

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商 品 分 類	追加型投信／内外／資産複合	
信 託 期 間	2021年7月5日まで（2006年3月17日設定）	
運 用 方 針	マザーファンド受益証券への投資を通じて、世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券への分散投資を行い、信託財産の成長をめざして運用を行います。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要運用対象	ベビーファンド	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 外国株式マザーファンド受益証券、三菱UFJ 国内債券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、MUAM J-REITマザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。各マザーファンド受益証券への資産配分は、信託財産の純資産総額に対して、それぞれ30%、30%、10%、10%、10%、10%を基本投資割合とします。
	三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	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。
	MUAM J-REITマザーファンド	わが国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
	MUAM G-REITマザーファンド	S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。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60%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。
	MUAM J-REITマザーファンド	投資信託証券への投資に制限を設けません。株式および外貨建資産への投資は行いません。
	MUAM G-REITマザーファンド	株式への直接投資は行いません。投資信託証券への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分 配 方 針	経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）」およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ 6資産バランス ファンド（成長型）

第25期（決算日：2018年7月5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 6資産バランスファンド（成長型）」は、去る7月5日に第25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

ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用フリーダイヤル **0120-151034**
（受付時間：営業日の9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取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 (分配落)	価 額 税 込 金 騰 落 率	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 組 入 比 率	純 資 産 額
	円	円	%	%	%	%	%	百万円
21期(2016年7月5日)	9,325	0	△ 8.5	57.5	1.1	20.0	0.0	2,113
22期(2017年1月5日)	10,454	250	14.8	58.4	1.2	19.1	0.0	2,310
23期(2017年7月5日)	10,394	300	2.3	58.2	1.2	19.8	0.0	2,161
24期(2018年1月5日)	10,724	600	8.9	58.9	1.0	19.5	0.0	2,088
25期(2018年7月5日)	10,188	100	△ 4.1	57.2	1.2	20.0	0.0	2,033

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドは、世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券への分散投資を行うことで信託財産の成長をはかることを目標としておりますが、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

(注) 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) 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 騰 落 率	価 額 騰 落 率	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 組 入 比 率
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%
2018年1月5日	10,724	—	58.9	1.0	19.5	0.0	19.6
1月末	10,584	△1.3	57.8	1.0	20.0	0.0	20.0
2月末	10,203	△4.9	58.1	1.7	20.1	0.0	19.7
3月末	10,021	△6.6	57.4	1.8	20.1	0.0	20.2
4月末	10,318	△3.8	57.2	1.3	20.1	0.0	20.1
5月末	10,292	△4.0	57.8	1.3	19.7	0.0	20.5
6月末	10,363	△3.4	57.3	1.3	19.9	0.0	20.6
(期 末)							
2018年7月5日	10,288	△4.1	57.2	1.2	20.0	0.0	20.4

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(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) 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。

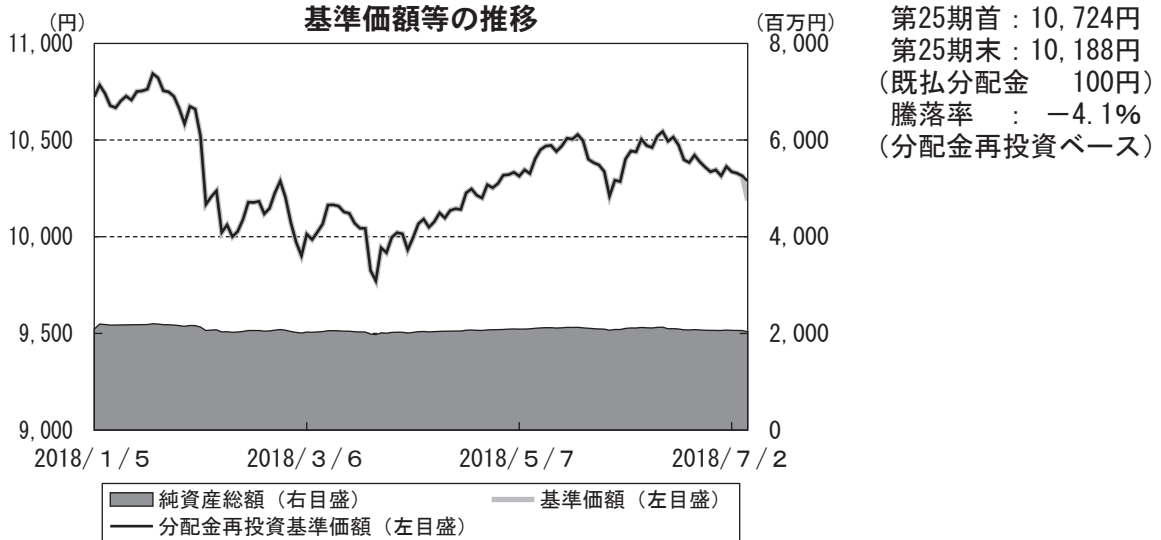
運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第25期：2018/1/6～2018/7/5）

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.1%（分配金再投資ベース）の下落となりました。



- ・分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。



実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

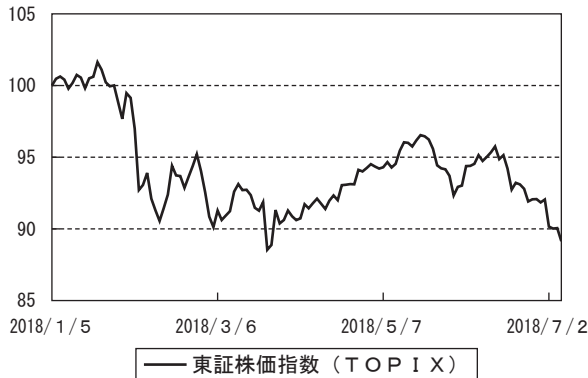
基準価額の主な変動要因

下落要因

内外株式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25期：2018/1/6～2018/7/5）

市況の推移
（期首を100として指数化）

・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。

◎国内株式市況

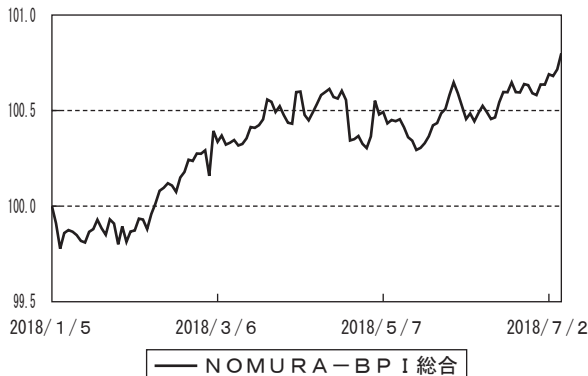
- ・期首から2018年3月末にかけては、米国長期金利上昇による世界的な株安や、円高・米ドル安が進んだこと等を受け、国内株式市況は下落しました。
- ・4月上旬から6月上旬にかけては、米中貿易摩擦や北朝鮮情勢等への不安後退で円高懸念が薄れたこと等を受けて、国内株式市況は上昇しました。
- ・6月中旬から期末にかけては、米中における報復関税の応酬により、米中貿易摩擦への懸念が強まったこと等を受けて、国内株式市況は下落しました。

市況の推移 （期首を100として指数化）



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

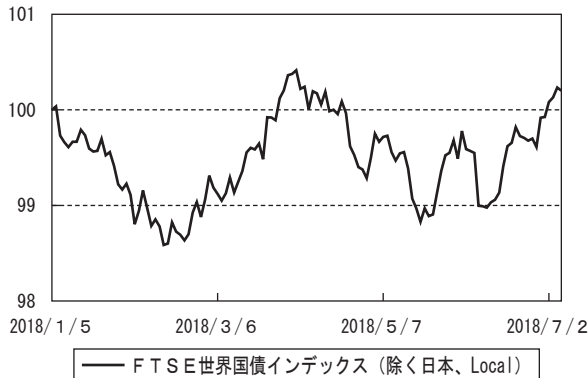
◎外国株式市況

- ・外国株式市況は、米国の堅調な企業決算内容が好感されて上昇したものの、米国の保護主義的な通商政策をめぐる懸念などから下落し、ほぼ横ばいとなりました。

◎国内債券市況

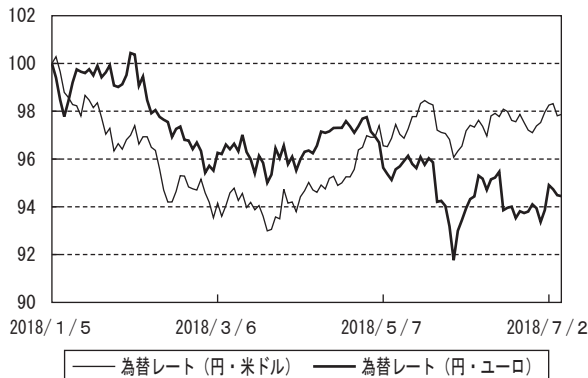
- ・日本銀行による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」の継続などを背景に、国内債券市況は上昇しました。

市況の推移 (期首を100として指数化)



- ・FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

市況の推移 (期首を100として指数化)



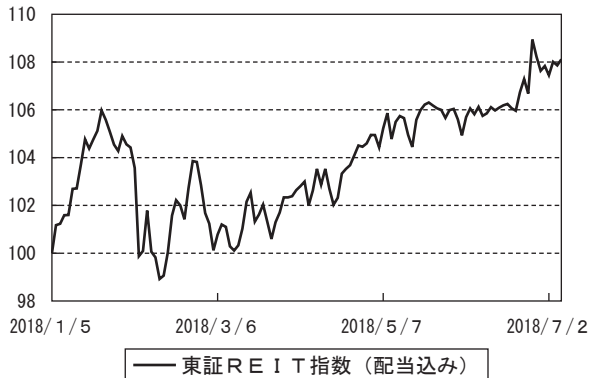
◎外国債券市況

- ・先進国の債券市況は、イタリアの政局不安を受けた同国の金利上昇などが下落要因になった一方、米国の保護主義的な通商政策に対する警戒感が高まったことを受けたリスク回避姿勢の高まりなどが上昇要因となり、期首との比較では、上昇しました。

◎為替市況

- ・米国の保護主義的な通商政策に対する警戒感が高まったことを受けたリスク回避姿勢の高まりなどを背景に、期首との比較では、米ドル、ユーロは対円で下落しました。

市況の推移 (期首を100として指数化)

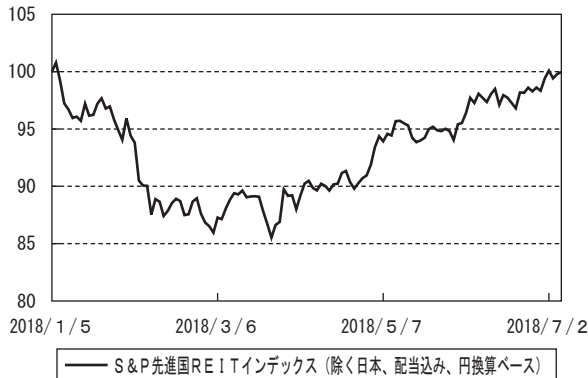


- ・東証REIT指数（配当込み）とは、東京証券取引所に上場している不動産投資信託全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。東証REIT指数の商標に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は東証REIT指数の内容の変更、公表の停止または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。東京証券取引所は東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対して、責任を負いません。

◎国内REIT市況

- ・投資口需給において投資信託などからの資金流出が継続する一方、配当利回り等の割安感などから、期首から2018年3月上旬にかけては一進一退の推移となりました。3月中旬から期末にかけては相対的に高い配当利回りの水準に改めて注目した投資家からの資金流入が見られたことや、大手仲介会社調べによる東京都心5区のオフィス空室率低下と賃料の上昇傾向が継続したこともあり、上昇基調で推移しました。

市況の推移 (期首を100として指数化)



◎外国REIT市況

- ・外国REIT市況は、米国の堅調な企業決算内容が好感され、上昇（ローカルベース）しました。

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

当該投資信託のポートフォリオについて

i 期間中にどのような運用をしたかを確認できます。

<三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）>

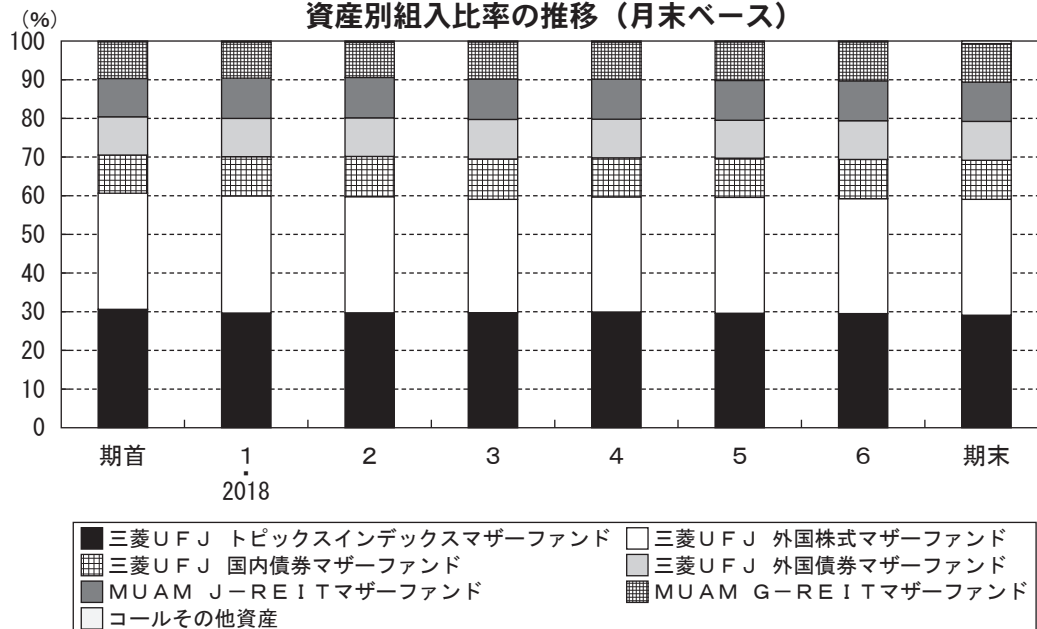
資産配分は、ファンドの基本投資割合に準じて運用を行いました。
その結果、基準価額の主な変動要因の内訳は以下の通りとなりました。

（内訳）

三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	△2.9%程度
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	△1.0%程度
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	0.1%程度
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	△0.4%程度
MUAM J-REITマザーファンド	0.8%程度
MUAM G-REITマザーファンド	0.0%程度
その他（信託報酬等）	△0.7%程度

（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9.8%の下落となりました。

- ・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）と業種別比率等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

【ベンチマークとの比較】

ベンチマークは10.9%の下落となったため、カイ離は1.1%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

- ・配当要因※ 1.1%

※ベンチマークが配当相当分を含まないインデックスであることによって生じるプラス要因です。

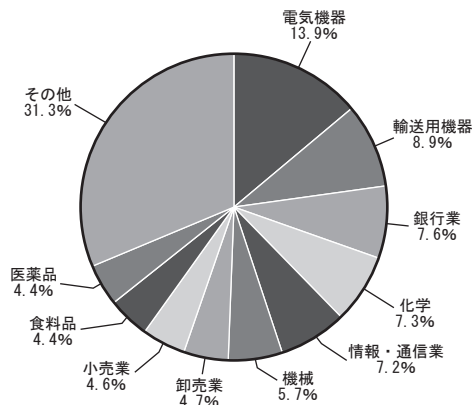
（主なマイナス要因）

- ・取引コスト要因

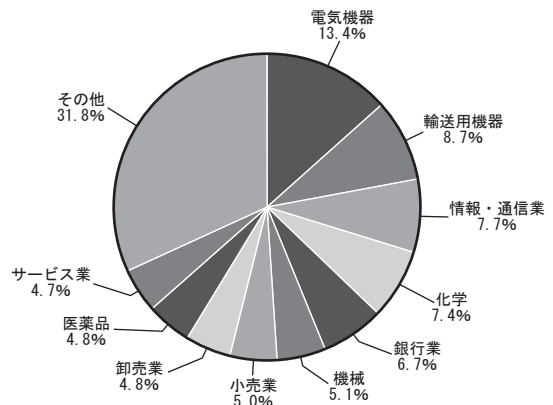
（ご参考）

組入上位10業種

期首（2018年1月5日）



期末（2018年7月5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3.3%の下落となりました。

- ・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

【ベンチマークとの比較】

ベンチマークは3.4%の下落となったため、カイ離は0.1%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

- ・その他の要因※

※その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

（主なマイナス要因）

- ・取引コスト要因

＜三菱ＵＦＪ 国内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。

- ・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総合の構成銘柄を種別や年限等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。

【ベンチマークとの比較】

ベンチマークは0.8%の上昇となったため、カイ離は0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

- ・評価時価差異要因※

※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価が異なるため生じる要因です。

（主なマイナス要因）

- ・ポートフォリオ要因

（ご参考）

利回り・デュレーション

期首（2018年1月5日）

最終利回り	0.2%
直接利回り	1.0%
デュレーション	8.9年



期末（2018年7月5日）

最終利回り	0.1%
直接利回り	0.9%
デュレーション	9.1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。

＜三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド＞

基準価額は期首に比べ4.0%の下落となりました。

- ・日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるＦＴＳＥ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。

【ベンチマークとの比較】

ベンチマークは3.8%の下落となったため、カイ離は△0.2%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

- ・ありません。

（主なマイナス要因）

- ・評価時価差異要因※

※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

（ご参考）

利回り・デュレーション

期首（2018年1月5日）

最終利回り	1.5%
直接利回り	2.5%
デュレーション	7.1年

期末（2018年7月5日）

最終利回り	1.8%
直接利回り	2.5%
デュレーション	7.2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。

＜MUAM J-REITマザーファンド＞

基準価額は期首に比べ7.9%の上昇となりました。

- ・ 銘柄選定およびポートフォリオの構築は主に、定性的評価・定量的評価を経て行っています。
- ・ 定性的評価については、事業内容および財務内容等の分析を中心に行い、定量的評価においては、キャッシュフロー、配当利回り、投資口価格純資産倍率（PBR）などの分析を行いました。
- ・ 組入銘柄数は50銘柄程度で推移させました。
- ・ 主な売買動向については、業績の成長性などを勘案してジャパンリアルエステイト投資法人のウェイトを引き上げたことなどや、割安感の後退した大和証券オフィス投資法人のウェイトを引き下げたことなどが挙げられます。

【ベンチマークとの比較】

基準価額の騰落率は、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）を0.2%下回りました。

銘柄選択がマイナスに影響しました。

（プラス要因となった主な銘柄）

- ・ 大和ハウスリート投資法人：配当利回り面などにおいて割安感に乏しいと判断し、期首よりアンダーウェイト。投資口価格が低調に推移したことからプラスに寄与。

（マイナス要因となった主な銘柄）

- ・ 野村不動産マスターファンド投資法人：相対的に高い利益成長が見込みにくいと想定し、期首よりアンダーウェイト。投資口価格が好調に推移したことからマイナスに影響。
- ・ 日本プライムリアルティ投資法人：高品質な物件ポートフォリオを保有しているものの、物件取得による資産規模の拡大が見込みにくいと想定し、期首よりアンダーウェイト。投資口価格が好調に推移したことからマイナスに影響。

<MUAM G-R E I Tマザーファンド>

基準価額は期首に比べ0.4%の下落となりました。

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

【ベンチマークとの比較】

ベンチマークは0.1%の下落となったため、カイ離は△0.3%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

- ・ありません。

（主なマイナス要因）

- ・その他の要因※

※その他の要因には、ベンチマークが配当金に課される税金を考慮していないために生じるマイナス要因などが含まれます。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・当ファンドは、世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券への分散投資を行うことで信託財産の成長をはかることを目標としておりますが、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。
- ・従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

分配金について

i 分配金の内訳および翌期繰越分配対象額（翌期に繰越す分配原資）がどの程度あるかを確認できます。

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額的水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきました。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25期
	2018年1月6日～2018年7月5日
当期分配金	100
（対基準価額比率）	0.972%
当期の収益	75
当期の収益以外	24
翌期繰越分配対象額	1,734

（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 （作成対象期間末での見解です。）

＜三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）＞

◎今後の運用方針

- ・資産配分方針は、従前通り基本投資割合を維持します。また、各資産の組入比率は、期を通じて同割合に準ずるよう調整を行います。

＜三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド＞

◎今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

＜三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド＞

◎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。

＜三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド＞

◎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。

＜三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド＞

◎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。

＜MUAM J-REITマザーファンド＞

◎運用環境の見通し

- ・ 今後のＪ－ＲＥＩＴ市況については、底堅く推移するとみています。
- ・ 投資口の需給に関しては、引き続き毎月分配型を中心とした投資信託からの売りが上値を押さえる一方で、割安感の台頭に伴い上場投資信託（ＥＴＦ）や海外投資家などの買いが下値を支える展開となっています。中期的には、日本銀行の金融緩和姿勢は当面維持されるとみられることに加えて、オフィス・ビル賃料の緩やかな上昇傾向などを背景にＲＥＩＴ各社の業績は総じて堅調に推移しているため、徐々に下値を切り上げていくと考えます。

◎今後の運用方針

- ・ ＲＥＩＴの組入比率については、高水準（90%以上）を維持する方針です。
 - ・ 配当利回りやＰＢＲ等のバリュエーション、また物件ポートフォリオのクオリティ等に着目し、安定した配当金が見込め相対的に割安と思われる銘柄への投資ウェイトを高めた運用を行います。
- 前述の不動産市況を踏まえ、保有物件の賃料動向等、ＲＥＩＴ各社の業績の先行きについて特に注意深く見守るほか、スポンサーのサポート体制等にも着目していく方針です。

＜MUAM G-REITマザーファンド＞

◎今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2018年 1 月 6 日～2018年 7 月 5 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 55	% 0.536	(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)	(0.225)	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)	(29)	(0.279)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.032)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.004	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.003)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	
(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)	(0.001)	
(d) そ の 他 費 用	1	0.013	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.008)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(0)	(0.003)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	56	0.554	
期中の平均基準価額は、10,296円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2018年 1月6日～2018年 7月5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	14,790	22,231	3,804	5,749
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	8,756	12,100	10,390	14,429
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	4,777	13,002	2,443	6,433
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	12,885	30,803	11,762	27,664
MUAM G－R E I Tマザーファンド	12,783	20,439	10,266	16,526
MUAM J－R E I Tマザーファンド	4,242	11,360	9,801	27,056

○株式売買比率

(2018年 1月6日～2018年 7月5日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	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	23,332,281千円	6,555,484千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	208,100,786千円	97,594,908千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.11	0.06

(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

(2018年 1月6日～2018年 7月5日)

利害関係人との取引状況

<三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）>

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	14,683	6,193	42.2	8,648	3,804	44.0
貸付有価証券(株式)	341,668	202,337	59.2	314,745	201,009	63.9

平均保有割合 0.3%

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

＜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 7,909	百万円 646	% 8.2	百万円 9,353	百万円 730	% 7.8

平均保有割合 0.6%

※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。

＜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 27,018	百万円 6,975	% 25.8	百万円 24,582	百万円 2,252	% 9.2

平均保有割合 0.1%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

＜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 3,569	百万円 223	% 6.2	百万円 5,237	百万円 289	% 5.5

平均保有割合 0.4%

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

＜MUAM J-REIT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	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 2,214	百万円 474	% 21.4	百万円 2,219	百万円 421	% 19.0

平均保有割合 1.8%

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

＜MUAM G－REITマザーファンド＞

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 2,117	百万円 175	% 8.3	百万円 919	百万円 21	% 2.3

平均保有割合 1.1%

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

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 236	百万円 165	百万円 3,882

＜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 －	百万円 100	百万円 721

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 4

＜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 700

＜MUAM J－REITマザーファンド＞

種 類	買 付 額
投資信託証券	百万円 213

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)	82千円
うち利害関係人への支払額 (B)	11千円
(B) / (A)	14.5%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは中京銀行、カブドットコム証券、三菱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

(2018年7月5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	417,112	428,098	592,060
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	148,915	147,281	205,339
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	75,322	77,656	204,453
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	262,641	263,764	609,191
MUAM G-R-E-I-Tマザーファンド	120,881	123,398	201,879
MUAM J-R-E-I-Tマザーファンド	78,031	72,472	207,048

○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、2018年7月5日現在における貸付株数の総株数は27,434,100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、13,884,000株です。

○投資信託財産の構成

(2018年7月5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	592,060	28.7
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	205,339	9.9
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	204,453	9.9
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	609,191	29.5
MUAM G－REITマザーファンド	201,879	9.8
MUAM J－REITマザーファンド	207,048	10.0
コール・ローン等、その他	45,340	2.2
投資信託財産総額	2,065,310	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（48,692,797千円）の投資信託財産総額（49,282,892千円）に対する比率は98.8%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（103,373,933千円）の投資信託財産総額（103,484,572千円）に対する比率は99.9%です。

(注) MUAM G－REITマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（19,825,023千円）の投資信託財産総額（19,884,470千円）に対する比率は99.7%です。

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

1 アメリカドル＝110.43円	1 カナダドル＝84.00円	1 メキシコペソ＝5.68円	1 ユーロ＝128.70円
1 イギリスポンド＝145.99円	1 スイスフラン＝111.21円	1 スウェーデンクローネ＝12.56円	1 ノルウェークローネ＝13.60円
1 デンマーククローネ＝17.27円	1 ポーランドズロチ＝29.38円	1 オーストラリアドル＝81.49円	1 ニュージーランドドル＝74.62円
1 香港ドル＝14.08円	1 シンガポールドル＝80.85円	1 マレーシアリンギット＝27.31円	1 イスラエルシェケル＝30.21円
1 南アフリカランド＝8.06円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2018年7月5日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,065,310,665
コール・ローン等	15,423,398
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド(評価額)	592,060,893
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド(評価額)	205,339,713
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド(評価額)	204,453,469
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド(評価額)	609,191,126
MUAM G-REITマザーファンド(評価額)	201,879,199
MUAM J-REITマザーファンド(評価額)	207,048,039
未収入金	29,914,828
(B) 負債	31,424,043
未払収益分配金	19,963,767
未払解約金	267,786
未払信託報酬	11,152,366
未払利息	32
その他未払費用	40,092
(C) 純資産総額(A－B)	2,033,886,622
元本	1,996,376,787
次期繰越損益金	37,509,835
(D) 受益権総口数	1,996,376,787口
1万口当たり基準価額(C／D)	10,188円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,947,370,318円
 期中追加設定元本額 129,758,268円
 期中一部解約元本額 80,751,799円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0188円です。

②分配金の計算過程

項 目	2018年1月6日～ 2018年7月5日
費用控除後の配当等収益額	15,084,445円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	221,137,481円
分配準備積立金額	130,041,967円
当ファンドの分配対象収益額	366,263,893円
1万口当たり収益分配対象額	1,834円
1万口当たり分配金額	100円
収益分配金金額	19,963,767円

○損益の状況（2018年1月6日～2018年7月5日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 3,248
受取利息	16
支払利息	△ 3,264
(B) 有価証券売買損益	△ 74,059,795
売買益	20,126,694
売買損	△ 94,186,489
(C) 信託報酬等	△ 11,192,458
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△ 85,255,501
(E) 前期繰越損益金	130,041,967
(F) 追加信託差損益金	12,687,136
(配当等相当額)	(221,022,110)
(売買損益相当額)	(△208,334,974)
(G) 計(D＋E＋F)	57,473,602
(H) 収益分配金	△ 19,963,767
次期繰越損益金(G＋H)	37,509,835
追加信託差損益金	12,687,136
(配当等相当額)	(221,137,481)
(売買損益相当額)	(△208,450,345)
分配準備積立金	125,162,645
繰越損益金	△100,339,946

- (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。

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	100円
-----------------	------

◆分配金は決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、2018年7月5日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

※NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

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

【お 知 ら せ】

①本資料内における旧シティ債券インデックスは、ブランド変更に伴い、F T S E 債券インデックスの名称に変更しています。

②2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。））の税率が適用されます。

三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド

《第18期》決算日2018年2月20日

[計算期間：2017年2月21日～2018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18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18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
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
18期(2018年2月20日)	14,375	16.3	1,762.45	13.9	99.0	1.0	206,265

(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)	騰 落 率	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	円	騰 落 率				
(期 首) 2017年2月20日	12,356	% —	1,547.01	% —	% 98.6	% 1.3
2月末	12,266	△ 0.7	1,535.32	△ 0.8	99.2	0.9
3月末	12,193	△ 1.3	1,512.60	△ 2.2	98.2	1.7
4月末	12,351	△ 0.0	1,531.80	△ 1.0	97.8	1.7
5月末	12,654	2.4	1,568.37	1.4	97.5	1.7
6月末	13,019	5.4	1,611.90	4.2	97.9	1.1
7月末	13,073	5.8	1,618.61	4.6	99.0	1.0
8月末	13,067	5.8	1,617.41	4.6	99.5	0.7
9月末	13,636	10.4	1,674.75	8.3	97.5	1.2
10月末	14,380	16.4	1,765.96	14.2	97.0	1.2
11月末	14,596	18.1	1,792.08	15.8	98.3	1.3
12月末	14,821	19.9	1,817.56	17.5	99.1	0.8
2018年1月末	14,979	21.2	1,836.71	18.7	98.6	0.7
(期 末) 2018年2月20日	14,375	16.3	1,762.45	13.9	99.0	1.0

(注) 騰落率は期首比。

(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。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

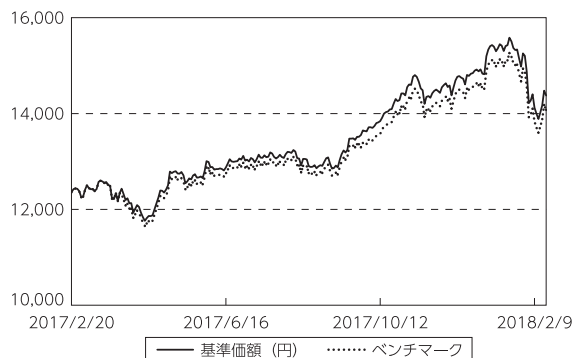
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ16.3%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(13.9%)を2.4%上回りました。

基準価額等の推移



(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2018年1月中旬までは、衆議院選挙で与党が勝利したことによる経済政策継続への期待や、国内企業の業績改善が進んだこと等を受けて、国内株式市況は上昇しました。
- ・1月下旬から期末までは、米国長期金利上昇による世界的な株安や、円高・米ドル安が進んだこと等を受け、国内株式市況は下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・株式ポートフォリオは、ベンチマークである東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）と業種別比率等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・企業規模等）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13.9%の上昇となったため、カイ離は2.4%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	2.4%程度	2.4%程度

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

◎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、1.1%程度となりました。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.4%程度でした。

- ・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

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

信託財産の収益向上を目的に、保有株式の貸し付けを行っています。貸付契約額は、期末時点で概ね純資産総額の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

(2017年２月21日～2018年２月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 0	% 0.002	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) そ の 他 費 用	0	0.001	(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)	(0.001)	
合 計	0	0.003	
期中の平均基準価額は、13,419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

(2017年２月21日～2018年２月20日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		4,220	7,633,422	22,749	37,333,055
		(△21,614)	()		

(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。

新株予約権証券

	買 付		売 付	
	証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内	証券 — (104, 200)	千円 — (—)	証券 104, 200	千円 2, 859

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株主割当および権利行使等による増減分です。

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 45, 469	百万円 46, 473	百万円 —	百万円 —

○株式売買比率

(2017年2月21日～2018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	44, 966, 477千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	206, 085, 433千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0. 21

(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

(2017年2月21日～2018年2月20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	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 7, 633	百万円 494	% 6. 5	百万円 37, 333	百万円 10, 769	% 28. 8
貸付有価証券(株式)	491, 489	362, 054	73. 7	493, 103	375, 031	76. 1

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 97	百万円 1,033	百万円 4,756

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 316

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)	3,746千円
うち利害関係人への支払額 (B)	64千円
(B) / (A)	1.7%

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

(2018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	4.1	3.6	14,022
日本水産	133.3	102.1	54,929
マルハニチロ	19.5	17.2	57,534
カネコ種苗	3.6	3.1	4,941
サカタのタネ	15.1	13.4	49,312
ホクト	10.4	9.1	18,791
ホクリョウ	1.2	1.3	1,927
鉱業 (0.3%)			
住石ホールディングス	33.3	26.1	4,123
日鉄鉱業	2.8	2.5	17,700
三井松島産業	6.5	4.7	7,059
国際石油開発帝石	540.7	441.2	585,031
日本海洋掘削	3.8	3.3	7,194
石油資源開発	16.3	14.4	37,483
K&Oエナジーグループ	6.9	5.3	9,036
建設業 (3.1%)			
ショーボンドホールディングス	9.9	8.6	63,468
ミライト・ホールディングス	31.6	27.8	45,731
タマホーム	8.2	7	8,225
サンヨーホームズ	2.6	1.9	1,664
ファーストコーポレーション	1.1	3	4,497
ベステラ	—	1.3	2,401
インベスターズクラウド	0.7	8	16,112
ダイセキ環境ソリューション	2.4	2.1	2,448
第一カッター興業	—	0.9	2,013
安藤・間	73.8	69.9	55,151
東急建設	36.6	34.9	41,984
コムシスホールディングス	40.1	31.9	89,160
ミサワホーム	12.4	7.7	6,776
ビーアールホールディングス	10.9	9.1	4,386
高松コンストラクショングループ	7.7	5.8	17,057
東建コーポレーション	3.8	3.4	40,562
ソネック	1.4	1.1	858

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヤマウラ	5	4.5	4,450
大成建設	522	90.3	487,620
大林組	307.8	272.1	324,887
清水建設	314	277.6	281,208
飛鳥建設	99.8	84.1	15,558
長谷工コーポレーション	119.8	105.9	165,627
松井建設	11.5	10	8,410
銭高組	15	1.3	7,410
鹿島建設	451	399	402,192
不動テトラ	84	69.2	13,494
大末建設	—	2.9	3,103
鉄建建設	63	5.6	17,248
西松建設	119	21	57,771
三井住友建設	394.3	65.3	40,943
大豊建設	37	33	20,526
前田建設工業	65	64.7	82,169
佐田建設	7.5	6.1	2,970
ナカノフド建設	8	7	4,459
奥村組	84	14.9	69,881
東鉄工業	12.4	11	36,025
イチケン	10	1.7	4,229
浅沼組	33	32	14,720
戸田建設	119	105	85,365
熊谷組	161	14.3	45,903
青木あすなろ建設	6.4	5.8	5,898
北野建設	21	19	8,759
植木組	12	1.1	2,989
三井ホーム	13	11	7,733
矢作建設工業	14.1	12.5	10,650
ビーエス三菱	11.5	11.1	9,601
日本ハウスホールディングス	21	17.6	11,140
大東建託	37.8	32.9	608,814
新日本建設	12.5	10.8	11,048
N I P P O	24	21	53,949

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
東亜道路工業	19	1.8	7,596	
前田道路	32	28	64,932	
日本道路	31	2.4	14,064	
東亜建設工業	8.4	7.4	16,331	
若築建設	61	4.9	8,251	
東洋建設	30	28.8	15,696	
五洋建設	113.9	107.9	84,809	
大林道路	10.7	—	—	
世紀東急工業	14.7	12.5	8,837	
福田組	17	2.9	19,227	
住友林業	70.6	58	108,460	
日本基礎技術	11.5	10.9	4,479	
日成ビルド工業	31	13.3	16,412	
ヤマダ・エスバイエルホーム	58	49	3,920	
巴コーポレーション	13	11.6	6,751	
バナホーム	38	—	—	
大和ハウス工業	303.2	268	1,064,496	
ライト工業	19.8	17.5	20,597	
積水ハウス	323	295.2	562,060	
日特建設	9.1	7.8	5,140	
北陸電気工事	5	5	5,725	
ユアテック	16	14.3	12,412	
西部電気工業	1.7	1.6	4,452	
四電工	8	1.3	3,606	
中電工	12.9	11.7	34,620	
関電工	41	36	43,776	
きんでん	68.3	60.3	105,886	
東京エネシス	11	10.1	12,140	
トーエネック	14	2.5	7,837	
住友電設	7	7.1	16,195	
日本電設工業	16.7	14	30,464	
協和エクシオ	40.2	32.6	92,649	
新日本空調	7.9	6.9	11,178	
NDS	1.4	1.4	6,398	
九電工	19.9	17.9	89,679	
三機工業	22.6	19.1	22,347	
日揮	95.8	78.2	188,774	
中外炉工業	31	2.7	6,388	
ヤマト	9.1	7.4	6,208	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
太平電業	14	6.2	16,312
高砂熟学工業	28.1	24.9	49,426
三晃金属工業	0.9	0.9	3,726
朝日工業社	2.3	1.9	6,887
明星工業	18.8	16.2	12,474
大気社	13.6	12	44,880
ダイダシ	14	6.1	14,231
日比谷総合設備	11.4	10.1	20,462
東芝プラントシステム	16.7	19.6	42,002
OSJBホールディングス	32.7	40.6	12,545
東洋エンジニアリング	61	10.8	10,854
千代田化工建設	75	59.2	63,699
新興プランテック	20.8	17.6	17,899
食料品 (4.3%)			
日本製粉	30.3	26.6	43,730
日清製粉グループ本社	112.5	99.5	209,646
日東富士製粉	0.6	0.6	2,931
昭和産業	42	7.3	20,454
鳥越製粉	7.9	7.3	7,168
中部飼料	11.1	9.9	20,047
フィード・ワン	61.8	54.8	13,206
東洋精糖	17	1.7	2,091
日本甜菜製糖	5.3	4.6	10,984
三井製糖	7.2	6.4	27,296
塩水港精糖	12.4	10.9	3,073
日新製糖	4.2	3.7	8,132
森永製菓	20	19.1	97,028
中村屋	2.4	2.1	10,080
江崎グリコ	25.7	22.7	120,764
名糖産業	4.4	4	6,272
井村屋グループ	—	3.2	13,504
不二家	60	5.2	13,166
山崎製パン	75.2	66.5	141,046
第一屋製パン	18	1.5	1,735
モロゾフ	16	1.4	9,506
亀田製菓	5.8	5.1	26,367
寿スピリッツ	7.4	7.8	47,814
カルビー	41.9	37	135,235
森永乳業	92	16.3	71,394

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
六甲バター	4.6	4.1	9,450
ヤクルト本社	55	48.7	373,529
明治ホールディングス	60.8	53.7	431,211
雪印メグミルク	22.1	19.6	54,684
ブリマハム	65	57	37,677
日本ハム	70	70	167,580
丸大食品	49	44	22,088
S F o o d s	5.5	5.7	24,424
伊藤ハム米久ホールディングス	59.2	52	48,620
サッポロホールディングス	33.6	29.7	95,188
アサヒグループホールディングス	192.6	170.2	945,461
キリンホールディングス	442	390.7	1,090,443
宝ホールディングス	74.3	60.9	80,509
オエノンホールディングス	26	23.5	9,329
養命酒製造	3	2.4	5,551
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	34.8	57.1	214,981
コカ・コーライーストジャパン	39.9	—	—
サントリー食品インターナショナル	70.3	62.2	310,067
ダイドーグループホールディングス	4.7	4.2	27,174
伊藤園	30.5	26.9	121,050
キーコーヒー	9.1	8.1	17,463
ユニカフェ	2.9	2.7	2,961
ジャパンフーズ	1.4	1.2	1,819
日清オイリオグループ	59	9.6	28,550
不二製油グループ本社	27.4	22	69,410
かどや製油	1	0.9	5,904
J-オイルミルズ	4.8	4.2	15,540
キッコーマン	72	63.5	269,875
味の素	211.5	186.9	369,594
キュービー	52.2	45.3	135,537
ハウス食品グループ本社	38	31	115,320
カゴメ	36.8	32.6	121,435
焼津水産化学工業	4.8	4.2	5,002
アリアケジャパン	8.4	7.4	59,570
ビエトロ	1.3	1.1	1,844
エバラ食品工業	2.5	1.6	3,451
ニチレイ	50.5	38.7	102,825
東洋水産	50.5	44.6	187,543
イートアンド	1.2	2	4,220

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大冷	0.8	1	2,223
ヨシムラ・フード・ホールディングス	—	1.5	2,728
日清食品ホールディングス	40.1	35.4	263,022
永谷園ホールディングス	10	9	14,040
一正蒲鉾	3.7	3.4	4,236
フジッコ	10	8.8	20,583
ロック・フィールド	10.1	8.8	18,814
日本たばこ産業	568.9	502.9	1,579,106
ケンコーマヨネーズ	3.8	5.4	19,926
わらべや日洋ホールディングス	6	5.4	14,110
なとり	5.2	4.6	8,960
イフジ産業	—	1.7	1,305
ビックスコーポレーション	—	1.2	2,179
北の達人コーポレーション	2.5	23.4	17,222
ユーグレナ	33.2	31.8	30,973
ミヨシ油脂	38	3.5	4,931
理研ビタミン	3.1	3.1	12,493
繊維製品 (0.7%)			
片倉工業	12.2	9.9	13,681
グンゼ	72	6.4	37,504
東洋紡	380	31.3	65,104
ユニチカ	267	24.9	17,728
富士紡ホールディングス	4.8	4.8	20,184
倉敷紡績	98	86	29,412
シキボウ	56	4.4	6,160
日本毛織	27.2	23.8	25,918
トーア紡コーポレーション	5.1	3.7	2,164
ダイドーリミテッド	12.8	11.2	5,286
帝国繊維	10	9	18,333
帝人	78.4	69.3	151,074
東レ	696	615.3	673,753
サカイオーベックス	2.5	2.2	6,087
住江織物	27	2.2	6,527
日本フエルト	5.5	4.5	2,376
イチカワ	7	6	2,250
アツギ	83	5.7	6,914
ダイニック	19	3.5	3,661
セーレン	23.9	19.5	39,741
ソトー	4.2	3.3	3,521

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東海染工	18	1.5	2,319
小松精練	14.3	13.4	12,435
ワコールホールディングス	57	23.4	74,178
ホギメディカル	6.1	5.3	44,997
クラウドピアホールディングス	3.4	2.7	1,512
T S I ホールディングス	40.1	32.2	24,407
マツオカコーポレーション	—	1.5	5,512
三陽商会	53	4.6	10,764
ナイガイ	—	3.9	2,133
オンワードホールディングス	62	50.9	46,268
ルックホールディングス	20	15	4,620
ゴールドウイン	4.1	2.4	28,656
デサント	22	19.4	33,794
キング	5.7	4.9	3,209
ヤマトインターナショナル	7.5	7.5	3,600
パルプ・紙 (0.3%)			
特種東海製紙	5.6	4.6	19,366
王子ホールディングス	375	357	253,470
日本製紙	43	38	81,890
三菱製紙	13.7	12.2	8,601
北越紀州製紙	53.3	47.4	33,037
中越パルプ工業	38	3.3	6,494
巴川製紙所	16	14	4,228
大王製紙	38.1	33.7	51,426
阿波製紙	1.9	2.3	1,520
レンゴー	92.5	81.8	74,110
トーモク	30	4.7	9,879
ザ・バック	6.8	6	21,540
化学 (7.2%)			
クラレ	161.5	142.8	270,320
旭化成	598	529	709,389
共和レザー	5.5	4.9	4,841
昭和電工	63.9	56.5	287,020
住友化学	706	624	419,328
住友精化	4	3.5	19,250
日産化学工業	52.6	49.4	196,612
ラサ工業	39	3.1	7,529
クレハ	7.2	7.3	55,042
多木化学	7	1.2	5,262

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
テイカ	15	6.5	17,816	
石原産業	17.3	15.3	22,276	
片倉コープアグリ	13	2	2,504	
日東エフシー	5.5	5	3,975	
日本曹達	58	59	38,527	
東ソー	277	122.6	278,915	
トクヤマ	149	24.6	76,629	
セントラル硝子	98	17.2	41,968	
東亜合成	60.1	49.8	60,258	
大阪ソーダ	41	7.5	20,797	
関東電化工業	20	20.3	24,969	
デンカ	199	31.2	120,120	
信越化学工業	172.1	141.2	1,598,384	
日本カーバイド工業	35	2.8	6,305	
堺化学工業	36	5.8	18,067	
エア・ウォーター	79.1	69.9	148,817	
大陽日酸	73.9	65.3	102,847	
日本化学工業	36	3.2	10,144	
東邦アセチレン	—	1.2	1,786	
日本バーカライジング	49	43.3	82,399	
高压ガス工業	14.2	12.2	10,650	
チタン工業	14	1	2,801	
四国化成工業	14	12.2	18,458	
戸田工業	20	1.7	6,315	
ステラ ケミファ	4.6	4.4	11,871	
保土谷化学工業	3.4	2.8	13,412	
日本触媒	15.1	13.3	99,617	
大日精化工業	39	6.5	30,160	
カネカ	129	114	122,322	
三菱瓦斯化学	89.4	69.9	182,578	
三井化学	436	77.1	253,659	
J S R	96.5	85.3	203,014	
東京応化工業	18	14.7	60,049	
大阪有機化学工業	6.5	5.6	8,769	
三菱ケミカルホールディングス	646.4	568.1	618,944	
K H ネオケム	11.9	13	40,235	
ダイセル	129.4	114.4	136,593	
住友ベークライト	85	69	61,617	
積水化学工業	217.8	176.2	347,642	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
日本ゼオン	81	71.5	111,111	
アイカ工業	30.8	23.8	97,461	
宇部興産	483	42.7	147,101	
積水樹脂	14.6	13.1	32,540	
タキロンシーアイ	20	17	12,189	
旭有機材	30	5	10,765	
日立化成	53.3	41.9	101,020	
ニチバン	10	4.2	13,650	
リケンテクノス	20.9	18.1	9,683	
大倉工業	23	20	11,540	
積水化成成品工業	13.6	10.9	12,676	
群栄化学工業	2.3	2	7,030	
タイガースポリマー	4.7	4.1	3,411	
ミライアル	3.7	2.9	5,875	
ダイキアクシス	1.7	2.9	4,683	
ダイキョーニシカワ	16.9	16.6	30,627	
竹本容器	—	0.9	2,215	
森六ホールディングス	—	3.2	9,904	
日本化薬	62	55.1	76,038	
カーリットホールディングス	9.1	8.1	9,436	
日本精化	7.7	7	8,659	
扶桑化学工業	6.8	6.1	17,476	
ADEKA	41.3	36.5	72,051	
日油	77	32.8	96,300	
新日本理化	16.6	14.2	3,635	
ハリマ化成グループ	8.2	6.4	5,676	
花王	243.7	199.1	1,570,699	
第一工業製薬	21	16	12,624	
日華化学	2	2.7	3,221	
ニイタカ	1.5	1.2	2,218	
三洋化成工業	5.9	5.3	27,719	
有機合成薬品工業	6.3	5.7	1,670	
大日本塗料	56	9.6	15,091	
日本ペイントホールディングス	74	65.5	242,677	
関西ペイント	100.8	89.1	236,115	
神東塗料	8	5.2	1,367	
中国塗料	27.4	24.6	26,838	
日本特殊塗料	6.8	5.3	10,679	
藤倉化成	12.7	10.1	6,787	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
太陽ホールディングス	7.8	6.5	31,947	
D I C	37.9	33.5	128,305	
サカタインクス	19.5	17.3	23,960	
東洋インキＳＣホールディングス	93	84	54,600	
T&K TOKA	6.8	5.5	7,540	
富士フイルムホールディングス	190.3	168.2	734,193	
資生堂	182	150.9	958,215	
ライオン	119	112.8	240,828	
高砂香料工業	6.3	5	16,000	
マンダム	9.6	15.8	60,356	
ミルボン	5.2	10.8	45,522	
ファンケル	20.4	19.7	67,275	
コーセー	15.5	13.7	282,905	
コタ	3.6	3.5	6,769	
シーズ・ホールディングス	12.5	11	66,220	
シーボン	1.1	1	3,430	
ポーラ・オルビスホールディングス	9.8	34.6	160,198	
ノエビアホールディングス	6	5.1	41,514	
アジュバンコスメジャパン	1.9	2.1	2,278	
エステー	6.6	5.9	13,092	
アグロ カネショウ	3.8	3.4	8,041	
コニシ	15.2	13.2	24,565	
長谷川香料	12.2	10.8	22,086	
星光PMC	5.5	4.8	5,184	
小林製薬	26.6	22.7	159,581	
荒川化学工業	8.2	7.3	13,986	
メック	7.5	5.6	9,956	
日本高純度化学	2.8	2.4	6,160	
タカラバイオ	20.7	21.3	42,557	
J C U	3	5	24,000	
新田ゼラチン	5.8	5.8	4,570	
OATアグリオ	1.2	1.3	3,773	
デクセリアルズ	25.1	20.8	28,475	
アース製薬	6.9	6.1	32,025	
イハラケミカル工業	13.4	—	—	
北興化学工業	9	8.5	6,409	
大成ラミック	2.7	2.3	7,268	
クミアイ化学工業	20	37	24,124	
日本農薬	22	21.5	12,900	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アキレス	7.7	6.2	13,224
有沢製作所	16	13.6	12,865
日東電工	69.2	61.2	512,917
レック	3	4.8	15,048
きもと	18.6	14.5	5,872
藤森工業	7.1	6.8	24,820
前澤化成工業	6.2	5.7	6,651
J S P	4.4	4.7	15,486
エフピコ	8.5	6.6	39,204
天馬	6.3	6.3	13,891
信越ポリマー	18.8	16.5	20,476
東リ	23.2	20.2	7,817
ニフコ	16.8	14.9	111,899
日本バルカー工業	7.4	6.6	20,988
ユニ・チャーム	194.2	171.7	518,362
医薬品 (4.6%)			
協和発酵キリン	114.8	101.5	236,292
武田薬品工業	359.7	298.3	1,762,953
アステラス製薬	980.2	832.3	1,270,922
大日本住友製薬	67.9	60	103,140
塩野義製薬	129.8	115.9	646,374
田辺三菱製薬	111.8	98.8	226,844
わかもと製薬	11	10	2,820
あすか製薬	10.5	9.3	20,106
日本新薬	22	21.2	133,348
バイオフェルミン製薬	1.5	1.3	3,798
中外製薬	95.5	84.4	472,640
科研製薬	17.9	14.6	90,228
エーザイ	118.1	96.9	543,512
ロート製薬	47	44.5	134,835
小野薬品工業	217.9	191.3	580,595
久光製薬	27.1	23.9	175,665
持田製薬	6.6	5.6	43,624
参天製薬	173.2	153.3	266,128
扶桑薬品工業	3.2	2.9	8,180
日本ケミファ	1.3	1	4,420
ツムラ	32.2	29	101,645
日医工	22.4	21.3	36,721
キッセイ薬品工業	16.8	15	43,755

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
生化学工業	17.8	16	33,632
栄研化学	8.1	6.6	32,703
日水製薬	3.7	3.2	4,566
鳥居薬品	6.5	5.1	14,030
J C R ファーマ	7.4	5.7	30,381
東和薬品	4.4	3.9	26,871
富士製薬工業	3.2	2.8	12,824
沢井製薬	16.3	16.3	82,967
ゼリア新薬工業	19.8	17.4	37,375
第一三共	282.3	231.8	898,920
キョーリン製薬ホールディングス	23.4	22.5	46,777
大幸薬品	5	4.4	9,231
ダイト	5.8	4.7	16,379
大塚ホールディングス	206.3	168.3	851,934
大正製薬ホールディングス	20.5	18.1	177,561
ペプチドリーム	17.9	36	168,300
石油・石炭製品 (0.7%)			
日本コークス工業	80.9	69.5	7,853
昭和シェル石油	85.8	75.8	104,831
ニチレキ	11.8	10.3	14,049
東燃ゼネラル石油	156	—	—
ユシロ化学工業	5	4.4	8,404
ビービー・カストロール	3.9	3.5	6,212
富士石油	22.7	19.9	8,974
MORESCO	3.4	3	5,826
出光興産	45.5	68	272,680
J X T Gホールディングス	1,064.7	1,292.5	848,914
コスモエネルギーホールディングス	28.9	23.4	91,962
ゴム製品 (0.9%)			
横浜ゴム	57.9	46.9	125,410
東洋ゴム工業	50.6	48	93,888
ブリヂストン	323.8	286.2	1,376,908
住友ゴム工業	89.8	83.4	177,141
藤倉ゴム工業	8.3	7.4	6,112
オカモト	29	28	30,940
フコク	3.5	3.3	3,458
ニッタ	8.6	8.3	34,320
住友理工	17.7	15.3	16,524
三ツ星ベルト	23	20	23,480

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
バンドー化学	17.2	15.3	18,788
ガラス・土石製品 (1.0%)			
日東紡績	77	12.1	31,048
旭硝子	473	82.8	375,498
日本板硝子	43.9	41	36,777
石塚硝子	14	1.1	2,926
日本山村硝子	37	32	5,888
日本電気硝子	198	35	119,350
オハラ	3.8	3.2	9,696
住友大阪セメント	178	157	75,517
太平洋セメント	579	51.2	205,312
日本ヒューム	9	8.2	6,601
日本コンクリート工業	21.7	17.9	8,144
三谷セキサン	4.8	4.2	10,567
アジアパイルホールディングス	11.9	10.6	7,208
東海カーボン	89.4	73.5	138,327
日本カーボン	48	4.2	24,402
東洋炭素	5.4	5.3	18,894
ノリタケカンパニーリミテド	5.3	4.8	25,728
TOTO	70.5	62.3	353,241
日本碍子	121.1	98.8	200,070
日本特殊陶業	82.7	69.5	188,762
ダントーホールディングス	9	—	—
MARUWA	3.5	2.8	23,744
品川リフラクトリーズ	24	2.1	6,499
黒崎播磨	21	1.6	8,048
ヨータイ	5	4	3,412
イソライト工業	5.1	4.2	4,002
東京窯業	11.7	10.7	4,686
ニッカトー	2.8	3	3,366
フジミインコーポレーテッド	8.2	7.3	19,184
エーアンドエーマテリアル	23	1.8	2,257
ニチアス	50	44	59,664
ニチハ	12.8	12.2	53,131
鉄鋼 (1.2%)			
新日鐵住金	432.5	358.4	918,400
神戸製鋼所	165.8	146.6	177,386
中山製鋼所	10.8	11	7,788
合同製鐵	5.3	4.3	8,772

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ジェイ エフ イー ホールディングス	262.2	216.3	547,887
日新製鋼	43.7	22.1	34,564
東京製鐵	48.5	43	37,152
共英製鋼	10.2	9.1	17,963
大和工業	19.2	17	54,655
東京鐵鋼	20	3.4	6,038
大阪製鐵	6	5.3	11,241
淀川製鋼所	13.2	11.7	36,679
東洋鋼板	22.7	20.4	14,545
丸一鋼管	32.1	28.4	96,560
モリ工業	3.1	2.6	10,413
大同特殊鋼	161	14.2	82,928
日本高周波鋼業	37	3.1	2,514
日本冶金工業	80.4	66.8	22,244
山陽特殊製鋼	57	9.3	22,664
愛知製鋼	5.6	4.5	21,217
日立金属	97.6	86.3	123,667
日本金属	2.4	2.1	5,766
大平洋金属	61	5	16,075
新日本電工	55	48.3	18,933
栗本鐵工所	4.6	4.1	8,671
虹技	15	1.2	2,439
日本鑄鉄管	11	9	1,503
三菱製鋼	67	5.8	15,445
日亜鋼業	13.4	11.8	4,283
日本精線	6	1.3	6,441
シンニッタン	7.7	6	5,010
新家工業	20	1.8	4,437
非鉄金属 (1.0%)			
大紀アルミニウム工業所	16	13.4	11,014
日本軽金属ホールディングス	233.8	233.8	68,035
三井金属鉱業	261	21.6	111,240
東邦亜鉛	54	4.5	26,685
三菱マテリアル	59.8	52.9	177,744
住友金属鉱山	248	102.4	525,414
DOWAホールディングス	106	20.3	80,997
古河機械金属	150	13.2	30,412
大阪チタニウムテクノロジーズ	10.6	8.4	24,578
東邦チタニウム	16.3	14.5	22,243

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
UACJ	122	12.1	31,617
古河電気工業	32.2	26.7	152,457
住友電気工業	361.3	299.5	505,556
フジクラ	126.2	96.7	74,555
昭和電線ホールディングス	119	10.2	10,016
東京特殊電線	1.5	1	3,195
タツタ電線	17.8	15.9	11,384
沖電線	11	0.3	1,087
カナレ電気	1.3	1.1	2,428
平河ヒューテック	4.7	4	4,788
リョービ	58	9.8	27,930
アーレスティ	11.2	9.9	9,553
アサヒホールディングス	14.5	12.9	26,457
金属製品 (0.7%)			
稲葉製作所	5	4.5	6,075
宮地エンジニアリンググループ	28	2.3	5,522
トーカロ	6.3	5.6	31,024
アルファCo	3.2	2.9	5,475
SUMCO	100.1	73.7	208,718
川田テクノロジーズ	1.8	1.6	9,904
RS Technologies	0.4	1.1	7,513
東洋製綱グループホールディングス	68.1	54.8	85,433
ホッカンホールディングス	25	20	7,800
コロナ	5.1	4.4	5,931
横河ブリッジホールディングス	16.9	14.9	36,892
駒井ハルテック	1.9	1.8	4,588
高田機工	9	0.7	3,108
三和ホールディングス	95.2	76.8	113,664
文化シャッター	26.6	23.8	23,585
三協立山	12.7	11.1	17,027
アルインコ	6.3	6.2	7,105
東洋シャッター	2.9	2.3	1,435
LIXILグループ	133.6	118.1	314,972
日本フィルコン	6.3	6.4	4,204
ノーリツ	18.7	17.9	35,316
長府製作所	10.2	9	22,221
リンナイ	16.3	14.3	140,283
ダイニチ工業	4.6	4.2	3,683
日東精工	14	11.1	7,048

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三洋工業	12	0.9	1,934
岡部	19.8	16	15,872
ジーテクト	10	8.8	18,568
中国工業	—	1.2	910
東ブレ	18.4	14.8	45,954
高周波熱練	17.7	15.3	16,830
東京製綱	6.6	5.8	11,553
サンコール	4.7	4.4	3,489
モリテック スチール	5.5	4.8	4,732
パイオラックス	4.8	11.9	34,878
エイチワン	—	5.9	8,336
日本発條	90.2	79.8	84,987
中央発條	10	0.8	2,876
アドパネクス	1.7	1.3	5,362
立川ブラインド工業	3.9	3.5	5,026
三益半導体工業	8.1	6.2	12,139
機械 (5.6%)			
日本ドライケミカル	1.3	1	2,538
日本製鋼所	31.7	26.2	89,211
三浦工業	39.2	34.7	103,926
タクマ	30.7	27.1	35,636
ツガミ	26	21	31,374
オークマ	62	9.3	61,008
東芝機械	57	45	34,470
アマダホールディングス	129.1	123.6	176,253
アイダエンジニアリング	27.4	20.4	28,662
滝澤鉄工所	29	2.6	5,634
富士機械製造	29.1	24	51,696
牧野フライス製作所	48	40	43,000
オーエスジー	43.7	36.9	92,286
ダイジェット工業	14	1	2,156
旭ダイヤモンド工業	27.5	23.9	30,568
DMG森精機	56.7	44.3	95,200
ソディック	24.3	17.5	24,640
ディスコ	11.2	10.8	257,040
日東工器	5.6	5	14,475
日進工具	—	2.1	7,224
パンチ工業	3.6	6.8	8,615
富士ダイス	—	3.1	3,391

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
豊和工業	5.9	4.5	6,912	
OKK	37	3.2	3,747	
石川製作所	2.9	2.1	6,239	
東洋機械金属	6.6	6.3	5,985	
津田駒工業	23	20	5,300	
島精機製作所	12.5	10.1	66,963	
オプトラン	—	5.9	22,951	
NCホールディングス	3.4	2.9	2,247	
フリーー	1.9	5.7	6,190	
ヤマシンフィルタ	2	11	13,354	
日阪製作所	13.2	11.5	12,604	
やまびこ	17.6	15.5	26,024	
平田機工	—	2.2	21,516	
ベガサスミシン製造	9.3	7.5	5,595	
ナプテスコ	49.8	44.1	195,804	
三井海洋開発	9.6	8.5	23,137	
レオン自動車機	8.2	7.2	16,538	
SMC	28.7	25.4	1,162,812	
新川	8.2	6.6	7,418	
ホソカワミクロン	16	3.1	23,994	
ユニオンツール	4.1	3.7	15,114	
オイレス工業	12.3	10.3	24,586	
日精エー・エス・ビー機械	3.1	2.7	20,169	
サトーホールディングス	12	10.6	37,524	
技研製作所	—	4.1	11,631	
日本エアーテック	3.2	3.2	3,180	
日精樹脂工業	7.6	6.8	11,478	
オカダアイヨン	2.1	2.4	3,986	
ワイエイシイホールディングス	3.7	2.7	2,462	
小松製作所	442.3	391	1,566,346	
住友重機械工業	280	46.4	201,840	
日立建機	42.8	37.9	170,739	
日工	2.9	2.2	5,493	
巴工業	4	3.4	6,616	
井関農機	98	8.1	18,168	
TOWA	7.9	6.3	10,067	
丸山製作所	22	1.9	3,433	
北川鉄工所	4.4	3.9	10,927	
ローツェ	3.4	4	9,348	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
タカキタ	3.3	2.9	2,433	
クボタ	458.9	434.4	859,677	
荏原実業	2.5	2.4	5,032	
三菱化工機	32	2.9	6,472	
月島機械	18.1	16.1	23,006	
帝国電機製作所	7	5.8	9,738	
新東工業	21.9	19.2	23,520	
澁谷工業	8	7.1	31,027	
アイチ コーポレーション	13.6	13.9	10,133	
小森コーポレーション	23	20.4	28,029	
鶴見製作所	7.1	6.8	13,334	
住友精密工業	15	13	5,369	
酒井重工業	19	1.5	6,202	
荏原製作所	43.4	33.3	132,201	
石井鐵工所	1.6	1.5	3,022	
西島製作所	9.6	8.2	8,200	
北越工業	10.1	9.1	10,565	
ダイキン工業	125.1	110.6	1,403,514	
オルガノ	18	2.9	9,642	
トーヨーカネツ	45	3.4	12,121	
栗田工業	54.2	43.8	139,941	
椿本チエイン	54	48	43,344	
大同工業	19	3	4,713	
木村化工機	8.9	7.1	3,663	
アネスト岩田	16.7	13.6	14,987	
ダイフク	45.7	41.2	271,096	
サムコ	2.3	2.2	2,780	
加藤製作所	5	3.9	10,350	
油研工業	19	1.7	5,125	
タダノ	47.9	39.1	66,430	
フジテック	26.5	25.8	36,429	
CKD	27.5	22.5	56,902	
キトー	11.7	6.2	12,865	
平和	28.4	25.3	54,496	
理想科学工業	9.1	8.1	17,374	
SANKYO	25.5	20.3	79,576	
日本金銭機械	8.7	7.7	9,717	
マースエンジニアリング	5.2	5.2	12,760	
福島工業	5.7	5	24,275	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
オーイズミ	4.3	3.9	2,102
ダイコク電機	4.1	4	6,956
竹内製作所	16.7	13.6	33,483
アマノ	28.3	25.1	72,162
JUKI	14.5	12.1	19,698
サンデンホールディングス	56	10	16,520
蛇の目マシン工業	9.1	7.5	5,752
マックス	14	12.4	18,463
グローリー	29.3	24.2	97,284
新晃工業	6.5	8.2	16,088
大和冷機工業	14.6	13	16,016
セガサミーホールディングス	90.9	80.3	125,589
日本ビストンリング	3.5	3	7,191
リケン	4.2	3.7	22,385
TPR	10.2	9	27,225
ツバキ・ナカシマ	10.3	8.1	24,988
ホシザキ	20.1	25.5	250,410
大豊工業	7.5	6.5	10,179
日本精工	188.2	166.3	266,578
NTN	212	187.4	89,764
ジェイテクト	97.6	86.3	146,019
不二越	92	75	50,925
日本トムソン	29.4	26	20,072
THK	64.7	50.5	232,047
ユースン精機	4.1	3.6	12,402
前澤給装工業	3.5	3	5,628
イーグル工業	9.9	10.1	19,725
前澤工業	6.2	5.9	2,513
日本ビラー工業	9.3	8.2	14,071
キッツ	44	36	31,680
日立工機	25	—	—
マキタ	59.7	105.6	535,392
日立造船	72.2	64.4	36,064
三菱重工業	1,535	135.7	592,737
IHI	704	62.2	215,834
スター精密	16	12.9	27,283
電気機器 (13.8%)			
日清紡ホールディングス	50.9	49.5	79,200
イビデン	64.1	49.6	87,990

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コニカミノルタ	214.5	189.6	184,480
ブラザー工業	118.4	98.9	255,755
ミネベアミツミ	166.7	150.3	364,928
日立製作所	2,200	1,945	1,614,739
東芝	2,049	—	—
三菱電機	977.2	809.9	1,481,712
富士電機	276	244	199,104
東洋電機製造	3.9	3.2	5,385
安川電機	106.2	93.9	456,354
シンフォニアテクノロジー	60	53	19,716
明電舎	84	69	28,497
オリジン電気	13	2.5	4,755
山洋電気	24	3.9	32,409
デンヨー	8.4	7.4	13,534
東芝テック	58	58	37,932
芝浦メカトロニクス	15	12	5,784
マブチモーター	25.9	22.6	121,362
日本電産	118.7	97.5	1,584,862
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1.1	3	8,148
東光高岳	4.7	4.1	6,560
ダブル・スコープ	8.9	11.8	18,101
ダイヘン	50	44	36,388
田淵電機	14.4	12.3	3,456
ヤーマン	1.2	11.7	19,995
JVCケンウッド	67.8	59.9	21,803
ミマキエンジニアリング	8.5	7.5	6,870
第一精工	4.3	3.8	10,856
日新電機	18.5	19	20,539
大崎電気工業	18	17.4	13,780
オムロン	97.4	86.1	527,793
日東工業	13.3	13.1	23,894
IDEC	12	10	28,010
不二電機工業	0.9	0.6	813
ジーエス・ユアサ コーポレーション	176	146	86,286
サクサホールディングス	24	2.2	4,760
メルコホールディングス	5.1	3.9	13,884
テクノメディア	2.1	2	3,938
日本電気	1,259	104.8	336,932
富士通	883	833	533,036

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
沖電気工業	39.7	33	47,916
岩崎通信機	44	3.6	2,797
電気興業	26	4.7	15,228
サンケン電気	54	48	40,464
ナカヨ	10	1.6	3,244
アイホン	5.2	4.6	7,898
ルネサスエレクトロニクス	47.2	41.9	48,059
セイコーエプソン	136.4	120.6	249,521
ワコム	71.6	63.2	35,012
アルバック	15.4	18.5	114,515
アクセル	4	3.7	2,960
E I Z O	9.1	7.4	37,518
ジャパンディスプレイ	171.7	167.2	36,115
日本信号	25.4	22.2	23,776
京三製作所	21	19	14,630
能美防災	10.6	10.7	25,155
ホーチキ	6.7	5.9	11,723
エレコム	8	7	16,394
日本無線	5.7	—	—
パナソニック	1,046.6	925.2	1,527,967
シャープ	—	55.6	194,878
アンリツ	66.8	59	77,880
富士通ゼネラル	31	24.7	51,079
日立国際電気	23.9	—	—
ソニー	646.8	540.8	2,864,076
TDK	51.6	42.4	391,352
帝国通信工業	21	3.7	5,002
タムラ製作所	35	31.3	24,727
アルプス電気	84.6	69.8	195,300
パイオニア	138.4	135.9	27,723
日本電波工業	8.9	7.5	5,310
鈴木	3.7	3.4	4,576
日本トリム	2.3	1.8	10,512
ローランド ディー・ジー	4.7	4.2	11,235
フォスター電機	10.7	9.5	27,683
クラリオン	49	43	14,921
SMK	23	21	9,303
ヨコオ	6.6	5.3	11,776
ホシデン	27.9	20.5	30,606

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヒロセ電機	14.8	13.1	201,347
日本航空電子工業	26	21	33,054
TOA	10.7	8.8	12,812
マクセルホールディングス	13.7	16.1	34,293
古野電気	12	10.1	7,504
ユニデンホールディングス	30	23	6,854
アルパイン	21.9	19.3	42,151
スミダコーポレーション	7.5	8.3	13,147
アイコム	5.2	4.6	12,705
リオン	3.7	3.5	10,136
本多通信工業	3	6.4	7,840
船井電機	10.4	8.5	6,528
横河電機	99.3	81.1	180,042
新電元工業	35	2.9	24,389
アズビル	27.8	24.3	114,574
東亜ディーケーケー	4.5	4.1	4,563
日本光電工業	38.3	33.8	97,107
チノー	3.4	2.9	4,808
共和電業	10	8.7	3,923
日本電子材料	3.7	3.2	2,272
堀場製作所	18.1	16	125,600
アドバンテスト	62.4	45.2	98,626
小野測器	4.5	3.4	2,726
エスベック	8.2	7.2	18,511
パナソニック デバイスSUNX	8.1	—	—
キーエンス	41.5	39.8	2,502,624
日置電機	4.7	4.2	14,847
シスメックス	71.2	63	548,730
日本マイクロニクス	17.3	14.3	15,787
メガチップス	8.6	6.4	23,680
OBARA GROUP	5.4	4.7	31,302
澤藤電機	6	0.9	1,977
コーセル	12.7	11.2	18,480
イリソ電子工業	2.9	6.8	46,240
新日本無線	8	5	4,370
オブテックスグループ	7	6.6	37,554
千代田インテグレ	4.8	3.9	9,469
アイ・オー・データ機器	3	3.4	3,780
レーザーテック	10.1	16.6	70,882

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
スタンレー電気	65.3	62	255,440	
岩崎電気	35	3.2	5,286	
ウシオ電機	55.6	49.2	71,635	
岡谷電機産業	5.2	4.6	3,555	
ヘリオス テクノ ホールディング	8.6	7	6,965	
日本セラミック	7.5	8.2	24,067	
遠藤照明	4.7	4.1	4,592	
古河電池	7	6	6,240	
双信電機	5.8	3.7	2,575	
山一電機	8.7	5.9	10,938	
図研	6.1	5.4	9,649	
日本電子	34	30	24,480	
カシオ計算機	73.7	65.1	98,952	
ファナック	92.9	77	2,114,805	
日本シイエムケイ	20	14.3	13,370	
エンプラス	4.1	3.7	13,579	
大真空	3.4	3	4,281	
ローム	44.3	36.3	400,389	
浜松ホトニクス	71.5	59	250,455	
三井ハイテック	12.2	10.7	21,699	
新光電気工業	34.9	30.7	27,691	
京セラ	150.4	132.9	824,511	
太陽誘電	44.6	36.4	64,391	
村田製作所	96.1	85	1,280,950	
ユースン	12.3	12.3	9,249	
双葉電子工業	15	13.3	29,446	
北陸電気工業	37	3.3	5,504	
ニチコン	29.1	25.4	33,629	
日本ケミコン	79	6.6	18,453	
KOA	12.6	11.2	26,051	
市光工業	19	12.2	14,042	
小糸製作所	54.9	48.5	358,900	
ミツバ	16.9	15	20,235	
SCREENホールディングス	18.8	15.3	146,574	
キャノン電子	8.2	7.4	19,203	
キャノン	493.2	436	1,723,508	
リコー	275.4	243.5	287,573	
MUTOHホールディングス	14	1.3	3,264	
東京エレクトロン	61.1	54	1,094,040	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
輸送用機器 (9.0%)			
トヨタ紡織	32	23.6	54,539
芦森工業	21	1.7	4,051
ユニプレス	17.6	15.6	40,404
豊田自動織機	83.4	65.5	445,400
モリタホールディングス	16.2	12.8	25,523
三櫻工業	12	10.3	8,023
デンソー	225.9	179.7	1,119,710
東海理化電機製作所	24	21.1	48,677
三井造船	331	29.2	57,816
川崎重工業	713	63	252,315
名村造船所	27.5	24.7	15,585
サノヤスホールディングス	11.4	10.2	2,652
日本車輛製造	34	30	9,330
三菱ロジスネクスト	10.8	9.7	8,846
近畿車輛	1.4	1.2	3,292
日産自動車	1,080.5	955.2	1,066,958
いすゞ自動車	265.5	234.7	408,730
トヨタ自動車	1,113.7	984.6	7,178,718
日野自動車	130.7	115.6	168,082
三菱自動車工業	335.7	299.8	250,333
エフテック	5	5.2	6,791
レシップホールディングス	3.3	3.2	2,854
GMB	1.6	1.4	2,549
ファルテック	1.5	1.3	1,899
武蔵精密工業	10.7	8.7	32,842
日産車体	40.1	31.6	32,263
新明和工業	37	35.1	33,204
極東開発工業	18.1	15	25,035
日信工業	20.3	16.5	31,152
トビー工業	7.5	6.7	21,507
ティラド	36	2.9	11,484
曙ブレーキ工業	43.6	38.1	12,115
タチエス	15.5	13.8	25,957
NOK	44.3	43.5	98,701
フタバ産業	28.1	24.8	23,460
KYB	103	8.4	46,116
大同メタル工業	11.7	10.1	13,342
プレス工業	48.5	43	28,337

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ミクニ	11.7	10.5	7,255
カルソニックカンセイ	62	—	—
太平洋工業	18.8	16.9	24,741
ケーヒン	21	18.6	39,599
河西工業	12.3	9.9	14,394
アイシン精機	83.8	66.7	412,206
富士機工	9.1	—	—
マツダ	290.1	254.2	381,554
今仙電機製作所	8.2	7.6	9,188
本田技研工業	824.4	728.8	2,758,508
スズキ	181.6	160.5	955,938
S U B A R U	284.4	251.4	939,733
安永	3.4	3.9	9,909
ヤマハ発動機	129.4	114.4	392,392
ショーワ	24.1	21.1	31,143
T B K	12.2	10.2	5,518
エクセディ	12.4	9.7	33,077
豊田合成	29.6	29.4	76,293
愛三工業	16	14.3	17,746
盟和産業	1.5	1.4	1,906
日本プラスト	—	3.3	3,095
ヨロズ	8.5	8.2	15,293
エフ・シー・シー	15	13.2	39,930
シマノ	36.9	32.6	506,930
タカタ	16.7	—	—
ティ・エス テック	21.3	18.8	78,772
ジャムコ	5.4	4.1	9,811
精密機器 (1.6%)			
テルモ	140.4	124.1	682,550
クリエートメディック	2.8	2.6	3,010
日機装	31.7	28.2	34,516
島津製作所	117.9	96.8	258,456
J M S	15	6.5	4,075
長野計器	6.8	6.5	7,962
ブイ・テクノロジー	1.9	1.9	45,201
東京計器	32	5.3	6,354
愛知時計電機	1.2	1.1	4,873
インターアクション	—	3.2	3,171
オーバル	9.5	8.9	2,598

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京精密	17.7	14.6	64,021
マニー	12.2	9.8	38,661
ニコン	159.6	141.1	302,518
トプコン	46.1	43.5	103,182
オリンパス	146.2	120.6	508,329
理研計器	8.1	7.7	17,163
タムロン	8.1	6.5	16,100
HOYA	188.5	164.9	911,732
シード	—	0.9	4,234
ノーリツ銅機	9.4	8.2	18,072
エー・アンド・デイ	8.4	7.6	5,008
シチズン時計	100.2	96.7	80,937
リズム時計工業	36	3	6,705
大研医器	8.2	7.5	5,610
メニコン	6.3	11.1	28,338
シンシア	—	0.6	394
松風	4.8	3.7	5,331
セイコーホールディングス	65	12.5	36,137
ニプロ	63.4	56	88,200
その他製品 (2.2%)			
中本ボックス	—	0.8	3,708
スノーピーク	1.4	2.6	3,104
パラマウントベッドホールディングス	8.8	8.5	48,960
トランザクション	2.1	3.7	3,925
S H O - B I	3.8	3.4	1,407
ニホンフラッシュ	4.4	3.8	9,842
前田工織	9.4	8.3	16,641
永大産業	12	10	5,700
アートネイチャー	10	8.6	6,475
ダンロップスポーツ	5.9	—	—
パンダイナムコホールディングス	101	83.7	298,809
アイフィスジャパン	2.5	2.1	1,430
共立印刷	14.9	12.2	4,440
S H O E I	4.1	3.7	16,872
フランスベッドホールディングス	11.2	9.4	9,766
パイロットコーポレーション	16	14.1	77,832
萩原工業	2.7	4.6	8,206
トッパン・フォームズ	16.1	17.4	21,262
フジシールインターナショナル	20.5	18.2	64,428

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タカラトミー	35.8	33.9	37,866
廣済堂	9.8	8	4,168
A s - m e エステール	2.4	2.4	2,325
アーク	41.8	35.4	4,460
タカノ	3.7	3.4	3,291
ブロネックス	8.7	7.5	9,870
ホクシン	7.9	6.7	1,286
ウッドワン	15	2.8	4,082
大建工業	6.5	6.3	16,644
凸版印刷	259	229	215,489
大日本印刷	264	106	242,528
図書印刷	12	5.2	4,992
共同印刷	28	2.4	7,632
N I S S H A	15.4	16.6	47,426
光村印刷	9	0.6	1,459
宝印刷	4.7	4.3	7,946
アシックス	91	80.4	135,634
ツツミ	3.4	2.6	5,545
小松ウオール工業	3	2.8	7,042
ヤマハ	61.7	54.6	257,985
河合楽器製作所	3.6	2.7	10,503
クリナップ	10.9	7.6	6,399
ビジョン	55.4	48.9	215,404
兼松サステック	11	0.7	1,410
キングジム	7.7	7.1	7,078
リンテック	21.6	19.3	59,058
T A S A K I	2.6	—	—
イトーキ	19.3	17.1	12,312
任天堂	56.4	49.9	2,343,304
三菱鉛筆	7.5	13.3	33,050
タカラスタンダード	18.9	16.7	30,677
コクヨ	47.6	38.8	74,767
ナカバヤシ	16	7.7	4,797
グローブリッド	4.5	3.6	8,373
岡村製作所	31.9	28.3	41,091
美津濃	49	8	25,560
電気・ガス業 (1.5%)			
東京電力ホールディングス	777.1	646.5	269,590
中部電力	301.8	247.8	350,017

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
関西電力	373.8	330.5	435,599
中国電力	126.7	112	139,552
北陸電力	89.7	79.3	66,770
東北電力	228.9	189.7	264,441
四国電力	82.5	72.9	89,229
九州電力	202.3	178.8	220,102
北海道電力	85.7	81.2	53,592
沖縄電力	13.5	13.1	37,767
電源開発	72.9	64.4	178,194
エフオン	3.5	4.1	4,780
イーレックス	3.9	12.8	10,329
東京瓦斯	983	172.8	470,102
大阪瓦斯	889	157.2	343,089
東邦瓦斯	231	40.1	132,530
北海道瓦斯	21	21	6,279
広島ガス	18.4	15.7	6,201
西部瓦斯	102	9.7	27,237
静岡ガス	28	22.9	20,793
メタウォーター	5.2	4.5	13,950
陸運業 (4.0%)			
S B Sホールディングス	9.2	8.1	10,278
東武鉄道	489	86.5	289,342
相鉄ホールディングス	147	25.9	74,592
東京急行電鉄	498	220	382,580
京浜急行電鉄	251	110.9	220,580
小田急電鉄	146.7	120.5	271,607
京王電鉄	256	45.3	220,384
京成電鉄	68.7	56.4	199,938
富士急行	25	11.1	31,257
新京成電鉄	11	1.8	4,046
東日本旅客鉄道	177.2	145.5	1,509,562
西日本旅客鉄道	88.2	73.1	555,633
東海旅客鉄道	76.2	72.5	1,457,975
西武ホールディングス	126.5	103.2	195,460
鴻池運輸	13	11.5	21,850
西日本鉄道	110	22.4	65,430
ハマキョウレックス	6.1	5.8	19,169
サカイ引越センター	3.2	4.3	22,876
近鉄グループホールディングス	922	76.7	322,523

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
阪急阪神ホールディングス	115.7	102.3	409,200
南海電気鉄道	194	36.4	101,446
京阪ホールディングス	205	34.2	116,451
神戸電鉄	22	1.7	6,723
名古屋鉄道	334	59.2	164,280
山陽電気鉄道	33	5.9	16,461
日本通運	354	30.1	217,021
ヤマトホールディングス	163.8	134.5	368,328
山九	121	19.7	102,637
丸運	3.8	3.4	1,217
丸全昭和運輸	30	27	13,797
センコーグループホールディングス	41.7	46	33,212
トナミホールディングス	18	1.8	9,198
ニッコンホールディングス	31.1	29.2	78,518
日本石油輸送	1	1	3,300
福山通運	55	11.1	50,616
セイノーホールディングス	65	57.4	102,057
神奈川中央交通	10	1.8	6,687
日立物流	19	16.8	43,596
丸和運輸機関	2.3	4	14,580
C＆Fロジホールディングス	9.6	8.4	12,642
九州旅客鉄道	68.3	64.4	215,096
S Gホールディングス	—	53.6	123,280
海運業 (0.2%)			
日本郵船	774	64.1	150,699
商船三井	480	48.5	163,930
川崎汽船	347	35.4	94,164
N Sユナイテッド海運	41	3.6	8,150
明治海運	8.4	8.6	3,784
飯野海運	47.6	40	22,480
共栄タンカー	9	0.6	1,156
乾汽船	6.9	6.1	5,044
空運業 (0.6%)			
日本航空	165.1	142.3	572,188
A N Aホールディングス	1,700	150.3	646,740
バスコ	9	8	2,720
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	2.7	2.1	14,658
日新	38	6.7	18,706

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱倉庫	60	26.5	67,734
三井倉庫ホールディングス	54	44	15,576
住友倉庫	66	53	38,955
澁澤倉庫	24	4.2	8,038
東陽倉庫	16.1	13.9	5,004
日本トランスシティ	20	18	7,920
ケイヒン	18	1.6	2,769
中央倉庫	5.3	4.8	5,313
川西倉庫	—	1.6	3,273
安田倉庫	7.5	7.1	6,787
東洋埠頭	29	2.3	4,050
宇徳	7.5	6.8	3,284
上組	109	48.3	114,615
サンリツ	2.4	2.1	1,734
キムラユニティ	2.2	1.8	2,028
キューソー流通システム	2.9	2.2	5,629
郵船ロジスティクス	8.4	—	—
近鉄エクスプレス	16.4	14.5	30,290
東海運	5.6	4.5	1,903
エーアイティ	5.8	5.7	6,594
内外トランスライン	2.7	2.8	5,194
日本コンセプト	—	1.5	2,305
情報・通信業 (7.2%)			
NECネットエスアイ	9.8	8.8	23,980
システナ	7.3	6.4	28,352
デジタルアーツ	4	3.9	14,449
新日鉄住金ソリューションズ	15	12.4	36,183
キューブシステム	3.9	4.6	3,666
エイジア	—	1.2	1,746
コア	3.9	3.4	4,484
ソリトンシステムズ	—	2.6	3,567
ソフトクリエイトホールディングス	4.4	3.8	5,734
T I S	30	26.5	101,627
ネオス	3.3	2.8	1,192
電算システム	3.2	2.8	5,390
グリー	54.9	42.6	28,329
コーエーテクモホールディングス	21.6	13.8	30,884
三菱総合研究所	3.5	3.3	11,335
ボルテージ	1.7	1.6	1,614

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
電算	0.9	0.8	2,043	
AGS	2.3	4.6	3,781	
ファインデックス	6.9	6.8	4,902	
ヒト・コミュニケーションズ	2.1	1.8	3,396	
ブレインパッド	2	1.8	4,296	
KL a b	17.6	15.5	24,877	
ポルトウウィン・ビットクルーホールディ	6.7	5.8	13,450	
イーブックイニシアティブジャパン	1.6	1.3	1,296	
ネクソン	99	88.5	336,742	
アイスタイル	19.1	19.8	29,700	
エムアップ	2.8	2.7	3,061	
エイチーム	5.1	5.5	14,542	
テクノスジャパン	7.1	7.4	6,985	
コロブラ	25.6	26	25,792	
モバイルクリエイト	6.9	7.1	2,591	
ブロードリーフ	22.5	19.8	25,304	
ハーツユナイテッドグループ	4.9	4.2	6,560	
メディアドゥホールディングス	2	2.6	5,168	
ブイキューブ	5.3	5.1	2,544	
サイバーリンクス	1.5	1.3	1,723	
ディー・エル・イー	3.1	5.1	2,228	
フィックスターズ	1.3	1.4	10,122	
VOYAGE GROUP	3.2	4.1	5,129	
オブティム	1	1.4	3,351	
セレス	1	2.5	4,515	
ベリサーブ	1.1	1.1	3,448	
ティーガイア	8.9	7.8	23,181	
セック	—	0.8	2,536	
日本アジアグループ	10.6	8.8	4,611	
豆蔵ホールディングス	6.9	5.9	7,174	
テクマトリックス	2.9	4.4	8,175	
プロシップ	—	1.2	2,785	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	191.2	215.5	78,657	
GMOペイメントゲートウェイ	7.4	5.6	51,240	
ザッパラス	5.2	4.5	1,755	
システムリサーチ	0.6	0.8	1,911	
インターネットイニシアティブ	13.3	12.9	30,147	
さくらインターネット	7	9.5	7,258	
ヴィンクス	—	0.3	528	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
GMOクラウド	2.1	1.8	4,212	
SRAホールディングス	4.7	4.2	14,112	
Minor i ソリューションズ	2	1.5	2,341	
システムインテグレータ	1.5	1.4	1,443	
朝日ネット	8	6.9	3,594	
eBASE	—	1.6	1,827	
アドソル日進	1.9	3.1	4,126	
フリービット	5.1	5.3	4,833	
コムチュア	1.6	4	13,880	
サイバーコム	1.3	1.5	1,978	
メディカル・データ・ビジョン	1.5	3	8,175	
gum i	10.4	9.4	10,227	
ショーケース・ティービー	0.7	1.6	2,561	
モバイルファクトリー	—	1.5	1,909	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	—	1.3	4,420	
PCIホールディングス	1.1	1.4	4,480	
パイプドHD	1.7	1.3	1,794	
アイビーシー	0.7	0.9	1,629	
オープンドア	0.6	3.3	7,042	
マイネット	—	1.6	2,233	
アカツキ	—	1.6	9,968	
Ub i c o mホールディングス	—	0.8	878	
LINE	15.1	23.8	105,672	
シンクロ・フード	—	0.7	3,346	
オークネット	—	2.4	3,266	
AOI TYO Holdings	7.4	6.6	8,388	
マクロミル	—	7.4	21,756	
ソルクシーズ	2.8	3.1	3,475	
フェイス	2.4	2.8	3,304	
ハイマックス	1.2	0.9	1,527	
野村総合研究所	67.6	53.1	248,242	
サイバネットシステム	7.5	6.6	4,989	
CEホールディングス	1.5	2.4	2,136	
日本システム技術	—	1	1,294	
インテージホールディングス	5.2	9.2	11,030	
東邦システムサイエンス	2.9	2.4	1,941	
ソースネクスト	5.8	11.2	7,728	
フォーカスシステムズ	3.6	4.6	4,287	
クレスコ	2.1	1.8	6,804	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
フジ・メディア・ホールディングス	94.1	83.2	153,920	
オービック	31.2	25	214,250	
ジャストシステム	14.7	12.9	31,192	
TDCソフト	4.1	3.4	3,913	
ヤフー	648	573	300,252	
トレンドマイクロ	47.9	38.8	233,188	
インフォメーション・ディベロプメント	2.7	2.5	3,457	
日本オラクル	14.5	12.9	108,747	
アルファシステムズ	2.8	2.5	5,972	
フューチャー	12	10.6	13,377	
CAC Holdings	6.5	5.9	6,596	
ソフトバンク・テクノロジー	2.2	3.3	6,418	
トーセ	2.9	2.2	4,347	
オービックビジネスコンサルタント	4.6	4	25,400	
伊藤忠テクノソリューションズ	20.5	18.1	75,929	
アイティフォー	11.7	9.8	7,271	
東計電算	1.3	1.4	4,655	
エクスネット	0.9	1.2	1,063	
大塚商会	24.3	23.9	230,635	
サイボウズ	12.5	10.8	5,864	
ソフトブレイン	12.6	6.4	2,764	
電通国際情報サービス	5.6	4.9	13,597	
デジタルガレージ	13.2	14.3	45,474	
EMシステムズ	3.1	2.7	6,714	
ウェザーニューズ	3	2.7	8,842	
C I J	6.7	6.2	4,346	
東洋ビジネスエンジニアリング	0.9	0.7	1,218	
日本エンタープライズ	10	9.3	2,101	
WOWOW	4.3	3.8	13,091	
スカラ	6.3	6.3	5,714	
日本コロムビア	3.1	—	—	
イマジカ・ロボット ホールディングス	7.8	6.8	7,833	
ネットワンシステムズ	39.4	32.6	51,638	
システムソフト	17.2	19.6	2,724	
アルゴグラフィックス	4.3	3.7	12,839	
マーベラス	15.5	13.7	12,686	
エイベックス	16.8	15	24,645	
日本ユニシス	24.9	21.9	48,070	
兼松エレクトロニクス	5.7	5	15,550	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
東京放送ホールディングス	59.6	47.9	112,612	
日本テレビホールディングス	82.5	73	149,139	
朝日放送	8.5	7.7	6,906	
テレビ朝日ホールディングス	24.7	21.7	48,434	
スカパー J S A Tホールディングス	58.3	59.9	29,410	
テレビ東京ホールディングス	7.4	6.4	17,132	
日本BS放送	2.1	2.7	3,661	
ビジョン	0.7	2	5,632	
USEN-NEXT HOLDINGS	2.5	2.1	2,076	
ワイヤレスゲート	3.2	3.8	4,605	
コネクシオ	7.9	5.6	13,098	
日本通信	77.2	74	8,584	
クロップス	1.8	1.8	1,513	
日本電信電話	725.8	570.3	2,734,588	
KDDI	894.4	715.6	1,888,826	
光通信	10.9	9.6	149,088	
NTTドコモ	675.6	588.3	1,607,823	
エムティーアイ	13.7	10.7	6,741	
GMOインターネット	32.9	28.9	55,863	
アイドママーケティングコミュニケーション	—	1.3	958	
カドカワ	26.3	23.4	27,939	
学研ホールディングス	31	2.6	13,520	
ゼンリン	12.1	9.6	32,832	
昭文社	5	3.9	3,010	
インプレスホールディングス	8.5	8.6	2,098	
アイネット	5	4.5	7,119	
松竹	59	5.3	80,719	
東宝	59.1	52.3	185,142	
東映	34	3	33,330	
エヌ・ティ・ティ・データ	55.8	246.9	273,071	
ビー・シー・エー	1.3	1.1	2,016	
ビジネスブレイン太田昭和	1.4	1.4	2,678	
D T S	9.3	8.3	31,498	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	34.8	36.9	161,437	
シーイーシー	5.4	4.7	14,899	
カブコン	21.4	17	73,950	
アイ・エス・ビー	1.9	1.6	2,158	
ジャステック	5.5	4.6	5,782	
S C S K	24.6	18.3	78,232	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本システムウエア	3.1	2.6	6,715
アイネス	11.3	9.9	10,711
TKC	8.3	7.3	33,069
富士ソフト	13.3	11	43,065
NSD	19.1	13.1	28,125
コナミホールディングス	40.8	32.5	182,975
福井コンピュータホールディングス	2.7	2.3	5,628
JBCホールディングス	7.2	6.4	6,841
ミロク情報サービス	6.8	7	22,050
ソフトバンクグループ	407	359.8	3,210,135
卸売業 (4.8%)			
ハウスイ	10	0.8	930
高千穂交易	3.8	3	3,384
伊藤忠食品	2.1	1.9	11,267
エレマテック	3.5	3.7	8,639
JALUX	2.9	2.3	7,095
あらた	4	3.9	19,324
トーマンデバイス	1.2	1.1	3,133
東京エレクトロン デバイス	2.9	2.7	5,751
フィールズ	7.1	6.6	7,887
双日	534	472	163,312
アルフレッサ ホールディングス	107	88.6	210,159
横浜冷凍	22.3	19.1	21,258
山下医科器械	0.9	—	—
ラサ商事	4.1	3.5	3,300
ラクーン	4.4	4.9	3,572
アルコニックス	5.2	8.5	20,927
神戸物産	4.9	5.2	22,386
ベッパーフードサービス	—	4.3	19,909
あい ホールディングス	13.3	12.7	38,290
ディーブイエックス	3.4	2.9	3,610
ダイワボウホールディングス	78	6.8	29,512
マクニカ・富士エレホールディングス	16.6	14.7	42,835
ラクト・ジャパン	—	1.1	4,323
バイタルケーエスケー・ホールディングス	16.8	14.7	15,023
八洲電機	6.5	6	5,178
メディアスホールディングス	—	1.5	3,409
UKCホールディングス	5.7	5.2	11,939
ジュエテックホールディングス	—	1.9	2,435

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	—	2	1,838
OCHIホールディングス	2.7	2.4	3,436
TOKAIホールディングス	39.7	42	48,048
大阪工機	1.1	1.3	1,388
三洋貿易	5	4.4	10,445
ビューティガレージ	0.9	1.1	2,438
ウイン・パートナーズ	6.6	5.8	9,639
ミタチ産業	2.1	1.9	3,125
シップヘルスケアホールディングス	17.3	16.6	61,669
明治電機工業	3.1	2.8	5,359
デリカフーズホールディングス	2.2	1.7	2,410
スターティア	2.4	2	2,010
コメダホールディングス	12.2	14.7	32,016
富士興産	3.2	2.9	1,809
協栄産業	13	1	1,994
小野建	7.9	6.8	13,321
佐島電機	6.1	5.9	6,490
エコートレーディング	2.1	1.8	1,335
伯東	5.9	4.8	7,771
コンドテック	7.3	6.3	6,230
中山福	4.6	4.1	3,267
ナガイレーベン	13.2	10.6	29,383
三菱食品	9.8	8.7	27,361
松田産業	6.5	5.7	11,069
第一興商	14.7	11.9	65,688
メディバルホールディングス	90.4	79.9	171,465
SPK	1.9	1.7	5,117
萩原電気	2.9	2.7	9,207
アズワン	7	6.2	43,152
スズデン	3.2	2.9	5,011
尾家産業	2.8	2.4	3,096
シモジマ	5.3	4.9	5,561
ドウシシャ	10.8	8.5	20,400
小津産業	2	1.9	4,250
高速	5.2	4.6	5,575
たけびし	3.1	2.9	5,286
黒田電気	12.2	6	16,272
リックス	2.2	1.8	3,988
丸文	7.5	6.7	6,947

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ハビネット	7.7	5.5	9,339
橋本総業ホールディングス	2	1.7	3,170
日本ライフライン	7.8	22.7	79,677
エクセル	3.8	3.2	8,860
マルカキカイ	2.9	2.6	5,538
I D O M	24.5	24.4	17,568
日本エム・ディ・エム	7	5.5	5,252
進和	5.4	4.8	10,992
エスケイジャパン	2.2	2.2	1,513
ダイترون	4.2	3.7	8,820
シークス	6.4	5	23,550
田中商事	3	2.4	1,900
オーハシテクニカ	5.1	4.5	8,280
白銅	2.2	2.9	6,991
伊藤忠商事	662.2	585.4	1,207,680
丸紅	889.8	655.5	531,282
高島	17	1.3	2,871
長瀬産業	54.4	48.1	89,706
蝶理	5.8	4.9	9,339
豊田通商	100.7	89	360,895
三共生興	14.3	14.4	7,444
兼松	193	34	48,484
ツカモトコーポレーション	22	1.9	2,414
三井物産	817.6	677.6	1,322,336
日本紙パルプ商事	46	4.1	17,753
日立ハイテクノロジーズ	31.3	27.7	141,824
カメイ	11.7	10.4	17,045
東都水産	1.4	1.1	2,184
O U G ホールディングス	14	1.1	2,945
スターゼン	3.8	3.1	16,213
山善	34.5	31.1	37,568
椿本興業	10	1.7	5,618
住友商事	569.1	503.1	916,648
内田洋行	4.4	3.6	11,448
三菱商事	678.4	559.7	1,709,323
第一実業	21	3.7	12,043
キャノンマーケティングジャパン	25.8	22.8	66,963
西華産業	29	4.9	12,960
佐藤商事	7.6	7	8,078

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
菱洋エレクトロ	8.5	7.4	13,912
東京産業	9.5	8	4,752
ユアサ商事	8.6	7.5	28,312
神鋼商事	2.3	1.8	6,606
小林産業	7.4	5.5	1,936
阪和興業	90	14.9	74,649
正栄食品工業	—	4.4	17,644
カナデン	8.4	7.6	10,366
菱電商事	14	5.7	10,539
フルサト工業	4.8	4.2	7,513
岩谷産業	100	17.7	72,127
すてきなイスグループ	39	3.3	4,785
昭光通商	36	31	3,844
ニチモウ	14	1.2	2,187
極東貿易	14	12	5,496
イワキ	14	12	5,004
三愛石油	24	21.3	32,013
稲畑産業	21.5	19.2	30,086
G S I クレオス	24	2.3	4,298
明和産業	8.7	7.6	3,815
ワキタ	19.3	17.2	21,517
東邦ホールディングス	28.9	23.6	59,448
サンゲツ	31	27	60,831
ミツウロコグループホールディングス	14.3	11.5	8,809
シナネンホールディングス	3.6	3.7	9,934
伊藤忠エネクス	19.9	17.6	17,846
サンリオ	27.9	22.5	44,190
サンワテクノス	5.1	4.7	10,236
リョーサン	13.3	10	39,250
新光商事	9.8	8.8	16,957
トーホー	4	3.7	9,205
三信電気	10	7.4	14,067
東陽テクニカ	11.9	9.2	8,933
モスフードサービス	11.8	10.4	33,592
加賀電子	8.1	7.2	19,814
ソーダニッカ	8.8	8	5,544
立花エレテック	5.8	5.2	11,408
フォーバル	4.1	3.5	3,262
P A L T A C	14.4	11.1	57,387

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三谷産業	9.7	8.3	3,660
太平洋興発	43	3.4	3,610
西本Wismettacホールディングス	—	1.6	6,688
ヤマシタヘルスケアホールディングス	—	0.6	900
ヤマタネ	4.7	4.2	8,345
丸紅建材リース	9	8	1,872
日鉄住金物産	7.8	6.2	37,882
泉州電業	—	2.7	7,730
トラスコ中山	20.7	16.6	47,177
オートバックスセブン	33.5	31.7	66,348
モリト	4.4	6.8	6,562
加藤産業	14	12.4	46,500
イノテック	7.8	7	8,967
イエローハット	8.5	7.5	24,900
J Kホールディングス	8.8	7.8	6,973
日伝	3.7	6.6	14,289
北沢産業	8.7	7.5	2,145
杉本商事	5.1	4.2	7,761
因幡電機産業	12.5	10.4	52,000
バイテックホールディングス	3.6	3.5	5,908
東テク	—	2.6	6,245
ミスミグループ本社	101.6	92.6	291,690
アルテック	8.9	7.5	2,550
タキヒヨー	14	2.6	5,998
蔵王産業	1.4	1.4	2,611
スズケン	41.2	36.4	157,430
ジェコス	6.3	5.4	6,685
ルネサスイーストン	8	7.3	5,394
小売業 (4.7%)			
ローソン	31.4	20.2	147,864
サンエー	6.8	6	33,360
カワチ薬品	7	6.3	16,254
エービーシー・マート	16.4	14.5	99,905
ハードオフコーポレーション	4	3.5	4,060
アスクル	9.4	6.9	27,393
ゲオホールディングス	15	14.6	29,200
アダストリア	13.9	12.3	27,490
ジーフット	5.6	4.9	3,915
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1.6	1.4	1,024

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
くらコーポレーション	5.9	4.7	29,657
キャンドウ	4.9	4	7,024
バルグループホールディングス	4.6	4.1	12,730
エディオン	34.9	30.7	40,769
サーラコーポレーション	11.3	13.9	9,438
ワッツ	4.2	3.4	3,668
ハローズ	3	3.1	7,849
あみやき亭	1.7	1.7	8,993
ひらまつ	12.7	11.7	6,598
ゲンキー	1.8	—	—
大黒天物産	2.2	1.9	10,070
ハニーズホールディングス	8.9	7.8	7,909
ファーマライズホールディングス	2.6	2.1	1,304
アルペン	7	6.1	15,243
ハブ	—	1.5	1,929
クオール	10.3	8.8	20,266
ジinz	6.2	5.4	28,944
ビックカメラ	51.9	46	76,038
DCMホールディングス	54.9	42.5	45,900
Monotaro	32	28.3	101,597
東京一番フーズ	2.4	2.4	1,704
DDホールディングス	2.1	1.8	6,444
きちり	3	2.4	1,790
アークランドサービスホールディングス	2.8	6.7	15,054
J. フロント リテイリング	114.4	95.2	186,687
ドトール・日レスホールディングス	15.7	13.9	35,597
マツモトキヨシホールディングス	17.1	33	146,520
ブロンコビリー	4.8	4.2	13,860
スタートトゥデイ	82.5	78.4	238,336
トレジャー・ファクトリー	2.7	2.3	1,996
物語コーポレーション	2.6	2.3	21,988
ココカラファイン	9.4	8.3	58,598
三越伊勢丹ホールディングス	179.9	149.1	188,611
Hamee	2.1	2	3,872
ウエルシアホールディングス	9	21.1	100,330
クリエイトSDホールディングス	13.3	11.8	32,072
丸善CH I ホールディングス	10.3	9.3	3,171
ミサワ	2.2	1.8	799
ティーライフ	0.9	1.2	1,575

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・ピーカンパニー	1.8	1.5	1,227	
チムニー	2.7	2.3	6,653	
シュッピン	3.5	4.9	6,051	
ネクステージ	1.8	8.5	9,248	
ジョイフル本田	14.6	11.7	40,657	
鳥貴族	2.3	3	8,823	
キリン堂ホールディングス	3	3	5,625	
ホットランド	4.3	4.8	6,340	
すかいらく	38.8	49.5	73,557	
綿半ホールディングス	3.7	3	11,640	
ヨシックス	1	1.3	4,914	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	29.6	26.6	29,818	
ブックオフコーポレーション	5.6	4.5	3,793	
ゴルフダイジェスト・オンライン	3.7	3.2	3,209	
BEENOS	1.1	1.3	2,076	
あさひ	6.8	5.9	7,793	
日本調剤	3.2	2.8	9,688	
コスモス薬品	4.6	4	79,800	
トーエル	4.4	4	4,044	
一六堂	3	2.4	1,080	
オンリー	1.8	1.3	1,166	
セブン&アイ・ホールディングス	378.4	334.3	1,504,350	
薬王堂	4.6	3.5	12,180	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	24.2	21.5	26,982	
ツルハホールディングス	18.1	17.1	265,221	
サンマルクホールディングス	5.8	5.8	18,386	
フェリシモ	2.7	2.3	2,914	
トリドールホールディングス	11.1	9.8	34,447	
TOKYO BASE	—	1.7	7,250	
サツドラホールディングス	1.2	1.3	2,581	
ダイユー・リックホールディングス	2.7	3.8	5,023	
パロックジャパンリミテッド	5.5	6.5	5,882	
クスリのアオキホールディングス	7.2	6.3	38,241	
スシローグローバルホールディングス	—	7.7	35,189	
LIXILピバ	—	7.5	16,035	
メディカルシステムネットワーク	10.5	9.3	5,412	
総合メディカル	4.4	3.5	21,000	
はるやまホールディングス	3.5	3.5	3,776	
ノジマ	10.5	13.9	35,500	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
カッパ・クリエイト	12.5	10.2	13,005	
ライトオン	6.8	6.8	6,262	
良品計画	12	10.6	379,480	
三城ホールディングス	10.5	10.2	5,365	
アドヴァン	9.2	8.1	8,918	
アルビス	2.4	1.8	5,427	
コナカ	11	10	5,960	
ハウス オブ ローゼ	1.2	1	1,766	
G-7ホールディングス	2.6	2.3	5,540	
イオン北海道	8.1	7.1	5,843	
コジマ	13.8	14.1	4,977	
ヒマラヤ	3	2.4	3,050	
コーナン商事	12.7	11.3	28,894	
エコス	3.6	3.3	4,296	
ワタミ	10.9	9.5	12,407	
マルシェ	2.6	2.6	2,124	
ドンキホーテホールディングス	58.5	51.7	305,547	
西松屋チェーン	16	17.4	21,663	
ゼンショーホールディングス	46.8	41.4	92,653	
幸楽苑ホールディングス	5.8	5.3	9,900	
ハークスレイ	1.9	1.5	1,669	
サイゼリヤ	14.8	11.8	36,698	
V Tホールディングス	30.6	27.1	15,013	
魚力	2.7	2	2,362	
ポブラ	3.4	2.5	2,185	
フジ・コーポレーション	1.4	1.4	3,501	
ユナイテッドアローズ	12.1	9.9	41,431	
ハイデイ日高	8.2	8.8	29,084	
京都きもの友禅	5.8	5.4	4,255	
コロワイド	30	26.5	64,951	
ピーシーデポコーポレーション	12.3	12	8,976	
壱番屋	7.2	5.6	25,368	
トップカルチャー	3.4	2.2	1,073	
P L A N T	2.1	1.9	2,627	
スギホールディングス	19.8	17.5	101,325	
ヴィア・ホールディングス	4.2	7.5	5,317	
スクロール	13.6	12.7	5,740	
ヨンドシーホールディングス	7	8.2	22,082	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	39.6	25.5	200,430	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
本曽路	11.1	9.8	26,793	
SRSホールディングス	10.5	9.2	8,749	
千趣会	16.2	15.4	9,424	
タカキュー	7.8	7.8	1,786	
ケーヨー	14.2	15	9,390	
上新電機	21	9.4	35,814	
日本瓦斯	16.6	14.7	66,223	
ベスト電器	29.4	—	—	
ロイヤルホールディングス	14.9	14.1	39,832	
東天紅	10	0.6	1,132	
いなげや	9.9	9.1	16,443	
島忠	23.4	19.3	67,743	
チョダ	10.6	9.4	26,019	
ライフコーポレーション	6.8	6	17,412	
リンガーハット	10.3	9.8	24,049	
さが美グループホールディングス	10	8	976	
MrMaxHD	11.3	10.2	7,833	
テンアライド	9.2	8.2	3,936	
AOKIホールディングス	17.8	15.7	26,297	
オークワ	13	11	11,968	
コメリ	13.9	12.3	37,146	
青山商事	18.9	15.3	67,779	
しまむら	10.5	9.3	122,016	
はせがわ	5	3.9	1,903	
高島屋	152	125	138,500	
松屋	19.8	16.3	25,281	
エイチ・ツー・オー リテイリング	46.3	37.8	79,871	
近鉄百貨店	34	3	11,880	
丸栄	26	—	—	
バルコ	8.2	7.7	11,396	
丸井グループ	95.1	76.4	154,175	
アクシアル リテイリング	7	6.7	28,709	
イオン	372	306.9	577,739	
イズミ	17.9	14.4	103,680	
東武ストア	1.1	1.1	3,388	
平和堂	18.2	16.2	38,944	
フジ	10	9.1	20,529	
ヤオコー	10.2	9	53,730	
ゼビオホールディングス	12.3	10.9	23,609	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ケーズホールディングス	41.7	33.8	100,893
O l y m p i cグループ	5.2	5	2,975
日産東京販売ホールディングス	13.5	11.5	4,623
G e n k y D r u g S t o r e s	—	3.1	10,478
アインホールディングス	11.8	10.7	70,406
元気寿司	2.3	2.1	5,812
ヤマダ電機	302.4	267.3	181,764
アークランドサカモト	15.1	13.3	23,913
ニトリホールディングス	39.1	31.7	558,712
グルメ杵屋	6	6	6,948
愛眼	8	6.7	3,269
ケーユーホールディングス	4.1	4	4,416
吉野家ホールディングス	31.4	26.1	51,182
松屋フーズ	4.4	3.8	14,725
サガミチェーン	11.1	10.6	14,776
関西スーパーマーケット	7.6	6.2	7,080
王将フードサービス	6.5	5.8	29,174
プレナス	10.1	8.9	18,957
ミニストップ	6.6	6	13,176
アークス	16.8	14.9	39,663
パローホールディングス	19.5	18.5	55,500
藤久	0.8	0.7	1,173
ベルク	4	3.5	21,665
大庄	4.9	4.3	7,430
ファーストリテイリング	15.1	13.3	568,043
サンドラッグ	17.2	33.8	165,789
サックスパー ホールディングス	8.6	7.6	8,770
ヤマザワ	1.8	1.5	2,601
やまや	1.7	1.7	4,834
バルーナ	22.5	19.5	25,057
銀行業 (7.4%)			
島根銀行	2	1.9	2,682
じもとホールディングス	65.9	54.1	10,116
めぶきフィナンシャルグループ	436	415.1	185,134
東京ＴＹフィナンシャルグループ	13.1	10.8	30,358
九州フィナンシャルグループ	148.3	131.1	81,282
ゆうちょ銀行	256	226.3	331,982
富山第一銀行	22.7	20.2	10,261
コンソルディア・フィナンシャルグループ	591.9	485.7	299,676

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
西日本フィナンシャルホールディングス	61.3	54.2	72,411	
新生銀行	861	69.2	120,477	
あおぞら銀行	572	47.6	213,486	
三菱ＵＦＪ フィナンシャル・グループ	6,851.2	5,643.6	4,427,968	
りそなホールディングス	1,057.7	876.6	548,663	
三井住友トラスト・ホールディングス	188.8	157	692,684	
三井住友フィナンシャルグループ	724	604.6	2,885,755	
第四銀行	111	9.7	47,918	
北越銀行	9.7	8	19,320	
千葉銀行	349	286	257,114	
群馬銀行	200.9	162.2	107,538	
武蔵野銀行	14.3	12.6	45,234	
千葉興業銀行	25	22.5	11,250	
筑波銀行	38.3	34.6	12,871	
七十七銀行	142	25.1	68,246	
青森銀行	71	6.2	21,142	
秋田銀行	58	5	14,615	
山形銀行	51	9	21,672	
岩手銀行	5.9	5.6	24,052	
東邦銀行	80	70.4	28,019	
東北銀行	46	4.2	6,207	
みちのく銀行	48	4.8	8,673	
ふくおかフィナンシャルグループ	367	324	185,652	
静岡銀行	246	211	233,366	
十六銀行	121	10.7	31,436	
スルガ銀行	92.4	81.7	158,334	
八十二銀行	174.5	144.6	93,122	
山梨中央銀行	56	50	21,900	
大垣共立銀行	121	12.7	35,788	
福井銀行	78	6.9	18,119	
北國銀行	95	9	38,925	
清水銀行	3.1	2.8	8,414	
富山銀行	1.8	1.6	6,384	
滋賀銀行	85	75	42,150	
南都銀行	8.7	9.4	28,529	
百五銀行	80	75.9	40,227	
京都銀行	162	30.5	183,915	
紀陽銀行	34	29.8	53,073	
三重銀行	4.1	3.7	8,794	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ほくほくフィナンシャルグループ	60.1	53.2	83,364	
広島銀行	267	117.9	100,332	
山陰合同銀行	54.3	46.9	48,447	
中国銀行	64.1	55.2	75,072	
鳥取銀行	2.9	2.6	4,570	
伊予銀行	96.7	114	99,522	
百十四銀行	99	85	30,260	
四国銀行	70	12.1	18,730	
阿波銀行	77	64	42,432	
大分銀行	52	4.6	19,136	
宮崎銀行	60	5.3	18,629	
佐賀銀行	55	4.8	12,220	
十八銀行	56	50	14,150	
沖縄銀行	8.8	7.7	33,880	
琉球銀行	18.4	15.7	25,591	
セブン銀行	338.9	299.6	112,949	
みずほフィナンシャルグループ	12,275.4	10,853.1	2,187,984	
高知銀行	35	3.1	4,228	
山口フィナンシャルグループ	85	75	96,375	
長野銀行	2.9	2.6	4,919	
名古屋銀行	7.5	6.5	26,227	
北洋銀行	147.6	121.1	44,928	
愛知銀行	3	2.7	14,634	
第三銀行	5.1	4.6	7,682	
中京銀行	3.8	3.2	7,443	
大光銀行	32	2.8	6,708	
愛媛銀行	10.7	11.2	14,403	
トマト銀行	3.6	2.8	4,312	
みなと銀行	8.2	7.2	15,076	
京葉銀行	73	71	35,216	
関西アーバン銀行	12.5	10.9	15,488	
栃木銀行	49.6	41.3	17,635	
北日本銀行	2.8	2.6	7,930	
東和銀行	170	14.1	19,401	
福島銀行	104	7.5	6,052	
大東銀行	49	3.9	5,577	
トモニホールディングス	74.3	65.9	32,027	
フィデアホールディングス	87.1	78.7	15,661	
池田泉州ホールディングス	95.3	84.7	35,828	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
証券、商品先物取引業 (1.0%)			
F P G	32.4	27.9	39,952
マーキュリアインベストメント	—	1.6	1,982
S B I ホールディングス	102.2	90.3	227,465
ジャフコ	15.1	11.5	62,445
大和証券グループ本社	846	684	495,763
野村ホールディングス	1,848.4	1,374.3	914,596
岡三証券グループ	77	68	47,396
丸三証券	29	25.9	27,065
東洋証券	33	29	9,019
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	103.8	88.4	69,570
光世証券	24	2.2	3,143
水戸証券	28.9	25.3	9,917
いちよし証券	20.6	17	21,981
松井証券	51.1	38.8	42,098
だいがく証券ビジネス	4.6	4.1	2,738
マネックスグループ	97.9	85	32,980
カブドットコム証券	68.7	52.4	19,964
極東証券	12.2	10.9	17,080
岩井コスモホールディングス	8.5	8.2	11,348
藍澤證券	16.8	15.1	12,095
マネーパートナーズグループ	11.8	10.5	4,084
保険業 (2.2%)			
かんぽ生命保険	34.1	30.2	84,167
S O M P O ホールディングス	189	156.7	650,775
アニコム ホールディングス	6.2	5.5	19,415
MS&ADインシュアランスグループホール	270.2	208.9	709,633
ソニーフィナンシャルホールディングス	86.6	65.6	129,494
第一生命ホールディングス	545.2	451.9	991,468
東京海上ホールディングス	366.3	300.9	1,515,934
アドバンテッジリスクマネジメント	—	1.1	1,525
T & D ホールディングス	329.5	247	446,205
アドバンスクリエイト	2.2	1.9	3,752
その他金融業 (1.2%)			
全国保証	25.5	22.5	108,000
イントラスト	—	0.6	1,034
アルヒ	—	6.8	9,880
クレディセゾン	68.6	60.6	113,685
アクリーティブ	7.5	4.7	1,640

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
芙蓉総合リース	10.4	9.1	65,975
興銀リース	17	14.9	41,511
東京センチュリー	18.2	16.1	98,854
日本証券金融	39.8	32.9	21,911
アイフル	153	135.5	50,948
ポケットカード	7.2	—	—
リコーリース	7.2	6.3	22,585
イオンフィナンシャルサービス	57.7	56.7	141,693
アコム	184.2	160.6	76,445
ジャックス	50	9.8	24,931
オリエントコーポレーション	197.6	177.3	30,672
日立キャピタル	21.3	22	62,744
アプラスフィナンシャル	46.4	43.8	4,686
オリックス	640.3	532.8	1,019,779
三菱ＵＦＪリース	229.3	202.7	137,227
九州リースサービス	—	3.4	2,944
日本取引所グループ	281.1	234.7	439,827
イー・ギャランティ	2.8	2.2	8,371
アサックス	1.5	0.9	1,719
NECキャピタルソリューション	3.8	3.3	7,062
不動産業 (2.4%)			
いちご	86.6	114.5	52,441
日本駐車場開発	110.7	97.7	18,074
ヒューリック	188.6	166.7	204,040
三栄建築設計	3.8	3.3	7,151
スター・マイカ	—	2.9	5,463
野村不動産ホールディングス	60	53.1	139,122
三重交通グループホールディングス	16.4	16.5	8,580
サムティ	7.5	6.9	13,006
ディア・ライフ	6.4	8.1	4,479
エー・ディー・ワークス	93.5	113.6	4,771
日本商業開発	5.1	4.7	8,962
プレサンスコーポレーション	14.2	10.9	18,061
ユニゾホールディングス	7.5	9.4	28,200
T H E グローバル社	4.1	4	3,760
日本管理センター	6.6	5.4	9,547
サンセイランディック	2.2	2.5	3,580
エストラスト	2	1.3	1,335
フージャースホールディングス	12.1	19.4	15,054

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
オープンハウス	13.1	13	87,100	
東急不動産ホールディングス	218.7	193.4	156,460	
飯田グループホールディングス	75.4	66.6	132,933	
イーランド	—	1	1,250	
ムゲンエステート	3.5	5.1	6,742	
ファーストブラザーズ	1	2.3	3,289	
ハウスドゥ	0.8	1.3	3,607	
シーアールイー	1.4	1.4	2,308	
ケイアイスター不動産	1.2	2.9	8,050	
パーク２４	45.9	44.3	115,268	
バラカ	2.7	2.6	6,305	
三井不動産	479	398.9	1,035,344	
三菱地所	672	594.6	1,131,523	
平和不動産	17.3	14.3	28,743	
東京建物	104.9	87.3	151,640	
ダイビル	23.5	20.7	27,841	
京阪神ビルディング	15.2	13.4	11,684	
住友不動産	217	192	756,480	
大京	169	12.9	28,818	
テオーシー	35.2	27.7	23,545	
東京楽天地	15	1.3	6,708	
レオパレス２１	114.1	95.3	78,146	
スターツコーポレーション	9.3	10.9	31,348	
フジ住宅	11.5	10.4	9,162	
空港施設	11.2	8.8	5,588	
明和地所	—	4.5	3,708	
住友不動産販売	8.2	—	—	
ゴールドクレスト	8.3	6.4	14,304	
日本エスリード	3.7	3.2	7,043	
日神不動産	10.9	10.6	8,586	
日本エスコン	12.6	14.3	13,899	
タカラレーベン	39.8	37.8	18,068	
サンヨーハウジング名古屋	4.9	4.6	5,694	
イオンモール	58.2	51.5	114,484	
ファースト住建	3.5	3.1	5,456	
カチタス	—	8.2	26,240	
トーセイ	12.4	9.8	13,102	
穴吹興産	1	0.9	2,817	
エヌ・ティ・ティ都市開発	56.2	49.7	65,604	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サンフロンティア不動産	10.1	8.9	10,955
エフ・ジェー・ネクスト	8.3	6.3	5,581
インテリックス	2.2	2.3	2,589
グランディハウス	8.2	7.5	3,630
日本空港ビルデング	28.8	23.4	94,536
サービス業 (4.3%)			
日本工営	6.4	5.2	15,236
L I F U L L	23.8	26.8	28,354
ジェイエイシーリクルートメント	6	6.2	13,398
日本M&Aセンター	27.6	26.8	179,560
メンバーズ	—	1.9	1,601
中広	1.1	0.9	654
タケエイ	8.6	8.2	10,471
トラスト・テック	4	3.4	10,710
コシダカホールディングス	3.3	4.1	27,429
パソナグループ	7.3	7.3	17,308
C D S	2.4	2.1	2,795
リンクアンドモチベーション	23.1	14.3	14,914
G C A	8.7	8.9	8,597
エス・エム・エス	13.6	15.3	67,549
パーソルホールディングス	74	71.4	198,135
リニカル	5.7	5	7,015
クックパッド	21.4	24.3	14,823
エスクリ	3.6	2.8	2,741
アイ・ケイ・ケイ	4.2	4.5	3,325
学情	4.1	3.6	5,760
スタジオアリス	4	3.8	10,309
シミックホールディングス	5	4.3	11,687
N J S	2.2	2	3,268
総合警備保障	34.8	30.8	161,084
カカココム	68.3	59.5	117,810
セントケア・ホールディング	0.8	3.3	2,418
サイネックス	0.4	1.2	1,027
ルネサンス	4.9	3.8	6,733
ディップ	12.3	10.9	36,733
オプトホールディング	7	5.5	6,341
新日本科学	11	9.7	5,044
ツクイ	23.3	18.3	15,408
キャリアデザインセンター	2.2	1.8	3,933

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
エムスリー	82.9	81.4	358,974	
ツカダ・グローバルホールディング	7.2	6	3,678	
プラス	—	0.5	515	
アウトソーシング	5.5	23.1	46,708	
ウェルネット	7.3	7.8	9,063	
ワールドホールディングス	2.2	2.6	10,322	
ディー・エヌ・エー	42.9	41.7	80,731	
博報堂D Yホールディングス	132.6	107.5	171,677	
ぐるなび	14	12.4	17,657	
エスアールジータカミヤ	10.7	9.4	6,420	
ジャパンベストレスキューシステム	13.6	9.8	7,938	
ファンコミュニケーションズ	24.4	21.7	16,383	
ライク	1.8	3.1	6,441	
ビジネス・ブレイクスルー	2	4	1,932	
WDBホールディングス	3.5	3.6	15,012	
ティア	4.6	4.2	4,498	
CDG	—	0.7	1,222	
バリューコマース	8.8	7	9,541	
インフォマート	40.7	39.3	35,016	
J Pホールディングス	28.3	25	7,825	
E P Sホールディングス	12	11.6	27,190	
レグス	2.4	2.1	1,915	
プレステージ・インターナショナル	13.7	16.1	22,346	
アミューズ	5.3	5.2	19,526	
ドリームインキュベータ	3	2.6	7,134	
クイック	5	4.9	10,162	
TAC	7.1	5.7	1,806	
ケネディクス	121.3	102.5	72,877	
電通	106.6	94.3	470,085	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4.6	3.7	3,500	
びあ	3	2.6	14,300	
イオンファンタジー	2.9	2.5	12,487	
シーティーエス	2.7	8	6,296	
ネクシィーズグループ	3.5	3	5,172	
みらかホールディングス	24.4	23.1	98,752	
アルプス技研	3.8	6.8	15,347	
ダイオーズ	1.6	1.5	2,020	
日本空調サービス	9.1	8.2	6,387	
オリエンタルランド	103.4	91.4	974,781	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ダスキン	24.5	20.8	55,161	
明光ネットワークジャパン	12	9.8	12,612	
ファルコホールディングス	4.5	4.1	7,236	
秀英予備校	2.1	1.9	940	
ラウンドワン	30.2	24.1	43,283	
リゾートトラスト	37	32.7	79,101	
ビー・エム・エル	12.6	9.9	26,175	
ワタバウエディング	1.8	1.5	907	
りらいあコミュニケーションズ	16	12.3	16,186	
リソー教育	16.4	13.3	10,892	
早稲田アカデミー	1.3	1.1	1,910	
ユー・エス・エス	115.8	94.5	209,695	
東京個別指導学院	3.2	2.8	3,500	
サイバーエージェント	50.3	50.9	229,559	
楽天	488.9	396.8	372,555	
クリーク・アンド・リバー社	3.5	4.1	4,050	
テー・オー・ダブリュー	7.7	7.4	6,815	
セントラルスポーツ	3.2	2.9	11,542	
フルキャストホールディングス	9.9	6.8	17,251	
リソルホールディングス	10	0.8	3,484	
テクノプロ・ホールディングス	15.6	13.8	85,146	
アトラ	1.2	1.4	1,124	
インターワークス	2.1	1.8	1,994	
Keeper 技研	1.1	2.6	3,647	
ファーストロジック	0.5	1.2	1,119	
三機サービス	—	0.9	1,800	
Gunosy	—	3.5	9,117	
デザインワン・ジャパン	0.7	1.5	1,870	
イー・ガーディアン	3.2	3.9	12,207	
リブセンス	7.1	5.6	3,068	
ジャパンマテリアル	7.1	7	28,210	
ベクトル	7.9	9.3	20,236	
ウチヤマホールディングス	4.6	3.9	2,433	
ライクキッズネクスト	0.9	0.8	1,603	
キャリアリンク	2.4	2.8	1,607	
IBJ	7.8	6.2	6,838	
アサンテ	3.5	2.8	5,264	
N・フィールド	4.7	4.4	9,702	
バリューHR	0.4	1.8	4,057	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
M&Aキャピタルパートナーズ	1.3	1.6	12,448	
ライドオンエクスプレスホールディングス	2.5	3.3	3,461	
ER I ホールディングス	2.8	2.6	2,519	
アビスト	1.5	1.1	5,500	
シグマクシス	—	3.1	5,009	
ウィルグループ	4	3.4	5,613	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1.7	10.8	5,194	
日本ビューホテル	2	2.4	3,604	
リクルートホールディングス	209	597	1,582,945	
エラン	1.4	2	3,060	
土木管理総合試験所	1.1	2.4	1,456	
日本郵政	249.7	439.1	575,660	
ベルシステム24ホールディングス	14.7	13	19,409	
鎌倉新書	—	1.1	2,490	
一蔵	0.4	1	1,076	
L I T A L I C O	—	1.4	2,366	
グローバルグループ	—	0.9	1,309	
エボラブルアジア	—	1.6	3,302	
ストライク	—	0.8	4,904	
ゾラスト	4.6	4.7	12,685	
セラク	—	1.3	971	
インソース	—	0.9	2,938	
キャリアインデックス	—	0.8	1,592	
MS-J a p a n	—	0.6	3,744	
船場	—	1.1	1,433	
リログループ	3.6	42.3	124,700	
東祥	2.1	4.8	18,288	
エイチ・アイ・エス	15.6	12.1	48,037	
ラックランド	1.7	1.5	3,196	
共立メンテナンス	7.8	13.8	62,721	
イチネンホールディングス	10.1	8.6	13,226	
建設技術研究所	6	5.2	6,905	
スペース	4.9	4.8	6,576	
長大	—	2.3	1,879	
燦ホールディングス	1.7	1.8	4,721	
スバル興業	7	0.6	4,074	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
東京テアトル	41	3.4	4,974	
タナベ経営	2	1.4	2,573	
ナガワ	1.8	1.5	6,420	
よみうりランド	20	1.7	8,100	
東京都競馬	66	5.8	21,721	
常磐興産	3.4	3.1	5,930	
カナモト	13.3	11.8	39,884	
東京ドーム	38.3	31.6	31,126	
西尾レントオール	7.7	6.8	23,732	
トランス・コスモス	11.1	8.6	24,750	
乃村工藝社	20.5	18.1	39,349	
藤田観光	32	3.1	10,121	
K N T - C T ホールディングス	56	4.9	8,893	
日本管財	8.1	8.3	17,363	
トーカイ	4.2	7.4	19,373	
白洋舎	0.9	0.9	3,046	
セコム	99.5	82.1	653,680	
セントラル警備保障	4.3	3.8	9,541	
丹青社	16.5	16	16,864	
メイテック	11.5	9	54,900	
アサツー ディ・ケイ	15.6	3.1	11,299	
応用地質	9.1	8.7	12,693	
船井総研ホールディングス	12.3	16.1	35,194	
進学会ホールディングス	3.8	3.4	2,029	
オオバ	7.6	6.7	4,428	
いであ	—	1.5	1,675	
学究社	2.6	2	3,252	
ベネッセホールディングス	32.1	28.3	112,634	
イオンディライト	10.7	9.5	36,812	
ナック	5.9	5.7	5,426	
ニチイ学館	16.9	14.9	18,699	
ダイセキ	16.7	13	39,650	
ステップ	3.2	2.8	5,149	
合 計	株 数 ・ 金 額	137,918	97,775	204,125,815
	銘柄数<比率>	1,968	2,030	<99.0%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期	末
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 2,133	百万円 —

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2018年2月20日現在)

区 分	当 期	末
	数	量
貸付有価証券<株式>総株数 (モルガン・スタンレーMUFG証券)		株 25,704,900 (12,949,700)

(注) ()内は利害関係人との貸付状況です。

○投資信託財産の構成

(2018年2月20日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
株式	千円 204,125,815	% 78.0
コール・ローン等、その他	57,508,055	22.0
投資信託財産総額	261,633,870	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年2月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	261,627,909,000
コール・ローン等	57,013,534,937
株式(評価額)	204,125,815,630
未収入金	41,102,337
未収配当金	228,703,095
その他未収収益	69,818,001
差入委託証拠金	148,935,000
(B) 負債	55,361,914,260
未払金	81,236,420
未払解約金	32,271,877
未払利息	82,802
受入担保金	55,248,323,161
(C) 純資産総額(A－B)	206,265,994,740
元本	143,491,492,903
次期繰越損益金	62,774,501,837
(D) 受益権総口数	143,491,492,903口
1万口当たり基準価額(C／D)	14,375円

<注記事項>

- ①期首元本額 169,558,946,817円
 期中追加設定元本額 17,650,281,098円
 期中一部解約元本額 43,717,735,012円
 また、1口当たり純資産額は、期末14,375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 トピックスインデックスオープン	9,972,979,331円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定型)	960,974,208円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)	3,671,327,125円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(成長型)	3,540,026,357円
三菱ＵＦＪ トピックスオープン(確定拠出年金)	4,936,688,994円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	8,146,833,260円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	39,581,845,049円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	37,889,693,513円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	205,344,037円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(成長型)	425,457,523円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,226,646,701円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式15)	801,848円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式40)	1,683,263円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式65)	2,577,982円
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスファンドＶＡ(適格機関投資家限定)	32,928,060,182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)	553,530円
合計	143,491,492,903円

○損益の状況 (2017年2月21日～2018年2月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,336,282,511
受取配当金	3,741,758,875
受取利息	340,615
その他収益金	615,894,898
支払利息	△ 21,711,877
(B) 有価証券売買損益	27,181,396,496
売買益	31,932,873,057
売買損	△ 4,751,476,561
(C) 先物取引等取引損益	368,144,000
取引益	640,131,360
取引損	△ 271,987,360
(D) 保管費用等	△ 1,440,804
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	31,884,382,203
(F) 前期繰越損益金	39,947,822,139
(G) 追加信託差損益金	6,080,415,166
(H) 解約差損益金	△15,138,117,671
(I) 計(E+F+G+H)	62,774,501,837
次期繰越損益金(I)	62,774,501,837

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

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

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

〔お 知 ら せ 〕

当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。

(変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)

(2018年1月1日)

三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド

《第18期》決算日2018年5月21日

〔計算期間：2017年5月23日～2018年5月21日〕

「三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド」は、5月21日に第18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18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 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	中 率	期 騰 落	中 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
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
18期(2018年5月21日)	23,482	13.4	751,162.81	13.2	95.2	2.5	2.2	106,222

- (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 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2017年 5 月22日	円	%	—	%	%	%	%
5 月末	20,708	—	663,775.10	—	95.7	1.7	2.5
6 月末	20,772	0.3	665,714.51	0.3	95.5	1.8	2.5
7 月末	21,096	1.9	675,698.46	1.8	94.4	2.7	2.5
8 月末	21,256	2.6	680,971.06	2.6	94.0	2.9	2.4
9 月末	21,177	2.3	678,408.11	2.2	94.6	3.4	2.5
10 月末	22,161	7.0	709,487.11	6.9	93.2	3.2	2.4
11 月末	22,674	9.5	725,655.02	9.3	94.4	3.0	2.4
12 月末	22,828	10.2	730,714.80	10.1	94.7	3.0	2.4
2018年 1 月末	23,536	13.7	753,088.61	13.5	93.7	2.6	2.3
2 月末	23,800	14.9	761,574.60	14.7	94.3	2.8	2.2
3 月末	22,726	9.7	727,288.73	9.6	94.5	5.0	2.1
4 月末	21,761	5.1	696,210.69	4.9	95.0	4.6	2.3
(期 末) 2018年 5 月21日	22,736	9.8	727,358.26	9.6	93.6	3.2	2.2
	23,482	13.4	751,162.81	13.2	95.2	2.5	2.2

(注) 騰落率は期首比。

(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。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ13.4%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率
(13.2%)を0.2%上回りました。

基準価額等の推移



(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内容や税制改革などが好感され、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0.4%の円高・米ドル安、4.6%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13.2%の上昇となったため、カイ離は0.2%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	△0.1%程度	△0.1%程度	0.4%程度	0.2%程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は△0.1%程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△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。

その他の要因としては、配当・利子収入、為替効果、売買コスト、保管料等による影響などが含まれます。

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。

◎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

(2017年5月23日～2018年5月21日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 1	% 0.003	(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)	(0.002)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.004	(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)	(0.004)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	9	0.041	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保 管 費 用)	(9)	(0.040)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	11	0.048	
期中の平均基準価額は、22,210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

(2017年5月23日～2018年5月21日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 3,583 (282)	千アメリカドル 25,825 (△ 16)	百株 14,083 (376)	千アメリカドル 90,758 (2,792)
	カナダ	727 (△ 96)	千カナダドル 2,402 (ー)	2,008 (21)	千カナダドル 6,728 (45)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	438 (50)	2,877 (△ 173)	887	5,083
	イタリア	1,202 (△ 1,493)	636 (ー)	2,137	938
	フランス	475 (10)	2,110 (△ 31)	992	4,666
	オランダ	225	565	804	1,830
	スペイン	947 (11,315)	776 (82)	13,611 (1,772)	2,082 (27)
	ベルギー	20 (25)	119 (ー)	71	535
	オーストリア	14 (ー)	39 (△ 8)	29	114
	ルクセンブルク	51	127	74	178
	フィンランド	87 (69)	161 (ー)	312	460
	アイルランド	248 (257)	159 (185)	405 (7,735)	177 (185)
	ボルトガル	97	45	177	107
	イギリス	ー	ー	62	204
	イギリス	6,158 (48,613)	千イギリスポンド 3,026 (△ 32)	11,475 (56,463)	千イギリスポンド 7,369 (32)
	スイス	266 (602)	千スイスフラン 1,402 (△ 148)	1,265	千スイスフラン 6,260
	スウェーデン	233 (620)	千スウェーデンクローネ 3,237 (ー)	1,109	千スウェーデンクローネ 13,812
	ノルウェー	30 (ー)	千ノルウェークローネ 502 (△ 99)	212	千ノルウェークローネ 2,879
	デンマーク	116	千デンマーククローネ 2,979	443	千デンマーククローネ 7,976

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	オーストラリア	百株 951 (△ 8)	千オーストラリアドル 1,380 (—)	百株 3,372 (—)	千オーストラリアドル 4,475 (9)
	ニュージーランド	138	千ニュージーランドドル 181	432	千ニュージーランドドル 201
	香港	2,021 (962)	千香港ドル 4,510 (—)	3,529	千香港ドル 12,674
	シンガポール	574	千シンガポールドル 236	1,898 (730)	千シンガポールドル 849 (218)
	イスラエル	188	千イスラエルシェケル 198	295	千イスラエルシェケル 509

(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	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	HCP INC	—	—	1	49
	MACERICH CO/THE	0.577	36	0.619	34
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.3	35	—	—
	PROLOGIS INC	—	—	1	92
	CAMDEN PROPERTY TRUST	—	—	0.215	18
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	—	—	0.2	7
	DIGITAL REALTY TRUST INC	1	174	0.592	66
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	—	—	0.195	50
	EXTRA SPACE STORAGE INC	—	—	0.592	49
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.243	27	0.369	45
	WELLTOWER INC	0.518	27	1	77
	BOSTON PROPERTIES INC	—	—	0.529	64
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	—	0.361	37
	REALTY INCOME CORP	0.903	47	0.843	46
	REGENCY CENTERS CORP	—	—	0.701	46
	SL GREEN REALTY CORP	—	—	0.489	49
	UDR INC	—	—	1	48
	VENTAS INC	0.559	27	1	74
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	2	27	3	36
	WEYERHAEUSER CO	0.797	27	2	82
	AMERICAN TOWER CORP	0.472	66	1	230
	AGNC INVESTMENT CORP	1	37	1	40
	VEREIT INC	—	—	2	19
	DUKE REALTY CORP	1	27	1	47
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1	27	3	61
	IRON MOUNTAIN INC	0.183	6	0.264	9
	EQUINIX INC	0.037	16	0.163	73
	CROWN CASTLE INTL CORP	1	152	1	162
	EQUITY RESIDENTIAL	0.495	27	1	76
	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	—	—	0.6	8
	INVITATION HOMES INC	7	184	—	—
	JBG SMITH PROPERTIES	—	—	2	80
		(2)	(—)		
	GGP INC	0.687	15	2	64
	HOST HOTELS & RESORTS INC	—	—	2	49
	LIBERTY PROPERTY TRUST	—	—	0.766	33
	PUBLIC STORAGE	0.079	17	0.371	78
	SIMON PROPERTY GROUP INC	0.18	27	1	186
	VORNADO REALTY TRUST	—	—	0.655	53
	KIMCO REALTY CORP	0.399	6	0.486	9

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	0.176	27	0.43	78
	小計	24 (2)	1,070 (-)	44	2,342
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	—	—	0.4	9
	小計	—	—	0.4	9
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	GECINA SA	0.266	36	0.195	29
	GECINA SA-RTS	— (1)	— (-)	1	3
	KLEPIERRE	—	—	1	40
	UNIBAIL-RODAMCO SE	—	—	0.357	77
	FONCIERE DES REGIONS	0.256	23	0.319	27
	ICADE	—	—	0.144	10
	小計	0.522 (1)	59 (-)	3	188
	ユ ー ロ 計	0.522 (1)	59 (-)	3	188
	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC	0.799	5	4	26
	HAMMERSON PLC	4	19	4	25
	LAND SECURITIES GROUP PLC	— (△ 1)	— (△ 11)	2	21
	INTU PROPERTIES PLC	—	—	26	52
	SEGRO PLC	7	40	4	21
	小計	12 (△ 1)	64 (△ 11)	41	149
	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	—	—	8	22
	SCENTRE GROUP	—	—	13	55
	GPT GROUP	—	—	4	23
	MIRVAC GROUP	31	72	39	87
	STOCKLAND	8	36	15	64
	WESTFIELD CORP	—	—	5	45
	DEXUS	—	—	1	13
	GOODMAN GROUP	4	36	5	47
	小計	45	144	93	359
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	—	—	8	494
	小計	—	—	8	494
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	SUNTEC REIT	— (-)	— (△ 0.8262)	5	9

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	— (—)	— (△ 0.0696)	5	9
	CAPITACOMMERCIAL TRUST-RTS	— (9)	— (—)	9	2
	CAPITALAND MALL TRUST	18	36	23	47
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	— (—)	— (△0.61334)	17	45
	小 計	18 (9)	36 (△ 1)	61	114

(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 35,024	百万円 34,548	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

(2017年5月23日～2018年5月21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	20,743,938千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	99,255,906千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.20

(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

(2017年5月23日～2018年5月21日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 11,545	百万円 2,447	% 21.2	百万円 24,707	百万円 10,970	% 44.4

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

○組入資産の明細

(2018年5月21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	
AMERICAN EXPRESS CO	218	187	1,890	209,974	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	484	437	2,702	300,258	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	89	81	524	58,320	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	15	13	228	25,338	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	126	111	1,438	159,832	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	20	12	58	6,509	小売
AES CORP	178	174	208	23,182	公益事業
AFLAC INC	112	196	893	99,274	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	288	226	1,250	138,969	保険
APACHE CORP	104	95	417	46,350	エネルギー
ADVANCED MICRO DEVICES	223	201	262	29,115	半導体・半導体製造装置
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	14	12	256	28,473	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	174	154	2,402	266,909	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	57	55	940	104,494	素材
ANTHEM INC	73	64	1,489	165,497	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	155	136	965	107,230	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	380	345	1,051	116,787	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	135	121	858	95,409	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	165	142	5,002	555,735	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	59	66	1,499	166,600	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	81	66	520	57,867	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	469	411	2,171	241,196	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	33	30	1,631	181,257	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,143	1,026	4,902	544,567	電気通信サービス
CR BARD INC	20	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	94	82	313	34,777	素材
BAKER HUGHES INC	111	—	—	—	エネルギー
ALLSTATE CORP	102	89	848	94,237	保険
AVERY DENNISON CORP	24	21	232	25,779	素材
CHUBB LTD	130	117	1,563	173,702	保険
ANALOG DEVICES INC	102	93	889	98,804	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	7	7	459	51,041	小売
CVS HEALTH CORP	299	255	1,655	183,962	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	263	218	604	67,104	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	1,002	873	9,706	1,078,324	銀行
CIGNA CORP	71	62	1,106	122,924	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	164	149	2,331	259,000	資本財
COCA-COLA CO/THE	1,148	1,018	4,298	477,475	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	135	122	1,179	130,980	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	53	43	147	16,429	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	263	214	1,364	151,613	運輸
CHEVRON CORP	529	478	6,116	679,446	エネルギー
TAPESTRY INC	78	74	330	36,669	耐久消費財・アパレル
ROCKWELL COLLINS INC	44	41	560	62,250	資本財
CONOCOPHILLIPS	348	302	2,105	233,937	エネルギー
CME GROUP INC	94	85	1,370	152,259	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	
CARDINAL HEALTH INC		88	80	429	47,709	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO		237	210	1,307	145,276	家庭用品・ パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC		176	162	1,028	114,244	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE		315	—	—	—	素材
DEVON ENERGY CORP		129	124	523	58,168	エネルギー
DEERE & CO		74	68	1,067	118,622	資本財
DANAHER CORP		174	157	1,594	177,097	ヘルスケア機器・ サービス
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS		244	—	—	—	素材
WALT DISNEY CO/THE		424	379	3,939	437,669	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC		33	29	255	28,329	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP		194	176	1,304	144,882	公益事業
DR HORTON INC		100	88	368	40,930	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC		24	—	—	—	小売
TARGET CORP		148	129	982	109,105	小売
DUN & BRADSTREET CORP		10	—	—	—	商業・ 専門サービス
DAVITA INC		45	36	249	27,764	ヘルスケア機器・ サービス
DOVER CORP		44	38	305	33,884	資本財
DTE ENERGY COMPANY		51	46	461	51,282	公益事業
EXXON MOBIL CORP	1,162	1,066		8,674	963,610	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP		59	53	729	81,071	ヘルスケア機器・ サービス
EOG RESOURCES INC		161	146	1,837	204,160	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO		179	161	1,181	131,204	資本財
EXELON CORP		258	239	944	104,964	公益事業
ECOLAB INC		73	65	969	107,649	素材
EQUIFAX INC		33	29	340	37,770	商業・ 専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A		61	56	826	91,851	家庭用品・ パーソナル用品
EATON CORP PLC		125	110	869	96,568	資本財
EDISON INTERNATIONAL		91	80	490	54,536	公益事業
ENTERGY CORP		51	45	345	38,434	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD		11	10	242	26,902	保険
EDGEWELL PERSONAL CARE CO		16	—	—	—	家庭用品・ パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC		131	118	1,855	206,109	公益事業
MACY'S INC		86	72	246	27,392	小売
FEDEX CORP		70	64	1,602	177,990	運輸
FORD MOTOR CO	1,038	935		1,059	117,746	自動車・ 自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC		100	83	286	31,773	各種金融
FOOT LOCKER INC		37	—	—	—	小売
FIRSTENERGY CORP		116	111	369	41,065	公益事業
FLUOR CORP		40	37	185	20,621	資本財
FREEPORT-MCMORAN INC		368	349	589	65,480	素材
GENERAL MILLS INC		164	142	596	66,286	食品・ 飲料・ タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP		72	63	1,292	143,626	資本財
WW GRAINGER INC		16	13	412	45,825	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	2,483	2,182		3,267	363,008	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC		41	40	460	51,106	ソフトウェア・ サービス
GENUINE PARTS CO		41	36	335	37,259	小売
TEGNA INC		58	—	—	—	メディア
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO		74	58	152	16,892	自動車・ 自動車部品
GAP INC/THE		67	56	177	19,667	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC		100	90	2,138	237,534	各種金融
HALLIBURTON CO		241	220	1,197	133,004	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC		203	182	2,702	300,199	資本財

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	
HARLEY-DAVIDSON INC		50	40	172	19,196	自動車・自動車部品
HP INC		477	419	928	103,120	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP		106	88	472	52,499	保険
HERSHEY CO/THE		40	36	330	36,690	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC		341	294	5,512	612,372	小売
HASBRO INC		31	26	238	26,479	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC		71	61	555	61,706	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP		253	221	3,190	354,433	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO		107	99	546	60,670	素材
ILLINOIS TOOL WORKS		88	78	1,150	127,756	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC		111	91	218	24,280	メディア
IDEX CORP		—	19	278	30,971	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES		22	19	243	27,007	素材
JOHNSON & JOHNSON		762	676	8,400	933,265	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KANSAS CITY SOUTHERN		30	25	280	31,204	運輸
KELLOGG CO		72	66	397	44,184	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP		100	89	923	102,590	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A		434	376	1,490	165,635	食品・飲料・タバコ
KROGER CO		248	220	548	60,968	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP		51	42	269	29,989	小売
ELI LILLY & CO		278	249	2,046	227,381	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		28	25	452	50,229	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO		44	36	192	21,359	運輸
LENNAR CORP-A		57	70	364	40,512	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC		244	209	1,807	200,779	小売
LEGGETT & PLATT INC		37	35	150	16,737	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC		69	59	200	22,245	小売
LAS VEGAS SANDS CORP		121	97	761	84,576	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP		74	65	2,083	231,427	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP		62	55	385	42,836	保険
LENNOX INTERNATIONAL INC		—	10	203	22,646	資本財
L3 TECHNOLOGIES INC		21	19	374	41,650	資本財
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A		92	78	1,084	120,427	消費者サービス
MCDONALD'S CORP		233	200	3,234	359,328	消費者サービス
S&P GLOBAL INC		72	64	1,278	142,013	各種金融
MEDTRONIC PLC		391	340	2,882	320,263	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.		773	685	4,055	450,567	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC		289	290	1,550	172,244	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC		98	93	141	15,683	耐久消費財・アパレル
3M CO		169	149	2,983	331,382	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC		40	40	433	48,123	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL		124	114	370	41,182	消費者サービス
MASCO CORP		88	78	297	33,087	資本財
MONSANTO CO		122	110	1,396	155,129	素材
M & T BANK CORP		38	33	608	67,547	銀行
MARSH & MCLENNAN COS		143	127	1,033	114,851	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC		17	15	340	37,795	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY		395	343	1,849	205,503	各種金融
MCKESSON CORP		62	52	779	86,605	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC		261	224	1,072	119,119	保険
MANPOWERGROUP INC		18	16	152	16,889	商業・専門サービス
MOODY'S CORP		47	43	752	83,541	各種金融

銘 柄	期首(前期末)	当 期		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 千アメリカドル		邦貨換算金額 千円
(アメリカ)	百株	百株			
NORFOLK SOUTHERN CORP	81	72	1,107	123,086	運輸
BANK OF AMERICA CORP	2,834	2,494	7,547	838,436	銀行
NISOURCE INC	93	86	211	23,480	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	46	41	1,369	152,161	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	140	133	160	17,799	銀行
NEWMONT MINING CORP	145	135	530	58,907	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	293	268	1,009	112,138	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	32	30	309	34,390	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	3	3	395	43,893	保険
NUCOR CORP	87	79	518	57,555	素材
NEWELL BRANDS INC	119	122	322	35,820	耐久消費財・アパレル
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	125	107	400	44,516	メディア
NOBLE ENERGY INC	122	114	415	46,140	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	214	193	1,655	183,931	エネルギー
OMNICOM GROUP	67	58	434	48,298	メディア
PEPSICO INC	402	358	3,491	387,886	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	25	22	276	30,720	素材
ALTRIA GROUP INC	546	480	2,667	296,335	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	32	30	230	25,661	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	716	638	4,690	521,085	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	136	119	1,782	197,978	銀行
PFIZER INC	1,701	1,500	5,347	594,089	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	122	107	1,104	122,721	保険
PULTEGROUP INC	84	67	202	22,481	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP	36	33	605	67,265	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	48	43	902	100,305	エネルギー
CITIGROUP INC	799	665	4,655	517,131	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	78	71	423	47,011	保険
PPG INDUSTRIES INC	73	62	660	73,416	素材
PENTAIR PLC	46	42	194	21,553	資本財
PRAXAIR INC	79	72	1,152	128,015	素材
P G & E CORP	141	126	540	59,994	公益事業
PPL CORP	190	177	475	52,809	公益事業
PROGRESSIVE CORP	164	144	883	98,126	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	140	130	648	72,078	公益事業
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	47	43	467	51,984	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	82	72	1,535	170,550	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	67	59	395	43,902	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	336	288	551	61,234	銀行
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	11	11	140	15,608	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	28	25	711	79,075	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	120	101	255	28,437	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	37	29	193	21,445	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	35	32	594	65,994	資本財
SCHLUMBERGER LTD	390	347	2,581	286,820	エネルギー
STRYKER CORP	94	84	1,463	162,621	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	334	303	1,796	199,572	各種金融
SEMPRA ENERGY	66	61	627	69,722	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21	21	835	92,869	素材
STANLEY BLACK & DECKER INC	41	38	560	62,292	資本財
SUNTRUST BANKS INC	139	118	816	90,722	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	78	68	885	98,378	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	
SOUTHERN CO/THE		276	254	1,087	120,836	公益事業
AT&T INC		1,720	1,544	4,951	550,040	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP		79	74	631	70,159	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP		107	93	933	103,703	各種金融
SYSCO CORP		144	125	797	88,649	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP		55	45	202	22,526	素材
SCANA CORP		39	36	124	13,851	公益事業
TEXAS INSTRUMENTS INC		281	248	2,745	305,020	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO		35	30	311	34,604	小売
TORCHMARK CORP		32	26	227	25,239	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION		261	234	841	93,520	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC		111	100	2,169	240,973	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC		76	66	443	49,288	資本財
UNION PACIFIC CORP		231	198	2,860	317,721	運輸
UNUM GROUP		65	55	214	23,868	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP		220	190	2,390	265,574	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC		269	243	5,966	662,766	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP		476	417	2,112	234,625	銀行
MARATHON OIL CORP		239	207	445	49,442	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B		194	173	2,001	222,359	運輸
VALERO ENERGY CORP		126	108	1,313	145,903	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC		26	22	263	29,278	ヘルスケア機器・サービス
VALSPAR CORP/THE		21	—	—	—	素材
CBS CORP-CLASS B NON VOTING		108	88	455	50,636	メディア
VF CORP		90	86	689	76,639	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO		37	33	429	47,665	素材
WILLIAMS COS INC		226	212	591	65,759	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC		258	211	1,363	151,506	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC		87	81	493	54,869	公益事業
WALMART INC		433	376	3,145	349,483	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO		1,337	1,177	6,324	702,578	銀行
WASTE MANAGEMENT INC		125	110	903	100,337	商業・専門サービス
WATERS CORP		22	19	388	43,116	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL		267	—	—	—	エネルギー
WHIRLPOOL CORP		21	18	299	33,252	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP		244	50	142	15,842	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XCEL ENERGY INC		141	126	552	61,347	公益事業
KEYCORP		297	275	557	61,878	銀行
CARMAX INC		51	46	304	33,799	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC		55	51	590	65,596	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC		44	36	158	17,553	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC		96	80	664	73,826	消費者サービス
TJX COMPANIES INC		182	157	1,337	148,608	小売
CA INC		89	74	263	29,287	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY		35	32	381	42,361	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A		40	34	397	44,200	素材
CADENCE DESIGN SYS INC		81	73	308	34,297	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP		98	88	576	64,013	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV		86	84	882	98,050	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC		113	106	397	44,184	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC		87	79	591	65,689	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP		206	181	607	67,498	銀行

銘 柄	期首(前期末) 株 数	当 株 数	期 末		業 種 等
			評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
STERICYCLE INC	23	23	147	16,407	商業・専門サービス
INTEL CORP	1,330	1,178	6,303	700,300	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	1,409	1,244	5,377	597,379	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	23	21	400	44,545	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	33	28	457	50,784	不動産
COSTCO WHOLESALE CORP	122	110	2,189	243,259	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	302	268	1,330	147,764	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	83	77	1,022	113,601	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	82	74	508	56,513	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	171	155	344	38,231	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	109	95	791	87,932	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	61	57	536	59,576	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	375	330	2,356	261,789	耐久消費財・アパレル
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	4	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	208	169	2,990	332,223	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	48	42	422	46,908	銀行
NORTHERN TRUST CORP	59	55	595	66,105	各種金融
MICROSOFT CORP	2,070	1,844	17,774	1,974,576	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	24	20	343	38,146	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	48	51	588	65,369	ヘルスケア機器・サービス
STAPLES INC	185	—	—	—	小売
STARBUCKS CORP	409	360	2,057	228,621	消費者サービス
ORACLE CORP	864	788	3,650	405,480	ソフトウェア・サービス
WHOLE FOODS MARKET INC	89	—	—	—	食品・生活必需品小売り
NETFLIX INC	120	108	3,530	392,255	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	26	21	593	65,893	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	165	180	1,301	144,544	ソフトウェア・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	50	46	458	50,953	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	22	39	281	31,240	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	37	31	227	25,271	小売
LAM RESEARCH CORP	45	41	805	89,495	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	23	24	461	51,301	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,336	1,173	3,841	426,718	メディア
XILINX INC	68	62	446	49,606	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	99	89	580	64,513	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	62	56	269	29,961	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	19	19	586	65,150	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	370	328	2,234	248,248	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	44	37	390	43,345	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	10	28	1,292	143,624	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	67	61	1,164	129,330	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	—	13	445	49,473	銀行
NUANCE COMMUNICATIONS INC	76	—	—	—	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	92	81	527	58,643	ソフトウェア・サービス
ALTAIR INC	253	—	—	—	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	23	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
SIGNATURE BANK	15	14	188	20,987	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	37	33	315	35,076	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	—	15	229	25,520	運輸
AUTODESK INC	54	50	703	78,111	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	67	47	140	15,574	メディア
SALESFORCE.COM INC	181	172	2,191	243,463	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	
NORDSTROM INC		36	33	153	17,016	小売
ALPHABET INC-CL A		83	75	8,031	892,266	ソフトウェア・サービス
EAST WEST BANCORP INC		—	34	243	27,051	銀行
UNITED THERAPEUTICS CORP		11	9	102	11,368	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARMIN LTD		33	31	189	21,097	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC		71	59	207	23,094	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC		414	371	2,135	237,196	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC		70	67	262	29,109	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC		42	36	328	36,496	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS		76	69	403	44,809	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC		113	103	16,230	1,803,010	小売
T ROWE PRICE GROUP INC		66	61	737	81,905	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC		37	33	343	38,196	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP		44	39	432	48,085	半導体・半導体製造装置
STEEL DYNAMICS INC		—	57	293	32,578	素材
E*TRADE FINANCIAL CORP		77	66	431	47,947	各種金融
CERNER CORP		86	76	466	51,808	ヘルスケア機器・サービス
BROADCOM LTD		113	—	—	—	半導体・半導体製造装置
ALKERMES PLC		43	40	185	20,658	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC		27	22	281	31,287	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC		84	—	—	—	電気通信サービス
WASTE CONNECTIONS INC		48	66	501	55,700	商業・専門サービス
EBAY INC		296	249	955	106,173	ソフトウェア・サービス
IAC/INTERACTIVECORP		—	18	274	30,482	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP		151	152	3,751	416,789	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC		64	60	561	62,406	小売
BOOKING HOLDINGS INC		13	12	2,537	281,887	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B		343	319	6,270	696,577	各種金融
BB&T CORP		226	197	1,084	120,467	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP		296	258	1,470	163,380	各種金融
BORGWARNER INC		60	50	264	29,346	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC		61	56	157	17,471	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE		31	28	308	34,222	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC		216	195	1,850	205,589	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP		46	40	341	37,903	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC		16	12	119	13,309	保険
AETNA INC		98	82	1,462	162,437	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION		70	61	343	38,174	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER		138	124	807	89,723	公益事業
AON PLC		74	62	879	97,666	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO		159	138	623	69,252	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD		24	20	120	13,379	保険
HESS CORP		81	69	449	49,929	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC		97	91	243	27,066	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP		70	71	433	48,151	各種金融
RED HAT INC		51	44	731	81,279	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC		18	14	256	28,533	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A		64	55	178	19,855	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC		49	41	312	34,674	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC		78	67	464	51,546	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP		46	46	315	35,038	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD		123	96	206	22,950	半導体・半導体製造装置

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 千アメリカドル		邦貨換算金額 千円
(アメリカ)	百株	百株			
BIOGEN INC	61	53	1,490	165,529	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	40	36	980	108,896	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC	139	124	2,953	328,078	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	68	64	1,009	112,178	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	227	481	53,536	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC	43	—	—	—	小売
CELGENE CORP	217	197	1,551	172,337	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	169	148	1,127	125,298	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	172	143	1,081	120,176	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	51	43	314	34,893	運輸
FASTENAL CO	81	71	375	41,760	資本財
FISERV INC	60	103	756	84,073	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	152	126	180	20,094	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIRIUS XM HOLDINGS INC	455	391	272	30,303	メディア
APPLE INC	1,495	1,292	24,076	2,674,696	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	44	37	267	29,685	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	308	270	409	45,473	銀行
ZIONS BANCORPORATION	—	52	304	33,878	銀行
COSTAR GROUP INC	9	9	349	38,773	商業・専門サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	62	55	672	74,739	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	40	34	302	33,623	運輸
CENTURYLINK INC	154	241	465	51,766	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	39	37	203	22,611	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	129	114	454	50,539	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	60	96	642	71,396	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC	239	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SEAGATE TECHNOLOGY	83	71	402	44,707	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	39	36	254	28,299	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	20	19	233	25,946	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC	106	92	403	44,805	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	49	43	955	106,091	食品・飲料・タバコ
NVR INC	—	0.86	254	28,313	耐久消費財・アパレル
NEWFIELD EXPLORATION CO	56	45	131	14,633	エネルギー
COOPER COS INC/THE	13	11	276	30,739	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	49	65	342	38,069	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	85	77	680	75,638	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	25	26	199	22,146	保険
AGCO CORP	18	17	117	13,006	資本財
DISCOVERY INC - A	41	41	94	10,452	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP	109	97	484	53,780	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA GROUP INC	33	31	359	39,934	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	67	56	233	25,995	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	168	146	416	46,320	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC	44	37	525	58,335	各種金融
ANDEAVOR	33	38	557	61,956	エネルギー
FNF GROUP	69	69	265	29,456	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	168	145	1,042	115,825	各種金融
NASDAQ INC	32	27	249	27,726	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	50	50	101	11,256	耐久消費財・アパレル
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	—	36	161	17,897	メディア
VIACOM INC-CLASS B	98	92	251	27,991	メディア
AUTOLIV INC	25	21	315	35,034	自動車・自動車部品

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	
CBRE GROUP INC - A		86	73	349	38,869	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC		7	6	294	32,678	消費者サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B		60	62	367	40,788	食品・飲料・タバコ
QURATE RETAIL INC QVC GROUP		118	114	259	28,809	小売
ARROW ELECTRONICS INC		25	23	172	19,132	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC		44	39	582	64,742	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC		34	32	207	23,076	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP		92	75	173	19,313	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS		16	15	341	37,982	素材
RANGE RESOURCES CORP		52	67	102	11,419	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO		138	—	—	—	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO		26	22	223	24,788	エネルギー
RALPH LAUREN CORP		15	15	174	19,380	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP		66	61	248	27,559	公益事業
WYNDHAM WORLDWIDE CORP		29	25	277	30,873	消費者サービス
HANESBRANDS INC		100	88	162	18,041	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A		270	236	4,500	500,001	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO		136	112	226	25,210	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC		—	34	212	23,565	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV		41	32	181	20,120	資本財
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A		—	29	260	28,889	資本財
AVNET INC		36	28	109	12,198	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IPG PHOTONICS CORP		—	9	232	25,776	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE		95	86	241	26,856	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR		50	60	184	20,469	消費者サービス
TRANSDIGM GROUP INC		14	13	434	48,222	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO		33	30	349	38,794	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC		35	30	475	52,866	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL		86	91	170	18,889	銀行
TE CONNECTIVITY LTD		98	87	831	92,351	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		109	92	715	79,514	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC		31	27	280	31,125	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC		15	13	175	19,488	資本財
MERCADOLIBRE INC		11	10	320	35,634	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A		18	18	255	28,348	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP		81	71	364	40,504	保険
SEATTLE GENETICS INC		28	28	160	17,879	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ULTA BEAUTY INC		16	14	370	41,198	小売
LKQ CORP		87	74	227	25,320	小売
HORMEL FOODS CORP		77	69	249	27,749	食品・飲料・タバコ
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR		22	21	78	8,718	運輸
EASTMAN CHEMICAL CO		41	36	392	43,571	素材
HARRIS CORP		33	30	467	51,905	資本財
HUMANA INC		41	36	1,054	117,190	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP		46	—	—	—	エネルギー
INVESCO LTD		116	100	288	32,014	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC		48	43	382	42,466	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY		38	32	212	23,623	各種金融
TOTAL SYSTEM SERVICES INC		46	40	349	38,836	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC		40	36	565	62,782	エネルギー
MSCI INC		25	21	341	37,932	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK		26	25	171	19,037	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	
MOLSON COORS BREWING CO -B		53	47	284	31,646	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL		435	391	3,158	350,836	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES		523	456	5,930	658,836	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC		51	46	550	61,117	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N.V.		12	—	—	—	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP		132	115	267	29,756	エネルギー
FLOWSERVE CORP		37	29	132	14,759	資本財
HELMERICH & PAYNE		31	29	211	23,464	エネルギー
T-MOBILE US INC		82	72	414	46,072	電気通信サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A		23	—	—	—	メディア
DISCOVERY INC-C		65	67	144	16,002	メディア
RESMED INC		40	34	349	38,837	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC		23	21	293	32,626	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC		62	56	429	47,690	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD		34	33	264	29,355	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC		73	61	282	31,391	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC		25	21	266	29,637	運輸
PERRIGO CO PLC		40	31	236	26,245	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FMC CORP		38	32	297	33,099	素材
WABTEC CORP		24	22	215	23,898	資本財
EVERSOURCE ENERGY		88	81	467	51,922	公益事業
INGREDION INC		20	17	196	21,790	食品・飲料・タバコ
ALLERGAN PLC		105	83	1,326	147,329	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CROWN HOLDINGS INC		40	31	140	15,634	素材
CALPINE CORP		98	—	—	—	公益事業
EATON VANCE CORP		32	30	176	19,626	各種金融
DELTA AIR LINES INC		54	44	236	26,281	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO		50	—	—	—	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC		49	45	363	40,387	公益事業
VERISK ANALYTICS INC		42	38	412	45,787	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP		77	69	675	75,069	小売
FORTINET INC		42	39	232	25,776	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS		22	18	123	13,727	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL		7	6	373	41,452	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC		57	34	186	20,706	銀行
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP		329	—	—	—	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO		384	320	1,210	134,464	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV		82	86	954	106,065	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A		96	85	991	110,181	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE		13	11	263	29,304	資本財
HCA HEALTHCARE INC		83	71	739	82,099	ヘルスケア機器・サービス
HOLLYFRONTIER CORP		47	39	289	32,201	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP		146	124	989	109,924	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP		30	25	219	24,383	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI		43	36	212	23,640	資本財
DEXCOM INC		23	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP		16	15	156	17,405	資本財
XYLEM INC		51	43	311	34,659	資本財
TRIPADVISOR INC		34	25	122	13,622	小売
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC		17	15	266	29,550	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA		41	40	399	44,431	銀行
ALLEGHANY CORP		4	3	212	23,630	保険

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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
REGENERON PHARMACEUTICALS	21	20	613	68,129	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	131	110	1,332	148,017	エネルギー
FACEBOOK INC-A	656	600	10,964	1,218,000	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP	77	70	308	34,306	公益事業
ALBEMARLE CORP	30	27	292	32,507	素材
PVH CORP	22	18	291	32,377	耐久消費財・アパレル
KINDER MORGAN INC	531	501	806	89,558	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	97	89	276	30,769	商業・専門サービス
APTIV PLC	74	68	665	73,888	自動車・自動車部品
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	48	44	235	26,200	資本財
SPLUNK INC	35	35	414	46,022	ソフトウェア・サービス
OGE ENERGY CORP	57	51	172	19,157	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	17	13	156	17,337	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	456	401	4,256	472,875	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC	36	34	941	104,618	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	57	48	304	33,856	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	36	31	308	34,308	各種金融
ZOETIS INC	130	121	1,028	114,265	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC	30	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	107	102	160	17,849	メディア
SPRINT CORP	229	218	111	12,418	電気通信サービス
SNAP-ON INC	16	13	205	22,829	資本財
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	46	38	257	28,649	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	162	162	528	58,733	ソフトウェア・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	—	20	250	27,863	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	46	73	603	67,026	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	34	34	464	51,585	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	45	44	766	85,175	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	25	21	252	28,045	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	26	22	468	51,993	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC	—	22	174	19,414	資本財
ALPHABET INC-CL C	86	79	8,439	937,507	ソフトウェア・サービス
NAVIENT CORP	88	—	—	—	各種金融
UNITED RENTALS INC	23	20	349	38,787	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	37	29	129	14,370	運輸
VOYA FINANCIAL INC	55	44	237	26,360	各種金融
ANTERO RESOURCES CORP	46	60	115	12,814	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	42	35	356	39,639	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	113	112	304	33,794	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	56	71	602	66,882	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	37	30	195	21,709	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	24	21	285	31,665	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C	30	26	185	20,555	メディア
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	—	29	340	37,785	ソフトウェア・サービス
OWENS CORNING	—	28	185	20,595	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	45	48	255	28,368	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	26	22	456	50,719	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIGNET JEWELERS LTD	17	—	—	—	小売
SYNCHRONY FINANCIAL	228	199	708	78,713	各種金融
QORVO INC	36	32	259	28,788	半導体・半導体製造装置
ARTHUR J GALLAGHER & CO	50	47	322	35,821	保険
ACUITY BRANDS INC	12	9	116	12,968	資本財

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	
JONES LANG LASALLE INC		12	12	207	23,039	不動産
ARAMARK		62	59	224	24,919	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP		140	121	504	56,095	銀行
LEAR CORP		20	16	337	37,520	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC		—	22	231	25,720	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD		62	58	186	20,771	素材
RITE AID CORP		301	—	—	—	食品・生活必需品小売り
TARGA RESOURCES CORP		51	52	253	28,203	エネルギー
CHEMOURS CO/THE		—	46	244	27,175	素材
LIBERTY LATIN AMERIC-CL C		30	—	—	—	メディア
WESTROCK CO		68	62	387	43,027	素材
KRAFT HEINZ CO/THE		170	155	881	97,874	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC		304	287	2,321	257,868	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C		32	28	146	16,301	ソフトウェア・サービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE		463	400	704	78,220	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOBILEYE NV		50	—	—	—	自動車・自動車部品
AMERCO		1	1	66	7,389	運輸
CDW CORP/DE		41	38	304	33,856	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDNAX INC		26	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
SABRE CORP		60	57	135	15,047	ソフトウェア・サービス
FIRST DATA CORP- CLASS A		91	113	217	24,148	ソフトウェア・サービス
ARISTA NETWORKS INC		—	12	297	33,072	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNEX CORP		—	43	199	22,195	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSUNION		—	39	269	29,914	商業・専門サービス
WR GRACE & CO		19	18	139	15,449	素材
UNDER ARMOUR INC-CLASS C		53	48	86	9,636	耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C		59	41	191	21,279	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A		24	24	112	12,518	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C		—	50	162	18,035	メディア
VAIL RESORTS INC		—	9	230	25,641	消費者サービス
DOMINO'S PIZZA INC		13	11	277	30,873	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A		60	46	1,259	139,921	メディア
IDEXX LABORATORIES INC		25	21	426	47,414	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP		39	34	220	24,501	資本財
UGI CORP		47	46	224	24,968	公益事業
WESTAR ENERGY INC		41	36	193	21,532	公益事業
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		—	55	210	23,425	食品・飲料・タバコ
FORTIVE CORP		88	79	616	68,503	資本財
IHS MARKIT LTD		97	102	524	58,276	商業・専門サービス
XL GROUP LTD		76	63	354	39,362	保険
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS		—	45	224	24,955	ソフトウェア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V		63	51	403	44,834	ソフトウェア・サービス
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC		17	—	—	—	素材
COTY INC-CL A		136	127	178	19,880	家庭用品・パーソナル用品
ARCONIC INC		124	108	197	21,886	資本財
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A		61	58	184	20,460	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA		17	16	250	27,814	保険
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC		7	7	57	6,440	家庭用品・パーソナル用品
TELEFLEX INC		12	11	306	34,094	ヘルスケア機器・サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC		45	50	171	19,031	電気通信サービス
ENVISION HEALTHCARE CORP		33	31	133	14,855	ヘルスケア機器・サービス
TECHNIPFMC PLC		125	115	395	43,963	エネルギー

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	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	—	29	224	24,899	ヘルスケア機器・サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC	—	24	262	29,109	各種金融
DXC TECHNOLOGY CO	78	72	729	81,014	ソフトウェア・サービス
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	—	39	181	20,118	保険
VALVOLINE INC	48	—	—	—	素材
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	—	19	220	24,525	保険
COMMSCOPE HOLDING CO INC	—	51	151	16,860	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HD SUPPLY HOLDINGS INC	—	47	193	21,456	資本財
ROLLINS INC	—	26	134	14,913	商業・専門サービス
TESARO INC	—	10	47	5,300	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAKER HUGHES A GE CO	—	98	354	39,381	エネルギー
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	—	22	106	11,850	保険
DOWDUPONT INC	—	589	3,982	442,379	素材
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	—	35	144	16,068	運輸
SQUARE INC - A	—	70	386	42,923	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	—	65	150	16,737	公益事業
BROADCOM INC	—	102	2,425	269,396	半導体・半導体製造装置
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	330	280	200	22,271	不動産
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	60	60	217	24,155	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	70	55	343	38,156	資本財
小計	株数・金額	87,483	76,889	597,695	66,397,958
	銘柄数<比率>	597	600	—	<62.5%>
(カナダ)			千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA	417	366	3,680	317,327	銀行
IMPERIAL OIL LTD	80	69	290	25,055	エネルギー
THOMSON REUTERS CORP	93	70	349	30,167	各種金融
TRANSCANADA CORP	243	220	1,213	104,579	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	99	91	569	49,063	電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	174	156	870	75,084	保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B	161	138	501	43,233	素材
BARRICK GOLD CORP	321	294	498	42,961	素材
BCE INC	42	40	217	18,735	電気通信サービス
AGRIUM INC	37	—	—	—	素材
BOMBARDIER INC-B	541	530	225	19,464	資本財
BANK OF MONTREAL	180	163	1,647	142,025	銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	249	214	1,114	96,103	各種金融
BANK OF NOVA SCOTIA	339	301	2,417	208,398	銀行
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	94	76	216	18,699	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC	76	72	179	15,449	資本財
CAMECO CORP	113	106	155	13,387	エネルギー
CI FINANCIAL CORP	68	72	181	15,617	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	112	108	1,256	108,283	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	308	306	1,473	127,047	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	215	188	2,013	173,582	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	19	16	268	23,185	小売
ENBRIDGE INC	459	417	1,728	149,010	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	6	7	531	45,778	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	62	63	486	41,977	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	99	91	178	15,394	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	28	23	90	7,788	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	63	53	348	30,055	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	550	492	1,221	105,317	保険

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 千カナダドル		邦貨換算金額 千円
(カナダ)	百株	百株			
MAGNA INTERNATIONAL INC	105	86	732	63,190	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	95	85	537	46,341	銀行
ONEX CORPORATION	24	19	178	15,380	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	237	—	—	—	素材
POWER CORP OF CANADA	100	93	278	24,044	保険
POWER FINANCIAL CORP	65	58	187	16,145	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	119	112	294	25,374	メディア
SUNCOR ENERGY INC	468	416	2,194	189,215	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	13	14	146	12,606	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	39	37	869	74,918	運輸
ENCANA CORP	263	236	408	35,218	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	63	57	316	27,252	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	47	46	146	12,670	資本財
GOLDCORP INC	243	226	394	34,018	素材
KINROSS GOLD CORP	353	353	163	14,120	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	43	46	254	21,906	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC	83	70	233	20,155	保険
METHANEX CORP	26	19	172	14,864	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	281	281	106	9,205	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	25	—	—	—	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	62	53	197	17,033	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	67	50	214	18,487	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	140	131	194	16,759	ソフトウェア・サービス
TELUS CORP	57	57	260	22,447	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	198	178	390	33,667	素材
YAMANA GOLD INC	260	—	—	—	素材
FORTIS INC	110	108	449	38,732	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	115	108	568	49,030	食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP	198	—	—	—	素材
LUNDIN MINING CORP	—	162	137	11,885	素材
TORONTO-DOMINION BANK	522	465	3,515	303,062	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	48	45	409	35,341	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	126	104	290	25,023	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	45	49	117	10,100	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	29	29	153	13,245	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	37	34	106	9,148	公益事業
METRO INC	66	60	257	22,164	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	74	64	280	24,149	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	37	35	338	29,220	保険
CRESCENT POINT ENERGY CORP	151	118	128	11,118	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	290	252	358	30,871	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	101	96	136	11,793	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	66	62	159	13,742	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	113	126	561	48,407	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	34	31	146	12,590	エネルギー
DOLLARAMA INC	32	27	407	35,150	小売
KEYERA CORP	53	51	175	15,089	エネルギー
ALTAGAS LTD	47	47	120	10,421	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	47	—	—	—	エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	23	21	80	6,953	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	41	41	85	7,330	不動産
INTER PIPELINE LTD	104	98	237	20,479	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		57	58	166	14,381	エネルギー
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A		68	68	123	10,610	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC		5	5	498	43,004	ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN		59	55	399	34,473	消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD		18	18	167	14,440	素材
VERESEN INC		89	—	—	—	エネルギー
CCL INDUSTRIES INC - CL B		8	37	237	20,436	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR		110	110	64	5,519	各種金融
LINAMAR CORP		14	12	84	7,269	自動車・自動車部品
HYDRO ONE LTD		55	69	131	11,361	公益事業
EMERA INC		15	17	69	5,959	公益事業
SHOPIFY INC - CLASS A		—	21	397	34,262	ソフトウェア・サービス
NUTRIEN LTD		—	163	1,081	93,208	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	11,734	10,334	45,444	3,917,779	
		91	87	—	<3.7%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
COMMERZBANK AG		304	264	267	34,890	銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		578	514	556	72,596	各種金融
CECONOMY AG		51	—	—	—	小売
SIEMENS AG-REG		215	192	2,261	295,053	資本財
RWE AG		140	128	258	33,718	公益事業
BASF SE		259	231	2,055	268,265	素材
VOLKSWAGEN AG		9	8	150	19,636	自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		271	242	1,633	213,217	自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		49	45	485	63,383	家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE		581	564	532	69,470	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		92	82	727	94,967	自動車・自動車部品
BAYER AG-REG		232	208	2,170	283,253	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINDE AG		51	—	—	—	素材
ALLIANZ SE-REG		128	112	2,150	280,674	保険
MAN SE		9	9	90	11,807	資本財
CONTINENTAL AG		30	28	631	82,427	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG		313	290	696	90,846	半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		43	36	253	33,050	自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		67	63	156	20,425	運輸
HUGO BOSS AG -ORD		18	17	135	17,673	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE POST AG-REG		270	244	833	108,751	運輸
SAP SE		276	247	2,367	308,984	ソフトウェア・サービス
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE		66	60	165	21,651	メディア
DEUTSCHE BOERSE AG		54	48	545	71,208	各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		59	54	474	61,894	ヘルスケア機器・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT		10	9	75	9,826	運輸
ADIDAS AG		52	47	923	120,541	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		921	837	1,125	146,864	電気通信サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		44	38	746	97,413	保険
THYSSENKRUPP AG		104	109	236	30,831	素材
BEIERSDORF AG		28	24	237	30,933	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG		42	36	296	38,689	素材
MERCK KGAA		35	31	271	35,393	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOLKSWAGEN AG-PREF		51	46	798	104,197	自動車・自動車部品
PUMA SE		—	1	75	9,833	耐久消費財・アパレル
LANXESS AG		24	21	151	19,789	素材

銘 柄	株 数	期首(前期末)	当 期		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
FRESENIUS SE & CO KGAA	114	103	713	93,080	ヘルスケア機器・サービス	
HOCHTIEF AG	5	5	80	10,511	資本財	
DEUTSCHE WOHNEN SE	100	88	345	45,126	不動産	
GEA GROUP AG	52	44	143	18,759	資本財	
SYMRISE AG	35	29	211	27,603	素材	
K+S AG-REG	54	51	126	16,457	素材	
HENKEL AG & CO KGAA	29	24	246	32,173	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	35	29	163	21,326	ソフトウェア・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	15	15	116	15,219	自動車・自動車部品	
HANNOVER RUECK SE	17	14	162	21,216	保険	
BRENNTAG AG	44	36	186	24,332	資本財	
AXEL SPRINGER SE	12	13	86	11,306	メディア	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	20	19	86	11,350	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	213	199	73	9,609	電気通信サービス	
OSRAM LICHT AG	25	26	142	18,645	資本財	
VONOVIA SE	127	119	472	61,598	不動産	
EVONIK INDUSTRIES AG	45	44	140	18,270	素材	
ZALANDO SE	23	29	136	17,776	小売	
COVESTRO AG	20	40	319	41,734	素材	
SCHAEFFLER AG	46	46	62	8,128	自動車・自動車部品	
UNIPER SE	—	50	138	18,029	公益事業	
INNOGY SE	40	33	119	15,568	公益事業	
METRO AG	—	48	56	7,322	食品・生活必需品小売り	
KION GROUP AG	—	18	136	17,776	資本財	
LINDE AG - TENDER	—	47	930	121,471	素材	
1&1 DRILLISCH AG	—	12	77	10,127	電気通信サービス	
MTU AERO ENGINES AG	—	12	200	26,188	資本財	
WIRECARD AG	—	29	389	50,853	ソフトウェア・サービス	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	—	37	128	16,750	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	6,572	6,173	30,733	4,010,476	
銘 柄 数 < 比 率 >		56	63	—	<3.8%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	320	316	509	66,504	保険	
INTESA SANPAOLO	3,537	3,412	1,023	133,572	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	3,250	3,021	224	29,244	電気通信サービス	
ENI SPA	712	633	1,048	136,853	エネルギー	
UNICREDIT SPA	526	503	816	106,582	銀行	
ENEL SPA	2,135	2,071	1,014	132,385	公益事業	
SAIPEM SPA	1,674	—	—	—	エネルギー	
RECORDATI SPA	—	23	73	9,646	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ATLANTIA SPA	117	112	307	40,155	運輸	
INTESA SANPAOLO-RSP	275	246	77	10,148	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	47	44	242	31,581	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	165	154	141	18,460	銀行	
SNAM SPA	696	551	208	27,161	エネルギー	
TELECOM ITALIA-RSP	1,692	1,610	104	13,585	電気通信サービス	
LEONARDO SPA	114	89	81	10,597	資本財	
TERNA SPA	409	370	176	23,073	公益事業	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	329	268	56	7,368	保険	
PRYSMIAN SPA	55	54	138	18,060	資本財	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	—	148	94	12,322	食品・飲料・タバコ	

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…イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
POSTE ITALIANE SPA		143	143	108	14,218	保険
小計	株数・金額	16,204	13,775	6,448	841,524	
銘柄数<比率>		18	19	—	<0.8%>	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)		50	43	528	68,982	自動車・自動車部品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		78	70	2,168	282,975	耐久消費財・アパレル
PEUGEOT SA		136	148	306	39,947	自動車・自動車部品
AXA SA		543	488	1,123	146,640	保険
DANONE		165	152	989	129,134	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA		155	150	244	31,890	食品・生活必需品小売り
VIVENDI		283	263	601	78,440	メディア
INGENICO GROUP		15	16	114	14,986	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA		214	193	801	104,625	銀行
AIR LIQUIDE SA		109	107	1,207	157,563	素材
TOTAL SA		640	605	3,296	430,121	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		138	127	579	75,619	資本財
ZODIAC AEROSPACE		58	—	—	—	資本財
VINCI SA		142	127	1,109	144,725	資本財
SANOFI		325	285	1,899	247,911	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		137	117	233	30,510	公益事業
L'OREAL		70	63	1,295	169,002	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA		48	44	213	27,808	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		157	142	1,105	144,238	資本財
BNP PARIBAS		318	282	1,741	227,205	銀行
ESSILOR INTERNATIONAL		57	53	630	82,317	ヘルスケア機器・サービス
CAPGEMINI SE		44	40	468	61,144	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON		15	14	55	7,271	食品・生活必需品小売り
VALEO SA		65	60	351	45,859	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL		7	7	468	61,108	耐久消費財・アパレル
SODEXO SA		25	22	187	24,420	消費者サービス
KERING		20	18	903	117,834	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA		36	31	352	46,016	ソフトウェア・サービス
CHRISTIAN DIOR SE		14	—	—	—	耐久消費財・アパレル
ATOS SE		24	23	268	35,084	ソフトウェア・サービス
ORANGE		555	497	715	93,350	電気通信サービス
CNP ASSURANCES		49	48	100	13,123	保険
IMERYS SA		10	9	72	9,440	素材
SAFRAN SA		86	84	855	111,578	資本財
RENAULT SA		52	48	442	57,696	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE		54	50	308	40,311	メディア
LAGARDERE SCA		32	32	74	9,701	メディア
JCDECAUX SA		20	20	55	7,281	メディア
SOCIETE BIC SA		8	7	64	8,465	商業・専門サービス
BOUYGUES SA		55	52	213	27,888	資本財
THALES SA		29	25	279	36,473	資本財
PERNOD RICARD SA		59	52	732	95,533	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA		319	290	390	50,919	銀行
ENGIE		440	457	668	87,263	公益事業
ALSTOM		43	41	170	22,220	資本財
ARKEMA		17	15	175	22,839	素材
LEGRAND SA		73	66	445	58,131	資本財
SCOR SE		42	40	134	17,589	保険

銘柄		期首(前期末)	当期末		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ADP		8	7	139	18,220	運輸
EDF		82	152	186	24,386	公益事業
NATIXIS		270	225	158	20,684	各種金融
WENDEL		7	6	79	10,345	各種金融
BUREAU VERITAS SA		76	61	129	16,914	商業・専門サービス
EURAZEO SA		11	12	88	11,546	各種金融
SUEZ		98	88	110	14,464	公益事業
EIFFAGE		17	17	176	23,040	資本財
ILIAD SA		7	7	92	12,121	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS		48	48	76	9,945	メディア
BIOMERIEUX		—	10	70	9,250	ヘルスケア機器・サービス
GETLINK SE		137	107	126	16,518	運輸
EDENRED		60	59	163	21,362	商業・専門サービス
REMY COINTREAU		6	5	72	9,440	食品・飲料・タバコ
REXEL SA		86	82	107	14,001	資本財
BOLLORE		260	242	106	13,911	運輸
SFR GROUP SA		24	—	—	—	電気通信サービス
DASSAULT AVIATION SA		0.5	0.63	105	13,794	資本財
SEB SA		6	5	97	12,705	耐久消費財・アパレル
IPSEN		—	10	133	17,446	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA		—	15	107	13,983	各種金融
FAURECIA		—	18	141	18,432	自動車・自動車部品
TELEPERFORMANCE		—	14	196	25,639	商業・専門サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT		—	15	139	18,224	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,267 66	6,761 69	31,953 —	4,169,580 <3.9%>	
(ユーロ…オランダ)						
QIAGEN N.V.		62	51	153	20,078	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV		291	248	268	35,062	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		256	268	497	64,983	自動車・自動車部品
FERRARI NV		35	30	344	45,010	自動車・自動車部品
EXOR NV		31	25	162	21,221	各種金融
AIRBUS SE		162	146	1,429	186,566	資本財
STMICROELECTRONICS NV		182	154	308	40,302	半導体・半導体製造装置
GEMALTO		23	—	—	—	ソフトウェア・サービス
WOLTERS KLUWER		85	69	324	42,325	商業・専門サービス
KONINKLIJKE KPN NV		970	834	201	26,356	電気通信サービス
AKZO NOBEL		69	64	490	64,018	素材
HEINEKEN NV		63	65	565	73,810	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV		264	238	873	113,972	ヘルスケア機器・サービス
RELX NV		273	248	454	59,318	商業・専門サービス
AEGON NV		504	436	255	33,279	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		354	326	634	82,856	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD NV		33	27	150	19,612	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV		29	27	234	30,570	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV		49	45	403	52,675	素材
ING GROEP NV		1,091	978	1,295	169,002	銀行
ASML HOLDING NV		104	97	1,654	215,887	半導体・半導体製造装置
UNILEVER NV-CVA		457	409	1,959	255,713	家庭用品・パーソナル用品
VOPAK		20	20	83	10,913	エネルギー
BOSKALIS WESTMINSTER		25	25	59	7,731	資本財
NN GROUP NV		89	75	291	38,035	保険

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ALTICE NV - B		26	—	—	—	メディア
ALTICE NV - A		110	142	121	15,879	メディア
ABN AMRO GROUP NV-CVA		81	109	262	34,280	銀行
小	計	株 数 ・ 金 額	5,748	5,169	13,483	1,759,467
	銘 柄 数 < 比 率 >	28	26	—	<1.7%>	
(ユーロ…スペイン)						
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		—	64	91	11,900	資本財
BANCO POPULAR ESPANOL		921	—	—	—	銀行
ENDESA SA		91	83	165	21,647	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		54	57	211	27,638	資本財
IBERDROLA SA		1,548	1,458	963	125,702	公益事業
TELEFONICA SA		1,271	1,171	933	121,852	電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA		4,092	4,059	2,113	275,804	銀行
BANKINTER SA		190	176	156	20,445	銀行
REPSOL SA		320	310	530	69,215	エネルギー
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		1,864	1,676	1,102	143,919	銀行
GAS NATURAL SDG SA		102	92	207	27,067	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		303	271	754	98,482	小売
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		175	—	—	—	運輸
MAPFRE SA		298	298	86	11,282	保険
FERROVIAL SA		137	115	200	26,155	資本財
FERROVIAL SA-RTS		—	115	3	465	資本財
ZARDOYA OTIS SA		51	—	—	—	資本財
ENAGAS SA		65	60	146	19,073	エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA		125	116	202	26,416	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		1,524	1,276	207	27,036	銀行
CAIXABANK S.A		1,018	896	368	48,117	銀行
GRIFOLS SA		84	72	181	23,670	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMADEUS IT GROUP SA		124	111	740	96,573	ソフトウェア・サービス
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI		240	147	115	15,088	運輸
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		173	—	—	—	食品・生活必需品小売り
BANKIA SA		1,303	331	119	15,634	銀行
AENA SME SA		19	16	282	36,869	運輸
小	計	株 数 ・ 金 額	16,103	12,981	9,886	1,290,058
	銘 柄 数 < 比 率 >	25	23	—	<1.2%>	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS		54	49	222	28,984	保険
UCB SA		35	29	195	25,461	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		22	19	179	23,374	各種金融
UMICORE		26	52	255	33,398	素材
COLRUYT SA		18	16	78	10,244	食品・生活必需品小売り
KBC GROUP NV		68	63	452	58,996	銀行
SOLVAY SA		21	17	208	27,265	素材
PROXIMUS		42	40	93	12,186	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		15	14	70	9,134	メディア
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		214	191	1,532	200,027	食品・飲料・タバコ
小	計	株 数 ・ 金 額	521	495	3,288	429,074
	銘 柄 数 < 比 率 >	10	10	—	<0.4%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG		86	74	282	36,855	銀行
OMV AG		42	35	187	24,498	エネルギー
VOESTALPINE AG		31	30	141	18,415	素材

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…オーストリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ANDRITZ AG		20	19	84	11,004	資本財 銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		34	40	116	15,247	
小 計	株 数 ・ 金 額	215	200	812	106,020	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP		10	10	65	8,565	メディア
TENARIS SA		135	125	215	28,082	エネルギー
SES		104	95	124	16,307	メディア
EUROFINS SCIENTIFIC		3	3	137	17,938	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCELORMITTAL		174	169	510	66,665	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	427	403	1,054	137,560	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ		1,629	1,488	785	102,558	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS		156	132	231	30,224	素材
NOKIAN RENKAAT OYJ		33	31	105	13,707	自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ		144	132	416	54,377	素材
FORTUM OYJ		128	116	241	31,518	公益事業
KONE OYJ-B		91	84	355	46,392	資本財
METSO OYJ		31	29	87	11,475	資本財
SAMPO OYJ-A SHS		123	114	496	64,759	保険
WARTSILA OYJ ABP		41	104	191	25,013	資本財
ELISA OYJ		41	37	139	18,212	電気通信サービス
NESTE OYJ		36	33	231	30,239	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		28	27	74	9,734	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	株 数 ・ 金 額	2,488	2,333	3,358	438,213	
	銘柄 数 < 比 率 >	12	12	—	<0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A		46	40	365	47,671	食品・飲料・タバコ
PADDY POWER BETFAIR PLC		20	20	196	25,576	消費者サービス
BANK OF IRELAND GROUP PLC		—	230	168	21,988	銀行
AIB GROUP PLC		—	200	97	12,746	銀行
BANK OF IRELAND		8,041	—	—	—	銀行
CRH PLC		234	215	686	89,558	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	8,341	706	1,513	197,540	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	5	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		687	634	219	28,652	公益事業
JERONIMO MARTINS		71	54	75	9,889	食品・生活必需品小売り
GALP ENERGIA SGPS SA		144	133	226	29,597	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	903	823	522	68,140	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
(ユーロ…イギリス)						
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		62	—	—	—	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	62	—	—	—	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	—	—	<—%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	64,856	49,825	103,055	13,447,658	
	銘柄 数 < 比 率 >	233	240	—	<12.7%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC		4,750	4,288	889	133,028	銀行
BP PLC		5,315	4,982	2,921	436,664	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC		18,034	18,120	1,196	178,859	銀行

銘柄	期首(前期末)	当期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	外貨建金額 邦貨換算金額	
(イギリス)		百株	百株	千イギリスポンド	千円	
ASTRAZENECA PLC		355	318	1,669	249,553	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC		112	103	176	26,358	資本財
NEXT PLC		40	35	206	30,842	小売
DIAGEO PLC		706	627	1,693	253,147	食品・飲料・タバコ
SKY PLC		282	252	342	51,180	メディア
BAE SYSTEMS PLC		902	814	527	78,909	資本財
UNILEVER PLC		360	309	1,279	191,317	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC		2,249	2,448	601	89,979	食品・生活必需品小売り
RELX PLC		308	272	441	66,071	商業・専門サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC		465	375	109	16,377	小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		176	167	999	149,394	家庭用品・パーソナル用品
PRUDENTIAL PLC		724	650	1,258	188,166	保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		1,633	1,513	429	64,164	保険
SAGE GROUP PLC/THE		306	260	174	26,117	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC		5,548	5,032	3,688	551,352	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		523	576	2,192	327,766	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC		187	159	125	18,825	公益事業
SCHRODERS PLC		38	28	97	14,571	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP		1,002	869	252	37,724	銀行
BHP BILLITON PLC		587	525	912	136,420	素材
IMPERIAL BRANDS PLC		268	238	661	98,943	食品・飲料・タバコ
WPP PLC		354	321	426	63,762	メディア
CENTRICA PLC		1,569	1,357	196	29,352	公益事業
BT GROUP PLC		2,358	2,098	426	63,771	電気通信サービス
SSE PLC		282	256	363	54,359	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC		914	820	615	92,016	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		506	420	360	53,935	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C		37,114	29,883	2	446	資本財
COMPASS GROUP PLC		457	405	644	96,367	消費者サービス
KINGFISHER PLC		629	522	153	22,943	小売
PEARSON PLC		236	195	177	26,578	メディア
SEVERN TRENT PLC		65	63	129	19,312	公益事業
RIO TINTO PLC		346	306	1,331	199,008	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC		1,369	1,237	1,842	275,401	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PROVIDENT FINANCIAL PLC		42	—	—	—	各種金融
3I GROUP PLC		269	233	231	34,561	各種金融
GKN PLC		491	—	—	—	自動車・自動車部品
VODAFONE GROUP PLC		7,469	6,700	1,294	193,506	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS		639	518	131	19,719	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC		472	370	113	16,898	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC		1,125	997	548	82,041	保険
CAPITA PLC		188	—	—	—	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC		277	—	—	—	小売
JOHNSON MATTHEY PLC		55	46	161	24,107	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC		292	244	161	24,073	保険
WHITBREAD PLC		51	48	200	29,942	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC		1,063	847	747	111,691	公益事業
FERGUSON PLC		71	63	363	54,322	資本財
BUNZL PLC		95	89	202	30,221	資本財
COBHAM PLC		479	657	78	11,764	資本財
ANGLO AMERICAN PLC		384	340	632	94,570	素材
INTERTEK GROUP PLC		43	38	199	29,786	商業・専門サービス

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	
WILLIAM HILL PLC		237	—	—	—	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC		125	103	200	30,016	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		51	47	228	34,191	消費者サービス
CARNIVAL PLC		53	46	226	33,867	消費者サービス
PERSIMMON PLC		88	73	207	31,008	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC		220	210	103	15,473	資本財
ITV PLC	1,019	951	161	24,135	メディア	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		89	78	356	53,359	各種金融
G4S PLC		410	424	113	16,992	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE		37	30	127	18,991	耐久消費財・アパレル
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		288	263	146	21,878	耐久消費財・アパレル
IMI PLC		77	73	87	13,036	資本財
SMITH & NEPHEW PLC		249	218	288	43,136	ヘルスケア機器・サービス
TATE & LYLE PLC		132	—	—	—	食品・飲料・タバコ
TAYLOR WIMPEY PLC		926	853	173	25,973	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,221	1,143	3,106	464,375	エネルギー	
PETROFAC LTD		72	—	—	—	エネルギー
TRAVIS PERKINS PLC		70	67	88	13,180	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,055	943	2,644	395,356	エネルギー	
OLD MUTUAL PLC	1,401	1,209	297	44,483	保険	
INVESTEC PLC		187	179	101	15,148	各種金融
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		565	675	249	37,282	各種金融
EXPERIAN PLC		270	237	431	64,566	商業・専門サービス
MONDI PLC		98	97	202	30,205	素材
WEIR GROUP PLC/THE		62	59	134	20,176	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		100	88	242	36,271	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC		109	101	109	16,419	素材
SHIRE PLC		253	230	966	144,529	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INMARSAT PLC		128	—	—	—	電気通信サービス
ADMIRAL GROUP PLC		55	55	106	15,882	保険
FRESNILLO PLC		62	59	75	11,361	素材
RANDGOLD RESOURCES LTD		26	24	143	21,424	素材
BABCOCK INTL GROUP PLC		74	69	53	7,997	商業・専門サービス
ST JAMES'S PLACE PLC		149	124	150	22,444	各種金融
GLENCORE PLC	3,428	3,075	1,169	174,886	素材	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC		254	—	—	—	各種金融
HARGREAVES LANSDOWN PLC		72	67	132	19,746	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC		37	35	163	24,414	素材
MELROSE INDUSTRIES PLC		—	1,218	288	43,144	資本財
COCA-COLA HBC AG-DI		51	49	127	18,993	食品・飲料・タバコ
EASYJET PLC		47	44	77	11,511	運輸
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		386	369	137	20,528	保険
ROYAL MAIL PLC		253	241	132	19,736	運輸
ASHTED GROUP PLC		142	121	278	41,699	資本財
MERLIN ENTERTAINMENT		198	150	56	8,381	消費者サービス
TUI AG-DI		142	104	187	27,990	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL		—	108	148	22,127	ソフトウェア・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		40	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC		104	104	69	10,329	ヘルスケア機器・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC		286	211	79	11,947	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY GROUP PLC		482	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DCC PLC		25	21	156	23,405	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
(イギリス)		百株	百株	千イギリスポンド	千円	
GVC HOLDINGS PLC		—	136	132	19,863	消費者サービス
CONVATEC GROUP PLC		—	322	72	10,840	ヘルスケア機器・サービス
WOOD GROUP (JOHN) PLC		—	175	119	17,876	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	120,530	107,363	49,640	7,420,792	
	銘 柄 数 < 比 率 >	105	99	—	<7.0%>	
(スイス)				千スイスフラン		
NESTLE SA-REG		872	782	6,036	670,797	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG		146	131	1,232	136,938	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		565	604	1,006	111,804	各種金融
LAFARGEHOLCIM LTD-REG		126	115	617	68,596	素材
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN		197	176	3,969	441,126	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GIVAUDAN-REG		2	2	531	59,024	素材
SONOVA HOLDING AG-REG		14	13	221	24,636	ヘルスケア機器・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG		42	38	1,201	133,493	保険
STRAUMANN HOLDING AG-REG		—	2	169	18,820	ヘルスケア機器・サービス
SYNGENTA AG-REG		25	—	—	—	素材
LONZA GROUP AG-REG		16	18	505	56,222	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		14	14	131	14,559	耐久消費財・アパレル
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		12	10	229	25,491	資本財
GEBERIT AG-REG		10	9	412	45,790	資本財
SWISS RE AG		89	79	750	83,433	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR		8	7	360	40,038	耐久消費財・アパレル
PARGESA HOLDING SA-BR		9	10	99	11,063	各種金融
NOVARTIS AG-REG		626	559	4,309	478,841	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG		46	39	250	27,796	商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG		7	6	288	32,094	電気通信サービス
ABB LTD-REG		535	457	1,113	123,754	資本財
CLARIANT AG-REG		—	58	142	15,801	素材
SGS SA-REG		1	1	342	38,103	商業・専門サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		4	4	89	9,920	資本財
ACTELION LTD-REG		26	—	—	—	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		15	12	193	21,472	運輸
BALOISE HOLDING AG - REG		14	11	185	20,597	保険
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		9	8	301	33,532	保険
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.03	0.03	231	25,668	食品・飲料・タバコ
ARYZTA AG		24	—	—	—	食品・飲料・タバコ
JULIUS BAER GROUP LTD		64	54	341	37,922	各種金融
SIKA AG-BR		0.59	0.54	436	48,483	素材
SWISS PRIME SITE-REG		20	19	177	19,717	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.28	0.26	170	18,894	食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG		4	4	336	37,394	各種金融
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.61	0.61	109	12,153	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		2	1	118	13,218	素材
UBS GROUP AG-REG		1,030	922	1,475	163,924	各種金融
DUFREY AG-REG		10	9	139	15,491	小売
VIFOR PHARMA AG		1	13	207	23,083	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	4,603	4,206	28,435	3,159,708	
	銘 柄 数 < 比 率 >	38	37	—	<3.0%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-SER B		63	62	1,437	18,230	耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS		843	777	5,263	66,739	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS		110	95	3,164	40,129	資本財

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	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	418	382	3,207	40,670	銀行
INVESTOR AB-B SHS	128	115	4,409	55,911	各種金融
NORDEA BANK AB	849	755	6,690	84,832	銀行
GETINGE AB-B SHS	56	53	456	5,786	ヘルスケア機器・サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	435	388	3,865	49,017	銀行
ATLAS COPCO AB-A SHS	185	170	6,228	78,980	資本財
SKF AB-B SHARES	112	90	1,718	21,784	資本財
ASSA ABLOY AB-B	284	252	4,849	61,495	資本財
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	261	244	3,531	44,779	小売
SANDVIK AB	291	283	4,612	58,488	資本財
SWEDBANK AB - A SHARES	258	230	4,462	56,583	銀行
SECURITAS AB-B SHS	90	69	981	12,442	商業・専門サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	172	—	—	—	素材
SKANSKA AB-B SHS	95	80	1,360	17,256	資本財
SWEDISH MATCH AB	54	47	2,001	25,377	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS	104	98	1,112	14,112	電気通信サービス
TELIA CO AB	735	698	3,035	38,490	電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS	440	397	6,403	81,199	資本財
ALFA LAVAL AB	83	68	1,584	20,097	資本財
LUNDIN PETROLEUM AB	54	51	1,477	18,739	エネルギー
BOLIDEN AB	77	70	2,281	28,929	素材
HUSQVARNA AB-B SHS	116	107	931	11,812	耐久消費財・アパレル
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	18	14	791	10,041	電気通信サービス
HEXAGON AB-B SHS	70	63	3,067	38,893	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINNEVIK AB - B	66	60	1,960	24,854	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	44	41	804	10,201	各種金融
ICA GRUPPEN AB	22	20	550	6,979	食品・生活必需品小売り
LUNDBERGS AB-B SHS	10	20	598	7,587	各種金融
ESSITY AKTIEBOLAG-B	—	152	3,614	45,833	家庭用品・パーソナル用品
ATLAS COPCO AB-B REDEMPTION	—	95	76	964	資本財
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	—	170	136	1,728	資本財
BOLIDEN AB-REDEMPTION	—	70	40	513	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	6,557	6,301	86,710	1,099,484
銘 柄 数 < 比 率 >		31	34	—	<1.0%>
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	267	246	3,812	52,194	銀行
NORSK HYDRO ASA	378	313	1,609	22,037	素材
ORKLA ASA	228	213	1,581	21,652	食品・飲料・タバコ
EQUINOR ASA	312	293	6,485	88,790	エネルギー
TELENOR ASA	212	185	3,164	43,328	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	50	42	1,469	20,110	素材
MARINE HARVEST	109	104	1,754	24,022	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	56	56	713	9,769	保険
SCHIBSTED ASA-CL A	22	—	—	—	メディア
SCHIBSTED ASA-B SHS	25	25	553	7,580	メディア
小 計	株 数 ・ 金 額	1,663	1,481	21,145	289,486
銘 柄 数 < 比 率 >		10	9	—	<0.3%>
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
NOVO NORDISK A/S-B	536	468	14,380	251,937	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	64	55	1,812	31,761	素材
DANSKE BANK A/S	191	189	4,109	71,990	銀行
WILLIAM DEMANT HOLDING	34	31	738	12,931	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	株数	当期末	期末		業種等
			評価額	金額	
株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額		
(デンマーク)					
H LUNDBECK A/S	百株	百株	千円	千円	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	—	18	805	14,104	資本財
TDC A/S	60	54	2,448	42,894	電気通信サービス
CARLSBERG AS-B	229	—	—	—	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B	30	26	1,839	32,222	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S	33	31	1,925	33,736	運輸
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	54	46	2,474	43,357	運輸
TRYG A/S	1	1	1,554	27,235	運輸
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	33	30	443	7,768	保険
PANDORA A/S	1	0.92	794	13,918	運輸
ISS A/S	31	26	1,331	23,330	耐久消費財・アパレル
CHR HANSEN HOLDING A/S	47	43	941	16,497	商業・専門サービス
GENMAB A/S	28	23	1,406	24,648	素材
ORSTED A/S	16	14	1,882	32,989	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
	42	46	1,917	33,597	公益事業
小計	株数・金額	株数	40,806	714,922	
銘柄数<比率>	1,439	1,112	—	<0.7%>	
(オーストラリア)					
BHP BILLITON LIMITED	903	809	千オーストラリアドル	230,141	素材
CSL LTD	128	113	2,757	173,614	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINA LTD	700	655	2,079	15,038	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	208	237	180	68,033	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	208	237	815	174,277	銀行
RIO TINTO LTD	825	741	2,087	73,323	銀行
QBE INSURANCE GROUP LTD	117	102	878	29,335	保険
LENLEASE GROUP	374	335	351	22,365	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	160	146	267	260,212	銀行
WESTPAC BANKING CORP	484	442	3,117	206,259	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	941	856	2,471	155,721	銀行
BRAMBLES LTD	749	680	1,865	29,940	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	457	388	358	—	運輸
BORAL LTD	157	—	—	15,092	素材
WOOLWORTHS GROUP LTD	340	277	180	79,827	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	358	329	956	24,142	電気通信サービス
AMP LTD	1,144	1,014	289	23,417	各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD	846	715	280	17,541	消費者サービス
AMCOR LIMITED	246	458	210	32,854	素材
COMPUTERSHARE LTD	335	287	393	16,725	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	136	108	200	34,239	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	146	144	410	78,452	各種金融
CIMIC GROUP LTD	85	82	939	9,992	資本財
ASX LTD	27	27	119	26,414	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	56	51	316	8,773	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	168	119	105	23,044	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	16	14	276	22,488	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	126	119	269	4,582	小売
NEWCREST MINING LTD	173	150	54	32,564	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	219	188	390	40,545	保険
ORIGIN ENERGY LTD	685	586	485	35,914	エネルギー
ORICA LTD	503	426	430	13,174	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	108	87	157	20,749	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	115	105	248	23,182	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	521	444	277	37,301	保険
	356	321	446		

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
TRANSURBAN GROUP		572	564	643	53,749	運輸
WESFARMERS LTD		316	282	1,270	106,066	食品・生活必需品小売り
BLUESCOPE STEEL LTD		—	130	235	19,624	素材
CHALLENGER LTD		169	134	177	14,777	各種金融
SYDNEY AIRPORT		297	263	183	15,304	運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD		76	62	192	16,044	エネルギー
OIL SEARCH LTD		394	329	281	23,516	エネルギー
AGL ENERGY LTD		186	164	350	29,231	公益事業
TATTS GROUP LTD		420	—	—	—	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD		452	424	206	17,239	素材
AUSNET SERVICES		639	572	94	7,883	公益事業
CROWN RESORTS LTD		103	109	147	12,271	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD		492	467	165	13,853	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK		135	127	141	11,831	銀行
AURIZON HOLDINGS LTD		554	547	236	19,700	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD		196	193	321	26,804	食品・飲料・タバコ
RAMSAY HEALTH CARE LTD		41	37	241	20,170	ヘルスケア機器・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L		14	14	92	7,704	消費者サービス
SEEK LTD		96	91	189	15,820	商業・専門サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD		96	110	115	9,609	銀行
REA GROUP LTD		15	15	135	11,287	ソフトウェア・サービス
TPG TELECOM LTD		104	104	56	4,688	電気通信サービス
HEALTHSCOPE LTD		513	471	117	9,766	ヘルスケア機器・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD		794	762	228	19,038	保険
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		17	17	76	6,398	消費者サービス
SOUTH32 LTD		1,518	1,307	524	43,748	素材
VOCUS GROUP LTD		160	—	—	—	電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	21,310	18,880	31,094	2,595,416	
(ニュージーランド)		61	59	—	<2.4%>	
SPARK NEW ZEALAND LTD		515	380	134	10,318	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		271	258	174	13,373	運輸
CONTACT ENERGY LTD		208	—	—	—	公益事業
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		—	138	181	13,932	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD		193	176	114	8,789	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD		110	110	127	9,742	ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD		388	356	108	8,305	公益事業
MERCURY NZ LTD		224	196	62	4,817	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,911	1,617	903	69,279	
(香港)		7	7	—	<0.1%>	
WHARF HOLDINGS LTD		370	320	830	11,750	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		155	130	1,030	14,587	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		746	681	6,052	85,636	資本財
SUN HUNG KAI PROPERTIES		400	370	4,713	66,700	不動産
MTR CORP		425	395	1,781	25,207	運輸
HONG KONG & CHINA GAS		2,219	2,092	3,560	50,387	公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT		1,620	1,550	1,869	26,450	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		380	345	1,887	26,703	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		331	299	7,756	109,748	各種金融
CATHAY PACIFIC AIRWAYS		370	—	—	—	運輸
HANG LUNG GROUP LTD		260	240	590	8,354	不動産

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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	640	450	836	11,830	不動産
CLP HOLDINGS LTD	475	415	3,351	47,418	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	310	310	1,580	22,357	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	345	329	1,090	15,432	銀行
HANG SENG BANK LTD	217	192	3,786	53,575	銀行
HYSAN DEVELOPMENT CO	180	170	775	10,969	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD	360	360	545	7,712	消費者サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	71	71	746	10,558	半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO	882	842	1,145	16,203	不動産
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	210	210	463	6,552	耐久消費財・アパレル
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	190	180	1,076	15,231	公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,050	930	3,710	52,506	銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	395	330	1,590	22,506	耐久消費財・アパレル
PCCW LTD	1,230	1,230	559	7,919	電気通信サービス
LI & FUNG LTD	1,684	1,684	594	8,411	耐久消費財・アパレル
KERRY PROPERTIES LTD	185	185	758	10,732	不動産
MINTH GROUP LTD	—	180	665	9,411	自動車・自動車部品
NWS HOLDINGS LTD	440	440	650	9,202	資本財
SANDS CHINA LTD	692	588	2,769	39,188	消費者サービス
WHEELOCK & CO LTD	230	220	1,299	18,382	不動産
WYNN MACAU LTD	468	424	1,231	17,428	消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD	580	580	523	7,402	消費者サービス
FIRST PACIFIC CO	460	620	243	3,439	各種金融
AIA GROUP LTD	3,388	3,028	21,801	308,492	保険
SWIRE PROPERTIES LTD	334	314	918	12,996	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	670	580	3,888	55,027	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	292	264	591	8,367	消費者サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,080	1,030	1,020	14,443	電気通信サービス
WH GROUP LTD	2,125	2,120	1,782	25,228	食品・飲料・タバコ
CK ASSET HOLDINGS LTD	766	641	4,281	60,584	不動産
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	—	1,020	391	5,542	各種金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	—	320	1,889	26,737	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	27,227	26,681	96,630	1,367,319
銘 柄 数 < 比 率 >		40	42	—	<1.3%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	895	800	1,040	86,042	銀行
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	453	436	120	9,923	メディア
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	293	293	89	7,436	資本財
CAPITALAND LTD	756	607	215	17,814	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	124	113	133	11,004	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	29	27	88	7,356	小売
DBS GROUP HOLDINGS LTD	493	444	1,287	106,445	銀行
KEPPEL CORP LTD	413	348	285	23,561	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	364	334	987	81,648	銀行
SINGAPORE TECH ENGINEERING	455	431	150	12,470	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,247	2,036	694	57,421	電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	167	155	179	14,851	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	225	212	162	13,407	各種金融
UOL GROUP LTD	138	138	115	9,548	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	617	562	134	11,104	運輸
STARHUB LTD	159	159	34	2,852	電気通信サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	2,089	1,857	62	5,144	食品・飲料・タバコ

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円
WILMAR INTERNATIONAL LTD		494	444	143	11,855
GENTING SINGAPORE PLC		1,774	1,397	183	15,129
SATS LTD		190	190	103	8,544
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L		784	—	—	—
YANGZIJIANG SHIPBUILDING		513	635	67	5,564
株 数 ・ 金 額		13,674	11,620	6,279	519,128
小 計	銘 柄 数 < 比 率 >	22	21	—	<0.5%>
(イスラエル)				千イスラエルシェケル	
ISRAEL CHEMICALS LTD		144	144	239	7,396
BANK HAPOLALIM BM		301	251	651	20,141
NICE LTD		17	16	612	18,949
BANK LEUMI LE-ISRAEL		409	344	783	24,235
ELBIT SYSTEMS LTD		6	5	233	7,207
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO		582	593	255	7,906
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		38	38	262	8,112
AZRIELI GROUP LTD		11	11	198	6,147
FRUTAROM		10	10	367	11,353
株 数 ・ 金 額		1,522	1,415	3,604	111,450
小 計	銘 柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.1%>
株 数 ・ 金 額		364,515	317,729	—	101,110,384
合 計	銘 柄 数 < 比 率 >	1,261	1,261	—	<95.2%>

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

(注) 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	13	11	264	29,401	0.0
MACERICH CO/THE	3	3	173	19,300	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2	2	290	32,319	0.0
PROLOGIS INC	14	13	834	92,727	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	2	187	20,837	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4	3	156	17,353	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	4	5	553	61,542	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	1	378	42,027	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	3	3	277	30,787	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2	1	218	24,282	0.0
WELLTOWER INC	10	9	507	56,424	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	4	3	450	50,039	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3	2	246	27,419	0.0
REALTY INCOME CORP	7	7	380	42,261	0.0
REGENCY CENTERS CORP	4	3	202	22,442	0.0
SL GREEN REALTY CORP	2	2	225	25,050	0.0
UDR INC	7	6	221	24,591	0.0
VENTAS INC	9	9	469	52,187	0.0
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	28	27	290	32,226	0.0
WEYERHAEUSER CO	20	19	697	77,526	0.1
AMERICAN TOWER CORP	11	10	1,476	163,972	0.2
AGNC INVESTMENT CORP	9	9	170	18,932	0.0
VEREIT INC	27	25	175	19,466	0.0
DUKE REALTY CORP	10	9	259	28,825	0.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	8	6	99	11,064	0.0
IRON MOUNTAIN INC	6	6	213	23,666	0.0
EQUINIX INC	2	1	748	83,115	0.1
CROWN CASTLE INTL CORP	10	10	1,042	115,770	0.1
EQUITY RESIDENTIAL	10	9	560	62,281	0.1
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	14	14	81	9,059	0.0
INVITATION HOMES INC	—	7	174	19,436	0.0
GGP INC	16	14	285	31,747	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	20	18	374	41,593	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	4	3	143	15,909	0.0
PUBLIC STORAGE	4	3	792	88,047	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	8	7	1,213	134,830	0.1
VORNADO REALTY TRUST	4	4	275	30,578	0.0
KIMCO REALTY CORP	11	11	156	17,429	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3	3	559	62,163	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	336	318	15,830	1,758,638
	銘柄 数 < 比 率 >	38	39	—	<1.7%>
(カナダ)			千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		1	51	4,478	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	%
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		4	3	75	6,478	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		4	4	99	8,588	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	10	9	226	19,545	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		1	1	177	23,114	0.0
KLEPIERRE		6	5	175	22,933	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		2	2	479	62,558	0.1
FONCIERE DES REGIONS		0.948	0.885	80	10,462	0.0
ICADE		1	0.932	74	9,735	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	12	10	987	128,804	
	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		25	22	156	23,445	0.0
HAMMERSON PLC		22	21	119	17,873	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		21	17	171	25,674	0.0
INTU PROPERTIES PLC		26	—	—	—	—
SEGRO PLC		23	26	170	25,514	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	118	88	618	92,508	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	4	—	<0.1%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		97	89	226	18,873	0.0
SCENTRE GROUP		147	133	548	45,749	0.0
GPT GROUP		52	47	229	19,129	0.0
MIRVAC GROUP		107	100	224	18,718	0.0
STOCKLAND		70	64	268	22,385	0.0
WESTFIELD CORP		54	48	429	35,867	0.0
DEXUS		28	26	258	21,613	0.0
GOODMAN GROUP		49	47	430	35,971	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	606	557	2,615	218,309	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<0.2%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		63	55	3,737	52,891	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	63	55	3,737	52,891	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		72	67	122	10,100	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		63	58	99	8,199	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		71	65	135	11,208	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		71	54	143	11,895	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	278	245	500	41,404	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	1,425	1,286	—	2,312,102	
	銘 柄 数 < 比 率 >	64	64	—	<2.2%>	

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

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 1,778	百万円 —
		SP/TSE60	82	—
		SWISS IX	69	—
		EURO ST	420	—
		SPI 200	127	—
		FTSE100	197	—

(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

(2018年5月21日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
株式	千円 101,110,384	% 95.1
投資証券	2,312,102	2.2
コール・ローン等、その他	2,931,896	2.7
投資信託財産総額	106,354,382	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（106,229,629千円）の投資信託財産総額（106,354,382千円）に対する比率は99.9%です。

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

1 アメリカドル＝111.09円	1 カナダドル＝86.21円	1 ユーロ＝130.49円	1 イギリスポンド＝149.49円
1 スイスフラン＝111.12円	1 スウェーデンクローネ＝12.68円	1 ノルウェークローネ＝13.69円	1 デンマーククローネ＝17.52円
1 オーストラリアドル＝83.47円	1 ニュージーランドドル＝76.64円	1 香港ドル＝14.15円	1 シンガポールドル＝82.67円
1 イスラエルシェケル＝30.92円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	106,480,090,499
コール・ローン等	1,977,634,497
株式(評価額)	101,110,384,999
投資証券(評価額)	2,312,102,559
未収入金	286,629,965
未収配当金	211,935,612
差入委託証拠金	581,402,867
(B) 負債	257,214,924
未払金	126,219,600
未払解約金	130,995,094
未払利息	230
(C) 純資産総額(A－B)	106,222,875,575
元本	45,235,834,310
次期繰越損益金	60,987,041,265
(D) 受益権総口数	45,235,834,310口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,482円

<注記事項>

- ①期首元本額 51,068,162,940円
期中追加設定元本額 6,750,454,285円
期中一部解約元本額 12,582,782,915円
また、1口当たり純資産額は、期末2.3482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)	298,814,102円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)	1,238,047,108円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(成長型)	1,142,068,114円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	2,557,603,632円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	13,568,721,333円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	12,487,983,033円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	127,219,374円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(成長型)	273,451,222円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,043,791,346円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式15)	134,841円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式40)	714,182円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式65)	1,286,619円
三菱ＵＦＪ 外国株式ファンドV A(適格機関投資家限定)	12,495,970,414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)	28,990円
合計	45,235,834,310円

○損益の状況 (2017年5月23日～2018年5月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,265,374,748
受取配当金	2,254,001,988
受取利息	4,319,961
その他収益金	10,778,724
支払利息	△ 3,725,925
(B) 有価証券売買損益	11,015,004,312
売買益	16,141,345,396
売買損	△ 5,126,341,084
(C) 先物取引等取引損益	295,578,148
取引益	507,336,680
取引損	△ 211,758,532
(D) 保管費用等	△ 42,777,787
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	13,533,179,421
(F) 前期繰越損益金	54,682,925,228
(G) 追加信託差損益金	8,162,523,928
(H) 解約差損益金	△15,391,587,312
(I) 計(E+F+G+H)	60,987,041,265
次期繰越損益金(I)	60,987,041,265

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

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

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

【お知らせ】

当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)
(2018年1月1日)

三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド

《第18期》決算日2018年5月21日

[計算期間：2017年5月23日～2018年5月21日]

「三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド」は、5月21日に第18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18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）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		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
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
18期(2018年5月21日)	13,877	0.6	381.504	0.6	99.2	0.4	225,098

(注) NOMURA—BPI 総合とは、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 総合は野村證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、野村證券株式会社は一切関係ありません。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	N O M U R A - B P I 総 合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
				騰 落 率		
(期 首) 2017年5月22日	円 13,798	% —	379.387	% —	% 99.3	% 0.3
5月末	13,805	0.1	379.549	0.0	100.0	0.3
6月末	13,766	△0.2	378.570	△0.2	100.5	0.3
7月末	13,768	△0.2	378.545	△0.2	99.6	0.3
8月末	13,842	0.3	380.579	0.3	98.7	0.4
9月末	13,793	△0.0	379.266	△0.0	101.0	0.4
10月末	13,793	△0.0	379.268	△0.0	100.8	0.3
11月末	13,830	0.2	380.257	0.2	99.3	0.5
12月末	13,838	0.3	380.513	0.3	100.0	0.5
2018年1月末	13,816	0.1	379.850	0.1	99.9	0.5
2月末	13,869	0.5	381.295	0.5	98.0	0.5
3月末	13,891	0.7	381.911	0.7	98.1	0.3
4月末	13,880	0.6	381.638	0.6	100.8	0.4
(期 末) 2018年5月21日	13,877	0.6	381.504	0.6	99.2	0.4

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.6%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(0.6%)とほぼ同程度となりました。

基準価額等の推移



(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

- ・日本銀行による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」の継続などを背景に、国内債券市場は上昇しました。

●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総合の構成銘柄を種別や年限等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0.6%の上昇となったため、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ベンチマークとのカイ離が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

- ・公社債の実質の組入比率については、期を通じて概ね100%の水準で推移させ、ベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。そのため、期を通じて現金の保有による影響は軽微でした。

- ・ポートフォリオについては、主に層化抽出法に基づき運用を行い、ファンドとベンチマークの値動きや推定トラッキングエラーなどについてモニターし必要に応じて調整を図ることでベンチマークとの連動性を維持するよう努めました。結果、種別および年限構成比については、概ねベンチマーク並みとなっており、影響は軽微でした。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

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

◎その他の要因

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

◎今後の運用方針

- ・ベンチマーク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

(2017年５月23日～2018年５月21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、13,824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

(2017年５月23日～2018年５月21日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 55,950,087	千円 43,342,752
	地方債証券	1,364,262	1,151,780
	特殊債券	3,400,919	3,108,757 (357,028)
	社債券	3,313,236	2,250,343 (100,000)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債券先物取引	百万円 5,878	百万円 5,579	百万円 －	百万円 －

○利害関係人との取引状況等

(2017年5月23日～2018年5月21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 64,028	百万円 15,771	% 24.6	百万円 49,853	百万円 10,636	% 21.3

(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 —	百万円 —	百万円 821

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公社債	百万円 1,300

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

(2018年5月21日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちＢＢ格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	170,634,000 (100,000)	185,717,710 (100,142)	82.5 (0.0)	— (—)	53.5 (—)	19.6 (—)	9.3 (0.0)
地方債証券	11,777,720 (11,777,720)	12,569,753 (12,569,753)	5.6 (5.6)	— (—)	3.4 (3.4)	1.6 (1.6)	0.6 (0.6)
特殊債券 (除く金融債)	12,547,066 (12,547,066)	13,500,022 (13,500,022)	6.0 (6.0)	— (—)	4.1 (4.1)	1.4 (1.4)	0.4 (0.4)
金融債券	1,430,000 (1,430,000)	1,432,061 (1,432,061)	0.6 (0.6)	— (—)	— (—)	0.4 (0.4)	0.3 (0.3)
普通社債券	9,821,000 (9,821,000)	10,141,299 (10,141,299)	4.5 (4.5)	— (—)	1.7 (1.7)	2.1 (2.1)	0.8 (0.8)
合 計	206,209,786 (35,675,786)	223,360,847 (37,743,279)	99.2 (16.8)	— (—)	62.8 (9.2)	25.0 (5.4)	11.5 (2.2)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘	柄	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378回利付国債 (2年)		0.1	650,000	651,787	2019/7/15
第380回利付国債 (2年)		0.1	1,200,000	1,203,792	2019/9/15
第381回利付国債 (2年)		0.1	400,000	401,344	2019/10/15
第383回利付国債 (2年)		0.1	1,100,000	1,104,136	2019/12/15
第384回利付国債 (2年)		0.1	850,000	853,374	2020/1/15
第385回利付国債 (2年)		0.1	300,000	301,251	2020/2/15
第386回利付国債 (2年)		0.1	550,000	552,398	2020/3/15
第387回利付国債 (2年)		0.1	1,300,000	1,305,928	2020/4/15
第118回利付国債 (5年)		0.2	1,200,000	1,204,404	2019/6/20
第119回利付国債 (5年)		0.1	610,000	611,579	2019/6/20
第120回利付国債 (5年)		0.2	1,040,000	1,044,638	2019/9/20
第121回利付国債 (5年)		0.1	380,000	381,189	2019/9/20
第122回利付国債 (5年)		0.1	2,230,000	2,238,117	2019/12/20
第123回利付国債 (5年)		0.1	1,100,000	1,104,532	2020/3/20
第124回利付国債 (5年)		0.1	1,880,000	1,888,817	2020/6/20
第125回利付国債 (5年)		0.1	2,110,000	2,121,098	2020/9/20
第126回利付国債 (5年)		0.1	1,420,000	1,428,264	2020/12/20
第127回利付国債 (5年)		0.1	1,500,000	1,509,360	2021/3/20
第128回利付国債 (5年)		0.1	2,110,000	2,124,326	2021/6/20
第129回利付国債 (5年)		0.1	2,090,000	2,105,027	2021/9/20
第130回利付国債 (5年)		0.1	1,500,000	1,511,310	2021/12/20
第131回利付国債 (5年)		0.1	1,810,000	1,824,244	2022/3/20
第132回利付国債 (5年)		0.1	2,200,000	2,218,458	2022/6/20
第133回利付国債 (5年)		0.1	1,810,000	1,826,145	2022/9/20
第134回利付国債 (5年)		0.1	1,750,000	1,766,502	2022/12/20
第135回利付国債 (5年)		0.1	930,000	939,244	2023/3/20
第1回利付国債 (40年)		2.4	220,000	316,186	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)		2.2	285,000	396,409	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)		2.2	285,000	398,344	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)		2.2	420,000	588,953	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)		2.0	410,000	552,753	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)		1.9	470,000	620,968	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)		1.7	420,000	529,683	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)		1.4	540,000	630,369	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)		0.4	750,000	634,327	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)		0.9	820,000	821,180	2057/3/20
第301回利付国債 (10年)		1.5	620,000	630,986	2019/6/20
第302回利付国債 (10年)		1.4	680,000	691,315	2019/6/20
第303回利付国債 (10年)		1.4	1,220,000	1,245,058	2019/9/20
第304回利付国債 (10年)		1.3	720,000	733,824	2019/9/20
第305回利付国債 (10年)		1.3	1,080,000	1,104,548	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)		1.4	1,120,000	1,151,382	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)		1.3	1,155,000	1,185,249	2020/3/20
第308回利付国債 (10年)		1.3	690,000	710,568	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)		1.1	1,580,000	1,620,511	2020/6/20

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310回利付国債 (10年)		1.0	1,200,000	1,231,560	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)		0.8	590,000	602,755	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)		1.2	2,180,000	2,255,079	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)		1.3	640,000	665,875	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)		1.1	580,000	600,155	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)		1.2	780,000	811,816	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)		1.1	400,000	415,080	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)		1.1	250,000	260,157	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)		1.0	550,000	570,504	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)		1.1	790,000	824,357	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)		1.0	640,000	665,536	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)		1.0	870,000	906,940	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)		0.9	420,000	436,220	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)		0.9	470,000	489,251	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)		0.8	980,000	1,016,122	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)		0.8	1,390,000	1,444,098	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)		0.7	100,000	103,657	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)		0.8	880,000	916,229	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)		0.6	1,770,000	1,830,091	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)		0.8	1,730,000	1,808,559	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)		0.8	1,240,000	1,298,416	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)		0.6	640,000	663,296	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)		0.6	1,880,000	1,951,101	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)		0.6	1,090,000	1,132,728	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)		0.6	1,630,000	1,695,640	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)		0.5	1,760,000	1,822,057	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)		0.5	350,000	362,708	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)		0.3	780,000	798,018	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)		0.4	1,210,000	1,246,868	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)		0.4	1,910,000	1,968,961	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)		0.4	1,510,000	1,557,700	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)		0.3	1,100,000	1,127,148	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)		0.1	1,560,000	1,574,664	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)		0.1	1,530,000	1,543,601	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)		0.1	2,140,000	2,157,826	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)		0.1	1,640,000	1,652,644	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)		0.1	1,630,000	1,641,475	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)		0.1	1,570,000	1,579,938	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)		0.1	1,820,000	1,830,992	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)		0.1	2,100,000	2,112,012	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)		0.1	1,270,000	1,276,197	2028/3/20
第1回利付国債 (30年)		2.8	120,000	156,214	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)		2.4	170,000	214,662	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)		2.3	190,000	238,412	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)		2.9	125,000	167,070	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)		2.2	180,000	226,310	2031/5/20

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6回利付国債 (30年)		2.4	170,000	219,301	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)		2.3	225,000	288,537	2032/ 5 /20
第8回利付国債 (30年)		1.8	160,000	194,710	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)		1.4	90,000	104,486	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)		1.1	263,000	294,120	2033/ 3 /20
第11回利付国債 (30年)		1.7	100,000	120,632	2033/ 6 /20
第12回利付国債 (30年)		2.1	205,000	259,845	2033/ 9 /20
第13回利付国債 (30年)		2.0	390,000	489,048	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)		2.4	380,000	500,574	2034/ 3 /20
第15回利付国債 (30年)		2.5	440,000	587,584	2034/ 6 /20
第16回利付国債 (30年)		2.5	345,000	461,727	2034/ 9 /20
第17回利付国債 (30年)		2.4	350,000	463,893	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)		2.3	360,000	471,931	2035/ 3 /20
第19回利付国債 (30年)		2.3	290,000	380,828	2035/ 6 /20
第20回利付国債 (30年)		2.5	260,000	350,768	2035/ 9 /20
第21回利付国債 (30年)		2.3	250,000	329,102	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)		2.5	285,000	385,556	2036/ 3 /20
第23回利付国債 (30年)		2.5	140,000	189,889	2036/ 6 /20
第24回利付国債 (30年)		2.5	230,000	312,225	2036/ 9 /20
第25回利付国債 (30年)		2.3	205,000	271,426	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)		2.4	430,000	577,541	2037/ 3 /20
第27回利付国債 (30年)		2.5	400,000	545,832	2037/ 9 /20
第28回利付国債 (30年)		2.5	415,000	568,309	2038/ 3 /20
第29回利付国債 (30年)		2.4	480,000	650,112	2038/ 9 /20
第30回利付国債 (30年)		2.3	565,000	756,834	2039/ 3 /20
第31回利付国債 (30年)		2.2	525,000	695,021	2039/ 9 /20
第32回利付国債 (30年)		2.3	610,000	822,036	2040/ 3 /20
第33回利付国債 (30年)		2.0	753,000	971,113	2040/ 9 /20
第34回利付国債 (30年)		2.2	675,000	901,793	2041/ 3 /20
第35回利付国債 (30年)		2.0	750,000	972,855	2041/ 9 /20
第36回利付国債 (30年)		2.0	700,000	909,986	2042/ 3 /20
第37回利付国債 (30年)		1.9	700,000	896,063	2042/ 9 /20
第38回利付国債 (30年)		1.8	515,000	649,239	2043/ 3 /20
第39回利付国債 (30年)		1.9	500,000	641,690	2043/ 6 /20
第40回利付国債 (30年)		1.8	370,000	466,603	2043/ 9 /20
第41回利付国債 (30年)		1.7	350,000	433,457	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)		1.7	450,000	557,572	2044/ 3 /20
第43回利付国債 (30年)		1.7	530,000	657,025	2044/ 6 /20
第44回利付国債 (30年)		1.7	450,000	558,742	2044/ 9 /20
第45回利付国債 (30年)		1.5	520,000	620,880	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)		1.5	630,000	752,327	2045/ 3 /20
第47回利付国債 (30年)		1.6	650,000	792,187	2045/ 6 /20
第48回利付国債 (30年)		1.4	710,000	830,692	2045/ 9 /20
第49回利付国債 (30年)		1.4	600,000	701,958	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)		0.8	560,000	571,043	2046/ 3 /20
第51回利付国債 (30年)		0.3	590,000	525,973	2046/ 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52回利付国債 (30年)		0.5	630,000	592,502	2046/ 9 /20
第53回利付国債 (30年)		0.6	610,000	588,460	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)		0.8	400,000	406,184	2047/ 3 /20
第55回利付国債 (30年)		0.8	660,000	669,471	2047/ 6 /20
第56回利付国債 (30年)		0.8	620,000	628,202	2047/ 9 /20
第57回利付国債 (30年)		0.8	770,000	779,317	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)		0.8	400,000	404,380	2048/ 3 /20
第43回利付国債 (20年)		2.9	360,000	374,572	2019/ 9 /20
第44回利付国債 (20年)		2.5	710,000	744,200	2020/ 3 /20
第45回利付国債 (20年)		2.4	100,000	104,634	2020/ 3 /20
第47回利付国債 (20年)		2.2	100,000	105,443	2020/ 9 /21
第48回利付国債 (20年)		2.5	250,000	267,007	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)		2.1	170,000	180,752	2021/ 3 /22
第50回利付国債 (20年)		1.9	515,000	544,643	2021/ 3 /22
第51回利付国債 (20年)		2.0	140,000	149,181	2021/ 6 /21
第52回利付国債 (20年)		2.1	260,000	279,273	2021/ 9 /21
第53回利付国債 (20年)		2.1	80,000	86,340	2021/12/20
第54回利付国債 (20年)		2.2	530,000	573,905	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)		2.0	240,000	259,425	2022/ 3 /21
第56回利付国債 (20年)		2.0	370,000	401,908	2022/ 6 /20
第57回利付国債 (20年)		1.9	160,000	173,142	2022/ 6 /20
第58回利付国債 (20年)		1.9	350,000	380,450	2022/ 9 /20
第59回利付国債 (20年)		1.7	590,000	638,722	2022/12/20
第60回利付国債 (20年)		1.4	230,000	245,819	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)		1.0	260,000	273,738	2023/ 3 /20
第62回利付国債 (20年)		0.8	560,000	585,278	2023/ 6 /20
第63回利付国債 (20年)		1.8	275,000	301,444	2023/ 6 /20
第64回利付国債 (20年)		1.9	480,000	530,740	2023/ 9 /20
第65回利付国債 (20年)		1.9	430,000	477,459	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)		1.8	170,000	187,810	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)		1.9	80,000	89,195	2024/ 3 /20
第68回利付国債 (20年)		2.2	395,000	447,333	2024/ 3 /20
第69回利付国債 (20年)		2.1	120,000	135,157	2024/ 3 /20
第70回利付国債 (20年)		2.4	510,000	586,372	2024/ 6 /20
第71回利付国債 (20年)		2.2	200,000	227,510	2024/ 6 /20
第72回利付国債 (20年)		2.1	645,000	732,842	2024/ 9 /20
第73回利付国債 (20年)		2.0	200,000	226,920	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)		2.1	380,000	433,656	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)		2.1	230,000	263,605	2025/ 3 /20
第76回利付国債 (20年)		1.9	210,000	237,808	2025/ 3 /20
第77回利付国債 (20年)		2.0	260,000	296,210	2025/ 3 /20
第79回利付国債 (20年)		2.0	100,000	114,401	2025/ 6 /20
第80回利付国債 (20年)		2.1	370,000	425,910	2025/ 6 /20
第82回利付国債 (20年)		2.1	620,000	716,769	2025/ 9 /20
第83回利付国債 (20年)		2.1	182,000	211,292	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)		2.0	410,000	472,877	2025/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第85回利付国債 (20年)		2.1	230,000	268,014	2026/ 3 /20
第86回利付国債 (20年)		2.3	532,000	628,265	2026/ 3 /20
第87回利付国債 (20年)		2.2	170,000	199,430	2026/ 3 /20
第88回利付国債 (20年)		2.3	460,000	545,918	2026/ 6 /20
第89回利付国債 (20年)		2.2	130,000	153,231	2026/ 6 /20
第90回利付国債 (20年)		2.2	470,000	555,916	2026/ 9 /20
第91回利付国債 (20年)		2.3	80,000	95,289	2026/ 9 /20
第92回利付国債 (20年)		2.1	650,000	766,142	2026/12/20
第94回利付国債 (20年)		2.1	260,000	307,517	2027/ 3 /20
第95回利付国債 (20年)		2.3	490,000	590,714	2027/ 6 /20
第96回利付国債 (20年)		2.1	120,000	142,491	2027/ 6 /20
第97回利付国債 (20年)		2.2	330,000	396,448	2027/ 9 /20
第98回利付国債 (20年)		2.1	340,000	405,300	2027/ 9 /20
第99回利付国債 (20年)		2.1	635,000	759,485	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)		2.2	370,000	447,574	2028/ 3 /20
第101回利付国債 (20年)		2.4	350,000	430,223	2028/ 3 /20
第102回利付国債 (20年)		2.4	190,000	234,425	2028/ 6 /20
第103回利付国債 (20年)		2.3	320,000	391,616	2028/ 6 /20
第104回利付国債 (20年)		2.1	310,000	373,171	2028/ 6 /20
第105回利付国債 (20年)		2.1	350,000	422,660	2028/ 9 /20
第106回利付国債 (20年)		2.2	210,000	255,748	2028/ 9 /20
第107回利付国債 (20年)		2.1	200,000	242,260	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)		1.9	250,000	297,582	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)		1.9	570,000	680,260	2029/ 3 /20
第110回利付国債 (20年)		2.1	100,000	121,487	2029/ 3 /20
第111回利付国債 (20年)		2.2	320,000	393,420	2029/ 6 /20
第112回利付国債 (20年)		2.1	510,000	621,429	2029/ 6 /20
第113回利付国債 (20年)		2.1	460,000	562,133	2029/ 9 /20
第114回利付国債 (20年)		2.1	580,000	710,761	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)		2.2	290,000	358,692	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)		2.2	215,000	266,683	2030/ 3 /20
第117回利付国債 (20年)		2.1	580,000	712,675	2030/ 3 /20
第118回利付国債 (20年)		2.0	314,000	383,145	2030/ 6 /20
第119回利付国債 (20年)		1.8	240,000	287,152	2030/ 6 /20
第120回利付国債 (20年)		1.6	200,000	234,546	2030/ 6 /20
第121回利付国債 (20年)		1.9	490,000	593,458	2030/ 9 /20
第122回利付国債 (20年)		1.8	310,000	371,702	2030/ 9 /20
第123回利付国債 (20年)		2.1	500,000	619,625	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)		2.0	340,000	417,149	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)		2.2	410,000	514,480	2031/ 3 /20
第126回利付国債 (20年)		2.0	330,000	405,810	2031/ 3 /20
第127回利付国債 (20年)		1.9	240,000	292,120	2031/ 3 /20
第128回利付国債 (20年)		1.9	480,000	585,124	2031/ 6 /20
第129回利付国債 (20年)		1.8	270,000	325,684	2031/ 6 /20
第130回利付国債 (20年)		1.8	580,000	700,953	2031/ 9 /20
第131回利付国債 (20年)		1.7	200,000	239,110	2031/ 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132回利付国債 (20年)		1.7	490,000	586,789	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)		1.8	380,000	460,081	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)		1.8	410,000	497,260	2032/ 3 /20
第135回利付国債 (20年)		1.7	220,000	263,692	2032/ 3 /20
第136回利付国債 (20年)		1.6	260,000	308,146	2032/ 3 /20
第137回利付国債 (20年)		1.7	260,000	312,122	2032/ 6 /20
第138回利付国債 (20年)		1.5	270,000	316,764	2032/ 6 /20
第139回利付国債 (20年)		1.6	250,000	296,707	2032/ 6 /20
第140回利付国債 (20年)		1.7	880,000	1,058,006	2032/ 9 /20
第141回利付国債 (20年)		1.7	930,000	1,118,910	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)		1.8	120,000	146,166	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)		1.6	540,000	642,848	2033/ 3 /20
第144回利付国債 (20年)		1.5	470,000	552,809	2033/ 3 /20
第145回利付国債 (20年)		1.7	990,000	1,194,256	2033/ 6 /20
第146回利付国債 (20年)		1.7	850,000	1,025,924	2033/ 9 /20
第147回利付国債 (20年)		1.6	620,000	739,970	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	670,000	789,688	2034/ 3 /20
第149回利付国債 (20年)		1.5	800,000	943,640	2034/ 6 /20
第150回利付国債 (20年)		1.4	880,000	1,024,320	2034/ 9 /20
第151回利付国債 (20年)		1.2	850,000	963,220	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	900,000	1,019,133	2035/ 3 /20
第153回利付国債 (20年)		1.3	920,000	1,056,592	2035/ 6 /20
第154回利付国債 (20年)		1.2	910,000	1,029,655	2035/ 9 /20
第155回利付国債 (20年)		1.0	980,000	1,075,697	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	840,000	835,128	2036/ 3 /20
第157回利付国債 (20年)		0.2	1,040,000	995,696	2036/ 6 /20
第158回利付国債 (20年)		0.5	930,000	936,286	2036/ 9 /20
第159回利付国債 (20年)		0.6	920,000	940,433	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)		0.7	850,000	882,283	2037/ 3 /20
第161回利付国債 (20年)		0.6	890,000	906,287	2037/ 6 /20
第162回利付国債 (20年)		0.6	840,000	853,297	2037/ 9 /20
第163回利付国債 (20年)		0.6	930,000	943,215	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)		0.5	710,000	705,541	2038/ 3 /20
第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013)		0.67	100,000	100,142	2018/11/15
小 計			170,634,000	185,717,710	
地方債証券					
第 5 回東京都公募公債 (20年)		2.11	100,000	113,784	2025/ 3 /19
第 7 回東京都公募公債 (20年)		2.16	100,000	115,034	2025/ 9 /19
第 7 回東京都公募公債 (30年)		2.51	70,000	93,537	2038/ 9 /17
第10回東京都公募公債 (20年)		2.33	100,000	118,175	2026/ 9 /18
第10回東京都公募公債 (30年)		2.31	100,000	130,605	2039/ 9 /20
第25回東京都公募公債 (20年)		1.8	100,000	118,834	2031/12/19
第27回東京都公募公債 (20年)		1.68	100,000	117,638	2032/12/20
第682回東京都公募公債		1.32	100,000	102,356	2020/ 3 /19
第700回東京都公募公債		1.02	100,000	103,289	2021/ 9 /17
第719回東京都公募公債		0.86	200,000	208,006	2023/ 3 /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730回東京都公募公債		0.664	100,000	103,507	2024/3/19
第749回東京都公募公債		0.436	100,000	102,445	2025/9/19
第770回東京都公募公債		0.18	100,000	100,178	2027/6/18
第771回東京都公募公債		0.155	200,000	199,540	2027/9/17
第3回東京都公募公債（20年）		2.26	100,000	112,775	2024/3/19
平成21年度第7回北海道公募公債		1.46	50,000	50,963	2019/9/25
平成22年度第8回北海道公募公債		0.96	80,000	81,819	2020/10/29
平成24年度第9回北海道公募公債		0.79	50,000	51,641	2022/10/31
平成26年度第13回北海道公募公債		0.461	100,000	102,366	2024/12/26
平成28年度第1回北海道公募公債		0.085	100,000	99,524	2026/4/28
平成29年度第1回北海道公募公債		0.2	272,000	272,356	2027/4/28
第2回神奈川県公募公債（30年）		2.87	100,000	138,601	2036/6/20
第4回神奈川県公募公債（30年）		2.62	100,000	135,423	2038/3/19
第196回神奈川県公募公債		0.678	100,000	103,075	2023/3/20
第5回大阪府公募公債（20年）		2.16	100,000	121,299	2030/5/28
第332回大阪府公募公債		1.58	50,000	51,178	2019/11/27
第335回大阪府公募公債		1.48	30,000	30,768	2020/2/25
第336回大阪府公募公債		1.46	50,000	51,327	2020/3/30
第342回大阪府公募公債		1.2	25,000	25,690	2020/9/29
第344回大阪府公募公債		1.06	21,000	21,546	2020/11/27
第348回大阪府公募公債		1.32	50,000	51,841	2021/3/30
第358回大阪府公募公債		0.97	70,000	72,440	2022/2/28
第404回大阪府公募公債		0.4	400,000	407,896	2026/1/28
第408回大阪府公募公債		0.072	118,000	117,267	2026/5/29
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）		2.19	100,000	121,182	2029/9/20
平成22年度第2回京都府公募公債		1.16	40,000	41,060	2020/9/24
平成22年度第7回京都府公募公債		1.31	45,900	47,564	2021/3/22
平成23年度第2回京都府公募公債		1.2	66,000	68,381	2021/6/22
第2回兵庫県公募公債（30年）		2.36	50,000	65,723	2040/3/19
第5回兵庫県公募公債（15年）		1.31	100,000	110,639	2028/5/26
平成21年度第35回兵庫県公募公債		1.46	40,000	40,956	2020/1/22
平成23年度第11回兵庫県公募公債		0.95	50,000	51,675	2022/1/27
平成24年度第18回兵庫県公募公債		0.77	100,000	103,170	2022/10/19
平成28年度第29回兵庫県公募公債		0.238	100,000	100,499	2027/2/19
第3回静岡県公募公債（15年）		1.368	100,000	110,895	2027/10/29
第14回静岡県公募公債（20年）		1.736	100,000	118,118	2032/6/18
平成25年度第8回静岡県公募公債		0.699	29,800	30,829	2023/10/24
平成20年度第8回愛知県公募公債（20年）		2.04	200,000	237,290	2028/12/20
平成21年度第6回愛知県公募公債		1.44	50,000	50,839	2019/7/30
平成21年度第10回愛知県公募公債		1.38	201,000	204,915	2019/10/30
平成22年度第5回愛知県公募公債		1.258	27,200	27,903	2020/6/30
平成23年度第11回愛知県公募公債		1.03	70,000	72,403	2021/10/28
平成23年度第20回愛知県公募公債		1.082	100,000	104,030	2022/3/29
平成28年度第16回愛知県公募公債		0.259	200,000	201,530	2027/2/12
平成22年度第3回広島県公募公債		1.08	45,000	46,107	2020/9/24
平成26年度第7回広島県公募公債		0.46	260,000	266,450	2025/3/25

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
平成27年度第5回広島県公募公債		0.41	200,000	204,254	2026/1/26
第8回埼玉県公募公債（20年）		2.19	100,000	121,182	2029/9/20
第10回埼玉県公募公債（20年）		1.94	100,000	119,579	2030/11/12
平成21年度第8回埼玉県公募公債		1.3	12,000	12,243	2019/12/25
平成22年度第11回埼玉県公募公債		1.28	40,000	41,383	2021/2/25
平成23年度第1回埼玉県公募公債		1.37	100,000	103,928	2021/4/27
平成22年度第10回福岡県公募公債		1.36	50,000	51,840	2021/2/25
平成22年度第12回千葉県公募公債		1.28	80,000	82,767	2021/2/25
平成22年度第14回千葉県公募公債		1.33	80,000	82,955	2021/3/25
平成23年度第5回千葉県公募公債		1.06	80,000	82,892	2021/11/25
平成23年度第9回千葉県公募公債		1.0	80,000	82,963	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債		1.05	80,000	83,185	2022/4/25
平成21年度第1回新潟県公募公債		1.42	54,500	55,399	2019/7/29
平成21年度第2回新潟県公募公債		1.55	80,550	82,410	2019/11/27
平成27年度第2回新潟県公募公債		0.215	140,000	140,905	2026/2/26
平成22年度第1回岐阜県公募公債		1.21	42,000	43,170	2020/9/30
平成21年度第1回大分県公募公債		1.35	54,900	55,947	2019/10/31
第80回共同発行市場公募地方債		1.54	200,000	204,572	2019/11/25
第81回共同発行市場公募地方債		1.32	50,000	51,029	2019/12/25
第84回共同発行市場公募地方債		1.38	20,000	20,497	2020/3/25
第90回共同発行市場公募地方債		1.12	100,000	102,559	2020/9/25
第96回共同発行市場公募地方債		1.29	20,000	20,716	2021/3/25
第104回共同発行市場公募地方債		1.03	100,000	103,511	2021/11/25
第108回共同発行市場公募地方債		1.01	70,000	72,619	2022/3/25
第116回共同発行市場公募地方債		0.8	300,000	310,275	2022/11/25
第130回共同発行市場公募地方債		0.76	100,000	103,905	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債		0.66	100,000	103,434	2024/3/25
第133回共同発行市場公募地方債		0.689	600,000	621,756	2024/4/25
第140回共同発行市場公募地方債		0.505	200,000	205,374	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債		0.345	200,000	203,318	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債		0.47	200,000	205,098	2025/3/25
平成21年度第1回栃木県公募公債		1.55	100,000	102,322	2019/11/30
平成21年度第1回新潟市公募公債		1.34	94,450	96,424	2019/12/25
平成21年度第1回浜松市公募公債		1.54	33,900	34,678	2019/11/27
平成21年度第6回大阪市公募公債		1.57	50,000	51,166	2019/11/25
平成22年度第8回大阪市公募公債		1.28	50,000	51,679	2021/1/25
平成22年度第10回大阪市公募公債		1.31	20,000	20,721	2021/3/17
平成26年度第7回大阪市公募公債		0.535	100,000	102,885	2024/11/28
第1回名古屋市公募公債（20年）		1.99	100,000	110,709	2023/12/20
第9回名古屋市公募公債（20年）		2.07	100,000	119,201	2028/12/20
第9回名古屋市公募公債（30年）		2.095	90,000	115,021	2042/9/19
第3回京都市公募公債（20年）		2.09	100,000	114,799	2025/12/19
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）		2.54	110,000	131,195	2026/6/19
平成23年度第5回神戸市公募公債		1.025	100,000	103,393	2021/10/19
第5回横浜市公募公債（20年）		2.17	100,000	114,557	2025/6/20
第7回横浜市公募公債（20年）		2.06	250,000	286,435	2025/12/19

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	
第27回横浜市公募公債（20年）		1.599	40,000	46,620	2033/ 5 /20
平成22年度第 7 回札幌市公募公債		1.05	50,000	51,187	2020/ 9 /18
第 7 回川崎市公募公債（20年）		2.08	100,000	119,731	2029/ 7 /17
平成22年度第 9 回福岡市公募公債		1.32	127,300	131,965	2021/ 3 /25
平成23年度第 6 回福岡市公募公債		1.0	50,000	51,665	2021/10/28
平成24年度第 4 回福岡市公募公債		0.8	70,000	72,361	2022/10/31
平成22年度第 6 回広島市公募公債		1.21	50,000	51,784	2021/ 5 /31
平成22年度第 1 回相模原市公募公債		1.29	60,000	61,954	2020/12/18
平成22年度第 1 回三重県公募公債		1.056	149,170	153,052	2020/11/30
平成23年度第 1 回三重県公募公債		1.021	162,550	168,227	2021/11/30
平成21年度第 1 回徳島県公募公債		1.55	36,500	37,346	2019/11/29
平成22年度第 1 回岡山県公募公債		1.05	50,000	51,294	2020/11/30
平成27年度第 1 回岡山県公募公債		0.395	189,000	192,808	2026/ 1 /29
小	計		11,777,720	12,569,753	
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	105,353	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	105,498	2021/ 3 /26
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	203,376	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	126,116	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	241,846	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	10,253	2020/ 2 /28
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	221,000	227,139	2020/ 4 /30
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	121,455	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	129,998	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	119,314	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	121,905	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	119,494	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	14,535	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	126,883	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	103,741	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	310,758	2022/10/31
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.834	200,000	207,982	2023/ 1 /31
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	31,189	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	350,516	2023/ 5 /31
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	103,655	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	208,627	2024/ 5 /31
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.644	100,000	103,746	2024/ 6 /28
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.495	100,000	102,961	2024/11/29
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	411,008	2025/ 8 /29
第344回政府保証道路債券		1.6	100,000	103,506	2020/ 7 /15
第12回政府保証日本政策投資銀行債券		2.1	100,000	106,617	2021/ 6 /28
第 1 回政府保証公営企業債券（15年）		1.6	200,000	206,806	2020/ 6 /22
第 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.4	200,000	203,266	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	31,542	2019/ 9 /13
第 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.2	200,000	203,470	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	11,371	2021/ 2 /15

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22回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.3	20,000	20,747	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	208,032	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	36,228	2022/3/14
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.815	38,000	39,497	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	104,395	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	103,778	2023/12/18
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.115	400,000	400,340	2027/1/19
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.16	125,000	125,395	2027/7/16
第2回政府保証公営企業債券(15年)		2.1	100,000	106,190	2021/4/16
第16回政府保証民間都市開発債券		0.699	90,000	93,356	2023/10/20
第211回政府保証預金保険機構債券		0.1	100,000	100,444	2021/10/19
第5回政府保証新関西国際空港債券		0.145	100,000	100,262	2027/3/30
第13回政府保証中部国際空港債券		1.3	72,000	74,699	2021/3/15
第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債)		2.23	30,000	35,410	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	149,946	2045/9/20
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	145,468	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	157,773	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	121,234	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	122,624	2029/4/20
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	103,602	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	118,283	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	104,326	2023/6/20
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)		1.03	100,000	104,651	2023/3/22
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)		2.95	100,000	136,873	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	121,578	2030/1/28
第7回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.2	100,000	112,151	2024/3/22
第8回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.25	100,000	112,441	2024/3/22
第13回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.278	100,000	102,605	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	121,799	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	118,837	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	116,948	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	206,736	2023/1/27
第47回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.576	200,000	205,078	2023/4/28
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.546	70,000	80,303	2031/7/30
第1回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.1	100,000	108,329	2022/6/20
第100回都市再生債券(財投機関債)		0.569	100,000	102,830	2024/11/20
第7回本州四国連絡橋債券(財投機関債)		2.26	100,000	114,866	2025/6/20
第29回福祉医療機構債券(財投機関債)		1.145	100,000	103,935	2021/12/20
第4回中部国際空港(財投機関債)		0.305	200,000	201,114	2027/2/22
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	33,976	35,705	2042/5/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.19	36,536	38,649	2042/6/10
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.85	19,604	19,713	2036/9/10
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.82	29,086	30,229	2036/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.76	44,865	46,556	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.26	15,603	16,484	2037/5/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.25	47,163	49,808	2037/5/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.99	18,994	20,004	2042/12/10
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.52	33,714	34,215	2037/12/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.43	12,159	12,378	2038/2/10
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券		0.92	13,119	13,271	2038/6/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.16	20,173	21,374	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	45,452	46,958	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	46,094	47,710	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	23,244	23,971	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	14,450	14,943	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	123,549	2028/9/20
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.95	34,730	37,272	2044/10/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	16,957	17,580	2040/6/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	35,222	37,635	2044/12/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	18,326	19,032	2040/7/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	76,276	80,880	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.71	75,102	79,352	2045/6/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	34,128	35,591	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	42,994	44,941	2045/9/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	33,612	35,563	2041/5/10
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.3	33,630	35,665	2041/7/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	145,803	155,586	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	82,812	88,118	2046/2/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	77,812	83,076	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	38,153	40,512	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	38,742	41,001	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	41,958	44,436	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.18	37,366	39,724	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	44,867	47,323	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	46,819	49,350	2046/10/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	51,011	53,773	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	52,254	55,105	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	54,651	57,380	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.26	105,602	110,528	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	103,447	2020/12/18
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	175,176	182,479	2047/11/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	61,511	63,937	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	124,142	128,863	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	103,358	2021/9/17
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	119,061	2031/11/18
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	135,708	139,902	2049/11/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	81,807	83,785	2050/5/10
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	239,304	2032/4/16
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.44	96,826	97,326	2052/7/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	98,487	98,635	2052/12/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	99,020	99,605	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	99,479	99,750	2053/3/10

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131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	99,851	99,920	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	100,000	99,980	2053/5/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	100,000	100,172	2053/6/10
第194回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	0.075	100,000	99,006	2026/10/20
第17回国際協力機構債券(財投機関債)	0.72	30,000	30,901	2022/12/26
第21回西日本高速道路	0.754	100,000	103,372	2023/12/20
第25回西日本高速道路	0.524	100,000	102,304	2024/12/20
第17回東京都住宅供給公社債券	1.17	100,000	102,915	2021/9/17
小 計		12,547,066	13,500,022	
金融債券				
い第775号商工債券	0.2	100,000	100,159	2019/12/27
い第769号農林債券	0.3	130,000	130,362	2019/6/27
い第774号農林債券	0.24	100,000	100,296	2019/11/27
い第778号農林債券	0.25	300,000	301,134	2020/3/27
第310回信金中金債	0.225	200,000	200,730	2020/9/25
第318回信金中金債	0.04	300,000	299,772	2021/5/27
第321回信金中金債	0.03	200,000	199,608	2021/8/27
第337回信金中金債	0.11	100,000	100,000	2022/12/27
小 計		1,430,000	1,432,061	
普通社債券				
第548回東京電力	2.347	100,000	115,908	2028/9/29
第559回東京電力	1.377	140,000	142,408	2019/10/29
第499回中部電力	1.194	50,000	52,530	2023/6/23
第518回中部電力	0.19	200,000	200,000	2023/1/25
第510回関西電力	0.49	100,000	100,529	2027/7/23
第383回中国電力	0.764	100,000	103,089	2024/10/25
第393回中国電力	0.26	100,000	99,173	2026/11/25
第297回北陸電力	0.976	20,000	20,439	2020/10/23
第494回東北電力	0.425	200,000	200,438	2027/6/25
第400回九州電力	1.777	70,000	72,311	2020/4/24
第427回九州電力	1.024	100,000	104,277	2024/5/24
第316回北海道電力	1.164	100,000	102,224	2020/6/25
第319回北海道電力	0.514	100,000	100,618	2019/9/25
第26回関西国際空港	1.156	100,000	102,585	2020/9/18
第15回成田国際空港	0.739	100,000	103,359	2024/2/20
第7回大和ハウス工業	0.06	100,000	99,727	2021/6/18
第7回明治ホールディングス	0.22	100,000	99,852	2024/9/13
第11回アサヒグループホールディングス	0.23	100,000	100,067	2024/6/13
第4回トヨタ紡織	0.21	200,000	199,626	2024/12/20
第22回森ビル	0.18	100,000	100,005	2023/3/8
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	200,000	202,142	2022/6/20
第31回東レ	0.25	100,000	100,095	2024/7/19
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	103,209	2022/12/2
第4回富士フイルムホールディングス	0.005	200,000	199,664	2020/3/3
第4回新日本製鐵	0.375	100,000	100,147	2027/5/20
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	103,225	2021/9/17

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5回日本電産		0.001	100,000	99,867	2019/11/25
第15回パナソニック		0.19	100,000	100,152	2021/9/17
第12回デンソー		0.01	100,000	99,652	2021/9/17
第34回三菱重工業		0.104	200,000	199,524	2022/8/29
第1回明治安田生命2014基金		0.51	100,000	100,352	2019/8/7
第7回ＪＡ三井リース		0.2	100,000	99,791	2022/9/15
第1回日本生命2017基金		0.304	100,000	100,111	2021/8/2
第78回三菱商事		1.155	100,000	103,645	2022/3/9
第79回三菱商事		1.022	100,000	103,285	2022/5/20
第67回クレディセゾン		0.06	100,000	99,944	2021/4/30
第7回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）		2.5	200,000	204,926	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	104,785	2021/10/29
第88回三菱東京ＵＦＪ銀行		2.34	100,000	117,866	2027/4/20
第6回りそな銀行（劣後特約付）		2.084	100,000	103,438	2020/3/4
第9回三菱ＵＦＪ信託銀行（劣後特約付）		1.68	100,000	104,248	2021/4/28
第12回住友信託銀行（劣後特約付）		1.373	100,000	102,957	2020/11/11
第15回住友信託銀行（劣後特約付）		1.62	100,000	105,329	2022/3/22
第20回三井住友銀行（劣後特約付）		2.21	100,000	102,448	2019/7/24
第22回三井住友銀行（劣後特約付）		1.43	100,000	102,971	2020/9/28
第23回三井住友銀行（劣後特約付）		1.61	100,000	103,708	2020/12/17
第18回みずほ銀行（劣後特約付）		2.14	100,000	113,597	2026/9/11
第19回みずほ銀行（劣後特約付）		1.67	100,000	105,418	2022/2/24
第20回東京センチュリーリース		0.19	100,000	99,743	2022/10/18
第22回東京センチュリーリース		0.06	100,000	99,959	2021/4/13
第38回ホンダファイナンス		0.01	100,000	99,595	2021/3/19
第77回トヨタファイナンス		0.145	100,000	99,881	2024/7/25
第29回リコーリース		0.08	100,000	100,016	2021/1/22
第30回リコーリース		0.16	100,000	100,040	2022/1/21
第52回日立キャピタル		0.508	100,000	100,668	2021/6/18
第62回日立キャピタル		0.001	200,000	199,672	2019/9/20
第39回三菱ＵＦＪリース		0.12	100,000	99,821	2021/6/9
第41回三菱ＵＦＪリース		0.06	200,000	199,218	2021/7/23
第23回野村ホールディングス		1.808	100,000	103,526	2020/6/24
第24回野村ホールディングス		2.329	100,000	113,746	2025/6/24
第58回三井不動産		0.1	100,000	99,958	2023/2/24
第72回三菱地所		2.28	100,000	112,701	2024/9/20
第80回三菱地所		2.305	100,000	117,159	2027/3/19
第125回三菱地所		0.19	100,000	99,706	2025/3/14
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発		1.12	100,000	103,094	2021/9/17
第36回京王電鉄		0.325	100,000	99,883	2027/9/17
第15回東日本旅客鉄道		2.65	20,000	21,185	2020/8/25
第19回東日本旅客鉄道		2.36	100,000	108,563	2022/2/25
第32回東日本旅客鉄道		2.26	100,000	112,351	2024/3/19
第34回東日本旅客鉄道		2.53	100,000	114,454	2024/6/20
第100回東日本旅客鉄道		1.981	100,000	124,636	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道		2.28	100,000	108,430	2022/3/25

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券		%	千円	千円	
第 6 回東海旅客鉄道		2. 39	21, 000	22, 808	2022/ 2 /15
第42回東海旅客鉄道		2. 312	100, 000	121, 478	2029/ 4 /24
第53回東海旅客鉄道		1. 797	100, 000	117, 093	2030/10/25
第16回三菱倉庫		0. 21	100, 000	99, 814	2024/12/ 6
第63回日本電信電話		0. 69	200, 000	204, 884	2023/ 3 /20
第21回ＫＤＤ Ｉ		0. 669	100, 000	101, 953	2024/ 9 /20
第20回エス・ティ・ティ・ドコモ		0. 73	100, 000	102, 776	2023/ 9 /20
第 8 回電源開発		2. 11	100, 000	111, 730	2024/12/20
第38回電源開発		0. 978	100, 000	103, 958	2023/12/20
第 4 回東京電力パワーグリッド		0. 69	100, 000	101, 009	2024/ 6 /20
第12回東京電力パワーグリッド		0. 44	100, 000	100, 150	2023/ 4 /19
第23回東京ガス		1. 01	100, 000	104, 495	2023/ 6 / 9
第 4 回ファーストリテイリング		0. 749	100, 000	102, 918	2025/12/18
第14回フランス相互信用連合銀行		0. 563	100, 000	101, 323	2021/10/15
第20回ＧＥキャピタルコーポレーション		2. 885	100, 000	100, 077	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, 207	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, 248	2019/ 5 / 2
第23回ラボバンク・ネダーランド		0. 557	100, 000	100, 261	2018/12/19
第27回ラボバンク・ネダーランド		0. 38	100, 000	100, 449	2020/ 5 /22
小 計			9, 821, 000	10, 141, 299	
合 計			206, 209, 786	223, 360, 847	

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	百万円
			904	—

○投資信託財産の構成

(2018年5月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 223,360,847	% 99.1
コール・ローン等、その他	1,975,832	0.9
投資信託財産総額	225,336,679	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	225,336,610,215
コール・ローン等	1,408,599,050
公社債(評価額)	223,360,847,799
未収利息	557,008,760
前払費用	7,464,606
差入委託証拠金	2,690,000
(B) 負債	238,106,324
未払金	100,116,480
未払解約金	137,987,227
未払利息	2,617
(C) 純資産総額(A－B)	225,098,503,891
元本	162,212,782,817
次期繰越損益金	62,885,721,074
(D) 受益権総口数	162,212,782,817口
1万口当たり基準価額(C／D)	13,877円

<注記事項>

- ①期首元本額 153,669,783,979円
 期中追加設定元本額 33,283,504,571円
 期中一部解約元本額 24,740,505,733円
 また、1口当たり純資産額は、期末13,877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)	4,100,004,841円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)	5,011,145,536円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(成長型)	1,272,332,051円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	35,114,657,345円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	54,955,337,241円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	13,921,053,817円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	212,238,947円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(成長型)	151,515,236円
三菱ＵＦＪ 国内債券インデックスファンド	2,263,515,443円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	3,591,141,401円
三菱ＵＦＪ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	15,855,339,589円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式15)	4,933,717円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式40)	3,276,168円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式65)	1,327,190円
三菱ＵＦＪ 日本債券ファンドＶＡ(適格機関投資家限定)	25,754,846,955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)	117,340円
合計	162,212,782,817円

○損益の状況 (2017年5月23日～2018年5月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,160,966,940
受取利息	2,161,819,944
支払利息	△ 853,004
(B) 有価証券売買損益	△ 878,696,444
売買益	482,999,168
売買損	△ 1,361,695,612
(C) 先物取引等取引損益	3,097,920
取引益	7,373,560
取引損	△ 4,275,640
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,285,368,416
(E) 前期繰越損益金	58,362,185,666
(F) 追加信託差損益金	12,723,710,902
(G) 解約差損益金	△ 9,485,543,910
(H) 計(D+E+F+G)	62,885,721,074
次期繰越損益金(H)	62,885,721,074

(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。

【お 知 ら せ】

当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。

(変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)

(2018年1月1日)

三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド

《第18期》決算日2018年5月21日

[計算期間：2017年5月23日～2018年5月21日]

「三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド」は、5月21日に第18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18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（ＦＴＳＥ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		ＦＴＳＥ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	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
18期(2018年5月21日)	26,312	1.5	446,7912	1.2	98.7	—	48,418

(注) ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLC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) 「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	F T S E 世界国債インデックス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
			(除く日本、 円 ベ ー ス)	騰 落 率		
(期 首) 2017年 5 月22日	円 25,920	% —	441.3251	% —	% 98.9	% —
5 月 末	25,826	△0.4	439.8327	△0.3	98.7	—
6 月 末	26,313	1.5	450.1506	2.0	98.6	—
7 月 末	26,299	1.5	450.0978	2.0	98.8	—
8 月 末	26,673	2.9	453.5060	2.8	98.2	—
9 月 末	26,972	4.1	459.0498	4.0	99.0	—
10月 末	26,974	4.1	459.2160	4.1	99.5	—
11月 末	26,996	4.2	458.9704	4.0	99.9	—
12月 末	27,333	5.5	464.6154	5.3	98.3	—
2018年 1 月 末	26,659	2.9	453.8055	2.8	99.8	—
2 月 末	25,975	0.2	443.2113	0.4	98.9	—
3 月 末	26,149	0.9	445.8746	1.0	96.8	—
4 月 末	26,466	2.1	450.7869	2.1	98.8	—
(期 末) 2018年 5 月21日	26,312	1.5	446.7912	1.2	98.7	—

(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

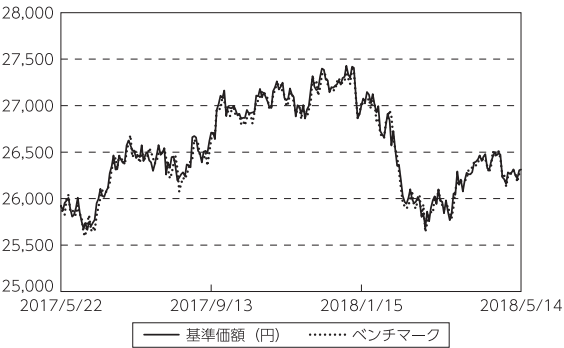
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.5%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(1.2%)を0.3%上回りました。

基準価額等の推移



(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、米国のインフレが加速するとの観測が高まったことなどを背景に下落しました。

◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、欧米長期金利の上昇を嫌気したリスク回避姿勢の高まりなどから米ドルが対円で売られる局面と、その後、北朝鮮を巡る地政学リスクの後退などを背景に米ドルが対円で買われる局面がありましたが、期首との比較では、米ドルは対円で0.4%下落しました。
- ・円・ユーロ相場は、欧州中央銀行（ＥＣＢ）が金融緩和政策を縮小することが意識されたことや欧州経済の回復期待などを背景にユーロが対円で買われました。期首との比較では、ユーロは対円で4.6%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ＦＴＳＥ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1.2%の上昇となったため、カイ離は0.3%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	0.3%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。

◎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0.3%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

(2017年5月23日～2018年5月21日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 9	% 0.033	(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)	(0.033)	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	0.033	
期中の平均基準価額は、26,552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

(2017年5月23日～2018年5月21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 67,020	千アメリカドル 84,523
	カナダ	国債証券	千カナダドル 3,569	千カナダドル 4,654
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 7,846	千メキシコペソ 19,132
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	5,963	10,495
	イタリア	国債証券	6,967	12,393
	フランス	国債証券	7,548	12,066
	オランダ	国債証券	1,120	2,506
	スペイン	国債証券	5,652	7,755
	ベルギー	国債証券	1,379	2,742
	オーストリア	国債証券	1,065	1,639
	フィンランド	国債証券	437	705
	アイルランド	国債証券	547	978
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 3,864	千イギリスポンド 7,622
	スイス	国債証券	千スイスフラン —	千スイスフラン 106
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 1,856	千スウェーデンクローネ 5,751
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 721	千ノルウェークローネ 1,325
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 2,392	千デンマーククローネ 5,498
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 1,078	千ポーランドズロチ 2,910
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 2,324	千オーストラリアドル 3,350
シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 338	千シンガポールドル 444	
マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 491	千マレーシアリンギット 926	
南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 4,895	千南アフリカランド 5,933	

(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

(2017年5月23日～2018年5月21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	5,732	1,870	32.6	12,526	5,744	45.9

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

○組入資産の明細

(2018年5月21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 191,080	千アメリカドル 186,756	千円 20,746,825	% 42.8	% —	% 17.6	% 17.6	% 7.6
カナダ	千カナダドル 11,380	千カナダドル 11,786	1,016,145	2.1	—	0.9	0.7	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 66,650	千メキシコペソ 66,705	372,214	0.8	—	0.5	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	22,360	25,823	3,369,736	7.0	—	4.0	2.1	0.9
イタリア	31,960	35,770	4,667,745	9.6	—	5.6	3.0	1.1
フランス	31,970	37,794	4,931,744	10.2	—	6.7	2.5	1.0
オランダ	6,870	7,970	1,040,115	2.1	—	1.3	0.6	0.2
スペイン	19,030	22,243	2,902,500	6.0	—	3.9	1.3	0.9
ベルギー	7,580	9,292	1,212,613	2.5	—	1.9	0.5	0.1
オーストリア	4,900	5,773	753,427	1.6	—	1.0	0.4	0.1
フィンランド	2,180	2,360	308,070	0.6	—	0.3	0.2	0.1
アイルランド	2,690	3,018	393,876	0.8	—	0.5	0.1	0.2
イギリス	千イギリスポンド 17,870	千イギリスポンド 22,265	3,328,396	6.9	—	5.1	1.4	0.4
スイス	千スイスフラン 620	千スイスフラン 727	80,878	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 12,890	千スウェーデンクローネ 14,581	184,888	0.4	—	0.2	0.2	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 10,200	千ノルウェークローネ 10,560	144,570	0.3	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 13,300	千デンマーククローネ 16,247	284,649	0.6	—	0.4	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 9,700	千ポーランドズロチ 9,991	303,047	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 11,660	千オーストラリアドル 12,194	1,017,894	2.1	—	1.3	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 2,340	千シンガポールドル 2,373	196,194	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 8,130	千マレーシアリンギット 8,002	223,580	0.5	—	0.3	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 37,200	千南アフリカランド 34,025	295,682	0.6	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	47,774,800	98.7	—	52.6	32.3	13.8

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

(注) 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	0.75 T-NOTE 190715	0.75	700	687	76,329	2019/7/15	
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	300	294	32,730	2019/7/31	
	0.875 T-NOTE 190915	0.875	900	881	97,946	2019/9/15	
	1 T-NOTE 190831	1.0	300	294	32,729	2019/8/31	
	1 T-NOTE 190930	1.0	700	686	76,259	2019/9/30	
	1 T-NOTE 191115	1.0	1,250	1,223	135,884	2019/11/15	
	1 T-NOTE 191130	1.0	900	880	97,762	2019/11/30	
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	600	587	65,211	2019/12/31	
	1.125 T-NOTE 200430	1.125	50	48	5,403	2020/4/30	
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	700	670	74,488	2021/2/28	
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	1,600	1,523	169,203	2021/6/30	
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	1,700	1,615	179,469	2021/7/31	
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	1,100	1,041	115,745	2021/9/30	
	1.25 T-NOTE 190430	1.25	450	445	49,492	2019/4/30	
	1.25 T-NOTE 191031	1.25	700	687	76,420	2019/10/31	
	1.25 T-NOTE 200131	1.25	1,100	1,077	119,650	2020/1/31	
	1.25 T-NOTE 200229	1.25	100	97	10,860	2020/2/29	
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	900	863	95,973	2021/3/31	
	1.25 T-NOTE 211031	1.25	1,300	1,234	137,173	2021/10/31	
	1.25 T-NOTE 230731	1.25	300	276	30,666	2023/7/31	
	1.375 T-NOTE 200115	1.375	800	785	87,250	2020/1/15	
	1.375 T-NOTE 200131	1.375	1,000	981	109,007	2020/1/31	
	1.375 T-NOTE 200229	1.375	950	930	103,408	2020/2/29	
	1.375 T-NOTE 200331	1.375	100	97	10,872	2020/3/31	
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	1,050	1,026	114,019	2020/4/30	
	1.375 T-NOTE 200531	1.375	2,150	2,098	233,152	2020/5/31	
	1.375 T-NOTE 200831	1.375	900	875	97,215	2020/8/31	
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	1,900	1,842	204,689	2020/10/31	
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	1,250	1,207	134,132	2021/1/31	
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	1,450	1,345	149,427	2023/6/30	
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	1,700	1,572	174,644	2023/8/31	
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	950	877	97,455	2023/9/30	
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	750	743	82,604	2019/5/31	
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	3,700	3,648	405,365	2019/10/31	
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	500	492	54,718	2019/11/30	
	1.5 T-NOTE 200415	1.5	2,400	2,353	261,398	2020/4/15	
	1.5 T-NOTE 200515	1.5	1,000	979	108,794	2020/5/15	
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	550	538	59,796	2020/5/31	
	1.5 T-NOTE 200715	1.5	3,000	2,931	325,654	2020/7/15	
	1.5 T-NOTE 200815	1.5	600	585	65,052	2020/8/15	
1.5 T-NOTE 220131	1.5	200	190	21,204	2022/1/31		
1.5 T-NOTE 230331	1.5	1,400	1,312	145,769	2023/3/31		
1.5 T-NOTE 260815	1.5	1,600	1,418	157,595	2026/8/15		
1.625 T-NOTE 190430	1.625	1,100	1,092	121,406	2019/4/30		

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	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	1.625 T-NOTE 190630	1.625	1,800	1,785	198,337	2019/6/30
		1.625 T-NOTE 190731	1.625	650	644	71,554	2019/7/31
		1.625 T-NOTE 190831	1.625	600	593	65,974	2019/8/31
		1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,000	986	109,553	2019/12/31
		1.625 T-NOTE 200315	1.625	2,100	2,065	229,507	2020/3/15
		1.625 T-NOTE 200731	1.625	250	244	27,188	2020/7/31
		1.625 T-NOTE 201015	1.625	1,300	1,269	140,992	2020/10/15
		1.625 T-NOTE 201130	1.625	850	828	92,014	2020/11/30
		1.625 T-NOTE 220815	1.625	350	332	36,986	2022/8/15
		1.625 T-NOTE 221115	1.625	3,500	3,318	368,614	2022/11/15
		1.625 T-NOTE 230430	1.625	1,050	988	109,846	2023/4/30
		1.625 T-NOTE 231031	1.625	1,050	981	109,026	2023/10/31
		1.625 T-NOTE 260215	1.625	1,650	1,488	165,355	2026/2/15
		1.625 T-NOTE 260515	1.625	1,950	1,753	194,742	2026/5/15
		1.75 T-NOTE 190930	1.75	500	495	55,024	2019/9/30
		1.75 T-NOTE 201031	1.75	1,000	978	108,703	2020/10/31
		1.75 T-NOTE 201231	1.75	750	732	81,364	2020/12/31
		1.75 T-NOTE 211130	1.75	1,550	1,496	166,203	2021/11/30
		1.75 T-NOTE 220228	1.75	100	96	10,686	2022/2/28
		1.75 T-NOTE 220331	1.75	950	912	101,413	2022/3/31
		1.75 T-NOTE 220430	1.75	400	383	42,648	2022/4/30
		1.75 T-NOTE 220515	1.75	3,050	2,926	325,059	2022/5/15
		1.75 T-NOTE 220531	1.75	1,600	1,534	170,425	2022/5/31
		1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,550	1,479	164,387	2022/9/30
		1.75 T-NOTE 230131	1.75	850	808	89,771	2023/1/31
		1.75 T-NOTE 230515	1.75	900	852	94,685	2023/5/15
		1.875 T-NOTE 211130	1.875	750	726	80,759	2021/11/30
		1.875 T-NOTE 220331	1.875	1,700	1,641	182,331	2022/3/31
		1.875 T-NOTE 220531	1.875	100	96	10,704	2022/5/31
		1.875 T-NOTE 220731	1.875	1,500	1,442	160,256	2022/7/31
		1.875 T-NOTE 220831	1.875	750	720	80,043	2022/8/31
		1.875 T-NOTE 221031	1.875	1,800	1,726	191,776	2022/10/31
		2 T-NOTE 200131	2.0	1,700	1,685	187,252	2020/1/31
		2 T-NOTE 200731	2.0	250	246	27,410	2020/7/31
		2 T-NOTE 200930	2.0	3,450	3,399	377,661	2020/9/30
		2 T-NOTE 201130	2.0	450	442	49,170	2020/11/30
		2 T-NOTE 210228	2.0	700	686	76,304	2021/2/28
		2 T-NOTE 210531	2.0	600	587	65,227	2021/5/31
		2 T-NOTE 210831	2.0	1,100	1,073	119,268	2021/8/31
		2 T-NOTE 211031	2.0	1,100	1,071	119,058	2021/10/31
		2 T-NOTE 211115	2.0	1,500	1,461	162,325	2021/11/15
		2 T-NOTE 211231	2.0	450	437	48,619	2021/12/31
		2 T-NOTE 220215	2.0	1,200	1,165	129,496	2022/2/15
		2 T-NOTE 230215	2.0	2,800	2,691	298,950	2023/2/15
		2 T-NOTE 240531	2.0	1,650	1,561	173,503	2024/5/31

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	2 T-NOTE 250215	2.0	2,500	2,346	260,649	2025/ 2 /15
		2 T-NOTE 250815	2.0	3,750	3,499	388,793	2025/ 8 /15
		2 T-NOTE 261115	2.0	900	828	92,021	2026/11/15
		2.125 T-NOTE 210131	2.125	100	98	10,944	2021/ 1 /31
		2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,150	1,128	125,418	2021/ 6 /30
		2.125 T-NOTE 210815	2.125	1,700	1,666	185,134	2021/ 8 /15
		2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,100	1,076	119,640	2021/ 9 /30
		2.125 T-NOTE 211231	2.125	1,900	1,855	206,173	2021/12/31
		2.125 T-NOTE 221231	2.125	1,050	1,016	112,890	2022/12/31
		2.125 T-NOTE 231130	2.125	900	862	95,864	2023/11/30
		2.125 T-NOTE 240229	2.125	700	669	74,348	2024/ 2 /29
		2.125 T-NOTE 240331	2.125	550	525	58,364	2024/ 3 /31
		2.125 T-NOTE 240731	2.125	2,050	1,951	216,739	2024/ 7 /31
		2.125 T-NOTE 250515	2.125	500	471	52,420	2025/ 5 /15
		2.25 T-BOND 460815	2.25	1,050	864	96,003	2046/ 8 /15
		2.25 T-NOTE 210331	2.25	200	197	21,938	2021/ 3 /31
		2.25 T-NOTE 210430	2.25	900	887	98,645	2021/ 4 /30
		2.25 T-NOTE 210731	2.25	1,300	1,279	142,171	2021/ 7 /31
		2.25 T-NOTE 231231	2.25	800	771	85,705	2023/12/31
		2.25 T-NOTE 240131	2.25	1,350	1,300	144,488	2024/ 1 /31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	2,950	2,820	313,301	2024/11/15
		2.25 T-NOTE 270215	2.25	900	843	93,693	2027/ 2 /15
		2.25 T-NOTE 270815	2.25	1,000	933	103,712	2027/ 8 /15
		2.25 T-NOTE 271115	2.25	2,200	2,050	227,805	2027/11/15
		2.375 T-NOTE 201231	2.375	200	198	22,046	2020/12/31
		2.375 T-NOTE 210415	2.375	2,300	2,278	253,121	2021/ 4 /15
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	1,450	1,399	155,518	2024/ 8 /15
		2.375 T-NOTE 270515	2.375	2,350	2,221	246,825	2027/ 5 /15
		2.5 T-BOND 450215	2.5	2,600	2,271	252,323	2045/ 2 /15
		2.5 T-BOND 460215	2.5	950	827	91,890	2046/ 2 /15
		2.5 T-BOND 460515	2.5	550	478	53,127	2046/ 5 /15
		2.5 T-NOTE 230815	2.5	1,650	1,617	179,646	2023/ 8 /15
		2.5 T-NOTE 240515	2.5	1,500	1,461	162,364	2024/ 5 /15
		2.625 T-NOTE 200815	2.625	1,200	1,200	133,328	2020/ 8 /15
		2.625 T-NOTE 201115	2.625	1,350	1,348	149,819	2020/11/15
		2.625 T-NOTE 250331	2.625	1,250	1,219	135,510	2025/ 3 /31
2.75 T-BOND 420815	2.75	450	416	46,319	2042/ 8 /15		
2.75 T-BOND 421115	2.75	700	647	71,894	2042/11/15		
2.75 T-BOND 470815	2.75	1,200	1,095	121,716	2047/ 8 /15		
2.75 T-BOND 471115	2.75	450	410	45,616	2047/11/15		
2.75 T-NOTE 231115	2.75	1,900	1,883	209,224	2023/11/15		
2.75 T-NOTE 240215	2.75	1,300	1,286	142,938	2024/ 2 /15		
2.75 T-NOTE 280215	2.75	600	583	64,826	2028/ 2 /15		
2.875 T-BOND 430515	2.875	1,200	1,133	125,892	2043/ 5 /15		
2.875 T-BOND 450815	2.875	1,150	1,081	120,128	2045/ 8 /15		

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ	国債証券	2.875 T-BOND 461115	2.875	950	890	98,939	2046/11/15
		3 T-BOND 420515	3.0	200	193	21,516	2042/5/15
		3 T-BOND 441115	3.0	1,750	1,686	187,375	2044/11/15
		3 T-BOND 450515	3.0	1,700	1,637	181,933	2045/5/15
		3 T-BOND 451115	3.0	1,200	1,155	128,381	2045/11/15
		3 T-BOND 470215	3.0	500	480	53,401	2047/2/15
		3 T-BOND 470515	3.0	750	720	80,049	2047/5/15
		3 T-BOND 480215	3.0	450	432	47,998	2048/2/15
		3.125 T-BOND 411115	3.125	350	346	38,489	2041/11/15
		3.125 T-BOND 420215	3.125	100	98	10,990	2042/2/15
		3.125 T-BOND 430215	3.125	550	543	60,340	2043/2/15
		3.125 T-BOND 440815	3.125	1,850	1,824	202,658	2044/8/15
		3.125 T-NOTE 190515	3.125	800	806	89,542	2019/5/15
		3.125 T-NOTE 210515	3.125	750	758	84,248	2021/5/15
		3.375 T-BOND 440515	3.375	780	803	89,283	2044/5/15
		3.375 T-NOTE 191115	3.375	300	303	33,739	2019/11/15
		3.5 T-BOND 390215	3.5	300	315	35,092	2039/2/15
		3.5 T-NOTE 200515	3.5	800	814	90,444	2020/5/15
		3.625 T-BOND 430815	3.625	950	1,019	113,244	2043/8/15
		3.625 T-BOND 440215	3.625	950	1,020	113,343	2044/2/15
		3.625 T-NOTE 190815	3.625	700	710	78,899	2019/8/15
		3.625 T-NOTE 200215	3.625	1,050	1,069	118,799	2020/2/15
		3.625 T-NOTE 210215	3.625	2,650	2,714	301,587	2021/2/15
		3.75 T-BOND 410815	3.75	450	491	54,606	2041/8/15
		3.75 T-BOND 431115	3.75	850	930	103,397	2043/11/15
		3.875 T-BOND 400815	3.875	500	556	61,776	2040/8/15
		4.25 T-BOND 390515	4.25	300	350	38,917	2039/5/15
		4.25 T-BOND 401115	4.25	500	585	65,083	2040/11/15
		4.375 T-BOND 380215	4.375	150	177	19,672	2038/2/15
		4.375 T-BOND 391115	4.375	150	178	19,807	2039/11/15
		4.375 T-BOND 400515	4.375	500	595	66,137	2040/5/15
		4.375 T-BOND 410515	4.375	450	537	59,707	2041/5/15
		4.5 T-BOND 360215	4.5	400	474	52,729	2036/2/15
		4.5 T-BOND 380515	4.5	200	240	26,684	2038/5/15
		4.5 T-BOND 390815	4.5	400	482	53,642	2039/8/15
		4.625 T-BOND 400215	4.625	600	737	81,927	2040/2/15
		4.75 T-BOND 410215	4.75	350	438	48,732	2041/2/15
		5 T-BOND 370515	5.0	150	189	21,100	2037/5/15
		5.25 T-BOND 281115	5.25	250	298	33,149	2028/11/15
		5.25 T-BOND 290215	5.25	50	59	6,652	2029/2/15
		5.375 T-BOND 310215	5.375	400	495	55,067	2031/2/15
		5.5 T-BOND 280815	5.5	150	181	20,190	2028/8/15
		6 T-BOND 260215	6.0	1,350	1,626	180,703	2026/2/15
		6.125 T-BOND 271115	6.125	1,100	1,376	152,891	2027/11/15
		6.25 T-BOND 230815	6.25	100	116	12,915	2023/8/15

銘 柄			当 期 末					
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
					外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
	国債証券	6.25 T-BOND 300515	6.25	250	328	36,507	2030/5/15	
		6.5 T-BOND 261115	6.5	200	251	27,937	2026/11/15	
		8 T-BOND 211115	8.0	500	586	65,122	2021/11/15	
		8.125 T-BOND 190815	8.125	300	320	35,645	2019/8/15	
		8.75 T-BOND 200815	8.75	800	906	100,647	2020/8/15	
小 計						20,746,825		
カナダ				千カナダドル	千カナダドル			
	国債証券	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	300	281	24,242	2022/3/1	
		0.75 CAN GOVT 190801	0.75	550	543	46,819	2019/8/1	
		0.75 CAN GOVT 200901	0.75	1,000	970	83,700	2020/9/1	
		0.75 CAN GOVT 210301	0.75	650	625	53,958	2021/3/1	
		0.75 CAN GOVT 210901	0.75	650	620	53,500	2021/9/1	
		1 CAN GOVT 220901	1.0	500	474	40,889	2022/9/1	
		1 CAN GOVT 270601	1.0	300	264	22,792	2027/6/1	
		1.5 CAN GOVT 200301	1.5	600	594	51,264	2020/3/1	
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	550	528	45,577	2023/6/1	
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	400	372	32,110	2026/6/1	
		1.75 CAN GOVT 190901	1.75	300	299	25,822	2019/9/1	
		2 CAN GOVT 280601	2.0	300	287	24,767	2028/6/1	
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	350	346	29,844	2025/6/1	
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	400	402	34,719	2024/6/1	
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	250	254	21,968	2022/6/1	
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	410	432	37,268	2048/12/1	
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	130	140	12,102	2064/12/1	
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	350	361	31,126	2021/6/1	
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	600	617	53,214	2020/6/1	
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	430	513	44,300	2045/12/1	
		3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,000	1,019	87,931	2019/6/1	
		4 CAN GOVT 410601	4.0	380	477	41,176	2041/6/1	
		5 CAN GOVT 370601	5.0	350	480	41,461	2037/6/1	
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	150	196	16,968	2029/6/1	
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	330	463	39,938	2033/6/1	
		8 CAN GOVT 270601	8.0	150	216	18,678	2027/6/1	
小 計						1,016,145		
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ			
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	7,650	8,530	47,600	2024/12/5	
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	2,050	2,462	13,741	2036/11/20	
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	6,900	6,637	37,035	2019/12/11	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	4,300	3,790	21,152	2026/3/5	
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	9,200	8,898	49,653	2021/6/10	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	5,600	5,354	29,879	2022/6/9	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	4,850	4,755	26,533	2027/6/3	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	3,350	3,318	18,519	2031/5/29	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	2,700	2,663	14,861	2034/11/23	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	5,250	5,138	28,670	2042/11/13	

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	
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	6,500	6,553	36,567	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	1,700	1,717	9,585	2023/12/7
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	1,300	1,305	7,284	2047/11/7
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	2,700	2,832	15,807	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	2,600	2,746	15,323	2038/11/18
小 計						372,214	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	500	484	63,178	2026/8/15
		0 OBL 200417	—	600	606	79,171	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	450	455	59,475	2021/4/9
		0 OBL 211008	—	400	404	52,826	2021/10/8
		0 OBL 220408	—	600	606	79,095	2022/4/8
		0.25 BUND 270215	0.25	700	688	89,821	2027/2/15
		0.25 OBL 191011	0.25	900	911	118,903	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	350	356	46,525	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	850	866	113,085	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	700	709	92,565	2026/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	600	599	78,233	2027/8/15
		0.5 BUND 280215	0.5	150	148	19,434	2028/2/15
		1 BUND 240815	1.0	400	421	54,985	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	610	642	83,824	2025/8/15
		1.25 BUND 480815	1.25	170	168	22,023	2048/8/15
		1.5 BUND 220904	1.5	800	858	112,034	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	700	753	98,384	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	250	269	35,177	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	550	595	77,751	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	750	811	105,910	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	550	603	78,694	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	500	542	70,745	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	550	608	79,363	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	550	585	76,391	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	450	489	63,823	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	400	431	56,330	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	660	851	111,122	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	620	807	105,349	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	600	645	84,236	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	800	851	111,067	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	550	613	80,034	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	350	505	65,898	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	900	942	122,945	2019/7/4
		4 BUND 370104	4.0	590	889	116,096	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	330	528	68,919	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	200	282	36,876	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	520	818	106,855	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	450	773	100,932	2040/7/4

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	5.5 BUND 310104	5.5	510	803	104,798	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	450	666	86,941	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	150	202	26,400	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	250	406	53,081	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	400	616	80,421	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.2 ITALY GOVT 201015	0.2	1,200	1,200	156,647	2020/10/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	100	99	12,984	2021/11/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	500	501	65,422	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	300	291	38,090	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	400	405	52,856	2020/5/1
		0.9 ITALY GOVT 220801	0.9	150	150	19,632	2022/8/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	350	348	45,522	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	400	406	53,101	2019/12/1
		1.2 ITALY GOVT 220401	1.2	350	356	46,511	2022/4/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	400	377	49,307	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	450	460	60,117	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	600	614	80,213	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	400	408	53,240	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	500	494	64,507	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	500	489	63,857	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	700	627	81,923	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	400	410	53,548	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	550	558	72,815	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	200	196	25,625	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	50	49	6,483	2027/8/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	950	1,003	130,899	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	850	857	111,861	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	300	275	35,891	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	50	48	6,329	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	650	666	87,009	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	550	582	76,026	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	400	364	47,547	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	170	146	19,157	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	200	198	25,943	2038/9/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	430	436	56,908	2046/9/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	370	382	49,972	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	550	606	79,119	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	250	273	35,751	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	250	274	35,866	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	800	884	115,358	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	500	568	74,136	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	600	652	85,159	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	770	896	116,928	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	450	475	62,025	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	950	1,021	133,346	2020/3/1

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	4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	700	753	98,358	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	850	990	129,205	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	550	646	84,312	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	550	656	85,647	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	750	854	111,453	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	900	1,064	138,949	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	600	734	95,804	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	450	572	74,718	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	650	755	98,560	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	600	730	95,361	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	870	1,123	146,625	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	580	757	98,900	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	600	782	102,122	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	740	949	123,913	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	750	896	117,018	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	570	684	89,294	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	410	561	73,322	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	800	1,100	143,607	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	650	891	116,365	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	550	776	101,340	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	300	423	55,214	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O.A.T 200525	—	850	858	111,996	2020/5/25
		0 O.A.T 210525	—	300	302	39,508	2021/5/25
		0 O.A.T 220525	—	850	853	111,420	2022/5/25
		0.25 O.A.T 201125	0.25	500	508	66,327	2020/11/25
		0.25 O.A.T 261125	0.25	400	387	50,585	2026/11/25
		0.5 O.A.T 191125	0.5	700	711	92,805	2019/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	950	956	124,856	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	400	398	51,993	2026/5/25
		1 O.A.T 190525	1.0	200	203	26,510	2019/5/25
		1 O.A.T 251125	1.0	850	883	115,258	2025/11/25
		1 O.A.T 270525	1.0	1,160	1,190	155,285	2027/5/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	500	491	64,181	2036/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	1,050	1,102	143,899	2031/5/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	1,150	1,247	162,755	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	950	1,037	135,395	2024/11/25
		1.75 O.A.T 390625	1.75	250	263	34,391	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	150	144	18,822	2066/5/25
		2 O.A.T 480525	2.0	150	160	20,889	2048/5/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	1,100	1,212	158,219	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	850	952	124,291	2024/5/25
		2.5 O.A.T 201025	2.5	1,000	1,071	139,811	2020/10/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	850	994	129,836	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	1,000	1,185	154,642	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	1,400	1,574	205,412	2022/4/25

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	
フランス	国債証券	3.25 O.A.T 211025	3.25	1,000	1,120	146,202	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	610	827	108,039	2045/ 5 /25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	1,200	1,292	168,659	2020/ 4 /25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	1,250	1,543	201,358	2026/ 4 /25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	1,250	1,327	173,185	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	1,150	1,288	168,151	2021/ 4 /25
		4 O.A.T 381025	4.0	550	806	105,302	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	450	720	93,967	2055/ 4 /25
		4 O.A.T 600425	4.0	560	918	119,907	2060/ 4 /25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	1,300	1,591	207,665	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	1,010	1,606	209,651	2041/ 4 /25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	830	1,277	166,765	2035/ 4 /25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	1,050	1,558	203,328	2029/ 4 /25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	950	1,540	200,964	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	650	917	119,750	2025/10/25
		8.5 O.A.T 191025	8.5	300	339	44,250	2019/10/25
		8.5 O.A.T 230425	8.5	300	425	55,495	2023/ 4 /25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	450	453	59,226	2022/ 1 /15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	450	456	59,564	2020/ 1 /15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	300	297	38,842	2025/ 7 /15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	650	650	84,918	2026/ 7 /15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	250	253	33,030	2027/ 7 /15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	200	217	28,410	2023/ 7 /15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	650	721	94,133	2024/ 7 /15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	400	440	57,458	2022/ 7 /15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	450	544	70,990	2033/ 1 /15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	340	461	60,179	2047/ 1 /15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	350	390	50,927	2021/ 7 /15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	500	543	70,964	2020/ 7 /15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	450	530	69,207	2023/ 1 /15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	390	598	78,072	2042/ 1 /15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	300	316	41,245	2019/ 7 /15
スペイン	国債証券	4 NETH GOVT 370115	4.0	390	584	76,280	2037/ 1 /15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	350	510	66,663	2028/ 1 /15
		0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	600	605	79,041	2022/ 4 /30
		0.45 SPAIN GOVT 221031	0.45	150	151	19,717	2022/10/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	700	717	93,638	2021/ 7 /30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	550	566	73,975	2020/ 7 /30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	400	403	52,675	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	700	720	94,013	2020/ 1 /31
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	500	504	65,835	2027/10/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	500	509	66,454	2027/ 4 /30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	350	366	47,889	2025/ 4 /30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,000	1,064	138,859	2026/ 4 /30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	500	513	67,042	2030/ 7 /30

銘 柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	500	541	70,636	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	200	209	27,368	2033/ 7 /30
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	400	411	53,740	2019/ 4 /30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	600	675	88,118	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	460	497	64,904	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	350	405	52,910	2066/ 7 /30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	600	708	92,501	2024/ 4 /30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	800	866	113,074	2020/ 4 /30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	600	792	103,464	2037/ 1 /31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	600	640	83,579	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	500	603	78,789	2023/10/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	600	635	82,958	2019/ 7 /30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	650	818	106,795	2025/ 7 /30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	600	853	111,393	2041/ 7 /30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	500	617	80,564	2024/ 1 /31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	400	449	58,627	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	430	623	81,425	2040/ 7 /30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	400	542	70,728	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	240	366	47,822	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	600	741	96,748	2023/ 1 /31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	500	581	75,942	2021/ 4 /30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	800	1,194	155,832	2032/ 7 /30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	700	848	110,736	2022/ 1 /31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	350	480	62,708	2026/ 7 /30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	700	1,011	131,982	2029/ 1 /31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	400	409	53,452	2025/ 6 /22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	400	402	52,489	2027/ 6 /22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	50	49	6,485	2028/ 6 /22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	260	256	33,438	2031/ 6 /22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	160	160	20,951	2037/ 6 /22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	210	205	26,790	2047/ 6 /22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	100	106	13,863	2066/ 6 /22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	500	556	72,565	2023/ 6 /22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	80	88	11,523	2057/ 6 /22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	500	570	74,445	2024/ 6 /22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	300	314	41,022	2019/ 9 /28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	100	124	16,295	2034/ 6 /22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	550	604	78,902	2020/ 9 /28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	340	497	64,952	2045/ 6 /22
		4 BEL GOVT 220328	4.0	500	581	75,865	2022/ 3 /28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	250	342	44,736	2032/ 3 /28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	350	403	52,660	2021/ 9 /28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	300	357	46,588	2022/ 9 /28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	500	765	99,925	2041/ 3 /28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	600	785	102,451	2026/ 3 /28

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	
ベルギー	国債証券	5 BEL GOVT 350328	5.0	610	954	124,583	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	520	755	98,624	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	150	147	19,283	2027/4/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	350	354	46,214	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	150	149	19,519	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	100	105	13,753	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	80	79	10,400	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	60	52	6,871	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	300	325	42,517	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	480	522	68,177	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	250	256	33,496	2019/6/18
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	90	96	12,618	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	170	200	26,168	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	220	303	39,560	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	400	462	60,351	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	400	450	58,782	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	250	287	37,480	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	100	167	21,803	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	400	437	57,124	2020/7/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	350	522	68,127	2037/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	300	401	52,421	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	300	450	58,754	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 230915	—	50	49	6,483	2023/9/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	150	152	19,949	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	200	199	26,085	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	100	97	12,691	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	200	206	26,944	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	80	79	10,426	2034/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	120	128	16,776	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	300	322	42,049	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	150	165	21,624	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	120	154	20,154	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	150	179	23,416	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	150	161	21,029	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	150	166	21,766	2021/4/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	110	137	17,999	2025/7/4
アイルランド	国債証券	4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	150	158	20,670	2019/7/4
		0 IRISH GOVT 221018	—	50	49	6,509	2022/10/18
		0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	150	155	20,238	2022/3/15
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	100	98	12,913	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	150	153	19,996	2026/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	100	98	12,801	2033/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	170	172	22,550	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	220	230	30,086	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	250	283	37,042	2030/5/15

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
アイルランド	国債証券	3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	250	294	38,463	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	150	177	23,165	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	150	157	20,608	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	300	328	42,883	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	50	56	7,380	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	450	596	77,895	2025/3/13
		5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	150	163	21,341	2019/10/18
小 計						19,579,831	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
	国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	800	782	116,937	2022/7/22
		1.25 GILT 270722	1.25	450	438	65,626	2027/7/22
		1.5 GILT 210122	1.5	400	406	60,805	2021/1/22
		1.5 GILT 260722	1.5	350	352	52,663	2026/7/22
		1.75 GILT 190722	1.75	750	759	113,536	2019/7/22
		1.75 GILT 220907	1.75	650	669	100,043	2022/9/7
		1.75 GILT 370907	1.75	150	146	21,882	2037/9/7
		2 GILT 200722	2.0	750	769	114,982	2020/7/22
		2 GILT 250907	2.0	820	859	128,422	2025/9/7
		2.25 GILT 230907	2.25	700	739	110,486	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	350	440	65,907	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	500	545	81,543	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	700	887	132,608	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	450	597	89,302	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	890	1,432	214,076	2068/7/22
		3.75 GILT 200907	3.75	550	587	87,766	2020/9/7
		3.75 GILT 210907	3.75	550	600	89,800	2021/9/7
		3.75 GILT 520722	3.75	530	788	117,800	2052/7/22
		4 GILT 220307	4.0	250	278	41,611	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	90	150	22,504	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	350	435	65,080	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	400	523	78,275	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	850	1,158	173,217	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	250	353	52,792	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	490	700	104,779	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	1,100	1,663	248,746	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	570	892	133,369	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	310	519	77,592	2055/12/7
		4.5 GILT 340907	4.5	360	495	74,038	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	400	602	90,076	2042/12/7
		4.75 GILT 200307	4.75	500	535	80,107	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75	410	551	82,378	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	280	416	62,332	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	400	496	74,237	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	270	385	57,673	2028/12/7

銘	柄	当 期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券 8 GILT 210607	8.0	250	303	45,389	2021/6/7
小 計					3,328,396	
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	100	107	11,981	2021/4/28
	2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	130	138	15,378	2020/7/6
	3 SWISS GOVT 190512	3.0	110	114	12,678	2019/5/12
	4 SWISS GOVT 230211	4.0	120	145	16,164	2023/2/11
	4 SWISS GOVT 280408	4.0	160	222	24,675	2028/4/8
小 計					80,878	
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 0.75 SWD GOVT 280512	0.75	1,150	1,153	14,625	2028/5/12
	1 SWD GOVT 261112	1.0	1,600	1,661	21,064	2026/11/12
	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	2,200	2,367	30,023	2023/11/13
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	1,550	1,782	22,608	2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 220601	3.5	2,700	3,101	39,325	2022/6/1
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	1,240	1,720	21,814	2039/3/30
	5 SWD GOVT 201201	5.0	2,450	2,793	35,427	2020/12/1
小 計					184,888	
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	1,000	980	13,417	2026/2/19
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	950	953	13,053	2025/3/13
	1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	1,000	990	13,554	2027/2/17
	2 NORWE GOVT 230524	2.0	1,750	1,793	24,551	2023/5/24
	3 NORWE GOVT 240314	3.0	1,300	1,401	19,182	2024/3/14
	3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	2,200	2,368	32,419	2021/5/25
	4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	2,000	2,073	28,392	2019/5/22
小 計					144,570	
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 201115	0.25	550	559	9,808	2020/11/15
	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	1,150	1,139	19,971	2027/11/15
	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	1,700	1,833	32,114	2023/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	2,500	2,763	48,409	2025/11/15
	3 DMK GOVT 211115	3.0	1,650	1,839	32,236	2021/11/15
	4 DMK GOVT 191115	4.0	2,400	2,565	44,946	2019/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	3,350	5,545	97,161	2039/11/15
小 計					284,649	
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	650	649	19,690	2020/4/25
	1.75 POLAND 210725	1.75	600	596	18,083	2021/7/25
	2 POLAND 210425	2.0	950	953	28,917	2021/4/25
	2.25 POLAND 220425	2.25	700	698	21,197	2022/4/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	1,200	1,139	34,567	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	750	705	21,389	2027/7/25
	3.25 POLAND 190725	3.25	450	459	13,950	2019/7/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	700	707	21,449	2025/7/25

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
ポーランド	国債証券	4 POLAND 231025	4.0	750	799	24,234	2023/10/25
		5.25 POLAND 201025	5.25	750	813	24,660	2020/10/25
		5.5 POLAND 191025	5.5	600	634	19,251	2019/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	700	784	23,805	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	600	682	20,692	2022/ 9 /23
		5.75 POLAND 290425	5.75	300	367	11,159	2029/ 4 /25
小 計						303,047	
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	693	57,849	2020/11/21
		2 AUST GOVT 211221	2.0	350	346	28,906	2021/12/21
		2.25 AUST GOVT 221121	2.25	150	148	12,417	2022/11/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	400	377	31,507	2028/ 5 /21
		2.75 AUST GOVT 191021	2.75	600	606	50,626	2019/10/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	500	503	42,042	2024/ 4 /21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	800	790	66,001	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 281121	2.75	550	541	45,221	2028/11/21
		2.75 AUST GOVT 291121	2.75	170	166	13,901	2029/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	200	188	15,754	2035/ 6 /21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	350	324	27,110	2047/ 3 /21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	750	774	64,681	2025/ 4 /21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	950	978	81,691	2029/ 4 /21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	150	149	12,462	2039/ 6 /21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	280	300	25,110	2037/ 4 /21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	950	1,047	87,460	2026/ 4 /21
		4.5 AUST GOVT 200415	4.5	700	731	61,089	2020/ 4 /15
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	360	420	35,126	2033/ 4 /21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	600	689	57,518	2027/ 4 /21
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	650	740	61,807	2023/ 4 /21
5.75 AUST GOVT 210515	5.75	850	935	78,126	2021/ 5 /15		
5.75 AUST GOVT 220715	5.75	650	736	61,482	2022/ 7 /15		
小 計						1,017,894	
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 SINGAPORGVT 191001	1.625	150	149	12,370	2019/10/ 1
		2 SINGAPORGVT 200701	2.0	50	50	4,138	2020/ 7 / 1
		2.125 SINGAPORGVT 260601	2.125	70	67	5,616	2026/ 6 / 1
		2.25 SINGAPORGVT 210601	2.25	220	221	18,278	2021/ 6 / 1
		2.25 SINGAPORGVT 360801	2.25	60	54	4,523	2036/ 8 / 1
		2.5 SINGAPORGVT 190601	2.5	220	221	18,329	2019/ 6 / 1
		2.75 SINGAPORGVT 230701	2.75	180	183	15,149	2023/ 7 / 1
		2.75 SINGAPORGVT 420401	2.75	170	163	13,547	2042/ 4 / 1
		2.75 SINGAPORGVT 460301	2.75	80	76	6,312	2046/ 3 / 1
		2.875 SINGAPORGVT 290701	2.875	50	50	4,199	2029/ 7 / 1
		2.875SINGAPORGVT 300901	2.875	120	121	10,014	2030/ 9 / 1
		3 SINGAPORGVT 240901	3.0	230	237	19,613	2024/ 9 / 1
		3.125SINGAPORGVT 220901	3.125	180	187	15,490	2022/ 9 / 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	
シンガポール			%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
	国債証券	3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	240	246	20,398	2020/9/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	120	127	10,511	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	200	214	17,699	2027/3/1
小 計						196,194	
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	341	9,554	2022/8/15
		3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	250	244	6,817	2023/3/15
		3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	300	298	8,344	2020/3/31
		3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	300	279	7,813	2027/5/31
		3.62 MALAYSIAGOV 211130	3.62	200	199	5,561	2021/11/30
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	100	96	2,686	2028/6/15
		3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	400	398	11,125	2022/9/30
		3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	300	295	8,264	2023/8/17
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	300	269	7,531	2033/4/15
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	450	435	12,155	2027/3/15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	150	146	4,094	2027/11/16
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	500	491	13,718	2025/9/15
		4.048 MALAYSIA 210930	4.048	480	483	13,504	2021/9/30
		4.127 MALAYSIA 320415	4.127	200	191	5,339	2032/4/15
		4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	400	403	11,266	2021/7/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	400	400	11,176	2024/7/15
		4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	200	191	5,347	2031/6/30
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	200	184	5,146	2035/5/31
		4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	900	909	25,422	2019/11/29
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	300	300	8,407	2026/4/15
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	500	491	13,725	2030/4/15	
	4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	300	290	8,112	2046/3/15	
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	350	353	9,869	2043/9/30	
	5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	300	307	8,594	2019/7/30	
小 計						223,580	
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	5,600	6,235	54,182	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	4,000	2,941	25,565	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	3,500	2,529	21,983	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	1,500	1,466	12,744	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	3,550	2,993	26,009	2031/2/28
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	700	699	6,077	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	1,950	1,932	16,790	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	2,700	2,502	21,744	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	1,650	1,528	13,279	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	2,700	2,486	21,607	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	2,650	2,452	21,309	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	4,850	4,487	38,998	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	800	768	6,681	2035/2/28

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	
南アフリカ	%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円	
国債証券 9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	1,050	1,002	8,708	2040/1/31
小 計				295,682	
合 計				47,774,800	

(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

(2018年5月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 47,774,800	% 98.6
コール・ローン等、その他	697,997	1.4
投資信託財産総額	48,472,797	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（48,423,841千円）の投資信託財産総額（48,472,797千円）に対する比率は99.9%です。

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

1 アメリカドル＝111.09円	1 カナダドル＝86.21円	1 メキシコペソ＝5.58円	1 ユーロ＝130.49円
1 イギリスポンド＝149.49円	1 スイスフラン＝111.12円	1 スウェーデンクローネ＝12.68円	1 ノルウェークローネ＝13.69円
1 デンマーククローネ＝17.52円	1 ポーランドズロチ＝30.33円	1 オーストラリアドル＝83.47円	1 シンガポールドル＝82.67円
1 マレーシアリンギット＝27.94円	1 南アフリカランド＝8.69円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	48,539,249,915
コール・ローン等	269,705,594
公社債(評価額)	47,774,800,597
未収入金	123,129,999
未収利息	355,688,850
前払費用	15,924,875
(B) 負債	120,843,612
未払金	66,474,106
未払解約金	54,369,416
未払利息	90
(C) 純資産総額(A－B)	48,418,406,303
元本	18,401,465,597
次期繰越損益金	30,016,940,706
(D) 受益権総口数	18,401,465,597口
1万口当たり基準価額(C／D)	26,312円

<注記事項>

- ①期首元本額 21,000,747,916円
期中追加設定元本額 2,544,639,158円
期中一部解約元本額 5,143,921,477円
また、1口当たり純資産額は、期末2,6312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)	160,490,922円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)	312,916,234円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(成長型)	196,287,155円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン	1,398,383,372円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,372,486,798円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	3,426,533,849円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	2,144,457,628円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	560,375,259円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(成長型)	78,883,018円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	224,245,430円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式15)	579,377円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式40)	613,732円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式65)	614,253円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン(確定拠出年金)	2,070,608,619円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	423,809,384円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,312,449,405円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドＶＡ(適格機関投資家限定)	4,028,931,853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)	7,327円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドＶＡ２(適格機関投資家限定)	26,440,678円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	662,351,304円
合計	18,401,465,597円

○損益の状況 (2017年5月23日～2018年5月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,265,502,305
受取利息	1,265,757,268
その他収益金	65,761
支払利息	△ 320,724
(B) 有価証券売買損益	△ 415,233,739
売買益	1,353,974,854
売買損	△ 1,769,208,593
(C) 保管費用等	△ 16,943,828
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	833,324,738
(E) 前期繰越損益金	33,432,854,058
(F) 追加信託差損益金	4,230,961,638
(G) 解約差損益金	△ 8,480,199,728
(H) 計(D＋E＋F＋G)	30,016,940,706
次期繰越損益金(H)	30,016,940,706

- (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】

- ①当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(変更前 (旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後 (新) <https://www.am.mufg.jp/>)
(2018年1月1日)
- ②使用指数名称の変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2018年2月8日)
- ③本資料内における旧シティ債券インデックスは、ブランド変更に伴い、F T S E 債券インデックスの名称に変更しています。

MUAM J-REITマザーファンド

《第14期》決算日2018年3月12日

[計算期間：2017年3月11日～2018年3月12日]

「MUAM J-REITマザーファンド」は、3月12日に第14期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	わが国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券への分散投資を行います。東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果をめざします。 銘柄選定およびポートフォリオの構築は、定性的評価・定量的評価を経て行います。定性的評価については、事業内容および財務内容等の分析を行います。定量的評価においては、キャッシュフロー、配当利回り、PBR（株価純資産倍率）等の分析を行います。不動産投資信託証券の組入比率は高位（通常の状態で90%以上）を基本とします。
主 要 運 用 対 象	わが国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式及び外貨建資産への投資は行いません。 投資信託証券への投資に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		東証REIT指数（配当込み）		投 資 信 託 証券 組 入 比	純 資 産 額
		期 騰	中 率	期 騰	中 率		
	円		%		%	%	百万円
10期(2014年3月10日)	20,786		14.5	2,507.61	10.3	98.0	4,237
11期(2015年3月10日)	26,403		27.0	3,166.15	26.3	95.9	7,117
12期(2016年3月10日)	28,097		6.4	3,332.09	5.2	97.4	15,042
13期(2017年3月10日)	26,870	△	4.4	3,310.28	△ 0.7	97.8	16,702
14期(2018年3月12日)	26,458	△	1.5	3,203.75	△ 3.2	96.7	11,617

(注) 東証REIT指数（配当込み）とは、東京証券取引所に上場している不動産投資信託全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。

東証REIT指数の商標に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は東証REIT指数の内容の変更、公表の停止または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。東京証券取引所は東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対して、責任を負いません。

○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	東証REIT指数（配当込み）		投 資 信 託 組 入 比 率
				騰 落 率	
(期 首) 2017年 3月10日	円 26,870	% —	3,310.28	% —	% 97.8
3月末	26,848	△0.1	3,307.66	△0.1	95.0
4月末	26,221	△2.4	3,234.60	△2.3	96.5
5月末	26,679	△0.7	3,271.22	△1.2	95.5
6月末	26,042	△3.1	3,180.48	△3.9	94.1
7月末	26,201	△2.5	3,220.02	△2.7	90.5
8月末	25,982	△3.3	3,188.63	△3.7	93.3
9月末	25,709	△4.3	3,139.87	△5.1	96.0
10月末	25,488	△5.1	3,099.44	△6.4	95.2
11月末	26,292	△2.2	3,189.89	△3.6	96.9
12月末	26,401	△1.7	3,189.59	△3.6	96.2
2018年 1月末	27,734	3.2	3,357.09	1.4	96.7
2月末	27,206	1.3	3,291.44	△0.6	96.6
(期 末) 2018年 3月12日	26,458	△1.5	3,203.75	△3.2	96.7

(注) 騰落率は期首比。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

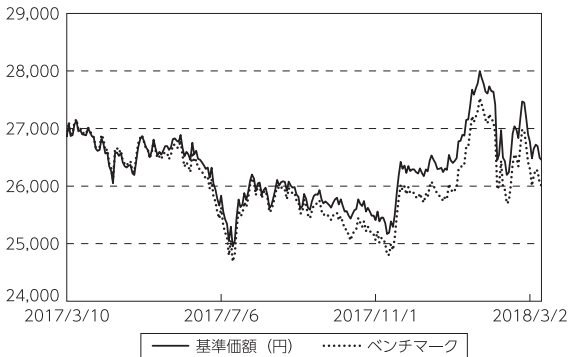
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）の騰落率（－3.2%）を1.7%上回りました。

基準価額等の推移



(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

◎J-REIT市況

- ・J-REIT各社による公募増資が多く発表されたことに加えて、米国などを中心とした金利上昇に対する懸念などを背景に、期首より軟調な展開となりました。また、地政学リスクなどの外部要因や、投資口需給において投資信託の売り越し基調が鮮明となったことなどが上値の重しとなりました。安定した改善基調の続く実物不動産市況を受けて、配当利回りなどで見た割安感が意識されて一時的に反発する局面もあったものの、全体としては軟調な展開となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・銘柄選定およびポートフォリオの構築は主に、定性的評価・定量的評価を経て行っています。
- ・定性的評価については、事業内容および財務内容等の分析を中心にを行い、定量的評価においては、キャッシュフロー、配当利回り、投資口価格純資産倍率(PBR)等の分析を行いました。
- ・組入銘柄数は50銘柄程度で推移させました。
- ・主な売買動向については、大型銘柄の中では相対的に配当利回りが高い日本リテールファンド投資法人のウェイトを引き上げたことや、割安感の後退したアクティビア・プロパティーズ投資法人のウェイトを引き下げたこと等が挙げられます。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について 銘柄選択がプラスに寄与しました。

(プラス要因となった主な銘柄)

- ・大和証券オフィス投資法人：投資口が割安であることに加え、賃料の引き上げや物件取得により中期的に業績成長が見込めると判断し、期首よりオーバーウェイト。投資口価格が好調に推移したことからプラスに寄与。
- ・日本プライムリアルティ投資法人：高品質な物件ポートフォリオを保有しているものの、物件

取得による資産規模の拡大が見込みにくいと想定し、期首よりアンダーウェイト。投資口価格が低調に推移したことからプラスに寄与。

(マイナス要因となった主な銘柄)

- ・平和不動産リート投資法人：相対的な割安などを考慮して期首よりアンダーウェイト。投資口価格が相対的に好調に推移したことからマイナスに影響。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・今後のJ-REIT市況については、当面横這い圏で推移するとみています。
- ・投資口の需給に関しては、引き続き毎月分配型を中心とした投資信託からの売りが上値を押さえる一方で、割安感の台頭に伴い上場投資信託(ETF)や海外投資家などの買いが下値を支える展開となっています。しかし、日銀の金融緩和姿勢は当面維持されるとみられることに加えて、オフィス・ビル賃料の緩やかな上昇傾向などを背景にREIT各社の業績は総じて堅調に推移しているため、中期的には徐々に下値を切り上げていくと考えます。

◎今後の運用方針

- ・REITの組入比率については、運用の基本方針にしたがい、引き続き高水準(90%以上)を維持する方針です。
- ・配当利回りやPBR等のバリュエーション、また物件ポートフォリオのクオリティなどに着目し、安定した分配金が見込め相対的に割安と思われる銘柄への投資ウェイトを高めた運用を行います。
- ・前述の不動産市況を踏まえ、保有物件の賃料動向等REIT各社の業績の先行きについて注意深く見守るほか、スポンサーのサポート体制などにも着目していく方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年3月11日～2018年3月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 41	% 0.156	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(投 資 信 託 証 券)	(41)	(0.156)	
合 計	41	0.156	
期中の平均基準価額は、26,400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

(2017年3月11日～2018年3月12日)

投資信託証券

銘	柄	買		付		売		付	
		口	数	金	額	口	数	金	額
			千口		千円		千口		千円
	日本アコモデーションファンド投資法人		0.612		286,769		0.818		370,083
	MCUBS MidCity投資法人		0.481		161,807		0.938		315,321
			(1)		(—)				
	森ヒルズリート投資法人		1		180,758		2		402,740
	産業ファンド投資法人		0.65		324,238		0.916		302,093
			(1)		(—)				
	アドバンス・レジデンス投資法人		1		496,910		2		753,466
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		1		380,053		0.851		236,175
			(1)		(—)				
	アクティビア・プロパティーズ投資法人		0.46		219,307		1		575,020
	GLP投資法人		2		278,430		2		295,285
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人		0.797		189,335		1		266,839
			(0.011)		(2,564)				
国	日本プロロジスリート投資法人		3		888,974		3		877,329
	星野リゾート・リート投資法人		0.421		245,414		0.321		180,300
	Oneリート投資法人		0.997		202,220		1		236,412
	イオンリート投資法人		1		138,508		1		179,589
	ヒューリックリート投資法人		0.12		21,803		1		300,063
	日本リート投資法人		1		415,211		0.754		231,850
	インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人		2		266,661		1		175,111
			(10)		(—)				
	積水ハウス・リート投資法人		1		160,553		2		422,696
	トーセイ・リート投資法人		0.25		26,375		0.334		36,333
	ケネディクス商業リート投資法人		0.364		86,954		1		355,251
	ヘルスケア&メディカル投資法人		1		117,023		—		—
	野村不動産マスターファンド投資法人		1		265,120		2		413,320
	いちごホテルリート投資法人		0.858		95,960		1		135,133
	ラサールロジポート投資法人		0.351		39,242		1		172,036
内	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		0.64		210,354		1		375,490
	大江戸温泉リート投資法人		0.66		58,564		0.66		59,139
	さくら総合リート投資法人		1		148,504		1		124,655
	投資法人みらい		0.996		163,549		0.756		130,932
	森トラスト・ホテルリート投資法人		1		216,409		0.75		108,529
	CREロジスティクスファンド投資法人		0.3		33,054		—		—
	ザイマックス・リート投資法人		0.3		32,162		—		—
	日本ビルファンド投資法人		1		802,738		1		1,041,127
	ジャパンリアルエステイト投資法人		1		979,956		1		937,595
	日本リテールファンド投資法人		4		892,494		3		648,718
	オリックス不動産投資法人		0.762		121,228		2		370,101

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	日本プライムリアルティ投資法人	千口 0.745	千円 301,574	千口 1	千円 501,797
	プレミアム投資法人	1	116,101	2	274,817
	東急リアル・エステート投資法人	0.61	84,741	1	180,406
	グローバル・ワン不動産投資法人	0.881	346,851	0.993	377,967
	ユナイテッド・アーバン投資法人	3	618,812	3	564,341
	森トラスト総合リート投資法人	2	405,048	3	666,576
	インヴィンシブル投資法人	8	398,590	9	432,175
	フロンティア不動産投資法人	0.38	178,390	0.932	443,031
	平和不動産リート投資法人	0.75	70,678	1	102,015
	日本ロジスティクスファンド投資法人	0.66	148,400	0.995	219,023
	福岡リート投資法人	0.8	140,016	1	214,617
	ケネディクス・オフィス投資法人	0.848	523,696	0.868	552,799
	積水ハウス・レジデンシャル投資法人	1	212,904	1	209,573
	いちごオフィスリート投資法人	1	89,092	2	193,914
	大和証券オフィス投資法人	0.72	401,763	0.945	539,081
	阪急リート投資法人	0.94	128,404	2	304,612
	スターツプロシード投資法人	0.36	52,662	0.909	141,195
	大和ハウスリート投資法人	1	339,690	2	598,485
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	2	151,273	5	394,158
	日本賃貸住宅投資法人	2	181,822	3	300,893
ジャパンエクセレント投資法人	1	233,165	1	243,022	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人（新）	0.011 (△0.011)	2,564 (△ 2,564)	—	—	
合	計	73 (14)	14,272,901 (—)	97	18,483,252

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2017年3月11日～2018年3月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	14,272	5,038	35.3	18,483	7,253	39.2

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
投資信託証券	百万円 1,035

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)	21,974千円
うち利害関係人への支払額 (B)	7,138千円
(B) / (A)	32.5%

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

○組入資産の明細

(2018年3月12日現在)

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千口	千円	%
日本アコモデーションファンド投資法人	0.806	0.6	278,700	2.4
MCUBS MidCity投資法人	0.857	2	152,000	1.3
森ヒルズリート投資法人	2	1	185,920	1.6
産業ファンド投資法人	0.316	1	165,620	1.4
アドバンス・レジデンス投資法人	2	1	297,000	2.6
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	0.8	2	358,800	3.1
アクティブア・プロパティーズ投資法人	1	0.8	368,000	3.2
GLP投資法人	2	2	289,640	2.5
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1	0.9	212,580	1.8
日本プロロジスリート投資法人	2	2	473,340	4.1
星野リゾート・リート投資法人	—	0.1	55,300	0.5
Oneリート投資法人	0.514	0.4	94,800	0.8
イオンリート投資法人	0.825	0.5	55,350	0.5
ヒューリックリート投資法人	2	0.9	141,120	1.2
日本リート投資法人	0.169	0.8	247,200	2.1
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	0.635	12	176,160	1.5
積水ハウス・リート投資法人	2	0.7	98,980	0.9
トーセイ・リート投資法人	0.084	—	—	—
ケネディクス商業リート投資法人	1	0.1	23,740	0.2
ヘルスケア&メディカル投資法人	—	1	112,750	1.0
野村不動産マスターファンド投資法人	3	2	365,560	3.1
いちごホテルリート投資法人	0.556	0.2	24,560	0.2
ラサールロジポート投資法人	2	1	108,800	0.9
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.876	0.4	138,600	1.2
さくら総合リート投資法人	—	0.4	36,960	0.3
投資法人みらい	0.56	0.8	146,640	1.3
森トラスト・ホテルリート投資法人	—	0.7	98,420	0.8
CREロジスティクスファンド投資法人	—	0.3	32,700	0.3
ザイマックス・リート投資法人	—	0.3	33,660	0.3
日本ビルファンド投資法人	1	1	853,500	7.3
ジャパンリアルエステイト投資法人	1	1	704,600	6.1
日本リテールファンド投資法人	1	2	579,710	5.0
オリックス不動産投資法人	4	3	536,320	4.6
日本プライムリアルティ投資法人	0.688	0.2	73,400	0.6
プレミアム投資法人	2	1	109,800	0.9
東急リアル・エステート投資法人	0.724	—	—	—
グローバル・ワン不動産投資法人	0.512	0.4	161,600	1.4
ユナイテッド・アーバン投資法人	2	3	546,810	4.7
森トラスト総合リート投資法人	2	0.6	95,280	0.8
インヴィンシブル投資法人	5	5	242,000	2.1
フロンティア不動産投資法人	0.952	0.4	172,400	1.5
平和不動産リート投資法人	1	0.7	68,810	0.6
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.435	0.1	21,000	0.2

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千口	千円	%
福岡リート投資法人	1	0.8	131,360	1.1
ケネディクス・オフィス投資法人	0.87	0.85	545,700	4.7
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	0.814	0.8	93,600	0.8
いちごオフィスリート投資法人	3	2	155,200	1.3
大和証券オフィス投資法人	1	0.8	476,800	4.1
阪急リート投資法人	1	0.3	39,210	0.3
スターツプロシード投資法人	0.549	—	—	—
大和ハウスリート投資法人	1	0.7	171,290	1.5
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8	4	364,320	3.1
日本賃貸住宅投資法人	3	2	205,000	1.8
ジャパンエクセレント投資法人	0.893	0.8	111,440	1.0
合 計	82	73	11,232,050	
銘 柄 数<比 率>	48	51	<96.7%>	

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) 日本アコモデーションファンド投資法人、MCUBS MidCity投資法人、森ヒルズリート投資法人、産業ファンド投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、アクティビア・プロパティーズ投資法人、GLP投資法人、コンフォリア・レジデンシャル投資法人、日本プロロジスリート投資法人、星野リゾート・リート投資法人、Oneリート投資法人、イオンリート投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本リート投資法人、インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人、積水ハウス・リート投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、野村不動産マスターファンド投資法人、いちごホテルリート投資法人、ラサールロジポート投資法人、三井不動産ロジスティクスパーク投資法人、さくら総合リート投資法人、投資法人みらい、森トラスト・ホテルリート投資法人、CREロジスティクスファンド投資法人、ザイマックス・リート投資法人、日本ビルファンド投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、日本リテールファンド投資法人、オリックス不動産投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、プレミアム投資法人、グローバル・ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、森トラスト総合リート投資法人、インヴィンシブル投資法人、フロンティア不動産投資法人、平和不動産リート投資法人、日本ロジスティクスファンド投資法人、福岡リート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、積水ハウス・レジデンシャル投資法人、いちごオフィスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、阪急リート投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、日本賃貸住宅投資法人、ジャパンエクセレント投資法人につきましては、委託会社の利害関係人である三菱UFJ信託銀行、三菱東京UFJ銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUFG証券が当該ファンドの一般事務受託会社等となっています。(各ファンドで開示されている2017年7月31日時点の有価証券報告書または有価証券届出書等より記載)

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

○投資信託財産の構成 (2018年3月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	11,232,050	95.6
コール・ローン等、その他	521,881	4.4
投資信託財産総額	11,753,931	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年3月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	11,753,931,769
コール・ローン等	222,936,365
投資証券(評価額)	11,232,050,000
未収入金	144,822,886
未収配当金	154,122,518
(B) 負債	136,031,559
未払金	75,180,671
未払解約金	60,850,345
未払利息	543
(C) 純資産総額(A-B)	11,617,900,210
元本	4,391,072,732
次期繰越損益金	7,226,827,478
(D) 受益権総口数	4,391,072,732口
1万口当たり基準価額(C/D)	26,458円

<注記事項>

- ①期首元本額 6,215,978,034円
 期中追加設定元本額 514,308,186円
 期中一部解約元本額 2,339,213,488円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,6458円です。

- ②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)
 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型) 110,564,737円
 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型) 78,736,223円
 ファンド・マネジャー(国内リート) 15,344,105円
 三菱UFJ <DC> J-REITファンド 2,909,409,047円
 MUAM J-REITファンド(適格機関投資家転売制限付) 1,277,018,620円
 合計 4,391,072,732円

[お 知 ら せ]

当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
 (変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)
 (2018年1月1日)

○損益の状況 (2017年3月11日～2018年3月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	465,972,932
受取配当金	466,252,222
受取利息	6,768
その他収益金	13
支払利息	△ 286,071
(B) 有価証券売買損益	△ 887,420,956
売買益	279,279,278
売買損	△ 1,166,700,234
(C) 当期損益金(A+B)	△ 421,448,024
(D) 前期繰越損益金	10,486,274,708
(E) 追加信託差損益金	842,274,709
(F) 解約差損益金	△ 3,680,273,915
(G) 計(C+D+E+F)	7,226,827,478
次期繰越損益金(G)	7,226,827,478

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

MUAM G-REITマザーファンド

《第12期》決算日2018年1月5日

[計算期間：2017年1月6日～2018年1月5日]

「MUAM G-REITマザーファンド」は、1月5日に第12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12期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	主としてS & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。銘柄選定にあたっては、時価総額および流動性等を勘案します。原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。市場動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主 要 運 用 対 象	S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への直接投資は行いません。投資信託証券への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		S & P 先 進 国 R E I T イ ン デ ッ ク ス (除く日本、配当込み、円換算ベース)		投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額
		期 騰	落 中 率	期 騰	落 中 率		
	円		%		%	%	百万円
8期(2014年1月6日)	10,769		19.4	11,215.01	20.1	98.1	6,129
9期(2015年1月5日)	15,384		42.9	16,149.24	44.0	99.1	11,986
10期(2016年1月5日)	15,105	△	1.8	15,914.11	△ 1.5	98.7	16,191
11期(2017年1月5日)	16,039		6.2	16,982.66	6.7	98.8	18,949
12期(2018年1月5日)	16,420		2.4	17,477.34	2.9	98.0	18,551

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

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P R E I T イ (除く日本、配当込 み、円換算ベース)	先 進 国 ス ン デ ッ ク ス 騰 落 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
	円	騰 落 率			
(期 首) 2017年 1 月 5 日	16,039	% —	16,982.66	% —	% 98.8
1 月末	15,292	△4.7	16,197.60	△4.6	98.3
2 月末	15,848	△1.2	16,809.34	△1.0	99.2
3 月末	15,389	△4.1	16,322.53	△3.9	98.5
4 月末	15,629	△2.6	16,568.56	△2.4	99.2
5 月末	15,400	△4.0	16,333.87	△3.8	98.2
6 月末	15,865	△1.1	16,842.43	△0.8	99.0
7 月末	15,839	△1.2	16,829.63	△0.9	98.8
8 月末	15,734	△1.9	16,718.51	△1.6	99.0
9 月末	16,120	0.5	17,124.06	0.8	98.9
10 月末	16,064	0.2	17,066.57	0.5	98.6
11 月末	16,351	1.9	17,386.28	2.4	98.5
12 月末	16,704	4.1	17,781.94	4.7	97.9
(期 末) 2018年 1 月 5 日	16,420	2.4	17,477.34	2.9	98.0

(注) 騰落率は期首比。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

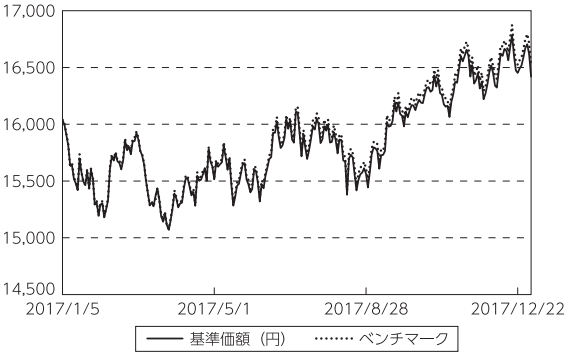
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.4%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(2.9%)を0.5%下回りました。

基準価額等の推移



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

●投資環境について

◎外国REIT市況（現地通貨ベース）

- ・米国の堅調な企業決算発表や良好な経済指標などを受けて、外国REIT市況は上昇しました。

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて3.2%の円高・米ドル安、11.1%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S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とし、同インデックスに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。
- ・不動産投資信託証券の組入比率は高位を保ち、国別比率や用途別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは2.9%の上昇となったため、カイ離は△0.5%程度となりました。

	売買コスト 要 因	配当課税 要 因	為替評価 要 因	その他の 要 因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	△0.1%程度	△0.4%程度	△0.1%程度	0.1%程度	△0.5%程度

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

◎売買コスト要因

売買コストによる影響は△0.1%程度でした。

◎配当課税要因

配当課税による影響は△0.4%程度でした。

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

◎為替評価要因

為替評価による影響は△0.1%程度でした。

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

◎その他の要因

その他の要因による影響は0.1%程度でした。

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

○今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年 1 月 6 日～2018年 1 月 5 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券)	円 2 (2)	% 0.013 (0.013)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (投 資 信 託 証 券)	1 (1)	0.007 (0.007)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	7 (6) (1)	0.043 (0.038) (0.005)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	10	0.063	
期中の平均基準価額は、15,852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

(2017年1月6日～2018年1月5日)

投資信託証券

銘柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	DDR CORP	0.893	8	4	40
	HCP INC	6	187	9	283
	MACERICH CO/THE	1	95	4	255
	ACADIA REALTY TRUST	1	32	1	39
	AGREE REALTY CORP	0.35	16	—	—
	ALEXANDER'S INC	0.069	29	0.05	20
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3	381	1	194
	PROLOGIS INC	7	426	11	652
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	1	67	2	97
	BRANDYWINE REALTY TRUST	2	33	4	72
	CAMDEN PROPERTY TRUST	1	156	1	146
	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	—	—	0.95	7
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	2	105	2	113
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	1	50	1	46
	COUSINS PROPERTIES INC	15	133	10	87
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	0.732	8	2	26
	DIGITAL REALTY TRUST INC	2	235	2	335
		(6)	(518)		
	EASTGROUP PROPERTIES INC	0.501	36	0.49	37
	EDUCATION REALTY TRUST INC	0.892	35	1	72
	EPR PROPERTIES	0.824	58	1	106
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1	121	1	106
	EQUITY ONE INC	—	—	0.68	21
		(△ 13)	(△ 417)		
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.796	194	1	317
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1	135	2	210
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	148	1	223
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	2	62	2	61
	FIRST POTOMAC REALTY TRUST	0.747	7	—	—
				(8)	(96)
	GETTY REALTY CORP	0.8	21	—	—
	WELLTOWER INC	5	423	7	542
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	1	65	1	76
	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	1	57	4	119
	EQUITY COMMONWEALTH	0.26	8	1	47
	KILROY REALTY CORP	1	136	1	102
	KITE REALTY GROUP TRUST	—	—	0.67	12
	LEXINGTON REALTY TRUST	0.852	8	2	24
	LTC PROPERTIES INC	—	—	0.28	12
	MAC-KALI REALTY CORP	0.299	8	1	29
	BOSTON PROPERTIES INC	2	314	3	469

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
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	7	98	4	58
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1	122	2	211
	NATL HEALTH INVESTORS INC	0.106	8	0.15	10
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2	74	4	141
	PENN REAL ESTATE INVEST TST	—	—	0.76	9
	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	1	19	2	36
	REALTY INCOME CORP	6	356	4	278
	REGENCY CENTERS CORP	1	116	2	157
		(6)	(417)		
	SENIOR HOUSING PROP TRUST	3	60	4	81
	SL GREEN REALTY CORP	1	197	3	319
	LIFE STORAGE INC	0.449	36	0.83	61
	SUN COMMUNITIES INC	2	204	1	99
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	4	71	3	62
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1	32	1	50
	TAUBMAN CENTERS INC	0.136	8	0.77	46
	CUBESMART	2	56	3	74
	UDR INC	3	113	5	193
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.112	8	0.26	16
	VENTAS INC	5	369	8	533
	WASHINGTON REIT	0.252	8	0.44	13
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	0.914	28	1	47
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	—	—	0.41	7
	PS BUSINESS PARKS INC/CA	0.066	8	0.3	37
	UMH PROPERTIES INC	1	27	0.76	12
	MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	1	22	1	16
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	2	85	2	68
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	1	60	1	81
	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	—	—	1	10
	DOUGLAS EMMETT INC	3	151	2	113
	DUPONT FABROS TECHNOLOGY	1	56	0.98	55
		(△ 11)	(△ 518)		
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1	35	2	69
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	1	33	2	54
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	6	228	3	108
	CORESITE REALTY CORP	0.53	52	0.7	66
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	3	58	1	31
	GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	3	56	—	—
	RLJ LODGING TRUST	1	34	3	72
		(6)	(150)		
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	0.412	8	1	34
	STAG INDUSTRIAL INC	2	67	1	35
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	2	51	0.28	6
		(12)	(290)		
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	0.641	8	2	37
	HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	10	319	3	96

	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
	WP CAREY INC	1	83	2	161
	WHITESTONE REIT	1	18	—	—
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	0.128	7	0.58	35
	CHATHAM LODGING TRUST	—	—	0.52	9
	TERRENO REALTY CORP	0.729	23	0.52	17
	SILVER BAY REALTY TRUST CORP	—	—	(5)	(96)
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	1	8	8	71
	CORECIVIC INC	1	41	2	83
	GEO GROUP INC/THE	1	55	1	44
		(6)	(—)		
	VEREIT INC	11	96	18	149
	DUKE REALTY CORP	3	94	6	181
	ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	2	26	1	18
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	0.75	22	0.34	8
	PHYSICIANS REALTY TRUST	6	134	2	42
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	6	143	3	71
	GRAMERCY PROPERTY TRUST	3	110	2	58
	CYRUSONE INC	3	180	1	65
	ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	2	22	0.88	9
	EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	1	36	2	46
	QTS REALTY TRUST INC-CL A	0.162	8	0.57	28
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	8	163	4	93
	STARWOOD WAYPOINT HOMES	11	386	0.64	21
		(△ 17)	(△ 575)		
	COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	1	32	3	72
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	—	—	1	12
	CARETRUST REIT INC	1	19	—	—
	NEW YORK REIT INC	—	—	24	243
	PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	1	19	1	17
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	1	65	3	113
	INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	5	49	3	31
	IRON MOUNTAIN INC	7	284	4	157
	STORE CAPITAL CORP	3	84	3	75
	URBAN EDGE PROPERTIES	2	58	1	45
	PARAMOUNT GROUP INC	28	452	—	—
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	1	36	—	—
	MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	—	—	24	295
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	—	—	0.58	10
	NORTHSTAR REALTY FINANCE	—	—	—	—
		(△ 27)	(△ 443)		
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	0.859	19	—	—
	CARE CAPITAL PROPERTIES INC	0.297	8	1	33
		(△ 11)	(△ 290)		
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	8	151	1	34
	BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	0.612	7	—	—

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
	GLOBAL NET LEASE INC	1 (△ 16)	32 (—)	—	—
	CITY OFFICE REIT INC	1	21	0.96	11
	NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	0.674	7	1	15
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	0.46	19	0.48	19
	FOREST CITY REALTY TRUST- A	7	188	2	54
	COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1	25	—	—
	FARMLAND PARTNERS INC	2	28	—	—
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	35 (—)	32 (△ 2)	—	—
	MANULIFE US REAL ESTATE INV-RTS	— (— 36)	— (—)	36	7
	TIER REIT INC	0.482	7	1	20
	WHEELER REAL ESTATE INVESTME	— (△ 9)	— (—)	—	—
	PARKWAY INC	—	—	0.53 (6)	10 (134)
	MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	2	32	—	—
	PARK HOTELS & RESORTS INC	25	692	3	84
	EQUITY RESIDENTIAL	4	306	7	500
	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	57 (29)	830 (443)	9	129
	INVITATION HOMES INC	11 (28)	257 (575)	0.68	14
	JBG SMITH PROPERTIES	0.961 (12)	31 (—)	—	—
	ALEXANDER & BALDWIN INC	6	281	—	—
	CLIPPER REALTY INC	2	32	—	—
	GLADSTONE LAND CORP	2	33	—	—
	GLOBAL MEDICAL REIT INC	3	32	—	—
	INFRAREIT INC	5	122	—	—
	FELCOR LODGING TRUST INC	— (△ 18)	— (△ 150)	—	—
	GGP INC	12	291	11	266
	HOST HOTELS & RESORTS INC	9	168	14	260
	LIBERTY PROPERTY TRUST	1	73	2	118
	LASALLE HOTEL PROPERTIES	0.981	27	1	38
	PUBLIC STORAGE	2	470	3	721
	SIMON PROPERTY GROUP INC	4	740	7	1,229
	VORNADO REALTY TRUST	2	201	3	314
	KIMCO REALTY CORP	5	110	8	181
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2	389	3	594
	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	1	76	2	105
	小計	519 (20)	15,696 (△ 2)	452 (20)	15,601 (327)

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	カナダ	千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	—	—	0.3	13
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	0.5	15	1	35
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	—	—	0.9	12
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	—	—	3	61
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	1	25	3	66
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	—	—	0.5	11
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2	70	4	104
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	1	52	0.5	19
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	1	20	1	20
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO	—	—	(2)	(52)
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	1	21	1	16
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	4	45	—	—
	ONEREIT	6	24	9	36
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	0.6	27	1	47
	MILESTONE APARTMENTS REAL ES	—	—	(5)	(106)
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	2	16	—	—
	CHOICE PROPERTIES REIT	1	24	1	16
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1	23	2	42
	PLAZA RETAIL REIT	2	10	7	31
	SLATE OFFICE REIT	2	16	2	19
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	5	38	—	—
	小 計	36	434	40 (7)	554 (159)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ				
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4 (—)	55 (△ 7)	2	34
	HAMBORNER REIT AG	1	17	1	14
	小 計	6 (—)	73 (△ 7)	4	48
	イタリア				
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	— (—)	— (△0.86567)	8	6
	BENI STABILI SPA	11	6	—	—
	小 計	11 (—)	6 (△0.86567)	8	6
	フランス				
	GECINA SA	1	205	0.872	116
	GECINA SA-RTS	— (5)	— (—)	5	14
	KLEPIERRE	2	90	4	151
	UNIBAIL-RODAMCO SE	1	344	2	536
	FONCIERE DES REGIONS	1 (—)	95 (△ 7)	1	103

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	フランス				
	MERCIALYS	0.4	7	—	—
	ICADE	0.449	31	0.79	57
	ALTAREA	0.12	23	—	—
		(—)	(△ 3)		
	小 計	7 (5)	798 (△ 11)	15	979
	オランダ				
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	0.192	7	0.72	25
	NSI NV	4 (△ 17)	17 (—)	7	27
	VASTNED RETAIL NV	—	—	0.914	34
	WERELDHAVE NV	0.166	7	0.49	20
	小 計	5 (△ 17)	31 (—)	9	108
	スペイン				
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	— (—)	— (△ 3)	1	9
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	8 (—)	98 (△ 7)	31	364
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	1	21	0.8	12
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	1	19	1	19
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	44	371	—	—
	小 計	56 (—)	511 (△ 10)	35	406
	ベルギー				
	BEFIMMO	0.35	18	0.3	15
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	—	—	0.35	8
	RETAIL ESTATES	0.25	19	0.37	28
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	—	—	0.15	14
	WERELDHAVE BELGIUM NV	—	—	0.32	30
	AEDIFICA	0.7	48	0.18	13
	AEDIFICA-RTS	— (2)	— (—)	2	2
	XIOR STUDENT HOUSING NV	0.25	9	0.75	29
	XIOR STUDENT HOUSING NV-RTS	— (0.5)	— (—)	0.5	1
	MONTEA	—	—	0.98	43
	MONTEA-RTS	— (0.98)	— (—)	0.98	0.44135
	COFINIMMO	0.23	24	0.39	43
	小 計	1 (3)	119 (—)	7	231
	アイルランド				
	GREEN REIT PLC	5	7	—	—

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	アイルランド				
	HIBERNIA REIT PLC	—	—	5	6
	小計	5	7	5	6
	ユーロ計	94 (△ 8)	1,548 (△ 31)	84	1,787
	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC	11	72	18	120
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	3 (△ 2)	19 (—)	3	24
	HAMMERSON PLC	13	77	15	92
	LAND SECURITIES GROUP PLC	9 (△ 6)	101 (△ 66)	16	175
	INTU PROPERTIES PLC	2	6	10	29
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	—	—	6	7
	SEGRO PLC	35	165	16	81
	SEGRO PLC -RTS	— (23)	— (—)	23	21
	WORKSPACE GROUP PLC	—	—	0.92	8
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	6	14	21	47
	SHAFTESBURY PLC	4	45	11	110
	DERWENT LONDON PLC	1	43	2	78
	MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	—	—	9	46
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	15	25	8	14
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	11	14	62	87
	RDI REIT PLC	—	—	16	6
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	—	—	2	8
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	40	59	17	25
	ASSURA PLC	121	75	24	15
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	25	15	40	23
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	18	20	—	—
	REGIONAL REIT LTD	11	12	—	—
	NEWRIVER REIT PLC	9	31	—	—
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	28	30	—	—
	UNITE GROUP PLC	35	226	2	13
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	21	21	21	20
	LXI REIT PLC	19	20	—	—
	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	10	10	—	—
	小計	452 (14)	1,109 (△ 66)	352	1,058
	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	43	121	79	221
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	1 (—)	10 (△ 2)	— (8)	— (51)
	ASPEN GROUP	—	—	11	11
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	3	10	—	—
	360 CAPITAL GROUP LTD	—	—	34	33

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	オーストラリア	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
	ALE PROPERTY GROUP	—	—	25	117
	CHARTER HALL GROUP	10	60	2	15
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	—	—	4	13
	CROMWELL PROPERTY GROUP	—	—	12	12
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	4	10	—	—
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	14	45	3	12
	NATIONAL STORAGE REIT	8	11	—	—
	GDI PROPERTY GROUP	10	10	—	—
	INDUSTRIA REIT	—	—	11	24
	CENTURIA URBAN REIT	—	—	—	—
				(7)	(16)
	SCENTRE GROUP	82	351	125	532
	ARENA REIT	5	10	8	16
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	8	24	14	43
	GENERATION HEALTHCARE REIT	—	—	23	52
	VIVA ENERGY REIT	—	—	6	15
	PROPERTYLINK GROUP	87	67	—	—
	CENTURIA METROPOLITAN REIT	—	—	6	16
		(6)	(15)		
	RURAL FUNDS GROUP	35	78	—	—
	GPT GROUP	24	127	42	215
	MIRVAC GROUP	43	98	77	174
	STOCKLAND	30	141	45	210
	WESTFIELD CORP	21	179	36	313
	DEXUS	18	175	21	204
	INVESTA OFFICE FUND	—	—	21	96
	CHARTER HALL RETAIL REIT	—	—	2	11
	GOODMAN GROUP	28	223	41	333
	小計	482	1,760	660	2,700
		(6)	(12)	(16)	(68)
	ニュージーランド		千ニュージーランドドル		千ニュージーランドドル
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	5	11	—	—
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	34	48	35	50
	GOODMAN PROPERTY TRUST	—	—	15	18
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	—	—	62	100
	ARGOSY PROPERTY LTD	23	24	25	25
	STRIDE PROPERTY GROUP	—	—	7	12
	INVESTORE PROPERTY LTD	8	11	—	—
	小計	72	96	144	207
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	34	1,910	52	2,939
	CHAMPION REIT	—	—	42	232
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	12	56	—	—
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	—	—	115	264
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	—	—	24	122
	FORTUNE REIT	—	—	9	81

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
	SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	—	—	23	74
	小 計	46	1,966	265	3,714
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	SUNTEC REIT	15 (—)	26 (△ 3)	80	146
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	78	128	47	77
	CAPITACOMMERCIAL TRUST-RTS	— (48)	— (—)	48	13
	KEPPEL REIT	— (—)	— (△0.86352)	16	19
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	— (—)	— (△ 0.9667)	—	—
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	50 (—)	54 (△ 4)	18	22
	ASCOTT RESIDENCE TRUST-RTS	— (36)	— (—)	36	5
	ESR-REIT	—	—	22	12
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	41 (—)	63 (△0.50498)	42	61
	CDL HOSPITALITY TRUSTS-RTS	— (19)	— (—)	19	5
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	14	29	21	42
	STARHILL GLOBAL REIT	— (—)	— (△ 0.513)	—	—
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	106 (—)	128 (△ 1)	35	40
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	— (—)	— (△ 8)	26	41
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	— (—)	— (△ 2)	8	10
	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	— (—)	— (△0.35862)	—	—
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	26 (—)	10 (△ 3)	—	—
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	— (—)	— (△ 1)	4	11
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	— (—)	— (△0.19385)	7	12
	CACHE LOGISTICS TRUST	— (—)	— (△0.32131)	—	—
	CACHE LOGISTICS TRUST-RTS	— (22)	— (—)	22	4
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	28	42	18	29
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	—	—	32	20
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	54	25	31	14
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT-RTS	—	—	46	4

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
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	— (—)	— (△ 1)	—	—
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	46 (—)	48 (△ 3)	80	88
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	22	15	60	43
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	24 (—)	17 (△ 0.5405)	100	69
	OUE HOSPITALITY TRUST	15	10	—	—
	KEPPEL DC REIT	— (—)	— (△ 0.27)	—	—
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	— (—)	— (△ 3)	13	13
	CAPITALAND MALL TRUST	29	59	41	82
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	32 (—)	82 (△ 3)	48	128
	小 計	582 (128)	743 (△ 41)	927	1,024
	イスラエル		千イスラエルシェケル		千イスラエルシェケル
	REIT 1 LTD	—	—	3	43
	小 計	—	—	3	43

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2017年1月6日～2018年1月5日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 2,762	百万円 1,049	% 38.0	百万円 3,478	百万円 936	% 26.9

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

○組入資産の明細

(2018年1月5日現在)

外国投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
DDR CORP	45	42	376	42,501	0.2	
HCP INC	68	65	1,664	187,825	1.0	
MACERICH CO/THE	17	15	971	109,619	0.6	
ACADIA REALTY TRUST	11	11	315	35,558	0.2	
AGREE REALTY CORP	3	4	207	23,425	0.1	
ALEXANDER'S INC	0.5	0.519	203	23,008	0.1	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11	13	1,695	191,366	1.0	
PROLOGIS INC	78	74	4,661	526,018	2.8	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	19	18	749	84,602	0.5	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12	12	78	8,844	0.0	
BRANDYWINE REALTY TRUST	26	24	429	48,432	0.3	
CAMDEN PROPERTY TRUST	12	12	1,146	129,370	0.7	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	25	24	137	15,553	0.1	
CEDAR REALTY TRUST INC	10	10	64	7,266	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	21	21	885	99,892	0.5	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	14	14	399	45,085	0.2	
COUSINS PROPERTIES INC	52	57	521	58,899	0.3	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	29	28	313	35,358	0.2	
DIGITAL REALTY TRUST INC	23	28	3,218	363,176	2.0	
EASTGROUP PROPERTIES INC	4	4	418	47,278	0.3	
EDUCATION REALTY TRUST INC	11	10	339	38,334	0.2	
EPR PROPERTIES	9	8	545	61,580	0.3	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12	12	1,061	119,774	0.6	
EQUITY ONE INC	14	—	—	—	—	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9	9	2,198	248,064	1.3	
EXTRA SPACE STORAGE INC	18	17	1,493	168,569	0.9	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10	10	1,285	145,102	0.8	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	17	17	522	58,908	0.3	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	7	—	—	—	—	
GETTY REALTY CORP	4	4	127	14,364	0.1	
WELLTOWER INC	53	51	3,251	366,924	2.0	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	14	14	716	80,860	0.4	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	24	22	652	73,652	0.4	
EQUITY COMMONWEALTH	18	17	512	57,781	0.3	
KILROY REALTY CORP	13	13	1,008	113,849	0.6	
KITE REALTY GROUP TRUST	12	11	226	25,586	0.1	
LEXINGTON REALTY TRUST	31	30	288	32,575	0.2	
LTC PROPERTIES INC	5	5	242	27,345	0.1	
MACK-CALI REALTY CORP	13	12	267	30,196	0.2	
BOSTON PROPERTIES INC	22	21	2,720	306,976	1.7	

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	%
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	47	50	678	76,612	0.4
MID-AMERICA APARTMENT COMM	16	15	1,543	174,205	0.9
NATL HEALTH INVESTORS INC	5	5	433	48,945	0.3
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	29	27	733	82,784	0.4
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2	2	59	6,701	0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST	10	9	115	13,070	0.1
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	12	11	163	18,420	0.1
REALTY INCOME CORP	38	39	2,174	245,386	1.3
REGENCY CENTERS CORP	15	20	1,386	156,451	0.8
SAUL CENTERS INC	1	1	97	11,042	0.1
SENIOR HOUSING PROP TRUST	34	33	636	71,872	0.4
SL GREEN REALTY CORP	15	13	1,366	154,207	0.8
LIFE STORAGE INC	6	6	559	63,151	0.3
SUN COMMUNITIES INC	9	11	998	112,651	0.6
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	31	32	527	59,513	0.3
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	14	13	339	38,340	0.2
TAUBMAN CENTERS INC	8	8	531	59,933	0.3
CUBESMART	26	25	722	81,568	0.4
UDR INC	39	37	1,413	159,545	0.9
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1	1	129	14,569	0.1
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4	4	96	10,865	0.1
VENTAS INC	52	49	2,916	329,149	1.8
WASHINGTON REIT	11	10	322	36,401	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	17	16	539	60,885	0.3
HERSHA HOSPITALITY TRUST	6	5	104	11,754	0.1
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2	2	323	36,512	0.2
UMH PROPERTIES INC	3	4	59	6,763	0.0
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3	3	73	8,292	0.0
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	9	10	179	20,266	0.1
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	16	17	542	61,229	0.3
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15	15	165	18,624	0.1
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	13	12	743	83,872	0.5
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	19	17	96	10,869	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	21	22	893	100,790	0.5
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	11	—	—	—	—
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	10	9	365	41,221	0.2
CHESAPEAKE LODGING TRUST	8	8	237	26,771	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	21	20	383	43,228	0.2
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17	21	708	79,901	0.4
CORESITE REALTY CORP	5	4	546	61,625	0.3
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5	5	219	24,754	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13	14	219	24,780	0.1
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	10	13	238	26,904	0.1
RLJ LODGING TRUST	18	23	531	59,932	0.3
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	16	15	293	33,083	0.2

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
STAG INDUSTRIAL INC	11	12	332	37,530	0.2	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	9	24	461	52,090	0.3	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	34	32	423	47,786	0.3	
SELECT INCOME REIT	9	9	221	25,013	0.1	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	21	28	820	92,612	0.5	
WP CAREY INC	15	14	991	111,899	0.6	
WHITESTONE REIT	4	5	76	8,648	0.0	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7	7	488	55,092	0.3	
CHATHAM LODGING TRUST	6	5	123	13,895	0.1	
TERRENO REALTY CORP	6	6	239	27,012	0.1	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	5	—	—	—	—	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	71	63	521	58,900	0.3	
CORECIVIC INC	17	16	367	41,460	0.2	
GEO GROUP INC/THE	11	17	398	44,916	0.2	
VEREIT INC	144	137	1,051	118,666	0.6	
DUKE REALTY CORP	53	50	1,316	148,562	0.8	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	5	5	87	9,902	0.1	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	9	10	293	33,145	0.2	
PHYSICIANS REALTY TRUST	20	25	439	49,550	0.3	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	32	35	743	83,927	0.5	
GRAMERCY PROPERTY TRUST	20	22	591	66,746	0.4	
CYRUSONE INC	10	12	745	84,124	0.5	
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	3	4	44	5,000	0.0	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	18	18	355	40,095	0.2	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	7	6	355	40,117	0.2	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	38	42	766	86,469	0.5	
STARWOOD WAYPOINT HOMES	7	—	—	—	—	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	18	16	377	42,649	0.2	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	28	26	187	21,133	0.1	
CARETRUST REIT INC	9	10	169	19,117	0.1	
NEW YORK REIT INC	24	—	—	—	—	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	3	3	73	8,308	0.0	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	28	27	1,008	113,783	0.6	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	9	11	113	12,812	0.1	
IRON MOUNTAIN INC	36	39	1,449	163,605	0.9	
STORE CAPITAL CORP	23	23	601	67,884	0.4	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	11	11	90	10,191	0.1	
URBAN EDGE PROPERTIES	13	14	359	40,543	0.2	
PARAMOUNT GROUP INC	—	28	436	49,231	0.3	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	3	5	106	12,032	0.1	
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	24	—	—	—	—	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	15	15	327	36,907	0.2	
NORTHSTAR REALTY FINANCE	27	—	—	—	—	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	5	6	164	18,527	0.1	
NEXPOINT RESIDENTIAL	2	2	66	7,472	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	
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカドル	千円	%
CARE CAPITAL PROPERTIES INC		12	—	—	—	—
APPLE HOSPITALITY REIT INC		22	29	561	63,354	0.3
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH		2	3	35	3,966	0.0
GLOBAL NET LEASE INC		24	9	197	22,308	0.1
CITY OFFICE REIT INC		2	3	45	5,109	0.0
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP		7	7	94	10,653	0.1
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT		3	3	143	16,186	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST		8	8	217	24,521	0.1
FOREST CITY REALTY TRUST- A		32	37	884	99,852	0.5
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I		1	2	76	8,685	0.0
FARMLAND PARTNERS INC		1	4	37	4,240	0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INV		90	125	116	13,188	0.1
TIER REIT INC		7	6	136	15,451	0.1
WHEELER REAL ESTATE INVESTME		10	1	11	1,319	0.0
PARKWAY INC		6	—	—	—	—
QUALITY CARE PROPERTIES		13	13	189	21,353	0.1
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC		3	5	64	7,293	0.0
PARK HOTELS & RESORTS INC		—	22	646	72,926	0.4
EQUITY RESIDENTIAL		54	51	3,224	363,833	2.0
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A		—	77	852	96,188	0.5
INVITATION HOMES INC		—	39	919	103,765	0.6
JBG SMITH PROPERTIES		—	13	447	50,542	0.3
ALEXANDER & BALDWIN INC		—	6	179	20,305	0.1
CLIPPER REALTY INC		—	2	29	3,294	0.0
GLADSTONE LAND CORP		—	2	34	3,927	0.0
GLOBAL MEDICAL REIT INC		—	3	29	3,280	0.0
INFREAREIT INC		—	5	97	10,981	0.1
FELCOR LODGING TRUST INC		18	—	—	—	—
GGP INC		86	87	2,036	229,778	1.2
HOST HOTELS & RESORTS INC		109	104	2,062	232,697	1.3
ISTAR INC		10	10	113	12,840	0.1
LIBERTY PROPERTY TRUST		22	20	873	98,582	0.5
LASALLE HOTEL PROPERTIES		16	16	457	51,579	0.3
PUBLIC STORAGE		22	20	4,252	479,830	2.6
SIMON PROPERTY GROUP INC		46	43	7,245	817,612	4.4
VORNADO REALTY TRUST		25	24	1,812	204,469	1.1
KIMCO REALTY CORP		62	58	1,040	117,456	0.6
AVALONBAY COMMUNITIES INC		20	19	3,372	380,583	2.1
APARTMENT INVT & MGMT CO -A		23	22	956	107,913	0.6
小計	口 数 ・ 金 額	3,186	3,253	112,621	12,708,236	
	銘 柄 数 < 比 率 >	159	158	—	<68.5%>	
(カナダ)				千カナダドル		
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		3	3	138	12,533	0.1
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		9	8	269	24,380	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		9	9	353	31,994	0.2

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST		5	5	234	21,213	0.1
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U		13	12	182	16,469	0.1
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV		8	5	115	10,443	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		21	19	405	36,683	0.2
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS		3	3	48	4,355	0.0
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST		4	3	86	7,799	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		24	22	556	50,337	0.3
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT		5	6	275	24,918	0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT		10	10	147	13,292	0.1
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME		6	6	92	8,333	0.0
BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO		2	—	—	—	—
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		4	5	57	5,236	0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV		8	12	149	13,534	0.1
ONEREIT		2	—	—	—	—
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		3	3	161	14,584	0.1
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		5	5	53	4,806	0.0
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		4	4	41	3,763	0.0
MILESTONE APARTMENTS REAL ES		5	—	—	—	—
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI		2	2	39	3,541	0.0
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE		16	19	129	11,661	0.1
CHOICE PROPERTIES REIT		5	6	86	7,801	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		5	3	52	4,782	0.0
PLAZA RETAIL REIT		5	—	—	—	—
SLATE RETAIL REIT - U		2	2	32	2,905	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		5	5	70	6,331	0.0
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA		2	2	25	2,268	0.0
SLATE OFFICE REIT		3	2	22	2,010	0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI		—	5	38	3,491	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	210	198	3,866	349,475	
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	27	—	<1.9%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		15	17	229	31,207	0.2
HAMBORNER REIT AG		10	11	113	15,528	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	26	29	342	46,736	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.3%>	
(ユーロ…イタリア)						
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		55	47	47	6,413	0.0
BENI STABILI SPA		135	147	112	15,371	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	191	195	159	21,784	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)						
GECINA SA		6	6	1,027	140,061	0.8
KLEPIERRE		30	29	1,057	144,114	0.8
UNIBAIL-RODAMCO SE		14	13	2,918	397,728	2.1
FONCIERE DES REGIONS		7	7	677	92,341	0.5

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
MERCIALYS		7	8	151	20,606	0.1
ICADE		6	6	509	69,417	0.4
ALTAREA		0.36	0.48	102	13,899	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	73	72	6,444	878,169	
	銘 柄 数 < 比 率 >	7	7	—	<4.7%>	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPRIETIE-CV		7	6	250	34,171	0.2
NSI NV		22	2	91	12,440	0.1
VASTNED RETAIL NV		2	2	82	11,264	0.1
WERELDHAVE NV		5	5	229	31,339	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	39	16	654	89,215	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.5%>	
(ユーロ…スペイン)						
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		14	12	115	15,742	0.1
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		69	47	534	72,902	0.4
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA		8	8	165	22,616	0.1
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI		15	15	249	34,051	0.2
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		—	44	379	51,769	0.3
小 計	口 数 ・ 金 額	107	129	1,446	197,082	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	5	—	<1.1%>	
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO		3	3	179	24,508	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES		2	1	41	5,641	0.0
RETAIL ESTATES		1	0.88	65	8,861	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA		2	2	206	28,132	0.2
WERELDHAVE BELGIUM NV		0.32	—	—	—	—
AEDIFICA		2	2	200	27,274	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV		0.5	—	—	—	—
MONTEA		0.98	—	—	—	—
COFINIMMO		3	2	319	43,500	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	15	13	1,012	137,919	
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	6	—	<0.7%>	
(ユーロ…アイルランド)						
GREEN REIT PLC		96	101	159	21,793	0.1
HIBERNIA REIT PLC		103	98	151	20,618	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		53	53	79	10,833	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	252	252	390	53,245	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.3%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	706	708	10,450	1,424,154	
	銘 柄 数 < 比 率 >	31	29	—	<7.7%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		152	145	968	148,163	0.8
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		49	46	317	48,602	0.3
HAMMERSON PLC		115	113	602	92,288	0.5
LAND SECURITIES GROUP PLC		118	104	1,012	155,034	0.8

銘 柄		期首(前期末)		当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		千口	千口	千イギリスポンド	千円	%
INTU PROPERTIES PLC		132	123	308	47,155	0.3
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		91	85	99	15,184	0.1
SEGRO PLC		122	141	820	125,529	0.7
WORKSPACE GROUP PLC		18	17	168	25,791	0.1
MCKAY SECURITIES PLC-ORD		15	—	—	—	—
SHAFTESBURY PLC		41	34	355	54,358	0.3
BIG YELLOW GROUP PLC		21	21	182	27,923	0.2
DERWENT LONDON PLC		16	15	453	69,437	0.4
MUCKLOW (A & J) GROUP PLC		9	—	—	—	—
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		88	96	180	27,683	0.1
HANSTEEN HOLDINGS PLC		108	58	82	12,650	0.1
RDI REIT PLC		197	181	67	10,266	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC		31	29	142	21,865	0.1
TRITAX BIG BOX REIT PLC		164	187	278	42,599	0.2
ASSURA PLC		235	331	208	31,938	0.2
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM		89	74	45	6,939	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		68	86	77	11,901	0.1
REGIONAL REIT LTD		24	35	36	5,590	0.0
CAPITAL & REGIONAL PLC		75	75	45	6,892	0.0
NEWRIVER REIT PLC		33	42	137	21,052	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		—	28	31	4,842	0.0
UNITE GROUP PLC		—	33	263	40,370	0.2
LXI REIT PLC		—	19	19	3,009	0.0
AEW UK LONG LEASE REIT PLC		—	10	10	1,557	0.0
小 計		口 数 ・ 金 額	2,022	2,137	6,916	1,058,631
銘 柄 数 < 比 率 >			24	26	—	<5.7%>
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		485	449	1,213	107,542	0.6
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP		6	—	—	—	—
ABACUS PROPERTY GROUP		43	43	176	15,622	0.1
ASPEN GROUP		11	—	—	—	—
INGENIA COMMUNITIES GROUP		22	26	74	6,597	0.0
360 CAPITAL GROUP LTD		34	—	—	—	—
ALE PROPERTY GROUP		25	—	—	—	—
CHARTER HALL GROUP		59	67	406	36,033	0.2
FOLKESTONE EDUCATION TRUST		35	30	86	7,664	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP		198	185	188	16,731	0.1
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA		101	106	246	21,890	0.1
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR		26	36	124	11,018	0.1
NATIONAL STORAGE REIT		64	72	110	9,801	0.1
GDI PROPERTY GROUP		65	75	94	8,335	0.0
INDUSTRIA REIT		23	11	30	2,679	0.0
CENTURIA URBAN REIT		7	—	—	—	—
SCENTRE GROUP		790	747	3,108	275,533	1.5
ARENA REIT		37	34	76	6,784	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	
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリアドル	千円	%
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS		23	17	57	5,122	0.0
GENERATION HEALTHCARE REIT		23	—	—	—	—
VIVA ENERGY REIT		66	60	135	12,014	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT		23	23	94	8,419	0.0
PROPERTYLINK GROUP		—	87	88	7,851	0.0
RURAL FUNDS GROUP		—	35	83	7,372	0.0
GPT GROUP		265	247	1,291	114,508	0.6
MIRVAC GROUP		543	509	1,191	105,647	0.6
STOCKLAND		353	338	1,493	132,416	0.7
WESTFIELD CORP		284	269	2,507	222,299	1.2
DEXUS		142	139	1,388	123,099	0.7
BWP TRUST		70	70	218	19,407	0.1
INVESTA OFFICE FUND		92	71	324	28,736	0.2
CHARTER HALL RETAIL REIT		49	47	195	17,334	0.1
GOODMAN GROUP		234	221	1,871	165,926	0.9
小 計	口 数 ・ 金 額	4,211	4,023	16,881	1,496,392	
	銘 柄 数 < 比 率 >	31	27	—	<8.1%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR		43	49	108	8,751	0.0
KIWI PROPERTY GROUP LTD		199	198	276	22,334	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST		147	132	184	14,875	0.1
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD		62	—	—	—	—
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL		141	141	193	15,595	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD		127	126	137	11,069	0.1
STRIDE PROPERTY GROUP		59	52	93	7,551	0.0
INVESTORE PROPERTY LTD		21	30	45	3,669	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	803	731	1,038	83,847	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	7	—	<0.5%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		329	311	22,858	329,848	1.8
CHAMPION REIT		310	268	1,546	22,313	0.1
PROSPERITY REIT		178	178	599	8,655	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN		148	160	817	11,797	0.1
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT		115	—	—	—	—
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		153	129	701	10,126	0.1
FORTUNE REIT		205	196	1,911	27,575	0.1
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN		137	114	378	5,461	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,575	1,356	28,813	415,779	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	7	—	<2.2%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		379	315	683	58,147	0.3
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		324	355	720	61,284	0.3
KEPPEL REIT		263	246	312	26,611	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST		84	84	128	10,942	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST		126	158	198	16,837	0.1

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポールドル	千円	%
ESR-REIT		180	158	90	7,682	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS		111	111	191	16,279	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		90	82	188	16,066	0.1
STARHILL GLOBAL REIT		190	190	147	12,522	0.1
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		215	286	386	32,902	0.2
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS		99	73	120	10,229	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		82	74	104	8,897	0.0
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL		83	83	113	9,645	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL		255	281	113	9,684	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		59	55	165	14,064	0.1
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		177	170	352	30,013	0.2
CACHE LOGISTICS TRUST		127	127	111	9,450	0.1
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		264	273	456	38,784	0.2
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		135	103	74	6,350	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		110	133	53	4,580	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT-RTS		46	—	—	—	—
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST		121	121	106	9,055	0.0
MAPLETREE GREATER CHINA COMM		264	230	287	24,449	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI		97	59	41	3,512	0.0
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		76	—	—	—	—
QUE HOSPITALITY TRUST		160	175	153	13,058	0.1
SPH REIT		105	105	113	9,617	0.1
KEPPEL DC REIT		112	112	163	13,872	0.1
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI		165	152	174	14,864	0.1
CAPITALAND MALL TRUST		397	384	812	69,064	0.4
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		346	330	921	78,367	0.4
小 計	口 数 ・ 金 額	5,250	5,033	7,488	636,840	
	銘 柄 数 < 比 率 >	31	29	—	<3.4%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
REIT 1 LTD		26	23	361	11,822	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	26	23	361	11,822	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	17,993	17,466	—	18,185,179	
	銘 柄 数 < 比 率 >	323	311	—	<98.0%>	

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

○投資信託財産の構成

(2018年 1 月 5 日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資証券	千円 18,185,179	% 97.7
コール・ローン等、その他	428,832	2.3
投資信託財産総額	18,614,011	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（18,556,473千円）の投資信託財産総額（18,614,011千円）に対する比率は99.7%です。
(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=112.84円	1 カナダドル=90.38円	1 ユーロ=136.27円	1 イギリスポンド=153.06円
1 オーストラリアドル=88.64円	1 ニュージーランドドル=80.76円	1 香港ドル=14.43円	1 シンガポールドル=85.04円
1 イスラエルシェケル=32.73円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年1月5日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	18,693,014,095
コール・ローン等	338,399,411
投資証券(評価額)	18,185,179,928
未収入金	79,012,798
未収配当金	90,421,958
(B) 負債	141,209,956
未払金	92,884,115
未払解約金	48,325,803
未払利息	38
(C) 純資産総額(A-B)	18,551,804,139
元本	11,298,361,109
次期繰越損益金	7,253,443,030
(D) 受益権総口数	11,298,361,109口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,420円

<注記事項>

- ①期首元本額 11,814,318,288円
 期中追加設定元本額 2,560,769,660円
 期中一部解約元本額 3,076,726,839円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.6420円です。

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

三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	183,341,917円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	120,881,529円
三菱UFJ 資産設計ファンド(分配型)	36,203,621円
三菱UFJ 資産設計ファンド(バランス型)	65,936,887円
三菱UFJ 資産設計ファンド(株式重視型)	28,301,506円
ファンド・マネジャー(海外リート)	61,783,419円
eMAXIS 先進国リートインデックス	5,817,071,504円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,905,797,800円
eMAXIS バランス(波乗り型)	290,307,203円
三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド	1,504,555,198円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	198,565,655円
オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け)	237,578,385円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	530,377,881円
つみたて8資産均等バランス	1,282,473円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	684,103円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	840,838円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	565,529円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	9,650,723円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	49,447,531円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	10,100,534円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	17,948,007円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	75,362,713円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	62,210,376円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	85,392,303円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	4,173,474円
合計	11,298,361,109円

○損益の状況 (2017年1月6日～2018年1月5日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	742,436,393
受取配当金	738,373,453
受取利息	563,138
その他収益金	3,529,909
支払利息	△ 30,107
(B) 有価証券売買損益	△ 291,220,165
売買益	1,298,862,686
売買損	△1,590,082,851
(C) 保管費用等	△ 7,955,902
(D) 当期損益金(A+B+C)	443,260,326
(E) 前期繰越損益金	7,135,086,125
(F) 追加信託差損益金	1,461,803,778
(G) 解約差損益金	△1,786,707,199
(H) 計(D+E+F+G)	7,253,443,030
次期繰越損益金(H)	7,253,443,030

- (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】

- ①投資対象、運用目的、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的について記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2017年8月16日)
- ②当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)
(2018年1月1日)