

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合
信託期間	無期限（2009年6月8日設定）
運用方針	<p>長期的な資産形成を補完することを目的とし、実質的な資産価値の保全を図りつつ収益の獲得をめざして運用を行います。</p> <p>マザーファンド受益証券および取引所に上場されている投資信託証券への投資を通じて内外の株式、債券および不動産ならびに商品（コモディティ）に投資を行います。ファンドの運用目標を達成するため、FPAアソシエイツ&コンサルティング株式会社の助言を受け、各資産クラスごとに投資対象ファンドの具体的な投資先を重視してファンドを選定します。</p> <p>あらかじめ、長期的な視点から各資産への基本資産配分を定め、基本資産配分と同程度の投資比率を維持することを基本とします。</p> <p>基本資産配分および投資対象とするマザーファンド受益証券および投資信託証券については見直しを行うことがあります。</p> <p>マザーファンド受益証券および投資信託証券への組入比率は高位を維持することを基本とします。</p> <p>実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p>
主要運用対象	<p>別に示した内外の株式、債券および不動産ならびに商品（コモディティ）を投資対象資産とするマザーファンドの受益証券または取引所に上場されている投資信託証券を主要投資対象とします。</p>
主な組入制限	<p>株式への直接投資は行いません。</p> <p>投資信託証券への投資割合に制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合に制限を設けません。</p>
分配方針	<p>経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p>

※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、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」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）

F P バランスファンド （安定型）

第6期（決算日：2015年5月20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「FPバランスファンド（安定型）」は、去る5月20日に第6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投信株式会社は2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、「三菱UFJ国際投信株式会社」となる予定です。



三菱UFJ投信

東京都千代田区丸の内一丁目4番5号
URL: <http://www.am.mufg.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

営業企画推進部 TEL. 0120-151034

お客様専用フリーダイヤル (9:00~17:00, 土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)

お客様のお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目次

F P バランスファンド（安定型）のご報告

◇最近5期の運用実績	1
◇当期中の基準価額と市況等の推移	2
◇運用経過	3
◇今後の運用方針	7
◇1万口当たりの費用明細	8
◇売買及び取引の状況	9
◇株式売買比率	9
◇利害関係人との取引状況等	10
◇自社による当ファンドの設定・解約状況	13
◇組入資産の明細	13
◇有価証券の貸付及び借入の状況	14
◇投資信託財産の構成	15
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	16
◇損益の状況	16
◇お知らせ	17

投資対象ファンドのご報告

◇三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	18
◇三菱UFJ 外国株式マザーファンド	50
◇新興国株式インデックスマザーファンド	92
◇三菱UFJ 国内債券マザーファンド	122
◇三菱UFJ 外国債券マザーファンド	147
◇MUAM J-REITマザーファンド	174
◇MUAM G-REITマザーファンド	184
◇ETF（上場投資信託）の概要	210

本資料の表記にあたって

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			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	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率						
	円	円	%	%	%	%	%	%	百万円
2期(2011年5月20日)	10,215	0	2.1	16.5	0.4	62.5	—	17.5	331
3期(2012年5月21日)	9,803	0	△ 4.0	16.2	0.4	63.9	0.0	16.2	316
4期(2013年5月20日)	12,674	0	29.3	17.9	0.3	62.4	0.2	16.8	406
5期(2014年5月20日)	12,874	0	1.6	17.0	0.3	62.5	—	17.5	504
6期(2015年5月20日)	14,532	0	12.9	17.1	0.3	61.6	—	18.5	608

- (注) 当ファンドは、内外の株式、債券および不動産ならびに商品（コモディティ）を投資対象資産とするマザーファンドの受益証券または取引所に上場されている投資信託証券を主要投資対象とし、投資信託財産の成長と収益の確保をめざして運用を行います。特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。
- (注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
- (注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
	円	騰 落 率					
(期 首) 2014年 5月20日	12,874	—	17.0	0.3	62.5	—	17.5
5 月 末	12,949	0.6	17.3	0.3	62.2	0.1	17.4
6 月 末	13,090	1.7	17.3	0.3	62.5	0.0	17.7
7 月 末	13,185	2.4	17.3	0.2	62.1	0.0	17.8
8 月 末	13,279	3.1	17.3	0.3	62.3	0.0	17.8
9 月 末	13,463	4.6	16.9	0.3	62.7	0.1	17.5
10月 末	13,508	4.9	17.9	0.3	61.5	—	17.5
11月 末	14,325	11.3	17.3	0.3	63.0	—	17.9
12月 末	14,407	11.9	17.3	0.2	62.2	—	17.3
2015年 1 月 末	14,169	10.1	17.1	0.2	62.6	—	17.5
2 月 末	14,332	11.3	17.5	0.2	62.6	0.0	17.4
3 月 末	14,315	11.2	17.0	0.3	62.4	—	17.8
4 月 末	14,450	12.2	16.5	0.3	61.8	—	18.4
(期 末) 2015年 5月20日	14,532	12.9	17.1	0.3	61.6	—	18.5

(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) 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。

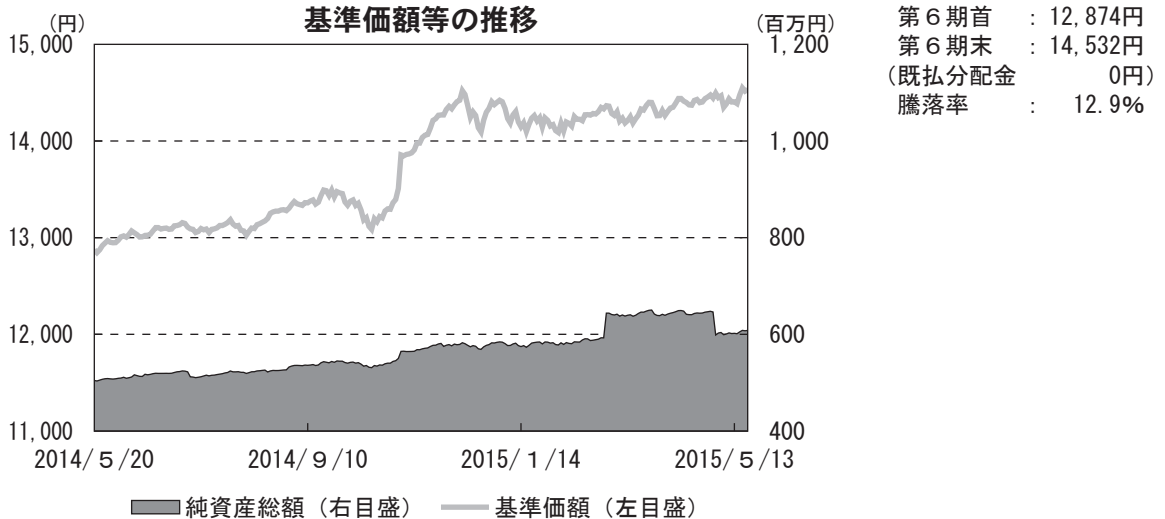
運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第6期 : 2014/5/21~2015/5/20)

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ12.9%の上昇となりました。



基準価額の主な変動要因

上昇要因	組み入れを行った投資信託証券などのうち、日本株式、先進国株式（除く日本）、日本債券、先進国債券（除く日本）、内外のREITなどの投資信託証券が上昇しプラスに寄与しました。
下落要因	組み入れを行ったETFなどのうち、ブラジル株式、コモディティのETFが下落しマイナスに影響しました。

投資環境について

(第6期 : 2014/5/21~2015/5/20)

◎市況

【概況】

- ・当期の世界各国の金融市場は、国内ならびに海外先進国の株式市況が上昇、新興国の株式市況はまちまちの展開となりました。債券市場では、内外先進国の長期金利は低下（債券価格は上昇）しました。為替市場では、円は米ドルに対して下落（円安）、ユーロに対しては上昇（円高）となりました。

【株式】

- ・日本株式は、2014年9月末にかけては、円安の進行、企業業績改善期待などから上昇しました。その後、10月中旬にかけて世界経済の先行き不安などからリスク回避傾向が高まり下落しましたが、米国の良好な経済指標や日銀の大規模な追加金融緩和策発表などを受けて上昇に転じました。11月以降も円安の進行や景気回復、企業業績改善に対する期待などを背景に期末まで上昇基調を維持しました。先進国（除く日本）株式は、米国の良好な経済指標の発表などを受けて上昇してはまりましたが、地政学的リスクの台頭などから2014年8月上旬にかけて下落しました。その後は米国の良好な経済指標やECB（欧州中央銀行）によるさらなる金融緩和観測などから反発しましたが、10月中旬にかけて地政学的リスクの高まりや世界経済の先行き不安などから下落しました。10月中旬以降は米国の良好な経済指標の発表やECBによる量的緩和策の実施、世界経済に対する楽観的な見通しなどから期末まで上昇基調を維持しました。新興国株式は、インドや中国の上海総合指数が上昇した一方、原油価格の下落を受けてロシアTRADED指数（ロシアの優良企業で構成される指数）が下落するなどまちまちの展開となりました。

【債券】

- ・日本債券は、日銀による追加金融緩和観測などを背景に国内長期金利は低下基調ではまりました。2014年10月末には大規模な追加金融緩和策が発表され2015年1月中旬まで国内長期金利は低下基調で推移した後は景気回復期待の高まりや株式市況の上昇などを背景に上昇しましたが、当期で見ると低下する展開となりました。海外の債券市場では、米国の低金利政策の長期化観測や原油価格の下落を受けた期待インフレ率の低下観測などを背景に2015年1月末まで米国長期金利は低下基調で推移しました。その後は期末にかけて良好な経済指標の発表や早期利上げ観測の台頭などから米国長期金利は上昇しましたが、当期で見ると低下する展開となりました。ユーロ圏では、ECBによる量的金融緩和策などを受けてドイツの長期金利は2015年4月中旬まで低下基調で推移しました。その後は良好な経済指標を受けて期末にかけて上昇したものの、当期で見ると低下する展開となりました。

【その他資産】

- ・国内のREIT市場は、長期金利の低下、不動産市況の改善、景気回復期待などを受けて上昇しました。海外のREIT市場は、世界的な低金利政策の継続観測、株式市況の上昇などを背景に米国、欧州、豪州いずれも上昇しました。コモディティ市場は、概ね下落する展開となりました。原油、農産物などが下落しました。

【為替】

- ・当期の為替相場は、日銀の追加金融緩和策などを受けて円が対米ドルで下落する展開となりました。ユーロ圏ではギリシャの債務懸念やECBによる大規模な量的金融緩和策などを受けて、円は対ユーロで上昇する展開となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

(ご参考)

各資産クラスが投資している投資信託証券の組入比率の推移および騰落率

(96)

資産	基本資産配分	資産クラス	基本資産配分	投資信託証券の名称	通貨	組入比率														騰落率	
						期首 (2014年 5月20日)	5月末	6月末	7月末	8月末	9月末	10月末	11月末	12月末	2015年 1月末	2月末	3月末	4月末	期末 (2015年 5月20日)		
債券	65	日本債券	30	三菱UFJ 国内債券 マザーファンド	—	28.1	28.0	28.0	27.7	27.9	27.9	27.5	28.0	27.9	28.0	27.9	27.9	27.5	27.7	2.5	
		先進国債券 (除く日本)	35	三菱UFJ 外国債券 マザーファンド	—	35.0	34.8	34.9	34.9	35.0	35.2	34.7	35.3	35.1	35.3	34.9	35.0	34.7	34.5	13.1	
株式	20	日本株式	10	三菱UFJ トピックス インデックスマザーファンド	—	9.8	10.2	10.1	10.0	9.9	10.0	10.5	10.1	9.9	10.0	10.3	10.0	9.6	10.1	45.2	
		先進国株式 (除く日本)	5	三菱UFJ 外国株式 マザーファンド	—	5.0	5.1	5.0	5.0	5.0	5.0	5.3	5.1	5.1	5.0	5.2	5.0	4.9	5.0	29.1	
	新興国株式	中国株式	5	新興国株式インデックス マザーファンド	—	2.6	2.6	2.5	2.6	2.7	2.5	2.4	2.5	2.6	2.6	2.6	2.5	2.5	2.5	22.0	
				ISHARES CHINA LARGE-CAP ETF	ドル	0.6	0.6	0.6	0.7	0.7	0.7	0.7	0.7	0.7	0.6	0.6	0.6	0.7	0.7	0.7	73.0
		インド株式	5	上場インデックスファンド 中国A株 (パンダ) CSI300 (ETF)	—	0.6	0.6	0.6	0.6	0.6	0.6	0.6	0.8	0.8	0.7	0.7	0.7	0.9	0.9	0.9	145.4
				LYXOR UCITS ETF MSCI INDIA (ETF) (旧名称: LYXOR ETF MSCI INDIA (ETF))	ユーロ	0.5	0.5	0.5	0.5	0.6	0.6	0.6	0.6	0.6	0.6	0.6	0.6	0.5	0.5	0.5	0.5
ブラジル 株式	5	ISHARES MSCI BRAZIL CAPPED ETF	ドル	0.8	0.8	0.8	0.8	0.9	0.7	0.7	0.7	0.7	0.6	0.6	0.6	0.8	0.9	0.9	△ 10.5		
その他 資産	15	グローバル REIT	国内 REIT	5	MUAM J-REIT マザーファンド	—	1.7	1.8	1.8	1.7	1.7	1.7	1.8	1.7	1.7	1.7	1.7	1.6	1.6	28.8	
		外国 REIT	5	MUAM G-REIT マザーファンド	—	3.3	3.3	3.3	3.4	3.4	3.2	3.4	3.4	3.5	3.4	3.2	3.4	3.5	3.5	31.8	
	コモディ ティ	金	10	ISHARES DIVERSIFIED COMMODITY SNAP UCITS ETF (DE) (ETF) (旧名称: ISHARES DOW JONES- UBS COMMODITY SNAP UCITS ETF (DE))	ユーロ	7.0	6.9	7.0	7.0	6.8	7.0	6.9	6.9	6.4	6.8	7.0	7.1	7.0	7.1	△ 10.3	
				SPDR GOLD SHARES (ETF)	ドル	2.9	2.8	3.1	3.0	3.0	2.9	2.8	2.9	2.9	3.0	2.9	3.0	3.2	3.2	3.2	10.9

(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

(注) 騰落率は、各投資信託証券の評価対象日 (当ファンドへの実質的な反映日) に基づいて算出したものです。

(注) ETF (上場投資信託) の騰落率は、評価対象日の価格に配当金 (税引前) を再投資し、通貨の欄に外貨表示があるものは、基準日の為替レートを用いて邦貨換算し算出したものです。

◎組入比率

- 投資信託証券を高位に組み入れ、当ファンドの基本資産配分「各資産クラスが投資している投資信託証券の組入比率の推移および騰落率」に則って、各資産クラスへ資金を配分し、期を通じてこれを維持しました。なお、新興国株式、グローバルREIT、コモディティの3つの資産クラスにおいてサブ資産クラスを導入し、複数のファンドに重点配分を行う投資を継続しました。また、各資産クラスおよびサブ資産クラスにおける投資信託証券 (マザーファンドならびにETF) への配分については、過去の運用実績、コスト、流動性などの要素から投資信託証券を選択し、ファンド全体として効率的なリスク・リターン特性を持つポートフォリオを維持しました。

◎パフォーマンス要因

組み入れを行った投資信託証券などのうち、日本株式、先進国株式（除く日本）、日本債券、先進国債券（除く日本）、内外のREITなどの投資信託証券が上昇したことがプラスに寄与し、基準価額は12.9%の上昇となりました。特に、日本株式市況の上昇を受けて日本株式の投資信託証券が大きくプラスに寄与しました。一方で、組み入れを行ったETFなどのうち、ブラジル株式、コモディティのETFが下落しマイナスに影響しました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・当ファンドは、内外の株式、債券および不動産ならびに商品（コモディティ）を投資対象資産とするマザーファンドの受益証券または取引所に上場されている投資信託証券を主要投資対象とし、投資信託財産の成長と収益の確保をめざして運用を行いますが、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。
- ・従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

分配金について

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

【分配原資の内訳】 (単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第6期
	2014年5月21日～2015年5月20日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	4,532

(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

- ・ 長期的な資産形成を補完することを目的とし、実質的な資産価値の保全を図りつつ収益の獲得をめざして運用を行います。
- ・ 長期的な視点から各資産への基本資産配分を定め、基本資産配分と同程度の投資比率を維持することを基本として運用を行います。
- ・ なお、各資産への基本資産配分はあくまで長期的な視点から定めていますが、投資環境の大きな変化などに対応して変更を行うことがあります。また、投資対象である投資信託証券についても、パフォーマンス、コスト、流動性をもとに見直しを実施し変更を行うことがあります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2014年5月21日～2015年5月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	97	0.702	(a) 信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(45)	(0.322)	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 分配金・償還金・換金代金支払等の事務手続き、交付運用報告書等の送付、購入後の説明・情報提供等の対価 投資信託財産の保管・管理、運用指図の実行等の対価
(販 売 会 社)	(45)	(0.326)	
(受 託 会 社)	(7)	(0.054)	
(b) 売 買 委 託 手 数 料	2	0.016	(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
(株 式)	(0)	(0.002)	有価証券等を売買する際に発生する費用
(新 株 予 約 権 証 券)	(0)	(0.000)	
(投 資 信 託 証 券)	(2)	(0.014)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.002	(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
(株 式)	(0)	(0.001)	有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(新 株 予 約 権 証 券)	(0)	(0.000)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.001)	
(d) そ の 他 費 用	5	0.036	(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)	(4)	(0.029)	外国での資産の保管等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.003)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(1)	(0.005)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	104	0.756	
期中の平均基準価額は、13,789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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)が支払った費用を含みません。

(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(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

(2014年5月21日～2015年5月20日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	上場インデックスファンド中国A株 (ハンダ) CSI 300	千口 —	千円 —	千口 0.34	千円 1,790
外国	アメリカ		千アメリカドル		千アメリカドル
	ISHARES CHINA LARGE-CAP ETF	—	—	0.16	6
	ISHARES MSCI BRAZIL CAPPED E	0.47	14	—	—
	SPDR GOLD SHARES	0.23	26	—	—
	小計	0.7	41	0.16	6
外国	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ				
	ISH DIV COMDTY SWAP DE	5	118	1	30
	小計	5	118	1	30
	ユーロ計	5	118	1	30

(注) 金額は受渡代金。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄		設定		解約	
		口数	金額	口数	金額
		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	11,604	12,300	19,644	22,000
三菱UFJ	国内債券マザーファンド	37,602	49,300	20,357	26,900
三菱UFJ	外国債券マザーファンド	17,099	46,000	13,358	35,900
三菱UFJ	外国株式マザーファンド	3,139	5,500	4,332	8,100
MUAM	G-R-E-I-Tマザーファンド	1,445	2,300	2,062	3,100
新興国株式	インデックスマザーファンド	870	1,900	1,183	2,800
MUAM	J-R-E-I-Tマザーファンド	254	700	772	2,000

○株式売買比率

(2014年5月21日～2015年5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			
	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	MUAM G-R-E-I-T マザーファンド	新興国株式 インデックス マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	135,168,218千円	76,752,158千円	866千円	12,140,631千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	272,334,564千円	167,219,209千円	—千円	30,733,053千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.49	0.45	—	0.39

(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

(2014年5月21日～2015年5月20日)

利害関係人との取引状況

<FPバランスファンド (安定型)>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 20	百万円 —	% —	百万円 6	百万円 1	% 16.7
為替直物取引	20	1	5.0	4	3	75.0

<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			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 15,046	百万円 3,921	% 26.1	百万円 120,121	百万円 36,990	% 30.8
株式先物取引	74,258	20,432	27.5	75,225	24,714	32.9

平均保有割合 0.0%

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

<三菱UFJ 外国株式マザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 7,065	百万円 3,650	% 51.7	百万円 74,169	百万円 45,603	% 61.5

平均保有割合 0.0%

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

<新興国株式インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 11,821	百万円 130	% 1.1	百万円 2,955	百万円 67	% 2.3

平均保有割合 0.0%

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

＜三菱UFJ 国内債券マザーファンド＞

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 61,376	百万円 19,382	% 31.6	百万円 97,949	百万円 26,474	% 27.0

平均保有割合 0.1%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

＜三菱UFJ 外国債券マザーファンド＞

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 8,637	百万円 3,788	% 43.9	百万円 76,031	百万円 52,878	% 69.5

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。

＜MUAM J-REITマザーファンド＞

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 11,841	百万円 2,446	% 20.7	百万円 7,782	百万円 1,830	% 23.5

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。

＜MUAM G-REITマザーファンド＞

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 5,061	百万円 87	% 1.7	百万円 903	百万円 57	% 6.3

平均保有割合 0.2%

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

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 442	百万円 3,139	百万円 8,160

<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 649	百万円 637

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 714

<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 300

<MUAM J-REITマザーファンド>

種 類	買 付 額
投資信託証券	百万円 708

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)	89千円
うち利害関係人への支払額 (B)	8千円
(B) / (A)	9.6%

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

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 145	百万円 —	百万円 —	百万円 145	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2015年5月20日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千口	千円	%
上 場 イ ン デ ッ ク ス フ ァ ン ド 中 国 A 株 (バ ン ダ) C S I 3 0 0	1	0.79	5,277	0.9
合 計	1	0.79	5,277	0.9

(注) 比率はF P バランスファンド (安定型) の純資産総額に対する比率。

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		比 率
	口 数	口 数	評 価 額		
			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	%
ISHARES CHINA LARGE-CAP ETF	0.86	0.7	35	4,277	0.7
ISHARES MSCI BRAZIL CAPPED E	0.82	1	45	5,544	0.9
SPDR GOLD SHARES	1	1	162	19,622	3.2
小 計	2	3	243	29,444	4.8
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
ISH DIV COMDTY SWAP DE	9	13	322	43,343	7.1
小 計	9	13	322	43,343	7.1
(ユーロ…フランス)					
LYXOR ETF MSCI INDIA	1	1	24	3,342	0.5
小 計	1	1	24	3,342	0.5
ユ ー ロ 計	11	15	346	46,686	7.7
合 計	14	18	—	76,130	12.5

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

(注) 比率はF P バランスファンド (安定型) の純資産総額に対する評価額の比率。

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
三菱UFJ	トピックスインデックスマザーファンド	56,623	48,583	61,716
三菱UFJ	国内債券マザーファンド	110,293	127,538	168,248
三菱UFJ	外国債券マザーファンド	72,639	76,380	209,984
三菱UFJ	外国株式マザーファンド	16,041	14,849	30,178
MUAM	G-R-E-I-Tマザーファンド	14,183	13,565	21,246
新興国株式	インデックスマザーファンド	6,531	6,218	15,104
MUAM	J-R-E-I-Tマザーファンド	4,074	3,555	9,672

○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2015年5月20日現在における貸付株数の総株数は31,375,800株です。うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUF証券株式会社に対する貸付は、27,461,000株です。

○投資信託財産の構成

（2015年5月20日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 5,277	% 0.9
投資証券	76,130	12.5
三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	61,716	10.1
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	168,248	27.6
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	209,984	34.4
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	30,178	4.9
MUAM G-R-E-I-Tマザーファンド	21,246	3.5
新興国株式インデックスマザーファンド	15,104	2.5
MUAM J-R-E-I-Tマザーファンド	9,672	1.6
コール・ローン等、その他	12,996	2.0
投資信託財産総額	610,551	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（128,384,420千円）の投資信託財産総額（128,569,518千円）に対する比率は99.9%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（161,083,618千円）の投資信託財産総額（161,601,437千円）に対する比率は99.7%です。

(注) MUAM G-R-E-I-Tマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（14,308,292千円）の投資信託財産総額（14,330,760千円）に対する比率は99.8%です。

(注) 新興国株式インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（40,459,302千円）の投資信託財産総額（40,697,645千円）に対する比率は99.4%です。

(注) 期末における外貨建純資産（76,882千円）の投資信託財産総額（610,551千円）に対する比率は12.6%です。

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

1 アメリカドル=120.94円	1 カナダドル=98.82円	1 メキシコペソ=7.95円	1 ブラジルリアル=39.80円
100チリペソ=20.01円	100コロンビアペソ=4.86円	1 ユーロ=134.55円	1 イギリスポンド=187.47円
1 スイスフラン=128.95円	1 スウェーデンクローネ=14.48円	1 ノルウェークローネ=16.02円	1 デンマーククローネ=18.04円
1 トルコリラ=46.55円	1 チェココロナ=4.91円	100ハンガリーフォリント=43.99円	1 ポーランドズロチ=33.21円
1 オーストラリアドル=95.63円	1 ニューゼーランドドル=88.90円	1 香港ドル=15.60円	1 シンガポールドル=90.55円
1 マレーシアリンギット=33.48円	1 タイバーツ=3.61円	1 フィリピンペソ=2.72円	100インドネシアルピア=0.93円
100韓国ウォン=11.06円	1 ニュー台湾ドル=3.97円	1 インドルピー=1.91円	1 アラブディルハム=32.98円
1 イスラエルシェケル=31.24円	1 カタールリアル=33.29円	1 南アフリカランド=10.15円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	610,551,743
コール・ローン等	12,991,812
投資信託受益証券(評価額)	5,277,200
投資証券(評価額)	76,130,545
三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド(評価額)	61,716,138
三菱UFJ 国内債券マザーファンド(評価額)	168,248,826
三菱UFJ 外国債券マザーファンド(評価額)	209,984,981
三菱UFJ 外国株式マザーファンド(評価額)	30,178,315
MUAM G-REITマザーファンド(評価額)	21,246,887
新興国株式インデックスマザーファンド(評価額)	15,104,792
MUAM J-REITマザーファンド(評価額)	9,672,229
未収利息	18
(B) 負債	2,375,129
未払解約金	265,960
未払信託報酬	2,100,826
その他未払費用	8,343
(C) 純資産総額(A-B)	608,176,614
元本	418,497,220
次期繰越損益金	189,679,394
(D) 受益権総口数	418,497,220口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,532円

<注記事項>

①期首元本額	391,999,099円
期中追加設定元本額	127,087,847円
期中一部解約元本額	100,589,726円

②分配金の計算過程

		第6期
費用控除後の配当等収益額	A	9,857,180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	B	47,700,239円
収益調整金額	C	74,204,552円
分配準備積立金額	D	57,917,423円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	189,679,394円
当ファンドの期末残存口数	F	418,497,220口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	4,532円
1万口当たり分配金額	H	-円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	-円

○損益の状況 (2014年5月21日～2015年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	209,747
受取配当金	209,258
受取利息	489
(B) 有価証券売買損益	61,413,296
売買益	77,049,014
売買損	△ 15,635,718
(C) 信託報酬等	△ 4,065,624
(D) 当期損益金(A+B+C)	57,557,419
(E) 前期繰越損益金	57,917,423
(F) 追加信託差損益金	74,204,552
(配当等相当額)	(62,980,461)
(売買損益相当額)	(11,224,091)
(G) 計(D+E+F)	189,679,394
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	189,679,394
追加信託差損益金	74,204,552
(配当等相当額)	(63,094,882)
(売買損益相当額)	(11,109,670)
分配準備積立金	115,474,842

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

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

【お 知 ら せ】

- ①書面決議を行う場合の受益者数要件の撤廃を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ②併合手続要件の緩和を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ③買取請求の一部適用除外を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ④運用報告書の二段階化について信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑤2014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15期》決算日2015年2月20日

[計算期間：2014年2月21日～2015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15期の決算を行いました。以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	東証株価指数（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 (TOPIX)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	円	騰落率	(TOPIX)	騰落率			
11期(2011年2月21日)	6,846	9.3	974.63	7.1	99.0	1.0	313,876
12期(2012年2月20日)	5,890	△14.0	819.03	△16.0	98.8	1.1	288,676
13期(2013年2月20日)	7,172	21.8	973.70	18.9	98.9	1.1	312,556
14期(2014年2月20日)	8,968	25.0	1,194.56	22.7	98.5	1.5	285,064
15期(2015年2月20日)	11,495	28.2	1,500.33	25.6	99.1	0.5	276,171

(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 (TOPIX)		株式組入比率	株式先物比率
	円	騰落率	(TOPIX)	騰落率		
(期首) 2014年2月20日	8,968	—	1,194.56	—	98.5	1.5
2月末	9,099	1.5	1,211.66	1.4	98.8	1.4
3月末	9,120	1.7	1,202.89	0.7	98.1	2.1
4月末	8,814	△1.7	1,162.44	△2.7	99.0	1.9
5月末	9,115	1.6	1,201.41	0.6	98.2	1.2
6月末	9,586	6.9	1,262.56	5.7	98.5	0.8
7月末	9,791	9.2	1,289.42	7.9	99.1	0.4
8月末	9,707	8.2	1,277.97	7.0	99.7	0.6
9月末	10,145	13.1	1,326.29	11.0	97.8	1.3
10月末	10,203	13.8	1,333.64	11.6	99.1	1.5
11月末	10,791	20.3	1,410.34	18.1	98.9	1.2
12月末	10,781	20.2	1,407.51	17.8	99.5	0.5
2015年1月末	10,840	20.9	1,415.07	18.5	98.9	0.6
(期末) 2015年2月20日	11,495	28.2	1,500.33	25.6	99.1	0.5

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

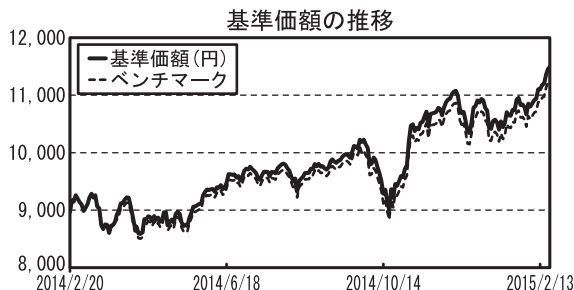
●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ28.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(25.6%)を2.6%上回りました。



(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

米国中心の海外景気の回復に加えて、政府の成長戦略に対する期待が高まったことや、日銀の追加金融緩和の発表等を受けて国内株式市況は上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは25.6%の上昇となったため、カイ離は2.6%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率 要因	銘柄選 択因	その他の 要因	合計
ベンチマーク とのカイ離	0.0%程度	0.0%程度	2.6%程度	2.6%程度

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

- ・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・期中における先物組入比率の平均は、1.1%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2.6%程度でした。配当金などの受取りにより、プラスカイ離となりました。

プラス要因	配当・利子収入、再投資 効果等	計 2.6%程度
マイナス要因	売買コスト等	計 △0.0%程度

再投資効果：配当金等を受け取った後、再投資することにより生じます。市場が上昇すればプラス、下落すればマイナスの要因となります。

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6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

(2014年2月21日～2015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 (株 式) (先物・オプション)	円 0 (0) (0)	% 0.003 (0.000) (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 有価証券等を売買する際に発生する費用
(b) その他費用 (その他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	0	0.003	
期中の平均基準価額は、9,832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

(2014年2月21日～2015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		16,122 (△ 711)	17,101,587 ()	74,925	87,626,713

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
内		63,218	66,921	—	—

○株式売買比率

(2014年2月21日～2015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	104,728,301千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	276,986,399千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.37

(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

(2014年2月21日～2015年2月20日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			B A	売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B		%		うち利害関係人 との取引状況D		D C
株式	百万円 17,101	百万円 3,867	% 22.6	百万円 87,626	百万円 26,040	% 29.7	
株式先物取引	63,218	30,636	48.5	66,921	35,357	52.8	

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 477	百万円 2,190	百万円 7,931

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 883

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	9,303千円
うち利害関係人への支払額 (B)	4,587千円
(B) / (A)	49.3%

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

○組入資産の明細

(2015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	75	59	17,228
日本水産	229.6	172	63,812
マルハニチロ	—	27.1	47,831
マルハニチロホールディングス	356	—	—
サカタのタネ	27.1	22.5	44,190
ホクト	20.5	15.5	37,510
鉱業 (0.4%)			
住石ホールディングス	54.2	42.4	5,003
日鉄鉱業	47	39	17,472
三井松島産業	124	94	12,690
国際石油開発帝石	901.4	736.6	1,054,442
日本海洋掘削	4.7	4.2	17,535
石油資源開発	26.4	19.9	79,699
K&Oエナジーグループ	9.4	9.4	14,795
建設業 (2.6%)			
ショーボンドホールディングス	16.4	13.5	68,175
ミライト・ホールディングス	52.2	42.8	56,496
タマホーム	7.9	11.8	6,619
サンヨーホームズ	—	1.8	1,171
ダイセキ環境ソリューション	1.6	1.7	3,209
安藤・間	124.2	93.3	66,336
東急建設	66.4	49.8	37,698
コムシスホールディングス	90	62.2	92,304
ミサワホーム	20	16.8	17,606
高松コンストラクショングループ	13.9	10.5	27,951
東建コーポレーション	6.89	5.2	27,456
ヤマウラ	10	6.8	2,767
大成建設	937	707	494,900
大林組	556	419	320,116
清水建設	567	428	364,228
飛島建設	117.6	92	24,472
長谷工コーポレーション	247.2	174.8	194,727
松井建設	21	16	11,824
銭高組	21	20	7,960
鹿島建設	815	615	329,640
不動テトラ	133.7	106.3	27,956

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大末建設	75	—	—
鉄建建設	114	85	39,100
日鉄住金テックスエンジ	30	27	15,147
西松建設	243	151	69,611
三井住友建設	500.3	567.3	98,710
大豊建設	58	39	25,194
前田建設工業	114	93	88,257
佐田建設	67	50	7,350
ナカノフドー建設	14.8	11.2	4,569
奥村組	164	133	77,140
大和小田急建設	11.5	7.8	7,183
東鉄工業	22.3	16.7	44,672
イチケン	21	16	5,376
浅沼組	59	47	7,567
戸田建設	215	175	79,975
熊谷組	190	176	68,816
青木あすなろ建設	11.3	8.5	7,259
北野建設	39	29	10,585
植木組	24	18	4,986
三井ホーム	23	17	8,823
矢作建設工業	25.5	17.7	14,407
ピーエス三菱	14.9	15.4	6,637
東日本ハウス	—	17.6	10,014
大東建託	70.4	53.1	708,885
新日本建設	22.7	17.1	7,489
N I P P O	43	32	56,384
東亜道路工業	35	27	11,556
前田道路	58	44	80,784
日本道路	50	42	25,410
東亜建設工業	163	106	23,426
若築建設	105	81	16,443
東洋建設	58	37.4	20,869
五洋建設	220.5	155.2	68,753
大林道路	22	16	11,152
世紀東急工業	98	21	11,718
福田組	28	21	16,905
住友林業	127.6	103.1	126,503

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本基礎技術	21.3	16.9	7,419
日成ビルド工業	48	39	11,505
ヤマダ・エスバイエルホーム	86	67	6,298
巴コーポレーション	23.9	18	7,596
バナホーム	69	52	40,560
大和ハウス工業	509	409.4	960,861
ライト工業	38.9	22.5	24,097
積水ハウス	486.8	430.3	692,783
日特建設	23.3	18.9	10,168
北陸電気工事	9	7	5,628
ユアテック	29	22	17,512
西部電気工業	16	12	5,748
四電工	15	12	5,532
中電工	26.8	20.1	41,104
関電工	84	64	45,056
きんでん	123	93	134,292
東京エネシス	19	16	13,936
トーエネック	26	20	11,840
住友電設	12.8	11.1	14,507
日本電設工業	30	22.7	42,222
協和エクシオ	72.6	59.3	69,143
新日本空調	15.6	11.7	11,407
NDS	26	22	6,754
九電工	34	26	37,700
三機工業	40	28.7	24,509
日揮	186	141	360,819
中外炉工業	55	43	12,470
ヤマト	17	13	5,733
太平電業	27	19	16,131
高砂熱学工業	52.5	38.9	57,610
三晃金属工業	21	15	3,915
朝日工業社	21	16	6,992
明星工業	27	24.8	17,484
大気社	24.5	19.9	54,366
ダイダン	24	19	13,870
日比谷総合設備	22.6	18	31,050
東芝プラントシステム	30	22.4	40,342
東洋エンジニアリング	99	68	24,208
千代田化工建設	147	101	99,889
新興ブランテック	38.3	28.3	26,913

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
食料品 (4.1%)			
日本製粉	113	85	49,470
日清製粉グループ本社	184.8	153.3	218,759
日東富士製粉	15	11	3,773
昭和産業	72	57	29,127
鳥越製粉	15	11.6	8,224
協同飼料	71	—	—
中部飼料	18	13.6	9,193
日本配合飼料	65	—	—
フィード・ワンホールディングス	—	88.2	10,407
東洋精糖	35	28	2,912
日本甜菜製糖	98	73	15,184
三井製糖	73	55	23,870
塩水港精糖	—	16.1	4,411
森永製菓	182	126	46,242
中村屋	44	33	16,962
江崎グリコ	64	32.3	164,407
名糖産業	8.6	6.3	7,326
不二家	108	81	16,119
山崎製パン	136	102	200,532
第一屋製パン	30	23	2,990
モロゾフ	29	22	8,294
亀田製菓	10.3	7.7	35,997
寿スピリッツ	—	3.3	8,593
カルビー	67.8	51.8	226,366
森永乳業	155	126	58,968
六甲バター	8.8	6.3	7,364
ヤクルト本社	108.4	75	540,000
明治ホールディングス	54.9	41.4	547,308
雪印メグミルク	39.8	32.8	52,644
プリマハム	94	78	21,684
日本ハム	129	103	282,632
伊藤ハム	101	76	46,892
丸大食品	87	72	29,664
米久	6	4.5	8,550
S F o o d s	11	8.7	18,722
サッポロホールディングス	304	229	107,630
アサヒグループホールディングス	372.6	281.1	1,053,984
キリンホールディングス	793	598.3	931,852
宝ホールディングス	145	109.7	87,540
オエノンホールディングス	45	37	8,214

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
養命酒製造	14	9	8,685
コカ・コーラウエスト	57.1	47.4	85,746
コカ・コーライーストジャパン	38.3	42.5	86,572
サントリー食品インターナショナル	95.2	83.8	359,502
ダイドードリンコ	8.3	7	33,915
伊藤園	50.4	41.5	102,380
キーコーヒー	17.5	12.4	22,307
ユニカフェ	6	4.3	3,870
ジャパンフーズ	2.8	2.2	2,505
日清オイリオグループ	79	67	29,078
不二製油	45	37.3	62,813
かどや製油	1.7	1.2	3,272
J-オイルミルズ	77	58	24,360
キッコーマン	151	114	383,040
味の素	442	322	723,534
キュービー	94.3	71.1	200,217
ハウス食品グループ本社	65.2	51.8	128,567
カゴメ	71.6	54	98,172
焼津水産化学工業	8.8	6.9	7,155
アリアケジャパン	16.8	12.7	39,624
エバラ食品工業	—	2.4	5,112
ニチレイ	198	149	89,102
東洋水産	91	73	312,075
イートアンド	1	1.6	2,923
日清食品ホールディングス	72.4	59.2	346,912
永谷園	17	13	15,444
一正蒲鉾	—	2.5	4,547
フジッコ	17	13	24,310
ロック・フィールド	9.9	7.2	16,171
日本たばこ産業	1,027.3	775	2,877,187
ケンコーマヨネーズ	4.8	4.6	7,475
わらべや日洋	10.9	8.2	16,596
なとり	8.7	6.5	10,543
ユーグレナ	—	30.3	54,297
ミヨシ油脂	68	50	7,050
理研ビタミン	—	4.1	16,974
繊維製品 (0.8%)			
片倉工業	20.2	16.6	19,505
グンゼ	143	105	33,915
東洋紡	732	518	84,952
ユニチカ	490	395	21,330

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
富士紡ホールディングス	92	64	19,904
日清紡ホールディングス	110	83	99,600
倉敷紡績	178	135	27,405
シキボウ	106	87	10,527
日本毛織	55	41	32,923
トーア紡コーポレーション	82	79	6,004
ダイドーリミテッド	19.8	16.5	9,190
帝国繊維	18.1	13.6	24,779
帝人	708	534	206,124
東レ	1,257	1,011	1,005,035
サカイオーベックス	48	39	7,293
住江織物	48	33	10,329
日本フェルト	10.1	7.3	4,234
イチカワ	12	9	2,484
日本バイリーン	18	18	10,800
芦森工業	40	31	5,053
アツギ	155	121	14,157
ダイニック	34	26	4,680
セーレン	46.6	32.4	34,830
小松精練	30	22.5	12,982
ワコールホールディングス	103	78	99,216
ホギメディカル	10.9	8.2	49,938
クラウディア	2.1	1.7	2,318
T S I ホールディングス	83.5	58.3	41,976
三陽商会	95	70	21,560
ナイガイ	66	—	—
オンワードホールディングス	115	94	77,738
ルック	33	24	5,280
キムラタン	610	649	5,841
ゴールドウイン	40	30	24,870
デサント	40	29.8	41,273
キング	10.2	8	3,464
ヤマトインターナショナル	12.2	10.4	4,440
パルプ・紙 (0.2%)			
特種東海製紙	99	76	20,672
王子ホールディングス	765	536	265,856
日本製紙	89.6	63.1	128,787
三菱製紙	253	205	18,040
北越紀州製紙	118.5	80.7	46,241
中越パルプ工業	67	51	13,821
大王製紙	60	58	59,102

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
レンゴー	139	115	61,870
トーモク	55	41	11,931
ザ・バック	12	9.1	22,058
化学 (6.1%)			
クラレ	275.3	222.5	323,070
旭化成	1,081	815	982,482
共和レザー	11.7	8.5	6,706
コープケミカル	30	23	2,438
昭和電工	1,154	870	136,590
住友化学	1,275	962	530,062
日本化成	35	26	3,848
住友精化	36	27	23,598
日産化学工業	118.7	87.3	198,607
ラサ工業	69	52	7,332
クレハ	122	91	49,777
多木化学	11	8	5,952
テイカ	29	22	9,944
石原産業	314	223	26,314
片倉チッカリン	13	9	2,781
日本曹達	111	83	58,183
東ソー	463	326	180,278
トクヤマ	269	204	54,264
セントラル硝子	164	133	67,697
東亜合成	203	164	88,724
ダイソー	69	52	23,244
関東電化工業	43	32	24,896
電気化学工業	347	271	123,034
信越化学工業	310.7	234.4	1,929,346
日本カーバイド工業	52	46	10,994
堺化学工業	70	53	20,935
エア・ウォーター	143	115	235,290
大陽日酸	222	168	302,736
日本化学工業	67	49	14,210
日本パーカラライジング	41	30.8	88,673
高压ガス工業	25	19	11,723
チタン工業	21	16	3,744
四国化成工業	25	19	19,741
戸田工業	32	27	13,878
ステラ ケミファ	8.9	6.9	9,335
保土谷化学工業	55	41	8,487
日本触媒	147	103	168,611

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大日精化工業	66	54	35,964
カネカ	216	176	138,160
三菱瓦斯化学	273	225	134,325
三井化学	787	594	207,900
J S R	158.9	129.1	278,726
東京応化工業	33.5	27.1	111,652
大阪有機化学工業	11.6	9.5	4,902
三菱ケミカルホールディングス	1,083.2	817.1	511,177
日本合成化学工業	35	30	22,020
ダイセル	225	183.8	296,469
住友ベークライト	134	122	62,952
積水化学工業	355	303	452,076
日本ゼオン	137	113	128,707
アイカ工業	48.6	39.3	107,328
宇部興産	873	658	125,678
積水樹脂	24	20	33,300
タキロン	40	27	14,364
旭有機材工業	62	46	13,294
日立化成	74.9	64.6	160,337
ニチバン	18	13	6,292
リケンテクノス	28	21.3	9,585
大倉工業	42	31	11,129
積水化成成品工業	50	37	16,798
群栄化学工業	47	35	12,075
タイガースポリマー	9.3	6.4	5,574
ミライアル	4.3	4.8	7,588
ダイキアクシス	—	1.6	1,758
ダイキョーニシカワ	—	3.2	12,384
日本化薬	122	85	131,410
カーリットホールディングス	13.8	10.5	6,877
日本精化	14.4	10.7	9,309
ADEKA	74.5	60.2	89,517
日油	144	109	92,105
新日本理化	21.5	21.5	4,730
ハリマ化成グループ	14.4	11	5,302
花王	450.6	351.5	1,810,225
第一工業製薬	31	29	11,774
三洋化成工業	54	41	38,622
大日本塗料	101	75	11,625
日本ペイントホールディングス	150	113.1	482,937
関西ペイント	210	158	326,270

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
神東塗料	11	10	2,160
中国塗料	49	37	36,297
日本特殊塗料	13.8	10.1	8,211
藤倉化成	22	17.7	10,230
太陽ホールディングス	13.9	10.6	44,997
D I C	614	524	169,252
サカティンクス	35.6	26.6	31,361
東洋インキS Cホールディングス	156	129	74,175
T & K T O K A	6.3	4.3	10,629
富士フイルムホールディングス	396.5	299.1	1,197,147
資生堂	308.2	232.5	463,488
ライオン	200	151	99,811
高砂香料工業	62	43	25,112
マンダム	17.4	13	51,610
ミルボン	11.1	7.7	26,334
ファンケル	39.9	30.4	52,926
コーセー	28	21.1	121,114
コタ	—	3.7	7,207
ドクターシーラボ	11.8	8.8	36,300
シーボン	1.7	1.6	4,561
ポーラ・オルビスホールディングス	17.6	15.5	83,545
ノエビアホールディングス	11.5	8.1	18,265
アジュバンコスメジャパン	2	2.5	2,522
エステー	10.8	8.9	9,273
アグロ カネショウ	—	3.6	3,474
コニシ	12.5	10.3	21,022
長谷川香料	21.7	16.5	29,023
星光PMC	7.4	7.4	6,926
小林製薬	28.4	21.4	171,200
荒川化学工業	14.5	10.9	14,856
メック	13.8	10.4	8,808
日本高純度化学	0.048	3.7	9,571
J C U	2.6	3.6	19,836
新田ゼラチン	10.6	8.2	6,601
アース製薬	12.4	9.3	36,688
イハラケミカル工業	27	20	27,560
北興化学工業	18	14	5,922
大成ラミック	4.5	3.6	10,418
クミアイ化学工業	36	27	24,246
日本農薬	40	29.8	40,885
アキレス	140	111	16,872

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
有沢製作所	29.5	21.9	21,286
日東電工	142.8	101	746,592
レック	5.5	4.5	6,345
きもと	12.9	25	7,375
藤森工業	14.9	11.2	42,336
前澤化成工業	11.8	9.2	12,374
J S P	11.2	9.7	23,309
エフピコ	8.4	11.5	47,552
天馬	13.9	10	17,680
信越ポリマー	34.5	25.7	14,777
東リ	45	35	9,030
ニフコ	38.7	29.2	119,720
日本バルカー工業	73	54	17,118
ユニ・チャーム	106.3	264.6	873,180
医薬品 (4.8%)			
協和発酵キリン	207	156	217,776
武田薬品工業	649	489.6	2,963,059
アステラス製薬	399	1,488.6	2,774,006
大日本住友製薬	122.6	92.5	117,845
塩野義製薬	270.5	204.1	682,714
田辺三菱製薬	144.2	152.3	305,513
わかもと製薬	21	16	4,880
あすか製薬	20.5	15.5	17,747
日本新薬	40	30	118,200
ピオフェルミン製薬	2.6	2.1	6,241
中外製薬	172.5	130.1	449,495
科研製薬	63	45	156,150
エーザイ	213.3	172.4	1,059,915
ロート製薬	72.7	59.4	91,119
小野薬品工業	78.7	59.4	690,822
久光製薬	53.8	36.9	161,806
有機合成薬品工業	13	9	2,493
持田製薬	12.8	9.3	66,309
参天製薬	63.6	48	378,720
扶桑薬品工業	58	44	14,124
日本ケミファ	24	17	9,741
ソムラ	50.9	41.1	122,354
日医工	40.5	30.6	72,277
キッセイ薬品工業	32.2	24.3	83,227
生化学工業	35.8	25	52,950
栄研化学	13.6	11.1	20,190

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日水製薬	6.6	5.2	7,150
鳥居薬品	11.8	8.9	29,503
JCRファーマ	10.1	10.1	22,826
東和薬品	8.8	6.6	43,164
富士製薬工業	4.8	3.6	8,319
沢井製薬	27.4	20.7	160,632
ゼリア新薬工業	27.3	26.8	51,965
第一三共	546.3	439.6	812,820
キョーリン製薬ホールディングス	46.2	34.8	95,247
大幸薬品	8.3	5.9	11,794
ダイト	5.7	5.3	13,801
大塚ホールディングス	343.8	259.4	948,107
大正製薬ホールディングス	41.7	31.4	253,398
石油・石炭製品 (0.5%)			
日本コークス工業	144.4	118.7	14,125
昭和シェル石油	154.9	116.8	133,736
コスモ石油	479	361	64,258
ニチレキ	21	16	15,728
東燃ゼネラル石油	261	197	221,428
ユシロ化学工業	9.6	7.7	11,881
ピービー・カストロール	4.4	5.3	6,736
富士石油	44.8	30.5	11,864
MORESCO	4.2	3.4	7,384
出光興産	82.2	62	131,378
JXホールディングス	1,922.7	1,450.4	676,901
ゴム製品 (1.0%)			
横浜ゴム	194	146	170,820
東洋ゴム工業	144	59.1	148,872
ブリヂストン	543	409.6	1,908,326
住友ゴム工業	135.1	101.9	213,174
藤倉ゴム工業	11.1	11.3	9,017
オカモト	59	44	20,636
フコク	6.9	5.4	6,458
ニッタ	17.2	12.8	38,976
住友理工	32.1	24.1	24,100
三ツ星ベルト	44	33	32,274
バンドー化学	64	48	20,976
ガラス・土石製品 (0.9%)			
日東紡績	127	96	46,848
旭硝子	853	644	462,392
日本板硝子	835	630	73,080

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
石塚硝子	23	19	4,370
日本山村硝子	67	52	9,100
日本電気硝子	358	251	143,070
オハラ	6.3	4.6	2,668
住友大阪セメント	329	243	86,751
太平洋セメント	1,017	815	306,440
デイ・シイ	18.2	13.7	6,795
日本ヒューム	17	13.8	12,075
日本コンクリート工業	30	22.7	10,964
三谷セキサン	8.7	6.5	13,253
ジャパンパイル	15.9	17.6	12,337
東海カーボン	162	112	40,432
日本カーボン	92	69	19,734
東洋炭素	10.7	7.3	17,023
ノリタケカンパニーリミテド	98	73	21,389
TOTO	255	192	298,176
日本碍子	219	165	384,780
日本特殊陶業	149	112.6	373,832
ダントーホールディングス	26	21	3,360
MARUWA	4.5	3.8	10,377
品川リフラクトリーズ	43	33	9,471
黒崎播磨	38	28	6,860
ヨータイ	10	7	2,660
イソライト工業	7	6.6	1,452
東京窯業	22	16	3,536
ニッカトー	5.6	3.9	1,610
フジミインコーポレーテッド	15.8	12.6	23,700
エーアンドエーマテリアル	38	31	3,689
ニチアス	83	58	39,730
ニチハ	21	17.4	23,437
鉄鋼 (1.6%)			
新日鐵住金	7,322	5,524	1,738,955
神戸製鋼所	2,400	2,259	499,239
中山製鋼所	97	101	8,686
合同製鐵	89	68	12,852
ジェイ エフ イー ホールディングス	441.9	333.3	944,238
日新製鋼	73.3	55.3	87,650
東京製鐵	96.1	66.3	59,670
共英製鋼	16.1	13.9	28,786
大和工業	35.8	29.7	94,446
東京鐵鋼	36	25	13,800

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大阪製鐵	8.5	8.2	17,367
淀川製鋼所	122	92	44,068
東洋鋼板	42	31	17,422
丸一鋼管	57.9	40.1	113,763
モリ工業	26	21	9,093
大同特殊鋼	290	219	113,442
日本高周波鋼業	71	54	6,318
日本冶金工業	136.5	103.4	25,436
山陽特殊製鋼	95	78	37,206
愛知製鋼	92	77	43,890
日立金属	154	133	252,833
日本金属	47	36	5,580
大太平洋金属	121	84	29,568
新日本電工	74	79.9	25,248
栗本鐵工所	90	68	15,368
虹技	19	19	4,275
日本鑄鉄管	19	13	2,990
三菱製鋼	105	86	21,672
日亜鋼業	24	18	6,246
日本精線	13	10	6,730
シンニッタン	16.7	13.7	7,658
新家工業	39	27	5,157
非鉄金属 (0.9%)			
大紀アルミニウム工業所	27	22	7,590
日本軽金属ホールディングス	393.9	316.2	56,599
三井金属鉱業	441	355	95,140
東邦亜鉛	98	74	27,750
三菱マテリアル	1,081	815	324,370
住友金属鉱山	448	361	653,410
DOWAホールディングス	191	156	149,448
古河機械金属	292	204	42,228
大阪チタニウムテクノロジーズ	18.9	12.9	31,927
東邦チタニウム	29.3	22.2	17,049
UACJ	220	149	49,617
古河電気工業	544	383	80,813
住友電気工業	652.5	492.2	761,433
フジクラ	278	182	90,818
昭和電線ホールディングス	225	150	15,150
東京特殊電線	—	2.2	3,403
タツタ電線	25.6	24.7	12,177
沖電線	20	14	4,718

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カナレ電気	2.2	2	5,222
平河ヒューテック	3.7	3	4,206
リョービ	106	73	24,966
アーレスティ	—	11.7	7,628
アサヒホールディングス	26	19.5	38,356
金属製品 (0.7%)			
稲葉製作所	7.4	5.4	7,225
宮地エンジニアリンググループ	60	40	8,320
トーカロ	10.5	8.6	19,737
アルファCO	5.6	4.3	5,676
SUMCO	105.9	89.9	199,937
川田テクノロジーズ	3.7	2.5	10,300
東洋製罐グループホールディングス	123	92.8	148,108
ホッカンホールディングス	42	32	9,024
コロナ	8.8	6.7	7,805
横河ブリッジホールディングス	33	24.8	32,636
駒井ハルテック	35	24	6,864
高田機工	17	13	3,211
三和ホールディングス	146	125.9	105,378
文化シャッター	41	36	35,244
三協立山	21	17.2	33,368
アルインコ	—	5.6	6,160
東洋シャッター	5.1	3.4	2,842
LIXILグループ	241.2	194.1	536,298
日本フィルコン	12.9	10.2	4,926
ノーリツ	33.9	25.6	51,840
長府製作所	18.3	13.9	42,395
リンナイ	26.8	24.3	203,634
ダイニチ工業	8.6	6.6	5,299
日東精工	25	19	6,935
三洋工業	22	17	3,808
岡部	34.1	25.8	27,348
ジーテクト	—	8.9	9,647
東プレ	33.2	25	43,075
高周波熱練	25.6	22.5	19,935
東京製綱	120	90	19,170
サンコール	12	8	5,416
モリテック スチール	8.7	6.6	2,138
パイオラックス	8.1	6.6	35,508
日本発條	137.9	113.5	140,626
中央発條	22	17	5,916

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三益半導体工業	14.7	9.7	13,356
機械 (5.0%)			
日本ドライケミカル	1.2	1.7	3,870
アタカ大機	12	—	—
日本製鋼所	248	187	90,508
三浦工業	25.7	58.3	83,369
タクマ	54	44	40,568
ツガミ	54	38	27,322
オークマ	113	85	97,325
東芝機械	95	71	32,518
アマダ	265	194.7	210,081
アイダエンジニアリング	40.6	28.5	38,503
滝澤鉄工所	44	41	9,020
富士機械製造	52.5	42.5	54,825
牧野フライス製作所	86	65	65,000
オーエスジー	71.2	59.5	136,612
ダイジェット工業	22	16	3,648
旭ダイヤモンド工業	44.5	35.8	45,322
DMG森精機	91.3	82.4	143,376
ディスコ	19.2	15.2	156,560
日東工器	9.8	7.5	16,357
パンチ工業	—	2.9	4,123
豊和工業	10	7.6	5,654
大阪機工	69	53	8,480
石川製作所	—	36	3,708
東洋機械金属	13.7	9.4	4,418
津田駒工業	44	34	5,236
エンシュウ	46	—	—
島精機製作所	22.5	18.5	38,332
日阪製作所	22	16.5	16,368
やまびこ	6.8	5.1	26,265
ベガサスミシン製造	16.5	11.7	7,160
ナブテスコ	79.1	79.5	248,437
三井海洋開発	14.4	13.2	26,360
レオン自動機	17	10.4	5,272
SMC	49.5	39.2	1,332,800
新川	15	11.1	7,670
ホソカワミクロン	29	22	13,948
ユニオンツール	7.5	6.5	21,937
オイレス工業	16.5	16.2	34,327
日精エー・エス・ビー機械	4.8	4.2	9,760

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サトーホールディングス	18.1	16.3	39,853
日本エアータック	5.8	4.2	2,847
日精樹脂工業	12.8	9.5	13,110
ワイエイシイ	7.4	5.5	3,602
小松製作所	808	647.6	1,605,724
住友重機械工業	473	357	263,466
日立建機	88.4	58.3	131,233
日工	26	18	7,524
巴工業	6.1	4.8	8,208
井関農機	177	134	32,696
TOWA	14.5	10.9	7,706
丸山製作所	37	30	6,960
北川鉄工所	80	60	14,640
クボタ	904	630	1,201,410
荏原実業	4.1	3.7	5,187
三菱化工機	59	43	19,608
月島機械	28	22.9	30,686
帝国電機製作所	5.9	8.8	10,762
東京機械製作所	66	—	—
新東工業	40.7	30.8	26,180
澁谷工業	10.9	10.9	24,317
アイチ コーポレーション	24.3	18.4	10,690
小森コーポレーション	42.1	31.9	42,235
鶴見製作所	13	9.7	19,438
住友精密工業	27	21	10,059
酒井重工業	33	25	7,425
荏原製作所	382	271	128,725
石井鐵工所	27	20	4,480
西島製作所	18.6	13.2	12,144
北越工業	—	9.7	10,301
ダイキン工業	225.8	181.7	1,410,173
オルガノ	26	24	11,592
トーヨーカネツ	93	76	18,164
栗田工業	104.1	73.9	219,926
椿本チエイン	88	67	66,330
大同工業	35	26	7,098
日本コンベヤ	56	42	9,576
木村化工機	16.6	12.5	6,250
アネスト岩田	28	19.6	15,562
ダイフク	70	61.7	91,994
サムコ	—	1.8	1,978

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
加藤製作所	39	27	21,195
油研工業	34	25	6,300
タダノ	73	60	85,080
フジテック	48	36.2	44,200
CKD	46.6	35	36,715
キトー	9.8	13.7	15,645
平和	35.5	27.1	67,208
理想科学工業	12.8	15.2	29,548
SANKYO	50.1	37.8	184,275
日本金銭機械	15.4	11.6	20,798
マースエンジニアリング	9.3	6.9	15,366
福島工業	9.1	6.8	11,444
オーイズミ	6	4.4	4,158
ダイコク電機	6.8	5.2	9,178
アマノ	47.1	41.6	59,363
JUKI	110	93	39,432
サンデン	94	76	45,676
蛇の目マシン工業	166	122	18,544
マックス	25	19	26,315
グローリー	49.4	39.9	126,682
新晃工業	11.5	8.7	11,275
大和冷機工業	27	18	13,050
セガサミーホールディングス	177.8	134.1	241,111
日本ビストンリング	66	50	12,900
リケン	65	53	25,175
TPR	18.4	13.9	40,838
ホシザキ電機	36.2	27.3	176,358
大豊工業	11.8	10.1	14,028
日本精工	368	256	408,832
NTN	383	289	163,863
ジェイテクト	175.8	133	243,789
不二越	154	116	77,952
日本トムソン	53	43	25,972
THK	103.1	83	228,997
ユーシン精機	7.3	5.5	11,852
前澤給装工業	6	4.8	6,974
イーグル工業	20.7	17.3	43,128
前澤工業	13	9.5	3,249
日本ビラー工業	18.3	13.8	12,916
キッツ	74.6	56.3	34,849
日立工機	43.7	33.5	30,920

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マキタ	107.9	81.4	459,910
日立造船	122.7	97.6	67,051
三菱重工業	2,946	2,092	1,360,009
I H I	1,130	899	494,450
電気機器 (12.7%)			
イビデン	100.7	81.8	161,964
コニカミノルタ	437	297.4	370,857
ブラザー工業	213.8	161.3	325,664
ミネベア	226	186	343,914
日立製作所	3,972	2,997	2,492,904
東芝	3,265	2,627	1,287,492
三菱電機	1,654	1,248	1,693,536
富士電機	460	347	188,074
東洋電機製造	33	25	10,800
安川電機	181	146.7	234,573
シンフォニアテクノロジー	100	88	18,920
明電舎	152	115	43,815
オリジン電気	25	18	9,396
山洋電気	25	28	22,876
デンヨー	16.2	11.3	21,809
東芝テック	104	89	65,949
芝浦メカトロニクス	31	21	6,111
マブチモーター	23.3	38.2	220,032
日本電産	89.4	134.9	1,104,291
東光高岳	9.2	6.3	11,333
ダイヘン	98	68	38,760
ヤママン	2.3	1.7	2,745
JVCケンウッド	115.9	92.6	34,817
第一精工	7	4.6	10,469
日新電機	33	29	20,445
大崎電気工業	26	20	16,320
オムロン	186.7	134.8	688,828
日東工業	24.2	19.9	43,421
I D E C	21.6	14.8	15,273
不二電機工業	—	1.1	1,672
ジーエス・ユアサ コーポレーション	319	240	127,440
サクサホールディングス	44	33	7,359
メルコホールディングス	8.2	7	13,181
テクノメディカ	3.8	2.8	7,011
日本電気	2,275	1,615	574,940
富士通	1,595	1,203	857,378

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	639	432	109,728
岩崎通信機	83	63	5,733
電気興業	47	36	19,116
サンケン電気	90	63	52,479
ナカヨ	17	13	5,018
アイホン	9.6	7.3	13,395
ルネサスエレクトロニクス	85.9	64.3	56,969
セイコーエプソン	112.9	85.2	375,732
ワコム	130.2	98.7	61,095
アルバック	30.4	21.1	37,895
アクセル	8.2	5.7	9,667
E I Z O	15.2	11.5	29,957
ジャパンディスプレイ	—	192.2	93,793
日本信号	41.7	34.3	41,365
京三製作所	38	29	11,020
能美防災	22	16.4	24,091
ホーチキ	12	9	8,046
エレコム	6	3.9	9,321
日本無線	44	27	9,639
パナソニック	1,890	1,520.8	2,217,326
シャープ	1,193	1,055	258,475
アンリツ	96.1	78.1	66,072
富士通ゼネラル	39	38	48,108
日立国際電気	33	33	51,876
ソニー	906.9	807.4	2,584,487
TDK	99.8	75.3	596,376
帝国通信工業	42	31	7,471
ミツミ電機	63.5	44.4	39,649
タムラ製作所	65	48	20,112
アルプス電気	121.2	98.5	258,464
パイオニア	231.1	189.4	45,456
日本電波工業	15.5	11.5	11,086
鈴木	—	1.4	1,300
日本トリム	3.6	3.1	10,648
ローランド ディー. ジー.	7.4	5.1	16,677
フォスター電機	17	12.8	36,915
クラリオン	104	67	26,063
SMK	49	37	18,611
ヨコオ	14.4	9.9	6,484
東光	80	30	10,350
ティアック	89	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ホシデン	49.1	39.6	25,700
ヒロセ電機	28.8	20.2	310,272
日本航空電子工業	43	36	99,936
TOA	17.8	13.3	15,760
日立マクセル	—	18.6	38,427
古野電気	16.7	15	17,640
ユニデン	53	37	8,288
アルパイン	36	29.8	59,749
スミダコーポレーション	14.3	11.3	7,322
アイコム	9.3	7	19,439
リオン	4.8	3.7	5,609
船井電機	16.8	12.9	17,350
横河電機	179.4	124.9	162,370
新電元工業	53	48	30,480
アズビル	50.2	40.7	126,984
東亜ディーケーケー	6.4	5.1	3,411
日本光電工業	35.3	26.6	162,260
チノー	30	4.4	5,363
共和電業	20	15.4	7,330
日本電子材料	7.8	5.6	4,183
堀場製作所	30.6	23.1	100,716
アドバンテスト	112.8	85.1	128,671
小野測器	17	6.2	5,883
エスベック	17	13.9	16,985
パナソニック デバイスSUNX	13.6	10.9	10,115
キーエンス	37.5	28.3	1,706,490
日置電機	8.6	6.5	12,382
シスメックス	69.2	96.6	569,940
メガチップス	14.8	13	17,940
OBARA GROUP	10.8	8.1	52,488
日本電産コパル電子	17.3	—	—
澤藤電機	11	9	2,124
コーセル	24	18.1	24,326
日立メディコ	4	—	—
新日本無線	13	9	4,293
オブテックス	10.4	8.5	17,892
千代田インテグレ	7.4	5.5	12,331
レーザータック	11.9	12.8	18,828
スタンレー電気	119.1	89.6	255,897
岩崎電気	62	43	9,804
ウシオ電機	100.4	75.7	110,976

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
岡谷電機産業	9.3	6.8	3,148
ヘリオス テクノ ホールディング	14.8	12.3	5,301
日本セラミック	9.6	7	11,081
遠藤照明	6.8	5.7	8,037
日本デジタル研究所	12.2	10.4	16,692
古河電池	12	9	8,451
双信電機	9.3	6.2	2,579
山一電機	—	14.6	12,935
図研	11.2	9.3	10,090
日本電子	57	53	30,316
カシオ計算機	172	125.1	237,439
ファナック	184.5	129.9	3,024,721
日本シイエムケイ	40.1	32.3	10,400
エンプラス	6.3	5.7	27,958
大真空	23	23	7,636
ローム	87.4	61.5	465,555
浜松ホトニクス	64.5	51.9	348,768
三井ハイテック	22	16.5	13,381
新光電気工業	55.6	47.2	42,857
京セラ	294.8	204.8	1,182,105
太陽誘電	80.5	65.4	90,579
村田製作所	173.6	130.9	1,786,785
ユーシン	23.4	17.5	12,845
双葉電子工業	30.8	21.3	41,236
北陸電気工業	69	54	10,638
ニチコン	52.3	39.3	41,029
日本ケミコン	117	102	39,474
KOA	20.9	17.3	20,292
市光工業	42	31	7,471
小糸製作所	91	74.8	280,126
ミツバ	30.6	22.9	51,387
スター精密	31.7	23.8	38,080
S C R E E Nホールディングス	157	118	95,462
キャノン電子	15.1	11.5	26,956
キャノン	959.1	723.5	2,772,813
リコー	497.4	375.2	460,182
M U T O Hホールディングス	23	18	7,974
東京エレクトロン	148.4	105	950,775
輸送用機器 (11.9%)			
トヨタ紡織	57.8	43.6	67,187
鬼怒川ゴム工業	31	29	15,196

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ユニプレス	26.7	23.9	53,034
豊田自動織機	150.6	113.6	749,760
モリタホールディングス	29	21.8	27,751
三櫻工業	20.6	16	12,416
デンソー	408.7	308.3	1,707,982
東海理化電機製作所	43.6	32.9	83,598
三井造船	640	483	100,464
佐世保重工業	120	—	—
川崎重工	1,288	907	509,734
名村造船所	24.3	34.9	40,518
サノヤスホールディングス	16.2	15.9	4,515
日本車輛製造	60	46	16,744
ニチユ三菱フォークリフト	19	14.1	9,813
近畿車輛	29	20	7,260
日産自動車	2,322.1	1,751.7	2,112,550
いすゞ自動車	959	394.5	666,902
トヨタ自動車	2,302.4	1,721.7	13,907,892
日野自動車	206.6	178.1	312,209
三菱自動車工業	518.1	457.4	496,279
エフテック	5.9	7.4	8,991
レシップホールディングス	—	4	3,488
GMB	1.5	1.8	2,372
ファルテック	—	1.4	2,293
武蔵精密工業	17.6	13.3	33,569
日産車体	81	54.8	86,255
新明和工業	67	50	62,000
極東開発工業	28.5	23.1	30,122
日信工業	33.6	22.8	42,408
トビー工業	135	103	29,252
ティラド	65	49	12,544
曙ブレーキ工業	76.8	53.7	24,057
タチエス	24.2	19.8	31,402
NOK	80	60.4	200,226
フタバ産業	50.8	38.5	22,291
カヤバ工業	156	140	63,700
シロキ工業	36	28	9,156
大同メタル工業	23	17.5	20,702
プレス工業	65	62	28,644
カルソニックカンセイ	112	95	66,120
太平洋工業	33.6	25.4	25,781
ケーヒン	37.9	28.7	53,927

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
河西工業	22	15.3	15,376
アイシン精機	151.4	114.2	509,903
富士機工	19	15	7,665
マツダ	2,465	371.9	937,188
ダイハツ工業	175.5	149	257,174
今仙電機製作所	12.3	10.7	16,959
本田技研工業	1,488.7	1,123	4,452,133
スズキ	345.8	260.9	977,983
富士重工業	563	424.7	1,699,012
安永	—	4.3	2,782
ヤマハ発動機	251.6	189.8	525,366
ショーワ	39.1	29.4	36,632
T B K	18	16.2	10,692
エクセディ	19.9	16.9	47,184
豊田合成	53.4	40.3	104,578
愛三工業	19.8	19.5	21,996
盟和産業	—	11	1,661
ヨロズ	12	11.6	27,492
エフ・シー・シー	26.9	18.3	35,868
シマノ	71.4	53.9	905,520
タカタ	29.9	22.9	31,327
テイ・エス テック	34.9	26.3	87,973
精密機器 (1.5%)			
テルモ	126.8	191.3	593,030
クリエートメディック	5.2	3.9	4,040
日機装	53.6	40.6	39,991
島津製作所	213	149	186,250
J M S	30	23	6,831
ショットモリテックス	4.5	3.8	942
長野計器	10.9	8	5,656
ブイ・テクノロジー	0.035	2.6	6,055
東京計器	58	44	11,836
愛知時計電機	18	16	5,232
オーバル	—	10.3	3,522
東京精密	29.7	22.4	57,075
マニー	5	3.4	24,480
ニコン	308.9	233	356,024
トプコン	44.5	37.7	94,476
オリンパス	246.4	185.9	795,652
理研計器	14.6	11	14,168
タムロン	12.7	9.5	21,869

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
HOYA	402.2	297	1,433,767
ノーリツ鋼機	15.3	11.4	7,695
エー・アンド・デイ	15.3	11.6	5,568
シチズンホールディングス	203.6	153.6	143,155
リズム時計工業	75	55	8,855
大研医器	5.8	8.7	10,092
松風	8.2	6.1	8,350
セイコーホールディングス	107	88	56,584
ニプロ	88.1	79.7	86,474
その他製品 (1.3%)			
パラマウントベッドホールディングス	15.8	13	40,885
S H O - B I	5.5	4.8	1,963
前田工織	12.1	12.4	12,933
永大産業	21	18	8,028
アートネイチャー	5.3	9	9,891
ダンロップスポーツ	9	7.8	10,069
バンダイナムコホールディングス	182.5	137.6	296,665
共立印刷	30.7	22.2	6,704
フランスベッドホールディングス	103	85	15,810
パイロットコーポレーション	14.5	10.9	75,646
萩原工業	—	2.7	5,329
トッパン・フォームズ	29	22.1	27,757
フジシールインターナショナル	20.1	15.1	54,058
タカラトミー	54.8	45.1	29,991
廣済堂	15.8	12	6,096
A s - m e エステール	—	3.5	2,922
アーク	51.1	41.6	5,740
タカノ	7.7	5.5	3,366
プロネクサス	16.7	12.6	10,067
ホクシン	13.8	12.3	1,660
ウッドワン	28	22	6,072
大建工業	67	51	14,280
凸版印刷	467	352	298,144
大日本印刷	504	380	434,910
図書印刷	28	21	6,867
共同印刷	51	38	14,934
日本写真印刷	27.9	21	49,413
光村印刷	16	11	2,981
宝印刷	9.7	6.7	6,284
アシックス	164.3	124	365,800
ツツミ	8.2	6.2	17,291

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ローランド	16	—	—
小松ウオール工業	5.7	3.8	9,762
ヤマハ	121.6	91.7	181,657
河合楽器製作所	60	4.4	10,001
クリナップ	16.7	11.4	10,522
ビジョン	27.1	23.6	187,384
兼松日産農林	27	18	2,808
キングジム	13.8	10.7	8,538
リンテック	39.3	29.7	82,417
TASAKI	—	2.4	4,761
イトーキ	34.9	26.3	18,173
任天堂	101.9	76.9	930,105
三菱鉛筆	13.7	10.2	40,800
タカラスタンダード	67	51	50,439
コクヨ	85	64.9	66,068
ナカバヤシ	37	27	6,156
グローブライド	89	62	10,540
岡村製作所	63	47.5	41,277
美津濃	82	66	39,600
アデランス	20.7	14.7	16,125
電気・ガス業 (2.0%)			
東京電力	1,403.3	1,058.6	507,069
中部電力	545.1	381.8	561,055
関西電力	675.1	509.2	548,917
中国電力	228.7	172.5	275,827
北陸電力	162.1	122.3	200,572
東北電力	413.3	311.8	440,261
四国電力	149	112.4	182,425
九州電力	365.4	275.6	288,828
北海道電力	154.8	116.8	109,324
沖縄電力	10.8	8.2	33,907
電源開発	102.7	83.9	355,316
東京瓦斯	1,940	1,517	1,111,809
大阪瓦斯	1,712	1,292	630,754
東邦瓦斯	421	317	217,145
北海道瓦斯	32	24	6,864
西部瓦斯	184	140	38,080
静岡瓦斯	42.8	35.3	29,899
メタウォーター	—	5.8	13,693
陸運業 (4.3%)			
SBSホールディングス	3.6	9.3	8,379

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東武鉄道	939	667	394,197
相鉄ホールディングス	284	214	120,268
東京急行電鉄	974	678	560,028
京浜急行電鉄	425	342	334,134
小田急電鉄	530	400	500,000
京王電鉄	462	349	344,812
京成電鉄	248	187	281,248
富士急行	45	34	42,228
新京成電鉄	22	17	7,191
東日本旅客鉄道	304.3	228.7	2,298,435
西日本旅客鉄道	149.3	120.1	808,032
東海旅客鉄道	148.1	111.8	2,512,146
西武ホールディングス	—	99.4	313,607
鴻池運輸	8.7	7.6	18,392
西日本鉄道	214	161	85,491
ハマキョウレックス	4.7	3.9	16,087
サカイ引越センター	2.6	2.1	7,864
近畿日本鉄道	1,665	1,256	580,272
阪急阪神ホールディングス	1,110	838	618,444
南海電気鉄道	345	280	137,760
京阪電気鉄道	349	280	201,880
神戸電鉄	42	32	12,384
名糖運輸	7	5.3	3,916
名古屋鉄道	577	452	221,028
山陽電気鉄道	62	46	22,540
日本通運	655	494	320,606
ヤマトホールディングス	308.1	219.4	603,898
山九	201	152	77,672
丸運	12	7.3	1,905
丸全昭和運輸	55	42	17,094
センコー	66	50	34,650
トナミホールディングス	33	26	11,882
日本梱包運輸倉庫	50.5	40.8	76,500
日本石油輸送	18	15	3,645
福山通運	99	75	48,375
セイノーホールディングス	117	97	126,391
神奈川中央交通	20	15	8,970
日立物流	34.2	25.8	44,350
海運業 (0.3%)			
日本郵船	1,398	1,054	365,738
商船三井	929	654	280,566

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
川崎汽船	724	546	184,548
NSユニテッド海運	72	54	16,308
乾汽船	21.2	—	—
明治海運	15.2	11.7	4,820
飯野海運	69.1	64.6	41,925
共栄タンカー	15	11	2,706
第一中央汽船	128	124	5,828
空運業 (0.6%)			
日本航空	139.7	238.9	886,319
ANAホールディングス	3,251	2,453	785,205
スカイマーク	35.6	—	—
バスコ	16	12	4,080
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	4.8	3.6	18,576
日新	62	48	15,216
三菱倉庫	108	82	149,568
三井倉庫ホールディングス	83	73	29,930
住友倉庫	110	91	63,518
澁澤倉庫	39	33	11,946
東陽倉庫	30	22	6,908
乾汽船	—	8.6	8,419
日本トランスシティ	34	28	11,032
ケイヒン	32	24	4,800
中央倉庫	9.7	7.1	6,922
安田倉庫	13	9.6	9,945
東洋埠頭	49	40	8,160
宇徳	13.8	10.3	6,684
上組	197	149	174,777
サンリツ	4.2	3.7	2,060
キムラユニティ	3.4	2.8	2,836
キユーソー流通システム	5.2	3.4	4,712
郵船ロジスティクス	15	11.3	16,859
近鉄エクスプレス	14.7	11.1	52,336
東海運	10.2	7.3	2,124
エーアイティ	6.2	5.7	7,467
情報・通信業 (6.7%)			
NECネットエスアイ	17.8	15.4	36,590
システナ	15.7	11.6	10,126
デジタルアーツ	4.6	6.6	7,504
新日鉄住金ソリューションズ	13.6	10.3	35,123
キューブシステム	—	5.4	3,423

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コア	6.1	5.2	4,794
ソフトクリエイトホールディングス	5.6	3.9	3,708
ITホールディングス	58.6	40.8	85,843
ネオス	3.4	3.7	2,512
電算システム	4	4.3	6,639
グリー	97	74.5	49,989
コーエーテックモホールディングス	32.3	27.5	47,025
三菱総合研究所	6.3	4.7	13,042
ボルテージ	2.6	2.4	2,534
電算	1.3	1.3	2,984
AGS	—	2.1	2,085
ファインデックス	—	1.8	9,630
ヒト・コミュニケーションズ	1.8	1.8	3,061
ブレインパッド	1.3	1.9	2,367
KL a b	11.1	13.1	13,676
ポールトゥウィン・ビットクルーホールディ	9.9	8.4	6,829
イーブックイニシアティブジャパン	2.4	2.9	3,042
ネクソン	135.4	117	129,753
アイスタイル	4.9	5.3	3,715
エムアップ	3	3.5	2,667
エイチーム	1.5	1.5	7,665
e n i s h	2.4	3.3	4,626
コロブラ	—	21.6	59,400
モバイルクリエイト	1.3	7.4	5,527
オルトプラス	—	2.5	2,877
ブロードリーフ	16.3	10.2	18,564
ハーツユニテッドグループ	3.7	3.7	6,460
ドワンゴ	14.8	—	—
ベリサーブ	1.2	1.6	1,721
マクロミル	39	—	—
ティーガイア	16.1	12.2	18,104
豆蔵ホールディングス	9.9	9.8	6,105
テクマトリックス	5.8	5.6	3,460
GMOペイメントゲートウェイ	6.3	10.7	26,546
ザッパラス	9.3	7.5	5,025
インターネットイニシアティブ	24	19.9	46,426
GMOクラウド	—	2.2	1,944
ビットアイル	12.5	14.2	7,568
SRAホールディングス	8.1	6.5	10,491
システムインテグレータ	—	2	1,010
パイブドピッツ	—	1.2	2,361

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
朝日ネット	15.5	12.5	6,575
コムチュア	1.5	2.1	4,193
g u m i	—	9.3	23,315
パナソニック インフォメーションシステム	3.4	2.9	10,469
フェイス	5.2	3.9	5,183
野村総合研究所	92.5	69.7	288,558
サイバネットシステム	14.1	10.5	4,914
CEホールディングス	—	1.6	1,948
インテージホールディングス	8.9	7	13,825
東邦システムサイエンス	—	3.8	2,428
ソースネクスト	—	6.2	4,891
ティー・ワイ・オー	—	13.8	2,428
クレスコ	3.9	2.7	5,200
フジ・メディア・ホールディングス	157.9	128.3	212,464
オービック	56.3	42.5	187,000
ジャストシステム	—	17	11,815
TDCソフトウェアエンジニアリング	3.7	2.7	2,959
ヤフー	1,181.8	882.7	380,443
トレンドマイクロ	72.1	65.2	237,654
インフォメーション・ディベロプメント	—	2.4	2,277
日本オラクル	26.1	19.7	102,440
アルファシステムズ	5.4	4	6,672
フューチャーアーキテクト	19.9	12.7	9,004
CAC Holdings	10.4	8.2	8,774
ソフトバンク・テクノロジー	4	3.4	4,117
トーセ	4.4	2.9	2,201
オービックビジネスコンサルタント	8.3	7.7	31,993
伊藤忠テクノソリューションズ	18.5	13.8	62,790
アイティフォー	18.8	14.9	6,988
東計電算	2.8	2.1	3,670
エックスネット	1.6	1.1	1,640
大塚商会	14.6	33.1	156,397
サイボウズ	25.4	16.9	5,610
ソフトブレイン	24.6	17.9	3,418
アグレックス	4.1	—	—
電通国際情報サービス	10.2	7.5	8,580
EMシステムズ	2.3	1.4	2,434
ウェザーニューズ	4.3	3.6	11,196
C I J	15.7	11.3	5,265
東洋ビジネスエンジニアリング	—	1.3	1,765
日本エンタープライズ	—	8.6	3,302

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
WOWOW	5	2.9	17,748
フュージョンパートナー	—	5.3	4,706
日本コロムビア	8.6	5.1	2,024
イマジカ・ロボット ホールディングス	—	6.3	4,586
ネットワンシステムズ	64.5	50.4	39,765
アルゴグラフィックス	6.3	5.2	9,079
マーベラス	25	20.8	36,961
エイベックス・グループ・ホールディングス	30	24.5	47,946
日本ユニシス	39.6	34	37,740
兼松エレクトロニクス	10.3	7.7	13,629
東京放送ホールディングス	88	73.8	103,098
日本テレビホールディングス	162.6	112.4	214,009
朝日放送	—	12.2	11,773
テレビ朝日ホールディングス	41.3	33.3	59,040
スカパーJ S A Tホールディングス	123.9	93.5	68,909
テレビ東京ホールディングス	13.5	10	22,770
コネクション	14.4	8.5	9,214
クロップス	—	1.8	964
日本電信電話	641.5	482	3,504,140
KDD I	506.8	417.1	3,397,279
光通信	14.7	11.1	86,913
N T T ドコモ	1,345.3	1,014.8	2,131,587
GMOインターネット	54.5	41	47,642
KADOKAWA・DWANGO	—	30.2	59,071
学研ホールディングス	55	41	10,865
ゼンリン	21.8	16.3	25,085
昭文社	10.2	7.3	6,971
KADOKAWA	15.8	—	—
インプレスホールディングス	14.3	11.6	1,496
アイネット	7.2	6.5	5,993
松竹	107	81	94,851
東宝	116.5	87.9	255,701
東映	68	46	31,464
AOI Pro.	7.6	5.6	4,670
エヌ・ティ・ティ・データ	115.3	76.1	354,626
ビー・シー・エー	—	1.6	2,955
D T S	15.7	12.7	28,549
スクウェア・エニックス・ホールディングス	59.4	44.8	104,697
シーイーシー	9.8	8	8,088
カブコン	41.7	31.5	65,740
ジャステック	10.8	7.2	7,012

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
SCSK	38.8	29.3	92,002	
日本システムウエア	6.8	4.8	4,377	
アイネス	22.3	16.9	14,534	
TKC	13.7	10.3	23,164	
富士ソフト	20.8	16.9	42,858	
NSD	34.7	25.9	48,018	
コナミ	73.7	50	116,000	
福井コンピュータホールディングス	2.3	3.3	2,781	
JBCCHホールディングス	14	10.3	8,003	
ミロク情報サービス	11	8	5,384	
ソフトバンク	801.7	651.3	4,571,474	
卸売業 (4.1%)				
ハウスイ	16	13	1,716	
高千穂交易	7.1	4.9	5,345	
伊藤忠食品	3.8	2.9	11,788	
エレマテック	7.5	5.6	15,545	
JALUX	5.1	3.6	7,311	
あらた	37	28	9,184	
トーマンデバイス	2.3	1.7	3,202	
東京エレクトロニクス デバイス	3.3	2.4	3,770	
双日	1,092.8	824.4	147,567	
アルフレッサ ホールディングス	48.3	145.7	239,530	
横浜冷凍	40.6	30.1	25,073	
山下医科器械	1.4	1	1,697	
ラサ商事	7.8	6.9	4,064	
アルコニックス	5	7.1	13,099	
神戸物産	1.5	4.1	17,240	
あい ホールディングス	26.1	19.8	44,550	
ディーブイエックス	—	3.6	4,021	
ダイワボウホールディングス	151	115	22,885	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30.1	23.2	22,736	
八洲電機	13.1	9.5	5,462	
UKCホールディングス	10.4	7.9	15,412	
OCHIホールディングス	—	3.2	4,710	
TOKAIホールディングス	79.3	60	33,600	
三洋貿易	5.8	7.3	10,263	
ウイン・パートナーズ	—	4	6,144	
ミタチ産業	3.7	2.9	2,146	
シップヘルスケアホールディングス	23.3	22.5	59,400	
明治電機工業	—	3.6	3,870	
デリカフーズ	—	2.3	2,435	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
スターティア	—	1.1	1,679	
富士興産	6.3	4.9	2,959	
協栄産業	21	16	3,296	
小野建	14.1	10.6	11,448	
佐島電機	12.9	9.7	7,963	
エコートレーディング	4.7	3.6	2,430	
伯東	9.5	8.1	10,902	
コンドーテック	13.2	8.9	7,084	
中山福	9.3	6.9	6,244	
ナガイレーベン	21.9	17.9	40,275	
三菱食品	17.7	13.4	33,928	
松田産業	11.8	9	12,933	
メディアバルホールディングス	163.3	123.2	183,568	
アドヴァン	8	6.2	8,847	
S P K	3.6	2.5	5,310	
萩原電気	—	3.4	6,364	
アズワン	10.6	8.7	30,928	
スズデン	6	3.8	2,724	
尾家産業	5.6	4	3,456	
シモジマ	11.2	7.6	8,306	
ドウシシャ	17.1	15.9	32,006	
小津産業	—	2.5	5,252	
高速	9.5	7.4	6,674	
たけびし	—	4.4	4,928	
黒田電気	23.5	20.6	36,420	
丸文	14.5	10.7	8,495	
ハビネット	10.1	7.6	10,184	
トーマンエレクトロニクス	7.8	—	—	
橋本総業	—	2.3	3,201	
エクセル	7.6	5.7	7,786	
マルカキカイ	5.4	4	6,756	
ガリバーインターナショナル	54.9	37.3	34,651	
日本エム・ディ・エム	14.7	10.6	6,550	
進和	9.6	7.2	10,123	
エスケイジャパン	5.2	4.8	1,137	
ダイトエレクトロン	8	5.7	4,041	
シークス	10.3	7.8	18,813	
田中商事	4.7	4.1	2,849	
オーハシテクニカ	8.3	7.5	12,450	
マクニカ	8.3	6.2	23,405	
白銅	4.9	3.7	4,488	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
伊藤忠商事	1,302.5	1,030.9	1,346,870
丸紅	1,428	1,077.5	778,817
高島	32	24	6,216
長瀬産業	92.4	75.1	114,978
蝶理	10.5	7.9	15,499
豊田通商	181.9	137.2	428,064
三共生興	29.7	21.3	10,245
兼松	349	247	43,472
ツカモトコーポレーション	32	27	3,834
三井物産	1,503.3	1,044.2	1,684,816
日本紙パルプ商事	83	63	21,420
日立ハイテクノロジーズ	49.5	42.7	156,495
カメイ	21	16	13,344
東都水産	32	23	4,600
OUGホールディングス	23	19	4,351
スターゼン	58	48	20,688
山善	61.6	47.2	42,385
椿本興業	19	14	4,228
住友商事	963.6	726.9	937,701
内田洋行	38	31	11,532
三菱商事	1,274	943.9	2,215,333
第一実業	37	30	17,970
キヤノンマーケティングジャパン	46.3	35.1	77,606
西華産業	56	40	11,840
佐藤商事	13.9	10.5	8,400
菱洋エレクトロ	19.4	14.2	18,275
東京産業	16.3	12.5	6,025
ユアサ商事	167	10.7	26,172
神鋼商事	42	32	8,736
小林産業	12	9.7	2,492
阪和興業	163	123	57,318
カナデン	16	12	10,260
菱電商事	23	19	16,074
フルサト工業	9.1	6.8	11,682
岩谷産業	181	136	111,520
すてきなリスグループ	71	54	10,692
昭光通商	57	46	6,946
ニチモウ	27	22	4,598
極東貿易	21	16	3,632
イワキ	26	19	4,275
三菱石油	38	31	27,125

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
稲畑産業	40.1	29.6	34,128
G S I クレオス	46	39	5,031
明和産業	15.9	10.1	4,635
ワキタ	24	26.2	30,365
東邦ホールディングス	52.3	42.5	84,872
サンゲツ	28.9	22.1	77,350
ミツウロコグループホールディングス	25.6	19.5	11,524
シナノン	34	26	12,870
伊藤忠エネクス	35.7	27.2	26,982
サンリオ	41.2	34.5	117,300
サンワテクノス	8.4	7.8	9,547
リョーサン	24.1	20.5	56,129
新光商事	17.5	14.1	16,074
トーヨー	34	28	12,712
三信電気	20.5	16.9	16,173
東陽テクニカ	22.2	18	22,140
モスフードサービス	21.4	16.1	39,203
加賀電子	15	11	15,356
ソーダニッカ	16	12	6,444
立花エレテック	10	7.6	13,558
フォーバル	—	2.5	3,685
P a l t a c	22.9	19.7	33,312
太平洋興発	66	54	5,400
ヤマタネ	86	63	12,159
丸紅建材リース	15	11	2,981
日鉄住金物産	108	80	33,200
トラスコ中山	18.6	15.3	51,561
オートバックスセブン	57.3	45.3	84,122
加藤産業	23.2	17.7	42,161
イノテック	15.8	11.6	5,359
イエローハット	14.2	11.6	28,420
富士エレクトロニクス	8	6.2	9,591
J Kホールディングス	14.6	12.4	7,167
日伝	7.3	4.9	12,495
北沢産業	14.5	10.9	2,005
杉本商事	8.9	6.8	8,887
因幡電機産業	22.4	18.2	74,256
パイテック	5.7	4.2	4,296
ミスミグループ本社	65.4	46	200,330
江守グループホールディングス	5.3	5.5	4,851
アルテック	8.8	11.2	2,408

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タキヒョー	29	22	9,570
スズケン	67.6	51	190,740
ジェコス	11.1	8.5	11,415
ルネサスイーストン	—	5.5	4,081
小売業 (4.2%)			
ローソン	67	46.6	376,528
サンエー	12.2	9.2	39,284
キリン堂	5.7	—	—
ダイユーエイト	3.4	2.6	2,249
カワチ薬品	11.3	9.7	19,390
エービーシー・マート	23.2	17.5	109,025
ハードオフコーポレーション	8.2	5.9	6,755
アスクル	16.9	12.9	28,341
ゲオホールディングス	27.6	23.2	29,858
アダストリアホールディングス	12.5	10.4	30,607
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	22	18	2,340
くらコーポレーション	9.6	7.2	27,576
キャンドゥ	7.9	6	9,552
バル	9.5	7.1	22,258
エディオン	75.1	56.4	51,775
サーラコーポレーション	14.4	10.9	6,518
ワッツ	—	5	4,440
あみやき亭	2.9	2.1	8,557
ひらまつ	17.1	17.1	11,012
ゲンキー	1.4	1.2	11,496
サッポロドラッグストア	—	1.1	1,940
大黒天物産	3.9	2.9	11,977
ハニーズ	12.95	10.9	10,769
アルペン	14.6	10.9	20,284
クオール	11.9	12.5	11,712
ジェイアイエヌ	8.3	8.4	28,770
ビックカメラ	0.618	53.4	74,119
DCMホールディングス	80.5	59.2	51,918
Monotaro	25.3	24	93,120
きちり	—	2.6	1,820
アークランドサービス	—	1.4	6,335
J. フロント リテイリング	386	155.8	253,175
ドトール・日レスホールディングス	28.6	21.5	38,313
マツモトキヨシホールディングス	33.7	27.5	110,275
ブロンコビリー	2.6	2.2	8,426
スタートトゥデイ	50.8	38.3	109,078

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トレジャー・ファクトリー	—	1.2	3,318
物語コーポレーション	2.8	3.5	12,635
ココカラファイン	16.9	12.8	42,560
三越伊勢丹ホールディングス	324.5	244.8	438,436
ウエルシアホールディングス	6.2	11.1	51,004
クリエイトSDホールディングス	6.8	6	25,110
丸善CHIホールディングス	14.2	14.3	5,319
エー・ピーカンパニー	1.5	1.8	3,612
チムニー	—	2.2	5,170
ネクステージ	—	1.2	790
ジョイフル本田	—	6.6	27,819
キリン堂ホールディングス	—	4.3	3,676
すかいらーく	—	45	60,750
ブックオフコーポレーション	8.6	7	6,377
あさひ	9.5	8.2	9,528
日本調剤	2	1.6	6,448
コスモス薬品	9.2	6.2	117,180
トーエル	8.7	6.7	4,803
一六堂	2.7	3.5	1,550
セブン&アイ・ホールディングス	683	515.2	2,347,766
薬王堂	—	1.8	5,292
クリエイト・レストランツ・ホールディング	2.1	8.5	13,421
ツルハホールディングス	16	26.3	209,348
サンマルクホールディングス	5.2	4.4	34,276
フェリシモ	4.7	3.3	3,372
トリドール	14.2	13.3	21,772
クスリのアオキ	2.7	4.9	37,681
メディカルシステムネットワーク	13.8	11.6	4,686
総合メディカル	3.9	2.9	18,502
はるやま商事	7	5.1	3,758
カップ・クリエイトホールディングス	12.1	19.1	21,907
ライトオン	12.3	9.4	7,209
ジーンズメイト	7.4	5.3	1,351
良品計画	17.3	15.2	222,072
三城ホールディングス	19.6	15.2	7,235
コナカ	21	14.7	10,201
ハウス オブ ローゼ	1.9	1.5	2,151
G-7ホールディングス	4.8	2.5	2,700
イオン北海道	10.6	7.7	5,390
コジマ	24.7	18.8	6,467
ヒマラヤ	3.9	2.8	2,814

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コーナン商事	21.2	18.9	27,197
エコス	6.4	4.5	4,396
ワタミ	19.2	14.8	16,946
マルシェ	5	3.5	3,192
ドンキホーテホールディングス	56.2	39.6	339,372
西松屋チェーン	32.3	24.4	24,009
ゼンショーホールディングス	62.2	63.3	67,414
幸楽苑	10.1	7.8	12,160
ハークスレイ	4.7	3.4	3,542
サイゼリヤ	24	18.2	36,654
ポプラ	5.4	4.1	2,304
ユナイテッドアローズ	21.4	16.1	58,765
ハイデイ日高	8.6	7.8	29,406
京都きもの友禅	10.8	7.5	7,582
コロナイド	54	40.8	65,198
老番屋	6.6	5.5	28,160
トップカルチャー	6.9	5.5	2,766
P L A N T	3.3	3.3	4,359
スギホールディングス	29.3	22.1	130,169
スクロール	21.6	17.1	4,941
ヨンドシーホールディングス	12.8	9.5	19,199
ファミリーマート	55.2	41.6	226,720
木曽路	19.8	15	31,890
サトレストランシシステムズ	15.7	11.6	12,922
千趣会	29.3	21.9	18,483
タカキュー	13.1	10.1	2,201
ケーヨー	26.8	23	13,202
上新電機	35	27	26,622
日本瓦斯	24.4	19.8	63,063
ベスト電器	54.8	43.5	6,568
マルエツ	33	30	14,910
ロイヤルホールディングス	27.3	20.5	37,720
東天紅	14	10	1,950
いなげや	17.3	13.7	20,221
島忠	37	29.9	92,092
チヨダ	19.2	14.4	39,196
ライフコーポレーション	12.4	7.7	13,459
カスミ	33.1	25.1	24,422
リンガーハット	16.1	12	26,256
さが美	19	14	1,330
M r M a x	16	13.1	3,759

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
テンアライド	13.6	10.7	4,130
AOKIホールディングス	28.1	28.3	42,421
オークワ	25	19	18,563
コメリ	25	21	58,737
青山商事	41	30.9	122,364
しまむら	19	14.3	155,727
C F S コーポレーション	10.9	8.2	7,289
はせがわ	5.9	4.5	2,466
高島屋	221	179	194,036
松屋	33	24.8	44,912
エイチ・ツー・オー リテイリング	96	58.2	126,003
近鉄百貨店	63	47	16,685
丸栄	28	23	3,197
ニッセンホールディングス	32.9	26.6	7,740
パルコ	15.8	11.9	12,364
丸井グループ	212.8	148.2	201,996
アクシアル リテイリング	9	9.5	29,925
井筒屋	99	—	—
ダイエー	101.95	—	—
イズミヤ	62	—	—
イオン	652.1	507.9	660,270
ユニグループ・ホールディングス	156.3	117.9	84,534
イズミ	36.5	27.5	117,425
東武ストア	21	17	4,913
平和堂	32.8	25	64,650
フジ	18	13.8	30,484
ヤオコー	8.2	6.9	55,476
ゼビオ	19.5	16.7	36,740
ケーズホールディングス	34.5	28.4	99,116
O l y m p i c グループ	9.7	7.5	6,277
日産東京販売ホールディングス	24	21.1	6,076
アインファーマシーズ	9	14.8	64,750
元氣寿司	5.3	3.8	10,507
ヤマダ電機	645.4	486.8	249,241
アークランドサカモト	10.7	8.8	21,797
ニトリホールディングス	64.7	53.2	404,320
グルメ杵屋	12	9	8,865
愛眼	14.8	11.2	2,788
ケーユーホールディングス	3.4	5.7	3,927
吉野家ホールディングス	44.1	34.7	46,116
松屋フーズ	7.7	5.9	14,744

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サガミチェーン	21	15	17,760
関西スーパーマーケット	12.4	9.5	7,609
王将フードサービス	8	9	40,680
ブレナス	18.2	13.6	31,878
ミニストップ	11.9	9	14,778
アークス	27.3	21.2	52,788
パロー	35.2	26.5	63,547
藤久	1.4	0.9	1,527
ベルク	7.9	5.5	18,232
大庄	7.8	6.6	9,748
ファーストリテイリング	38.1	24.7	1,059,877
サンドラッグ	34.5	26	150,540
サックスパー ホールディングス	8.3	9.3	16,256
ヤマザワ	3.6	2.5	4,500
やまや	3.4	2.1	3,454
ベルーナ	40.5	30.2	16,308
銀行業 (9.4%)			
島根銀行	3.8	2.8	4,138
じもとホールディングス	117.6	88.4	21,481
足利ホールディングス	64	76.2	38,557
東京TYフィナンシャルグループ	—	15.8	56,880
新生銀行	1,413	1,172	274,248
あおぞら銀行	848	831	357,330
三菱UFJフィナンシャル・グループ	12,368.1	9,882.3	7,564,900
りそなホールディングス	1,551.9	1,440.9	961,368
三井住友トラスト・ホールディングス	3,208	2,723	1,355,237
三井住友フィナンシャルグループ	1,234.8	931.5	4,352,433
第四銀行	208	156	71,448
北越銀行	175	131	32,226
西日本シティ銀行	573	432	171,504
千葉銀行	630	475	438,900
横浜銀行	1,077	851	646,930
常陽銀行	608	445	293,255
群馬銀行	366	292	250,536
武蔵野銀行	26	19.6	84,770
千葉興業銀行	34	25.8	22,110
筑波銀行	67.9	51.1	20,337
東京都民銀行	29	—	—
七十七銀行	256	208	152,880
青森銀行	120	96	36,576
秋田銀行	113	82	31,816

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
山形銀行	100	74	39,886
岩手銀行	10.7	8.6	46,268
東邦銀行	146	109	53,192
東北銀行	84	67	11,390
みちのく銀行	87	60	12,960
ふくおかフィナンシャルグループ	662	500	337,000
静岡銀行	478	361	442,947
十六銀行	205	154	72,072
スルガ銀行	159	130	322,920
八十二銀行	301	223	200,254
山梨中央銀行	104	79	41,475
大垣共立銀行	200	153	64,107
福井銀行	141	105	29,190
北國銀行	183	136	58,616
清水銀行	5.6	4.3	13,523
滋賀銀行	153	123	91,389
南都銀行	157	118	49,442
百五銀行	145	118	69,148
京都銀行	312	235	278,710
紀陽銀行	64.1	48.4	80,344
三重銀行	69	56	16,744
ほくほくフィナンシャルグループ	1,111	838	236,316
広島銀行	482	363	238,491
山陰合同銀行	101	75	77,700
中国銀行	121.5	88.6	166,125
鳥取銀行	52	40	10,440
伊予銀行	174.6	131.7	200,052
百十四銀行	179	135	58,590
四国銀行	117	94	24,440
阿波銀行	134	101	70,397
鹿児島銀行	113	86	71,294
大分銀行	103	76	34,352
宮崎銀行	108	82	39,852
肥後銀行	134	101	75,649
佐賀銀行	100	75	22,725
十八銀行	101	76	28,956
沖縄銀行	12.2	9.8	50,764
琉球銀行	31.8	25.4	46,812
八千代銀行	7.8	—	—
セブン銀行	611.7	415.3	250,841
みずほフィナンシャルグループ	21,137.6	17,054.3	3,700,783

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
高知銀行	64	49	7,938
山口フィナンシャルグループ	163	123	168,756
長野銀行	54	40	8,480
名古屋銀行	147	111	52,392
北洋銀行	246	185.6	89,644
愛知銀行	5.9	4.5	27,225
第三銀行	91	71	14,768
中京銀行	66	50	10,900
東日本銀行	71	54	21,330
大光銀行	59	46	11,224
愛媛銀行	96	72	18,504
トマト銀行	66	49	9,310
みなと銀行	145	110	29,590
京葉銀行	132	101	72,518
関西アーバン銀行	225	16.3	21,646
栃木銀行	82	62	39,928
北日本銀行	5.1	3.9	11,914
東和銀行	196	173	18,165
福島銀行	209	157	14,915
大東銀行	108	81	12,312
トモニホールディングス	124.6	94	52,546
フィデアホールディングス	93	71	16,472
池田泉州ホールディングス	120.5	99.3	56,700
証券、商品先物取引業 (1.4%)			
F P G	10.9	10.6	28,344
S B I ホールディングス	196.1	147.9	206,912
日本アジア投資	117	94	7,238
ジャフコ	22.3	16.8	78,624
大和証券グループ本社	1,618	1,152	1,090,137
野村ホールディングス	3,337.9	2,518	1,815,729
岡三証券グループ	128	105	98,175
丸三証券	48.5	39	34,203
東洋証券	66	50	18,850
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	172.9	141.3	119,822
光世証券	40	30	7,230
水戸証券	48	38.1	16,992
いちよし証券	32.1	25.8	34,959
松井証券	83	62.6	68,547
だいこう証券ビジネス	8.3	6	4,878
マネックスグループ	177.3	146	41,756
カブドットコム証券	63.7	54.3	39,476

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
極東証券	20.3	16.6	30,759
岩井コスモホールディングス	15.6	12.7	18,618
マネースクウェアHD	—	3.8	5,316
マナーパートナーナズグループ	12.5	13.5	5,683
保険業 (2.5%)			
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	362.7	273.6	965,808
アニコム ホールディングス	—	5.2	9,490
MS&ADインシュアランスグループホール	487.9	392.6	1,283,409
ソニーフィナンシャルホールディングス	156.4	118	213,580
第一生命保険	821.9	789.1	1,437,740
東京海上ホールディングス	632.4	506.9	2,160,914
T&Dホールディングス	560.1	448.9	712,404
その他金融業 (1.2%)			
全国保証	19.5	32	125,760
クレディセゾン	133.4	100.6	231,480
芙蓉総合リース	17.1	12.9	55,728
興銀リース	28.5	23.1	57,426
東京センチュリーリース	38.3	28.9	88,434
日本証券金融	72.1	58.9	38,343
アイフル	297	206.1	95,630
ポケットカード	16.6	9.5	5,329
リコーリース	11.3	9.7	33,610
イオンフィナンシャルサービス	94.6	80.8	208,706
アコム	328	247.4	95,496
ジャックス	99	68	39,984
オリエントコーポレーション	364.8	286.1	57,506
日立キャピタル	32.1	24.1	61,238
アプラスフィナンシャル	59.7	59.8	8,312
オリックス	1,009	871.9	1,409,426
三菱UFJリース	414.1	312.4	180,879
日本取引所グループ	239.7	180.8	551,440
イー・ギャランティ	4.9	3.7	6,981
アサックス	3	2.2	3,689
NECキャピタルソリューション	5.6	5.2	10,119
不動産業 (3.0%)			
日本駐車場開発	180.2	134.7	17,376
ヒューリック	275.3	207.9	276,091
東京建物不動産販売	10	7.3	4,036
三栄建築設計	4.9	4.8	4,401
野村不動産ホールディングス	107.8	74	155,548
日本商業開発	—	3.8	7,307

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ブレサンスコーポレーション	3	4.1	15,457
常和ホールディングス	5.8	5.1	20,094
日本管理センター	—	6	8,058
サンセイランディック	—	1.7	1,312
エストラスト	—	1.7	1,178
フージャースホールディングス	24.8	19.1	10,161
オープンハウス	6.6	7.8	21,840
東急不動産ホールディングス	362.1	322.8	265,341
飯田グループホールディングス	71.5	79.9	131,515
パーク24	85.2	61.9	131,723
バラカ	4.3	4.7	5,903
三井不動産	770	653	2,203,875
三菱地所	1,143	916	2,485,108
平和不動産	33.3	23.4	39,803
東京建物	334	268	244,416
ダイビル	48.2	32.1	35,502
京阪神ビルディング	28.1	20.9	15,048
住友不動産	391	295	1,240,917
大京	275	199	35,223
テーオーシー	56.4	42.8	32,742
東京薬天地	28	21	10,500
レオバレス21	187.7	134.7	94,559
スターツコーポレーション	—	14.1	23,744
フジ住宅	21.1	16.1	11,060
空港施設	20.2	15.6	11,029
住友不動産販売	11.8	8.9	28,168
ゴールドクレスト	13.1	11.3	23,278
日本エスリード	6.8	5	6,070
日神不動産	21.4	16.4	8,118
タカラレーベン	55.1	54.8	31,564
サンヨーハウジング名古屋	8.7	7	9,212
イオンモール	105.3	79.5	189,607
ファースト住建	4.6	4.6	6,187
トーセイ	23.1	17.3	13,199
穴吹興産	12	12	3,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	101.4	76.5	94,248
サンフロンティア不動産	15.6	13.5	13,257
エフ・ジェー・ネクスト	6.8	9.5	5,120
グランディハウス	10	11.6	3,526
日本空港ビルデング	56.4	42.6	236,430

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サービス業 (3.0%)			
日本工営	58	43	21,715
ネクスト	14.7	15.4	14,630
日本M&Aセンター	8.9	20.1	77,385
ノバレーゼ	4.7	3.6	3,121
アコーディア・ゴルフ	70.4	49.1	59,656
タケエイ	12.1	12.9	12,603
トラスト・テック	2.2	2.2	3,984
パソナグループ	12.7	9.8	6,909
CDS	2.7	3	2,982
リンクアンドモチベーション	0.225	17.2	2,700
GCAサヴィアン	10.4	10.3	14,718
エス・エム・エス	9.8	14.6	19,651
テンブホールディングス	37.8	25.6	97,920
リニカル	3.5	3.4	3,219
クックパッド	8.5	8.3	40,379
エスクリ	6.1	4.7	5,997
アイ・ケイ・ケイ	4	3.5	3,958
学情	5.9	4.9	4,919
スタジオアリス	6.9	6	12,498
シミックホールディングス	6.6	4.9	9,912
NECフィールディング	13.8	—	—
総合警備保障	62.9	43.5	152,902
カカコム	104.8	86.7	158,747
アイロムホールディングス	—	3.3	5,827
ルネサンス	7.9	6.8	8,364
ディップ	2.9	2.9	15,486
オプト	7.2	6.1	3,995
新日本科学	14.6	12.6	11,491
ソクイ	18.8	15.6	15,069
総合臨床ホールディングス	5.2	6.1	2,921
キャリアデザインセンター	0.038	3.9	3,728
エムスリー	0.572	112.8	288,316
ツカダ・グローバルホールディング	10	9.6	7,680
アウトソーシング	5.6	5	9,105
ウエルネット	—	3.5	7,931
ディー・エヌ・エー	93	64.3	88,734
博報堂DYホールディングス	239.5	180.7	232,018
ぐるなび	12.1	15.1	28,252
エスアールジータカミヤ	—	10.5	9,040
一休	0.124	10.2	17,625

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ジャパンベストレスクューシステム	0.112	12	3,060
ファンコミュニケーションズ	—	22.6	25,628
ジェイコムホールディングス	3.2	2.8	2,279
PGMホールディングス	24.4	18.5	24,882
WDBホールディングス	1.5	4.7	3,990
ティア	—	3.8	2,162
バリューコマース	10.8	11.3	5,966
J Pホールディングス	29.2	33	12,078
E P Sホールディングス	0.186	16.4	24,485
プレステージ・インターナショナル	11.7	9.8	10,192
アミューズ	4.8	4	11,644
ドリームインキュベータ	0.047	4.3	10,216
クイック	—	4.4	3,550
T A C	10.8	8.1	1,701
ケネディクス	203.7	185.3	99,320
電通	163	145.3	729,406
テイクアンドキッズ・ニュース	7.5	5.4	5,437
びあ	5.1	3.8	8,873
イオンファンタジー	5.7	4.3	6,772
ネクシィーズ	—	4.9	2,974
みらかホールディングス	45.3	34.3	194,481
アルプス技研	7.3	5.2	9,287
サニックス	25.4	15.6	6,068
ダイオーズ	3	2.5	2,282
日本空調サービス	4.2	6.3	5,481
オリエンタルランド	46.7	35.2	1,046,144
ダスキン	46.7	36.9	72,656
明光ネットワークジャパン	17.1	13	16,237
ファルコホールディングス	8.9	6.2	8,531
秀英予備校	4	4.2	1,293
田谷	3.2	2.6	2,145
ラウンドワン	49.4	37.6	25,981
リゾートトラスト	58.4	48.1	136,315
ビー・エム・エル	11.3	7.6	25,802
ワタベウェディング	5.5	5.1	2,590
もしもしホットライン	31.9	24.3	32,780
リソー教育	19.7	—	—
早稲田アカデミー	2.2	2.3	1,902
ユー・エス・エス	209.2	157.8	326,961
東京個別指導学院	9.6	6.7	2,371
サイバーエージェント	—	23.9	137,186

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
楽天	561	566.3	1,111,930
テー・オー・ダブリュー	5.9	4	3,380
セントラルスポーツ	5.4	4.5	9,733
フルキャストホールディングス	—	13.7	7,809
リゾートソリューション	16	14	3,612
テクノプロ・ホールディングス	—	13.9	33,679
リブセンス	8.6	7.8	5,280
ジャパンマテリアル	1.5	5.2	8,314
ベクトル	—	2.1	3,318
ウチヤマホールディングス	—	5.9	3,380
サクセスホールディングス	—	1.2	1,447
アサンテ	—	3.1	3,884
M&Aキャピタルパートナーズ	—	0.2	498
E R Iホールディングス	3.4	3.4	3,383
ウィルグループ	—	1.2	1,462
リクルートホールディングス	—	147.9	532,440
リロ・ホールディング	6.5	4.4	42,944
東祥	—	2.8	7,646
エイチ・アイ・エス	14.1	21.2	82,468
共立メンテナンス	8.6	6.5	43,615
イチネンホールディングス	18.4	13.6	13,994
建設技術研究所	10.4	7.7	10,464
スペース	8.2	6.9	8,549
燦ホールディングス	3.3	2.7	4,803
スバル興業	13	10	4,400
東京テアトル	70	54	7,722
よみうりランド	35	27	12,933
東京都競馬	134	90	28,530
常磐興産	57	49	7,448
カナモト	22	18.2	55,510
東京ドーム	128	90	50,040
西尾レントオール	9.4	10.5	33,075
トランス・コスモス	22.6	16.9	40,948
乃村工藝社	34	25.6	30,361
藤田観光	44	48	23,808
KN T-C Tホールディングス	58	63	9,954
日本管財	7.4	6.3	16,751
トーカイ	7.6	5.7	21,831
白洋舎	20	15	3,705
セコム	179.8	126.6	923,673
セントラル警備保障	7.6	5.7	7,387

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
丹青社	21.9	15.2	12,494
メイテック	23.7	17.6	62,392
アサツー ディ・ケイ	30.3	24.5	80,360
応用地質	16.5	13.6	22,236
船井総研ホールディングス	17.9	13.8	13,455
進学会	7.4	5.6	2,660
ベネッセホールディングス	57.9	47.6	178,976
イオンディライト	16.4	12.4	35,005

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ナック	8.7	8.9	9,264	
ニチイ学館	37.5	25.6	29,286	
ダイセキ	25.5	20.9	42,803	
ステップ	4.8	4.4	3,709	
合 計	株数・金額	266,562	207,046	273,582,287
	銘柄数<比率>	1,745	1,827	<99.1%>

(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 1,473	百万円 -

○有価証券の貸付および借入の状況

2015年2月20日現在における貸付株数の総株数は36,617,000株です。

うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUFJ証券株式会社に対する貸付は、33,410,600株です。

○投資信託財産の構成

(2015年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	273,582,287	83.0
コール・ローン等、その他	56,065,997	17.0
投資信託財産総額	329,648,284	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年2月20日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	329,638,139,963
コール・ローン等	53,590,048,809
株式(評価額)	273,582,287,170
未収入金	2,065,279,803
未収配当金	322,361,471
未収利息	87,608
その他未収収益	32,285,102
差入委託証拠金	45,790,000
(B) 負債	53,466,255,074
未払解約金	2,145,281,630
未払利息	843,975
受入担保金	51,320,129,469
(C) 純資産総額(A-B)	276,171,884,889
元本	240,254,912,958
次期繰越損益金	35,916,971,931
(D) 受益権総口数	240,254,912,958口
1万円当たり基準価額(C/D)	11,495円

〈注記事項〉

①期首元本額	317,883,470,659円
期中追加設定元本額	26,747,002,537円
期中一部解約元本額	104,375,560,238円

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	13,808,930,243円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	1,084,084,871円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	3,879,941,756円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	3,752,280,117円
三菱UFJ トピックスオープン(確定拠出年金)	4,545,779,618円
三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	6,637,283,930円
三菱UFJ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	33,965,497,263円
三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	33,775,446,213円
三菱UFJ 財産分散ファンド(毎月決算型)	1,197,586,497円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	364,095,040円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	663,888,055円
FPバランスファンド(安定型)	52,256,853円
FPバランスファンド(安定成長型)	78,875,626円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	185,062,628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)	136,249,842,405円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)VA(適格機関投資家限定)	1,663,513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)	12,398,330円
合計	240,254,912,958円

○損益の状況 (2014年2月21日～2015年2月20日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	5,686,414,405
受取配当金	5,203,353,144
受取利息	22,387,380
その他収益金	473,109,284
支払利息	△ 12,435,403
(B) 有価証券売買損益	63,439,449,669
売買益	67,223,028,261
売買損	△ 3,783,578,592
(C) 先物取引等取引損益	787,671,880
取引益	1,098,544,328
取引損	△ 310,872,448
(D) 保管費用等	△ 756,253
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	69,912,779,701
(F) 前期繰越損益金	△32,818,848,570
(G) 追加信託差損益金	△ 975,119,182
(H) 解約差損益金	△ 201,840,018
(I) 計(E+F+G+H)	35,916,971,931
次期繰越損益金(I)	35,916,971,931

(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]

デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)

三菱UFJ 外国株式マザーファンド

《第15期》決算日2015年5月20日

[計算期間：2014年5月21日～2015年5月20日]

「三菱UFJ 外国株式マザーファンド」は、5月20日に第15期の決算を行いました。

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

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		MSCIコクサイ インデックス (除く日本 円換算ベース)		株式 組入比率	株式 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
11期(2011年5月20日)	9,306	14.2	303,050.09	13.8	95.9	2.4	1.7	193,120
12期(2012年5月21日)	8,087	△13.1	262,612.35	△13.3	94.9	2.9	2.0	169,037
13期(2013年5月20日)	13,762	70.2	445,900.88	69.8	95.9	1.3	2.3	235,276
14期(2014年5月20日)	15,742	14.4	508,902.69	14.1	96.3	1.5	2.1	182,512
15期(2015年5月20日)	20,323	29.1	655,211.07	28.7	96.7	0.9	2.2	160,903

(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の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		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 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2014年5月20日	円	%		%	%	%	%
5月末	15,742	—	508,902.69	—	96.3	1.5	2.1
6月末	16,018	1.8	517,526.86	1.7	96.5	1.5	2.1
7月末	16,220	3.0	523,855.14	2.9	96.3	1.8	2.1
8月末	16,447	4.5	531,052.71	4.4	96.6	1.4	2.1
9月末	16,698	6.1	539,176.20	5.9	96.5	1.0	2.1
10月末	17,185	9.2	554,848.79	9.0	96.5	1.3	2.0
11月末	17,097	8.6	552,093.96	8.5	96.8	0.9	2.2
12月末	19,159	21.7	618,790.76	21.6	96.1	1.5	2.2
2015年1月末	19,406	23.3	626,562.12	23.1	96.2	1.6	2.2
2月末	18,583	18.0	599,902.47	17.9	96.4	2.3	2.5
3月末	19,647	24.8	633,869.84	24.6	95.7	1.4	2.2
4月末	19,613	24.6	632,257.75	24.2	96.0	2.3	2.3
5月末	19,800	25.8	639,054.87	25.6	96.6	1.2	2.2
(期 末) 2015年5月20日	20,323	29.1	655,211.07	28.7	96.7	0.9	2.2

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ29.1%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(28.7%)を0.4%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国株式市況

- ・欧州経済の先行き不透明感やギリシャ債務問題などを受けて下落する局面もありましたが、欧米での緩和的な金融政策や米国の良好な企業決算発表などを受けて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19.2%の円安・米ドル高、3.3%の円高・ユーロ安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・MSCI 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・REIT（不動産投資信託証券）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。
- ・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

（注）マルチファクターモデル

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

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは28.7%の上昇となったため、カイ離は0.4%程度となりました。

	組入比率 要因	銘柄選択 要因	その他の 要因	合計
ベンチマーク とのカイ離	△0.0%程度	△0.0%程度	0.4%程度	0.4%程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は△0.0%程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

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

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

◎その他の要因

その他の要因による影響は0.4%程度でした。

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

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

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

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

◎今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2014年5月21日～2015年5月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 1 (1) (0) (0)	% 0.006 (0.005) (0.000) (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 有価証券等を売買する際に発生する費用
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	1 (1) (0)	0.004 (0.004) (0.000)	(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) (監 査 費 用) (そ の 他)	13 (12) (0) (1)	0.069 (0.067) (0.000) (0.003)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 外国での資産の保管等に要する費用 ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	15	0.079	
期中の平均基準価額は、17,989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) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

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

○売買及び取引の状況

(2014年5月21日～2015年5月20日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ	百株 7,463 (5,494)	千アメリカドル 40,467 (△ 74)	百株 63,800 (247)	千アメリカドル 375,287 (2,855)
	カナダ	1,179 (477)	千カナダドル 3,983 (—)	8,907 (62)	千カナダドル 30,546 (370)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	1,191 (1,007)	3,247 (△ 91)	4,989	18,400
	イタリア	4,205 (△ 2,142)	1,046 (△ 335)	10,895	4,483
	フランス	790 (343)	2,556 (△ 99)	5,288 (0.02)	18,261 (0.61939)
	オランダ	352 (463)	693 (335)	3,740	6,775
	スペイン	3,884 (53,577)	2,811 (543)	55,484 (6,810)	7,734 (78)
	ベルギー	27	175	391	2,533
	オーストリア	92	88	513	533
	ルクセンブルク	62	294	342	617
	フィンランド	100	156	1,324	1,884
	アイルランド	3,853	243	5,916	625
	ポルトガル	20,989 (1,054)	439 (—)	9,036	521
国	イギリス	9,781 (202,071)	千イギリスポンド 3,615 (54)	53,994 (242,926)	千イギリスポンド 32,672 (153)
	スイス	2,031 (1,751)	千スイスフラン 4,311 (2,451)	4,954 (1,751)	千スイスフラン 24,489 (2,987)
	スウェーデン	379 (855)	千スウェーデンクローネ 5,170 (—)	4,115	千スウェーデンクローネ 56,863
	ノルウェー	213 (77)	千ノルウェークローネ 1,915 (—)	1,390	千ノルウェークローネ 13,816
	デンマーク	302 (33)	千デンマーククローネ 10,307 (—)	836	千デンマーククローネ 22,610

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	オーストラリア	百株 3,474 (1,442)	千オーストラリアドル 2,520 (△ 42)	百株 13,174 (321)	千オーストラリアドル 20,351 (157)
	ニュージーランド	1,223 (-)	千ニュージーランドドル 418 (27)	1,121	千ニュージーランドドル 537
	香港	3,960 (4,183)	千香港ドル 7,540 (-)	20,241	千香港ドル 58,816
国	シンガポール	1,500 (182)	千シンガポールドル 585 (-)	13,160	千シンガポールドル 5,116
	イスラエル	10 (8)	千イスラエルシェケル 277 (-)	1,022	千イスラエルシェケル 4,925

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
HCP INC	—	—	8	351
MACERICH CO/THE	0.19	16	2	199
PROLOGIS INC	—	—	8	362
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.228	17	1	130
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.335	21	2	158
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.134	24	1	220
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.273	36	1	181
HEALTH CARE REIT INC	2	193	5	396
BOSTON PROPERTIES INC	0.116	16	2	367
REALTY INCOME CORP	0.303	16	4	200
REGENCY CENTERS CORP	0.501	27	2	133
SL GREEN REALTY CORP	0.225	28	1	204
UDR INC	—	—	3	121
VENTAS INC	1	119	5	391
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	1	17	18	212
RAYONIER INC	—	—	2	73
WEYERHAEUSER CO	0.465	16	13	459
AMERICAN TOWER CORP	1	143	7	727
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	1	34	9	225
AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	11	134	18	194
DUKE REALTY CORP	1	21	6	115
WP GLIMCHER INC	—	—	9	180
	(9)	(—)		
RAYONIER ADVANCED MATERIALS	—	—	2	100
	(2)	(—)		
IRON MOUNTAIN INC	—	—	2	93
	(9)	(286)		
URBAN EDGE PROPERTIES	—	—	3	92
	(3)	(—)		
EQUINIX INC	0.161	35	0.296	68
	(2)	(477)		
COMMUNICATIONS SALES & LE	—	—	0.304	8
	(5)	(183)		
EQUITY RESIDENTIAL	—	—	5	415
GENERAL GROWTH PROPERTIES	—	—	10	266
HOST HOTELS & RESORTS INC	—	—	13	293
LIBERTY PROPERTY TRUST	—	—	2	95
PLUM CREEK TIMBER CO	—	—	3	129
PUBLIC STORAGE	0.295	50	2	522
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.306	53	5	1,060
VORNADO REALTY TRUST	—	—	2	316
KIMCO REALTY CORP	—	—	7	174

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.517	76	2	370
小 計	25 (32)	1,101 (948)	203	9,618
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	0.8	18	3	69
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	—	—	2	60
小 計	0.8	18	5	130
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
GECINA SA	0.4	43	0.567	62
KLEPIERRE	3	150	2	100
UNIBAIL-RODAMCO SE	0.148	33	1	404
FONCIERE DES REGIONS	—	—	0.339	24
	(—)	(△ 1)	(—)	(0.00001)
FONCIERE DES REGIONS-RTS	—	—	1	1
	(1)	(—)		
ICADE	0.181	12	0.805	56
小 計	4 (1)	239 (△ 1)	7 (—)	650 (0.00001)
オランダ				
CORIO NV	0.314	12	4	185
小 計	0.314	12	4	185
ユ ー ロ 計	4 (1)	252 (△ 1)	11 (—)	835 (0.00001)
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	1	12	18	135
HAMMERSON PLC	1	11	10	65
LAND SECURITIES GROUP PLC	0.864	11	14	164
INTU PROPERTIES PLC	—	—	12	42
SEGRO PLC	2	11	17	67
小 計	7	46	72	475
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
FEDERATION CENTRES	—	—	28	77
WESTFIELD RETAIL TRUST	—	—	—	—
			(177)	(572)
SCENTRE GROUP	12 (304)	44 (521)	96	343
NOVION PROPERTY GROUP	9	21	47	107
GPT GROUP	—	—	32	136
MIRVAC GROUP	—	—	69	127
STOCKLAND	—	—	39	168
WESTFIELD CORP	2	21	38	336
DEXUS PROPERTY GROUP	16 (△ 245)	19 (—)	65	138

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
	GOODMAN GROUP	—	—	30	172
	小計	40 (59)	105 (521)	449 (177)	1,609 (572)
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	—	—	42	1,979
	小計	—	—	42	1,979
	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	132 (—)	255 (△0.1764)	31	58
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	—	—	33	54
	CAPITALAND MALL TRUST	— (—)	— (△0.1404)	52	105
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	— (—)	— (△ 0.06)	35	82	
小計	132 (—)	255 (△0.3768)	151	300	

(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 50,035	百万円 51,864	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

(2014年5月21日～2015年5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	76,752,158千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	167,219,209千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.45

(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

(2014年5月21日～2015年5月20日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 3,650	% 51.7		百万円 45,603	% 61.5	

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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2015年5月20日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ALCOA INC	633	484	633	76,668	素材
AMERICAN EXPRESS CO	572	385	3,136	379,290	各種金融
AVON PRODUCTS INC	261	182	127	15,421	家庭用品・パーソナル用品
ABBOTT LABORATORIES	918	623	3,056	369,636	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	197	137	583	70,509	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	31	23	518	62,701	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	286	199	1,754	212,187	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	—	30	191	23,129	小売
AES CORP	406	284	387	46,854	公益事業
AFLAC INC	275	186	1,197	144,793	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	830	579	3,443	416,473	保険
ALLERGAN INC	176	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
APACHE CORP	237	155	969	117,286	エネルギー
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	28	26	794	96,075	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	377	259	2,525	305,388	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	124	88	1,306	157,954	素材
ANTHEM INC	175	111	1,839	222,480	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	298	209	1,754	212,170	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	793	547	991	119,948	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	322	224	1,534	185,582	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	424	280	4,126	499,096	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	115	86	1,225	148,217	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	159	122	429	51,988	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	977	687	4,691	567,441	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	79	54	2,029	245,484	各種金融
VERTIZON COMMUNICATIONS INC	2,454	1,718	8,517	1,030,052	電気通信サービス
CR BARD INC	44	31	541	65,507	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	83	53	395	47,802	素材
BAKER HUGHES INC	262	179	1,155	139,725	エネルギー
ALLSTATE CORP	268	173	1,192	144,275	保険
AVERY DENNISON CORP	56	37	227	27,487	素材
ACE LTD	201	137	1,495	180,882	保険
ANALOG DEVICES INC	186	130	825	99,826	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	20	13	920	111,303	小売
CVS HEALTH CORP	707	475	4,861	587,903	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ENTERPRISES	147	94	435	52,715	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	856	530	1,140	137,947	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	2,231	1,548	10,375	1,254,836	銀行
CIGNA CORP	164	108	1,450	175,384	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	378	237	2,076	251,098	資本財
COCA-COLA CO/THE	2,358	1,632	6,744	815,647	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	341	229	1,963	237,464	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	120	85	397	48,112	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	599	412	1,469	177,686	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	118	80	168	20,436	メディア
CHEVRON CORP	1,141	782	8,222	994,383	エネルギー

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
COACH INC	164	113	422	51,143	耐久消費財・アパレル
ROCKWELL COLLINS INC	77	49	485	58,764	資本財
COMPUTER SCIENCES CORP	86	58	396	47,983	ソフトウェア・サービス
CONOCOPHILLIPS	690	510	3,322	401,861	エネルギー
CME GROUP INC	187	132	1,258	152,249	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	201	137	1,196	144,751	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	549	377	2,608	315,532	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION RESOURCES INC/VA	346	242	1,752	211,928	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE	719	488	2,475	299,420	素材
DEVON ENERGY CORP	227	161	1,044	126,284	エネルギー
DEERE & CO	215	140	1,256	151,992	資本財
DANAHER CORP	351	261	2,265	274,033	資本財
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	549	375	2,673	323,300	素材
WALT DISNEY CO/THE	991	667	7,379	892,469	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC	79	54	353	42,794	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	420	293	2,238	270,784	公益事業
DR HORTON INC	172	136	365	44,228	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC	58	39	210	25,453	小売
TARGET CORP	356	250	1,951	236,024	小売
DENBURY RESOURCES INC	222	—	—	—	エネルギー
DUN & BRADSTREET CORP	23	15	197	23,942	商業・専門サービス
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	39	27	86	10,471	エネルギー
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I	106	71	591	71,522	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	100	68	515	62,289	資本財
DTE ENERGY COMPANY	104	73	586	70,983	公益事業
EXXON MOBIL CORP	2,592	1,754	15,258	1,845,308	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	64	44	578	69,974	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	324	227	2,051	248,088	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	415	286	1,718	207,846	資本財
EXELON CORP	509	356	1,235	149,377	公益事業
ECOLAB INC	161	111	1,293	156,437	素材
EQUIFAX INC	71	49	497	60,130	商業・専門サービス
ENSCO PLC-CL A	137	95	235	28,481	エネルギー
EMC CORP/MA	1,223	842	2,263	273,788	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	142	95	854	103,353	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	282	196	1,429	172,892	資本財
EDISON INTERNATIONAL	184	128	781	94,483	公益事業
ENTERGY CORP	105	75	572	69,282	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	28	18	348	42,131	保険
ENERGIZER HOLDINGS INC	37	25	360	43,596	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC	259	181	1,860	225,065	公益事業
MACY'S INC	219	142	987	119,403	小売
FEDEX CORP	179	111	1,986	240,260	運輸
FMC TECHNOLOGIES INC	139	97	399	48,360	エネルギー
FAMILY DOLLAR STORES	61	42	335	40,597	小売
FORD MOTOR CO	2,184	1,486	2,304	278,694	自動車・自動車部品
FOREST LABORATORIES INC	143	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FRANKLIN RESOURCES INC	244	166	861	104,209	各種金融
FOOT LOCKER INC	—	59	378	45,734	小売
FIRSTENERGY CORP	248	176	625	75,674	公益事業
FLUOR CORP	98	64	380	45,960	資本財
FREEMPORT-MCMORAN INC	617	429	914	110,639	素材

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
GENERAL MILLS INC	377	249	1,419	171,696	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	177	116	1,634	197,679	資本財
WW GRAINGER INC	35	25	627	75,885	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	6,007	4,160	11,378	1,376,086	資本財
GENUINE PARTS CO	91	63	594	71,924	小売
GAP INC/THE	147	99	385	46,594	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	255	162	3,333	403,170	各種金融
HALLIBURTON CO	503	350	1,581	191,245	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	442	308	3,260	394,265	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	131	88	494	59,794	自動車・自動車部品
HEWLETT-PACKARD CO	1,141	773	2,582	312,297	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	251	177	749	90,596	保険
HERSHEY CO/THE	92	62	596	72,181	食品・飲料・タバコ
DIRECTV	295	197	1,805	218,353	メディア
HOSPIRA INC	97	70	623	75,391	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HOME DEPOT INC	837	545	6,132	741,654	小売
HASBRO INC	69	47	340	41,133	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	173	110	771	93,317	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	612	389	6,754	816,903	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	249	166	891	107,790	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	250	153	1,487	179,893	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	243	174	365	44,245	メディア
IRON MOUNTAIN INC	85	—	—	—	商業・専門サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	49	33	390	47,205	素材
INTERNATIONAL GAME TECHNOLOG	150	—	—	—	消費者サービス
JOHNSON & JOHNSON	1,674	1,159	12,052	1,457,666	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC	405	275	1,379	166,785	自動車・自動車部品
KANSAS CITY SOUTHERN	66	45	429	51,903	運輸
KELLOGG CO	151	110	710	85,968	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	227	154	1,739	210,395	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	989	695	2,799	338,523	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	291	193	1,419	171,711	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	123	84	562	68,047	小売
ELI LILLY & CO	602	415	3,048	368,681	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	51	40	484	58,622	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	107	71	292	35,420	運輸
LENNAR CORP-A	97	72	353	42,692	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	623	408	2,937	355,225	小売
LEGGETT & PLATT INC	85	56	269	32,546	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	146	102	905	109,481	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	242	165	835	101,071	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	161	111	2,153	260,395	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	154	107	635	76,865	保険
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	52	34	420	50,854	資本財
LEGG MASON INC	64	42	228	27,693	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	143	93	759	91,793	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	589	402	4,057	490,653	消費者サービス
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	151	112	1,207	146,063	各種金融
MEDTRONIC PLC	592	586	4,602	556,679	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	1,733	1,180	7,146	864,290	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	622	444	1,170	141,551	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	199	138	360	43,633	耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
3M CO	379	252	4,115	497,691	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	138	93	559	67,671	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	229	161	317	38,401	消費者サービス
MASCO CORP	214	148	413	50,001	資本財
MONSANTO CO	312	200	2,403	290,647	素材
MEADWESTVACO CORP	106	69	357	43,242	素材
M & T BANK CORP	69	49	612	74,082	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	326	224	1,317	159,363	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	37	25	483	58,435	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	867	607	2,352	284,488	各種金融
MCKESSON CORP	136	96	2,331	281,928	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	565	399	2,134	258,172	保険
MANPOWERGROUP INC	47	32	284	34,385	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	115	77	855	103,501	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	183	128	1,247	150,898	運輸
BANK OF AMERICA CORP	6,334	4,355	7,304	883,352	銀行
NISOURCE INC	186	131	618	74,783	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	125	79	1,264	152,922	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	260	185	328	39,703	銀行
NEWMONT MINING CORP	299	208	563	68,176	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	879	562	1,932	233,667	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	71	48	389	47,061	食品・飲料・タバコ
NUCOR CORP	189	131	631	76,338	素材
SAFEWAY INC	148	—	—	—	食品・生活必需品小売り
NEWELL RUBBERMAID INC	169	113	455	55,099	耐久消費財・アパレル
NOBLE CORP PLC	151	102	170	20,560	エネルギー
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	263	181	620	75,068	メディア
NOBLE ENERGY INC	213	159	706	85,399	エネルギー
PALL CORP	64	44	553	66,890	資本財
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	478	322	2,447	295,974	エネルギー
OMNICARE INC	61	41	379	45,854	ヘルスケア機器・サービス
OMNICOM GROUP	152	102	797	96,487	メディア
PEPSICO INC	909	619	6,071	734,314	食品・飲料・タバコ
ALTRIA GROUP INC	1,188	818	4,239	512,779	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	65	47	286	34,695	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,613	1,119	9,045	1,094,004	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	315	217	2,080	251,665	銀行
PFIZER INC	3,846	2,609	8,928	1,079,817	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	274	188	1,627	196,808	保険
PULTEGROUP INC	206	138	277	33,547	耐久消費財・アパレル
PEPCO HOLDINGS INC	149	105	284	34,437	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	88	61	749	90,704	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	81	61	944	114,201	エネルギー
CITIGROUP INC	1,801	1,254	6,942	839,582	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	174	122	641	77,639	保険
PPG INDUSTRIES INC	84	56	1,306	158,044	素材
PEABODY ENERGY CORP	162	—	—	—	エネルギー
PENTAIR PLC	118	78	499	60,435	資本財
PRAAIR INC	176	120	1,461	176,802	素材
P G & E CORP	267	197	1,045	126,451	公益事業
PPL CORP	378	276	955	115,580	公益事業
PROGRESSIVE CORP	338	232	633	76,646	保険

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	302	210	905	109,555	公益事業
STARWOOD HOTELS & RESORTS	113	73	631	76,398	消費者サービス
SPX CORP	24	14	108	13,076	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	90	68	530	64,199	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	188	127	1,363	164,934	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	168	118	485	58,668	商業・専門サービス
ROWAN COMPANIES PLC-A	74	—	—	—	エネルギー
REGIONS FINANCIAL CORP	818	566	588	71,164	銀行
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	27	18	195	23,642	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	58	41	732	88,619	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	241	171	349	42,254	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	82	57	331	40,100	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	81	56	701	84,800	資本財
SCHLUMBERGER LTD	782	533	4,827	583,890	エネルギー
STRYKER CORP	178	140	1,362	164,758	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	686	486	1,544	186,799	各種金融
SEMPRA ENERGY	139	97	1,051	127,124	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	51	33	985	119,153	素材
ST JUDE MEDICAL INC	174	118	887	107,316	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	88	61	642	77,651	資本財
SUNTRUST BANKS INC	315	214	936	113,241	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	215	137	1,421	171,952	保険
SOUTHERN CO/THE	527	374	1,633	197,542	公益事業
AT&T INC	3,126	2,148	7,382	892,864	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	127	91	877	106,149	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	259	172	1,365	165,126	各種金融
SYSCO CORP	345	242	927	112,200	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	109	83	415	50,274	素材
SCANA CORP	79	56	301	36,455	公益事業
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	95	65	147	17,830	エネルギー
TEXAS INSTRUMENTS INC	648	438	2,444	295,644	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	76	53	462	55,993	小売
TORCHMARK CORP	52	52	304	36,812	保険
TYCO INTERNATIONAL PLC	275	172	693	83,835	商業・専門サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	214	165	2,162	261,524	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	166	113	526	63,619	資本財
UNION PACIFIC CORP	274	368	3,833	463,629	運輸
UNUM GROUP	152	104	364	44,085	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	517	358	4,271	516,654	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	597	397	4,795	579,921	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,082	740	3,311	400,447	銀行
MARATHON OIL CORP	413	279	764	92,429	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	426	291	2,973	359,663	運輸
VALERO ENERGY CORP	319	215	1,292	156,323	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	62	41	364	44,108	ヘルスケア機器・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	332	198	1,206	145,940	メディア
VF CORP	208	142	1,019	123,274	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	77	55	507	61,421	素材
TOWERS WATSON & CO-CL A	38	29	399	48,286	商業・専門サービス
WILLIAMS COS INC	406	294	1,561	188,803	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	536	361	3,101	375,083	食品・生活必需品小売り
WISCONSIN ENERGY CORP	137	95	460	55,669	公益事業

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
WAL-MART STORES INC	965	667	5,101	616,944	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO	2,968	2,041	11,514	1,392,592	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	265	179	893	108,052	商業・専門サービス
WATERS CORP	50	34	463	56,055	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	454	319	450	54,514	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	46	32	615	74,439	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	692	447	506	61,213	ソフトウェア・サービス
XL GROUP PLC	165	125	473	57,231	保険
XCEL ENERGY INC	298	212	730	88,350	公益事業
KEYCORP	540	356	538	65,156	銀行
CARMAX INC	132	89	644	77,900	小売
ZIMMER HOLDINGS INC	101	70	800	96,825	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	96	69	262	31,778	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	264	181	1,707	206,559	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	425	286	1,983	239,939	小売
CA INC	186	137	435	52,707	ソフトウェア・サービス
CAMERON INTERNATIONAL CORP	141	82	421	50,992	エネルギー
CLOROX COMPANY	76	53	589	71,292	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	93	64	430	52,085	素材
CARNIVAL CORP	226	159	770	93,174	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	173	118	766	92,682	ソフトウェア・サービス
CHUBB CORP	150	97	972	117,657	保険
CONAGRA FOODS INC	248	176	681	82,427	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	175	122	746	90,261	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	524	341	715	86,588	銀行
STERICYCLE INC	51	35	484	58,625	商業・専門サービス
INTEL CORP	2,952	2,003	6,641	803,271	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	3,176	2,119	6,300	762,027	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	59	40	351	42,523	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	76	53	622	75,270	電気通信サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	259	181	2,625	317,503	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	713	503	1,006	121,754	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	181	128	805	97,376	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	162	126	541	65,495	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	409	285	715	86,590	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	128	86	893	108,116	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	118	83	402	48,632	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	422	283	2,963	358,394	耐久消費財・アパレル
AMGEN INC	448	315	5,153	623,317	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	107	74	369	44,668	銀行
NORTHERN TRUST CORP	133	93	709	85,796	各種金融
MICROSOFT CORP	4,708	3,243	15,434	1,866,628	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	54	38	344	41,651	ソフトウェア・サービス
STAPLES INC	382	267	439	53,106	小売
STARBUCKS CORP	444	620	3,188	385,573	消費者サービス
ORACLE CORP	2,165	1,468	6,508	787,114	ソフトウェア・サービス
ALTERA CORP	189	126	590	71,420	半導体・半導体製造装置
WHOLE FOODS MARKET INC	210	148	630	76,251	食品・生活必需品小売り
PETSMART INC	59	—	—	—	小売
NETFLIX INC	31	23	1,461	176,700	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	63	41	938	113,473	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	266	206	526	63,707	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
URBAN OUTFITTERS INC	67	44	155	18,756	小売
SKYWORKS SOLUTIONS INC	—	78	820	99,254	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	49	34	488	59,130	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	82	56	504	61,012	小売
LAM RESEARCH CORP	97	65	528	63,951	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	48	33	359	43,533	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,267	890	5,096	616,426	メディア
XILINX INC	158	108	506	61,315	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	210	146	958	115,955	資本財
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	85	57	303	36,752	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	910	624	6,909	835,641	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	111	67	441	53,341	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	22	15	758	91,771	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	160	112	1,159	140,244	ソフトウェア・サービス
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	280	172	981	118,669	メディア
NUANCE COMMUNICATIONS INC	144	108	184	22,340	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	195	136	684	82,830	ソフトウェア・サービス
YAHOO! INC	571	372	1,527	184,694	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	48	34	164	19,879	ヘルスケア機器・サービス
AUTODESK INC	133	93	540	65,362	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	123	102	544	65,881	メディア
SALESFORCE.COM INC	339	248	1,774	214,641	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	91	58	435	52,642	小売
GOOGLE INC-CL A	164	118	6,483	784,138	ソフトウェア・サービス
JOY GLOBAL INC	64	39	165	20,073	資本財
B/E AEROSPACE INC	59	43	269	32,608	資本財
GARMIN LTD	67	47	218	26,465	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE NAVIGATION LTD	152	106	261	31,565	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	1,003	688	4,794	579,857	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	164	92	327	39,580	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	92	64	315	38,193	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP	138	98	460	55,657	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	166	118	403	48,855	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	217	163	6,875	831,479	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	155	106	876	105,948	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	84	59	431	52,156	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	98	68	402	48,722	半導体・半導体製造装置
CERNER CORP	183	127	871	105,385	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC	—	61	383	46,323	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERTISIGN INC	83	47	307	37,192	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	93	118	659	79,798	電気通信サービス
BROADCOM CORP-CL A	305	224	1,060	128,227	半導体・半導体製造装置
EBAY INC	692	463	2,743	331,807	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	342	225	474	57,428	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	124	84	656	79,392	小売
PRICELINE GROUP INC/THE	30	21	2,631	318,219	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	660	478	7,011	848,023	各種金融
BB&T CORP	417	297	1,184	143,194	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	683	465	2,028	245,335	各種金融
BORGWARNER INC	136	94	573	69,365	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	160	114	365	44,173	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	62	42	504	61,015	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
TIME WARNER INC	537	347	2,977	360,044	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP	136	90	1,041	125,988	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	41	28	190	23,039	保険
AETNA INC	218	145	1,662	201,037	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	144	102	417	50,443	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	292	203	1,136	137,425	公益事業
AON PLC	168	112	1,138	137,659	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	390	266	1,398	169,122	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	61	39	220	26,634	保険
HESS CORP	180	111	754	91,300	エネルギー
CROWN CASTLE INTL CORP	198	138	1,159	140,271	不動産
JUNIPER NETWORKS INC	297	159	439	53,161	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	131	112	422	51,124	各種金融
RED HAT INC	112	77	606	73,333	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	45	30	389	47,158	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	129	91	623	75,362	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	105	73	568	68,740	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	200	130	460	55,689	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	—	62	679	82,124	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	228	157	223	27,043	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	140	97	3,865	467,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	75	58	1,189	143,820	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC	281	196	1,562	188,935	ソフトウェア・サービス
EQUINIX INC	30	—	—	—	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	139	100	1,291	156,202	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC	126	76	556	67,325	小売
CELGENE CORP	245	330	3,866	467,608	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CREE INC	72	50	156	18,889	半導体・半導体製造装置
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	357	252	1,640	198,372	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	478	304	2,698	326,296	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	124	80	383	46,394	運輸
FASTENAL CO	167	115	491	59,456	資本財
FISERV INC	152	100	816	98,698	ソフトウェア・サービス
FLEXTRONICS INTL LTD	368	238	298	36,083	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOSSIL GROUP INC	29	19	151	18,331	耐久消費財・アパレル
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,809	1,030	401	48,603	メディア
SANDISK CORP	134	90	611	73,994	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	534	2,429	31,605	3,822,315	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	93	64	333	40,333	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	—	332	381	46,097	銀行
SIGMA-ALDRICH	71	49	689	83,374	素材
SEARS HOLDINGS CORP	20	—	—	—	小売
NABORS INDUSTRIES LTD	176	106	159	19,293	エネルギー
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	116	82	1,329	160,832	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHLAND INC	43	27	350	42,422	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	89	60	390	47,245	運輸
CENTURYLINK INC	350	235	798	96,628	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	82	59	191	23,103	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	227	172	1,227	148,419	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	68	—	—	—	自動車・自動車部品
ONEOK INC	121	86	391	47,365	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC	192	132	1,004	121,454	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	—	201	159	19,235	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	194	135	746	90,329	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	88	59	546	66,135	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	42	29	458	55,434	小売
CONSOL ENERGY INC	134	95	295	35,701	エネルギー
NATIONAL OILWELL VARCO INC	253	177	888	107,399	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	97	69	836	101,145	食品・飲料・タバコ
CHESAPEAKE ENERGY CORP	318	223	325	39,400	エネルギー
PARTNERRE LTD	27	18	244	29,548	保険
COOPER COS INC/THE	—	19	363	44,012	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	89	63	557	67,464	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	93	128	743	89,899	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	69	44	221	26,843	保険
OWENS-ILLINOIS INC	90	67	172	20,907	素材
AGCO CORP	57	35	183	22,181	資本財
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	87	61	205	24,903	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP	83	58	768	92,943	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA INC	61	42	443	53,687	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	34	20	638	77,182	素材
HUDSON CITY BANCORP INC	275	201	194	23,573	銀行
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	316	263	1,335	161,509	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC	114	76	982	118,791	各種金融
TESORO CORP	78	52	478	57,901	エネルギー
FNF GROUP	144	104	401	48,540	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	67	46	1,109	134,191	各種金融
NASDAQ OMX GROUP/THE	71	48	252	30,507	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	97	69	547	66,172	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	233	148	972	117,596	メディア
AUTOLIV INC	56	37	480	58,073	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	167	122	474	57,446	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	18	12	816	98,801	消費者サービス
IHS INC-CLASS A	37	28	350	42,438	商業・専門サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	73	50	481	58,194	食品・飲料・タバコ
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	282	184	526	63,706	小売
ARROW ELECTRONICS INC	59	39	253	30,601	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	106	71	1,007	121,876	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	79	54	239	28,946	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP	180	130	316	38,277	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	26	23	367	44,420	素材
RANGE RESOURCES CORP	96	69	407	49,334	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO	207	159	427	51,658	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	51	36	420	50,880	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	35	25	333	40,307	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	66	46	287	34,717	公益事業
OCEANEERING INTL INC	65	43	224	27,137	エネルギー
WINDSTREAM HOLDINGS INC	357	—	—	—	電気通信サービス
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	78	50	440	53,221	消費者サービス
HANESBRANDS INC	—	164	528	63,906	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC-CLASS A	619	414	3,892	470,726	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	323	215	482	58,310	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	42	—	—	—	ソフトウェア・サービス
KBR INC	85	—	—	—	資本財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AVNET INC	80	57	261	31,661	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	175	132	615	74,465	素材
SPECTRA ENERGY CORP	395	277	996	120,481	エネルギー
TRANSDIGM GROUP INC	29	20	470	56,846	資本財
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	98	66	325	39,317	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	187	125	194	23,562	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	242	168	1,188	143,749	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COVIDIEN PLC	267	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	281	187	1,126	136,235	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	59	44	279	33,806	耐久消費財・アパレル
PRECISION CASTPARTS CORP	86	58	1,298	157,030	資本財
VMWARE INC-CLASS A	49	35	308	37,362	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	194	138	569	68,883	保険
TIME WARNER CABLE	167	116	1,835	221,983	メディア
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	36	25	388	47,029	小売
LKQ CORP	178	126	360	43,587	小売
HORMEL FOODS CORP	87	60	337	40,766	食品・飲料・タバコ
EASTMAN CHEMICAL CO	91	61	470	56,888	素材
GAMESTOP CORP-CLASS A	71	47	191	23,190	小売
HARRIS CORP	62	43	346	41,934	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	92	63	1,129	136,541	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP	104	70	303	36,708	エネルギー
NRG ENERGY INC	191	139	360	43,586	公益事業
INVESCO LTD	263	177	717	86,734	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	84	64	807	97,666	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	87	58	279	33,756	各種金融
TERADATA CORP	99	62	253	30,605	ソフトウェア・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	99	68	288	34,920	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	66	49	571	69,131	エネルギー
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	27	38	174	21,076	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	89	63	477	57,743	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	951	643	5,511	666,585	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	300	817	5,734	693,516	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	119	81	627	75,928	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N.V.	27	18	228	27,640	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP	248	170	598	72,340	エネルギー
FLOWSERVE CORP	83	56	316	38,299	資本財
HELMERICH & PAYNE	63	44	325	39,352	エネルギー
MDU RESOURCES GROUP INC	109	78	163	19,729	公益事業
ENERGEN CORP	43	30	212	25,747	エネルギー
T-MOBILE US INC	141	100	345	41,728	電気通信サービス
LORILLARD INC	219	149	1,073	129,770	食品・飲料・タバコ
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	50	31	214	25,974	メディア
RACKSPACE HOSTING INC	71	50	218	26,419	ソフトウェア・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	49	113	352	42,583	メディア
RESMED INC	84	58	330	40,028	ヘルスケア機器・サービス
AMETEK INC	147	101	556	67,272	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	80	53	346	41,936	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	81	55	466	56,429	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	55	39	350	42,365	運輸
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	48	33	247	29,970	公益事業
PERRIGO CO PLC	79	58	1,151	139,236	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
QUANTA SERVICES INC	124	89	262	31,691	資本財
FMC CORP	79	54	313	37,918	素材
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	73	50	449	54,368	食品・飲料・タバコ
WABTEC CORP	—	39	404	48,899	資本財
EVERSOURCE ENERGY	188	132	652	78,901	公益事業
NETSUITE INC	21	14	138	16,798	ソフトウェア・サービス
ACTAVIS PLC	103	156	4,656	563,109	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRGAS INC	39	27	289	34,976	素材
CROWN HOLDINGS INC	81	57	326	39,510	素材
CALPINE CORP	212	139	292	35,376	公益事業
EATON VANCE CORP	69	50	206	25,003	各種金融
DELTA AIR LINES INC	129	88	407	49,325	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	120	83	812	98,264	食品・飲料・タバコ
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	147	104	1,359	164,363	半導体・半導体製造装置
AMERICAN WATER WORKS CO INC	105	75	407	49,282	公益事業
CAREFUSION CORP	127	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
OCWEN FINANCIAL CORP	70	—	—	—	銀行
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	88	65	484	58,561	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	183	124	922	111,603	小売
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	54	38	233	28,240	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	17	11	391	47,314	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	111	76	353	42,776	銀行
QEP RESOURCES INC	107	69	137	16,615	エネルギー
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	580	422	227	27,468	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO	724	532	1,869	226,060	自動車・自動車部品
LYONDELLBASELL INDU-CL A	278	176	1,783	215,705	素材
HCA HOLDINGS INC	187	125	1,033	124,969	ヘルスケア機器・サービス
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	269	187	375	45,364	運輸
WHITING PETROLEUM CORP	69	85	282	34,223	エネルギー
ROCK-TENN COMPANY -CL A	43	57	380	45,968	素材
HOLLYFRONTIER CORP	111	78	335	40,543	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	178	116	1,209	146,304	エネルギー
ZILLOW GROUP INC - CL A	—	19	191	23,149	ソフトウェア・サービス
XYLEM INC	110	76	280	33,877	資本財
HERBALIFE LTD	50	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
TRIPADVISOR INC	68	48	392	47,452	小売
MEDIVATION INC	—	32	410	49,632	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	—	25	455	55,036	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	55	53	332	40,185	銀行
ALLEGHANY CORP	10	6	325	39,369	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	45	33	1,665	201,451	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	337	229	1,849	223,666	エネルギー
FACEBOOK INC-A	1,095	829	6,686	808,653	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP	157	116	398	48,251	公益事業
ALBEMARLE CORP	49	46	291	35,298	素材
PVH CORP	48	34	358	43,306	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A	59	44	868	105,066	ソフトウェア・サービス
KINDER MORGAN INC	402	745	3,197	386,677	エネルギー
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	173	122	123	14,880	エネルギー
NIELSEN NV	170	144	661	79,972	商業・専門サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	172	122	1,067	129,131	自動車・自動車部品
CHARTER COMMUNICATION-A	36	31	575	69,593	メディア

銘柄	株数	当期末			業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	86	66	363	43,955	資本財	
ADT CORP/THE	115	72	272	32,934	商業・専門サービス	
KRAFT FOODS GROUP INC	353	243	2,074	250,943	食品・飲料・タバコ	
OGE ENERGY CORP	120	83	265	32,150	公益事業	
POLARIS INDUSTRIES INC	38	26	370	44,845	耐久消費財・アパレル	
ABBVIE INC	945	659	4,337	524,635	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LIBERTY MEDIA CORP - A	58	38	144	17,472	メディア	
TESLA MOTORS INC	50	36	897	108,527	自動車・自動車部品	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	67	—	—	—	エネルギー	
CHENIERE ENERGY INC	121	93	708	85,640	エネルギー	
REALOGY HOLDINGS CORP	87	60	283	34,301	不動産	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	76	52	308	37,355	各種金融	
ZOETIS INC	297	207	983	118,972	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MALLINCKRODT PLC	—	48	621	75,186	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NEWS CORP - CLASS A	227	156	245	29,666	メディア	
SPRINT CORP	568	330	156	18,929	電気通信サービス	
SNAP-ON INC	—	24	378	45,830	資本財	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	114	85	518	62,669	耐久消費財・アパレル	
TWITTER INC	—	158	595	71,965	ソフトウェア・サービス	
VANTIV INC - CL A	83	60	245	29,676	ソフトウェア・サービス	
WORKDAY INC-CLASS A	50	41	372	45,102	ソフトウェア・サービス	
SERVICENOW INC	74	55	432	52,329	ソフトウェア・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	53	37	481	58,226	ヘルスケア機器・サービス	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	56	41	240	29,066	資本財	
PHARMACYCLICS INC	36	26	692	83,742	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	41	32	496	60,002	ソフトウェア・サービス	
GOOGLE INC-CL C	164	119	6,434	778,235	ソフトウェア・サービス	
NAVIENT CORP	261	172	332	40,224	各種金融	
ENDO INTERNATIONAL PLC	—	71	593	71,717	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UNITED RENTALS INC	—	41	426	51,569	資本財	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	—	75	361	43,749	運輸	
VOYA FINANCIAL INC	—	95	430	52,079	各種金融	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	—	19	138	16,711	素材	
ANTERO RESOURCES CORP	—	22	93	11,348	エネルギー	
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	—	28	192	23,325	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FIREEYE INC	—	34	141	17,097	ソフトウェア・サービス	
LIBERTY MEDIA CORP - C	—	87	329	39,899	メディア	
ALLY FINANCIAL INC	—	180	401	48,549	各種金融	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	—	204	603	73,018	消費者サービス	
JARDEN CORP	—	75	403	48,794	耐久消費財・アパレル	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	—	47	272	32,937	消費者サービス	
PALO ALTO NETWORKS INC	—	28	446	54,036	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SIGNET JEWELERS LTD	—	31	426	51,580	小売	
SYNCHRONY FINANCIAL	—	70	225	27,288	各種金融	
QORVO INC	—	60	485	58,685	半導体・半導体製造装置	
ISIS PHARMACEUTICALS INC	—	48	313	37,880	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	180,044	128,954	802,159	97,013,163	
	銘柄数<比率>	578	592	—	<60.3%>	
(カナダ)				千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA	854	597	4,781	472,495	銀行	
IMPERIAL OIL LTD	175	123	598	59,145	エネルギー	
THOMSON REUTERS CORP	221	149	742	73,385	メディア	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
TRANSCANADA CORP	421	294	1,592	157,409	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	214	151	642	63,522	電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	361	254	1,041	102,911	保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B	336	232	369	36,498	素材
BARRICK GOLD CORP	692	482	735	72,685	素材
BCE INC	152	59	314	31,116	電気通信サービス
AGRIUM INC	85	60	780	77,132	素材
BOMBARDIER INC-B	844	588	154	15,223	資本財
BANK OF MONTREAL	383	267	2,078	205,380	銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	330	358	1,593	157,437	不動産
BANK OF NOVA SCOTIA	716	504	3,289	325,079	銀行
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	189	132	3,680	363,699	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC	149	111	170	16,815	資本財
CAMECO CORP	234	164	323	31,942	エネルギー
CI FINANCIAL CORP	94	95	340	33,655	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	237	164	1,563	154,463	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	645	453	1,709	168,900	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	502	338	2,520	249,105	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	46	31	414	40,911	小売
ENBRIDGE INC	468	352	2,164	213,925	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	12	8	529	52,330	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	125	93	512	50,693	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	203	143	351	34,734	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	60	42	183	18,112	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	133	94	600	59,375	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,095	816	1,887	186,513	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	134	172	1,172	115,902	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	192	137	676	66,865	銀行
ONEX CORPORATION	54	36	251	24,895	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	511	344	1,381	136,486	素材
POWER CORP OF CANADA	207	155	511	50,500	保険
POWER FINANCIAL CORP	145	104	384	37,995	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	234	163	438	43,313	メディア
SUNCOR ENERGY INC	885	601	2,171	214,579	エネルギー
TRANSALTA CORP	157	113	123	12,182	公益事業
TALISMAN ENERGY INC	618	—	—	—	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	29	21	217	21,453	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	104	71	1,510	149,284	運輸
ENCANA CORP	441	318	511	50,593	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	101	88	349	34,584	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	104	70	175	17,369	資本財
GOLDCORP INC	482	337	767	75,796	素材
KINROSS GOLD CORP	667	472	141	13,992	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	89	63	276	27,324	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC	177	125	459	45,370	保険
METHANEX CORP	58	38	263	26,008	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	488	334	183	18,153	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	—	36	83	8,271	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	69	97	386	38,236	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	76	106	367	36,358	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	278	206	255	25,242	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELUS CORP	132	84	349	34,531	電気通信サービス

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	328	251	437	43,282	素材	
YAMANA GOLD INC	455	379	178	17,602	素材	
FORTIS INC	128	116	448	44,327	公益事業	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	246	173	813	80,436	食品・生活必需品小売り	
ELDORADO GOLD CORP	427	306	181	17,901	素材	
TORONTO-DOMINION BANK	1,092	763	4,279	422,916	銀行	
FRANCO-NEVADA CORP	85	65	422	41,789	素材	
SILVER WHEATON CORP	215	155	372	36,837	素材	
EMPIRE CO LTD 'A'	32	23	207	20,546	食品・生活必需品小売り	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	60	43	186	18,429	保険	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	71	52	190	18,833	公益事業	
METRO INC	53	105	375	37,136	食品・生活必需品小売り	
OPEN TEXT CORP	70	51	300	29,694	ソフトウェア・サービス	
INTACT FINANCIAL CORP	77	55	494	48,861	保険	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	236	177	508	50,287	エネルギー	
CENOVUS ENERGY INC	452	341	699	69,080	エネルギー	
TIM HORTONS INC	86	—	—	—	消費者サービス	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	187	—	—	—	エネルギー	
ATHABASCA OIL CORP	187	—	—	—	エネルギー	
MEG ENERGY CORP	86	64	119	11,852	エネルギー	
PENN WEST PETROLEUM LTD	281	—	—	—	エネルギー	
ARC RESOURCES LTD	185	131	297	29,424	エネルギー	
CANADIAN OIL SANDS LTD	292	205	226	22,344	エネルギー	
BAYTEX ENERGY CORP	75	72	145	14,407	エネルギー	
TOURMALINE OIL CORP	95	70	270	26,770	エネルギー	
ENERPLUS CORP	124	83	100	9,924	エネルギー	
NEW GOLD INC	308	227	91	9,017	素材	
PEMBINA PIPELINE CORP	185	140	563	55,726	エネルギー	
VERMILION ENERGY INC	58	45	244	24,168	エネルギー	
PENGROWTH ENERGY CORP	302	—	—	—	エネルギー	
CATAMARAN CORP	124	85	626	61,872	ヘルスクエア機器・サービス	
BELL ALIANT INC	42	—	—	—	電気通信サービス	
DOLLARAMA INC	40	53	376	37,206	小売	
KEYERA CORP	47	69	284	28,133	エネルギー	
ALTAGAS LTD	71	54	216	21,366	エネルギー	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	84	62	207	20,500	エネルギー	
ATCO LTD -CLASS I	45	33	145	14,348	公益事業	
FIRST CAPITAL REALTY INC	58	38	74	7,322	不動産	
INTER PIPELINE LTD	184	136	422	41,716	エネルギー	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	—	54	175	17,326	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	—	7	348	34,414	ソフトウェア・サービス	
CONSTELLATION SOFTWARE INC-RTS	—	8	0.208	20	ソフトウェア・サービス	
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	—	25	75	7,465	エネルギー	
RESTAURANT BRANDS INTERN	—	79	401	39,715	消費者サービス	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	—	28	191	18,903	素材	
小 計	株数・金額	23,581	16,269	64,782	6,401,812	
	銘柄数<比率>	93	93	—	<4.0%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
COMMERZBANK AG	577	440	556	74,838	銀行	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	603	570	1,687	227,084	各種金融	
METRO AG	75	66	212	28,589	食品・生活必需品小売り	
SIEMENS AG-REG	470	328	3,217	432,888	資本財	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
RWE AG	288	202	447	60,198	公益事業
BASF SE	545	380	3,361	452,318	素材
VOLKSWAGEN AG	17	12	284	38,268	自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	572	399	3,565	479,798	自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	106	73	797	107,243	家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE	1,072	829	1,162	156,469	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	196	137	1,471	197,974	自動車・自動車部品
BAYER AG-REG	491	342	4,710	633,757	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINDE AG	110	76	1,361	183,219	素材
ALLIANZ SE-REG	271	189	2,876	387,026	保険
MAN SE	21	14	134	18,124	資本財
CONTINENTAL AG	64	45	1,006	135,413	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	642	466	547	73,685	半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	91	63	544	73,230	自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	140	99	136	18,330	運輸
HUGO BOSS AG -ORD	19	27	304	40,916	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE POST AG-REG	539	401	1,151	154,922	運輸
SAP SE	547	381	2,634	354,509	ソフトウェア・サービス
CELESIO AG	24	22	59	7,991	ヘルスケア機器・サービス
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	129	91	435	58,644	メディア
DEUTSCHE BOERSE AG	114	80	595	80,184	各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	126	90	715	96,286	ヘルスケア機器・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	23	15	95	12,816	運輸
ADIDAS AG	124	87	664	89,460	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,716	1,315	2,227	299,766	電気通信サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	106	71	1,253	168,667	保険
THYSSENKRUPP AG	269	187	479	64,512	素材
BEIERSDORF AG	60	41	349	46,984	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	83	58	441	59,453	素材
MERCK KGAA	38	53	538	72,407	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOLKSWAGEN AG-PREF	85	67	1,570	211,355	自動車・自動車部品
SUEDZUCKER AG	46	—	—	—	食品・飲料・タバコ
LANXESS AG	50	38	199	26,889	素材
FRESENIUS SE & CO KGAA	74	157	898	120,894	ヘルスケア機器・サービス
SKY DEUTSCHLAND AG	260	—	—	—	メディア
HOCHTIEF AG	19	—	—	—	資本財
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	169	120	299	40,328	不動産
GEA GROUP AG	108	75	327	44,063	資本財
SYMRISE AG	—	51	300	40,378	素材
K+S AG-REG	104	70	214	28,864	素材
HENKEL AG & CO KGAA	76	48	442	59,514	家庭用品・パーソナル用品
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	62	50	223	30,110	ソフトウェア・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	32	22	177	23,871	自動車・自動車部品
HANNOVER RUECK SE	35	25	229	30,943	保険
BRENNTAG AG	30	63	360	48,478	資本財
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	13	9	119	16,062	メディア
AXEL SPRINGER SE	23	17	90	12,171	メディア
FUCHS PETROLUB SE -PREF	21	29	114	15,423	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	174	246	127	17,219	電気通信サービス
OSRAM LICHT AG	49	37	186	25,144	資本財

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		
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIE	—	141	436	58,797	不動産	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	11,724 53	8,933 52	46,350 —	6,236,497 <3.9%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	693	484	872	117,457	保険	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	36	91	94	12,729	銀行	
INTESA SANPAOLO	6,876	5,244	1,752	235,809	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	6,017	4,221	472	63,613	電気通信サービス	
ENI SPA	1,517	1,052	1,762	237,099	エネルギー	
UNICREDIT SPA	2,573	1,819	1,179	158,674	銀行	
ENEL SPA	3,909	2,731	1,184	159,438	公益事業	
SAIPEM SPA	157	108	134	18,075	エネルギー	
FIAT SPA	524	—	—	—	自動車・自動車部品	
ATLANTIA SPA	221	172	409	55,100	運輸	
INTESA SANPAOLO-RSP	—	397	116	15,643	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	98	69	420	56,587	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	307	246	233	31,459	各種金融	
SNAM SPA	1,211	868	398	53,634	公益事業	
TELECOM ITALIA-RSP	3,558	2,448	219	29,485	電気通信サービス	
BANCO POPOLARE SC	203	147	228	30,731	銀行	
FINMECCANICA SPA	237	164	189	25,548	資本財	
PIRELLI & C.	136	96	149	20,059	自動車・自動車部品	
UBI BANCA SCPA	509	359	273	36,790	銀行	
TERNA SPA	917	629	277	37,279	公益事業	
UNIPOLSAI SPA	527	369	92	12,436	保険	
PRYSMIAN SPA	122	85	180	24,229	資本財	
EXOR SPA	57	41	182	24,498	各種金融	
ENEL GREEN POWER SPA	1,023	754	130	17,625	公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	31,439 23	22,607 23	10,955 —	1,474,008 <0.9%>	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)	110	76	791	106,527	自動車・自動車部品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	150	115	1,918	258,185	耐久消費財・アパレル	
PEUGEOT SA	236	162	294	39,564	自動車・自動車部品	
AXA SA	1,062	752	1,780	239,548	保険	
DANONE	336	239	1,525	205,218	食品・飲料・タバコ	
CARREFOUR SA	363	228	713	95,973	食品・生活必需品小売り	
VIVENDI	712	502	1,131	152,266	メディア	
ALCATEL-LUCENT	1,655	1,161	399	53,696	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SOCIETE GENERALE SA	426	299	1,338	180,157	銀行	
AIR LIQUIDE SA	184	142	1,693	227,826	素材	
TOTAL SA	1,271	886	4,193	564,279	エネルギー	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	246	185	781	105,149	資本財	
ZODIAC AEROSPACE	103	76	257	34,685	資本財	
VINCI SA	285	195	1,076	144,787	資本財	
LAFARGE SA	111	76	497	66,877	素材	
SANOFI	709	494	4,518	608,005	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	215	176	339	45,711	公益事業	
L'OREAL	143	104	1,821	245,024	家庭用品・パーソナル用品	
ACCOR SA	93	87	448	60,339	消費者サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	327	217	1,519	204,482	資本財	
BNP PARIBAS	591	438	2,518	338,812	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	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ESSILOR INTERNATIONAL	121	84	937	126,090	ヘルスケア機器・サービス
CAP GEMINI	84	59	488	65,764	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	33	23	178	24,034	食品・生活必需品小売り
VALEO SA	44	31	485	65,341	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	—	10	380	51,182	耐久消費財・アパレル
VALLOUREC SA	63	44	101	13,707	資本財
SODEXO	56	39	365	49,224	消費者サービス
KERING	45	31	531	71,560	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	37	53	379	51,015	ソフトウェア・サービス
TECHNIP SA	61	42	258	34,812	エネルギー
CHRISTIAN DIOR SE	32	22	408	54,924	耐久消費財・アパレル
ATOS	41	33	240	32,395	ソフトウェア・サービス
ORANGE	1,096	768	1,141	153,632	電気通信サービス
CNP ASSURANCES	98	70	109	14,692	保険
IMERYS SA	19	14	95	12,899	素材
SAFRAN SA	160	121	788	106,053	資本財
RENAULT SA	114	79	766	103,169	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	108	77	595	80,115	メディア
LAGARDERE SCA	63	47	134	18,079	メディア
JC DECAUX SA	38	27	97	13,144	メディア
SOCIETE BIC SA	17	12	177	23,869	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	112	69	265	35,757	資本財
THALES SA	53	37	215	28,995	資本財
PERNOD RICARD SA	125	87	980	131,870	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	594	428	595	80,174	銀行
GDF SUEZ	788	600	1,098	147,750	公益事業
ALSTOM	127	89	256	34,446	資本財
ARKEMA	36	27	194	26,125	素材
LEGRAND SA	157	109	569	76,651	資本財
SCOR SE	91	64	205	27,670	保険
ADP	18	12	150	20,250	運輸
EDF	144	101	229	30,869	公益事業
CGG	100	—	—	—	エネルギー
NATIXIS	558	389	280	37,757	銀行
WENDEL	19	13	145	19,585	各種金融
BUREAU VERITAS SA	133	110	235	31,716	商業・専門サービス
EURAZEO	18	17	108	14,652	各種金融
EURAZEO-NEW	0.91	—	—	—	各種金融
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	164	124	224	30,180	公益事業
ILIAD SA	15	10	231	31,213	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	86	63	196	26,463	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	329	195	268	36,106	運輸
EDENRED	122	84	195	26,256	商業・専門サービス
REMY COINTREAU	14	10	71	9,606	食品・飲料・タバコ
REXEL SA	144	115	192	25,905	資本財
BOLLORE	—	360	187	25,233	運輸
NUMERICABLE-SFR	—	39	222	29,963	メディア
小 計	株 数	金 額	株 数	金 額	
	15,639	11,484	45,544	6,128,033	
	銘柄 数 < 比 率 >	65	66	—	< 3.8% >
(ユーロ…オランダ)					
QIAGEN N.V.	139	95	214	28,815	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV	555	387	309	41,619	資本財

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等		
		株 数	評 価 額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	—	373	522	70,263	自動車・自動車部品		
AIRBUS GROUP NV	347	243	1,531	206,079	資本財		
STMICROELECTRONICS NV	372	259	189	25,473	半導体・半導体製造装置		
GEMALTO	47	33	270	36,442	ソフトウェア・サービス		
WOLTERS KLUWER	178	124	357	48,110	メディア		
KONINKLIJKE KPN NV	1,902	1,322	461	62,050	電気通信サービス		
AKZO NOBEL	141	101	696	93,749	素材		
HEINEKEN NV	135	95	692	93,200	食品・飲料・タバコ		
KONINKLIJKE PHILIPS NV	565	386	963	129,675	資本財		
REED ELSEVIER NV	412	291	665	89,520	メディア		
AEGON NV	1,080	747	542	73,024	保険		
KONINKLIJKE AHOLD NV	557	368	688	92,660	食品・生活必需品小売り		
RANDSTAD HOLDING NV	74	52	287	38,626	商業・専門サービス		
HEINEKEN HOLDING NV	61	42	268	36,190	食品・飲料・タバコ		
KONINKLIJKE DSM NV	91	72	384	51,774	素材		
ING GROEP NV-CVA	2,280	1,598	2,374	319,506	銀行		
ASML HOLDING NV	213	145	1,450	195,144	半導体・半導体製造装置		
UNILEVER NV-CVA	968	674	2,649	356,521	食品・飲料・タバコ		
FUGRO NV-CVA	42	—	—	—	エネルギー		
VOPAK	40	29	131	17,638	エネルギー		
BOSKALIS WESTMINSTER	46	36	165	22,272	資本財		
DELTA LLOYD NV	113	85	146	19,739	保険		
TNT EXPRESS NV	259	182	139	18,775	運輸		
ZIGGO NV	89	—	—	—	電気通信サービス		
OCI NV	57	36	100	13,561	素材		
NN GROUP NV	—	64	168	22,714	保険		
小 計	株 数	金 額	10,774	7,850	16,374	2,203,153	
	銘柄数 < 比率 >		26	26	—	< 1.4% >	
(ユーロ…スペイン)							
BANCO POPULAR ESPANOL	987	748	356	48,028	銀行		
ENDESA SA	—	133	236	31,885	公益事業		
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	102	73	225	30,318	資本財		
IBERDROLA SA	2,853	2,142	1,356	182,531	公益事業		
TELEFONICA SA	2,438	1,852	2,448	329,394	電気通信サービス		
BANCO SANTANDER SA	7,039	5,953	4,001	538,373	銀行		
BANKINTER SA	—	273	193	26,082	銀行		
REPSOL SA	518	429	772	103,914	エネルギー		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,511	2,614	2,408	324,116	銀行		
GAS NATURAL SDG SA	211	146	330	44,524	公益事業		
INDITEX	129	451	1,339	180,273	小売		
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	233	169	280	37,699	運輸		
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS-RTS	233	—	—	—	運輸		
MAPFRE SA	633	386	127	17,206	保険		
FERROVIAL SA	240	174	353	47,552	資本財		
ZARDOYA OTIS SA	94	69	81	11,032	資本財		
ENAGAS SA	112	84	228	30,798	公益事業		
RED ELECTRICA CORPORACION SA	63	45	352	47,411	公益事業		
BANCO DE SABADELL SA	1,998	1,805	430	57,975	銀行		
CAIXABANK S. A	1,038	946	424	57,056	銀行		
GRIFOLS SA	87	60	227	30,646	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	225	186	789	106,204	ソフトウェア・サービス		
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	621	347	273	36,831	運輸		

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	339	251	185	24,980	食品・生活必需品小売り	
BANKIA SA	2,373	1,886	230	30,995	銀行	
AENA SA	—	24	235	31,686	運輸	
小計	株数・金額	26,089	21,256	17,893	2,407,520	
	銘柄数<比率>	23	25	—	<1.5%>	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS	134	92	315	42,493	保険	
UCB SA	65	52	334	44,944	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	477	333	3,703	498,263	食品・飲料・タバコ	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	47	33	255	34,424	各種金融	
DELHAIZE GROUP	59	42	356	48,009	食品・生活必需品小売り	
UMICORE	69	38	174	23,529	素材	
COLRUYT SA	45	29	124	16,721	食品・生活必需品小売り	
KBC GROEP NV	147	103	640	86,218	銀行	
SOLVAY SA	34	24	317	42,783	素材	
BELGACOM SA	87	63	207	27,983	電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	30	22	115	15,567	メディア	
小計	株数・金額	1,201	837	6,547	880,938	
	銘柄数<比率>	11	11	—	<0.5%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG	151	116	312	42,037	銀行	
OMV AG	89	62	168	22,688	エネルギー	
TELEKOM AUSTRIA AG	127	—	—	—	電気通信サービス	
VOESTALPINE AG	65	46	186	25,059	素材	
IMMOFINANZ AG	575	403	105	14,234	不動産	
ANDRITZ AG	42	31	176	23,791	資本財	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	70	47	71	9,593	銀行	
VIENNA INSURANCE GROUP AG	24	17	62	8,380	保険	
小計	株数・金額	1,145	723	1,083	145,787	
	銘柄数<比率>	8	7	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP	22	16	136	18,344	メディア	
TENARIS SA	276	194	259	34,891	エネルギー	
SES	179	125	400	53,853	メディア	
ARCELORMITTAL	589	415	418	56,352	素材	
ALTICE SA	—	36	418	56,320	メディア	
小計	株数・金額	1,068	788	1,633	219,764	
	銘柄数<比率>	4	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ	2,213	1,550	979	131,855	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STORA ENSO OYJ-R SHS	333	226	216	29,185	素材	
NOKIAN RENKAAT OYJ	65	47	152	20,560	自動車・自動車部品	
UPM-KYMMENE OYJ	309	223	369	49,742	素材	
FORTUM OYJ	263	186	333	44,845	公益事業	
KONE OYJ-B	184	129	510	68,746	資本財	
METSO OYJ	75	47	125	16,870	資本財	
SAMPO OYJ-A SHS	265	185	827	111,386	保険	
WARTSILA OYJ ABP	104	61	253	34,064	資本財	
ELISA OYJ	81	60	164	22,114	電気通信サービス	
NESTE OIL OYJ	79	53	122	16,486	エネルギー	

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フィンランド) ORION OYJ-CLASS B	百株 60	百株 40	千ユーロ 121	千円 16,410	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	4,037 12	2,813 12	4,178 -	562,268 < 0.3% >	
(ユーロ…アイルランド) KERRY GROUP PLC-A BANK OF IRELAND CRH PLC	90 13,519 439	67 11,576 342	451 421 882	60,814 56,697 118,791	食品・飲料・タバコ 銀行 素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	14,049 3	11,986 3	1,756 -	236,304 < 0.1% >	
(ユーロ…ポルトガル) EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA JERONIMO MARTINS PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R BANCO ESPIRITO SANTO-REG GALP ENERGIA SGPS SA	1,192 149 379 -	973 105 -	351 138 -	47,251 18,602 -	公益事業 食品・生活必需品小売り 電気通信サービス 銀行 銀行 エネルギー	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	2,983 5	15,990 4	809 -	108,879 < 0.1% >	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	120,152 233	105,272 234	153,126 -	20,603,156 < 12.8% >	
(イギリス) BARCLAYS PLC BP PLC LLOYDS BANKING GROUP PLC ASTRAZENECA PLC SMITHS GROUP PLC NEXT PLC DIAGEO PLC SKY PLC BAE SYSTEMS PLC UNILEVER PLC TESCO PLC REED ELSEVIER PLC MARKS & SPENCER GROUP PLC RECKITT BENCKISER GROUP PLC PRUDENTIAL PLC BG GROUP PLC LEGAL & GENERAL GROUP PLC SAGE GROUP PLC/THE HSBC HOLDINGS PLC BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC UNITED UTILITIES GROUP PLC SCHRODERS PLC ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP BHP BILLITON PLC IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC WPP PLC CENTRICA PLC BT GROUP PLC SSE PLC STANDARD CHARTERED PLC ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	9,096 11,065 29,690 745 236 92 1,487 612 1,914 763 4,822 695 970 385 1,515 2,025 3,522 663 11,121 1,121 409 58 1,282 1,254 572 795 3,024 4,696 576 1,441 1,114	6,813 7,555 23,650 523 163 63 1,040 427 1,303 531 3,362 472 675 267 1,063 1,413 2,463 441 7,948 772 287 51 1,047 874 396 544 2,056 3,373 410 1,023 780	千イギリスポンド 1,789 3,417 2,081 2,303 189 472 1,889 466 663 1,541 743 531 395 1,566 1,775 1,631 665 252 4,901 2,809 288 174 364 1,228 1,295 861 580 1,573 695 1,080 787	335,533 640,693 390,174 431,823 35,595 88,515 354,150 87,405 124,369 288,946 139,385 99,630 74,177 293,650 332,902 305,866 124,670 47,254 918,901 526,753 54,120 32,756 68,409 230,386 242,811 161,529 108,896 294,982 130,413 202,573 147,712	銀行 エネルギー 銀行 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス 資本財 小売 食品・飲料・タバコ メディア 資本財 食品・飲料・タバコ 食品・生活必需品小売り メディア 小売 家庭用品・パーソナル用品 保険 エネルギー 保険 ソフトウェア・サービス 銀行 食品・飲料・タバコ 公益事業 各種金融 銀行 素材 食品・飲料・タバコ メディア 公益事業 電気通信サービス 公益事業 銀行 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	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF C	153,450	112,001	11	2,099	資本財
COMPASS GROUP PLC	1,061	690	805	150,953	消費者サービス
KINGFISHER PLC	1,412	971	352	66,126	小売
PEARSON PLC	486	339	454	85,217	メディア
SEVERN TRENT PLC	144	101	221	41,597	公益事業
RIO TINTO PLC	755	526	1,500	281,215	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,885	2,013	2,904	544,455	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SABMILLER PLC	571	400	1,463	274,400	食品・飲料・タバコ
3I GROUP PLC	584	404	221	41,571	各種金融
GKN PLC	967	685	251	47,069	自動車・自動車部品
VODAFONE GROUP PLC	15,704	10,978	2,487	466,395	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	1,324	872	157	29,598	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	738	504	133	25,032	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	1,747	1,657	894	167,770	保険
CAPITA PLC	392	273	346	65,014	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC	—	408	190	35,786	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	121	84	288	54,072	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	609	420	185	34,819	保険
WHITBREAD PLC	108	75	400	75,137	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	2,223	1,564	1,408	264,012	公益事業
ARM HOLDINGS PLC	826	582	655	122,869	半導体・半導体製造装置
WOLSELEY PLC	156	108	437	81,959	資本財
SERCO GROUP PLC	300	—	—	—	商業・専門サービス
LONMIN PLC	—	49	6	1,288	素材
BUNZL PLC	196	137	263	49,369	資本財
COBHAM PLC	628	468	138	26,049	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	824	576	611	114,687	素材
INTERTEK GROUP PLC	95	66	176	33,161	商業・専門サービス
WILLIAM HILL PLC	525	356	144	27,103	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	265	184	333	62,606	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	155	98	274	51,521	消費者サービス
CARNIVAL PLC	110	76	246	46,159	消費者サービス
PERSIMMON PLC	181	127	242	45,425	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	470	335	172	32,398	資本財
ICAP PLC	336	223	124	23,339	各種金融
ITV PLC	2,258	1,586	428	80,387	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	105	130	323	60,615	各種金融
G4S PLC	907	643	189	35,476	商業・専門サービス
AMEC FOSTER WHEELER PLC	173	159	145	27,279	エネルギー
IMI PLC	161	111	135	25,382	資本財
REXAM PLC	472	287	164	30,748	素材
SMITH & NEPHEW PLC	533	372	423	79,367	ヘルスケア機器・サービス
TATE & LYLE PLC	273	196	120	22,545	食品・飲料・タバコ
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,289	1,619	3,191	598,344	エネルギー
PETROFAC LTD	151	110	97	18,260	エネルギー
TRAVIS PERKINS PLC	143	102	222	41,776	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,472	1,010	2,021	379,023	エネルギー
OLD MUTUAL PLC	2,913	2,024	477	89,585	保険
INVESTEC PLC	348	226	141	26,596	各種金融
STANDARD LIFE PLC	1,412	815	400	75,116	保険
EXPERIAN PLC	592	412	515	96,570	商業・専門サービス
TUI TRAVEL PLC	262	—	—	—	消費者サービス

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
WEIR GROUP PLC/THE	125	87	167	31,392	資本財	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	212	146	434	81,527	食品・飲料・タバコ	
ANTOFAGASTA PLC	236	159	123	23,225	素材	
TULLOW OIL PLC	535	371	150	28,279	エネルギー	
SHIRE PLC	348	244	1,339	251,155	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INMARSAT PLC	261	175	172	32,281	電気通信サービス	
ADMIRAL GROUP PLC	115	82	123	23,133	保険	
FRESNILLO PLC	113	91	69	13,108	素材	
RANDGOLD RESOURCES LTD	51	36	176	33,128	素材	
FRIENDS LIFE GROUP LTD	856	—	—	—	保険	
AGGREKO PLC	157	105	172	32,374	商業・専門サービス	
BABCOCK INTL GROUP PLC	296	105	116	21,842	商業・専門サービス	
GLENCORE PLC	6,304	4,605	1,333	250,071	素材	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	577	382	168	31,499	各種金融	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	122	99	127	23,883	各種金融	
CRODA INTERNATIONAL PLC	80	55	157	29,573	素材	
MELROSE INDUSTRIES PLC	630	423	112	21,066	資本財	
COCA-COLA HBC AG-CDI	116	81	120	22,645	食品・飲料・タバコ	
EASYJET PLC	101	67	113	21,286	運輸	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	646	613	200	37,548	保険	
ASOS PLC	32	—	—	—	小売	
ROYAL MAIL PLC	390	264	132	24,784	運輸	
ASHTREAD GROUP PLC	—	206	247	46,399	資本財	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	—	113	75	14,070	小売	
MERLIN ENTERTAINMENT	—	291	137	25,691	消費者サービス	
TUI AG-DI	—	187	229	42,977	消費者サービス	
SOUTH32 LTD-W/I	—	874	103	19,342	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	314,921 103	229,853 106	72,836 —	13,654,649 < 8.5% >	
(スイス)			千スイスフラン			
NESTLE SA-REG	1,913	1,335	9,804	1,264,287	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	310	215	1,848	238,363	耐久消費財・アパレル	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	899	631	1,554	200,391	各種金融	
HOLCIM LTD-REG	135	94	710	91,642	素材	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	417	291	8,098	1,044,341	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GIVAUDAN-REG	5	3	683	88,170	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	30	22	305	39,410	ヘルスケア機器・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	88	61	1,887	243,332	保険	
SYNGENTA AG-REG	55	38	1,567	202,186	素材	
LONZA GROUP AG-REG	31	22	295	38,163	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	25	20	166	21,440	耐久消費財・アパレル	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	27	18	303	39,173	資本財	
GEBERIT AG-REG	22	15	531	68,557	資本財	
SWISS RE AG	209	145	1,214	156,562	保険	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	18	12	513	66,178	耐久消費財・アパレル	
PARGESA HOLDING SA-BR	15	12	82	10,666	各種金融	
NOVARTIS AG-REG	1,364	952	9,295	1,198,672	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO SA-REG	78	70	534	68,943	商業・専門サービス	
UBS AG-REG	2,163	—	—	—	各種金融	
SWISSCOM AG-REG	13	9	532	68,670	電気通信サービス	
ABB LTD-REG	1,307	909	1,858	239,692	資本財	
SGS SA-REG	3	2	414	53,385	商業・専門サービス	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円		
SULZER AG-REG	14	9	105	13,601	資本財	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	12	8	145	18,784	資本財	
ACTELION LTD-REG	60	42	570	73,540	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	32	22	309	39,859	運輸	
BALOISE HOLDING AG - REG	27	20	245	31,616	保険	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	19	13	309	39,850	保険	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.06	0.04	242	31,223	食品・飲料・タバコ	
ARYZTA AG	52	35	226	29,268	食品・飲料・タバコ	
JULIUS BAER GROUP LTD	131	92	466	60,138	各種金融	
SIKA AG-BR	1	0.9	286	36,905	素材	
TRANSOCEAN LTD	216	151	270	34,886	エネルギー	
SWISS PRIME SITE-REG	32	24	201	26,047	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.5	0.42	216	27,918	食品・飲料・タバコ	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	10	7	206	26,650	各種金融	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	0.9	101	13,056	食品・飲料・タバコ	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	4	3	141	18,280	素材	
UBS GROUP AG-REG	—	1,512	2,997	386,476	各種金融	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,757 38	6,834 38	49,246 —	6,350,338 <3.9%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ			
ELECTROLUX AB-SER B	139	100	2,616	37,894	耐久消費財・アパレル	
ERICSSON LM-B SHS	1,812	1,259	11,969	173,317	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ATLAS COPCO AB-B SHS	232	161	3,628	52,540	資本財	
ATLAS COPCO AB- B REDEMPTION	—	161	97	1,405	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	898	631	6,444	93,309	銀行	
INVESTOR AB-B SHS	272	187	6,265	90,722	各種金融	
NORDEA BANK AB	1,795	1,256	13,705	198,448	銀行	
GETINGE AB-B SHS	119	81	1,680	24,338	ヘルスケア機器・サービス	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	295	623	7,878	114,077	銀行	
ATLAS COPCO AB-A SHS	395	277	6,971	100,947	資本財	
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	—	277	165	2,393	資本財	
SKF AB-B SHARES	234	165	3,409	49,368	資本財	
ASSA ABLOY AB-B	197	137	6,909	100,046	資本財	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	566	392	13,292	192,479	小売	
SANDVIK AB	641	439	4,442	64,330	資本財	
SWEDBANK AB - A SHARES	534	373	7,277	105,375	銀行	
SECURITAS AB-B SHS	187	133	1,532	22,197	商業・専門サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	348	244	5,429	78,621	家庭用品・パーソナル用品	
SKANSKA AB-B SHS	222	158	2,799	40,533	資本財	
SWEDISH MATCH AB	121	82	2,054	29,749	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	186	130	1,458	21,125	電気通信サービス	
TELIASONERA AB	1,418	1,079	5,614	81,293	電気通信サービス	
VOLVO AB-B SHS	911	633	7,233	104,737	資本財	
ALFA LAVAL AB	184	128	2,042	29,581	資本財	
ELEKTA AB-B SHS	217	155	934	13,536	ヘルスケア機器・サービス	
LUNDIN PETROLEUM AB	132	90	1,193	17,277	エネルギー	
BOLIDEN AB	158	113	2,076	30,072	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	247	166	1,066	15,449	耐久消費財・アパレル	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	39	26	1,715	24,843	電気通信サービス	
HEXAGON AB-B SHS	144	106	3,337	48,327	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	131	98	2,641	38,254	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	74	68	1,162	16,834	各種金融	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円		
ICA GRUPPEN AB	—	32	979	14,184	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額	12,860	9,980	140,028	2,027,615	
	銘柄数<比率>	30	33	—	<1.3%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	582	403	5,612	89,919	銀行	
NORSK HYDRO ASA	803	558	2,084	33,387	素材	
ORKLA ASA	445	334	2,036	32,616	食品・飲料・タバコ	
STATOIL ASA	666	461	6,944	111,244	エネルギー	
TELENOR ASA	403	310	5,540	88,755	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	105	74	2,946	47,198	素材	
SUBSEA 7 SA	157	117	976	15,642	エネルギー	
SEADRILL LTD	221	161	1,547	24,782	エネルギー	
AKASTOR ASA	100	—	—	—	エネルギー	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	118	84	1,076	17,251	保険	
小計	株数・金額	3,604	2,505	28,763	460,799	
	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	1,183	832	31,804	573,744	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	132	99	3,137	56,609	素材	
DANSKE BANK A/S	390	272	5,352	96,563	銀行	
WILLIAM DEMANT HOLDING	14	8	502	9,063	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	—	93	3,138	56,626	資本財	
TDC A/S	478	334	1,648	29,742	電気通信サービス	
CARLSBERG AS-B	63	44	2,835	51,159	食品・飲料・タバコ	
COLOPLAST-B	65	46	2,404	43,377	ヘルスケア機器・サービス	
DSV A/S	106	76	1,772	31,976	運輸	
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	3	3	4,020	72,520	運輸	
TRYG A/S	14	41	611	11,033	保険	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	1	1	2,063	37,231	運輸	
PANDORA A/S	—	48	3,378	60,950	耐久消費財・アパレル	
ISS A/S	—	52	1,204	21,724	商業・専門サービス	
小計	株数・金額	2,456	1,955	63,876	1,152,324	
	銘柄数<比率>	11	14	—	<0.7%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
BHP BILLITON LIMITED	1,909	1,331	3,944	377,203	素材	
CSL LTD	289	196	1,742	166,649	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALUMINA LTD	1,496	1,063	182	17,485	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	390	308	1,059	101,315	エネルギー	
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,633	1,144	3,661	350,177	銀行	
RIO TINTO LTD	260	180	1,038	99,297	素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD	731	566	786	75,186	保険	
LEND LEASE GROUP	324	232	372	35,608	不動産	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	958	672	5,574	533,079	銀行	
WESTPAC BANKING CORP	1,849	1,290	4,165	398,359	銀行	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,399	1,049	3,534	337,956	銀行	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-RTS	—	79	41	3,935	銀行	
BRAMBLES LTD	925	651	707	67,667	商業・専門サービス	
QANTAS AIRWAYS LTD	643	242	85	8,184	運輸	
BORAL LTD	454	342	215	20,588	素材	
WOOLWORTHS LTD	745	523	1,470	140,626	食品・生活必需品小売り	
TELSTRA CORP LTD	2,597	1,780	1,091	104,373	電気通信サービス	
AMP LTD	1,776	1,243	782	74,810	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	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
TABCORP HOLDINGS LTD	444	355	162	15,520	消費者サービス
AMCOR LIMITED	725	508	705	67,436	素材
COMPUTERSHARE LTD	281	204	248	23,802	ソフトウェア・サービス
MACQUARIE GROUP LTD	173	119	946	90,534	各種金融
CIMIC GROUP LTD	60	44	99	9,515	資本財
ASX LTD	117	82	340	32,587	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	347	246	246	23,603	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	33	24	193	18,498	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	271	189	285	27,301	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	353	241	107	10,311	小売
NEWCREST MINING LTD	448	322	465	44,562	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,387	974	540	51,644	保険
ORIGIN ENERGY LTD	656	462	583	55,766	エネルギー
ORICA LTD	224	156	327	31,325	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	235	159	306	29,353	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	580	408	330	31,570	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	769	541	712	68,113	保険
TRANSURBAN GROUP	1,046	760	757	72,464	運輸
WESFARMERS LTD	679	466	2,037	194,833	食品・生活必需品小売り
TOLL HOLDINGS LTD	407	—	—	—	運輸
SYDNEY AIRPORT	654	484	253	24,241	運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD	80	111	370	35,386	エネルギー
WORLEYPARSONS LTD	121	89	92	8,831	エネルギー
AGL ENERGY LTD	332	287	426	40,779	公益事業
TATTS GROUP LTD	866	618	244	23,404	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	935	645	143	13,693	素材
ASCIANO LTD	581	410	263	25,203	運輸
ILUKA RESOURCES LTD	256	179	154	14,751	素材
AUSNET SERVICES	1,077	832	122	11,704	公益事業
CROWN RESORTS LTD	242	156	196	18,838	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD	955	690	261	24,969	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	254	193	233	22,353	銀行
METCASH LTD	540	—	—	—	食品・生活必需品小売り
AURIZON HOLDINGS LTD	1,230	891	460	44,002	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	378	268	141	13,526	食品・飲料・タバコ
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	443	—	—	—	消費者サービス
ALS LTD	236	170	101	9,727	商業・専門サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	77	55	356	34,127	ヘルスケア機器・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	32	24	112	10,801	消費者サービス
SEEK LTD	195	139	221	21,211	商業・専門サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	196	155	201	19,252	銀行
REA GROUP LTD	31	23	99	9,482	メディア
TPG TELECOM LTD	—	120	106	10,160	電気通信サービス
HEALTHSCOPE LTD	—	476	131	12,540	ヘルスケア機器・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	—	1,146	240	23,019	保険
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	—	100	73	6,996	各種金融
SOUTH32 LTD	—	1,331	310	29,661	素材
小 計	株 数	金 額	株 数	金 額	
	59	28,774	62	45,173	4,319,923
	銘柄 数 < 比率 >	—	—	—	< 2.7% >
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,098	749	211	18,793	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	577	392	181	16,179	運輸

銘柄	株数	期首(前期末)			業種等
		株数	当 期 末		
			株数	評 価 額	
		株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランドドル	千円	
CONTACT ENERGY LTD	206	170	96	8,586	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD	398	284	248	22,120	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD	228	163	132	11,778	ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD	—	544	126	11,230	公益事業
MIGHTY RIVER POWER	—	307	91	8,129	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	2,510	2,612	1,089	96,819
	銘柄 数 < 比 率 >	5	7	—	< 0.1% >
(香港)			千香港ドル		
WHARF HOLDINGS LTD	890	630	3,468	54,103	不動産
HUTCHISON WHAMPOA LTD	1,270	880	10,102	157,597	資本財
SWIRE PACIFIC LTD-A	395	260	2,732	42,628	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	820	575	9,694	151,234	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	950	700	9,184	143,270	不動産
MTR CORP	875	620	2,383	37,188	運輸
HONG KONG & CHINA GAS	3,452	2,627	4,913	76,647	公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT	2,930	2,130	2,274	35,487	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	835	575	4,390	68,485	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	658	460	13,284	207,242	各種金融
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	700	510	1,009	15,752	運輸
HOPEWELL HOLDINGS LTD	340	—	—	—	資本財
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,350	920	2,323	36,238	不動産
CLP HOLDINGS LTD	1,070	790	5,403	84,296	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	627	433	2,734	42,657	不動産
BANK OF EAST ASIA	737	479	1,626	25,368	銀行
HANG SENG BANK LTD	457	316	4,958	77,345	銀行
HYSAN DEVELOPMENT CO	370	260	938	14,642	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD	960	460	561	8,754	消費者サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	138	97	842	13,149	半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO	1,762	1,222	1,698	26,497	不動産
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	415	310	881	13,758	耐久消費財・アパレル
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	380	260	1,665	25,978	公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,190	1,545	4,743	73,993	銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	—	570	1,547	24,141	耐久消費財・アパレル
PCCW LTD	2,380	1,660	844	13,181	電気通信サービス
LI & FUNG LTD	3,444	2,424	1,774	27,680	耐久消費財・アパレル
KERRY PROPERTIES LTD	375	260	846	13,202	不動産
NWS HOLDINGS LTD	920	650	865	13,506	資本財
SANDS CHINA LTD	1,444	1,012	3,208	50,045	消費者サービス
WHEELOK & CO LTD	540	380	1,656	25,846	不動産
WYNN MACAU LTD	904	656	1,018	15,882	消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD	1,170	820	839	13,099	消費者サービス
FIRST PACIFIC CO	1,400	1,000	730	11,388	各種金融
ATA GROUP LTD	7,156	4,990	25,948	404,788	保険
SWIRE PROPERTIES LTD	664	478	1,290	20,133	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,260	970	3,627	56,593	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	564	384	578	9,021	消費者サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,270	1,080	1,101	17,184	電気通信サービス
WH GROUP LTD	—	1,570	940	14,670	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	48,062	35,964	138,633	2,162,687
	銘柄 数 < 比 率 >	38	39	—	< 1.3% >
(シンガポール)			千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,550	1,247	1,299	117,658	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	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	1,012	702	292	26,525	メディア
KEPPEL LAND LTD	430	—	—	—	不動産
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	600	422	175	15,896	資本財
CAPITALAND LTD	1,550	1,100	396	35,857	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	240	180	184	16,722	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	60	44	178	16,128	小売
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,030	721	1,517	137,428	銀行
KEPPEL CORP LTD	868	603	532	48,213	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	760	537	1,302	117,916	銀行
SINGAPORE TECH ENGINEERING	990	686	246	22,362	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,757	3,317	1,430	129,487	電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	341	241	279	25,312	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	530	340	295	26,723	各種金融
SEMBCORP MARINE LTD	510	350	105	9,507	資本財
UOL GROUP LTD	289	199	148	13,478	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,310	890	267	24,257	運輸
NOBLE GROUP LTD	2,643	1,786	151	13,751	資本財
STARHUB LTD	370	270	113	10,317	電気通信サービス
OLAM INTERNATIONAL LTD	840	—	—	—	食品・生活必需品小売り
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	4,143	2,890	121	10,993	食品・飲料・タバコ
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,180	840	275	24,948	食品・飲料・タバコ
GENTING SINGAPORE PLC	3,740	2,510	237	21,478	消費者サービス
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	1,880	1,310	357	32,383	不動産
CAPITAMALLS ASIA LTD	750	—	—	—	不動産
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	1,130	840	119	10,838	資本財
小 計	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	33,506	22,028	10,029	908,186	
	銘柄数 < 比率 >	26	23	—	< 0.6% >
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
ISRAEL CHEMICALS LTD	266	184	517	16,162	素材
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	504	356	8,405	262,583	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANK HAPOALIM BM	629	441	891	27,841	銀行
NICE SYSTEMS LTD	34	24	626	19,573	ソフトウェア・サービス
BANK LEUMI LE-ISRAEL	749	545	832	26,010	銀行
ISRAEL CORP LIMITED/THE	1	1	179	5,606	素材
DELEK GROUP LTD	2	1	216	6,754	エネルギー
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	1,133	780	524	16,385	電気通信サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	75	59	267	8,359	銀行
小 計	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	3,398	2,394	12,460	389,277	
	銘柄数 < 比率 >	9	9	—	< 0.2% >
合 計	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	792,209	593,398	—	155,540,755	
	銘柄数 < 比率 >	1,233	1,259	—	< 96.7% >

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

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

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		比 率	
	口 数	口 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
HCP INC	27	18	752	91,027	0.1	
MACERICH CO/THE	8	5	485	58,681	0.0	
PROLOGIS INC	29	20	836	101,196	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST	5	3	271	32,799	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	7	5	371	44,958	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3	2	592	71,670	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3	2	380	46,045	0.0	
HEALTH CARE REIT INC	17	14	1,025	124,079	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	9	6	845	102,213	0.1	
REALTY INCOME CORP	13	9	431	52,198	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	5	3	249	30,171	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	5	4	482	58,317	0.0	
UDR INC	14	10	350	42,354	0.0	
VENTAS INC	17	13	925	111,985	0.1	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	55	38	393	47,591	0.0	
RAYONIER INC	7	5	137	16,682	0.0	
WEYERHAEUSER CO	34	21	703	85,021	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	23	17	1,659	200,733	0.1	
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	22	14	294	35,671	0.0	
AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	44	37	348	42,109	0.0	
DUKE REALTY CORP	19	14	285	34,496	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	—	6	259	31,408	0.0	
EQUINIX INC	—	2	598	72,420	0.0	
COMMUNICATIONS SALES & LE	—	4	126	15,252	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL	20	14	1,063	128,617	0.1	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	32	22	631	76,388	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	44	31	648	78,376	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	8	6	226	27,394	0.0	
PLUM CREEK TIMBER CO	10	7	308	37,309	0.0	
PUBLIC STORAGE	8	6	1,197	144,824	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	18	12	2,369	286,509	0.2	
VORNADO REALTY TRUST	9	7	717	86,756	0.1	
KIMCO REALTY CORP	24	17	420	50,863	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	7	5	915	110,725	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	560	414	21,306	2,576,855	
	銘柄 数 < 比 率 >	31	34	—	< 1.6% >	
(カナダ)				千カナダドル		
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	7	5	122	12,108	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8	6	188	18,646	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	16	11	311	30,754	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA	1	1	143	19,327	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	
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
KLEPIERRE		5	7	307	41,358	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		5	4	1,003	135,054	0.1
FONCIERE DES REGIONS		1	1	106	14,303	0.0
ICADE		2	1	110	14,915	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	16	15	1,671	224,959	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…オランダ)						
CORIO NV		3	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	3	—	—	—	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	—	—	<—%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	20	15	1,671	224,959	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	5	—	<0.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		56	39	352	66,155	0.0
HAMMERSON PLC		41	32	230	43,250	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		46	32	448	84,074	0.1
INTU PROPERTIES PLC		50	38	135	25,338	0.0
SEGRO PLC		45	30	128	24,176	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	239	173	1,296	242,995	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.2%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
FEDERATION CENTRES		89	61	184	17,678	0.0
WESTFIELD RETAIL TRUST		177	—	—	—	—
SCENTRE GROUP		—	221	858	82,086	0.1
NOVION PROPERTY GROUP		126	88	221	21,227	0.0
GPT GROUP		102	70	310	29,687	0.0
MIRVAC GROUP		225	156	303	29,020	0.0
STOCKLAND		138	99	423	40,532	0.0
WESTFIELD CORP		118	82	746	71,382	0.0
DEXUS PROPERTY GROUP		333	39	290	27,800	0.0
GOODMAN GROUP		103	73	455	43,530	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,416	890	3,795	362,947	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.2%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		137	94	4,446	69,361	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	137	94	4,446	69,361	
	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		—	101	180	16,389	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		120	87	142	12,919	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		155	103	227	20,611	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		
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポールドル	千円	%
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		123	88	220	19,921	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	398	379	771	69,842	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	4	—	< 0.0% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	2,788	1,979	—	3,577,715	
	銘柄 数 < 比 率 >	57	60	—	< 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
		百万円	百万円
外 国	株式先物取引		
	SP EMINI	899	—
	SP/TSE60	52	—
	SWISS IX	47	—
	EURO ST	206	—
	SPI 200	94	—
	FTSE100	104	—

(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

(2015年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	155,540,755	96.2
投資証券	3,577,715	2.2
コール・ローン等、その他	2,482,967	1.6
投資信託財産総額	161,601,437	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (161,083,618千円) の投資信託財産総額 (161,601,437千円) 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=120.94円	1 カナダドル=98.82円	1 ユーロ=134.55円	1 イギリスポンド=187.47円
1 スイスフラン=128.95円	1 スウェーデンクローネ=14.48円	1 ノルウェークローネ=16.02円	1 デンマーククローネ=18.04円
1 オーストラリアドル=95.63円	1 ニュージーランドドル=88.90円	1 香港ドル=15.60円	1 シンガポールドル=90.55円
1 イスラエルシェケル=31.24円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	162,096,560,893
コール・ローン等	1,244,334,000
株式(評価額)	155,540,755,862
投資証券(評価額)	3,577,715,385
未収入金	609,331,334
未収配当金	346,762,283
未収利息	751
差入委託証拠金	777,661,278
(B) 負債	1,192,829,136
未払金	515,717,831
未払解約金	677,111,305
(C) 純資産総額(A-B)	160,903,731,757
元本	79,173,628,594
次期繰越損益金	81,730,103,163
(D) 受益権総口数	79,173,628,594口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,323円

<注記事項>

①期首元本額	115,937,566,615円
期中追加設定元本額	6,419,108,216円
期中一部解約元本額	43,183,046,237円

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)	284,440,822円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	1,153,674,446円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	1,104,042,878円
三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,805,948,895円
三菱UFJ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	10,292,080,159円
三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	10,236,743,068円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	193,385,718円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	372,959,830円
F Pバランスファンド(安定型)	14,849,341円
F Pバランスファンド(安定成長型)	47,811,883円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	161,070,948円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA(適格機関投資家限定)	53,502,797,229円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)VA(適格機関投資家限定)	351,928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)	3,471,449円
合計	79,173,628,594円

○損益の状況 (2014年5月21日～2015年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,020,290,771
受取配当金	3,998,414,395
受取利息	983,140
その他収益金	21,038,126
支払利息	△ 144,890
(B) 有価証券売買損益	41,096,374,277
売買益	48,700,067,175
売買損	△ 7,603,692,898
(C) 先物取引等取引損益	232,730,083
取引益	573,670,705
取引損	△ 340,940,622
(D) 保管費用等	△ 121,706,868
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	45,227,688,263
(F) 前期繰越損益金	66,575,029,325
(G) 追加信託差損益金	5,148,452,789
(H) 解約差損益金	△35,221,067,214
(I) 計(E+F+G+H)	81,730,103,163
次期繰越損益金(I)	81,730,103,163

(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】

- ①新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ②デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)

新興国株式インデックスマザーファンド

《第6期》決算日2015年5月12日

[計算期間：2014年5月13日～2015年5月12日]

「新興国株式インデックスマザーファンド」は、5月12日に第6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6期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	新興国の株式等を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		MSCI エマージング・マーケット・インデックス		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	期騰落	中率	(円換算ベース)	期騰落中率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
2期(2011年5月12日)	16,655	8.8	94,613.52	6.3	94.3	4.9	1.3	8,679
3期(2012年5月14日)	14,047	△15.7	77,807.35	△17.8	96.2	2.9	0.5	14,336
4期(2013年5月13日)	19,772	40.8	107,091.73	37.6	98.2	1.7	—	24,079
5期(2014年5月12日)	19,482	△1.5	102,729.55	△4.1	96.6	3.0	0.4	24,665
6期(2015年5月12日)	23,973	23.1	124,478.28	21.2	94.8	5.0	0.4	39,530

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

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

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		M S C I エマージング・ マーケット・インデックス (円換算ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率	信 託 券 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
(期 首) 2014年5月12日	円	%		%	%	%	%	%
5月末	19,482	—	102,729.55	—	96.6	3.0	0.4	0.4
6月末	20,055	2.9	105,588.14	2.8	95.5	4.7	0.4	0.4
7月末	20,231	3.8	106,041.21	3.2	96.4	3.2	0.4	0.4
8月末	21,238	9.0	110,949.54	8.0	96.4	3.3	0.4	0.4
9月末	21,661	11.2	112,763.10	9.8	94.6	5.1	0.4	0.4
10月末	21,213	8.9	110,482.33	7.5	96.6	3.0	0.4	0.4
11月末	21,161	8.6	110,164.64	7.2	96.5	4.3	0.4	0.4
12月末	22,960	17.9	119,722.30	16.5	96.7	2.7	0.5	0.5
2015年1月末	22,200	14.0	115,570.80	12.5	96.2	3.8	0.5	0.5
2月末	22,112	13.5	115,079.72	12.0	96.6	3.0	0.5	0.5
3月末	22,794	17.0	118,532.43	15.4	95.9	3.8	0.5	0.5
4月末	22,458	15.3	116,434.52	13.3	96.2	3.4	0.5	0.5
5月末	24,293	24.7	126,082.17	22.7	96.3	3.5	0.4	0.4
(期 末) 2015年5月12日	23,973	23.1	124,478.28	21.2	94.8	5.0	0.4	0.4

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ23.1%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(21.2%)を1.9%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎新興国株式市況

- ・商品市況の下落などが嫌気される局面もありましたが、中国の金融緩和政策などを受けて新興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17.8%の円安・香港ドル高、14.9%の円高・ブラジルレアル安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・当ファンドは、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に採用されている新興国の株式等を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

(注) マルチファクターモデル

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

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークとのカイ離は1.9%程度となりました。

	組入比率 要因	銘柄選択 要因	コスト 要因	その他の 要因	合計
ベンチマーク とのカイ離	0.1% 程度	0.4% 程度	△0.2% 程度	1.6% 程度	1.9% 程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.1%程度でした。

- ・期中、ファンドの資産をほぼ全額株式（先物・REIT（不動産投資信託証券）を含む）に投資しました。

- ・効率的に運用を行うため、円貨、外貨現金などを若干保有しました。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.4%程度でした。

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

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

◎コスト要因

売買にかかるコストおよび保管料等による影響は△0.2%程度でした。

◎その他の要因

その他配当・利子収入等による影響は1.6%程度でした。

○今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2014年5月13日～2015年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 12 (10) (0) (0) (2)	% 0.055 (0.048) (0.000) (0.000) (0.007)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等を売買する際に発生する費用
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券)	5 (5) (0) (0)	0.022 (0.022) (0.000) (0.000)	(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)	33 (30) (3)	0.149 (0.135) (0.014)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 外国での資産の保管等に要する費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	50	0.226	
期中の平均基準価額は、21,864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) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

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

○売買及び取引の状況

(2014年5月13日～2015年5月12日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 523,209 (30)	千アメリカドル 7,850 (-)	百株 165,567	千アメリカドル 4,344
	メキシコ	13,431 (373)	千メキシコペソ 47,052 (-)	1,906	千メキシコペソ 5,819
	ブラジル	8,319 (△ 139)	千ブラジルリアル 17,306 (-)	2,296	千ブラジルリアル 2,976
	チリ	44,399 (356)	千チリペソ 728,334 (-)	2,063	千チリペソ 88,237
	コロンビア	3,081 (1)	千コロンビアペソ 1,414,497 (31)	199 (-)	千コロンビアペソ 428,151 (31)
	ユーロ ギリシャ	7,865 (-)	千ユーロ 680 (△ 1)	48	千ユーロ 40
	トルコ	3,355 (99)	千トルコリラ 3,045 (-)	231	千トルコリラ 264
	チェコ	22	千チェココルナ 2,639	-	千チェココルナ -
	ハンガリー	75	千ハンガリーフォリント 37,059	-	千ハンガリーフォリント -
	ポーランド	2,349 (40)	千ポーランドズロチ 5,159 (-)	151	千ポーランドズロチ 408
	香港	160,713 (7,345)	千香港ドル 129,040 (933)	20,399 (829)	千香港ドル 13,776 (981)
	マレーシア	14,740 (2,094)	千マレーシアリンギット 11,938 (66)	3,402 (-)	千マレーシアリンギット 1,393 (66)
	タイ	16,971 (1,476)	千タイバーツ 63,720 (-)	624 (-)	千タイバーツ 12,587 (68)
	フィリピン	19,029 (2,280)	千フィリピンペソ 61,500 (-)	404	千フィリピンペソ 4,390

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	インドネシア	百株 41,235	千インドネシアルピア 22,548,016	百株 4,240	千インドネシアルピア 1,891,989
	韓国	1,614 (28)	千韓国ウォン 12,873,181 (-)	275	千韓国ウォン 1,438,026
	台湾	55,987 (4,669)	千ニュー台湾ドル 266,490 (△ 1,366)	6,810 (-)	千ニュー台湾ドル 28,893 (0.16745)
	インド	8,029 (2,104)	千インドルピー 388,882 (-)	4,516 (-)	千インドルピー 162,916 (195)
	アラブ首長国連邦	10,730 (218)	アラブディルハム 7,970,248 (-)	-	アラブディルハム -
	カタール	1,136 (6)	千カタールリアル 10,320 (-)	-	千カタールリアル -
	南アフリカ	5,881 (207)	千南アフリカランド 65,556 (△ 41)	2,217	千南アフリカランド 9,643

(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
外 国	タイ	証券 - (21,423)	千タイバーツ - (68)	証券 21,423	千タイバーツ 93

(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。

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外	メキシコ	千口	千メキシコペソ	千口	千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	104 (-)	4,720 (△ 183)	8 (-)	400 (0.00001)
	小計	104 (-)	4,720 (△ 183)	8 (-)	400 (0.00001)
	トルコ		千トルコリラ		千トルコリラ
	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	22	53	-	-
小計	22	53	-	-	
国	南アフリカ		千南アフリカランド		千南アフリカランド
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	43	1,196	-	-
	REDEFINE PROPERTIES LTD	80	860	-	-
	RESILIENT PROPERTY INCOME	19	1,623	-	-
	小計	142	3,680	-	-

(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 12,879	百万円 11,929	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

(2014年5月13日～2015年5月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	11,584,253千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	30,733,053千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.37

(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

(2014年5月13日～2015年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 11,326	百万円 130	% 1.1	百万円 2,922	百万円 67	% 2.3

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

(2015年5月12日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AMBEV SA-ADR	70	85	55	6,638	食品・飲料・タバコ
AMERICA MOVIL-SPN ADR CL L	20	8	16	1,963	電気通信サービス
VALE SA-SP ADR	40	20	15	1,840	素材
PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	20	40	38	4,628	エネルギー
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	36	28	68	8,239	半導体・半導体製造装置
INFOSYS LTD-SP ADR	9	18	56	6,769	ソフトウェア・サービス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	108	153	171	20,570	素材
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	310	382	462	55,535	電気通信サービス
SOUTHERN COPPER CORP	104	122	393	47,241	素材
BANCO BRADESCO-ADR	29	35	36	4,336	銀行
ITAU UNIBANCO H-SPON PRF ADR	32	36	45	5,422	銀行
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	14	14	22	2,674	エネルギー
SASOL LTD-SPONSORED ADR	10	11	41	5,016	エネルギー
CREDICORP LTD	41	51	794	95,433	銀行
AK TRANSNEFT OAO-PREF	0.87	1	282	33,939	エネルギー
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS	710	980	143	17,200	各種金融
SBERBANK	5,930	500	75	9,016	銀行
GAZPROM OAO	6,710	360	111	13,371	エネルギー
FEDERAL GRID CO UNIFIED	150,000	—	—	—	公益事業
RUSHYDRO JSC	72,000	100,000	121	14,645	公益事業
MMC NORILSK NICKEL OJSC	33	42	879	105,727	素材
LUKOIL OAO	283	19	104	12,535	エネルギー
TATNEFT-CLS	855	1,077	649	78,003	エネルギー
ROSNEFT OAO	710	869	448	53,848	エネルギー
VTB BANK OJSC	3,260,000	3,740,000	501	60,290	銀行
URALKALI PJSC	810	995	304	36,632	素材
SBERBANK-PREFERENCE	600	820	82	9,946	銀行
SURGUTNEFTEGAS	4,350	5,430	393	47,271	エネルギー
SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	4,200	5,230	425	51,088	エネルギー
SEVERSTAL PAO	135	158	185	22,256	素材
ROSTELECOM	500	650	103	12,403	電気通信サービス
DP WORLD LTD	—	123	275	33,103	運輸
ALROSA AO	—	1,410	190	22,943	素材
SAMSUNG ELECTR-GDR	0.8	0.8	49	5,896	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HON HAI PRECISION-GDR REG S	102	99	60	7,274	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
RELIANCE INDS-SPONS GDR 1444	23	8	23	2,834	エネルギー
LUKOIL OAO-SPON ADR	29	370	1,946	233,929	エネルギー
GAZPROM OAO-SPON ADR	260	4,359	2,630	316,021	エネルギー
SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	73	120	93	11,246	電気通信サービス
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	54	69	691	83,086	エネルギー
GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR	450	620	119	14,377	電気通信サービス
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	160	197	1,104	132,735	食品・生活必需品小売り
SBERBANK-SPONSORED ADR	170	1,871	1,097	131,868	銀行
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	626	731	514	61,827	銀行
MEGAFON-REG S GDR	55	64	109	13,174	電気通信サービス

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	590	760	122	14,738		エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	3,511,267 44	3,868,940 45	16,059 -	1,929,546 <4.9%>	
(メキシコ)			千メキシコペソ			
ALFA S. A. B. -A	1,695	2,167	6,743	52,803		資本財
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	337	427	2,778	21,758		資本財
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	21,050	24,980	39,268	307,472		電気通信サービス
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	965	1,205	4,198	32,872		家庭用品・パーソナル用品
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	3,220	3,960	14,861	116,368		食品・生活必需品小売り
CEMEX SAB-CPO	7,219	9,713	14,997	117,431		素材
GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO	1,583	1,938	21,606	169,180		メディア
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,015	1,200	4,995	39,115		食品・飲料・タバコ
INDUSTRIAS CH S. A. B. -SER B	120	-	-	-		素材
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	1,535	1,880	17,079	133,734		銀行
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	1,195	1,473	21,458	168,021		食品・飲料・タバコ
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	82	106	2,868	22,463		素材
MEXICHEM SAB DE CV-*	665	670	3,003	23,518		素材
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	263	323	4,064	31,826		食品・飲料・タバコ
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	2,327	2,853	13,914	108,951		素材
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	1,380	1,790	6,665	52,194		銀行
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	198	263	2,921	22,876		運輸
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	193	303	2,927	22,920		食品・飲料・タバコ
GENTERA SAB DE CV	660	780	2,123	16,630		各種金融
MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	387	547	716	5,606		素材
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	110	150	2,563	20,071		小売
GRUPO FIN SANTANDER-B	1,070	1,385	4,232	33,140		銀行
CONTROLADORA COML MEXIC-UBC	240	300	1,475	11,554		食品・生活必需品小売り
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	120	142	3,248	25,436		運輸
OHL MEXICO SAB DE CV	405	620	1,526	11,952		運輸
GENOMMA LAB INTERNACIONAL-B	490	580	977	7,656		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	190	260	1,201	9,411		食品・生活必需品小売り
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	169	209	3,614	28,301		資本財
GRUMA S. A. B. -B	-	138	2,582	20,224		食品・飲料・タバコ
GRUPO LALA SAB DE CV	-	420	1,389	10,881		食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	48,885 28	60,783 29	210,009 -	1,644,377 <4.2%>	
(ブラジル)			千ブラジルレアル			
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	471	568	900	35,318		公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	120	170	167	6,575		公益事業
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	2,530	3,109	4,265	167,337		エネルギー
OI SA-PREFERENCE	1,648	209	123	4,856		電気通信サービス
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	219	252	489	19,208		公益事業
GERDAU SA-PREF	507	589	614	24,123		素材
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	55	71	248	9,743		公益事業
TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF	183	258	1,215	47,698		電気通信サービス
VALE SA-PREF	1,126	1,448	2,758	108,213		素材
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	1,501	2,050	7,806	306,236		銀行
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	75	101	270	10,610		エネルギー
BRF SA	398	495	3,221	126,377		食品・飲料・タバコ
JBS SA	470	580	959	37,634		食品・飲料・タバコ
NATURA COSMETICOS SA	100	135	415	16,311		家庭用品・パーソナル用品
VALE SA	788	947	2,204	86,487		素材

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジルレアル	千円	
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	255	255	154	6,072	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	198	276	1,969	77,254	エネルギー
TRACTEBEL ENERGIA SA	97	134	492	19,339	公益事業
PORTO SEGURO SA	64	82	320	12,561	保険
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	1,815	2,241	3,287	128,970	エネルギー
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	85	106	1,005	39,438	食品・生活必需品小売り
LOJAS RENNER S. A.	74	93	1,040	40,821	小売
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	340	382	662	25,982	小売
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	1,919	2,695	2,625	102,982	銀行
METALURGICA GERDAU SA-PREF	172	270	277	10,867	素材
AES TIETE SA-PREF	67	67	121	4,778	公益事業
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	130	180	209	8,226	公益事業
EMBRAER SA	357	512	1,210	47,502	資本財
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIR	185	185	149	5,864	公益事業
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	165	225	254	9,991	耐久消費財・アパレル
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	424	489	418	16,401	素材
SOUZA CRUZ SA	230	287	716	28,091	食品・飲料・タバコ
CPFL ENERGIA SA	145	177	356	13,995	公益事業
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	107	150	331	13,010	公益事業
CCR SA	550	683	1,051	41,262	運輸
BM&FBOVESPA SA	1,165	1,380	1,736	68,104	各種金融
B2W CIA DIGITAL	—	85	220	8,653	小売
BRASKEM SA-PREF A	80	120	171	6,713	素材
BRADSPAR SA -PREF	135	160	203	7,977	素材
BANCO BRADESCO SA-PREF	1,261	1,902	6,021	236,212	銀行
BANCO DO BRASIL S. A.	521	659	1,849	72,542	銀行
CIELO SA	431	644	2,727	107,008	ソフトウェア・サービス
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	575	310	531	20,832	銀行
DURATEX SA	178	258	227	8,937	素材
SUZANO PAPEL E CELULO-PREF A	160	230	357	14,012	素材
FIBRIA CELULOSE SA	152	185	789	30,953	素材
MRV ENGENHARIA	225	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HYPERMARCAS SA	215	255	551	21,647	家庭用品・パーソナル用品
BANCO BRADESCO S. A.	382	547	1,619	63,517	銀行
WEG SA	166	418	713	27,979	資本財
BR MALLS PARTICIPACOES SA	247	340	545	21,407	不動産
BANCO ESTADO RIO GRAN-PREF B	100	150	158	6,208	銀行
LOCALIZA RENT A CAR	83	113	383	15,045	運輸
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	49	58	304	11,945	不動産
SUL AMERICA SA - UNITS	74	134	185	7,273	保険
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS	33	—	—	—	公益事業
TIM PARTICIPACOES SA	493	663	603	23,670	電気通信サービス
CIA HERING	88	—	—	—	小売
RAIA DROGASIL SA	128	155	577	22,668	食品・生活必需品小売り
M DIAS BRANCO SA	19	24	216	8,473	食品・飲料・タバコ
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	125	158	545	21,396	各種金融
ODONTOPREV S. A.	180	180	197	7,760	ヘルスケア機器・サービス
MARCOPOLO SA-PREF	310	—	—	—	資本財
TOTVS SA	75	90	343	13,459	ソフトウェア・サービス
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	50	75	150	5,884	公益事業
ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	300	—	—	—	運輸
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	90	152	128	5,032	運輸

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジルレアル	千円		
BR PROPERTIES SA	133	—	—	—	不動産	
ESTACIO PARTICIPACOES SA	160	215	379	14,886	消費者サービス	
LOJAS AMERICANAS SA	75	125	167	6,575	小売	
ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTI	230	—	—	—	消費者サービス	
QUALICORP SA	122	149	359	14,110	ヘルスクエア機器・サービス	
KROTON EDUCACIONAL SA	114	1,026	1,103	43,307	消費者サービス	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	365	521	1,949	76,461	保険	
AMBEV SA	2,803	3,471	6,879	269,883	食品・飲料・タバコ	
AMBEV SA-RTS	3	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
VIA VAREJO SA	—	87	171	6,740	小売	
KLABIN SA - UNIT	315	360	699	27,440	素材	
KLABIN SA - UNIT-RTS	9	—	—	—	素材	
小計	株数・金額	29,995	35,878	76,086	2,984,875	
	銘柄数<比率>	77	70	—	<7.6%>	
(チリ)			千チリペソ			
BANCO DE CREDITO E INVERSION	19	25	78,824	15,528	銀行	
CAP SA	45	—	—	—	素材	
CENCOSUD SA	685	1,000	160,680	31,653	食品・生活必需品小売り	
EMPRESAS CMPC SA	735	915	163,876	32,283	素材	
COLBUN SA	4,950	6,000	110,064	21,682	公益事業	
EMPRESAS COPEC SA	278	343	245,039	48,272	エネルギー	
CORPBANCA	76,000	95,000	70,138	13,817	銀行	
E. CL SA	300	—	—	—	公益事業	
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	74	98	71,010	13,989	電気通信サービス	
S. A. C. I. FALABELLA	454	720	358,257	70,576	小売	
AES GENER SA	1,400	1,850	68,342	13,463	公益事業	
AGUAS ANDINAS SA-A	1,300	1,800	66,493	13,099	公益事業	
LATAM AIRLINES GROUP SA	203	240	135,081	26,611	運輸	
VINA CONCHA Y TORO SA	240	360	45,111	8,886	食品・飲料・タバコ	
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	2,040	2,540	244,792	48,224	公益事業	
BANCO SANTANDER CHILE	38,800	51,300	171,598	33,804	銀行	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	60	69	89,555	17,642	素材	
ENERSIS SA	12,100	15,010	336,239	66,239	公益事業	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	90	118	80,756	15,909	食品・飲料・タバコ	
BANCO DE CHILE	13,723	18,341	131,029	25,812	銀行	
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	140	200	40,972	8,071	食品・飲料・タバコ	
SONDA SA	—	400	60,036	11,827	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額	153,637	196,329	2,727,899	537,396	
	銘柄数<比率>	21	20	—	<1.4%>	
(コロンビア)			千コロンビアペソ			
GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	900	2,754	338,766	17,039	銀行	
BANCO DAVIVIENDA SA	52	68	183,328	9,221	銀行	
BANCOLOMBIA SA-PREF	258	333	906,426	45,593	銀行	
ECOPETROL SA	2,775	3,420	649,800	32,684	エネルギー	
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	51	65	246,411	12,394	各種金融	
INTERCONEXION ELECTRICA SA	250	303	244,824	12,314	公益事業	
GRUPO ARGOS SA	184	225	392,400	19,737	素材	
ALMACENES EXITO SA	119	149	365,348	18,377	食品・生活必需品小売り	
BANCOLOMBIA SA	131	—	—	—	銀行	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	142	179	641,536	32,269	各種金融	
CEMENTOS ARGOS SA	230	308	277,200	13,943	素材	
ISAGEN SA ESP	440	580	194,300	9,773	公益事業	

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(コロンビア)	百株	百株	千コロンビアペソ	千円	
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	63	77	269,654	13,563	各種金融
GRUPO ARGOS SA-PRF	73	90	154,800	7,786	素材
CEMEX LATAM HOLDINGS SA	112	112	148,288	7,458	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,780 15	8,663 14	5,013,081 -	252,158 <0.6%>
(ユーロ…ギリシャ)			千ユーロ		
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	151	191	152	20,392	電気通信サービス
ALPHA BANK A. E.	2,250	2,850	88	11,896	銀行
HELLENIC PETROLEUM SA	42	-	-	-	エネルギー
NATIONAL BANK OF GREECE	190	1,265	150	20,140	銀行
EUROBANK ERGASIAS SA	-	5,770	77	10,421	銀行
TITAN CEMENT CO. S. A.	33	33	74	9,994	素材
PIRAEUS BANK S. A	1,310	1,630	67	9,072	銀行
PUBLIC POWER CORP	74	74	40	5,445	公益事業
OPAP SA	131	159	133	17,868	消費者サービス
FF GROUP	20	27	68	9,222	小売
JUMBO SA	66	85	74	9,974	小売
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,268 10	12,085 10	930 -	124,428 <0.3%>
(トルコ)			千トルコリラ		
AKBANK T. A. S.	1,106	1,700	1,360	60,693	銀行
TURKIYE IS BANKASI-C	927	1,157	686	30,613	銀行
TURKIYE GARANTI BANKASI	1,430	1,775	1,537	68,572	銀行
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	468	663	822	36,674	電気通信サービス
YAPI VE KREDI BANKASI	560	690	291	13,020	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	130	148	342	15,284	食品・飲料・タバコ
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	72	93	595	26,551	エネルギー
HACI OMER SABANCI HOLDING	490	696	694	30,986	各種金融
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	839	1,059	497	22,214	素材
KOC HOLDING AS	378	468	573	25,602	資本財
ARCELIK AS	160	160	233	10,420	耐久消費財・アパレル
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	314	499	178	7,984	資本財
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	38	58	211	9,456	自動車・自動車部品
TURK HAVA YOLLARI AO	353	418	381	17,038	運輸
ULKER BISKUVI SANAYI	75	107	211	9,451	食品・飲料・タバコ
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	80	80	138	6,156	自動車・自動車部品
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	430	530	255	11,419	銀行
COCA-COLA ICECEK AS	36	64	281	12,562	食品・飲料・タバコ
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	110	130	278	12,439	運輸
TURKIYE HALK BANKASI	367	490	681	30,383	銀行
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	257	380	202	9,053	資本財
ENKA INSAAT VE SANAYI AS-NEW	-	30	16	720	資本財
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	250	350	254	11,351	電気通信サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	132	155	763	34,063	食品・生活必需品小売り
KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	25	-	-	-	素材
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	-	348	132	5,914	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,030 24	12,252 25	11,625 -	518,630 <1.3%>
(チェコ)			千チェココルナ		
O2 CZECH REPUBLIC AS	68	68	1,462	7,134	電気通信サービス
CEZ AS	101	121	7,789	38,015	公益事業

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(チェコ)	百株	百株	千チェココロナ	千円		
KOMERCNI BANKA AS	9	12	6,379	31,130	銀行	
小計	株数・金額	178	201	15,631	76,280	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.2%>	
(ハンガリー)			千ハンガリーフォリント			
RICHTER GEDEON NYRT	80	111	50,061	21,961	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
OTP BANK PLC	131	170	101,320	44,449	銀行	
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	25	30	46,848	20,552	エネルギー	
小計	株数・金額	236	311	198,229	86,963	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.2%>	
(ポーランド)			千ポーランドズロチ			
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	195	244	1,703	55,828	エネルギー	
ORANGE POLSKA SA	390	455	464	15,213	電気通信サービス	
PKO BANK POLSKI SA	533	655	2,439	79,979	銀行	
BANK PEKAO SA	79	96	1,853	60,749	銀行	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	88	108	1,379	45,204	素材	
BANK ZACHODNI WBK SA	17	25	958	31,435	銀行	
MBANK SA	9	11	552	18,105	銀行	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	1,022	1,312	885	29,029	エネルギー	
GRUPA LOTOS SA	40	78	241	7,913	エネルギー	
EUROCASH SA	51	71	274	8,992	食品・生活必需品小売り	
BANK MILLENNIUM SA	230	330	259	8,491	銀行	
CYFROWY POLSAT SA	95	163	411	13,475	メディア	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	18	26	291	9,541	銀行	
PGE SA	460	636	1,281	42,008	公益事業	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	34	42	2,027	66,453	保険	
KERNEL HOLDING SA	35	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	600	730	351	11,533	公益事業	
ENEA SA	140	140	233	7,663	公益事業	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	22	—	—	—	素材	
SYNTHOS SA	290	430	206	6,779	素材	
GETIN NOBLE BANK SA	—	820	153	5,026	銀行	
GRUPA AZOTY SA	28	36	313	10,266	素材	
ALIOR BANK SA	27	38	347	11,397	銀行	
ENERGA SA	—	175	401	13,153	公益事業	
LPP SA	—	0.66	466	15,284	耐久消費財・アパレル	
CCC SA	—	18	341	11,188	耐久消費財・アパレル	
小計	株数・金額	4,404	6,642	17,837	584,719	
	銘柄数<比率>	22	24	—	<1.5%>	
(香港)			千香港ドル			
PETROCHINA CO LTD-H	12,930	15,910	15,146	234,767	エネルギー	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	15,460	19,360	13,745	213,056	エネルギー	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	2,920	4,440	6,464	100,201	電気通信サービス	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1,820	2,280	3,169	49,122	自動車・自動車部品	
CITIC LTD	920	1,700	2,614	40,526	資本財	
CNOOC LTD	10,940	13,500	17,361	269,095	エネルギー	
YANZHOU COAL MINING CO-H	1,060	1,360	975	15,114	エネルギー	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	2,210	2,810	1,109	17,204	素材	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	1,000	1,000	810	12,555	運輸	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	980	980	1,160	17,984	運輸	
CHINA RESOURCES ENTERPRISE	700	880	2,147	33,281	食品・生活必需品小売り	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	1,200	1,480	2,439	37,805	食品・飲料・タバコ	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	320	400	1,216	18,848	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	680	840	2,860	44,333	運輸
COSCO PACIFIC LTD	1,000	1,340	1,575	24,425	運輸
BYD CO LTD-H	305	445	2,182	33,832	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD-H	8,340	10,560	5,924	91,824	電気通信サービス
DATANG INTL POWER GEN CO-H	1,640	2,100	942	14,614	公益事業
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	325	385	2,745	42,548	資本財
CHINA EVERBRIGHT LTD	540	660	1,824	28,285	各種金融
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	700	920	978	15,172	運輸
CHINA MOBILE LTD	3,680	4,625	49,811	772,074	電気通信サービス
HUANENG POWER INTL INC-H	1,960	2,720	3,035	47,050	公益事業
HUADIAN POWER INTL CORP-H	—	1,280	1,102	17,082	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	745	905	2,918	45,238	素材
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1,020	3,120	2,430	37,672	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LENOVO GROUP LTD	3,700	5,080	7,040	109,133	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	440	840	2,515	38,994	保険
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	220	260	1,275	19,767	食品・飲料・タバコ
SINOTRANS LIMITED-H	—	1,450	849	13,170	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	2,600	3,200	1,529	23,708	素材
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	1,000	1,000	468	7,254	素材
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	1,200	1,560	1,330	20,625	資本財
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,920	2,620	4,668	72,367	保険
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	4,570	5,600	21,392	331,576	保険
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	410	540	760	11,784	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	—	19,400	1,629	25,258	半導体・半導体製造装置
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	1,180	1,460	3,299	51,143	公益事業
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	2,410	3,150	1,203	18,651	運輸
CHINA MENGNIU DAIRY CO	850	1,060	4,420	68,513	食品・飲料・タバコ
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,140	1,965	21,968	340,514	保険
ATR CHINA LTD-H	1,160	1,460	1,351	20,955	運輸
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,880	2,120	1,886	29,245	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	1,120	1,360	2,064	31,999	エネルギー
TENCENT HOLDINGS LTD	624	3,894	61,758	957,262	ソフトウェア・サービス
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	5,279	6,519	5,026	77,905	銀行
ZTE CORP-H	382	492	1,234	19,132	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	3,740	4,640	1,387	21,504	素材
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	44,045	54,475	40,148	622,300	銀行
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	560	700	696	10,795	不動産
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	350	430	1,554	24,093	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,680	2,100	2,797	43,356	自動車・自動車部品
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	1,960	2,180	1,698	26,322	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	2,100	2,535	4,922	76,306	エネルギー
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	900	1,200	804	12,462	素材
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	760	—	—	—	不動産
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	400	—	—	—	小売
JIANGXI COPPER CO LTD-H	820	970	1,542	23,905	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1,040	1,280	872	13,530	ヘルスケア機器・サービス
BANK OF CHINA LTD-H	46,050	60,040	31,340	485,783	銀行
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	1,580	1,900	2,907	45,058	商業・専門サービス
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	880	1,090	2,007	31,120	不動産
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	435	570	2,433	37,725	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS BANK-H	2,775	3,475	7,976	123,632	銀行
CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	1,000	—	—	—	素材

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
IND & COMM BK OF CHINA-H	45,103	55,803	36,718	569,139	銀行
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	460	580	3,227	50,029	公益事業
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	1,300	1,880	810	12,559	電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	2,690	3,370	4,340	67,278	資本財
CHINA COAL ENERGY CO-H	2,480	2,920	1,410	21,860	エネルギー
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	2,460	3,080	9,424	146,084	不動産
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	1,340	1,340	572	8,868	食品・飲料・タバコ
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	5,020	6,240	4,280	66,349	銀行
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	590	730	1,321	20,480	耐久消費財・アパレル
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	2,300	3,040	3,100	48,062	資本財
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	6,200	7,900	1,817	28,163	小売
HENGAN INTL GROUP CO LTD	455	560	5,364	83,154	家庭用品・パーソナル用品
CHINA RESOURCES LAND LTD	1,240	1,720	4,669	72,381	不動産
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1,200	1,480	2,175	33,721	資本財
GUANGDONG INVESTMENT LTD	1,560	1,920	2,135	33,093	公益事業
POSUN INTERNATIONAL LTD	1,130	1,310	2,744	42,538	素材
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	2,120	2,520	1,517	23,514	不動産
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	1,660	2,220	1,940	30,074	素材
SHUI ON LAND LTD	2,276	3,176	816	12,651	不動産
WEICHAI POWER CO LTD-H	292	342	1,015	15,743	資本財
CHINA COSCO HOLDINGS-H	1,640	2,040	1,279	19,825	運輸
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	2,850	3,550	3,493	54,144	耐久消費財・アパレル
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	3,550	4,430	3,707	57,472	食品・飲料・タバコ
KUNLUN ENERGY CO LTD	1,980	2,360	2,135	33,104	エネルギー
SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GR	1,680	—	—	—	素材
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2,932	4,372	1,814	28,124	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	560	640	1,609	24,948	公益事業
SOHO CHINA LTD	1,100	1,380	801	12,427	不動産
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	2,060	3,220	2,192	33,988	公益事業
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	3,500	4,100	1,660	25,737	自動車・自動車部品
POLY PROPERTY GROUP CO LTD	1,260	—	—	—	不動産
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	1,540	2,180	2,125	32,945	公益事業
CHINA MINSHENG BANKING-H	3,180	4,756	5,383	83,448	銀行
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	1,630	2,002	8,318	128,933	保険
YINGDE GASES GROUP CO LTD	600	—	—	—	素材
CSR CORP LTD - H	1,240	1,500	2,250	34,875	資本財
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	310	380	2,338	36,252	資本財
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	12,840	15,960	6,751	104,641	銀行
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	4,020	4,500	3,150	48,825	不動産
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	1,326	1,626	1,333	20,675	自動車・自動車部品
SINOPHARM GROUP CO-H	616	916	3,407	52,816	ヘルスケア機器・サービス
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,220	1,560	2,134	33,078	公益事業
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	1,330	3,160	1,393	21,600	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LONGFOR PROPERTIES	780	1,160	1,575	24,416	不動産
CHINA RESOURCES CEMENT	1,100	1,460	718	11,133	素材
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	5,900	7,860	1,799	27,899	半導体・半導体製造装置
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	860	—	—	—	資本財
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	635	790	4,289	66,490	自動車・自動車部品
INTIME RETAIL GROUP CO LTD	560	—	—	—	小売
BBMG CORP-H	760	760	690	10,696	素材
FRANSHION PROPERTIES	2,500	2,500	780	12,090	不動産
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	1,100	1,260	1,738	26,951	資本財

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
WUMART STORES INC-H	390	—	—	—	—	食品・生活必需品小売り
CITIC SECURITIES CO LTD-H	640	820	2,771	42,959	—	各種金融
SUN ART RETAIL GROUP LTD	1,400	1,820	1,412	21,890	—	食品・生活必需品小売り
FAR EAST HORIZON LTD	700	1,020	770	11,936	—	各種金融
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	1,520	2,000	1,298	20,119	—	銀行
YUEXIU PROPERTY CO LTD	2,800	5,300	1,017	15,772	—	不動産
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	600	940	667	10,344	—	食品・飲料・タバコ
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	610	830	1,888	29,267	—	耐久消費財・アパレル
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	410	—	—	—	—	小売
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	390	520	1,315	20,391	—	ヘルスケア機器・サービス
CHINA SOUTH CITY HOLDINGS	—	2,100	701	10,871	—	不動産
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	840	992	2,420	37,517	—	各種金融
CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	273	373	737	11,424	—	資本財
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	430	—	—	—	—	不動産
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	500	530	2,824	43,785	—	保険
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	2,940	4,920	2,804	43,468	—	保険
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	—	1,220	1,554	24,091	—	各種金融
CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS	360	—	—	—	—	不動産
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	—	870	1,148	17,800	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	—	275	797	12,361	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOSTIME INTERNATIONAL HOLDI	100	—	—	—	—	食品・飲料・タバコ
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	390	530	993	15,394	—	資本財
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	670	890	694	10,760	—	資本財
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	—	4,000	644	9,982	—	食品・飲料・タバコ
NEW WORLD CHINA LAND LTD	1,640	1,980	1,061	16,449	—	不動産
HANERGY THIN FILM POWER GROU	6,400	9,300	6,510	100,905	—	半導体・半導体製造装置
KINGSOFT CORP LTD	—	510	1,473	22,845	—	ソフトウェア・サービス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	2,460	3,720	1,770	27,446	—	各種金融
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	1,500	1,900	2,257	34,986	—	電気通信サービス
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	—	1,900	946	14,666	—	銀行
CHINA VANKE CO LTD-H	—	1,029	2,013	31,212	—	不動産
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	—	4,100	1,389	21,543	—	メディア
CHINA CNR CORP LTD-H	—	1,505	2,386	36,997	—	資本財
CGN POWER CO LTD-H	—	4,160	1,743	27,017	—	公益事業
YANTAI CHANGYU PIONEER-B	130	—	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	470	590	1,475	22,862	—	自動車・自動車部品
CHINA VANKE CO LTD -B	829	—	—	—	—	不動産
小 計	株 数	金 額	394,985	541,815	605,222	9,380,954
	銘柄 数 < 比 率 >		140	139	—	<23.7%>
(マレーシア)					千マレーシアリンギット	
GENTING MALAYSIA BHD	1,769	2,189	941	31,193	—	消費者サービス
GENTING BHD	1,246	1,526	1,338	44,351	—	消費者サービス
TELEKOM MALAYSIA BHD	700	820	606	20,109	—	電気通信サービス
TENAGA NASIONAL BHD	1,720	2,558	3,530	116,985	—	公益事業
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	293	363	788	26,128	—	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	2,725	3,470	3,234	107,176	—	銀行
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	449	449	147	4,880	—	消費者サービス
IOI CORP BHD	1,834	2,224	918	30,439	—	食品・飲料・タバコ
AMMB HOLDINGS BHD	1,030	1,530	970	32,146	—	銀行
YTL CORP BHD	2,874	3,374	556	18,452	—	公益事業
GAMUDA BHD	1,050	1,390	721	23,907	—	資本財
MISC BHD	700	820	689	22,854	—	運輸

銘柄	株数	当 期		末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシアリンギット	千円		
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	2,970	3,600	2,134	70,747	銀行	
PETRONAS GAS BHD	369	509	1,150	38,122	公益事業	
PARKSON HOLDINGS BHD	318	—	—	—	小売	
MMC CORP BHD	460	—	—	—	資本財	
SIME DARBY BERHAD	1,620	2,260	2,038	67,556	資本財	
PUBLIC BANK BERHAD	651	2,062	3,975	131,749	銀行	
UMW HOLDINGS BHD	300	440	475	15,748	自動車・自動車部品	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	77	99	654	21,679	食品・飲料・タバコ	
RHB CAPITAL BHD	360	360	281	9,341	銀行	
PPB GROUP BERHAD	268	368	563	18,683	食品・飲料・タバコ	
IJM CORP BHD	701	1,233	875	29,011	資本財	
DIGI.COM BHD	2,190	2,700	1,628	53,955	電気通信サービス	
MAXIS BHD	1,420	1,460	1,024	33,965	電気通信サービス	
AXIATA GROUP BERHAD	1,520	1,940	1,307	43,332	電気通信サービス	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	1,260	910	145	4,825	公益事業	
HONG LEONG BANK BERHAD	355	410	574	19,049	銀行	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	1,710	2,120	1,242	41,170	素材	
LAFARGE MALAYSIA BHD	255	335	323	10,724	素材	
PETRONAS DAGANGAN BHD	148	183	396	13,123	エネルギー	
ATRASIA BHD	700	1,000	220	7,290	運輸	
BUMI ARMADA BERHAD	570	1,455	181	6,027	エネルギー	
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	590	740	352	11,673	銀行	
SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	2,230	2,860	795	26,348	エネルギー	
UEM SUNRISE BHD	860	1,180	154	5,122	不動産	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	440	670	424	14,077	運輸	
FELDA GLOBAL VENTURES	820	820	171	5,679	食品・飲料・タバコ	
IHH HEALTHCARE BHD	1,400	1,810	1,086	35,990	ヘルスケア機器・サービス	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	135	185	302	10,017	銀行	
GENTING PLANTATIONS BHD	150	150	147	4,886	食品・飲料・タバコ	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	1,030	1,170	367	12,174	メディア	
DIALOG GROUP BHD	1,050	2,766	445	14,762	資本財	
IOI PROPERTIES GROUP BHD	938	1,178	257	8,549	不動産	
小 計	株 数	44,255	57,687	38,141	1,264,014	
	銘柄 数 < 比率 >	44	42	—	< 3.2% >	
(タイ)				千タイバーツ		
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	820	970	3,952	14,071	不動産	
KASIKORN BANK PCL-NVDR	1,170	1,382	29,160	103,810	銀行	
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	7,200	10,200	2,631	9,368	銀行	
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	550	750	2,943	10,479	メディア	
CP ALL PCL-NVDR	2,682	3,302	14,198	50,547	食品・生活必需品小売り	
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	662	426	7,966	28,359	銀行	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	632	787	18,730	66,680	電気通信サービス	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,095	1,165	18,989	67,602	銀行	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	269	313	16,839	59,948	素材	
PTT PCL-NVDR	520	761	26,939	95,904	エネルギー	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	867	1,075	12,577	44,775	エネルギー	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	250	313	9,045	32,202	運輸	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	720	720	2,070	7,369	エネルギー	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,660	1,940	4,306	15,332	食品・飲料・タバコ	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	900	900	2,061	7,337	素材	
IRPC PCL - NVDR	6,500	8,300	3,552	12,646	エネルギー	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,005	1,285	8,195	29,176	素材	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(タイ)	百株	百株	千タイバツ	千円		
THAI OIL PCL-NVDR	510	650	3,558	12,669	エネルギー	
KRUNG THAI BANK - NVDR	2,260	2,610	5,220	18,583	銀行	
GLOW ENERGY PCL - NVDR	270	360	3,078	10,957	公益事業	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,700	2,500	5,000	17,800	ヘルスケア機器・サービス	
THAI UNION FROZEN PROD-NVDR	—	1,460	3,095	11,018	食品・飲料・タバコ	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	1,733	2,980	1,966	7,001	小売	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	3,300	4,250	3,846	13,692	運輸	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	—	290	5,205	18,531	ヘルスケア機器・サービス	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	—	320	2,888	10,281	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TRUE CORP PCL-NVDR	2,800	6,400	7,168	25,518	電気通信サービス	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	850	1,370	4,247	15,119	消費者サービス	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	—	970	2,425	8,633	エネルギー	
小計	株数・金額	40,925	58,749	231,859	825,420	
	銘柄数<比率>	25	29	—	<2.1%>	
(フィリピン)			千フィリピンペソ			
PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	25	74	21,098	56,754	電気通信サービス	
SM PRIME HOLDINGS INC	3,975	6,405	12,579	33,838	不動産	
AYALA LAND INC	3,340	5,430	21,910	58,938	不動産	
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	500	620	6,293	16,928	銀行	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	330	400	4,396	11,825	運輸	
MEGAWORLD CORP	—	8,300	4,457	11,989	不動産	
JOLLIBEE FOODS CORP	235	337	7,130	19,182	消費者サービス	
ENERGY DEVELOPMENT CORP	5,000	6,900	5,520	14,848	公益事業	
SM INVESTMENTS CORP	86	117	10,506	28,262	資本財	
AYALA CORPORATION	103	160	12,888	34,668	各種金融	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	1,250	1,470	8,511	22,895	資本財	
ABOITIZ POWER CORP	1,100	1,100	4,653	12,516	公益事業	
METROPOLITAN BANK & TRUST	195	195	1,842	4,956	銀行	
BDO UNIBANK INC	860	1,250	13,962	37,559	銀行	
DMCI HOLDINGS INC	430	2,850	4,121	11,085	資本財	
UNIVERSAL ROBINA CORP	540	680	13,600	36,584	食品・飲料・タバコ	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	1,320	1,320	3,273	8,805	資本財	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	1,470	1,850	13,125	35,308	資本財	
GLOBE TELECOM INC	20	26	5,818	15,652	電気通信サービス	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	7,000	9,200	4,250	11,433	各種金融	
小計	株数・金額	27,779	48,684	179,938	484,035	
	銘柄数<比率>	19	20	—	<1.2%>	
(インドネシア)			千インドネシアルピア			
KALBE FARMA TBK PT	13,600	15,400	2,849,000	26,210	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	27,400	37,500	10,668,750	98,152	電気通信サービス	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	2,660	3,350	2,227,750	20,495	食品・飲料・タバコ	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	7,600	9,360	12,823,200	117,973	銀行	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	850	1,060	2,332,000	21,454	素材	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	12,320	15,330	11,229,225	103,308	自動車・自動車部品	
GUDANG GARAM TBK PT	290	385	1,769,075	16,275	食品・飲料・タバコ	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	6,700	8,400	9,891,000	90,997	銀行	
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	220	340	755,650	6,951	食品・飲料・タバコ	
BANK DANAMON INDONESIA TBK	2,060	2,810	1,133,835	10,431	銀行	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	1,740	2,310	3,066,525	28,212	素材	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	6,835	8,085	3,294,637	30,310	公益事業	
UNITED TRACTORS TBK PT	1,030	1,310	3,085,050	28,382	資本財	
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	565	565	562,175	5,172	エネルギー	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシアルピア	千円		
LIPPO KARAWACI TBK PT	13,000	15,500	1,929,750	17,753	不動産	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	5,730	7,090	7,887,625	72,566	銀行	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	940	1,120	4,888,800	44,976	家庭用品・パーソナル用品	
ADARO ENERGY TBK PT	8,200	10,400	941,200	8,659	エネルギー	
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	1,400	1,400	896,000	8,243	運輸	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	4,500	5,650	3,757,250	34,566	銀行	
INDO TAMBANGRAYA MEGAH TBK P	220	220	330,000	3,036	エネルギー	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	4,700	5,500	1,606,000	14,775	食品・飲料・タバコ	
XL AXIATA TBK PT	1,750	2,250	858,375	7,897	電気通信サービス	
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	2,600	3,850	877,800	8,075	メディア	
BUMI SERPONG DAMAI PT	5,000	6,200	1,137,700	10,466	不動産	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	650	910	1,248,975	11,490	食品・飲料・タバコ	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	900	1,350	1,201,500	11,053	電気通信サービス	
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	2,400	4,650	1,420,575	13,069	メディア	
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	4,400	4,400	642,400	5,910	メディア	
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	900	1,460	2,463,750	22,666	小売	
小 計	株 数	金 額	141,160	178,155	97,775,572	899,535
	銘柄 数 < 比 率 >		30	30	-	< 2.3% >
(韓国)			千韓国ウォン			
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	67	83	11,138,232	1,220,750	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	155	195	912,600	100,020	公益事業	
SHINSEGAE CO LTD	3	4	102,752	11,261	小売	
CJ CORP	9	11	241,920	26,514	資本財	
SAMSUNG C&T CORP	76	95	546,832	59,932	資本財	
SK TELECOM	6	7	183,230	20,082	電気通信サービス	
HYUNDAI MOTOR CO	94	117	1,986,540	217,724	自動車・自動車部品	
POSCO	40	49	1,272,150	139,427	素材	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	35	44	279,905	30,677	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KT CORP	39	22	68,062	7,459	電気通信サービス	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	35	45	286,556	31,406	各種金融	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	41	51	1,208,320	132,431	自動車・自動車部品	
CHEIL WORLDWIDE INC	53	66	146,850	16,094	メディア	
KB FINANCIAL GROUP INC	235	290	1,179,430	129,265	銀行	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	21	24	716,720	78,552	保険	
SAMSUNG SDI CO LTD	21	42	490,348	53,742	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	262	320	1,406,995	154,206	銀行	
LG ELECTRONICS INC	65	82	481,750	52,799	耐久消費財・アパレル	
AMOREPACIFIC GROUP	1	21	341,320	37,408	家庭用品・パーソナル用品	
HYUNDAI DEPT STORE CO	9	10	154,235	16,904	小売	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	16	19	162,313	17,789	資本財	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	31	41	133,045	14,581	資本財	
KT&G CORP	66	81	784,462	85,977	食品・飲料・タバコ	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	56	82	146,850	16,094	資本財	
NCSOFT CORP	9	11	225,120	24,673	ソフトウェア・サービス	
LG DISPLAY CO LTD	143	179	536,705	58,822	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	25	31	427,245	46,826	資本財	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	99	118	215,350	23,602	資本財	
AMOREPACIFIC CORP	1	24	935,080	102,484	家庭用品・パーソナル用品	
HANA FINANCIAL GROUP	170	218	677,980	74,306	銀行	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	35	42	255,425	27,994	資本財	
LG CHEM LTD	28	34	946,560	103,742	素材	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	27	47	141,000	15,453	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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
LS CORP	9	12	68,352	7,491	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	5	7	597,025	65,433	家庭用品・パーソナル用品
SK INNOVATION CO LTD	36	45	519,800	56,970	エネルギー
DAUM KAKAO CORP	—	19	200,256	21,948	ソフトウェア・サービス
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	22	31	205,220	22,492	各種金融
COWAY CO LTD	32	39	356,058	39,023	耐久消費財・アパレル
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	16	16	95,760	10,495	各種金融
S-1 CORPORATION	9	13	106,990	11,726	商業・専門サービス
DOOSAN INFRACORE CO LTD	82	107	126,260	13,838	資本財
KIA MOTORS CORP	162	198	1,005,888	110,245	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	323	441	2,042,293	223,835	半導体・半導体製造装置
LG CORP	59	73	494,832	54,233	資本財
SK HOLDINGS CO LTD	15	19	353,430	38,735	資本財
HYUNDAI STEEL CO	44	52	406,877	44,593	素材
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	12	15	1,549,380	169,812	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OCI CO LTD	10	13	135,048	14,801	素材
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	23	—	—	—	資本財
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	130	213	313,110	34,316	銀行
KANGWON LAND INC	61	92	343,160	37,610	消費者サービス
NAVER CORP	17	21	1,273,812	139,609	ソフトウェア・サービス
DAEWOO SECURITIES CO LTD	107	132	207,174	22,706	各種金融
CELLTRION INC	37	50	413,854	45,358	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HYUNDAI SECURITIES CO	85	—	—	—	各種金融
KOREA GAS CORPORATION	16	22	113,061	12,391	公益事業
LG UPLUS CORP	137	162	155,682	17,062	電気通信サービス
LOTTE SHOPPING CO	7	8	216,630	23,742	小売
YUHAN CORP	4	5	151,294	16,581	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONGBU INSURANCE CO LTD	25	29	156,350	17,135	保険
S-OIL CORP	26	33	235,431	25,803	エネルギー
KCC CORP	3	4	225,250	24,687	資本財
DAEWOO INTERNATIONAL CORP	26	32	96,057	10,527	資本財
SAMSUNG CARD CO	20	25	110,670	12,129	各種金融
LS INDUSTRIAL SYSTEMS	9	9	51,775	5,674	資本財
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18	—	—	—	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	23	27	313,005	34,305	自動車・自動車部品
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	45	56	296,736	32,522	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	15	28	128,760	14,112	運輸
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	37	44	477,120	52,292	保険
CHEIL INDUSTRIES INC	28	—	—	—	素材
LOTTE CHEMICAL CORP	10	11	293,480	32,165	素材
GS HOLDINGS	31	38	187,530	20,553	エネルギー
NH INVESTMENT & SECURITIES C	65	113	158,179	17,336	各種金融
HANWHA CHEMICAL CORP	51	86	137,170	15,033	素材
HYOSUNG CORPORATION	15	18	229,075	25,106	素材
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	6	6	61,171	6,704	資本財
HANWHA CORPORATION	25	34	146,710	16,079	素材
CJ CHEILJEDANG CORP	4	5	255,080	27,956	食品・飲料・タバコ
BNK FINANCIAL GROUP INC	95	142	229,330	25,134	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	8	14	326,160	35,747	運輸
DGB FINANCIAL GROUP INC	85	123	151,290	16,581	銀行
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	14	18	212,750	23,317	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	5	6	306,495	33,591	素材

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円		
E-MART CO LTD	12	15	361,900	39,664	食品・生活必需品小売り	
HYUNDAI WIA CORP	9	12	184,140	20,181	自動車・自動車部品	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	9	9	78,864	8,643	素材	
DOOSAN CORP	4	6	77,675	8,513	資本財	
SK C&C CO LTD	14	15	376,650	41,280	ソフトウェア・サービス	
ORION CORP	2	2	364,000	39,894	食品・飲料・タバコ	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	35	44	123,860	13,575	保険	
WOORI FINANCE HOLDINGS CO	217	—	—	—	銀行	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	22	35	236,250	25,893	資本財	
SK NETWORKS CO LTD	86	86	66,134	7,248	資本財	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	40	70	66,150	7,250	運輸	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	0.4	0.5	93,700	10,269	食品・飲料・タバコ	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	130	167	130,260	14,276	保険	
LG INNOTEK CO LTD	6	10	102,752	11,261	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	4	6	117,495	12,877	素材	
HANKOOK TIRE CO LTD	43	54	224,787	24,636	自動車・自動車部品	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	55	78	55,146	6,044	資本財	
HALLA VISTEON CLIMATE CONTRO	24	30	119,100	13,053	自動車・自動車部品	
HITE JINRO CO LTD	16	16	36,000	3,945	食品・飲料・タバコ	
NHN ENTERTAINMENT CORP	7	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
PARADISE CO LTD	—	33	87,120	9,548	消費者サービス	
CJ KOREA EXPRESS CORP	—	5	116,290	12,745	運輸	
HOTEL SHILLA CO LTD	—	26	284,040	31,130	小売	
HANSSEM CO LTD	—	8	177,480	19,451	耐久消費財・アパレル	
WOORI BANK	—	232	248,314	27,215	銀行	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	—	16	147,258	16,139	商業・専門サービス	
SAMSUNG SDS CO LTD	—	20	518,665	56,845	ソフトウェア・サービス	
CHEIL INDUSTRIES INC	—	11	159,895	17,524	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,885 104	6,252 107	49,522,632 —	5,427,680 <13.7%>	
(台湾)			千ニュー台湾ドル			
COMPAL ELECTRONICS	2,657	3,237	8,806	34,434	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
DELTA ELECTRONICS INC	1,112	1,382	24,603	96,198	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	1,829	2,290	7,754	30,321	資本財	
FORMOSA PLASTICS CORP	2,496	3,136	24,554	96,009	素材	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	6,620	9,301	86,690	338,960	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	7,440	9,040	12,656	49,484	半導体・半導体製造装置	
NAN YA PLASTICS CORP	2,945	3,615	27,008	105,602	素材	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	340	430	9,632	37,661	食品・生活必需品小売り	
SILICONWARE PRECISION INDS	1,870	2,230	10,927	42,724	半導体・半導体製造装置	
TAIWAN CEMENT	2,037	2,567	10,948	42,808	素材	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	14,840	18,480	274,428	1,073,013	半導体・半導体製造装置	
ASUSTEK COMPUTER INC	407	527	16,016	62,626	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	297	387	3,487	13,634	半導体・半導体製造装置	
QUANTA COMPUTER INC	1,541	2,021	15,686	61,335	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	4,668	6,203	33,809	132,196	保険	
ACER INC	1,531	2,151	4,002	15,648	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	3,916	5,521	7,647	29,903	銀行	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	3,775	4,735	20,837	81,476	半導体・半導体製造装置	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	1,954	2,404	18,585	72,668	素材	
WAN HAI LINES LTD	300	520	1,742	6,811	運輸	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	4,070	5,020	33,037	129,175	各種金融	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千ニュー台湾ドル	千円	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	266	347	3,131	12,245	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDIATEK INC	862	1,072	39,677	155,138	半導体・半導体製造装置
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	4,163	5,876	7,992	31,249	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	8,213	10,271	23,316	91,168	銀行
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,044	1,304	14,278	55,830	電気通信サービス
CHINA STEEL CORP	7,070	9,009	22,974	89,828	素材
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	350	430	6,600	25,807	半導体・半導体製造装置
ADVANTECH CO LTD	160	238	5,816	22,744	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	538	675	6,149	24,045	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	420	490	17,248	67,439	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AU OPTRONICS CORP	5,540	6,520	9,975	39,004	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
U-MING MARINE TRANSPORT CORP	270	270	1,236	4,835	運輸
EPICSTAR CORP	520	760	3,518	13,758	半導体・半導体製造装置
HTC CORP	437	497	5,521	21,589	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINSUS INTERCONNECT TECH	160	230	1,987	7,769	半導体・半導体製造装置
POWERTECH TECHNOLOGY INC	363	493	3,002	11,739	半導体・半導体製造装置
INVENTEC CORP	1,354	1,594	3,340	13,059	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	2,310	2,880	28,540	111,594	電気通信サービス
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	181	231	3,507	13,713	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PHISON ELECTRONICS CORP	70	100	2,825	11,045	半導体・半導体製造装置
WPG HOLDINGS LTD	854	1,044	4,113	16,083	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CLEVO COMPANY	284	284	1,340	5,241	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GIANT MANUFACTURING	170	220	5,896	23,053	耐久消費財・アパレル
TSRC CORP	330	—	—	—	素材
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	210	370	1,398	5,468	不動産
FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS	20	22	717	2,804	消費者サービス
RUENTEX INDUSTRIES LTD	320	410	3,054	11,943	耐久消費財・アパレル
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	801	981	4,131	16,154	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	5,169	6,668	11,636	45,497	各種金融
INNOLUX CORP	4,051	6,151	9,872	38,601	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	3,493	4,471	8,407	32,871	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	3,984	5,949	5,914	23,124	保険
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	990	1,240	9,076	35,490	電気通信サービス
FENG HSIN IRON & STEEL CO	260	—	—	—	素材
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,004	1,264	9,038	35,340	自動車・自動車部品
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	671	881	7,025	27,469	エネルギー
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	5,677	7,597	20,437	79,910	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	4,068	5,760	11,060	43,247	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	60	77	24,549	95,988	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	2,624	3,456	17,283	67,579	食品・飲料・タバコ
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	2,760	3,755	6,873	26,874	銀行
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	8,492	10,392	12,730	49,777	銀行
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,257	1,624	6,237	24,386	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASIA CEMENT CORP	1,264	1,662	6,393	24,998	素材
YULON MOTOR COMPANY	440	600	2,379	9,301	自動車・自動車部品
POU CHEN	1,205	1,585	7,124	27,857	耐久消費財・アパレル
WISTRON CORP	1,364	1,871	4,632	18,113	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	500	620	3,397	13,284	素材
INOTERA MEMORIES INC	—	1,680	5,115	20,001	半導体・半導体製造装置
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	710	1,010	1,711	6,693	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEGATRON CORP	969	1,219	11,063	43,257	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA AIRLINES LTD	1,680	2,080	3,088	12,077	運輸

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千ニュー台湾ドル	千円		
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	3,218	4,821	9,860	38,552	銀行	
WALSIN LIHWA CORP	1,900	2,700	2,381	9,311	資本財	
FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	538	788	1,940	7,587	小売	
TPK HOLDING CO LTD	134	204	4,262	16,665	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	1,285	2,176	6,953	27,187	保険	
CHINA PETROCHEMICAL DEV CORP	1,252	—	—	—	素材	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	111	135	3,085	12,064	資本財	
TAIWAN GLASS IND CORP	669	669	1,366	5,341	資本財	
EVA AIRWAYS CORP	970	1,290	2,767	10,819	運輸	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	919	1,319	2,633	10,296	運輸	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	3,445	5,057	8,244	32,235	銀行	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	160	180	9,342	36,527	小売	
TECO ELECTRIC & MACHINERY	1,180	1,380	4,195	16,403	資本財	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	265	335	3,570	13,959	半導体・半導体製造装置	
CTCI CORP	330	460	2,419	9,460	資本財	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	390	500	2,620	10,244	不動産	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	180	420	3,347	13,088	不動産	
NAN KANG RUBBER TIRE CO LTD	331	—	—	—	自動車・自動車部品	
TAIWAN BUSINESS BANK	1,796	2,803	2,787	10,897	銀行	
LCY CHEMICAL CORP	260	—	—	—	素材	
CHENG UEI PRECISION INDUSTRY	280	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STANDARD FOODS CORP	172	278	2,118	8,283	食品・飲料・タバコ	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	110	210	2,236	8,744	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FORMOSA TAFFETA CO.	420	660	2,412	9,432	耐久消費財・アパレル	
CHALLENGE HOLDING CO LTD	440	716	5,957	23,292	各種金融	
SCINOPHARM TAIWAN LTD	157	163	747	2,922	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRANSCEND INFORMATION INC	140	140	1,680	6,568	半導体・半導体製造装置	
HERMES MICROVISION INC	20	30	6,450	25,219	半導体・半導体製造装置	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	140	147	3,329	13,018	耐久消費財・アパレル	
CHINA MOTOR CORP	360	360	910	3,561	自動車・自動車部品	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	420	560	2,556	9,995	半導体・半導体製造装置	
YANG MING MARINE TRANSPORT	880	880	1,293	5,057	運輸	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	100	124	5,356	20,945	耐久消費財・アパレル	
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	900	1,400	1,694	6,623	電気通信サービス	
小計	株数・金額	180,516	234,362	1,197,725	4,683,106	
銘柄数<比率>		106	101	—	<11.8%>	
(インド)				千インドルピー		
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	909	1,128	138,304	261,394	銀行	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	289	355	90,865	171,736	ソフトウェア・サービス	
ITC LTD	1,353	1,694	55,300	104,518	食品・飲料・タバコ	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	390	575	49,720	93,971	家庭用品・パーソナル用品	
JINDAL STEEL & POWER LTD	210	300	4,068	7,688	素材	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	335	450	10,561	19,961	資本財	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	480	575	18,342	34,667	エネルギー	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	690	800	11,400	21,546	素材	
COAL INDIA LTD	315	530	19,713	37,258	エネルギー	
GAIL INDIA LTD	195	230	8,580	16,216	公益事業	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	185	—	—	—	銀行	
AMBUJA CEMENTS LTD	420	490	11,686	22,087	素材	
HERO MOTOCORP LTD	49	39	9,417	17,799	自動車・自動車部品	
BAJAJ AUTO LTD	50	63	13,749	25,985	自動車・自動車部品	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	379	611	58,982	111,477	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円	
ADANI ENTERPRISES LTD	80	108	7,637	14,434	資本財
ASIAN PAINTS LTD	165	212	16,358	30,918	素材
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	760	—	—	—	公益事業
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	87	117	9,631	18,203	各種金融
VEDANTA LTD	610	900	20,727	39,174	素材
TATA POWER CO LTD	710	860	6,389	12,076	公益事業
BHARTI AIRTEL LTD	375	460	18,225	34,445	電気通信サービス
CIPLA LTD	200	260	17,318	32,732	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NTPC LTD	640	1,290	18,698	35,340	公益事業
INFOSYS LTD	269	677	134,990	255,131	ソフトウェア・サービス
ULTRATECH CEMENT LTD	23	28	8,076	15,263	素材
JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	540	—	—	—	資本財
ACC LTD	10	38	5,696	10,765	素材
HDFC BANK LIMITED	713	—	—	—	銀行
DLF LTD	290	370	4,819	9,108	不動産
DR. REDDY'S LABORATORIES	64	90	30,237	57,148	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ICICI BANK LTD	133	847	27,400	51,786	銀行
RELIANCE INDUSTRIES LTD	748	964	86,369	163,238	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	88	1,140	31,469	59,477	銀行
TATA STEEL LTD	170	253	9,540	18,031	素材
LIC HOUSING FINANCE LTD	150	205	8,743	16,524	銀行
RELIANCE POWER LTD	400	—	—	—	公益事業
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	112	134	10,060	19,014	エネルギー
IDEA CELLULAR LTD	370	820	14,030	26,517	電気通信サービス
CAIRN INDIA LTD	280	330	6,928	13,094	エネルギー
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	67	84	9,300	17,577	家庭用品・パーソナル用品
RURAL ELECTRIFICATION CORP	160	202	6,016	11,371	各種金融
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	—	392	12,453	23,537	メディア
POWER FINANCE CORPORATION	185	185	4,898	9,258	各種金融
BANK OF BARODA	22	—	—	—	銀行
DABUR INDIA LTD	150	380	9,773	18,472	家庭用品・パーソナル用品
JSW STEEL LTD	55	55	4,967	9,388	素材
LARSEN & TOUBRO LTD	194	239	38,605	72,964	資本財
RANBAXY LABORATORIES LTD	80	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	70	70	2,889	5,462	公益事業
UNITED SPIRITS LTD	54	34	11,457	21,654	食品・飲料・タバコ
SIEMENS LTD	38	52	6,979	13,191	資本財
WIPRO LTD	370	462	25,017	47,282	ソフトウェア・サービス
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	193	253	30,214	57,105	自動車・自動車部品
TATA MOTORS LTD	480	617	32,682	61,769	自動車・自動車部品
HCL TECHNOLOGIES LTD	153	374	35,227	66,579	ソフトウェア・サービス
UNITED BREWERIES LTD	42	56	5,287	9,993	食品・飲料・タバコ
DIVI'S LABORATORIES LTD	25	33	5,713	10,799	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	240	375	12,901	24,384	運輸
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	52	52	6,503	12,290	ヘルスケア機器・サービス
OIL INDIA LTD	65	88	4,281	8,092	エネルギー
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	290	560	3,628	6,858	電気通信サービス
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	5	8	5,468	10,335	食品・飲料・タバコ
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	37	57	5,775	10,915	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADITYA BIRLA NUVO LTD	20	29	5,417	10,239	資本財
RELIANCE CAPITAL LTD	60	—	—	—	各種金融
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	160	215	5,891	11,133	各種金融

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円		
YES BANK LTD	100	—	—	—	銀行	
NESTLE INDIA LTD	14	16	11,434	21,611	食品・飲料・タバコ	
TECH MAHINDRA LTD	33	157	9,924	18,756	ソフトウェア・サービス	
AUROBINDO PHARMA LTD	—	104	14,173	26,787	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	—	167	8,547	16,153	自動車・自動車部品	
BOSCH LTD	—	5	12,826	24,241	自動車・自動車部品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,651 69	23,268 64	1,342,299 —	2,536,945 <6.4%>	
(アラブ首長国連邦)			アラブディルハム			
EMAAR PROPERTIES PJSC	—	2,625	2,068,500	67,784	不動産	
ALDAR PROPERTIES PJSC	—	2,340	624,780	20,474	不動産	
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	—	750	547,500	17,941	銀行	
NATIONAL BANK OF ABU DHABI	—	484	539,660	17,684	銀行	
ARABTEC HOLDING CO PJSC	—	1,774	459,595	15,060	資本財	
FIRST GULF BANK	—	675	1,036,125	33,953	銀行	
DUBAI FINANCIAL MARKET PJSC	—	1,520	297,920	9,762	各種金融	
DUBAI ISLAMIC BANK	—	780	523,380	17,151	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	10,948 8	6,097,460 —	199,813 <0.5%>	
(カタール)			千カタールリアル			
MASRAF AL RAYAN	—	281	1,347	44,544	銀行	
OOREDOO QSC	—	61	613	20,267	電気通信サービス	
QATAR NATIONAL BANK	—	127	2,556	84,513	銀行	
INDUSTRIES QATAR	—	114	1,661	54,925	資本財	
VODAFONE QATAR	—	265	465	15,384	電気通信サービス	
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	—	21	465	15,395	公益事業	
QATAR ISLAMIC BANK	—	43	458	15,168	銀行	
BARWA REAL ESTATE CO	—	77	389	12,880	不動産	
COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	—	67	378	12,511	銀行	
DOHA BANK QSC	—	55	301	9,964	銀行	
GULF INTERNATIONAL SERVICES	—	30	255	8,440	エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	1,142 11	8,892 —	293,996 <0.7%>	
(南アフリカ)			千南アフリカランド			
BARLOWORLD LTD	127	160	1,535	15,259	資本財	
REUNERT LTD	110	—	—	—	資本財	
SAPPI LIMITED	305	435	2,085	20,728	素材	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	43	35	1,131	11,251	素材	
NEDBANK GROUP LTD	120	146	3,694	36,720	銀行	
SASOL LTD	328	409	18,668	185,567	エネルギー	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	247	300	4,026	40,021	素材	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	320	410	2,720	27,040	素材	
GOLD FIELDS LTD	480	550	2,378	23,644	素材	
NORTHAM PLATINUM LTD	210	—	—	—	素材	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	460	699	6,464	64,255	小売	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	275	280	2,510	24,956	小売	
TELKOM SA SOC LTD	—	190	1,393	13,852	電気通信サービス	
TIGER BRANDS LTD	103	125	3,841	38,182	食品・飲料・タバコ	
SANLAM LTD	1,090	1,389	10,171	101,106	保険	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	267	352	5,884	58,490	食品・生活必需品小売り	
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	1,115	1,616	12,446	123,721	耐久消費財・アパレル	
STANDARD BANK GROUP LTD	737	914	15,546	154,532	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	
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカランド	千円	
RMB HOLDINGS LTD	424	519	3,579	35,575	各種金融
REMGRO LTD	298	364	9,544	94,868	各種金融
PPC LTD	320	410	668	6,642	素材
NETCARE LTD	559	734	2,934	29,169	ヘルスケア機器・サービス
NASPERS LTD-N SHS	241	300	53,968	536,449	メディア
MTN GROUP LTD	1,031	1,259	29,152	289,772	電気通信サービス
MASSMART HOLDINGS LTD	70	86	1,308	13,004	食品・生活必需品小売り
KUMBA IRON ORE LTD	51	41	664	6,604	素材
IMPERIAL HOLDINGS LTD	115	143	2,752	27,356	小売
INVESTEC LTD	158	186	2,097	20,849	各種金融
HARMONY GOLD MINING CO LTD	220	—	—	—	素材
FIRSTRAND LTD	1,890	2,552	13,913	138,300	各種金融
THE FOSCHINI GROUP LTD	110	154	2,775	27,584	小売
EXXARO RESOURCES LTD	81	101	981	9,755	エネルギー
BIDVEST GROUP LTD	181	244	7,597	75,518	資本財
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	199	258	4,721	46,930	銀行
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	61	75	813	8,086	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	212	258	9,159	91,040	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	780	—	—	—	銀行
DISCOVERY LTD	172	275	3,509	34,879	保険
VODACOM GROUP LTD	226	271	4,005	39,816	電気通信サービス
PICK N PAY STORES LTD	165	165	917	9,123	食品・生活必需品小売り
MMI HOLDINGS LTD	650	860	2,819	28,021	保険
SPAR GROUP LIMITED/THE	98	121	2,341	23,279	食品・生活必需品小売り
RMI HOLDINGS	440	520	2,340	23,259	保険
LIBERTY HOLDINGS LTD	75	95	1,573	15,638	保険
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	550	680	2,737	27,205	ヘルスケア機器・サービス
MR PRICE GROUP LTD	150	177	4,356	43,303	小売
ASSORE LTD	23	23	253	2,516	素材
NAMPAK LTD	340	430	1,838	18,272	素材
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	222	290	3,503	34,821	ヘルスケア機器・サービス
CORONATION FUND MANAGERS LTD	—	185	1,628	16,182	各種金融
BRAIT SE	—	240	2,158	21,458	各種金融
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	—	295	802	7,981	消費者サービス
小 計	株 数	株 数	275,915	2,742,602	
	銘 柄 数 < 比 率 >	銘 柄 数 < 比 率 >	—	< 6.9% >	
合 計	株 数	株 数	—	37,477,479	
	銘 柄 数 < 比 率 >	銘 柄 数 < 比 率 >	—	< 94.8% >	

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

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

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)	千口	千口	千メキシコペソ	千円	%
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	81	176	6,962	54,513	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	81	176	6,962	54,513
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>
(トルコ)			千トルコリラ		
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	122	144	443	19,785	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	122	144	443	19,785
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>
(南アフリカ)			千南アフリカランド		
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	135	178	4,616	45,884	0.1
REDEFINE PROPERTIES LTD	189	269	3,093	30,749	0.1
RESILIENT PROPERTY INCOME	—	19	1,800	17,900	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	324	466	9,510	94,534
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	3	—	<0.2%>
合 計	口 数 ・ 金 額	527	786	—	168,833
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	5	—	<0.4%>

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の割合です。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外国	株式先物取引	百万円	百万円
	MINI MS	1,976	—

(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

(2015年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 37,477,479	% 94.7
投資証券	168,833	0.4
コール・ローン等、その他	1,941,168	4.9
投資信託財産総額	39,587,480	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (39,376,310千円) の投資信託財産総額 (39,587,480千円) に対する比率は99.5%です。
 (注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=120.15円	1 メキシコペソ=7.83円	1 ブラジルリアル=39.23円	100チリペソ=19.70円
100コロンビアペソ=5.03円	1 ユーロ=133.79円	1 トルコリラ=44.61円	1 チェココロナ=4.88円
100ハンガリーフォリント=43.87円	1 ポーランドズロチ=32.78円	1 香港ドル=15.50円	1 マレーシアリンギット=33.14円
1 タイバート=3.56円	1 フィリピンペソ=2.69円	100インドネシアルピア=0.92円	100韓国ウォン=10.96円
1 ニュー台湾ドル=3.91円	1 インドルピー=1.89円	1 アラブディルハム=32.77円	1 カタールリアル=33.06円
1 南アフリカランド=9.94円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年5月12日現在)

○損益の状況 (2014年5月13日～2015年5月12日)

項 目	当 期 末
(A) 資産	39,731,709,366 円
コール・ローン等	1,639,535,378
株式(評価額)	37,477,479,628
投資証券(評価額)	168,833,007
未収入金	171,760,942
未収配当金	42,409,153
未収利息	263
差入委託証拠金	231,690,995
(B) 負債	200,852,089
未払金	169,149,330
未払解約金	31,702,759
(C) 純資産総額(A-B)	39,530,857,277
元本	16,489,570,857
次期繰越損益金	23,041,286,420
(D) 受益権総口数	16,489,570,857口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,973円

項 目	当 期
(A) 配当等収益	740,150,966 円
受取配当金	737,498,378
受取利息	2,601,329
その他収益金	52,258
支払利息	△ 999
(B) 有価証券売買損益	5,716,556,787
売買益	8,377,446,533
売買損	△ 2,660,889,746
(C) 先物取引等取引損益	74,337,628
取引益	293,485,160
取引損	△ 219,147,532
(D) 保管費用等	△ 47,958,504
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	6,483,086,877
(F) 前期繰越損益金	12,005,206,223
(G) 追加信託差損益金	6,389,620,422
(H) 解約差損益金	△ 1,836,627,102
(I) 計(E+F+G+H)	23,041,286,420
次期繰越損益金(I)	23,041,286,420

<注記事項>

①期首元本額	12,660,631,564円
期中追加設定元本額	5,431,117,878円
期中一部解約元本額	1,602,178,585円

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

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

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

②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）	
F P バランスファンド（安定型）	6, 218, 523円
F P バランスファンド（安定成長型）	28, 506, 376円
e M A X I S 新興国株式インデックス	11, 398, 126, 921円
e M A X I S バランス（8資産均等型）	648, 747, 172円
e M A X I S バランス（波乗り型）	361, 366, 520円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	26, 026, 502円
コアバランス	93, 111円
三菱UFJ DC 新興国株式インデックスファンド	2, 575, 611, 561円
新興国株式インデックスオープン	182, 765, 275円
e M A X I S 全世界株式インデックス	249, 801, 002円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	34, 763, 998円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	24, 010, 529円
MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	890, 591, 742円
新興国株式インデックスファンド（ラップ向け）	42, 734, 617円
アドバンスト・バランスⅡ（FOFs用）（適格機関投資家限定）	16, 846, 709円
アドバンスト・バランスⅠ（FOFs用）（適格機関投資家限定）	3, 360, 299円
合計	16, 489, 570, 857円

【お 知 ら せ】

- ①書面決議を行う場合の受益者数要件の撤廃を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ②併合手続要件の緩和を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ③買取請求の一部適用除外を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ④新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑤デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑥信託金の限度額を従来の1,000億円から3,000億円へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年2月25日)

三菱UFJ 国内債券マザーファンド

《第15期》決算日2015年5月20日

[計算期間：2014年5月21日～2015年5月20日]

「三菱UFJ 国内債券マザーファンド」は、5月20日に第15期の決算を行いました。

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

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合指数		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
11期(2011年5月20日)	12,047	1.6	331.342	1.6	99.5	—	286,722
12期(2012年5月21日)	12,405	3.0	341.171	3.0	99.4	0.1	280,753
13期(2013年5月20日)	12,518	0.9	344.269	0.9	99.0	0.6	316,364
14期(2014年5月20日)	12,874	2.8	354.058	2.8	99.4	—	290,123
15期(2015年5月20日)	13,192	2.5	362.715	2.4	99.3	—	256,631

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合指数		債 券 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %
	円	騰 落 率 %		騰 落 率 %		
(期 首) 2014年5月20日	12,874	—	354.058	—	99.4	—
5月末	12,887	0.1	354.387	0.1	99.6	0.3
6月末	12,925	0.4	355.413	0.4	100.0	0.1
7月末	12,946	0.6	356.015	0.6	99.7	0.2
8月末	12,988	0.9	357.148	0.9	99.3	0.2
9月末	12,997	1.0	357.408	0.9	100.2	0.2
10月末	13,058	1.4	359.079	1.4	99.2	—
11月末	13,135	2.0	361.194	2.0	100.6	—
12月末	13,272	3.1	364.961	3.1	99.7	—
2015年1月末	13,275	3.1	365.067	3.1	99.2	—
2月末	13,204	2.6	363.039	2.5	100.9	0.1
3月末	13,211	2.6	363.279	2.6	100.0	—
4月末	13,254	3.0	364.501	2.9	100.3	—
(期 末) 2015年5月20日	13,192	2.5	362.715	2.4	99.3	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.5%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(2.4%)を0.1%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内債券市況

- ・日銀による大規模国債買い入れオペの効果や世界景気に対する慎重な見方を受けて、債券市況は緩やかな上昇（利回りは低下）基調となっていました。日銀が2014年10月末に「量的・質的金融緩和」の拡大を決定したことから、2015年1月中旬にかけて一段の上昇となりました。
- ・その後は、日銀の追加金融緩和観測の後退や米国金利の上昇などから市況は下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
- ・なお、期末時点では、資金フロー対応のため、債券先物のポジションは保有していません。
- ・ベンチマーク（NOMURA-BPI総合指数）の構成銘柄を種別や年限などの属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました*。
*一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは2.4%の上昇となったため、カイ離は0.1%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	0.1%程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

- ・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

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2014年5月21日～2015年5月20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 有価証券等を売買する際に発生する費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,096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

(2014年5月21日～2015年5月20日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 57,722,736	千円 84,038,554
	地方債証券	721,057	3,326,365
	特殊債券	1,713,446	6,557,060 (430,202)
	社債券	1,218,818	4,027,539 (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 4,379	百万円 4,380	百万円 587	百万円 587

○利害関係人との取引状況等

(2014年5月21日～2015年5月20日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	
			B/A			D/C
公社債	百万円 61,376	百万円 19,382	% 31.6	百万円 97,949	百万円 26,474	% 27.0

(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 649	百万円 637

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 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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJリース、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2015年5月20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	190,789,000 (100,000)	203,862,685 (100,789)	79.4 (0.0)	— (—)	48.2 (—)	21.3 (0.0)	9.9 (—)	
地方債証券	14,223,490 (14,223,490)	15,236,870 (15,236,870)	5.9 (5.9)	— (—)	3.6 (3.6)	2.0 (2.0)	0.4 (0.4)	
特殊債券 (除く金融債)	18,327,108 (18,327,108)	19,597,325 (19,597,325)	7.6 (7.6)	— (—)	5.0 (5.0)	2.2 (2.2)	0.4 (0.4)	
金融債券	2,530,000 (2,530,000)	2,540,140 (2,540,140)	1.0 (1.0)	— (—)	— (—)	0.7 (0.7)	0.3 (0.3)	
普通社債券	13,051,000 (13,051,000)	13,672,120 (13,672,120)	5.3 (5.3)	— (—)	1.9 (1.9)	2.4 (2.4)	1.0 (1.0)	
合 計	238,920,598 (48,231,598)	254,909,142 (51,147,246)	99.3 (19.9)	— (—)	58.7 (10.5)	28.5 (7.3)	12.1 (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	償還年月日
	利率	額面金額	評価額		
国債証券	%	千円	千円		
第341回利付国債(2年)	0.1	250,000	250,292		2016/6/15
第342回利付国債(2年)	0.1	680,000	680,856		2016/7/15
第343回利付国債(2年)	0.1	900,000	901,215		2016/8/15
第344回利付国債(2年)	0.1	1,130,000	1,131,627		2016/9/15
第345回利付国債(2年)	0.1	1,300,000	1,302,002		2016/10/15
第347回利付国債(2年)	0.1	200,000	200,344		2016/12/15
第348回利付国債(2年)	0.1	210,000	210,399		2017/1/15
第349回利付国債(2年)	0.1	1,300,000	1,302,587		2017/2/15
第350回利付国債(2年)	0.1	880,000	881,830		2017/3/15
第351回利付国債(2年)	0.1	1,170,000	1,172,550		2017/4/15
第97回利付国債(5年)	0.4	2,150,000	2,159,632		2016/6/20
第98回利付国債(5年)	0.3	700,000	702,380		2016/6/20
第99回利付国債(5年)	0.4	1,880,000	1,890,246		2016/9/20
第100回利付国債(5年)	0.3	720,000	722,966		2016/9/20
第101回利付国債(5年)	0.4	2,050,000	2,063,284		2016/12/20
第102回利付国債(5年)	0.3	1,750,000	1,758,575		2016/12/20
第103回利付国債(5年)	0.3	1,650,000	1,659,339		2017/3/20
第104回利付国債(5年)	0.2	490,000	491,876		2017/3/20
第105回利付国債(5年)	0.2	2,810,000	2,821,970		2017/6/20
第106回利付国債(5年)	0.2	3,350,000	3,366,013		2017/9/20
第107回利付国債(5年)	0.2	1,650,000	1,658,728		2017/12/20
第108回利付国債(5年)	0.1	900,000	902,439		2017/12/20
第109回利付国債(5年)	0.1	1,200,000	1,203,552		2018/3/20
第110回利付国債(5年)	0.3	1,000,000	1,008,620		2018/3/20
第111回利付国債(5年)	0.4	1,220,000	1,233,969		2018/3/20
第112回利付国債(5年)	0.4	1,210,000	1,225,088		2018/6/20
第113回利付国債(5年)	0.3	2,590,000	2,614,320		2018/6/20
第114回利付国債(5年)	0.3	420,000	424,124		2018/9/20
第115回利付国債(5年)	0.2	1,740,000	1,751,292		2018/9/20
第116回利付国債(5年)	0.2	2,900,000	2,918,676		2018/12/20
第117回利付国債(5年)	0.2	2,840,000	2,857,892		2019/3/20
第118回利付国債(5年)	0.2	790,000	794,819		2019/6/20
第119回利付国債(5年)	0.1	1,640,000	1,643,329		2019/6/20
第120回利付国債(5年)	0.2	1,260,000	1,267,345		2019/9/20
第121回利付国債(5年)	0.1	1,630,000	1,632,461		2019/9/20
第122回利付国債(5年)	0.1	2,600,000	2,602,366		2019/12/20
第123回利付国債(5年)	0.1	1,620,000	1,620,388		2020/3/20
第1回利付国債(40年)	2.4	210,000	258,978		2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	345,000	407,886		2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	345,000	408,183		2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	500,000	591,905		2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	460,000	518,249		2052/3/20
第6回利付国債(40年)	1.9	520,000	571,573		2053/3/20
第7回利付国債(40年)	1.7	510,000	529,823		2054/3/20
第8回利付国債(40年)	1.4	140,000	132,703		2055/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第280回利付国債 (10年)	1.9	500,000	510,305	2016/6/20
第282回利付国債 (10年)	1.7	740,000	756,849	2016/9/20
第283回利付国債 (10年)	1.8	460,000	471,086	2016/9/20
第284回利付国債 (10年)	1.7	1,180,000	1,211,895	2016/12/20
第285回利付国債 (10年)	1.7	1,320,000	1,361,250	2017/3/20
第286回利付国債 (10年)	1.8	130,000	134,878	2017/6/20
第287回利付国債 (10年)	1.9	870,000	904,460	2017/6/20
第288回利付国債 (10年)	1.7	740,000	769,415	2017/9/20
第289回利付国債 (10年)	1.5	1,610,000	1,672,532	2017/12/20
第290回利付国債 (10年)	1.4	190,000	197,575	2018/3/20
第291回利付国債 (10年)	1.3	230,000	238,519	2018/3/20
第292回利付国債 (10年)	1.7	70,000	73,385	2018/3/20
第293回利付国債 (10年)	1.8	165,000	174,172	2018/6/20
第294回利付国債 (10年)	1.7	270,000	284,177	2018/6/20
第295回利付国債 (10年)	1.5	150,000	156,952	2018/6/20
第296回利付国債 (10年)	1.5	1,620,000	1,700,092	2018/9/20
第297回利付国債 (10年)	1.4	760,000	797,521	2018/12/20
第298回利付国債 (10年)	1.3	520,000	543,816	2018/12/20
第299回利付国債 (10年)	1.3	810,000	849,163	2019/3/20
第300回利付国債 (10年)	1.5	100,000	105,599	2019/3/20
第301回利付国債 (10年)	1.5	620,000	656,728	2019/6/20
第302回利付国債 (10年)	1.4	680,000	717,515	2019/6/20
第303回利付国債 (10年)	1.4	1,470,000	1,555,098	2019/9/20
第304回利付国債 (10年)	1.3	520,000	547,856	2019/9/20
第305回利付国債 (10年)	1.3	2,190,000	2,312,990	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)	1.4	1,430,000	1,520,404	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)	1.3	725,000	767,347	2020/3/20
第308回利付国債 (10年)	1.3	1,030,000	1,093,015	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	1,410,000	1,481,994	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	1,630,000	1,707,783	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	590,000	611,900	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	1,890,000	2,004,250	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	940,000	1,004,474	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	340,000	359,383	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	1,380,000	1,469,506	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	500,000	529,570	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	710,000	753,246	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	1,100,000	1,160,093	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	1,760,000	1,869,560	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	150,000	158,359	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	940,000	993,326	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	730,000	766,478	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	590,000	619,258	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	1,510,000	1,574,341	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	1,720,000	1,791,964	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	650,000	672,256	2022/12/20

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327回利付国債 (10年)	0.8	1,090,000	1,135,442	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	1,470,000	1,508,337	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	2,120,000	2,207,089	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	1,510,000	1,572,000	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	1,000,000	1,024,800	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	2,710,000	2,775,663	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	2,830,000	2,896,759	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	2,850,000	2,915,236	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	2,690,000	2,725,212	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	670,000	678,053	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	1,910,000	1,896,744	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	1,420,000	1,421,334	2025/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	120,000	153,522	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	170,000	208,499	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	190,000	230,314	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	125,000	162,540	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	180,000	215,580	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	170,000	208,578	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	225,000	272,434	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	160,000	180,681	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	90,000	95,812	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	263,000	266,171	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	100,000	110,717	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	205,000	240,118	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	390,000	449,697	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	380,000	463,554	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	440,000	544,002	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	345,000	426,071	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	350,000	425,701	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	360,000	431,017	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	290,000	347,234	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	260,000	320,213	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	250,000	298,590	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	335,000	412,374	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	270,000	332,405	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	250,000	307,810	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	305,000	364,069	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	590,000	715,552	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	540,000	665,388	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	525,000	647,876	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	640,000	777,862	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	715,000	855,969	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	645,000	760,029	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	690,000	828,055	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	863,000	980,920	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	835,000	985,066	2041/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第35回利付国債 (30年)	2.0	940,000	1,068,028	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	850,000	965,464	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	930,000	1,035,220	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	645,000	702,998	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	560,000	622,708	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	560,000	609,767	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	490,000	522,134	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	570,000	606,987	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	610,000	649,155	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	600,000	638,088	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	710,000	720,330	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	510,000	516,920	2045/3/20
第33回利付国債 (20年)	3.8	590,000	619,930	2016/9/20
第34回利付国債 (20年)	3.5	170,000	180,905	2017/3/20
第35回利付国債 (20年)	3.3	785,000	832,484	2017/3/20
第36回利付国債 (20年)	3.0	50,000	53,503	2017/9/20
第37回利付国債 (20年)	3.1	250,000	268,100	2017/9/20
第39回利付国債 (20年)	2.6	1,120,000	1,202,667	2018/3/20
第40回利付国債 (20年)	2.3	290,000	312,167	2018/9/20
第41回利付国債 (20年)	1.5	240,000	253,485	2019/3/20
第42回利付国債 (20年)	2.6	835,000	917,038	2019/3/20
第43回利付国債 (20年)	2.9	360,000	404,344	2019/9/20
第44回利付国債 (20年)	2.5	710,000	793,006	2020/3/20
第45回利付国債 (20年)	2.4	100,000	111,156	2020/3/20
第47回利付国債 (20年)	2.2	100,000	111,201	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	250,000	283,235	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)	2.1	170,000	189,606	2021/3/22
第50回利付国債 (20年)	1.9	515,000	568,426	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	140,000	155,985	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	260,000	292,177	2021/9/21
第53回利付国債 (20年)	2.1	80,000	90,224	2021/12/20
第54回利付国債 (20年)	2.2	530,000	601,189	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	240,000	269,925	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	370,000	416,779	2022/6/20
第57回利付国債 (20年)	1.9	160,000	179,112	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	350,000	392,707	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	590,000	654,616	2022/12/20
第60回利付国債 (20年)	1.4	230,000	249,957	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	260,000	274,757	2023/3/20
第62回利付国債 (20年)	0.8	560,000	583,004	2023/6/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	275,000	308,266	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	480,000	542,865	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	430,000	487,757	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	170,000	191,411	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)	1.9	80,000	90,928	2024/3/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	395,000	459,341	2024/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第69回利付国債 (20年)	2.1	120,000	138,456	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	510,000	603,324	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	200,000	233,072	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	645,000	748,348	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	200,000	230,484	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	380,000	441,438	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	230,000	267,984	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	210,000	240,466	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	260,000	300,328	2025/3/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	100,000	115,670	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	370,000	431,778	2025/6/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	700,000	818,468	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	182,000	213,081	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	410,000	475,866	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	230,000	269,737	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	532,000	634,920	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	170,000	201,128	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	360,000	430,509	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	360,000	426,484	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	620,000	735,791	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	180,000	215,670	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	850,000	1,000,518	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	480,000	560,088	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	310,000	365,183	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	640,000	769,913	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	120,000	141,548	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	490,000	584,040	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	340,000	401,087	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	845,000	997,936	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	370,000	441,824	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	550,000	670,307	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	360,000	439,383	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	320,000	386,441	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	310,000	366,615	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	520,000	615,524	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	190,000	227,243	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	30,000	35,517	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	750,000	868,612	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	820,000	949,437	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	110,000	130,235	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	60,000	71,856	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	740,000	876,707	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	810,000	959,574	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	680,000	805,419	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	140,000	167,783	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	455,000	545,212	2030/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第117回利付国債 (20年)	2.1	560,000	663,084	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	544,000	636,550	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	470,000	536,852	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	70,000	77,954	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	320,000	369,836	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	580,000	661,919	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	620,000	734,204	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	440,000	514,571	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	580,000	695,048	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	540,000	631,033	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	30,000	34,611	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	610,000	703,086	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	460,000	523,296	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	880,000	999,169	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	160,000	179,244	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	330,000	369,154	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	590,000	669,024	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	380,000	430,293	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	380,000	424,425	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	360,000	396,536	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	390,000	434,896	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	100,000	108,400	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	600,000	659,730	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	1,090,000	1,213,453	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	1,210,000	1,344,685	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	750,000	819,945	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	460,000	495,548	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	1,120,000	1,240,030	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	1,250,000	1,381,262	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	1,080,000	1,173,258	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	970,000	1,034,543	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	1,210,000	1,288,347	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	1,260,000	1,315,011	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	1,250,000	1,257,975	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	690,000	691,656	2035/3/20
第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013)	0.67	100,000	100,789	2018/11/15
小 計		190,789,000	203,862,685	
地方債証券				
第5回東京都公募公債 (20年)	2.11	100,000	115,904	2025/3/19
第7回東京都公募公債 (20年)	2.16	100,000	116,768	2025/9/19
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	70,000	84,256	2038/9/17
第10回東京都公募公債 (30年)	2.31	100,000	116,504	2039/9/20
第19回東京都公募公債 (20年)	2.13	100,000	117,878	2029/6/20
第22回東京都公募公債 (20年)	1.92	100,000	114,839	2030/6/20
第25回東京都公募公債 (20年)	1.8	100,000	112,253	2031/12/19
第27回東京都公募公債 (20年)	1.68	100,000	109,714	2032/12/20

銘柄	当 期 末		
	利 率	額 面 金 額	評 価 額
	%	千円	千円
地方債証券			
第629回東京都公募公債	1.45	82,100	82,753
第642回東京都公募公債	1.84	50,000	51,395
第643回東京都公募公債	1.7	26,000	26,770
第646回東京都公募公債	1.99	35,400	36,819
第655回東京都公募公債	1.42	30,000	31,150
第682回東京都公募公債	1.32	100,000	105,611
第689回東京都公募公債	1.08	140,000	146,847
第697回東京都公募公債	1.11	150,000	158,436
第700回東京都公募公債	1.02	100,000	105,223
第717回東京都公募公債	0.63	200,000	204,814
第718回東京都公募公債	0.6	100,000	102,178
第719回東京都公募公債	0.86	200,000	208,332
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	100,000	116,315
平成19年度第2回北海道公募公債	1.84	100,000	103,481
平成19年度第4回北海道公募公債	1.98	150,000	155,857
平成20年度第12回北海道公募公債	1.72	50,000	52,850
平成21年度第7回北海道公募公債	1.46	50,000	52,785
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	80,000	83,204
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	50,000	51,634
第2回神奈川県公募公債(30年)	2.87	100,000	126,512
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	122,257
第136回神奈川県公募公債	1.5	69,100	69,697
第142回神奈川県公募公債	1.95	39,920	40,914
第155回神奈川県公募公債	1.61	60,000	62,836
第196回神奈川県公募公債	0.678	100,000	102,696
第5回大阪府公募公債(20年)	2.16	100,000	117,526
第286回大阪府公募公債	1.5	80,000	80,770
第287回大阪府公募公債	1.6	50,000	50,573
第291回大阪府公募公債	2.0	100,000	102,095
第301回大阪府公募公債	1.83	50,000	51,665
第311回大阪府公募公債	1.68	50,000	52,192
第313回大阪府公募公債	1.66	50,000	52,289
第318回大阪府公募公債	1.7	14,000	14,749
第322回大阪府公募公債	1.62	60,000	63,322
第328回大阪府公募公債	1.43	120,000	126,428
第332回大阪府公募公債	1.58	50,000	53,188
第335回大阪府公募公債	1.48	30,000	31,846
第336回大阪府公募公債	1.46	50,000	53,070
第342回大阪府公募公債	1.2	25,000	26,340
第344回大阪府公募公債	1.06	21,000	21,985
第346回大阪府公募公債	1.25	140,000	148,268
第348回大阪府公募公債	1.32	50,000	53,227
第358回大阪府公募公債	0.97	70,000	73,376
平成20年度第3回京都府公募公債	1.57	20,200	21,271
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	2.19	200,000	237,278
平成22年度第2回京都府公募公債	1.16	40,000	42,109

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22年度第7回京都府公募公債	1.31	45,900	48,895	2021/3/22
平成23年度第2回京都府公募公債	1.2	66,000	70,034	2021/6/22
第2回兵庫県公募公債(30年)	2.36	50,000	58,191	2040/3/19
第5回兵庫県公募公債(15年)	1.31	100,000	107,005	2028/5/26
平成18年度第7回兵庫県公募公債	2.1	39,000	39,921	2016/7/27
平成19年度第1回兵庫県公募公債	1.85	50,000	51,689	2017/4/26
平成20年度第3回兵庫県公募公債	1.76	40,000	41,995	2018/5/22
平成21年度第35回兵庫県公募公債	1.46	40,000	42,400	2020/1/22
平成23年度第11回兵庫県公募公債	0.95	50,000	52,343	2022/1/27
平成24年度第18回兵庫県公募公債	0.77	100,000	103,297	2022/10/19
第3回静岡県公募公債(15年)	1.368	100,000	108,442	2027/10/29
第14回静岡県公募公債(20年)	1.736	100,000	110,894	2032/6/18
平成19年度第9回静岡県公募公債	1.53	50,000	52,072	2018/3/27
平成21年度第1回静岡県公募公債	1.58	114,740	121,475	2019/5/24
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	29,800	30,613	2023/10/24
平成20年度第8回愛知県公募公債(20年)	2.04	200,000	233,112	2028/12/20
平成21年度第6回愛知県公募公債	1.44	50,000	52,754	2019/7/30
平成21年度第10回愛知県公募公債	1.38	201,000	212,061	2019/10/30
平成22年度第5回愛知県公募公債	1.258	27,200	28,713	2020/6/30
平成23年度第11回愛知県公募公債	1.03	70,000	73,684	2021/10/28
平成23年度第20回愛知県公募公債	1.082	100,000	105,781	2022/3/29
平成24年度第13回愛知県公募公債	0.772	100,000	103,476	2022/11/30
平成19年度第1回広島県公募公債	1.78	150,000	155,121	2017/5/25
平成19年度第4回広島県公募公債	1.53	29,300	30,500	2018/3/19
平成21年度第1回広島県公募公債	1.57	20,000	21,165	2019/5/28
平成22年度第3回広島県公募公債	1.08	45,000	47,170	2020/9/24
第8回埼玉県公募公債(20年)	2.19	100,000	118,639	2029/9/20
第10回埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	114,984	2030/11/12
平成20年度第3回埼玉県公募公債	1.87	29,000	30,611	2018/6/25
平成21年度第8回埼玉県公募公債	1.3	12,000	12,636	2019/12/25
平成22年度第11回埼玉県公募公債	1.28	40,000	42,511	2021/2/25
平成23年度第1回埼玉県公募公債	1.37	100,000	106,989	2021/4/27
平成22年度第10回福岡県公募公債	1.36	50,000	53,367	2021/2/25
平成20年度第6回千葉県公募公債	1.64	179,000	188,590	2018/10/25
平成21年度第2回千葉県公募公債	1.57	80,000	84,664	2019/5/24
平成21年度第3回千葉県公募公債	1.64	132,000	140,211	2019/6/25
平成22年度第12回千葉県公募公債	1.28	80,000	85,022	2021/2/25
平成22年度第14回千葉県公募公債	1.33	80,000	85,320	2021/3/25
平成23年度第5回千葉県公募公債	1.06	80,000	84,378	2021/11/25
平成23年度第9回千葉県公募公債	1.0	80,000	84,176	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債	1.05	80,000	84,463	2022/4/25
平成21年度第1回新潟県公募公債	1.42	54,500	57,419	2019/7/29
平成21年度第2回新潟県公募公債	1.55	80,550	85,615	2019/11/27
平成22年度第1回岐阜県公募公債	1.21	42,000	44,321	2020/9/30
平成21年度第1回大分県公募公債	1.35	54,900	57,837	2019/10/31
第37回共同発行市場公募地方債	1.8	20,000	20,320	2016/4/25

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第44回共同発行市場公募地方債	1.8	49,700	50,988	2016/11/25
第46回共同発行市場公募地方債	1.8	50,000	51,439	2017/1/25
第55回共同発行市場公募地方債	1.85	50,000	52,156	2017/10/25
第60回共同発行市場公募地方債	1.49	100,000	104,016	2018/3/23
第67回共同発行市場公募地方債	1.5	100,000	104,879	2018/10/25
第68回共同発行市場公募地方債	1.69	171,200	180,845	2018/11/22
第69回共同発行市場公募地方債	1.56	34,000	35,793	2018/12/25
第72回共同発行市場公募地方債	1.46	100,000	105,211	2019/3/25
第73回共同発行市場公募地方債	1.59	80,600	85,286	2019/4/25
第75回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	106,221	2019/6/25
第80回共同発行市場公募地方債	1.54	200,000	212,618	2019/11/25
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	50,000	52,683	2019/12/25
第84回共同発行市場公募地方債	1.38	20,000	21,173	2020/3/25
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	100,000	105,065	2020/9/25
第96回共同発行市場公募地方債	1.29	20,000	21,284	2021/3/25
第97回共同発行市場公募地方債	1.38	212,000	226,914	2021/4/23
第98回共同発行市場公募地方債	1.18	150,000	158,875	2021/5/25
第104回共同発行市場公募地方債	1.03	100,000	105,280	2021/11/25
第108回共同発行市場公募地方債	1.01	70,000	73,726	2022/3/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	200,000	207,696	2022/9/22
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	311,028	2022/11/25
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	103,238	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	102,308	2024/3/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	198,138	2025/1/24
平成18年度第1回堺市公募公債	1.84	80,000	82,196	2016/12/26
平成21年度第1回栃木県公募公債	1.55	100,000	106,349	2019/11/30
平成20年度第2回熊本県公募公債	1.57	176,630	185,675	2018/10/30
平成20年度第1回新潟市公募公債	1.56	34,190	36,001	2018/12/26
平成21年度第1回新潟市公募公債	1.34	94,450	99,606	2019/12/25
平成19年度第1回浜松市公募公債	1.81	82,390	85,974	2017/11/28
平成21年度第1回浜松市公募公債	1.54	33,900	36,024	2019/11/27
平成19年度第4回大阪市公募公債	1.9	200,000	207,526	2017/6/21
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	50,000	53,174	2019/11/25
平成22年度第8回大阪市公募公債	1.28	50,000	53,048	2021/1/25
平成22年度第10回大阪市公募公債	1.31	20,000	21,277	2021/3/17
第1回名古屋市公募公債(20年)	1.99	100,000	113,438	2023/12/20
第9回名古屋市公募公債(20年)	2.07	100,000	117,001	2028/12/20
第9回名古屋市公募公債(30年)	2.095	90,000	100,755	2042/9/19
第467回名古屋市公募公債	1.62	100,000	106,119	2019/6/20
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	2.54	110,000	133,148	2026/6/19
平成23年度第5回神戸市公募公債	1.025	100,000	105,182	2021/10/19
第5回横浜市公募公債(20年)	2.17	100,000	116,594	2025/6/20
第7回横浜市公募公債(20年)	2.06	250,000	289,775	2025/12/19
平成20年度第4回横浜市公募公債	1.71	100,000	105,677	2018/11/16
平成24年度第4回横浜市公募公債	0.81	100,000	103,708	2023/2/20
第27回横浜市公募公債(20年)	1.599	40,000	43,192	2033/5/20

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	
平成18年度第7回札幌市公募公債	1.8	50,000	51,558	2017/3/17
平成22年度第7回札幌市公募公債	1.05	50,000	52,324	2020/9/18
平成23年度第5回札幌市公募公債 (5年)	0.4	68,800	69,084	2016/9/20
第6回川崎市公募公債 (20年)	2.21	100,000	118,739	2029/5/25
第7回川崎市公募公債 (20年)	2.08	100,000	117,019	2029/7/17
平成19年度第5回福岡市公募公債	1.49	20,000	20,804	2018/3/28
平成20年度第5回福岡市公募公債	1.57	30,000	31,528	2018/10/24
平成20年度第8回福岡市公募公債	1.49	84,500	88,983	2019/3/25
平成22年度第9回福岡市公募公債	1.32	127,300	135,653	2021/3/25
平成23年度第6回福岡市公募公債	1.0	50,000	52,519	2021/10/28
平成24年度第1回福岡市公募公債 (5年)	0.25	55,000	55,196	2017/6/26
平成24年度第4回福岡市公募公債	0.8	70,000	72,550	2022/10/31
平成20年度第1回広島市公募公債	1.56	50,000	52,628	2018/12/25
平成20年度第2回広島市公募公債	1.52	50,000	52,656	2019/2/25
平成22年度第6回広島市公募公債	1.21	50,000	53,024	2021/5/31
平成17年度第2回千葉市公募公債	1.6	50,000	50,378	2015/11/20
平成22年度第1回相模原市公募公債	1.29	60,000	63,676	2020/12/18
平成22年度第1回三重県公募公債	1.056	149,170	156,406	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債	1.021	117,600	123,791	2021/11/30
平成20年度第1回徳島県公募公債	1.73	130,300	137,762	2018/11/28
平成21年度第1回徳島県公募公債	1.55	36,500	38,780	2019/11/29
平成19年度第1回岡山県公募公債	1.72	60,650	63,164	2017/11/30
平成22年度第1回岡山県公募公債	1.05	50,000	52,380	2020/11/30
小 計		14,223,490	15,236,870	
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	109,981	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	110,113	2021/3/26
第16回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	97,000	99,236	2016/7/28
第25回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	139,000	143,100	2017/1/31
第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	114,000	118,631	2017/7/31
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	145,000	151,034	2017/11/30
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	123,000	129,134	2018/5/30
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	155,000	163,435	2018/6/29
第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	11,000	11,534	2018/9/28
第73回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	14,000	14,635	2019/1/30
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	104,611	2019/2/27
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	30,000	31,403	2019/3/19
第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	105,191	2019/4/30
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	200,000	211,538	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	130,764	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	235,498	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	10,601	2020/2/28
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	235,488	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	116,333	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	114,901	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	107,951	2040/8/31

銘柄	利 率	当 期 末		評 価 額	償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額		
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円		
第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	200,000	229,622	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	14,881	2021/6/30	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	200,000	209,410	2022/2/28	
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	112,001	2042/2/28	
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	200,000	209,492	2022/3/18	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.895	100,000	104,617	2022/6/30	
第173回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.819	500,000	520,010	2022/9/30	
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	100,000	103,805	2022/10/31	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.734	163,000	168,449	2022/12/28	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	200,000	208,196	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	31,186	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	347,721	2023/5/31	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.882	100,000	104,485	2023/6/30	
第344回政府保証道路債券	1.6	100,000	107,496	2020/7/15	
第2回政府保証阪神高速道路債券	1.7	100,000	102,987	2017/3/16	
第2回政府保証東日本高速道路債券	1.5	85,000	85,718	2015/12/21	
第11回政府保証東日本高速道路債券	1.6	50,000	52,151	2018/2/27	
第13回政府保証東日本高速道路債券	1.6	80,000	84,214	2018/10/19	
第14回政府保証東日本高速道路債券	1.4	80,000	83,839	2018/12/21	
第11回政府保証中日本高速道路債券	1.7	41,000	42,055	2016/12/16	
第12回政府保証日本政策投資銀行債券	2.1	100,000	111,734	2021/6/28	
第23回政府保証日本政策投資銀行債券	1.6	126,000	132,356	2018/8/20	
第1回政府保証公営企業債券(15年)	1.6	200,000	214,808	2020/6/22	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	200,000	211,430	2019/6/14	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	200,000	210,776	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	32,599	2019/9/13	
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	0.093	100,000	100,059	2017/2/24	
第5回政府保証公営企業債券(15年)	2.2	100,000	113,868	2022/7/15	
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.3	14,000	14,644	2019/2/18	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	200,000	209,620	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	11,653	2021/2/15	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	20,000	21,318	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	211,878	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	36,657	2022/3/14	
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.734	100,000	103,368	2022/12/16	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	38,000	39,496	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	104,091	2023/8/14	
第865回政府保証公営企業債券	2.0	27,000	27,609	2016/7/20	
第875回政府保証公営企業債券	1.7	100,000	103,291	2017/5/22	
第876回政府保証公営企業債券	1.9	100,000	103,845	2017/6/20	
第882回政府保証公営企業債券	1.6	115,000	119,910	2018/2/19	
第885回政府保証公営企業債券	1.7	100,000	104,950	2018/5/22	
第886回政府保証公営企業債券	1.8	189,000	199,153	2018/6/19	
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	111,383	2021/4/16	
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	103,949	2023/2/24	
第188回政府保証中小企業債券	1.8	51,000	52,172	2016/9/16	

銘柄	利 率	当 期 末		償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第16回政府保証民間都市開発債券	0.699	90,000	92,682	2023/10/20
第5回政府保証日本政策投資銀行	1.4	10,000	10,513	2019/4/15
第48回政府保証関西国際空港債券	2.0	104,000	106,572	2016/8/30
第8回政府保証中部国際空港債券	1.3	166,000	173,743	2019/3/15
第13回政府保証中部国際空港債券	1.3	72,000	76,752	2021/3/15
第7回政府保証西日本高速道路債券	1.7	78,000	80,369	2017/3/27
第9回政府保証西日本高速道路債券	1.9	34,000	35,322	2017/6/27
第16回政府保証西日本高速道路債券	1.6	75,000	79,039	2018/11/16
第17回政府保証西日本高速道路債券	1.3	75,000	78,397	2019/1/28
第19回政府保証西日本高速道路債券	1.4	110,000	115,654	2019/4/16
第29回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.86	100,000	102,756	2016/12/20
第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	2.23	30,000	35,321	2027/5/28
第46回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.69	100,000	104,466	2018/3/20
第11回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.83	100,000	105,736	2018/9/20
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	129,419	2045/9/20
第17回道路債券(財投機関債)	1.54	150,000	163,012	2022/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.75	100,000	122,519	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	132,657	2047/3/20
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.39	100,000	119,662	2027/7/20
第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.82	100,000	103,989	2017/9/20
第31回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.56	100,000	103,729	2017/12/20
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	119,857	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	120,617	2029/4/20
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.71	100,000	106,005	2019/3/20
第67回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.3	100,000	106,122	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	110,263	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	104,270	2023/6/20
第1回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.648	100,000	106,114	2019/6/28
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	100,000	105,068	2023/3/22
第3回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.573	200,000	211,996	2019/8/28
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)	2.95	100,000	128,640	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	118,121	2030/1/28
第7回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.2	100,000	115,173	2024/3/22
第8回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.25	100,000	115,600	2024/3/22
第12回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.38	100,000	105,839	2020/5/28
第13回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.278	100,000	105,415	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	116,772	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	112,034	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	109,082	2032/7/28
第30回公営企業債券(財投機関債)	1.97	100,000	105,722	2018/6/20
第36回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.892	200,000	208,228	2022/5/27
第41回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.801	200,000	206,690	2022/10/28
第44回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.791	200,000	206,450	2023/1/27
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	70,000	75,555	2031/7/30
第1回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.1	100,000	112,490	2022/6/20
第27回国際協力銀行債券(財投機関債)	1.77	100,000	103,015	2017/3/17

銘柄	当 期 末			償還年月日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第16回都市再生債券(財投機関債)	1.76	100,000	103,849	2017/9/20
第21回都市再生債券(財投機関債)	1.72	100,000	105,370	2018/9/20
第100回都市再生債券(財投機関債)	0.569	100,000	100,853	2024/11/20
第7回本州四国連絡橋債券(財投機関債)	2.26	100,000	116,562	2025/6/20
第14回福祉医療機構債券(財投機関債)	1.99	300,000	311,739	2017/6/20
第29回福祉医療機構債券(財投機関債)	1.145	100,000	105,831	2021/12/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	65,638	70,661	2042/5/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	67,958	73,387	2042/6/10
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.85	30,452	31,859	2036/9/10
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	45,118	48,008	2036/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	69,567	73,848	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	24,112	26,126	2037/5/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	72,498	78,488	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	34,639	37,110	2042/12/10
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.52	51,132	53,055	2037/12/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	18,268	18,944	2038/2/10
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	0.92	20,190	20,642	2038/6/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	37,789	40,739	2043/5/10
第14回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.86	200,000	209,892	2018/3/20
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.64	81,084	85,161	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	82,708	87,127	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	41,562	43,550	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8	22,501	23,750	2039/6/10
第21回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.92	100,000	106,035	2018/9/20
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	122,579	2028/9/20
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	53,958	57,857	2044/10/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	33,495	35,522	2040/6/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	56,282	60,143	2044/12/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	36,000	38,150	2040/7/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	130,044	138,638	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	131,178	139,135	2045/6/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	64,784	69,113	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.36	73,698	76,917	2045/9/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	63,678	69,505	2041/5/10
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3	59,654	65,097	2041/7/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	234,537	250,999	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	149,646	160,137	2046/2/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	147,680	158,853	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	73,895	78,880	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	73,997	78,589	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	78,221	82,990	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.18	67,156	72,924	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	79,876	84,136	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	80,668	84,831	2046/10/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	83,197	87,313	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	83,868	88,011	2047/4/10

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60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	84,153	87,826	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	168,838	175,218	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	106,268	2020/12/18
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	262,938	270,413	2047/11/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	94,357	96,447	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	190,094	193,895	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	105,025	2021/9/17
第87回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.53	100,000	109,800	2026/9/18
第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.863	100,000	112,057	2031/11/18
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	224,496	2032/4/16
第8回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)	1.94	100,000	102,883	2016/12/20
第17回国際協力機構債券(財投機関債)	0.72	30,000	30,833	2022/12/26
第22回東日本高速道路	0.401	100,000	100,865	2018/6/20
第3回中日本高速道路	1.92	100,000	104,222	2017/9/20
第13回中日本高速道路	1.49	100,000	105,934	2019/12/20
第38回中日本高速道路	0.677	100,000	101,998	2019/2/28
第17回東京都住宅供給公社債券	1.17	100,000	104,688	2021/9/17
小 計		18,327,108	19,597,325	
金融債券				
い第737号商工債券	0.45	170,000	170,708	2016/10/27
い第739号商工債券	0.5	100,000	100,546	2016/12/27
い第745号商工債券	0.35	100,000	100,421	2017/6/27
い第735号農林債券	0.45	100,000	100,329	2016/8/26
い第742号農林債券	0.45	100,000	100,483	2017/3/27
い第746号農林債券	0.35	130,000	130,483	2017/7/27
い第749号農林債券	0.3	100,000	100,293	2017/10/27
い第752号農林債券	0.3	200,000	200,636	2018/1/26
い第755号農林債券	0.3	100,000	100,344	2018/4/27
い第758号農林債券	0.4	100,000	100,691	2018/7/27
い第760号農林債券	0.4	100,000	100,733	2018/9/27
い第761号農林債券	0.3	100,000	100,392	2018/10/26
い第765号農林債券	0.3	200,000	200,710	2019/2/27
い第769号農林債券	0.3	130,000	130,395	2019/6/27
い第774号農林債券	0.24	100,000	99,977	2019/11/27
第263回信金中金債	0.5	200,000	201,006	2016/10/27
第265回信金中金債	0.5	100,000	100,562	2016/12/27
第274回信金中金債	0.3	100,000	100,378	2017/9/27
第288回信金中金債	0.3	200,000	201,050	2018/11/27
第175号商工債券(3年)	0.15	100,000	100,002	2017/8/25
小 計		2,530,000	2,540,140	
普通社債券				
第459回東京電力	2.7	20,000	21,095	2019/1/29
第522回東京電力	2.06	100,000	101,381	2016/8/31
第526回東京電力	1.78	100,000	101,640	2017/5/31
第532回東京電力	1.75	30,000	30,550	2017/9/28
第536回東京電力	1.672	100,000	101,613	2018/1/29

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542回東京電力	1.602	100,000	101,563	2018/4/25
第548回東京電力	2.347	100,000	102,059	2028/9/29
第559回東京電力	1.377	140,000	140,334	2019/10/29
第478回中部電力	1.89	130,000	132,992	2016/9/23
第497回中部電力	0.986	100,000	103,303	2020/10/23
第499回中部電力	1.194	50,000	52,413	2023/6/23
第410回関西電力	2.0	100,000	105,537	2018/11/22
第460回関西電力	1.77	100,000	103,669	2017/12/20
第478回関西電力	1.448	100,000	104,304	2020/1/24
第365回中国電力	1.405	100,000	104,846	2019/12/25
第376回中国電力	0.628	200,000	202,334	2018/6/25
第287回北陸電力	2.01	50,000	51,909	2017/6/23
第288回北陸電力	1.89	30,000	31,243	2017/10/25
第292回北陸電力	1.84	100,000	104,995	2018/7/25
第297回北陸電力	0.976	20,000	20,638	2020/10/23
第431回東北電力	2.05	80,000	84,053	2018/3/23
第432回東北電力	2.09	20,000	20,380	2016/5/25
第445回東北電力	1.792	200,000	210,618	2018/11/22
第267回四国電力	1.89	100,000	106,851	2019/9/25
第279回四国電力	0.579	100,000	100,979	2018/2/23
第343回九州電力	2.825	100,000	107,476	2018/5/25
第400回九州電力	1.777	70,000	74,514	2020/4/24
第409回九州電力	1.483	100,000	104,536	2019/8/23
第296回北海道電力	2.027	100,000	105,227	2018/6/25
第315回北海道電力	0.82	100,000	101,431	2018/4/25
第316回北海道電力	1.164	100,000	103,530	2020/6/25
第16回沖縄電力	1.83	70,000	72,491	2017/6/20
第344回東京交通債券	1.67	200,000	219,504	2023/2/17
第26回関西国際空港	1.156	100,000	104,822	2020/9/18
第3回セブン&アイ・ホールディングス	1.94	100,000	105,590	2018/6/20
第31回王子ホールディングス	0.482	100,000	100,999	2018/7/26
第48回住友化学	0.623	100,000	101,284	2018/6/12
第1回富士フイルムホールディングス	0.33	100,000	100,531	2017/12/4
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	103,732	2022/12/2
第12回旭硝子	1.943	100,000	106,414	2019/1/29
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	105,352	2021/9/17
第1回日本電産	0.386	100,000	100,572	2017/9/20
第12回パナソニック	0.387	100,000	99,944	2020/3/19
第22回三菱重工業	2.03	100,000	104,388	2017/9/12
第1回B号日本生命2011基金	1.12	100,000	101,800	2017/8/5
第1回日本生命2012基金	0.87	100,000	101,660	2018/8/3
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,318	2019/8/7
第60回伊藤忠商事	1.135	100,000	104,034	2020/7/29
第78回三菱商事	1.155	100,000	105,478	2022/3/9
第79回三菱商事	1.022	100,000	104,543	2022/5/20
第3回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	2.26	100,000	105,437	2018/3/2

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7回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	2.5	200,000	217,098	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	107,287	2021/10/29
第10回みずほコーポレート銀行	1.945	100,000	104,309	2017/10/27
第26回みずほコーポレート銀行	0.54	200,000	200,860	2016/7/20
第27回みずほコーポレート銀行	0.515	200,000	200,976	2016/10/20
第12回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	2.16	100,000	104,240	2017/7/28
第87回三菱東京UFJ銀行	1.87	200,000	206,556	2017/4/20
第88回三菱東京UFJ銀行	2.34	100,000	117,954	2027/4/20
第6回りそな銀行 (劣後特約付)	2.084	100,000	107,793	2020/3/4
第9回三菱UFJ信託銀行 (劣後特約付)	1.68	100,000	107,519	2021/4/28
第12回住友信託銀行 (劣後特約付)	1.373	100,000	105,163	2020/11/11
第15回住友信託銀行 (劣後特約付)	1.62	100,000	107,715	2022/3/22
第11回三井住友銀行 (劣後特約付)	2.17	100,000	104,972	2017/12/20
第17回三井住友銀行 (劣後特約付)	2.8	200,000	218,728	2019/2/12
第20回三井住友銀行 (劣後特約付)	2.21	100,000	107,890	2019/7/24
第22回三井住友銀行 (劣後特約付)	1.43	100,000	105,629	2020/9/28
第23回三井住友銀行 (劣後特約付)	1.61	100,000	106,779	2020/12/17
第54回三井住友銀行	0.49	100,000	100,413	2016/7/20
第57回三井住友銀行	0.28	100,000	100,348	2017/10/20
第6回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.25	100,000	102,872	2016/11/4
第18回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.14	100,000	113,323	2026/9/11
第19回みずほ銀行 (劣後特約付)	1.67	100,000	107,578	2022/2/24
第28回日産フィナンシャルサービス	0.253	100,000	100,223	2019/6/20
第49回トヨタファイナンス	0.415	100,000	100,678	2017/6/20
第52回日立キャピタル	0.508	100,000	100,907	2021/6/18
第152回オリックス	0.92	100,000	100,946	2016/8/31
第153回オリックス	0.78	100,000	100,775	2016/9/5
第160回オリックス	1.06	100,000	101,693	2017/4/25
第176回オリックス	0.354	100,000	100,173	2019/2/27
第9回三井住友ファイナンス&リース	0.518	100,000	101,306	2021/1/29
第15回三菱UFJリース	0.66	100,000	100,830	2016/12/14
第8回野村ホールディングス	2.12	100,000	104,203	2017/8/14
第10回野村ホールディングス	1.91	100,000	104,161	2017/11/27
第23回野村ホールディングス	1.808	100,000	106,850	2020/6/24
第24回野村ホールディングス	2.329	100,000	113,302	2025/6/24
第2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回	1.98	100,000	104,865	2018/6/20
第36回三井不動産	1.629	100,000	106,137	2019/9/10
第31回三菱地所	3.125	100,000	107,101	2017/9/26
第72回三菱地所	2.28	100,000	115,920	2024/9/20
第80回三菱地所	2.305	100,000	117,671	2027/3/19
第11回エス・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	104,957	2021/9/17
第5回東日本旅客鉄道	3.3	100,000	105,619	2017/2/25
第15回東日本旅客鉄道	2.65	20,000	22,518	2020/8/25
第19回東日本旅客鉄道	2.36	100,000	113,884	2022/2/25
第32回東日本旅客鉄道	2.26	100,000	115,671	2024/3/19
第34回東日本旅客鉄道	2.53	100,000	118,367	2024/6/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第43回東日本旅客鉄道	1.86	100,000	108,886	2020/12/18
第58回東日本旅客鉄道	1.58	100,000	105,349	2019/3/20
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	106,016	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道	2.28	100,000	113,470	2022/3/25
第27回西日本旅客鉄道	1.36	100,000	105,624	2020/6/11
第4回東海旅客鉄道	2.18	100,000	107,039	2018/10/31
第6回東海旅客鉄道	2.39	21,000	23,944	2022/2/15
第42回東海旅客鉄道	2.312	100,000	119,171	2029/4/24
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	111,839	2030/10/25
第63回日本電信電話	0.69	200,000	204,558	2023/3/20
第19回KDDI	1.151	100,000	104,396	2020/6/19
第21回KDDI	0.669	100,000	101,086	2024/9/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	102,335	2023/9/20
第8回電源開発	2.11	100,000	112,397	2024/12/20
第23回東京ガス	1.01	100,000	104,924	2023/6/9
第9回大阪ガス	2.9	100,000	107,461	2018/1/30
第14回GEキャピタルコーポレーション	1.84	100,000	100,857	2015/11/20
第20回GEキャピタルコーポレーション	2.885	100,000	107,773	2018/5/29
第8回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.05	100,000	100,655	2016/2/22
第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.32	200,000	203,812	2017/2/9
第6回ナショナル・オーストラリア銀行	1.03	100,000	101,001	2016/7/8
第8回ナショナル・オーストラリア銀行	1.3	100,000	101,915	2017/1/20
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	99,987	2020/1/16
第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.89	100,000	100,795	2016/6/10
第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション	1.2	100,000	101,882	2017/3/9
第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行	0.98	200,000	201,134	2016/1/21
第18回ラボバンク・ネダーランド	0.778	100,000	101,245	2017/11/2
第23回ラボバンク・ネダーランド	0.557	100,000	100,830	2018/12/19
第27回ラボバンク・ネダーランド	0.38	100,000	100,067	2020/5/22
小 計		13,051,000	13,672,120	
合 計		238,920,598	254,909,142	

○投資信託財産の構成

(2015年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	254,909,142	99.0
コール・ローン等、その他	2,468,408	1.0
投資信託財産総額	257,377,550	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年5月20日現在)

項目	当期末
(A) 資産	257,377,550,556 円
コール・ローン等	897,904,712
公社債(評価額)	254,909,142,326
未収入金	793,402,000
未収利息	765,654,403
前払費用	11,447,115
(B) 負債	745,803,693
未払金	100,000,000
未払解約金	645,803,693
(C) 純資産総額(A-B)	256,631,746,863
元本	194,532,901,496
次期繰越損益金	62,098,845,367
(D) 受益権総口数	194,532,901,496口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,192円

<注記事項>

①期首元本額	225,356,029,434円
期中追加設定元本額	26,212,404,404円
期中一部解約元本額	57,035,532,342円

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

三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	3,558,582,135円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	4,257,782,053円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	1,121,489,731円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	22,593,845,005円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	37,984,162,446円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	10,398,481,856円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	292,020,025円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	186,670,867円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	2,084,159,043円
F P バランスファンド(安定型)	127,538,528円
F P バランスファンド(安定成長型)	129,876,073円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	505,284,655円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	1,208,200,633円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	110,067,593,706円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)VA(適格機関投資家限定)	4,402,917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)	12,811,823円
合計	194,532,901,496円

○損益の状況 (2014年5月21日～2015年5月20日)

項目	当期
(A) 配当等収益	3,301,111,935 円
受取利息	3,301,111,935
(B) 有価証券売買損益	3,631,938,504
売買益	4,413,527,496
売買損	△ 781,588,992
(C) 先物取引等取引損益	1,116,560
取引益	3,008,960
取引損	△ 1,892,400
(D) 当期損益金(A+B+C)	6,934,166,999
(E) 前期繰越損益金	64,767,699,947
(F) 追加信託差損益金	8,098,632,120
(G) 解約差損益金	△17,701,653,699
(H) 計(D+E+F+G)	62,098,845,367
次期繰越損益金(H)	62,098,845,367

(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】

- ①新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ②デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)

三菱UFJ 外国債券マザーファンド

《第15期》決算日2015年5月20日

[計算期間：2014年5月21日～2015年5月20日]

「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」は、5月20日に第15期の決算を行いました。

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

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		債組入比率	債券先物比率	純資産額
	期騰落	期中率	期騰落	期中率			
	円	%		%	%	%	百万円
11期(2011年5月20日)	17,226	△ 1.8	292.5904	△ 1.4	98.7	—	217,756
12期(2012年5月21日)	17,164	△ 0.4	291.3347	△ 0.4	98.8	—	204,958
13期(2013年5月20日)	23,300	35.7	396.6181	36.1	98.9	—	238,488
14期(2014年5月20日)	24,305	4.3	412.1913	3.9	98.7	—	174,867
15期(2015年5月20日)	27,492	13.1	466.3665	13.1	98.8	—	128,186

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、 円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2014年5月20日	円	%		%	%	%
	24,305	—	412.1913	—	98.7	—
5月末	24,361	0.2	413.8182	0.4	98.6	—
6月末	24,451	0.6	415.5816	0.8	98.7	—
7月末	24,685	1.6	419.3546	1.7	98.8	—
8月末	25,087	3.2	426.4201	3.5	98.8	—
9月末	25,795	6.1	438.1378	6.3	98.6	—
10月末	25,850	6.4	438.2998	6.3	98.7	—
11月末	28,041	15.4	475.7084	15.4	98.6	—
12月末	28,339	16.6	482.5458	17.1	97.8	—
2015年1月末	27,501	13.1	467.2651	13.4	98.6	—
2月末	27,572	13.4	469.4314	13.9	98.6	—
3月末	27,460	13.0	465.9620	13.0	98.6	—
4月末	27,451	12.9	467.4672	13.4	98.6	—
(期 末) 2015年5月20日						
	27,492	13.1	466.3665	13.1	98.8	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ13.1%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(13.1%)とほぼ同程度となりました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

債券市況の推移
(期首を100として指数化)

◎外国債券市況

・世界経済の先行き不透明感の高まりや先進国のインフレ期待の低下などに加え、ECB（欧州中央銀行）による追加緩和策の発表および実施などを背景に、金利は総じて低下（債券価格は上昇）しました。

為替市況の推移
(期首を100として指数化)

◎為替市況

・円・ドル相場は、日銀による追加金融緩和策の発表・実施や、FRB（米連邦準備制度理事会）による利上げ観測の高まりなどから、ドルが対円で買われました。期首との比較では、ドルは対円で19.2%上昇しました。

・円・ユーロ相場は、ECBによる追加緩和策の発表・実施や、ギリシャの情勢不安などを背景に、ユーロが対円で売られました。期首との比較では、ユーロは対円で3.3%下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

・日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは13.1%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

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

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は $\Delta 0.0\%$ 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 $\Delta 0.0\%$ 程度でした。
コストディーフィー、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 0.0% 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、当ファンドの運用方針
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

(2014年5月21日～2015年5月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 7	% 0.027	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(7)	(0.027)	外国での資産の保管等に要する費用
（ 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	7	0.027	
期中の平均基準価額は、26,382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

(2014年5月21日～2015年5月20日)

公社債

		買付額	売付額
外 国	アメリカ	千アメリカドル 108,149	千アメリカドル 326,349
	カナダ	千カナダドル 6,279	千カナダドル 20,711
	メキシコ	千メキシコペソ 39,714	千メキシコペソ 108,779
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 13,309	54,261
	イタリア	国債証券 16,037	60,604
	フランス	国債証券 15,165	61,874
	オランダ	国債証券 3,076	15,205
	スペイン	国債証券 11,083	33,949
	ベルギー	国債証券 3,519	16,250
	オーストリア	国債証券 1,491	9,571
	フィンランド	国債証券 1,141	4,638
	アイルランド	国債証券 1,747	5,447
	イギリス	国債証券 10,611	千イギリスポンド 39,032
	スイス	国債証券 222	千スイスフラン 3,260
	スウェーデン	国債証券 6,244	千スウェーデンクローネ 29,623
	ノルウェー	国債証券 5,325	千ノルウェークローネ 20,164
	デンマーク	国債証券 7,055	千デンマーククローネ 38,402
	ポーランド	国債証券 6,062	千ポーランドズロチ 19,331
	オーストラリア	国債証券 5,369	千オーストラリアドル 12,574
	シンガポール	国債証券 1,510	千シンガポールドル 4,083
	マレーシア	国債証券 4,115	千マレーシアリングgit 12,564
南アフリカ	国債証券 15,145	千南アフリカランド 38,458	

(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

(2014年5月21日～2015年5月20日)

利害関係人との取引状況

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

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

○組入資産の明細

(2015年5月20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 426,200	千アメリカドル 438,710	千円 53,057,673	% 41.4	% —	% 15.6	% 15.2	% 10.7
カナダ	千カナダドル 26,600	千カナダドル 29,614	2,926,529	2.3	—	1.1	0.7	0.6
メキシコ	千メキシコペソ 155,100	千メキシコペソ 173,045	1,375,710	1.1	—	0.7	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	60,650	71,985	9,685,711	7.6	—	4.4	2.1	1.1
イタリア	77,650	92,841	12,491,832	9.7	—	5.9	2.8	1.0
フランス	74,600	90,212	12,138,060	9.5	—	5.8	2.6	1.1
オランダ	20,400	24,057	3,236,956	2.5	—	1.5	0.7	0.3
スペイン	43,300	51,172	6,885,230	5.4	—	3.0	1.6	0.8
ベルギー	19,350	24,290	3,268,336	2.5	—	1.8	0.6	0.2
オーストリア	12,350	15,147	2,038,031	1.6	—	1.0	0.4	0.2
フィンランド	4,900	5,562	748,467	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	6,200	7,403	996,112	0.8	—	0.4	0.4	—
イギリス	千イギリスポンド 48,350	千イギリスポンド 57,138	10,711,831	8.4	—	6.1	1.8	0.4
スイス	千スイスフラン 2,520	千スイスフラン 3,048	393,049	0.3	—	0.2	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 37,400	千スウェーデンクローネ 43,860	635,098	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 21,600	千ノルウェークローネ 23,602	378,110	0.3	—	0.2	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 38,600	千デンマーククローネ 48,962	883,285	0.7	—	0.5	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 20,600	千ポーランドズロチ 22,357	742,499	0.6	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 21,400	千オーストラリアドル 23,327	2,230,824	1.7	—	0.9	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 4,910	千シンガポールドル 5,123	463,963	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 20,100	千マレーシアリンギット 20,179	675,612	0.5	—	0.2	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 69,600	千南アフリカランド 67,709	687,254	0.5	—	0.4	0.1	—
合 計	—	—	126,650,183	98.8	—	50.7	31.1	17.0

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利率	当 期 額面金額	期 末 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					
	0.25 T-NOTE 160515	0.25	1,900	1,899	229,777	2016/5/15
	0.5 T-NOTE 160615	0.5	3,500	3,506	424,133	2016/6/15
	0.5 T-NOTE 170731	0.5	2,500	2,487	300,838	2017/7/31
	0.625 T-NOTE 160715	0.625	3,000	3,009	363,967	2016/7/15
	0.625 T-NOTE 160815	0.625	3,100	3,109	376,012	2016/8/15
	0.625 T-NOTE 161015	0.625	2,600	2,605	315,168	2016/10/15
	0.625 T-NOTE 161115	0.625	3,000	3,006	363,571	2016/11/15
	0.625 T-NOTE 170215	0.625	2,700	2,702	326,882	2017/2/15
	0.625 T-NOTE 170531	0.625	4,000	3,997	483,400	2017/5/31
	0.625 T-NOTE 170831	0.625	3,500	3,489	422,000	2017/8/31
	0.625 T-NOTE 170930	0.625	3,000	2,988	361,388	2017/9/30
	0.625 T-NOTE 171130	0.625	1,400	1,392	168,356	2017/11/30
	0.75 T-NOTE 170315	0.75	2,900	2,909	351,835	2017/3/15
	0.75 T-NOTE 170630	0.75	3,300	3,303	399,585	2017/6/30
	0.75 T-NOTE 171031	0.75	3,000	2,994	362,153	2017/10/31
	0.75 T-NOTE 171231	0.75	2,700	2,690	325,441	2017/12/31
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	1,500	1,492	180,446	2018/2/28
	0.75 T-NOTE 180331	0.75	400	397	48,081	2018/3/31
	0.875 T-NOTE 160915	0.875	3,900	3,923	474,448	2016/9/15
	0.875 T-NOTE 161130	0.875	3,100	3,117	377,066	2016/11/30
	0.875 T-NOTE 161231	0.875	3,400	3,420	413,621	2016/12/31
	0.875 T-NOTE 170131	0.875	3,600	3,619	437,782	2017/1/31
	0.875 T-NOTE 170228	0.875	3,300	3,317	401,237	2017/2/28
	0.875 T-NOTE 170415	0.875	1,500	1,507	182,324	2017/4/15
	0.875 T-NOTE 170430	0.875	2,900	2,914	352,465	2017/4/30
	0.875 T-NOTE 170515	0.875	3,000	3,014	364,534	2017/5/15
	0.875 T-NOTE 170615	0.875	3,500	3,514	425,026	2017/6/15
	0.875 T-NOTE 170815	0.875	1,300	1,303	157,682	2017/8/15
	0.875 T-NOTE 171015	0.875	1,300	1,302	157,473	2017/10/15
	0.875 T-NOTE 180131	0.875	1,400	1,398	169,157	2018/1/31
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	1,200	1,173	141,919	2019/7/31
	1 T-NOTE 160831	1.0	3,700	3,728	450,886	2016/8/31
	1 T-NOTE 160930	1.0	4,500	4,534	548,418	2016/9/30
	1 T-NOTE 161031	1.0	3,300	3,325	402,157	2016/10/31
	1 T-NOTE 170331	1.0	3,500	3,526	426,530	2017/3/31
	1 T-NOTE 170915	1.0	2,000	2,010	243,117	2017/9/15
	1 T-NOTE 180315	1.0	500	500	60,543	2018/3/15
	1 T-NOTE 190831	1.0	2,400	2,355	284,847	2019/8/31
	1 T-NOTE 190930	1.0	1,000	980	118,549	2019/9/30
	1 T-NOTE 191130	1.0	2,500	2,443	295,535	2019/11/30
	1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,200	1,188	143,795	2019/5/31
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,900	1,865	225,585	2019/12/31
	1.125 T-NOTE 200331	1.125	1,400	1,369	165,651	2020/3/31
	1.25 T-NOTE 181130	1.25	2,900	2,903	351,137	2018/11/30

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 190131	1.25	2,400	2,398	290,029	2019/1/31
		1.25 T-NOTE 190430	1.25	800	797	96,449	2019/4/30
		1.25 T-NOTE 191031	1.25	1,500	1,485	179,638	2019/10/31
		1.25 T-NOTE 200131	1.25	3,200	3,157	381,837	2020/1/31
		1.25 T-NOTE 200229	1.25	100	98	11,915	2020/2/29
		1.375 T-NOTE 180630	1.375	1,800	1,817	219,766	2018/6/30
		1.375 T-NOTE 180731	1.375	2,200	2,219	268,437	2018/7/31
		1.375 T-NOTE 180930	1.375	4,000	4,029	487,312	2018/9/30
		1.375 T-NOTE 181130	1.375	1,100	1,106	133,834	2018/11/30
		1.375 T-NOTE 181231	1.375	1,400	1,406	170,096	2018/12/31
		1.375 T-NOTE 190228	1.375	1,700	1,704	206,160	2019/2/28
		1.375 T-NOTE 200131	1.375	1,900	1,885	228,044	2020/1/31
		1.375 T-NOTE 200229	1.375	2,900	2,875	347,766	2020/2/29
		1.375 T-NOTE 200331	1.375	2,500	2,476	299,491	2020/3/31
		1.375 T-NOTE 200531	1.375	1,900	1,878	227,218	2020/5/31
		1.5 T-NOTE 160630	1.5	2,800	2,836	343,036	2016/6/30
		1.5 T-NOTE 160731	1.5	4,600	4,662	563,886	2016/7/31
		1.5 T-NOTE 180831	1.5	2,900	2,934	354,918	2018/8/31
		1.5 T-NOTE 181231	1.5	3,100	3,127	378,282	2018/12/31
		1.5 T-NOTE 190131	1.5	2,600	2,621	317,023	2019/1/31
		1.5 T-NOTE 190228	1.5	2,200	2,216	268,084	2019/2/28
		1.5 T-NOTE 190331	1.5	900	906	109,577	2019/3/31
		1.5 T-NOTE 190531	1.5	2,000	2,009	243,070	2019/5/31
		1.5 T-NOTE 191031	1.5	2,900	2,900	350,835	2019/10/31
		1.5 T-NOTE 191130	1.5	500	499	60,467	2019/11/30
		1.5 T-NOTE 220131	1.5	2,700	2,619	316,818	2022/1/31
		1.625 T-NOTE 190331	1.625	2,300	2,325	281,291	2019/3/31
		1.625 T-NOTE 190430	1.625	1,500	1,515	183,323	2019/4/30
		1.625 T-NOTE 190630	1.625	3,400	3,430	414,922	2019/6/30
		1.625 T-NOTE 190731	1.625	2,000	2,016	243,864	2019/7/31
		1.625 T-NOTE 191231	1.625	500	502	60,725	2019/12/31
		1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,800	1,751	211,858	2022/8/15
		1.625 T-NOTE 221115	1.625	2,700	2,620	316,945	2022/11/15
		1.75 T-NOTE 160531	1.75	2,700	2,740	331,397	2016/5/31
		1.75 T-NOTE 181031	1.75	1,200	1,223	147,951	2018/10/31
		1.75 T-NOTE 190930	1.75	3,700	3,743	452,791	2019/9/30
		1.75 T-NOTE 201031	1.75	1,800	1,802	217,998	2020/10/31
		1.75 T-NOTE 220228	1.75	700	689	83,407	2022/2/28
		1.75 T-NOTE 220331	1.75	2,200	2,165	261,952	2022/3/31
		1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,300	1,279	154,759	2022/5/15
1.75 T-NOTE 230515	1.75	3,700	3,599	435,382	2023/5/15		
1.875 T-NOTE 170831	1.875	1,900	1,948	235,629	2017/8/31		
1.875 T-NOTE 170930	1.875	1,700	1,743	210,874	2017/9/30		
1.875 T-NOTE 171031	1.875	2,200	2,256	272,844	2017/10/31		
1.875 T-NOTE 211130	1.875	300	298	36,128	2021/11/30		

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 200731	2.0	1,600	1,627	196,875	2020/7/31
		2 T-NOTE 201130	2.0	2,300	2,331	281,964	2020/11/30
		2 T-NOTE 210228	2.0	800	809	97,855	2021/2/28
		2 T-NOTE 210531	2.0	2,000	2,017	243,949	2021/5/31
		2 T-NOTE 210831	2.0	3,400	3,418	413,476	2021/8/31
		2 T-NOTE 211031	2.0	2,800	2,810	339,954	2021/10/31
		2 T-NOTE 211115	2.0	3,600	3,615	437,254	2021/11/15
		2 T-NOTE 220215	2.0	1,900	1,904	230,378	2022/2/15
		2 T-NOTE 230215	2.0	3,900	3,880	469,344	2023/2/15
		2 T-NOTE 250215	2.0	4,500	4,394	531,474	2025/2/15
		2.125 T-NOTE 200831	2.125	2,500	2,556	309,176	2020/8/31
		2.125 T-NOTE 210131	2.125	100	101	12,316	2021/1/31
		2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,900	1,928	233,178	2021/6/30
		2.125 T-NOTE 210815	2.125	3,700	3,749	453,473	2021/8/15
		2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,400	1,417	171,379	2021/9/30
		2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,300	2,324	281,095	2021/12/31
		2.25 T-NOTE 171130	2.25	1,900	1,966	237,819	2017/11/30
		2.25 T-NOTE 180731	2.25	1,500	1,554	188,014	2018/7/31
		2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,800	1,843	222,930	2021/3/31
		2.25 T-NOTE 210430	2.25	2,000	2,046	247,549	2021/4/30
		2.25 T-NOTE 210731	2.25	2,200	2,246	271,701	2021/7/31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	4,800	4,797	580,149	2024/11/15
		2.375 T-NOTE 170731	2.375	2,100	2,175	263,130	2017/7/31
		2.375 T-NOTE 180531	2.375	1,000	1,040	125,815	2018/5/31
		2.375 T-NOTE 180630	2.375	900	936	113,225	2018/6/30
		2.375 T-NOTE 201231	2.375	2,400	2,479	299,825	2020/12/31
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	4,700	4,755	575,123	2024/8/15
		2.5 T-BOND 450215	2.5	2,300	2,051	248,085	2045/2/15
		2.5 T-NOTE 170630	2.5	1,800	1,868	226,017	2017/6/30
		2.5 T-NOTE 230815	2.5	2,800	2,880	348,341	2023/8/15
		2.5 T-NOTE 240515	2.5	4,500	4,605	557,027	2024/5/15
		2.625 T-NOTE 160430	2.625	200	204	24,726	2016/4/30
		2.625 T-NOTE 180131	2.625	1,000	1,046	126,509	2018/1/31
		2.625 T-NOTE 180430	2.625	800	837	101,343	2018/4/30
		2.625 T-NOTE 200815	2.625	3,100	3,249	393,000	2020/8/15
		2.625 T-NOTE 201115	2.625	5,000	5,233	632,998	2020/11/15
		2.75 T-BOND 420815	2.75	4,100	3,866	467,652	2042/8/15
		2.75 T-BOND 421115	2.75	4,500	4,242	513,106	2042/11/15
		2.75 T-NOTE 161130	2.75	2,600	2,688	325,191	2016/11/30
		2.75 T-NOTE 170531	2.75	1,700	1,771	214,263	2017/5/31
2.75 T-NOTE 171231	2.75	1,700	1,782	215,580	2017/12/31		
2.75 T-NOTE 180228	2.75	1,000	1,050	127,010	2018/2/28		
2.75 T-NOTE 190215	2.75	2,300	2,424	293,210	2019/2/15		
2.75 T-NOTE 231115	2.75	3,800	3,977	481,042	2023/11/15		
2.75 T-NOTE 240215	2.75	3,400	3,553	429,764	2024/2/15		

銘柄		当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ	国債証券					
	2.875 T-BOND 430515	2.875	4,100	3,960	478,963	2043/5/15
	2.875 T-NOTE 180331	2.875	1,100	1,159	140,194	2018/3/31
	3 T-BOND 420515	3.0	1,800	1,786	216,059	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	2,600	2,574	311,397	2044/11/15
	3 T-NOTE 160831	3.0	800	826	99,975	2016/8/31
	3 T-NOTE 160930	3.0	2,500	2,587	312,896	2016/9/30
	3 T-NOTE 170228	3.0	1,800	1,877	227,088	2017/2/28
	3.125 T-BOND 411115	3.125	1,000	1,019	123,321	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	900	916	110,784	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	4,200	4,259	515,091	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	2,400	2,434	294,428	2044/8/15
	3.125 T-NOTE 161031	3.125	2,400	2,491	301,310	2016/10/31
	3.125 T-NOTE 170131	3.125	2,200	2,295	277,656	2017/1/31
	3.125 T-NOTE 170430	3.125	1,900	1,991	240,835	2017/4/30
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	2,300	2,457	297,263	2019/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	2,100	2,252	272,456	2021/5/15
	3.25 T-NOTE 160531	3.25	1,900	1,957	236,787	2016/5/31
	3.25 T-NOTE 160630	3.25	2,400	2,478	299,689	2016/6/30
	3.25 T-NOTE 160731	3.25	3,000	3,103	375,376	2016/7/31
	3.25 T-NOTE 161231	3.25	2,000	2,087	252,415	2016/12/31
	3.25 T-NOTE 170331	3.25	2,200	2,308	279,163	2017/3/31
	3.375 T-BOND 440515	3.375	2,900	3,084	373,084	2044/5/15
	3.375 T-NOTE 191115	3.375	2,800	3,028	366,304	2019/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	800	870	105,229	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 180215	3.5	1,800	1,925	232,870	2018/2/15
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	2,100	2,290	277,030	2020/5/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	200	222	26,924	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	3,000	3,271	395,643	2019/8/15
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	2,400	2,628	317,852	2020/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	4,100	4,514	545,943	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,200	1,363	164,867	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	500	568	68,803	2043/11/15
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	2,600	2,827	341,982	2018/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	1,300	1,500	181,444	2040/8/15
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	1,100	1,193	144,326	2018/5/15
	4 T-NOTE 180815	4.0	1,300	1,422	171,998	2018/8/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	1,000	1,217	147,301	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	1,400	1,712	207,094	2040/11/15
	4.25 T-NOTE 171115	4.25	1,800	1,951	235,983	2017/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	500	620	75,100	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	1,100	1,366	165,211	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	1,500	1,866	225,685	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,200	1,500	181,444	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	500	633	76,645	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	500	631	76,324	2038/5/15

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	4.5 T-BOND 390815	4.5	1,000	1,263	152,837	2039/8/15
	4.5 T-NOTE 170515	4.5	1,500	1,614	195,214	2017/5/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	1,800	2,318	280,414	2040/2/15
	4.625 T-NOTE 161115	4.625	2,300	2,442	295,362	2016/11/15
	4.625 T-NOTE 170215	4.625	2,100	2,249	272,020	2017/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	1,600	2,108	255,001	2041/2/15
	4.75 T-NOTE 170815	4.75	1,800	1,960	237,139	2017/8/15
	4.875 T-NOTE 160815	4.875	1,700	1,794	217,026	2016/8/15
	5 T-BOND 370515	5.0	500	675	81,747	2037/5/15
	5.125 T-NOTE 160515	5.125	1,500	1,571	190,041	2016/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	600	786	95,087	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	400	525	63,501	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	900	1,217	147,214	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815	5.5	400	535	64,702	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	600	810	98,040	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	600	837	101,340	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	300	394	47,744	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	600	870	105,314	2030/5/15
	6.5 T-BOND 261115	6.5	400	566	68,455	2026/11/15
	7.25 T-BOND 160515	7.25	700	747	90,461	2016/5/15
	7.5 T-BOND 161115	7.5	1,500	1,656	200,337	2016/11/15
	8 T-BOND 211115	8.0	500	686	83,023	2021/11/15
	8.125 T-BOND 190815	8.125	500	638	77,250	2019/8/15
	8.75 T-BOND 170515	8.75	900	1,044	126,261	2017/5/15
	8.75 T-BOND 200815	8.75	700	950	114,995	2020/8/15
	8.875 T-BOND 190215	8.875	600	768	92,983	2019/2/15
小 計					53,057,673	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	200	195	19,301	2020/9/1
	1 CAN GOVT 160801	1.0	1,100	1,104	109,107	2016/8/1
	1.25 CAN GOVT 170801	1.25	200	202	19,996	2017/8/1
	1.25 CAN GOVT 180201	1.25	400	405	40,086	2018/2/1
	1.25 CAN GOVT 180301	1.25	800	812	80,266	2018/3/1
	1.25 CAN GOVT 180901	1.25	600	610	60,290	2018/9/1
	1.5 CAN GOVT 170201	1.5	800	810	80,132	2017/2/1
	1.5 CAN GOVT 170301	1.5	1,400	1,420	140,369	2017/3/1
	1.5 CAN GOVT 170901	1.5	900	916	90,561	2017/9/1
	1.5 CAN GOVT 200301	1.5	700	713	70,488	2020/3/1
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	900	891	88,147	2023/6/1
	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	600	619	61,265	2019/3/1
	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	700	722	71,431	2019/9/1
	2 CAN GOVT 160601	2.0	1,400	1,418	140,175	2016/6/1
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	800	832	82,238	2025/6/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,000	1,065	105,333	2024/6/1
	2.75 CAN GOVT 160901	2.75	1,700	1,744	172,393	2016/9/1

銘柄	当期末					償還年月日	
	利率	額面金額	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
国債証券	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	900	976	96,522	2022/6/1	
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	300	322	31,847	2048/12/1	
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	200	220	21,761	2064/12/1	
	3.25 CAN GOVT 210601	3.25	800	891	88,130	2021/6/1	
	3.5 CAN GOVT 200601	3.5	900	1,003	99,211	2020/6/1	
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,300	1,600	158,205	2045/12/1	
	3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,400	1,557	153,898	2019/6/1	
	4 CAN GOVT 160601	4.0	700	723	71,507	2016/6/1	
	4 CAN GOVT 170601	4.0	1,100	1,173	115,961	2017/6/1	
	4 CAN GOVT 410601	4.0	1,050	1,367	135,095	2041/6/1	
	4.25 CAN GOVT 180601	4.25	800	883	87,355	2018/6/1	
	5 CAN GOVT 370601	5.0	950	1,376	136,055	2037/6/1	
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	700	1,008	99,682	2029/6/1	
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	900	1,362	134,639	2033/6/1	
	8 CAN GOVT 270601	8.0	400	658	65,070	2027/6/1	
小計					2,926,529		
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	14,800	19,188	152,550	2024/12/5	
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	4,500	6,266	49,814	2036/11/20	
	4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	15,500	15,538	123,528	2018/6/14	
	5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	6,200	6,316	50,212	2017/6/15	
	5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	5,000	4,947	39,329	2019/12/11	
	6.25 MEXICAN BONO 160616	6.25	8,900	9,152	72,762	2016/6/16	
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	8,800	9,220	73,299	2021/6/10	
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	7,700	8,043	63,943	2022/6/9	
	7.25 MEXICAN BONO 161215	7.25	8,900	9,366	74,467	2016/12/15	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	5,900	6,548	52,061	2027/6/3	
	7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	10,400	11,253	89,463	2017/12/14	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	9,800	11,093	88,189	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	3,500	3,965	31,528	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	8,400	9,545	75,888	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	6,600	7,378	58,660	2020/6/11	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	6,300	7,185	57,122	2023/12/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	10,000	11,189	88,955	2018/12/13	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	6,800	8,192	65,129	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	7,100	8,654	68,800	2038/11/18	
小計					1,375,710		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 OBL 200417	—	800	797	107,338	2020/4/17
		0 SCHATS 160916	—	400	401	53,986	2016/9/16
		0 SCHATS 161216	—	100	100	13,504	2016/12/16
		0 SCHATS 170310	—	500	501	67,540	2017/3/10
		0.25 OBL 180413	0.25	1,100	1,113	149,781	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	800	808	108,813	2019/10/11
		0.25 SCHATS 160610	0.25	900	904	121,712	2016/6/10

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	0.5 BUND 250215	0.5	1,100	1,090	146,680	2025/2/15
		0.5 OBL 170407	0.5	1,600	1,621	218,186	2017/4/7
		0.5 OBL 171013	0.5	1,300	1,321	177,801	2017/10/13
		0.5 OBL 180223	0.5	1,200	1,221	164,414	2018/2/23
		0.5 OBL 190412	0.5	1,100	1,123	151,187	2019/4/12
		0.75 OBL 170224	0.75	1,200	1,220	164,220	2017/2/24
		1 BUND 240815	1.0	1,300	1,352	181,955	2024/8/15
		1 OBL 181012	1.0	1,200	1,245	167,522	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,200	1,247	167,902	2019/2/22
		1.25 OBL 161014	1.25	1,500	1,531	206,012	2016/10/14
		1.5 BUND 220904	1.5	1,300	1,410	189,730	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,300	1,411	189,887	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,300	1,411	189,983	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	900	977	131,521	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,100	1,212	163,145	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,500	1,662	223,753	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,400	1,562	210,183	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	1,300	1,466	197,251	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	900	1,002	134,948	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,200	1,353	182,167	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,400	1,586	213,451	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,300	1,721	231,578	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	650	867	116,677	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,600	1,839	247,496	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	1,700	1,953	262,896	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,300	1,543	207,632	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	900	1,334	179,583	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	1,800	2,062	277,452	2019/7/4
		3.75 BUND 170104	3.75	1,500	1,597	214,883	2017/1/4
		3.75 BUND 190104	3.75	1,700	1,936	260,529	2019/1/4
		4 BUND 160704	4.0	1,900	1,990	267,788	2016/7/4
		4 BUND 180104	4.0	1,400	1,553	209,053	2018/1/4
		4 BUND 370104	4.0	1,800	2,801	376,908	2037/1/4
4.25 BUND 170704	4.25	1,700	1,860	250,373	2017/7/4		
4.25 BUND 180704	4.25	1,400	1,591	214,186	2018/7/4		
4.25 BUND 390704	4.25	1,000	1,653	222,485	2039/7/4		
4.75 BUND 280704	4.75	800	1,194	160,668	2028/7/4		
4.75 BUND 340704	4.75	1,400	2,297	309,162	2034/7/4		
4.75 BUND 400704	4.75	900	1,603	215,785	2040/7/4		
5.5 BUND 310104	5.5	1,200	1,995	268,443	2031/1/4		
5.625 BUND 280104	5.625	1,000	1,584	213,154	2028/1/4		
6 BUND 160620	6.0	300	320	43,083	2016/6/20		
6.25 BUND 240104	6.25	1,100	1,641	220,912	2024/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	600	1,045	140,659	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	800	1,335	179,731	2027/7/4		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	0.75 ITALY GOVT 180115	0.75	900	912	122,723	2018/1/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	400	406	54,737	2019/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	700	702	94,491	2022/4/15
		1.5 ITALY GOVT 161215	1.5	1,000	1,022	137,604	2016/12/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,300	1,349	181,596	2019/8/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	900	951	128,064	2021/12/15
		2.25 ITALY GOVT 160515	2.25	500	511	68,755	2016/5/15
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,500	1,615	217,325	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,500	1,587	213,601	2024/12/1
		2.75 ITALY GOVT 161115	2.75	1,100	1,144	153,940	2016/11/15
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	600	640	86,138	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 171101	3.5	1,400	1,512	203,533	2017/11/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	1,100	1,205	162,154	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,400	1,551	208,798	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,100	1,258	169,369	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 160801	3.75	2,500	2,611	351,427	2016/8/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	1,700	1,961	263,925	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,000	1,153	155,230	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,500	2,889	388,731	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,400	1,631	219,469	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 170201	4.0	1,700	1,812	243,934	2017/2/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,500	1,742	234,460	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,900	2,279	306,658	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	1,800	2,050	275,830	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	2,100	2,424	326,181	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,600	1,865	251,048	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	1,800	2,004	269,727	2018/2/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	1,800	2,036	274,074	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	1,900	2,186	294,234	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	1,600	1,881	253,147	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,300	1,586	213,483	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,600	1,960	263,847	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,600	1,988	267,603	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 160915	4.75	1,200	1,274	171,502	2016/9/15
		4.75 ITALY GOVT 170501	4.75	900	981	131,993	2017/5/1
		4.75 ITALY GOVT 170601	4.75	1,400	1,530	205,935	2017/6/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	2,200	2,675	359,992	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,800	2,232	300,436	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	1,500	1,924	258,880	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,050	1,432	192,766	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,300	1,614	217,279	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,500	1,921	258,487	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,200	2,984	401,626	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,300	1,789	240,831	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,400	1,930	259,752	2040/9/1

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	5.25 ITALY GOVT 170801	5.25	2,100	2,334	314,074	2017/8/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,100	2,845	382,833	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,300	1,667	224,310	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	1,200	1,539	207,145	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	900	1,313	176,726	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,000	2,955	397,649	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	1,800	2,647	356,237	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	700	1,069	143,966	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,100	1,735	233,551	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O. A. T 200525	—	600	593	79,882	2020/5/25
		0.25 O. A. T 161125	0.25	700	704	94,778	2016/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	1,500	1,524	205,165	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	600	578	77,872	2025/5/25
		1 BTAN 170725	1.0	1,700	1,742	234,464	2017/7/25
		1 O. A. T 180525	1.0	1,700	1,753	235,985	2018/5/25
		1 O. A. T 181125	1.0	1,600	1,656	222,825	2018/11/25
		1 O. A. T 190525	1.0	1,700	1,763	237,221	2019/5/25
		1.75 BTAN 170225	1.75	1,800	1,860	250,376	2017/2/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	1,900	2,070	278,550	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	2,200	2,390	321,585	2024/11/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	1,700	1,915	257,669	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	2,000	2,263	304,513	2024/5/25
		2.5 BTAN 160725	2.5	2,500	2,578	346,987	2016/7/25
		2.5 O. A. T 201025	2.5	2,600	2,917	392,544	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	1,800	2,113	284,306	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	2,600	3,101	417,312	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	2,500	2,936	395,072	2022/4/25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	2,700	3,193	429,711	2021/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	1,000	1,374	184,912	2045/5/25
		3.5 O. A. T 200425	3.5	2,800	3,256	438,129	2020/4/25
		3.5 O. A. T 260425	3.5	2,200	2,786	374,970	2026/4/25
		3.75 O. A. T 170425	3.75	2,700	2,903	390,731	2017/4/25
		3.75 O. A. T 191025	3.75	2,800	3,251	437,470	2019/10/25
		3.75 O. A. T 210425	3.75	2,500	3,007	404,625	2021/4/25
		4 O. A. T 180425	4.0	1,800	2,014	271,059	2018/4/25
		4 O. A. T 381025	4.0	1,700	2,533	340,849	2038/10/25
		4 O. A. T 550425	4.0	1,000	1,634	219,975	2055/4/25
		4 O. A. T 600425	4.0	800	1,332	179,274	2060/4/25
		4.25 O. A. T 171025	4.25	2,600	2,877	387,104	2017/10/25
		4.25 O. A. T 181025	4.25	1,800	2,062	277,549	2018/10/25
		4.25 O. A. T 190425	4.25	1,600	1,864	250,833	2019/4/25
		4.25 O. A. T 231025	4.25	2,400	3,109	418,391	2023/10/25
4.5 O. A. T 410425	4.5	1,700	2,766	372,174	2041/4/25		
4.75 O. A. T 350425	4.75	1,600	2,529	340,400	2035/4/25		
5 O. A. T 161025	5.0	2,400	2,577	346,832	2016/10/25		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	5.5 O. A. T 290425	5.5	2,000	3,116	419,257	2029/4/25
		5.75 O. A. T 321025	5.75	1,700	2,880	387,625	2032/10/25
		6 O. A. T 251025	6.0	1,600	2,421	325,858	2025/10/25
		8.5 O. A. T 191025	8.5	700	959	129,137	2019/10/25
		8.5 O. A. T 230425	8.5	800	1,293	174,070	2023/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	200	200	26,974	2018/4/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	400	402	54,153	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	500	474	63,907	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 170415	0.5	500	506	68,129	2017/4/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	1,200	1,243	167,272	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	700	731	98,456	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,000	1,094	147,318	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,000	1,119	150,662	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,300	1,466	197,347	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 170115	2.5	1,400	1,462	196,752	2017/1/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	700	857	115,400	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	500	684	92,123	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,200	1,416	190,595	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	1,100	1,287	173,291	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	900	1,121	150,890	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,050	1,658	223,161	2042/1/15
		4 NETH GOVT 160715	4.0	900	943	126,968	2016/7/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	1,200	1,353	182,046	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	1,400	1,628	219,177	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	950	1,468	197,594	2037/1/15
4.5 NETH GOVT 170715	4.5	1,400	1,540	207,282	2017/7/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	900	1,393	187,449	2028/1/15		
スペイン	国債証券	0.5 SPAIN GOVT 171031	0.5	600	604	81,383	2017/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	1,500	1,551	208,707	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,100	1,084	145,984	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	500	474	63,840	2030/7/30
		2.1 SPAIN GOVT 170430	2.1	1,500	1,559	209,797	2017/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,100	1,198	161,207	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	1,500	1,631	219,504	2024/10/31
		3.25 SPAIN GOVT 160430	3.25	1,200	1,236	166,416	2016/4/30
		3.3 SPAIN GOVT 160730	3.3	1,300	1,351	181,797	2016/7/30
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	1,400	1,562	210,258	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 170131	3.8	1,600	1,702	229,068	2017/1/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,600	1,879	252,846	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	1,500	1,737	233,773	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	1,400	1,568	211,078	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,150	1,427	192,115	2037/1/31
		4.25 SPAIN GOVT 161031	4.25	1,700	1,804	242,790	2016/10/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	1,700	1,976	265,927	2019/10/31
4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,500	1,832	246,620	2023/10/31		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	1,500	1,672	225,075	2018/1/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,500	1,753	235,933	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,100	1,390	187,033	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	850	1,143	153,841	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,100	1,382	186,071	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,300	1,575	211,918	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	900	1,239	166,772	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	1,100	1,466	197,253	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	700	1,019	137,133	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	1,100	1,416	190,541	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 170730	5.5	1,500	1,677	225,670	2017/7/30
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	1,500	1,887	254,027	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,200	1,753	235,909	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,700	2,206	296,852	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,000	1,394	187,643	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,400	2,009	270,433	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	500	496	66,746	2025/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	800	831	111,918	2018/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,000	1,128	151,792	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,100	1,277	171,930	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	800	900	121,197	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	500	634	85,408	2034/6/22
		3.25 BEL GOVT 160928	3.25	700	732	98,564	2016/9/28
		3.5 BEL GOVT 170628	3.5	1,100	1,184	159,356	2017/6/28
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,300	1,546	208,017	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	450	675	90,875	2045/6/22
		4 BEL GOVT 170328	4.0	900	969	130,491	2017/3/28
		4 BEL GOVT 180328	4.0	800	893	120,217	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	900	1,037	139,531	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,000	1,242	167,144	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	600	843	113,546	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,000	1,245	167,642	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,000	1,271	171,026	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,050	1,659	223,225	2041/3/28
4.5 BEL GOVT 260328	4.5	600	821	110,515	2026/3/28		
5 BEL GOVT 350328	5.0	1,450	2,346	315,784	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 170928	5.5	500	566	76,225	2017/9/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,300	1,985	267,173	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	100	100	13,543	2019/10/18
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	600	651	87,616	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	300	328	44,155	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	600	645	86,897	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	300	361	48,627	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	400	574	77,231	2044/6/20
		3.2 AUSTRIA GOVT 170220	3.2	800	847	113,969	2017/2/20

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	1,000	1,214	163,451	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	900	1,079	145,198	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	700	855	115,061	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	300	535	71,986	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	900	1,071	144,151	2020/7/15
		4 AUSTRIA GOVT 160915	4.0	700	738	99,379	2016/9/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	850	1,324	178,144	2037/3/15
		4.3 AUSTRIA GOVT 170915	4.3	600	661	89,012	2017/9/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	1,400	1,630	219,413	2019/3/15
		4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	900	1,013	136,352	2018/1/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	500	708	95,325	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	500	806	108,511	2027/7/15
		フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	300	302
0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75			200	190	25,568	2031/4/15
1.125 FINNISH GOV 180915	1.125			400	415	55,897	2018/9/15
1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5			200	214	28,897	2023/4/15
1.625 FINNISH GOV 220915	1.625			400	433	58,305	2022/9/15
1.875 FINNISH GOV 170415	1.875			400	415	55,940	2017/4/15
2 FINNISH GOVT 240415	2.0			400	446	60,095	2024/4/15
2.625 FINNISH GOV 420704	2.625			300	397	53,495	2042/7/4
2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75			300	365	49,126	2028/7/4
3.375 FINNISH GOV 200415	3.375			500	578	77,890	2020/4/15
3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5			400	475	64,035	2021/4/15
3.875 FINNISH GOVT170915	3.875			300	328	44,155	2017/9/15
4 FINNISH GOVT 250704	4.0			400	527	70,913	2025/7/4
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375			400	471	63,381	2019/7/4
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	200	200	27,012	2022/3/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	400	398	53,569	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	300	332	44,756	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	600	715	96,205	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	400	487	65,644	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	400	468	63,090	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	700	805	108,312	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	800	957	128,791	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	600	742	99,947	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	800	1,105	148,774	2025/3/13
5.5 IRISH GOVT 171018	5.5	500	566	76,262	2017/10/18		
5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	500	622	83,743	2019/10/18		
小 計						51,488,739	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	1 GILT 170907	1.0	2,100	2,115	396,580	2017/9/7	
	1.25 GILT 180722	1.25	2,300	2,321	435,147	2018/7/22	
	1.75 GILT 170122	1.75	1,400	1,428	267,825	2017/1/22	
	1.75 GILT 190722	1.75	2,100	2,144	402,013	2019/7/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	1,800	1,802	338,002	2022/9/7	

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
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					
	2 GILT 200722	2.0	1,100	1,131	212,094	2020/7/22
	2 GILT 250907	2.0	200	199	37,323	2025/9/7
	2.25 GILT 230907	2.25	1,700	1,752	328,483	2023/9/7
	2.75 GILT 240907	2.75	1,700	1,814	340,131	2024/9/7
	3.25 GILT 440122	3.25	1,900	2,143	401,821	2044/1/22
	3.5 GILT 450122	3.5	1,000	1,181	221,448	2045/1/22
	3.5 GILT 680722	3.5	1,050	1,340	251,241	2068/7/22
	3.75 GILT 190907	3.75	1,300	1,438	269,702	2019/9/7
	3.75 GILT 200907	3.75	1,600	1,792	336,006	2020/9/7
	3.75 GILT 210907	3.75	1,600	1,811	339,620	2021/9/7
	3.75 GILT 520722	3.75	1,100	1,409	264,184	2052/7/22
	4 GILT 160907	4.0	1,500	1,568	294,042	2016/9/7
	4 GILT 220307	4.0	900	1,038	194,706	2022/3/7
	4 GILT 600122	4.0	900	1,251	234,600	2060/1/22
	4.25 GILT 271207	4.25	800	982	184,215	2027/12/7
	4.25 GILT 320607	4.25	1,100	1,382	259,256	2032/6/7
	4.25 GILT 360307	4.25	1,400	1,792	335,985	2036/3/7
	4.25 GILT 390907	4.25	800	1,043	195,688	2039/9/7
	4.25 GILT 401207	4.25	1,100	1,443	270,680	2040/12/7
	4.25 GILT 461207	4.25	1,150	1,563	293,030	2046/12/7
	4.25 GILT 491207	4.25	1,000	1,387	260,049	2049/12/7
	4.25 GILT 551207	4.25	1,050	1,508	282,755	2055/12/7
	4.5 GILT 190307	4.5	900	1,014	190,201	2019/3/7
	4.5 GILT 340907	4.5	1,700	2,226	417,320	2034/9/7
	4.5 GILT 421207	4.5	1,300	1,792	336,126	2042/12/7
	4.75 GILT 200307	4.75	1,300	1,508	282,704	2020/3/7
	4.75 GILT 301207	4.75	1,500	1,973	369,925	2030/12/7
	4.75 GILT 381207	4.75	1,300	1,809	339,306	2038/12/7
	5 GILT 180307	5.0	1,100	1,228	230,303	2018/3/7
	5 GILT 250307	5.0	1,200	1,525	285,951	2025/3/7
	6 GILT 281207	6.0	900	1,303	244,412	2028/12/7
	8 GILT 210607	8.0	1,000	1,374	257,743	2021/6/7
	8.75 GILT 170825	8.75	500	593	111,197	2017/8/25
小	計				10,711,831	
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	300	341	44,019	2021/4/28
	2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	320	364	46,999	2020/7/6
	3 SWISS GOVT 180108	3.0	500	550	70,961	2018/1/8
	3 SWISS GOVT 190512	3.0	360	412	53,141	2019/5/12
	4 SWISS GOVT 230211	4.0	320	422	54,503	2023/2/11
	4 SWISS GOVT 280408	4.0	420	625	80,707	2028/4/8
	4.25 SWISS GOVT 170605	4.25	300	331	42,715	2017/6/5
小	計				393,049	
スウェーデン			千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券					
	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	4,400	4,711	68,218	2023/11/13

銘	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
スウェーデン		%	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ	千円		
	国債証券	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	4,800	5,602	81,129	2025/5/12
		3 SWD GOVT 160712	3.0	3,500	3,636	52,656	2016/7/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	5,200	6,286	91,025	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,000	4,169	60,373	2039/3/30
		3.75 SWD GOVT 170812	3.75	4,600	5,018	72,665	2017/8/12
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	6,100	7,110	102,966	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	5,800	7,324	106,063	2020/12/1
小	計					635,098	
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	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	1,600	1,611	25,812	2025/3/13
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	3,500	3,623	58,052	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	3,200	3,560	57,046	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	4,800	5,460	87,484	2021/5/25
		4.25 NORWE GOVT 170519	4.25	4,400	4,692	75,168	2017/5/19
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	4,100	4,653	74,545	2019/5/22
小	計					378,110	
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	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	4,400	4,746	85,618	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	3,200	3,503	63,200	2025/11/15
		2.5 DMK GOVT 161115	2.5	3,400	3,542	63,902	2016/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	6,400	7,489	135,112	2021/11/15
		4 DMK GOVT 171115	4.0	3,600	3,978	71,766	2017/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	7,100	8,365	150,921	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	8,600	14,314	258,229	2039/11/15
		7 DMK GOVT 241110	7.0	1,900	3,022	54,533	2024/11/10
小	計					883,285	
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	800	767	25,494	2020/4/25
		2.5 POLAND 180725	2.5	1,800	1,824	60,602	2018/7/25
		3.25 POLAND 190725	3.25	1,600	1,663	55,229	2019/7/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	1,500	1,557	51,712	2025/7/25
		3.75 POLAND 180425	3.75	1,400	1,471	48,862	2018/4/25
		4 POLAND 231025	4.0	1,900	2,085	69,263	2023/10/25
		4.75 POLAND 161025	4.75	2,100	2,188	72,680	2016/10/25
		4.75 POLAND 170425	4.75	1,100	1,161	38,574	2017/4/25
		5.25 POLAND 171025	5.25	1,900	2,052	68,153	2017/10/25
		5.25 POLAND 201025	5.25	1,300	1,488	49,439	2020/10/25
		5.5 POLAND 191025	5.5	1,300	1,476	49,038	2019/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	1,100	1,310	43,510	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	1,600	1,932	64,190	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	5.75	600	788	26,202	2029/4/25
		POLAND 160725	—	600	588	19,543	2016/7/25
小	計					742,499	
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	2.75 AUST GOVT 191021	2.75	700	714	68,299	2019/10/21

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円		
	国債証券	2.75	AUST GOVT 240421	1,500	1,485	142,036	2024/4/21
		2.75	AUST GOVT 350621	200	178	17,051	2035/6/21
		3.25	AUST GOVT 181021	600	621	59,420	2018/10/21
		3.25	AUST GOVT 250421	1,200	1,230	117,685	2025/4/21
		3.25	AUST GOVT 290421	700	701	67,070	2029/4/21
		3.75	AUST GOVT 370421	600	619	59,246	2037/4/21
		4.25	AUST GOVT 170721	1,400	1,465	140,107	2017/7/21
		4.25	AUST GOVT 260421	1,000	1,113	106,486	2026/4/21
		4.5	AUST GOVT 200415	1,400	1,540	147,318	2020/4/15
		4.5	AUST GOVT 330421	700	804	76,958	2033/4/21
		4.75	AUST GOVT 160615	1,300	1,337	127,945	2016/6/15
		4.75	AUST GOVT 270421	1,000	1,165	111,413	2027/4/21
		5.25	AUST GOVT 190315	1,800	2,000	191,351	2019/3/15
		5.5	AUST GOVT 180121	1,300	1,414	135,236	2018/1/21
		5.5	AUST GOVT 230421	1,500	1,791	171,317	2023/4/21
		5.75	AUST GOVT 210515	1,600	1,888	180,636	2021/5/15
		5.75	AUST GOVT 220715	1,200	1,440	137,732	2022/7/15
		6.0	AUST GOVT 170215	1,700	1,814	173,508	2017/2/15
小	計					2,230,824	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル			
	国債証券	0.5	SINGAPORGV 180401	200	195	17,744	2018/4/1
		1.625	SINGAPORGV 191001	150	150	13,609	2019/10/1
		2.25	SINGAPORGV 210601	300	305	27,681	2021/6/1
		2.375	SINGAPORGV 170401	300	307	27,852	2017/4/1
		2.5	SINGAPORGV 190601	400	416	37,705	2019/6/1
		2.75	SINGAPORGV 230701	200	208	18,906	2023/7/1
		2.75	SINGAPORGV 420401	360	348	31,587	2042/4/1
		2.875	SINGAPORGV 290701	100	102	9,310	2029/7/1
		2.875	SINGAPORGV 300901	240	244	22,134	2030/9/1
		3.0	SINGAPORGV 240901	450	477	43,253	2024/9/1
		3.125	SINGAPORGV 220901	400	429	38,845	2022/9/1
		3.25	SINGAPORGV 200901	300	322	29,161	2020/9/1
		3.375	SINGAPORGV 330901	200	215	19,540	2033/9/1
		3.5	SINGAPORGV 270301	410	451	40,838	2027/3/1
		3.75	SINGAPORGV 160901	600	621	56,269	2016/9/1
		4.0	SINGAPORGV 180901	300	326	29,522	2018/9/1
小	計					463,963	
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	3.172	MALAYSIA 160715	800	800	26,803	2016/7/15
		3.26	MALAYSIA GOVT 180301	700	695	23,292	2018/3/1
		3.314	MALAYSIA 171031	600	599	20,060	2017/10/31
		3.394	MALAYSIA GOV 170315	600	600	20,097	2017/3/15
		3.418	MALAYSIA GOVT 220815	400	388	12,992	2022/8/15
		3.48	MALAYSIA GOVT 230315	1,300	1,259	42,156	2023/3/15
		3.492	MALAYSIA GOV 200331	800	792	26,549	2020/3/31

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額		千円	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
マレーシア		%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
国債証券	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	900	846	28,325	2027/5/31
	3.58 MALAYSIAGOV 180928	3.58	800	801	26,826	2018/9/28
	3.654 MALAYSIAGOV 191031	3.654	500	500	16,745	2019/10/31
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	100	95	3,197	2028/6/15
	3.814MALAYSIAGOV 170215	3.814	1,200	1,209	40,479	2017/2/15
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	200	190	6,367	2033/4/15
	3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	800	807	27,030	2020/7/31
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	800	782	26,203	2027/3/15
	4.012 MALAYSIAGOV 170915	4.012	1,200	1,216	40,715	2017/9/15
	4.048 MALAYSIA 210930	4.048	800	808	27,075	2021/9/30
	4.127 MALAYSIA 320415	4.127	700	686	22,990	2032/4/15
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	1,000	1,019	34,124	2021/7/15
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	600	608	20,380	2024/7/15
	4.24 MALAYSIAGOV 180207	4.24	1,000	1,019	34,133	2018/2/7
	4.262MALAYSIAGOV 160915	4.262	700	709	23,753	2016/9/15
	4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	1,500	1,544	51,719	2019/11/29
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	600	616	20,650	2026/4/15
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	600	624	20,892	2030/4/15
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	400	416	13,951	2043/9/30
	5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	500	540	18,094	2019/7/30
小計					675,612	
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	10,300	12,183	123,661	2026/12/21
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	6,100	4,721	47,926	2036/3/31
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	5,900	4,604	46,737	2041/2/28
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	5,000	4,791	48,628	2021/3/31
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	6,100	5,310	53,898	2031/2/28
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	5,100	5,049	51,254	2020/1/15
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	3,900	3,877	39,358	2023/2/28
	8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	4,600	4,704	47,746	2018/12/21
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	4,200	4,041	41,018	2030/1/31
	8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	4,400	4,513	45,810	2017/9/15
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	3,000	2,919	29,635	2032/3/31
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	3,400	3,351	34,022	2037/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	1,500	1,507	15,299	2044/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	6,100	6,133	62,255	2048/2/28
小計					687,254	
合計					126,650,183	

(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

(2015年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 126,650,183	% 98.5
コール・ローン等、その他	1,919,335	1.5
投資信託財産総額	128,569,518	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (128,384,420千円) の投資信託財産総額 (128,569,518千円) 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=120.94円	1 カナダドル=98.82円	1 メキシコペソ=7.95円	1 ユーロ=134.55円
1 イギリスポンド=187.47円	1 スイスフラン=128.95円	1 スウェーデンクローネ=14.48円	1 ノルウェークローネ=16.02円
1 デンマーククローネ=18.04円	1 ポーランドズロチ=33.21円	1 オーストラリアドル=95.63円	1 シンガポールドル=90.55円
1 マレーシアリンギット=33.48円	1 南アフリカランド=10.15円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年5月20日現在)

項目	当期末
(A) 資産	129,225,326,156
コール・ローン等	474,298,821
公社債(評価額)	126,650,183,348
未収入金	1,005,406,163
未収利息	1,059,980,155
前払費用	35,457,669
(B) 負債	1,038,568,757
未払金	656,665,800
未払解約金	381,902,957
(C) 純資産総額(A-B)	128,186,757,399
元本	46,627,128,292
次期繰越損益金	81,559,629,107
(D) 受益権総口数	46,627,128,292口
1万口当たり基準価額(C/D)	27,492円

<注記事項>

①期首元本額	71,948,386,523円
期中追加設定元本額	3,044,240,090円
期中一部解約元本額	28,365,498,321円

②期末における元本の内訳(親規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)	128,142,848円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	244,582,421円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	159,161,869円
三菱UFJ 外国債券オープン	1,675,979,617円
三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	813,592,203円
三菱UFJ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	2,181,939,664円
三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	1,475,743,728円
三菱UFJ 財産分散ファンド(毎月決算型)	776,107,898円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	703,699,212円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	90,277,762円
F Pバランスファンド(安定型)	76,380,395円
F Pバランスファンド(安定成長型)	104,110,642円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	29,025,364円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	2,037,321,341円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	486,394,914円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,288,305,732円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	32,526,879,148円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)VA(適格機関投資家限定)	158,545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)	735,956円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定)	90,712,564円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	1,737,876,469円
合計	46,627,128,292円

○損益の状況 (2014年5月21日～2015年5月20日)

項目	当期
(A) 配当等収益	4,331,274,475
受取利息	4,331,133,261
その他収益金	141,214
(B) 有価証券売買損益	16,167,820,885
売買益	19,440,181,430
売買損	△ 3,272,360,545
(C) 保管費用等	△ 42,600,138
(D) 当期損益金(A+B+C)	20,456,495,222
(E) 前期繰越損益金	102,919,406,211
(F) 追加信託差損益金	4,926,430,597
(G) 解約差損益金	△ 46,742,702,923
(H) 計(D+E+F+G)	81,559,629,107
次期繰越損益金(H)	81,559,629,107

- (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新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ②デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)

MUAM J-REITマザーファンド

《第11期》決算日2015年3月10日

[計算期間：2014年3月11日～2015年3月10日]

「MUAM J-REITマザーファンド」は、3月10日に第11期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	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（通常の状態では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（不動産投資法人の投資証券もしくは新投資口予約権証券または不動産投資信託の受益証券をいいます。）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 (分配落)	税		期		東証REIT指数（配当込み）		投資信託証券 組入比率	純総 資産額
		分	配	騰	落	期	中		
	円		円		%		%	%	百万円
7期(2011年3月10日)	12,011		—		26.5	1,587.80	27.7	97.8	3,930
8期(2012年3月12日)	11,453		—	△	4.6	1,486.12	△ 6.4	97.8	2,994
9期(2013年3月11日)	18,149		—		58.5	2,273.38	53.0	97.1	3,548
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

(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		東 証 REIT 指 数 (配 当 込 み)		投 資 信 託 組 入 比	託 券 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2014年3月10日	円 20,785	% —		% —		% 98.0
3月末	20,419	△ 1.8	2,464.98	△ 1.7		98.3
4月末	20,882	0.5	2,520.81	0.5		98.3
5月末	21,845	5.1	2,645.27	5.5		98.1
6月末	22,433	7.9	2,710.90	8.1		98.4
7月末	22,747	9.4	2,749.06	9.6		97.3
8月末	23,244	11.8	2,815.18	12.3		97.6
9月末	23,650	13.8	2,859.23	14.0		98.5
10月末	24,287	16.8	2,942.29	17.3		98.6
11月末	26,019	25.2	3,139.72	25.2		98.1
12月末	27,279	31.2	3,273.60	30.5		98.6
2015年1月末	27,300	31.3	3,260.64	30.0		96.9
2月末	27,447	32.1	3,306.03	31.8		97.9
(期 末) 2015年3月10日	26,403	27.0	3,166.15	26.3		95.9

(注) 騰落率は期首比。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ27.0%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(26.3%)を0.7%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎J-REIT市況

- ・ 期初は利益確定の売りなどにより上値の重い展開でしたが、2014年5月に入るとGPIF(年金積立金管理運用独立行政法人)が今後REITの投資額を増やすとの期待などに後押しされ上昇に転じました。
- ・ 度重なる公募増資などを消化しつつ、一段の円安傾向や低位安定する長期金利に支えられて上昇基調を維持し、さらに10月末には追加的な金融緩和策が日銀から発表され急騰しました。
- ・ しかし2015年に入ると、相次ぐ公募増資などの発表に加え長期金利が反転上昇したことを受けて利益確定の売りに押され期末を迎えました。

●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など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、PBR（投資口価格純資産倍率）などの分析を行いました。
- ・組入銘柄数は43銘柄程度で推移させました。
- ・主な売買動向については、今後とも堅調な業績が見込まれるオリックス不動産投資法人のウェイトを引き上げたことなどや、相対的に割安感の後退した東急リアル・エステート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。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

(プラス要因となった主な銘柄)

- ・インヴィンシブル投資法人：高収益なホテル物件の取得による業績の大幅な拡大が見込めることからオーバーウェイト（投資比率を基準となる配分比率より多くすること）とした時期に、投資口価格が好調に推移したことからプラスに寄与。
- ・日本ビルファンド投資法人：高品質な物件ポートフォリオを保有するものの本格的な業績拡大に時間を要するとみてアンダーウェイト（投資比率を基準となる配分比率より少なくすること）とした時期に、投資口価格が低調に推移したことからプラスに寄与。
- ・オリックス不動産投資法人：物件取得や賃料値上げによる業績の回復基調を評価しオーバーウェイトとした時期に、投資口価格が好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)

- ・イオンリート投資法人：物件取得による成長が見込めるものの割安感が後退したことからアンダーウェイトとした時期に、投資口価格が好調に推移したことからマイナスに影響。
- ・プレミア投資法人：保有物件の賃料収入の回復に時間を要するとみてアンダーウェイト。投資口価格が好調に推移したことからマイナスに影響。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・当面のJ-REIT市場は、底堅い展開を想定しています。
- ・オフィス市況については、テナントの動きが活発化していることに加え、賃料の回復についても優良な一部物件以外への広がりが見られます。REIT各社の業績については、物件取得による収益寄与に加えてオフィス中心に賃料値上げが徐々に浸透しつつあり、増益への期待が高まりつつある状況です。
- ・バリュエーション（投資価値基準）については、配当金利回りなどの観点から引き続き投資魅力はあるとみています。今後見込まれる高水準の公募増資などを消化しながらも、市場は底堅く推移するものとみられます。

◎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。
- ・配当金利回りやPBRなど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など、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

(2014年3月11日～2015年3月10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 61 (61)	% 0.255 (0.255)	(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 有価証券等を売買する際に発生する費用
合 計	61	0.255	
期中の平均基準価額は、23,962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) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(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

(2014年3月11日～2015年3月10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	0.396	162,371	0.358	148,997
MIDリート投資法人	0.888	239,566	0.524	138,129
森ヒルズリート投資法人	1 (0.164)	189,140 (23,946)	0.495	72,524
野村不動産レジデンシャル投資法人	0.207	118,582	0.304	175,525
産業ファンド投資法人	0.283 (0.151)	243,683 (-)	0.134	121,139
大和ハウスリート投資法人	0.425	193,781	0.358	175,796
アドバンス・レジデンス投資法人	0.999	251,139	0.906	258,333
ケネディクス・レジデンシャル投資法人	0.075	25,621	-	-
アクティブ・プロパティーズ投資法人	0.357	342,935	0.335	295,011
GLP投資法人	2	277,093	2	247,214
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.243 (0.087)	88,187 (-)	0.027	20,549
日本プロロジスリート投資法人	1	334,083	1	319,474
野村不動産マスターファンド投資法人	1	194,247	1	206,650
星野リゾート・リート投資法人	-	-	0.003	2,273
イオンリート投資法人	1	162,319	1	216,991
ヒューリックリート投資法人	0.547	88,890	0.621	98,849
日本リート投資法人	0.595	188,289	0.011	3,997
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1	128,452	0.702	75,162
トーセイ・リート投資法人	0.035	4,577	-	-
ケネディクス商業リート投資法人	0.462	118,785	-	-
日本ビルファンド投資法人	0.521	302,236	0.699	407,881
ジャパンリアルエステイト投資法人	0.92	523,702	0.735	404,965
日本リテールファンド投資法人	1	354,207	1	438,180
オリックス不動産投資法人	2	398,168	0.978	138,245
日本プライムリアルティ投資法人	0.416	160,836	0.339	136,344
プレミアム投資法人	0.21	124,617	0.147	63,592
東急リアル・エステート投資法人	0.801	111,374	1	194,921
グローバル・ワン不動産投資法人	0.6 (0.037)	201,880 (-)	0.458	168,608
野村不動産オフィスファンド投資法人	0.273	149,375	0.339	156,262
ユナイテッド・アーバン投資法人	1	178,558	1	260,787
森トラスト総合リート投資法人	1 (0.644)	223,905 (-)	0.811	185,787
インヴィンシブル投資法人	7	248,370	0.634	15,488
フロンティア不動産投資法人	0.254	137,030	0.364	191,669
平和不動産リート投資法人	1	144,626	1	94,533
日本ロジスティクスファンド投資法人	1	317,267	0.999	249,339

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	福岡リート投資法人	0.368	69,598	0.486	97,767
	ケネディクス・オフィス投資法人	0.532	304,203	0.498	281,931
	積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	1	170,607	1	161,506
		(0.104)	(-)		
	いちご不動産投資法人	2	216,457	1	90,787
	大和証券オフィス投資法人	0.588	322,675	0.339	187,253
	阪急リート投資法人	0.086	49,026	0.122	58,160
		(0.032)	(-)		
	スターツプロシード投資法人	0.186	39,771	0.132	23,243
	トップリート投資法人	0.343	164,766	0.412	199,272
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	0.222	103,525	0.295	127,332
		(0.127)	(-)		
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	1	109,142	0.074	4,591
	日本賃貸住宅投資法人	0.911	72,489	1	100,467
ジャパンエクセレント投資法人	0.28	40,364	0.451	65,061	
森ヒルズリート投資法人(新)	0.164	23,946	-	-	
	(△0.164)	(△ 23,946)			
合	計	44	8,614,482	30	7,080,606
		(1)	(-)		

(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

(2014年3月11日～2015年3月10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	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 8,614	百万円 1,692	% 19.6	百万円 7,080	百万円 1,560	% 22.0

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 565

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)	14,342千円
うち利害関係人への支払額 (B)	2,920千円
(B) / (A)	20.4%

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

○組入資産の明細

(2015年3月10日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千口	千円	%
日本アコモデーションファンド投資法人	0.172	0.21	95,130	1.3
MIDリート投資法人	0.033	0.397	116,122	1.6
森ヒルズリート投資法人	1	2	355,507	5.0
野村不動産レジデンシャル投資法人	0.13	0.033	22,506	0.3
産業ファンド投資法人	0.059	0.359	198,527	2.8
大和ハウスリート投資法人	0.082	0.149	81,205	1.1
アドバンス・レジデンス投資法人	0.629	0.722	207,430	2.9
ケネディクス・レジデンシャル投資法人	—	0.075	26,550	0.4
アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.218	0.24	246,000	3.5
GLP投資法人	1	1	157,458	2.2
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.004	0.307	75,829	1.1
日本プロロジスリート投資法人	1	1	337,963	4.7
野村不動産マスターファンド投資法人	0.703	0.686	98,029	1.4
星野リゾート・リート投資法人	0.003	—	—	—
イオンリート投資法人	0.364	0.007	1,238	0.0
ヒューリックリート投資法人	0.401	0.327	57,715	0.8
日本リート投資法人	—	0.584	185,128	2.6
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	—	0.516	59,494	0.8
トーセイ・リート投資法人	—	0.035	4,494	0.1
ケネディクス商業リート投資法人	—	0.462	125,063	1.8
日本ビルファンド投資法人	0.622	0.444	247,308	3.5
ジャパンリアルエステイト投資法人	0.757	0.942	534,114	7.5
日本リテールファンド投資法人	1	0.917	216,962	3.0
オリックス不動産投資法人	0.839	2	460,271	6.5
日本プライムリアルティ投資法人	0.281	0.358	145,527	2.0
プレミアム投資法人	0.106	0.169	107,315	1.5
東急リアル・エステート投資法人	0.54	0.02	3,026	0.0
グローバル・ワン不動産投資法人	0.052	0.231	109,378	1.5
野村不動産オフィスファンド投資法人	0.223	0.157	89,804	1.3
ユナイテッド・アーバン投資法人	1	1	220,264	3.1
森トラスト総合リート投資法人	0.215	1	276,012	3.9
インヴィンシブル投資法人	0.729	7	418,938	5.9
フロンティア不動産投資法人	0.168	0.058	31,146	0.4
平和不動産リート投資法人	1	1	158,332	2.2
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.23	0.57	138,852	2.0
福岡リート投資法人	0.235	0.117	26,020	0.4

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	%
ケネディクス・オフィス投資法人	0.168	0.202	130,896	1.8
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	0.048	0.406	55,053	0.8
いちご不動産投資法人	1	2	236,111	3.3
大和証券オフィス投資法人	0.286	0.535	346,145	4.9
阪急リート投資法人	0.014	0.01	1,471	0.0
スターツプロシード投資法人	0.148	0.202	42,460	0.6
トップリート投資法人	0.118	0.049	24,206	0.3
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	0.115	0.169	43,686	0.6
ジャパン・ホテル・リート投資法人	0.851	2	167,257	2.4
日本賃貸住宅投資法人	1	1	136,030	1.9
ジャパンエクセレント投資法人	0.23	0.059	8,814	0.1
合 計	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	20	36	6,826,796	
	銘 柄 数 < 比 率 >	42	< 95.9% >	

(注) 比率および合計欄の<>内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注) 日本アコモデーションファンド投資法人、MIDリート投資法人、森ヒルズリート投資法人、野村不動産レジデンシャル投資法人、産業ファンド投資法人、大和ハウスリート投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、ケネディクス・レジデンシャル投資法人、アクティビア・プロパティーズ投資法人、GLP投資法人、コンフォリア・レジデンシャル投資法人、日本プロロジスリート投資法人、野村不動産マスターファンド投資法人、イオンリート投資法人、ヘ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、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、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、プレミアア投資法人、東急リアル・エステート投資法人、グローバル・ワン不動産投資法人、野村不動産オフィスファンド投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、森トラスト総合リート投資法人、インヴィンシブル投資法人、フロンティア不動産投資法人、平和不動産リート投資法人、日本ロジスティクスファンド投資法人、福岡リート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人、いちご不動産投資法人、大和証券オフィス投資法人、阪急リート投資法人、スターツプロシード投資法人、トップリート投資法人、大和ハウス・レジデンシャル投資法人、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者である三菱UFJ信託銀行、三菱東京UFJ銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUFJ証券が当該ファンドの一般事務受託会社等となっています。(各ファンドで開示されている直近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

(2015年3月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	6,826,796	94.5
コール・ローン等、その他	394,928	5.5
投資信託財産総額	7,221,724	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年3月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	7,221,724,817
コール・ローン等	196,657,936
投資証券(評価額)	6,826,796,100
未収入金	143,380,622
未収配当金	54,889,830
未収利息	329
(B) 負債	104,552,396
未払金	91,162,183
未払解約金	13,390,213
(C) 純資産総額(A-B)	7,117,172,421
元本	2,695,596,532
次期繰越損益金	4,421,575,889
(D) 受益権総口数	2,695,596,532口
1万口当たり基準価額(C/D)	26,403円

○損益の状況 (2014年3月11日～2015年3月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	145,219,418
受取配当金	145,153,234
受取利息	66,182
その他収益金	2
(B) 有価証券売買損益	1,138,611,036
売買益	1,199,852,023
売買損	△ 61,240,987
(C) 当期損益金(A+B)	1,283,830,454
(D) 前期繰越損益金	2,198,858,054
(E) 追加信託差損益金	1,662,353,302
(F) 解約差損益金	△ 723,465,921
(G) 計(C+D+E+F)	4,421,575,889
次期繰越損益金(G)	4,421,575,889

(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。

<注記事項>

①期首元本額	2,038,753,172円
期中追加設定元本額	1,157,624,508円
期中一部解約元本額	500,781,148円
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 財産分散ファンド(毎月決算型)	324,310,587円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	144,197,164円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	87,733,982円
ファンド・マネジャー(国内リート)	123,257,248円
三菱UFJ <DC>J-REITファンド	1,839,489,530円
FPバランスファンド(安定型)	3,921,574円
FPバランスファンド(安定成長型)	5,562,648円
MUAM J-REITファンド(適格機関投資家転売制限付)	167,123,799円
合計	2,695,596,532円

【お知らせ】

- ①新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ②デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)

MUAM G-REITマザーファンド

《第9期》決算日2015年1月5日

[計算期間：2014年1月7日～2015年1月5日]

「MUAM G-REITマザーファンド」は、1月5日に第9期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第9期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		S & P 先進国REITインデックス (除く日本、配当込み、円換算ベース)		投資信託 組入比率	純資産 総額
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
5期(2011年1月5日)	6,556	6.8%	6,712.35	7.5%	97.4%	2,883
6期(2012年1月5日)	6,322	△3.6%	6,499.46	△3.2%	99.0%	3,231
7期(2013年1月7日)	9,018	42.6%	9,337.10	43.7%	98.5%	4,623
8期(2014年1月6日)	10,769	19.4%	11,215.01	20.1%	98.1%	6,129
9期(2015年1月5日)	15,384	42.9%	16,149.24	44.0%	99.1%	11,986

(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(「SPDJ」)の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ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投信株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P先進国REITインデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		S & P先進国REITインデックス (除く日本、配当込み、円換算ベース)		投資信託 組入比率
	円	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2014年1月6日	10,769	—	11,215.01	—	98.1%
1月末	10,765	△0.0%	11,206.07	△0.1%	99.1%
2月末	11,195	4.0%	11,666.64	4.0%	98.8%
3月末	11,353	5.4%	11,830.09	5.5%	98.3%
4月末	11,775	9.3%	12,278.78	9.5%	99.6%
5月末	11,945	10.9%	12,463.34	11.1%	98.9%
6月末	12,142	12.7%	12,692.52	13.2%	98.9%
7月末	12,454	15.6%	13,023.65	16.1%	99.3%
8月末	12,671	17.7%	13,257.92	18.2%	99.0%
9月末	12,607	17.1%	13,186.18	17.6%	98.8%
10月末	13,379	24.2%	14,004.15	24.9%	100.8%
11月末	14,842	37.8%	15,551.98	38.7%	99.3%
12月末	15,520	44.1%	16,279.87	45.2%	99.2%
(期末) 2015年1月5日	15,384	42.9%	16,149.24	44.0%	99.1%

(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

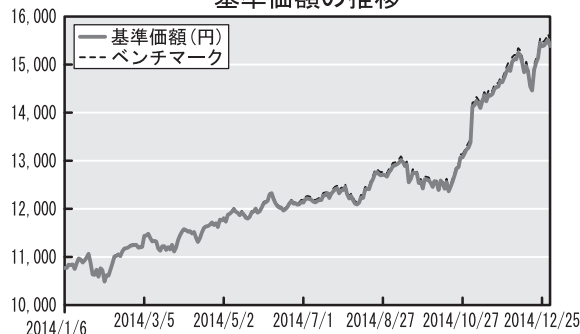
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ42.9%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ベンチマークは44.0%の上昇となったため、カイ離は△1.1%程度となりました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国REIT市況

期首から2014年8月にかけては、ウクライナなどで地政学的リスクが高まるなか、欧米での緩和的な金融政策が好感され、REIT市況は上昇しました。

9月から期末にかけては、欧州の経済指標が悪化するなど世界経済への不透明感が強まる局面もありましたが、米国の良好な企業決算発表などを受けて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15.0%の円安・米ドル高、1.1%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

◎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

基準価額は期首に比べ42.9%の上昇となりました。

ベンチマークは44.0%の上昇となったため、カイ離は△1.1%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	△0.5%程度	△1.1%程度

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

◎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 $\Delta 0.4\%$ 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 $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

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

◎その他の要因

その他の要因による影響は $\Delta 0.5\%$ 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

引き続き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

(2014年1月7日～2015年1月5日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	円 3 (0) (3)	% 0.026 (0.000) (0.026)	(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 有価証券等を売買する際に発生する費用
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	3 (0) (3)	0.022 (0.000) (0.022)	(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)	8 (8) (0)	0.062 (0.061) (0.001)	(c) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 外国での資産の保管等に要する費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	14	0.110	
期中の平均基準価額は、12,554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) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(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）を各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

(2014年1月7日～2015年1月5日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ	百株 — (0.78)	千アメリカドル — (3)	百株 0.78	千アメリカドル 7
	国				
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	— (32)	— (10)	32	9

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株式分割・増資割当および合併等による増減分です。

投資信託証券

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	DDR CORP	7	130	—	—
	HCP INC	14	600	3	132
	MACERICH CO/THE	4	311	1	72
	ACADIA REALTY TRUST	2	77	—	—
	AGREE REALTY CORP	0.36	10	—	—
	ALEXANDER'S INC	0.16	63	—	—
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1	150	0.25	18
	PROLOGIS INC	16	658	3	158
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	3	122	0.45	16
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2	24	—	—
	ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	1	22	—	—
	BIOMED REALTY TRUST INC	6	134	1	26
	BRANDYWINE REALTY TRUST	7	110	0.9	13
	BRE PROPERTIES INC	0.4	23	—	—
		(△ 6)	(△ 347)		
	CAMDEN PROPERTY TRUST	2	167	0.16	12
	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	4	88	0.61	11
	CEDAR REALTY TRUST INC	1	11	—	—
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4	154	0.4	15
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	2	78	—	—
	COUSINS PROPERTIES INC	6	83	1	12
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	5	77	1	14
	DIGITAL REALTY TRUST INC	5	308	1	79
	EASTGROUP PROPERTIES INC	0.88	55	—	—
	EDUCATION REALTY TRUST INC	5	53	—	—
		(△ 9)	(—)		
	EPR PROPERTIES	1	101	—	—
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2	97	—	—
	EQUITY ONE INC	3	72	0.54	12
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	340	0.218	43
		(1)	(347)		
	EXTRA SPACE STORAGE INC	3	163	0.37	19
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	243	0.14	18
	TRADE STREET RESIDENTIAL INC	2	15	1	9
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	3	71	—	—
	FIRST POTOMAC REALTY TRUST	1	12	—	—
	GETTY REALTY CORP	0.6	11	0.53	9
	GLIMCHER REALTY TRUST	3	42	—	—
	HEALTH CARE REIT INC	12	798	1	88
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	2	92	0.2	8
	HOME PROPERTIES INC	1	105	0.23	14

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	4	128	0.6	16
EQUITY COMMONWEALTH	4	117	0.55	14
INLAND REAL ESTATE CORP	3	38	1	10
KILROY REALTY CORP	2	143	0.2	13
KITE REALTY GROUP TRUST	22 (△ 22)	166 (-)	-	-
LEXINGTON REALTY TRUST	5	62	1	12
LTC PROPERTIES INC	0.9	35	-	-
MACK-CALI REALTY CORP	1	24	-	-
BOSTON PROPERTIES INC	4	565	0.98	118
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5	68	-	-
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2	141	0.26	17
NATL HEALTH INVESTORS INC	1	77	-	-
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	3	129	0.33	12
PARKWAY PROPERTIES INC	4	79	-	-
PENN REAL ESTATE INVEST TST	1	27	-	-
POST PROPERTIES INC	1	82	0.26	14
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	2	39	-	-
REALTY INCOME CORP	8	367	1	70
REGENCY CENTERS CORP	2	160	0.47	28
SENIOR HOUSING PROP TRUST	7	173	1	33
SL GREEN REALTY CORP	2	312	0.58	62
SOVRAN SELF STORAGE INC	0.79	61	-	-
STRATEGIC HOTELS & RESORTS I	14	170	1	13
SUN COMMUNITIES INC	1	94	-	-
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	7	111	0.95	14
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	3	115	0.76	26
TAUBMAN CENTERS INC	1	121	0.23	17
CUBESMART	7	140	0.7	14
UDR INC	8	241	2	57
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.3	13	-	-
URSTADT BIDDLE - CLASS A	0.6	13	-	-
VENTAS INC	9	603	2	139
WASHINGTON REIT	1	41	-	-
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	3	110	0.42	15
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7	52	1	11
PS BUSINESS PARKS INC/CA	0.76	62	0.35	27
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	0.7	12	-	-
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	2	22	-	-
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	2	67	-	-
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1	23	-	-
WINTHROP REALTY TRUST	0.8	12	3	55
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	8 (△ 22)	103 (-)	1	14

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	アメリカ		千口		千アメリカドル
	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	4	38	—	—
	DOUGLAS EMMETT INC	3	95	—	—
	GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	14	86	—	—
	DUPONT FABROS TECHNOLOGY	1	48	0.36	11
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	2	110	0.3	12
	EXCEL TRUST INC	2	25	—	—
	CHESAPEAKE LODGING TRUST	1	54	0.4	13
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	3	65	1	17
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	2	55	0.45	10
	CORESITE REALTY CORP	1	35	0.3	11
	CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	3	23	1	9
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	1	47	0.27	10
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	2	23	—	—
	GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	2	52	—	—
	RLJ LODGING TRUST	4	119	0.45	14
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	4	65	—	—
	ROUSE PROPERTIES INC	2	35	0.55	9
	STAG INDUSTRIAL INC	3	75	0.45	10
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	1	53	—	—
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	9	150	0.85	13
	SELECT INCOME REIT	2	58	0.45	10
	HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	11	148	1	13
		(△ 11)	(—)		
	WP CAREY INC	5	355	—	—
	WHITESTONE REIT	0.76	11	—	—
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1	60	—	—
	CHATHAM LODGING TRUST	1	32	—	—
	TERRENO REALTY CORP	2	54	—	—
国	SILVER BAY REALTY TRUST CORP	0.65	10	—	—
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	13	157	1	10
	CORRECTIONS CORP OF AMERICA	3	119	0.79	28
	AVIV REIT INC	1	49	0.35	11
	GEO GROUP INC/THE	2	79	—	—
	AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	87	1,136	10	124
	COLE REAL ESTATE INVESTMENT	0.8	11	32	490
	AMREIT INC	0.51	11	—	—
	DUKE REALTY CORP	10	192	1	27
	AMERICAN RESIDENTIAL PROPERT	2	38	—	—
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	3	45	—	—
	PHYSICIANS REALTY TRUST	3	43	—	—
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	11	206	0.75	12
	CHAMBERS STREET PROPERTIES	7	56	1	13
	CYRUSONE INC	2	68	0.4	10
	ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	0.9	14	—	—

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	4	70	0.7	11
QTS REALTY TRUST INC-CL A	0.4	10	—	—
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	10	250	—	—
STARWOOD WAYPOINT RESIDE	3	107	—	—
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	12	339	—	—
WASHINGTON PRIME GROUP	2	42	—	—
	(13)	(—)		
CARETRUST REIT INC	2	54	—	—
NEW YORK REIT INC	15	186	—	—
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	2	21	—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	9	284	—	—
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	3	29	—	—
IRON MOUNTAIN INC	19	636	0.76	28
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	7	120	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	12	785	1	107
FELCOR LODGING TRUST INC	1	12	—	—
GENERAL GROWTH PROPERTIES	25	621	4	103
HOST HOTELS & RESORTS INC	23	515	5	112
LIBERTY PROPERTY TRUST	4	162	0.8	28
LASALLE HOTEL PROPERTIES	3	121	—	—
PUBLIC STORAGE	4	793	1	190
SIMON PROPERTY GROUP INC	9	1,632	2	361
VORNADO REALTY TRUST	5	561	1	119
KIMCO REALTY CORP	13	322	3	84
AVALONBAY COMMUNITIES INC	4	688	0.74	109
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	3	128	0.4	13
小 計	783	23,558	125	3,815
	(△ 56)	(—)	(—)	(3)
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	0.4	25	—	—
CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	1	40	—	—
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1	29	—	—
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	0.9	40	—	—
CHARTWELL RETIREMENT RESIDEN	1	16	—	—
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	3	71	0.5	9
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1	39	0.5	13
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3	83	0.5	11
INNVEST REAL ESTATE INVESTME	3	20	—	—
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	0.8	13	0.7	11
NORTHERN PROPERTY REAL ESTAT	0.4	11	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4	114	—	—
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	1	40	—	—
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	1	28	—	—
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6	78	2	37

銘 柄		買 付		売 付		
		口 数	金 額	口 数	金 額	
外	カナダ		千口	千口	千カナダドル	
		BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO	0.4	10	—	—
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	1	11	—	—
		DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	1	14	—	—
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	0.9	36	0.3	12
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	2	22	1	11
		HEALTHLEASE PROPERTIES REAL	—	—	(1)	(14)
		MILESTONE APARTMENTS REAL ES	1	13	—	—
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1	11	—	—
		PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	5	25	—	—
		CHOICE PROPERTIES REIT	1	12	—	—
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	2	25	2	29
	PLAZA RETAIL REIT	4	19	—	—	
	小 計	54	857	9	137	
				(1)	(14)	
国	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ	
		ドイツ				
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	3	30	0.8	7
			(—)	(△ 2)		
		HAMBORNER REIT AG	0.95	7	—	—
		PRIME OFFICE REIT-AG	—	—	—	—
					(3)	(10)
		小 計	3	37	0.8	7
			(—)	(△ 2)	(3)	(10)
		イタリア				
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	42	32	13	8
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ-RTS	—	—	15	2
		(15)	(—)			
	BENI STABILI SPA	35	21	—	—	
	BENI STABILI SPA-RTS	—	—	80	1	
		(80)	(—)			
	小 計	77	53	108	11	
		(95)	(—)			
	フランス					
	GECINA SA	1	180	0.08	8	
	KLEPIERRE	2	99	0.3	10	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	3	600	0.605	119	
	FONCIERE DES REGIONS	1	84	0.15	10	
		(—)	(△ 4)			
	STE DE LA TOUR EIFFEL	0.1	5	0.582	25	
	MERCIALYS	1	26	—	—	
	ANF IMMOBILIER	0.35	8	—	—	
	ICADE	1	72	0.33	21	

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
フランス				
ALTAREA	0.06	8	0.15	19
小 計	11 (-)	1,084 (△ 4)	2	215
オランダ				
EUROCOMMERCIAL PROPETIE-CV	1	49	-	-
NSI NV	4	19	3	11
VASTNED RETAIL NV	0.49	18	-	-
CORIO NV	3	114	0.57	21
WERELDHAVE NV	1	97	-	-
WERELDHAVE NV-RTS	-	-	2	13
小 計	11 (2)	299 (-)	5	47
スペイン				
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	3	31	-	-
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	13	137	-	-
AXIA REAL ESTATE SOCIMI SA	3	36	-	-
小 計	20	205	-	-
ベルギー				
BEFIMMO	0.59	33	-	-
WAREHOUSES DE PAUW SCA	0.42	24	-	-
AEDIFICA	0.65	34	0.32	16
COFINIMMO	0.5	44	-	-
小 計	2	136	0.32	16
アイルランド				
GREEN REIT PLC	52	68	7	9
HIBERNIA REIT PLC	75	82	8	9
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	12	13	-	-
小 計	139	163	15	18
ギリシャ				
GRIVALIA PROPERTIES REIC	1	9	2	20
GRIVALIA PROPERTIES REIC-RTS	-	-	0.95	1
小 計	1 (0.95)	9 (-)	3	22
ユ ー ロ 計	267 (98)	1,991 (△ 7)	136 (3)	340 (10)
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	33	238	6	47
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	11	74	2	13
HAMMERSON PLC	28	162	4	25
LAND SECURITIES GROUP PLC	23	248	4	50
INTU PROPERTIES PLC	46	142	3	10

外 国

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
INTU PROPERTIES PLC-RTS	— (15)	— (—)	15	14
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	4	15	3	12
SEGRE PLC	20	73	2	9
WORKSPACE GROUP PLC	3	24	—	—
MCKAY SECURITIES PLC-ORD	8	19	—	—
SHAFTESBURY PLC	9	67	0.9	6
BIG YELLOW GROUP PLC	4	25	—	—
DERWENT LONDON PLC	3	109	0.3	8
MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	1	6	—	—
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	11	16	—	—
HANSTEEN HOLDINGS PLC	16	17	—	—
REDEFINE INTERNATIONAL PLC	85	45	13	6
SAFESTORE HOLDINGS PLC	20	48	—	—
TRITAX BIG BOX REIT PLC	46	49	—	—
ASSURA GROUP LTD	94	48	—	—
小 計	473 (15)	1,434 (—)	56	206
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
FEDERATION CENTRES	37	96	5	13
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	2	11	3	11
ABACUS PROPERTY GROUP	14	38	9	22
INGENIA COMMUNITIES GROUP	22	10	—	—
360 CAPITAL GROUP LTD	19	18	—	—
ALE PROPERTY GROUP	3	10	—	—
CHARTER HALL GROUP	13	58	2	13
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	16	31	—	—
CHALLENGER DIVERSIFIED PROPE	—	—	10	28
GALILEO JAPAN TRUST	15	25	—	—
CROMWELL PROPERTY GROUP	22	21	—	—
WESTFIELD RETAIL TRUST	32	98	4 (253)	12 (761)
AUSTRALAND PROPERTY GROUP	14	64	42	191
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	14	25	—	—
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	10	25	—	—
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR-RTS	— (1)	— (—)	1	0.06332
NATIONAL STORAGE REIT	24	29	—	—
GDI PROPERTY GROUP	49	45	—	—
INDUSTRIA REIT	13	25	—	—
AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT	6	13	—	—
360 CAPITAL OFFICE FUND	7	15	—	—
SCENTRE GROUP	111 (436)	381 (689)	17	60

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
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
ARENA REIT	16	24	—	—
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	26	64	10	25
NOVION PROPERTY GROUP	69	144	15	29
GPT GROUP	52	208	3	15
MIRVAC GROUP	103	182	17	29
STOCKLAND	77	309	17	70
COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	11	13	157	197
WESTFIELD CORP	58	518	14	129
DEXUS PROPERTY GROUP	189	244	22	46
	(△ 433)	(—)		
BWP TRUST	17	43	—	—
INVESTA OFFICE FUND	14	50	—	—
CHARTER HALL RETAIL REIT	6	23	—	—
GOODMAN GROUP	41	214	5	29
小 計	1,135	3,090	359	926
	(3)	(689)	(253)	(761)
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
KIWI PROPERTY GROUP LTD	25	29	—	—
GOODMAN PROPERTY TRUST	26	28	—	—
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	11	15	—	—
DNZ PROPERTY FUND LTD	9	15	—	—
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	90	107	—	—
ARGOSY PROPERTY LTD	83	89	—	—
小 計	245	284	—	—
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	66	2,861	11	494
CHAMPION REIT	79	279	—	—
PROSPERITY REIT	62	162	32	82
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	64	247	84	331
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	25	77	—	—
FORTUNE REIT	27	185	—	—
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	66	212	—	—
NEW CENTURY REIT	30	105	—	—
小 計	419	4,131	127	908
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	89	156	8	14
	(—)	(△ 0.5348)	(—)	(0.30975)
CAPITACOMMERCIAL TRUST	67	108	26	41
KEPPEL REIT	114	138	11	13
	(—)	(△ 0.399)	(—)	(0.2378)
FRASERS COMMERCIAL TRUST	9	13	—	—
			(—)	(0.03152)
ASCOTT RESIDENCE TRUST	38	47	10	12
	(—)	(△ 2)	(—)	(1)

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	36 (-)	25 (△0.41015)	- (-)	- (0.096)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	15	25	-	-
FRASERS CENTREPOINT TRUST	16	30	-	-
STARHILL GLOBAL REIT	20 (-)	16 (△ 0.254)	-	-
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	39 (-)	43 (△ 1)	-	(0.30688)
CAPITARETAIL CHINA TRUST	9 (-)	13 (△ 2)	-	(0.9016)
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	12 (-)	12 (△ 0.9945)	-	(0.2535)
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	20 (-)	27 (△ 0.1196)	-	-
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL-RTS	- (5)	- (-)	5	1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	80 (-)	29 (△ 1)	38 (-)	14 (0.2272)
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	- (-)	- (△ 0.3616)	-	- (0.112)
SAIZEN REIT	-	-	22	19
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	60 (-)	84 (△ 0.0945)	30 (-)	41 (0.1218)
CACHE LOGISTICS TRUST	11 (-)	13 (△0.02506)	-	-
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	42	57	11	15
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	16	13	-	-
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	12	12	-	-
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	45 (-)	32 (△ 1)	-	-
MAPLETREE GREATER CHINA COMM	36 (-)	31 (△ 1)	-	-
CROESUS RETAIL TRUST	-	-	34	32
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	15	12	15	11
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	46 (-)	36 (△ 0.2346)	15	11
OUE HOSPITALITY TRUST	80	74	-	-
SPH REIT	81	87	-	-
FRASERS HOSPITALITY TRUST	51	45	-	-
CAPITAMALL TRUST	74	145	6	11
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	50 (-)	114 (△ 0.1083)	6	13
小 計	1,183 (5)	1,452 (△ 13)	237 (-)	254 (4)

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	イスラエル	千口	千口	千イスラエルシェケル
	REIT 1 LTD	15		136
	小 計	15		136

(注) 金額は受渡代金。

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

○株式売買比率

(2014年1月7日～2015年1月5日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	2,258千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	一千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	—

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2014年1月7日～2015年1月5日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 3,266	百万円 87	% 2.7	百万円 600	百万円 57	% 9.5

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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2015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		比 率
	口 数	口 数	評 価 額		
			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	22	29	550	66,227	0.6
HCP INC	34	45	2,046	246,276	2.1
MACERICH CO/THE	10	14	1,182	142,272	1.2
ACADIA REALTY TRUST	4	6	224	26,989	0.2
AGREE REALTY CORP	1	1	45	5,527	0.0
ALEXANDER'S INC	0.165	0.325	143	17,226	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5	7	634	76,393	0.6
PROLOGIS INC	37	49	2,163	260,367	2.2
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	7	10	446	53,690	0.4
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	5	8	84	10,178	0.1
ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	4	5	133	16,020	0.1
BIOMED REALTY TRUST INC	14	19	424	51,083	0.4
BRANDYWINE REALTY TRUST	11	18	288	34,761	0.3
BRE PROPERTIES INC	5	—	—	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	6	8	651	78,421	0.7
CEL & ASSOCIATES PROPERTIES	13	17	340	40,981	0.3
CEDAR REALTY TRUST INC	4	5	43	5,183	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	9	13	520	62,660	0.5
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	6	9	269	32,426	0.3
COUSINS PROPERTIES INC	13	19	228	27,533	0.2
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	15	19	297	35,764	0.3
DIGITAL REALTY TRUST INC	9	13	898	108,128	0.9
EASTGROUP PROPERTIES INC	2	3	200	24,174	0.2
EDUCATION REALTY TRUST INC	8	4	168	20,274	0.2
EPR PROPERTIES	3	5	338	40,745	0.3
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5	8	421	50,723	0.4
EQUITY ONE INC	4	7	192	23,136	0.2
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2	6	1,331	160,285	1.3
EXTRA SPACE STORAGE INC	8	11	653	78,588	0.7
FEDERAL REALTY INVS TRUST	4	6	922	111,028	0.9
TRADE STREET RESIDENTIAL INC	—	0.9	6	833	0.0
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	7	11	234	28,234	0.2
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	4	5	65	7,899	0.1
GETTY REALTY CORP	2	2	45	5,429	0.0
GLIMCHER REALTY TRUST	10	14	202	24,396	0.2
HEALTH CARE REIT INC	21	32	2,510	302,159	2.5
HIGHWOODS PROPERTIES INC	6	9	404	48,672	0.4
HOME PROPERTIES INC	4	5	378	45,596	0.4
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	11	15	473	57,035	0.5

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		比 率
	口 数	口 数	評 価 額		
			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	%
EQUITY COMMONWEALTH	8	12	332	40,001	0.3
INLAND REAL ESTATE CORP	6	9	100	12,118	0.1
KILROY REALTY CORP	6	8	580	69,803	0.6
KITE REALTY GROUP TRUST	8	8	245	29,517	0.2
LEXINGTON REALTY TRUST	15	20	225	27,131	0.2
LTC PROPERTIES INC	2	3	150	18,133	0.2
MACK-CALI REALTY CORP	6	7	153	18,473	0.2
BOSTON PROPERTIES INC	11	15	2,003	241,044	2.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	12	17	244	29,483	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5	7	566	68,179	0.6
NATL HEALTH INVESTORS INC	2	3	234	28,213	0.2
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	9	12	507	61,055	0.5
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1	1	28	3,472	0.0
PARKWAY PROPERTIES INC	4	8	160	19,342	0.2
PENN REAL ESTATE INVEST TST	5	6	160	19,345	0.2
POST PROPERTIES INC	4	5	324	39,074	0.3
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	4	7	135	16,306	0.1
REALTY INCOME CORP	15	22	1,081	130,183	1.1
REGENCY CENTERS CORP	7	9	605	72,922	0.6
SAUL CENTERS INC	1	1	61	7,418	0.1
SENIOR HOUSING PROP TRUST	14	20	457	55,078	0.5
SL GREEN REALTY CORP	7	9	1,159	139,572	1.2
SOVRAN SELF STORAGE INC	2	3	289	34,849	0.3
STRATEGIC HOTELS & RESORTS I	13	26	355	42,813	0.4
SUN COMMUNITIES INC	2	4	274	33,013	0.3
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	14	20	344	41,443	0.3
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	7	9	358	43,129	0.4
TAUBMAN CENTERS INC	4	6	479	57,761	0.5
CUBESMART	9	16	366	44,068	0.4
UDR INC	18	25	795	95,720	0.8
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1	1	65	7,914	0.1
URSTADT BIDDLE - CLASS A	2	2	62	7,553	0.1
VENTAS INC	22	29	2,143	257,923	2.2
WASHINGTON REIT	5	6	187	22,574	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	8	11	400	48,163	0.4
HERSHA HOSPITALITY TRUST	13	20	143	17,262	0.1
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1	1	153	18,484	0.2
UMH PROPERTIES INC	1	1	14	1,732	0.0
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	0.99	1	29	3,516	0.0
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	3	6	66	8,057	0.1
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	7	9	272	32,781	0.3
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	6	8	109	13,181	0.1
WINTHROP REALTY TRUST	2	—	—	—	—
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	24	8	319	38,428	0.3
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	7	12	101	12,196	0.1

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		比 率
	口 数	口 数	評 価 額		
			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	%
DOUGLAS EMMETT INC	9	13	384	46,218	0.4
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	2	16	115	13,863	0.1
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	5	6	215	25,983	0.2
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	4	7	329	39,593	0.3
EXCEL TRUST INC	3	5	73	8,888	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	3	5	197	23,735	0.2
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	12	14	285	34,375	0.3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	3	5	164	19,839	0.2
CORESITE REALTY CORP	1	2	91	10,979	0.1
CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	5	7	52	6,329	0.1
AMERICAN ASSETS TRUST INC	2	3	144	17,392	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	6	8	104	12,595	0.1
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	4	6	156	18,883	0.2
RLJ LODGING TRUST	9	12	435	52,410	0.4
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	4	8	149	17,981	0.2
ROUSE PROPERTIES INC	2	3	69	8,326	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	3	6	154	18,532	0.2
SABRA HEALTH CARE REIT INC	3	5	159	19,181	0.2
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	14	23	393	47,408	0.4
SELECT INCOME REIT	2	3	96	11,652	0.1
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	13	12	331	39,868	0.3
WP CAREY INC	4	9	681	82,001	0.7
WHITESTONE REIT	1	2	36	4,411	0.0
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	3	5	267	32,140	0.3
CHATHAM LODGING TRUST	1	3	96	11,655	0.1
TERRENO REALTY CORP	1	4	93	11,309	0.1
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	2	3	59	7,159	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	27	40	482	58,100	0.5
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	8	11	422	50,811	0.4
AVIV REIT INC	1	2	91	10,976	0.1
GEO GROUP INC/THE	5	7	305	36,817	0.3
AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	13	90	843	101,492	0.8
COLE REAL ESTATE INVESTMENT	31	—	—	—	—
AMREIT INC	1	1	48	5,789	0.0
DUKE REALTY CORP	24	34	694	83,631	0.7
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	2	2	19	2,286	0.0
AMERICAN RESIDENTIAL PROPERT	0.82	2	51	6,202	0.1
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	1	4	67	8,120	0.1
PHYSICIANS REALTY TRUST	1	4	74	8,969	0.1
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	3	14	249	30,020	0.3
CHAMBERS STREET PROPERTIES	17	22	189	22,845	0.2
CYRUSONE INC	1	3	100	12,123	0.1
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	1	2	34	4,170	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	5	9	173	20,903	0.2
QTS REALTY TRUST INC-CL A	0.8	1	41	4,948	0.0

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		比 率	
	口 数	口 数	評 価 額			
			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	%	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	2	13	340	40,928	0.3	
STARWOOD WAYPOINT RESIDE	—	3	101	12,228	0.1	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	—	12	318	38,362	0.3	
WASHINGTON PRIME GROUP	—	15	270	32,505	0.3	
CARETRUST REIT INC	—	2	34	4,126	0.0	
NEW YORK REIT INC	—	15	167	20,105	0.2	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	—	2	23	2,770	0.0	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	—	9	269	32,441	0.3	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	—	3	28	3,408	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	—	18	713	85,845	0.7	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	—	7	117	14,135	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	25	35	2,640	317,720	2.7	
FELCOR LODGING TRUST INC	9	10	113	13,626	0.1	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	40	62	1,770	213,041	1.8	
HOST HOTELS & RESORTS INC	56	75	1,796	216,220	1.8	
LIBERTY PROPERTY TRUST	10	14	557	67,045	0.6	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	7	11	456	54,987	0.5	
PUBLIC STORAGE	10	14	2,694	324,314	2.7	
SIMON PROPERTY GROUP INC	23	30	5,728	689,366	5.8	
VORNADO REALTY TRUST	13	17	2,070	249,131	2.1	
KIMCO REALTY CORP	30	41	1,044	125,710	1.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	9	13	2,180	262,429	2.2	
APARTMENT INVNT & MGMT CO -A	11	14	552	66,457	0.6	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,233	1,834	70,247	8,453,609	
	銘 柄 数 < 比 率 >	141	149	—	< 70.5% >	
(カナダ)			千カナダドル			
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2	2	149	15,279	0.1	
CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	4	6	175	17,972	0.1	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4	5	138	14,184	0.1	
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	2	3	154	15,807	0.1	
CHARTWELL RETIREMENT RESIDEN	6	8	97	9,938	0.1	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	4	7	149	15,279	0.1	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	4	5	129	13,284	0.1	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	9	13	285	29,180	0.2	
INNVEST REAL ESTATE INVESTME	3	7	42	4,292	0.0	
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	2	2	52	5,360	0.0	
NORTHERN PROPERTY REAL ESTAT	1	1	38	3,974	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	11	15	410	41,968	0.4	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	2	3	139	14,246	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	5	7	101	10,396	0.1	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	3	6	90	9,199	0.1	
BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO	1	1	40	4,152	0.0	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	1	2	19	1,991	0.0	
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	4	5	48	4,921	0.0	
RETROCOM REAL ESTATE INVESTM	2	2	9	998	0.0	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		比 率	
	口 数	口 数	評 価 額			
			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	%	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1	2	95	9,739	0.1	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	2	2	17	1,795	0.0	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	1	2	22	2,325	0.0	
HEALTHLEASE PROPERTIES REAL	1	—	—	—	—	
MILESTONE APARTMENTS REAL ES	1	2	30	3,109	0.0	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1	2	26	2,656	0.0	
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	4	10	44	4,516	0.0	
CHOICE PROPERTIES REIT	3	4	45	4,679	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4	3	41	4,224	0.0	
PLAZA RETAIL REIT	—	4	18	1,880	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	99	143	2,616	267,358	
	銘柄 数 < 比 率 >	28	28	—	<2.2%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	5	8	84	12,148	0.1	
HAMBORNER REIT AG	2	3	30	4,426	0.0	
PRIME OFFICE REIT-AG	3	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	11	11	115	16,574	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	2	—	<0.1%>	
(ユーロ…イタリア)						
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	7	36	24	3,495	0.0	
BENI STABILI SPA	65	100	58	8,474	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	72	137	83	11,970	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)						
GECLINA SA	1	3	377	54,323	0.5	
KLEPIERRE	7	9	353	50,832	0.4	
UNIBAIL-RODAMCO SE	7	9	2,058	296,252	2.5	
FONCIERE DES REGIONS	3	4	340	48,966	0.4	
STE DE LA TOUR EIFFEL	0.482	—	—	—	—	
MERCIALYS	4	5	100	14,480	0.1	
ANF IMMOBILIER	0.72	1	22	3,181	0.0	
ICADE	2	3	217	31,249	0.3	
ALTAREA	0.29	0.2	26	3,774	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	28	37	3,494	503,061	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	8	—	<4.2%>	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPRIETE-CV	2	4	144	20,788	0.2	
NSI NV	8	10	39	5,658	0.0	
VASTNED RETAIL NV	1	1	73	10,591	0.1	
CORTIO NV	7	9	398	57,380	0.5	
WERELDHAVE NV	1	3	192	27,689	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	21	29	848	122,108	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<1.0%>	
(ユーロ…スペイン)						
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	—	3	31	4,492	0.0	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		比 率
	口 数	口 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)	千口	千口	千ユーロ	千円	%
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	—	13	136	19,644	0.2
AXIA REAL ESTATE SOCIMI SA	—	3	40	5,890	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	—	20	208	30,027
	銘柄 数 < 比 率 >	—	3	—	<0.3%>
(ユーロ…ベルギー)					
BEFIMMO	1	1	113	16,381	0.1
WAREHOUSES DE PAUW SCA	0.87	1	81	11,683	0.1
AEDIFICA	0.64	0.97	54	7,843	0.1
COFINIMMO	1	1	170	24,546	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	4	5	420	60,455
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.5%>
(ユーロ…アイルランド)					
GREEN REIT PLC	21	66	84	12,226	0.1
HIBERNIA REIT PLC	—	66	73	10,624	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	—	12	12	1,829	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	21	144	171	24,680
	銘柄 数 < 比 率 >	1	3	—	<0.2%>
(ユーロ…ギリシャ)					
GRIVALIA PROPERTIES REIC	0.95	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	0.95	—	—	—
	銘柄 数 < 比 率 >	1	—	—	<—%>
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	160	387	5,341	768,878
	銘柄 数 < 比 率 >	25	27	—	<6.4%>
(イギリス)			千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC	75	101	776	143,048	1.2
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	25	34	254	46,937	0.4
HAMMERSON PLC	53	77	466	85,912	0.7
LAND SECURITIES GROUP PLC	58	77	888	163,732	1.4
INTU PROPERTIES PLC	50	93	311	57,440	0.5
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	8	9	36	6,674	0.1
SEGRO PLC	56	73	279	51,553	0.4
WORKSPACE GROUP PLC	7	11	90	16,693	0.1
MCKAY SECURITIES PLC-ORD	—	8	19	3,509	0.0
SHAFTESBURY PLC	19	28	219	40,424	0.3
BIG YELLOW GROUP PLC	9	14	89	16,420	0.1
DERWENT LONDON PLC	6	10	302	55,628	0.5
MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	4	5	25	4,660	0.0
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	48	59	91	16,868	0.1
HANSTEEN HOLDINGS PLC	49	66	71	13,186	0.1
REDEFINE INTERNATIONAL PLC	23	95	52	9,686	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	—	20	49	9,078	0.1
TRITAX BIG BOX REIT PLC	—	46	50	9,290	0.1
ASSURA GROUP LTD	—	94	47	8,743	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	496	929	4,123	759,491
	銘柄 数 < 比 率 >	15	19	—	<6.3%>

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		比 率	
	口 数	口 数	評 価 額			
			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	%	
FEDERATION CENTRES	110	142	410	40,022	0.3	
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	7	6	35	3,418	0.0	
ABACUS PROPERTY GROUP	20	26	79	7,784	0.1	
ASPEN GROUP	11	11	14	1,389	0.0	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	53	75	33	3,254	0.0	
360 CAPITAL GROUP LTD	—	19	19	1,926	0.0	
ALE PROPERTY GROUP	12	16	55	5,388	0.0	
CHARTER HALL GROUP	16	27	125	12,198	0.1	
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	—	16	31	3,105	0.0	
CHALLENGER DIVERSIFIED PROPE	10	—	—	—	—	
GALILEO JAPAN TRUST	—	15	25	2,445	0.0	
CROMWELL PROPERTY GROUP	100	123	128	12,537	0.1	
WESTFIELD RETAIL TRUST	225	—	—	—	—	
AUSTRALAND PROPERTY GROUP	28	—	—	—	—	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	48	62	116	11,361	0.1	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	7	17	49	4,782	0.0	
NATIONAL STORAGE REIT	—	24	35	3,417	0.0	
GDI PROPERTY GROUP	—	49	42	4,157	0.0	
INDUSTRIA REIT	—	13	26	2,598	0.0	
AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT	—	6	14	1,388	0.0	
360 CAPITAL OFFICE FUND	—	7	16	1,566	0.0	
SCENTRE GROUP	—	530	1,873	182,745	1.5	
ARENA REIT	—	16	25	2,510	0.0	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	—	16	42	4,183	0.0	
NOVION PROPERTY GROUP	184	239	515	50,236	0.4	
GPT GROUP	118	168	740	72,250	0.6	
MIRVAC GROUP	273	359	650	63,432	0.5	
STOCKLAND	172	232	963	93,988	0.8	
COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	146	—	—	—	—	
WESTFIELD CORP	146	190	1,743	169,991	1.4	
DEXUS PROPERTY GROUP	355	89	629	61,403	0.5	
BWP TRUST	33	51	142	13,931	0.1	
INVESTA OFFICE FUND	47	61	227	22,190	0.2	
CHARTER HALL RETAIL REIT	23	29	124	12,095	0.1	
GOODMAN GROUP	115	151	876	85,439	0.7	
小 計	口 数 ・ 金 額	2,269	2,796	9,814	957,146	
	銘柄 数 < 比 率 >	24	31	—	< 8.0% >	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	27	27	42	3,946	0.0	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	70	95	117	10,887	0.1	
GOODMAN PROPERTY TRUST	76	103	117	10,861	0.1	
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	30	41	62	5,754	0.0	
DNZ PROPERTY FUND LTD	19	28	55	5,101	0.0	
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	—	90	107	9,898	0.1	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		比 率	
	口 数	口 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ニュージーランド)	千口	千口	千ニュージーランドドル	千円	%	
ARGOSY PROPERTY LTD	—	83	89	8,284	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	222	468	592	54,734	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	7	—	< 0.5% >	
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	174	229	11,255	174,683	1.5	
CHAMPION REIT	187	266	965	14,985	0.1	
PROSPERITY REIT	104	134	357	5,552	0.0	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	135	115	450	6,996	0.1	
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	75	75	154	2,397	0.0	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	66	91	318	4,943	0.0	
FORTUNE REIT	104	131	1,021	15,858	0.1	
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	—	66	244	3,789	0.0	
NEW CENTURY REIT	—	30	99	1,550	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	845	1,137	14,868	230,757	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	9	—	< 1.9% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
SUNTEC REIT	168	249	488	44,070	0.4	
CAPITACOMMERCIAL TRUST	168	209	365	32,979	0.3	
KEPPEL REIT	58	161	197	17,809	0.1	
FRASERS COMMERCIAL TRUST	42	51	72	6,565	0.1	
ASCOTT RESIDENCE TRUST	64	92	116	10,550	0.1	
CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	79	115	78	7,061	0.1	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	51	66	115	10,399	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	42	58	111	10,055	0.1	
STARHILL GLOBAL REIT	115	135	109	9,874	0.1	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	112	151	177	16,021	0.1	
CAPITARETAIL CHINA TRUST	49	58	94	8,510	0.1	
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	39	51	64	5,802	0.0	
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	32	52	74	6,691	0.1	
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	142	184	63	5,732	0.0	
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	32	32	75	6,790	0.1	
SAIZEN REIT	22	—	—	—	—	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	87	117	174	15,794	0.1	
CACHE LOGISTICS TRUST	56	67	77	7,018	0.1	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	100	131	186	16,797	0.1	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	62	78	63	5,775	0.0	
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	44	56	52	4,753	0.0	
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	39	84	57	5,157	0.0	
MAPLETREE GREATER CHINA COMM	137	173	164	14,840	0.1	
CROESUS RETAIL TRUST	34	—	—	—	—	
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	51	51	40	3,638	0.0	
OU COMMERCIAL REAL ESTATE I	—	31	25	2,267	0.0	
OU HOSPITALITY TRUST	—	80	73	6,609	0.1	
SPH REIT	—	81	84	7,606	0.1	
FRASERS HOSPITALITY TRUST	—	51	44	4,052	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	
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポールドル	千円	%	
CAPITAMALL TRUST	194	262	534	48,263	0.4	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	154	198	475	42,910	0.4	
小 計	口 数 ・ 金 額	2,174	3,125	4,256	384,403	
	銘柄 数 < 比 率 >	27	29	—	< 3.2% >	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
REIT 1 LTD	—	15	146	4,468	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	—	15	146	4,468	
	銘柄 数 < 比 率 >	—	1	—	< 0.0% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	7,502	10,836	—	11,880,847	
	銘柄 数 < 比 率 >	272	300	—	< 99.1% >	

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

(注) 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

(2015年1月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資証券	千円 11,880,847	% 98.4
コール・ローン等、その他	196,036	1.6
投資信託財産総額	12,076,883	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (11,915,926千円) の投資信託財産総額 (12,076,883千円) に対する比率は98.7%です。

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

1 アメリカドル=120.34円	1 カナダドル=102.19円	1 ユーロ=143.94円	1 イギリスポンド=184.20円
1 オーストラリアドル=97.52円	1 ニュージーランドドル=92.42円	1 香港ドル=15.52円	1 シンガポールドル=90.30円
1 イスラエルシェケル=30.57円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年1月5日現在)

○損益の状況 (2014年1月7日～2015年1月5日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	12,156,462,357
コール・ローン等	143,106,992
投資証券(評価額)	11,880,847,274
未収入金	79,619,209
未収配当金	52,888,729
未収利息	153
(B) 負債	169,803,916
未払金	141,681,908
未払解約金	28,122,008
(C) 純資産総額(A-B)	11,986,658,441
元本	7,791,829,073
次期繰越損益金	4,194,829,368
(D) 受益権総口数	7,791,829,073口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,384円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	356,658,663
受取配当金	356,189,861
受取利息	232,144
その他収益金	236,658
(B) 有価証券売買損益	2,835,113,521
売買益	2,913,934,066
売買損	△ 78,820,545
(C) 保管費用等	△ 5,161,424
(D) 当期損益金(A+B+C)	3,186,610,760
(E) 前期繰越損益金	437,900,041
(F) 追加信託差損益金	860,502,643
(G) 解約差損益金	△ 290,184,076
(H) 計(D+E+F+G)	4,194,829,368
次期繰越損益金(H)	4,194,829,368

(注記事項)

①期首元本額	5,691,968,849円
期中追加設定元本額	3,067,811,045円
期中一部解約元本額	967,950,821円

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

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)	259,472,162円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	147,510,341円
三菱UFJ 資産設計ファンド(分配型)	39,212,420円
三菱UFJ 資産設計ファンド(バランス型)	79,922,206円
三菱UFJ 資産設計ファンド(株式重視型)	35,491,929円
ファンド・マネジャー(海外リート)	146,637,705円
FPバランスファンド(安定型)	13,245,774円
FPバランスファンド(安定成長型)	19,825,162円
eMAXIS 先進国リートインデックス	5,884,582,528円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	734,784,930円
eMAXIS バランス(波乗り型)	247,169,714円
三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド	161,234,498円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	22,739,704円
合計	7,791,829,073円

E T F (上場投資信託) の概要

ファンド名	ベンチマーク (参照指標)	内 容	決算月
ISHARES CHINA LARGE-CAP ETF	FTSE 中国 50 インデックス	中国の株式市場に上場され、かつ海外投資家にも投資可能な、規模が最も大きく流動性の高い中国企業50社の株式で構成されるFTSE 中国 50 インデックスに連動することをめざすETFです。	7月
上場インデックスファンド中国A株 (パンダ) CSI 300	CSI 300指数 (円換算ベース)	上海証券取引所および深セン証券取引所に上場されている全A株のうち、時価総額および流動性の高い300銘柄で構成される円換算したCSI 300指数に連動することをめざすETFです。	1月
LYXOR UCITS ETF MSCI INDIA (旧名称: LYXOR ETF MSCI INDIA)	MSCI インディア・インデックス	インド株式市場全体を正確に捉えるための株価指数で、浮動株ベース時価総額の85%をカバーするMSCI インディア・インデックスに連動することをめざすETFです。	2月
ISHARES MSCI BRAZIL CAPPED ETF	MSCI ブラジル 25/50 インデックス	ブラジルにある証券取引所で取引される株式で構成されるMSCI ブラジル 25/50 インデックスに連動することをめざすETFです。	8月
ISHARES DIVERSIFIED COMMODITY SWAP UCITS ETF (DE) (旧名称: ISHARES DOW JONES-UBS COMMODITY SWAP UCITS ETF (DE))	ブルームバーグ商品指数	ブルームバーグ商品指数により表される世界の商品市況の動きに連動することをめざすETFです。	3月
SPDR GOLD SHARES	金地金価格 (LBMA金価格)	金現物取引価格として、金価格の世界標準となっている金地金価格に連動することをめざすETFです。	9月

(注) 各社資料 (アニュアルレポート、有価証券報告書等) を基に三菱UFJ投信が作成。

E T F の対象指数について

●中国株式①: FTSE 中国 50 インデックス

FTSE 中国 50 インデックスは、中国の株式市場に上場し、かつ海外投資家が投資可能な大手企業のパフォーマンスを表すように構成されたものです。FTSE 中国 50 インデックスは、中国の大手企業のうち、最も流動性の高い企業50社の株式で構成されています。FTSE 中国 50 インデックスの構成銘柄はその時価総額をベースにウエイト付けされており、時価総額の大きい銘柄はFTSE 中国 50 インデックスへの組み入れ比率も大きくなります。FTSE 中国 50 インデックスの各構成銘柄はその時におけるFTSE オール・ワールド・インデックス構成銘柄です。FTSE 中国 50 インデックスの構成銘柄はすべて香港証券取引所に上場しています。FTSE 中国 50 インデックス (円換算ベース) は、FTSE 中国 50 インデックスをもとに、委託会社が計算したものです。また、「FTSE®」はロンドン・ストック・エクスチェンジ・ビーエルシー (ロンドン証券取引所) とザ・フィナンシャル・タイムズ・リミテッド (FTT) とが共同で所有する商標であり、FTSEインターナショナル・リミテッド (FTSEI) が許可を受けて使用しています。FTSE 中国 50 インデックスは、FTSEが算出しています。FTSEは当ファンドに関して出資、保証、発行、販売および販売の促進をするものではなく、一切の関わりを有しません。また、当ファンドの発行、業務およびトレーディングに関して一切責任を負いません。

●中国株式②: CSI 300指数 (円換算ベース)

CSI 300指数は、上海証券取引所 (中国語名称「上海証券交易所」) および深セン証券取引所 (中国語名称「深セン証券交易所」) に上場されている全A株のうち、時価総額および流動性の高い300銘柄で構成されており、中国の株価を代表する指数です。CSI 300指数 (円換算ベース) は、CSI 300指数をもとに、委託会社が計算したものです。CSI 300指数は、中証指数有限公司 (China Securities Index Co., Ltd) によって計算されます。中証指数有限公司、上海証券取引所および深セン証券取引所はCSI 300指数の正確性を確保するために一切の必要な手段を講じます。しかしながら、中証指数有限公司、上海証券取引所および深セン証券取引所は、過失の有無にかかわらず、CSI 300指数のいかなる誤りについて、いかなる者に対しても責任を負わず、中証指数有限公司、上海証券取引所および深セン証券取引所は、CSI 300指数のいかなる誤りについても、いかなる者に対しても通知する義務を負いません。指数にかかわる価値や銘柄リストといった著作権は中証指数有限公司に属します。

●インド株式: MSCI インディア・インデックス

MSCI インディア・インデックスとは、MSCI Inc.が開発したインド株式市場全体を正確に捉えるための株価指数であり、浮動株ベース時価総額の85%をカバーしています。また、MSCI インディア・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。

●ブラジル株式: MSCI ブラジル 25/50 インデックス

MSCI ブラジル 25/50 インデックスとは、MSCI Inc.が開発したブラジルの株式市場のパフォーマンスを幅広く測定するよう構成されています。MSCI ブラジル 25/50 インデックスの各構成銘柄のMSCI ブラジル 25/50 インデックスに占める比率の上限は最大25%、および構成比率が5%以上の銘柄の比率の合計は最大50%になるように、MSCI ブラジル 25/50 インデックスは設定されています。MSCI ブラジル 25/50 インデックスはブラジルにある証券取引所で取引されている銘柄から構成されています。また、MSCI ブラジル 25/50 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。

●コモディティ: ブルームバーグ商品指数

ブルームバーグ商品指数 (Bloomberg Commodity IndexSM) および「ブルームバーグ (Bloomberg: ®)」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー (Bloomberg Finance L.P.) およびその関係会社 (以下「ブルームバーグ」と総称します。) のサービスマークであり、三菱UFJ投信株式会社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数 (Bloomberg Commodity IndexSM) は、ブルームバーグとUBSセキュリティティーズ・エル・エル・シー (UBS Securities LLC) の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBSセキュリティティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社 (以下「UBS」と総称します。) のいずれも、三菱UFJ投信株式会社の関係会社ではなく、ブルームバーグおよびUBSは、当ファンドを承認し、是認し、レビューまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性を保証するものではありません。ブルームバーグ商品指数 (円換算ベース) は、ブルームバーグ商品指数をもとに、委託会社が計算したものです。

●金: 金地金価格 (LBMA金価格)

金地金価格 (LBMA金価格) とは、ロンドン渡し金価格とも呼ばれるロンドンでの、金現物取引価格として、金価格の世界標準になっています。

E T F の損益計算書および組入上位銘柄等

各 E T F の直近の入手しうる有価証券報告書やアニュアルレポート等から抜粋して作成しています。

ISHARES CHINA LARGE-CAP ETF

損益計算書

2014年7月31日終了年度

	米ドル
投資純利益	
受取配当金－関連会社以外 ^a	180,500,828
受取利息－関連会社	467
有価証券貸付収益－関連会社	1,322,964
投資収益合計	181,824,259
費用	
投資顧問報酬	39,300,368
費用合計	39,300,368
投資純利益	142,523,891
実現および未実現純利益（損失）	
実現純利益（損失）：	
投資－関連会社以外	(176,537,964)
現物償還－関連会社以外	60,447,911
先物契約	5,759,243
外国通貨取引	35,523
実現純損失	(110,295,287)
未実現評価損益の純変動：	
投資	869,889,055
先物契約	2,343,439
外貨建て資産および負債の換算	39,318
未実現評価損益の純変動	872,271,812
実現および未実現純利益	761,976,525
運用による純資産の純増加額	904,500,416

^a18,871,782米ドルの外国源泉徴収税控除後の金額です。

組入上位10銘柄

銘柄	2014年7月31日現在	
	総投資比率*	
Tencent Holdings Ltd.	10.27%	
China Construction Bank Corp. Class H	8.51	
China Mobile Ltd.	8.42	
Industrial and Commercial Bank of China Ltd. Class H	6.98	
Bank of China Ltd. Class H	5.51	
China Overseas Land & Investment Ltd.	4.45	
China Life Insurance Co. Ltd. Class H	4.05	
Ping An Insurance (Group) Co. of China Ltd. Class H	4.00	
PetroChina Co. Ltd. Class H	3.98	
China Shenhua Energy Co. Ltd. Class H	3.86	
合計	60.03%	

*マネー・マーケット・ファンドを除く。

上場インデックスファンド中国A株 (パンダ) C S I 300

損益及び剰余金計算書

(単位: 円)

科目	第7期
	自平成26年1月21日 至平成27年1月20日
営業収益	
受取利息	2,959
有価証券売買等損益	2,729,494,208
営業収益合計	2,729,497,167
営業費用	
受託者報酬	2,320,828
委託者報酬	6,962,862
その他費用	4,317,663
営業費用合計	13,601,353
営業利益又は営業損失 (△)	2,715,895,814
経常利益又は経常損失 (△)	2,715,895,814
当期純利益又は当期純損失 (△)	2,715,895,814
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額 (△)	—
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△1,754,215,802
剰余金増加額又は欠損金減少額	—
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	60,400,000
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	60,400,000
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—
分配金	—
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	901,280,012

組入上位10銘柄

〈株式〉

2015年1月30日現在

銘柄名	投資比率 (%)
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	4.33
CHINA MINSHENG BANKING-A	3.10
CHINA MERCHANTS BANK-A	2.81
CITIC SECURITIES CO-A SHARES	2.63
INDUSTRIAL BANK CO LTD-A	1.96
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	1.95
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	1.92
CHINA VANKE CO LTD -A	1.50
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	1.31
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	1.18

(注) 投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(注) 上記は、上場インデックスファンド中国A株 (パンダ) C S I 300が主要投資対象とする中国A株C S I 300インデックスマザーファンドの内容です。

LYXOR UCITS ETF MSCI INDIA

損益計算書

2013年3月1日～2014年2月28日

通貨	ユーロ
金融取引に係る収益	
・ 預け金及び財務勘定に係る収益	—
・ 株式及び類似証券に係る収益	10,094,735.30
・ 債券及び類似証券に係る収益	—
・ 債務証券に係る収益	—
・ 有価証券短期売買に係る収益	—
・ 金融先物商品に係る収益	—
・ その他の金融収益	—
合計（I）	10,094,735.30
金融取引に係る費用	
・ 有価証券短期売買に係る費用	—
・ 金融先物商品に係る費用	—
・ 金融債務に係る費用	—
・ その他の金融費用	—
合計（II）	—
金融取引に係る収益（I - II）	10,094,735.30
その他の収益（III）	—
管理報酬及び減価償却費（IV）	-7,809,726.39
当期純利益（L.214-9）（I - II + III - IV）	2,285,008.91
当期利益の調整（V）	-10,624.71
当期前払金（VI）	—
利益（I - II + III - IV ± V - VI）：	2,274,384.20

組入投資有価証券上位10銘柄

2014年2月28日現在

銘柄	%組入比率
SIEMENS AG-NOM	9.6
BAYER AG	7.5
SANOFI	6.1
DAIMLER	5.9
TELEFONICA SA	5.4
DANONE	5.0
SCHNEIDER ELECTRIC SA	4.6
AIRBUS GROUP	3.7
VINCI SA	2.8
CARREFOUR SA	2.7

(注) ファンドが保有している銘柄は、流動性の高い国際的な企業の銘柄で構成されており、これらに投資するとともに、インデックスを厳密に複製するために、エクイティ・スワップに投資しています。このため、必ずインデックスの構成銘柄が入っているものではありません。

ISHARES MSCI BRAZIL CAPPED ETF

損益計算書

2014年8月31日終了年度

	米ドル
投資純利益	
関連会社以外の発行者からの配当金 ^a	187,425,894
関連会社発行者からの受取利息	537
投資収益合計	187,426,431
費用	
投資顧問報酬	29,033,197
費用合計	29,033,197
投資純利益	158,393,234
実現純利益 (損失) および未実現純利益 (損失)	
実現純利益 (損失) :	
関連会社以外の発行者への投資	(23,777,530)
外国為替取引	(679,380)
実現純利益 (損失)	(24,456,910)
未実現評価益 (評価損) の純変動 :	
投資	1,183,727,046
資産・負債の外国為替換算	1,879,635
未実現評価益 (評価損) の純変動	1,185,606,681
実現および未実現純損失	1,161,149,771
運用による純資産の純増 (減) 額	1,319,543,005

^a15,133,581米ドルの外国源泉徴収税控除後の金額です。

組入上位10銘柄

2014年8月31日現在

銘柄	総投資比率*
Itau Unibanco Holding SA (Preferred)	9.06%
Petroleo Brasileiro SA (Preferred)	7.87
Banco Bradesco SA (Preferred)	6.79
AMBEV SA	6.02
Petroleo Brasileiro SA	5.00
Vale SA Class A (Preferred)	3.70
BRF SA	3.66
Cielo SA	2.78
Vale SA	2.59
Banco do Brasil SA	2.58
合計	50.05%

*マネー・マーケット・ファンドを除く。

ISHARES DIVERSIFIED COMMODITY SWAP UCITS ETF (DE)

損益計算書

2013年4月1日～2014年3月31日

I. Income		
1. Dividends from domestic issuers	EUR	25,260.75
2. Dividends from foreign issuers (before withholding tax)	EUR	204,355.10
3. Interest from domestic liquidity investments	EUR	267.43
Total income	EUR	229,883.28
II. Expenses		
1. Interest from borrowing	EUR	-23,239.86
2. Management fee	EUR	-2,177,066.37
3. Other expenses	EUR	-58,132.98
Total expenses	EUR	-2,258,439.21
III. Ordinary net income	EUR	-2,028,555.93
IV. Disposals		
1. Realised gains	EUR	197,217,132.46
2. Realised losses	EUR	-241,381,525.14
Gain/loss on disposals	EUR	-44,164,392.68
V. Annual realised results	EUR	-46,192,948.61
1. Net change in unrealised gains	EUR	-15,980,881.67
2. Net change in unrealised losses	EUR	178,891.50
VI. Annual unrealised results	EUR	-15,801,990.17
VII. Result for the financial year	EUR	-61,994,938.78

組入投資有価証券上位10銘柄

2014年3月31日現在

銘柄	%組入比率
Siemens AG Namens-Aktien o. N.	9.06
Bayer AG Namens-Aktien o. N.	8.83
BASF SE Namens-Aktien o. N.	8.25
Unilever N. V. Cert. v. Aandelen E0-, 16	6.20
Daimler AG Namens-Aktien o. N.	4.69
Anheuser-Busch InBev N. V. / S. A. Actions au Port o. N.	4.60
Banco Santander S. A. Acciones Nom. E0 0.50	4.55
SAP AG Inhaber-Aktien o. N.	4.43
Telefonica S. A. Acciones Port E0 1	4.31
Deutsche Telekom AG Namens-Akien o. N.	4.26

SPDR GOLD SHARES

損益計算書および組入資産は、SPDR GOLD SHARESが実質的に保有するSPDR GOLD TRUSTの内容を掲載しています。

損益計算書

2014年9月30日に終了した年度

（受益権および受益権1口当たりのデータ以外、千ドル）	2014年9月30日に終了した年度 千ドル
収益	
費用支払のため売却した金による収入	135,509
費用支払のため売却した金の原価	(129,207)
費用支払のため売却した金の利益	6,302
受益権償還のため分配した金の利益	374,322
金投資の未実現利益（損失）	(477,254)
金に関する総利益（損失）	(96,630)
費用	
カストディ報酬	22,724
受託者報酬	2,000
スポンサー報酬	50,158
マーケティング・エージェント報酬	50,158
その他費用	8,716
費用合計	133,756
営業活動による純利益（損失）	(230,386)
受益権1口当たり純利益（損失）（ドル）	(0.85)
加重平均受益権数	270,245

組入資産

2014年9月30日現在

資産の種類	運用比率（％）
金	100%
現金	0%
その他の資産（負債控除後）	0%
合計（純資産総額）	100%