLIPS		437	348	1,653	184,382	エネルギー
CME GROUP INC		113	94	1,104	123,223	各種金融
CARDINAL HEALTH INC		116	88	649	72,463	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO		301	237	1,778	198,337	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC		212	176	1,389	155,007	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE		397	315	1,934	215,780	素材
DEVON ENERGY CORP		162	129	496	55,375	エネルギー
DEERE & CO		110	74	901	100,518	資本財
DANAHER CORP		218	174	1,434	160,021	ヘルスケア機器・サービス
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS		310	244	1,903	212,322	素材
WALT DISNEY CO/THE		555	424	4,559	508,613	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC		41	33	288	32,144	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP		244	194	1,620	180,718	公益事業
DR HORTON INC		118	100	339	37,907	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC		31	24	100	11,154	小売
TARGET CORP		206	148	830	92,596	小売
DUN & BRADSTREET CORP		12	10	109	12,229	商業・専門サービス
DAVITA INC		59	45	294	32,870	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP		55	44	367	41,016	資本財
DTE ENERGY COMPANY		64	51	547	61,060	公益事業
EXXON MOBIL CORP	1,473	1,162	1,162	9,526	1,062,575	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP		76	59	667	74,429	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC		194	161	1,517	169,227	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO		234	179	1,065	118,880	資本財
EXELON CORP		326	258	904	100,936	公益事業
ECOLAB INC		94	73	929	103,637	素材
EQUIFAX INC		41	33	461	51,518	商業・専門サービス
EMC CORP/MA		686	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A		78	61	564	62,940	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC		163	125	981	109,487	資本財
EDISON INTERNATIONAL		116	91	713	79,539	公益事業
ENTERGY CORP		64	51	392	43,807	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD		14	11	281	31,453	保険
EDGEWELL PERSONAL CARE CO		21	16	118	13,236	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC		163	131	1,810	201,952	公益事業
MACY'S INC		111	86	200	22,316	小売
FEDEX CORP		95	70	1,341	149,630	運輸
FMC TECHNOLOGIES INC		80	—	—	—	エネルギー
FORD MOTOR CO	1,311	1,038	1,038	1,128	125,903	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC		137	100	422	47,130	各種金融
FOOT LOCKER INC		48	37	221	24,718	小売
FIRSTENERGY CORP		150	116	329	36,749	公益事業
FLUOR CORP		50	40	183	20,482	資本財
FREEPORT-MCMORAN INC		407	368	432	48,192	素材
GENERAL MILLS INC		211	164	926	103,329	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP		94	72	1,420	158,393	資本財
WW GRAINGER INC		20	16	280	31,321	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	3,341	2,483	2,483	6,966	777,011	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC		46	41	376	41,949	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO		53	41	385	43,021	小売
TEGNA INC		74	58	133	14,938	メディア

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO		94	74	235	26,288	自動車・自動車部品
GAP INC/THE		85	67	151	16,881	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC		135	100	2,173	242,408	各種金融
HALLIBURTON CO		306	241	1,155	128,939	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC		258	203	2,679	298,828	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC		68	50	265	29,569	自動車・自動車部品
HP INC		636	477	906	101,122	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP		144	106	517	57,744	保険
HERSHEY CO/THE		52	40	458	51,097	食品・飲料・タバコ
HARMAN INTERNATIONAL		25	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HOME DEPOT INC		448	341	5,343	596,023	小売
HASBRO INC		40	31	322	35,999	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC		92	71	635	70,911	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP		326	253	3,853	429,864	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO		139	107	549	61,323	素材
ILLINOIS TOOL WORKS		115	88	1,212	135,190	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC		144	111	271	30,328	メディア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES		28	22	304	33,982	素材
JOHNSON & JOHNSON		979	762	9,684	1,080,252	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC		229	—	—	—	自動車・自動車部品
KANSAS CITY SOUTHERN		39	30	274	30,639	運輸
KELLOGG CO		93	72	513	57,265	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP		128	100	1,278	142,588	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A		562	434	1,986	221,570	食品・飲料・タバコ
KROGER CO		327	248	726	81,054	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP		69	51	191	21,310	小売
ELI LILLY & CO		352	278	2,170	242,067	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS		35	28	390	43,598	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO		59	44	258	28,873	運輸
LENNAR CORP-A		63	57	301	33,673	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC		324	244	2,070	230,906	小売
LEGGETT & PLATT INC		47	37	191	21,380	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC		86	69	339	37,813	小売
LAS VEGAS SANDS CORP		140	121	687	76,663	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP		97	74	2,027	226,163	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP		88	62	406	45,396	保険
L3 TECHNOLOGIES INC		28	21	356	39,779	資本財
LEGG MASON INC		34	—	—	—	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A		72	92	952	106,244	消費者サービス
MCDONALD'S CORP		324	233	3,458	385,767	消費者サービス
S&P GLOBAL INC		95	72	1,001	111,708	各種金融
MEDTRONIC PLC		500	391	3,261	363,735	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.		988	773	4,933	550,297	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC		382	289	806	89,904	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC		119	98	218	24,333	耐久消費財・アパレル
3M CO		217	169	3,310	369,240	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC		56	40	330	36,892	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL		158	124	390	43,507	消費者サービス
MASCO CORP		120	88	328	36,692	資本財
MONSANTO CO		155	122	1,427	159,256	素材
M & T BANK CORP		50	38	604	67,479	銀行
MARSH & MCLENNAN COS		184	143	1,073	119,786	保険

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
MOHAWK INDUSTRIES INC		22	17	408	45,617	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY		514	395	1,653	184,480	各種金融
MCKESSON CORP		81	62	963	107,452	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC		334	261	1,321	147,356	保険
MANPOWERGROUP INC		26	18	193	21,602	商業・専門サービス
MOODY'S CORP		63	47	546	60,911	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP		105	81	923	102,955	運輸
BANK OF AMERICA CORP	3,686	2,834	6,532	728,648	銀行	
NISOURCE INC	—	93	232	25,878	公益事業	
NORTHROP GRUMMAN CORP	61	46	1,169	130,467	資本財	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	171	140	183	20,422	銀行	
NEWMONT MINING CORP	187	145	489	54,563	素材	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	414	293	794	88,659	メディア	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	41	32	325	36,327	食品・飲料・タバコ	
MARKEL CORP	4	3	379	42,346	保険	
NUCOR CORP	113	87	493	55,039	素材	
NEWELL BRANDS INC	161	119	632	70,595	耐久消費財・アパレル	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	155	125	339	37,874	メディア	
NOBLE ENERGY INC	152	122	382	42,629	エネルギー	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	270	214	1,300	145,083	エネルギー	
OMNICOM GROUP	85	67	558	62,315	メディア	
PEPSICO INC	515	402	4,573	510,168	食品・飲料・タバコ	
PACKAGING CORP OF AMERICA	34	25	251	28,080	素材	
ALTRIA GROUP INC	694	546	3,876	432,387	食品・飲料・タバコ	
PINNACLE WEST CAPITAL	40	32	275	30,685	公益事業	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	962	716	6,177	688,985	家庭用品・パーソナル用品	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	179	136	1,622	180,973	銀行	
PFIZER INC	2,184	1,701	5,523	616,101	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	158	122	1,269	141,589	保険	
PULTEGROUP INC	110	84	196	21,877	耐久消費財・アパレル	
PARKER HANNIFIN CORP	48	36	577	64,459	資本財	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	57	48	851	94,935	エネルギー	
CITIGROUP INC	1,054	799	4,886	545,009	銀行	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	104	78	479	53,458	保険	
PPG INDUSTRIES INC	95	73	782	87,273	素材	
PENTAIR PLC	63	46	313	34,994	資本財	
PRAXAIR INC	100	79	1,031	115,026	素材	
P G & E CORP	175	141	930	103,784	公益事業	
PPL CORP	240	190	740	82,559	公益事業	
PROGRESSIVE CORP	205	164	676	75,494	保険	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	180	140	619	69,083	公益事業	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	60	—	—	—	消費者サービス	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	61	47	499	55,718	消費者サービス	
RAYTHEON COMPANY	106	82	1,317	146,936	資本財	
REPUBLIC SERVICES INC	85	67	415	46,363	商業・専門サービス	
REGIONS FINANCIAL CORP	459	336	474	52,920	銀行	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	15	11	163	18,212	保険	
ROPER TECHNOLOGIES INC	35	28	638	71,250	資本財	
CENTERPOINT ENERGY INC	149	120	330	36,873	公益事業	
ROBERT HALF INTL INC	46	37	172	19,199	商業・専門サービス	
ROCKWELL AUTOMATION INC	46	35	555	61,923	資本財	
SCHLUMBERGER LTD	493	390	2,802	312,612	エネルギー	

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
STRYKER CORP		119	94	1,290	143,960	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP		419	334	1,279	142,769	各種金融
SEMPRA ENERGY		84	66	741	82,654	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE		27	21	728	81,300	素材
ST JUDE MEDICAL INC		99	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC		53	41	565	63,055	資本財
SUNTRUST BANKS INC		179	139	752	83,913	銀行
TRAVELERS COS INC/THE		107	78	952	106,274	保険
SOUTHERN CO/THE		323	276	1,378	153,705	公益事業
AT&T INC		2,177	1,720	6,578	733,736	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP		98	79	685	76,458	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP		142	107	867	96,805	各種金融
SYSCO CORP		199	144	788	87,945	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP		70	55	239	26,669	素材
SCANA CORP		48	39	259	28,929	公益事業
TEXAS INSTRUMENTS INC		359	281	2,261	252,228	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO		45	35	327	36,513	小売
TORCHMARK CORP		43	32	238	26,553	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION		149	261	1,114	124,363	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC		141	111	1,907	212,810	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC		98	76	357	39,866	資本財
UNION PACIFIC CORP		302	231	2,480	276,622	運輸
UNUM GROUP		86	65	298	33,320	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP		298	220	2,670	297,906	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC		337	269	4,650	518,671	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP		618	476	2,432	271,356	銀行
MARATHON OIL CORP		292	239	348	38,854	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B		246	194	2,011	224,341	運輸
VALERO ENERGY CORP		170	126	804	89,777	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC		34	26	251	27,999	ヘルスケア機器・サービス
VALSPAR CORP/THE		—	21	234	26,161	素材
CBS CORP-CLASS B NON VOTING		153	108	669	74,662	メディア
VF CORP		120	90	474	52,941	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO		47	37	473	52,766	素材
WILLIAMS COS INC		252	226	684	76,303	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC		308	258	2,084	232,477	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC		112	87	536	59,796	公益事業
WAL-MART STORES INC		567	433	3,413	380,794	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO		1,717	1,337	7,096	791,580	銀行
WASTE MANAGEMENT INC		157	125	886	98,829	商業・専門サービス
WATERS CORP		28	22	403	44,964	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL		292	267	140	15,625	エネルギー
WHIRLPOOL CORP		27	21	380	42,426	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP		325	244	171	19,077	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XL GROUP PLC		104	—	—	—	保険
XCEL ENERGY INC		181	141	650	72,579	公益事業
KEYCORP		298	297	526	58,736	銀行
CARMAX INC		72	51	335	37,476	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC		66	55	652	72,738	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC		58	44	169	18,933	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC		152	96	675	75,326	消費者サービス
TJX COMPANIES INC		236	182	1,355	151,242	小売

銘柄	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
CA INC	117	89	278	31,084	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	45	35	467	52,139	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	52	40	343	38,262	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	—	81	265	29,645	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	145	98	608	67,856	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	99	86	719	80,282	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	153	113	427	47,706	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	104	87	702	78,385	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	282	206	500	55,777	銀行
STERICYCLE INC	29	23	200	22,312	商業・専門サービス
INTEL CORP	1,671	1,330	4,710	525,409	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	1,797	1,409	4,400	490,812	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	31	23	286	31,924	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	44	33	451	50,332	不動産
COSTCO WHOLESALE CORP	154	122	2,109	235,307	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	425	302	1,334	148,867	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	109	83	901	100,587	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	104	82	483	53,874	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	240	171	497	55,528	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	143	109	681	76,058	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	72	61	492	54,965	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	479	375	1,944	216,927	耐久消費財・アパレル
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	3	4	45	5,098	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	267	208	3,269	364,661	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	62	48	332	37,072	銀行
NORTHERN TRUST CORP	78	59	512	57,213	各種金融
MICROSOFT CORP	2,686	2,070	14,017	1,563,543	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	31	24	300	33,503	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	60	48	363	40,535	ヘルスケア機器・サービス
STAPLES INC	226	185	161	18,043	小売
STARBUCKS CORP	525	409	2,511	280,121	消費者サービス
ORACLE CORP	1,131	864	3,829	427,101	ソフトウェア・サービス
WHOLE FOODS MARKET INC	120	89	323	36,124	食品・生活必需品小売り
NETFLIX INC	143	120	1,892	211,043	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	34	26	655	73,119	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	180	165	925	103,247	ソフトウェア・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	67	50	529	59,075	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	29	22	406	45,338	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	47	37	214	23,919	小売
LAM RESEARCH CORP	56	45	686	76,545	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	29	23	282	31,486	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	878	1,336	5,193	579,257	メディア
XILINX INC	90	68	459	51,221	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	124	99	626	69,919	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	84	62	386	43,066	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	—	19	274	30,649	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	510	370	2,376	265,090	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	54	44	366	40,926	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	13	10	938	104,648	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	88	67	850	94,845	ソフトウェア・サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	87	76	145	16,191	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	114	92	530	59,149	ソフトウェア・サービス

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
YAHOO! INC		317	253	1,273	141,992	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC		31	23	101	11,297	ヘルスケア機器・サービス
SIGNATURE BANK		18	15	211	23,565	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH		24	37	401	44,748	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC		80	54	604	67,389	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A		90	67	204	22,818	メディア
SALESFORCE.COM INC		223	181	1,584	176,703	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC		48	36	150	16,739	小売
ALPHABET INC-CL A		103	83	7,930	884,543	ソフトウェア・サービス
UNITED THERAPEUTICS CORP		16	11	145	16,240	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B/E AEROSPACE INC		36	—	—	—	資本財
GARMIN LTD		39	33	170	19,047	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC		88	71	253	28,256	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC		532	414	2,392	266,910	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC		84	70	304	33,928	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC		55	42	304	33,937	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP		84	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS		100	76	360	40,195	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC		141	113	10,870	1,212,460	小売
T ROWE PRICE GROUP INC		88	66	467	52,168	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC		51	37	402	44,846	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP		56	44	450	50,246	半導体・半導体製造装置
E*TRADE FINANCIAL CORP		104	77	263	29,418	各種金融
CERNER CORP		108	86	555	61,937	ヘルスケア機器・サービス
BROADCOM LTD		139	113	2,647	295,347	半導体・半導体製造装置
ALKERMES PLC		53	43	252	28,130	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC		36	27	240	26,880	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC		106	84	500	55,869	電気通信サービス
WASTE CONNECTIONS INC		44	48	441	49,202	商業・専門サービス
EBAY INC		382	296	1,001	111,726	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP		189	151	2,059	229,741	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC		78	64	516	57,599	小売
PRICELINE GROUP INC/THE		17	13	2,506	279,550	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B		419	343	5,603	625,037	各種金融
BB&T CORP		287	226	956	106,640	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP		386	296	1,379	153,837	各種金融
BORGWARNER INC		79	60	243	27,113	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC		84	61	157	17,580	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE		41	31	397	44,372	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC		282	216	2,112	235,630	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP		68	46	418	46,711	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC		22	16	161	18,017	保険
AETNA INC		123	98	1,390	155,102	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION		87	70	391	43,665	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER		175	138	948	105,792	公益事業
AON PLC		96	74	951	106,135	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO		211	159	660	73,632	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD		33	24	156	17,470	保険
HESS CORP		99	81	396	44,212	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC		124	97	287	32,028	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP		95	70	258	28,882	各種金融
RED HAT INC		64	51	440	49,158	ソフトウェア・サービス

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
F5 NETWORKS INC		24	18	235	26,294	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A		79	64	408	45,549	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC		63	49	234	26,196	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC		103	78	311	34,783	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP		59	46	613	68,475	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD		150	123	198	22,086	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC		78	61	1,528	170,522	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC		51	40	721	80,514	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC		176	139	1,909	212,937	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		87	68	814	90,804	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR		—	254	758	84,653	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC		59	43	154	17,264	小売
CELGENE CORP		278	217	2,546	284,023	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A		215	169	1,108	123,646	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO		239	172	1,035	115,454	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC		65	51	269	30,077	運輸
FASTENAL CO		97	81	356	39,796	資本財
FISERV INC		80	60	726	81,060	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD		198	152	252	28,132	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIRIUS XM HOLDINGS INC		744	455	223	24,954	メディア
APPLE INC	1,973	1,495	22,882	2,552,310	2,552,310	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP		54	44	304	33,913	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC		281	308	387	43,187	銀行
COSTAR GROUP INC		—	9	235	26,293	ソフトウェア・サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC		79	62	708	79,068	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHLAND INC		22	—	—	—	素材
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC		50	40	270	30,158	運輸
CENTURYLINK INC		193	154	383	42,769	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC		47	39	145	16,187	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV		147	129	490	54,704	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC		74	60	310	34,682	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC		303	239	1,592	177,586	食品・飲料・タバコ
SEAGATE TECHNOLOGY		107	83	356	39,748	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD		50	39	274	30,567	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC		26	20	316	35,344	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC		132	106	371	41,471	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A		61	49	905	100,964	食品・飲料・タバコ
NEWFIELD EXPLORATION CO		—	56	193	21,610	エネルギー
COOPER COS INC/THE		17	13	295	32,917	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP		53	49	276	30,880	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A		109	85	620	69,237	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP		35	25	170	19,005	保険
AGCO CORP		23	18	118	13,193	資本財
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A		52	41	107	12,029	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP		50	109	523	58,347	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA INC		44	33	477	53,285	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC		83	67	192	21,419	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C		210	168	497	55,459	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC		61	44	565	63,129	各種金融
TESORO CORP		42	33	278	31,027	エネルギー
FNF GROUP		89	69	285	31,876	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN		41	168	1,002	111,799	各種金融

銘柄	株数	期首(前期末)	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	百株	千アメリカドル	千円	
NASDAQ INC	40	32	220	24,627	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	63	50	96	10,728	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	124	98	347	38,798	メディア
AUTOLIV INC	30	25	263	29,350	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	107	86	291	32,476	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	10	7	382	42,681	消費者サービス
IHS INC-CLASS A	24	—	—	—	商業・専門サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	41	60	317	35,428	食品・飲料・タバコ
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	159	118	281	31,375	小売
ARROW ELECTRONICS INC	32	25	188	21,024	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	59	44	684	76,297	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	42	34	183	20,446	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP	114	92	227	25,411	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	20	16	387	43,255	素材
RANGE RESOURCES CORP	60	52	134	14,993	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO	134	138	98	10,993	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	33	26	317	35,373	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	20	15	110	12,311	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	41	66	264	29,488	公益事業
OCEANEERING INTL INC	35	—	—	—	エネルギー
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	41	29	278	31,115	消費者サービス
HANESBRANDS INC	137	100	208	23,205	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A	350	270	3,177	354,455	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	180	136	260	29,030	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	31	41	182	20,345	資本財
AVNET INC	46	36	135	15,145	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	113	95	225	25,105	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	30	50	105	11,767	消費者サービス
SPECTRA ENERGY CORP	236	—	—	—	エネルギー
TRANSDIGM GROUP INC	19	14	370	41,332	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	—	33	246	27,546	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	46	35	498	55,552	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	105	86	144	16,105	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	136	98	735	81,987	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	151	109	657	73,335	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	39	31	155	17,384	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	19	15	178	19,952	資本財
MERCADOLIBRE INC	—	11	299	33,442	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A	28	18	172	19,287	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	99	81	374	41,764	保険
SEATTLE GENETICS INC	—	28	190	21,193	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ULTA BEAUTY INC	21	16	476	53,138	小売
LKQ CORP	106	87	272	30,345	小売
HORMEL FOODS CORP	103	77	271	30,248	食品・飲料・タバコ
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	—	22	173	19,403	運輸
EASTMAN CHEMICAL CO	52	41	329	36,702	素材
GAMESTOP CORP-CLASS A	35	—	—	—	小売
HARRIS CORP	43	33	363	40,536	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	52	41	947	105,640	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP	59	46	123	13,775	エネルギー
NRG ENERGY INC	110	—	—	—	公益事業
INVESCO LTD	149	116	368	41,049	各種金融

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC		56	48	434	48,439	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY		49	38	194	21,684	各種金融
TERADATA CORP		45	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC		59	46	272	30,426	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC		45	40	531	59,328	エネルギー
MSCI INC		35	25	247	27,572	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK		33	26	115	12,828	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B		65	53	503	56,160	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL		548	435	4,996	557,331	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES		688	523	4,844	540,404	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC		66	51	471	52,622	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N.V.		14	12	139	15,527	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP		160	132	310	34,638	エネルギー
FLOWERVE CORP		46	37	184	20,579	資本財
HELMERICH & PAYNE		38	31	186	20,800	エネルギー
T-MOBILE US INC		100	82	545	60,874	電気通信サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A		27	23	160	17,875	メディア
ILG INC		26	—	—	—	消費者サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C		97	65	164	18,354	メディア
RESMED INC		49	40	273	30,540	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC		29	23	271	30,334	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC		85	62	376	42,016	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD		42	34	329	36,726	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC		46	73	364	40,711	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC		32	25	215	24,063	運輸
PERRIGO CO PLC		52	40	288	32,215	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUANTA SERVICES INC		55	—	—	—	資本財
FMC CORP		47	38	284	31,728	素材
WABTEC CORP		34	24	200	22,415	資本財
EVERSOURCE ENERGY		113	88	530	59,175	公益事業
NETSUITE INC		14	—	—	—	ソフトウェア・サービス
INGREDION INC		—	20	237	26,500	食品・飲料・タバコ
ALLERGAN PLC		139	105	2,307	257,396	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRGAS INC		23	—	—	—	素材
CROWN HOLDINGS INC		49	40	225	25,108	素材
CALPINE CORP		121	98	135	15,132	公益事業
EATON VANCE CORP		41	32	143	16,053	各種金融
DELTA AIR LINES INC		71	54	261	29,209	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO		69	50	450	50,230	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC		64	49	374	41,816	公益事業
VERISK ANALYTICS INC		57	42	340	38,033	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP		104	77	557	62,172	小売
FORTINET INC		53	42	170	18,967	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS		33	22	178	19,909	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL		9	7	419	46,811	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC		60	57	269	30,028	銀行
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP		413	329	48	5,360	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO		500	384	1,258	140,417	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV		48	82	883	98,551	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A		135	96	779	86,967	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE		—	13	254	28,346	資本財
HCA HEALTHCARE INC		115	83	684	76,401	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC		130	—	—	—	運輸
HOLLYFRONTIER CORP		62	47	126	14,055	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP		188	146	774	86,404	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP		37	30	243	27,130	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI		56	43	275	30,689	資本財
DEXCOM INC		—	23	159	17,772	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP		—	16	205	22,966	資本財
XYLEM INC		63	51	265	29,597	資本財
TRIPADVISOR INC		42	34	150	16,736	小売
MEDIVATION INC		58	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC		21	17	254	28,397	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA		52	41	378	42,169	銀行
ALLEGHANY CORP		5	4	250	27,913	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS		27	21	973	108,620	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66		188	131	1,026	114,511	エネルギー
FACEBOOK INC-A		803	656	9,715	1,083,672	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP		100	77	357	39,879	公益事業
ALBEMARLE CORP		40	30	337	37,665	素材
PVH CORP		29	22	227	25,333	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A		40	—	—	—	ソフトウェア・サービス
KINDER MORGAN INC		671	531	1,036	115,651	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC		122	97	384	42,902	商業・専門サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC		98	74	643	71,802	自動車・自動車部品
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		60	48	194	21,668	資本財
SPLUNK INC		45	35	237	26,451	ソフトウェア・サービス
OGE ENERGY CORP		71	57	198	22,111	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC		21	17	153	17,112	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC		578	456	2,991	333,693	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC		34	36	1,119	124,915	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC		80	57	285	31,813	エネルギー
REALOGY HOLDINGS CORP		52	—	—	—	不動産
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		45	36	265	29,634	各種金融
ZOETIS INC		167	130	788	87,914	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC		41	30	125	13,974	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A		134	107	137	15,357	メディア
SPRINT CORP		294	229	185	20,666	電気通信サービス
TECO ENERGY INC		84	—	—	—	公益事業
SNAP-ON INC		20	16	270	30,146	資本財
AGL RESOURCES INC		43	—	—	—	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD		66	46	169	18,933	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC		206	162	298	33,253	ソフトウェア・サービス
VANTIV INC - CL A		54	46	283	31,612	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A		39	34	340	37,969	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC		53	45	453	50,572	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B		32	25	302	33,795	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV		34	—	—	—	資本財
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC		27	26	357	39,846	ソフトウェア・サービス
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS		65	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL C		110	86	8,124	906,257	ソフトウェア・サービス
IMS HEALTH HOLDINGS INC		56	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
NAVIENT CORP		127	88	123	13,732	各種金融
ENDO INTERNATIONAL PLC		77	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
UNITED RENTALS INC		32	23	263	29,362	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC		56	37	170	18,995	運輸
VOYA FINANCIAL INC		76	55	197	22,042	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP		16	—	—	—	素材
ANTERO RESOURCES CORP		29	46	102	11,415	エネルギー
QUINTILES IMS HOLDINGS INC		33	42	351	39,174	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC		155	113	213	23,791	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN		174	56	360	40,245	消費者サービス
CDK GLOBAL INC		48	37	227	25,364	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC		—	24	255	28,455	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C		—	30	251	28,004	メディア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN		57	45	224	25,051	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC		28	26	303	33,902	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIGNET JEWELERS LTD		26	17	101	11,297	小売
SYNCHRONY FINANCIAL		294	228	612	68,358	各種金融
QORVO INC		49	36	277	30,969	半導体・半導体製造装置
IONIS PHARMACEUTICALS INC		42	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARTHUR J GALLAGHER & CO		62	50	281	31,414	保険
ACUITY BRANDS INC		15	12	210	23,483	資本財
JONES LANG LASALLE INC		15	12	144	16,079	不動産
ARAMARK		81	62	228	25,445	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP		186	140	485	54,156	銀行
LEAR CORP		26	20	288	32,197	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC		26	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHITEWAVE FOODS CO		63	—	—	—	食品・飲料・タバコ
AXALTA COATING SYSTEMS LTD		50	62	194	21,694	素材
RITE AID CORP		373	301	104	11,636	食品・生活必需品小売り
TARGA RESOURCES CORP		—	51	263	29,397	エネルギー
BAXALTA INC		241	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLUMBIA PIPELINE GROUP		136	—	—	—	エネルギー
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C		—	30	60	6,720	メディア
WESTROCK CO		91	68	355	39,699	素材
KRAFT HEINZ CO/THE		214	170	1,542	172,103	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC		389	304	1,505	167,891	ソフトウェア・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A		19	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C		34	32	134	15,019	ソフトウェア・サービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS		638	463	858	95,799	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOBILEYE NV		30	50	309	34,465	ソフトウェア・サービス
AMERCO		2	1	70	7,899	運輸
CDW CORP/DE		50	41	235	26,311	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDNAX INC		33	26	143	16,021	ヘルスケア機器・サービス
SABRE CORP		67	60	138	15,473	ソフトウェア・サービス
FIRST DATA CORP- CLASS A		—	91	149	16,707	ソフトウェア・サービス
WR GRACE & CO		25	19	141	15,773	素材
UNDER ARMOUR INC-CLASS C		63	53	94	10,596	耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C		71	59	227	25,332	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A		33	24	93	10,453	メディア
INGEVITY CORP		15	—	—	—	素材
DOMINO'S PIZZA INC		—	13	268	29,898	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A		76	60	1,922	214,396	メディア
IDEXX LABORATORIES INC		—	25	404	45,070	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP		—	39	209	23,407	資本財

銘柄		期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
UGI CORP		—	47	225	25,205	公益事業
WESTAR ENERGY INC		—	41	216	24,134	公益事業
FORTIVE CORP		—	88	544	60,699	資本財
IHS MARKIT LTD		—	97	432	48,255	商業・専門サービス
XL GROUP LTD		—	76	315	35,178	保険
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V		—	63	411	45,887	ソフトウェア・サービス
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC		—	17	114	12,798	素材
COTY INC-CL A		—	136	256	28,628	家庭用品・パーソナル用品
ARCONIC INC		—	124	344	38,444	資本財
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A		—	61	193	21,542	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA		—	17	221	24,714	保険
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC		—	7	97	10,835	家庭用品・パーソナル用品
TELEFLEX INC		—	12	246	27,453	ヘルスケア機器・サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC		—	45	140	15,720	電気通信サービス
ENVISION HEALTHCARE CORP		—	33	184	20,585	ヘルスケア機器・サービス
TECHNIPFMC PLC		—	125	403	45,020	エネルギー
DXC TECHNOLOGY CO		—	78	612	68,304	ソフトウェア・サービス
VALVOLINE INC		—	48	109	12,218	素材
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		220	330	250	27,937	不動産
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD		—	60	252	28,148	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		90	70	447	49,907	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	111,339	87,483	586,145	65,378,664	
		596	597	—	<61.8%>	
(カナダ)				千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA		525	417	3,878	319,585	銀行
IMPERIAL OIL LTD		107	80	313	25,844	エネルギー
THOMSON REUTERS CORP		122	93	543	44,801	各種金融
TRANSCANADA CORP		251	243	1,523	125,550	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B		128	99	612	50,489	電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC		216	174	780	64,310	保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B		197	161	407	33,546	素材
BARRICK GOLD CORP		412	321	722	59,532	素材
BCE INC		51	42	253	20,900	電気通信サービス
AGRIUM INC		47	37	462	38,141	素材
BOMBARDIER INC-B		712	541	114	9,404	資本財
BANK OF MONTREAL		227	180	1,685	138,899	銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		313	249	1,265	104,241	各種金融
BANK OF NOVA SCOTIA		425	339	2,558	210,817	銀行
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE		116	94	172	14,203	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC		94	76	161	13,318	資本財
CAMECO CORP		141	113	150	12,401	エネルギー
CI FINANCIAL CORP		83	68	181	14,947	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		140	112	1,194	98,422	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES		387	308	1,293	106,605	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO		282	215	2,176	179,335	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A		25	19	288	23,770	小売
ENBRIDGE INC		325	459	2,456	202,358	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		7	6	389	32,090	保険
CGI GROUP INC - CLASS A		79	62	408	33,632	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC		123	99	165	13,602	エネルギー
IGM FINANCIAL INC		34	28	111	9,163	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD		80	63	483	39,837	食品・生活必需品小売り

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円	
MANULIFE FINANCIAL CORP		697	550	1,294	106,670	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC		143	105	641	52,831	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA		120	95	501	41,342	銀行
ONEX CORPORATION		30	24	233	19,235	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN		295	237	532	43,895	素材
POWER CORP OF CANADA		133	100	290	23,959	保険
POWER FINANCIAL CORP		89	65	210	17,319	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		145	119	340	28,070	メディア
SUNCOR ENERGY INC		560	468	2,026	166,958	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD		18	13	158	13,091	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		51	39	820	67,605	運輸
ENCANA CORP		302	263	402	33,131	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD		78	63	419	34,564	素材
FINNING INTERNATIONAL INC		62	47	122	10,056	資本財
GOLDCORP INC		293	243	455	37,498	素材
KINROSS GOLD CORP		433	353	202	16,694	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC		53	43	219	18,110	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC		106	83	279	23,058	保険
METHANEX CORP		31	26	155	12,814	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD		346	281	104	8,612	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A		32	25	54	4,510	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC		82	62	232	19,170	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC		91	67	292	24,139	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD		175	140	196	16,183	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELUS CORP		79	57	260	21,442	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		239	198	239	19,755	素材
YAMANA GOLD INC		343	260	98	8,118	素材
FORTIS INC		102	110	480	39,568	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B		148	115	708	58,374	食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP		267	198	92	7,650	素材
TORONTO-DOMINION BANK		656	522	3,291	271,162	銀行
FRANCO-NEVADA CORP		62	48	473	39,048	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		148	126	358	29,544	素材
EMPIRE CO LTD 'A'		60	45	94	7,796	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC		37	29	147	12,135	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A		45	37	150	12,385	公益事業
METRO INC		86	66	300	24,779	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP		43	74	322	26,600	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP		47	37	344	28,396	保険
CRESCENT POINT ENERGY CORP		179	151	201	16,621	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC		295	290	379	31,252	エネルギー
ARC RESOURCES LTD		122	101	185	15,311	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP		66	66	184	15,220	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP		133	113	497	40,992	エネルギー
VERMILION ENERGY INC		41	34	159	13,137	エネルギー
DOLLARAMA INC		43	32	388	32,017	小売
KEYERA CORP		61	53	215	17,785	エネルギー
ALTAGAS LTD		51	47	145	12,008	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP		53	47	123	10,203	エネルギー
ATCO LTD -CLASS I		30	23	115	9,552	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC		42	41	81	6,715	不動産
INTER PIPELINE LTD		120	104	280	23,143	エネルギー

銘柄		期首(前期末)		当		期		業	種	等
		株	数	株	数	評 価 額				
						外貨建金額	邦貨換算金額			
(カナダ)			百株		百株		千カナダドル		千円	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD			63		57		172		14,214	エネルギー
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A			59		68		178		14,729	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC			7		5		341		28,116	ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN			72		59		486		40,079	消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD			25		18		108		8,898	素材
VERESEN INC			108		89		166		13,682	エネルギー
CCL INDUSTRIES INC - CL B			10		8		241		19,910	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR			136		110		122		10,059	各種金融
LINAMAR CORP			18		14		89		7,375	自動車・自動車部品
HYDRO ONE LTD			—		55		127		10,494	公益事業
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS			38		—		—		—	商業・専門サービス
EMERA INC			—		15		70		5,815	公益事業
小	計	株 数 ・ 金 額	14,150	株 数	11,734		47,376		3,903,379	
		銘柄 数 < 比 率 >	90		91		—		<3.7%>	
(ユーロ…ドイツ)							千ユーロ			
COMMERZBANK AG			375		304		290		36,252	銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED			488		578		987		123,272	各種金融
METRO AG			63		51		156		19,572	食品・生活必需品小売り
SIEMENS AG-REG			280		215		2,764		345,007	資本財
RWE AG			173		140		238		29,751	公益事業
BASF SE			324		259		2,222		277,288	素材
VOLKSWAGEN AG			12		9		134		16,744	自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES			340		271		1,841		229,777	自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG			62		49		606		75,731	家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE			707		581		430		53,660	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG			117		92		796		99,381	自動車・自動車部品
BAYER AG-REG			292		232		2,717		339,096	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINDE AG			65		51		860		107,384	素材
ALLIANZ SE-REG			161		128		2,183		272,473	保険
MAN SE			11		9		93		11,666	資本財
CONTINENTAL AG			38		30		612		76,479	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG			401		313		603		75,288	半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF			54		43		232		29,034	自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG			82		67		110		13,776	運輸
HUGO BOSS AG -ORD			23		18		131		16,363	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE POST AG-REG			343		270		854		106,687	運輸
SAP SE			347		276		2,597		324,111	ソフトウェア・サービス
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE			78		66		246		30,711	メディア
DEUTSCHE BOERSE AG			67		54		488		60,958	各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &			77		59		484		60,407	ヘルスケア機器・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT			14		10		74		9,302	運輸
ADIDAS AG			74		52		907		113,271	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG			1,141		921		1,640		204,753	電気通信サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG			58		44		768		95,902	保険
THYSSENKRUPP AG			130		104		240		30,018	素材
BEIERSDORF AG			35		28		264		33,062	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG			48		42		353		44,130	素材
MERCK KGAA			46		35		383		47,854	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOLKSWAGEN AG-PREF			65		51		717		89,553	自動車・自動車部品
LANXESS AG			32		24		158		19,730	素材
FRESENIUS SE & CO KGAA			135		114		873		108,953	ヘルスケア機器・サービス
HOCHTIEF AG			—		5		94		11,849	資本財

銘柄		期首(前期末)	当期		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR		118	100	345	43,162	不動産
GEA GROUP AG		65	52	193	24,091	資本財
SYMRISE AG		44	35	222	27,775	素材
K+S AG-REG		69	54	128	16,082	素材
HENKEL AG & CO KGAA		36	29	321	40,078	家庭用品・パーソナル用品
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		44	35	167	20,911	ソフトウェア・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		18	15	115	14,355	自動車・自動車部品
HANNOVER RUECK SE		21	17	180	22,556	保険
BRENNTAG AG		54	44	230	28,815	資本財
AXEL SPRINGER SE		15	12	70	8,738	メディア
FUCHS PETROLUB SE -PREF		23	20	98	12,311	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		253	213	88	11,063	電気通信サービス
OSRAM LICHT AG		30	25	171	21,462	資本財
VONOVIA SE		165	127	439	54,803	不動産
EVONIK INDUSTRIES AG		49	45	143	17,909	素材
ZALANDO SE		31	23	95	11,960	小売
COVESTRO AG		—	20	135	16,855	素材
SCHAEFFLER AG		—	46	70	8,813	自動車・自動車部品
INNOGY SE		—	40	140	17,512	公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,820	6,572	32,522	4,058,520	
		52	56	—	<3.8%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI		411	320	484	60,488	保険
INTESA SANPAOLO		4,499	3,537	990	123,594	銀行
TELECOM ITALIA SPA		4,068	3,250	286	35,775	電気通信サービス
ENI SPA		901	712	1,071	133,698	エネルギー
UNICREDIT SPA		1,687	526	885	110,442	銀行
ENEL SPA		2,712	2,135	1,000	124,824	公益事業
SAIPEM SPA		2,049	1,674	65	8,164	エネルギー
ATLANTIA SPA		144	117	292	36,530	運輸
INTESA SANPAOLO-RSP		324	275	73	9,165	銀行
LUXOTTICA GROUP SPA		60	47	259	32,382	耐久消費財・アパレル
MEDIOBANCA SPA		203	165	149	18,663	銀行
SNAM SPA		753	696	302	37,701	エネルギー
TELECOM ITALIA-RSP		2,076	1,692	121	15,202	電気通信サービス
BANCO POPOLARE SC		130	—	—	—	銀行
LEONARDO SPA		146	114	175	21,890	資本財
UBI BANCA SPA		318	—	—	—	銀行
TERNA SPA		551	409	205	25,617	公益事業
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA		391	329	71	8,870	保険
PRYSMIAN SPA		66	55	134	16,780	資本財
EXOR SPA		38	—	—	—	各種金融
POSTE ITALIANE SPA		—	143	91	11,358	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	21,536	16,204	6,660	831,151	
		20	18	—	<0.8%>	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)		65	50	598	74,718	自動車・自動車部品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		98	78	1,796	224,226	耐久消費財・アパレル
PEUGEOT SA		157	136	253	31,673	自動車・自動車部品
AXA SA		696	543	1,292	161,265	保険
DANONE		208	165	1,087	135,760	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA		194	155	354	44,273	食品・生活必需品小売り

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		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	
VIVENDI	409	283	536	66,960	メディア
INGENICO GROUP	19	15	139	17,394	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA	256	214	1,073	133,953	銀行
AIR LIQUIDE SA	121	109	1,208	150,752	素材
TOTAL SA	777	640	3,098	386,706	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	168	138	699	87,242	資本財
ZODIAC AEROSPACE	70	58	135	16,952	資本財
VINCI SA	169	142	1,088	135,892	資本財
SANOFI	415	325	2,880	359,488	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	164	137	265	33,090	公益事業
L' OREAL	88	70	1,320	164,768	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA	75	48	201	25,169	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	197	157	1,077	134,470	資本財
BNP PARIBAS	374	318	2,093	261,271	銀行
ESSILOR INTERNATIONAL	72	57	683	85,282	ヘルスケア機器・サービス
CAPGEMINI	57	44	416	51,997	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	20	15	84	10,527	食品・生活必需品小売り
VALEO SA	28	65	423	52,837	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	9	7	328	41,012	耐久消費財・アパレル
SODEXO	33	25	308	38,524	消費者サービス
KERING	27	20	608	75,980	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	45	36	301	37,581	ソフトウェア・サービス
TECHNIP SA	37	—	—	—	エネルギー
CHRISTIAN DIOR SE	19	14	375	46,810	耐久消費財・アパレル
ATOS SE	31	24	296	37,036	ソフトウェア・サービス
ORANGE	702	555	850	106,073	電気通信サービス
CNP ASSURANCES	59	49	93	11,668	保険
IMERYS SA	13	10	81	10,150	素材
SAFRAN SA	110	86	661	82,578	資本財
RENAULT SA	67	52	452	56,503	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	67	54	357	44,568	メディア
LAGARDERE SCA	40	32	89	11,216	メディア
JCDECAUX SA	27	20	59	7,406	メディア
SOCIETE BIC SA	10	8	89	11,144	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	73	55	209	26,134	資本財
THALES SA	37	29	292	36,562	資本財
PERNOD RICARD SA	75	59	703	87,762	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	375	319	457	57,124	銀行
ENGIE	519	440	594	74,129	公益事業
ALSTOM	54	43	133	16,708	資本財
ARKEMA	23	17	172	21,484	素材
LEGRAND SA	94	73	446	55,751	資本財
SCOR SE	53	42	147	18,374	保険
ADP	10	8	110	13,793	運輸
EDF	85	82	76	9,561	公益事業
NATIXIS	335	270	171	21,418	銀行
WENDEL	10	7	107	13,398	各種金融
BUREAU VERITAS SA	94	76	161	20,100	商業・専門サービス
EURAZEO	13	11	68	8,491	各種金融
EURAZEO-NEW	0.69	—	—	—	各種金融
SUEZ	109	98	160	20,014	公益事業
EIFFAGE	—	17	133	16,640	資本財

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ILIAD SA		9	7	165	20,712	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS		60	48	107	13,476	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR		168	137	141	17,620	運輸
EDENRED		71	60	137	17,153	商業・専門サービス
REMY COINTREAU		7	6	62	7,756	食品・飲料・タバコ
REXEL SA		105	86	131	16,465	資本財
BOLLORE		319	260	103	12,907	運輸
SFR GROUP SA		40	24	74	9,268	電気通信サービス
DASSAULT AVIATION SA		—	0.5	66	8,270	資本財
SEB SA		—	6	96	12,048	耐久消費財・アパレル
小 計	株 数 ・ 金 額	8,966	7,267	32,999	4,118,062	
	銘 柄 数 < 比 率 >	65	66	—	<3.9%>	
(ユーロ…オランダ)						
QIAGEN N.V.		80	62	180	22,532	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV		334	291	293	36,574	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		320	256	248	31,065	自動車・自動車部品
FERRARI NV		44	35	260	32,538	自動車・自動車部品
EXOR NV		—	31	165	20,669	各種金融
AIRBUS SE		209	162	1,200	149,794	資本財
STMICROELECTRONICS NV		221	182	267	33,331	半導体・半導体製造装置
GEMALTO		28	23	126	15,726	ソフトウェア・サービス
WOLTERS KLUWER		107	85	338	42,230	商業・専門サービス
KONINKLIJKE KPN NV		1,149	970	284	35,549	電気通信サービス
AKZO NOBEL		87	69	522	65,173	素材
HEINEKEN NV		81	63	547	68,324	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV		336	264	834	104,187	資本財
RELX NV		351	273	500	62,502	商業・専門サービス
AEGON NV		652	504	223	27,849	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		294	354	716	89,352	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD HOLDING NV		45	33	180	22,516	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV		36	29	237	29,659	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV		63	49	326	40,729	素材
ING GROEP NV		1,369	1,091	1,646	205,451	銀行
ASML HOLDING NV		122	104	1,261	157,449	半導体・半導体製造装置
UNILEVER NV-CVA		576	457	2,253	281,157	家庭用品・パーソナル用品
VOPAK		25	20	84	10,508	エネルギー
BOSKALIS WESTMINSTER		30	25	77	9,702	資本財
TNT EXPRESS NV		173	—	—	—	運輸
OCI NV		30	—	—	—	素材
NN GROUP NV		113	89	286	35,765	保険
ALTICE NV - B		40	26	57	7,148	メディア
ALTICE NV - A		130	110	234	29,320	メディア
ABN AMRO GROUP NV-CVA		—	81	191	23,945	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	7,057	5,748	13,548	1,690,756	
	銘 柄 数 < 比 率 >	28	28	—	<1.6%>	
(ユーロ…スペイン)						
BANCO POPULAR ESPANOL		600	921	66	8,270	銀行
ENDESA SA		114	91	193	24,127	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		67	54	194	24,241	資本財
IBERDROLA SA		1,948	1,548	1,073	134,003	公益事業
TELEFONICA SA		1,592	1,271	1,264	157,776	電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA		5,105	4,092	2,387	297,881	銀行

銘柄		期首(前期末)	当期		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
BANKINTER SA		236	190	158	19,775	銀行
REPSOL SA		388	320	475	59,393	エネルギー
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		2,292	1,864	1,382	172,488	銀行
GAS NATURAL SDG SA		126	102	222	27,705	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		383	303	1,091	136,211	小売
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		186	175	287	35,911	運輸
MAPFRE SA		391	298	92	11,593	保険
FERROVIAL SA		168	137	270	33,712	資本財
ZARDOYA OTIS SA		67	51	44	5,546	資本財
ENAGAS SA		76	65	167	20,916	エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA		38	125	241	30,163	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		1,836	1,524	276	34,525	銀行
CAIXABANK S.A		937	1,018	429	53,635	銀行
GRIFOLS SA		105	84	214	26,756	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMADEUS IT GROUP SA		154	124	642	80,121	ソフトウェア・サービス
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI		293	240	166	20,785	運輸
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		215	173	92	11,503	食品・生活必需品小売り
BANKIA SA		1,600	1,303	135	16,962	銀行
AENA SA		24	19	326	40,803	運輸
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	18,953 25	16,103 25	11,898 —	1,484,813 <1.4%>	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS		72	54	205	25,598	保険
UCB SA		44	35	275	34,359	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		284	—	—	—	食品・飲料・タバコ
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		28	22	194	24,250	各種金融
DELHAIZE GROUP		36	—	—	—	食品・生活必需品小売り
UMICORE		33	26	160	20,044	素材
COLRUYT SA		25	18	87	10,965	食品・生活必需品小売り
KBC GROEP NV		88	68	453	56,634	銀行
SOLVAY SA		26	21	249	31,182	素材
PROXIMUS		53	42	132	16,473	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		19	15	90	11,266	メディア
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		—	214	2,265	282,773	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	713 11	521 10	4,115 —	513,548 <0.5%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG		99	86	295	36,861	銀行
OMV AG		54	42	204	25,509	エネルギー
VOESTALPINE AG		41	31	125	15,663	素材
ANDRITZ AG		28	20	109	13,667	資本財
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		39	34	78	9,768	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	262 5	215 5	813 —	101,470 <0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP		13	10	73	9,175	メディア
TENARIS SA		165	135	194	24,333	エネルギー
SES		117	104	219	27,354	メディア
EUROFINS SCIENTIFIC		—	3	138	17,275	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCELORMITTAL		607	174	350	43,780	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	903 4	427 5	976 —	121,919 <0.1%>	

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
NOKIA OYJ		2,041	1,629	906	113,158	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS		194	156	175	21,919	素材
NOKIAN RENKAAT OYJ		41	33	124	15,495	自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ		185	144	357	44,628	素材
FORTUM OYJ		159	128	179	22,404	公益事業
KONE OYJ-B		118	91	394	49,244	資本財
METSO OYJ		41	31	97	12,146	資本財
SAMPO OYJ-A SHS		157	123	552	68,930	保険
WARTSILA OYJ ABP		52	41	221	27,679	資本財
ELISA OYJ		50	41	140	17,472	電気通信サービス
NESTE OYJ		45	36	137	17,166	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		37	28	161	20,173	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 柄 数 < 比 率 >	3,125 12	2,488 12	3,449 —	430,420 <0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A		57	46	361	45,053	食品・飲料・タバコ
PADDY POWER BETFAIR PLC		30	20	194	24,219	消費者サービス
BANK OF IRELAND		10,157	8,041	196	24,484	銀行
CRH PLC		295	234	767	95,791	素材
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 柄 数 < 比 率 >	10,540 4	8,341 4	1,518 —	189,548 <0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		836	687	212	26,567	公益事業
JERONIMO MARTINS		89	71	124	15,517	食品・生活必需品小売り
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R		15,817	—	—	—	銀行
GALP ENERGIA SGPS SA		163	144	206	25,758	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 柄 数 < 比 率 >	16,906 4	903 3	543 —	67,843 <0.1%>	
(ユーロ…イギリス)						
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		—	62	223	27,938	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 柄 数 < 比 率 >	— —	62 1	223 —	27,938 <0.0%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 柄 数 < 比 率 >	96,787 230	64,856 233	109,271 —	13,635,994 <12.9%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC		5,939	4,750	1,015	146,951	銀行
BP PLC		6,486	5,315	2,509	363,294	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC		20,217	18,034	1,294	187,396	銀行
ASTRAZENECA PLC		447	355	1,819	263,331	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC		140	112	178	25,835	資本財
NEXT PLC		52	40	176	25,618	小売
DIAGEO PLC		890	706	1,620	234,568	食品・飲料・タバコ
SKY PLC		365	282	283	41,071	メディア
BAE SYSTEMS PLC		1,116	902	577	83,568	資本財
UNILEVER PLC		453	360	1,491	215,957	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC		2,873	2,249	410	59,422	食品・生活必需品小売り
RELX PLC		392	308	502	72,685	商業・専門サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC		583	465	179	25,921	小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		225	176	1,346	194,868	家庭用品・パーソナル用品
PRUDENTIAL PLC		909	724	1,272	184,240	保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		2,095	1,633	406	58,903	保険
SAGE GROUP PLC/THE		380	306	213	30,910	ソフトウェア・サービス

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)		百株	百株	千イギリスポンド	千円	
HSBC HOLDINGS PLC		6,929	5,548	3,692	534,532	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		660	523	2,827	409,282	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC		251	187	193	28,069	公益事業
SCHRODERS PLC		43	38	118	17,177	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP		1,224	1,002	263	38,143	銀行
BHP BILLITON PLC		748	587	714	103,403	素材
IMPERIAL BRANDS PLC		339	268	986	142,831	食品・飲料・タバコ
WPP PLC		463	354	608	88,107	メディア
CENTRICA PLC		1,805	1,569	315	45,721	公益事業
BT GROUP PLC		2,996	2,358	734	106,378	電気通信サービス
SSE PLC		359	282	425	61,611	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC		1,158	914	673	97,475	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		650	506	431	62,405	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C		46,179	37,114	3	537	資本財
COMPASS GROUP PLC		580	457	731	105,906	消費者サービス
KINGFISHER PLC		802	629	231	33,524	小売
PEARSON PLC		289	236	164	23,882	メディア
SEVERN TRENT PLC		87	65	158	22,954	公益事業
RIO TINTO PLC		439	346	1,097	158,852	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC		1,722	1,369	2,256	326,712	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SABMILLER PLC		343	—	—	—	食品・飲料・タバコ
PROVIDENT FINANCIAL PLC		51	42	132	19,125	各種金融
3I GROUP PLC		342	269	223	32,320	各種金融
GKN PLC		608	491	173	25,156	自動車・自動車部品
VODAFONE GROUP PLC		9,393	7,469	1,645	238,201	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS		793	639	155	22,460	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC		476	472	129	18,746	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC		1,430	1,125	601	87,014	保険
CAPITA PLC		237	188	109	15,914	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC		349	277	90	13,141	小売
JOHNSON MATTHEY PLC		68	55	168	24,450	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC		361	292	178	25,812	保険
WHITBREAD PLC		65	51	215	31,147	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC		1,331	1,063	1,120	162,270	公益事業
ARM HOLDINGS PLC		495	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WOLSELEY PLC		90	71	350	50,779	資本財
BUNZL PLC		120	95	233	33,856	資本財
COBHAM PLC		414	479	66	9,638	資本財
ANGLO AMERICAN PLC		495	384	420	60,827	素材
INTERTEK GROUP PLC		57	43	179	25,938	商業・専門サービス
WILLIAM HILL PLC		312	237	68	9,963	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC		159	125	214	31,054	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		68	51	218	31,582	消費者サービス
CARNIVAL PLC		67	53	255	36,955	消費者サービス
PERSIMMON PLC		109	88	214	31,006	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC		272	220	107	15,536	資本財
ICAP PLC		193	—	—	—	各種金融
ITV PLC		1,368	1,019	199	28,916	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		110	89	309	44,792	各種金融
G4S PLC		550	410	132	19,162	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE		46	37	126	18,337	耐久消費財・アパレル
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		358	288	175	25,438	耐久消費財・アパレル

銘柄		期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		百株	百株	千イギリスポンド	千円	
IMI PLC		95	77	96	14,015	資本財
REXAM PLC		250	—	—	—	素材
SMITH & NEPHEW PLC		314	249	331	47,943	ヘルスケア機器・サービス
TATE & LYLE PLC		161	132	103	14,935	食品・飲料・タバコ
TAYLOR WIMPEY PLC		1,157	926	183	26,569	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		1,394	1,221	2,587	374,541	エネルギー
PETROFAC LTD		94	72	47	6,870	エネルギー
TRAVIS PERKINS PLC		86	70	117	16,958	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		1,403	1,055	2,284	330,652	エネルギー
OLD MUTUAL PLC		1,743	1,401	267	38,753	保険
INVESTEC PLC		192	187	112	16,323	各種金融
STANDARD LIFE PLC		689	565	216	31,395	保険
EXPERIAN PLC		341	270	440	63,806	商業・専門サービス
MONDI PLC		130	98	194	28,223	素材
WEIR GROUP PLC/THE		77	62	119	17,232	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		125	100	289	41,978	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC		135	109	88	12,806	素材
SHIRE PLC		209	253	1,230	178,059	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INMARSAT PLC		157	128	100	14,608	電気通信サービス
ADMIRAL GROUP PLC		74	55	110	15,982	保険
FRESNILLO PLC		80	62	100	14,531	素材
RANDGOLD RESOURCES LTD		32	26	194	28,200	素材
AGGREKO PLC		93	—	—	—	商業・専門サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC		92	74	69	10,126	商業・専門サービス
ST JAMES'S PLACE PLC		188	149	174	25,304	保険
GLENCORE PLC		4,329	3,428	1,011	146,495	素材
ABERDEEN ASSET MGMT PLC		321	254	73	10,652	各種金融
HARGREAVES LANSDOWN PLC		92	72	99	14,334	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC		46	37	146	21,238	素材
COCA-COLA HBC AG-DI		70	51	114	16,552	食品・飲料・タバコ
EASYJET PLC		57	47	59	8,673	運輸
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		489	386	136	19,697	保険
ROYAL MAIL PLC		320	253	108	15,718	運輸
ASHTREAD GROUP PLC		177	142	222	32,267	資本財
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL		96	—	—	—	小売
MERLIN ENTERTAINMENT		252	198	101	14,762	消費者サービス
TUI AG-DI		178	142	161	23,379	消費者サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		—	40	70	10,243	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC		129	104	91	13,195	ヘルスケア機器・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC		277	286	116	16,826	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY GROUP PLC		506	482	155	22,460	ソフトウェア・サービス
DCC PLC		—	25	186	26,961	資本財
小計	株数・金額	149,119	120,530	52,465	7,594,890	
	銘柄数<比率>	109	105	—	<7.2%>	
(スイス)				千スイスフラン		
NESTLE SA-REG		1,128	872	7,186	822,765	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG		184	146	1,194	136,781	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		636	565	794	90,989	各種金融
LAFARGEHOLCIM LTD-REG		161	126	687	78,731	素材
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN		248	197	5,267	603,061	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GIVAUDAN-REG		3	2	520	59,584	素材
SONOVA HOLDING AG-REG		18	14	231	26,528	ヘルスケア機器・サービス

銘 柄	株 数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	53	42	1,204	137,929	保険
SYNGENTA AG-REG	32	25	1,173	134,409	素材
LONZA GROUP AG-REG	18	16	325	37,320	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWATCH GROUP AG/THE-REG	17	14	109	12,524	耐久消費財・アパレル
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	15	12	253	29,017	資本財
GEBERIT AG-REG	13	10	477	54,640	資本財
SWISS RE AG	124	89	789	90,363	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR	10	8	336	38,489	耐久消費財・アパレル
PARGESA HOLDING SA-BR	11	9	70	8,074	各種金融
NOVARTIS AG-REG	805	626	4,935	565,119	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	58	46	348	39,868	商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG	9	7	334	38,301	電気通信サービス
ABB LTD-REG	778	535	1,300	148,917	資本財
SGS SA-REG	1	1	364	41,719	商業・専門サービス
SULZER AG-REG	5	—	—	—	資本財
SCHINDLER HOLDING AG-REG	7	4	99	11,373	資本財
ACTELION LTD-REG	36	26	736	84,357	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	19	15	236	27,081	運輸
BALOISE HOLDING AG - REG	17	14	208	23,889	保険
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	11	9	295	33,869	保険
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.04	0.03	208	23,826	食品・飲料・タバコ
ARYZTA AG	29	24	86	9,895	食品・飲料・タバコ
JULIUS BAER GROUP LTD	78	64	332	38,036	各種金融
SIKA AG-BR	0.76	0.59	373	42,724	素材
SWISS PRIME SITE-REG	23	20	177	20,322	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.34	0.28	163	18,705	食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG	5	4	284	32,527	各種金融
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.83	0.61	84	9,637	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2	2	155	17,819	素材
UBS GROUP AG-REG	1,295	1,030	1,643	188,199	各種金融
DUFREY AG-REG	14	10	174	19,986	小売
GALENICA AG-REG	1	1	131	15,059	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	5,884	4,603	33,299	3,812,450
銘柄数<比率>		39	38	—	<3.6%>
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-SER B	84	63	1,696	21,665	耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS	1,078	843	4,891	62,465	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS	138	110	3,126	39,922	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	539	418	4,406	56,267	銀行
INVESTOR AB-B SHS	161	128	5,110	65,266	各種金融
NORDEA BANK AB	1,076	849	9,747	124,476	銀行
GETINGE AB-B SHS	73	56	1,008	12,879	ヘルスケア機器・サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	527	435	5,444	69,529	銀行
ATLAS COPCO AB-A SHS	237	185	5,879	75,077	資本財
SKF AB-B SHARES	141	112	2,011	25,686	資本財
ASSA ABLOY AB-B	353	284	5,391	68,848	資本財
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	335	261	5,792	73,965	小売
SANDVIK AB	375	291	3,935	50,261	資本財
SWEDBANK AB - A SHARES	318	258	5,335	68,128	銀行
SECURITAS AB-B SHS	111	90	1,246	15,920	商業・専門サービス
SVENSKA CELLULOSEA AB SCA-B	213	172	5,174	66,082	家庭用品・パーソナル用品
SKANSKA AB-B SHS	135	95	1,970	25,158	資本財

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
		株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円	
SWEDISH MATCH AB		69	54	1,595	20,374	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS		117	104	901	11,517	電気通信サービス
TELIA CO AB		939	735	2,828	36,116	電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS		543	440	6,283	80,245	資本財
ALFA LAVAL AB		103	83	1,439	18,378	資本財
LUNDIN PETROLEUM AB		79	54	960	12,261	エネルギー
BOLIDEN AB		93	77	1,892	24,167	素材
HUSQVARNA AB-B SHS		144	116	1,013	12,936	耐久消費財・アパレル
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR		24	18	895	11,431	電気通信サービス
HEXAGON AB-B SHS		91	70	2,733	34,909	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINNEVIK AB - B		84	66	1,578	20,162	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		50	44	902	11,523	各種金融
ICA GRUPPEN AB		28	22	706	9,016	食品・生活必需品小売り
LUNDBERGS AB-B SHS		—	10	663	8,472	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額	8,273	6,557	96,563	1,233,117	
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	31	—	<1.2%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
DNB ASA		349	267	3,900	51,909	銀行
NORSK HYDRO ASA		475	378	1,811	24,111	素材
ORKLA ASA		286	228	1,941	25,841	食品・飲料・タバコ
STATOIL ASA		394	312	4,788	63,739	エネルギー
TELENOR ASA		264	212	2,831	37,693	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		63	50	1,626	21,654	素材
MARINE HARVEST		—	109	1,687	22,458	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		69	56	766	10,198	保険
SCHIBSTED ASA-CL A		27	22	463	6,162	メディア
SCHIBSTED ASA-B SHS		32	25	483	6,432	メディア
小 計	株 数 ・ 金 額	1,965	1,663	20,300	270,201	
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	10	—	<0.3%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
NOVO NORDISK A/S-B		693	536	14,624	245,108	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S-B SHARES		82	64	1,893	31,737	素材
DANSKE BANK A/S		250	191	4,806	80,554	銀行
WILLIAM DEMANT HOLDING		9	34	561	9,406	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		79	60	3,670	61,517	資本財
TDC A/S		280	229	842	14,118	電気通信サービス
CARLSBERG AS-B		37	30	2,092	35,074	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B		39	33	1,855	31,105	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S		68	54	2,132	35,741	運輸
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		2	1	2,226	37,312	運輸
TRYG A/S		39	33	450	7,545	保険
AP MOELLER-MAERSK A/S-A		1	1	1,298	21,766	運輸
PANDORA A/S		38	31	2,114	35,447	耐久消費財・アパレル
ISS A/S		52	47	1,319	22,114	商業・専門サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S		35	28	1,318	22,096	素材
GENMAB A/S		19	16	2,268	38,025	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONG ENERGY A/S		—	42	1,188	19,925	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	1,731	1,439	44,665	748,598	
	銘 柄 数 < 比 率 >	16	17	—	<0.7%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
BHP BILLITON LIMITED		1,140	903	2,194	182,233	素材
CSL LTD		165	128	1,679	139,451	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
ALUMINA LTD		896	700	128	10,701	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		263	208	675	56,093	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP		1,033	825	2,352	195,318	銀行
RIO TINTO LTD		150	117	741	61,575	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		488	374	480	39,902	保険
LENLEASE GROUP		198	160	262	21,803	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		606	484	3,887	322,762	銀行
WESTPAC BANKING CORP		1,180	941	2,905	241,265	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		933	749	2,276	188,984	銀行
BRAMBLES LTD		566	457	470	39,073	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD		206	157	76	6,369	運輸
BORAL LTD		268	340	225	18,739	素材
WOOLWORTHS LTD		452	358	927	77,023	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD		1,529	1,144	507	42,106	電気通信サービス
AMP LTD		1,062	846	429	35,684	各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD		295	246	112	9,368	消費者サービス
AMCOR LIMITED		415	335	503	41,793	素材
COMPUTERSHARE LTD		169	136	197	16,366	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD		197	146	295	24,524	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD		109	85	751	62,381	各種金融
CIMIC GROUP LTD		38	27	109	9,094	資本財
ASX LTD		70	56	289	24,059	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD		214	168	155	12,879	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD		20	16	239	19,905	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		161	126	255	21,191	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		206	173	66	5,515	小売
NEWCREST MINING LTD		270	219	457	38,002	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		889	685	424	35,274	保険
ORIGIN ENERGY LTD		625	503	381	31,710	エネルギー
ORICA LTD		132	108	204	16,996	素材
SONIC HEALTHCARE LTD		141	115	258	21,464	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD		597	521	183	15,252	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD		459	356	498	41,401	保険
TRANSURBAN GROUP		735	572	680	56,541	運輸
WESFARMERS LTD		400	316	1,363	113,197	食品・生活必需品小売り
CHALLENGER LTD		207	169	214	17,822	各種金融
SYDNEY AIRPORT		408	297	216	17,978	運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD		98	76	245	20,419	エネルギー
OIL SEARCH LTD		492	394	286	23,748	エネルギー
AGL ENERGY LTD		251	186	495	41,157	公益事業
TATTS GROUP LTD		531	420	178	14,817	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD		573	452	236	19,674	素材
ASCIANO LTD		229	—	—	—	運輸
ILUKA RESOURCES LTD		152	—	—	—	素材
AUSNET SERVICES		765	639	111	9,290	公益事業
CROWN RESORTS LTD		128	103	130	10,797	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD		604	492	172	14,301	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK		161	135	162	13,494	銀行
AURIZON HOLDINGS LTD		753	554	302	25,099	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD		265	196	256	21,300	食品・飲料・タバコ
RAMSAY HEALTH CARE LTD		51	41	287	23,911	ヘルスケア機器・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L		21	14	53	4,409	消費者サービス

銘	柄	期首(前期末)	当 期		末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価	額	額	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
SEEK LTD		122	96	170	14,122		商業・専門サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD		134	96	113	9,416		銀行
REA GROUP LTD		21	15	94	7,870		メディア
TPG TELECOM LTD		109	104	61	5,129		電気通信サービス
HEALTHSCOPE LTD		633	513	108	8,998		ヘルスケア機器・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD		985	794	223	18,526		保険
PLATINUM ASSET MANAGEMENT		100	—	—	—		各種金融
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		—	17	109	9,082		消費者サービス
SOUTH32 LTD		1,890	1,518	397	33,023		素材
VOCUS GROUP LTD		160	160	41	3,454		電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	27,147	21,310	32,323	2,683,857		
	銘柄 数 < 比 率 >	63	61	—	< 2.5% >		
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル			
SPARK NEW ZEALAND LTD		634	515	187	14,461		電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		351	271	186	14,388		運輸
CONTACT ENERGY LTD		262	208	106	8,261		公益事業
FLETCHER BUILDING LTD		247	193	157	12,149		素材
RYMAN HEALTHCARE LTD		137	110	93	7,219		ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD		454	388	113	8,782		公益事業
MERCURY NZ LTD		270	224	72	5,596		公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	2,359	1,911	917	70,859		
	銘柄 数 < 比 率 >	7	7	—	< 0.1% >		
(香港)				千香港ドル			
WHARF HOLDINGS LTD		490	370	2,466	35,338		不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		205	155	1,157	16,591		不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		956	746	7,439	106,605		資本財
SUN HUNG KAI PROPERTIES		610	400	4,576	65,574		不動産
MTR CORP		525	425	1,906	27,314		運輸
HONG KONG & CHINA GAS		2,541	2,219	3,488	49,993		公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT		1,900	1,620	1,576	22,587		不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		495	380	2,633	37,736		公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		406	331	6,477	92,825		各種金融
CATHAY PACIFIC AIRWAYS		430	370	418	6,001		運輸
HANG LUNG GROUP LTD		—	260	846	12,127		不動産
HANG LUNG PROPERTIES LTD		790	640	1,248	17,883		不動産
CLP HOLDINGS LTD		680	475	3,940	56,461		公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		406	310	1,533	21,970		不動産
BANK OF EAST ASIA LTD		435	345	1,119	16,042		銀行
HANG SENG BANK LTD		273	217	3,513	50,344		銀行
HYSAN DEVELOPMENT CO		240	180	644	9,234		不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD		420	360	399	5,726		消費者サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		92	71	784	11,242		半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO		1,062	882	1,176	16,860		不動産
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		260	210	668	9,584		耐久消費財・アパレル
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE		240	190	1,270	18,201		公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		1,325	1,050	3,601	51,609		銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		490	395	1,364	19,556		耐久消費財・アパレル
PCCW LTD		1,550	1,230	548	7,861		電気通信サービス
LI & FUNG LTD		2,184	1,684	525	7,529		耐久消費財・アパレル
KERRY PROPERTIES LTD		245	185	527	7,555		不動産
NWS HOLDINGS LTD		560	440	658	9,432		資本財
SANDS CHINA LTD		864	692	2,345	33,616		消費者サービス

銘柄	株数	当期末	評価額		業種等
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
WHEELOCK & CO LTD	320	230	1,368	19,610	不動産
WYNN MACAU LTD	576	468	756	10,837	消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD	700	580	411	5,901	消費者サービス
FIRST PACIFIC CO	860	460	280	4,014	各種金融
AIA GROUP LTD	4,266	3,388	18,532	265,568	保険
SWIRE PROPERTIES LTD	430	334	863	12,372	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	840	670	2,680	38,404	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	348	292	477	6,845	消費者サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	940	1,080	1,090	15,631	電気通信サービス
WH GROUP LTD	2,090	2,125	1,479	21,194	食品・飲料・タバコ
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	956	766	4,390	62,917	不動産
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	33,002 39	27,227 40	91,186 —	1,306,708 <1.2%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,099	895	931	74,917	銀行
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	568	453	149	12,033	メディア
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	375	293	92	7,397	資本財
CAPITALAND LTD	920	756	266	21,458	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	143	124	129	10,399	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	42	29	132	10,675	小売
DBS GROUP HOLDINGS LTD	626	493	1,020	82,059	銀行
KEPPEL CORP LTD	515	413	267	21,486	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	459	364	847	68,109	銀行
SINGAPORE TECH ENGINEERING	556	455	166	13,354	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,825	2,247	838	67,421	電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	206	167	167	13,433	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	288	225	162	13,062	各種金融
SEMBCORP MARINE LTD	315	—	—	—	資本財
UOL GROUP LTD	166	138	94	7,612	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	765	617	149	12,006	運輸
NOBLE GROUP LTD	1,738	—	—	—	資本財
STARHUB LTD	245	159	42	3,452	電気通信サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	2,673	2,089	79	6,384	食品・飲料・タバコ
WILMAR INTERNATIONAL LTD	688	494	181	14,578	食品・飲料・タバコ
GENTING SINGAPORE PLC	2,260	1,774	204	16,404	消費者サービス
SATS LTD	—	190	100	8,082	運輸
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	1,119	784	229	18,471	不動産
YANGZIJANG SHIPBUILDING	706	513	62	5,011	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	19,300 23	13,674 22	6,315 —	507,812 <0.5%>
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
ISRAEL CHEMICALS LTD	185	144	224	6,993	素材
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	323	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANK HAPOLIM BM	373	301	696	21,677	銀行
NICE LTD	19	17	464	14,475	ソフトウェア・サービス
BANK LEUMI LE-ISRAEL	491	409	695	21,662	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD	—	6	292	9,111	資本財
DELEK GROUP LTD	1	—	—	—	エネルギー
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	671	582	362	11,291	電気通信サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	46	38	244	7,610	銀行
AZRIELI GROUP LTD	12	11	242	7,535	不動産

銘柄		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	
(イスラエル) FRUTAROM		百株 —	百株 10	千円 千イスラエルシェケル 232 7,249	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	2,125	1,522	3,456	107,606
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.1%>
合 計	株 数 ・ 金 額	473,185	364,515	—	101,254,143
	銘柄 数 < 比 率 >	1,260	1,261	—	<95.7%>

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

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

外国投資信託証券

銘柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカドル	千円	%
HCP INC		16	13	419	46,836	0.0
MACERICH CO/THE		4	3	190	21,249	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		—	2	247	27,562	0.0
PROLOGIS INC		18	14	811	90,481	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST		3	2	203	22,726	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		—	4	157	17,608	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC		5	4	501	55,976	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC		2	1	470	52,469	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC		4	3	275	30,756	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST		2	2	255	28,450	0.0
WELLTOWER INC		12	10	735	82,010	0.1
BOSTON PROPERTIES INC		5	4	529	59,064	0.1
MID-AMERICA APARTMENT COMM		2	3	316	35,335	0.0
REALTY INCOME CORP		8	7	395	44,156	0.0
REGENCY CENTERS CORP		3	4	262	29,268	0.0
SL GREEN REALTY CORP		3	2	294	32,857	0.0
UDR INC		9	7	288	32,174	0.0
VENTAS INC		11	9	656	73,217	0.1
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		32	28	328	36,641	0.0
WEYERHAEUSER CO		27	20	684	76,316	0.1
AMERICAN TOWER CORP		15	11	1,536	171,352	0.2
AGNC INVESTMENT CORP		11	9	184	20,560	0.0
VEREIT INC		32	27	216	24,095	0.0
DUKE REALTY CORP		12	10	287	32,074	0.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC		6	8	163	18,258	0.0
IRON MOUNTAIN INC		7	6	235	26,227	0.0
EQUINIX INC		2	2	881	98,291	0.1
CROWN CASTLE INTL CORP		11	10	1,020	113,799	0.1
EQUITY RESIDENTIAL		12	10	662	73,874	0.1
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A		—	14	197	22,009	0.0
GGP INC		20	16	373	41,611	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC		26	20	378	42,225	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST		5	4	170	19,015	0.0
PUBLIC STORAGE		5	4	897	100,118	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC		10	8	1,395	155,626	0.1
VORNADO REALTY TRUST		6	4	454	50,673	0.0
KIMCO REALTY CORP		14	11	208	23,285	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC		4	3	726	81,083	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	381	336	18,014	2,009,344	
	銘 柄 数 < 比 率 >	35	38	—	<1.9%>	
(カナダ)				千カナダドル		
SMART REAL ESTATE INVESTMENT		2	1	56	4,687	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		4	4	90	7,492	0.0

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		5	4	106	8,754	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	12	10	254	20,934	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		1	1	156	19,563	0.0
KLEPIERRE		7	6	228	28,541	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		3	2	649	81,011	0.1
FONCIERE DES REGIONS		1	0.948	76	9,551	0.0
ICADE		1	1	76	9,553	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	14	12	1,187	148,221	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		34	25	163	23,623	0.0
HAMMERSON PLC		27	22	128	18,650	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		28	21	228	33,082	0.0
INTU PROPERTIES PLC		34	26	69	9,994	0.0
SEGRO PLC		26	23	112	16,325	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	151	118	702	101,676	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		123	97	264	21,956	0.0
SCENTRE GROUP		189	147	611	50,783	0.0
GPT GROUP		65	52	267	22,230	0.0
MIRVAC GROUP		134	107	245	20,350	0.0
STOCKLAND		86	70	322	26,786	0.0
WESTFIELD CORP		70	54	446	37,073	0.0
DEXUS		35	28	284	23,583	0.0
GOODMAN GROUP		63	49	411	34,200	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	768	606	2,853	236,965	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<0.2%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		79	63	3,708	53,141	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	79	63	3,708	53,141	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		91	72	128	10,318	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		80	63	106	8,578	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		87	71	139	11,192	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		77	71	182	14,701	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	336	278	557	44,791	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	1,743	1,425	—	2,615,075	
	銘 柄 数 < 比 率 >	61	64	—	<2.5%>	

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期	末
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引	SP EMINI	百万円 1,195	百万円 —
		SP/TSE60	74	—
		SWISS IX	61	—
		EURO ST	298	—
		SPI 200	83	—
		FTSE100	129	—

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

○投資信託財産の構成

(2017年5月22日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
株式	千円 101,254,143	% 95.3
投資証券	2,615,075	2.5
コール・ローン等、その他	2,332,056	2.2
投資信託財産総額	106,201,274	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（105,755,144千円）の投資信託財産総額（106,201,274千円）に対する比率は99.6%です。

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

1 アメリカドル＝111.54円	1 カナダドル＝82.39円	1 ユーロ＝124.79円	1 イギリスポンド＝144.76円
1 スイスフラン＝114.49円	1 スウェーデンクローネ＝12.77円	1 ノルウェークローネ＝13.31円	1 デンマーククローネ＝16.76円
1 オーストラリアドル＝83.03円	1 ニュージーランドドル＝77.24円	1 香港ドル＝14.33円	1 シンガポールドル＝80.41円
1 イスラエルシェケル＝31.13円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	106,273,636,085
コール・ローン等	1,565,364,088
株式(評価額)	101,254,143,231
投資証券(評価額)	2,615,075,622
未収入金	89,539,121
未収配当金	221,051,011
差入委託証拠金	528,463,012
(B) 負債	522,547,917
未払金	80,349,813
未払解約金	442,197,377
未払利息	727
(C) 純資産総額(A－B)	105,751,088,168
元本	51,068,162,940
次期繰越損益金	54,682,925,228
(D) 受益権総口数	51,068,162,940口
1万口当たり基準価額(C／D)	20,708円

<注記事項>

- ①期首元本額 66,611,642,280円
期中追加設定元本額 7,328,102,204円
期中一部解約元本額 22,871,581,544円
また、1口当たり純資産額は、期末2.0708円です。

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

三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定型)	303,582,885円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)	1,220,174,987円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(成長型)	1,105,115,482円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	2,488,583,685円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	12,812,269,671円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	11,314,550,173円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	152,417,674円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(成長型)	329,371,847円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	841,812,038円
三菱ＵＦＪ 外国株式ファンドVA(適格機関投資家限定)	20,499,300,313円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定型)VA(適格機関投資家限定)	10,287円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)VA(適格機関投資家限定)	973,898円
合計	51,068,162,940円

【お 知 ら せ】

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

○損益の状況 (2016年5月21日～2017年5月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,550,486,461
受取配当金	2,540,290,082
受取利息	△ 550,726
その他収益金	13,787,830
支払利息	△ 3,040,725
(B) 有価証券売買損益	18,629,887,883
売買益	22,617,929,253
売買損	△ 3,988,041,370
(C) 先物取引等取引損益	577,199,824
取引益	702,621,471
取引損	△ 125,421,647
(D) 保管費用等	△ 64,679,596
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	21,692,894,572
(F) 前期繰越損益金	47,591,331,586
(G) 追加信託差損益金	5,353,816,653
(H) 解約差損益金	△19,955,117,583
(I) 計(E+F+G+H)	54,682,925,228
次期繰越損益金(I)	54,682,925,228

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

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

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

三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド

《第17期》決算日2017年5月22日

[計算期間：2016年5月21日～2017年5月22日]

「三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド」は、5月22日に第17期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	わが国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマーク（NOMURA－BPI総合指数）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主 要 運 用 対 象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とし、外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		NOMURA－BPI総合指数		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
13期(2013年5月20日)	12,518	0.9	344.269	0.9	99.0	0.6	316,364
14期(2014年5月20日)	12,874	2.8	354.058	2.8	99.4	—	290,123
15期(2015年5月20日)	13,192	2.5	362.715	2.4	99.3	—	256,631
16期(2016年5月20日)	14,075	6.7	386.993	6.7	99.3	0.3	219,902
17期(2017年5月22日)	13,798	△2.0	379.387	△2.0	99.3	0.3	212,031

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額	NOMURA－BPI総合指数		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首)	円	%		%	%	%
2016年 5月20日	14,075	－	386.993	－	99.3	0.3
5 月 末	14,096	0.1	387.599	0.2	99.6	0.3
6 月 末	14,268	1.4	392.355	1.4	96.3	0.3
7 月 末	14,148	0.5	389.242	0.6	100.9	0.4
8 月 末	14,011	△0.5	385.240	△0.5	99.2	0.3
9 月 末	14,021	△0.4	385.504	△0.4	99.6	0.3
10月 末	13,983	△0.7	384.444	△0.7	100.7	0.3
11月 末	13,893	△1.3	381.967	△1.3	101.2	0.5
12月 末	13,815	△1.8	379.825	△1.9	100.8	0.4
2017年 1 月 末	13,740	△2.4	377.739	△2.4	99.8	0.4
2 月 末	13,782	△2.1	378.896	△2.1	99.5	0.4
3 月 末	13,764	△2.2	378.492	△2.2	99.4	0.4
4 月 末	13,832	△1.7	380.333	△1.7	99.6	0.4
(期 末)						
2017年 5月22日	13,798	△2.0	379.387	△2.0	99.3	0.3

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

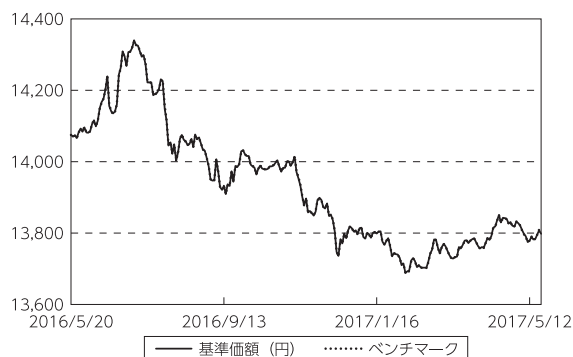
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.0%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(－2.0%)とほぼ同程度となりました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内債券市況

- ・期の前半は、イギリスの欧州連合（ＥＵ）離脱をめぐる国民投票で離脱派が過半数を占めたことにより、世界的な景気の先行きに対する不透明感が高まったことから、一時、国内債券市況は上昇しました。その後、日本銀行が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を導入したことや、次期米国大統領にトランプ氏が選出され米国の金利が上昇したことなどから、国内債券市況は下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは2.0%の下落となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

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

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

◎その他の要因

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

◎今後の運用方針

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

○１万口当たりの費用明細

(2016年５月21日～2017年５月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,946円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2016年５月21日～2017年５月22日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 56,319,655	千円 54,842,931
	地方債証券	1,529,796	1,267,568
	特殊債券	1,123,612	2,530,801 (680,786)
	社債券	2,700,010	3,114,162 (620,000)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債券先物取引	百万円 3,774	百万円 3,777	百万円 －	百万円 －

○利害関係人との取引状況等

(2016年5月21日～2017年5月22日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 61,673	百万円 17,875	% 29.0	百万円 61,755	百万円 9,091	% 14.7

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 300	百万円 102	百万円 824

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公社債	百万円 2,500

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

○組入資産の明細

(2017年5月22日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちＢＢ格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	158,534,000 (100,000)	173,740,290 (100,212)	81.9 (0.0)	— (—)	52.6 (—)	19.7 (—)	9.6 (0.0)
地方債証券	11,572,510 (11,572,510)	12,450,224 (12,450,224)	5.9 (5.9)	— (—)	3.5 (3.5)	2.0 (2.0)	0.4 (0.4)
特殊債券 (除く金融債)	12,473,551 (12,473,551)	13,565,726 (13,565,726)	6.4 (6.4)	— (—)	4.6 (4.6)	1.4 (1.4)	0.4 (0.4)
金融債券	1,530,000 (1,530,000)	1,536,263 (1,536,263)	0.7 (0.7)	— (—)	— (—)	0.4 (0.4)	0.3 (0.3)
普通社債券	8,841,000 (8,841,000)	9,229,196 (9,229,196)	4.4 (4.4)	— (—)	1.3 (1.3)	2.7 (2.7)	0.4 (0.4)
合 計	192,951,061 (34,517,061)	210,521,700 (36,881,622)	99.3 (17.4)	— (—)	62.1 (9.4)	26.1 (6.5)	11.1 (1.5)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第366回利付国債 (2年)		0.1	150,000	150,463	2018/7/15
第367回利付国債 (2年)		0.1	500,000	501,660	2018/8/15
第369回利付国債 (2年)		0.1	500,000	501,885	2018/10/15
第370回利付国債 (2年)		0.1	1,150,000	1,154,680	2018/11/15
第371回利付国債 (2年)		0.1	500,000	502,150	2018/12/15
第373回利付国債 (2年)		0.1	600,000	602,862	2019/2/15
第374回利付国債 (2年)		0.1	200,000	200,996	2019/3/15
第112回利付国債 (5年)		0.4	1,360,000	1,368,404	2018/6/20
第113回利付国債 (5年)		0.3	1,330,000	1,336,796	2018/6/20
第114回利付国債 (5年)		0.3	720,000	724,543	2018/9/20
第115回利付国債 (5年)		0.2	1,190,000	1,195,926	2018/9/20
第116回利付国債 (5年)		0.2	1,980,000	1,991,880	2018/12/20
第117回利付国債 (5年)		0.2	2,030,000	2,043,905	2019/3/20
第118回利付国債 (5年)		0.2	1,200,000	1,208,988	2019/6/20
第119回利付国債 (5年)		0.1	610,000	613,300	2019/6/20
第120回利付国債 (5年)		0.2	1,040,000	1,048,611	2019/9/20
第121回利付国債 (5年)		0.1	530,000	533,153	2019/9/20
第122回利付国債 (5年)		0.1	1,930,000	1,942,467	2019/12/20
第123回利付国債 (5年)		0.1	1,100,000	1,107,788	2020/3/20
第124回利付国債 (5年)		0.1	1,880,000	1,894,212	2020/6/20
第125回利付国債 (5年)		0.1	2,010,000	2,026,441	2020/9/20
第126回利付国債 (5年)		0.1	1,520,000	1,533,376	2020/12/20
第127回利付国債 (5年)		0.1	1,800,000	1,816,938	2021/3/20
第128回利付国債 (5年)		0.1	2,370,000	2,392,799	2021/6/20
第129回利付国債 (5年)		0.1	2,090,000	2,110,900	2021/9/20
第130回利付国債 (5年)		0.1	1,800,000	1,819,890	2021/12/20
第131回利付国債 (5年)		0.1	800,000	808,728	2022/3/20
第1回利付国債 (40年)		2.4	220,000	314,019	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)		2.2	285,000	393,186	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)		2.2	235,000	325,604	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)		2.2	420,000	583,510	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)		2.0	380,000	506,950	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)		1.9	410,000	535,570	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)		1.7	430,000	535,504	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)		1.4	490,000	563,901	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)		0.4	790,000	651,971	2056/3/20
第293回利付国債 (10年)		1.8	895,000	913,965	2018/6/20
第294回利付国債 (10年)		1.7	570,000	581,468	2018/6/20
第295回利付国債 (10年)		1.5	730,000	743,110	2018/6/20
第296回利付国債 (10年)		1.5	1,620,000	1,655,834	2018/9/20
第297回利付国債 (10年)		1.4	760,000	778,840	2018/12/20
第298回利付国債 (10年)		1.3	950,000	972,049	2018/12/20
第299回利付国債 (10年)		1.3	810,000	831,756	2019/3/20
第300回利付国債 (10年)		1.5	100,000	103,052	2019/3/20
第301回利付国債 (10年)		1.5	620,000	641,414	2019/6/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第302回利付国債 (10年)		1.4	680,000	702,072	2019/ 6 /20
第303回利付国債 (10年)		1.4	1,470,000	1,523,361	2019/ 9 /20
第304回利付国債 (10年)		1.3	520,000	537,659	2019/ 9 /20
第305回利付国債 (10年)		1.3	830,000	861,108	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)		1.4	1,120,000	1,169,022	2020/ 3 /20
第307回利付国債 (10年)		1.3	455,000	473,627	2020/ 3 /20
第308回利付国債 (10年)		1.3	690,000	720,560	2020/ 6 /20
第309回利付国債 (10年)		1.1	1,180,000	1,224,981	2020/ 6 /20
第310回利付国債 (10年)		1.0	1,200,000	1,245,708	2020/ 9 /20
第311回利付国債 (10年)		0.8	590,000	608,531	2020/ 9 /20
第312回利付国債 (10年)		1.2	1,890,000	1,980,644	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)		1.3	90,000	94,960	2021/ 3 /20
第314回利付国債 (10年)		1.1	580,000	607,515	2021/ 3 /20
第315回利付国債 (10年)		1.2	780,000	822,315	2021/ 6 /20
第316回利付国債 (10年)		1.1	400,000	420,064	2021/ 6 /20
第317回利付国債 (10年)		1.1	250,000	263,320	2021/ 9 /20
第318回利付国債 (10年)		1.0	550,000	576,911	2021/ 9 /20
第319回利付国債 (10年)		1.1	690,000	728,722	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)		1.0	540,000	567,820	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)		1.0	870,000	917,032	2022/ 3 /20
第322回利付国債 (10年)		0.9	420,000	440,668	2022/ 3 /20
第323回利付国債 (10年)		0.9	470,000	494,092	2022/ 6 /20
第324回利付国債 (10年)		0.8	980,000	1,025,236	2022/ 6 /20
第325回利付国債 (10年)		0.8	1,490,000	1,561,803	2022/ 9 /20
第326回利付国債 (10年)		0.7	100,000	104,455	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)		0.8	580,000	609,092	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)		0.6	1,290,000	1,342,090	2023/ 3 /20
第329回利付国債 (10年)		0.8	1,480,000	1,559,964	2023/ 6 /20
第330回利付国債 (10年)		0.8	1,240,000	1,309,378	2023/ 9 /20
第331回利付国債 (10年)		0.6	770,000	803,287	2023/ 9 /20
第332回利付国債 (10年)		0.6	1,650,000	1,723,590	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)		0.6	820,000	857,949	2024/ 3 /20
第334回利付国債 (10年)		0.6	1,290,000	1,350,475	2024/ 6 /20
第335回利付国債 (10年)		0.5	1,970,000	2,048,898	2024/ 9 /20
第336回利付国債 (10年)		0.5	520,000	541,127	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)		0.3	1,050,000	1,076,712	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)		0.4	1,560,000	1,611,948	2025/ 3 /20
第339回利付国債 (10年)		0.4	1,940,000	2,005,067	2025/ 6 /20
第340回利付国債 (10年)		0.4	1,560,000	1,612,618	2025/ 9 /20
第341回利付国債 (10年)		0.3	1,200,000	1,230,336	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)		0.1	1,490,000	1,501,145	2026/ 3 /20
第343回利付国債 (10年)		0.1	1,890,000	1,903,683	2026/ 6 /20
第344回利付国債 (10年)		0.1	2,140,000	2,153,931	2026/ 9 /20
第345回利付国債 (10年)		0.1	2,160,000	2,172,355	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)		0.1	1,020,000	1,025,477	2027/ 3 /20
第 1 回利付国債 (30年)		2.8	120,000	158,580	2029/ 9 /20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第 2 回利付国債 (30年)		2.4	170,000	217,562	2030/ 2 /20
第 3 回利付国債 (30年)		2.3	190,000	241,277	2030/ 5 /20
第 4 回利付国債 (30年)		2.9	125,000	169,342	2030/11/20
第 5 回利付国債 (30年)		2.2	180,000	228,213	2031/ 5 /20
第 6 回利付国債 (30年)		2.4	170,000	221,273	2031/11/20
第 7 回利付国債 (30年)		2.3	225,000	290,589	2032/ 5 /20
第 8 回利付国債 (30年)		1.8	160,000	195,398	2032/11/22
第 9 回利付国債 (30年)		1.4	90,000	104,575	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)		1.1	263,000	293,229	2033/ 3 /20
第11回利付国債 (30年)		1.7	100,000	120,819	2033/ 6 /20
第12回利付国債 (30年)		2.1	205,000	260,604	2033/ 9 /20
第13回利付国債 (30年)		2.0	390,000	490,428	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)		2.4	380,000	502,956	2034/ 3 /20
第15回利付国債 (30年)		2.5	440,000	590,031	2034/ 6 /20
第16回利付国債 (30年)		2.5	345,000	463,517	2034/ 9 /20
第17回利付国債 (30年)		2.4	350,000	464,943	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)		2.3	360,000	472,608	2035/ 3 /20
第19回利付国債 (30年)		2.3	290,000	381,265	2035/ 6 /20
第20回利付国債 (30年)		2.5	260,000	351,127	2035/ 9 /20
第21回利付国債 (30年)		2.3	250,000	329,000	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)		2.5	285,000	385,710	2036/ 3 /20
第23回利付国債 (30年)		2.5	140,000	189,747	2036/ 6 /20
第24回利付国債 (30年)		2.5	230,000	312,165	2036/ 9 /20
第25回利付国債 (30年)		2.3	205,000	271,034	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)		2.4	430,000	576,819	2037/ 3 /20
第27回利付国債 (30年)		2.5	400,000	545,592	2037/ 9 /20
第28回利付国債 (30年)		2.5	415,000	567,778	2038/ 3 /20
第29回利付国債 (30年)		2.4	480,000	649,492	2038/ 9 /20
第30回利付国債 (30年)		2.3	575,000	768,803	2039/ 3 /20
第31回利付国債 (30年)		2.2	435,000	574,291	2039/ 9 /20
第32回利付国債 (30年)		2.3	600,000	807,174	2040/ 3 /20
第33回利付国債 (30年)		2.0	643,000	826,351	2040/ 9 /20
第34回利付国債 (30年)		2.2	615,000	819,235	2041/ 3 /20
第35回利付国債 (30年)		2.0	800,000	1,032,272	2041/ 9 /20
第36回利付国債 (30年)		2.0	590,000	762,681	2042/ 3 /20
第37回利付国債 (30年)		1.9	770,000	980,371	2042/ 9 /20
第38回利付国債 (30年)		1.8	505,000	632,007	2043/ 3 /20
第39回利付国債 (30年)		1.9	500,000	637,920	2043/ 6 /20
第40回利付国債 (30年)		1.8	430,000	538,738	2043/ 9 /20
第41回利付国債 (30年)		1.7	350,000	430,353	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)		1.7	450,000	553,491	2044/ 3 /20
第43回利付国債 (30年)		1.7	420,000	516,768	2044/ 6 /20
第44回利付国債 (30年)		1.7	450,000	553,855	2044/ 9 /20
第45回利付国債 (30年)		1.5	520,000	614,728	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)		1.5	630,000	744,760	2045/ 3 /20
第47回利付国債 (30年)		1.6	590,000	712,076	2045/ 6 /20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第48回利付国債 (30年)		1.4	500,000	578,630	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)		1.4	630,000	728,935	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)		0.8	550,000	551,936	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)		0.3	470,000	410,211	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)		0.5	720,000	664,740	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)		0.6	620,000	587,530	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)		0.8	210,000	209,745	2047/3/20
第40回利付国債 (20年)		2.3	290,000	299,497	2018/9/20
第41回利付国債 (20年)		1.5	240,000	247,324	2019/3/20
第42回利付国債 (20年)		2.6	835,000	877,267	2019/3/20
第43回利付国債 (20年)		2.9	360,000	385,628	2019/9/20
第44回利付国債 (20年)		2.5	710,000	763,207	2020/3/20
第45回利付国債 (20年)		2.4	100,000	107,211	2020/3/20
第47回利付国債 (20年)		2.2	100,000	107,807	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)		2.5	250,000	273,685	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)		2.1	170,000	184,616	2021/3/22
第50回利付国債 (20年)		1.9	515,000	555,319	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)		2.0	140,000	152,189	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)		2.1	260,000	285,053	2021/9/21
第53回利付国債 (20年)		2.1	80,000	88,170	2021/12/20
第54回利付国債 (20年)		2.2	530,000	586,566	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)		2.0	240,000	264,561	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)		2.0	370,000	409,623	2022/6/20
第57回利付国債 (20年)		1.9	160,000	176,318	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)		1.9	350,000	387,481	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)		1.7	590,000	649,359	2022/12/20
第60回利付国債 (20年)		1.4	230,000	249,271	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)		1.0	260,000	276,585	2023/3/20
第62回利付国債 (20年)		0.8	560,000	590,256	2023/6/20
第63回利付国債 (20年)		1.8	275,000	306,647	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)		1.9	480,000	540,427	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)		1.9	430,000	485,955	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)		1.8	170,000	190,998	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)		1.9	80,000	90,771	2024/3/20
第68回利付国債 (20年)		2.2	395,000	456,304	2024/3/20
第69回利付国債 (20年)		2.1	120,000	137,802	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)		2.4	510,000	599,127	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)		2.2	200,000	232,110	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)		2.1	645,000	746,690	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)		2.0	200,000	230,824	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)		2.1	380,000	441,453	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)		2.1	230,000	268,198	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)		1.9	210,000	241,586	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)		2.0	260,000	301,145	2025/3/20
第79回利付国債 (20年)		2.0	100,000	116,241	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)		2.1	370,000	433,081	2025/6/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第82回利付国債 (20年)		2.1	620,000	728,400	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)		2.1	182,000	214,590	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)		2.0	410,000	479,905	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)		2.1	230,000	272,248	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)		2.3	532,000	639,096	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)		2.2	170,000	202,725	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)		2.3	460,000	554,994	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)		2.2	130,000	155,668	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)		2.2	470,000	564,850	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)		2.3	80,000	96,888	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)		2.1	650,000	777,718	2026/12/20
第94回利付国債 (20年)		2.1	260,000	312,247	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)		2.3	490,000	600,504	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)		2.1	120,000	144,657	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)		2.2	330,000	402,266	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)		2.1	340,000	410,968	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)		2.1	655,000	794,161	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)		2.2	370,000	453,912	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)		2.4	410,000	511,778	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)		2.4	190,000	237,992	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)		2.3	320,000	397,321	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)		2.1	190,000	231,746	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)		2.1	350,000	428,151	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)		2.2	210,000	259,242	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)		2.1	30,000	36,802	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)		1.9	510,000	613,989	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)		1.9	570,000	687,864	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)		2.1	100,000	123,008	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)		2.2	320,000	398,502	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)		2.1	550,000	678,392	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)		2.1	310,000	383,156	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)		2.1	580,000	718,260	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)		2.2	270,000	337,689	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)		2.2	215,000	269,597	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)		2.1	560,000	695,184	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)		2.0	314,000	386,502	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)		1.8	240,000	289,291	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)		1.6	200,000	235,824	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)		1.9	430,000	524,883	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)		1.8	310,000	374,380	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)		2.1	500,000	624,730	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)		2.0	260,000	321,427	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)		2.2	410,000	518,891	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)		2.0	330,000	408,790	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)		1.9	240,000	294,084	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)		1.9	480,000	589,276	2031/6/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第129回利付国債 (20年)		1.8	240,000	291,168	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)		1.8	580,000	704,821	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)		1.7	270,000	324,369	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)		1.7	270,000	324,599	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)		1.8	370,000	450,016	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)		1.8	320,000	389,772	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)		1.7	220,000	264,646	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)		1.6	260,000	309,059	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)		1.7	260,000	313,172	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)		1.5	270,000	317,182	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)		1.6	250,000	297,512	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)		1.7	820,000	988,928	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)		1.7	820,000	990,084	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)		1.8	50,000	61,114	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)		1.6	540,000	644,090	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)		1.5	320,000	376,579	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)		1.7	920,000	1,111,534	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)		1.7	850,000	1,027,208	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)		1.6	750,000	894,765	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	540,000	635,623	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)		1.5	800,000	941,392	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)		1.4	780,000	904,917	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)		1.2	770,000	866,881	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	840,000	945,495	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)		1.3	820,000	936,497	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)		1.2	910,000	1,022,940	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)		1.0	880,000	957,220	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	840,000	822,007	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)		0.2	1,020,000	958,361	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)		0.5	980,000	971,434	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)		0.6	800,000	805,640	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)		0.7	500,000	512,030	2037/3/20
第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013)		0.67	100,000	100,212	2018/11/15
小 計			158,534,000	173,740,290	
地方債証券					
第5回東京都公募公債 (20年)		2.11	100,000	115,653	2025/3/19
第7回東京都公募公債 (20年)		2.16	100,000	116,829	2025/9/19
第7回東京都公募公債 (30年)		2.51	70,000	93,156	2038/9/17
第10回東京都公募公債 (30年)		2.31	100,000	129,852	2039/9/20
第25回東京都公募公債 (20年)		1.8	100,000	118,957	2031/12/19
第27回東京都公募公債 (20年)		1.68	100,000	117,557	2032/12/20
第682回東京都公募公債		1.32	100,000	103,715	2020/3/19
第700回東京都公募公債		1.02	100,000	104,364	2021/9/17
第718回東京都公募公債		0.6	100,000	103,286	2023/3/20
第719回東京都公募公債		0.86	200,000	209,596	2023/3/20
第3回東京都公募公債 (20年)		2.26	100,000	115,031	2024/3/19

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
平成20年度第12回北海道公募公債		1.72	50,000	51,365	2018/12/26
平成21年度第7回北海道公募公債		1.46	50,000	51,700	2019/9/25
平成22年度第8回北海道公募公債		0.96	80,000	82,612	2020/10/29
平成24年度第9回北海道公募公債		0.79	50,000	52,008	2022/10/31
平成28年度第1回北海道公募公債		0.085	100,000	99,250	2026/4/28
第2回神奈川県公募公債（30年）		2.87	100,000	137,959	2036/6/20
第4回神奈川県公募公債（30年）		2.62	100,000	134,891	2038/3/19
第155回神奈川県公募公債		1.61	60,000	61,036	2018/6/20
第196回神奈川県公募公債		0.678	100,000	103,679	2023/3/20
第5回大阪府公募公債（20年）		2.16	100,000	122,078	2030/5/28
第318回大阪府公募公債		1.7	14,000	14,320	2018/9/28
第322回大阪府公募公債		1.62	60,000	61,634	2019/1/29
第332回大阪府公募公債		1.58	50,000	51,980	2019/11/27
第335回大阪府公募公債		1.48	30,000	31,223	2020/2/25
第336回大阪府公募公債		1.46	50,000	52,076	2020/3/30
第342回大阪府公募公債		1.2	25,000	25,998	2020/9/29
第344回大阪府公募公債		1.06	21,000	21,771	2020/11/27
第348回大阪府公募公債		1.32	50,000	52,524	2021/3/30
第358回大阪府公募公債		0.97	70,000	73,152	2022/2/28
第404回大阪府公募公債		0.4	400,000	408,224	2026/1/28
第408回大阪府公募公債		0.072	118,000	116,971	2026/5/29
平成20年度第3回京都府公募公債		1.57	20,200	20,696	2018/12/19
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）		2.19	100,000	122,108	2029/9/20
平成22年度第2回京都府公募公債		1.16	40,000	41,537	2020/9/24
平成22年度第7回京都府公募公債		1.31	45,900	48,186	2021/3/22
平成23年度第2回京都府公募公債		1.2	66,000	69,206	2021/6/22
第2回兵庫県公募公債（30年）		2.36	50,000	65,364	2040/3/19
第5回兵庫県公募公債（15年）		1.31	100,000	110,760	2028/5/26
平成21年度第35回兵庫県公募公債		1.46	40,000	41,553	2020/1/22
平成23年度第11回兵庫県公募公債		0.95	50,000	52,164	2022/1/27
平成24年度第18回兵庫県公募公債		0.77	100,000	103,885	2022/10/19
第3回静岡県公募公債（15年）		1.368	100,000	111,423	2027/10/29
第14回静岡県公募公債（20年）		1.736	100,000	118,067	2032/6/18
平成25年度第8回静岡県公募公債		0.699	29,800	31,028	2023/10/24
平成20年度第8回愛知県公募公債（20年）		2.04	200,000	239,342	2028/12/20
平成21年度第6回愛知県公募公債		1.44	50,000	51,568	2019/7/30
平成21年度第10回愛知県公募公債		1.38	201,000	207,729	2019/10/30
平成22年度第5回愛知県公募公債		1.258	27,200	28,254	2020/6/30
平成23年度第11回愛知県公募公債		1.03	70,000	73,165	2021/10/28
平成23年度第20回愛知県公募公債		1.082	100,000	105,170	2022/3/29
平成24年度第13回愛知県公募公債		0.772	100,000	104,036	2022/11/30
平成28年度第16回愛知県公募公債		0.259	200,000	201,412	2027/2/12
平成21年度第1回広島県公募公債		1.57	20,000	20,631	2019/5/28
平成22年度第3回広島県公募公債		1.08	45,000	46,608	2020/9/24
平成27年度第5回広島県公募公債		0.41	200,000	204,456	2026/1/26
第8回埼玉県公募公債（20年）		2.19	100,000	122,108	2029/9/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
第10回埼玉県公募公債（20年）		1.94	100,000	120,077	2030/11/12
平成20年度第3回埼玉県公募公債		1.87	29,000	29,589	2018/6/25
平成21年度第8回埼玉県公募公債		1.3	12,000	12,402	2019/12/25
平成22年度第11回埼玉県公募公債		1.28	40,000	41,911	2021/2/25
平成23年度第1回埼玉県公募公債		1.37	100,000	105,345	2021/4/27
平成22年度第10回福岡県公募公債		1.36	50,000	52,540	2021/2/25
平成21年度第2回千葉県公募公債		1.57	80,000	82,512	2019/5/24
平成22年度第12回千葉県公募公債		1.28	80,000	83,823	2021/2/25
平成22年度第14回千葉県公募公債		1.33	80,000	84,054	2021/3/25
平成23年度第5回千葉県公募公債		1.06	80,000	83,788	2021/11/25
平成23年度第9回千葉県公募公債		1.0	80,000	83,810	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債		1.05	80,000	84,068	2022/4/25
平成21年度第1回新潟県公募公債		1.42	54,500	56,183	2019/7/29
平成21年度第2回新潟県公募公債		1.55	80,550	83,679	2019/11/27
平成27年度第2回新潟県公募公債		0.215	140,000	140,725	2026/2/26
平成22年度第1回岐阜県公募公債		1.21	42,000	43,692	2020/9/30
平成21年度第1回大分県公募公債		1.35	54,900	56,700	2019/10/31
第69回共同発行市場公募地方債		1.56	34,000	34,840	2018/12/25
第73回共同発行市場公募地方債		1.59	80,600	83,061	2019/4/25
第80回共同発行市場公募地方債		1.54	200,000	207,700	2019/11/25
第81回共同発行市場公募地方債		1.32	50,000	51,704	2019/12/25
第84回共同発行市場公募地方債		1.38	20,000	20,781	2020/3/25
第90回共同発行市場公募地方債		1.12	100,000	103,712	2020/9/25
第96回共同発行市場公募地方債		1.29	20,000	20,983	2021/3/25
第104回共同発行市場公募地方債		1.03	100,000	104,601	2021/11/25
第108回共同発行市場公募地方債		1.01	70,000	73,368	2022/3/25
第116回共同発行市場公募地方債		0.8	300,000	312,540	2022/11/25
第130回共同発行市場公募地方債		0.76	100,000	104,671	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債		0.66	100,000	104,086	2024/3/25
第133回共同発行市場公募地方債		0.689	600,000	625,728	2024/4/25
第140回共同発行市場公募地方債		0.505	200,000	206,040	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債		0.345	200,000	203,654	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債		0.47	200,000	205,596	2025/3/25
平成21年度第1回栃木県公募公債		1.55	100,000	103,898	2019/11/30
平成20年度第1回新潟市公募公債		1.56	34,190	35,035	2018/12/26
平成21年度第1回新潟市公募公債		1.34	94,450	97,718	2019/12/25
平成21年度第1回浜松市公募公債		1.54	33,900	35,208	2019/11/27
平成21年度第6回大阪市公募公債		1.57	50,000	51,963	2019/11/25
平成22年度第8回大阪市公募公債		1.28	50,000	52,335	2021/1/25
平成22年度第10回大阪市公募公債		1.31	20,000	20,992	2021/3/17
平成26年度第7回大阪市公募公債		0.535	100,000	103,247	2024/11/28
第1回名古屋市公募公債（20年）		1.99	100,000	112,653	2023/12/20
第9回名古屋市公募公債（20年）		2.07	100,000	120,007	2028/12/20
第9回名古屋市公募公債（30年）		2.095	90,000	114,049	2042/9/19
第3回京都市公募公債（20年）		2.09	100,000	116,584	2025/12/19
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）		2.54	110,000	133,551	2026/6/19

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
平成23年度第5回神戸市公募公債		1.025	100,000	104,475	2021/10/19
第5回横浜市公募公債（20年）		2.17	100,000	116,453	2025/6/20
第7回横浜市公募公債（20年）		2.06	250,000	290,822	2025/12/19
平成24年度第4回横浜市公募公債		0.81	100,000	104,388	2023/2/20
第27回横浜市公募公債（20年）		1.599	40,000	46,472	2033/5/20
平成22年度第7回札幌市公募公債		1.05	50,000	51,729	2020/9/18
第7回川崎市公募公債（20年）		2.08	100,000	120,656	2029/7/17
平成20年度第5回福岡市公募公債		1.57	30,000	30,666	2018/10/24
平成20年度第8回福岡市公募公債		1.49	84,500	86,810	2019/3/25
平成22年度第9回福岡市公募公債		1.32	127,300	133,703	2021/3/25
平成23年度第6回福岡市公募公債		1.0	50,000	52,194	2021/10/28
平成24年度第4回福岡市公募公債		0.8	70,000	72,909	2022/10/31
平成20年度第1回広島市公募公債		1.56	50,000	51,235	2018/12/25
平成20年度第2回広島市公募公債		1.52	50,000	51,335	2019/2/25
平成22年度第6回広島市公募公債		1.21	50,000	52,413	2021/5/31
平成22年度第1回相模原市公募公債		1.29	60,000	62,745	2020/12/18
平成22年度第1回三重県公募公債		1.056	149,170	154,669	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債		1.021	162,550	169,985	2021/11/30
平成20年度第1回徳島県公募公債		1.73	130,300	133,704	2018/11/28
平成21年度第1回徳島県公募公債		1.55	36,500	37,920	2019/11/29
平成22年度第1回岡山県公募公債		1.05	50,000	51,833	2020/11/30
平成27年度第1回岡山県公募公債		0.395	189,000	192,972	2026/1/29
小 計			11,572,510	12,450,224	
特殊債券（除く金融債）					
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	100,000	107,257	2021/2/26
第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	100,000	107,405	2021/3/26
第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	11,000	11,227	2018/9/28
第73回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	14,000	14,314	2019/1/30
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	100,000	102,352	2019/2/27
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	30,000	30,728	2019/3/19
第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	100,000	102,774	2019/4/30
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	200,000	206,432	2019/6/28
第85回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	124,000	127,881	2019/7/31
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	200,000	243,764	2029/10/31
第100回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	10,000	10,396	2020/2/28
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	100,000	122,195	2030/4/30
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.2	100,000	129,219	2040/5/31
第114回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	100,000	119,927	2030/7/31
第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	100,000	120,908	2040/8/31
第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	100,000	120,019	2030/9/30
第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.2	14,000	14,704	2021/6/30
第158回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.0	100,000	125,727	2042/2/28
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.895	100,000	104,677	2022/6/30
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.791	300,000	313,173	2022/10/31
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.734	163,000	169,846	2022/12/28
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.834	200,000	209,620	2023/1/31

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.815	30,000	31,429	2023/2/28
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.605	340,000	352,481	2023/5/31
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.882	100,000	105,412	2023/6/30
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.645	100,000	104,345	2024/3/29
第218回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.66	201,000	209,966	2024/5/31
第254回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.44	400,000	411,704	2025/8/29
第344回政府保証道路債券		1.6	100,000	105,120	2020/7/15
第13回政府保証東日本高速道路債券		1.6	80,000	81,834	2018/10/19
第14回政府保証東日本高速道路債券		1.4	80,000	81,804	2018/12/21
第12回政府保証日本政策投資銀行債券		2.1	100,000	108,724	2021/6/28
第1回政府保証公営企業債券(15年)		1.6	200,000	210,034	2020/6/22
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.5	200,000	206,316	2019/6/14
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.4	200,000	206,116	2019/7/12
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.3	31,000	31,950	2019/9/13
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.3	14,000	14,324	2019/2/18
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.2	200,000	205,908	2019/10/18
第21回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.2	11,000	11,503	2021/2/15
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.3	20,000	21,009	2021/3/12
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.1	200,000	210,280	2021/12/14
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.9	35,000	36,559	2022/3/14
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.734	100,000	104,175	2022/12/16
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.815	38,000	39,801	2023/2/17
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.835	100,000	105,200	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.693	100,000	104,489	2023/12/18
第2回政府保証公営企業債券(15年)		2.1	100,000	108,298	2021/4/16
第25回政府保証日本政策金融公庫債券		0.815	100,000	104,756	2023/2/24
第16回政府保証民間都市開発債券		0.699	90,000	94,003	2023/10/20
第5回政府保証日本政策投資銀行		1.4	10,000	10,271	2019/4/15
第13回政府保証中部国際空港債券		1.3	72,000	75,641	2021/3/15
第16回政府保証西日本高速道路債券		1.6	75,000	76,812	2018/11/16
第17回政府保証西日本高速道路債券		1.3	75,000	76,679	2019/1/28
第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債)		2.23	30,000	35,856	2027/5/28
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.99	100,000	148,056	2045/9/20
第17回道路債券(財投機関債)		1.54	150,000	162,303	2022/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.75	100,000	143,227	2047/3/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.67	110,000	155,299	2047/3/20
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.37	100,000	122,817	2028/9/20
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.41	100,000	124,051	2029/4/20
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.71	100,000	103,188	2019/3/20
第67回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.3	100,000	104,932	2021/3/19
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.773	100,000	118,362	2032/9/17
第110回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		0.94	100,000	105,229	2023/6/20
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)		1.03	100,000	105,577	2023/3/22
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)		2.95	100,000	137,858	2034/3/24
第5回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		2.22	100,000	122,642	2030/1/28
第7回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.2	100,000	114,406	2024/3/22

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第8回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.25	100,000	114,746	2024/3/22
第12回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.38	100,000	104,152	2020/5/28
第13回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.278	100,000	103,926	2020/6/26
第13回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		2.132	100,000	122,472	2031/1/28
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.84	100,000	119,040	2031/12/26
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.68	100,000	116,976	2032/7/28
第44回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.791	200,000	208,224	2023/1/27
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.546	70,000	80,440	2031/7/30
第1回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.1	100,000	110,303	2022/6/20
第100回都市再生債券(財投機関債)		0.569	100,000	103,337	2024/11/20
第7回本州四国連絡橋債券(財投機関債)		2.26	100,000	116,939	2025/6/20
第29回福祉医療機構債券(財投機関債)		1.145	100,000	105,100	2021/12/20
第4回中部国際空港(財投機関債)		0.305	200,000	200,758	2027/2/22
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	40,452	42,754	2042/5/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.19	42,672	45,333	2042/6/10
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.85	22,332	22,638	2036/9/10
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.82	33,328	34,844	2036/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.76	50,844	53,107	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.26	17,820	18,952	2037/5/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.25	53,586	56,960	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.99	22,358	23,670	2042/12/10
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.52	38,256	38,997	2037/12/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.43	13,641	13,939	2038/2/10
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券		0.92	14,979	15,187	2038/6/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.16	23,595	25,090	2043/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.64	55,172	57,251	2032/11/10
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.71	56,238	58,497	2032/11/10
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.57	28,236	29,242	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	15,861	16,449	2039/6/10
第23回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.6	100,000	125,410	2028/9/20
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.95	38,980	41,815	2044/10/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	19,914	20,739	2040/6/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	39,518	42,223	2044/12/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	21,524	22,446	2040/7/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	88,374	93,917	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.71	86,172	91,217	2045/6/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	39,854	41,738	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	49,712	51,982	2045/9/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	39,164	41,709	2041/5/10
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.3	38,256	40,803	2041/7/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	167,751	179,243	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	97,264	103,697	2046/2/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	92,934	99,525	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	45,666	48,615	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	45,836	48,609	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	50,078	53,138	2046/8/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2. 18	44, 432	47, 504	2042/ 3 /10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1. 51	52, 750	55, 707	2046/ 9 /10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1. 48	54, 520	57, 525	2046/10/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1. 44	59, 372	62, 603	2047/ 2 /10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1. 44	60, 874	64, 205	2047/ 4 /10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1. 34	62, 987	66, 116	2047/ 5 /10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1. 26	122, 584	128, 298	2047/ 6 /10
第63回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)		1. 358	100, 000	104, 818	2020/12/18
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1. 12	202, 563	210, 598	2047/11/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1. 04	70, 720	73, 418	2049/ 4 /10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1. 01	141, 648	146, 835	2049/ 5 /10
第86回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)		1. 046	100, 000	104, 432	2021/ 9 /17
第87回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)		1. 53	100, 000	112, 335	2026/ 9 /18
第88回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)		1. 863	100, 000	119, 304	2031/11/18
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0. 87	152, 734	157, 103	2049/11/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)		1. 892	200, 000	239, 768	2032/ 4 /16
第17回国際協力機構債券 (財投機関債)		0. 72	30, 000	31, 095	2022/12/26
第13回中日本高速道路		1. 49	100, 000	103, 816	2019/12/20
第38回中日本高速道路		0. 677	100, 000	101, 201	2019/ 2 /28
第21回西日本高速道路		0. 754	100, 000	104, 038	2023/12/20
第17回東京都住宅供給公社債券		1. 17	100, 000	103, 536	2021/ 9 /17
小	計		12, 473, 551	13, 565, 726	
金融債券					
い第758号農林債券		0. 4	100, 000	100, 454	2018/ 7 /27
い第760号農林債券		0. 4	100, 000	100, 519	2018/ 9 /27
い第761号農林債券		0. 3	100, 000	100, 407	2018/10/26
い第765号農林債券		0. 3	200, 000	201, 020	2019/ 2 /27
い第769号農林債券		0. 3	130, 000	130, 776	2019/ 6 /27
い第774号農林債券		0. 24	100, 000	100, 561	2019/11/27
い第778号農林債券		0. 25	300, 000	302, 001	2020/ 3 /27
第288回信金中金債		0. 3	200, 000	200, 862	2018/11/27
第318回信金中金債		0. 04	100, 000	99, 919	2021/ 5 /27
第321回信金中金債		0. 03	200, 000	199, 744	2021/ 8 /27
小	計		1, 530, 000	1, 536, 263	
普通社債券					
第459回東京電力		2. 7	20, 000	20, 809	2019/ 1 /29
第548回東京電力		2. 347	100, 000	114, 781	2028/ 9 /29
第559回東京電力		1. 377	140, 000	143, 498	2019/10/29
第497回中部電力		0. 986	100, 000	102, 881	2020/10/23
第499回中部電力		1. 194	50, 000	52, 859	2023/ 6 /23
第518回中部電力		0. 19	200, 000	199, 718	2023/ 1 /25
第478回関西電力		1. 448	100, 000	103, 375	2020/ 1 /24
第297回北陸電力		0. 976	20, 000	20, 555	2020/10/23
第400回九州電力		1. 777	70, 000	73, 257	2020/ 4 /24
第296回北海道電力		2. 027	100, 000	102, 109	2018/ 6 /25
第316回北海道電力		1. 164	100, 000	103, 060	2020/ 6 /25

銘柄	利 率	当 期		末	
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
普通社債券	%	千円	千円		
第319回北海道電力	0.514	100,000	100,862	2019/9/25	
第26回関西国際空港	1.156	100,000	103,775	2020/9/18	
第15回成田国際空港	0.739	100,000	104,064	2024/2/20	
第7回大和ハウス工業	0.06	100,000	99,498	2021/6/18	
第10回大和ハウス工業	0.001	100,000	99,949	2020/2/28	
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	200,000	202,294	2022/6/20	
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	103,757	2022/12/2	
第4回富士フイルムホールディングス	0.005	200,000	199,312	2020/3/3	
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	104,141	2021/9/17	
第30回豊田自動織機	0.001	100,000	99,763	2020/3/19	
第5回日本電産	0.001	100,000	99,803	2019/11/25	
第15回パナソニック	0.19	100,000	99,939	2021/9/17	
第12回デンソー	0.01	100,000	99,548	2021/9/17	
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,705	2019/8/7	
第78回三菱商事	1.155	100,000	104,514	2022/3/9	
第79回三菱商事	1.022	100,000	104,014	2022/5/20	
第7回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	2.5	200,000	209,398	2019/6/3	
第8回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	1.62	100,000	105,877	2021/10/29	
第88回三菱東京ＵＦＪ銀行	2.34	100,000	120,220	2027/4/20	
第6回りそな銀行（劣後特約付）	2.084	100,000	105,188	2020/3/4	
第9回三菱ＵＦＪ信託銀行（劣後特約付）	1.68	100,000	105,452	2021/4/28	
第12回住友信託銀行（劣後特約付）	1.373	100,000	104,014	2020/11/11	
第15回住友信託銀行（劣後特約付）	1.62	100,000	106,340	2022/3/22	
第17回三井住友銀行（劣後特約付）	2.8	200,000	209,102	2019/2/12	
第20回三井住友銀行（劣後特約付）	2.21	100,000	104,393	2019/7/24	
第22回三井住友銀行（劣後特約付）	1.43	100,000	104,101	2020/9/28	
第23回三井住友銀行（劣後特約付）	1.61	100,000	105,005	2020/12/17	
第18回みずほ銀行（劣後特約付）	2.14	100,000	114,458	2026/9/11	
第19回みずほ銀行（劣後特約付）	1.67	100,000	106,533	2022/2/24	
第12回芙蓉総合リース	0.12	100,000	99,706	2020/9/18	
第38回日産フィナンシャルサービス	0.001	100,000	99,639	2019/6/20	
第40回日産フィナンシャルサービス	0.001	200,000	199,278	2020/3/19	
第35回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,644	2019/12/20	
第37回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,667	2020/3/19	
第38回ホンダファイナンス	0.01	100,000	99,509	2021/3/19	
第39回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,798	2019/12/20	
第52回日立キャピタル	0.508	100,000	100,943	2021/6/18	
第62回日立キャピタル	0.001	200,000	199,518	2019/9/20	
第9回三井住友ファイナンス&リース	0.518	100,000	100,984	2021/1/29	
第14回三井住友ファイナンス&リース	0.321	100,000	100,417	2020/10/30	
第39回三菱ＵＦＪリース	0.12	100,000	99,703	2021/6/9	
第41回三菱ＵＦＪリース	0.06	200,000	198,850	2021/7/23	
第23回野村ホールディングス	1.808	100,000	105,087	2020/6/24	
第24回野村ホールディングス	2.329	100,000	115,234	2025/6/24	
第2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回	1.98	100,000	101,823	2018/6/20	
第72回三菱地所	2.28	100,000	114,312	2024/9/20	

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券		%	千円	千円	
第80回三菱地所		2.305	100,000	118,147	2027/3/19
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発		1.12	100,000	103,769	2021/9/17
第15回東日本旅客鉄道		2.65	20,000	21,671	2020/8/25
第19回東日本旅客鉄道		2.36	100,000	110,742	2022/2/25
第32回東日本旅客鉄道		2.26	100,000	114,408	2024/3/19
第34回東日本旅客鉄道		2.53	100,000	116,756	2024/6/20
第43回東日本旅客鉄道		1.86	100,000	106,326	2020/12/18
第100回東日本旅客鉄道		1.981	100,000	122,985	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道		2.28	100,000	110,528	2022/3/25
第27回西日本旅客鉄道		1.36	100,000	103,903	2020/6/11
第6回東海旅客鉄道		2.39	21,000	23,278	2022/2/15
第42回東海旅客鉄道		2.312	100,000	123,017	2029/4/24
第53回東海旅客鉄道		1.797	100,000	118,030	2030/10/25
第63回日本電信電話		0.69	200,000	205,764	2023/3/20
第19回ＫＤＤＩ		1.151	100,000	102,880	2020/6/19
第21回ＫＤＤＩ		0.669	100,000	102,193	2024/9/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ		0.73	100,000	102,664	2023/9/20
第8回電源開発		2.11	100,000	113,358	2024/12/20
第23回東京ガス		1.01	100,000	105,213	2023/6/9
第4回ファーストリテイリング		0.749	100,000	102,703	2025/12/18
第20回ＧＥキャピタルコーポレーション		2.885	100,000	102,555	2018/5/29
第11回ナショナル・オーストラリア銀行		0.284	100,000	100,218	2020/1/16
第8回オーストラリア・コモンウェルス銀行		0.407	100,000	100,413	2019/5/2
第18回ラボバンク・ネダーランド		0.778	100,000	100,249	2017/11/2
第23回ラボバンク・ネダーランド		0.557	100,000	100,354	2018/12/19
第27回ラボバンク・ネダーランド		0.38	100,000	100,037	2020/5/22
小	計		8,841,000	9,229,196	
合	計		192,951,061	210,521,700	

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	債券先物取引	10年国債標準物	百万円 602	百万円 —

○投資信託財産の構成

(2017年５月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 210,521,700	% 99.1
コール・ローン等、その他	1,926,788	0.9
投資信託財産総額	212,448,488	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	212,447,168,706
コール・ローン等	1,180,720,001
公社債(評価額)	210,521,700,750
未収入金	156,618,780
未収利息	580,815,977
前払費用	6,113,198
差入委託証拠金	1,200,000
(B) 負債	415,199,061
未払解約金	415,197,102
未払利息	1,959
(C) 純資産総額(A－B)	212,031,969,645
元本	153,669,783,979
次期繰越損益金	58,362,185,666
(D) 受益権総口数	153,669,783,979口
1万口当たり基準価額(C／D)	13,798円

<注記事項>

- ①期首元本額 156,236,987,608円
 期中追加設定元本額 30,516,869,384円
 期中一部解約元本額 33,084,073,013円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3798円です。

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

三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定型)	3,761,708,082円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)	4,460,103,900円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(成長型)	1,111,830,683円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	30,836,038,682円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	46,832,531,993円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	11,383,272,944円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	224,306,494円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(成長型)	160,966,135円
三菱ＵＦＪ 国内債券インデックスファンド	2,551,311,938円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	2,615,512,359円
三菱ＵＦＪ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	11,804,100,701円
三菱ＵＦＪ 日本債券ファンドV A(適格機関投資家限定)	37,924,412,703円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定型)V A(適格機関投資家限定)	127,478円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)V A(適格機関投資家限定)	3,559,887円
合計	153,669,783,979円

【お 知 ら せ】

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

○損益の状況 (2016年5月21日～2017年5月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,269,052,671
受取利息	2,269,739,543
支払利息	△ 686,872
(B) 有価証券売買損益	△ 6,483,781,320
売買益	162,737,150
売買損	△ 6,646,518,470
(C) 先物取引等取引損益	△ 1,474,000
取引益	6,401,920
取引損	△ 7,875,920
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 4,216,202,649
(E) 前期繰越損益金	63,665,675,310
(F) 追加信託差損益金	12,086,729,169
(G) 解約差損益金	△13,174,016,164
(H) 計(D+E+F+G)	58,362,185,666
次期繰越損益金(H)	58,362,185,666

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

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

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

三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド

《第17期》決算日2017年5月22日

[計算期間：2016年5月21日～2017年5月22日]

「三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド」は、5月22日に第17期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース））に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主 要 運 用 対 象	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とし、外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		シティ世界国債インデックス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰 落	中 率	(除く日本、円 ベース)	期 騰 落			
	円		%		%	%	%	百万円
13期(2013年 5月20日)	23,300		35.7	396.6181	36.1	98.9	—	238,488
14期(2014年 5月20日)	24,305		4.3	412.1913	3.9	98.7	—	174,867
15期(2015年 5月20日)	27,492		13.1	466.3665	13.1	98.8	—	128,186
16期(2016年 5月20日)	25,716	△	6.5	436.8953	△ 6.3	98.7	—	73,559
17期(2017年 5月22日)	25,920		0.8	441.3251	1.0	98.9	—	54,433

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	シティ世界国債インデックス (除く日本、 円 ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
			騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2016年 5月20日	円 25,716	% —	436.8953	% —	% 98.7	% —
5 月末	25,916	0.8	441.6129	1.1	98.7	—
6 月末	24,490	△4.8	415.4491	△4.9	99.1	—
7 月末	24,887	△3.2	425.0763	△2.7	98.8	—
8 月末	24,703	△3.9	419.0226	△4.1	98.9	—
9 月末	24,240	△5.7	414.9990	△5.0	99.2	—
10月末	24,279	△5.6	414.5482	△5.1	99.0	—
11月末	25,255	△1.8	431.0003	△1.3	98.7	—
12月末	26,042	1.3	442.1486	1.2	98.3	—
2017年 1 月末	25,421	△1.1	432.5967	△1.0	99.1	—
2 月末	25,287	△1.7	429.5990	△1.7	99.2	—
3 月末	25,290	△1.7	428.1895	△2.0	98.9	—
4 月末	25,444	△1.1	432.7440	△1.0	98.7	—
(期 末) 2017年 5月22日	25,920	0.8	441.3251	1.0	98.9	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

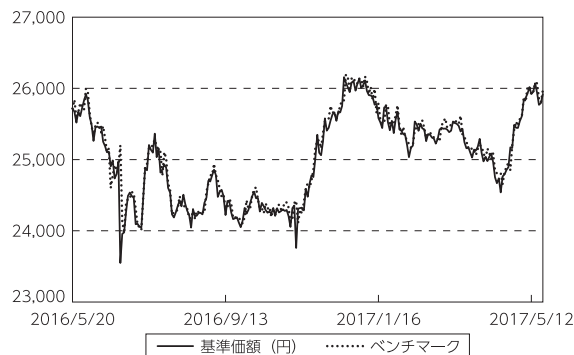
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.8%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率
(1.0%) を0.2%下回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国債券市況

- ・先進国の債券市況は、2016年6月にかけて世界的な景気減速懸念が強まったことなどを背景に上昇しましたが、その後は米連邦準備制度理事会（ＦＲＢ）の利上げに対する期待が高まったことなどから下落しました。

◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、2016年6月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、米ドルが対円で下落しましたが、その後、ＦＲＢの利上げに対する期待が高まったことなどから、米ドルが対円で買われました。期首との比較では、米ドルは対円で1.3%上昇しました。
- ・円・ユーロ相場は、2016年6月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、ユーロが対円で下落しましたが、米国大統領選挙以降、大半の主要通貨に対して円安が進行し、ユーロは対円で上昇しました。期首との比較では、ユーロは対円で1.2%上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは1.0%の上昇となったため、カイ離は△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。

◎今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年5月21日～2017年5月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 9	% 0.035	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(9)	(0.035)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	9	0.035	
期中の平均基準価額は、25,104円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2016年5月21日~2017年5月22日)

公社債

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

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2016年5月21日～2017年5月22日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	4,020	2,560	63.7	23,107	12,940	56.0

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

○組入資産の明細

(2017年5月22日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 207,950	千アメリカドル 212,060	千円 23,653,240	% 43.5	% —	% 17.8	% 17.1	% 8.5
カナダ	千カナダドル 12,270	千カナダドル 13,561	1,117,295	2.1	—	1.0	0.7	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 77,350	千メキシコペソ 80,105	476,625	0.9	—	0.5	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	26,330	31,020	3,871,050	7.1	—	4.2	2.0	1.0
イタリア	36,610	41,880	5,226,286	9.6	—	5.6	2.7	1.3
フランス	35,990	42,805	5,341,738	9.8	—	6.0	2.8	0.9
オランダ	8,060	9,556	1,192,503	2.2	—	1.4	0.6	0.2
スペイン	20,830	24,405	3,045,608	5.6	—	3.4	1.6	0.7
ベルギー	8,740	10,860	1,355,275	2.5	—	1.8	0.5	0.1
オーストリア	5,410	6,490	809,966	1.5	—	0.9	0.4	0.1
フィンランド	2,410	2,680	334,486	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	3,050	3,520	439,343	0.8	—	0.4	0.3	0.1
イギリス	千イギリスポンド 20,860	千イギリスポンド 27,094	3,922,132	7.2	—	5.2	1.6	0.4
スイス	千スイスフラン 710	千スイスフラン 862	98,788	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 16,400	千スウェーデンクローネ 18,902	241,390	0.4	—	0.3	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 10,750	千ノルウェークローネ 11,515	153,271	0.3	—	0.2	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 15,750	千デンマーククローネ 19,631	329,017	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 11,420	千ポーランドズロチ 11,768	350,241	0.6	—	0.3	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 12,510	千オーストラリアドル 13,592	1,128,604	2.1	—	1.3	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 2,440	千シンガポールドル 2,581	207,601	0.4	—	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 8,550	千マレーシアリンギット 8,561	221,582	0.4	—	0.2	0.2	0.0
南アフリカ	千南アフリカランド 37,600	千南アフリカランド 34,711	292,268	0.5	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	53,808,318	98.9	—	52.0	32.6	14.3

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄			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	0.625 T-NOTE 180430	0.625	700	696	77,687	2018/4/30	
	0.75 T-NOTE 180731	0.75	1,800	1,790	199,744	2018/7/31	
	0.75 T-NOTE 180930	0.75	1,700	1,690	188,514	2018/9/30	
	0.75 T-NOTE 190215	0.75	700	694	77,422	2019/2/15	
	0.75 T-NOTE 190715	0.75	700	691	77,153	2019/7/15	
	0.875 T-NOTE 180531	0.875	800	797	88,970	2018/5/31	
	0.875 T-NOTE 181015	0.875	1,400	1,393	155,466	2018/10/15	
	0.875 T-NOTE 190415	0.875	1,100	1,091	121,797	2019/4/15	
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	300	297	33,152	2019/7/31	
	0.875 T-NOTE 190915	0.875	900	890	99,346	2019/9/15	
	1 T-NOTE 180815	1.0	700	698	77,910	2018/8/15	
	1 T-NOTE 180915	1.0	1,600	1,595	177,996	2018/9/15	
	1 T-NOTE 181130	1.0	1,400	1,395	155,649	2018/11/30	
	1 T-NOTE 190831	1.0	300	297	33,221	2019/8/31	
	1 T-NOTE 190930	1.0	700	694	77,474	2019/9/30	
	1 T-NOTE 191115	1.0	1,250	1,239	138,221	2019/11/15	
	1 T-NOTE 191130	1.0	900	892	99,519	2019/11/30	
	1.125 T-NOTE 180615	1.125	600	599	66,895	2018/6/15	
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	800	794	88,667	2019/12/31	
	1.125 T-NOTE 200430	1.125	350	346	38,688	2020/4/30	
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	700	687	76,650	2021/2/28	
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	2,000	1,955	218,147	2021/6/30	
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	2,000	1,953	217,921	2021/7/31	
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	1,300	1,267	141,376	2021/9/30	
	1.25 T-NOTE 181031	1.25	300	300	33,480	2018/10/31	
	1.25 T-NOTE 181115	1.25	1,500	1,500	167,394	2018/11/15	
	1.25 T-NOTE 181130	1.25	500	500	55,785	2018/11/30	
	1.25 T-NOTE 181215	1.25	1,300	1,300	145,052	2018/12/15	
	1.25 T-NOTE 190131	1.25	1,200	1,200	133,848	2019/1/31	
	1.25 T-NOTE 190430	1.25	450	449	50,167	2019/4/30	
	1.25 T-NOTE 191031	1.25	700	698	77,907	2019/10/31	
	1.25 T-NOTE 200131	1.25	1,100	1,096	122,262	2020/1/31	
	1.25 T-NOTE 200229	1.25	100	99	11,106	2020/2/29	
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	900	886	98,935	2021/3/31	
	1.25 T-NOTE 211031	1.25	1,300	1,273	142,011	2021/10/31	
	1.25 T-NOTE 230731	1.25	300	287	32,055	2023/7/31	
	1.375 T-NOTE 180630	1.375	2,100	2,104	234,773	2018/6/30	
	1.375 T-NOTE 180731	1.375	1,000	1,002	111,792	2018/7/31	
	1.375 T-NOTE 180930	1.375	400	400	44,710	2018/9/30	
	1.375 T-NOTE 181130	1.375	800	801	89,427	2018/11/30	
1.375 T-NOTE 181231	1.375	1,400	1,403	156,503	2018/12/31		
1.375 T-NOTE 190228	1.375	1,700	1,703	189,988	2019/2/28		
1.375 T-NOTE 200115	1.375	800	799	89,214	2020/1/15		
1.375 T-NOTE 200131	1.375	1,000	999	111,509	2020/1/31		

銘 柄			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	1.375 T-NOTE 200229	1.375	1,100	1,098	122,569	2020/2/29	
	1.375 T-NOTE 200331	1.375	100	99	11,140	2020/3/31	
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	1,050	1,047	116,888	2020/4/30	
	1.375 T-NOTE 200831	1.375	900	895	99,915	2020/8/31	
	1.375 T-NOTE 200930	1.375	1,900	1,889	210,750	2020/9/30	
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	1,900	1,888	210,601	2020/10/31	
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	1,200	1,189	132,718	2021/1/31	
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	1,700	1,642	183,203	2023/6/30	
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	1,000	964	107,540	2023/8/31	
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	1,000	963	107,444	2023/9/30	
	1.5 T-NOTE 180831	1.5	800	803	89,573	2018/8/31	
	1.5 T-NOTE 181231	1.5	1,300	1,305	145,591	2018/12/31	
	1.5 T-NOTE 190131	1.5	1,800	1,807	201,603	2019/1/31	
	1.5 T-NOTE 190228	1.5	1,200	1,204	134,402	2019/2/28	
	1.5 T-NOTE 190331	1.5	400	401	44,814	2019/3/31	
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	900	903	100,813	2019/5/31	
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	1,700	1,706	190,314	2019/10/31	
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	500	501	55,955	2019/11/30	
	1.5 T-NOTE 200415	1.5	2,400	2,404	268,187	2020/4/15	
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	1,200	1,201	133,963	2020/5/31	
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	200	197	22,039	2022/1/31	
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	900	878	97,993	2023/3/31	
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	1,650	1,549	172,811	2026/8/15	
	1.625 T-NOTE 190331	1.625	1,200	1,208	134,747	2019/3/31	
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	1,100	1,107	123,527	2019/4/30	
	1.625 T-NOTE 190630	1.625	1,800	1,812	202,120	2019/6/30	
	1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,400	1,409	157,229	2019/7/31	
	1.625 T-NOTE 190831	1.625	1,600	1,610	179,663	2019/8/31	
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,200	1,207	134,695	2019/12/31	
	1.625 T-NOTE 200315	1.625	2,100	2,112	235,579	2020/3/15	
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	250	250	27,987	2020/7/31	
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,300	1,302	145,262	2020/11/30	
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	550	543	60,671	2022/8/15	
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	1,400	1,381	154,082	2022/11/15	
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	1,300	1,276	142,396	2023/4/30	
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	1,200	1,173	130,867	2023/10/31	
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	1,750	1,668	186,151	2026/2/15	
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	2,300	2,188	244,095	2026/5/15	
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	1,100	1,108	123,599	2018/10/31	
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	500	504	56,310	2019/9/30	
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	1,350	1,358	151,567	2020/10/31	
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	250	251	28,037	2020/12/31	
	1.75 T-NOTE 211130	1.75	1,550	1,551	173,008	2021/11/30	
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	100	99	11,139	2022/2/28	
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	950	948	105,780	2022/3/31	

銘 柄			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	1.75 T-NOTE 220430	1.75	550	548	61,217	2022/4/30	
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,250	1,247	139,141	2022/5/15	
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,100	1,093	122,003	2022/9/30	
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	850	842	93,986	2023/1/31	
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,200	1,186	132,347	2023/5/15	
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	900	905	100,966	2021/11/30	
	1.875 T-NOTE 220331	1.875	1,700	1,707	190,447	2022/3/31	
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	100	100	11,197	2022/5/31	
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,000	1,001	111,705	2022/8/31	
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	1,200	1,200	133,879	2022/10/31	
	2 T-NOTE 200731	2.0	600	609	67,954	2020/7/31	
	2 T-NOTE 200930	2.0	800	812	90,584	2020/9/30	
	2 T-NOTE 201130	2.0	600	608	67,896	2020/11/30	
	2 T-NOTE 210228	2.0	700	709	79,188	2021/2/28	
	2 T-NOTE 210531	2.0	1,100	1,114	124,309	2021/5/31	
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,100	1,113	124,165	2021/8/31	
	2 T-NOTE 211031	2.0	1,100	1,112	124,083	2021/10/31	
	2 T-NOTE 211115	2.0	1,500	1,517	169,303	2021/11/15	
	2 T-NOTE 220215	2.0	1,200	1,213	135,348	2022/2/15	
	2 T-NOTE 220731	2.0	1,500	1,512	168,682	2022/7/31	
	2 T-NOTE 221130	2.0	1,200	1,207	134,642	2022/11/30	
	2 T-NOTE 230215	2.0	2,300	2,310	257,764	2023/2/15	
	2 T-NOTE 250215	2.0	1,900	1,881	209,856	2025/2/15	
	2 T-NOTE 250815	2.0	3,000	2,960	330,201	2025/8/15	
	2 T-NOTE 261115	2.0	1,150	1,126	125,615	2026/11/15	
	2.125 T-NOTE 200831	2.125	1,600	1,630	181,865	2020/8/31	
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	100	101	11,360	2021/1/31	
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,400	1,424	158,900	2021/6/30	
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	1,700	1,730	193,010	2021/8/15	
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,100	1,118	124,764	2021/9/30	
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,100	2,133	238,003	2021/12/31	
	2.125 T-NOTE 221231	2.125	1,000	1,011	112,855	2022/12/31	
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	900	906	101,146	2023/11/30	
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	850	854	95,349	2024/2/29	
	2.125 T-NOTE 240331	2.125	750	753	84,079	2024/3/31	
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	2,200	2,195	244,870	2025/5/15	
	2.25 T-BOND 460815	2.25	600	520	58,072	2046/8/15	
	2.25 T-NOTE 180731	2.25	800	809	90,343	2018/7/31	
	2.25 T-NOTE 210331	2.25	200	204	22,820	2021/3/31	
	2.25 T-NOTE 210430	2.25	1,050	1,073	119,788	2021/4/30	
2.25 T-NOTE 210731	2.25	1,300	1,329	148,241	2021/7/31		
2.25 T-NOTE 231231	2.25	1,000	1,014	113,134	2023/12/31		
2.25 T-NOTE 241115	2.25	700	706	78,828	2024/11/15		
2.25 T-NOTE 251115	2.25	3,200	3,214	358,545	2025/11/15		
2.25 T-NOTE 270215	2.25	900	899	100,378	2027/2/15		

銘 柄			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	2.375 T-NOTE 201231	2.375	1,300	1,336	149,046	2020/12/31	
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	1,030	1,050	117,156	2024/ 8 /15	
	2.5 T-BOND 450215	2.5	2,900	2,670	297,891	2045/ 2 /15	
	2.5 T-BOND 460215	2.5	950	872	97,303	2046/ 2 /15	
	2.5 T-BOND 460515	2.5	600	550	61,423	2046/ 5 /15	
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	1,650	1,700	189,691	2023/ 8 /15	
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	1,550	1,595	177,911	2024/ 5 /15	
	2.625 T-NOTE 180430	2.625	300	304	33,918	2018/ 4 /30	
	2.625 T-NOTE 200815	2.625	1,500	1,552	173,178	2020/ 8 /15	
	2.625 T-NOTE 201115	2.625	1,500	1,553	173,283	2020/11/15	
	2.75 T-BOND 420815	2.75	450	439	49,008	2042/ 8 /15	
	2.75 T-BOND 421115	2.75	950	926	103,396	2042/11/15	
	2.75 T-NOTE 190215	2.75	1,000	1,025	114,415	2019/ 2 /15	
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	1,900	1,986	221,595	2023/11/15	
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	1,300	1,359	151,606	2024/ 2 /15	
	2.875 T-BOND 430515	2.875	1,850	1,844	205,784	2043/ 5 /15	
	2.875 T-BOND 450815	2.875	1,250	1,241	138,433	2045/ 8 /15	
	2.875 T-BOND 461115	2.875	950	943	105,193	2046/11/15	
	3 T-BOND 420515	3.0	200	204	22,823	2042/ 5 /15	
	3 T-BOND 441115	3.0	1,500	1,529	170,577	2044/11/15	
	3 T-BOND 450515	3.0	1,700	1,730	193,040	2045/ 5 /15	
	3 T-BOND 451115	3.0	1,200	1,220	136,179	2045/11/15	
	3 T-BOND 470215	3.0	240	244	27,258	2047/ 2 /15	
	3.125 T-BOND 411115	3.125	500	523	58,421	2041/11/15	
	3.125 T-BOND 420215	3.125	250	261	29,189	2042/ 2 /15	
	3.125 T-BOND 430215	3.125	1,130	1,179	131,613	2043/ 2 /15	
	3.125 T-BOND 440815	3.125	1,950	2,036	227,137	2044/ 8 /15	
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	800	829	92,484	2019/ 5 /15	
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	1,100	1,162	129,619	2021/ 5 /15	
	3.375 T-BOND 440515	3.375	1,650	1,802	201,064	2044/ 5 /15	
	3.375 T-NOTE 191115	3.375	300	314	35,112	2019/11/15	
	3.5 T-BOND 390215	3.5	350	392	43,824	2039/ 2 /15	
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	800	848	94,603	2020/ 5 /15	
	3.625 T-BOND 430815	3.625	1,250	1,422	158,672	2043/ 8 /15	
	3.625 T-BOND 440215	3.625	1,050	1,196	133,431	2044/ 2 /15	
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	700	735	82,052	2019/ 8 /15	
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	1,050	1,112	124,102	2020/ 2 /15	
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	1,500	1,609	179,505	2021/ 2 /15	
	3.75 T-BOND 410815	3.75	500	579	64,686	2041/ 8 /15	
	3.75 T-BOND 431115	3.75	800	930	103,746	2043/11/15	
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	1,800	1,866	208,230	2018/11/15	
	3.875 T-BOND 400815	3.875	550	649	72,451	2040/ 8 /15	
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	600	615	68,688	2018/ 5 /15	
	4 T-NOTE 180815	4.0	1,300	1,344	149,946	2018/ 8 /15	
	4.25 T-BOND 390515	4.25	350	435	48,615	2039/ 5 /15	

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	4.25 T-BOND 401115	4.25	550	685	76,496	2040/11/15
		4.375 T-BOND 380215	4.375	300	381	42,512	2038/ 2 /15
		4.375 T-BOND 391115	4.375	150	189	21,186	2039/11/15
		4.375 T-BOND 400515	4.375	500	633	70,684	2040/ 5 /15
		4.375 T-BOND 410515	4.375	600	762	85,050	2041/ 5 /15
		4.5 T-BOND 360215	4.5	450	578	64,580	2036/ 2 /15
		4.5 T-BOND 380515	4.5	200	258	28,793	2038/ 5 /15
		4.5 T-BOND 390815	4.5	300	386	43,090	2039/ 8 /15
		4.625 T-BOND 400215	4.625	600	785	87,659	2040/ 2 /15
		4.75 T-BOND 410215	4.75	350	468	52,214	2041/ 2 /15
		5 T-BOND 370515	5.0	250	341	38,128	2037/ 5 /15
		5.25 T-BOND 281115	5.25	300	387	43,241	2028/11/15
		5.25 T-BOND 290215	5.25	50	64	7,233	2029/ 2 /15
		5.375 T-BOND 310215	5.375	400	540	60,290	2031/ 2 /15
		5.5 T-BOND 280815	5.5	200	262	29,287	2028/ 8 /15
		6 T-BOND 260215	6.0	1,550	2,020	225,414	2026/ 2 /15
		6.125 T-BOND 271115	6.125	300	407	45,445	2027/11/15
		6.25 T-BOND 230815	6.25	100	125	13,976	2023/ 8 /15
		6.25 T-BOND 300515	6.25	300	429	47,952	2030/ 5 /15
		6.5 T-BOND 261115	6.5	500	682	76,121	2026/11/15
8 T-BOND 211115	8.0	600	762	85,009	2021/11/15		
8.125 T-BOND 190815	8.125	300	344	38,469	2019/ 8 /15		
8.75 T-BOND 200815	8.75	800	982	109,574	2020/ 8 /15		
8.875 T-BOND 190215	8.875	600	679	75,767	2019/ 2 /15		
小 計					23,653,240		
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	0.25 CAN GOVT 180501	0.25	800	797	65,684	2018/ 5 / 1
		0.5 CAN GOVT 181101	0.5	400	399	32,890	2018/11/ 1
		0.5 CAN GOVT 220301	0.5	200	195	16,132	2022/ 3 / 1
		0.75 CAN GOVT 200901	0.75	600	598	49,348	2020/ 9 / 1
		0.75 CAN GOVT 210301	0.75	400	398	32,827	2021/ 3 / 1
		0.75 CAN GOVT 210901	0.75	750	745	61,423	2021/ 9 / 1
		1 CAN GOVT 220901	1.0	100	99	8,230	2022/ 9 / 1
		1 CAN GOVT 270601	1.0	150	143	11,816	2027/ 6 / 1
		1.5 CAN GOVT 200301	1.5	600	612	50,459	2020/ 3 / 1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	550	563	46,403	2023/ 6 / 1
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	400	404	33,337	2026/ 6 / 1
		1.75 CAN GOVT 190301	1.75	600	611	50,389	2019/ 3 / 1
		1.75 CAN GOVT 190901	1.75	300	307	25,301	2019/ 9 / 1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	450	483	39,849	2025/ 6 / 1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	400	435	35,883	2024/ 6 / 1
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	550	597	49,229	2022/ 6 / 1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	290	332	27,431	2048/12/ 1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	150	180	14,873	2064/12/ 1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	350	382	31,546	2021/ 6 / 1

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	3.5 CAN GOVT 200601	3.5	300	324	26,733	2020/6/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	540	696	57,388	2045/12/1
		3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,000	1,061	87,454	2019/6/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	510	689	56,841	2041/6/1
		4.25 CAN GOVT 180601	4.25	700	725	59,804	2018/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	320	475	39,140	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	360	519	42,831	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	350	536	44,171	2033/6/1
		8 CAN GOVT 270601	8.0	150	241	19,870	2027/6/1
小 計						1,117,295	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	9,250	10,788	64,192	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	2,200	2,776	16,520	2036/11/20
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	2,800	2,746	16,343	2018/6/14
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	6,900	6,578	39,142	2019/12/11
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	2,900	2,637	15,690	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	9,500	9,311	55,405	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	3,900	3,804	22,633	2022/6/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	2,900	2,959	17,610	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	4,600	4,782	28,453	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	2,900	3,001	17,861	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	5,400	5,523	32,867	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	5,500	5,642	33,573	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	2,700	2,828	16,827	2023/12/7
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	800	843	5,018	2047/11/7
		8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	9,700	9,922	59,041	2018/12/13
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	2,200	2,422	14,411	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	3,200	3,534	21,032	2038/11/18
小 計						476,625	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
	ドイツ	0 BUND 260815	—	700	681	85,095	2026/8/15
		0 OBL 200417	—	750	763	95,337	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	700	713	89,087	2021/4/9
		0 OBL 211008	—	100	101	12,723	2021/10/8
		0 OBL 220408	—	350	356	44,443	2022/4/8
		0 SCHATS 180615	—	200	201	25,152	2018/6/15
		0.25 BUND 270215	0.25	50	49	6,172	2027/2/15
		0.25 OBL 191011	0.25	500	510	63,763	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	300	308	38,488	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	650	672	83,899	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	750	769	96,087	2026/2/15
		0.5 OBL 190412	0.5	700	715	89,344	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	900	966	120,647	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	950	1,018	127,133	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	700	716	89,471	2018/10/12

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	1 OBL 190222	1.0	900	926	115,679	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	550	602	75,210	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	900	989	123,511	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	550	606	75,644	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	550	610	76,144	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	750	830	103,595	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	550	618	77,231	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	600	667	83,335	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	450	511	63,773	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	600	656	81,912	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	550	614	76,734	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	800	889	110,975	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	620	811	101,243	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	630	831	103,717	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	850	946	118,140	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	600	662	82,634	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	600	693	86,561	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	490	720	89,919	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	700	762	95,132	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	700	750	93,712	2019/1/4
		4 BUND 370104	4.0	700	1,087	135,672	2037/1/4
		4.25 BUND 180704	4.25	800	844	105,435	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	400	658	82,225	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	100	146	18,283	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	590	962	120,165	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	500	884	110,392	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	550	900	112,342	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	600	925	115,524	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	200	284	35,486	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	300	508	63,451	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	350	564	70,408	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.1 ITALY GOVT 190415	0.1	100	100	12,527	2019/4/15
		0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	100	100	12,552	2018/5/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	100	98	12,340	2021/11/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	500	500	62,425	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	200	202	25,271	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	300	288	36,038	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	400	405	50,617	2020/5/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	400	397	49,591	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	400	409	51,105	2019/12/1
		1.2 ITALY GOVT 220401	1.2	300	305	38,090	2022/4/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	300	281	35,179	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	450	461	57,596	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	200	205	25,613	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	600	619	77,334	2019/8/1

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	500	492	61,416	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	500	486	60,754	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	480	433	54,124	2032/3/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	550	557	69,553	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	600	640	79,918	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	200	201	25,153	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	350	323	40,404	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	50	48	6,088	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	700	734	91,688	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	650	690	86,113	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	400	360	44,942	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	210	177	22,159	2067/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	450	454	56,761	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	650	675	84,321	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,100	1,161	144,932	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	900	1,006	125,601	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	1,100	1,239	154,709	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	550	621	77,517	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	800	907	113,243	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	550	632	78,893	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	750	841	104,976	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	750	880	109,826	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	1,200	1,288	160,805	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	450	493	61,532	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	950	1,057	131,938	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	900	951	118,740	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	700	757	94,472	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	700	781	97,536	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	900	1,074	134,049	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	650	778	97,188	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	700	847	105,816	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	1,050	1,235	154,205	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	900	1,092	136,374	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	600	746	93,197	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	450	571	71,312	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	700	837	104,558	2022/3/1
5 ITALY GOVT 250301	5.0	750	931	116,269	2025/3/1		
5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,500	1,961	244,797	2034/8/1		
5 ITALY GOVT 390801	5.0	650	855	106,725	2039/8/1		
5 ITALY GOVT 400901	5.0	680	886	110,631	2040/9/1		
5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	1,000	1,307	163,213	2029/11/1		
5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	600	741	92,496	2022/9/1		
5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	920	1,139	142,177	2022/11/1		
6 ITALY GOVT 310501	6.0	820	1,156	144,262	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	800	1,125	140,388	2027/11/1		

銘 柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	600	873	108,986	2026/11/ 1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	300	442	55,221	2023/11/ 1
フランス	国債証券	0 O. A. T 190225	—	200	201	25,197	2019/ 2 /25
		0 O. A. T 200525	—	550	557	69,564	2020/ 5 /25
		0 O. A. T 210525	—	400	404	50,512	2021/ 5 /25
		0.25 O. A. T 201125	0.25	600	613	76,562	2020/11/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	620	592	73,957	2026/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	700	717	89,552	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	1,450	1,456	181,804	2025/ 5 /25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	400	395	49,301	2026/ 5 /25
		1 O. A. T 180525	1.0	200	203	25,354	2018/ 5 /25
		1 O. A. T 181125	1.0	1,100	1,125	140,477	2018/11/25
		1 O. A. T 190525	1.0	700	721	90,037	2019/ 5 /25
		1 O. A. T 251125	1.0	650	674	84,230	2025/11/25
		1 O. A. T 270525	1.0	250	254	31,781	2027/ 5 /25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	400	384	47,919	2036/ 5 /25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	850	886	110,600	2031/ 5 /25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	1,200	1,323	165,169	2023/ 5 /25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	970	1,072	133,814	2024/11/25
		1.75 O. A. T 390625	1.75	250	257	32,130	2039/ 6 /25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	950	1,069	133,510	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	600	684	85,442	2024/ 5 /25
		2.5 O. A. T 201025	2.5	1,150	1,265	157,942	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	1,050	1,231	153,714	2030/ 5 /25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	1,020	1,215	151,621	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	1,250	1,446	180,475	2022/ 4 /25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	1,400	1,618	202,003	2021/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	700	924	115,314	2045/ 5 /25
		3.5 O. A. T 200425	3.5	1,350	1,507	188,151	2020/ 4 /25
		3.5 O. A. T 260425	3.5	1,750	2,195	273,928	2026/ 4 /25
		3.75 O. A. T 191025	3.75	1,200	1,325	165,392	2019/10/25
		3.75 O. A. T 210425	3.75	1,600	1,859	232,029	2021/ 4 /25
		4 O. A. T 381025	4.0	470	682	85,186	2038/10/25
		4 O. A. T 550425	4.0	400	620	77,440	2055/ 4 /25
		4 O. A. T 600425	4.0	560	884	110,393	2060/ 4 /25
4.25 O. A. T 181025	4.25	1,100	1,176	146,754	2018/10/25		
4.25 O. A. T 190425	4.25	1,200	1,311	163,666	2019/ 4 /25		
4.25 O. A. T 231025	4.25	1,400	1,773	221,286	2023/10/25		
4.5 O. A. T 410425	4.5	1,280	2,006	250,442	2041/ 4 /25		
4.75 O. A. T 350425	4.75	1,060	1,633	203,892	2035/ 4 /25		
5.5 O. A. T 290425	5.5	900	1,365	170,422	2029/ 4 /25		
5.75 O. A. T 321025	5.75	760	1,248	155,741	2032/10/25		
6 O. A. T 251025	6.0	700	1,022	127,580	2025/10/25		
8.5 O. A. T 191025	8.5	300	366	45,691	2019/10/25		
8.5 O. A. T 230425	8.5	350	526	65,743	2023/ 4 /25		

銘柄			当期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	250	253	31,623	2022/ 1 /15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	500	511	63,813	2020/ 1 /15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	400	399	49,881	2025/ 7 /15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	460	463	57,875	2026/ 7 /15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	150	152	19,052	2027/ 7 /15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	400	412	51,505	2019/ 1 /15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	350	389	48,595	2023/ 7 /15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	500	568	70,934	2024/ 7 /15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	400	451	56,395	2022/ 7 /15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	400	496	61,910	2033/ 1 /15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	380	520	64,930	2047/ 1 /15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	500	576	71,997	2021/ 7 /15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	600	677	84,519	2020/ 7 /15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	550	672	83,947	2023/ 1 /15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	470	733	91,562	2042/ 1 /15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	300	316	39,457	2018/ 7 /15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	600	660	82,362	2019/ 7 /15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	450	693	86,536	2037/ 1 /15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	400	605	75,600	2028/ 1 /15
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	250	251	31,378	2018/ 4 /30
		0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25	100	100	12,593	2019/ 1 /31
		0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	100	100	12,530	2022/ 4 /30
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	700	720	89,866	2021/ 7 /30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	300	296	36,990	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	800	835	104,204	2020/ 1 /31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	850	879	109,734	2025/ 4 /30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,050	1,101	137,453	2026/ 4 /30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	670	668	83,442	2030/ 7 /30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	500	534	66,678	2025/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	400	423	52,884	2019/ 4 /30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	730	820	102,328	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	350	352	43,999	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	150	158	19,779	2066/ 7 /30
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	1,200	1,272	158,763	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	600	717	89,542	2024/ 4 /30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	1,100	1,234	154,015	2020/ 4 /30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	900	947	118,234	2018/ 7 /30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	630	799	99,779	2037/ 1 /31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	600	666	83,136	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	600	739	92,270	2023/10/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	600	663	82,848	2019/ 7 /30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	700	886	110,680	2025/ 7 /30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	580	788	98,444	2041/ 7 /30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	500	630	78,663	2024/ 1 /31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	500	584	72,964	2020/10/31

銘柄			当期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	500	695	86,778	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	500	677	84,521	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	170	245	30,665	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	800	1,019	127,265	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	800	973	121,532	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	650	957	119,541	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	800	1,010	126,076	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	250	346	43,289	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	900	1,303	162,725	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	800	825	102,979	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	200	200	25,076	2027/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	50	51	6,475	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	320	314	39,229	2031/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	210	200	24,995	2047/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	20	20	2,539	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	500	569	71,119	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	100	106	13,277	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	500	584	72,950	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	300	325	40,575	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	150	190	23,726	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	750	856	106,883	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	340	494	61,717	2045/6/22
		4 BEL GOVT 190328	4.0	600	651	81,238	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	600	724	90,468	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	250	348	43,497	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	350	420	52,435	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	400	494	61,764	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	660	1,014	126,621	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	400	541	67,516	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	640	1,024	127,798	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	600	900	112,386	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	150	147	18,467	2027/4/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	350	356	44,525	2026/10/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	200	213	26,687	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	50	49	6,158	2047/2/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	350	387	48,299	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	300	333	41,616	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	400	420	52,533	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	150	180	22,550	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	230	317	39,597	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	300	358	44,728	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	450	524	65,487	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	400	476	59,436	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	150	249	31,122	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	450	512	63,932	2020/7/15

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	380	576	71,955	2037/3/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	600	653	81,596	2019/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	300	417	52,047	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	200	314	39,222	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 230915	－	50	49	6,221	2023/9/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	250	256	32,036	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	100	100	12,568	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	150	147	18,400	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	200	209	26,083	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	100	102	12,771	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	250	272	34,065	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	200	218	27,308	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	100	113	14,105	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	130	169	21,142	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	160	196	24,505	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	170	189	23,610	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	150	172	21,559	2021/4/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	200	260	32,518	2025/7/4
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	200	221	27,588	2019/7/4		
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	200	208	26,041	2022/3/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	100	101	12,672	2026/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	300	302	37,724	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	300	340	42,456	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	250	301	37,613	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	150	183	22,857	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	200	220	27,495	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	300	321	40,063	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	350	399	49,896	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	250	295	36,915	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	450	615	76,817	2025/3/13
		5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	200	230	28,789	2019/10/18
小 計						21,616,258	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
	国債証券	1.25 GILT 180722	1.25	700	709	102,699	2018/7/22
		1.25 GILT 270722	1.25	50	50	7,299	2027/7/22
		1.5 GILT 210122	1.5	350	365	52,959	2021/1/22
		1.5 GILT 260722	1.5	400	416	60,338	2026/7/22
		1.75 GILT 190722	1.75	900	932	134,933	2019/7/22
		1.75 GILT 220907	1.75	750	799	115,790	2022/9/7
		1.75 GILT 370907	1.75	100	100	14,561	2037/9/7
		2 GILT 200722	2.0	850	898	130,111	2020/7/22
		2 GILT 250907	2.0	900	980	142,003	2025/9/7
		2.25 GILT 230907	2.25	750	825	119,562	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	350	462	66,925	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	600	685	99,201	2024/9/7

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券	3.25 GILT 440122	3.25	780	1,026	148,576	2044/ 1 /22
3.5 GILT 450122		3.5	420	580	84,076	2045/ 1 /22	
3.5 GILT 680722		3.5	940	1,588	230,020	2068/ 7 /22	
3.75 GILT 190907		3.75	450	487	70,622	2019/ 9 / 7	
3.75 GILT 200907		3.75	750	838	121,425	2020/ 9 / 7	
3.75 GILT 210907		3.75	550	631	91,418	2021/ 9 / 7	
3.75 GILT 520722		3.75	520	814	117,897	2052/ 7 /22	
4 GILT 220307		4.0	600	704	101,921	2022/ 3 / 7	
4 GILT 600122		4.0	240	422	61,129	2060/ 1 /22	
4.25 GILT 271207		4.25	300	394	57,083	2027/12/ 7	
4.25 GILT 320607		4.25	600	825	119,479	2032/ 6 / 7	
4.25 GILT 360307		4.25	790	1,124	162,818	2036/ 3 / 7	
4.25 GILT 390907		4.25	370	543	78,636	2039/ 9 / 7	
4.25 GILT 401207		4.25	700	1,041	150,731	2040/12/ 7	
4.25 GILT 461207		4.25	750	1,187	171,830	2046/12/ 7	
4.25 GILT 491207		4.25	810	1,332	192,824	2049/12/ 7	
4.25 GILT 551207		4.25	310	547	79,189	2055/12/ 7	
4.5 GILT 190307		4.5	700	755	109,361	2019/ 3 / 7	
4.5 GILT 340907		4.5	410	591	85,591	2034/ 9 / 7	
4.5 GILT 421207		4.5	430	675	97,836	2042/12/ 7	
4.75 GILT 200307	4.75	500	564	81,768	2020/ 3 / 7		
4.75 GILT 301207	4.75	420	597	86,517	2030/12/ 7		
4.75 GILT 381207	4.75	490	761	110,202	2038/12/ 7		
5 GILT 250307	5.0	450	593	85,934	2025/ 3 / 7		
6 GILT 281207	6.0	380	578	83,813	2028/12/ 7		
8 GILT 210607	8.0	500	656	95,037	2021/ 6 / 7		
小 計						3,922,132	
スイス				千スイスフラン	千スイスフラン		
	国債証券	2 SWISS GOVT 210428	2.0	130	144	16,502	2021/ 4 /28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	150	164	18,844	2020/ 7 / 6
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	110	118	13,575	2019/ 5 /12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	150	189	21,702	2023/ 2 /11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	170	245	28,162	2028/ 4 / 8
小 計						98,788	
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	1 SWD GOVT 261112	1.0	2,000	2,090	26,698	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	2,450	2,669	34,095	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	1,950	2,287	29,207	2025/ 5 /12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	3,050	3,609	46,099	2022/ 6 / 1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	1,300	1,787	22,824	2039/ 3 /30
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	2,750	2,998	38,287	2019/ 3 /12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	2,900	3,459	44,179	2020/12/ 1
小 計						241,390	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	1,050	1,057	14,071	2026/ 2 /19

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ノルウェー			%	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ	千円	
	国債証券	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	1,350	1,391	18,515	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	500	510	6,798	2027/2/17
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	1,850	1,944	25,885	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	1,400	1,562	20,797	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	2,500	2,785	37,068	2021/5/25
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	2,100	2,264	30,134	2019/5/22
小 計						153,271	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	0.25 DMK GOVT 181115	0.25	1,000	1,012	16,966	2018/11/15
		0.5 DMK GOVT 271115	0.5	500	492	8,257	2027/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	1,300	1,421	23,830	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	2,800	3,132	52,502	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	2,900	3,323	55,702	2021/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	3,300	3,663	61,394	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	3,950	6,584	110,363	2039/11/15
小 計						329,017	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	700	686	20,417	2020/4/25
		1.75 POLAND 210725	1.75	600	580	17,273	2021/7/25
		2 POLAND 210425	2.0	1,000	980	29,173	2021/4/25
		2.25 POLAND 220425	2.25	500	488	14,545	2022/4/25
		2.5 POLAND 180725	2.5	900	909	27,067	2018/7/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	1,100	1,035	30,816	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	2.5	350	325	9,675	2027/7/25
		3.25 POLAND 190725	3.25	800	821	24,436	2019/7/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	1,000	1,009	30,038	2025/7/25
		4 POLAND 231025	4.0	850	902	26,845	2023/10/25
		5.25 POLAND 201025	5.25	900	984	29,288	2020/10/25
		5.5 POLAND 191025	5.5	600	648	19,290	2019/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	700	790	23,523	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	750	858	25,538	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	5.75	370	457	13,609	2029/4/25
		POLAND 181025	—	300	292	8,701	2018/10/25
小 計						350,241	
オーストラリア				千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	1.75	700	697	57,937	2020/11/21
		2 AUST GOVT 211221	2.0	400	400	33,245	2021/12/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	150	145	12,052	2028/5/21
		2.75 AUST GOVT 191021	2.75	750	768	63,840	2019/10/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	800	824	68,460	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	500	509	42,287	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 281121	2.75	250	253	21,035	2028/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	200	191	15,890	2035/6/21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	260	238	19,763	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	800	850	70,652	2025/4/21

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	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	810	859	71,394	2029/4/21		
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	70	70	5,816	2039/6/21		
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	330	359	29,876	2037/4/21		
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,000	1,145	95,071	2026/4/21		
		4.5 AUST GOVT 200415	4.5	870	937	77,848	2020/4/15		
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	370	445	36,994	2033/4/21		
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,000	1,198	99,482	2027/4/21		
		5.25 AUST GOVT 190315	5.25	1,000	1,064	88,401	2019/3/15		
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	650	771	64,028	2023/4/21		
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	850	975	80,978	2021/5/15		
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	750	885	73,545	2022/7/15		
小 計						1,128,604			
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル				
	国債証券	1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	50	50	4,055	2019/10/1		
		2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	150	152	12,300	2020/7/1		
		2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	70	70	5,688	2026/6/1		
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	290	297	23,955	2021/6/1		
		2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	220	225	18,160	2019/6/1		
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	180	190	15,284	2023/7/1		
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	170	181	14,585	2042/4/1		
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	30	32	2,576	2046/3/1		
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	80	85	6,895	2029/7/1		
		2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	160	171	13,776	2030/9/1		
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	250	268	21,590	2024/9/1		
		3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	190	204	16,416	2022/9/1		
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	170	180	14,487	2020/9/1		
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	70	79	6,419	2033/9/1		
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	200	224	18,062	2027/3/1		
		4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	160	165	13,346	2018/9/1		
		小 計						207,601	
		マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	3.418MALAYSIAGOV 220815	3.418	350	345	8,933	2022/8/15		
		3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	400	393	10,185	2023/3/15		
		3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	300	299	7,751	2020/3/31		
		3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	300	281	7,281	2027/5/31		
		3.62 MALAYSIAGOV 211130	3.62	200	199	5,174	2021/11/30		
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	100	95	2,470	2028/6/15		
		3.759 MALAYSIAGOV 190315	3.759	100	100	2,608	2019/3/15		
		3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	400	401	10,380	2022/9/30		
		3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	300	299	7,744	2023/8/17		
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	200	187	4,863	2033/4/15		
		3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	450	454	11,765	2020/7/31		
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	450	441	11,429	2027/3/15		
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	500	498	12,897	2025/9/15		
		4.048 MALAYSIA 210930	4.048	600	610	15,787	2021/9/30		

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
マレーシア			%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
	国債証券	4.127 MALAYSIA 320415	4.127	200	195	5,049	2032/4/15
		4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	400	408	10,562	2021/7/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	500	507	13,135	2024/7/15
		4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	200	197	5,098	2031/6/30
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	200	194	5,026	2035/5/31
		4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	900	919	23,793	2019/11/29
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	300	307	7,969	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	500	506	13,099	2030/4/15
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	100	99	2,578	2046/3/15
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	300	303	7,861	2043/9/30
		5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	300	314	8,135	2019/7/30
小計						221,582	
南アフリカ				千南アフリカランド	千南アフリカランド		
	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	5,850	6,540	55,072	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	2,650	1,915	16,132	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	2,700	1,922	16,186	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	1,700	1,652	13,915	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	3,300	2,748	23,141	2031/2/28
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	2,300	2,290	19,288	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	2,100	2,070	17,435	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	300	302	2,547	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	2,700	2,474	20,835	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	2,300	2,112	17,783	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	3,400	3,086	25,986	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	2,700	2,456	20,679	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	4,100	3,720	31,325	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	800	760	6,404	2035/2/28
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	700	657	5,534	2040/1/31	
小計						292,268	
合計						53,808,318	

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

○投資信託財産の構成

(2017年５月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 53,808,318	% 98.4
コール・ローン等、その他	872,615	1.6
投資信託財産総額	54,680,933	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（54,562,124千円）の投資信託財産総額（54,680,933千円）に対する比率は99.8%です。
(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル＝111.54円	1 カナダドル＝82.39円	1 メキシコペソ＝5.95円	1 ユーロ＝124.79円
1 イギリスポンド＝144.76円	1 スイスフラン＝114.49円	1 スウェーデンクローネ＝12.77円	1 ノルウェークローネ＝13.31円
1 デンマーククローネ＝16.76円	1 ポーランドズロチ＝29.76円	1 オーストラリアドル＝83.03円	1 シンガポールドル＝80.41円
1 マレーシアリングgit＝25.88円	1 南アフリカランド＝8.42円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	54,871,368,159
コール・ローン等	278,869,388
公社債(評価額)	53,808,318,253
未収入金	361,790,420
未収利息	408,456,394
前払費用	13,933,704
(B) 負債	437,766,185
未払金	191,192,100
未払解約金	246,573,888
未払利息	197
(C) 純資産総額(A－B)	54,433,601,974
元本	21,000,747,916
次期繰越損益金	33,432,854,058
(D) 受益権総口数	21,000,747,916口
1万口当たり基準価額(C／D)	25,920円

<注記事項>

- ①期首元本額 28,604,779,095円
 期中追加設定元本額 2,130,531,386円
 期中一部解約元本額 9,734,562,565円
 また、1口当たり純資産額は、期末25,920円です。

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

三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定型)	152,623,703円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)	288,673,852円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(成長型)	177,787,633円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン	1,558,150,498円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,251,110,470円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	3,031,169,817円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	1,820,246,396円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	613,153,868円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(成長型)	88,430,177円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	169,285,305円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン(確定拠出年金)	2,081,266,693円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	446,761,815円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,321,960,372円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドV A(適格機関投資家限定)	7,134,634,663円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定型)V A(適格機関投資家限定)	5,172円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)V A(適格機関投資家限定)	230,408円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドV A 2(適格機関投資家限定)	44,151,505円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	821,105,569円
合計	21,000,747,916円

○損益の状況 (2016年5月21日～2017年5月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,593,695,114
受取利息	1,593,903,748
その他収益金	76,278
支払利息	△ 284,912
(B) 有価証券売買損益	△ 1,569,972,907
売買益	1,498,481,065
売買損	△ 3,068,453,972
(C) 保管費用等	△ 21,593,843
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,128,364
(E) 前期繰越損益金	44,954,999,186
(F) 追加信託差損益金	3,177,943,719
(G) 解約差損益金	△14,702,217,211
(H) 計(D+E+F+G)	33,432,854,058
次期繰越損益金(H)	33,432,854,058

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

【お 知 ら せ】

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