251384

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合／インデックス型	
信託期間	無期限（2012年２月15日設定）	
運用方針	各マザーファンド受益証券および短期金融資産等への投資を通じて、合成ベンチマークに連動する成果をめざして運用を行います。三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド受益証券16%、三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド受益証券20%、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券４%、三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド受益証券42%、三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド受益証券５%、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券４%、東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド受益証券３%、ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド受益証券３%および短期金融資産３%の比率配分として基準ポートフォリオを構築します。基準ポートフォリオは原則として年１回見直し（確認）を行うこととします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。	
主要運用対象	ベビーファンド	三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド受益証券、三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド受益証券、三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド受益証券およびＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。
	三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
	三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。
	新興国株式インデックスマザーファンド	新興国の株式等（ＤＲ（預託証書）を含みます。）を主要投資対象とします。
	三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
	新興国債券インデックスマザーファンド	新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。
	東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
	MUAM G-REIT マザーファンド	Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
	三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）および外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	新興国株式インデックスマザーファンド	株式および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
	三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
	三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	新興国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
	東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	株式および外貨建資産への投資は行いません。 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。
	MUAM G-REIT マザーファンド	株式への直接投資は行いません。 投資信託証券および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書（全体版）

三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）

第５期（決算日：2016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「三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）」は、去る５月20日に第５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」となりました。

MUFG

三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番１号

URL:http://www.am.mufg.jp/

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034

（9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～１月３日を除く）

お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目 次

三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）のご報告

◇設定以来の運用実績 …… 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 …… 22
◇１万口当たりの費用明細 …… 23
◇売買及び取引の状況 …… 24
◇株式売買比率 …… 24
◇利害関係人との取引状況等 …… 24
◇組入資産の明細 …… 28
◇投資信託財産の構成 …… 29
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況 …… 30
◇損益の状況 …… 30
◇お知らせ …… 31

マザーファンドのご報告

◇三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド …… 95
◇三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド …… 128
◇新興国株式インデックスマザーファンド …… 169
◇三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド …… 199
◇三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド …… 221
◇新興国債券インデックスマザーファンド …… 246
◇東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド …… 258
◇ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド …… 269

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。
・－印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			合成ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率						
(設定日)	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
2012年２月15日	10,000	－	－	10,000	－	－	－	－	－	－	1
1期(2012年5月21日)	9,831	0	△ 1.7	9,811	△ 1.9	35.9	1.0	52.7	0.0	6.2	0.983119
2期(2013年5月20日)	13,103	0	33.3	13,069	33.2	40.8	0.6	48.4	0.2	6.4	18
3期(2014年5月20日)	13,436	0	2.5	13,392	2.5	38.7	0.7	50.6	－	6.4	439
4期(2015年5月20日)	15,640	0	16.4	15,579	16.3	39.5	0.7	49.8	－	6.3	1,608
5期(2016年5月20日)	14,761	0	△ 5.6	14,681	△ 5.8	38.0	1.1	50.9	0.1	6.4	6,511

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。
(注) 当ファンドのベンチマークは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）16%、ＭＳＣＩコクサイ インデックス（除く日本、円換算ベース）20%、ＭＳＣＩ エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）４%、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数42%、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）５%、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）４%、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）３%、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）３%および短期金融資産（有担保コール（翌日物））３%で組み合わせた合成指数です。ベンチマークは、設定日の前営業日の値を10,000として委託会社が計算したものです。
(注) 外国の指数は基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
(注) 株式先物比率には不動産投信指数先物を含めて表示しております。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。
(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		合成ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率					
（期首）	円	%		%	%	%	%	%	%
2015年５月20日	15,640	－	15,579	－	39.5	0.7	49.8	－	6.3
５月末	15,761	0.8	15,691	0.7	39.5	0.7	50.0	0.1	6.4
６月末	15,459	△1.2	15,392	△1.2	38.4	0.8	50.7	0.0	6.1
７月末	15,591	△0.3	15,524	△0.3	39.1	0.6	50.4	－	6.4
８月末	14,984	△4.2	14,928	△4.2	37.3	1.2	51.5	－	6.2
９月末	14,551	△7.0	14,478	△7.1	37.4	1.0	51.1	－	6.6
10月末	15,274	△2.3	15,200	△2.4	40.3	0.8	49.2	0.1	6.5
11月末	15,335	△2.0	15,278	△1.9	38.7	0.9	50.5	0.1	6.4
12月末	15,191	△2.9	15,127	△2.9	38.1	1.0	50.8	－	6.4
2016年１月末	14,744	△5.7	14,688	△5.7	37.2	0.9	51.6	－	6.4
２月末	14,423	△7.8	14,373	△7.7	37.5	1.0	51.2	－	6.6
３月末	14,917	△4.6	14,848	△4.7	39.1	1.1	49.9	0.1	6.5
４月末	14,905	△4.7	14,827	△4.8	38.2	1.1	50.9	0.1	6.4
（期末） 2016年５月20日	14,761	△5.6	14,681	△5.8	38.0	1.1	50.9	0.1	6.4

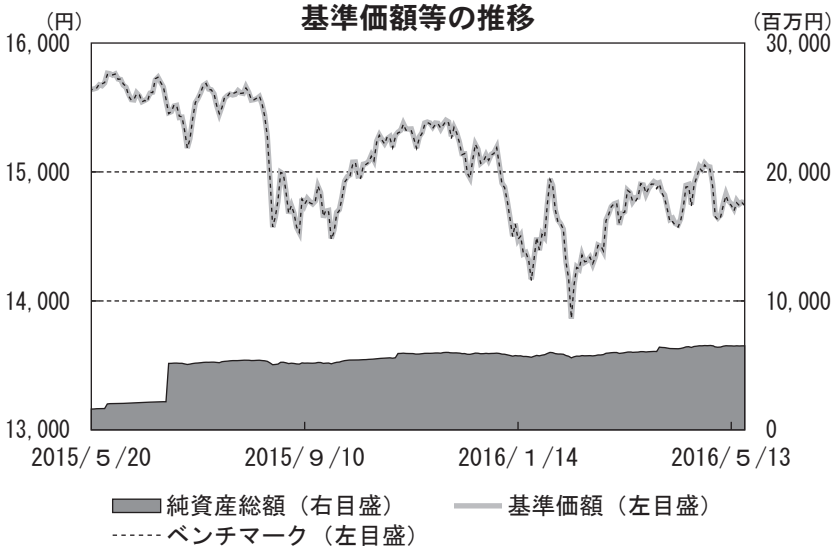
（注）騰落率は期首比。
（注）株式先物比率には不動産投信指数先物を含めて表示しております。
（注）当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
（注）「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第５期：2015/５/21～2016/５/20）

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ5.6%の下落となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－5.8%）を0.2%上回りました。



第５期首　：15,640円
第５期末　：14,761円
（既払分配金　　0円）
騰落率　　：　－5.6%

基準価額の主な変動要因

下落要因	内外株式市況の下落や主要通貨に対する円高の進行などが基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

（第５期：2015/５/21～2016/５/20）

市況の推移
（期首を100として指数化）

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

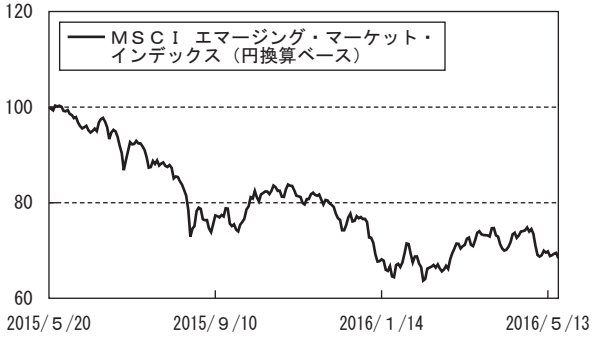
◎国内株式市況
・中国経済減速への不安から世界同時株安となったことや、円高・米ドル安が進行したことなどから、期を通じて国内株式市況は下落しました。

市況の推移
（期首を100として指数化）

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

◎外国株式市況
・米国の利上げを巡る警戒感に加え、原油価格の下落や中国経済の減速懸念などから、外国株式市況は下落しました。

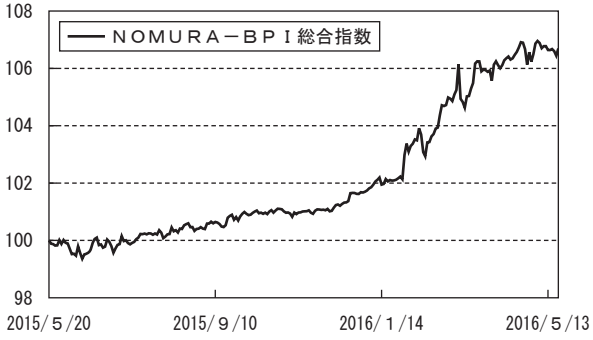
市況の推移
（期首を100として指数化）



・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。

◎新興国株式市況
・米国の利上げを巡る警戒感に加え、原油価格の下落や中国経済の減速懸念などから、新興国株式市況は下落しました。

市況の推移
（期首を100として指数化）



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

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

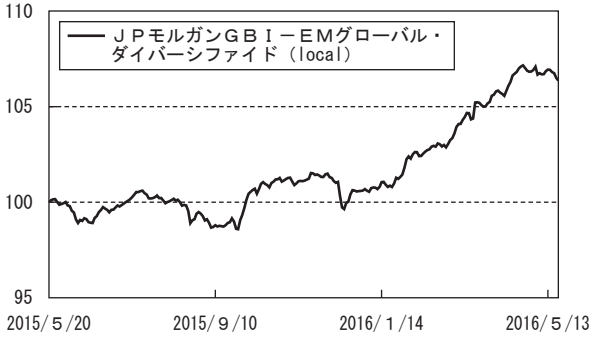
市況の推移
（期首を100として指数化）

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

◎外国債券市況

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

市況の推移
（期首を100として指数化）



・ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイドとは、Ｊ．Ｐ．モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はＪ．Ｐ．モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

◎新興国債券市況

・ＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）が2008年12月から過去最低水準で維持してきた政策金利の引き上げに踏み切ったことや、原油を始めとした資源価格が低迷したことなどを受けて、新興国から資金が流出する動きが強まりましたが、2016年１月以降落ち着きを取り戻し、期首に比べて上昇しました。

市況の推移
（期首を100として指数化）

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

◎国内ＲＥＩＴ市況

・期首から2015年９月上旬にかけては、中国の景気減速懸念を受けた世界的なリスク回避の流れなどから、国内ＲＥＩＴ市況は下落しました。

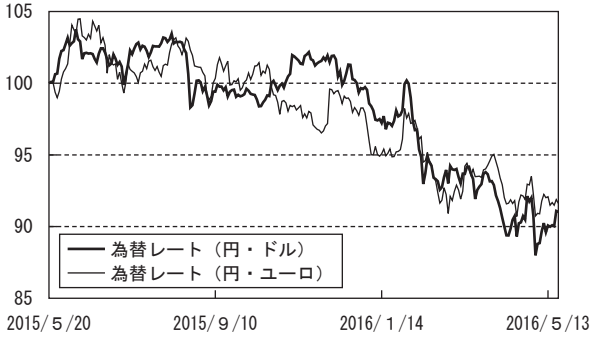
・９月上旬から期末にかけては、日銀によるＲＥＩＴ買入れの個別銘柄ごとの上限引き上げが発表されたことや、日銀によるマイナス金利政策導入を受け、日本の長期金利が一段と低下したことなどから、国内ＲＥＩＴ市況は上昇しました。

市況の推移
（期首を100として指数化）

・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。Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）は、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み）をもとに、委託会社が計算したものです。Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックスはS&P Dow Jones Indices LLC（「ＳＰＤＪＩ」）の商品であり、これを利用するライセンスが三菱ＵＦＪ国際投信株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびＳ＆Ｐ®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「Ｓ＆Ｐ」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがＳＰＤＪＩに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱ＵＦＪ国際投信株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、ＳＰＤＪＩ、Dow Jones、Ｓ＆Ｐまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

◎外国ＲＥＩＴ市況
・米国長期金利が低下基調で推移するなか、米国の堅調な企業決算内容などを受けて、外国ＲＥＩＴ市況（ローカルベース）は上昇しました。

為替市況の推移
（期首を100として指数化）

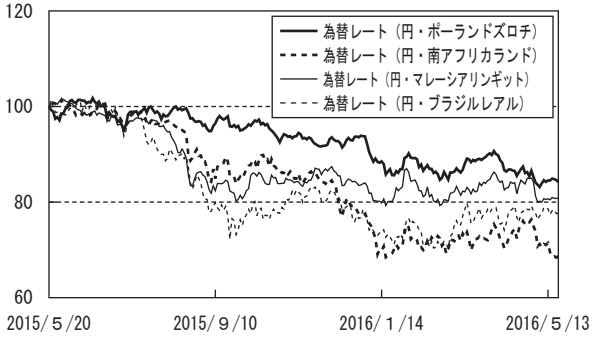


◎為替市況

・円・ドル相場は、ＦＲＢによる政策金利の引き上げが意識されてドルが対円で上昇する局面もありましたが、世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景にドルが対円で売られました。期首との比較では、ドルは対円で9.0％下落しました。

・円・ユーロ相場は、ユーロ圏の景況感の改善などを背景に上昇する局面もありましたが、ＥＣＢ（欧州中央銀行）が緩和的な金融政策を維持したことなどを背景に、ユーロが対円で売られました。期首との比較では、ユーロは対円で8.4％下落しました。

為替市況の推移
（期首を100として指数化）



・ＦＲＢが2008年12月から過去最低水準で維持してきた政策金利の引き上げに踏み切ったことや、原油を始めとした資源価格が低迷したことなどを受けて、新興国から資金が流出する動きが強まったことから、新興国通貨は対円で下落しました。特にロシアルーブルや南アフリカランドなどの通貨が対円で下落しました。

・期首に比べて15.8％の円高・ポーランドズロチ安、31.3％の円高・南アフリカランド安、19.3％の円高・マレーシアリンギット安、22.4％の円高・ブラジルレアル安となりました。

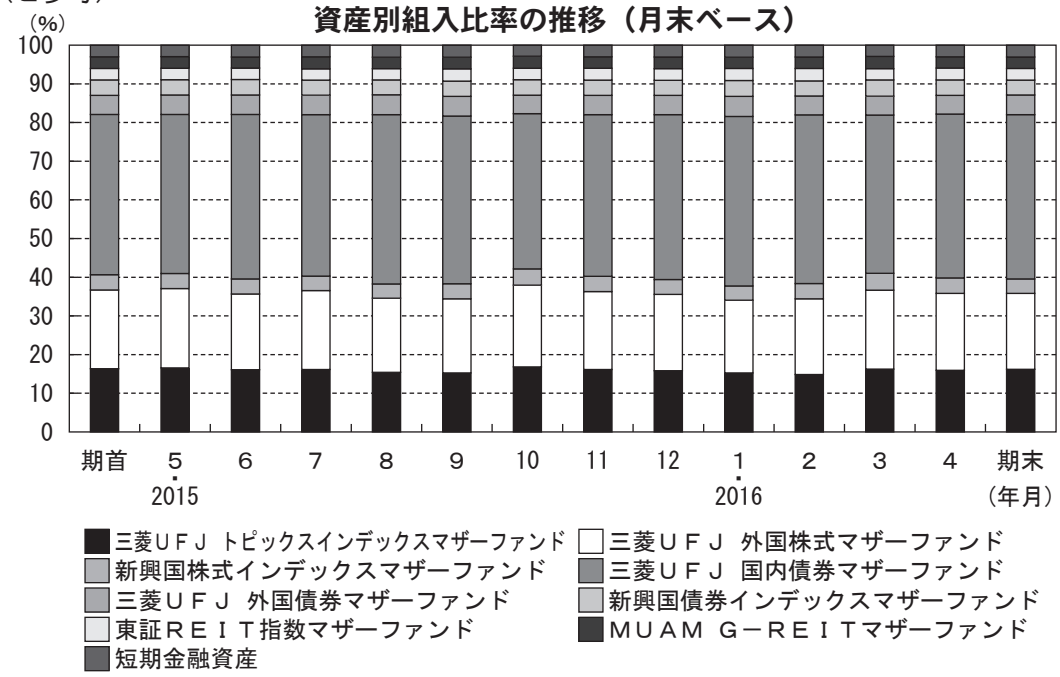
当該投資信託のポートフォリオについて

＜三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）＞

・新興国を含む内外の株式・債券および日本と先進国のリートに投資し、各資産の指数を独自に合成した指数に連動する投資成果をめざして運用を行いました。その結果、当期は、主に内外株式市況の下落や主要通貨に対する円高の進行などから基準価額は下落しました。

・当期の資産配分の推移は以下の通りです。

（ご参考）



＜三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド＞

基準価額は期首に比べ16.5%の下落となりました。

・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

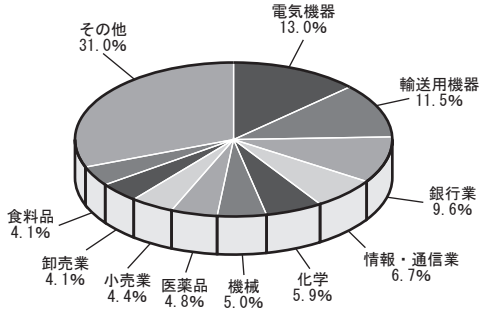
・株式ポートフォリオは、ベンチマークである東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）と業種別比率などがほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いて構築しました。

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

（ご参考）

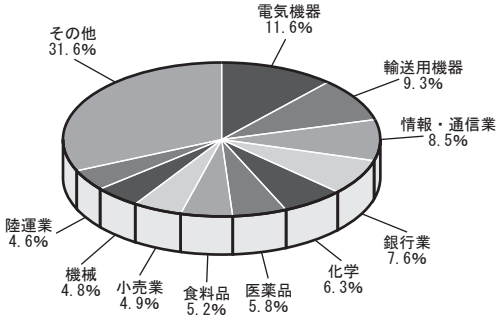
組入上位10業種

期首（2015年５月20日）



（注）比率は現物株式評価額に対する割合です。

期末（2016年５月20日）



（注）比率は現物株式評価額に対する割合です。

＜三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド＞

基準価額は期首に比べ15.6%の下落となりました。

・ベンチマークであるＭＳＣＩコクサイ インデックス（除く日本　円換算ベース）に採用されている株式（先物・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

＜新興国株式インデックスマザーファンド＞

基準価額は期首に比べ29.7%の下落となりました。

・ベンチマークである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（先物・ＲＥＩＴを含む）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

＜三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド＞
基準価額は期首に比べ6.7%の上昇となりました。
・資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
・ベンチマークであるＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数の構成銘柄を種別や年限などの属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました※。
※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

（ご参考）
利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

期首（2015年５月20日）

最終利回り	0.4%
直接利回り	1.2%
デュレーション	8.0年

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

期末（2016年５月20日）

最終利回り	−0.0%
直接利回り	1.1%
デュレーション	8.8年

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

＜三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド＞
基準価額は期首に比べ6.5%の下落となりました。
・日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

（ご参考）
利回り・デュレーション

期首（2015年５月20日）

最終利回り	1.3%
直接利回り	2.7%
デュレーション	6.6年

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

期末（2016年５月20日）

最終利回り	1.1%
直接利回り	2.5%
デュレーション	6.9年

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

＜新興国債券インデックスマザーファンド＞
基準価額は期首に比べ16.0%の下落となりました。
・新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

（ご参考）
利回り・デュレーション

期首（2015年５月20日）

最終利回り	6.4%
直接利回り	6.1%
デュレーション	4.8年

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

期末（2016年５月20日）

最終利回り	6.3%
直接利回り	5.9%
デュレーション	4.8年

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

＜東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド＞
基準価額は期首に比べ5.2%の上昇となりました。
・資産のほぼ全額をＲＥＩＴ（先物を含む）に投資しました。
・ポートフォリオはベンチマークである東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

＜ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド＞
基準価額は期首に比べ6.6%の下落となりました。
・ベンチマークであるＳ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とし、同インデックスに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。
・不動産投資信託証券の組入比率は高位を保ち、国別比率や用途別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

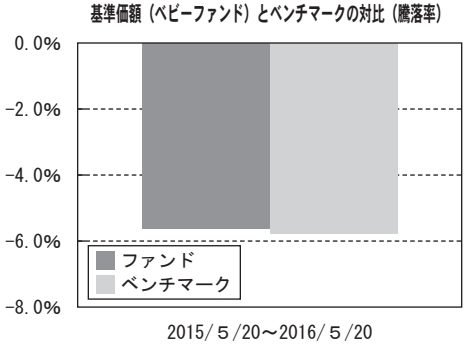
＜三菱ＵＦＪ　プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）＞

基準価額の騰落率は5.6％の下落となり、ベンチマークの5.8％の下落を0.2％上回りました。

差異の内訳は以下の通りです。

（内訳）

三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	0.3％程度
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	0.1％程度
新興国株式インデックスマザーファンド	0.1％程度
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	0.0％程度
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	0.0％程度
新興国債券インデックスマザーファンド	0.0％程度
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	0.0％程度
ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド	0.0％程度
その他（信託報酬等）	△0.3％程度



＜三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド＞

ベンチマークは18.3％の下落となったため、カイ離は1.8％程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合　　計
ベンチマークとのカイ離	0.0％程度	0.0％程度	1.7％程度	1.8％程度

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0％程度でした。

・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

・期中における先物組入比率の平均は、1.3％程度となりました。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0％程度でした。

◎その他の要因
その他の要因による影響は1.7%程度でした。
・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

プラス要因	配当・利子収入等	計　2.1%程度
マイナス要因	売買コスト等	計　△0.4%程度

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

＜三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド＞
ベンチマークは16.0%の下落となったため、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	△0.1%程度	0.5%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△0.1%程度でした。
ファンドとベンチマークの値動きや、推定トラッキングエラー、株式の国別比率、業種別比率などについてモニターし、必要に応じて定量モデルを用いた調整を図ることでベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。その際に、ファンドがベンチマークと連動する可能性をより高めるため、
・売買に係るコストを考慮しつつ、できる限り多くの銘柄に分散投資を行いました。
・ファンドの特性をよりベンチマークに近づけるべく、マルチファクターモデルを用いて組入銘柄とその組入比率を決定しています。

◎その他の要因
その他の要因による影響は0.5%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入・為替効果等	計　0.6%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料等	計　△0.1%程度

為替効果：現地通貨建て株価を円建てに換算する方法が、ファンドとベンチマークで異なるため生じる差異。
ファンド：株価（現地通貨建て前日終値）を翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。
ベンチマーク：株価（現地通貨建て前日終値）を同日ロンドン時間の16時時点の為替レートを用い一旦ドル換算で評価。その後翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。

＜新興国株式インデックスマザーファンド＞
ベンチマークは31.6%の下落となったため、カイ離は1.9%程度となりました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	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	0.3%程度	△0.2%程度	1.9%程度	1.9%程度

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

◎組入比率要因
組入比率による影響は△0.1%程度でした。
・期中、ファンドの資産をほぼ全額株式（先物・ＲＥＩＴを含む）に投資しました。
・効率的に運用を行うため、円貨、外貨現金などを若干保有しました。

◎銘柄選択要因
銘柄選択による影響は0.3%程度でした。
ファンドとベンチマークの値動きや、推定トラッキングエラー、株式の国別比率、業種別比率などについてモニターし、必要に応じて定量モデルを用いた調整を図ることでベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。その際に、ファンドがベンチマークと連動する可能性をより高めるため、
・売買に係るコストを考慮しつつ、できる限り多くの銘柄に分散投資を行いました。
・ファンドの特性をよりベンチマークに近づけるべく、マルチファクターモデルを用いて組入銘柄とその組入比率を決定しています。

◎コスト要因
売買にかかるコストおよび保管料等による影響は△0.2%程度でした。

◎その他の要因
その他配当・利子収入等による影響は1.9%程度でした。

＜三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド＞
ベンチマークは6.7%上昇となったため、カイ離は△0.0%程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

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

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

◎組入比率要因
組入比率による影響は0.0%程度でした。
・公社債の実質の組入比率については、期を通じて概ね100%の水準で推移させ、ベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。そのため、期を通じて現金の保有による影響は軽微でした。
・ポートフォリオについては、主に層化抽出法に基づき運用を行い、ファンドとベンチマークの値動きや推定トラッキングエラーなどについてモニターし必要に応じて調整を図ることでベンチマークとの連動性を維持するよう努めました。結果、種別および年限構成比については、概ねベンチマーク並みとなっており、影響は軽微でした。

◎銘柄選択要因
銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。
・年限構成、種別構成、デュレーション、流動性などを考慮して選択した銘柄に分散投資しました。
・流動性の問題を勘案し、相対的に格付の低い社債への投資は見送りましたが、影響は軽微でした。

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

＜三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド＞
ベンチマークは6.3%の下落となったため、カイ離は△0.2%程度となりました。

	ポートフォリオ要因	管理コスト等要因	評価時価差異に基づく要因	合計
ベンチマークとのカイ離	△0.0%程度	△0.0%程度	△0.1%程度	△0.2%程度

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

◎ポートフォリオ要因
ポートフォリオ要因による影響は△0.0%程度でした。
・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

◎管理コスト等要因
管理コスト等による影響は△0.0%程度でした。
・カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因
評価時価差異による影響は△0.1%程度でした。
・為替の効果および債券の効果による要因です。
為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。
債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

＜新興国債券インデックスマザーファンド＞
ベンチマークは15.6%の下落となったため、カイ離は△0.4%程度となりました。

	ポートフォリオ要因	管理コスト等要因	評価時価差異に基づく要因	合計
ベンチマークとのカイ離	△0.5%程度	△0.2%程度	0.3%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。

◎ポートフォリオ要因
ポートフォリオ要因による影響は△0.5%程度でした。
・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

◎管理コスト等要因
管理コスト等による影響は△0.2%程度でした。
・カストディーフィー、取引コスト、税金等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因
評価時価差異による影響は0.3%程度でした。
・為替の効果および債券の効果による要因です。
為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。
債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

＜東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド＞
ベンチマークは5.1%の上昇となったため、カイ離は0.1%程度となりました。カイ離幅を低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合計
ベンチマークとのカイ離	0.1%程度	0.0%程度	0.0%程度	0.1%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
組入比率や先物使用による影響は0.1%程度でした。
・期を通じて、運用資産のほぼ全額をＲＥＩＴ（先物を含む）に投資しました。
・期中における先物組入比率の平均は、2.4%程度となりました。
（注）先物の使用は、「利便性に優れ、売買コストが低い」利点がある反面、必ずしも指数の値動きと一致しないことから、ベンチマークからのカイ離を生む可能性があります。

◎銘柄選択要因
銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

◎その他の要因
その他の要因による影響は0.0%程度でした。

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

＜ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド＞
ベンチマークは6.2%の下落となったため、カイ離は△0.4%程度となりました。

	売買コスト要因	配当課税要因	為替評価要因	その他の要因	合計
ベンチマークとのカイ離	△0.1%程度	△0.5%程度	0.1%程度	0.1%程度	△0.4%程度

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

◎売買コスト要因
売買コストによる影響は△0.1%程度でした。

◎配当課税要因
配当課税による影響は△0.5%程度でした。
・ベンチマークでは配当金に課される税金が考慮されていないため、ファンドではマイナス要因となりました。

◎為替評価要因
為替評価による影響は0.1%程度でした。
・為替評価要因は、ベンチマークの計算に使用する為替レートとファンドの基準価額の計算に使用する為替レートの差によって生じます。

◎その他の要因
その他の要因による影響は0.1%程度でした。
・その他の要因としては、ベンチマークとファンド間でのＲＥＩＴの保有比率の差や、円貨、外貨現金の保有による影響などが含まれます。

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した。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

【分配原資の内訳】　（単位：円、１万口当たり、税込み）

項目	第５期 2015年５月21日～2016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	4,760

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

＜三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）＞
・資産配分方針は、従前通り基準ポートフォリオを維持します。また各資産の組入比率は、期を通じて同比率に準ずるよう調整を行います。

＜三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド＞
・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

＜三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド＞
・ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を株式（先物・ＲＥＩＴを含む）に投資し、高い株式組入比率を維持します。
・売買に係るコストを考慮しつつ、多くの銘柄に分散投資を行います。

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

＜三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド＞
・ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を公社債（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持します。
・組入銘柄の見直しと投資比率の調整を適宜行い、種別構成比についてもベンチマークの比率に近づけるように運用します。

＜三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド＞
・今後の運用についても、運用方針を堅持します。
・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

＜新興国債券インデックスマザーファンド＞
・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。
・新興国の現地通貨建て国際機関債、および新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価額などが連動する債券に投資することがあります。

＜東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド＞
・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

＜ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド＞
・Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とし、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

（2015年５月21日～2016年５月20日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	52	0.346	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×（期中の日数÷年間日数）
（投信会社）	(27)	(0.178)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（販売会社）	(19)	(0.124)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(7)	(0.043)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	1	0.004	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(0)	(0.002)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	0	0.003	(c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(0)	(0.002)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
(d) その他費用	5	0.035	(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)	(0.030)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（監査費用）	(1)	(0.004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（その他）	(0)	(0.002)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	58	0.388	
期中の平均基準価額は、15,094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）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2015年５月21日～2016年５月20日）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	943,334	1,117,652	155,891	179,717
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	1,890,653	2,518,950	429,872	579,794
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	115,971	315,324	17,000	46,448
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	683,208	1,320,753	99,533	186,715
ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド	133,020	200,838	31,285	47,135
新興国株式インデックスマザーファンド	146,035	304,908	28,649	53,743
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	70,933	179,734	18,111	46,222
新興国債券インデックスマザーファンド	192,779	254,354	25,022	30,791

○株式売買比率

（2015年５月21日～2016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-REIT 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	91,682,036千円	48,776,644千円	67,250千円	9,114,842千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	231,862,274千円	129,910,903千円	－千円	34,146,810千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.39	0.37	－	0.26

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2015年５月21日～2016年５月20日）

利害関係人との取引状況

＜三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）＞

該当事項はございません。

＜三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	38,315	7,120	18.6	53,366	8,302	15.6

平均保有割合　0.4%

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

＜三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド＞

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	17,338	13,044	75.2	41,757	33,499	80.2

平均保有割合　0.8%

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

＜新興国株式インデックスマザーファンド＞

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	11,642	204	1.8	4,655	51	1.1

平均保有割合　0.6%

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

＜三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド＞

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	56,318	18,303	32.5	104,383	35,239	33.8

平均保有割合　1.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。
（注）公社債には現先などによるものを含みません。

＜三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド＞

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	5,876	3,836	65.3	54,626	41,821	76.6

平均保有割合　0.3%

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

＜新興国債券インデックスマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	6,142	495	8.1	3,353	259	7.7

平均保有割合　2.1%

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

＜東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	4,853	1,522	31.4	1,693	146	8.6
株式先物取引	5,772	1,098	19.0	5,635	578	10.3

平均保有割合　1.0%

※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。

＜ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	5,557	88	1.6	857	38	4.4

平均保有割合　1.0%

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

利害関係人の発行する有価証券等

＜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
	百万円	百万円	百万円
株式	845	1,397	4,658

＜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
	百万円	百万円	百万円
公社債	－	305	331

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
	百万円
株式	176

＜三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド＞

種　　類	買　　付　　額
	百万円
公社債	600

＜東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド＞

種　　類	買　　付　　額
	百万円
投資信託証券	377

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）	225千円
うち利害関係人への支払額（B）	1千円
（B）／（A）	0.6%

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

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

○組入資産の明細

（2016年５月20日現在）

親投資信託残高

銘　　柄	期首(前期末)	当　期　末	
	口　数	口　数	評　価　額
	千口	千口	千円
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	207,253	994,695	1,054,477
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	505,284	1,966,065	2,767,237
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	29,025	127,996	329,156
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	161,070	744,745	1,276,866
ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド	31,061	132,796	194,320
新興国株式インデックスマザーファンド	26,238	143,625	245,139
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	18,318	71,140	194,113
新興国債券インデックスマザーファンド	45,490	213,247	253,274

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

○投資信託財産の構成

（2016年５月20日現在）

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	1,054,477	16.2
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	2,767,237	42.4
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	329,156	5.0
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	1,276,866	19.6
ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド	194,320	3.0
新興国株式インデックスマザーファンド	245,139	3.8
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	194,113	3.0
新興国債券インデックスマザーファンド	253,274	3.9
コール・ローン等、その他	211,164	3.1
投資信託財産総額	6,525,746	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（73,799,116千円）の投資信託財産総額（73,862,308千円）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（114,260,390千円）の投資信託財産総額（114,397,698千円）に対する比率は99.9%です。

（注）ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（17,865,310千円）の投資信託財産総額（18,185,533千円）に対する比率は98.2%です。

（注）新興国株式インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（34,780,646千円）の投資信託財産総額（35,106,295千円）に対する比率は99.1%です。

（注）新興国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（10,796,965千円）の投資信託財産総額（10,997,953千円）に対する比率は98.2%です。

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

１アメリカドル＝110.09円	１カナダドル＝84.13円	１メキシコペソ＝5.98円	１ブラジルレアル＝30.88円
100チリペソ＝15.82円	100コロンビアペソ＝3.60円	１ペルーヌエボソル＝32.94円	１ユーロ＝123.28円
１イギリスポンド＝160.73円	１スイスフラン＝111.03円	１スウェーデンクローネ＝13.18円	１ノルウェークローネ＝13.17円
１デンマーククローネ＝16.58円	１トルコリラ＝36.84円	１チェココルナ＝4.56円	100ハンガリーフォリント＝38.97円
１ポーランドズロチ＝27.95円	１ロシアルーブル＝1.66円	１ルーマニアレイ＝27.37円	１オーストラリアドル＝79.63円
１ニュージーランドドル＝74.43円	１香港ドル＝14.17円	１シンガポールドル＝79.85円	１マレーシアリンギット＝27.03円
１タイバーツ＝3.09円	１フィリピンペソ＝2.35円	100インドネシアルピア＝0.82円	100韓国ウォン＝9.29円
１ニュー台湾ドル＝3.36円	１インドルピー＝1.64円	１アラブディルハム＝30.03円	１イスラエルシェケル＝28.47円
１カタールリアル＝30.29円	１南アフリカランド＝6.97円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年５月20日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,525,746,842
コール・ローン等	211,066,223
三菱UFJトピックスインデックスマザーファンド(評価額)	1,054,477,192
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド(評価額)	2,767,237,172
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド(評価額)	329,156,673
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド(評価額)	1,276,866,062
MUAM G-REITマザーファンド(評価額)	194,320,969
新興国株式インデックスマザーファンド(評価額)	245,139,837
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド(評価額)	194,113,488
新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)	253,274,467
未収入金	94,759
(B) 負債	14,021,489
未払解約金	3,532,559
未払信託報酬	10,371,732
未払利息	343
その他未払費用	116,855
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	6,511,725,353
元本	4,411,572,812
次期繰越損益金	2,100,152,541
(D) 受益権総口数	4,411,572,812口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	14,761円

＜注記事項＞

①期首元本額　1,028,741,893円
　期中追加設定元本額　3,918,951,426円
　期中一部解約元本額　536,120,507円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.4761円です。

○損益の状況 (2015年５月21日～2016年５月20日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	57,320
受取利息	70,807
支払利息	△ 13,487
(B) 有価証券売買損益	△ 262,500,756
売買益	202,923,405
売買損	△ 465,424,161
(C) 信託報酬等	△ 18,586,458
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	△ 281,029,894
(E) 前期繰越損益金	118,040,871
(F) 追加信託差損益金	2,263,141,564
(配当等相当額)	(1,310,917,503)
(売買損益相当額)	(952,224,061)
(G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	2,100,152,541
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ)	2,100,152,541
追加信託差損益金	2,263,141,564
(配当等相当額)	(1,319,103,065)
(売買損益相当額)	(944,038,499)
分配準備積立金	212,254,129
繰越損益金	△ 375,243,152

(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。

②分配金の計算過程

項　　目	2015年５月21日～2016年５月20日
費用控除後の配当等収益額	94,213,258円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	1,887,898,412円
分配準備積立金額	118,040,871円
当ファンドの分配対象収益額	2,100,152,541円
１万口当たり収益分配対象額	4,760円
１万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

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

［お知らせ］

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

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2016年５月20日現在）

＜三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド＞

下記は、三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド全体(198,095,381千口)の内容です。

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	53	49	13,034
日本水産	151.5	132.7	78,956
マルハニチロ	25.7	23.5	58,585
サカタのタネ	19.7	17.1	48,222
ホクト	13.5	11.8	23,092
ホクリヨウ	－	1.2	1,194
鉱業（0.3%）			
住石ホールディングス	38.6	35.3	3,212
日鉄鉱業	34	32	12,288
三井松島産業	81	77	8,085
国際石油開発帝石	647.2	606.7	519,881
日本海洋掘削	3.7	3.5	8,431
石油資源開発	17.5	18.4	43,810
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	8.1	7.8	10,296
建設業（3.3%）			
ショーボンドホールディングス	11.9	12.1	58,564
ミライト・ホールディングス	37.6	35.4	38,055
タマホーム	9.1	9.6	4,329
サンヨーホームズ	1.9	3.3	1,494
ダイセキ環境ソリューション	1.5	2.7	3,183
安藤・間	82.1	77.3	47,230
東急建設	43.9	37.8	35,834
コムシスホールディングス	54.7	49.5	92,515
ミサワホーム	14.7	13.9	10,925
ビーアールホールディングス	－	3.2	1,366
高松コンストラクショングループ	9.3	8.6	22,403
東建コーポレーション	4.6	4.8	42,624
ソネック	－	0.9	513
ヤマウラ	6.1	5.5	2,838
大成建設	638	598	478,400
大林組	368	345.4	392,374

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
清水建設	376	352	345,312
飛島建設	84.2	94.9	17,461
長谷工コーポレーション	153.6	134.4	159,667
松井建設	14	12.8	11,955
錢高組	18	17	6,800
鹿島建設	540	540	395,820
不動テトラ	94.4	83.6	12,205
鉄建建設	75	71	20,803
日鉄住金テックスエンジ	23	－	－
西松建設	133	133	61,712
三井住友建設	498.4	446.7	43,329
大豊建設	34	45	20,295
前田建設工業	82	71	57,865
佐田建設	44	8.4	3,242
ナカノフドー建設	9.8	9	4,392
奥村組	117	109	66,708
大和小田急建設	6.9	－	－
東鉄工業	14.7	13.9	39,698
イチケン	14	13	3,562
淺沼組	41	38	9,196
戸田建設	154	134	66,732
熊谷組	155	170	48,790
青木あすなろ建設	8.2	7.7	5,459
北野建設	26	24	6,288
植木組	16	15	3,240
三井ホーム	15	15	7,305
矢作建設工業	15.2	15.8	13,935
ピーエス三菱	13.8	14.3	5,434
日本ハウスホールディングス	21	23.9	8,651
大東建託	45.9	42.4	695,572
新日本建設	15	13.9	8,423
ＮＩＰＰＯ	28	27	52,596

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東亜道路工業	23	22	7,062
前田道路	38	36	70,488
日本道路	37	34	15,742
東亜建設工業	93	102	15,708
若築建設	73	69	11,040
東洋建設	37.3	36.7	18,203
五洋建設	136.3	127.8	69,778
大林道路	15	13.6	10,363
世紀東急工業	18.5	18.6	9,895
福田組	18	19	22,192
住友林業	90.6	79.3	119,663
日本基礎技術	15.1	13.1	4,768
日成ビルド工業	34	32	16,064
ヤマダ・エスバイエルホーム	59	62	5,332
巴コーポレーション	16.1	15	5,205
パナホーム	46	43	37,496
大和ハウス工業	359.7	340.2	1,101,907
ライト工業	19.9	22.3	25,734
積水ハウス	382.1	385.1	761,150
日特建設	16.8	12.9	5,456
北陸電気工事	6	5.6	4,552
ユアテック	19	18	14,670
西部電気工業	11	9	3,915
四電工	10	9	3,690
中電工	17.7	16.5	36,597
関電工	56	46	40,158
きんでん	82	69.6	89,505
東京エネシス	14	13	14,482
トーエネック	17	16	8,992
住友電設	9.7	9.2	12,824
日本電設工業	20	18.8	36,584
協和エクシオ	52.1	45.1	61,651
新日本空調	10.1	9.8	10,280
ＮＤＳ	19	18	4,968
九電工	23	21	67,935
三機工業	25	25.8	22,549
日揮	123	116	200,912
中外炉工業	38	36	8,208
ヤマト	11	10.6	5,300

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
太平電業	17	17	19,108
高砂熱学工業	33.7	34.3	47,814
三晃金属工業	13	12	3,372
朝日工業社	14	13	6,513
明星工業	20.5	21.2	9,964
大氣社	17.5	14.1	36,053
ダイダン	16	15	11,850
日比谷総合設備	15.8	14	22,722
東芝プラントシステム	19.9	18.5	29,803
東洋エンジニアリング	60	62	21,080
千代田化工建設	89	83	66,649
新興プランテック	25.1	23.4	20,966
食料品（5.1%）			
日本製粉	75	74	61,716
日清製粉グループ本社	134.7	126.3	236,054
日東富士製粉	10	9	3,006
昭和産業	50	47	22,936
鳥越製粉	9.4	9.3	5,914
中部飼料	11.6	10.8	8,802
フィード・ワン	75.5	70	8,610
東洋精糖	25	22	2,442
日本甜菜製糖	62	59	10,915
三井製糖	48	45	23,265
塩水港精糖	14.8	13.9	3,308
日新製糖	－	4.9	6,938
森永製菓	111	104	58,136
中村屋	28	27	12,393
江崎グリコ	28.4	26.6	156,408
名糖産業	5.5	5.2	6,905
不二家	70	66	12,936
山崎製パン	90	84	218,988
第一屋製パン	20	21	2,394
モロゾフ	19	18	7,686
亀田製菓	6.8	6.4	29,376
寿スピリッツ	2.9	8.3	22,376
カルビー	45.5	42.7	174,856
森永乳業	111	103	68,392
六甲バター	5.5	5.2	10,238
ヤクルト本社	65.9	61.8	334,338

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
明治ホールディングス	36.4	68.2	674,498
雪印メグミルク	28.7	27.1	86,313
プリマハム	69	73	21,535
日本ハム	90	85	216,750
伊藤ハム	67	－	－
丸大食品	63	60	28,440
米久	4	－	－
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	7.7	7.2	20,808
伊藤ハム米久ホールディングス	－	69	64,722
サッポロホールディングス	201	176	103,840
アサヒグループホールディングス	247	216.1	780,121
キリンホールディングス	497.9	466.8	850,042
宝ホールディングス	96.3	83.4	82,649
オエノンホールディングス	31	33	6,897
養命酒製造	7	3.5	6,471
コカ・コーラウエスト	41.6	39	122,655
コカ・コーライーストジャパン	37.3	40.8	87,475
サントリー食品インターナショナル	73.6	78.9	407,124
ダイドードリンコ	6.2	5.8	33,060
伊藤園	36.5	34.2	126,027
キーコーヒー	10.9	10.2	18,441
ユニカフェ	3.7	3.4	3,015
ジャパンフーズ	2.2	1.9	2,356
日清オイリオグループ	59	61	29,463
不二製油グループ本社	32.8	30.7	60,417
かどや製油	1.1	1.1	3,054
Ｊ－オイルミルズ	52	48	17,088
キッコーマン	100	87	330,600
味の素	283	242.2	605,621
キユーピー	62.5	58.6	172,225
ハウス食品グループ本社	45.5	39.4	86,758
カゴメ	47.5	41.3	110,766
焼津水産化学工業	6.3	5.4	5,410
アリアケジャパン	11.2	9.4	63,732
ピエトロ	－	1.2	2,312
エバラ食品工業	2.1	2.7	5,213
ニチレイ	131	123	117,957
東洋水産	64.2	56.6	241,682
イートアンド	1.3	1.3	2,837

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日清食品ホールディングス	52	48.7	270,772
永谷園ホールディングス	11	11	13,167
一正蒲鉾	4.4	4.1	4,259
フジッコ	12	11.2	26,700
ロック・フィールド	6.5	12.1	20,715
日本たばこ産業	680.9	680.9	2,993,917
ケンコーマヨネーズ	4.1	3.8	9,591
わらべや日洋	7.3	6.3	13,469
なとり	5.7	5.8	9,657
北の達人コーポレーション	－	2.2	1,042
ユーグレナ	41.1	36.9	58,486
ミヨシ油脂	45	41	5,207
理研ビタミン	3.6	3.3	14,652
繊維製品（0.7%）			
片倉工業	14.6	13.8	17,636
グンゼ	93	88	28,864
東洋紡	455	426	87,756
ユニチカ	349	325	20,475
富士紡ホールディングス	58	53	13,462
日清紡ホールディングス	73	－	－
倉敷紡績	120	112	22,064
シキボウ	78	73	8,249
日本毛織	36	32.9	24,773
トーア紡コーポレーション	72	6.1	2,885
ダイドーリミテッド	14.1	13.4	6,164
帝国繊維	12	11.3	15,469
帝人	469	440	170,280
東レ	889	781	731,172
サカイオーベックス	34	30	5,070
住江織物	29	27	7,101
日本フエルト	6	5.4	2,575
イチカワ	8	7	1,911
日本バイリーン	15	－	－
芦森工業	27	25	4,100
アツギ	105	88	9,768
ダイニック	23	22	3,542
セーレン	28.5	27	32,238
東海染工	－	18	2,340
小松精練	20.1	17	10,200

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ワコールホールディングス	68	64	76,224
ホギメディカル	7.2	6.7	43,081
クラウディア	3.4	3	1,503
ＴＳＩホールディングス	51.7	48.5	32,495
三陽商会	63	62	15,252
オンワードホールディングス	82	70	53,760
ルック	22	20	3,020
キムラタン	587	537	3,759
ゴールドウイン	26	4.6	21,988
デサント	26.3	24.7	35,172
キング	8	6	2,172
ヤマトインターナショナル	8.9	7.8	3,034
パルプ・紙（0.3%）			
特種東海製紙	66	63	21,735
王子ホールディングス	471	442	186,966
日本製紙	55.4	55.7	108,559
三菱製紙	176	167	13,360
北越紀州製紙	71.2	66.7	47,557
中越パルプ工業	45	44	9,460
巴川製紙所	20	18	3,420
大王製紙	51	47.9	54,366
レンゴー	101	95	59,945
トーモク	36	34	10,166
ザ・パック	8.1	7.6	19,972
化学（6.3%）			
クラレ	195.5	169.9	244,656
旭化成	716	672	483,436
共和レザー	7.5	6.9	6,203
コープケミカル	21	－	－
昭和電工	765	717	81,021
住友化学	845	793	389,363
日本化成	22	21	2,331
住友精化	24	22	12,012
日産化学工業	75.3	64.7	207,040
ラサ工業	45	43	4,558
クレハ	80	81	32,967
多木化学	7	7	4,515
テイカ	19	18	9,306
石原産業	196	195	14,625

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
片倉コープアグリ	8	13	2,704
日東エフシー	－	6.2	5,394
日本曹達	73	70	35,350
東ソー	287	291	161,796
トクヤマ	180	181	51,223
セントラル硝子	117	117	64,233
東亜合成	144	67.4	68,748
大阪ソーダ	45	45	17,730
関東電化工業	28	26	25,142
デンカ	238	223	108,601
信越化学工業	205.9	193.1	1,224,254
日本カーバイド工業	40	38	6,118
堺化学工業	46	44	13,640
エア・ウォーター	101	89	153,169
大陽日酸	147.4	82.9	87,127
日本化学工業	44	41	8,323
日本パーカライジング	54.2	55	56,925
高圧ガス工業	16	16	10,336
チタン工業	14	14	2,576
四国化成工業	17	16	13,632
戸田工業	24	23	7,291
ステラ　ケミファ	6	5.6	16,794
保土谷化学工業	35	34	8,874
日本触媒	90	15.6	97,968
大日精化工業	47	41	18,901
カネカ	155	145	128,905
三菱瓦斯化学	198	185	116,365
三井化学	522	457	173,660
ＪＳＲ	113.4	101	162,004
東京応化工業	23.8	21.6	57,780
大阪有機化学工業	8.2	7.6	4,742
三菱ケミカルホールディングス	717.9	721.1	406,267
日本合成化学工業	27	25	17,100
ダイセル	161.5	151.4	202,119
住友ベークライト	107	100	52,200
積水化学工業	266	244.4	353,646
日本ゼオン	99	91	74,529
アイカ工業	34.5	32.4	80,481
宇部興産	578	576	115,776

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
積水樹脂	17.7	16.7	26,285
タキロン	24	25	13,425
旭有機材	40	34	7,072
日立化成	56.7	53.2	107,517
ニチバン	12	11	7,887
リケンテクノス	18.4	23	9,959
大倉工業	27	26	7,618
積水化成品工業	33	27	9,774
群栄化学工業	30	29	8,265
タイガースポリマー	5.8	5	2,810
ミライアル	4.3	4.2	3,267
ダイキアクシス	1.8	2.1	1,829
ダイキョーニシカワ	3.7	14	19,656
日本化薬	75	70	74,970
カーリットホールディングス	9.2	10.3	4,830
日本精化	9.6	9	6,525
扶桑化学工業	－	6.8	11,002
ＡＤＥＫＡ	52.9	52.9	80,143
日油	94	81	76,059
新日本理化	19.1	18.6	3,329
ハリマ化成グループ	9.3	9.2	4,857
花王	308.8	289.6	1,747,736
第一工業製薬	26	24	8,376
ニイタカ	－	1.6	2,225
三洋化成工業	36	34	29,036
大日本塗料	65	62	12,462
日本ペイントホールディングス	99.4	83.1	250,962
関西ペイント	139	121.8	256,876
神東塗料	9	9	1,593
中国塗料	33	31	23,684
日本特殊塗料	8.9	7.5	7,500
藤倉化成	15.3	14.5	7,482
太陽ホールディングス	9.3	7.9	27,729
ＤＩＣ	460	425	108,375
サカタインクス	23.5	22.1	28,464
東洋インキＳＣホールディングス	114	105	48,300
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	3.8	7.7	6,837
富士フイルムホールディングス	262.8	246.4	1,119,888
資生堂	204.3	204.3	568,771

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ライオン	132	124	210,552
高砂香料工業	37	7.1	18,062
マンダム	11.5	10.1	51,005
ミルボン	6.8	6.4	31,360
ファンケル	26.9	25.2	38,379
コーセー	18.6	17.4	162,864
コタ	4	3.8	4,130
シーズ・ホールディングス	7.8	13.7	31,647
シーボン	1.4	1.3	2,986
ポーラ・オルビスホールディングス	13.7	11	102,080
ノエビアホールディングス	7.2	6.8	21,454
アジュバンコスメジャパン	2.4	2.2	2,074
エステー	7.7	7.4	8,421
アグロ　カネショウ	3.2	4.2	4,414
コニシ	9	16.9	23,981
長谷川香料	14.4	13.7	26,030
星光ＰＭＣ	6.6	6.1	7,228
小林製薬	18.8	16.3	145,396
荒川化学工業	9.7	9.2	8,859
メック	9.2	8.5	7,301
日本高純度化学	3.2	3	6,339
タカラバイオ	－	22.5	31,860
ＪＣＵ	3.1	3.2	10,880
新田ゼラチン	7	7.1	5,332
ＯＡＴアグリオ	－	1.3	2,072
デクセリアルズ	－	32.2	28,400
アース製薬	8.2	7.8	38,376
イハラケミカル工業	17.7	16.7	21,659
北興化学工業	12	12	3,852
大成ラミック	3.2	3	8,376
クミアイ化学工業	23.7	22.4	20,227
日本農薬	26.3	25	12,650
アキレス	100	86	11,610
有沢製作所	19.4	16.1	8,694
日東電工	88.7	83.2	561,766
レック	4	3.4	4,637
きもと	21.2	19.7	3,250
藤森工業	9.8	9.3	22,292
前澤化成工業	8	7.6	7,508

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＪＳＰ	8.6	7	15,302
エフピコ	10.2	9.5	45,552
天馬	8.8	8.2	14,079
信越ポリマー	22.7	21.1	13,989
東リ	30	28	9,156
ニフコ	25.6	20.6	113,712
日本バルカー工業	46	40	11,320
ユニ・チャーム	232.5	218	475,458
医薬品（5.8%）			
協和発酵キリン	137	128.8	266,616
武田薬品工業	430.3	428.8	2,011,072
アステラス製薬	1,307.9	1,205.5	1,793,181
大日本住友製薬	81.3	76.2	116,814
塩野義製薬	179.3	156.9	957,090
田辺三菱製薬	133.8	125.4	229,607
わかもと製薬	14	13	3,302
あすか製薬	13.5	13.8	24,232
日本新薬	26	24.7	130,169
ビオフェルミン製薬	1.8	1.7	5,072
中外製薬	114.3	107.2	413,256
科研製薬	40	18.6	108,996
エーザイ	151.4	132.5	901,265
ロート製薬	52.2	52.7	89,958
小野薬品工業	52.2	244.5	1,269,688
久光製薬	32.4	33.4	189,044
有機合成薬品工業	8	8	1,928
持田製薬	7.9	7.4	58,016
参天製薬	211	198.3	313,908
扶桑薬品工業	38	36	10,656
日本ケミファ	14	15	7,305
ツムラ	36.1	33.9	87,970
日医工	26.8	25.2	59,724
キッセイ薬品工業	21.3	19.1	47,730
生化学工業	22	20.8	31,220
栄研化学	9.7	9.1	19,328
日水製薬	4.6	4.2	4,855
鳥居薬品	7.9	7.4	19,225
ＪＣＲファーマ	8.9	8.4	23,452
東和薬品	5.9	5	26,500

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
富士製薬工業	3.1	3.4	6,939
沢井製薬	18.2	18.3	141,093
ゼリア新薬工業	23.4	22.2	32,034
第一三共	386.2	362.1	944,899
キョーリン製薬ホールディングス	30.6	28.7	60,040
大幸薬品	5.2	5.4	7,975
ダイト	5.2	6	16,878
大塚ホールディングス	227.9	231.5	1,055,408
大正製薬ホールディングス	27.6	25.9	253,561
ペプチドリーム	－	17.9	104,178
石油・石炭製品（0.5%）			
日本コークス工業	105.6	89.6	6,272
昭和シェル石油	102.6	108.3	121,945
コスモ石油	317	－	－
ニチレキ	14	13.2	9,741
東燃ゼネラル石油	173	162	166,374
ユシロ化学工業	6.2	5.7	7,170
ビーピー・カストロール	4.7	4.2	5,392
富士石油	26.8	25.6	9,113
ＭＯＲＥＳＣＯ	3	3.4	3,937
出光興産	54.5	56.2	128,529
ＪＸホールディングス	1,274.4	1,274.4	538,179
コスモエネルギーホールディングス	－	32.7	46,630
ゴム製品（0.9%）			
横浜ゴム	127	64.9	102,477
東洋ゴム工業	52	48.7	61,264
ブリヂストン	359.9	363.3	1,326,045
住友ゴム工業	89.6	100.7	156,991
藤倉ゴム工業	9.9	9.2	3,965
オカモト	39	34	34,238
フコク	4.7	3.4	2,825
ニッタ	11.3	11.3	30,171
住友理工	21.1	23	20,976
三ツ星ベルト	28	26	22,620
バンドー化学	42	39	19,227
ガラス・土石製品（0.9%）			
日東紡績	84	72	23,904
旭硝子	566	568	378,856
日本板硝子	554	527	46,376

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
石塚硝子	16	16	2,800
日本山村硝子	46	43	6,966
日本電気硝子	220	222	116,550
オハラ	4	4.3	2,214
住友大阪セメント	213	213	91,803
太平洋セメント	716	672	186,144
デイ・シイ	11.9	10.5	4,000
日本ヒューム	12.1	10.6	6,360
日本コンクリート工業	20.2	23.3	7,362
三谷セキサン	5.7	5.4	9,185
アジアパイルホールディングス	15.4	13.7	5,534
東海カーボン	99	94	28,106
日本カーボン	61	55	12,210
東洋炭素	6.4	6.1	8,796
ノリタケカンパニーリミテド	64	59	14,809
ＴＯＴＯ	169	79.1	322,332
日本碍子	145	136	326,808
日本特殊陶業	98.9	92.8	185,600
ダントーホールディングス	18	14	2,632
ＭＡＲＵＷＡ	3.4	4	12,760
品川リフラクトリーズ	29	26	5,200
黒崎播磨	25	23	5,980
ヨータイ	6	6	1,722
イソライト工業	5.7	5.5	1,237
東京窯業	13	12.8	2,163
ニッカトー	2.7	3.3	1,247
フジミインコーポレーテッド	11.2	9.6	16,684
エーアンドエーマテリアル	27	27	2,376
ニチアス	51	55	46,695
ニチハ	15.3	14.4	22,219
鉄鋼（1.2%）			
新日鐵住金	4,853	485.3	1,080,277
神戸製鋼所	1,985	1,977	203,631
中山製鋼所	89	120	7,320
合同製鐵	60	60	10,800
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	292.9	294.2	428,208
日新製鋼	48.6	49.1	68,543
東京製鐵	58.4	59.6	38,382
共英製鋼	12.3	11.4	19,049

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大和工業	26.1	23.8	60,309
東京鐵鋼	23	22	7,128
大阪製鐵	7.1	6.6	11,800
淀川製鋼所	78	15.9	42,866
東洋鋼鈑	27.3	26.2	7,938
丸一鋼管	35.2	36	127,620
モリ工業	18	16	4,752
大同特殊鋼	192	180	64,620
日本高周波鋼業	48	46	3,404
日本冶金工業	91.1	82	12,792
山陽特殊製鋼	68	63	28,728
愛知製鋼	68	63	27,279
日立金属	117	123.2	142,296
日本金属	32	31	3,193
大平洋金属	74	76	24,548
新日本電工	69.7	62.1	11,115
栗本鐵工所	60	53	9,275
虹技	16	15	2,340
日本鋳鉄管	12	13	1,963
三菱製鋼	75	76	13,148
日亜鋼業	15.3	15	3,585
日本精線	9	7	3,206
シンニッタン	12	9.7	5,732
新家工業	24	24	3,600
非鉄金属（0.9%）			
大紀アルミニウム工業所	19	16	5,088
日本軽金属ホールディングス	278.4	241	51,815
三井金属鉱業	312	274	54,252
東邦亜鉛	65	58	19,140
三菱マテリアル	716	671	210,023
住友金属鉱山	317	297	343,926
ＤＯＷＡホールディングス	137	138	95,220
古河機械金属	179	169	29,406
大阪チタニウムテクノロジーズ	11.4	10.8	14,256
東邦チタニウム	19.6	18.6	13,447
ＵＡＣＪ	130	151	39,864
古河電気工業	337	338	91,936
住友電気工業	432.5	430.8	639,738
フジクラ	160	150	83,250

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
昭和電線ホールディングス	132	134	8,174
東京特殊電線	1.9	1.9	1,533
タツタ電線	21.9	22.6	7,503
沖電線	13	13	2,587
カナレ電気	1.8	1.7	3,318
平河ヒューテック	2.7	5	4,695
リョービ	64	66	29,436
アーレスティ	13.4	12.6	9,676
アサヒホールディングス	17.2	16.1	25,566
金属製品（0.6%）			
稲葉製作所	6	5.7	7,598
宮地エンジニアリンググループ	35	35	5,250
トーカロ	7.5	7.6	13,946
アルファＣｏ	3.8	3.4	3,308
ＳＵＭＣＯ	89.4	84.2	58,603
川田テクノロジーズ	2.3	2.1	7,434
東洋製罐グループホールディングス	81.6	76.5	174,573
ホッカンホールディングス	27	28	9,268
コロナ	5.7	5.6	5,880
横河ブリッジホールディングス	21.8	20.6	21,712
駒井ハルテック	22	20	4,140
高田機工	12	11	2,112
三和ホールディングス	108	106.8	101,353
文化シヤッター	31.9	30	25,860
三協立山	15	14.3	21,550
アルインコ	4.9	7.8	7,815
東洋シヤッター	3.1	2.8	1,447
ＬＩＸＩＬグループ	170.5	149.9	286,908
日本フイルコン	8.9	7.8	3,361
ノーリツ	22.3	21	42,000
長府製作所	12.3	11.6	29,533
リンナイ	21.3	20	187,800
ダイニチ工業	5.6	5.4	3,288
日東精工	17	16	4,880
三洋工業	15	15	2,730
岡部	22.8	22.5	17,100
ジーテクト	10.3	11.2	14,963
東プレ	22	20.6	52,859
高周波熱錬	19.9	20.2	16,402

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京製綱	79	75	11,850
サンコール	6	5.5	2,497
モリテック　スチール	5.9	5.5	1,446
バイオラックス	5.8	5.4	30,240
日本発條	99.7	101.3	96,235
中央発條	15	13	3,796
アドバネクス	－	2.2	2,624
立川ブラインド工業	－	4.5	3,159
三益半導体工業	8.5	7.9	8,073
機械（4.8%）			
日本ドライケミカル	1.5	1.3	2,778
日本製鋼所	164	178	81,524
三浦工業	51.2	48	104,640
タクマ	37	40	40,440
ツガミ	33	32	15,264
オークマ	75	70	56,770
東芝機械	63	59	19,706
アマダホールディングス	171.1	156.9	181,690
アイダエンジニアリング	25	28.2	31,273
滝澤鉄工所	36	35	4,480
富士機械製造	37.5	34.9	36,610
牧野フライス製作所	57	54	35,370
オーエスジー	52.3	49	98,735
ダイジェット工業	14	15	2,085
旭ダイヤモンド工業	31.5	29.2	26,718
ＤＭＧ森精機	72.4	59.4	77,695
ソディック	22	27.3	24,679
ディスコ	13.4	13.7	132,890
日東工器	6.7	6.2	14,880
パンチ工業	4.1	4.3	3,676
豊和工業	6.3	6.5	3,653
ＯＫＫ	46	44	4,664
石川製作所	32	31	2,232
東洋機械金属	8.1	7.9	3,246
津田駒工業	29	28	3,388
島精機製作所	16.2	15.3	35,373
ＮＣホールディングス	－	4	4,728
フリュー	－	2.1	5,023
ヤマシンフィルタ	－	1.5	648

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日阪製作所	14.5	13.7	11,699
やまびこ	4.5	19.8	16,275
ペガサスミシン製造	10.2	11.1	5,527
ナブテスコ	69.9	55.9	150,650
三井海洋開発	11.6	12.6	22,591
レオン自動機	9	9.2	5,455
ＳＭＣ	34.4	32.3	875,007
新川	9.7	10.3	4,542
ホソカワミクロン	19	17	10,098
ユニオンツール	5.7	4.7	13,836
オイレス工業	13.5	13.6	24,820
日精エー・エス・ビー機械	4.2	3.5	7,147
サトーホールディングス	14.3	14.6	33,375
日本エアーテック	3.8	4.2	2,713
日精樹脂工業	8.4	8	5,648
オカダアイヨン	－	1.5	1,186
ワイエイシイ	4.5	4.5	5,022
小松製作所	562.5	527.4	953,802
住友重機械工業	314	314	166,420
日立建機	51.3	48.1	80,134
日工	16	16	4,960
巴工業	4.4	4.2	6,245
井関農機	118	111	28,194
ＴＯＷＡ	9.5	10.6	9,126
丸山製作所	25	24	4,032
北川鉄工所	53	50	9,350
タカキタ	－	3.7	1,972
クボタ	552	516.5	871,335
荏原実業	2.8	2.7	3,450
三菱化工機	38	37	7,548
月島機械	20.1	20.4	19,706
帝国電機製作所	7.7	8	6,400
新東工業	26.9	24.4	20,837
澁谷工業	9.6	8.9	14,596
アイチ　コーポレーション	16.2	15.2	13,041
小森コーポレーション	27.9	26.3	34,190
鶴見製作所	8.5	8	11,840
住友精密工業	18	18	6,012
酒井重工業	22	20	3,680

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
荏原製作所	238	238	134,232
石井鐵工所	17	17	2,754
酉島製作所	11.3	11.6	12,377
北越工業	11.3	11.5	7,015
ダイキン工業	159.7	149.7	1,379,186
オルガノ	22	18	7,524
トーヨーカネツ	66	58	11,252
栗田工業	64.9	64.7	168,867
椿本チエイン	59	61	46,116
大同工業	23	22	4,378
日本コンベヤ	37	－	－
木村化工機	11.2	9.6	3,139
アネスト岩田	17.2	17.5	18,235
ダイフク	54.2	55.2	108,523
サムコ	1.7	2.6	2,363
加藤製作所	24	25	10,500
油研工業	22	21	3,675
タダノ	53	49.6	52,328
フジテック	31.8	29.8	31,737
ＣＫＤ	30.7	28.9	26,674
キトー	12	13.1	10,244
平和	23.6	31.9	70,211
理想科学工業	13.3	11.4	18,627
ＳＡＮＫＹＯ	30.5	28.6	118,547
日本金銭機械	10.2	9.6	8,448
マースエンジニアリング	6.1	5.6	11,827
福島工業	6	6.4	18,688
オーイズミ	3.9	4.5	2,011
ダイコク電機	4.6	4.3	6,127
竹内製作所	4.6	20.3	35,768
アマノ	36.5	31.8	57,399
ＪＵＫＩ	82	15.6	17,643
サンデンホールディングス	67	64	23,424
蛇の目ミシン工業	108	10.3	6,375
マックス	17	15	19,035
グローリー	35.1	35.1	115,830
新晃工業	7.6	7.2	11,066
大和冷機工業	15.8	16.5	15,328
セガサミーホールディングス	117.8	110.5	138,898

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本ピストンリング	44	4.4	6,978
リケン	47	47	16,638
ＴＰＲ	12.2	12.5	33,637
ツバキ・ナカシマ	－	12.7	18,897
ホシザキ電機	24	22.5	230,400
大豊工業	8.9	8.3	9,926
日本精工	225.2	211.1	200,756
ＮＴＮ	254	255	92,565
ジェイテクト	116.9	109.6	159,796
不二越	102	96	34,848
日本トムソン	38	35.8	13,425
ＴＨＫ	72.9	68.4	135,774
ユーシン精機	4.8	4	6,580
前澤給装工業	4.2	4.2	6,039
イーグル工業	15.2	12.8	17,331
前澤工業	8.3	7.9	2,291
日本ピラー工業	12.1	10.4	9,380
キッツ	49.2	44.7	21,768
日立工機	29.2	27.4	20,029
マキタ	71.5	67	477,040
日立造船	85.9	81.1	48,254
三菱重工業	1,838	1,831	755,104
ＩＨＩ	790	790	213,300
電気機器（11.6%）			
日清紡ホールディングス	－	57.1	69,890
イビデン	71.9	62.9	86,361
コニカミノルタ	261.3	256.7	235,393
ブラザー工業	141.7	132.9	167,586
ミネベア	163	166	141,930
日立製作所	2,633	2,623	1,311,500
東芝	2,308	2,164	484,952
三菱電機	1,096	1,097	1,421,712
富士電機	305	310	138,880
東洋電機製造	22	21	6,804
安川電機	133.7	127.7	168,436
シンフォニアテクノロジー	77	69	12,420
明電舎	100	95	39,615
オリジン電気	16	15	4,170
山洋電気	24	27	14,472

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
デンヨー	9.3	9.6	11,702
東芝テック	79	75	28,800
芝浦メカトロニクス	19	17	3,553
マブチモーター	33.5	29.4	151,998
日本電産	120.2	123.7	1,036,853
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	－	0.9	1,787
東光高岳	5.5	5.8	10,416
ダブル・スコープ	－	4.1	27,101
ダイヘン	60	61	31,842
田淵電機	12.6	12	4,896
ヤーマン	1.7	1.4	2,949
ＪＶＣケンウッド	81.4	77.2	19,763
ミマキエンジニアリング	6.7	9.3	4,696
第一精工	4.1	4.5	5,031
日新電機	25.8	24.4	34,916
大崎電気工業	20	19	14,497
オムロン	118.4	116.1	398,223
日東工業	17.5	16.5	26,334
ＩＤＥＣ	12.8	13.1	13,060
不二電機工業	0.9	0.5	717
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	211	198	91,674
サクサホールディングス	29	28	6,160
メルコホールディングス	6.2	5.8	12,957
テクノメディカ	2.5	2.3	4,618
日本電気	1,419	1,413	344,772
富士通	1,057	991	415,229
沖電気工業	386	445	71,645
岩崎通信機	57	56	3,864
電気興業	31	27	13,338
サンケン電気	56	57	17,328
ナカヨ	11	11	3,509
アイホン	6.4	5.9	10,555
ルネサスエレクトロニクス	56.5	53	33,390
セイコーエプソン	149.7	153.1	288,287
ワコム	86.7	81.7	33,415
アルバック	18.6	18.9	70,308
アクセル	5	4.8	4,056
ＥＩＺＯ	10	10	30,750
ジャパンディスプレイ	225.2	193.9	38,392

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本信号	30.1	28.7	26,604
京三製作所	25	23	7,659
能美防災	14.4	11.8	15,941
ホーチキ	8.1	7.5	9,900
エレコム	4.6	9	19,197
日本無線	24	30	8,280
パナソニック	1,336.2	1,174.4	1,134,118
シャープ	927	869	120,791
アンリツ	66	61.9	36,892
富士通ゼネラル	34	31	60,791
日立国際電気	29	23.6	31,128
ソニー	716.8	725.3	2,115,700
ＴＤＫ	66.2	62	385,640
帝国通信工業	27	26	4,082
ミツミ電機	39.2	39.8	20,099
タムラ製作所	43	40	13,400
アルプス電気	86.5	88.6	183,667
パイオニア	166.5	168.2	38,517
日本電波工業	10.2	9.5	6,735
鈴木	1.5	4.1	2,378
日本トリム	2.7	2.8	19,936
ローランド　ディー．ジー．	4.4	5.1	10,026
フォスター電機	12.9	13	26,338
クラリオン	59	55	17,600
ＳＭＫ	32	30	13,590
ヨコオ	8.7	7.5	3,690
東光	26	－	－
ホシデン	33.3	31.5	22,081
ヒロセ電機	18.6	16.6	218,788
日本航空電子工業	31	30	39,060
ＴＯＡ	11.6	12.3	11,980
日立マクセル	21.9	16.9	26,803
古野電気	13.3	12.7	7,442
ユニデンホールディングス	32	36	4,680
アルパイン	26.1	24.8	28,445
スミダコーポレーション	10	8.7	6,446
アイコム	6.1	5.8	11,704
リオン	4.3	4	6,452
本多通信工業	－	1.8	1,704

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
船井電機	11.3	10.7	9,865
横河電機	109.7	102.9	126,978
新電元工業	42	37	14,504
アズビル	35.8	33.6	103,320
東亜ディーケーケー	4.8	5.8	2,778
日本光電工業	46.7	43	135,235
チノー	3.8	3.6	3,614
共和電業	13.7	12.6	4,561
日本電子材料	4.9	4.4	1,795
堀場製作所	20.3	19	87,970
アドバンテスト	74.7	70.1	81,175
小野測器	5.5	5	4,120
エスペック	12.2	10.7	15,964
パナソニック　デバイスＳＵＮＸ	9.5	8.8	5,368
キーエンス	24.8	23.3	1,602,108
日置電機	5.8	5.4	12,673
シスメックス	84.9	79.8	612,066
日本マイクロニクス	－	19.2	16,857
メガチップス	11.3	10.4	12,448
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	7.1	6	22,800
澤藤電機	7	7	1,197
コーセル	15.9	14.1	16,863
新日本無線	8	7.9	3,270
オプテックス	7.5	7.7	25,333
千代田インテグレ	5.8	5.3	10,843
アイ・オー・データ機器	－	3.4	2,142
レーザーテック	11.3	12.1	16,286
スタンレー電気	78.7	73.5	170,079
岩崎電気	38	36	5,904
ウシオ電機	66.5	62.4	79,060
岡谷電機産業	6.1	5.6	2,122
ヘリオス　テクノ　ホールディング	10.8	8.9	3,293
日本セラミック	6.2	5.7	11,856
遠藤照明	4.9	5.3	5,580
日本デジタル研究所	9.2	8.5	12,070
古河電池	8	8	5,112
双信電機	5.2	5.9	1,640
山一電機	13	9.2	5,308
図研	8.1	7.5	7,995

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本電子	47	41	21,115
カシオ計算機	109.9	103	176,542
ファナック	114.2	105.2	1,690,564
日本シイエムケイ	28.3	22.7	9,329
エンプラス	5	5.2	16,146
大真空	20	20	5,080
ローム	54	50.7	227,136
浜松ホトニクス	85.6	80.2	227,928
三井ハイテック	14.5	15.1	10,705
新光電気工業	41.5	39.1	24,242
京セラ	180	168.7	928,862
太陽誘電	57.4	50	55,350
村田製作所	115	108.3	1,367,287
ユーシン	15.3	13.7	9,521
双葉電子工業	18.7	16.9	34,053
北陸電気工業	49	43	5,418
ニチコン	34.6	32.5	25,642
日本ケミコン	89	85	12,920
ＫＯＡ	15	14.1	11,040
市光工業	27	25	7,075
小糸製作所	65.7	61.6	308,000
ミツバ	20.2	17.6	27,913
スター精密	20.9	19.7	24,152
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	104	105	108,045
キヤノン電子	10.1	9.1	14,387
キヤノン	635.7	553.4	1,723,287
リコー	329.7	332.9	314,590
ＭＵＴＯＨホールディングス	15	13	3,042
東京エレクトロン	92.2	84.4	658,235
輸送用機器（9.3%）			
トヨタ紡織	38.3	35.9	76,790
鬼怒川ゴム工業	25	24	18,552
ユニプレス	21	21.3	45,965
豊田自動織機	99.8	93.6	427,752
モリタホールディングス	19.1	18	25,650
三櫻工業	13.8	13	7,280
デンソー	270.9	254	1,055,878
東海理化電機製作所	28.9	30.1	58,965
三井造船	424	398	72,436

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
川崎重工業	796	800	263,200
名村造船所	30.7	31.1	20,526
サノヤスホールディングス	14	13.2	2,283
日本車輌製造	40	43	11,739
ニチユ三菱フォークリフト	12.2	11.6	5,916
近畿車輛	17	16	4,592
日産自動車	1,539	1,434.6	1,499,874
いすゞ自動車	346.6	297.9	360,161
トヨタ自動車	1,512.7	1,278.5	7,111,017
日野自動車	156.5	146.7	162,983
三菱自動車工業	401.9	408.1	217,517
エフテック	6.4	5.3	5,527
レシップホールディングス	3.5	3.5	2,509
ＧＭＢ	1.4	2	1,682
ファルテック	1.7	1.1	1,345
武蔵精密工業	11.7	10.9	24,612
日産車体	48.2	50.2	58,382
新明和工業	44	45	33,840
極東開発工業	20.3	20.5	23,431
日信工業	20.1	22.8	32,923
トピー工業	90	85	18,020
ティラド	42	41	7,831
曙ブレーキ工業	46.3	53.5	12,840
タチエス	17.4	16.3	28,378
ＮＯＫ	53	49.7	90,106
フタバ産業	33.7	31.9	16,141
ＫＹＢ	122	115	43,125
シロキ工業	25	－	－
大同メタル工業	15.3	14.5	14,239
プレス工業	54.4	53.8	20,659
ミクニ	10.8	13.1	4,152
カルソニックカンセイ	84	78	69,030
太平洋工業	22.3	22.8	25,125
ケーヒン	25.2	23.5	40,866
河西工業	13.5	12.7	14,363
アイシン精機	100.3	105.4	442,153
富士機工	12.8	11.8	4,767
マツダ	326.8	325.5	584,760
ダイハツ工業	130.9	122.7	180,000

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
今仙電機製作所	9.5	9.5	8,901
本田技研工業	986.7	925	2,726,900
スズキ	229.2	188.1	512,478
富士重工業	373.1	324.8	1,265,420
安永	3.9	4.2	2,041
ヤマハ発動機	166.8	145.2	268,474
ショーワ	25.8	26.5	20,961
ＴＢＫ	14.1	12.9	4,605
エクセディ	14.8	13.9	35,556
豊田合成	35.4	37.3	77,957
愛三工業	17.2	17.7	15,469
盟和産業	11	1.8	1,796
ヨロズ	10.2	9.3	15,828
エフ・シー・シー	16	16.8	32,659
シマノ	47.3	41.4	682,686
タカタ	19.9	19.4	6,731
テイ・エス　テック	23.2	23.9	67,302
ジャムコ	4.1	6	13,374
精密機器（1.6%）			
テルモ	168.1	157.6	691,076
クリエートメディック	3.9	3.4	2,896
日機装	35.6	37.2	30,876
島津製作所	131	132	229,548
ＪＭＳ	21	19	5,358
モリテックス	3.5	－	－
長野計器	7.2	6.4	3,731
ブイ・テクノロジー	2.2	2.5	19,800
東京計器	38	33	5,412
愛知時計電機	14	13	3,952
オーバル	12.3	11.2	2,576
東京精密	19.7	19.9	50,506
マニー	3.4	13.6	24,303
ニコン	204.7	191.9	294,374
トプコン	33.1	34.9	34,830
オリンパス	163.3	153.1	665,219
理研計器	9.8	8.4	9,391
タムロン	8.4	8.4	12,986
ＨＯＹＡ	260.9	232.4	894,972
ノーリツ鋼機	9.9	9.6	7,065

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エー・アンド・デイ	10.1	9.4	4,230
シチズンホールディングス	135	126.5	77,038
リズム時計工業	48	45	6,525
大研医器	7.7	8.3	7,470
メニコン	－	6.9	25,668
松風	5.5	5	7,245
セイコーホールディングス	78	67	27,068
ニプロ	70	76.6	95,060
その他製品（1.7%）			
スノーピーク	－	1.1	4,130
パラマウントベッドホールディングス	11.5	10.8	47,574
トランザクション	1	2.2	1,577
ＳＨＯ－ＢＩ	4	3.8	1,512
ニホンフラッシュ	－	3.9	4,410
前田工繊	12.1	10.3	11,556
永大産業	15	14	6,048
アートネイチャー	7.8	10.8	9,752
ダンロップスポーツ	6.9	6.8	7,167
バンダイナムコホールディングス	120.9	106.3	283,927
アイフィスジャパン	－	2.7	1,128
共立印刷	20.2	17.1	5,061
ＳＨＯＥＩ	－	4.6	7,337
フランスベッドホールディングス	74	14.3	13,570
パイロットコーポレーション	9.6	17.9	86,367
萩原工業	2.4	2.9	7,728
トッパン・フォームズ	19.6	18.3	23,204
フジシールインターナショナル	13.3	12.5	51,875
タカラトミー	39.9	34.3	25,176
廣済堂	10.4	10.3	3,368
Ａｓ－ｍｅエステール	3	2.9	1,803
アーク	36.3	45.8	3,709
タカノ	4.9	4.6	2,852
プロネクサス	11.1	9.8	10,005
ホクシン	10.9	10.8	1,371
ウッドワン	19	20	5,000
大建工業	44	41	12,628
凸版印刷	310	290	292,320
大日本印刷	334	304	342,608
図書印刷	18	20	11,460

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
共同印刷	34	35	11,725
日本写真印刷	18.5	17.5	41,772
光村印刷	11	12	2,508
宝印刷	5.9	5.1	7,282
アシックス	108.9	95.7	235,326
ツツミ	5.5	5.1	11,454
小松ウオール工業	3.3	3.4	5,691
ヤマハ	80.6	75.5	249,150
河合楽器製作所	3.8	3.9	7,690
クリナップ	9.9	12.2	9,796
ピジョン	62.1	58.2	168,547
兼松日産農林	15	12	1,740
キングジム	9.3	8.7	7,429
リンテック	26.1	24.4	53,021
ＴＡＳＡＫＩ	2.2	2.1	3,378
イトーキ	23.1	21.8	13,799
任天堂	67.5	63.3	1,035,904
三菱鉛筆	9	7.8	43,602
タカラスタンダード	45	42	40,950
コクヨ	57	53.4	79,459
ナカバヤシ	24	21	6,195
グローブライド	54	5	7,395
岡村製作所	41.8	35.7	38,591
美津濃	58	55	29,590
アデランス	12.9	18.2	9,445
電気・ガス業（2.0%）			
東京電力ホールディングス	930.1	872	463,904
中部電力	335.5	314.5	470,649
関西電力	447.4	419.5	422,017
中国電力	151.6	142.1	196,950
北陸電力	107.4	100.7	137,052
東北電力	273.9	256.8	361,574
四国電力	98.7	92.6	117,972
九州電力	242.1	227	248,338
北海道電力	102.6	96.2	87,830
沖縄電力	7.2	11	34,210
電源開発	79.5	87.6	248,170
ファーストエスコ	－	4.5	2,155
イーレックス	－	3.1	5,285

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京瓦斯	1,333	1,147	511,217
大阪瓦斯	1,135	1,064	443,900
東邦瓦斯	279	259	205,905
北海道瓦斯	23	25	6,975
広島ガス	18	18.4	6,403
西部瓦斯	122	117	29,601
静岡ガス	31.1	29.3	21,652
メタウォーター	6.9	6.7	19,289
陸運業（4.6%）			
ＳＢＳホールディングス	11	10.5	8,925
東武鉄道	586	549	304,146
相鉄ホールディングス	188	176	117,040
東京急行電鉄	596	598	574,080
京浜急行電鉄	300	282	289,614
小田急電鉄	351	329	384,601
京王電鉄	306	287	267,484
京成電鉄	164	154	221,606
富士急行	30	28	37,632
新京成電鉄	14	13	5,421
東日本旅客鉄道	200.9	187.9	1,854,197
西日本旅客鉄道	105.5	98.9	647,597
東海旅客鉄道	98.2	92	1,772,840
西武ホールディングス	87.4	109.2	232,705
鴻池運輸	13.6	14.4	17,856
西日本鉄道	142	133	79,268
ハマキョウレックス	3.4	7.9	16,882
サカイ引越センター	1.8	4.1	13,202
近鉄グループホールディングス	1,103	1,035	457,470
阪急阪神ホールディングス	736	690	513,360
南海電気鉄道	246	231	130,284
京阪ホールディングス	246	230	174,340
神戸電鉄	29	26	9,438
名糖運輸	4.9	－	－
名古屋鉄道	399	374	207,570
山陽電気鉄道	41	38	18,886
日本通運	424	398	193,428
ヤマトホールディングス	192.8	183.8	424,578
山九	133	135	73,440
丸運	7.3	6.2	1,481

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
丸全昭和運輸	36	32	12,832
センコー	48	45.1	29,720
トナミホールディングス	23	21	6,090
ニッコンホールディングス	35.9	32.7	73,967
日本石油輸送	13	11	2,552
福山通運	66	61	32,940
セイノーホールディングス	84.8	72.9	80,773
神奈川中央交通	13	12	7,296
日立物流	22.7	21.4	41,152
丸和運輸機関	－	3.1	9,008
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	－	10	9,210
海運業（0.2%）			
日本郵船	926	923	192,907
商船三井	575	501	122,244
川崎汽船	480	450	101,250
ＮＳユナイテッド海運	47	47	7,097
明治海運	10.1	9.6	3,580
飯野海運	56.5	53.7	21,372
共栄タンカー	10	10	1,820
第一中央汽船	140	－	－
乾汽船	－	8.3	7,453
空運業（0.7%）			
日本航空	209.9	196.8	742,723
ＡＮＡホールディングス	2,155	1,908	619,146
パスコ	10	10	3,790
倉庫・運輸関連業（0.2%）			
トランコム	3.2	3	19,410
日新	42	42	14,154
三菱倉庫	72	73	110,887
三井倉庫ホールディングス	64	60	18,000
住友倉庫	80	74	42,476
澁澤倉庫	28	27	7,398
東陽倉庫	19	18	3,960
乾汽船	7.6	－	－
日本トランスシティ	25	23	7,820
ケイヒン	22	20	2,840
中央倉庫	6.2	5.7	5,112
安田倉庫	8.4	8.1	5,670
東洋埠頭	35	31	4,836

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
宇徳	9.1	8.4	2,730
上組	131	123	124,968
サンリツ	2.7	2.8	1,293
キムラユニティー	2.3	2.6	2,802
キユーソー流通システム	3.1	2.9	7,777
郵船ロジスティクス	9.9	9.4	10,716
近鉄エクスプレス	9.8	18.5	25,345
東海運	6.5	5.3	1,383
エーアイテイー	5	6.1	5,496
内外トランスライン	1.3	3.4	3,284
情報・通信業（8.5%）			
ＮＥＣネッツエスアイ	13.6	12.7	23,685
システナ	10.2	10	16,780
デジタルアーツ	5.9	5.1	15,192
新日鉄住金ソリューションズ	9	16.9	31,146
キューブシステム	4.8	4.6	2,617
コア	4.5	4.4	5,363
ソフトクリエイトホールディングス	3.4	4.7	4,371
ＩＴホールディングス	35.9	33.6	87,393
ネオス	3.3	3.6	2,476
電算システム	3.7	3.6	5,461
グリー	66.3	62.2	39,808
コーエーテクモホールディングス	24.4	24	47,448
三菱総合研究所	4.1	3.9	13,864
ボルテージ	2	2.1	2,515
電算	1.2	1.1	2,191
ＡＧＳ	1.9	2.3	2,316
ファインデックス	6.2	6.7	11,792
ヒト・コミュニケーションズ	1.2	2.3	4,790
ブレインパッド	1.6	1.9	1,808
ＫＬａｂ	11.6	16.1	9,885
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ	7.3	6.9	6,417
イーブックイニシアティブジャパン	2.5	2.5	1,722
ネクソン	103	97.2	181,083
アイスタイル	4.7	15.7	14,208
エムアップ	3.2	3	1,674
エイチーム	4	5.6	9,161
テクノスジャパン	－	3	7,635
ｅｎｉｓｈ	2.9	3.3	2,798

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コロプラ	29.7	28.2	60,912
モバイルクリエイト	6.4	7.2	3,016
オルトプラス	4.2	4.1	1,652
ブロードリーフ	9	10.4	11,055
ハーツユナイテッドグループ	3.2	3.1	8,500
メディアドゥ	－	2.2	3,764
ブイキューブ	－	6.7	8,334
サイバーリンクス	－	1.7	1,742
ＶＯＹＡＧＥ　ＧＲＯＵＰ	－	3.5	4,284
オプティム	－	0.9	4,563
ベリサーブ	1.4	1.2	5,460
ティーガイア	10.8	10.2	16,014
日本アジアグループ	－	11.8	5,109
豆蔵ホールディングス	8.7	8.2	6,199
テクマトリックス	4.7	4.5	9,958
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	－	236.4	63,355
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	9.4	8.3	60,009
ザッパラス	6.3	6.4	2,451
インターネットイニシアティブ	17.5	16.4	39,032
さくらインターネット	－	6.7	7,979
ＧＭＯクラウド	2.4	2.4	2,791
ビットアイル	12.4	－	－
ＳＲＡホールディングス	5.6	5.9	13,935
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	－	2	1,732
システムインテグレータ	1.7	1.5	1,062
パイプドビッツ	1.4	－	－
朝日ネット	10.8	8.4	4,158
コムチュア	1.8	1.7	5,278
ｇｕｍｉ	11	10.8	11,124
パイプドＨＤ	－	1.3	1,606
パナソニック　インフォメーションシステム	2.6	－	－
フェイス	3.4	2.8	3,264
ハイマックス	1.6	1.2	1,370
野村総合研究所	61.3	71.1	297,198
サイバネットシステム	9.1	8.5	7,463
ＣＥホールディングス	1.8	1.7	1,630
インテージホールディングス	6.2	5.4	8,121
東邦システムサイエンス	3.1	3	1,803
ソースネクスト	5.5	5.3	2,496

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ティー・ワイ・オー	16.7	21	3,549
フォーカスシステムズ	－	2.7	1,355
クレスコ	2.4	2.2	4,140
フジ・メディア・ホールディングス	112.7	105.6	143,721
オービック	37.3	35	204,750
ジャストシステム	19.7	18.5	16,169
ＴＤＣソフトウェアエンジニアリング	2.4	4.4	2,930
ヤフー	775.5	727.1	365,731
トレンドマイクロ	57.3	49.3	204,841
インフォメーション・ディベロプメント	2.1	1.7	1,671
日本オラクル	17.3	16.3	95,355
アルファシステムズ	3.5	3.2	5,552
フューチャー	11.1	12.1	9,196
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	7.2	7.6	6,163
ソフトバンク・テクノロジー	2.9	2.8	4,838
トーセ	3.2	2.7	1,792
オービックビジネスコンサルタント	6.8	5.1	24,888
伊藤忠テクノソリューションズ	24.5	22.8	55,723
アイティフォー	13.1	13.3	6,982
東計電算	1.7	1.7	3,078
エックスネット	1.1	0.7	1,066
大塚商会	29.1	27.3	149,877
サイボウズ	15.1	13.6	4,760
ソフトブレーン	15.9	15.7	3,595
電通国際情報サービス	6.5	6.3	12,524
ＥＭシステムズ	1.6	3.4	4,022
ウェザーニューズ	3.2	3.4	12,580
ＣＩＪ	10	9.1	4,613
東洋ビジネスエンジニアリング	1.1	1	1,387
日本エンタープライズ	9.9	11.3	2,802
ＷＯＷＯＷ	5.2	4.8	12,547
フュージョンパートナー	6.3	6.7	3,906
日本コロムビア	4.6	4	1,664
イマジカ・ロボット　ホールディングス	7.8	8.9	3,880
ネットワンシステムズ	44.7	44.5	26,789
アルゴグラフィックス	4.6	4.6	8,119
マーベラス	18.4	17.3	15,794
エイベックス・グループ・ホールディングス	21.5	18.9	26,044
日本ユニシス	29.9	28	37,548

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
兼松エレクトロニクス	6.8	6.2	12,083
東京放送ホールディングス	64.8	60.8	97,219
日本テレビホールディングス	98.8	92.6	180,847
朝日放送	10.7	10.1	6,655
テレビ朝日ホールディングス	29.6	27.7	49,001
スカパーＪＳＡＴホールディングス	81.3	77	41,503
テレビ東京ホールディングス	8.8	9.2	19,734
日本ＢＳ放送	1.9	2.2	2,224
Ｕ－ＮＥＸＴ	－	3.2	2,848
ワイヤレスゲート	－	2.5	5,095
コネクシオ	7.5	8.7	11,901
日本通信	－	72.6	16,407
クロップス	1.9	2.5	1,307
日本電信電話	423.5	784.2	3,764,160
ＫＤＤＩ	1,099.3	1,030.6	3,242,267
光通信	9.7	12.2	107,238
ＮＴＴドコモ	834.6	758.1	2,029,054
エムティーアイ	14	15.4	10,718
ＧＭＯインターネット	36.1	37.3	48,415
カドカワ	26.5	31.9	43,352
学研ホールディングス	35	34	8,568
ゼンリン	14.3	13.5	35,100
昭文社	6.6	5.8	3,410
インプレスホールディングス	8.7	10.6	1,441
アイネット	5.6	5.6	6,115
松竹	71	67	70,752
東宝	77.2	72.4	213,797
東映	40	38	32,148
ＡＯＩ　Ｐｒｏ．	4.9	4.9	4,851
エヌ・ティ・ティ・データ	66.8	62.7	357,390
ピー・シー・エー	1.3	1.2	1,549
ビジネスブレイン太田昭和	－	1.4	1,283
ＤＴＳ	11.2	11.2	25,760
スクウェア・エニックス・ホールディングス	41.6	42.9	146,074
シーイーシー	7	6.7	10,378
カプコン	27.7	25.9	67,443
アイ・エス・ビー	1.4	1.9	1,746
ジャステック	6	6.4	6,092
ＳＣＳＫ	25.7	24.1	96,761

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本システムウエア	4.2	3.9	4,422
アイネス	14.9	14.5	15,993
ＴＫＣ	10	9.3	26,988
富士ソフト	14.8	15	35,985
ＮＳＤ	25.3	21.1	37,304
コナミホールディングス	44	45.8	176,559
福井コンピュータホールディングス	2.9	2.9	4,463
ＪＢＣＣホールディングス	9.3	8.5	5,771
ミロク情報サービス	7.1	7.6	9,682
ソフトバンクグループ	572.3	574.8	3,509,154
卸売業（4.2%）			
ホウスイ	10	10	1,190
高千穂交易	4.2	3.8	3,294
伊藤忠食品	2.6	2.4	9,696
エレマテック	5	4.6	9,273
ＪＡＬＵＸ	3.1	3.4	6,847
あらた	24	4.6	11,164
トーメンデバイス	1.5	1.2	2,283
東京エレクトロン　デバイス	2.9	3	4,530
フィールズ	－	8.8	13,552
双日	724.3	639.1	155,301
アルフレッサ　ホールディングス	128	127.5	294,015
横浜冷凍	26.5	25.2	26,409
山下医科器械	0.8	0.8	1,516
ラサ商事	5.9	4.8	2,256
ラクーン	－	3	1,779
アルコニックス	6.2	5.8	9,135
神戸物産	3.5	6.6	16,381
あい　ホールディングス	17.4	18.1	52,707
ディーブイエックス	3.3	3.5	3,853
ダイワボウホールディングス	101	93	20,367
マクニカ・富士エレホールディングス	19.2	17.7	21,434
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20.3	17.7	17,735
八洲電機	8.8	8	4,200
ＵＫＣホールディングス	6.9	6.5	12,168
ＯＣＨＩホールディングス	2.8	3	3,084
ＴＯＫＡＩホールディングス	52.8	44.9	30,397
三洋貿易	6	5.6	7,823
ウイン・パートナーズ	3.6	3.7	5,572

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ミタチ産業	2.7	2.4	1,581
シップヘルスケアホールディングス	19.8	20.6	65,611
明治電機工業	3.1	3	3,051
デリカフーズ	2	2.2	2,057
スターティア	1.2	2.3	1,232
富士興産	4.3	4	1,700
協栄産業	14	16	2,080
小野建	9.2	8.1	9,938
佐鳥電機	8.7	8.1	5,686
エコートレーディング	2.6	2.6	1,479
伯東	7.2	7.7	7,099
コンドーテック	7.6	8	6,400
中山福	5.9	6	4,674
ナガイレーベン	15.8	14.8	35,372
三菱食品	11.7	11.1	30,325
松田産業	7.8	7.4	9,316
第一興商	－	17.9	75,180
メディパルホールディングス	108.2	101.5	195,387
アドヴァン	5.5	10.3	11,391
ＳＰＫ	2.2	2.1	4,200
萩原電気	2.9	3.4	6,045
アズワン	7.7	7.9	32,627
スズデン	3.5	3.3	3,121
尾家産業	3.4	3.2	2,771
シモジマ	6.4	7	6,972
ドウシシャ	14	12	25,416
小津産業	2.2	2.2	4,699
高速	6.1	6	5,256
たけびし	3.8	3.2	3,184
黒田電気	18.8	18.9	34,813
丸文	9.3	8.8	5,359
ハピネット	6.8	9.3	8,165
橋本総業ホールディングス	2	2.1	3,160
エクセル	5.1	4.9	6,668
マルカキカイ	3.5	3.3	4,118
ガリバーインターナショナル	33	27.6	30,829
日本エム・ディ・エム	9.4	8.6	7,344
進和	6.3	6	8,550
エスケイジャパン	4.7	3.1	926

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ダイトエレクトロン	5	4.7	2,946
シークス	6.9	6.5	24,700
田中商事	3	3.1	2,111
オーハシテクニカ	6.6	5.4	6,766
白銅	3.5	2.7	3,140
伊藤忠商事	905.8	796.1	1,100,210
丸紅	946.7	998.5	506,539
高島	21	20	3,400
長瀬産業	60.7	61	73,749
蝶理	7	6.4	9,670
豊田通商	120.5	113	282,952
三共生興	19	15.8	5,245
兼松	218	218	38,150
ツカモトコーポレーション	24	24	2,544
三井物産	917.4	917.4	1,201,335
日本紙パルプ商事	54	49	16,268
日立ハイテクノロジーズ	37.5	35.2	110,000
カメイ	14	13.2	12,012
東都水産	20	17	2,890
ＯＵＧホールディングス	17	15	3,765
スターゼン	42	3.7	13,449
山善	41.5	38.8	34,609
椿本興業	12	10	2,850
住友商事	638.6	638.6	705,653
内田洋行	27	25	11,150
三菱商事	829.3	761.3	1,429,721
第一実業	26	23	12,282
キヤノンマーケティングジャパン	30.9	28.9	57,915
西華産業	36	33	8,349
佐藤商事	9.3	8.4	5,317
菱洋エレクトロ	12.5	11.6	15,497
東京産業	10.9	10.3	3,883
ユアサ商事	9.4	9.6	23,769
神鋼商事	28	21	3,780
小林産業	7.6	6.5	1,436
阪和興業	108	101	55,550
カナデン	9.3	9.6	8,380
菱電商事	17	16	10,384
フルサト工業	6	5.5	7,546

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
岩谷産業	120	120	76,200
すてきナイスグループ	47	45	6,795
昭光通商	42	42	3,108
ニチモウ	19	17	2,873
極東貿易	13	15	3,000
イワキ	17	16	3,184
三愛石油	27	25	19,075
稲畑産業	25.8	24.2	26,474
ＧＳＩクレオス	35	31	3,472
明和産業	9.2	9.4	3,327
ワキタ	22.8	21.7	16,275
東邦ホールディングス	37.3	32.5	86,840
サンゲツ	37.8	35.3	71,094
ミツウロコグループホールディングス	17.1	16.2	8,391
シナネンホールディングス	22	21	8,841
伊藤忠エネクス	23.8	26.3	24,643
サンリオ	30.3	31.3	65,010
サンワテクノス	6.8	6.4	4,793
リョーサン	18.2	15.9	41,260
新光商事	12.5	11.7	12,530
トーホー	24	4.6	11,104
三信電気	15	14.1	12,097
東陽テクニカ	15.8	13.6	14,048
モスフードサービス	14	13.3	38,410
加賀電子	9.6	9.1	11,247
ソーダニッカ	11.4	9.9	4,801
立花エレテック	7.9	7.3	8,701
フォーバル	2.2	5.4	4,185
ＰＡＬＴＡＣ	17.3	16.3	36,218
三谷産業	11.8	11.1	3,862
太平洋興発	50	49	3,528
ヤマタネ	57	49	7,203
丸紅建材リース	10	10	1,880
日鉄住金物産	70	86	33,540
トラスコ中山	13.5	11.6	59,044
オートバックスセブン	39.8	38.9	66,130
加藤産業	16.9	15.8	43,908
イノテック	10.4	9.3	3,729
イエローハット	10.2	9.6	22,435

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＪＫホールディングス	10.9	9.9	4,504
日伝	4.3	4	12,140
北沢産業	9.6	10.4	1,632
杉本商事	5.9	5.6	6,384
因幡電機産業	16.1	14	51,730
バイテックホールディングス	3.6	4.2	4,263
ミスミグループ本社	40.4	113.9	192,718
アルテック	9.3	11.8	1,699
タキヒヨー	19	17	7,718
蔵王産業	1.5	1.1	1,422
スズケン	49.3	46.2	161,469
ジェコス	7.5	7	7,735
ルネサスイーストン	5.3	8.2	3,296
小売業（4.9%）			
ローソン	41	38.4	328,704
サンエー	8.2	6.9	35,190
ダイユーエイト	2.8	2.5	1,707
カワチ薬品	8.6	8	20,240
エービーシー・マート	15.4	13.2	95,172
ハードオフコーポレーション	5.3	4.9	6,610
アスクル	11.3	12.3	50,553
ゲオホールディングス	20.3	17	25,857
アダストリア	9.2	18.7	67,133
ジーフット	－	6.2	4,904
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	16	19	1,634
くらコーポレーション	6.4	6	29,760
キャンドゥ	5.1	5.4	8,607
パル	6.3	5.9	15,487
エディオン	49.6	42.3	35,193
サーラコーポレーション	9.3	8.8	4,972
ワッツ	4.3	4.3	3,943
ハローズ	－	3.4	7,860
あみやき亭	1.9	1.9	8,303
ひらまつ	14.6	14.1	10,166
ゲンキー	1.1	2.1	7,108
サッポロドラッグストアー	1.1	1.4	2,938
大黒天物産	2.6	2.4	11,688
ハニーズ	9.6	9	9,783
ファーマライズホールディングス	2.7	2.4	1,339

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アルペン	9.4	8.7	15,164
クオール	11.1	10.4	15,444
ジェイアイエヌ	7.4	6.9	25,012
ビックカメラ	53.2	58.2	58,258
ＤＣＭホールディングス	52.3	49.3	38,454
ＭｏｎｏｔａＲＯ	21.1	35.8	138,546
東京一番フーズ	－	2.7	1,387
ダイヤモンドダイニング	－	2.3	2,272
きちり	3	2.8	1,789
アークランドサービス	1.3	3.2	10,336
Ｊ．フロント　リテイリング	136.9	128.4	158,188
ドトール・日レスホールディングス	19	17.6	32,172
マツモトキヨシホールディングス	24.2	20.9	121,638
ブロンコビリー	1.9	5.2	15,860
スタートトゥデイ	33.7	30.9	150,174
トレジャー・ファクトリー	1.4	2.9	3,271
物語コーポレーション	3.1	2.7	13,770
ココカラファイン	11.2	10.6	55,650
三越伊勢丹ホールディングス	215.1	201.8	203,818
ウエルシアホールディングス	9.3	8.8	52,976
クリエイトＳＤホールディングス	5.3	15	38,595
丸善ＣＨＩホールディングス	12	11.8	4,377
ミサワ	－	1.9	951
エー・ピーカンパニー	1.5	1.7	1,688
チムニー	2.6	2.5	7,382
シュッピン	－	3.8	4,111
ネクステージ	1.5	1.8	1,184
ジョイフル本田	7.8	16.5	40,210
キリン堂ホールディングス	3.4	3.4	3,590
ホットランド	－	3.6	3,153
すかいらーく	52.9	30.7	38,620
綿半ホールディングス	－	3.8	5,738
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	35.6	33.4	35,270
ブックオフコーポレーション	6	5.6	4,726
ゴルフダイジェスト・オンライン	－	2.9	2,923
あさひ	7.2	7.6	12,129
日本調剤	1.4	2.6	11,297
コスモス薬品	5.4	5.1	99,450
トーエル	5.9	5	4,005

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
一六堂	2.7	2.5	832
セブン＆アイ・ホールディングス	452.7	424.4	2,006,138
薬王堂	1.6	1.9	7,524
クリエイト・レストランツ・ホールディング	7.6	27.4	27,619
ツルハホールディングス	23.1	23.3	263,290
サンマルクホールディングス	7.7	8	25,480
フェリシモ	2.9	3.1	3,143
トリドール	11.8	12.6	34,927
クスリのアオキ	8.6	9.1	58,786
メディカルシステムネットワーク	9.9	11.7	6,224
総合メディカル	5.2	4.9	16,390
はるやま商事	4.4	3.9	2,925
カッパ・クリエイト	17	14.4	17,524
ライトオン	8.1	7.7	10,618
ジーンズメイト	4.5	4.8	878
良品計画	13.4	11.7	296,010
三城ホールディングス	12.1	10.9	4,447
アルビス	2.5	2.6	5,410
コナカ	12.7	12.8	6,540
ハウス　オブ　ローゼ	1.4	1.3	1,830
Ｇ－７ホールディングス	2.2	3	3,609
イオン北海道	6.6	6.9	3,539
コジマ	16.6	15.9	3,816
ヒマラヤ	3.2	3	3,030
コーナン商事	16.6	14.4	26,640
エコス	4	4	5,320
ワタミ	13	12.3	11,955
マルシェ	2.8	2.7	2,227
ドンキホーテホールディングス	34.9	65.6	231,240
西松屋チェーン	21.4	20	24,240
ゼンショーホールディングス	55.6	52.2	72,453
幸楽苑ホールディングス	6.8	6.3	9,601
ハークスレイ	3	2.9	3,033
サイゼリヤ	17.8	16.6	33,382
ＶＴホールディングス	－	34.4	17,303
魚力	3	3.2	4,150
ポプラ	3.8	4	1,888
ユナイテッドアローズ	14.1	14.5	48,792
ハイデイ日高	8.2	9.3	24,021

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
京都きもの友禅	6.5	7.2	6,429
コロワイド	35.9	33.6	64,411
ピーシーデポコーポレーション	－	11.2	16,945
壱番屋	4.9	4.6	32,660
トップカルチャー	4.7	4.1	1,873
ＰＬＡＮＴ	2.7	2.4	2,901
スギホールディングス	19.4	18.2	101,192
スクロール	14	15.9	7,425
ヨンドシーホールディングス	8.3	7.8	19,991
ファミリーマート	36.6	31.2	185,016
木曽路	13.2	12.3	27,908
サトレストランシステムズ	10	12	9,564
千趣会	19.1	20.2	15,129
タカキュー	8	8.7	1,574
ケーヨー	19.9	17.2	9,202
上新電機	23	24	21,912
日本瓦斯	17.4	15.5	38,207
ベスト電器	40.3	35.8	3,938
ロイヤルホールディングス	18.1	16.7	34,769
東天紅	8	9	1,161
いなげや	12	11.4	16,370
島忠	28	26.2	64,766
チヨダ	12.7	12	32,604
ライフコーポレーション	6.8	6.5	20,117
リンガーハット	10.6	9.2	21,509
さが美	14	11	979
ＭｒＭａｘ	10.8	9.7	2,890
テンアライド	9.5	10.1	3,716
ＡＯＫＩホールディングス	24.8	22.9	27,022
オークワ	17	16	18,960
コメリ	18.4	15.5	42,051
青山商事	27.2	19.4	78,570
しまむら	12.6	11.8	168,740
ＣＦＳコーポレーション	7.3	－	－
はせがわ	3.7	5	2,035
髙島屋	157	148	113,368
松屋	21.8	20.8	17,472
エイチ・ツー・オー　リテイリング	51.1	51.9	83,766
近鉄百貨店	41	39	13,143

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
丸栄	20	24	2,184
ニッセンホールディングス	22.7	17.1	2,103
パルコ	10.5	9.9	9,048
丸井グループ	113.8	124.5	198,328
アクシアル　リテイリング	8.4	7.9	29,467
イオン	446.3	417.4	697,475
ユニーグループ・ホールディングス	103.6	97.1	78,942
イズミ	24.2	20.1	88,138
東武ストア	15	13	3,900
平和堂	21.9	20.6	46,638
フジ	11.9	11.4	26,527
ヤオコー	12.2	11.5	56,120
ゼビオホールディングス	14.6	13.7	21,632
ケーズホールディングス	24.9	21.4	74,900
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	6.6	6.4	3,520
日産東京販売ホールディングス	18.4	16.6	3,718
アインホールディングス	13	12.2	72,224
元気寿司	3.4	2.8	6,109
ヤマダ電機	427.7	308.5	154,558
アークランドサカモト	7.8	17.3	20,275
ニトリホールディングス	46.7	43.8	458,148
グルメ杵屋	8	7	6,888
愛眼	9.7	9.7	2,037
ケーユーホールディングス	5	5.1	3,646
吉野家ホールディングス	30.4	37.1	51,828
松屋フーズ	5.1	4.8	13,329
サガミチェーン	14	13.6	16,646
関西スーパーマーケット	8	8.1	8,083
王将フードサービス	7.9	7.4	27,158
プレナス	12.1	11.2	21,548
ミニストップ	8.1	7.6	13,619
アークス	18.7	18.9	47,930
バローホールディングス	23.3	21.9	64,013
藤久	0.7	0.8	1,404
ベルク	4.8	5	21,850
大庄	5.1	5.4	7,986
ファーストリテイリング	21.7	16.9	486,297
サンドラッグ	22.9	21.4	188,748
サックスバー　ホールディングス	8.2	9.7	11,804

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ヤマザワ	2	2	3,338
やまや	1.8	2	3,970
ベルーナ	26.3	25.4	15,290
銀行業（7.5%）			
島根銀行	2.2	2.4	2,995
じもとホールディングス	77	72.2	10,757
足利ホールディングス	67	74.7	24,800
東京ＴＹフィナンシャルグループ	13.9	14	36,414
九州フィナンシャルグループ	－	155.3	86,657
ゆうちょ銀行	－	260	340,860
富山第一銀行	－	23.8	12,542
コンコルディア・フィナンシャルグループ	－	707	349,682
新生銀行	1,030	878	151,016
あおぞら銀行	730	642	238,824
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	8,682.6	8,140.1	4,339,487
りそなホールディングス	1,266	1,186.9	506,212
三井住友トラスト・ホールディングス	2,392	2,118	764,598
三井住友フィナンシャルグループ	818.4	812.4	2,786,532
第四銀行	137	129	47,859
北越銀行	116	110	20,460
西日本シティ銀行	380	331	66,862
千葉銀行	417	391	218,960
横浜銀行	726	－	－
常陽銀行	391	367	143,130
群馬銀行	256	225	94,500
武蔵野銀行	17.3	16.3	44,841
千葉興業銀行	22.6	28.1	12,560
筑波銀行	45	42.2	12,533
七十七銀行	183	159	60,897
青森銀行	84	74	23,162
秋田銀行	71	67	20,502
山形銀行	65	57	23,028
岩手銀行	7.6	7.1	29,713
東邦銀行	96	91	32,396
東北銀行	58	51	7,344
みちのく銀行	54	50	9,250
ふくおかフィナンシャルグループ	439	439	166,381
静岡銀行	317	297	236,709
十六銀行	136	127	38,608

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
スルガ銀行	114.2	96.3	212,726
八十二銀行	196	183.5	90,282
山梨中央銀行	67	63	24,507
大垣共立銀行	135	136	45,560
福井銀行	93	88	18,392
北國銀行	121	109	34,880
清水銀行	3.7	3.6	8,964
富山銀行	－	2	7,050
滋賀銀行	108	95	43,890
南都銀行	103	97	31,137
百五銀行	104	92	37,076
京都銀行	207	194	137,352
紀陽銀行	42.5	39.8	55,202
三重銀行	49	46	9,246
ほくほくフィナンシャルグループ	736	690	91,770
広島銀行	319	299	119,002
山陰合同銀行	66	61.6	44,044
中国銀行	76.7	71.9	87,502
鳥取銀行	35	33	5,709
伊予銀行	115.7	108.5	79,747
百十四銀行	118	111	35,187
四国銀行	84	79	16,669
阿波銀行	89	82	46,658
鹿児島銀行	75	－	－
大分銀行	66	58	19,024
宮崎銀行	72	67	19,095
肥後銀行	88	－	－
佐賀銀行	65	62	14,384
十八銀行	67	63	16,569
沖縄銀行	8.6	7.8	29,484
琉球銀行	22.5	21	24,906
セブン銀行	364.9	380.1	159,642
みずほフィナンシャルグループ	15,088.2	14,380.2	2,456,138
高知銀行	44	41	4,305
山口フィナンシャルグループ	108	95	105,450
長野銀行	34	33	6,501
名古屋銀行	98	86	30,358
北洋銀行	163	153.7	45,187
愛知銀行	3.9	3.5	16,957

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
第三銀行	59	57	9,462
中京銀行	44	41	9,512
東日本銀行	47	－	－
大光銀行	39	37	7,030
愛媛銀行	63	59	13,924
トマト銀行	41	39	5,850
みなと銀行	98	93	16,554
京葉銀行	89	84	34,440
関西アーバン銀行	14.4	13.8	14,131
栃木銀行	54	53	22,472
北日本銀行	3.4	3.2	8,227
東和銀行	155	186	16,182
福島銀行	137	127	10,922
大東銀行	70	61	10,614
トモニホールディングス	83	78.6	25,702
フィデアホールディングス	64.7	82.2	12,987
池田泉州ホールディングス	102.5	106.9	43,935
証券、商品先物取引業（1.0%）			
ＦＰＧ	32.2	36.1	40,215
ＳＢＩホールディングス	130	121.8	152,493
日本アジア投資	88	－	－
ジャフコ	14.8	17	54,825
大和証券グループ本社	1,012	949	601,381
野村ホールディングス	2,212.3	1,952.1	906,164
岡三証券グループ	92	86	48,676
丸三証券	34.7	30.6	29,773
東洋証券	42	40	9,360
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	124.2	116.4	62,041
光世証券	26	27	3,429
水戸証券	33.7	32	8,928
いちよし証券	22.6	22.9	20,106
松井証券	54.6	48.7	47,287
だいこう証券ビジネス	5.2	5.1	3,707
マネックスグループ	127.9	118.8	33,264
カブドットコム証券	48	86.4	30,412
極東証券	14.5	13.8	17,595
岩井コスモホールディングス	11.1	9.8	9,760
藍澤證券	15.3	19	11,514
マネースクウェアＨＤ	4.4	3.7	3,463

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
マネーパートナーズグループ	12.2	9.8	6,330
保険業（2.3%）			
かんぽ生命保険	－	41.3	99,367
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	240.4	225.4	686,117
アニコム　ホールディングス	6.1	7	20,552
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホール	345	303.2	919,908
ソニーフィナンシャルホールディングス	103.7	97.2	126,360
第一生命保険	693.3	650	895,700
東京海上ホールディングス	438.4	411	1,543,716
Ｔ＆Ｄホールディングス	394.4	369.8	381,818
その他金融業（1.3%）			
全国保証	28.1	26.4	101,244
クレディセゾン	88.4	76.9	159,183
芙蓉総合リース	11.4	11.6	55,448
興銀リース	20.3	19.3	38,117
東京センチュリーリース	25.4	23.8	93,891
日本証券金融	48.5	46.4	21,483
アイフル	181.1	169.9	62,693
ポケットカード	8.5	10.7	5,863
リコーリース	8.6	8.1	24,624
イオンフィナンシャルサービス	71	66.6	161,571
アコム	217.4	203.8	128,801
ジャックス	60	57	28,215
オリエントコーポレーション	251.3	438.7	98,707
日立キャピタル	21.2	23.9	56,165
アプラスフィナンシャル	52.6	50.9	5,548
オリックス	766.1	718.4	1,102,384
三菱ＵＦＪリース	274.5	257.3	121,702
日本取引所グループ	158.9	297.9	462,638
イー・ギャランティ	3.2	3.4	8,734
アサックス	2	2.1	2,832
ＮＥＣキャピタルソリューション	4.5	4.3	6,587
不動産業（2.8%）			
いちごグループホールディングス	－	112.3	52,331
日本駐車場開発	119.2	122.5	15,190
ヒューリック	201	211.5	235,611
東京建物不動産販売	6.4	－	－
三栄建築設計	4.3	4.1	4,952
野村不動産ホールディングス	65.1	67.3	127,466

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三重交通グループホールディングス	20	18.4	8,390
サムティ	－	7.4	8,058
ディア・ライフ	－	7	2,590
エー・ディー・ワークス	－	99.9	4,195
日本商業開発	3.5	4.5	7,942
プレサンスコーポレーション	3.6	3.5	14,122
ユニゾホールディングス	6	6.4	36,416
日本管理センター	7.1	6.8	11,369
サンセイランディック	1.9	2.5	2,310
エストラスト	1.4	2.2	1,174
フージャースホールディングス	16.8	14.4	9,086
オープンハウス	7.8	14.8	39,516
東急不動産ホールディングス	283.6	245.4	179,878
飯田グループホールディングス	70.2	94	227,292
ムゲンエステート	－	1.5	3,595
パーク２４	54.5	51.2	166,656
パラカ	3.8	2.9	4,651
三井不動産	574	538	1,456,635
三菱地所	805	754	1,602,627
平和不動産	20.6	19.6	26,479
東京建物	236	110.8	153,901
ダイビル	28	26.6	26,999
京阪神ビルディング	18.1	17.3	10,207
住友不動産	259	243	744,309
大京	176	189	31,185
テーオーシー	37.4	39.7	37,476
東京楽天地	18	16	7,568
レオパレス２１	118.4	119.5	81,499
スターツコーポレーション	12.4	11.7	27,600
フジ住宅	14	12.7	9,042
空港施設	13.2	12.8	6,220
住友不動産販売	7.8	7.4	16,124
ゴールドクレスト	9.9	8.2	14,801
日本エスリード	4.4	4	4,332
日神不動産	14.5	13.1	4,899
タカラレーベン	48.3	44.8	32,524
サンヨーハウジング名古屋	6.2	5.3	5,029
イオンモール	69.8	65.5	96,612
ファースト住建	4.1	3.7	4,861

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
トーセイ	15.1	15.8	12,023
穴吹興産	11	11	2,827
エヌ・ティ・ティ都市開発	67.2	63	71,127
サンフロンティア不動産	11.8	12.4	15,413
エフ・ジェー・ネクスト	8.5	8.8	4,532
グランディハウス	10	9	3,051
日本空港ビルデング	37.4	32.4	118,746
サービス業（3.9%）			
日本工営	38	36	12,672
ネクスト	13.5	30.6	38,678
ジェイエイシーリクルートメント	－	6.6	10,573
日本Ｍ＆Ａセンター	17.7	16.6	112,382
ノバレーゼ	2.9	2.5	2,067
アコーディア・ゴルフ	43.1	29.5	29,618
中広	－	1	618
タケエイ	11.3	9.6	10,876
トラスト・テック	2	4.4	6,415
パソナグループ	8.6	9.6	6,662
ＣＤＳ	2.5	2.4	2,148
リンクアンドモチベーション	15.9	22.6	3,548
ＧＣＡサヴィアン	9.3	9.8	9,251
エス・エム・エス	12.9	13.5	29,551
テンプホールディングス	22.5	75.3	126,729
リニカル	3	6.4	13,139
クックパッド	7.3	24.2	39,131
エスクリ	4.1	5	2,875
アイ・ケイ・ケイ	6.4	5.8	3,619
学情	4.3	4.1	4,374
スタジオアリス	5.3	4.9	12,818
シミックホールディングス	5.2	5.5	8,888
ＮＪＳ	2.6	2.3	2,762
綜合警備保障	38.2	35.8	189,740
カカクコム	75.5	77.1	162,681
ルネサンス	6	5.5	6,528
ディップ	2.6	12	33,672
オプトホールディング	5	6.7	5,071
新日本科学	11.1	－	－
ツクイ	13.7	12.9	19,440
綜合臨床ホールディングス	6.1	－	－

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キャリアデザインセンター	3.1	2.4	2,304
エムスリー	99.1	93	302,715
ツカダ・グローバルホールディング	8.3	7.5	5,437
アウトソーシング	4.5	5.1	22,746
ウェルネット	4.1	4.1	16,687
ディー・エヌ・エー	56.5	48.1	104,521
博報堂ＤＹホールディングス	158.7	148.8	205,939
ぐるなび	13.4	12.5	36,012
エスアールジータカミヤ	9.2	11.7	5,194
一休	9.1	－	－
ジャパンベストレスキューシステム	13.9	13.9	3,266
ファンコミュニケーションズ	26.5	25	19,650
ジェイコムホールディングス	2.8	2.3	6,074
ＰＧＭホールディングス	16.3	－	－
ＷＤＢホールディングス	4.2	3.9	3,459
ティア	5.1	5.2	3,702
バリューコマース	9.6	10	3,600
インフォマート	－	20.6	19,879
ＪＰホールディングス	28.3	27.2	9,900
ＥＰＳホールディングス	10.5	13.3	19,072
レッグス	－	2.2	1,562
プレステージ・インターナショナル	8.8	9.1	13,067
アミューズ	3.5	6	13,194
ドリームインキュベータ	3.8	3.6	8,470
クイック	5.3	5.6	4,384
ＴＡＣ	7.4	7.6	1,603
ケネディクス	162.8	144.1	62,251
電通	127.6	119.7	658,350
テイクアンドギヴ・ニーズ	4.7	5.4	2,494
ぴあ	3.3	3.2	6,876
イオンファンタジー	3.8	3.8	10,035
シーティーエス	－	3.3	2,550
ネクシィーズグループ	4.2	3.9	7,761
みらかホールディングス	29.2	27.4	123,985
アルプス技研	4.7	4	9,024
サニックス	13.6	－	－
ダイオーズ	2	1.9	1,882
日本空調サービス	5.6	9.7	5,199
オリエンタルランド	123.8	116.1	859,140

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ダスキン	32.4	27.5	52,662
明光ネットワークジャパン	13.3	13.2	16,315
ファルコホールディングス	5.5	4.8	6,408
秀英予備校	3.7	2.5	1,025
田谷	2.5	2.6	1,773
ラウンドワン	33.1	34.2	24,008
リゾートトラスト	43.3	45	105,615
ビー・エム・エル	6.7	6.4	32,064
ワタベウェディング	4.3	3.8	1,653
りらいあコミュニケーションズ	21.4	18	19,710
リソー教育	－	20.4	8,241
早稲田アカデミー	1.9	1.3	1,094
ユー・エス・エス	138.6	130	217,360
東京個別指導学院	5.9	5.1	3,524
サイバーエージェント	28	28.2	143,820
楽天	498.1	502.4	594,339
テー・オー・ダブリュー	3.6	8.7	5,846
セントラルスポーツ	4	3.7	8,695
フルキャストホールディングス	12.1	10.2	8,333
リゾートソリューション	13	11	3,322
テクノプロ・ホールディングス	16.3	17.4	55,419
インターワークス	－	2.1	1,969
ＫｅｅＰｅｒ技研	－	0.8	1,410
ファーストロジック	－	0.6	1,491
リブセンス	6.8	7.6	3,465
ジャパンマテリアル	4.8	4.5	14,085
ベクトル	2.5	3.4	10,404
ウチヤマホールディングス	6.8	5.6	2,951
サクセスホールディングス	1.3	1.1	1,457
キャリアリンク	1.6	1.5	2,670
ＩＢＪ	－	8.4	4,888
アサンテ	3.8	4	5,524
Ｎ・フィールド	－	5.1	8,338
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	0.5	1.4	3,071
ライドオン・エクスプレス	－	2.4	3,218
ＥＲＩホールディングス	2.9	3	2,622
アビスト	1.4	1.7	3,590
ウィルグループ	1.3	2.5	2,565
日本ビューホテル	－	1.6	2,534

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
リクルートホールディングス	173.2	216.5	795,637
エラン	－	1.2	1,633
日本郵政	－	315.7	447,978
ベルシステム２４ホールディングス	－	21	19,257
リロ・ホールディング	3.9	4	61,920
東祥	2.5	3.2	13,952
エイチ・アイ・エス	18.7	17.4	49,659
ラックランド	－	1.5	2,541
共立メンテナンス	6.8	8.1	67,311
イチネンホールディングス	12	11.3	12,328
建設技術研究所	6.9	6.4	5,702
スペース	6.1	5.8	7,528
燦ホールディングス	2.3	2.1	2,902
スバル興業	8	8	3,008
東京テアトル	49	44	5,104
ナガワ	－	2	7,040
よみうりランド	23	22	10,318
東京都競馬	79	74	16,354
常磐興産	43	40	5,920
カナモト	16	15.1	37,901
東京ドーム	79	86	38,958
西尾レントオール	9.2	8.7	22,298
トランス・コスモス	14.9	12.5	39,437
乃村工藝社	22.5	23.2	39,532
藤田観光	42	40	20,240
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	55	52	8,788
日本管財	5.6	9.1	14,050
トーカイ	5	4.8	15,480
白洋舎	13	12	3,072
セコム	111.2	111.7	966,093
セントラル警備保障	5.1	4.8	10,512
丹青社	13.4	20.4	18,523
メイテック	15.3	13	49,660
アサツー　ディ・ケイ	21.5	18.8	51,098
応用地質	12	10.2	12,005
船井総研ホールディングス	12.5	15.1	24,899
進学会	5	4.7	2,561
オオバ	－	7.9	3,713
学究社	－	1.6	1,868
ベネッセホールディングス	41.9	36	88,236
イオンディライト	11	10.3	32,445
ナック	7.5	6.6	6,204
ニチイ学館	22.4	19	12,939
ダイセキ	18.4	20.2	43,147
ステップ	3.9	3.5	3,717
合計　株数・金額	183,713	171,074	204,519,272
合計　銘柄数＜比率＞	1,847	1,918	＜97.4%＞

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
国内	株式先物取引	ＴＯＰＩＸ	5,468	－

＜有価証券の貸付及び借入の状況＞

2016年５月20日現在における貸付株数の総株数は34,988,100株です。
うち利害関係人であるモルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券株式会社に対する貸付は、31,291,700株です。

＜新興国株式インデックスマザーファンド＞

下記は、新興国株式インデックスマザーファンド全体(20,343,223千口)の内容です。

外国株式

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AMBEV SA-ADR	85	85	44	4,856	食品・飲料・タバコ
AMERICA MOVIL-SPN ADR CL L	8	8	10	1,100	電気通信サービス
VALE SA-SP ADR	20	20	8	907	素材
PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	40	40	25	2,827	エネルギー
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	28	42	97	10,786	半導体・半導体製造装置
NETEASE INC-ADR	—	34	556	61,236	ソフトウェア・サービス
CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	—	114	488	53,786	小売
INFOSYS LTD-SP ADR	18	36	66	7,320	ソフトウェア・サービス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	153	168	167	18,439	素材
BAIDU INC - SPON ADR	—	117	1,983	218,348	ソフトウェア・サービス
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	400	453	400	44,084	電気通信サービス
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	—	57	231	25,464	消費者サービス
SOUTHERN COPPER CORP	122	138	372	40,979	素材
BANCO BRADESCO-ADR	35	38	26	2,908	銀行
ITAU UNIBANCO H-SPON PRF ADR	36	39	33	3,733	銀行
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	14	14	12	1,424	エネルギー
SASOL LTD-SPONSORED ADR	11	11	32	3,527	エネルギー
CREDICORP LTD	51	59	826	91,034	銀行
YY INC-ADR	—	13	60	6,704	ソフトウェア・サービス
TAL EDUCATION GROUP- ADR	—	17	94	10,359	消費者サービス
SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR	—	100	53	5,856	ソフトウェア・サービス
AK TRANSNEFT OAO-PREF	1	1	373	41,133	エネルギー
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	980	1,011	161	17,753	各種金融
SBERBANK OF RUSSIA PJSC	500	500	91	10,055	銀行
GAZPROM PAO	360	360	80	8,911	エネルギー
RUSHYDRO PJSC	100,000	104,640	105	11,567	公益事業
MMC NORILSK NICKEL PJSC	42	48	674	74,233	素材
LUKOIL PJSC	19	19	79	8,772	エネルギー
TATNEFT PAO-CLS	1,077	1,241	596	65,671	エネルギー
ROSNEFT OAO	909	1,020	510	56,181	エネルギー
VTB BANK PJSC	4,040,000	4,678,200	483	53,212	銀行
URALKALI PJSC	995	—	—	—	素材
SBERBANK-PREFERENCE	820	—	—	—	銀行
SURGUTNEFTEGAS	5,430	5,930	304	33,470	エネルギー
SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	5,230	6,337	405	44,683	エネルギー
SEVERSTAL PAO	158	184	196	21,622	素材
ROSTELECOM PJSC	650	650	94	10,426	電気通信サービス
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	—	24	79	8,777	小売
DP WORLD LTD	123	146	264	29,148	運輸
ALROSA PAO	1,410	1,597	185	20,402	素材
JD.COM INC-ADR	—	151	348	38,417	小売
QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	—	40	283	31,199	ソフトウェア・サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	—	171	179	19,804	小売
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	—	431	3,379	372,050	ソフトウェア・サービス
58.COM INC-ADR	—	31	154	16,995	ソフトウェア・サービス
SAMSUNG ELECTR-GDR	0.8	0.8	42	4,667	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（アメリカ）	百株	百株	千アメリカドル	千円	
HON HAI PRECISION-GDR REG S	99	104	46	5,163	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
RELIANCE INDS-SPONS GDR 144A	8	8	24	2,648	エネルギー
LUKOIL PJSC-SPON ADR	370	422	1,706	187,922	エネルギー
GAZPROM PAO -SPON ADR	4,359	4,945	2,175	239,452	エネルギー
SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	120	143	107	11,854	電気通信サービス
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	69	79	781	85,986	エネルギー
GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR	620	620	106	11,774	電気通信サービス
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	200	226	780	85,929	食品・生活必需品小売り
SBERBANK PAO -SPONSORED ADR	1,941	2,126	1,608	177,071	銀行
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	731	1,044	375	41,299	銀行
MEGAFON-REG S GDR	64	82	89	9,839	電気通信サービス
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	760	—	—	—	エネルギー
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	—	420	124	13,751	不動産
小計 株数・金額	4,169,071	4,814,567	22,595	2,487,539	
小計 銘柄数＜比率＞	45	56	—	＜7.2%＞	
（メキシコ）			千メキシコペソ		
ALFA S.A.B.-A	2,167	2,474	7,991	47,786	資本財
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	427	503	3,876	23,182	資本財
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	25,360	27,316	31,522	188,505	電気通信サービス
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	1,205	1,339	5,626	33,646	家庭用品・パーソナル用品
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	3,960	4,574	19,617	117,314	食品・生活必需品小売り
CEMEX SAB-CPO	9,713	12,234	14,411	86,181	素材
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	1,978	2,133	20,139	120,435	メディア
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,300	1,449	8,252	49,347	食品・飲料・タバコ
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	1,920	2,177	20,892	124,938	銀行
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	1,498	1,603	25,942	155,138	食品・飲料・タバコ
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	106	118	3,369	20,151	素材
MEXICHEM SAB DE CV-*	770	906	3,609	21,584	素材
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	323	437	6,369	38,090	食品・飲料・タバコ
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	2,943	3,329	13,528	80,900	素材
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	1,790	2,044	6,487	38,796	銀行
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	263	268	4,909	29,357	運輸
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	303	353	4,272	25,549	食品・飲料・タバコ
GENTERA SAB DE CV	780	921	3,010	18,004	各種金融
MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	547	—	—	—	素材
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	150	165	3,289	19,668	小売
GRUPO FIN SANTANDER-B	1,385	1,613	5,185	31,011	銀行
CONTROLADORA COML MEXIC-UBC	300	—	—	—	食品・生活必需品小売り
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	142	186	5,291	31,641	運輸
OHL MEXICO SAB DE CV	620	670	1,482	8,862	運輸
GENOMMA LAB INTERNACIONAL-B	580	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	260	290	1,359	8,128	食品・生活必需品小売り
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	209	217	4,711	28,176	運輸
GRUMA S.A.B.-B	138	171	4,523	27,050	食品・飲料・タバコ
GRUPO LALA SAB DE CV	420	552	2,492	14,903	食品・飲料・タバコ
小計 株数・金額	61,558	68,043	232,166	1,388,355	
小計 銘柄数＜比率＞	29	26	—	＜4.0%＞	
（ブラジル）			千ブラジルレアル		
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	568	663	357	11,047	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	170	201	234	7,231	公益事業
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	3,169	3,389	3,036	93,768	エネルギー
OI SA-PREFERENCE	209	—	—	—	電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジルレアル	千円	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	252	292	774	23,931	公益事業
GERDAU SA-PREF	589	729	413	12,764	素材
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	71	91	223	6,912	公益事業
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	258	343	1,409	43,532	電気通信サービス
VALE SA-PREF	1,498	1,708	2,023	62,500	素材
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	2,080	2,609	7,951	245,533	銀行
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	101	101	338	10,457	エネルギー
BRF SA	503	573	2,648	81,800	食品・飲料・タバコ
JBS SA	580	615	690	21,327	食品・飲料・タバコ
NATURA COSMETICOS SA	135	147	332	10,263	家庭用品・パーソナル用品
VALE SA	947	1,082	1,611	49,750	素材
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	355	—	—	—	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	276	316	2,210	68,257	エネルギー
TRACTEBEL ENERGIA SA	134	144	515	15,910	公益事業
PORTO SEGURO SA	82	104	270	8,349	保険
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	2,241	2,547	2,931	90,527	エネルギー
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	106	139	579	17,898	食品・生活必需品小売り
LOJAS RENNER S.A.	99	563	1,195	36,909	小売
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	382	494	768	23,735	小売
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	2,695	3,409	2,529	78,111	銀行
METALURGICA GERDAU SA-PREF	270	—	—	—	素材
AES TIETE SA-PREF	67	—	—	—	公益事業
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	180	202	244	7,535	公益事業
EMBRAER SA	512	586	1,119	34,562	資本財
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	185	—	—	—	公益事業
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	225	—	—	—	耐久消費財・アパレル
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	579	549	409	12,630	素材
SOUZA CRUZ SA	287	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CPFL ENERGIA SA	177	171	318	9,828	公益事業
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	150	170	207	6,409	公益事業
CCR SA	683	778	1,221	37,718	運輸
BM&FBOVESPA SA	1,380	1,511	2,493	76,988	各種金融
B2W CIA DIGITAL	85	112	118	3,672	小売
BRASKEM SA-PREF A	120	128	256	7,925	素材
BRADESPAR SA -PREF	160	—	—	—	素材
BANCO BRADESCO SA-PREF	1,932	2,461	6,066	187,343	銀行
BANCO DO BRASIL S.A.	659	756	1,340	41,391	銀行
CIELO SA	644	890	2,890	89,251	ソフトウェア・サービス
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	310	369	658	20,339	銀行
DURATEX SA	258	258	182	5,621	素材
SUZANO PAPEL E CELULO-PREF A	270	310	441	13,641	素材
FIBRIA CELULOSE SA	185	222	680	21,018	素材
HYPERMARCAS SA	255	309	923	28,520	家庭用品・パーソナル用品
BANCO BRADESCO S.A.	547	657	1,735	53,598	銀行
WEG SA	448	488	737	22,777	資本財
BR MALLS PARTICIPACOES SA	340	508	606	18,741	不動産
BANCO ESTADO RIO GRAN-PREF B	150	—	—	—	銀行
LOCALIZA RENT A CAR	113	133	450	13,922	運輸
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	58	67	381	11,793	不動産
SUL AMERICA SA - UNITS	134	150	225	6,960	保険
TIM PARTICIPACOES SA	663	749	522	16,137	電気通信サービス
RAIA DROGASIL SA	173	190	1,028	31,765	食品・生活必需品小売り

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	
M DIAS BRANCO SA	24	30	279	8,634	食品・飲料・タバコ
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	158	199	844	26,067	各種金融
CETIP SA-RTS	0.07	—	—	—	各種金融
ODONTOPREV S.A.	180	220	250	7,724	ヘルスケア機器・サービス
TOTVS SA	90	109	309	9,542	ソフトウェア・サービス
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	—	160	725	22,406	公益事業
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	75	91	172	5,339	公益事業
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	152	—	—	—	運輸
ESTACIO PARTICIPACOES SA	215	240	274	8,485	消費者サービス
LOJAS AMERICANAS SA	125	150	162	5,002	小売
QUALICORP SA	149	184	308	9,522	ヘルスケア機器・サービス
KROTON EDUCACIONAL SA	1,086	1,215	1,416	43,742	消費者サービス
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	539	614	1,701	52,539	保険
AMBEV SA	3,525	4,026	7,488	231,240	食品・飲料・タバコ
VIA VAREJO SA	87	—	—	—	小売
KLABIN SA - UNIT	360	477	852	26,322	素材
RUMO LOGISTICA OPERADORA MUL	—	700	268	8,278	運輸
小計 株数・金額	36,472	41,406	73,363	2,265,464	
小計 銘柄数＜比率＞	71	61	—	＜6.5%＞	
(チリ)			千チリペソ		
BANCO DE CREDITO E INVERSION	25	32	91,292	14,442	銀行
CENCOSUD SA	1,000	1,121	196,020	31,010	食品・生活必需品小売り
EMPRESAS CMPC SA	915	1,074	156,702	24,790	素材
COLBUN SA	6,000	7,017	120,360	19,041	公益事業
EMPRESAS COPEC SA	343	400	237,061	37,503	エネルギー
ITAU CORPBANCA	95,000	125,500	68,284	10,802	銀行
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	98	98	57,554	9,105	電気通信サービス
S.A.C.I. FALABELLA	720	426	207,439	32,816	小売
AES GENER SA	1,850	2,201	70,907	11,217	公益事業
AGUAS ANDINAS SA-A	2,200	2,210	82,307	13,020	公益事業
LATAM AIRLINES GROUP SA	240	255	111,761	17,680	運輸
VINA CONCHA Y TORO SA	360	—	—	—	食品・飲料・タバコ
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	2,540	2,881	174,394	27,589	公益事業
BANCO SANTANDER CHILE	51,300	58,371	186,790	29,550	銀行
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	69	85	125,189	19,804	素材
ENERSIS AMERICAS SA	15,010	17,259	188,799	29,868	公益事業
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	118	132	97,190	15,375	食品・飲料・タバコ
BANCO DE CHILE	18,341	20,658	145,660	23,043	銀行
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	200	220	51,462	8,141	食品・飲料・タバコ
SONDA SA	400	400	46,920	7,422	ソフトウェア・サービス
ENDESA AMERICAS SA	—	2,881	85,237	13,484	公益事業
ENERSIS CHILE SA	—	17,259	131,809	20,852	公益事業
小計 株数・金額	196,729	260,486	2,633,145	416,563	
小計 銘柄数＜比率＞	20	21	—	＜1.2%＞	
(コロンビア)			千コロンビアペソ		
GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	2,754	2,954	342,687	12,336	銀行
BANCO DAVIVIENDA SA	68	—	—	—	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF	333	376	1,011,440	36,411	銀行
ECOPETROL SA	3,420	3,983	563,622	20,290	エネルギー
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	65	67	253,260	9,117	各種金融
INTERCONEXION ELECTRICA SA	303	333	289,710	10,429	公益事業
GRUPO ARGOS SA	225	258	458,253	16,497	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	
(コロンビア)		百株	百株	千コロンビアペソ	千円	
ALMACENES EXITO SA		149	－	－	－	食品・生活必需品小売り
GRUPO DE INV SURAMERICANA		179	206	778,128	28,012	各種金融
CEMENTOS ARGOS SA		308	348	411,702	14,821	素材
ISAGEN SA ESP		580	－	－	－	公益事業
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF		77	85	320,386	11,533	各種金融
GRUPO ARGOS SA-PRF		90	－	－	－	素材
CEMEX LATAM HOLDINGS SA		112	－	－	－	素材
小計	株数・金額	8,663	8,612	4,429,189	159,450	
	銘柄数＜比率＞	14	9	－	＜0.5%＞	
(ユーロ…ギリシャ)				千ユーロ		
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA		191	217	197	24,366	電気通信サービス
ALPHA BANK AE		2,850	1,224	291	35,930	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE		1,265	4,665	138	17,082	銀行
EUROBANK ERGASIAS SA		5,770	1,598	166	20,498	銀行
TITAN CEMENT CO. S.A.		33	38	76	9,421	素材
PIRAEUS BANK S.A		1,630	5,815	165	20,433	銀行
PUBLIC POWER CORP		74	100	29	3,612	公益事業
OPAP SA		159	192	130	16,035	消費者サービス
FF GROUP		27	27	48	5,924	小売
JUMBO SA		85	91	110	13,565	小売
ユーロ計	株数・金額	12,085	13,971	1,353	166,870	
	銘柄数＜比率＞	10	10	－	＜0.5%＞	
(トルコ)				千トルコリラ		
AKBANK T.A.S.		1,700	1,931	1,489	54,866	銀行
TURKIYE IS BANKASI-C		1,157	1,358	595	21,920	銀行
TURKIYE GARANTI BANKASI		1,775	2,026	1,509	55,610	銀行
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS		663	775	827	30,471	電気通信サービス
YAPI VE KREDI BANKASI		690	745	293	10,813	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK VE		148	182	360	13,263	食品・飲料・タバコ
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE		93	107	689	25,385	エネルギー
HACI OMER SABANCI HOLDING		696	804	714	26,315	各種金融
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK		1,059	1,219	533	19,636	素材
KOC HOLDING AS		468	559	713	26,275	資本財
ARCELIK AS		160	211	410	15,137	耐久消費財・アパレル
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI		499	558	198	7,328	資本財
FORD OTOMOTIV SANAYI AS		58	64	222	8,196	自動車・自動車部品
TURK HAVA YOLLARI AO		418	474	290	10,686	運輸
ULKER BISKUVI SANAYI		107	127	271	10,012	食品・飲料・タバコ
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA		80	110	237	8,743	自動車・自動車部品
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D		530	656	285	10,523	銀行
COCA-COLA ICECEK AS		64	64	222	8,209	食品・飲料・タバコ
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS		130	140	207	7,659	運輸
TURKIYE HALK BANKASI		490	538	489	18,049	銀行
ENKA INSAAT VE SANAYI AS		411	451	192	7,078	資本財
TURK TELEKOMUNIKASYON AS		444	384	230	8,502	電気通信サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		170	186	1,122	41,339	食品・生活必需品小売り
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS		348	522	226	8,326	素材
小計	株数・金額	12,361	14,199	12,333	454,353	
	銘柄数＜比率＞	24	24	－	＜1.3%＞	
(チェコ)				千チェココルナ		
O2 CZECH REPUBLIC AS		68	56	1,278	5,827	電気通信サービス
CEZ AS		121	141	6,197	28,262	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	
(チェコ)		百株	百株	千チェココルナ	千円	
KOMERCNI BANKA AS		12	67	6,465	29,482	銀行
小計	株数・金額	201	265	13,941	63,573	
	銘柄数＜比率＞	3	3	－	＜0.2%＞	
(ハンガリー)				千ハンガリーフォリント		
RICHTER GEDEON NYRT		111	123	66,638	25,969	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OTP BANK PLC		170	208	139,156	54,229	銀行
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL		34	32	51,471	20,058	エネルギー
小計	株数・金額	315	363	257,267	100,256	
	銘柄数＜比率＞	3	3	－	＜0.3%＞	
(ポーランド)				千ポーランドズロチ		
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN		244	281	1,871	52,308	エネルギー
ORANGE POLSKA SA		455	572	338	9,455	電気通信サービス
PKO BANK POLSKI SA		675	765	1,786	49,935	銀行
BANK PEKAO SA		102	115	1,747	48,828	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA		108	122	761	21,297	素材
BANK ZACHODNI WBK SA		25	30	787	22,013	銀行
MBANK SA		11	13	401	11,220	銀行
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I		1,312	1,563	833	23,284	エネルギー
GRUPA LOTOS SA		78	78	238	6,671	エネルギー
EUROCASH SA		71	71	328	9,168	食品・生活必需品小売り
BANK MILLENNIUM SA		330	520	240	6,729	銀行
CYFROWY POLSAT SA		163	163	377	10,565	メディア
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA		26	29	222	6,207	銀行
PGE SA		636	741	889	24,859	公益事業
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE		42	491	1,707	47,718	保険
TAURON POLSKA ENERGIA SA		730	959	244	6,837	公益事業
ENEA SA		190	190	193	5,406	公益事業
SYNTHOS SA		430	430	167	4,675	素材
GETIN NOBLE BANK SA		820	－	－	－	銀行
GRUPA AZOTY SA		36	37	275	7,698	素材
ALIOR BANK SA		38	42	282	7,888	銀行
ENERGA SA		175	175	175	4,891	公益事業
LPP SA		0.66	1	575	16,090	耐久消費財・アパレル
CCC SA		18	20	324	9,069	耐久消費財・アパレル
小計	株数・金額	6,718	7,413	14,770	412,822	
	銘柄数＜比率＞	24	23	－	＜1.2%＞	
(香港)				千香港ドル		
PETROCHINA CO LTD-H		16,210	18,430	9,602	136,060	エネルギー
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H		19,560	22,240	11,364	161,036	エネルギー
CHINA UNICOM HONG KONG LTD		4,600	5,240	4,380	62,073	電気通信サービス
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H		－	820	1,213	17,196	ソフトウェア・サービス
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE		2,280	2,600	1,874	26,563	自動車・自動車部品
CITIC LTD		1,700	3,820	4,163	59,001	資本財
CNOOC LTD		13,680	15,580	14,084	199,574	エネルギー
YANZHOU COAL MINING CO-H		1,360	1,520	592	8,399	エネルギー
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H		2,810	2,970	1,095	15,529	素材
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H		1,000	1,340	1,093	15,494	運輸
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H		1,160	1,220	868	12,308	運輸
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN		960	1,080	1,820	25,801	食品・飲料・タバコ
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO		1,480	1,740	1,440	20,415	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD		400	440	740	10,486	資本財
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL		900	1,020	2,162	30,641	運輸

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	
COSCO PACIFIC LTD	1,340	1,580	1,235	17,507	運輸
BYD CO LTD-H	505	565	2,401	34,025	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD-H	10,560	12,160	4,462	63,236	電気通信サービス
DATANG INTL POWER GEN CO-H	2,100	2,360	472	6,688	公益事業
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	385	455	1,767	25,047	資本財
CHINA EVERBRIGHT LTD	660	800	1,128	15,983	各種金融
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	920	1,080	1,144	16,221	運輸
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	—	1,520	732	10,381	運輸
CHINA MOBILE LTD	4,690	5,350	44,619	632,251	電気通信サービス
HUANENG POWER INTL INC-H	2,720	3,720	1,923	27,252	公益事業
HUADIAN POWER INTL CORP-H	1,280	1,360	504	7,149	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	965	1,090	1,959	27,770	素材
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	3,120	3,640	2,486	35,228	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LENOVO GROUP LTD	5,080	6,320	3,166	44,866	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	840	1,422	1,999	28,330	保険
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	260	320	876	12,424	食品・飲料・タバコ
SINOTRANS LIMITED-H	1,450	1,590	532	7,547	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	3,200	3,420	796	11,291	素材
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	1,000	—	—	—	素材
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	1,560	1,880	988	14,012	資本財
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2,620	4,020	5,402	76,558	保険
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	5,700	6,500	10,699	151,604	保険
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	540	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	19,400	23,390	1,496	21,211	半導体・半導体製造装置
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	1,460	1,700	2,057	29,147	公益事業
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	3,150	3,150	504	7,141	運輸
CHINA MENGNIU DAIRY CO	1,060	2,420	2,976	42,178	食品・飲料・タバコ
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2,005	4,545	15,112	214,138	保険
AIR CHINA LTD-H	1,460	1,540	833	11,805	運輸
SINO BIOPHARMACEUTICAL	2,320	3,930	2,027	28,735	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	1,360	1,600	960	13,603	エネルギー
TENCENT HOLDINGS LTD	3,949	4,504	70,802	1,003,276	ソフトウェア・サービス
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	6,719	7,669	3,435	48,684	銀行
ZTE CORP-H	492	631	624	8,856	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	4,640	4,880	1,156	16,388	素材
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	55,235	73,315	33,138	469,574	銀行
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	700	876	859	12,177	不動産
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	430	490	1,813	25,690	耐久消費財・アパレル
CHINA POWER INTERNATIONAL	—	2,890	921	13,063	公益事業
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,100	2,400	1,848	26,186	自動車・自動車部品
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	2,180	2,540	822	11,661	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	2,615	2,980	3,409	48,307	エネルギー
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	1,200	1,360	718	10,175	素材
JIANGXI COPPER CO LTD-H	970	1,170	994	14,092	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1,280	1,720	758	10,748	ヘルスケア機器・サービス
BANK OF CHINA LTD-H	60,860	69,220	20,558	291,311	銀行
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	1,900	2,190	1,699	24,081	商業・専門サービス
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	1,090	1,200	1,160	16,442	不動産
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	570	645	3,886	55,066	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS BANK-H	3,475	4,020	6,087	86,253	銀行
IND & COMM BK OF CHINA-H	56,523	64,313	24,632	349,036	銀行
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	580	660	2,432	34,462	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	1,880	2,080	746	10,581	電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	3,370	3,870	3,258	46,173	資本財
CHINA COAL ENERGY CO-H	3,280	2,440	729	10,337	エネルギー
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	3,140	3,440	7,482	106,019	不動産
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	1,340	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	6,240	7,150	3,160	44,781	銀行
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	730	860	1,640	23,251	耐久消費財・アパレル
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	3,040	3,520	2,016	28,580	資本財
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	7,900	10,080	937	13,283	小売
HENGAN INTL GROUP CO LTD	560	640	4,249	60,216	家庭用品・パーソナル用品
CHINA RESOURCES LAND LTD	1,720	2,420	4,167	59,049	不動産
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1,480	1,740	1,592	22,560	資本財
GUANGDONG INVESTMENT LTD	1,920	2,480	2,643	37,460	公益事業
FOSUN INTERNATIONAL LTD	1,310	1,840	1,906	27,011	資本財
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	2,520	2,880	889	12,610	不動産
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	2,220	2,480	848	12,018	素材
SHUI ON LAND LTD	3,176	3,276	632	8,959	不動産
WEICHAI POWER CO LTD-H	342	824	716	10,146	資本財
CHINA COSCO HOLDINGS-H	2,040	2,270	597	8,459	運輸
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	3,550	4,080	1,864	26,420	耐久消費財・アパレル
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	4,430	5,120	2,764	39,177	食品・飲料・タバコ
KUNLUN ENERGY CO LTD	2,360	2,860	1,736	24,599	エネルギー
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	4,372	5,032	1,494	21,178	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	640	780	1,704	24,149	公益事業
SOHO CHINA LTD	1,380	1,720	660	9,359	不動産
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	3,220	3,860	1,752	24,832	公益事業
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	4,100	4,700	1,828	25,907	自動車・自動車部品
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	2,360	2,830	1,480	20,972	公益事業
CHINA MINSHENG BANKING-H	4,756	5,151	3,605	51,092	銀行
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2,002	2,300	5,842	82,781	保険
CRRC CORP LTD - H	1,500	3,845	2,757	39,069	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	380	455	1,867	26,466	資本財
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	16,540	20,150	5,400	76,520	銀行
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	4,500	3,640	1,863	26,408	不動産
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	1,626	1,906	1,643	23,290	自動車・自動車部品
SINOPHARM GROUP CO-H	916	1,044	3,654	51,777	ヘルスケア機器・サービス
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,560	1,540	1,632	23,131	公益事業
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	3,160	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LONGFOR PROPERTIES	1,160	1,295	1,256	17,799	不動産
CHINA RESOURCES CEMENT	1,460	—	—	—	素材
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	7,860	11,100	1,209	17,144	半導体・半導体製造装置
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	790	2,745	1,545	21,898	自動車・自動車部品
BBMG CORP-H	940	—	—	—	素材
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	2,500	3,220	621	8,806	不動産
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	1,420	1,560	1,597	22,635	資本財
CITIC SECURITIES CO LTD-H	820	1,900	2,941	41,676	各種金融
SUN ART RETAIL GROUP LTD	1,820	2,130	1,039	14,728	食品・生活必需品小売り
FAR EAST HORIZON LTD	1,390	1,590	901	12,774	各種金融
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	2,000	2,270	846	11,997	銀行
YUEXIU PROPERTY CO LTD	5,300	5,700	552	7,834	不動産
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	940	—	—	—	食品・飲料・タバコ
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	830	1,110	1,289	18,276	耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	520	600	987	13,994	ヘルスケア機器・サービス
CHINA SOUTH CITY HOLDINGS	2,100	—	—	—	不動産
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	992	2,836	3,323	47,098	各種金融
CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	373	474	456	6,468	資本財
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	—	1,680	771	10,926	不動産
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	570	688	1,668	23,641	保険
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	4,920	5,810	1,696	24,039	保険
HUANENG RENEWABLES CORP-H	—	3,340	771	10,932	公益事業
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	2,540	2,925	1,816	25,738	各種金融
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	870	930	956	13,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	275	335	641	9,085	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	530	530	620	8,786	資本財
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	890	1,105	710	10,067	資本財
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS	4,000	3,440	987	13,989	食品・飲料・タバコ
NEW WORLD CHINA LAND LTD	1,980	—	—	—	不動産
HANERGY THIN FILM POWER GROU	9,600	9,600	3,753	53,188	半導体・半導体製造装置
KINGSOFT CORP LTD	510	730	1,236	17,522	ソフトウェア・サービス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	4,220	7,740	1,865	26,431	各種金融
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	—	1,190	1,751	24,821	資本財
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	1,900	2,040	1,089	15,436	電気通信サービス
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	1,900	2,880	904	12,814	銀行
CHINA VANKE CO LTD-H	1,029	1,163	2,026	28,720	不動産
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	4,100	8,900	1,548	21,943	メディア
CHINA CNR CORP LTD-H	1,505	—	—	—	資本財
CGN POWER CO LTD-H	4,160	7,910	1,937	27,460	公益事業
DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	—	517	2,649	37,545	不動産
LUYE PHARMA GROUP LTD	—	1,170	558	7,908	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GF SECURITIES CO LTD-H	—	1,164	1,920	27,214	各種金融
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	—	1,290	1,893	26,834	各種金融
CAR INC	—	680	524	7,438	運輸
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBI-B	690	690	723	10,246	自動車・自動車部品
小計 株数・金額	550,285	665,443	488,886	6,927,518	
小計 銘柄数＜比率＞	139	140	—	＜20.0%＞	
(マレーシア)			千マレーシアリンギット		
GENTING MALAYSIA BHD	2,189	2,609	1,121	30,324	消費者サービス
GENTING BHD	1,626	1,967	1,701	45,990	消費者サービス
TELEKOM MALAYSIA BHD	820	969	649	17,548	電気通信サービス
TENAGA NASIONAL BHD	2,618	2,959	4,136	111,814	公益事業
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	363	367	845	22,855	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	3,470	4,257	3,609	97,576	銀行
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	449	552	165	4,483	消費者サービス
IOI CORP BHD	2,224	2,569	1,094	29,581	食品・飲料・タバコ
AMMB HOLDINGS BHD	1,530	1,720	749	20,270	銀行
YTL CORP BHD	3,374	3,872	619	16,748	公益事業
GAMUDA BHD	1,390	1,460	694	18,784	資本財
MISC BHD	820	985	728	19,702	運輸
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	3,600	3,600	1,566	42,328	銀行
PETRONAS GAS BHD	549	610	1,299	35,120	公益事業
SIME DARBY BERHAD	2,370	2,714	2,016	54,506	資本財
PUBLIC BANK BERHAD	2,062	2,114	4,037	109,140	銀行
UMW HOLDINGS BHD	440	490	268	7,258	自動車・自動車部品
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	99	111	569	15,391	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	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシアリンギット	千円	
RHB CAPITAL BHD	360	544	324	8,763	銀行
PPB GROUP BERHAD	368	406	649	17,558	食品・飲料・タバコ
IJM CORP BHD	1,233	2,688	935	25,284	資本財
DIGI.COM BHD	2,700	3,068	1,402	37,898	電気通信サービス
MAXIS BHD	1,460	1,647	897	24,262	電気通信サービス
AXIATA GROUP BERHAD	1,940	2,331	1,277	34,527	電気通信サービス
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	1,460	1,620	236	6,393	公益事業
HONG LEONG BANK BERHAD	410	580	773	20,913	銀行
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,120	2,459	1,563	42,272	素材
LAFARGE MALAYSIA BHD	335	335	285	7,705	素材
PETRONAS DAGANGAN BHD	183	214	499	13,489	エネルギー
AIRASIA BHD	1,000	1,000	234	6,325	運輸
BUMI ARMADA BERHAD	1,455	2,055	147	3,999	エネルギー
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	920	920	360	9,748	銀行
SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	2,860	2,957	473	12,788	エネルギー
UEM SUNRISE BHD	1,180	—	—	—	不動産
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	670	738	457	12,367	運輸
FELDA GLOBAL VENTURES	820	1,020	140	3,804	食品・飲料・タバコ
IHH HEALTHCARE BHD	1,930	2,160	1,395	37,716	ヘルスケア機器・サービス
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	185	208	308	8,343	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	—	497	382	10,330	資本財
GENTING PLANTATIONS BHD	150	195	206	5,576	食品・飲料・タバコ
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	1,170	1,377	382	10,347	メディア
WESTPORTS HOLDINGS BHD	—	932	398	10,782	運輸
DIALOG GROUP BHD	2,766	3,482	546	14,779	資本財
IOI PROPERTIES GROUP BHD	1,178	1,328	298	8,076	不動産
HARTALEGA HOLDINGS BHD	—	601	248	6,725	ヘルスケア機器・サービス
小計 株数・金額	58,847	69,289	40,703	1,100,208	
小計 銘柄数＜比率＞	42	44	—	＜3.2%＞	
(タイ)			千タイバーツ		
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	970	1,196	6,488	20,048	不動産
KASIKORNBANK PCL-NVDR	1,382	1,537	24,438	75,514	銀行
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	10,200	11,100	2,464	7,614	銀行
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	750	830	1,892	5,847	メディア
CP ALL PCL-NVDR	3,442	3,858	18,518	57,221	食品・生活必需品小売り
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	426	222	3,418	10,564	銀行
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	787	915	14,274	44,106	電気通信サービス
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,215	1,364	17,050	52,684	銀行
SIAM CEMENT PCL-NVDR	313	358	17,208	53,172	素材
PTT PCL-NVDR	761	875	26,512	81,923	エネルギー
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	1,075	1,226	9,195	28,412	エネルギー
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	313	377	14,816	45,781	運輸
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	720	860	1,040	3,215	エネルギー
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	2,240	2,640	7,656	23,657	食品・飲料・タバコ
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	900	1,200	3,630	11,216	素材
IRPC PCL - NVDR	8,300	8,980	4,382	13,541	エネルギー
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,285	1,771	10,408	32,161	素材
THAI OIL PCL-NVDR	650	692	4,342	13,417	エネルギー
KRUNG THAI BANK - NVDR	2,610	2,940	4,792	14,807	銀行
GLOW ENERGY PCL - NVDR	360	435	3,741	11,559	公益事業
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	2,500	3,406	8,106	25,048	ヘルスケア機器・サービス
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	1,460	1,652	3,667	11,332	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	
(タイ)	百株	百株	千タイバーツ	千円	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	2,980	3,320	2,971	9,181	小売
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	4,250	4,920	4,378	13,530	運輸
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	290	316	5,893	18,210	ヘルスケア機器・サービス
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	430	430	2,655	8,204	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRUE CORP PCL-NVDR	6,400	7,562	5,596	17,293	電気通信サービス
TRUE CORP PCL-NVDR-RTS	—	2,540	25	78	電気通信サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,370	1,521	5,817	17,977	消費者サービス
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	970	970	2,095	6,474	エネルギー
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	—	6,040	3,744	11,571	運輸
小計 株数・金額	59,349	76,055	241,220	745,372	
小計 銘柄数＜比率＞	29	31	—	＜2.1%＞	
(フィリピン)			千フィリピンペソ		
PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	74	85	14,501	34,077	電気通信サービス
SM PRIME HOLDINGS INC	6,405	7,265	17,581	41,316	不動産
AYALA LAND INC	5,430	6,453	23,230	54,592	不動産
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	620	660	6,138	14,424	銀行
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	400	450	2,846	6,688	運輸
MEGAWORLD CORP	8,300	9,990	4,245	9,977	不動産
JOLLIBEE FOODS CORP	337	379	8,862	20,827	消費者サービス
ENERGY DEVELOPMENT CORP	6,900	8,000	4,600	10,810	公益事業
SM INVESTMENTS CORP	117	137	13,553	31,850	資本財
AYALA CORPORATION	172	189	15,297	35,950	各種金融
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	1,470	1,677	11,915	28,002	資本財
ABOITIZ POWER CORP	1,100	1,321	6,069	14,264	公益事業
METROPOLITAN BANK & TRUST	305	265	2,265	5,324	銀行
BDO UNIBANK INC	1,250	1,436	15,086	35,453	銀行
DMCI HOLDINGS INC	2,850	3,536	4,596	10,802	資本財
UNIVERSAL ROBINA CORP	680	763	15,581	36,616	食品・飲料・タバコ
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	1,820	1,820	2,649	6,227	資本財
JG SUMMIT HOLDINGS INC	1,850	2,197	20,492	48,157	資本財
GLOBE TELECOM INC	26	28	6,232	14,647	電気通信サービス
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	9,200	11,200	6,854	16,107	各種金融
ROBINSONS LAND CO	—	1,450	4,212	9,898	不動産
GT CAPITAL HOLDINGS INC	—	69	9,924	23,321	各種金融
小計 株数・金額	49,306	59,374	216,739	509,338	
小計 銘柄数＜比率＞	20	22	—	＜1.5%＞	
(インドネシア)			千インドネシアルピア		
KALBE FARMA TBK PT	15,400	18,261	2,556,540	20,963	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	38,850	44,027	15,981,801	131,050	電気通信サービス
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	3,350	3,782	2,637,945	21,631	食品・飲料・タバコ
HM SAMPOERNA TBK PT	—	328	3,129,940	25,665	食品・飲料・タバコ
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	9,360	10,750	13,948,125	114,374	銀行
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	1,200	1,272	1,974,780	16,193	素材
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	15,330	17,669	11,043,125	90,553	自動車・自動車部品
GUDANG GARAM TBK PT	385	415	2,946,500	24,161	食品・飲料・タバコ
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	8,400	9,698	9,382,815	76,939	銀行
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	340	340	505,750	4,147	食品・飲料・タバコ
BANK DANAMON INDONESIA TBK	2,810	2,810	814,900	6,682	銀行
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	2,310	2,554	2,260,290	18,534	素材
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	8,085	9,575	2,116,075	17,351	公益事業
UNITED TRACTORS TBK PT	1,310	1,433	1,938,132	15,892	資本財
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	565	—	—	—	エネルギー

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(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	15,500	17,464	1,641,616	13,461	不動産
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	7,090	8,177	7,318,415	60,011	銀行
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,200	1,342	5,743,760	47,098	家庭用品・パーソナル用品
ADARO ENERGY TBK PT	10,400	12,400	837,000	6,863	エネルギー
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	1,400	1,700	892,500	7,318	運輸
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	5,650	6,606	2,880,216	23,617	銀行
INDO TAMBANGRAYA MEGAH TBK P	220	—	—	—	エネルギー
AKR CORPORINDO TBK PT	—	1,543	952,802	7,812	資本財
CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	5,500	6,403	2,112,990	17,326	食品・飲料・タバコ
XL AXIATA TBK PT	2,250	2,450	793,800	6,509	電気通信サービス
XL AXIATA TBK PT-RTS	—	612	11,270	92	電気通信サービス
SUMMARECON AGUNG TBK PT	—	8,500	1,300,500	10,664	不動産
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	3,850	4,402	1,003,656	8,229	メディア
BUMI SERPONG DAMAI PT	6,200	7,017	1,259,551	10,328	不動産
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	910	990	1,576,575	12,927	食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,350	1,756	1,101,890	9,035	電気通信サービス
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	4,650	5,000	1,675,000	13,735	メディア
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	4,400	5,800	646,700	5,302	メディア
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	1,660	2,057	3,671,745	30,108	小売
小計 株数・金額	179,925	217,133	106,656,705	874,584	
小計 銘柄数＜比率＞	30	32	—	＜2.5%＞	
(韓国)			千韓国ウォン		
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	84	96	12,311,380	1,143,727	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KOREA ELECTRIC POWER CORP	195	224	1,368,840	127,165	公益事業
SHINSEGAE CO LTD	4	6	137,280	12,753	小売
CJ CORP	11	12	284,900	26,467	資本財
SAMSUNG C&T CORP	95	—	—	—	資本財
SK TELECOM	7	17	372,164	34,574	電気通信サービス
HYUNDAI MOTOR CO	119	140	1,883,000	174,930	自動車・自動車部品
POSCO	50	60	1,242,360	115,415	素材
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	44	52	265,630	24,677	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KT CORP	22	22	70,762	6,573	電気通信サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	45	49	174,552	16,215	各種金融
HYUNDAI MOBIS CO LTD	52	59	1,445,300	134,268	自動車・自動車部品
CHEIL WORLDWIDE INC	66	72	114,234	10,612	メディア
KB FINANCIAL GROUP INC	296	337	1,140,412	105,944	銀行
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	25	31	894,240	83,074	保険
SAMSUNG SDI CO LTD	42	48	514,288	47,777	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	328	372	1,514,447	140,692	銀行
LG ELECTRONICS INC	82	93	504,954	46,910	耐久消費財・アパレル
AMOREPACIFIC GROUP	21	24	401,795	37,326	家庭用品・パーソナル用品
HYUNDAI DEPT STORE CO	10	13	185,640	17,245	小売
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	22	24	190,190	17,668	資本財
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	41	41	119,515	11,102	資本財
KT&G CORP	84	96	1,209,600	112,371	食品・飲料・タバコ
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	82	—	—	—	資本財
NCSOFT CORP	11	15	359,600	33,406	ソフトウェア・サービス
LG DISPLAY CO LTD	179	203	499,310	46,385	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	31	36	373,195	34,669	資本財
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	118	130	115,706	10,749	資本財
AMOREPACIFIC CORP	24	28	1,168,960	108,596	家庭用品・パーソナル用品
HANA FINANCIAL GROUP	218	258	639,236	59,385	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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	42	50	210,500	19,555	資本財
LG CHEM LTD	34	40	1,102,970	102,465	素材
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	47	41	95,735	8,893	資本財
LS CORP	12	—	—	—	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	7	8	834,974	77,569	家庭用品・パーソナル用品
SK INNOVATION CO LTD	45	56	850,500	79,011	エネルギー
KAKAO CORP	19	25	258,774	24,040	ソフトウェア・サービス
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	31	35	150,850	14,013	各種金融
HANMI SCIENCE CO LTD	—	9	136,081	12,641	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COWAY CO LTD	42	47	471,156	43,770	耐久消費財・アパレル
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	16	66	161,587	15,011	各種金融
S-1 CORPORATION	13	16	164,670	15,297	商業・専門サービス
DOOSAN INFRACORE CO LTD	107	—	—	—	資本財
KIA MOTORS CORP	202	230	1,075,282	99,893	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	446	508	1,352,876	125,682	半導体・半導体製造装置
LG CORP	73	83	538,304	50,008	資本財
SK HOLDINGS CO LTD	19	—	—	—	資本財
HYUNDAI STEEL CO	52	70	361,011	33,537	素材
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	15	16	1,706,928	158,573	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OCI CO LTD	13	14	151,525	14,076	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	213	245	286,884	26,651	銀行
KANGWON LAND INC	92	103	437,805	40,672	消費者サービス
NAVER CORP	21	24	1,713,244	159,160	ソフトウェア・サービス
DAEWOO SECURITIES CO LTD	132	160	130,554	12,128	各種金融
CELLTRION INC	50	60	560,883	52,106	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KOREA GAS CORPORATION	22	22	93,600	8,695	公益事業
LG UPLUS CORP	162	188	213,720	19,854	電気通信サービス
LOTTE SHOPPING CO	8	9	229,670	21,336	小売
YUHAN CORP	5	6	197,345	18,333	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONGBU INSURANCE CO LTD	34	37	267,750	24,873	保険
S-OIL CORP	33	38	322,758	29,984	エネルギー
KCC CORP	4	5	204,455	18,993	資本財
POSCO DAEWOO CORP	32	41	97,813	9,086	資本財
SAMSUNG CARD CO	25	30	120,664	11,209	各種金融
LS INDUSTRIAL SYSTEMS	9	—	—	—	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	27	27	259,347	24,093	自動車・自動車部品
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	56	68	225,992	20,994	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	28	30	85,267	7,921	運輸
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	61	69	733,950	68,183	保険
LOTTE CHEMICAL CORP	11	13	384,075	35,680	素材
GS HOLDINGS	38	45	228,600	21,236	エネルギー
NH INVESTMENT & SECURITIES C	113	121	110,707	10,284	各種金融
HANWHA CHEMICAL CORP	86	92	218,308	20,280	素材
HYOSUNG CORPORATION	18	19	217,560	20,211	素材
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	9	—	—	—	資本財
HANWHA CORPORATION	34	40	153,984	14,305	資本財
CJ CHEILJEDANG CORP	6	6	271,092	25,184	食品・飲料・タバコ
BNK FINANCIAL GROUP INC	142	230	199,266	18,511	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	14	16	296,240	27,520	運輸
DGB FINANCIAL GROUP INC	123	143	126,412	11,743	銀行
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	18	18	171,495	15,931	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	6	7	355,365	33,013	素材

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
E-MART INC	15	18	338,560	31,452	食品・生活必需品小売り
HYUNDAI WIA CORP	12	13	125,378	11,647	自動車・自動車部品
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	9	11	71,530	6,645	素材
DOOSAN CORP	6	6	60,840	5,652	資本財
SK HOLDINGS CO LTD	15	30	692,582	64,340	資本財
ORION CORP	2	3	306,900	28,511	食品・飲料・タバコ
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	44	55	178,560	16,588	保険
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	35	51	322,164	29,929	資本財
SK NETWORKS CO LTD	86	97	58,103	5,397	資本財
HYUNDAI MERCHANT MARINE	70	—	—	—	運輸
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	0.5	5	125,970	11,702	食品・飲料・タバコ
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	167	193	123,516	11,474	保険
LG INNOTEK CO LTD	10	12	97,020	9,013	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG CHEM LTD-PREFERENCE	6	6	118,440	11,003	素材
HANKOOK TIRE CO LTD	54	65	334,270	31,053	自動車・自動車部品
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	78	89	51,887	4,820	資本財
HANON SYSTEMS	30	159	182,055	16,912	自動車・自動車部品
HITE JINRO CO LTD	16	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CJ E&M CORP	—	17	123,840	11,504	メディア
DONGSUH COMPANIES INC	—	29	94,764	8,803	食品・生活必需品小売り
PARADISE CO LTD	33	37	58,090	5,396	消費者サービス
CJ KOREA EXPRESS CORP	5	5	120,350	11,180	運輸
HOTEL SHILLA CO LTD	26	29	199,995	18,579	小売
HANSSEM CO LTD	8	8	147,795	13,730	耐久消費財・アパレル
WOORI BANK	232	291	300,214	27,889	銀行
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	16	20	149,124	13,853	商業・専門サービス
SAMSUNG SDS CO LTD	20	27	483,735	44,938	ソフトウェア・サービス
SAMSUNG C&T CORP	13	66	776,763	72,161	資本財
AMOREPACIFIC CORP-PREF	—	7	169,875	15,781	家庭用品・パーソナル用品
HANMI PHARM CO LTD	—	4	256,480	23,826	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BGF RETAIL CO LTD	—	7	159,220	14,791	食品・生活必需品小売り
GS RETAIL CO LTD	—	23	128,934	11,977	食品・生活必需品小売り
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	—	0.54	106,434	9,887	食品・飲料・タバコ
OTTOGI CORPORATION	—	1	91,770	8,525	食品・飲料・タバコ
小計 株数・金額	6,319	7,217	54,595,186	5,071,892	
小計 銘柄数＜比率＞	107	107	—	＜14.6%＞	
(台湾)			千ニュー台湾ドル		
COMPAL ELECTRONICS	3,237	3,747	6,614	22,225	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA ELECTRONICS INC	1,382	1,702	23,490	78,927	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	2,520	2,831	6,257	21,024	資本財
FORMOSA PLASTICS CORP	3,136	3,616	27,445	92,216	素材
HON HAI PRECISION INDUSTRY	9,421	12,337	91,545	307,592	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNITED MICROELECTRONICS CORP	9,040	10,650	12,247	41,151	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	3,615	4,155	24,684	82,938	素材
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	430	500	12,050	40,488	食品・生活必需品小売り
SILICONWARE PRECISION INDS	2,230	1,930	8,800	29,570	半導体・半導体製造装置
TAIWAN CEMENT	2,567	2,907	8,052	27,056	素材
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	18,740	21,230	312,081	1,048,592	半導体・半導体製造装置
ASUSTEK COMPUTER INC	547	617	15,721	52,824	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	387	387	3,506	11,781	半導体・半導体製造装置
QUANTA COMPUTER INC	2,121	2,371	13,066	43,905	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	6,203	7,123	25,039	84,133	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	
(台湾)	百株	百株	千ニュー台湾ドル	千円	
ACER INC	2,151	2,591	2,915	9,796	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	6,021	8,537	7,760	26,075	銀行
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	4,735	5,545	16,083	54,039	半導体・半導体製造装置
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	2,504	2,824	22,537	75,727	素材
WAN HAI LINES LTD	520	—	—	—	運輸
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	5,120	5,810	21,093	70,874	各種金融
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	347	419	3,126	10,505	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDIATEK INC	1,082	1,302	26,047	87,518	半導体・半導体製造装置
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	5,876	7,046	8,244	27,701	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	10,671	13,408	21,855	73,435	銀行
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,304	1,464	16,177	54,355	電気通信サービス
CHINA STEEL CORP	9,009	10,329	20,245	68,025	素材
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	430	510	5,253	17,650	半導体・半導体製造装置
ADVANTECH CO LTD	238	268	6,130	20,599	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	675	802	5,680	19,088	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	490	580	12,760	42,873	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AU OPTRONICS CORP	6,520	7,630	6,416	21,560	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
U-MING MARINE TRANSPORT CORP	270	—	—	—	運輸
EPISTAR CORP	760	—	—	—	半導体・半導体製造装置
HTC CORP	497	587	3,636	12,217	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINSUS INTERCONNECT TECH	230	—	—	—	半導体・半導体製造装置
POWERTECH TECHNOLOGY INC	593	553	3,572	12,003	半導体・半導体製造装置
INVENTEC CORP	1,834	1,954	4,006	13,461	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	2,880	3,320	36,354	122,149	電気通信サービス
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	231	231	2,477	8,322	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PHISON ELECTRONICS CORP	100	120	2,964	9,959	半導体・半導体製造装置
WPG HOLDINGS LTD	1,044	1,274	4,306	14,468	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CLEVO COMPANY	284	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GIANT MANUFACTURING	220	240	4,308	14,474	耐久消費財・アパレル
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	370	—	—	—	不動産
FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS	22	—	—	—	消費者サービス
RUENTEX INDUSTRIES LTD	410	470	2,063	6,932	耐久消費財・アパレル
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	981	1,211	3,773	12,678	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	6,668	8,433	8,601	28,902	各種金融
INNOLUX CORP	6,151	7,291	6,613	22,219	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	4,871	5,643	8,889	29,867	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	5,949	6,892	4,239	14,243	保険
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	1,240	1,400	10,542	35,421	電気通信サービス
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,264	1,434	9,465	31,803	自動車・自動車部品
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	881	1,011	8,931	30,009	エネルギー
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	7,597	9,517	21,795	73,231	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	5,760	8,045	12,872	43,251	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	77	84	21,892	73,557	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	3,636	4,226	25,103	84,348	食品・飲料・タバコ
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	3,755	4,109	6,636	22,299	銀行
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	10,392	12,012	9,153	30,755	銀行
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,624	1,852	7,566	25,424	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASIA CEMENT CORP	1,662	2,072	4,954	16,645	素材
YULON MOTOR COMPANY	600	790	2,073	6,967	自動車・自動車部品
POU CHEN	1,585	1,965	8,213	27,598	耐久消費財・アパレル
WISTRON CORP	1,871	2,049	3,760	12,634	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	620	650	2,704	9,085	素材

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(台湾)	百株	百株	千ニュー台湾ドル	千円	
INOTERA MEMORIES INC	1,680	1,960	5,752	19,328	半導体・半導体製造装置
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	1,010	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEGATRON CORP	1,219	1,719	10,524	35,363	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA AIRLINES LTD	2,080	2,260	2,282	7,669	運輸
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	4,821	6,310	10,885	36,576	銀行
WALSIN LIHWA CORP	2,700	—	—	—	資本財
FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	788	—	—	—	小売
TPK HOLDING CO LTD	204	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	2,176	2,813	6,486	21,793	保険
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	135	170	2,205	7,409	資本財
TAIWAN GLASS IND CORP	669	—	—	—	資本財
EVA AIRWAYS CORP	1,290	1,750	2,406	8,085	運輸
EVERGREEN MARINE CORP LTD	1,319	1,533	1,717	5,769	運輸
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	5,057	6,320	8,596	28,883	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	190	220	6,314	21,215	小売
TECO ELECTRIC & MACHINERY	1,380	1,700	4,148	13,937	資本財
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	335	365	1,711	5,749	半導体・半導体製造装置
CTCI CORP	460	—	—	—	資本財
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	610	760	2,595	8,720	不動産
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	500	650	3,029	10,177	不動産
TAIWAN BUSINESS BANK	2,803	3,798	2,997	10,070	銀行
STANDARD FOODS CORP	278	305	2,348	7,891	食品・飲料・タバコ
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	210	340	1,781	5,986	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FORMOSA TAFFETA CO.	660	680	1,938	6,511	耐久消費財・アパレル
CHAILEASE HOLDING CO LTD	716	874	4,285	14,400	各種金融
SCINOPHARM TAIWAN LTD	163	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRANSCEND INFORMATION INC	140	180	1,539	5,171	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HERMES MICROVISION INC	30	32	3,298	11,083	半導体・半導体製造装置
MERIDA INDUSTRY CO LTD	177	177	2,185	7,344	耐久消費財・アパレル
CHINA MOTOR CORP	360	—	—	—	自動車・自動車部品
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	560	720	3,758	12,628	半導体・半導体製造装置
YANG MING MARINE TRANSPORT	880	—	—	—	運輸
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	124	164	4,821	16,200	耐久消費財・アパレル
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	1,400	1,600	1,640	5,510	電気通信サービス
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	—	267	3,313	11,132	耐久消費財・アパレル
CASETEK HOLDINGS LTD	—	120	1,362	4,576	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OBI PHARMA INC	—	90	4,275	14,364	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	237,352	272,506	1,152,602	3,872,742	
小計 銘柄数＜比率＞	101	88	—	＜11.2%＞	
(インド)			千インドルピー		
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	1,144	1,307	153,718	252,098	銀行
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	361	412	105,550	173,103	ソフトウェア・サービス
ITC LTD	1,694	1,962	63,755	104,558	食品・飲料・タバコ
HINDUSTAN UNILEVER LTD	575	662	53,984	88,533	家庭用品・パーソナル用品
JINDAL STEEL & POWER LTD	300	—	—	—	素材
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	450	532	6,351	10,416	資本財
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	575	752	15,806	25,922	エネルギー
HINDALCO INDUSTRIES LTD	900	960	8,356	13,705	素材
COAL INDIA LTD	530	612	17,162	28,146	エネルギー
GAIL INDIA LTD	230	338	12,620	20,697	公益事業
AMBUJA CEMENTS LTD	490	606	12,949	21,236	素材
HERO MOTOCORP LTD	39	44	12,750	20,911	自動車・自動車部品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円	
BAJAJ AUTO LTD	63	74	18,095	29,676	自動車・自動車部品
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	651	839	66,538	109,122	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADANI ENTERPRISES LTD	108	—	—	—	資本財
ASIAN PAINTS LTD	212	251	24,101	39,526	素材
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	117	131	14,498	23,777	各種金融
VEDANTA LTD	900	803	7,630	12,513	素材
TATA POWER CO LTD	860	930	6,361	10,432	公益事業
BHARTI AIRTEL LTD	460	1,047	36,128	59,250	電気通信サービス
CIPLA LTD	260	305	15,657	25,678	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NTPC LTD	1,290	1,018	13,781	22,601	公益事業
INFOSYS LTD	686	1,563	188,555	309,230	ソフトウェア・サービス
ULTRATECH CEMENT LTD	28	30	9,600	15,744	素材
ACC LTD	38	38	5,357	8,786	素材
DLF LTD	370	—	—	—	不動産
DR. REDDY'S LABORATORIES	90	103	31,284	51,306	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ICICI BANK LTD	847	971	21,916	35,943	銀行
LUPIN LTD	—	193	32,016	52,506	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	—	92	36,399	59,695	自動車・自動車部品
RELIANCE INDUSTRIES LTD	977	1,112	105,801	173,515	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	1,140	1,363	23,542	38,609	銀行
TATA STEEL LTD	253	253	8,254	13,536	素材
LIC HOUSING FINANCE LTD	205	246	11,226	18,411	銀行
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	134	74	7,027	11,524	エネルギー
IDEA CELLULAR LTD	820	965	10,380	17,024	電気通信サービス
CAIRN INDIA LTD	330	404	5,471	8,973	エネルギー
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	98	102	14,021	22,995	家庭用品・パーソナル用品
RURAL ELECTRIFICATION CORP	252	252	3,965	6,502	各種金融
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	392	507	22,249	36,488	メディア
POWER FINANCE CORPORATION	185	215	3,637	5,965	各種金融
DABUR INDIA LTD	380	470	13,244	21,720	家庭用品・パーソナル用品
JSW STEEL LTD	55	75	9,901	16,238	素材
LARSEN & TOUBRO LTD	239	277	35,096	57,557	資本財
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	70	—	—	—	公益事業
UNITED SPIRITS LTD	34	51	12,543	20,571	食品・飲料・タバコ
SIEMENS LTD	52	61	6,996	11,474	資本財
WIPRO LTD	462	540	29,351	48,137	ソフトウェア・サービス
AXIS BANK LTD	—	523	25,697	42,143	銀行
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	268	326	42,858	70,287	自動車・自動車部品
TATA MOTORS LTD	617	724	28,046	45,996	自動車・自動車部品
HCL TECHNOLOGIES LTD	374	493	36,059	59,137	ソフトウェア・サービス
UNITED BREWERIES LTD	56	56	4,137	6,786	食品・飲料・タバコ
DIVI'S LABORATORIES LTD	33	71	7,583	12,437	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	375	732	12,558	20,595	運輸
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	52	65	8,586	14,081	ヘルスケア機器・サービス
OIL INDIA LTD	88	—	—	—	エネルギー
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	560	760	3,868	6,344	電気通信サービス
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	8	8	5,003	8,205	食品・飲料・タバコ
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	57	57	8,215	13,473	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADITYA BIRLA NUVO LTD	29	—	—	—	資本財
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	215	233	6,844	11,224	各種金融
NESTLE INDIA LTD	16	20	12,488	20,481	食品・飲料・タバコ
TECH MAHINDRA LTD	187	194	9,423	15,454	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	
(インド)		百株	百株	千インドルピー	千円	
AUROBINDO PHARMA LTD		104	232	17,868	29,304	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD		167	267	7,253	11,895	自動車・自動車部品
BOSCH LTD		5	6	13,957	22,889	自動車・自動車部品
SHREE CEMENT LTD		—	7	10,017	16,428	素材
CONTAINER CORP OF INDIA LTD		—	30	4,112	6,743	運輸
MARICO LTD		—	382	9,494	15,571	家庭用品・パーソナル用品
BHARTI INFRATEL LTD		—	478	18,398	30,173	電気通信サービス
EICHER MOTORS LTD		—	10	19,565	32,087	資本財
BHARAT FORGE LTD		—	93	6,717	11,016	自動車・自動車部品
UPL LTD		—	248	13,925	22,837	素材
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD		—	118	10,078	16,528	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INDIABULLS HOUSING FINANCE L		—	259	17,948	29,435	銀行
ASHOK LEYLAND LTD		—	1,012	10,324	16,932	資本財
CADILA HEALTHCARE LTD		—	180	5,870	9,627	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TATA MOTORS LTD-A-DVR		—	310	8,249	13,528	自動車・自動車部品
小計	株数・金額	23,562	31,466	1,698,795	2,786,024	
	銘柄数＜比率＞	64	73	—	＜8.0%＞	
(アラブ首長国連邦)				千アラブディルハム		
EMAAR PROPERTIES PJSC		2,745	3,066	1,901	57,097	不動産
ALDAR PROPERTIES PJSC		2,590	2,590	665	19,988	不動産
ABU DHABI COMMERCIAL BANK		890	1,640	939	28,219	銀行
NATIONAL BANK OF ABU DHABI		484	584	490	14,731	銀行
ARABTEC HOLDING CO PJSC		1,774	1,904	266	8,006	資本財
FIRST GULF BANK		675	761	890	26,737	銀行
DUBAI FINANCIAL MARKET PJSC		1,520	1,670	207	6,218	各種金融
DUBAI ISLAMIC BANK		780	830	448	13,459	銀行
EMAAR MALLS GROUP PJSC		—	1,600	416	12,492	不動産
EMIRATES TELECOM GROUP CO		—	1,518	2,672	80,262	電気通信サービス
小計	株数・金額	11,458	16,164	8,898	267,215	
	銘柄数＜比率＞	8	10	—	＜0.8%＞	
(カタール)				千カタールリアル		
MASRAF AL RAYAN		281	307	1,019	30,872	銀行
OOREDOO QSC		61	66	574	17,412	電気通信サービス
QATAR NATIONAL BANK		135	183	2,494	75,556	銀行
INDUSTRIES QATAR		114	126	1,253	37,971	資本財
VODAFONE QATAR		265	285	319	9,685	電気通信サービス
QATAR ELECTRICITY & WATER CO		21	23	473	14,330	公益事業
QATAR ISLAMIC BANK		43	49	470	14,243	銀行
BARWA REAL ESTATE CO		77	83	263	7,994	不動産
COMMERCIAL BANK QSC		67	134	498	15,110	銀行
DOHA BANK QSC		55	103	368	11,160	銀行
GULF INTERNATIONAL SERVICES		30	—	—	—	エネルギー
QATAR INSURANCE CO		—	105	813	24,629	保険
QATAR INSURANCE CO-NEW		—	16	130	3,950	保険
EZDAN HOLDING GROUP		—	666	1,168	35,403	不動産
QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)		—	234	540	16,357	エネルギー
小計	株数・金額	1,150	2,384	10,388	314,681	
	銘柄数＜比率＞	11	14	—	＜0.9%＞	
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
BARLOWORLD LTD		160	180	1,229	8,571	資本財
SAPPI LIMITED		435	480	3,361	23,429	素材
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD		45	45	1,711	11,930	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	
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカランド	千円	
NEDBANK GROUP LTD	157	173	2,928	20,411	銀行
SASOL LTD	413	472	21,574	150,377	エネルギー
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	300	355	7,929	55,265	素材
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	410	534	2,647	18,451	素材
GOLD FIELDS LTD	610	664	4,180	29,137	素材
MONDI LTD	—	104	3,108	21,663	素材
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	699	865	7,371	51,379	小売
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	280	392	3,834	26,728	小売
TELKOM SA SOC LTD	190	216	1,193	8,316	電気通信サービス
TIGER BRANDS LTD	125	143	4,845	33,772	食品・飲料・タバコ
SANLAM LTD	1,389	1,516	9,385	65,419	保険
SHOPRITE HOLDINGS LTD	352	401	6,662	46,437	食品・生活必需品小売り
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	1,616	—	—	—	耐久消費財・アパレル
STANDARD BANK GROUP LTD	933	1,058	12,211	85,114	銀行
RMB HOLDINGS LTD	519	625	3,221	22,450	各種金融
REMGRO LTD	364	420	10,103	70,418	各種金融
PPC LTD	410	—	—	—	素材
NETCARE LTD	734	810	2,573	17,938	ヘルスケア機器・サービス
NASPERS LTD-N SHS	303	347	71,487	498,268	メディア
MTN GROUP LTD	1,275	1,450	18,125	126,331	電気通信サービス
MASSMART HOLDINGS LTD	86	98	1,158	8,075	食品・生活必需品小売り
KUMBA IRON ORE LTD	41	—	—	—	素材
IMPERIAL HOLDINGS LTD	143	160	2,061	14,369	小売
INVESTEC LTD	186	214	2,299	16,027	各種金融
FIRSTRAND LTD	2,552	2,941	12,132	84,563	各種金融
THE FOSCHINI GROUP LTD	154	185	2,451	17,083	小売
EXXARO RESOURCES LTD	101	121	798	5,566	エネルギー
BIDVEST GROUP LTD	244	279	9,803	68,329	資本財
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	258	369	5,021	34,997	銀行
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	75	—	—	—	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	258	299	9,035	62,977	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DISCOVERY LTD	275	314	3,701	25,802	保険
VODACOM GROUP LTD	284	325	5,328	37,141	電気通信サービス
PICK N PAY STORES LTD	165	216	1,582	11,028	食品・生活必需品小売り
MMI HOLDINGS LTD	860	940	2,058	14,348	保険
SPAR GROUP LIMITED/THE	121	145	3,044	21,219	食品・生活必需品小売り
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	520	565	2,273	15,846	保険
LIBERTY HOLDINGS LTD	95	95	1,230	8,574	保険
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	750	821	3,072	21,414	ヘルスケア機器・サービス
MR PRICE GROUP LTD	189	213	3,632	25,321	小売
ASSORE LTD	23	—	—	—	素材
SIBANYE GOLD LTD	—	622	2,973	20,721	素材
NAMPAK LTD	430	—	—	—	素材
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	290	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CORONATION FUND MANAGERS LTD	185	204	1,331	9,282	各種金融
BRAIT SE	275	296	4,565	31,820	各種金融
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	295	295	744	5,187	消費者サービス
PSG GROUP LTD	—	74	1,363	9,500	各種金融
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	—	29	1,645	11,465	銀行
PIONEER FOODS GROUP LTD	—	107	1,735	12,093	食品・飲料・タバコ
FORTRESS INCOME FUND LTD	—	611	2,175	15,160	不動産
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	—	798	1,198	8,354	不動産

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(南アフリカ)		百株	百株	千南アフリカランド	千円	
NEW EUROPE PROPERTY INVEST		－	197	3,606	25,140	不動産
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV		－	2,523	21,877	152,487	耐久消費財・アパレル
小計	株数・金額	20,576	25,322	313,589	2,185,718	
	銘柄数＜比率＞	48	50	－	＜6.3%＞	
合計	株数・金額	5,702,312	6,671,689	－	32,570,548	
	銘柄数＜比率＞	842	847	－	＜93.8%＞	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 邦貨換算金額欄の＜　＞内は、親投資信託の純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国投資信託証券

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)		千口	千口	千メキシコペソ	千円	%
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		176	213	8,265	49,429	0.1
小計	口数・金額	176	213	8,265	49,429	
	銘柄数＜比率＞	1	1	－	＜0.1%＞	
(トルコ)				千トルコリラ		
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI		144	167	455	16,780	0.0
小計	口数・金額	144	167	455	16,780	
	銘柄数＜比率＞	1	1	－	＜0.0%＞	
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		178	203	4,768	33,235	0.1
REDEFINE PROPERTIES LTD		269	389	4,392	30,616	0.1
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS		－	20	2,402	16,746	0.0
RESILIENT REIT LTD		21	24	3,163	22,052	0.1
小計	口数・金額	468	638	14,727	102,650	
	銘柄数＜比率＞	3	4	－	＜0.3%＞	
合計	口数・金額	789	1,019	－	168,859	
	銘柄数＜比率＞	5	6	－	＜0.5%＞	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 比率および合計欄の＜　＞内は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
外国	株式先物取引	MINI MS	百万円 1,945	百万円 －

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

＜新興国債券インデックスマザーファンド＞

下記は、新興国債券インデックスマザーファンド全体(9,070,295千口)の内容です。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債　種類別開示

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	%	%	%	%	%
メキシコ	151,700	166,994	998,626	9.3	－	5.8	2.6	0.9
	千ブラジルレアル	千ブラジルレアル						
ブラジル	41,650	35,173	1,086,172	10.1	10.1	2.5	5.4	2.2
	千チリペソ	千チリペソ						
チリ	50,000	53,440	8,454	0.1	－	－	0.1	－
	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ						
コロンビア	19,130,000	19,008,810	684,317	6.4	－	4.4	2.0	－
	千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル						
ペルー	5,750	5,963	196,433	1.8	－	1.6	0.2	－
	千トルコリラ	千トルコリラ						
トルコ	27,600	26,249	967,030	9.0	－	4.0	4.6	0.5
	千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント						
ハンガリー	1,222,300	1,384,550	539,559	5.0	5.0	2.0	2.6	0.4
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	36,700	38,612	1,079,212	10.0	－	3.8	4.7	1.5
	千ロシアルーブル	千ロシアルーブル						
ロシア	344,000	321,022	532,897	4.9	－	2.2	1.8	1.0
	千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ						
ルーマニア	9,000	9,821	268,810	2.5	－	0.8	1.1	0.6
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	36,920	37,304	1,008,338	9.4	－	4.6	3.1	1.7
	千タイバーツ	千タイバーツ						
タイ	273,400	301,412	931,363	8.6	－	4.9	2.3	1.4
	千フィリピンペソ	千フィリピンペソ						
フィリピン	20,000	21,637	50,848	0.5	－	0.2	0.2	－
	千インドネシアルピア	千インドネシアルピア						
インドネシア	124,120,000	127,193,121	1,042,983	9.7	－	9.0	0.6	0.1
	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
南アフリカ	145,700	127,983	892,047	8.3	－	6.5	1.6	0.2
合計	－	－	10,287,095	95.5	15.1	52.1	33.0	10.4

(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) 組入比率は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。
(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

（Ｂ）外国（外貨建）公社債　銘柄別開示

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	償還年月日
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	15,500	19,642	117,460	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	4,200	5,725	34,239	2036/11/20
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	12,100	12,094	72,325	2018/6/14
		5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	3,300	3,324	19,877	2017/6/15
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	8,000	7,906	47,283	2019/12/11
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	4,300	4,184	25,024	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	14,200	14,733	88,107	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	7,400	7,659	45,801	2022/6/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	4,000	4,382	26,210	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	11,700	12,330	73,736	2017/12/14
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	8,900	9,875	59,054	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	5,000	5,551	33,200	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	9,300	10,405	62,223	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	8,500	9,289	55,550	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	5,500	6,185	36,989	2023/12/7
		8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	16,900	18,336	109,654	2018/12/13
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	6,400	7,569	45,265	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	6,500	7,796	46,622	2038/11/18
小計						998,626	
ブラジル				千ブラジルレアル	千ブラジルレアル		
	国債証券	10 (IN)BRAZIL NTN 180101	10.0	900	900	27,811	2018/1/1
		10 (IN)BRAZIL NTN 190101	10.0	1,700	1,677	51,801	2019/1/1
		10 (IN)BRAZIL NTN 250101	10.0	5,050	4,561	140,852	2025/1/1
		10(IN)BRAZIL NTN-F210101	10.0	6,300	6,024	186,038	2021/1/1
		10(IN)BRAZIL NTN-F230101	10.0	4,550	4,218	130,271	2023/1/1
		BRAZIL-LTN 170701	－	900	784	24,224	2017/7/1
		BRAZIL-LTN 171001	－	2,600	2,200	67,943	2017/10/1
		BRAZIL-LTN 180101	－	4,250	3,501	108,135	2018/1/1
		BRAZIL-LTN 180401	－	300	240	7,416	2018/4/1
		BRAZIL-LTN 180701	－	4,500	3,500	108,086	2018/7/1
		BRAZIL-LTN 190101	－	6,100	4,479	138,312	2019/1/1
		BRAZIL-LTN 190701	－	3,700	2,563	79,166	2019/7/1
		BRAZIL-LTN 200101	－	800	521	16,111	2020/1/1
小計						1,086,172	
チリ				千チリペソ	千チリペソ		
	国債証券	5.5 CHILE (GL) 200805	5.5	50,000	53,440	8,454	2020/8/5
小計						8,454	
コロンビア				千コロンビアペソ	千コロンビアペソ		
	国債証券	10 TITULOS DE TES 240724	10.0	4,050,000	4,561,839	164,226	2024/7/24
		11 TITULOS DE TES 200724	11.0	760,000	850,424	30,615	2020/7/24
		4.375 COLOMBI(GL) 230321	4.375	1,680,000	1,398,936	50,361	2023/3/21
		5 TITULOS DE TESO 181121	5.0	3,700,000	3,512,928	126,465	2018/11/21
		6 TITULOS DE TESO 280428	6.0	1,750,000	1,467,042	52,813	2028/4/28
		7 TITULOS DE TESO 190911	7.0	550,000	542,855	19,542	2019/9/11

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
コロンビア			%	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ	千円	
	国債証券	7 TITULOS DE TESO 220504	7.0	1,400,000	1,351,784	48,664	2022/5/4
		7.5 TITULOS DE TE 260826	7.5	1,200,000	1,151,076	41,438	2026/8/26
		7.75 COLOMBI (GL) 210414	7.75	1,000,000	1,015,200	36,547	2021/4/14
		7.75 TITULOS DE T 300918	7.75	1,750,000	1,672,580	60,212	2030/9/18
		9.85 COLOMBI (GL) 270628	9.85	1,290,000	1,484,145	53,429	2027/6/28
小計						684,317	
ペルー				千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル		
	国債証券	5.2 PERU 230912	5.2	800	773	25,485	2023/9/12
		5.7 PERU 240812	5.7	1,000	987	32,523	2024/8/12
		6.9 PERU 370812	6.9	900	915	30,168	2037/8/12
		6.95 PERU 310812	6.95	1,400	1,440	47,451	2031/8/12
		7.84 PERU 200812	7.84	750	816	26,902	2020/8/12
		8.2 PERU 260812	8.2	900	1,029	33,902	2026/8/12
小計						196,433	
トルコ				千トルコリラ	千トルコリラ		
	国債証券	10.4 TURKEY GOVT 190327	10.4	1,100	1,116	41,148	2019/3/27
		10.4 TURKEY GOVT 240320	10.4	800	815	30,028	2024/3/20
		10.5 TURKEY GOVT 200115	10.5	1,600	1,630	60,085	2020/1/15
		10.7 TURKEY GOVT 210217	10.7	800	822	30,306	2021/2/17
		6.3 TURKEY GOVT 180214	6.3	1,400	1,326	48,857	2018/2/14
		7.1 TURKEY GOVT 230308	7.1	2,500	2,144	79,013	2023/3/8
		7.4 TURKEY GOVT 200205	7.4	1,700	1,567	57,730	2020/2/5
		8 TURKEY GOVT 250312	8.0	2,600	2,292	84,442	2025/3/12
		8.3 TURKEY GOVT 180620	8.3	2,000	1,952	71,928	2018/6/20
		8.5 TURKEY GOVT 190710	8.5	2,000	1,929	71,076	2019/7/10
		8.5 TURKEY GOVT 220914	8.5	1,700	1,581	58,269	2022/9/14
		8.8 TURKEY GOVT 181114	8.8	1,600	1,567	57,755	2018/11/14
		8.8 TURKEY GOVT 230927	8.8	1,800	1,687	62,171	2023/9/27
		9 TURKEY GOVT 240724	9.0	1,700	1,601	58,994	2024/7/24
		9.4 TURKEY GOVT 200708	9.4	2,800	2,746	101,174	2020/7/8
		9.5 TURKEY GOVT 220112	9.5	1,500	1,467	54,048	2022/1/12
小計						967,030	
ハンガリー				千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント		
	国債証券	2.5 HUNGARY 180622	2.5	109,000	111,002	43,257	2018/6/22
		3 HUNGARY 240626	3.0	25,000	24,496	9,546	2024/6/26
		3.5 HUNGARY 200624	3.5	143,000	150,272	58,561	2020/6/24
		4 HUNGARY 180425	4.0	20,000	20,975	8,174	2018/4/25
		5.5 HUNGARY 181220	5.5	103,000	112,804	43,959	2018/12/20
		5.5 HUNGARY 250624	5.5	167,000	194,863	75,938	2025/6/24
		6 HUNGARY 231124	6.0	173,000	206,151	80,337	2023/11/24
		6.5 HUNGARY 190624	6.5	184,800	210,337	81,968	2019/6/24
		6.75 HUNGARY 171124	6.75	79,000	85,753	33,418	2017/11/24
		7 HUNGARY 220624	7.0	102,500	126,398	49,257	2022/6/24
		7.5 HUNGARY 201112	7.5	116,000	141,493	55,139	2020/11/12
小計						539,559	

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	償還年月日
ポーランド			%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
	国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	3,300	3,235	90,441	2020/4/25
		2 POLAND 210425	2.0	2,700	2,668	74,589	2021/4/25
		2.5 POLAND 180725	2.5	2,900	2,952	82,513	2018/7/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	2,600	2,479	69,294	2026/7/25
		3.25 POLAND 190725	3.25	3,300	3,445	96,302	2019/7/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	3,400	3,491	97,595	2025/7/25
		3.75 POLAND 180425	3.75	1,800	1,873	52,372	2018/4/25
		4 POLAND 231025	4.0	3,300	3,577	99,978	2023/10/25
		5.25 POLAND 171025	5.25	2,400	2,526	70,608	2017/10/25
		5.25 POLAND 201025	5.25	2,600	2,950	82,462	2020/10/25
		5.5 POLAND 191025	5.5	2,400	2,689	75,179	2019/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	2,200	2,582	72,167	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	2,000	2,376	66,425	2022/9/23
		POLAND 170725	－	1,500	1,474	41,224	2017/7/25
		POLAND 181025	－	300	288	8,055	2018/10/25
小計						1,079,212	
ロシア				千ロシアルーブル	千ロシアルーブル		
	国債証券	6.2 RUSSIA GOVT 180131	6.2	14,000	13,321	22,112	2018/1/31
		6.4 RUSSIA OFZ 200527	6.4	28,500	25,982	43,130	2020/5/27
		6.7 RUSSIA GOVT B 190515	6.7	32,500	30,428	50,511	2019/5/15
		6.8 RUSSIA GOVT 191211	6.8	22,000	20,486	34,007	2019/12/11
		7 RUSSIA GOVT 230125	7.0	22,000	19,950	33,118	2023/1/25
		7 RUSSIA GOVT BON 230816	7.0	36,200	32,615	54,142	2023/8/16
		7.05 RUSSIA GOVT 280119	7.05	36,300	31,910	52,972	2028/1/19
		7.4 RUSSIA GOVT 170614	7.4	13,500	13,229	21,961	2017/6/14
		7.5 RUSSIA GOVT 180315	7.5	4,000	3,884	6,447	2018/3/15
		7.5 RUSSIA GOVT 190227	7.5	16,500	15,825	26,269	2019/2/27
		7.6 RUSSIA GOVT 210414	7.6	23,000	21,797	36,183	2021/4/14
		7.6 RUSSIA GOVT 220720	7.6	27,000	25,316	42,025	2022/7/20
		7.85 RUSSIA (GL) 180310	7.85	35,000	34,140	56,673	2018/3/10
		8.15 RUSSIA GOVT 270203	8.15	33,500	32,133	53,341	2027/2/3
小計						532,897	
ルーマニア				千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ		
	国債証券	3.25 ROMANIA GOVE 180117	3.25	2,000	2,070	56,659	2018/1/17
		4.75 ROMANIA GOVE 250224	4.75	2,800	3,030	82,940	2025/2/24
		5.75 ROMANIA GOVE 200429	5.75	4,000	4,509	123,414	2020/4/29
		5.9 ROMANIA GOVER 170726	5.9	200	211	5,795	2017/7/26
小計						268,810	
マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	3.26 MALAYSIAGOVT 180301	3.26	1,400	1,408	38,071	2018/3/1
		3.314 MALAYSIA 171031	3.314	1,700	1,708	46,191	2017/10/31
		3.418MALAYSIAGOVT 220815	3.418	1,900	1,862	50,356	2022/8/15
		3.48 MALAYSIAGOVT 230315	3.48	1,500	1,468	39,695	2023/3/15
		3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	1,700	1,705	46,108	2020/3/31
		3.58 MALAYSIAGOVT 180928	3.58	1,600	1,615	43,664	2018/9/28

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	償還年月日
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	3.654 MALAYSIAGOV 191031	3.654	1,800	1,819	49,180	2019/10/31
		3.659 MALAYSIAGOV 201015	3.659	1,600	1,618	43,760	2020/10/15
		3.759 MALAYSIAGOV 190315	3.759	700	710	19,193	2019/3/15
		3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	1,600	1,600	43,257	2022/9/30
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	700	659	17,819	2033/4/15
		3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	1,200	1,222	33,040	2020/7/31
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	800	777	21,028	2027/3/15
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	2,000	2,016	54,509	2025/9/15
		4.012 MALAYSIAGOV 170915	4.012	1,600	1,622	43,862	2017/9/15
		4.048 MALAYSIA 210930	4.048	2,120	2,163	58,473	2021/9/30
		4.127 MALAYSIA 320415	4.127	1,500	1,466	39,646	2032/4/15
		4.16 MALAYSIAGOVT 210715	4.16	1,400	1,438	38,883	2021/7/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,600	1,630	44,071	2024/7/15
		4.24 MALAYSIAGOVT 180207	4.24	1,800	1,839	49,734	2018/2/7
		4.378MALAYSIAGOVT 191129	4.378	2,500	2,585	69,874	2019/11/29
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	1,400	1,443	39,023	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	1,800	1,846	49,914	2030/4/15
		5.734MALAYSIAGOVT 190730	5.734	1,000	1,072	28,977	2019/7/30
小計						1,008,338	
タイ				千タイバーツ	千タイバーツ		
	国債証券	2.55 THAILAND 200626	2.55	20,400	21,006	64,911	2020/6/26
		2.8 THAILAND 171010	2.8	11,700	11,883	36,720	2017/10/10
		3.25 THAILAND 170616	3.25	20,900	21,282	65,761	2017/6/16
		3.45 THAILAND 190308	3.45	11,700	12,259	37,881	2019/3/8
		3.58 THAILAND 271217	3.58	10,900	12,364	38,205	2027/12/17
		3.625 THAILAND 230616	3.625	30,200	33,396	103,195	2023/6/16
		3.65 THAILAND 211217	3.65	47,900	52,301	161,611	2021/12/17
		3.85 THAILAND 251212	3.85	25,300	29,090	89,888	2025/12/12
		3.875 THAILAND 190613	3.875	45,500	48,463	149,753	2019/6/13
		4.875 THAILAND 290622	4.875	32,900	42,371	130,927	2029/6/22
		5.125 THAILAND 180313	5.125	16,000	16,992	52,505	2018/3/13
小計						931,363	
フィリピン				千フィリピンペソ	千フィリピンペソ		
	国債証券	4.95 PHILIPPI(GL) 210115	4.95	10,000	10,400	24,440	2021/1/15
		6.25 PHILIPPI(GL) 360114	6.25	10,000	11,237	26,408	2036/1/14
小計						50,848	
インドネシア				千インドネシアルピア	千インドネシアルピア		
	国債証券	10.5 INDONESIA 300815	10.5	3,550,000	4,290,991	35,186	2030/8/15
		11 INDONESIA 201115	11.0	750,000	849,277	6,964	2020/11/15
		11 INDONESIA 250915	11.0	3,450,000	4,144,795	33,987	2025/9/15
		12.8 INDONESIA 210615	12.8	2,590,000	3,156,433	25,882	2021/6/15
		5.25 INDONESIA 180515	5.25	1,550,000	1,493,983	12,250	2018/5/15
		5.625 INDONESIA 230515	5.625	4,800,000	4,258,704	34,921	2023/5/15
		6.125 INDONESIA 280515	6.125	5,050,000	4,352,140	35,687	2028/5/15
		6.625 INDONESIA 330515	6.625	6,400,000	5,565,760	45,639	2033/5/15

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	償還年月日
インドネシア			%	ﾁｲﾝﾄﾞﾈｼｱﾙﾋﾟｱ	ﾁｲﾝﾄﾞﾈｼｱﾙﾋﾟｱ	千円	
	国債証券	7 INDONESIA 220515	7.0	5,650,000	5,491,404	45,029	2022/5/15
		7 INDONESIA 270515	7.0	4,050,000	3,786,304	31,047	2027/5/15
		7.875 INDONESIA 190415	7.875	7,000,000	7,088,900	58,128	2019/4/15
		8.25 INDONESIA 210715	8.25	8,600,000	8,842,176	72,505	2021/7/15
		8.25 INDONESIA 320615	8.25	5,000,000	5,134,100	42,099	2032/6/15
		8.25 INDONESIA 360515	8.25	4,500,000	4,586,850	37,612	2036/5/15
		8.375 INDONESIA 240315	8.375	16,700,000	17,159,083	140,704	2024/3/15
		8.375 INDONESIA 260915	8.375	12,830,000	13,282,514	108,916	2026/9/15
		8.375 INDONESIA 340315	8.375	12,100,000	12,438,558	101,996	2034/3/15
		8.75 INDONESIA 310515	8.75	3,800,000	4,017,474	32,943	2031/5/15
		9 INDONESIA 290315	9.0	11,600,000	12,575,792	103,121	2029/3/15
		9.5 INDONESIA 310715	9.5	4,150,000	4,677,880	38,358	2031/7/15
小計						1,042,983	
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	20,800	22,219	154,867	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	11,700	7,965	55,516	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	10,700	7,219	50,321	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	7,600	6,953	48,465	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	12,800	9,947	69,333	2031/2/28
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	9,300	8,855	61,725	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	8,100	7,512	52,365	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	8,400	8,306	57,899	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	12,200	10,509	73,248	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	2,700	2,705	18,856	2017/9/15
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	9,200	7,933	55,294	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	10,400	8,966	62,493	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	7,600	6,602	46,018	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	14,200	12,287	85,642	2048/2/28
小計						892,047	
合計						10,287,095	

（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。

＜東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド＞

下記は、東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド全体(6,877,353千口)の内容です。

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当期末		
	口数	口数	評価額	比率
	千口	千口	千円	%
日本アコモデーションファンド投資法人	0.655	0.749	344,165	1.8
ＭＣＵＢＳ ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	0.26	0.411	153,097	0.8
森ヒルズリート投資法人	2	2	443,406	2.4
野村不動産レジデンシャル投資法人	0.217	－	－	－
産業ファンド投資法人	0.476	0.545	307,380	1.6
大和ハウスリート投資法人	0.474	0.542	313,818	1.7
アドバンス・レジデンス投資法人	1	2	566,820	3.0
ケネディクス・レジデンシャル投資法人	0.472	0.54	157,410	0.8
アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.375	0.927	540,441	2.9
ＧＬＰ投資法人	3	4	509,270	2.7
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.64	0.794	185,796	1.0
日本プロロジスリート投資法人	2	2	714,563	3.8
野村不動産マスターファンド投資法人	2	－	－	－
星野リゾート・リート投資法人	0.067	0.126	159,768	0.9
ＳＩＡ不動産投資法人	0.101	0.116	49,184	0.3
イオンリート投資法人	1	2	284,715	1.5
ヒューリックリート投資法人	1	1	281,200	1.5
日本リート投資法人	0.411	0.606	168,952	0.9
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	0.637	0.838	80,867	0.4
日本ヘルスケア投資法人	0.082	0.115	20,861	0.1
積水ハウス・リート投資法人	1	1	167,785	0.9
トーセイ・リート投資法人	0.13	0.249	27,514	0.1
ケネディクス商業リート投資法人	0.352	0.648	185,716	1.0
ヘルスケア＆メディカル投資法人	0.163	0.186	20,106	0.1
サムティ・レジデンシャル投資法人	－	0.253	23,933	0.1
ジャパン・シニアリビング投資法人	－	0.131	20,462	0.1
野村不動産マスターファンド投資法人	－	5	942,093	5.0
いちごホテルリート投資法人	－	0.214	37,813	0.2
ラサールロジポート投資法人	－	1	171,290	0.9
日本ビルファンド投資法人	1	2	1,449,512	7.7
ジャパンリアルエステイト投資法人	1	2	1,347,984	7.2
日本リテールファンド投資法人	3	3	1,019,251	5.4
オリックス不動産投資法人	3	3	664,934	3.5
日本プライムリアルティ投資法人	1	1	637,200	3.4
プレミア投資法人	0.356	2	277,914	1.5
東急リアル・エステート投資法人	1	1	236,174	1.3
グローバル・ワン不動産投資法人	0.262	0.3	126,000	0.7
野村不動産オフィスファンド投資法人	0.503	－	－	－
ユナイテッド・アーバン投資法人	3	4	775,078	4.1
森トラスト総合リート投資法人	1	2	421,670	2.2
インヴィンシブル投資法人	3	5	412,017	2.2
フロンティア不動産投資法人	0.67	0.767	416,481	2.2
平和不動産リート投資法人	1	1	138,228	0.7

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	%
日本ロジスティクスファンド投資法人		1	1	330,450	1.8
福岡リート投資法人		1	1	227,997	1.2
ケネディクス・オフィス投資法人		0.547	0.626	400,640	2.1
積水ハウス・ＳＩ　レジデンシャル投資法人		1	1	185,574	1.0
いちごオフィスリート投資法人		1	2	182,361	1.0
大和証券オフィス投資法人		0.596	0.748	510,884	2.7
阪急リート投資法人		0.807	0.924	126,126	0.7
スターツプロシード投資法人		0.235	0.269	45,864	0.2
トップリート投資法人		0.238	0.272	122,264	0.7
大和ハウス・レジデンシャル投資法人		1	1	307,496	1.6
ジャパン・ホテル・リート投資法人		4	5	487,406	2.6
日本賃貸住宅投資法人		1	2	215,813	1.2
ジャパンエクセレント投資法人		1	1	294,618	1.6
合計	口数・金額	61	83	18,238,376	
	銘柄数<比率>	51	53	<97.2%>	

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

(注) 日本アコモデーションファンド投資法人、ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人、森ヒルズリート投資法人、産業ファンド投資法人、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、星野リゾート・リート投資法人、ＳＩＡ不動産投資法人、イオンリート投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本リート投資法人、インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人、日本ヘルスケア投資法人、積水ハウス・リート投資法人、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、ジャパン・シニアリビング投資法人、野村不動産マスターファンド投資法人、いちごホテルリート投資法人、ラサールロジポート投資法人、日本ビルファンド投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、日本リテールファンド投資法人、オリックス不動産投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、プレミア投資法人、東急リアル・エステート投資法人、グローバル・ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、森トラスト総合リート投資法人、インヴィンシブル投資法人、フロンティア不動産投資法人、平和不動産リート投資法人、日本ロジスティクスファンド投資法人、福岡リート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、積水ハウス・ＳＩ　レジデンシャル投資法人、いちごオフィスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、阪急リート投資法人、スターツプロシード投資法人、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人である三菱ＵＦＪ信託銀行、三菱東京ＵＦＪ銀行、三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券が当該ファンドの一般事務受託会社等となっています。(各ファンドで開示されている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

当期末において10%を超える銘柄の組入れはございません。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
国内	不動産投信指数先物取引	東証ＲＥＩＴ指数	526	－

＜ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド＞

下記は、ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド全体(12,253,224千口)の内容です。

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
DDR CORP	34	47	790	87,076	0.5
HCP INC	52	73	2,367	260,609	1.5
MACERICH CO/THE	16	19	1,444	159,051	0.9
ACADIA REALTY TRUST	7	10	361	39,780	0.2
AGREE REALTY CORP	1	3	151	16,672	0.1
ALEXANDER'S INC	0.395	0.57	211	23,279	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8	11	1,084	119,338	0.7
PROLOGIS INC	58	82	3,841	422,939	2.4
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	12	20	933	102,749	0.6
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	9	12	59	6,574	0.0
ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	6	－	－	－	－
BIOMED REALTY TRUST INC	23	－	－	－	－
BRANDYWINE REALTY TRUST	20	27	406	44,771	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	9	13	1,132	124,660	0.7
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	19	23	235	25,969	0.1
CEDAR REALTY TRUST INC	8	10	72	7,986	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	15	21	970	106,854	0.6
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	10	14	383	42,204	0.2
COUSINS PROPERTIES INC	24	30	319	35,225	0.2
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	23	30	257	28,373	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	15	23	2,138	235,462	1.3
EASTGROUP PROPERTIES INC	3	4	304	33,506	0.2
EDUCATION REALTY TRUST INC	5	9	400	44,055	0.2
EPR PROPERTIES	6	9	684	75,382	0.4
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	9	12	913	100,555	0.6
EQUITY ONE INC	9	14	409	45,134	0.3
ESSEX PROPERTY TRUST INC	7	10	2,282	251,326	1.4
EXTRA SPACE STORAGE INC	12	19	1,770	194,963	1.1
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7	10	1,638	180,371	1.0
TRADE STREET RESIDENTIAL INC	0.9	－	－	－	－
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	12	18	442	48,693	0.3
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	6	9	83	9,172	0.1
GETTY REALTY CORP	3	4	79	8,736	0.0
WELLTOWER INC	40	55	3,820	420,604	2.3
HIGHWOODS PROPERTIES INC	10	14	674	74,245	0.4
HOME PROPERTIES INC	6	－	－	－	－
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	17	24	602	66,328	0.4
EQUITY COMMONWEALTH	14	20	550	60,625	0.3
INLAND REAL ESTATE CORP	10	－	－	－	－
KILROY REALTY CORP	9	14	873	96,164	0.5

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
KITE REALTY GROUP TRUST	9	12	339	37,355	0.2
LEXINGTON REALTY TRUST	24	34	306	33,785	0.2
LTC PROPERTIES INC	4	5	256	28,231	0.2
MACK-CALI REALTY CORP	9	14	353	38,905	0.2
BOSTON PROPERTIES INC	17	24	2,992	329,422	1.8
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	23	36	506	55,760	0.3
MID-AMERICA APARTMENT COMM	8	11	1,166	128,396	0.7
NATL HEALTH INVESTORS INC	3	5	360	39,668	0.2
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	17	26	810	89,182	0.5
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1	2	51	5,683	0.0
PARKWAY PROPERTIES INC	9	12	214	23,577	0.1
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8	10	224	24,677	0.1
POST PROPERTIES INC	6	8	500	55,150	0.3
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	9	12	215	23,684	0.1
REALTY INCOME CORP	25	39	2,330	256,561	1.4
REGENCY CENTERS CORP	10	15	1,164	128,196	0.7
SAUL CENTERS INC	1	1	90	9,981	0.1
SENIOR HOUSING PROP TRUST	27	37	678	74,700	0.4
SL GREEN REALTY CORP	11	15	1,553	171,048	1.0
SOVRAN SELF STORAGE INC	4	6	647	71,238	0.4
STRATEGIC HOTELS & RESORTS I	32	—	—	—	—
SUN COMMUNITIES INC	5	10	692	76,252	0.4
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	23	33	392	43,230	0.2
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	10	14	497	54,735	0.3
TAUBMAN CENTERS INC	7	9	646	71,175	0.4
CUBESMART	18	26	829	91,367	0.5
UDR INC	29	41	1,473	162,271	0.9
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1	1	103	11,402	0.1
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3	4	93	10,266	0.1
VENTAS INC	37	52	3,433	377,998	2.1
WASHINGTON REIT	7	11	316	34,799	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	12	17	653	71,925	0.4
HERSHA HOSPITALITY TRUST	22	7	126	13,953	0.1
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2	3	305	33,584	0.2
UMH PROPERTIES INC	2	4	44	4,861	0.0
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2	3	57	6,367	0.0
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	6	9	110	12,182	0.1
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	11	15	472	51,971	0.3
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	10	14	149	16,496	0.1
WINTHROP REALTY TRUST	—	5	51	5,638	0.0
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	10	14	583	64,184	0.4
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	14	19	115	12,703	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	15	21	702	77,287	0.4
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	6	—	—	—	—
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	7	11	479	52,768	0.3

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	8	11	275	30,344	0.2
EXCEL TRUST INC	7	－	－	－	－
CHESAPEAKE LODGING TRUST	6	9	216	23,846	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	17	23	453	49,936	0.3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	8	11	305	33,637	0.2
CORESITE REALTY CORP	2	4	340	37,535	0.2
CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	7	－	－	－	－
AMERICAN ASSETS TRUST INC	4	6	236	26,051	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	9	13	149	16,487	0.1
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	8	11	216	23,870	0.1
RLJ LODGING TRUST	14	20	385	42,485	0.2
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	10	15	315	34,779	0.2
ROUSE PROPERTIES INC	3	5	108	11,920	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	7	10	211	23,333	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	6	10	196	21,627	0.1
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	27	37	590	65,043	0.4
SELECT INCOME REIT	4	10	238	26,209	0.1
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	14	21	631	69,475	0.4
WP CAREY INC	11	15	954	105,130	0.6
WHITESTONE REIT	2	4	51	5,672	0.0
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	5	7	386	42,546	0.2
CHATHAM LODGING TRUST	4	6	123	13,632	0.1
TERRENO REALTY CORP	4	6	152	16,791	0.1
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	4	5	77	8,543	0.0
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	49	74	847	93,347	0.5
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	13	18	594	65,492	0.4
GEO GROUP INC/THE	8	11	362	39,955	0.2
VEREIT INC	103	141	1,323	145,650	0.8
DUKE REALTY CORP	39	54	1,240	136,614	0.8
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	3	4	56	6,230	0.0
AMERICAN RESIDENTIAL PROPERT	3	－	－	－	－
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	6	9	190	20,987	0.1
PHYSICIANS REALTY TRUST	8	20	372	41,030	0.2
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	16	28	499	55,037	0.3
GRAMERCY PROPERTY TRUST	26	65	571	62,911	0.4
CYRUSONE INC	5	10	524	57,715	0.3
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	2	4	48	5,346	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	12	18	338	37,234	0.2
QTS REALTY TRUST INC-CL A	2	7	365	40,238	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	19	31	784	86,416	0.5
COLONY STARWOOD HOMES	4	6	152	16,792	0.1
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	14	19	388	42,741	0.2
WP GLIMCHER INC	21	28	274	30,241	0.2
CARETRUST REIT INC	3	9	117	12,984	0.1
NEW YORK REIT INC	18	24	235	25,889	0.1

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	2	3	49	5,476	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	10	27	881	97,044	0.5
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	3	5	44	4,904	0.0
IRON MOUNTAIN INC	21	37	1,371	150,983	0.8
STORE CAPITAL CORP	2	22	562	61,911	0.3
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	7	14	149	16,454	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES	11	14	369	40,719	0.2
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	1	1	33	3,723	0.0
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	18	26	261	28,785	0.2
XENIA HOTELS & RESORTS INC	13	17	257	28,346	0.2
NORTHSTAR REALTY FINANCE	31	30	378	41,665	0.2
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	—	3	72	7,983	0.0
NEXPOINT RESIDENTIAL	—	3	50	5,592	0.0
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	—	13	326	35,964	0.2
APPLE HOSPITALITY REIT INC	—	24	435	47,951	0.3
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	—	2	33	3,690	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	—	27	224	24,704	0.1
CITY OFFICE REIT INC	—	2	30	3,341	0.0
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	—	9	107	11,858	0.1
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	—	2	98	10,865	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	—	8	160	17,630	0.1
FOREST CITY REALTY TRUST- A	—	33	731	80,499	0.4
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	—	1	32	3,612	0.0
EQUITY RESIDENTIAL	41	57	3,840	422,746	2.4
FELCOR LODGING TRUST INC	14	21	137	15,120	0.1
GENERAL GROWTH PROPERTIES	71	90	2,380	262,101	1.5
HOST HOTELS & RESORTS INC	86	118	1,739	191,501	1.1
LIBERTY PROPERTY TRUST	17	23	828	91,190	0.5
LASALLE HOTEL PROPERTIES	13	17	387	42,660	0.2
PUBLIC STORAGE	16	23	5,784	636,828	3.6
SIMON PROPERTY GROUP INC	35	48	9,422	1,037,340	5.8
VORNADO REALTY TRUST	20	27	2,587	284,840	1.6
KIMCO REALTY CORP	47	65	1,771	195,070	1.1
AVALONBAY COMMUNITIES INC	15	21	3,865	425,540	2.4
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	17	24	1,019	112,281	0.6
小計 口数・金額	2,223	3,153	116,130	12,784,779	
小計 銘柄数＜比率＞	152	155	—	＜71.3%＞	
(カナダ)			千カナダドル		
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3	3	180	15,148	0.1
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	7	9	333	28,031	0.2
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	6	9	289	24,341	0.1
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	4	5	266	22,446	0.1
CHARTWELL RETIREMENT RESIDEN	9	—	—	—	—
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	8	13	236	19,861	0.1
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	6	8	155	13,059	0.1

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		15	21	457	38,469	0.2
INNVEST REAL ESTATE INVESTME		7	11	78	6,621	0.0
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS		4	4	59	5,034	0.0
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST		1	3	62	5,278	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		18	25	699	58,823	0.3
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT		4	5	219	18,440	0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT		8	10	136	11,510	0.1
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME		6	6	98	8,289	0.0
BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO		2	2	58	4,879	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		2	4	44	3,768	0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV		5	7	70	5,941	0.0
ONEREIT		2	8	29	2,523	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		2	3	144	12,139	0.1
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		2	5	44	3,776	0.0
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		4	4	38	3,214	0.0
MILESTONE APARTMENTS REAL ES		3	10	196	16,572	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI		2	2	31	2,622	0.0
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE		10	14	73	6,195	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT		5	7	104	8,753	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		3	5	74	6,229	0.0
PLAZA RETAIL REIT		4	10	49	4,170	0.0
SLATE RETAIL REIT - U		—	2	33	2,852	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		—	5	62	5,228	0.0
小計	口数・金額	164	233	4,329	364,226	
	銘柄数＜比率＞	28	29	—	＜2.0%＞	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		9	16	183	22,604	0.1
HAMBORNER REIT AG		5	9	92	11,447	0.1
小計	口数・金額	14	25	276	34,052	
	銘柄数＜比率＞	2	2	—	＜0.2%＞	
(ユーロ…イタリア)						
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		36	55	43	5,412	0.0
BENI STABILI SPA		120	167	103	12,786	0.1
小計	口数・金額	157	223	147	18,199	
	銘柄数＜比率＞	2	2	—	＜0.1%＞	
(ユーロ…フランス)						
GECINA SA		4	5	714	88,128	0.5
KLEPIERRE		23	29	1,179	145,431	0.8
UNIBAIL-RODAMCO SE		11	15	3,559	438,802	2.4
AFFINE		—	1	16	2,059	0.0
FONCIERE DES REGIONS		5	6	534	65,917	0.4
MERCIALYS		6	3	56	6,940	0.0
ANF IMMOBILIER		1	1	42	5,236	0.0
ICADE		3	5	374	46,135	0.3
ALTAREA		0.28	0.36	63	7,779	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	%
FONCIERE DES MURS		－	1	35	4,349	0.0
小計	口数・金額	56	70	6,576	810,783	
	銘柄数＜比率＞	8	10	－	＜4.5%＞	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV		4	7	315	38,942	0.2
NSI NV		10	22	86	10,667	0.1
VASTNED RETAIL NV		2	2	116	14,325	0.1
WERELDHAVE NV		4	6	278	34,353	0.2
小計	口数・金額	21	40	797	98,288	
	銘柄数＜比率＞	4	4	－	＜0.5%＞	
(ユーロ…スペイン)						
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		4	10	86	10,639	0.1
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		22	49	454	56,007	0.3
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA		3	9	121	14,971	0.1
小計	口数・金額	30	68	662	81,618	
	銘柄数＜比率＞	3	3	－	＜0.5%＞	
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO		2	3	175	21,696	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES		－	1	33	4,127	0.0
RETAIL ESTATES		－	0.78	62	7,659	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA		1	2	172	21,295	0.1
WERELDHAVE BELGIUM NV		－	0.32	36	4,544	0.0
AEDIFICA		1	2	141	17,495	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV		－	0.5	16	1,990	0.0
COFINIMMO		2	3	334	41,261	0.2
小計	口数・金額	7	13	973	120,071	
	銘柄数＜比率＞	4	8	－	＜0.7%＞	
(ユーロ…アイルランド)						
GREEN REIT PLC		75	112	161	19,884	0.1
HIBERNIA REIT PLC		78	103	131	16,159	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		39	53	60	7,415	0.0
小計	口数・金額	192	269	352	43,459	
	銘柄数＜比率＞	3	3	－	＜0.2%＞	
ユーロ計	口数・金額	480	711	9,786	1,206,473	
	銘柄数＜比率＞	26	32	－	＜6.7%＞	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		117	159	1,151	185,098	1.0
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		39	54	417	67,135	0.4
HAMMERSON PLC		90	124	693	111,427	0.6
LAND SECURITIES GROUP PLC		91	126	1,445	232,294	1.3
INTU PROPERTIES PLC		108	130	366	58,982	0.3
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		12	91	95	15,361	0.1
SEGRO PLC		85	116	488	78,555	0.4
WORKSPACE GROUP PLC		13	17	147	23,679	0.1
MCKAY SECURITIES PLC-ORD		11	15	35	5,702	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	
(イギリス)	千口	千口	千イギリスポンド	千円	%
SHAFTESBURY PLC	32	43	401	64,507	0.4
BIG YELLOW GROUP PLC	16	22	188	30,299	0.2
DERWENT LONDON PLC	12	17	580	93,362	0.5
MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	7	—	—	—	—
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	65	97	159	25,617	0.1
HANSTEEN HOLDINGS PLC	74	112	118	19,054	0.1
REDEFINE INTERNATIONAL PLC	115	197	88	14,149	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	24	31	109	17,660	0.1
TRITAX BIG BOX REIT PLC	74	133	181	29,097	0.2
ASSURA PLC	110	262	149	24,003	0.1
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	—	89	53	8,540	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	—	70	79	12,747	0.1
REGIONAL REIT LTD	—	25	25	4,138	0.0
小計 口数・金額	1,102	1,941	6,977	1,121,416	
小計 銘柄数＜比率＞	19	21	—	＜6.3%＞	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES	163	514	1,703	135,612	0.8
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	6	6	47	3,791	0.0
ABACUS PROPERTY GROUP	26	43	140	11,165	0.1
ASPEN GROUP	11	11	13	1,039	0.0
INGENIA COMMUNITIES GROUP	119	19	53	4,285	0.0
360 CAPITAL GROUP LTD	34	34	32	2,609	0.0
ALE PROPERTY GROUP	17	25	112	8,920	0.0
CHARTER HALL GROUP	30	51	273	21,810	0.1
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	27	35	94	7,530	0.0
GALILEO JAPAN TRUST	15	15	38	3,086	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP	154	198	204	16,250	0.1
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	72	113	256	20,462	0.1
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	17	26	84	6,708	0.0
NATIONAL STORAGE REIT	35	50	93	7,455	0.0
GDI PROPERTY GROUP	66	66	57	4,598	0.0
INDUSTRIA REIT	13	13	27	2,153	0.0
AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT	6	—	—	—	—
360 CAPITAL OFFICE FUND	7	7	17	1,366	0.0
SCENTRE GROUP	608	835	3,919	312,127	1.7
ARENA REIT	27	37	74	5,897	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	16	23	66	5,314	0.0
NOVION PROPERTY GROUP	275	—	—	—	—
GPT GROUP	200	278	1,472	117,220	0.7
MIRVAC GROUP	414	577	1,103	87,855	0.5
STOCKLAND	268	370	1,676	133,521	0.7
WESTFIELD CORP	220	298	3,106	247,339	1.4
DEXUS PROPERTY GROUP	109	151	1,319	105,098	0.6
BWP TRUST	58	78	281	22,440	0.1
INVESTA OFFICE FUND	70	97	412	32,882	0.2

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリアドル	千円	%
CHARTER HALL RETAIL REIT		33	50	239	19,096	0.1
GOODMAN GROUP		178	246	1,755	139,829	0.8
小計	口数・金額	3,306	4,279	18,679	1,487,470	
	銘柄数＜比率＞	31	29	－	＜8.3%＞	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR		27	40	88	6,605	0.0
KIWI PROPERTY GROUP LTD		136	199	297	22,143	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST		118	165	225	16,813	0.1
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD		52	63	105	7,819	0.0
STRIDE PROPERTY LTD		36	59	129	9,621	0.1
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL		118	164	212	15,780	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD		83	127	151	11,265	0.1
小計	口数・金額	571	820	1,209	90,049	
	銘柄数＜比率＞	7	7	－	＜0.5%＞	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		261	351	16,075	227,794	1.3
CHAMPION REIT		290	345	1,355	19,212	0.1
PROSPERITY REIT		134	178	526	7,465	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN		115	150	636	9,012	0.1
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT		115	115	216	3,063	0.0
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		117	153	630	8,932	0.0
FORTUNE REIT		157	211	1,799	25,503	0.1
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN		90	137	449	6,367	0.0
NEW CENTURY REIT		30	63	163	2,312	0.0
小計	口数・金額	1,309	1,703	21,853	309,663	
	銘柄数＜比率＞	9	9	－	＜1.7%＞	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		281	399	641	51,186	0.3
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		244	310	427	34,159	0.2
KEPPEL REIT		200	272	279	22,278	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST		51	83	105	8,404	0.0
ASCOTT RESIDENCE TRUST		108	148	166	13,295	0.1
CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST		144	180	97	7,782	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS		79	111	151	12,119	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		67	90	178	14,229	0.1
STARHILL GLOBAL REIT		158	219	166	13,257	0.1
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		167	239	233	18,607	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS		70	103	149	11,966	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		64	82	103	8,303	0.0
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL		66	83	115	9,190	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL		234	312	106	8,489	0.0
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		39	59	145	11,603	0.1
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		132	184	293	23,475	0.1
CACHE LOGISTICS TRUST		81	127	110	8,822	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		159	216	307	24,582	0.1

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポールドル	千円	%
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		99	135	80	6,413	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		75	110	66	5,314	0.0
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST		84	121	80	6,425	0.0
MAPLETREE GREATER CHINA COMM		194	274	268	21,441	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI		51	97	67	5,421	0.0
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		31	76	49	3,944	0.0
OUE HOSPITALITY TRUST		80	167	110	8,801	0.0
SPH REIT		81	125	116	9,299	0.1
FRASERS HOSPITALITY TRUST		51	92	71	5,730	0.0
KEPPEL DC REIT		111	130	140	11,184	0.1
CAPITALAND MALL TRUST		294	416	853	68,161	0.4
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		237	353	802	64,093	0.4
小計	口数・金額	3,735	5,321	6,486	517,983	
	銘柄数＜比率＞	30	30	－	＜2.9%＞	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
REIT 1 LTD		20	26	302	8,614	0.0
小計	口数・金額	20	26	302	8,614	
	銘柄数＜比率＞	1	1	－	＜0.0%＞	
合計	口数・金額	12,914	18,191	－	17,890,676	
	銘柄数＜比率＞	303	313	－	＜99.8%＞	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 比率および合計欄の＜　＞内は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の比率。

三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド

《第16期》決算日2016年２月22日

［計算期間：2015年２月21日～2016年２月22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22日に第16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16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	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
16期(2016年２月22日)	10,155	△11.7	1,300.00	△13.4	99.0	1.0	199,359

（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
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
（期　首） 2015年２月20日	11,495	－	1,500.33	－	99.1	0.5
２月末	11,678	1.6	1,523.85	1.6	98.0	0.6
３月末	11,918	3.7	1,543.11	2.9	97.9	1.2
４月末	12,306	7.1	1,592.79	6.2	97.7	1.3
５月末	12,937	12.5	1,673.65	11.6	97.8	1.3
６月末	12,614	9.7	1,630.40	8.7	99.5	0.9
７月末	12,841	11.7	1,659.52	10.6	99.5	0.5
８月末	11,896	3.5	1,537.05	2.4	100.0	1.1
９月末	11,006	△ 4.3	1,411.16	△ 5.9	100.5	1.7
10月末	12,154	5.7	1,558.20	3.9	97.0	1.5
11月末	12,327	7.2	1,580.25	5.3	98.0	1.5
12月末	12,085	5.1	1,547.30	3.1	99.5	0.7
2016年１月末	11,187	△ 2.7	1,432.07	△ 4.5	100.6	1.5
（期　末） 2016年２月22日	10,155	△11.7	1,300.00	△13.4	99.0	1.0

（注）騰落率は期首比。
（注）「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ11.7%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－13.4%）を1.7%上回りました。

基準価額の推移

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

●投資環境について

◎国内株式市況

・期首から2015年８月上旬にかけては、国内企業業績改善への期待が高まったことや、円安・米ドル高の進行などを受けて国内株式市況は上昇しました。

・８月中旬から期末にかけては、2015年内の米利上げ観測の高まりを受けて円安が進んだことなどから国内株式市況が一時上昇する場面もありましたが、中国経済減速への不安から世界同時株安となったことなどにより、国内株式市況は下落しました。

・期を通じてみると、国内株式市況は下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

・株式ポートフォリオは、ベンチマークである東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）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13.4%の下落となったため、カイ離は1.7%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

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

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

・期中における先物組入比率の平均は、1.2%程度となりました。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.7%程度でした。配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

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

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

（2015年２月21日～2016年２月22日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	0	0.003	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.003)	
合計	0	0.003	
期中の平均基準価額は、12,079円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2015年２月21日～2016年２月22日）

株式

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
		千株	千円	千株	千円
国内	上場	23,951 (△ 3,082)	31,446,911 (－)	57,878	80,787,988

（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 新規買付額	買建 決済額	売建 新規売付額	売建 決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	株式先物取引	57,482	57,014	－	－

○株式売買比率

（2015年２月21日～2016年２月22日）

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項　　目	当　　期
(a) 期中の株式売買金額	112,234,899千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	246,106,376千円
(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

（2015年２月21日～2016年２月22日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	31,446	6,634	21.1	80,787	17,743	22.0

利害関係人の発行する有価証券等

種　　類	買　付　額	売　付　額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	703	2,246	4,158

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
	百万円
株式	196

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）	7,355千円
うち利害関係人への支払額（B）	119千円
（B）／（A）	1.6%

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

○組入資産の明細

（2016年２月22日現在）

国内株式

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業（0.1%）			
極洋	59	49	12,838
日本水産	172	132.6	72,399
マルハニチロ	27.1	23.5	52,546
サカタのタネ	22.5	16.9	46,559
ホクト	15.5	11.7	23,669
鉱業（0.3%）			
住石ホールディングス	42.4	35.3	3,282
日鉄鉱業	39	32	13,120
三井松島産業	94	76	8,968
国際石油開発帝石	736.6	606	499,889
日本海洋掘削	4.2	3.4	6,898
石油資源開発	19.9	18.2	46,300
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	9.4	7.6	9,310
建設業（3.1%）			
ショーボンドホールディングス	13.5	12	46,080
ミライト・ホールディングス	42.8	35.3	28,063
タマホーム	11.8	9.8	4,096
サンヨーホームズ	1.8	3.5	1,750
ダイセキ環境ソリューション	1.7	2.7	2,799
安藤・間	93.3	76.8	39,782
東急建設	49.8	37.6	30,944
コムシスホールディングス	62.2	49.4	83,881
ミサワホーム	16.8	13.8	9,108
高松コンストラクショングループ	10.5	8.6	18,464
東建コーポレーション	5.2	4.7	40,279
ヤマウラ	6.8	5.8	2,627
大成建設	707	597	413,124
大林組	419	345	341,205
清水建設	428	352	304,480
飛島建設	92	88.7	13,659
長谷工コーポレーション	174.8	134.2	126,953
松井建設	16	12.8	8,537
錢高組	20	16	7,072
鹿島建設	615	539	347,116
不動テトラ	106.3	82.3	9,382
鉄建建設	85	70	17,990
日鉄住金テックスエンジ	27	－	－
西松建設	151	133	57,057
三井住友建設	567.3	443.5	40,802
大豊建設	39	44	18,744
前田建設工業	93	71	53,321
佐田建設	50	8.3	3,344
ナカノフドー建設	11.2	8.9	4,681
奥村組	133	109	60,604
大和小田急建設	7.8	－	－
東鉄工業	16.7	13.7	41,511
イチケン	16	14	4,172
淺沼組	47	37	8,399
戸田建設	175	134	60,970
熊谷組	176	168	49,728
青木あすなろ建設	8.5	7.6	5,046
北野建設	29	25	6,675
植木組	18	16	3,424
三井ホーム	17	15	7,590
矢作建設工業	17.7	15.8	11,549
ピーエス三菱	15.4	14.1	5,907
日本ハウスホールディングス	17.6	24	9,576
大東建託	53.1	43	653,170
新日本建設	17.1	13.9	7,228
ＮＩＰＰＯ	32	26	43,914
東亜道路工業	27	22	7,700
前田道路	44	36	61,812
日本道路	42	34	18,904
東亜建設工業	106	100	24,300
若築建設	81	68	7,820
東洋建設	37.4	36.2	15,095
五洋建設	155.2	127.6	59,716

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大林道路	16	13.6	9,941
世紀東急工業	21	18.3	8,546
福田組	21	18	16,416
住友林業	103.1	79.2	100,900
日本基礎技術	16.9	13	5,811
日成ビルド工業	39	31	11,439
ヤマダ・エスバイエルホーム	67	63	4,284
巴コーポレーション	18	15	5,595
パナホーム	52	43	35,389
大和ハウス工業	409.4	339.8	1,041,147
ライト工業	22.5	22.2	24,331
積水ハウス	430.3	384.6	693,626
日特建設	18.9	12.7	5,054
北陸電気工事	7	4.3	3,289
ユアテック	22	18	14,166
西部電気工業	12	10	4,100
四電工	12	10	3,700
中電工	20.1	16.5	38,626
関電工	64	46	38,594
きんでん	93	69.5	100,705
東京エネシス	16	13	11,349
トーエネック	20	16	10,864
住友電設	11.1	9.2	12,263
日本電設工業	22.7	18.8	40,156
協和エクシオ	59.3	45.1	56,871
新日本空調	11.7	9.8	9,417
ＮＤＳ	22	19	5,358
九電工	26	21	47,124
三機工業	28.7	25.7	24,080
日揮	141	116	198,360
中外炉工業	43	36	6,336
ヤマト	13	10.6	4,547
太平電業	19	16	14,240
高砂熱学工業	38.9	34.3	52,410
三晃金属工業	15	13	3,445
朝日工業社	16	14	6,258
明星工業	24.8	21.1	8,693
大氣社	19.9	14.1	35,785
ダイダン	19	15	11,310

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日比谷総合設備	18	14	22,834
東芝プラントシステム	22.4	18.5	23,328
東洋エンジニアリング	68	61	16,043
千代田化工建設	101	83	70,301
新興プランテック	28.3	23.6	20,768
食料品（5.2%）			
日本製粉	85	76	61,180
日清製粉グループ本社	153.3	126.1	235,933
日東富士製粉	11	9	3,177
昭和産業	57	47	21,244
鳥越製粉	11.6	8.9	5,687
中部飼料	13.6	10.6	8,405
フィード・ワン	88.2	69.6	8,143
東洋精糖	28	23	2,323
日本甜菜製糖	73	59	11,033
三井製糖	55	45	21,600
塩水港精糖	16.1	13.9	3,197
日新製糖	－	1.6	6,920
森永製菓	126	104	66,768
中村屋	33	27	12,501
江崎グリコ	32.3	26.6	161,196
名糖産業	6.3	5.2	6,760
不二家	81	65	12,350
山崎製パン	102	84	181,020
第一屋製パン	23	23	2,369
モロゾフ	22	18	7,578
亀田製菓	7.7	6.4	27,520
寿スピリッツ	3.3	2.7	14,769
カルビー	51.8	42.6	197,877
森永乳業	126	103	55,208
六甲バター	6.3	5.1	9,134
ヤクルト本社	75	61.7	343,052
明治ホールディングス	41.4	68.1	635,373
雪印メグミルク	32.8	27.1	73,684
プリマハム	78	72	20,016
日本ハム	103	85	215,730
伊藤ハム	76	55	38,830
丸大食品	72	59	24,898
米久	4.5	3.6	9,237

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	8.7	7.1	15,257
サッポロホールディングス	229	176	96,624
アサヒグループホールディングス	281.1	215.8	754,652
キリンホールディングス	598.3	466.2	698,833
宝ホールディングス	109.7	83.3	68,389
オエノンホールディングス	37	32	6,560
養命酒製造	9	3.5	6,702
コカ・コーラウエスト	47.4	39	101,322
コカ・コーライーストジャパン	42.5	40.7	83,516
サントリー食品インターナショナル	83.8	78.8	393,212
ダイドードリンコ	7	5.8	29,696
伊藤園	41.5	34.1	110,654
キーコーヒー	12.4	10	18,010
ユニカフェ	4.3	3.3	3,042
ジャパンフーズ	2.2	1.9	2,141
日清オイリオグループ	67	61	27,694
不二製油グループ本社	37.3	30.7	59,834
かどや製油	1.2	1	2,798
Ｊ－オイルミルズ	58	48	16,320
キッコーマン	114	87	331,470
味の素	322	246	708,603
キユーピー	71.1	58.5	149,409
ハウス食品グループ本社	51.8	39.3	86,656
カゴメ	54	41.3	88,340
焼津水産化学工業	6.9	5.4	5,427
アリアケジャパン	12.7	9.4	59,972
ピエトロ	－	1.2	2,215
エバラ食品工業	2.4	2.8	5,451
ニチレイ	149	123	109,101
東洋水産	73	56.6	235,739
イートアンド	1.6	1.3	2,956
日清食品ホールディングス	59.2	48.7	263,467
永谷園ホールディングス	13	11	11,418
一正蒲鉾	2.5	4.2	3,624
フジッコ	13	11.2	24,628
ロック・フィールド	7.2	6	17,976
日本たばこ産業	775	680.1	3,089,014
ケンコーマヨネーズ	4.6	3.7	8,576
わらべや日洋	8.2	6.2	14,594

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
なとり	6.5	5.7	9,074
北の達人コーポレーション	－	1.8	939
ユーグレナ	30.3	38.8	59,014
ミヨシ油脂	50	42	5,082
理研ビタミン	4.1	3.3	12,342
繊維製品（0.7%）			
片倉工業	16.6	13.7	16,179
グンゼ	105	87	24,882
東洋紡	518	426	66,882
ユニチカ	395	324	16,524
富士紡ホールディングス	64	54	11,016
日清紡ホールディングス	83	－	－
倉敷紡績	135	111	19,425
シキボウ	87	74	7,918
日本毛織	41	33	24,453
トーア紡コーポレーション	79	6.5	3,003
ダイドーリミテッド	16.5	13.6	6,351
帝国繊維	13.6	11.2	16,508
帝人	534	439	166,381
東レ	1,011	780	712,764
サカイオーベックス	39	30	5,040
住江織物	33	28	8,008
日本フエルト	7.3	5.1	2,315
イチカワ	9	7	1,897
日本バイリーン	18	－	－
芦森工業	31	25	3,725
アツギ	121	87	9,483
ダイニック	26	22	3,322
セーレン	32.4	26.9	28,621
東海染工	－	19	2,223
小松精練	22.5	16.8	9,710
ワコールホールディングス	78	64	83,904
ホギメディカル	8.2	6.7	37,118
クラウディア	1.7	3.6	1,746
ＴＳＩホールディングス	58.3	48	34,992
三陽商会	70	61	15,677
オンワードホールディングス	94	71	50,055
ルック	24	21	3,003
キムラタン	649	510	3,570

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ゴールドウイン	30	4.5	20,565
デサント	29.8	24.6	42,139
キング	8	6.8	2,604
ヤマトインターナショナル	10.4	7.6	2,888
パルプ・紙（0.3%）			
特種東海製紙	76	62	22,816
王子ホールディングス	536	441	189,630
日本製紙	63.1	55.6	101,470
三菱製紙	205	166	13,280
北越紀州製紙	80.7	66.6	41,092
中越パルプ工業	51	44	6,996
巴川製紙所	－	18	3,168
大王製紙	58	47.5	41,420
レンゴー	115	95	51,205
トーモク	41	34	8,500
ザ・パック	9.1	7.5	19,815
化学（6.1%）			
クラレ	222.5	169.7	210,258
旭化成	815	671	440,243
共和レザー	8.5	7	5,782
コープケミカル	23	－	－
昭和電工	870	716	80,908
住友化学	962	792	397,584
日本化成	26	22	2,508
住友精化	27	22	12,914
日産化学工業	87.3	64.6	165,569
ラサ工業	52	42	4,242
クレハ	91	81	29,241
多木化学	8	7	4,438
テイカ	22	18	9,468
石原産業	223	195	14,235
片倉コープアグリ	9	14	3,038
日東エフシー	－	6.3	5,260
日本曹達	83	69	34,845
東ソー	326	290	124,120
トクヤマ	204	180	25,200
セントラル硝子	133	116	62,988
東亜合成	164	67.3	59,224
大阪ソーダ	52	46	19,044

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
関東電化工業	32	25	21,925
デンカ	271	223	89,423
信越化学工業	234.4	192.8	1,094,140
日本カーバイド工業	46	39	4,641
堺化学工業	53	43	12,771
エア・ウォーター	115	89	140,887
大陽日酸	168	82.8	83,296
日本化学工業	49	41	7,913
日本パーカライジング	30.8	55	53,460
高圧ガス工業	19	16	9,376
チタン工業	16	14	2,324
四国化成工業	19	15	13,035
戸田工業	27	23	7,291
ステラ　ケミファ	6.9	5.5	12,655
保土谷化学工業	41	34	5,916
日本触媒	103	15.6	105,924
大日精化工業	54	41	18,122
カネカ	176	145	125,280
三菱瓦斯化学	225	185	105,635
三井化学	594	456	180,576
ＪＳＲ	129.1	100.9	159,119
東京応化工業	27.1	21.6	64,022
大阪有機化学工業	9.5	7.8	4,797
三菱ケミカルホールディングス	817.1	720.2	439,322
日本合成化学工業	30	25	16,550
ダイセル	183.8	151.2	229,068
住友ベークライト	122	100	48,300
積水化学工業	303	244.1	312,203
日本ゼオン	113	93	64,728
アイカ工業	39.3	32.3	70,607
宇部興産	658	576	110,592
積水樹脂	20	16.5	22,176
タキロン	27	25	13,575
旭有機材工業	46	34	6,868
日立化成	64.6	53.1	99,243
ニチバン	13	11	6,864
リケンテクノス	21.3	17.4	6,246
大倉工業	31	26	7,072
積水化成品工業	37	27	9,369

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
群栄化学工業	35	28	7,476
タイガースポリマー	6.4	5.3	3,217
ミライアル	4.8	4.2	3,607
ダイキアクシス	1.6	2.2	1,909
ダイキョーニシカワ	3.2	13.8	21,169
日本化薬	85	70	79,870
カーリットホールディングス	10.5	10.3	5,026
日本精化	10.7	9	6,489
扶桑化学工業	－	6.8	9,241
ＡＤＥＫＡ	60.2	52.9	79,085
日油	109	82	64,944
新日本理化	21.5	18.3	2,635
ハリマ化成グループ	11	9.4	4,756
花王	351.5	289.2	1,691,241
第一工業製薬	29	24	7,488
ニイタカ	－	1.7	2,221
三洋化成工業	41	33	25,278
大日本塗料	75	62	12,276
日本ペイントホールディングス	113.1	83	196,876
関西ペイント	158	121.7	205,551
神東塗料	10	9	1,611
中国塗料	37	30	21,390
日本特殊塗料	10.1	7.6	7,531
藤倉化成	17.7	14.6	7,533
太陽ホールディングス	10.6	7.9	29,111
ＤＩＣ	524	431	104,302
サカタインクス	26.6	21.9	24,900
東洋インキＳＣホールディングス	129	105	46,935
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	4.3	7.6	6,908
富士フイルムホールディングス	299.1	246.1	1,050,600
資生堂	232.5	204	494,904
ライオン	151	124	151,776
高砂香料工業	43	7.1	16,124
マンダム	13	9.9	45,936
ミルボン	7.7	6.3	27,657
ファンケル	30.4	24.9	34,635
コーセー	21.1	17.4	166,344
コタ	3.7	3.4	4,838
シーズ・ホールディングス	8.8	13.5	24,853

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
シーボン	1.6	1.3	3,120
ポーラ・オルビスホールディングス	15.5	11	94,600
ノエビアホールディングス	8.1	6.8	20,536
アジュバンコスメジャパン	2.5	2	1,996
エステー	8.9	7.3	7,993
アグロ　カネショウ	3.6	4.2	3,704
コニシ	10.3	8.4	21,982
長谷川香料	16.5	13.6	19,706
星光ＰＭＣ	7.4	6.1	5,575
小林製薬	21.4	16.3	157,947
荒川化学工業	10.9	9.2	8,528
メック	10.4	8.5	7,148
日本高純度化学	3.7	3.1	6,274
ＪＣＵ	3.6	3.1	10,199
新田ゼラチン	8.2	7.2	5,119
ＯＡＴアグリオ	－	1	1,239
デクセリアルズ	－	24.1	24,750
アース製薬	9.3	7.7	31,185
イハラケミカル工業	20	16.6	20,517
北興化学工業	14	12	3,504
大成ラミック	3.6	3	9,045
クミアイ化学工業	27	22.3	25,600
日本農薬	29.8	24.6	14,489
アキレス	111	88	12,848
有沢製作所	21.9	16	8,960
日東電工	101	83.1	497,104
レック	4.5	3.3	4,151
きもと	25	19.3	3,223
藤森工業	11.2	9.2	22,475
前澤化成工業	9.2	7.5	7,312
ＪＳＰ	9.7	7	15,673
エフピコ	11.5	9.5	41,800
天馬	10	8.2	15,637
信越ポリマー	25.7	21	12,201
東リ	35	28	8,148
ニフコ	29.2	20.6	104,236
日本バルカー工業	54	40	11,040
ユニ・チャーム	264.6	217.7	525,745

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
医薬品（5.8%）			
協和発酵キリン	156	128.6	207,817
武田薬品工業	489.6	428.2	2,319,559
アステラス製薬	1,488.6	1,204	1,898,708
大日本住友製薬	92.5	76.1	94,059
塩野義製薬	204.1	156.7	746,518
田辺三菱製薬	152.3	125.3	254,484
わかもと製薬	16	13	3,484
あすか製薬	15.5	13.8	16,228
日本新薬	30	24.6	95,448
ビオフェルミン製薬	2.1	1.7	5,967
中外製薬	130.1	107	360,590
科研製薬	45	18.5	133,200
エーザイ	172.4	132.4	926,800
ロート製薬	59.4	52.6	108,408
小野薬品工業	59.4	48.8	962,092
久光製薬	36.9	33.4	167,668
有機合成薬品工業	9	8	1,872
持田製薬	9.3	7.4	63,196
参天製薬	48	197.9	344,741
扶桑薬品工業	44	36	9,072
日本ケミファ	17	15	7,200
ツムラ	41.1	33.8	94,403
日医工	30.6	25.1	68,548
キッセイ薬品工業	24.3	19	50,293
生化学工業	25	20.6	27,521
栄研化学	11.1	9	19,242
日水製薬	5.2	4.4	5,416
鳥居薬品	8.9	7.3	17,089
ＪＣＲファーマ	10.1	8.3	16,666
東和薬品	6.6	4.9	25,578
富士製薬工業	3.6	3	6,072
沢井製薬	20.7	18.2	138,684
ゼリア新薬工業	26.8	22.1	30,696
第一三共	439.6	361.6	816,854
キョーリン製薬ホールディングス	34.8	28.7	61,044
大幸薬品	5.9	5.2	6,994
ダイト	5.3	4.5	12,172
大塚ホールディングス	259.4	231.2	959,942

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大正製薬ホールディングス	31.4	25.9	230,769
ペプチドリーム	－	13.2	56,166
石油・石炭製品（0.5%）			
日本コークス工業	118.7	90.4	6,870
昭和シェル石油	116.8	108.1	101,181
コスモ石油	361	－	－
ニチレキ	16	13	9,685
東燃ゼネラル石油	197	162	145,800
ユシロ化学工業	7.7	5.7	7,022
ビーピー・カストロール	5.3	4.3	5,276
富士石油	30.5	25.4	7,010
ＭＯＲＥＳＣＯ	3.4	3.4	5,004
出光興産	62	56.1	100,755
ＪＸホールディングス	1,450.4	1,272.8	566,650
コスモエネルギーホールディングス	－	32.5	38,610
ゴム製品（1.0%）			
横浜ゴム	146	64.9	123,504
東洋ゴム工業	59.1	48.6	83,154
ブリヂストン	409.6	362.9	1,448,333
住友ゴム工業	101.9	100.6	166,694
藤倉ゴム工業	11.3	9.2	4,167
オカモト	44	33	30,954
フコク	5.4	3.7	3,148
ニッタ	12.8	11.6	33,779
住友理工	24.1	23.1	22,961
三ツ星ベルト	33	26	22,698
バンドー化学	48	39	16,809
ガラス・土石製品（0.8%）			
日東紡績	96	71	25,773
旭硝子	644	567	309,015
日本板硝子	630	521	37,512
石塚硝子	19	16	3,472
日本山村硝子	52	44	7,216
日本電気硝子	251	222	118,104
オハラ	4.6	3.8	1,972
住友大阪セメント	243	213	87,756
太平洋セメント	815	671	152,988
デイ・シイ	13.7	10.5	3,318
日本ヒューム	13.8	10.3	5,634

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本コンクリート工業	22.7	22.8	5,700
三谷セキサン	6.5	5.3	7,271
アジアパイルホールディングス	17.6	13.5	4,833
東海カーボン	112	93	25,389
日本カーボン	69	54	11,556
東洋炭素	7.3	6	8,718
ノリタケカンパニーリミテド	73	60	14,580
ＴＯＴＯ	192	79	255,565
日本碍子	165	136	279,480
日本特殊陶業	112.6	92.6	200,479
ダントーホールディングス	21	15	2,715
ＭＡＲＵＷＡ	3.8	3.9	9,707
品川リフラクトリーズ	33	26	5,278
黒崎播磨	28	24	5,616
ヨータイ	7	6	1,758
イソライト工業	6.6	6	1,062
東京窯業	16	12	2,004
ニッカトー	3.9	3.6	1,342
フジミインコーポレーテッド	12.6	9.4	10,951
エーアンドエーマテリアル	31	27	1,917
ニチアス	58	54	33,912
ニチハ	17.4	14.4	22,017
鉄鋼（1.1%）			
新日鐵住金	5,524	484.7	908,327
神戸製鋼所	2,259	1,975	169,850
中山製鋼所	101	125	8,125
合同製鐵	68	61	11,712
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	333.3	293.8	379,736
日新製鋼	55.3	49	57,134
東京製鐵	66.3	59.4	43,005
共英製鋼	13.9	11.3	19,221
大和工業	29.7	23.7	54,675
東京鐵鋼	25	22	8,558
大阪製鐵	8.2	6.7	11,570
淀川製鋼所	92	15.9	38,970
東洋鋼鈑	31	26	7,826
丸一鋼管	40.1	36	112,500
モリ工業	21	17	5,219
大同特殊鋼	219	180	73,620

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本高周波鋼業	54	45	3,240
日本冶金工業	103.4	81.7	9,232
山陽特殊製鋼	78	63	30,177
愛知製鋼	77	63	26,649
日立金属	133	123.1	146,735
日本金属	36	31	3,317
大平洋金属	84	76	23,712
新日本電工	79.9	61.5	10,147
栗本鐵工所	68	52	8,112
虹技	19	16	2,464
日本鋳鉄管	13	13	1,742
三菱製鋼	86	76	13,300
日亜鋼業	18	14.9	3,903
日本精線	10	8	3,816
シンニッタン	13.7	9.8	5,762
新家工業	27	24	3,168
非鉄金属（0.8%）			
大紀アルミニウム工業所	22	17	4,369
日本軽金属ホールディングス	316.2	242.7	40,773
三井金属鉱業	355	275	44,000
東邦亜鉛	74	58	16,298
三菱マテリアル	815	671	208,681
住友金属鉱山	361	297	344,668
ＤＯＷＡホールディングス	156	138	83,076
古河機械金属	204	168	26,880
大阪チタニウムテクノロジーズ	12.9	10.6	17,299
東邦チタニウム	22.2	18.4	15,916
ＵＡＣＪ	149	150	32,100
古河電気工業	383	338	78,078
住友電気工業	492.2	430.2	576,683
フジクラ	182	150	69,900
昭和電線ホールディングス	150	135	7,425
東京特殊電線	2.2	1.8	1,542
タツタ電線	24.7	22.3	7,336
沖電線	14	14	2,744
カナレ電気	2	1.7	2,878
平河ヒューテック	3	5.2	5,012
リョービ	73	65	26,455
アーレスティ	11.7	12.6	8,253

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アサヒホールディングス	19.5	16.1	23,184
金属製品（0.7%）			
稲葉製作所	5.4	5.7	6,600
宮地エンジニアリンググループ	40	35	4,830
トーカロ	8.6	7.5	14,130
アルファＣｏ	4.3	3.5	3,710
ＳＵＭＣＯ	89.9	84.1	64,168
川田テクノロジーズ	2.5	2.1	6,615
東洋製罐グループホールディングス	92.8	76.4	150,584
ホッカンホールディングス	32	29	8,381
コロナ	6.7	5.7	5,700
横河ブリッジホールディングス	24.8	20.5	21,689
駒井ハルテック	24	21	4,704
高田機工	13	12	2,232
三和ホールディングス	125.9	108.9	78,299
文化シヤッター	36	29.8	26,969
三協立山	17.2	14.1	18,315
アルインコ	5.6	5.9	5,823
東洋シヤッター	3.4	3.1	1,683
ＬＩＸＩＬグループ	194.1	149.7	358,232
日本フイルコン	10.2	8.1	3,369
ノーリツ	25.6	21	39,774
長府製作所	13.9	11.6	28,884
リンナイ	24.3	20	194,800
ダイニチ工業	6.6	5.6	3,410
日東精工	19	16	4,832
三洋工業	17	15	2,235
岡部	25.8	22.2	15,051
ジーテクト	8.9	11.1	13,009
東プレ	25	20.6	42,333
高周波熱錬	22.5	20	16,340
東京製綱	90	74	10,286
サンコール	8	5.6	2,648
モリテック　スチール	6.6	5.5	1,364
パイオラックス	6.6	5.4	28,242
日本発條	113.5	101.1	103,122
中央発條	17	14	3,682
アドバネクス	－	2.2	2,756
立川ブラインド工業	－	4.7	3,219

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	9.7	8	8,208
機械（4.6%）			
日本ドライケミカル	1.7	1.3	2,704
日本製鋼所	187	178	67,640
三浦工業	58.3	47.9	86,699
タクマ	44	39	33,930
ツガミ	38	31	12,369
オークマ	85	70	60,340
東芝機械	71	59	21,830
アマダホールディングス	194.7	156.7	170,646
アイダエンジニアリング	28.5	28.1	24,278
滝澤鉄工所	41	35	4,340
富士機械製造	42.5	35	37,695
牧野フライス製作所	65	53	38,266
オーエスジー	59.5	48.9	93,496
ダイジェット工業	16	14	1,820
旭ダイヤモンド工業	35.8	29.4	28,694
ＤＭＧ森精機	82.4	59.3	57,698
ソディック	－	20.6	15,202
ディスコ	15.2	13.7	147,686
日東工器	7.5	6.3	13,047
パンチ工業	2.9	4.4	3,036
豊和工業	7.6	6.5	3,510
ＯＫＫ	53	44	4,928
石川製作所	36	32	2,176
東洋機械金属	9.4	8	2,576
津田駒工業	34	29	2,842
島精機製作所	18.5	15.1	25,911
フリュー	－	1.6	5,120
日阪製作所	16.5	13.6	10,948
やまびこ	5.1	19.7	14,775
ペガサスミシン製造	11.7	11.1	5,439
ナブテスコ	79.5	55.8	123,820
三井海洋開発	13.2	12.5	18,437
レオン自動機	10.4	9.1	5,505
ＳＭＣ	39.2	32.2	881,153
新川	11.1	9.9	3,940
ホソカワミクロン	22	18	9,504
ユニオンツール	6.5	4.6	11,178

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
オイレス工業	16.2	14	24,878
日精エー・エス・ビー機械	4.2	4	7,224
サトーホールディングス	16.3	14.5	36,134
日本エアーテック	4.2	4.4	3,040
日精樹脂工業	9.5	8	5,440
ワイエイシイ	5.5	4.5	2,785
小松製作所	647.6	526.7	917,248
住友重機械工業	357	313	145,232
日立建機	58.3	48	78,576
日工	18	16	5,200
巴工業	4.8	4.4	6,261
井関農機	134	111	19,980
ＴＯＷＡ	10.9	10.6	7,335
丸山製作所	30	24	3,960
北川鉄工所	60	49	10,094
タカキタ	－	2.8	1,450
クボタ	630	515.9	747,539
荏原実業	3.7	3.1	3,751
三菱化工機	43	36	8,028
月島機械	22.9	20.2	20,341
帝国電機製作所	8.8	7.9	5,229
新東工業	30.8	24.5	22,270
澁谷工業	10.9	9	11,988
アイチ　コーポレーション	18.4	15.2	11,734
小森コーポレーション	31.9	26	31,252
鶴見製作所	9.7	8	14,064
住友精密工業	21	18	6,192
酒井重工業	25	21	3,696
荏原製作所	271	238	101,388
石井鐵工所	20	17	2,482
酉島製作所	13.2	11.6	11,240
北越工業	9.7	11.4	7,318
ダイキン工業	181.7	149.5	1,167,445
オルガノ	24	19	7,847
トーヨーカネツ	76	58	13,920
栗田工業	73.9	64.6	164,471
椿本チエイン	67	60	37,620
大同工業	26	22	4,180
日本コンベヤ	42	38	4,484

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
木村化工機	12.5	9.6	3,456
アネスト岩田	19.6	17.3	14,929
ダイフク	61.7	55.2	96,820
サムコ	1.8	1.8	1,441
加藤製作所	27	24	8,976
油研工業	25	21	3,906
タダノ	60	50	48,700
フジテック	36.2	29.7	34,838
ＣＫＤ	35	28.7	22,414
キトー	13.7	13	9,659
平和	27.1	31.8	75,048
理想科学工業	15.2	11.4	20,360
ＳＡＮＫＹＯ	37.8	28.6	121,550
日本金銭機械	11.6	9.5	9,395
マースエンジニアリング	6.9	5.7	11,097
福島工業	6.8	6.3	14,263
オーイズミ	4.4	4.6	2,185
ダイコク電機	5.2	4.2	5,115
竹内製作所	－	15.2	21,842
アマノ	41.6	31.7	50,181
ＪＵＫＩ	93	15.4	13,274
サンデンホールディングス	76	63	18,333
蛇の目ミシン工業	122	10.2	5,477
マックス	19	16	19,040
グローリー	39.9	35	132,650
新晃工業	8.7	7.2	12,211
大和冷機工業	18	16.5	15,180
セガサミーホールディングス	134.1	110.3	131,918
日本ピストンリング	50	4.4	6,613
リケン	53	47	16,685
ＴＰＲ	13.9	12.6	33,415
ツバキ・ナカシマ	－	9.5	14,848
ホシザキ電機	27.3	22.5	193,275
大豊工業	10.1	8.4	9,130
日本精工	256	210.9	221,023
ＮＴＮ	289	255	92,310
ジェイテクト	133	109.4	169,570
不二越	116	95	35,910
日本トムソン	43	35	13,265

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＴＨＫ	83	68.3	134,482
ユーシン精機	5.5	4	6,896
前澤給装工業	4.8	4.3	5,886
イーグル工業	17.3	12.7	17,805
前澤工業	9.5	7.9	2,148
日本ピラー工業	13.8	10.4	9,484
キッツ	56.3	49.5	23,265
日立工機	33.5	27.6	20,424
マキタ	81.4	66.9	452,244
日立造船	97.6	81.2	41,736
三菱重工業	2,092	1,828	749,297
ＩＨＩ	899	789	149,910
電気機器（11.4%）			
日清紡ホールディングス	－	57	63,270
イビデン	81.8	62.9	85,103
コニカミノルタ	297.4	256.4	236,400
ブラザー工業	161.3	132.7	158,974
ミネベア	186	165	130,680
日立製作所	2,997	2,619	1,248,215
東芝	2,627	2,161	396,543
三菱電機	1,248	1,095	1,241,730
富士電機	347	309	118,038
東洋電機製造	25	21	6,699
安川電機	146.7	127.5	163,327
シンフォニアテクノロジー	88	68	9,792
明電舎	115	94	43,616
オリジン電気	18	15	3,825
山洋電気	28	27	13,500
デンヨー	11.3	9.4	11,007
東芝テック	89	74	26,048
芝浦メカトロニクス	21	18	3,438
マブチモーター	38.2	29.4	135,828
日本電産	134.9	123.6	911,179
東光高岳	6.3	5.7	7,620
ダブル・スコープ	－	3	12,075
ダイヘン	68	60	27,240
田淵電機	－	11.8	5,156
ヤーマン	1.7	1.4	2,704
ＪＶＣケンウッド	92.6	76.6	22,520

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ミマキエンジニアリング	－	7.2	3,088
第一精工	4.6	4.5	5,782
日新電機	29	24.1	22,099
大崎電気工業	20	19	13,623
オムロン	134.8	117.8	361,646
日東工業	19.9	16.4	29,503
ＩＤＥＣ	14.8	13.1	13,401
不二電機工業	1.1	0.9	1,257
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	240	198	88,704
サクサホールディングス	33	29	5,539
メルコホールディングス	7	5.8	12,974
テクノメディカ	2.8	2.4	5,364
日本電気	1,615	1,412	385,476
富士通	1,203	990	410,058
沖電気工業	432	445	67,640
岩崎通信機	63	56	4,032
電気興業	36	27	14,877
サンケン電気	63	56	16,968
ナカヨ	13	11	3,553
アイホン	7.3	5.8	11,211
ルネサスエレクトロニクス	64.3	53.1	34,992
セイコーエプソン	85.2	152.9	275,067
ワコム	98.7	80.9	39,155
アルバック	21.1	18.9	61,992
アクセル	5.7	4.7	4,042
ＥＩＺＯ	11.5	10.2	30,498
ジャパンディスプレイ	192.2	192.2	40,554
日本信号	34.3	28.3	22,611
京三製作所	29	24	7,704
能美防災	16.4	11.7	15,830
ホーチキ	9	7.6	8,618
エレコム	3.9	8.9	14,400
日本無線	27	26	6,942
パナソニック	1,520.8	1,173	991,302
シャープ	1,055	868	150,164
アンリツ	78.1	61.4	39,173
富士通ゼネラル	38	31	46,128
日立国際電気	33	23	29,118
ソニー	807.4	724.4	1,802,307

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＴＤＫ	75.3	62	355,880
帝国通信工業	31	27	4,401
ミツミ電機	44.4	39.6	19,285
タムラ製作所	48	40	10,840
アルプス電気	98.5	87.1	157,128
パイオニア	189.4	167	40,748
日本電波工業	11.5	9.6	6,480
鈴木	1.4	3	1,389
日本トリム	3.1	2.7	11,704
ローランド　ディー．ジー．	5.1	5.1	11,903
フォスター電機	12.8	12.8	27,366
クラリオン	67	54	18,954
ＳＭＫ	37	30	15,870
ヨコオ	9.9	7.4	4,003
東光	30	21	7,518
ホシデン	39.6	31.4	20,755
ヒロセ電機	20.2	16.6	209,326
日本航空電子工業	36	29	33,379
ＴＯＡ	13.3	12.2	12,346
日立マクセル	18.6	17	27,659
古野電気	15	12.5	8,725
ユニデンホールディングス	37	36	4,068
アルパイン	29.8	24.6	31,242
スミダコーポレーション	11.3	8.8	6,230
アイコム	7	5.7	12,517
リオン	3.7	3.9	6,084
船井電機	12.9	10.9	10,496
横河電機	124.9	102.8	115,547
新電元工業	48	36	12,996
アズビル	40.7	33.5	93,029
東亜ディーケーケー	5.1	4.5	2,295
日本光電工業	26.6	42.9	121,235
チノー	4.4	3.5	3,517
共和電業	15.4	12.6	4,573
日本電子材料	5.6	4.4	1,689
堀場製作所	23.1	19	69,445
アドバンテスト	85.1	70	71,750
小野測器	6.2	5.1	3,605
エスペック	13.9	10.6	14,235

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
パナソニック　デバイスＳＵＮＸ	10.9	8.8	4,787
キーエンス	28.3	23.3	1,364,914
日置電機	6.5	5.4	12,090
シスメックス	96.6	79.7	530,802
日本マイクロニクス	－	13.5	12,946
メガチップス	13	10.8	11,480
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	8.1	6.6	27,390
澤藤電機	9	7	1,253
コーセル	18.1	14.3	14,271
新日本無線	9	7.7	2,872
オプテックス	8.5	7.6	21,052
千代田インテグレ	5.5	5.4	13,705
レーザーテック	12.8	12.1	17,169
スタンレー電気	89.6	73.7	186,755
岩崎電気	43	37	6,438
ウシオ電機	75.7	62.3	98,309
岡谷電機産業	6.8	5.8	2,146
ヘリオス　テクノ　ホールディング	12.3	8.8	3,361
日本セラミック	7	5.8	10,556
遠藤照明	5.7	5.3	5,443
日本デジタル研究所	10.4	8.6	13,493
古河電池	9	8	4,992
双信電機	6.2	5.9	1,528
山一電機	14.6	9.1	5,205
図研	9.3	7.6	8,838
日本電子	53	40	20,960
カシオ計算機	125.1	102.9	216,295
ファナック	129.9	105	1,789,200
日本シイエムケイ	32.3	22.7	8,853
エンプラス	5.7	5.2	19,838
大真空	23	21	4,263
ローム	61.5	50.6	237,061
浜松ホトニクス	51.9	80.1	224,680
三井ハイテック	16.5	14.9	7,867
新光電気工業	47.2	38.8	25,142
京セラ	204.8	168.5	830,199
太陽誘電	65.4	49.9	55,438
村田製作所	130.9	107.7	1,446,949
ユーシン	17.5	13.7	9,028

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
双葉電子工業	21.3	17.5	26,320
北陸電気工業	54	43	5,332
ニチコン	39.3	32.3	23,675
日本ケミコン	102	84	11,928
ＫＯＡ	17.3	14.2	12,268
市光工業	31	26	4,784
小糸製作所	74.8	61.5	303,195
ミツバ	22.9	17.4	26,047
スター精密	23.8	19.5	24,823
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	118	105	85,260
キヤノン電子	11.5	9.5	15,608
キヤノン	723.5	552.7	1,829,989
リコー	375.2	332.4	376,941
ＭＵＴＯＨホールディングス	18	13	3,029
東京エレクトロン	105	92.1	649,581
輸送用機器（9.9%）			
トヨタ紡織	43.6	35.9	63,291
鬼怒川ゴム工業	29	23	12,052
ユニプレス	23.9	21.2	37,799
豊田自動織機	113.6	93.5	446,930
モリタホールディングス	21.8	17.8	22,143
三櫻工業	16	12.9	7,275
デンソー	308.3	253.6	1,065,120
東海理化電機製作所	32.9	30	70,710
三井造船	483	397	58,359
川崎重工業	907	799	242,097
名村造船所	34.9	30.8	20,790
サノヤスホールディングス	15.9	13.6	2,774
日本車輌製造	46	43	10,449
ニチユ三菱フォークリフト	14.1	11.5	4,956
近畿車輛	20	17	5,066
日産自動車	1,751.7	1,441.1	1,411,125
いすゞ自動車	394.5	297.5	338,406
トヨタ自動車	1,721.7	1,276.9	7,635,862
日野自動車	178.1	146.5	173,163
三菱自動車工業	457.4	407.6	329,748
エフテック	7.4	5.5	5,824
レシップホールディングス	4	3.4	2,590
ＧＭＢ	1.8	1.9	1,569

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ファルテック	1.4	1.8	2,383
武蔵精密工業	13.3	10.8	22,734
日産車体	54.8	50.1	56,763
新明和工業	50	44	33,748
極東開発工業	23.1	20.3	20,949
日信工業	22.8	22.8	32,877
トピー工業	103	85	18,190
ティラド	49	41	6,888
曙ブレーキ工業	53.7	53.7	12,888
タチエス	19.8	16.2	24,219
ＮＯＫ	60.4	49.7	91,945
フタバ産業	38.5	31.7	14,677
ＫＹＢ	140	114	33,516
シロキ工業	28	25	8,275
大同メタル工業	17.5	14.4	11,217
プレス工業	62	54.2	21,192
ミクニ	－	10.2	3,468
カルソニックカンセイ	95	78	63,492
太平洋工業	25.4	22.7	22,722
ケーヒン	28.7	23.5	37,247
河西工業	15.3	12.6	15,561
アイシン精機	114.2	103.3	462,784
富士機工	15	12	4,920
マツダ	371.9	325.1	524,873
ダイハツ工業	149	122.5	194,285
今仙電機製作所	10.7	9.5	9,652
本田技研工業	1,123	923.9	2,702,407
スズキ	260.9	214.6	602,918
富士重工業	424.7	324.4	1,198,009
安永	4.3	4	2,008
ヤマハ発動機	189.8	145	258,535
ショーワ	29.4	26.5	24,539
ＴＢＫ	16.2	12.9	4,760
エクセディ	16.9	13.8	31,353
豊田合成	40.3	37.3	83,365
愛三工業	19.5	17.9	15,877
盟和産業	11	1.5	1,300
ヨロズ	11.6	9.5	20,634
エフ・シー・シー	18.3	16.7	31,062

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
シマノ	53.9	41.4	764,658
タカタ	22.9	18.9	9,582
テイ・エス　テック	26.3	23.8	60,761
ジャムコ	－	4.5	11,200
精密機器（1.6%）			
テルモ	191.3	157.4	611,499
クリエートメディック	3.9	3.5	2,814
日機装	40.6	38.5	32,109
島津製作所	149	132	235,884
ＪＭＳ	23	19	5,510
モリテックス	3.8	3.4	982
長野計器	8	6.7	4,006
ブイ・テクノロジー	2.6	2.5	9,187
東京計器	44	33	5,082
愛知時計電機	16	14	4,186
オーバル	10.3	11.2	2,408
東京精密	22.4	19.7	42,177
マニー	3.4	9.3	15,456
ニコン	233	191.7	324,356
トプコン	37.7	34.8	41,238
オリンパス	185.9	152.9	626,890
理研計器	11	8.3	8,665
タムロン	9.5	8.2	14,087
ＨＯＹＡ	297	238.9	991,435
ノーリツ鋼機	11.4	9.4	3,929
エー・アンド・デイ	11.6	9.4	3,553
シチズンホールディングス	153.6	126.4	79,126
リズム時計工業	55	45	6,390
大研医器	8.7	8.1	7,290
メニコン	－	5.1	15,606
松風	6.1	5.1	6,681
セイコーホールディングス	88	66	26,268
ニプロ	79.7	76.5	82,237
その他製品（1.6%）			
スノーピーク	－	0.9	3,109
パラマウントベッドホールディングス	13	10.8	40,446
トランザクション	－	1.6	945
ＳＨＯ－ＢＩ	4.8	3.8	1,501
ニホンフラッシュ	－	3	2,940

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
前田工繊	12.4	11.3	11,096
永大産業	18	15	5,865
アートネイチャー	9	8.1	7,776
ダンロップスポーツ	7.8	6.8	6,351
バンダイナムコホールディングス	137.6	106.2	249,039
アイフィスジャパン	－	2.4	984
共立印刷	22.2	16.9	4,765
ＳＨＯＥＩ	－	4.9	8,918
フランスベッドホールディングス	85	14.3	13,785
パイロットコーポレーション	10.9	17.9	70,973
萩原工業	2.7	2.2	4,347
トッパン・フォームズ	22.1	18.3	24,247
フジシールインターナショナル	15.1	12.4	45,260
タカラトミー	45.1	34	28,662
廣済堂	12	10	3,080
Ａｓ－ｍｅエステール	3.5	3.1	1,838
アーク	41.6	45.5	3,776
タカノ	5.5	4.6	2,755
プロネクサス	12.6	9.7	10,786
ホクシン	12.3	10.8	1,166
ウッドワン	22	21	5,082
大建工業	51	40	9,560
凸版印刷	352	290	281,880
大日本印刷	380	304	300,960
図書印刷	21	19	8,759
共同印刷	38	35	11,830
日本写真印刷	21	17.2	29,859
光村印刷	11	12	2,460
宝印刷	6.7	5.1	6,420
アシックス	124	95.6	194,259
ツツミ	6.2	5.1	12,489
小松ウオール工業	3.8	3.5	5,834
ヤマハ	91.7	75.5	240,090
河合楽器製作所	4.4	3.9	7,398
クリナップ	11.4	12.1	8,748
ピジョン	23.6	58.2	153,473
兼松日産農林	18	12	1,560
キングジム	10.7	8.8	6,476
リンテック	29.7	24.4	51,850

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＴＡＳＡＫＩ	2.4	2.1	2,746
イトーキ	26.3	21.6	15,055
任天堂	76.9	63.2	1,042,484
三菱鉛筆	10.2	7.6	33,136
タカラスタンダード	51	42	40,656
コクヨ	64.9	53.4	59,113
ナカバヤシ	27	21	5,460
グローブライド	62	5	7,115
岡村製作所	47.5	35.7	35,450
美津濃	66	55	27,665
アデランス	14.7	17.7	10,000
電気・ガス業（2.2%）			
東京電力	1,058.6	870.9	487,704
中部電力	381.8	314.1	448,691
関西電力	509.2	418.9	517,760
中国電力	172.5	141.9	215,404
北陸電力	122.3	100.6	164,984
東北電力	311.8	256.5	373,977
四国電力	112.4	92.4	150,150
九州電力	275.6	226.7	246,196
北海道電力	116.8	96.1	92,928
沖縄電力	8.2	10.9	30,312
電源開発	83.9	87.5	301,875
イーレックス	－	2.1	3,494
東京瓦斯	1,517	1,146	619,871
大阪瓦斯	1,292	1,063	469,420
東邦瓦斯	317	259	205,905
北海道瓦斯	24	24	6,576
広島ガス	－	18.1	7,330
西部瓦斯	140	114	28,956
静岡ガス	35.3	28.8	20,851
メタウォーター	5.8	6.6	15,734
陸運業（5.0%）			
ＳＢＳホールディングス	9.3	10.4	6,718
東武鉄道	667	549	329,400
相鉄ホールディングス	214	176	123,376
東京急行電鉄	678	598	570,492
京浜急行電鉄	342	281	285,215
小田急電鉄	400	329	450,401

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
京王電鉄	349	287	309,099
京成電鉄	187	154	254,562
富士急行	34	27	33,291
新京成電鉄	17	13	5,447
東日本旅客鉄道	228.7	187.7	1,868,178
西日本旅客鉄道	120.1	98.8	673,223
東海旅客鉄道	111.8	91.9	1,907,384
西武ホールディングス	99.4	81.8	192,639
鴻池運輸	7.6	14.5	18,473
西日本鉄道	161	133	111,454
ハマキョウレックス	3.9	7.8	14,258
サカイ引越センター	2.1	4	10,692
近鉄グループホールディングス	1,256	1,033	506,170
阪急阪神ホールディングス	838	689	497,458
南海電気鉄道	280	230	154,560
京阪電気鉄道	280	230	181,470
神戸電鉄	32	25	8,875
名糖運輸	5.3	－	－
名古屋鉄道	452	374	207,196
山陽電気鉄道	46	37	16,835
日本通運	494	397	204,852
ヤマトホールディングス	219.4	189.7	448,925
山九	152	135	71,280
丸運	7.3	5.6	1,366
丸全昭和運輸	42	34	13,566
センコー	50	46	32,706
トナミホールディングス	26	22	5,676
ニッコンホールディングス	40.8	33.6	65,822
日本石油輸送	15	12	2,880
福山通運	75	62	33,108
セイノーホールディングス	97	72.8	87,214
神奈川中央交通	15	12	8,220
日立物流	25.8	21.2	36,697
丸和運輸機関	－	2.4	5,205
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	－	9.8	8,310
海運業（0.2%）			
日本郵船	1,054	922	196,386
商船三井	654	500	104,500
川崎汽船	546	449	84,861

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＮＳユナイテッド海運	54	47	7,144
明治海運	11.7	9.5	3,239
飯野海運	64.6	53.5	23,005
共栄タンカー	11	11	1,518
第一中央汽船	124	－	－
乾汽船	－	8.2	6,297
空運業（0.7%）			
日本航空	238.9	196.6	824,147
ＡＮＡホールディングス	2,453	1,906	621,165
パスコ	12	10	4,110
倉庫・運輸関連業（0.2%）			
トランコム	3.6	2.9	18,386
日新	48	42	11,550
三菱倉庫	82	73	108,989
三井倉庫ホールディングス	73	60	16,380
住友倉庫	91	75	41,250
澁澤倉庫	33	28	7,728
東陽倉庫	22	18	4,158
乾汽船	8.6	－	－
日本トランスシティ	28	24	8,472
ケイヒン	24	21	3,045
中央倉庫	7.1	5.9	5,380
安田倉庫	9.6	8	5,576
東洋埠頭	40	32	4,608
宇徳	10.3	8.8	2,754
上組	149	122	128,100
サンリツ	3.7	2.4	1,164
キムラユニティー	2.8	2.7	2,932
キユーソー流通システム	3.4	2.8	5,807
郵船ロジスティクス	11.3	9.3	11,197
近鉄エクスプレス	11.1	18.3	27,340
東海運	7.3	5.5	1,490
エーアイテイー	5.7	4.6	4,664
内外トランスライン	－	2.5	2,242
情報・通信業（8.3%）			
ＮＥＣネッツエスアイ	15.4	12.7	22,047
システナ	11.6	9.9	14,998
デジタルアーツ	6.6	4.9	9,486
新日鉄住金ソリューションズ	10.3	16.8	33,079

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キューブシステム	5.4	4.1	2,054
コア	5.2	4.4	5,790
ソフトクリエイトホールディングス	3.9	3.5	2,702
ＩＴホールディングス	40.8	33.6	84,369
ネオス	3.7	3.6	1,548
電算システム	4.3	3.6	5,500
グリー	74.5	61.5	33,271
コーエーテクモホールディングス	27.5	24	40,296
三菱総合研究所	4.7	3.9	13,572
ボルテージ	2.4	2.2	2,978
電算	1.3	1.1	2,634
ＡＧＳ	2.1	1.5	1,222
ファインデックス	1.8	6.8	6,895
ヒト・コミュニケーションズ	1.8	2.3	3,983
ブレインパッド	1.9	1.8	1,186
ＫＬａｂ	13.1	15.8	7,805
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ	8.4	6.7	6,499
イーブックイニシアティブジャパン	2.9	2.3	1,156
ネクソン	117	96.9	160,950
アイスタイル	5.3	15.5	12,059
エムアップ	3.5	2.9	1,380
エイチーム	1.5	3.7	5,294
テクノスジャパン	－	1.2	3,120
ｅｎｉｓｈ	3.3	3.3	1,613
コロプラ	21.6	28	55,412
モバイルクリエイト	7.4	6.8	2,713
オルトプラス	2.5	4.1	1,693
ブロードリーフ	10.2	10.5	13,440
ハーツユナイテッドグループ	3.7	3.1	5,936
ブイキューブ	－	5	6,435
サイバーリンクス	－	1.3	986
ＶＯＹＡＧＥ　ＧＲＯＵＰ	－	2.4	2,582
オプティム	－	0.7	2,947
ベリサーブ	1.6	1.3	2,878
ティーガイア	12.2	10.2	12,280
日本アジアグループ	－	8.9	4,521
豆蔵ホールディングス	9.8	8	5,160
テクマトリックス	5.6	4.4	6,538
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	－	177	50,268

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	10.7	8.8	53,768
ザッパラス	7.5	6.4	2,508
インターネットイニシアティブ	19.9	16.4	35,555
さくらインターネット	－	4.9	8,741
ＧＭＯクラウド	2.2	2.4	1,641
ビットアイル	14.2	－	－
ＳＲＡホールディングス	6.5	5.8	13,084
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	－	1.4	1,202
システムインテグレータ	2	1.6	1,155
パイプドビッツ	1.2	－	－
朝日ネット	12.5	8.4	4,057
コムチュア	2.1	1.7	3,343
ｇｕｍｉ	9.3	10.9	6,976
パイプドＨＤ	－	1.4	1,506
パナソニック　インフォメーションシステム	2.9	－	－
フェイス	3.9	2.8	3,340
ハイマックス	－	1.3	1,423
野村総合研究所	69.7	71	272,995
サイバネットシステム	10.5	8.4	7,660
ＣＥホールディングス	1.6	1.8	1,693
インテージホールディングス	7	5.4	7,700
東邦システムサイエンス	3.8	3	1,740
ソースネクスト	6.2	5.4	2,440
ティー・ワイ・オー	13.8	15.3	2,448
クレスコ	2.7	2.2	3,865
フジ・メディア・ホールディングス	128.3	105.5	138,627
オービック	42.5	34.9	194,393
ジャストシステム	17	18.4	15,658
ＴＤＣソフトウェアエンジニアリング	2.7	2.2	2,294
ヤフー	882.7	726.2	314,444
トレンドマイクロ	65.2	49.2	189,912
インフォメーション・ディベロプメント	2.4	1.8	1,584
日本オラクル	19.7	16.2	87,156
アルファシステムズ	4	3.3	5,718
フューチャーアーキテクト	12.7	12	9,624
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	8.2	7.4	5,350
ソフトバンク・テクノロジー	3.4	2.8	3,640
トーセ	2.9	2.9	2,018
オービックビジネスコンサルタント	7.7	5.1	23,001

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
伊藤忠テクノソリューションズ	13.8	22.9	52,120
アイティフォー	14.9	13.2	6,006
東計電算	2.1	1.8	3,463
エックスネット	1.1	0.9	1,334
大塚商会	33.1	27.3	149,331
サイボウズ	16.9	14.1	4,272
ソフトブレーン	17.9	16.1	2,366
電通国際情報サービス	7.5	6.2	13,038
ＥＭシステムズ	1.4	1.8	4,622
ウェザーニューズ	3.6	3.4	12,053
ＣＩＪ	11.3	9	3,933
東洋ビジネスエンジニアリング	1.3	1.1	1,444
日本エンタープライズ	8.6	10.5	2,404
ＷＯＷＯＷ	2.9	4.8	12,307
フュージョンパートナー	5.3	6	3,114
日本コロムビア	5.1	4	2,036
イマジカ・ロボット　ホールディングス	6.3	8.9	3,462
ネットワンシステムズ	50.4	44.2	25,989
アルゴグラフィックス	5.2	4.7	7,924
マーベラス	20.8	17.1	14,039
エイベックス・グループ・ホールディングス	24.5	18.7	24,347
日本ユニシス	34	27.7	38,641
兼松エレクトロニクス	7.7	6.3	11,554
東京放送ホールディングス	73.8	60.7	106,953
日本テレビホールディングス	112.4	92.5	182,780
朝日放送	12.2	10.4	7,113
テレビ朝日ホールディングス	33.3	27.7	56,064
スカパーＪＳＡＴホールディングス	93.5	76.5	52,249
テレビ東京ホールディングス	10	9.1	16,807
日本ＢＳ放送	－	1.5	1,549
Ｕ－ＮＥＸＴ	－	2.6	2,433
コネクシオ	8.5	8.8	9,477
日本通信	－	55.2	9,439
クロップス	1.8	2.1	1,094
日本電信電話	482	783.2	3,768,758
ＫＤＤＩ	417.1	1,029.3	3,101,280
光通信	11.1	12.2	94,916
ＮＴＴドコモ	1,014.8	781.5	2,064,723
エムティーアイ	－	13	9,555

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＧＭＯインターネット	41	37.6	45,796
カドカワ	30.2	31.6	57,259
学研ホールディングス	41	34	8,058
ゼンリン	16.3	13.4	24,816
昭文社	7.3	5.7	3,568
インプレスホールディングス	11.6	10	1,250
アイネット	6.5	5.7	6,213
松竹	81	67	68,340
東宝	87.9	72.3	203,596
東映	46	37	32,523
ＡＯＩ　Ｐｒｏ．	5.6	5.1	5,120
エヌ・ティ・ティ・データ	76.1	62.6	351,812
ピー・シー・エー	1.6	1.2	1,741
ビジネスブレイン太田昭和	－	1.4	1,289
ＤＴＳ	12.7	11.2	23,396
スクウェア・エニックス・ホールディングス	44.8	42.9	125,268
シーイーシー	8	6.6	7,213
カプコン	31.5	25.9	62,263
アイ・エス・ビー	－	1.5	1,105
ジャステック	7.2	6.4	5,849
ＳＣＳＫ	29.3	24.1	105,558
日本システムウエア	4.8	4	3,488
アイネス	16.9	14.5	15,790
ＴＫＣ	10.3	9.4	29,563
富士ソフト	16.9	15	35,025
ＮＳＤ	25.9	21.3	35,315
コナミホールディングス	50	45.7	129,970
福井コンピュータホールディングス	3.3	2.3	2,318
ＪＢＣＣホールディングス	10.3	8.5	5,406
ミロク情報サービス	8	7.5	6,877
ソフトバンクグループ	651.3	574.1	2,925,039
卸売業（4.3%）			
ホウスイ	13	10	1,090
高千穂交易	4.9	3.7	3,222
伊藤忠食品	2.9	2.5	10,462
エレマテック	5.6	4.7	10,100
ＪＡＬＵＸ	3.6	3.3	6,755
あらた	28	4.5	9,765
トーメンデバイス	1.7	1.4	2,412

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京エレクトロン　デバイス	2.4	3.5	5,260
フィールズ	－	6.6	11,437
双日	824.4	638.3	143,617
アルフレッサ　ホールディングス	145.7	127.4	254,163
横浜冷凍	30.1	24.9	25,422
山下医科器械	1	0.8	1,274
ラサ商事	6.9	4.8	2,880
アルコニックス	7.1	5.8	8,305
神戸物産	4.1	6.5	15,431
あい　ホールディングス	19.8	18	50,274
ディーブイエックス	3.6	2.7	2,802
ダイワボウホールディングス	115	92	18,400
マクニカ・富士エレホールディングス	－	18	23,868
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23.2	17.4	16,651
八洲電機	9.5	8.2	4,255
ＵＫＣホールディングス	7.9	6.5	13,422
ＯＣＨＩホールディングス	3.2	3.1	3,121
ＴＯＫＡＩホールディングス	60	44.3	25,118
三洋貿易	7.3	5.4	6,966
ウイン・パートナーズ	4	3.8	5,506
ミタチ産業	2.9	2.2	1,350
シップヘルスケアホールディングス	22.5	20.6	57,494
明治電機工業	3.6	2.9	2,975
デリカフーズ	2.3	2.4	2,287
スターティア	1.1	2	1,046
富士興産	4.9	4	1,736
協栄産業	16	16	2,000
小野建	10.6	8.6	8,264
佐鳥電機	9.7	8.1	5,580
エコートレーディング	3.6	2.5	1,512
伯東	8.1	7.6	7,075
コンドーテック	8.9	7.8	5,967
中山福	6.9	6.2	4,631
ナガイレーベン	17.9	14.7	29,297
三菱食品	13.4	11.1	32,944
松田産業	9	7.3	8,906
第一興商	－	17.9	83,235
メディパルホールディングス	123.2	101.3	176,160
アドヴァン	6.2	10.3	10,794

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＳＰＫ	2.5	2.2	4,191
萩原電気	3.4	2.6	4,802
アズワン	8.7	7.9	31,007
スズデン	3.8	3.4	3,559
尾家産業	4	3.3	2,791
シモジマ	7.6	6.9	7,458
ドウシシャ	15.9	11.9	25,489
小津産業	2.5	2.1	4,531
高速	7.4	6	5,136
たけびし	4.4	3.4	3,270
黒田電気	20.6	18.7	30,350
丸文	10.7	8.8	6,204
ハピネット	7.6	9.2	8,565
橋本総業	2.3	2.2	3,333
エクセル	5.7	5	6,470
マルカキカイ	4	3.3	4,573
ガリバーインターナショナル	37.3	27.3	30,466
日本エム・ディ・エム	10.6	8.6	4,867
進和	7.2	6	8,448
エスケイジャパン	4.8	3.1	1,398
ダイトエレクトロン	5.7	4.9	3,518
シークス	7.8	6.4	18,131
田中商事	4.1	3.3	2,046
オーハシテクニカ	7.5	5.6	7,044
マクニカ	6.2	－	－
白銅	3.7	2.8	2,833
伊藤忠商事	1,030.9	795.1	1,096,045
丸紅	1,077.5	997.2	582,763
高島	24	20	3,300
長瀬産業	75.1	60.9	71,253
蝶理	7.9	6.4	9,139
豊田通商	137.2	112.9	263,057
三共生興	21.3	15.6	6,068
兼松	247	215	32,465
ツカモトコーポレーション	27	25	2,625
三井物産	1,044.2	916.3	1,203,101
日本紙パルプ商事	63	51	16,116
日立ハイテクノロジーズ	42.7	35.1	106,353
カメイ	16	13.2	12,975

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東都水産	23	17	2,941
ＯＵＧホールディングス	19	15	3,225
スターゼン	48	3.7	11,636
山善	47.2	38.8	35,191
椿本興業	14	11	3,146
住友商事	726.9	637.9	724,973
内田洋行	31	25	9,750
三菱商事	943.9	760.3	1,423,281
第一実業	30	22	10,032
キヤノンマーケティングジャパン	35.1	28.9	56,239
西華産業	40	33	7,161
佐藤商事	10.5	9	5,598
菱洋エレクトロ	14.2	11.6	12,702
東京産業	12.5	10.3	4,047
ユアサ商事	10.7	9.5	23,199
神鋼商事	32	23	4,554
小林産業	9.7	6.5	1,254
阪和興業	123	101	43,935
カナデン	12	9.7	7,866
菱電商事	19	16	9,984
フルサト工業	6.8	5.5	8,596
岩谷産業	136	120	73,080
すてきナイスグループ	54	45	5,940
昭光通商	46	42	3,150
ニチモウ	22	17	2,975
極東貿易	16	16	3,568
イワキ	19	17	3,145
三愛石油	31	26	22,594
稲畑産業	29.6	24.2	28,894
ＧＳＩクレオス	39	30	3,570
明和産業	10.1	9.2	3,440
ワキタ	26.2	21.5	17,737
東邦ホールディングス	42.5	32.4	75,394
サンゲツ	22.1	36.6	71,370
ミツウロコグループホールディングス	19.5	16.2	9,023
シナネンホールディングス	26	22	9,680
伊藤忠エネクス	27.2	26	21,242
サンリオ	34.5	31.2	65,520
サンワテクノス	7.8	6.4	4,326

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
リョーサン	20.5	16	45,136
新光商事	14.1	11.7	12,051
トーホー	28	4.6	10,175
三信電気	16.9	14	11,718
東陽テクニカ	18	14.9	16,181
モスフードサービス	16.1	13.2	40,986
加賀電子	11	9.2	11,877
ソーダニッカ	12	10.4	4,680
立花エレテック	7.6	7.4	8,073
フォーバル	2.5	4.3	2,605
ＰＡＬＴＡＣ	19.7	16.1	27,997
三谷産業	－	11.2	3,472
太平洋興発	54	49	3,626
ヤマタネ	63	49	7,840
丸紅建材リース	11	10	1,830
日鉄住金物産	80	65	21,840
トラスコ中山	15.3	11.5	44,965
オートバックスセブン	45.3	38.8	75,466
加藤産業	17.7	15.7	42,735
イノテック	11.6	9.5	4,180
イエローハット	11.6	9.5	18,050
富士エレクトロニクス	6.2	－	－
ＪＫホールディングス	12.4	10.2	4,651
日伝	4.9	4.1	11,549
北沢産業	10.9	10.4	1,684
杉本商事	6.8	5.9	7,434
因幡電機産業	18.2	14.1	48,574
バイテックホールディングス	4.2	3.2	3,040
ミスミグループ本社	46	113.7	175,666
江守グループホールディングス	5.5	－	－
アルテック	11.2	10.6	1,505
タキヒヨー	22	17	7,820
蔵王産業	－	1.7	2,126
スズケン	51	46.1	171,261
ジェコス	8.5	7	6,265
ルネサスイーストン	5.5	6.6	2,706
小売業（4.8%）			
ローソン	46.6	38.4	352,128
サンエー	9.2	6.8	32,674

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ダイユーエイト	2.6	2.8	1,974
カワチ薬品	9.7	7.9	15,294
エービーシー・マート	17.5	12.9	87,204
ハードオフコーポレーション	5.9	4.9	7,991
アスクル	12.9	12.3	42,004
ゲオホールディングス	23.2	19.2	32,313
アダストリア	10.4	9.3	55,056
ジーフット	－	6.2	5,270
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	18	20	1,660
くらコーポレーション	7.2	5.9	30,680
キャンドゥ	6	5.4	7,884
パル	7.1	5.9	15,050
エディオン	56.4	42.8	36,636
サーラコーポレーション	10.9	8.9	5,188
ワッツ	5	4.1	3,202
ハローズ	－	3	7,971
あみやき亭	2.1	1.9	8,217
ひらまつ	17.1	14	9,142
ゲンキー	1.2	2	5,604
サッポロドラッグストアー	1.1	1.1	2,233
大黒天物産	2.9	2.4	11,304
ハニーズ	10.9	8.9	10,786
ファーマライズホールディングス	－	2.5	1,232
アルペン	10.9	9	15,993
クオール	12.5	10.3	14,656
ジェイアイエヌ	8.4	6.8	32,266
ビックカメラ	53.4	52.4	46,583
ＤＣＭホールディングス	59.2	49.7	41,748
ＭｏｎｏｔａＲＯ	24	35.7	86,108
東京一番フーズ	－	2	1,032
ダイヤモンドダイニング	－	1.8	2,016
きちり	2.6	2.9	1,885
アークランドサービス	1.4	3.1	8,856
Ｊ．フロント　リテイリング	155.8	128.2	171,403
ドトール・日レスホールディングス	21.5	17.6	31,644
マツモトキヨシホールディングス	27.5	20.9	108,262
ブロンコビリー	2.2	3.9	10,377
スタートトゥデイ	38.3	30.8	104,412
トレジャー・ファクトリー	1.2	2.9	3,471

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
物語コーポレーション	3.5	2.6	13,572
ココカラファイン	12.8	10.5	46,042
三越伊勢丹ホールディングス	244.8	201.5	264,972
ウエルシアホールディングス	11.1	8.8	49,368
クリエイトＳＤホールディングス	6	14.9	36,028
丸善ＣＨＩホールディングス	14.3	11.7	3,872
ミサワ	－	1.4	694
エー・ピーカンパニー	1.8	1.7	1,949
チムニー	2.2	2.4	6,516
シュッピン	－	2.9	2,931
ネクステージ	1.2	1.9	1,039
ジョイフル本田	6.6	16.4	36,244
キリン堂ホールディングス	4.3	3.5	3,524
ホットランド	－	2.8	2,912
すかいらーく	45	30.9	46,350
綿半ホールディングス	－	3	3,975
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	－	33.3	31,501
ブックオフコーポレーション	7	5.9	5,339
ゴルフダイジェスト・オンライン	－	2.3	1,591
あさひ	8.2	7.5	9,757
日本調剤	1.6	2.5	9,012
コスモス薬品	6.2	5.1	84,966
トーエル	6.7	4.9	3,430
一六堂	3.5	2.6	863
セブン＆アイ・ホールディングス	515.2	423.9	1,931,288
薬王堂	1.8	1.5	3,873
クリエイト・レストランツ・ホールディング	8.5	9	26,505
ツルハホールディングス	26.3	23.3	221,816
サンマルクホールディングス	4.4	7.9	22,878
フェリシモ	3.3	3.1	3,047
トリドール	13.3	12.4	27,924
クスリのアオキ	4.9	9	44,010
メディカルシステムネットワーク	11.6	11.8	5,015
総合メディカル	2.9	4.9	16,880
はるやま商事	5.1	4.1	3,091
カッパ・クリエイト	19.1	14.1	15,876
ライトオン	9.4	7.6	11,080
ジーンズメイト	5.3	4.8	801
良品計画	15.2	11.6	276,660

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三城ホールディングス	15.2	11.4	5,073
アルビス	－	2.6	4,947
コナカ	14.7	11.9	6,342
ハウス　オブ　ローゼ	1.5	1.3	1,898
Ｇ－７ホールディングス	2.5	3.1	3,475
イオン北海道	7.7	6.7	3,470
コジマ	18.8	15.6	3,556
ヒマラヤ	2.8	3.2	3,219
コーナン商事	18.9	14.3	22,122
エコス	4.5	3.9	4,602
ワタミ	14.8	12.1	13,019
マルシェ	3.5	2.5	2,090
ドンキホーテホールディングス	39.6	65.5	242,677
西松屋チェーン	24.4	19.9	19,342
ゼンショーホールディングス	63.3	52.1	72,575
幸楽苑ホールディングス	7.8	6.4	10,003
ハークスレイ	3.4	3	3,153
サイゼリヤ	18.2	16.7	38,393
ＶＴホールディングス	－	34.4	19,573
魚力	－	3.2	3,872
ポプラ	4.1	4	2,012
ユナイテッドアローズ	16.1	14.5	73,660
ハイデイ日高	7.8	7.5	26,212
京都きもの友禅	7.5	7.2	6,062
コロワイド	40.8	33.6	58,128
ピーシーデポコーポレーション	－	8.4	8,635
壱番屋	5.5	4.5	26,640
トップカルチャー	5.5	4	1,828
ＰＬＡＮＴ	3.3	2.4	2,791
スギホールディングス	22.1	18.2	98,826
スクロール	17.1	15.8	6,383
ヨンドシーホールディングス	9.5	7.7	18,764
ファミリーマート	41.6	31.1	172,916
木曽路	15	12.3	27,416
サトレストランシステムズ	11.6	11.7	9,126
千趣会	21.9	19.8	13,959
タカキュー	10.1	9.1	1,638
ケーヨー	23	16.8	8,450
上新電機	27	24	20,472

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本瓦斯	19.8	11.7	24,336
ベスト電器	43.5	34.8	4,176
マルエツ	30	－	－
ロイヤルホールディングス	20.5	16.8	33,885
東天紅	10	9	1,170
いなげや	13.7	11.3	13,899
島忠	29.9	26.2	64,687
チヨダ	14.4	11.9	33,510
ライフコーポレーション	7.7	6.4	14,950
カスミ	25.1	－	－
リンガーハット	12	9.1	21,940
さが美	14	12	1,104
ＭｒＭａｘ	13.1	9.7	2,764
テンアライド	10.7	10.1	3,666
ＡＯＫＩホールディングス	28.3	22.9	28,350
オークワ	19	16	16,080
コメリ	21	15.6	33,898
青山商事	30.9	19.4	80,995
しまむら	14.3	11.8	142,308
ＣＦＳコーポレーション	8.2	－	－
はせがわ	4.5	3.9	1,583
高島屋	179	147	135,240
松屋	24.8	20.6	17,510
エイチ・ツー・オー　リテイリング	58.2	51.9	96,015
近鉄百貨店	47	39	11,934
丸栄	23	25	2,150
ニッセンホールディングス	26.6	16.4	2,394
パルコ	11.9	9.8	8,486
丸井グループ	148.2	124.4	186,600
アクシアル　リテイリング	9.5	7.8	26,286
イオン	507.9	416.9	594,290
ユニーグループ・ホールディングス	117.9	97	72,653
イズミ	27.5	20.1	86,932
東武ストア	17	13	3,861
平和堂	25	20.5	42,947
フジ	13.8	11.3	23,232
ヤオコー	6.9	11.5	47,437
ゼビオホールディングス	16.7	13.7	24,029
ケーズホールディングス	28.4	21.4	74,472

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	7.5	6.5	3,685
日産東京販売ホールディングス	21.1	17.1	4,839
アインホールディングス	14.8	12.2	60,329
元気寿司	3.8	2.9	6,214
ヤマダ電機	486.8	308.1	159,595
アークランドサカモト	8.8	17	17,595
ニトリホールディングス	53.2	43.8	368,796
グルメ杵屋	9	8	7,968
愛眼	11.2	9.7	2,027
ケーユーホールディングス	5.7	5.2	3,614
吉野家ホールディングス	34.7	37.3	53,301
松屋フーズ	5.9	4.8	13,497
サガミチェーン	15	13.4	16,294
関西スーパーマーケット	9.5	8	6,184
王将フードサービス	9	7.3	28,543
プレナス	13.6	11.3	22,068
ミニストップ	9	7.5	15,292
アークス	21.2	18.8	43,221
バローホールディングス	26.5	21.8	52,690
藤久	0.9	0.7	1,199
ベルク	5.5	4.9	18,693
大庄	6.6	4.8	6,873
ファーストリテイリング	24.7	20.3	644,728
サンドラッグ	26	21.4	161,784
サックスバー　ホールディングス	9.3	9.5	14,231
ヤマザワ	2.5	2.1	3,494
やまや	2.1	2.1	3,927
ベルーナ	30.2	25.3	12,751
銀行業（7.2%）			
島根銀行	2.8	2.2	2,543
じもとホールディングス	88.4	71.6	10,382
足利ホールディングス	76.2	74.4	23,510
東京ＴＹフィナンシャルグループ	15.8	13.9	36,098
九州フィナンシャルグループ	－	155.1	102,210
ゆうちょ銀行	－	194.7	231,887
新生銀行	1,172	877	123,657
あおぞら銀行	831	641	228,837
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	9,882.3	8,130	3,880,449
りそなホールディングス	1,440.9	1,185.4	461,831

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三井住友トラスト・ホールディングス	2,723	2,115	686,317
三井住友フィナンシャルグループ	931.5	811.4	2,455,296
第四銀行	156	128	47,104
北越銀行	131	110	20,020
西日本シティ銀行	432	330	66,000
千葉銀行	475	391	210,358
横浜銀行	851	680	342,856
常陽銀行	445	366	140,910
群馬銀行	292	225	109,575
武蔵野銀行	19.6	16.2	46,882
千葉興業銀行	25.8	28.1	12,560
筑波銀行	51.1	41.8	11,662
七十七銀行	208	159	63,918
青森銀行	96	74	21,830
秋田銀行	82	67	17,956
山形銀行	74	57	21,489
岩手銀行	8.6	7.1	26,305
東邦銀行	109	90	29,070
東北銀行	67	52	7,280
みちのく銀行	60	48	7,968
ふくおかフィナンシャルグループ	500	439	154,528
静岡銀行	361	297	244,134
十六銀行	154	126	45,486
スルガ銀行	130	96.2	175,084
八十二銀行	223	183	92,232
山梨中央銀行	79	63	24,696
大垣共立銀行	153	135	46,305
福井銀行	105	87	16,182
北國銀行	136	113	31,301
清水銀行	4.3	3.5	7,378
富山銀行	－	2	5,406
滋賀銀行	123	94	42,112
南都銀行	118	98	29,498
百五銀行	118	91	35,763
京都銀行	235	193	140,311
紀陽銀行	48.4	39.8	47,123
三重銀行	56	46	8,786
ほくほくフィナンシャルグループ	838	689	115,063
広島銀行	363	299	122,590

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
山陰合同銀行	75	61.5	40,098
中国銀行	88.6	71.8	84,436
鳥取銀行	40	34	5,406
伊予銀行	131.7	108.4	83,684
百十四銀行	135	111	35,076
四国銀行	94	79	16,353
阿波銀行	101	82	41,164
鹿児島銀行	86	－	－
大分銀行	76	58	19,662
宮崎銀行	82	67	17,420
肥後銀行	101	－	－
佐賀銀行	75	61	12,200
十八銀行	76	63	14,490
沖縄銀行	9.8	8.1	27,985
琉球銀行	25.4	20.8	23,566
セブン銀行	415.3	379.7	183,395
みずほフィナンシャルグループ	17,054.3	14,274.5	2,373,849
高知銀行	49	42	4,578
山口フィナンシャルグループ	123	95	99,750
長野銀行	40	33	5,808
名古屋銀行	111	86	30,616
北洋銀行	185.6	152.7	42,145
愛知銀行	4.5	3.4	14,875
第三銀行	71	57	7,980
中京銀行	50	42	8,064
東日本銀行	54	48	13,008
大光銀行	46	37	7,030
愛媛銀行	72	58	12,064
トマト銀行	49	39	5,694
みなと銀行	110	92	13,984
京葉銀行	101	84	35,280
関西アーバン銀行	16.3	13.6	14,212
栃木銀行	62	54	22,572
北日本銀行	3.9	3.2	8,348
東和銀行	173	144	11,664
福島銀行	157	125	8,875
大東銀行	81	61	10,797
トモニホールディングス	94	78.6	26,016
フィデアホールディングス	71	63	10,836

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
池田泉州ホールディングス	99.3	106.1	41,060
証券、商品先物取引業（1.1%）			
ＦＰＧ	10.6	30.2	28,901
ＳＢＩホールディングス	147.9	121.7	123,647
日本アジア投資	94	－	－
ジャフコ	16.8	16.9	53,657
大和証券グループ本社	1,152	948	636,866
野村ホールディングス	2,518	1,949.7	963,346
岡三証券グループ	105	86	45,752
丸三証券	39	30.1	36,089
東洋証券	50	39	11,271
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	141.3	116.3	60,824
光世証券	30	27	3,726
水戸証券	38.1	31.8	10,271
いちよし証券	25.8	22.6	24,362
松井証券	62.6	50.6	48,727
だいこう証券ビジネス	6	5.1	3,927
マネックスグループ	146	119.1	33,705
カブドットコム証券	54.3	89.8	29,634
極東証券	16.6	13.6	18,047
岩井コスモホールディングス	12.7	9.9	10,444
藍澤證券	－	14.3	8,065
マネースクウェアＨＤ	3.8	3.5	3,482
マネーパートナーズグループ	13.5	10.3	3,172
保険業（2.4%）			
かんぽ生命保険	－	30.9	73,449
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	273.6	225.1	692,182
アニコム　ホールディングス	5.2	6.9	17,201
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホール	392.6	302.8	899,921
ソニーフィナンシャルホールディングス	118	97.1	150,699
第一生命保険	789.1	649.2	847,855
東京海上ホールディングス	506.9	410.5	1,556,205
Ｔ＆Ｄホールディングス	448.9	369.3	412,323
その他金融業（1.3%）			
全国保証	32	26.3	87,053
クレディセゾン	100.6	76.8	142,387
芙蓉総合リース	12.9	11.6	53,418
興銀リース	23.1	19.1	36,003
東京センチュリーリース	28.9	23.8	89,012

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本証券金融	58.9	45.6	21,842
アイフル	206.1	169.6	49,862
ポケットカード	9.5	10.6	4,664
リコーリース	9.7	8.1	25,677
イオンフィナンシャルサービス	80.8	66.5	166,250
アコム	247.4	203.5	95,238
ジャックス	68	57	21,375
オリエントコーポレーション	286.1	438.1	83,677
日立キャピタル	24.1	23.9	56,666
アプラスフィナンシャル	59.8	51.6	4,489
オリックス	871.9	717.5	1,025,666
三菱ＵＦＪリース	312.4	257	123,617
日本取引所グループ	180.8	297.5	514,377
イー・ギャランティ	3.7	3.4	7,347
アサックス	2.2	2.2	2,904
ＮＥＣキャピタルソリューション	5.2	4.4	6,806
不動産業（2.9%）			
いちごグループホールディングス	－	84.4	30,468
日本駐車場開発	134.7	111.5	13,268
ヒューリック	207.9	211.2	208,876
東京建物不動産販売	7.3	－	－
三栄建築設計	4.8	4.2	5,040
野村不動産ホールディングス	74	67.2	132,988
三重交通グループホールディングス	－	17.9	7,893
サムティ	－	5.7	5,865
ディア・ライフ	－	5.6	1,702
エー・ディー・ワークス	－	77.5	3,410
日本商業開発	3.8	3.3	5,765
プレサンスコーポレーション	4.1	3.4	12,053
ユニゾホールディングス	5.1	6.3	24,696
日本管理センター	6	6.7	11,651
サンセイランディック	1.7	2.7	2,289
エストラスト	1.7	2.2	1,357
フージャースホールディングス	19.1	14.6	6,234
オープンハウス	7.8	14.7	30,958
東急不動産ホールディングス	322.8	245.1	173,285
飯田グループホールディングス	79.9	93.9	192,682
パーク２４	61.9	51.1	150,387
パラカ	4.7	3.6	4,791

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三井不動産	653	537	1,424,124
三菱地所	916	753	1,614,808
平和不動産	23.4	19.5	23,088
東京建物	268	110.7	146,898
ダイビル	32.1	26.4	24,578
京阪神ビルディング	20.9	17.4	9,935
住友不動産	295	243	749,655
大京	199	191	34,762
テーオーシー	42.8	39.6	35,679
東京楽天地	21	17	8,041
レオパレス２１	134.7	119.4	79,759
スターツコーポレーション	14.1	11.7	26,991
フジ住宅	16.1	13.3	9,017
空港施設	15.6	12.9	6,437
住友不動産販売	8.9	7.3	15,585
ゴールドクレスト	11.3	8.2	13,251
日本エスリード	5	4.1	4,251
日神不動産	16.4	13.9	4,990
タカラレーベン	54.8	45.4	27,013
サンヨーハウジング名古屋	7	5.9	5,988
イオンモール	79.5	65.4	103,920
ファースト住建	4.6	3.9	5,011
トーセイ	17.3	15.8	10,270
穴吹興産	12	12	2,952
エヌ・ティ・ティ都市開発	76.5	62.9	68,938
サンフロンティア不動産	13.5	12.3	12,361
エフ・ジェー・ネクスト	9.5	8.9	4,423
グランディハウス	11.6	9	3,276
日本空港ビルデング	42.6	32.3	129,523
サービス業（3.8%）			
日本工営	43	36	12,960
ネクスト	15.4	30.4	31,312
ジェイエイシーリクルートメント	－	4.9	5,262
日本M&Aセンター	20.1	16.6	84,826
ノバレーゼ	3.6	2.6	2,147
アコーディア・ゴルフ	49.1	30	32,940
中広	－	1	670
タケエイ	12.9	9.3	6,761
トラスト・テック	2.2	2.2	5,253

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
パソナグループ	9.8	9.4	5,940
ＣＤＳ	3	2.5	2,122
リンクアンドモチベーション	17.2	21.9	2,562
ＧＣＡサヴィアン	10.3	9.8	8,594
エス・エム・エス	14.6	13.4	24,146
テンプホールディングス	25.6	75.2	109,641
リニカル	3.4	6.4	9,932
クックパッド	8.3	23.9	48,182
エスクリ	4.7	4.5	2,565
アイ・ケイ・ケイ	3.5	5.8	3,706
学情	4.9	4.1	4,177
スタジオアリス	6	4.7	10,490
シミックホールディングス	4.9	4.9	7,634
ＮＪＳ	－	2.4	2,769
綜合警備保障	43.5	35.8	207,282
カカクコム	86.7	77.8	153,888
アイロムグループ	3.3	－	－
ルネサンス	6.8	5.5	6,627
ディップ	2.9	11.9	25,930
オプトホールディング	6.1	6.8	3,991
新日本科学	12.6	－	－
ツクイ	15.6	12.7	16,979
綜合臨床ホールディングス	6.1	－	－
キャリアデザインセンター	3.9	3	2,487
エムスリー	112.8	92.9	250,737
ツカダ・グローバルホールディング	9.6	7.7	5,182
アウトソーシング	5	5	14,525
ウェルネット	3.5	4.1	12,894
ディー・エヌ・エー	64.3	48.1	83,934
博報堂ＤＹホールディングス	180.7	148.6	187,384
ぐるなび	15.1	12.4	31,186
エスアールジータカミヤ	10.5	9.1	2,893
一休	10.2	－	－
ジャパンベストレスキューシステム	12	13	3,094
ファンコミュニケーションズ	22.6	24.7	16,104
ジェイコムホールディングス	2.8	2.3	4,639
ＰＧＭホールディングス	18.5	－	－
ＷＤＢホールディングス	4.7	3.9	3,400
ティア	3.8	4.7	2,937

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
バリューコマース	11.3	10	3,420
インフォマート	－	15.5	14,849
ＪＰホールディングス	33	27	6,966
ＥＰＳホールディングス	16.4	12	16,284
レッグス	－	1.9	1,200
プレステージ・インターナショナル	9.8	9	10,863
アミューズ	4	2.9	11,919
ドリームインキュベータ	4.3	3.7	8,014
クイック	4.4	5.6	3,981
ＴＡＣ	8.1	7.6	1,360
ケネディクス	185.3	144	66,816
電通	145.3	119.5	662,030
テイクアンドギヴ・ニーズ	5.4	5.1	2,351
ぴあ	3.8	2.9	6,272
イオンファンタジー	4.3	3.9	8,291
シーティーエス	－	2.5	1,805
ネクシィーズ	4.9	4.1	2,849
みらかホールディングス	34.3	27.4	130,424
アルプス技研	5.2	4	8,764
サニックス	15.6	－	－
ダイオーズ	2.5	2	2,010
日本空調サービス	6.3	5.2	5,777
オリエンタルランド	35.2	115.9	928,359
ダスキン	36.9	30.4	65,664
明光ネットワークジャパン	13	12.2	13,810
ファルコホールディングス	6.2	4.8	6,081
秀英予備校	4.2	2.5	1,310
田谷	2.6	2.6	1,786
ラウンドワン	37.6	33.8	23,355
リゾートトラスト	48.1	45	113,085
ビー・エム・エル	7.6	6.3	25,798
ワタベウェディング	5.1	3.8	1,675
りらいあコミュニケーションズ	24.3	17.8	17,479
リソー教育	－	20.4	6,283
早稲田アカデミー	2.3	1.2	1,080
ユー・エス・エス	157.8	129.8	223,126
東京個別指導学院	6.7	5.4	3,769
サイバーエージェント	23.9	26.2	134,406
楽天	566.3	501.6	501,399

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
テー・オー・ダブリュー	4	6.8	3,957
セントラルスポーツ	4.5	3.6	8,179
フルキャストホールディングス	13.7	10.1	6,736
リゾートソリューション	14	12	3,720
テクノプロ・ホールディングス	13.9	17.4	53,418
インターワークス	－	1.6	1,033
リブセンス	7.8	7.6	2,956
ジャパンマテリアル	5.2	4.4	9,750
ベクトル	2.1	3.3	8,540
ウチヤマホールディングス	5.9	5.6	2,749
サクセスホールディングス	1.2	1.1	1,185
キャリアリンク	－	1.6	2,444
ＩＢＪ	－	6.6	2,673
アサンテ	3.1	4	5,984
Ｎ・フィールド	－	3.9	4,282
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	0.2	1.1	1,745
ライドオン・エクスプレス	－	1.8	3,153
ＥＲＩホールディングス	3.4	2.9	2,349
アビスト	－	1.3	2,575
ウィルグループ	1.2	2.5	2,240
日本ビューホテル	－	1.3	1,952
リクルートホールディングス	147.9	216.3	731,094
エラン	－	1.1	1,107
日本郵政	－	236.5	328,971
ベルシステム２４ホールディングス	－	15.8	15,136
リロ・ホールディング	4.4	4	51,400
東祥	2.8	3.2	12,624
エイチ・アイ・エス	21.2	17.5	57,050
ラックランド	－	1.7	2,400
共立メンテナンス	6.5	8.1	68,850
イチネンホールディングス	13.6	11.3	10,226
建設技術研究所	7.7	6.3	5,758
スペース	6.9	5.8	7,186
燦ホールディングス	2.7	2.1	2,881
スバル興業	10	8	3,048
東京テアトル	54	44	5,148
ナガワ	－	2	5,460
よみうりランド	27	21	8,799
東京都競馬	90	73	15,476

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
常磐興産	49	40	5,960
カナモト	18.2	14.9	36,937
東京ドーム	90	85	44,285
西尾レントオール	10.5	8.6	22,342
トランス・コスモス	16.9	12.4	29,995
乃村工藝社	25.6	23.1	33,102
藤田観光	48	39	21,528
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	63	52	8,840
日本管財	6.3	9.2	16,155
トーカイ	5.7	4.7	14,429
白洋舎	15	12	3,084
セコム	126.6	111.5	905,380
セントラル警備保障	5.7	4.7	9,935
丹青社	15.2	20.2	13,534
メイテック	17.6	13.3	52,934
アサツー　ディ・ケイ	24.5	18.8	53,749
応用地質	13.6	11.3	13,831
船井総研ホールディングス	13.8	15	20,985
進学会	5.6	5	3,110
オオバ	－	6	2,244
学究社	－	1.6	2,046
ベネッセホールディングス	47.6	35.9	126,906
イオンディライト	12.4	10.3	37,440
ナック	8.9	6.7	5,587
ニチイ学館	25.6	18.8	14,833
ダイセキ	20.9	20.1	35,315
ステップ	4.4	3.6	3,567
合計　株数・金額	207,046	170,037	197,392,717
合計　銘柄数＜比率＞	1,827	1,905	＜99.0％＞

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
国内	株式先物取引	ＴＯＰＩＸ	1,972	－

○有価証券の貸付及び借入の状況

2016年２月22日現在における貸付株数の総株数は24,418,300株です。
うち利害関係人であるモルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券株式会社に対する貸付は、17,244,600株です。

○投資信託財産の構成

（2016年２月22日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	％
株式	197,392,717	86.3
コール・ローン等、その他	31,244,240	13.7
投資信託財産総額	228,636,957	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年２月22日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	228,636,668,502
コール・ローン等	30,638,245,080
株式(評価額)	197,392,717,480
未収配当金	266,376,813
未収利息	53
その他未収収益	42,899,076
差入委託証拠金	296,430,000
(B) 負債	29,277,148,836
未払金	156,484,784
未払解約金	168,940,011
未払利息	522,077
受入担保金	28,951,201,964
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	199,359,519,666
元本	196,312,695,095
次期繰越損益金	3,046,824,571
(D) 受益権総口数	196,312,695,095口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	10,155円

＜注記事項＞

①期首元本額　240,254,912,958円
　期中追加設定元本額　38,117,449,694円
　期中一部解約元本額　82,059,667,557円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.0155円です。

○損益の状況 (2015年２月21日～2016年２月22日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	4,798,033,960
受取配当金	4,422,869,654
受取利息	22,811,982
その他収益金	363,173,408
支払利息	△　10,821,084
(B) 有価証券売買損益	△26,848,492,578
売買益	14,407,278,415
売買損	△41,255,770,993
(C) 先物取引等取引損益	31,763,800
取引益	947,098,808
取引損	△　915,335,008
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	△22,018,694,818
(E) 前期繰越損益金	35,916,971,931
(F) 追加信託差損益金	6,800,354,901
(G) 解約差損益金	△17,651,807,443
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	3,046,824,571
次期繰越損益金(Ｈ)	3,046,824,571

(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。

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	15,195,569,292円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	1,089,092,666円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	3,938,080,266円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	3,752,462,434円
三菱ＵＦＪ トピックスオープン（確定拠出年金）	5,052,520,179円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	7,911,190,817円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	37,806,277,742円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	35,335,066,662円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	314,855,534円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	630,178,746円
ＦＰバランスファンド（安定型）	57,961,441円
ＦＰバランスファンド（安定成長型）	88,678,014円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	846,368,364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）	84,282,665,330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）	394,339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）	11,333,269円
合計	196,312,695,095円

［お知らせ］

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

三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド

《第16期》決算日2016年５月20日

［計算期間：2015年５月21日～2016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16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16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	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
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
16期(2016年５月20日)	17,145	△15.6	550,658.40	△16.0	95.4	1.8	2.7	114,202

（注）ＭＳＣＩコクサイ インデックスは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。
ＭＳＣＩコクサイ インデックス（除く日本 円換算ベース）は、ＭＳＣＩコクサイ インデックス（除く日本 米ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。またＭＳＣＩコクサイ インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
（注）外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
（注）株式組入比率には新株予約権証券を含めて表示しております。
（注）「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		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
		騰落率		騰落率			
（期　首）	円	%		%	%	%	%
2015年５月20日	20,323	－	655,211.07	－	96.7	0.9	2.2
５月末	20,685	1.8	665,986.38	1.6	95.7	1.4	2.2
６月末	19,863	△ 2.3	639,675.25	△ 2.4	95.5	2.3	2.2
７月末	20,426	0.5	657,639.37	0.4	95.9	1.0	2.2
８月末	18,804	△ 7.5	605,323.67	△ 7.6	95.9	3.5	2.4
９月末	17,517	△13.8	563,736.55	△14.0	96.2	1.8	2.5
10月末	19,431	△ 4.4	625,024.47	△ 4.6	94.7	1.2	2.4
11月末	19,643	△ 3.3	632,617.45	△ 3.4	95.4	2.1	2.4
12月末	19,181	△ 5.6	616,951.51	△ 5.8	94.7	3.5	2.5
2016年１月末	17,485	△14.0	562,468.06	△14.2	97.2	2.2	2.6
２月末	16,761	△17.5	539,065.32	△17.7	95.3	2.9	2.6
３月末	17,733	△12.7	570,645.55	△12.9	94.4	2.3	2.6
４月末	17,652	△13.1	567,147.39	△13.4	95.2	2.3	2.6
（期　末）							
2016年５月20日	17,145	△15.6	550,658.40	△16.0	95.4	1.8	2.7

（注）騰落率は期首比。
（注）「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

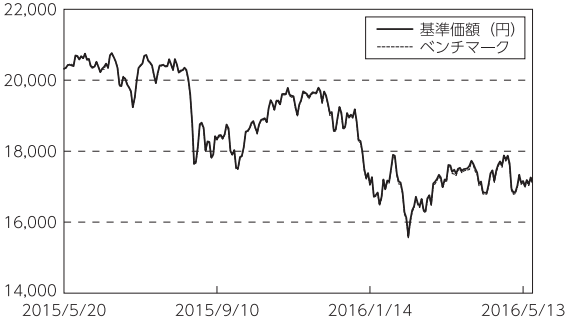
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ15.6%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－16.0%）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

・米国の利上げを巡る警戒感に加え、原油価格の下落や中国経済の減速懸念などから、外国株式市況は下落しました。

◎為替市況

・為替市況は、期首に比べて9.0%の円高・米ドル安、8.4%の円高・ユーロ安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

・ベンチマークである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16.0%の下落となったため、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	△0.1%程度	0.5%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△0.1%程度でした。

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

・売買に係るコストを考慮しつつ、できる限り多くの銘柄に分散投資を行いました。

・ファンドの特性をよりベンチマークに近づけるべく、マルチファクターモデルを用いて組入銘柄とその組入比率を決定しています。

◎その他の要因

その他の要因による影響は0.5%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入・為替効果等	計　0.6%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料等	計 △0.1%程度

為替効果：現地通貨建て株価を円建てに換算する方法が、ファンドとベンチマークで異なるため生じる差異。
ファンド：株価（現地通貨建て前日終値）を翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。
ベンチマーク：株価（現地通貨建て前日終値）を同日ロンドン時間の16時時点の為替レートを用い一旦ドル換算で評価。その後翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。

○今後の運用方針

・ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を株式（先物・ＲＥＩＴを含む）に投資し、高い株式組入比率を維持します。

・売買に係るコストを考慮しつつ、多くの銘柄に分散投資を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2015年５月21日～2016年５月20日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	1	0.006	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(1)	(0.005)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.002)	
(b) 有価証券取引税	1	0.008	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(1)	(0.008)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	15	0.078	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(14)	(0.076)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（その他）	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	17	0.092	
期中の平均基準価額は、18,765円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2015年５月21日～2016年５月20日）

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 13,775 (2,907)	千アメリカドル 72,653 (460)	百株 33,343 (955)	千アメリカドル 185,461 (11,268)
	カナダ	2,144 (46)	千カナダドル 6,301 (－)	4,229 (81)	千カナダドル 13,742 (596)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	929 (257)	3,644 (△ 173)	2,299	9,520
	イタリア	5,831 (△ 133)	1,168 (△ 6)	6,769	2,520
	フランス	1,070 (0.69)	3,962 (△ 64)	3,589	10,309
	オランダ	735 (308)	1,421 (398)	1,836	3,580
	スペイン	2,208 (25,139)	1,472 (207)	29,651	3,746
	ベルギー	77 (21)	552 (－)	222	1,505
	オーストリア	19 (－)	48 (△ 4)	480	317
	ルクセンブルク	324 (337)	186 (△ 297)	546	282
	フィンランド	973	818	661	918
	アイルランド	1,251	559	2,697	387
	ポルトガル	4,430	101	3,514	166
	イギリス	15,856 (112,079)	千イギリスポンド 8,286 (△ 103)	29,112 (179,557)	千イギリスポンド 16,301 (591)
	スイス	695 (618)	千スイスフラン 4,617 (△ 388)	2,263 (－)	千スイスフラン 10,728 (0.0179)
	スウェーデン	747 (269)	千スウェーデンクローネ 9,279 (－)	2,724	千スウェーデンクローネ 29,643
	ノルウェー	240	千ノルウェークローネ 3,663	780	千ノルウェークローネ 7,123
	デンマーク	265	千デンマーククローネ 9,259	490	千デンマーククローネ 15,762

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	オーストラリア	百株 4,332 (1,724)	千オーストラリアドル 4,904 (200)	百株 7,684	千オーストラリアドル 9,577
	ニュージーランド	263	千ニュージーランドドル 105	516	千ニュージーランドドル 204
	香港	3,373 (2,069)	千香港ドル 8,413 (—)	7,525 (880)	千香港ドル 26,839 (—)
	シンガポール	1,152 (4)	千シンガポールドル 600 (—)	3,884	千シンガポールドル 1,898
	イスラエル	202	千イスラエルシェケル 1,582	471	千イスラエルシェケル 2,693

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

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	HCP INC	1	53	3	141
	MACERICH CO/THE	0.608	46	1	136
	PROLOGIS INC	2	95	4	193
	CAMDEN PROPERTY TRUST	0.259	18	0.739	56
	DIGITAL REALTY TRUST INC	0.891	65	1	100
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.25	53	0.55	122
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5	357	0.915	71
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.205	29	0.549	78
	WELLTOWER INC	1	65	2	191
	BOSTON PROPERTIES INC	0.447	52	1	172
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	2	251	0.111	11
	REALTY INCOME CORP	1	75	1	86
	REGENCY CENTERS CORP	0.565	36	1	68
	SL GREEN REALTY CORP	0.27	26	0.778	87
	UDR INC	0.97	32	2	84
	VENTAS INC	0.795	45	2	141
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	3	34	9	91
	RAYONIER INC	—	—	5	138
	WEYERHAEUSER CO	1 (10)	44 (275)	5	175
	AMERICAN TOWER CORP	1	107	3	344
	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	1	26	3	71
	VEREIT INC	2	17	7	64
	DUKE REALTY CORP	1	28	3	66
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7	192	1	38
	IRON MOUNTAIN INC	1	62	1	51
	EQUINIX INC	0.492 (0.06)	147 (17)	0.457	133
	COMMUNICATIONS SALES & LE	—	—	4	93
	CROWN CASTLE INTL CORP	0.783 (13)	64 (1,096)	2	172
	CARE CAPITAL PROPERTIES INC	— (3)	— (—)	3	95
	EQUITY RESIDENTIAL	1	124	3	230
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	2	74	4	117
	HOST HOTELS & RESORTS INC	3	50	7	141
	LIBERTY PROPERTY TRUST	0.576	17	1	55
	PLUM CREEK TIMBER CO	0.613 (△ 6)	23 (△ 275)	1	57
	PUBLIC STORAGE	0.409	91	1	286
	SIMON PROPERTY GROUP INC	0.68	124	2	493
	VORNADO REALTY TRUST	0.635	56	1	159
	KIMCO REALTY CORP	1	29	3	96

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.485	82	1	194
	小計	54 (20)	2,709 (1,114)	107	5,117
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	2	73	—	—
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	1	18	2	49
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	—	—	0.8	21
	小計	3	92	3	71
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	GECINA SA	0.291	34	0.228	26
	KLEPIERRE	2	112	2	87
	UNIBAIL-RODAMCO SE	0.315	72	0.879	212
	FONCIERE DES REGIONS	0.072 (—)	5 (△ 1)	0.292	24
	ICADE	0.247	15	0.651	43
	小計	3 (—)	240 (△ 1)	4	394
	ユーロ計	3 (—)	240 (△ 1)	4	394
	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC	5	40	10	81
	HAMMERSON PLC	4	29	10	62
	LAND SECURITIES GROUP PLC	2	23	6	84
	INTU PROPERTIES PLC	6	19	9	31
	SEGRO PLC	3	14	7	32
	小計	21	126	43	292
	オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
	VICINITY CENTRES	8	25	19	57
	SCENTRE GROUP	16	67	47	196
	FEDERATION CENTRES	— (72)	— (221)	—	—
	NOVION PROPERTY GROUP	— (△ 88)	— (△ 221)	—	—
	GPT GROUP	10	45	14	68
	MIRVAC GROUP	16	29	37	71
	STOCKLAND	11	47	24	103
	WESTFIELD CORP	6	60	17	170
	DEXUS PROPERTY GROUP	5	37	9	71
	GOODMAN GROUP	7	45	17	111
	小計	82 (△ 15)	359 (—)	189	850
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	6	256	21	961
	小計	6	256	21	961

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	SUNTEC REIT	11 (　－)	16 (△0.85185)	21 (　－)	35 (0.00001)
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	－	－	7	10
	CAPITALAND MALL TRUST	12	23	27	56
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	14 (　－)	32 (△0.11507)	24	59
	小計	37 (　－)	72 (△0.96692)	80 (　－)	162 (0.00001)

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 42,583	百万円 41,448	百万円 －	百万円 －

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

○株式売買比率

(2015年５月21日～2016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	48,776,644千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	129,910,903千円
(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

(2015年５月21日～2016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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	17,338	13,044	75.2	41,757	33,499	80.2

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

○組入資産の明細

（2016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	484	464	423	46,649	素材
AMERICAN EXPRESS CO	385	296	1,858	204,572	各種金融
AVON PRODUCTS INC	182	－	－	－	家庭用品・パーソナル用品
ABBOTT LABORATORIES	623	527	1,965	216,364	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	137	117	521	57,464	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	23	19	311	34,314	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	199	163	1,387	152,790	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	30	26	122	13,519	小売
AES CORP	284	241	259	28,583	公益事業
AFLAC INC	186	150	1,034	113,856	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	579	437	2,466	271,553	保険
APACHE CORP	155	133	760	83,749	エネルギー
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	26	21	443	48,807	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	259	220	2,563	282,248	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	88	72	1,025	112,911	素材
ANTHEM INC	111	92	1,235	136,036	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	209	179	884	97,399	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	547	475	1,054	116,081	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	224	192	832	91,689	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	280	225	2,885	317,638	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	86	74	1,223	134,657	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	122	110	347	38,213	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	687	598	4,207	463,218	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	54	43	1,523	167,769	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,718	1,440	7,148	787,017	電気通信サービス
CR BARD INC	31	26	570	62,853	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	53	46	331	36,466	素材
BAKER HUGHES INC	179	156	709	78,118	エネルギー
ALLSTATE CORP	173	136	915	100,758	保険
AVERY DENNISON CORP	37	32	239	26,312	素材
CHUBB LTD	137	163	2,035	224,052	保険
ANALOG DEVICES INC	130	110	613	67,513	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	13	10	817	89,948	小売
CVS HEALTH CORP	475	391	3,955	435,430	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ENTERPRISES	94	76	387	42,684	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	530	419	793	87,388	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	1,548	1,303	8,260	909,375	銀行
CIGNA CORP	108	91	1,175	129,451	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	237	206	1,431	157,556	資本財
COCA-COLA CO/THE	1,632	1,481	6,563	722,622	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	229	188	1,328	146,216	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	85	65	418	46,022	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	412	345	882	97,114	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	80	71	245	27,053	メディア
CHEVRON CORP	782	666	6,653	732,506	エネルギー
COACH INC	113	97	371	40,849	耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ROCKWELL COLLINS INC	49	47	415	45,759	資本財
COMPUTER SCIENCES CORP	58	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CONOCOPHILLIPS	510	437	1,895	208,621	エネルギー
CME GROUP INC	132	113	1,087	119,679	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	137	116	899	99,051	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	377	301	2,125	233,958	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION RESOURCES INC/VA	242	212	1,503	165,466	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE	488	397	2,019	222,380	素材
DEVON ENERGY CORP	161	162	551	60,724	エネルギー
DEERE & CO	140	110	906	99,848	資本財
DANAHER CORP	261	218	2,137	235,318	資本財
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	375	310	1,997	219,931	素材
WALT DISNEY CO/THE	667	555	5,468	602,075	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC	54	41	271	29,912	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	293	244	1,883	207,341	公益事業
DR HORTON INC	136	118	346	38,132	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC	39	31	129	14,251	小売
TARGET CORP	250	206	1,387	152,783	小売
DUN & BRADSTREET CORP	15	12	150	16,532	商業・専門サービス
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	27	—	—	—	エネルギー
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I	71	59	459	50,617	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	68	55	355	39,164	資本財
DTE ENERGY COMPANY	73	64	569	62,685	公益事業
EXXON MOBIL CORP	1,754	1,473	13,280	1,462,040	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	44	76	746	82,189	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	227	194	1,557	171,515	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	286	234	1,174	129,287	資本財
EXELON CORP	356	326	1,116	122,951	公益事業
ECOLAB INC	111	94	1,092	120,246	素材
EQUIFAX INC	49	41	512	56,448	商業・専門サービス
ENSCO PLC-CL A	95	—	—	—	エネルギー
EMC CORP/MA	842	686	1,898	209,021	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	95	78	715	78,821	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	196	163	974	107,288	資本財
EDISON INTERNATIONAL	128	116	809	89,147	公益事業
ENTERGY CORP	75	64	476	52,494	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	18	14	267	29,488	保険
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	25	21	162	17,836	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC	181	163	1,938	213,460	公益事業
MACY'S INC	142	111	343	37,770	小売
FEDEX CORP	111	95	1,511	166,405	運輸
FMC TECHNOLOGIES INC	97	80	219	24,199	エネルギー
FAMILY DOLLAR STORES	42	—	—	—	小売
FORD MOTOR CO	1,486	1,311	1,717	189,026	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	166	137	485	53,395	各種金融
FOOT LOCKER INC	59	48	284	31,345	小売
FIRSTENERGY CORP	176	150	485	53,499	公益事業
FLUOR CORP	64	50	247	27,284	資本財
FREEPORT-MCMORAN INC	429	407	447	49,300	素材
GENERAL MILLS INC	249	211	1,330	146,496	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	116	94	1,363	150,095	資本財
WW GRAINGER INC	25	20	444	48,971	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
GENERAL ELECTRIC CO	4,160	3,341	9,809	1,079,895	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	－	46	343	37,780	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	63	53	496	54,677	小売
TEGNA INC	－	74	164	18,119	メディア
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	－	94	254	28,047	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	99	85	147	16,257	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	162	135	2,103	231,552	各種金融
HALLIBURTON CO	350	306	1,230	135,438	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	308	258	2,908	320,249	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	88	68	300	33,105	自動車・自動車部品
HP INC	773	636	728	80,224	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	177	144	636	70,118	保険
HERSHEY CO/THE	62	52	475	52,377	食品・飲料・タバコ
DIRECTV	197	－	－	－	メディア
HOSPIRA INC	70	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARMAN INTERNATIONAL	－	25	180	19,844	耐久消費財・アパレル
HOME DEPOT INC	545	448	5,910	650,697	小売
HASBRO INC	47	40	339	37,392	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	110	92	590	65,042	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	389	326	4,727	520,463	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	166	139	560	61,732	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	153	115	1,189	130,934	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	174	144	341	37,558	メディア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	33	28	367	40,442	素材
JOHNSON & JOHNSON	1,159	979	11,050	1,216,574	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC	275	229	969	106,749	自動車・自動車部品
KANSAS CITY SOUTHERN	45	39	353	38,950	運輸
KELLOGG CO	110	93	703	77,422	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	154	128	1,629	179,434	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	695	562	2,433	267,914	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	193	327	1,139	125,455	食品・生活必需品小売り
KOHLS CORP	84	69	242	26,683	小売
ELI LILLY & CO	415	352	2,622	288,716	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	40	35	451	49,754	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	71	59	249	27,427	運輸
LENNAR CORP-A	72	63	277	30,589	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	408	324	2,591	285,249	小売
LEGGETT & PLATT INC	56	47	231	25,538	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	102	86	526	58,014	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	165	140	620	68,342	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	111	97	2,339	257,602	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	107	88	392	43,219	保険
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	34	28	383	42,244	資本財
LEGG MASON INC	42	34	109	12,039	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	93	72	472	52,034	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	402	324	4,070	448,154	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	112	95	1,023	112,702	各種金融
MEDTRONIC PLC	586	500	4,001	440,553	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	1,180	988	5,395	594,009	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	444	382	385	42,455	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	138	119	361	39,835	耐久消費財・アパレル
3M CO	252	217	3,597	396,021	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	93	56	386	42,532	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	161	158	340	37,488	消費者サービス
MASCO CORP	148	120	378	41,691	資本財
MONSANTO CO	200	155	1,565	172,319	素材
MEADWESTVACO CORP	69	—	—	—	素材
M & T BANK CORP	49	50	587	64,645	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	224	184	1,185	130,479	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	25	22	425	46,806	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	607	514	1,368	150,663	各種金融
MCKESSON CORP	96	81	1,473	162,223	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	399	334	1,480	163,030	保険
MANPOWERGROUP INC	32	26	201	22,150	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	77	63	587	64,683	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	128	105	891	98,130	運輸
BANK OF AMERICA CORP	4,355	3,686	5,356	589,642	銀行
NISOURCE INC	131	—	—	—	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	79	61	1,293	142,394	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	185	171	258	28,418	銀行
NEWMONT MINING CORP	208	187	639	70,354	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	562	414	1,156	127,325	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	48	41	394	43,458	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	—	4	476	52,432	保険
NUCOR CORP	131	113	530	58,378	素材
NEWELL BRANDS INC	113	161	760	83,762	耐久消費財・アパレル
NOBLE CORP PLC	102	—	—	—	エネルギー
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	181	155	439	48,361	メディア
NOBLE ENERGY INC	159	152	531	58,501	エネルギー
PALL CORP	44	—	—	—	資本財
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	322	270	2,024	222,860	エネルギー
OMNICARE INC	41	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
OMNICOM GROUP	102	85	705	77,615	メディア
PEPSICO INC	619	515	5,225	575,307	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	—	34	220	24,314	素材
ALTRIA GROUP INC	818	694	4,397	484,169	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	47	40	292	32,177	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,119	962	7,720	849,900	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	217	179	1,579	173,864	銀行
PFIZER INC	2,609	2,184	7,292	802,856	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	188	158	1,235	135,995	保険
PULTEGROUP INC	138	110	195	21,557	耐久消費財・アパレル
PEPCO HOLDINGS LLC	105	—	—	—	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	61	48	524	57,695	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	61	57	929	102,273	エネルギー
CITIGROUP INC	1,254	1,054	4,752	523,244	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	122	104	443	48,821	保険
PPG INDUSTRIES INC	56	95	1,006	110,763	素材
PENTAIR PLC	78	63	368	40,579	資本財
PRAXAIR INC	120	100	1,109	122,158	素材
P G & E CORP	197	175	1,006	110,855	公益事業
PPL CORP	276	240	909	100,158	公益事業
PROGRESSIVE CORP	232	205	670	73,823	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	210	180	808	88,953	公益事業

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	73	60	442	48,685	消費者サービス
SPX CORP	14	—	—	—	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	68	61	474	52,234	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	127	106	1,375	151,474	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	118	85	405	44,641	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	566	459	434	47,883	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	18	15	172	19,030	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	41	35	641	70,601	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	171	149	328	36,116	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	57	46	182	20,051	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	56	46	514	56,622	資本財
SCHLUMBERGER LTD	533	493	3,658	402,723	エネルギー
STRYKER CORP	140	119	1,309	144,211	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	486	419	1,214	133,687	各種金融
SEMPRA ENERGY	97	84	867	95,469	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	33	27	807	88,849	素材
ST JUDE MEDICAL INC	118	99	757	83,376	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	61	53	599	65,999	資本財
SUNTRUST BANKS INC	214	179	765	84,226	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	137	107	1,183	130,336	保険
SOUTHERN CO/THE	374	323	1,573	173,274	公益事業
AT&T INC	2,148	2,177	8,368	921,322	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	91	98	376	41,443	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	172	142	866	95,363	各種金融
SYSCO CORP	242	199	979	107,788	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	83	70	329	36,325	素材
SCANA CORP	56	48	333	36,735	公益事業
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	65	—	—	—	エネルギー
TEXAS INSTRUMENTS INC	438	359	2,057	226,501	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	53	45	289	31,871	小売
TORCHMARK CORP	52	43	258	28,403	保険
TYCO INTERNATIONAL PLC	172	149	602	66,338	商業・専門サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	165	141	2,095	230,730	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	113	98	368	40,519	資本財
UNION PACIFIC CORP	368	302	2,462	271,141	運輸
UNUM GROUP	104	86	304	33,475	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	358	298	2,937	323,386	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	397	337	4,384	482,733	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	740	618	2,569	282,890	銀行
MARATHON OIL CORP	279	292	372	41,044	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	291	246	2,499	275,151	運輸
VALERO ENERGY CORP	215	170	944	103,963	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	41	34	286	31,535	ヘルスケア機器・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	198	153	799	88,008	メディア
VF CORP	142	120	725	79,906	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	55	47	536	59,104	素材
TOWERS WATSON & CO-CL A	29	—	—	—	商業・専門サービス
WILLIAMS COS INC	294	252	543	59,809	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	361	308	2,348	258,578	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	95	112	658	72,450	公益事業
WAL-MART STORES INC	667	567	3,924	432,037	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO	2,041	1,717	8,309	914,820	銀行

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
WASTE MANAGEMENT INC	179	157	959	105,647	商業・専門サービス
WATERS CORP	34	28	386	42,495	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	319	292	149	16,505	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	32	27	466	51,389	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	447	325	294	32,450	ソフトウェア・サービス
XL GROUP PLC	125	104	356	39,296	保険
XCEL ENERGY INC	212	181	736	81,073	公益事業
KEYCORP	356	298	369	40,666	銀行
CARMAX INC	89	72	373	41,091	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	70	66	790	86,995	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	69	58	156	17,233	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	181	152	1,221	134,506	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	286	236	1,794	197,538	小売
CA INC	137	117	365	40,229	ソフトウェア・サービス
CAMERON INTERNATIONAL CORP	82	—	—	—	エネルギー
CLOROX COMPANY	53	45	591	65,065	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	64	52	364	40,100	素材
CARNIVAL CORP	159	145	722	79,538	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	118	99	724	79,728	ソフトウェア・サービス
CHUBB CORP	97	—	—	—	保険
CONAGRA FOODS INC	176	153	685	75,468	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	122	104	753	82,920	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	341	282	512	56,462	銀行
STERICYCLE INC	35	29	290	31,963	商業・専門サービス
INTEL CORP	2,003	1,671	4,951	545,090	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	2,119	1,797	4,954	545,425	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	40	31	291	32,095	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	53	44	435	47,907	電気通信サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	181	154	2,207	243,046	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	503	425	847	93,311	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	128	109	808	88,975	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	126	104	680	74,866	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	285	240	406	44,717	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	86	143	799	88,003	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	83	72	347	38,239	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	283	479	2,737	301,379	耐久消費財・アパレル
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	—	3	39	4,380	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	315	267	3,969	437,050	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	74	62	275	30,333	銀行
NORTHERN TRUST CORP	93	78	554	61,046	各種金融
MICROSOFT CORP	3,243	2,686	13,516	1,488,026	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	38	31	268	29,554	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	—	60	342	37,755	ヘルスケア機器・サービス
STAPLES INC	267	226	181	20,022	小売
STARBUCKS CORP	620	525	2,865	315,416	消費者サービス
ORACLE CORP	1,468	1,131	4,396	483,980	ソフトウェア・サービス
ALTERA CORP	126	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WHOLE FOODS MARKET INC	148	120	370	40,829	食品・生活必需品小売り
NETFLIX INC	23	143	1,287	141,706	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	41	34	891	98,095	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	206	180	683	75,263	ソフトウェア・サービス
URBAN OUTFITTERS INC	44	—	—	—	小売

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	78	67	421	46,376	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	34	29	504	55,555	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	56	47	439	48,378	小売
LAM RESEARCH CORP	65	56	413	45,492	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	33	29	256	28,248	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	890	878	5,294	582,841	メディア
XILINX INC	108	90	396	43,639	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	146	124	664	73,150	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	57	84	511	56,269	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	624	510	4,190	461,318	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	67	54	445	49,044	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	15	13	824	90,785	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	112	88	899	99,047	ソフトウェア・サービス
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	172	—	—	—	メディア
NUANCE COMMUNICATIONS INC	108	87	141	15,630	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	136	114	590	65,022	ソフトウェア・サービス
YAHOO! INC	372	317	1,175	129,442	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	34	31	143	15,848	ヘルスケア機器・サービス
SIGNATURE BANK	—	18	242	26,739	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	—	24	197	21,763	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	93	80	460	50,709	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	102	90	325	35,821	メディア
SALESFORCE.COM INC	248	223	1,811	199,380	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	58	48	181	19,990	小売
ALPHABET INC-CL A	118	103	7,377	812,211	ソフトウェア・サービス
JOY GLOBAL INC	39	—	—	—	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	16	179	19,772	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B/E AEROSPACE INC	43	36	170	18,800	資本財
GARMIN LTD	47	39	158	17,408	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE NAVIGATION LTD	106	88	208	22,952	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	688	532	2,808	309,213	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	92	84	279	30,786	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	64	55	271	29,892	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP	98	84	375	41,311	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	118	100	357	39,393	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	163	141	9,852	1,084,675	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	106	88	651	71,706	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	59	51	390	42,936	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	68	56	381	42,035	半導体・半導体製造装置
E*TRADE FINANCIAL CORP	—	104	275	30,345	各種金融
CERNER CORP	127	108	581	64,047	ヘルスケア機器・サービス
BROADCOM LTD	—	139	1,988	218,962	半導体・半導体製造装置
ALKERMES PLC	61	53	210	23,123	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	47	36	300	33,046	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	118	106	552	60,772	電気通信サービス
BROADCOM CORP-CL A	224	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WASTE CONNECTIONS INC	—	44	303	33,437	商業・専門サービス
EBAY INC	463	382	896	98,689	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	225	189	826	90,954	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	84	78	602	66,339	小売
PRICELINE GROUP INC/THE	21	17	2,203	242,533	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	478	419	5,908	650,439	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
BB&T CORP	297	287	1,005	110,705	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	465	386	1,578	173,744	各種金融
BORGWARNER INC	94	79	257	28,400	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	114	84	169	18,663	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	42	41	523	57,639	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC	347	282	2,025	222,978	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP	90	68	517	56,926	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	28	22	199	21,963	保険
AETNA INC	145	123	1,353	148,995	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	102	87	416	45,841	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	203	175	1,117	123,018	公益事業
AON PLC	112	96	1,016	111,880	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	266	211	809	89,129	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	39	33	179	19,735	保険
HESS CORP	111	99	567	62,463	エネルギー
CROWN CASTLE INTL CORP	138	—	—	—	不動産
JUNIPER NETWORKS INC	159	124	278	30,631	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	112	95	289	31,882	各種金融
RED HAT INC	77	64	467	51,454	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	30	24	261	28,808	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	91	79	351	38,733	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	73	63	323	35,601	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	130	103	243	26,776	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	62	59	449	49,432	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	157	150	146	16,116	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	97	78	2,041	224,755	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	58	51	711	78,364	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC	196	176	1,692	186,356	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	100	87	704	77,607	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC	76	59	250	27,573	小売
CELGENE CORP	330	278	2,780	306,075	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CREE INC	50	—	—	—	半導体・半導体製造装置
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	252	215	1,334	146,862	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	304	239	1,731	190,634	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	80	65	311	34,318	運輸
FASTENAL CO	115	97	435	47,923	資本財
FISERV INC	100	80	823	90,659	ソフトウェア・サービス
FLEXTRONICS INTL LTD	238	198	242	26,710	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOSSIL GROUP INC	19	—	—	—	耐久消費財・アパレル
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,030	744	290	32,030	メディア
SANDISK CORP	90	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	2,429	1,973	18,593	2,046,924	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	64	54	366	40,336	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	332	281	288	31,711	銀行
SIGMA-ALDRICH	49	—	—	—	素材
NABORS INDUSTRIES LTD	106	—	—	—	エネルギー
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	82	79	1,109	122,109	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHLAND INC	27	22	253	27,875	素材
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	60	50	370	40,785	運輸
CENTURYLINK INC	235	193	520	57,343	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	59	47	141	15,594	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	172	147	605	66,672	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	
ONEOK INC	86	74	308	33,987	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC	132	303	1,509	166,169	食品・飲料・タバコ
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	201	—	—	—	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	135	107	219	24,203	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	59	50	310	34,143	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	29	26	373	41,117	小売
CONSOL ENERGY INC	95	—	—	—	エネルギー
NATIONAL OILWELL VARCO INC	177	132	411	45,265	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	69	61	957	105,371	食品・飲料・タバコ
CHESAPEAKE ENERGY CORP	223	—	—	—	エネルギー
PARTNERRE LTD	18	—	—	—	保険
COOPER COS INC/THE	19	17	275	30,355	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	63	53	371	40,935	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	128	109	605	66,687	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	44	35	195	21,535	保険
OWENS-ILLINOIS INC	67	—	—	—	素材
AGCO CORP	35	23	120	13,294	資本財
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	61	52	137	15,108	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP	58	50	743	81,866	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA INC	42	44	478	52,633	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	20	83	239	26,318	素材
HUDSON CITY BANCORP INC	201	—	—	—	銀行
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	263	210	747	82,286	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC	76	61	595	65,537	各種金融
TESORO CORP	52	42	328	36,184	エネルギー
FNF GROUP	104	89	292	32,177	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	46	41	1,094	120,452	各種金融
NASDAQ INC	48	40	257	28,301	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	69	63	237	26,160	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	148	124	477	52,582	メディア
AUTOLIV INC	37	30	371	40,916	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	122	107	297	32,700	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	12	10	493	54,274	消費者サービス
IHS INC-CLASS A	28	24	289	31,825	商業・専門サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	50	41	392	43,219	食品・飲料・タバコ
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	184	159	403	44,451	小売
ARROW ELECTRONICS INC	39	32	199	21,987	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	71	59	642	70,689	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	54	42	207	22,824	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP	130	114	203	22,405	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	23	20	370	40,781	素材
RANGE RESOURCES CORP	69	60	242	26,652	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO	159	134	161	17,810	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	36	33	382	42,109	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	25	20	184	20,279	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	46	41	298	32,893	公益事業
OCEANEERING INTL INC	43	35	112	12,381	エネルギー
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	50	41	277	30,559	消費者サービス
HANESBRANDS INC	164	137	371	40,864	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC-CLASS A	414	350	3,318	365,331	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	215	180	341	37,592	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	—	31	113	12,494	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	57	46	181	20,032	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	132	113	290	31,973	素材
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	—	30	42	4,699	消費者サービス
SPECTRA ENERGY CORP	277	236	735	81,015	エネルギー
TRANSDIGM GROUP INC	20	19	471	51,954	資本財
WILLIS TOWERS WATSON PLC	66	46	579	63,830	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	125	105	160	17,654	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	168	136	791	87,081	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	187	151	824	90,774	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	44	39	243	26,798	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	—	19	192	21,208	資本財
PRECISION CASTPARTS CORP	58	—	—	—	資本財
VMWARE INC-CLASS A	35	28	168	18,578	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	138	99	397	43,778	保険
TIME WARNER CABLE	116	—	—	—	メディア
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	25	21	450	49,641	小売
LKQ CORP	126	106	336	37,017	小売
HORMEL FOODS CORP	60	103	366	40,352	食品・飲料・タバコ
EASTMAN CHEMICAL CO	61	52	381	42,042	素材
GAMESTOP CORP-CLASS A	47	35	102	11,271	小売
HARRIS CORP	43	43	338	37,263	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	63	52	882	97,178	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP	70	59	175	19,267	エネルギー
NRG ENERGY INC	139	110	171	18,898	公益事業
INVESCO LTD	177	149	429	47,317	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	64	56	480	52,911	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	58	49	242	26,740	各種金融
TERADATA CORP	62	45	117	12,948	ソフトウェア・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	68	59	317	34,944	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	49	45	534	58,795	エネルギー
MSCI INC	—	35	263	29,010	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	38	33	135	14,965	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	63	65	637	70,148	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	643	548	5,395	594,016	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	817	688	5,295	582,972	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	81	66	613	67,570	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N.V.	18	14	171	18,838	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP	170	160	372	41,054	エネルギー
FLOWSERVE CORP	56	46	207	22,822	資本財
HELMERICH & PAYNE	44	38	219	24,210	エネルギー
MDU RESOURCES GROUP INC	78	—	—	—	公益事業
ENERGEN CORP	30	—	—	—	エネルギー
T-MOBILE US INC	100	100	410	45,219	電気通信サービス
LORILLARD INC	149	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	31	27	167	18,430	メディア
RACKSPACE HOSTING INC	50	—	—	—	ソフトウェア・サービス
INTERVAL LEISURE GROUP	—	26	35	3,907	消費者サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	113	97	243	26,836	メディア
RESMED INC	58	49	283	31,206	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	—	29	291	32,074	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	101	85	400	44,050	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	53	42	304	33,543	保険

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
CHURCH & DWIGHT CO INC	55	46	460	50,682	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	39	32	263	29,031	運輸
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	33	—	—	—	公益事業
PERRIGO CO PLC	58	52	479	52,814	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUANTA SERVICES INC	89	55	124	13,683	資本財
FMC CORP	54	47	216	23,887	素材
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	50	—	—	—	食品・飲料・タバコ
WABTEC CORP	39	34	262	28,952	資本財
EVERSOURCE ENERGY	132	113	628	69,232	公益事業
NETSUITE INC	14	14	113	12,501	ソフトウェア・サービス
ALLERGAN PLC	156	139	3,166	348,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRGAS INC	27	23	331	36,447	素材
CROWN HOLDINGS INC	57	49	259	28,552	素材
CALPINE CORP	139	121	176	19,411	公益事業
EATON VANCE CORP	50	41	144	15,961	各種金融
DELTA AIR LINES INC	88	71	308	33,987	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	83	69	575	63,317	食品・飲料・タバコ
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	104	—	—	—	半導体・半導体製造装置
AMERICAN WATER WORKS CO INC	75	64	474	52,208	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	65	57	435	47,912	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	124	104	853	93,938	小売
FORTINET INC	—	53	177	19,588	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	38	33	147	16,226	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	11	9	355	39,161	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	76	60	193	21,259	銀行
QEP RESOURCES INC	69	—	—	—	エネルギー
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	422	413	205	22,568	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO	532	500	1,517	167,053	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	48	414	45,672	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	176	135	1,092	120,264	素材
HCA HOLDINGS INC	125	115	886	97,645	ヘルスケア機器・サービス
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	187	130	109	12,052	運輸
WHITING PETROLEUM CORP	85	—	—	—	エネルギー
ROCK-TENN COMPANY -CL A	57	—	—	—	素材
HOLLYFRONTIER CORP	78	62	171	18,905	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	116	188	681	75,017	エネルギー
ZILLOW GROUP INC - A	19	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ATMOS ENERGY CORP	—	37	265	29,283	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	—	56	322	35,529	資本財
XYLEM INC	76	63	275	30,279	資本財
TRIPADVISOR INC	48	42	266	29,335	小売
MEDIVATION INC	32	58	354	39,038	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	25	21	322	35,483	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	53	52	366	40,325	銀行
ALLEGHANY CORP	6	5	294	32,400	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	33	27	1,039	114,481	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	229	188	1,466	161,463	エネルギー
FACEBOOK INC-A	829	803	9,389	1,033,732	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP	116	100	410	45,223	公益事業
ALBEMARLE CORP	46	40	303	33,399	素材
PVH CORP	34	29	255	28,132	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A	44	40	511	56,364	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
KINDER MORGAN INC	745	671	1,159	127,659	エネルギー
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	122	—	—	—	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	144	122	631	69,534	商業・専門サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	122	98	651	71,685	自動車・自動車部品
CHARTER COMMUNICATION-A	31	—	—	—	メディア
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	66	60	207	22,825	資本財
SPLUNK INC	—	45	227	25,039	ソフトウェア・サービス
ADT CORP/THE	72	—	—	—	商業・専門サービス
KRAFT FOODS GROUP INC	243	—	—	—	食品・飲料・タバコ
OGE ENERGY CORP	83	71	218	24,035	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	26	21	180	19,850	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	659	578	3,431	377,752	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LIBERTY MEDIA CORP - A	38	—	—	—	メディア
TESLA MOTORS INC	36	34	748	82,426	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	93	80	265	29,244	エネルギー
REALOGY HOLDINGS CORP	60	52	158	17,480	不動産
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	52	45	234	25,786	各種金融
ZOETIS INC	207	167	778	85,693	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC	48	41	244	26,928	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	156	134	155	17,074	メディア
SPRINT CORP	330	294	107	11,884	電気通信サービス
TECO ENERGY INC	—	84	233	25,676	公益事業
SNAP-ON INC	24	20	328	36,159	資本財
AGL RESOURCES INC	—	43	283	31,222	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	85	66	268	29,572	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	158	206	292	32,230	ソフトウェア・サービス
VANTIV INC - CL A	60	54	293	32,293	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	41	39	292	32,247	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	55	53	370	40,781	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	37	32	436	48,068	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	41	34	124	13,666	資本財
PHARMACYCLICS INC	26	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	32	27	402	44,331	ソフトウェア・サービス
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	—	65	150	16,525	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL C	119	110	7,709	848,697	ソフトウェア・サービス
IMS HEALTH HOLDINGS INC	—	56	140	15,416	ヘルスケア機器・サービス
NAVIENT CORP	172	127	157	17,388	各種金融
ENDO INTERNATIONAL PLC	71	77	114	12,637	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED RENTALS INC	41	32	211	23,230	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	75	56	182	20,142	運輸
VOYA FINANCIAL INC	95	76	242	26,745	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	19	16	70	7,726	素材
ANTERO RESOURCES CORP	22	29	78	8,590	エネルギー
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	28	33	215	23,678	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIREEYE INC	34	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP - C	87	—	—	—	メディア
ALLY FINANCIAL INC	180	155	259	28,618	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	204	174	358	39,510	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	—	48	248	27,411	ソフトウェア・サービス
JARDEN CORP	75	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	47	57	267	29,432	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	28	28	401	44,183	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
SIGNET JEWELERS LTD	31	26	286	31,523	小売
SYNCHRONY FINANCIAL	70	294	882	97,155	各種金融
QORVO INC	60	49	235	25,923	半導体・半導体製造装置
IONIS PHARMACEUTICALS INC	48	42	140	15,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	－	62	299	33,006	保険
ACUITY BRANDS INC	－	15	377	41,527	資本財
JONES LANG LASALLE INC	－	15	170	18,733	不動産
ARAMARK	－	81	261	28,812	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	－	186	427	47,045	銀行
LEAR CORP	－	26	299	32,924	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	－	26	142	15,740	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHITEWAVE FOODS CO	－	63	277	30,559	食品・飲料・タバコ
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	－	50	138	15,251	素材
RITE AID CORP	－	373	288	31,717	食品・生活必需品小売り
BAXALTA INC	－	241	1,054	116,083	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLUMBIA PIPELINE GROUP	－	136	349	38,479	エネルギー
WESTROCK CO	－	91	340	37,454	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	－	214	1,782	196,263	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	－	389	1,464	161,281	ソフトウェア・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	－	19	92	10,135	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	－	34	93	10,326	ソフトウェア・サービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	－	638	1,008	110,994	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOBILEYE NV	－	30	108	11,945	ソフトウェア・サービス
AMERCO	－	2	105	11,628	運輸
CDW CORP/DE	－	50	212	23,406	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDNAX INC	－	33	223	24,654	ヘルスケア機器・サービス
SABRE CORP	－	67	186	20,511	ソフトウェア・サービス
WR GRACE & CO	－	25	188	20,793	素材
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	－	63	221	24,416	耐久消費財・アパレル
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	－	71	220	24,292	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	－	33	104	11,486	メディア
INGEVITY CORP	－	15	38	4,292	素材
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	－	76	1,745	192,208	メディア
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	－	220	133	14,749	不動産
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	－	90	484	53,285	資本財
小計 株数・金額	128,954	111,339	641,953	70,672,647	
小計 銘柄数＜比率＞	592	596	－	＜61.9%＞	
(カナダ)			千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA	597	525	4,072	342,613	銀行
IMPERIAL OIL LTD	123	107	435	36,637	エネルギー
THOMSON REUTERS CORP	149	122	646	54,418	メディア
TRANSCANADA CORP	294	251	1,326	111,580	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	151	128	636	53,520	電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	254	216	951	80,048	保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B	232	197	250	21,081	素材
BARRICK GOLD CORP	482	412	978	82,355	素材
BCE INC	59	51	306	25,743	電気通信サービス
AGRIUM INC	60	47	540	45,444	素材
BOMBARDIER INC-B	588	712	142	11,980	資本財
BANK OF MONTREAL	267	227	1,867	157,077	銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	358	313	1,375	115,758	不動産
BANK OF NOVA SCOTIA	504	425	2,666	224,292	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	132	116	397	33,444	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC	111	94	153	12,914	資本財
CAMECO CORP	164	141	210	17,746	エネルギー
CI FINANCIAL CORP	95	83	227	19,125	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	164	140	1,411	118,724	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	453	387	1,448	121,898	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	338	282	2,125	178,836	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	31	25	347	29,275	小売
ENBRIDGE INC	352	325	1,693	142,453	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	8	7	512	43,112	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	93	79	461	38,814	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	143	123	178	15,034	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	42	34	124	10,500	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	94	80	551	46,426	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	816	697	1,282	107,895	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	172	143	731	61,560	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	137	120	503	42,391	銀行
ONEX CORPORATION	36	30	227	19,156	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	344	295	642	54,079	素材
POWER CORP OF CANADA	155	133	384	32,325	保険
POWER FINANCIAL CORP	104	89	277	23,361	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	163	145	354	29,838	メディア
SUNCOR ENERGY INC	601	560	1,920	161,596	エネルギー
TRANSALTA CORP	113	－	－	－	公益事業
WESTON (GEORGE) LTD	21	18	200	16,859	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	71	51	856	72,091	運輸
ENCANA CORP	318	302	298	25,153	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	88	78	466	39,267	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	70	62	131	11,058	資本財
GOLDCORP INC	337	293	664	55,931	素材
KINROSS GOLD CORP	472	433	279	23,496	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	63	53	273	22,994	資本財
GREAT-WEST LIFECO INC	125	106	365	30,784	保険
METHANEX CORP	38	31	123	10,379	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	334	346	127	10,741	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	36	32	61	5,212	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	97	82	308	25,966	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	106	91	365	30,730	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	206	175	153	12,926	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELUS CORP	84	79	319	26,864	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	251	239	206	17,332	素材
YAMANA GOLD INC	379	343	214	18,035	素材
FORTIS INC	116	102	407	34,290	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	173	148	829	69,776	食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP	306	267	158	13,365	素材
TORONTO-DOMINION BANK	763	656	3,691	310,550	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	65	62	526	44,310	素材
SILVER WHEATON CORP	155	148	370	31,140	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	23	60	129	10,862	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	43	37	152	12,809	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	52	45	162	13,666	公益事業
METRO INC	105	86	369	31,104	食品・生活必需品小売り

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	
OPEN TEXT CORP	51	43	313	26,386	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	55	47	419	35,250	保険
CRESCENT POINT ENERGY CORP	177	179	390	32,844	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	341	295	566	47,651	エネルギー
MEG ENERGY CORP	64	—	—	—	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	131	122	253	21,348	エネルギー
CANADIAN OIL SANDS LTD	205	—	—	—	エネルギー
BAYTEX ENERGY CORP	72	—	—	—	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	70	66	203	17,146	エネルギー
ENERPLUS CORP	83	—	—	—	エネルギー
NEW GOLD INC	227	—	—	—	素材
PEMBINA PIPELINE CORP	140	133	491	41,377	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	45	41	174	14,694	エネルギー
CATAMARAN CORP	85	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
DOLLARAMA INC	53	43	381	32,131	小売
KEYERA CORP	69	61	232	19,573	エネルギー
ALTAGAS LTD	54	51	151	12,777	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	62	53	170	14,344	エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	33	30	125	10,557	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	38	42	87	7,349	不動産
INTER PIPELINE LTD	136	120	316	26,612	エネルギー
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	54	63	158	13,351	エネルギー
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	—	59	150	12,682	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	7	7	361	30,385	ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION SOFTWARE INC-RTS	8	—	—	—	ソフトウェア・サービス
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	25	—	—	—	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	79	72	385	32,395	消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	28	25	97	8,194	素材
VERESEN INC	—	108	104	8,758	エネルギー
CCL INDUSTRIES INC - CL B	—	10	225	18,955	素材
ELEMENT FINANCIAL CORP	—	136	202	17,070	各種金融
LINAMAR CORP	—	18	91	7,703	自動車・自動車部品
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	—	38	165	13,929	商業・専門サービス
小計 株数・金額	16,269	14,150	50,805	4,274,238	
小計 銘柄数<比率>	93	90	—	<3.7%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
COMMERZBANK AG	440	375	272	33,562	銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	570	488	729	89,938	各種金融
METRO AG	66	63	176	21,705	食品・生活必需品小売り
SIEMENS AG-REG	328	280	2,602	320,867	資本財
RWE AG	202	173	197	24,307	公益事業
BASF SE	380	324	2,162	266,573	素材
VOLKSWAGEN AG	12	12	168	20,804	自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	399	340	1,956	241,187	自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	73	62	642	79,176	家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE	829	707	578	71,309	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	137	117	830	102,353	自動車・自動車部品
BAYER AG-REG	342	292	2,590	319,369	医薬品・ﾊﾞｲｵﾃｸﾉﾛｼﾞｰ・ﾗｲﾌｻｲｴﾝｽ
LINDE AG	76	65	832	102,611	素材
ALLIANZ SE-REG	189	161	2,202	271,488	保険
MAN SE	14	11	112	13,908	資本財
CONTINENTAL AG	45	38	711	87,709	自動車・自動車部品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	466	401	491	60,585	半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	63	54	259	32,032	自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	99	82	102	12,583	運輸
HUGO BOSS AG -ORD	27	23	135	16,761	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE POST AG-REG	401	343	883	108,886	運輸
SAP SE	381	347	2,382	293,672	ソフトウェア・サービス
CELESIO AG	22	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	91	78	341	42,117	メディア
DEUTSCHE BOERSE AG	80	67	515	63,538	各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	90	77	569	70,208	ヘルスケア機器・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	15	14	73	9,098	運輸
ADIDAS AG	87	74	810	99,974	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,315	1,141	1,801	222,037	電気通信サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	71	58	936	115,452	保険
THYSSENKRUPP AG	187	130	235	29,070	素材
BEIERSDORF AG	41	35	274	33,899	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	58	48	358	44,159	素材
MERCK KGAA	53	46	398	49,126	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOLKSWAGEN AG-PREF	67	65	841	103,795	自動車・自動車部品
LANXESS AG	38	32	133	16,422	素材
FRESENIUS SE & CO KGAA	157	135	859	105,956	ヘルスケア機器・サービス
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	120	118	329	40,645	不動産
GEA GROUP AG	75	65	268	33,137	資本財
SYMRISE AG	51	44	244	30,144	素材
K+S AG-REG	70	69	147	18,189	素材
HENKEL AG & CO KGAA	48	36	337	41,590	家庭用品・パーソナル用品
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	50	44	197	24,300	ソフトウェア・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	22	18	117	14,497	自動車・自動車部品
HANNOVER RUECK SE	25	21	204	25,251	保険
BRENNTAG AG	63	54	255	31,442	資本財
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	9	—	—	—	メディア
AXEL SPRINGER SE	17	15	75	9,319	メディア
FUCHS PETROLUB SE -PREF	29	23	86	10,631	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	246	253	114	14,176	電気通信サービス
OSRAM LICHT AG	37	30	140	17,361	資本財
VONOVIA SE	141	165	495	61,026	不動産
EVONIK INDUSTRIES AG	—	49	130	16,147	素材
ZALANDO SE	—	31	86	10,613	小売
小計 株数・金額	8,933	7,820	32,403	3,994,730	
小計 銘柄数<比率>	52	52	—	<3.5%>	
(ユーロ…イタリア)					
ASSICURAZIONI GENERALI	484	411	515	63,515	保険
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	91	—	—	—	銀行
INTESA SANPAOLO	5,244	4,499	1,032	127,347	銀行
TELECOM ITALIA SPA	4,221	4,068	337	41,657	電気通信サービス
ENI SPA	1,052	901	1,188	146,522	エネルギー
UNICREDIT SPA	1,819	1,687	471	58,075	銀行
ENEL SPA	2,731	2,712	1,068	131,752	公益事業
SAIPEM SPA	108	2,049	73	9,064	エネルギー
ATLANTIA SPA	172	144	352	43,517	運輸
INTESA SANPAOLO-RSP	397	324	71	8,835	銀行
LUXOTTICA GROUP SPA	69	60	293	36,161	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	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
MEDIOBANCA SPA	246	203	134	16,533	各種金融
SNAM SPA	868	753	387	47,718	公益事業
TELECOM ITALIA-RSP	2,448	2,076	140	17,330	電気通信サービス
BANCO POPOLARE SC	147	130	55	6,893	銀行
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	164	146	154	19,029	資本財
PIRELLI & C.	96	—	—	—	自動車・自動車部品
UBI BANCA SPA	359	318	110	13,623	銀行
TERNA SPA	629	551	263	32,543	公益事業
UNIPOLSAI SPA	369	391	72	8,930	保険
PRYSMIAN SPA	85	66	143	17,660	資本財
EXOR SPA	41	38	121	15,017	各種金融
ENEL GREEN POWER SPA	754	—	—	—	公益事業
小計 株数・金額	22,607	21,536	6,990	861,731	
小計 銘柄数＜比率＞	23	20	—	＜0.8％＞	
(ユーロ…フランス)					
MICHELIN (CGDE)	76	65	569	70,165	自動車・自動車部品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	115	98	1,406	173,340	耐久消費財・アパレル
PEUGEOT SA	162	157	206	25,450	自動車・自動車部品
AXA SA	752	696	1,452	179,044	保険
DANONE	239	208	1,240	152,960	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	228	194	467	57,581	食品・生活必需品小売り
VIVENDI	502	409	696	85,917	メディア
INGENICO GROUP	—	19	197	24,349	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALCATEL-LUCENT SA	1,161	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA	299	256	884	109,046	銀行
AIR LIQUIDE SA	142	121	1,165	143,628	素材
TOTAL SA	886	777	3,273	403,562	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	185	168	645	79,519	資本財
ZODIAC AEROSPACE	76	70	150	18,499	資本財
VINCI SA	195	169	1,105	136,321	資本財
LAFARGE SA	76	—	—	—	素材
SANOFI	494	415	2,868	353,624	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	176	164	319	39,428	公益事業
L'OREAL	104	88	1,407	173,556	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA	87	75	287	35,433	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	217	197	1,094	134,982	資本財
BNP PARIBAS	438	374	1,698	209,439	銀行
ESSILOR INTERNATIONAL	84	72	815	100,479	ヘルスケア機器・サービス
CAPGEMINI	59	57	462	57,065	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	23	20	101	12,528	食品・生活必需品小売り
VALEO SA	31	28	365	45,036	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	10	9	293	36,190	耐久消費財・アパレル
VALLOUREC SA	44	—	—	—	エネルギー
SODEXO	39	33	299	36,886	消費者サービス
KERING	31	27	383	47,318	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	53	45	310	38,316	ソフトウェア・サービス
TECHNIP SA	42	37	183	22,645	エネルギー
CHRISTIAN DIOR SE	22	19	279	34,460	耐久消費財・アパレル
ATOS SE	33	31	249	30,770	ソフトウェア・サービス
ORANGE	768	702	1,050	129,547	電気通信サービス
CNP ASSURANCES	70	59	84	10,456	保険
IMERYS SA	14	13	81	10,050	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	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
SAFRAN SA	121	110	647	79,873	資本財
RENAULT SA	79	67	537	66,219	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	77	67	427	52,763	メディア
LAGARDERE SCA	47	40	87	10,845	メディア
JC DECAUX SA	27	27	95	11,769	メディア
SOCIETE BIC SA	12	10	126	15,615	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	69	73	209	25,860	資本財
THALES SA	37	37	285	35,218	資本財
PERNOD RICARD SA	87	75	704	86,877	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	428	375	328	40,515	銀行
ENGIE	600	519	685	84,460	公益事業
ALSTOM	89	54	120	14,866	資本財
ARKEMA	27	23	165	20,363	素材
LEGRAND SA	109	94	453	55,935	資本財
SCOR SE	64	53	153	18,895	保険
ADP	12	10	112	13,889	運輸
EDF	101	85	98	12,161	公益事業
NATIXIS	389	335	145	17,914	銀行
WENDEL	13	10	107	13,311	各種金融
BUREAU VERITAS SA	110	94	178	21,992	商業・専門サービス
EURAZEO	17	13	78	9,622	各種金融
EURAZEO-NEW	—	0.69	3	474	各種金融
SUEZ	124	109	159	19,687	公益事業
ILIAD SA	10	9	181	22,394	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	63	60	108	13,392	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	195	168	196	24,225	運輸
EDENRED	84	71	117	14,479	商業・専門サービス
REMY COINTREAU	10	7	56	7,000	食品・飲料・タバコ
REXEL SA	115	105	137	16,997	資本財
BOLLORE	360	319	102	12,640	運輸
NUMERICABLE-SFR	39	40	110	13,676	電気通信サービス
小計 株数・金額	11,484	8,966	33,026	4,071,546	
小計 銘柄数<比率>	66	65	—	<3.6%>	
(ユーロ…オランダ)					
QIAGEN N.V.	95	80	151	18,660	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV	387	334	202	24,953	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	373	320	201	24,826	自動車・自動車部品
FERRARI NV	—	44	160	19,766	自動車・自動車部品
AIRBUS GROUP SE	243	209	1,116	137,598	資本財
STMICROELECTRONICS NV	259	221	110	13,683	半導体・半導体製造装置
GEMALTO	33	28	152	18,846	ソフトウェア・サービス
WOLTERS KLUWER	124	107	366	45,197	メディア
KONINKLIJKE KPN NV	1,322	1,149	397	48,995	電気通信サービス
AKZO NOBEL	101	87	529	65,330	素材
HEINEKEN NV	95	81	657	81,083	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV	386	336	771	95,076	資本財
RELX NV	291	351	523	64,589	メディア
AEGON NV	747	652	288	35,522	保険
KONINKLIJKE AHOLD NV	368	294	555	68,501	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD HOLDING NV	52	45	207	25,541	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV	42	36	254	31,384	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	72	63	335	41,339	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	
(ユーロ…オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ING GROEP NV-CVA		1,598	1,369	1,408	173,613	銀行
ASML HOLDING NV		145	122	1,022	126,011	半導体・半導体製造装置
UNILEVER NV-CVA		674	576	2,225	274,301	家庭用品・パーソナル用品
VOPAK		29	25	119	14,702	エネルギー
BOSKALIS WESTMINSTER		36	30	99	12,300	資本財
DELTA LLOYD NV		85	—	—	—	保険
TNT EXPRESS NV		182	173	138	17,084	運輸
OCI NV		36	30	40	5,007	素材
NN GROUP NV		64	113	327	40,339	保険
ALTICE NV - B		—	40	58	7,191	メディア
ALTICE NV - A		—	130	184	22,790	メディア
小計	株数・金額	7,850	7,057	12,607	1,554,240	
	銘柄数＜比率＞	26	28	—	＜1.4%＞	
(ユーロ…スペイン)						
BANCO POPULAR ESPANOL		748	600	127	15,659	銀行
ENDESA SA		133	114	204	25,200	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		73	67	189	23,365	資本財
IBERDROLA SA		2,142	1,948	1,174	144,796	公益事業
TELEFONICA SA		1,852	1,592	1,451	178,896	電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA		5,953	5,105	2,086	257,242	銀行
BANKINTER SA		273	236	154	19,048	銀行
REPSOL SA		429	388	434	53,559	エネルギー
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		2,614	2,292	1,277	157,500	銀行
GAS NATURAL SDG SA		146	126	214	26,382	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		451	383	1,082	133,441	小売
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		169	186	266	32,803	運輸
MAPFRE SA		386	391	84	10,422	保険
FERROVIAL SA		174	168	311	38,383	資本財
ZARDOYA OTIS SA		69	67	61	7,552	資本財
ENAGAS SA		84	76	200	24,744	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		45	38	295	36,443	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		1,805	1,836	286	35,316	銀行
CAIXABANK S.A		946	937	228	28,209	銀行
GRIFOLS SA		60	105	191	23,635	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		186	154	604	74,495	ソフトウェア・サービス
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI		347	293	196	24,272	運輸
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		251	215	111	13,758	食品・生活必需品小売り
BANKIA SA		1,886	1,600	123	15,195	銀行
AENA SA		24	24	293	36,143	運輸
小計	株数・金額	21,256	18,953	11,652	1,436,469	
	銘柄数＜比率＞	25	25	—	＜1.3%＞	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS		92	72	248	30,591	保険
UCB SA		52	44	293	36,144	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		333	284	3,081	379,920	食品・飲料・タバコ
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		33	28	206	25,443	各種金融
DELHAIZE GROUP		42	36	333	41,134	食品・生活必需品小売り
UMICORE		38	33	145	17,951	素材
COLRUYT SA		29	25	131	16,158	食品・生活必需品小売り
KBC GROEP NV		103	88	432	53,320	銀行
SOLVAY SA		24	26	226	27,938	素材
PROXIMUS		63	53	150	18,536	電気通信サービス

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円	
TELENET GROUP HOLDING NV		22	19	81	10,043	メディア
小計	株数・金額	837	713	5,330	657,183	
	銘柄数<比率>	11	11	－	<0.6%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG		116	99	228	28,168	銀行
OMV AG		62	54	136	16,865	エネルギー
VOESTALPINE AG		46	41	118	14,600	素材
IMMOFINANZ AG		403	－	－	－	不動産
ANDRITZ AG		31	28	124	15,407	資本財
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		47	39	44	5,470	銀行
VIENNA INSURANCE GROUP AG		17	－	－	－	保険
小計	株数・金額	723	262	653	80,513	
	銘柄数<比率>	7	5	－	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP		16	13	109	13,454	メディア
TENARIS SA		194	165	190	23,544	エネルギー
SES		125	117	254	31,418	メディア
ARCELORMITTAL		415	607	238	29,423	素材
ALTICE SA		36	－	－	－	メディア
小計	株数・金額	788	903	793	97,841	
	銘柄数<比率>	5	4	－	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ		1,550	2,041	940	115,996	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS		226	194	139	17,234	素材
NOKIAN RENKAAT OYJ		47	41	129	15,914	自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ		223	185	307	37,863	素材
FORTUM OYJ		186	159	207	25,520	公益事業
KONE OYJ-B		129	118	465	57,333	資本財
METSO OYJ		47	41	81	10,062	資本財
SAMPO OYJ-A SHS		185	157	614	75,696	保険
WARTSILA OYJ ABP		61	52	189	23,419	資本財
ELISA OYJ		60	50	162	20,042	電気通信サービス
NESTE OYJ		53	45	129	15,937	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		40	37	115	14,210	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	2,813	3,125	3,481	429,233	
	銘柄数<比率>	12	12	－	<0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A		67	57	454	56,070	食品・飲料・タバコ
PADDY POWER BETFAIR PLC		－	30	339	41,847	消費者サービス
BANK OF IRELAND		11,576	10,157	243	30,052	銀行
CRH PLC		342	295	768	94,686	素材
小計	株数・金額	11,986	10,540	1,806	222,655	
	銘柄数<比率>	3	4	－	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		973	836	245	30,211	公益事業
JERONIMO MARTINS		105	89	122	15,082	食品・生活必需品小売り
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R		14,749	15,817	51	6,395	銀行
GALP ENERGIA SGPS SA		163	163	191	23,591	エネルギー
小計	株数・金額	15,990	16,906	610	75,280	
	銘柄数<比率>	4	4	－	<0.1%>	
ユーロ計	株数・金額	105,272	96,787	109,356	13,481,428	
	銘柄数<比率>	234	230	－	<11.8%>	

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
BARCLAYS PLC	6,813	5,939	1,013	162,925	銀行
BP PLC	7,555	6,486	2,309	371,139	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	23,650	20,217	1,396	224,479	銀行
ASTRAZENECA PLC	523	447	1,704	273,951	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC	163	140	151	24,324	資本財
NEXT PLC	63	52	277	44,556	小売
DIAGEO PLC	1,040	890	1,618	260,105	食品・飲料・タバコ
SKY PLC	427	365	336	54,128	メディア
BAE SYSTEMS PLC	1,303	1,116	533	85,789	資本財
UNILEVER PLC	531	453	1,380	221,874	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC	3,362	2,873	459	73,861	食品・生活必需品小売り
RELX PLC	472	392	477	76,672	メディア
MARKS & SPENCER GROUP PLC	675	583	256	41,199	小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	267	225	1,523	244,850	家庭用品・パーソナル用品
PRUDENTIAL PLC	1,063	909	1,177	189,320	保険
BG GROUP PLC	1,413	—	—	—	エネルギー
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,463	2,095	462	74,288	保険
SAGE GROUP PLC/THE	441	380	221	35,586	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	7,948	6,929	2,955	475,109	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	772	660	2,697	433,489	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	287	251	234	37,712	公益事業
SCHRODERS PLC	51	43	110	17,744	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,047	1,224	277	44,626	銀行
BHP BILLITON PLC	874	748	609	98,003	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	396	339	1,244	200,010	食品・飲料・タバコ
WPP PLC	544	463	723	116,305	メディア
CENTRICA PLC	2,056	1,805	358	57,649	公益事業
BT GROUP PLC	3,373	2,996	1,297	208,498	電気通信サービス
SSE PLC	410	359	537	86,322	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	1,023	1,158	593	95,313	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	780	650	412	66,330	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF C	112,001	46,179	4	742	資本財
COMPASS GROUP PLC	690	580	727	116,902	消費者サービス
KINGFISHER PLC	971	802	283	45,641	小売
PEARSON PLC	339	289	232	37,383	メディア
SEVERN TRENT PLC	101	87	189	30,522	公益事業
RIO TINTO PLC	526	439	852	137,007	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,013	1,722	2,424	389,728	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SABMILLER PLC	400	343	1,447	232,619	食品・飲料・タバコ
PROVIDENT FINANCIAL PLC	—	51	144	23,289	各種金融
3I GROUP PLC	404	342	171	27,520	各種金融
GKN PLC	685	608	166	26,712	自動車・自動車部品
VODAFONE GROUP PLC	10,978	9,393	2,117	340,297	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	872	793	149	24,039	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	504	476	120	19,292	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	1,657	1,430	608	97,833	保険
CAPITA PLC	273	237	252	40,535	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC	408	349	150	24,121	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	84	68	199	32,041	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	420	361	173	27,908	保険
WHITBREAD PLC	75	65	265	42,730	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	1,564	1,331	1,292	207,793	公益事業

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
ARM HOLDINGS PLC	582	495	458	73,650	半導体・半導体製造装置
WOLSELEY PLC	108	90	353	56,810	資本財
LONMIN PLC	49	—	—	—	素材
BUNZL PLC	137	120	240	38,613	資本財
COBHAM PLC	468	414	67	10,834	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	576	495	286	46,105	素材
INTERTEK GROUP PLC	66	57	187	30,093	商業・専門サービス
WILLIAM HILL PLC	356	312	95	15,345	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	184	159	171	27,613	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	98	68	174	27,995	消費者サービス
CARNIVAL PLC	76	67	235	37,820	消費者サービス
PERSIMMON PLC	127	109	221	35,554	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	335	272	102	16,472	資本財
ICAP PLC	223	193	83	13,345	各種金融
ITV PLC	1,586	1,368	283	45,632	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	130	110	284	45,750	各種金融
G4S PLC	643	550	102	16,504	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS	—	46	142	22,860	耐久消費財・アパレル
AMEC FOSTER WHEELER PLC	159	—	—	—	エネルギー
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	—	358	200	32,187	耐久消費財・アパレル
IMI PLC	111	95	94	15,240	資本財
REXAM PLC	287	250	155	25,045	素材
SMITH & NEPHEW PLC	372	314	356	57,226	ヘルスケア機器・サービス
TATE & LYLE PLC	196	161	96	15,543	食品・飲料・タバコ
TAYLOR WIMPEY PLC	—	1,157	228	36,802	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,619	1,394	2,298	369,360	エネルギー
PETROFAC LTD	110	94	75	12,184	エネルギー
TRAVIS PERKINS PLC	102	86	156	25,175	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,010	1,403	2,335	375,337	エネルギー
OLD MUTUAL PLC	2,024	1,743	286	46,012	保険
INVESTEC PLC	226	192	90	14,562	各種金融
STANDARD LIFE PLC	815	689	226	36,475	保険
EXPERIAN PLC	412	341	429	69,054	商業・専門サービス
MONDI PLC	—	130	170	27,441	素材
WEIR GROUP PLC/THE	87	77	92	14,855	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	146	125	363	58,366	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC	159	135	56	9,104	素材
TULLOW OIL PLC	371	—	—	—	エネルギー
SHIRE PLC	244	209	861	138,522	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INMARSAT PLC	175	157	116	18,760	電気通信サービス
ADMIRAL GROUP PLC	82	74	140	22,563	保険
FRESNILLO PLC	91	80	85	13,794	素材
RANDGOLD RESOURCES LTD	36	32	198	31,932	素材
AGGREKO PLC	105	93	103	16,646	商業・専門サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	105	92	90	14,509	商業・専門サービス
ST JAMES'S PLACE PLC	—	188	166	26,789	保険
GLENCORE PLC	4,605	4,329	554	89,135	素材
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	382	321	86	13,897	各種金融
HARGREAVES LANSDOWN PLC	99	92	116	18,676	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC	55	46	138	22,234	素材
MELROSE INDUSTRIES PLC	423	—	—	—	資本財
COCA-COLA HBC AG-DI	81	70	91	14,638	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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
EASYJET PLC	67	57	84	13,542	運輸
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	613	489	179	28,803	保険
ROYAL MAIL PLC	264	320	156	25,157	運輸
ASHTEAD GROUP PLC	206	177	168	27,009	資本財
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	113	96	34	5,599	小売
MERLIN ENTERTAINMENT	291	252	103	16,711	消費者サービス
TUI AG-DI	187	178	180	28,995	消費者サービス
SOUTH32 LTD	874	—	—	—	素材
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	—	129	106	17,105	ヘルスケア機器・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	—	277	105	17,000	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY GROUP PLC	—	506	131	21,145	ソフトウェア・サービス
小計 株数・金額	229,853	149,119	54,532	8,764,992	
小計 銘柄数<比率>	106	109	—	<7.7%>	
(スイス)			千スイスフラン		
NESTLE SA-REG	1,335	1,128	8,155	905,449	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	215	184	1,138	126,427	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	631	636	845	93,843	各種金融
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	94	161	709	78,726	素材
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	291	248	6,021	668,622	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GIVAUDAN-REG	3	3	623	69,237	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	22	18	241	26,858	ヘルスケア機器・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	61	53	1,245	138,278	保険
SYNGENTA AG-REG	38	32	1,298	144,223	素材
LONZA GROUP AG-REG	22	18	315	34,978	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	20	17	103	11,506	耐久消費財・アパレル
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	18	15	278	30,891	資本財
GEBERIT AG-REG	15	13	494	54,930	資本財
SWISS RE AG	145	124	1,067	118,522	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR	12	10	330	36,742	耐久消費財・アパレル
PARGESA HOLDING SA-BR	12	11	71	7,926	各種金融
NOVARTIS AG-REG	952	805	5,939	659,498	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	70	58	341	37,951	商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG	9	9	436	48,424	電気通信サービス
ABB LTD-REG	909	778	1,556	172,822	資本財
SGS SA-REG	2	1	416	46,222	商業・専門サービス
SULZER AG-REG	9	5	44	4,966	資本財
SCHINDLER HOLDING AG-REG	8	7	126	14,031	資本財
ACTELION LTD-REG	42	36	568	63,110	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	22	19	260	28,928	運輸
BALOISE HOLDING AG - REG	20	17	209	23,215	保険
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	13	11	269	29,882	保険
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.04	0.04	290	32,289	食品・飲料・タバコ
ARYZTA AG	35	29	116	12,892	食品・飲料・タバコ
JULIUS BAER GROUP LTD	92	78	321	35,666	各種金融
SIKA AG-BR	0.9	0.76	320	35,584	素材
TRANSOCEAN LTD	151	—	—	—	エネルギー
SWISS PRIME SITE-REG	24	23	199	22,152	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.42	0.34	210	23,367	食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG	7	5	231	25,744	各種金融
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.9	0.83	96	10,671	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	3	2	135	15,041	素材
UBS GROUP AG-REG	1,512	1,295	1,889	209,784	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	
(スイス)		百株	百株	千スイスフラン	千円	
DUFRY AG-REG		－	14	191	21,232	小売
GALENICA AG-REG		－	1	182	20,207	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	6,834	5,884	37,294	4,140,851	
	銘柄数＜比率＞	38	39	－	＜3.6%＞	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-SER B		100	84	1,822	24,021	耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS		1,259	1,078	6,734	88,758	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS		161	138	2,655	35,004	資本財
ATLAS COPCO AB- B REDEMPTION		161	－	－	－	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		631	539	4,059	53,508	銀行
INVESTOR AB-B SHS		187	161	4,434	58,441	各種金融
NORDEA BANK AB		1,256	1,076	8,283	109,180	銀行
GETINGE AB-B SHS		81	73	1,232	16,246	ヘルスケア機器・サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		623	527	5,405	71,249	銀行
ATLAS COPCO AB-A SHS		277	237	4,920	64,852	資本財
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION		277	－	－	－	資本財
SKF AB-B SHARES		165	141	2,039	26,886	資本財
ASSA ABLOY AB-B		137	353	5,848	77,085	資本財
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		392	335	8,591	113,229	小売
SANDVIK AB		439	375	3,064	40,393	資本財
SWEDBANK AB - A SHARES		373	318	5,502	72,517	銀行
SECURITAS AB-B SHS		133	111	1,401	18,477	商業・専門サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B		244	213	5,437	71,660	家庭用品・パーソナル用品
SKANSKA AB-B SHS		158	135	2,349	30,967	資本財
SWEDISH MATCH AB		82	69	1,891	24,935	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS		130	117	923	12,167	電気通信サービス
TELIA CO AB		1,079	939	3,539	46,646	電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS		633	543	4,920	64,853	資本財
ALFA LAVAL AB		128	103	1,288	16,980	資本財
ELEKTA AB-B SHS		155	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
LUNDIN PETROLEUM AB		90	79	1,176	15,504	エネルギー
BOLIDEN AB		113	93	1,305	17,206	素材
HUSQVARNA AB-B SHS		166	144	940	12,398	耐久消費財・アパレル
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR		26	24	1,104	14,555	電気通信サービス
HEXAGON AB-B SHS		106	91	2,830	37,310	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS		98	84	1,866	24,600	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		68	50	695	9,164	各種金融
ICA GRUPPEN AB		32	28	786	10,366	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	9,980	8,273	97,053	1,279,171	
	銘柄数＜比率＞	33	30	－	＜1.1%＞	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
DNB ASA		403	349	3,457	45,540	銀行
NORSK HYDRO ASA		558	475	1,493	19,674	素材
ORKLA ASA		334	286	2,118	27,897	食品・飲料・タバコ
STATOIL ASA		461	394	5,250	69,151	エネルギー
TELENOR ASA		310	264	3,605	47,487	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		74	63	1,835	24,176	素材
SUBSEA 7 SA		117	－	－	－	エネルギー
SEADRILL LTD		161	－	－	－	エネルギー
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		84	69	950	12,517	保険
SCHIBSTED ASA-CL A		－	27	716	9,442	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	
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェークローネ	千円	
SCHIBSTED ASA-B SHS		—	32	819	10,794	メディア
小計	株数・金額	2,505	1,965	20,249	266,682	
	銘柄数<比率>	9	9	—	<0.2%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
NOVO NORDISK A/S-B		832	693	24,759	410,510	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		99	82	2,603	43,164	素材
DANSKE BANK A/S		272	250	4,578	75,903	銀行
WILLIAM DEMANT HOLDING		8	9	614	10,192	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		93	79	3,492	57,899	資本財
TDC A/S		334	280	946	15,699	電気通信サービス
CARLSBERG AS-B		44	37	2,322	38,505	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B		46	39	1,962	32,531	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S		76	68	2,021	33,517	運輸
AP MOELLER-MAERSK A/S-B		3	2	2,142	35,526	運輸
TRYG A/S		41	39	499	8,283	保険
AP MOELLER-MAERSK A/S-A		1	1	1,126	18,678	運輸
PANDORA A/S		48	38	3,768	62,480	耐久消費財・アパレル
ISS A/S		52	52	1,366	22,651	商業・専門サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S		—	35	1,437	23,838	素材
GENMAB A/S		—	19	2,027	33,612	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	1,955	1,731	55,669	922,994	
	銘柄数<比率>	14	16	—	<0.8%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
BHP BILLITON LIMITED		1,331	1,140	2,133	169,924	素材
CSL LTD		196	165	1,887	150,340	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINA LTD		1,063	896	123	9,847	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		308	263	712	56,717	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP		1,144	1,033	2,573	204,931	銀行
RIO TINTO LTD		180	150	668	53,212	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		566	488	587	46,820	保険
LENDLEASE GROUP		232	198	260	20,760	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		672	606	4,716	375,583	銀行
WESTPAC BANKING CORP		1,290	1,180	3,558	283,330	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		1,049	933	2,547	202,860	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-RTS		79	—	—	—	銀行
BRAMBLES LTD		651	566	720	57,359	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD		242	206	66	5,324	運輸
BORAL LTD		342	268	180	14,405	素材
WOOLWORTHS LTD		523	452	1,002	79,843	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD		1,780	1,529	862	68,687	電気通信サービス
AMP LTD		1,243	1,062	583	46,429	保険
TABCORP HOLDINGS LTD		355	295	124	9,947	消費者サービス
AMCOR LIMITED		508	415	677	53,959	素材
COMPUTERSHARE LTD		204	169	176	14,036	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD		—	197	245	19,538	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD		119	109	768	61,184	各種金融
CIMIC GROUP LTD		44	38	148	11,790	資本財
ASX LTD		82	70	309	24,682	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD		246	214	189	15,111	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD		24	20	239	19,060	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		189	161	324	25,829	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		241	206	94	7,546	小売

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
NEWCREST MINING LTD	322	270	533	42,477	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	974	889	524	41,778	保険
ORIGIN ENERGY LTD	462	625	348	27,731	エネルギー
ORICA LTD	156	132	183	14,594	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	159	141	302	24,124	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	408	597	252	20,111	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	541	459	595	47,414	保険
TRANSURBAN GROUP	760	735	893	71,115	運輸
WESFARMERS LTD	466	400	1,702	135,574	食品・生活必需品小売り
CHALLENGER LTD	—	207	189	15,055	各種金融
SYDNEY AIRPORT	484	408	293	23,367	運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD	111	98	331	26,384	エネルギー
OIL SEARCH LTD	—	492	340	27,076	エネルギー
WORLEYPARSONS LTD	89	—	—	—	エネルギー
AGL ENERGY LTD	287	251	463	36,942	公益事業
TATTS GROUP LTD	618	531	206	16,462	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	645	573	168	13,421	素材
ASCIANO LTD	410	229	203	16,166	運輸
ILUKA RESOURCES LTD	179	152	88	7,028	素材
AUSNET SERVICES	832	765	120	9,570	公益事業
CROWN RESORTS LTD	156	128	152	12,175	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD	690	604	204	16,307	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	193	161	161	12,864	銀行
AURIZON HOLDINGS LTD	891	753	334	26,643	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	268	265	267	21,270	食品・飲料・タバコ
ALS LTD	170	—	—	—	商業・専門サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	55	51	365	29,080	ヘルスケア機器・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	24	21	76	6,068	消費者サービス
SEEK LTD	139	122	196	15,639	商業・専門サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	155	134	151	12,033	銀行
REA GROUP LTD	23	21	116	9,298	メディア
TPG TELECOM LTD	120	109	127	10,125	電気通信サービス
HEALTHSCOPE LTD	476	633	174	13,928	ヘルスケア機器・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,146	985	302	24,079	保険
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	100	100	62	4,982	各種金融
SOUTH32 LTD	1,331	1,890	296	23,629	素材
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	—	160	142	11,377	電気通信サービス
小計 株数・金額	28,774	27,147	37,359	2,974,972	
小計 銘柄数<比率>	62	63	—	<2.6%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
SPARK NEW ZEALAND LTD	749	634	232	17,331	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	392	351	224	16,674	運輸
CONTACT ENERGY LTD	170	262	141	10,539	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD	284	247	211	15,730	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD	163	137	131	9,796	ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD	544	454	122	9,081	公益事業
MIGHTY RIVER POWER	307	270	79	5,947	公益事業
小計 株数・金額	2,612	2,359	1,143	85,101	
小計 銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>	
(香港)			千香港ドル		
WHARF HOLDINGS LTD	630	490	2,023	28,675	不動産
HUTCHISON WHAMPOA LTD	880	—	—	—	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	260	205	1,670	23,674	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	575	956	8,463	119,934	資本財
SUN HUNG KAI PROPERTIES	700	610	5,261	74,551	不動産
MTR CORP	620	525	2,052	29,087	運輸
HONG KONG & CHINA GAS	2,627	2,541	3,633	51,492	公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT	2,130	1,900	1,331	18,873	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	575	495	3,658	51,834	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	460	406	7,214	102,231	各種金融
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	510	430	509	7,226	運輸
HANG LUNG PROPERTIES LTD	920	790	1,090	15,448	不動産
CLP HOLDINGS LTD	790	680	4,821	68,316	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	433	406	1,774	25,145	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	479	435	1,204	17,074	銀行
HANG SENG BANK LTD	316	273	3,614	51,217	銀行
HYSAN DEVELOPMENT CO	260	240	762	10,797	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD	460	420	367	5,201	消費者サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	97	92	482	6,831	半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO	1,222	1,062	1,187	16,824	不動産
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	310	260	735	10,426	耐久消費財・アパレル
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	260	240	1,731	24,536	公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,545	1,325	2,941	41,681	銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	570	490	1,489	21,107	耐久消費財・アパレル
PCCW LTD	1,660	1,550	781	11,069	電気通信サービス
LI & FUNG LTD	2,424	2,184	932	13,214	耐久消費財・アパレル
KERRY PROPERTIES LTD	260	245	464	6,582	不動産
NWS HOLDINGS LTD	650	560	677	9,601	資本財
SANDS CHINA LTD	1,012	864	2,354	33,361	消費者サービス
WHEELOCK & CO LTD	380	320	1,043	14,782	不動産
WYNN MACAU LTD	656	576	620	8,798	消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD	820	700	332	4,711	消費者サービス
FIRST PACIFIC CO	1,000	860	420	5,959	各種金融
AIA GROUP LTD	4,990	4,266	18,215	258,118	保険
SWIRE PROPERTIES LTD	478	430	872	12,368	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	970	840	2,037	28,864	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	384	348	356	5,049	消費者サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,080	940	1,041	14,758	電気通信サービス
WH GROUP LTD	1,570	2,090	1,254	17,769	食品・飲料・タバコ
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	－	956	4,253	60,272	不動産
小計 株数・金額	35,964	33,002	93,681	1,327,470	
小計 銘柄数＜比率＞	39	39	－	＜1.2%＞	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,247	1,099	925	73,889	銀行
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	702	568	221	17,703	メディア
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	422	375	102	8,144	資本財
CAPITALAND LTD	1,100	920	272	21,744	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	180	143	114	9,169	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	44	42	135	10,798	小売
DBS GROUP HOLDINGS LTD	721	626	939	75,029	銀行
KEPPEL CORP LTD	603	515	268	21,466	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	537	459	814	65,055	銀行
SINGAPORE TECH ENGINEERING	686	556	171	13,674	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,317	2,825	1,076	85,971	電気通信サービス

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円	
SINGAPORE AIRLINES LTD		241	206	218	17,486	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD		340	288	213	17,063	各種金融
SEMBCORP MARINE LTD		350	315	48	3,898	資本財
UOL GROUP LTD		199	166	93	7,436	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD		890	765	211	16,920	運輸
NOBLE GROUP LTD		1,786	1,738	55	4,442	資本財
STARHUB LTD		270	245	85	6,788	電気通信サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		2,890	2,673	94	7,578	食品・飲料・タバコ
WILMAR INTERNATIONAL LTD		840	688	223	17,854	食品・飲料・タバコ
GENTING SINGAPORE PLC		2,510	2,260	163	13,083	消費者サービス
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L		1,310	1,119	206	16,485	不動産
YANGZIJIANG SHIPBUILDING		840	706	62	5,017	資本財
小計	株数・金額	22,028	19,300	6,721	536,704	
	銘柄数<比率>	23	23	－	<0.5%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
ISRAEL CHEMICALS LTD		184	185	279	7,949	素材
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD		356	323	6,450	183,650	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANK HAPOALIM BM		441	373	712	20,285	銀行
NICE SYSTEMS LTD		24	19	497	14,165	ソフトウェア・サービス
BANK LEUMI LE-ISRAEL		545	491	671	19,110	銀行
ISRAEL CORP LIMITED/THE		1	－	－	－	素材
DELEK GROUP LTD		1	1	115	3,300	エネルギー
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO		780	671	510	14,522	電気通信サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		59	46	200	5,711	銀行
AZRIELI GROUP		－	12	199	5,682	不動産
小計	株数・金額	2,394	2,125	9,637	274,379	
	銘柄数<比率>	9	9	－	<0.2%>	
合計	株数・金額	593,398	473,185	－	109,001,635	
	銘柄数<比率>	1,259	1,260	－	<95.4%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
HCP INC	18	16	531	58,511	0.1
MACERICH CO/THE	5	4	346	38,169	0.0
PROLOGIS INC	20	18	858	94,551	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	3	3	259	28,513	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	5	5	476	52,500	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2	2	518	57,136	0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC	—	4	369	40,638	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2	2	368	40,545	0.0
WELLTOWER INC	14	12	854	94,089	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	6	5	668	73,557	0.1
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	2	266	29,333	0.0
REALTY INCOME CORP	9	8	524	57,720	0.1
REGENCY CENTERS CORP	3	3	253	27,929	0.0
SL GREEN REALTY CORP	4	3	343	37,866	0.0
UDR INC	10	9	324	35,729	0.0
VENTAS INC	13	11	765	84,264	0.1
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	38	32	356	39,216	0.0
RAYONIER INC	5	—	—	—	—
WEYERHAEUSER CO	21	27	845	93,047	0.1
AMERICAN TOWER CORP	17	15	1,559	171,669	0.2
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	14	11	221	24,423	0.0
VEREIT INC	37	32	302	33,316	0.0
DUKE REALTY CORP	14	12	283	31,257	0.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	6	154	17,008	0.0
IRON MOUNTAIN INC	6	7	258	28,492	0.0
EQUINIX INC	2	2	811	89,355	0.1
COMMUNICATIONS SALES & LE	4	—	—	—	—
CROWN CASTLE INTL CORP	—	11	1,059	116,600	0.1
EQUITY RESIDENTIAL	14	12	860	94,748	0.1
GENERAL GROWTH PROPERTIES	22	20	535	59,002	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	31	26	390	43,010	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	6	5	184	20,312	0.0
PLUM CREEK TIMBER CO	7	—	—	—	—
PUBLIC STORAGE	6	5	1,301	143,332	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	12	10	2,127	234,195	0.2
VORNADO REALTY TRUST	7	6	557	61,389	0.1
KIMCO REALTY CORP	17	14	397	43,742	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5	4	866	95,444	0.1
小計 口数・金額	414	381	20,806	2,290,622	
小計 銘柄数＜比率＞	34	35	—	＜2.0%＞	
(カナダ)			千カナダドル		
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	—	2	79	6,646	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	5	4	86	7,255	0.0

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		6	5	158	13,374	0.0
小計	口数・金額	11	12	324	27,276	
	銘柄数<比率>	2	3	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		1	1	154	19,036	0.0
KLEPIERRE		7	7	306	37,792	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		4	3	805	99,352	0.1
FONCIERE DES REGIONS		1	1	81	10,001	0.0
ICADE		1	1	75	9,300	0.0
ユーロ計	口数・金額	15	14	1,423	175,483	
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.2%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		39	34	251	40,419	0.0
HAMMERSON PLC		32	27	153	24,673	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		32	28	321	51,746	0.0
INTU PROPERTIES PLC		38	34	97	15,729	0.0
SEGRO PLC		30	26	109	17,655	0.0
小計	口数・金額	173	151	934	150,225	
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.1%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		61	123	407	32,439	0.0
SCENTRE GROUP		221	189	891	70,950	0.1
NOVION PROPERTY GROUP		88	—	—	—	—
GPT GROUP		70	65	345	27,515	0.0
MIRVAC GROUP		156	134	257	20,499	0.0
STOCKLAND		99	86	390	31,107	0.0
WESTFIELD CORP		82	70	737	58,756	0.1
DEXUS PROPERTY GROUP		39	35	305	24,314	0.0
GOODMAN GROUP		73	63	450	35,899	0.0
小計	口数・金額	890	768	3,786	301,482	
	銘柄数<比率>	9	8	—	<0.3%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		94	79	3,641	51,594	0.0
小計	口数・金額	94	79	3,641	51,594	
	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	91	146	11,675	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		87	80	110	8,815	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		103	87	178	14,290	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		88	77	176	14,083	0.0
小計	口数・金額	379	336	611	48,864	
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>	
合計	口数・金額	1,979	1,743	—	3,045,550	
	銘柄数<比率>	60	61	—	<2.7%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末 買建額	当期末 売建額
			百万円	百万円
外国	株式先物取引	SP EMINI	1,346	－
		SP/TSE60	67	－
		SWISS IX	70	－
		EURO ST	307	－
		SPI 200	74	－
		FTSE100	165	－

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

○投資信託財産の構成

（2016年５月20日現在）

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
株式	109,001,635	95.3
投資証券	3,045,550	2.7
コール・ローン等、その他	2,350,513	2.0
投資信託財産総額	114,397,698	100.0

（注）期末における外貨建純資産（114,260,390千円）の投資信託財産総額（114,397,698千円）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＝110.09円	１カナダドル＝84.13円	１ユーロ＝123.28円	１イギリスポンド＝160.73円
１スイスフラン＝111.03円	１スウェーデンクローネ＝13.18円	１ノルウェークローネ＝13.17円	１デンマーククローネ＝16.58円
１オーストラリアドル＝79.63円	１ニュージーランドドル＝74.43円	１香港ドル＝14.17円	１シンガポールドル＝79.85円
１イスラエルシェケル＝28.47円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年５月20日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	114,567,704,891
コール・ローン等	1,345,336,375
株式(評価額)	109,001,635,166
投資証券(評価額)	3,045,550,194
未収入金	294,027,013
未収配当金	254,814,873
差入委託証拠金	626,341,270
(B) 負債	364,731,025
未払金	207,525,066
未払解約金	157,205,584
未払利息	162
その他未払費用	213
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	114,202,973,866
元本	66,611,642,280
次期繰越損益金	47,591,331,586
(D) 受益権総口数	66,611,642,280口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	17,145円

＜注記事項＞

①期首元本額　79,173,628,594円
　期中追加設定元本額　11,761,805,506円
　期中一部解約元本額　24,323,791,820円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.7145円です。

○損益の状況 (2015年５月21日～2016年５月20日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	2,967,680,825
受取配当金	2,910,707,919
受取利息	△ 167,822
その他収益金	57,689,634
支払利息	△ 548,906
(B) 有価証券売買損益	△24,813,700,439
売買益	6,241,759,685
売買損	△31,055,460,124
(C) 先物取引等取引損益	△ 174,382,614
取引益	486,037,222
取引損	△ 660,419,836
(D) 保管費用等	△ 105,443,513
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	△22,125,845,741
(F) 前期繰越損益金	81,730,103,163
(G) 追加信託差損益金	10,019,772,822
(H) 解約差損益金	△22,032,698,658
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	47,591,331,586
次期繰越損益金(Ｉ)	47,591,331,586

(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）

三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	330,014,840円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	1,292,335,372円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	1,164,998,999円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	2,477,065,925円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	12,696,753,102円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	11,191,695,429円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	193,813,124円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	386,082,104円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	744,745,443円
三菱ＵＦＪ 外国株式ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	36,132,317,138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）	118,264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）	1,702,540円
合計	66,611,642,280円

［お知らせ］

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

新興国株式インデックスマザーファンド

《第７期》決算日2016年５月12日

［計算期間：2015年５月13日～2016年５月12日］

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

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＭＳＣＩ エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
3期(2012年5月14日)	14,047	△15.7	77,807.35	△17.8	96.2	2.9	0.5	14,336
4期(2013年5月13日)	19,772	40.8	107,091.73	37.6	98.2	1.7	－	24,079
5期(2014年5月12日)	19,482	△ 1.5	102,729.55	△ 4.1	96.6	3.0	0.4	24,665
6期(2015年5月12日)	23,973	23.1	124,478.28	21.2	94.8	5.0	0.4	39,530
7期(2016年5月12日)	17,338	△27.7	87,559.17	△29.7	92.8	6.4	0.5	35,618

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

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

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		MSCI エマージング・マーケット・インデックス		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	(円換算ベース)	騰落率			
(期首)	円	%		%	%	%	%
2015年5月12日	23,973	－	124,478.28	－	94.8	5.0	0.4
5月末	24,168	0.8	124,908.28	0.3	94.8	4.8	0.4
6月末	22,860	△ 4.6	117,480.49	△ 5.6	94.6	4.6	0.5
7月末	21,655	△ 9.7	110,900.32	△10.9	93.7	7.1	0.5
8月末	19,362	△19.2	99,398.26	△20.1	94.2	5.5	0.5
9月末	18,263	△23.8	93,131.31	△25.2	94.0	6.3	0.5
10月末	20,102	△16.1	102,297.72	△17.8	94.7	4.9	0.5
11月末	19,854	△17.2	101,493.66	△18.5	94.5	5.1	0.5
12月末	18,950	△21.0	96,451.09	△22.5	96.9	3.2	0.5
2016年1月末	17,182	△28.3	87,296.42	△29.9	96.1	3.5	0.5
2月末	16,532	△31.0	84,080.85	△32.5	94.5	5.3	0.5
3月末	18,566	△22.6	93,973.20	△24.5	92.3	7.1	0.5
4月末	18,355	△23.4	92,537.69	△25.7	92.4	6.9	0.5
(期末)							
2016年5月12日	17,338	△27.7	87,559.17	△29.7	92.8	6.4	0.5

(注) 騰落率は期首比。
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

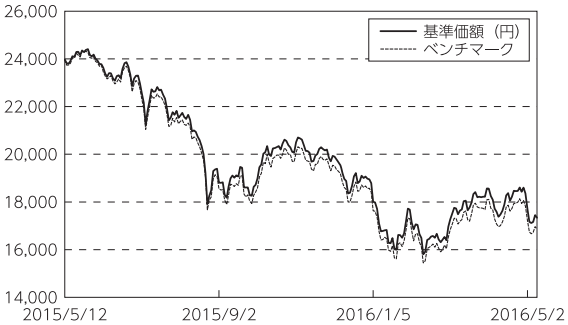
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ27.7%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(－29.7%)を2.0%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎新興国株式市況

・米国の利上げを巡る警戒感に加え、原油価格の下落や中国経済の減速懸念などから、新興国株式市況は下落しました。

◎為替市況

・為替市況は、期首に比べて9.9%の円高・香港ドル安、20.0%の円高・ブラジル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

・ＭＳＣＩ エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に採用されている新興国の株式等を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは29.7%の下落となったため、カイ離は2.0%程度となりました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	コスト要因	その他の要因	合計
ベンチマークとのカイ離	△0.0%程度	0.3%程度	△0.2%程度	1.9%程度	2.0%程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は△0.0%程度でした。

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

・効率的に運用を行うため、円貨、外貨現金などを若干保有しました。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.3%程度でした。

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

・売買に係るコストを考慮しつつ、できる限り多くの銘柄に分散投資を行いました。

・ファンドの特性をよりベンチマークに近づけるべく、マルチファクターモデルを用いて組入銘柄とその組入比率を決定しています。

◎コスト要因

売買にかかるコストおよび保管料等による影響は△0.2%程度でした。

◎その他の要因

その他配当・利子収入等による影響は1.9%程度でした。

○今後の運用方針

・引き続きファンドの資産のほぼ全額を株式（先物・ＲＥＩＴを含む）に投資し、高い株式組入比率を維持します。

・売買に係るコストを考慮しつつ、多くの銘柄に分散投資を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2015年５月13日～2016年５月12日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	8	0.040	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(6)	(0.030)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(2)	(0.009)	
(b) 有価証券取引税	4	0.018	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(4)	(0.018)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	29	0.148	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(26)	(0.134)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（その他）	(3)	(0.015)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	41	0.206	
期中の平均基準価額は、19,654円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2015年５月13日～2016年５月12日）

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 953,364 (263)	千アメリカドル 11,208 (－)	百株 7,951 (49)	千アメリカドル 579 (133)
	メキシコ	9,917 (2,151)	千メキシコペソ 34,884 (△252)	4,808	千メキシコペソ 10,634
	ブラジル	6,753 (1,749)	千ブラジルレアル 11,664 (△27)	2,919	千ブラジルレアル 2,708
	チリ	44,542 (20,838)	千チリペソ 361,946 (35,877)	941 (281)	千チリペソ 219,439 (35,877)
	コロンビア	1,096 (67)	千コロンビアペソ 623,636 (246,411)	1,149 (65)	千コロンビアペソ 839,268 (246,411)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ギリシャ	13,260 (△5,587)	832 (△1)	74 (5,712)	33 (－)
	トルコ	1,950 (232)	千トルコリラ 1,840 (－)	236	千トルコリラ 176
	チェコ	83	千チェココルナ 3,641	73	千チェココルナ 1,573
	ハンガリー	56	千ハンガリーフォリント 37,475	4	千ハンガリーフォリント 5,877
	ポーランド	1,245 (423)	千ポーランドズロチ 2,758 (－)	897	千ポーランドズロチ 182
	香港	189,490 (9,807)	千香港ドル 129,744 (△103)	75,669	千香港ドル 14,985
	マレーシア	12,259 (1,652)	千マレーシアリンギット 6,998 (－)	2,309	千マレーシアリンギット 688
	タイ	14,983 (111)	千タイバーツ 39,811 (－)	330	千タイバーツ 5,050
	フィリピン	11,150	千フィリピンペソ 42,771	460	千フィリピンペソ 867
	インドネシア	40,206	千インドネシアルピア 20,844,636	1,840	千インドネシアルピア 1,339,828

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

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

投資信託証券

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

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 15,769	百万円 14,911	百万円 －	百万円 －

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

○株式売買比率

（2015年５月13日～2016年５月12日）

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	9,679,052千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	34,146,810千円
(c) 売買高比率（a）／（b）	0.28

（注）(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2015年５月13日～2016年５月12日）

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	12,177	204	1.7	4,416	32	0.7

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

○組入資産の明細

(2016年５月12日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AMBEV SA-ADR	85	85	46	5,011	食品・飲料・タバコ
AMERICA MOVIL-SPN ADR CL L	8	8	10	1,115	電気通信サービス
VALE SA-SP ADR	20	20	9	997	素材
PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	40	40	29	3,216	エネルギー
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	28	42	97	10,603	半導体・半導体製造装置
NETEASE INC-ADR	—	34	500	54,275	ソフトウェア・サービス
CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	—	114	498	53,988	小売
INFOSYS LTD-SP ADR	18	36	67	7,279	ソフトウェア・サービス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	153	168	169	18,333	素材
BAIDU INC - SPON ADR	—	117	1,919	207,972	ソフトウェア・サービス
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	382	453	416	45,115	電気通信サービス
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	—	57	225	24,436	消費者サービス
SOUTHERN COPPER CORP	122	138	384	41,715	素材
BANCO BRADESCO-ADR	35	38	29	3,225	銀行
ITAU UNIBANCO H-SPON PRF ADR	36	39	37	4,055	銀行
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	14	14	13	1,445	エネルギー
SASOL LTD-SPONSORED ADR	11	11	32	3,557	エネルギー
CREDICORP LTD	51	59	847	91,799	銀行
YY INC-ADR	—	13	64	6,976	ソフトウェア・サービス
TAL EDUCATION GROUP- ADR	—	17	94	10,195	消費者サービス
SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR	—	100	59	6,393	ソフトウェア・サービス
AK TRANSNEFT OAO-PREF	1	1	419	45,407	エネルギー
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	980	1,011	162	17,567	各種金融
SBERBANK OF RUSSIA PJSC	500	500	93	10,112	銀行
GAZPROM PAO	360	360	86	9,404	エネルギー
RUSHYDRO PJSC	100,000	104,640	106	11,554	公益事業
MMC NORILSK NICKEL PJSC	42	48	647	70,177	素材
LUKOIL PJSC	19	19	77	8,442	エネルギー
TATNEFT PAO-CLS	1,077	1,241	605	65,657	エネルギー
ROSNEFT OAO	869	1,020	500	54,250	エネルギー
VTB BANK PJSC	3,740,000	4,678,200	491	53,268	銀行
URALKALI PJSC	995	—	—	—	素材
SBERBANK-PREFERENCE	820	—	—	—	銀行
SURGUTNEFTEGAS	5,430	5,930	304	33,013	エネルギー
SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	5,230	6,337	393	42,614	エネルギー
SEVERSTAL PAO	158	184	190	20,690	素材
ROSTELECOM PJSC	650	650	95	10,382	電気通信サービス
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	—	24	89	9,649	小売
DP WORLD LTD	123	146	262	28,439	運輸
ALROSA PAO	1,410	1,597	175	19,000	素材
JD.COM INC-ADR	—	151	349	37,849	小売
QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	—	40	281	30,529	ソフトウェア・サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	—	171	209	22,719	小売
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	—	431	3,443	373,158	ソフトウェア・サービス
58.COM INC-ADR	—	31	160	17,368	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
SAMSUNG ELECTR-GDR	0.8	0.8	44	4,802	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HON HAI PRECISION-GDR REG S	99	104	47	5,178	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
RELIANCE INDS-SPONS GDR 144A	8	8	24	2,685	エネルギー
LUKOIL PJSC-SPON ADR	370	422	1,709	185,283	エネルギー
GAZPROM PAO -SPON ADR	4,359	4,945	2,395	259,638	エネルギー
SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	120	143	102	11,142	電気通信サービス
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	69	79	766	83,045	エネルギー
GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR	620	620	97	10,548	電気通信サービス
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	197	226	763	82,742	食品・生活必需品小売り
SBERBANK PAO -SPONSORED ADR	1,871	2,126	1,674	181,495	銀行
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	731	1,044	407	44,164	銀行
MEGAFON-REG S GDR	64	82	92	10,041	電気通信サービス
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	760	—	—	—	エネルギー
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	—	420	140	15,183	不動産
小計 株数・金額	3,868,940	4,814,567	22,966	2,488,924	
小計 銘柄数<比率>	45	56	—	<7.0%>	
(メキシコ)			千メキシコペソ		
ALFA S.A.B.-A	2,167	2,474	8,003	48,260	資本財
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	427	503	3,867	23,321	資本財
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	24,980	27,316	31,659	190,905	電気通信サービス
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	1,205	1,339	5,744	34,638	家庭用品・パーソナル用品
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	3,960	4,574	19,636	118,406	食品・生活必需品小売り
CEMEX SAB-CPO	9,713	12,234	15,084	90,959	素材
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	1,938	2,133	20,549	123,912	メディア
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,200	1,449	7,983	48,143	食品・飲料・タバコ
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	1,880	2,177	21,380	128,923	銀行
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	1,473	1,603	26,234	158,195	食品・飲料・タバコ
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	106	118	3,365	20,292	素材
MEXICHEM SAB DE CV-*	670	906	3,729	22,486	素材
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	323	437	6,502	39,213	食品・飲料・タバコ
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	2,853	3,329	13,655	82,340	素材
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	1,790	2,044	6,595	39,773	銀行
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	263	268	4,774	28,788	運輸
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	303	353	4,250	25,633	食品・飲料・タバコ
GENTERA SAB DE CV	780	921	3,100	18,693	各種金融
MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	547	—	—	—	素材
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	150	165	3,212	19,369	小売
GRUPO FIN SANTANDER-B	1,385	1,613	5,350	32,262	銀行
CONTROLADORA COML MEXIC-UBC	300	—	—	—	食品・生活必需品小売り
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	142	186	5,209	31,411	運輸
OHL MEXICO SAB DE CV	620	670	1,666	10,051	運輸
GENOMMA LAB INTERNACIONAL-B	580	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	260	290	1,335	8,051	食品・生活必需品小売り
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	209	217	4,626	27,897	運輸
GRUMA S.A.B.-B	138	171	4,413	26,615	食品・飲料・タバコ
GRUPO LALA SAB DE CV	420	552	2,550	15,377	食品・飲料・タバコ
小計 株数・金額	60,783	68,043	234,481	1,413,923	
小計 銘柄数<比率>	29	26	—	<4.0%>	
(ブラジル)			千ブラジルレアル		
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	568	663	424	13,334	公益事業

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジルレアル	千円	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	170	201	262	8,227	公益事業
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	3,109	3,389	3,473	109,040	エネルギー
OI SA-PREFERENCE	209	—	—	—	電気通信サービス
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	252	292	787	24,711	公益事業
GERDAU SA-PREF	589	729	534	16,773	素材
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	71	91	250	7,855	公益事業
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	258	343	1,471	46,182	電気通信サービス
VALE SA-PREF	1,448	1,708	2,223	69,805	素材
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	2,050	2,609	8,431	264,660	銀行
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	101	101	325	10,208	エネルギー
BRF SA	495	573	2,706	84,950	食品・飲料・タバコ
JBS SA	580	615	535	16,814	食品・飲料・タバコ
NATURA COSMETICOS SA	135	147	351	11,028	家庭用品・パーソナル用品
VALE SA	947	1,082	1,724	54,138	素材
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	255	—	—	—	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	276	316	2,300	72,212	エネルギー
TRACTEBEL ENERGIA SA	134	144	526	16,530	公益事業
PORTO SEGURO SA	82	104	275	8,634	保険
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	2,241	2,547	3,288	103,215	エネルギー
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	106	139	653	20,507	食品・生活必需品小売り
LOJAS RENNER S.A.	93	563	1,199	37,642	小売
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	382	494	708	22,248	小売
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	2,695	3,409	2,642	82,933	銀行
METALURGICA GERDAU SA-PREF	270	—	—	—	素材
AES TIETE SA-PREF	67	—	—	—	公益事業
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	180	202	252	7,938	公益事業
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA-RTS	—	55	6	189	公益事業
EMBRAER SA	512	586	1,123	35,280	資本財
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	185	—	—	—	公益事業
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	225	—	—	—	耐久消費財・アパレル
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	489	549	546	17,146	素材
SOUZA CRUZ SA	287	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CPFL ENERGIA SA	177	171	338	10,616	公益事業
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	150	170	239	7,524	公益事業
CCR SA	683	778	1,288	40,441	運輸
BM&FBOVESPA SA	1,380	1,511	2,656	83,382	各種金融
B2W CIA DIGITAL	85	112	121	3,803	小売
BRASKEM SA-PREF A	120	128	263	8,276	素材
BRADESPAR SA -PREF	160	—	—	—	素材
BANCO BRADESCO SA-PREF	1,902	2,461	6,618	207,742	銀行
BANCO DO BRASIL S.A.	659	756	1,548	48,600	銀行
CIELO SA	644	890	3,082	96,764	ソフトウェア・サービス
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	310	369	701	22,007	銀行
DURATEX SA	258	258	198	6,233	素材
SUZANO PAPEL E CELULO-PREF A	230	310	454	14,255	素材
FIBRIA CELULOSE SA	185	222	691	21,693	素材
HYPERMARCAS SA	255	309	972	30,524	家庭用品・パーソナル用品
BANCO BRADESCO S.A.	547	657	1,874	58,839	銀行
WEG SA	418	488	757	23,766	資本財
BR MALLS PARTICIPACOES SA	340	508	653	20,518	不動産

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジルレアル	千円	
BANCO ESTADO RIO GRAN-PREF B	150	—	—	—	銀行
LOCALIZA RENT A CAR	113	133	480	15,079	運輸
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	58	67	395	12,418	不動産
SUL AMERICA SA - UNITS	134	150	236	7,414	保険
TIM PARTICIPACOES SA	663	749	547	17,180	電気通信サービス
RAIA DROGASIL SA	155	190	1,056	33,160	食品・生活必需品小売り
M DIAS BRANCO SA	24	30	269	8,467	食品・飲料・タバコ
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	158	199	841	26,423	各種金融
ODONTOPREV S.A.	180	220	246	7,734	ヘルスケア機器・サービス
TOTVS SA	90	109	317	9,963	ソフトウェア・サービス
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	—	160	716	22,505	公益事業
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	75	91	178	5,604	公益事業
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	152	—	—	—	運輸
ESTACIO PARTICIPACOES SA	215	240	283	8,912	消費者サービス
LOJAS AMERICANAS SA	125	150	152	4,783	小売
QUALICORP SA	149	184	276	8,663	ヘルスケア機器・サービス
KROTON EDUCACIONAL SA	1,026	1,215	1,459	45,801	消費者サービス
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	521	614	1,730	54,312	保険
AMBEV SA	3,471	4,026	7,593	238,345	食品・飲料・タバコ
VIA VAREJO SA	87	—	—	—	小売
KLABIN SA - UNIT	360	477	831	26,112	素材
RUMO LOGISTICA OPERADORA MUL	—	700	308	9,668	運輸
小計 株数・金額	35,878	41,461	77,405	2,429,756	
小計 銘柄数<比率>	70	62	—	<6.8%>	
(チリ)			千チリペソ		
BANCO DE CREDITO E INVERSION	25	32	91,263	14,538	銀行
CENCOSUD SA	1,000	1,121	202,143	32,201	食品・生活必需品小売り
EMPRESAS CMPC SA	915	1,074	156,401	24,914	素材
COLBUN SA	6,000	7,017	123,722	19,708	公益事業
EMPRESAS COPEC SA	343	400	254,672	40,569	エネルギー
ITAU CORPBANCA	95,000	125,500	70,945	11,301	銀行
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	98	98	57,665	9,186	電気通信サービス
S.A.C.I. FALABELLA	720	426	212,684	33,880	小売
AES GENER SA	1,850	2,201	72,628	11,569	公益事業
AGUAS ANDINAS SA-A	1,800	2,210	86,331	13,752	公益事業
LATAM AIRLINES GROUP SA	240	255	115,634	18,420	運輸
VINA CONCHA Y TORO SA	360	—	—	—	食品・飲料・タバコ
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	2,540	2,881	184,120	29,330	公益事業
BANCO SANTANDER CHILE	51,300	58,371	185,330	29,523	銀行
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	69	85	122,889	19,576	素材
ENERSIS AMERICAS SA	15,010	17,259	196,272	31,266	公益事業
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	118	132	96,866	15,430	食品・飲料・タバコ
BANCO DE CHILE	18,341	20,658	146,817	23,388	銀行
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	200	220	50,815	8,094	食品・飲料・タバコ
SONDA SA	400	400	50,728	8,080	ソフトウェア・サービス
ENDESA AMERICAS SA	—	2,881	88,436	14,087	公益事業
ENERSIS CHILE SA	—	17,259	140,853	22,437	公益事業
小計 株数・金額	196,329	260,486	2,707,221	431,260	
小計 銘柄数<比率>	20	21	—	<1.2%>	

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA POWER INTERNATIONAL	—	2,890	965	13,484	公益事業
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,100	2,400	1,922	26,855	自動車・自動車部品
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	2,180	2,540	802	11,212	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	2,535	2,980	3,570	49,873	エネルギー
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	1,200	1,360	711	9,936	素材
JIANGXI COPPER CO LTD-H	970	1,170	1,031	14,416	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1,280	1,720	760	10,620	ヘルスケア機器・サービス
BANK OF CHINA LTD-H	60,040	69,220	20,904	292,035	銀行
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	1,900	2,190	1,802	25,179	商業・専門サービス
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	1,090	1,200	1,221	17,065	不動産
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	570	645	3,621	50,594	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS BANK-H	3,475	4,020	6,786	94,808	銀行
IND & COMM BK OF CHINA-H	55,803	64,313	25,403	354,891	銀行
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	580	660	2,560	35,774	公益事業
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	1,880	2,080	738	10,315	電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	3,370	3,870	3,467	48,441	資本財
CHINA COAL ENERGY CO-H	2,920	2,440	773	10,805	エネルギー
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	3,080	3,440	7,619	106,445	不動産
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	1,340	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	6,240	7,150	3,274	45,747	銀行
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	730	860	1,659	23,187	耐久消費財・アパレル
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	3,040	3,520	2,041	28,521	資本財
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	7,900	10,080	897	12,532	小売
HENGAN INTL GROUP CO LTD	560	640	4,326	60,439	家庭用品・パーソナル用品
CHINA RESOURCES LAND LTD	1,720	2,420	4,331	60,515	不動産
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1,480	1,740	1,623	22,679	資本財
GUANGDONG INVESTMENT LTD	1,920	2,480	2,698	37,694	公益事業
FOSUN INTERNATIONAL LTD	1,310	1,840	1,854	25,910	資本財
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	2,520	2,880	936	13,075	不動産
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	2,220	2,480	875	12,229	素材
SHUI ON LAND LTD	3,176	3,276	638	8,924	不動産
WEICHAI POWER CO LTD-H	342	824	730	10,210	資本財
CHINA COSCO HOLDINGS-H	2,040	2,270	626	8,752	運輸
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	3,550	4,080	1,725	24,109	耐久消費財・アパレル
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	4,430	5,120	2,821	39,411	食品・飲料・タバコ
KUNLUN ENERGY CO LTD	2,360	2,860	1,730	24,172	エネルギー
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	4,372	5,032	1,539	21,512	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	640	780	1,731	24,190	公益事業
SOHO CHINA LTD	1,380	1,720	639	8,938	不動産
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	3,220	3,860	1,837	25,667	公益事業
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	4,100	4,700	1,748	24,425	自動車・自動車部品
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	2,180	2,830	1,491	20,834	公益事業
CHINA MINSHENG BANKING-H	4,756	5,151	3,677	51,379	銀行
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2,002	2,300	5,911	82,576	保険
CRRC CORP LTD - H	1,500	3,845	2,799	39,109	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	380	455	1,947	27,205	資本財
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	15,960	20,150	5,400	75,440	銀行
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	4,500	3,640	1,994	27,866	不動産
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	1,626	1,906	1,635	22,854	自動車・自動車部品
SINOPHARM GROUP CO-H	916	1,044	3,523	49,223	ヘルスケア機器・サービス

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

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	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシアリンギット	千円	
GENTING MALAYSIA BHD	2,189	2,609	1,124	30,327	消費者サービス
GENTING BHD	1,526	1,967	1,664	44,880	消費者サービス
TELEKOM MALAYSIA BHD	820	969	639	17,248	電気通信サービス
TENAGA NASIONAL BHD	2,558	2,959	4,142	111,725	公益事業
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	363	367	847	22,844	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	3,470	4,257	3,767	101,607	銀行
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	449	552	170	4,593	消費者サービス
IOI CORP BHD	2,224	2,569	1,076	29,030	食品・飲料・タバコ
AMMB HOLDINGS BHD	1,530	1,720	779	21,013	銀行
YTL CORP BHD	3,374	3,872	631	17,024	公益事業
GAMUDA BHD	1,390	1,460	693	18,703	資本財
MISC BHD	820	985	751	20,269	運輸
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	3,600	3,600	1,684	45,439	銀行
PETRONAS GAS BHD	509	610	1,299	35,042	公益事業
SIME DARBY BERHAD	2,260	2,714	2,068	55,775	資本財
PUBLIC BANK BERHAD	2,062	2,114	4,008	108,099	銀行
UMW HOLDINGS BHD	440	490	301	8,140	自動車・自動車部品
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	99	111	534	14,405	食品・飲料・タバコ
RHB CAPITAL BHD	360	544	326	8,803	銀行
PPB GROUP BERHAD	368	406	632	17,059	食品・飲料・タバコ
IJM CORP BHD	1,233	2,688	932	25,155	資本財
DIGI.COM BHD	2,700	3,068	1,343	36,241	電気通信サービス
MAXIS BHD	1,460	1,647	920	24,830	電気通信サービス
AXIATA GROUP BERHAD	1,940	2,331	1,272	34,325	電気通信サービス
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	910	1,620	238	6,422	公益事業
HONG LEONG BANK BERHAD	410	580	777	20,961	銀行
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,120	2,459	1,576	42,510	素材
LAFARGE MALAYSIA BHD	335	335	278	7,508	素材
PETRONAS DAGANGAN BHD	183	214	485	13,101	エネルギー
AIRASIA BHD	1,000	1,000	216	5,825	運輸
BUMI ARMADA BERHAD	1,455	2,055	157	4,239	エネルギー
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	740	920	374	10,098	銀行
SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	2,860	2,957	467	12,600	エネルギー
UEM SUNRISE BHD	1,180	—	—	—	不動産
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	670	738	467	12,619	運輸
FELDA GLOBAL VENTURES	820	1,020	144	3,906	食品・飲料・タバコ
IHH HEALTHCARE BHD	1,810	2,160	1,404	37,865	ヘルスケア機器・サービス
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	185	208	310	8,380	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	—	497	381	10,294	資本財
GENTING PLANTATIONS BHD	150	195	207	5,585	食品・飲料・タバコ
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	1,170	1,377	371	10,027	メディア
WESTPORTS HOLDINGS BHD	—	932	391	10,557	運輸
DIALOG GROUP BHD	2,766	3,482	546	14,747	資本財
IOI PROPERTIES GROUP BHD	1,178	1,328	316	8,524	不動産
HARTALEGA HOLDINGS BHD	—	601	234	6,321	ヘルスケア機器・サービス
小計 株数・金額	57,687	69,289	40,959	1,104,686	
小計 銘柄数<比率>	42	44	—	<3.1%>	
(タイ)			千タイバーツ		
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	970	1,196	6,458	19,827	不動産
KASIKORNBANK PCL-NVDR	1,382	1,537	24,284	74,553	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	
(タイ)	百株	百株	千タイバーツ	千円	
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	10,200	11,100	2,419	7,428	銀行
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	750	830	2,033	6,242	メディア
CP ALL PCL-NVDR	3,302	3,858	18,229	55,963	食品・生活必需品小売り
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	426	222	3,474	10,666	銀行
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	787	915	13,587	41,714	電気通信サービス
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,165	1,364	17,186	52,762	銀行
SIAM CEMENT PCL-NVDR	313	358	17,423	53,488	素材
PTT PCL-NVDR	761	875	25,550	78,438	エネルギー
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	1,075	1,226	8,857	27,193	エネルギー
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	313	377	14,627	44,906	運輸
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	720	860	1,161	3,564	エネルギー
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,940	2,640	6,864	21,072	食品・飲料・タバコ
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	900	1,200	3,600	11,052	素材
IRPC PCL - NVDR	8,300	8,980	4,310	13,232	エネルギー
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,285	1,771	10,231	31,409	素材
THAI OIL PCL-NVDR	650	692	4,446	13,649	エネルギー
KRUNG THAI BANK - NVDR	2,610	2,940	4,821	14,802	銀行
GLOW ENERGY PCL - NVDR	360	435	3,708	11,384	公益事業
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	2,500	3,406	8,140	24,990	ヘルスケア機器・サービス
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	1,460	1,652	3,568	10,954	食品・飲料・タバコ
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	2,980	3,320	2,755	8,459	小売
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	4,250	4,920	4,403	13,518	運輸
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	290	316	6,272	19,256	ヘルスケア機器・サービス
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	320	430	2,816	8,646	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRUE CORP PCL-NVDR	6,400	7,562	5,558	17,064	電気通信サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,370	1,521	5,855	17,977	消費者サービス
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	970	970	2,075	6,372	エネルギー
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	—	6,040	3,865	11,867	運輸
小計 株数・金額	58,749	73,514	238,587	732,463	
小計 銘柄数<比率>	29	30	—	<2.1%>	
(フィリピン)			千フィリピンペソ		
PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	74	85	14,910	34,741	電気通信サービス
SM PRIME HOLDINGS INC	6,405	7,265	18,344	42,741	不動産
AYALA LAND INC	5,430	6,453	22,746	53,000	不動産
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	620	660	6,250	14,562	銀行
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	400	450	2,859	6,663	運輸
MEGAWORLD CORP	8,300	9,990	4,045	9,427	不動産
JOLLIBEE FOODS CORP	337	379	8,870	20,667	消費者サービス
ENERGY DEVELOPMENT CORP	6,900	8,000	4,784	11,146	公益事業
SM INVESTMENTS CORP	117	137	13,264	30,906	資本財
AYALA CORPORATION	160	189	14,984	34,914	各種金融
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	1,470	1,677	11,739	27,353	資本財
ABOITIZ POWER CORP	1,100	1,321	5,997	13,973	公益事業
METROPOLITAN BANK & TRUST	195	265	2,199	5,124	銀行
BDO UNIBANK INC	1,250	1,436	14,799	34,481	銀行
DMCI HOLDINGS INC	2,850	3,536	4,476	10,430	資本財
UNIVERSAL ROBINA CORP	680	763	16,100	37,515	食品・飲料・タバコ
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	1,320	1,820	2,631	6,131	資本財
JG SUMMIT HOLDINGS INC	1,850	2,197	19,338	45,059	資本財
GLOBE TELECOM INC	26	28	6,423	14,966	電気通信サービス

銘柄	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	
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピンペソ	千円	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	9,200	11,200	6,664	15,527	各種金融
ROBINSONS LAND CO	—	1,450	4,234	9,865	不動産
GT CAPITAL HOLDINGS INC	—	69	9,820	22,880	各種金融
小計 株数・金額	48,684	59,374	215,485	502,082	
小計 銘柄数<比率>	20	22	—	<1.4%>	
(インドネシア)			千インドネシアルピア		
KALBE FARMA TBK PT	15,400	18,261	2,392,191	19,615	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	37,500	44,027	16,378,044	134,299	電気通信サービス
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	3,350	3,782	2,713,585	22,251	食品・飲料・タバコ
HM SAMPOERNA TBK PT	—	328	3,230,800	26,492	食品・飲料・タバコ
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	9,360	10,750	14,136,250	115,917	銀行
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	1,060	1,272	2,362,740	19,374	素材
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	15,330	17,669	11,749,885	96,349	自動車・自動車部品
GUDANG GARAM TBK PT	385	415	2,942,350	24,127	食品・飲料・タバコ
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	8,400	9,698	9,698,000	79,523	銀行
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	340	340	527,000	4,321	食品・飲料・タバコ
BANK DANAMON INDONESIA TBK	2,810	2,810	834,570	6,843	銀行
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	2,310	2,554	2,464,610	20,209	素材
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	8,085	9,575	2,288,425	18,765	公益事業
UNITED TRACTORS TBK PT	1,310	1,433	2,016,947	16,538	資本財
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	565	—	—	—	エネルギー
LIPPO KARAWACI TBK PT	15,500	17,464	1,641,616	13,461	不動産
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	7,090	8,177	7,870,362	64,536	銀行
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,120	1,342	5,945,060	48,749	家庭用品・パーソナル用品
ADARO ENERGY TBK PT	10,400	12,400	849,400	6,965	エネルギー
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	1,400	1,700	913,750	7,492	運輸
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	5,650	6,606	3,091,608	25,351	銀行
INDO TAMBANGRAYA MEGAH TBK P	220	—	—	—	エネルギー
AKR CORPORINDO TBK PT	—	1,543	987,520	8,097	資本財
CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	5,500	6,403	2,177,020	17,851	食品・飲料・タバコ
XL AXIATA TBK PT	2,250	2,450	810,950	6,649	電気通信サービス
SUMMARECON AGUNG TBK PT	—	8,500	1,219,750	10,001	不動産
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	3,850	4,402	928,822	7,616	メディア
BUMI SERPONG DAMAI PT	6,200	7,017	1,234,992	10,126	不動産
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	910	990	1,534,500	12,582	食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,350	1,756	1,066,770	8,747	電気通信サービス
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	4,650	5,000	1,545,000	12,669	メディア
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	4,400	5,800	646,700	5,302	メディア
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	1,460	2,057	3,805,450	31,204	小売
小計 株数・金額	178,155	216,521	110,004,668	902,038	
小計 銘柄数<比率>	30	31	—	<2.5%>	
(韓国)			千韓国ウォン		
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	83	96	12,524,648	1,167,297	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KOREA ELECTRIC POWER CORP	195	224	1,373,328	127,994	公益事業
SHINSEGAE CO LTD	4	6	129,168	12,038	小売
CJ CORP	11	12	312,095	29,087	資本財
SAMSUNG C&T CORP	95	—	—	—	資本財
SK TELECOM	7	17	375,700	35,015	電気通信サービス
HYUNDAI MOTOR CO	117	140	1,946,000	181,367	自動車・自動車部品
POSCO	49	60	1,278,900	119,193	素材

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	44	52	265,104	24,707	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KT CORP	22	22	71,325	6,647	電気通信サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	45	49	184,001	17,148	各種金融
HYUNDAI MOBIS CO LTD	51	59	1,561,520	145,533	自動車・自動車部品
CHEIL WORLDWIDE INC	66	72	118,933	11,084	メディア
KB FINANCIAL GROUP INC	290	337	1,137,038	105,971	銀行
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	24	31	915,975	85,368	保険
SAMSUNG SDI CO LTD	42	48	538,433	50,182	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	320	372	1,477,237	137,678	銀行
LG ELECTRONICS INC	82	93	516,175	48,107	耐久消費財・アパレル
AMOREPACIFIC GROUP	21	24	416,585	38,825	家庭用品・パーソナル用品
HYUNDAI DEPT STORE CO	10	13	189,040	17,618	小売
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	19	24	197,600	18,416	資本財
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	41	41	127,305	11,864	資本財
KT&G CORP	81	96	1,214,400	113,182	食品・飲料・タバコ
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	82	—	—	—	資本財
NCSOFT CORP	11	15	368,900	34,381	ソフトウェア・サービス
LG DISPLAY CO LTD	179	203	499,310	46,535	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	31	36	371,347	34,609	資本財
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	118	130	121,309	11,306	資本財
AMOREPACIFIC CORP	24	28	1,181,605	110,125	家庭用品・パーソナル用品
HANA FINANCIAL GROUP	218	258	650,882	60,662	銀行
HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	42	50	229,250	21,366	資本財
LG CHEM LTD	34	40	1,172,160	109,245	素材
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	47	41	97,990	9,132	資本財
LS CORP	12	—	—	—	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	7	8	839,876	78,276	家庭用品・パーソナル用品
SK INNOVATION CO LTD	45	56	884,520	82,437	エネルギー
KAKAO CORP	19	25	272,706	25,416	ソフトウェア・サービス
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	31	35	147,525	13,749	各種金融
HANMI SCIENCE CO LTD	—	9	139,018	12,956	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COWAY CO LTD	39	47	473,526	44,132	耐久消費財・アパレル
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	16	66	153,558	14,311	各種金融
S-1 CORPORATION	13	16	165,000	15,378	商業・専門サービス
DOOSAN INFRACORE CO LTD	107	—	—	—	資本財
KIA MOTORS CORP	198	230	1,086,807	101,290	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	441	508	1,332,532	124,191	半導体・半導体製造装置
LG CORP	73	83	544,128	50,712	資本財
SK HOLDINGS CO LTD	19	—	—	—	資本財
HYUNDAI STEEL CO	52	70	389,215	36,274	素材
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	15	16	1,787,974	166,639	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OCI CO LTD	13	14	160,225	14,932	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	213	245	284,432	26,509	銀行
KANGWON LAND INC	92	103	441,945	41,189	消費者サービス
NAVER CORP	21	24	1,693,692	157,852	ソフトウェア・サービス
DAEWOO SECURITIES CO LTD	132	160	123,954	11,552	各種金融
CELLTRION INC	50	60	604,400	56,330	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KOREA GAS CORPORATION	22	22	94,162	8,775	公益事業
LG UPLUS CORP	162	188	213,720	19,918	電気通信サービス
LOTTE SHOPPING CO	8	9	226,775	21,135	小売

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

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

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

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

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

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

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

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国投資信託証券

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

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 比率および合計欄の<　>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末 買建額	当期末 売建額
			百万円	百万円
外国	株式先物取引	MINI MS	2,270	－

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

○投資信託財産の構成

(2016年５月12日現在)

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
株式	33,061,297	91.9
投資証券	176,441	0.5
コール・ローン等、その他	2,755,866	7.6
投資信託財産総額	35,993,604	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（35,622,785千円）の投資信託財産総額（35,993,604千円）に対する比率は99.0%です。
(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

１アメリカドル＝108.37円	１メキシコペソ＝6.03円	１ブラジルレアル＝31.39円	100チリペソ＝15.93円
100コロンビアペソ＝3.69円	１ユーロ＝123.81円	１トルコリラ＝36.71円	１チェココルナ＝4.58円
100ハンガリーフォリント＝39.20円	１ポーランドズロチ＝27.97円	１香港ドル＝13.97円	１マレーシアリンギット＝26.97円
１タイバーツ＝3.07円	１フィリピンペソ＝2.33円	100インドネシアルピア＝0.82円	100韓国ウォン＝9.32円
１ニュー台湾ドル＝3.33円	１インドルピー＝1.64円	１アラブディルハム＝29.56円	１カタールリアル＝29.82円
１南アフリカランド＝7.21円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年５月12日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	36,134,249,556
コール・ローン等	2,383,004,222
株式(評価額)	33,061,297,581
投資証券(評価額)	176,441,443
未収入金	141,356,100
未収配当金	35,472,832
差入委託証拠金	336,677,378
(B) 負債	515,877,040
未払金	217,194,246
未払解約金	298,681,966
未払利息	596
その他未払費用	232
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	35,618,372,516
元本	20,543,703,750
次期繰越損益金	15,074,668,766
(D) 受益権総口数	20,543,703,750口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	17,338円

＜注記事項＞

①期首元本額　16,489,570,857円
　期中追加設定元本額　6,808,008,459円
　期中一部解約元本額　2,753,875,566円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.7338円です。

○損益の状況 (2015年５月13日～2016年５月12日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	805,647,797
受取配当金	800,525,443
受取利息	3,692,444
その他収益金	1,445,674
支払利息	△　15,764
(B) 有価証券売買損益	△12,282,545,935
売買益	1,180,186,296
売買損	△13,462,732,231
(C) 先物取引等取引損益	△　337,204,622
取引益	251,013,746
取引損	△　588,218,368
(D) 保管費用等	△　53,491,815
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	△11,867,594,575
(F) 前期繰越損益金	23,041,286,420
(G) 追加信託差損益金	6,652,921,879
(H) 解約差損益金	△ 2,751,944,958
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	15,074,668,766
次期繰越損益金(Ｉ)	15,074,668,766

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

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

ｅＭＡＸＩＳ 新興国株式インデックス	13,151,327,640円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,293,667,761円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	411,453,452円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	143,369,205円
コアバランス	60,986円
三菱ＵＦＪ ＤＣ新興国株式インデックスファンド	3,766,556,674円
新興国株式インデックスオープン	244,268,844円
ｅＭＡＸＩＳ 全世界株式インデックス	329,035,038円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	44,350,527円
三菱ＵＦＪ グローバル型バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,934,320円
ＭＵＡＭ 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	935,495,891円
新興国株式インデックスファンド（ラップ向け）	105,113,054円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	10,273,325円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	80,745,997円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	1,469,087円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	873,232円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	3,162,523円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	2,546,194円
合計	20,543,703,750円

［お知らせ］

①2015年７月１日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
（2015年７月１日）

②信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため（分散型に分類）、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行うための、所要の約款変更を行いました。
（2016年３月２日）

三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド

《第16期》決算日2016年５月20日

［計算期間：2015年５月21日～2016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16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16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
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
16期(2016年５月20日)	14,075	6.7	386.993	6.7	99.3	0.3	219,902

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年　月　日	基準価額		ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
（期　首） 2015年５月20日	13,192	－	362.715	－	99.3	－
５月末	13,193	0.0	362.770	0.0	100.3	0.3
６月末	13,186	△0.0	362.542	△0.0	98.6	0.1
７月末	13,224	0.2	363.584	0.2	99.9	－
８月末	13,246	0.4	364.201	0.4	97.7	－
９月末	13,284	0.7	365.235	0.7	97.7	－
10月末	13,335	1.1	366.655	1.1	101.2	0.2
11月末	13,333	1.1	366.578	1.1	99.9	0.2
12月末	13,415	1.7	368.877	1.7	99.0	－
2016年１月末	13,582	3.0	373.520	3.0	97.3	－
２月末	13,814	4.7	379.830	4.7	97.9	－
３月末	13,924	5.5	382.913	5.6	100.5	0.3
４月末	14,047	6.5	386.253	6.5	99.7	0.3
（期　末） 2016年５月20日	14,075	6.7	386.993	6.7	99.3	0.3

（注）騰落率は期首比。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

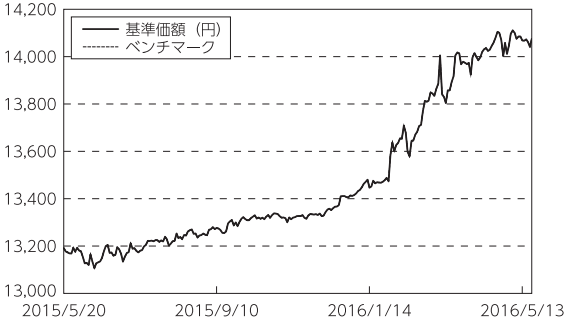
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.7%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（6.7%）とほぼ同程度となりました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内債券市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

・資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。

・ベンチマークであるＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数の構成銘柄を種別や年限などの属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました※。

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは6.7%の上昇となったため、カイ離は△0.0%程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

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

（注）四捨五入などにより各要因を合算した値と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

・ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を公社債（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持します。

・組入銘柄の見直しと投資比率の調整を適宜行い、種別構成比についてもベンチマークの比率に近づけるように運用します。

○１万口当たりの費用明細

（2015年５月21日～2016年５月20日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	0	0.000	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
(b) その他費用	0	0.000	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（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	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,465円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2015年５月21日～2016年５月20日）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	52,279,840	89,673,403
	地方債証券	1,115,939	4,238,690
	特殊債券	1,415,305	6,020,189 (　419,559)
	社債券	1,506,951	4,451,059 (　400,000)

（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 新規買付額	買建 決済額	売建 新規売付額	売建 決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	債券先物取引	4,904	4,297	602	602

○利害関係人との取引状況等

（2015年５月21日～2016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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	56,318	18,303	32.5	104,383	35,239	33.8

（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
	百万円	百万円	百万円
公社債	－	305	331

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
	百万円
公社債	600

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

○組入資産の明細

（2016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	156,554,000	178,095,596	81.0	－	50.9	20.6	9.5
	(100,000)	(100,649)	(0.0)	(－)	(－)	(0.0)	(－)
地方債証券	11,299,900	12,409,380	5.6	－	3.5	1.9	0.2
	(11,299,900)	(12,409,380)	(5.6)	(－)	(3.5)	(1.9)	(0.2)
特殊債券（除く金融債）	14,004,337	15,462,010	7.0	－	5.5	1.4	0.2
	(14,004,337)	(15,462,010)	(7.0)	(－)	(5.5)	(1.4)	(0.2)
金融債券	2,030,000	2,041,508	0.9	－	－	0.6	0.4
	(2,030,000)	(2,041,508)	(0.9)	(－)	(－)	(0.6)	(0.4)
普通社債券	9,821,000	10,380,161	4.7	－	1.6	1.8	1.2
	(9,821,000)	(10,380,161)	(4.7)	(－)	(1.6)	(1.8)	(1.2)
合計	193,709,237	218,388,657	99.3	－	61.6	26.3	11.5
	(37,255,237)	(40,393,709)	(18.4)	(－)	(10.6)	(5.7)	(2.0)

（注）（　）内は非上場債で内書き。
（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。
（注）現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

（Ｂ）国内（邦貨建）公社債　銘柄別開示

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第355回利付国債（２年）	0.1	530,000	532,379	2017/８/15
第356回利付国債（２年）	0.1	950,000	954,626	2017/９/15
第357回利付国債（２年）	0.1	850,000	854,454	2017/10/15
第358回利付国債（２年）	0.1	1,320,000	1,327,352	2017/11/15
第360回利付国債（２年）	0.1	1,100,000	1,106,446	2018/１/15
第362回利付国債（２年）	0.1	1,200,000	1,207,620	2018/３/15
第105回利付国債（５年）	0.2	1,010,000	1,014,999	2017/６/20
第106回利付国債（５年）	0.2	3,350,000	3,370,502	2017/９/20
第107回利付国債（５年）	0.2	1,270,000	1,279,232	2017/12/20
第108回利付国債（５年）	0.1	900,000	905,121	2017/12/20
第109回利付国債（５年）	0.1	660,000	664,283	2018/３/20
第110回利付国債（５年）	0.3	800,000	808,120	2018/３/20
第111回利付国債（５年）	0.4	990,000	1,001,860	2018/３/20
第112回利付国債（５年）	0.4	560,000	567,588	2018/６/20
第114回利付国債（５年）	0.3	720,000	729,259	2018/９/20
第115回利付国債（５年）	0.2	1,190,000	1,202,518	2018/９/20
第116回利付国債（５年）	0.2	2,080,000	2,103,982	2018/12/20
第117回利付国債（５年）	0.2	2,880,000	2,916,403	2019/３/20
第118回利付国債（５年）	0.2	1,200,000	1,216,344	2019/６/20
第119回利付国債（５年）	0.1	780,000	788,205	2019/６/20
第120回利付国債（５年）	0.2	1,060,000	1,075,454	2019/９/20
第121回利付国債（５年）	0.1	530,000	535,946	2019/９/20
第122回利付国債（５年）	0.1	2,030,000	2,054,502	2019/12/20
第123回利付国債（５年）	0.1	1,760,000	1,782,387	2020/３/20
第124回利付国債（５年）	0.1	2,040,000	2,067,682	2020/６/20
第125回利付国債（５年）	0.1	2,470,000	2,505,049	2020/９/20
第126回利付国債（５年）	0.1	1,160,000	1,177,423	2020/12/20
第127回利付国債（５年）	0.1	1,310,000	1,330,750	2021/３/20
第１回利付国債（40年）	2.4	210,000	340,080	2048/３/20
第２回利付国債（40年）	2.2	245,000	385,240	2049/３/20
第３回利付国債（40年）	2.2	305,000	483,684	2050/３/20
第４回利付国債（40年）	2.2	420,000	671,592	2051/３/20
第５回利付国債（40年）	2.0	440,000	679,747	2052/３/20
第６回利付国債（40年）	1.9	410,000	623,388	2053/３/20
第７回利付国債（40年）	1.7	410,000	598,870	2054/３/20
第８回利付国債（40年）	1.4	450,000	612,535	2055/３/20
第286回利付国債（10年）	1.8	130,000	132,883	2017/６/20
第287回利付国債（10年）	1.9	870,000	890,236	2017/６/20
第288回利付国債（10年）	1.7	740,000	759,299	2017/９/20
第289回利付国債（10年）	1.5	1,610,000	1,654,677	2017/12/20
第290回利付国債（10年）	1.4	190,000	195,719	2018/３/20
第291回利付国債（10年）	1.3	230,000	236,502	2018/３/20
第292回利付国債（10年）	1.7	480,000	497,083	2018/３/20
第293回利付国債（10年）	1.8	895,000	933,144	2018/６/20
第294回利付国債（10年）	1.7	270,000	280,945	2018/６/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第295回利付国債（10年）	1.5	730,000	756,550	2018/6/20
第296回利付国債（10年）	1.5	1,620,000	1,685,934	2018/9/20
第297回利付国債（10年）	1.4	760,000	792,087	2018/12/20
第298回利付国債（10年）	1.3	950,000	987,648	2018/12/20
第299回利付国債（10年）	1.3	810,000	845,194	2019/3/20
第300回利付国債（10年）	1.5	100,000	104,913	2019/3/20
第301回利付国債（10年）	1.5	620,000	653,306	2019/6/20
第302回利付国債（10年）	1.4	680,000	714,421	2019/6/20
第303回利付国債（10年）	1.4	1,470,000	1,550,306	2019/9/20
第304回利付国債（10年）	1.3	520,000	546,665	2019/9/20
第305回利付国債（10年）	1.3	830,000	875,616	2019/12/20
第306回利付国債（10年）	1.4	1,120,000	1,190,616	2020/3/20
第307回利付国債（10年）	1.3	455,000	481,931	2020/3/20
第308回利付国債（10年）	1.3	810,000	860,787	2020/6/20
第309回利付国債（10年）	1.1	1,270,000	1,339,176	2020/6/20
第310回利付国債（10年）	1.0	1,200,000	1,263,936	2020/9/20
第311回利付国債（10年）	0.8	590,000	616,278	2020/9/20
第312回利付国債（10年）	1.2	1,890,000	2,014,040	2020/12/20
第313回利付国債（10年）	1.3	90,000	96,666	2021/3/20
第314回利付国債（10年）	1.1	580,000	617,311	2021/3/20
第315回利付国債（10年）	1.2	1,080,000	1,158,980	2021/6/20
第316回利付国債（10年）	1.1	500,000	534,000	2021/6/20
第317回利付国債（10年）	1.1	580,000	621,423	2021/9/20
第318回利付国債（10年）	1.0	700,000	746,221	2021/9/20
第319回利付国債（10年）	1.1	790,000	849,099	2021/12/20
第320回利付国債（10年）	1.0	150,000	160,374	2021/12/20
第321回利付国債（10年）	1.0	720,000	772,027	2022/3/20
第322回利付国債（10年）	0.9	170,000	181,281	2022/3/20
第323回利付国債（10年）	0.9	320,000	342,166	2022/6/20
第324回利付国債（10年）	0.8	980,000	1,041,857	2022/6/20
第325回利付国債（10年）	0.8	990,000	1,054,775	2022/9/20
第326回利付国債（10年）	0.7	220,000	233,503	2022/12/20
第327回利付国債（10年）	0.8	500,000	534,025	2022/12/20
第328回利付国債（10年）	0.6	1,290,000	1,363,259	2023/3/20
第329回利付国債（10年）	0.8	870,000	933,423	2023/6/20
第330回利付国債（10年）	0.8	1,110,000	1,192,961	2023/9/20
第331回利付国債（10年）	0.6	620,000	657,119	2023/9/20
第332回利付国債（10年）	0.6	1,810,000	1,921,369	2023/12/20
第333回利付国債（10年）	0.6	1,300,000	1,381,536	2024/3/20
第334回利付国債（10年）	0.6	1,680,000	1,787,352	2024/6/20
第335回利付国債（10年）	0.5	2,090,000	2,208,252	2024/9/20
第336回利付国債（10年）	0.5	740,000	782,801	2024/12/20
第337回利付国債（10年）	0.3	1,210,000	1,258,387	2024/12/20
第338回利付国債（10年）	0.4	1,280,000	1,342,937	2025/3/20
第339回利付国債（10年）	0.4	1,940,000	2,036,262	2025/6/20
第340回利付国債（10年）	0.4	2,320,000	2,436,069	2025/9/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第341回利付国債（10年）	0.3	1,730,000	1,800,376	2025/12/20
第342回利付国債（10年）	0.1	1,120,000	1,143,352	2026/3/20
第１回利付国債（30年）	2.8	120,000	164,665	2029/9/20
第２回利付国債（30年）	2.4	170,000	225,613	2030/2/20
第３回利付国債（30年）	2.3	190,000	250,431	2030/5/20
第４回利付国債（30年）	2.9	125,000	176,513	2030/11/20
第５回利付国債（30年）	2.2	180,000	237,574	2031/5/20
第６回利付国債（30年）	2.4	170,000	230,708	2031/11/20
第７回利付国債（30年）	2.3	225,000	303,615	2032/5/20
第８回利付国債（30年）	1.8	160,000	203,816	2032/11/22
第９回利付国債（30年）	1.4	90,000	108,810	2032/12/20
第10回利付国債（30年）	1.1	263,000	305,245	2033/3/20
第11回利付国債（30年）	1.7	100,000	126,224	2033/6/20
第12回利付国債（30年）	2.1	205,000	272,965	2033/9/20
第13回利付国債（30年）	2.0	390,000	513,988	2033/12/20
第14回利付国債（30年）	2.4	380,000	527,949	2034/3/20
第15回利付国債（30年）	2.5	440,000	620,857	2034/6/20
第16回利付国債（30年）	2.5	345,000	488,295	2034/9/20
第17回利付国債（30年）	2.4	350,000	490,098	2034/12/20
第18回利付国債（30年）	2.3	360,000	498,484	2035/3/20
第19回利付国債（30年）	2.3	290,000	402,259	2035/6/20
第20回利付国債（30年）	2.5	260,000	370,578	2035/9/20
第21回利付国債（30年）	2.3	250,000	347,587	2035/12/20
第22回利付国債（30年）	2.5	285,000	408,031	2036/3/20
第23回利付国債（30年）	2.5	140,000	200,978	2036/6/20
第24回利付国債（30年）	2.5	250,000	359,847	2036/9/20
第25回利付国債（30年）	2.3	205,000	287,799	2036/12/20
第26回利付国債（30年）	2.4	510,000	727,734	2037/3/20
第27回利付国債（30年）	2.5	400,000	582,808	2037/9/20
第28回利付国債（30年）	2.5	445,000	652,187	2038/3/20
第29回利付国債（30年）	2.4	470,000	682,952	2038/9/20
第30回利付国債（30年）	2.3	585,000	842,095	2039/3/20
第31回利付国債（30年）	2.2	435,000	619,909	2039/9/20
第32回利付国債（30年）	2.3	640,000	931,833	2040/3/20
第33回利付国債（30年）	2.0	653,000	910,869	2040/9/20
第34回利付国債（30年）	2.2	625,000	906,662	2041/3/20
第35回利付国債（30年）	2.0	770,000	1,085,769	2041/9/20
第36回利付国債（30年）	2.0	710,000	1,006,496	2042/3/20
第37回利付国債（30年）	1.9	650,000	909,291	2042/9/20
第38回利付国債（30年）	1.8	535,000	737,877	2043/3/20
第39回利付国債（30年）	1.9	500,000	704,730	2043/6/20
第40回利付国債（30年）	1.8	430,000	595,906	2043/9/20
第41回利付国債（30年）	1.7	420,000	571,939	2043/12/20
第42回利付国債（30年）	1.7	450,000	614,137	2044/3/20
第43回利付国債（30年）	1.7	530,000	724,939	2044/6/20
第44回利付国債（30年）	1.7	490,000	670,844	2044/9/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第45回利付国債（30年）	1.5	520,000	686,036	2044/12/20
第46回利付国債（30年）	1.5	630,000	831,650	2045/3/20
第47回利付国債（30年）	1.6	620,000	836,652	2045/6/20
第48回利付国債（30年）	1.4	670,000	868,655	2045/9/20
第49回利付国債（30年）	1.4	460,000	597,452	2045/12/20
第50回利付国債（30年）	0.8	410,000	462,943	2046/3/20
第36回利付国債（20年）	3.0	50,000	52,168	2017/9/20
第37回利付国債（20年）	3.1	250,000	261,175	2017/9/20
第39回利付国債（20年）	2.6	1,120,000	1,178,195	2018/3/20
第40回利付国債（20年）	2.3	290,000	307,191	2018/9/20
第41回利付国債（20年）	1.5	240,000	251,827	2019/3/20
第42回利付国債（20年）	2.6	835,000	902,242	2019/3/20
第43回利付国債（20年）	2.9	360,000	397,699	2019/9/20
第44回利付国債（20年）	2.5	710,000	784,429	2020/3/20
第45回利付国債（20年）	2.4	100,000	110,098	2020/3/20
第47回利付国債（20年）	2.2	100,000	110,552	2020/9/21
第48回利付国債（20年）	2.5	250,000	281,447	2020/12/21
第49回利付国債（20年）	2.1	170,000	189,196	2021/3/22
第50回利付国債（20年）	1.9	515,000	567,993	2021/3/22
第51回利付国債（20年）	2.0	140,000	155,996	2021/6/21
第52回利付国債（20年）	2.1	260,000	292,601	2021/9/21
第53回利付国債（20年）	2.1	80,000	90,501	2021/12/20
第54回利付国債（20年）	2.2	530,000	602,562	2021/12/20
第55回利付国債（20年）	2.0	240,000	271,514	2022/3/21
第56回利付国債（20年）	2.0	370,000	420,693	2022/6/20
第57回利付国債（20年）	1.9	160,000	180,937	2022/6/20
第58回利付国債（20年）	1.9	350,000	397,726	2022/9/20
第59回利付国債（20年）	1.7	590,000	665,354	2022/12/20
第60回利付国債（20年）	1.4	230,000	254,858	2022/12/20
第61回利付国債（20年）	1.0	260,000	281,967	2023/3/20
第62回利付国債（20年）	0.8	560,000	600,824	2023/6/20
第63回利付国債（20年）	1.8	275,000	314,690	2023/6/20
第64回利付国債（20年）	1.9	480,000	555,148	2023/9/20
第65回利付国債（20年）	1.9	430,000	499,264	2023/12/20
第66回利付国債（20年）	1.8	170,000	196,076	2023/12/20
第67回利付国債（20年）	1.9	80,000	93,238	2024/3/20
第68回利付国債（20年）	2.2	395,000	469,769	2024/3/20
第69回利付国債（20年）	2.1	120,000	141,762	2024/3/20
第70回利付国債（20年）	2.4	510,000	617,293	2024/6/20
第71回利付国債（20年）	2.2	200,000	238,802	2024/6/20
第72回利付国債（20年）	2.1	645,000	768,001	2024/9/20
第73回利付国債（20年）	2.0	200,000	237,354	2024/12/20
第74回利付国債（20年）	2.1	380,000	454,271	2024/12/20
第75回利付国債（20年）	2.1	230,000	276,018	2025/3/20
第76回利付国債（20年）	1.9	210,000	248,264	2025/3/20
第77回利付国債（20年）	2.0	260,000	309,696	2025/3/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第79回利付国債（20年）	2.0	100,000	119,558	2025/6/20
第80回利付国債（20年）	2.1	370,000	445,761	2025/6/20
第82回利付国債（20年）	2.1	620,000	749,815	2025/9/20
第83回利付国債（20年）	2.1	182,000	220,816	2025/12/20
第84回利付国債（20年）	2.0	410,000	493,476	2025/12/20
第85回利付国債（20年）	2.1	230,000	280,052	2026/3/20
第86回利付国債（20年）	2.3	532,000	658,323	2026/3/20
第87回利付国債（20年）	2.2	170,000	208,680	2026/3/20
第88回利付国債（20年）	2.3	460,000	571,766	2026/6/20
第89回利付国債（20年）	2.2	130,000	160,264	2026/6/20
第90回利付国債（20年）	2.2	470,000	581,874	2026/9/20
第91回利付国債（20年）	2.3	80,000	99,876	2026/9/20
第92回利付国債（20年）	2.1	650,000	800,702	2026/12/20
第93回利付国債（20年）	2.0	230,000	281,915	2027/3/20
第94回利付国債（20年）	2.1	260,000	321,521	2027/3/20
第95回利付国債（20年）	2.3	490,000	619,605	2027/6/20
第96回利付国債（20年）	2.1	120,000	149,061	2027/6/20
第97回利付国債（20年）	2.2	330,000	415,044	2027/9/20
第98回利付国債（20年）	2.1	340,000	423,745	2027/9/20
第99回利付国債（20年）	2.1	555,000	693,922	2027/12/20
第100回利付国債（20年）	2.2	370,000	468,723	2028/3/20
第101回利付国債（20年）	2.4	450,000	580,765	2028/3/20
第102回利付国債（20年）	2.4	360,000	466,570	2028/6/20
第103回利付国債（20年）	2.3	320,000	410,848	2028/6/20
第104回利付国債（20年）	2.1	90,000	113,366	2028/6/20
第105回利付国債（20年）	2.1	270,000	341,147	2028/9/20
第106回利付国債（20年）	2.2	190,000	242,419	2028/9/20
第107回利付国債（20年）	2.1	30,000	38,017	2028/12/20
第108回利付国債（20年）	1.9	510,000	633,445	2028/12/20
第109回利付国債（20年）	1.9	620,000	772,526	2029/3/20
第110回利付国債（20年）	2.1	100,000	127,170	2029/3/20
第111回利付国債（20年）	2.2	170,000	219,038	2029/6/20
第112回利付国債（20年）	2.1	650,000	828,997	2029/6/20
第113回利付国債（20年）	2.1	310,000	396,486	2029/9/20
第114回利付国債（20年）	2.1	680,000	872,079	2029/12/20
第115回利付国債（20年）	2.2	270,000	349,922	2029/12/20
第116回利付国債（20年）	2.2	215,000	279,603	2030/3/20
第117回利付国債（20年）	2.1	560,000	720,552	2030/3/20
第118回利付国債（20年）	2.0	314,000	400,971	2030/6/20
第119回利付国債（20年）	1.8	430,000	537,039	2030/6/20
第120回利付国債（20年）	1.6	160,000	195,340	2030/6/20
第121回利付国債（20年）	1.9	430,000	544,311	2030/9/20
第122回利付国債（20年）	1.8	310,000	387,992	2030/9/20
第123回利付国債（20年）	2.1	530,000	688,210	2030/12/20
第124回利付国債（20年）	2.0	330,000	423,726	2030/12/20
第125回利付国債（20年）	2.2	270,000	355,406	2031/3/20

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126回利付国債（20年）	2.0	330,000	424,677	2031/３/20
第127回利付国債（20年）	1.9	260,000	330,766	2031/３/20
第128回利付国債（20年）	1.9	610,000	777,670	2031/６/20
第129回利付国債（20年）	1.8	200,000	251,986	2031/６/20
第130回利付国債（20年）	1.8	610,000	770,015	2031/９/20
第131回利付国債（20年）	1.7	110,000	137,187	2031/９/20
第132回利付国債（20年）	1.7	270,000	337,545	2031/12/20
第133回利付国債（20年）	1.8	370,000	468,260	2031/12/20
第134回利付国債（20年）	1.8	380,000	482,117	2032/３/20
第135回利付国債（20年）	1.7	220,000	275,684	2032/３/20
第136回利付国債（20年）	1.6	260,000	321,744	2032/３/20
第137回利付国債（20年）	1.7	390,000	489,489	2032/６/20
第138回利付国債（20年）	1.5	150,000	183,511	2032/６/20
第139回利付国債（20年）	1.6	110,000	136,317	2032/６/20
第140回利付国債（20年）	1.7	880,000	1,106,177	2032/９/20
第141回利付国債（20年）	1.7	960,000	1,208,467	2032/12/20
第143回利付国債（20年）	1.6	490,000	609,574	2033/３/20
第144回利付国債（20年）	1.5	460,000	564,668	2033/３/20
第145回利付国債（20年）	1.7	1,000,000	1,262,240	2033/６/20
第146回利付国債（20年）	1.7	880,000	1,112,214	2033/９/20
第147回利付国債（20年）	1.6	730,000	911,251	2033/12/20
第148回利付国債（20年）	1.5	690,000	850,211	2034/３/20
第149回利付国債（20年）	1.5	840,000	1,035,896	2034/６/20
第150回利付国債（20年）	1.4	790,000	960,126	2034/９/20
第151回利付国債（20年）	1.2	840,000	991,326	2034/12/20
第152回利付国債（20年）	1.2	920,000	1,085,894	2035/３/20
第153回利付国債（20年）	1.3	910,000	1,091,899	2035/６/20
第154回利付国債（20年）	1.2	1,120,000	1,322,238	2035/９/20
第155回利付国債（20年）	1.0	710,000	811,643	2035/12/20
第156回利付国債（20年）	0.4	540,000	554,250	2036/３/20
第14回ポーランド共和国円貨債券（2013）	0.67	100,000	100,649	2018/11/15
小計		156,554,000	178,095,596	
地方債証券				
第５回東京都公募公債（20年）	2.11	100,000	118,305	2025/３/19
第７回東京都公募公債（20年）	2.16	100,000	119,579	2025/９/19
第７回東京都公募公債（30年）	2.51	70,000	99,370	2038/９/17
第10回東京都公募公債（30年）	2.31	100,000	139,305	2039/９/20
第25回東京都公募公債（20年）	1.8	100,000	124,468	2031/12/19
第27回東京都公募公債（20年）	1.68	100,000	123,276	2032/12/20
第655回東京都公募公債	1.42	30,000	30,769	2018/３/20
第682回東京都公募公債	1.32	100,000	105,096	2020/３/19
第700回東京都公募公債	1.02	100,000	105,295	2021/９/17
第718回東京都公募公債	0.6	100,000	103,891	2023/３/20
第719回東京都公募公債	0.86	200,000	211,324	2023/３/20
第３回東京都公募公債（20年）	2.26	100,000	117,413	2024/３/19
平成20年度第12回北海道公募公債	1.72	50,000	52,183	2018/12/26

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21年度第７回北海道公募公債	1.46	50,000	52,367	2019/９/25
平成22年度第８回北海道公募公債	0.96	80,000	83,228	2020/10/29
平成24年度第９回北海道公募公債	0.79	50,000	52,313	2022/10/31
第２回神奈川県公募公債（30年）	2.87	100,000	145,529	2036/６/20
第４回神奈川県公募公債（30年）	2.62	100,000	143,433	2038/３/19
第155回神奈川県公募公債	1.61	60,000	62,008	2018/６/20
第196回神奈川県公募公債	0.678	100,000	104,565	2023/３/20
第５回大阪府公募公債（20年）	2.16	100,000	126,482	2030/５/28
第311回大阪府公募公債	1.68	50,000	51,442	2018/２/28
第313回大阪府公募公債	1.66	50,000	51,553	2018/４/27
第318回大阪府公募公債	1.7	14,000	14,540	2018/９/28
第322回大阪府公募公債	1.62	60,000	62,510	2019/１/29
第332回大阪府公募公債	1.58	50,000	52,659	2019/11/27
第335回大阪府公募公債	1.48	30,000	31,596	2020/２/25
第336回大阪府公募公債	1.46	50,000	52,686	2020/３/30
第342回大阪府公募公債	1.2	25,000	26,222	2020/９/29
第344回大阪府公募公債	1.06	21,000	21,908	2020/11/27
第346回大阪府公募公債	1.25	140,000	147,555	2021/１/28
第348回大阪府公募公債	1.32	50,000	53,065	2021/３/30
第358回大阪府公募公債	0.97	70,000	73,627	2022/２/28
平成20年度第３回京都府公募公債	1.57	20,200	21,011	2018/12/19
平成21年度第３回京都府公募公債（20年）	2.19	100,000	126,031	2029/９/20
平成22年度第２回京都府公募公債	1.16	40,000	42,008	2020/９/24
平成22年度第７回京都府公募公債	1.31	45,900	48,797	2021/３/22
平成23年度第２回京都府公募公債	1.2	66,000	69,960	2021/６/22
第２回兵庫県公募公債（30年）	2.36	50,000	69,741	2040/３/19
第５回兵庫県公募公債（15年）	1.31	100,000	113,314	2028/５/26
平成20年度第３回兵庫県公募公債	1.76	40,000	41,378	2018/５/22
平成21年度第35回兵庫県公募公債	1.46	40,000	42,069	2020/１/22
平成23年度第11回兵庫県公募公債	0.95	50,000	52,539	2022/１/27
平成24年度第18回兵庫県公募公債	0.77	100,000	104,575	2022/10/19
第３回静岡県公募公債（15年）	1.368	100,000	114,169	2027/10/29
第14回静岡県公募公債（20年）	1.736	100,000	123,936	2032/６/18
平成19年度第９回静岡県公募公債	1.53	50,000	51,412	2018/３/27
平成25年度第８回静岡県公募公債	0.699	29,800	31,302	2023/10/24
平成20年度第８回愛知県公募公債（20年）	2.04	200,000	246,400	2028/12/20
平成21年度第６回愛知県公募公債	1.44	50,000	52,284	2019/７/30
平成21年度第10回愛知県公募公債	1.38	201,000	210,539	2019/10/30
平成22年度第５回愛知県公募公債	1.258	27,200	28,602	2020/６/30
平成23年度第11回愛知県公募公債	1.03	70,000	73,863	2021/10/28
平成23年度第20回愛知県公募公債	1.082	100,000	106,249	2022/３/29
平成24年度第13回愛知県公募公債	0.772	100,000	104,942	2022/11/30
平成19年度第４回広島県公募公債	1.53	29,300	30,110	2018/３/19
平成21年度第１回広島県公募公債	1.57	20,000	20,957	2019/５/28
平成22年度第３回広島県公募公債	1.08	45,000	47,153	2020/９/24
第８回埼玉県公募公債（20年）	2.19	100,000	126,195	2029/９/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
第10回埼玉県公募公債（20年）	1.94	100,000	124,770	2030/11/12
平成20年度第３回埼玉県公募公債	1.87	29,000	30,128	2018/６/25
平成21年度第８回埼玉県公募公債	1.3	12,000	12,565	2019/12/25
平成22年度第11回埼玉県公募公債	1.28	40,000	42,432	2021/２/25
平成23年度第１回埼玉県公募公債	1.37	100,000	106,785	2021/４/27
平成22年度第10回福岡県公募公債	1.36	50,000	53,230	2021/２/25
平成21年度第２回千葉県公募公債	1.57	80,000	83,766	2019/５/24
平成22年度第12回千葉県公募公債	1.28	80,000	84,865	2021/２/25
平成22年度第14回千葉県公募公債	1.33	80,000	85,136	2021/３/25
平成23年度第５回千葉県公募公債	1.06	80,000	84,610	2021/11/25
平成23年度第９回千葉県公募公債	1.0	80,000	84,606	2022/３/25
平成24年度第１回千葉県公募公債	1.05	80,000	84,918	2022/４/25
平成21年度第１回新潟県公募公債	1.42	54,500	56,940	2019/７/29
平成21年度第２回新潟県公募公債	1.55	80,550	84,988	2019/11/27
平成22年度第１回岐阜県公募公債	1.21	42,000	44,226	2020/９/30
平成21年度第１回大分県公募公債	1.35	54,900	57,489	2019/10/31
第55回共同発行市場公募地方債	1.85	50,000	51,324	2017/10/25
第69回共同発行市場公募地方債	1.56	34,000	35,374	2018/12/25
第73回共同発行市場公募地方債	1.59	80,600	84,352	2019/４/25
第80回共同発行市場公募地方債	1.54	200,000	210,854	2019/11/25
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	50,000	52,383	2019/12/25
第84回共同発行市場公募地方債	1.38	20,000	21,057	2020/３/25
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	100,000	104,872	2020/９/25
第96回共同発行市場公募地方債	1.29	20,000	21,240	2021/３/25
第97回共同発行市場公募地方債	1.38	212,000	226,354	2021/４/23
第98回共同発行市場公募地方債	1.18	150,000	158,793	2021/５/25
第104回共同発行市場公募地方債	1.03	100,000	105,627	2021/11/25
第108回共同発行市場公募地方債	1.01	70,000	74,093	2022/３/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	200,000	210,274	2022/９/22
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	315,444	2022/11/25
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	105,681	2024/１/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	105,017	2024/３/25
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	600,000	631,554	2024/４/25
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	200,000	208,194	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	205,702	2025/１/24
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	200,000	207,864	2025/３/25
平成21年度第１回栃木県公募公債	1.55	100,000	105,451	2019/11/30
平成20年度第１回新潟市公募公債	1.56	34,190	35,568	2018/12/26
平成21年度第１回新潟市公募公債	1.34	94,450	99,027	2019/12/25
平成19年度第１回浜松市公募公債	1.81	82,390	84,651	2017/11/28
平成21年度第１回浜松市公募公債	1.54	33,900	35,756	2019/11/27
平成21年度第６回大阪市公募公債	1.57	50,000	52,721	2019/11/25
平成22年度第８回大阪市公募公債	1.28	50,000	52,924	2021/１/25
平成22年度第10回大阪市公募公債	1.31	20,000	21,253	2021/３/17
平成26年度第７回大阪市公募公債	0.535	100,000	104,224	2024/11/28
第１回名古屋市公募公債（20年）	1.99	100,000	114,831	2023/12/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
第９回名古屋市公募公債（20年）	2.07	100,000	123,646	2028/12/20
第９回名古屋市公募公債（30年）	2.095	90,000	124,420	2042/９/19
平成18年度第３回神戸市公募公債（20年）	2.54	110,000	136,451	2026/６/19
平成23年度第５回神戸市公募公債	1.025	100,000	105,438	2021/10/19
第５回横浜市公募公債（20年）	2.17	100,000	119,537	2025/６/20
第７回横浜市公募公債（20年）	2.06	250,000	299,455	2025/12/19
平成24年度第４回横浜市公募公債	0.81	100,000	105,297	2023/２/20
第27回横浜市公募公債（20年）	1.599	40,000	48,844	2033/５/20
平成22年度第７回札幌市公募公債	1.05	50,000	52,310	2020/９/18
第７回川崎市公募公債（20年）	2.08	100,000	124,483	2029/７/17
平成19年度第５回福岡市公募公債	1.49	20,000	20,545	2018/３/28
平成20年度第５回福岡市公募公債	1.57	30,000	31,151	2018/10/24
平成20年度第８回福岡市公募公債	1.49	84,500	88,020	2019/３/25
平成22年度第９回福岡市公募公債	1.32	127,300	135,212	2021/３/25
平成23年度第６回福岡市公募公債	1.0	50,000	52,677	2021/10/28
平成24年度第１回福岡市公募公債（５年）	0.25	55,000	55,146	2017/６/26
平成24年度第４回福岡市公募公債	0.8	70,000	73,542	2022/10/31
平成20年度第１回広島市公募公債	1.56	50,000	51,997	2018/12/25
平成20年度第２回広島市公募公債	1.52	50,000	52,068	2019/２/25
平成22年度第６回広島市公募公債	1.21	50,000	53,016	2021/５/31
平成22年度第１回相模原市公募公債	1.29	60,000	63,517	2020/12/18
平成22年度第１回三重県公募公債	1.056	149,170	156,240	2020/11/30
平成23年度第１回三重県公募公債	1.021	117,600	124,140	2021/11/30
平成20年度第１回徳島県公募公債	1.73	130,300	136,025	2018/11/28
平成21年度第１回徳島県公募公債	1.55	36,500	38,514	2019/11/29
平成19年度第１回岡山県公募公債	1.72	60,650	62,235	2017/11/30
平成22年度第１回岡山県公募公債	1.05	50,000	52,403	2020/11/30
小計		11,299,900	12,409,380	
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	109,103	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	109,214	2021/３/26
第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	11,000	11,386	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	14,488	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	103,577	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	31,094	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	104,108	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	209,292	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	129,544	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	251,118	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	10,528	2020/２/28
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	126,729	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	140,248	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	124,251	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	131,456	2040/８/31
第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	124,445	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	14,856	2021/６/30

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	210,648	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	137,896	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	210,738	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	105,629	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	300,000	316,044	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	300,000	315,615	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	171,136	2022/12/28
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	200,000	211,464	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	31,700	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	355,065	2023/5/31
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.882	100,000	106,459	2023/6/30
第197回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.835	101,000	107,268	2023/8/31
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.645	100,000	105,153	2024/3/29
第344回政府保証道路債券	1.6	100,000	106,626	2020/7/15
第11回政府保証東日本高速道路債券	1.6	50,000	51,425	2018/2/27
第13回政府保証東日本高速道路債券	1.6	80,000	83,074	2018/10/19
第14回政府保証東日本高速道路債券	1.4	80,000	82,874	2018/12/21
第12回政府保証日本政策投資銀行債券	2.1	100,000	110,712	2021/6/28
第１回政府保証公営企業債券（15年）	1.6	200,000	213,058	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	209,150	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	208,782	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	32,330	2019/9/13
第５回政府保証公営企業債券（15年）	2.2	100,000	113,662	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	14,495	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	208,160	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	11,627	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	21,247	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	212,268	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	36,875	2022/3/14
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.734	100,000	104,967	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	40,144	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	106,173	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	100,000	105,376	2023/12/18
第２回政府保証公営企業債券（15年）	2.1	100,000	110,310	2021/4/16
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	105,660	2023/2/24
第16回政府保証民間都市開発債券	0.699	90,000	94,775	2023/10/20
第５回政府保証日本政策投資銀行	1.4	10,000	10,403	2019/4/15
第13回政府保証中部国際空港債券	1.3	72,000	76,518	2021/3/15
第16回政府保証西日本高速道路債券	1.6	75,000	77,972	2018/11/16
第17回政府保証西日本高速道路債券	1.3	75,000	77,607	2019/1/28
第36回日本政策投資銀行債券（財投機関債）	2.23	30,000	36,788	2027/5/28
第１回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	2.99	100,000	161,567	2045/9/20
第17回道路債券（財投機関債）	1.54	150,000	164,725	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	155,852	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	168,934	2047/3/20
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	102,474	2017/12/20

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	126,279	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	127,821	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	104,739	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	106,048	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	122,658	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	106,322	2023/6/20
第３回公営企業債券（20年）（財投機関債）	1.03	100,000	106,718	2023/3/22
第４回公営企業債券（30年）（財投機関債）	2.95	100,000	143,982	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	126,181	2030/1/28
第７回公営企業債券（20年）（財投機関債）	2.2	100,000	116,598	2024/3/22
第８回公営企業債券（20年）（財投機関債）	2.25	100,000	116,988	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	105,359	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	105,049	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	126,245	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	123,150	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	121,323	2032/7/28
第36回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	0.892	200,000	210,220	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	209,716	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	209,958	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	82,873	2031/7/30
第１回公営企業債券（20年）（財投機関債）	2.1	100,000	112,501	2022/6/20
第16回都市再生債券（財投機関債）	1.76	100,000	102,342	2017/9/20
第100回都市再生債券（財投機関債）	0.569	100,000	104,103	2024/11/20
第７回本州四国連絡橋債券（財投機関債）	2.26	100,000	119,273	2025/6/20
第29回福祉医療機構債券（財投機関債）	1.145	100,000	106,161	2021/12/20
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	52,952	56,753	2042/5/10
第２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	56,422	60,783	2042/6/10
第３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.85	26,706	27,569	2036/9/10
第３回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	1.82	38,828	41,054	2036/5/10
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	1.76	59,805	63,158	2036/11/10
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.26	20,909	22,525	2037/5/10
第７回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.25	62,919	67,734	2037/5/10
第８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	28,382	30,384	2042/12/10
第９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.52	44,835	46,129	2037/12/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	15,949	16,425	2038/2/10
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	0.92	17,545	17,868	2038/6/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	31,322	33,733	2043/5/10
第16回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	1.64	67,486	70,607	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	69,280	72,685	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	34,572	36,092	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8	19,211	20,117	2039/6/10
第23回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	2.6	100,000	128,661	2028/9/20
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	46,434	50,143	2044/10/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	26,809	28,291	2040/6/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	48,555	52,239	2044/12/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	29,093	30,719	2040/7/10

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36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	113,056	121,095	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	112,682	120,202	2045/6/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	52,124	55,291	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.36	65,596	69,079	2045/9/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	52,264	56,640	2041/5/10
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3	49,670	53,859	2041/7/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	214,980	231,761	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	132,970	143,090	2046/2/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	128,572	139,150	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	64,274	69,120	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	64,107	68,652	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	68,941	73,864	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.18	55,758	60,342	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	71,981	76,732	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	73,005	77,740	2046/10/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	76,428	81,327	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	76,918	81,881	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	77,502	82,072	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	154,424	163,249	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	106,004	2020/12/18
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	243,672	255,845	2047/11/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	87,869	92,129	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	176,722	185,004	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	105,349	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	113,997	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	123,434	2031/11/18
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	184,808	192,048	2049/11/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	1.892	200,000	248,550	2032/4/16
第17回国際協力機構債券（財投機関債）	0.72	30,000	31,293	2022/12/26
第３回中日本高速道路	1.92	100,000	102,568	2017/9/20
第13回中日本高速道路	1.49	100,000	105,191	2019/12/20
第38回中日本高速道路	0.677	100,000	101,767	2019/2/28
第21回西日本高速道路	0.754	100,000	105,205	2023/12/20
第17回東京都住宅供給公社債券	1.17	100,000	105,308	2021/9/17
小計		14,004,337	15,462,010	
金融債券				
い第749号農林債券	0.3	100,000	100,417	2017/10/27
い第752号農林債券	0.3	200,000	200,934	2018/1/26
い第755号農林債券	0.3	100,000	100,484	2018/4/27
い第758号農林債券	0.4	100,000	100,764	2018/7/27
い第760号農林債券	0.4	100,000	100,811	2018/9/27
い第761号農林債券	0.3	100,000	100,583	2018/10/26
い第765号農林債券	0.3	200,000	201,328	2019/2/27
い第769号農林債券	0.3	130,000	131,008	2019/6/27
い第774号農林債券	0.24	100,000	100,628	2019/11/27
い第778号農林債券	0.25	300,000	302,253	2020/3/27

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
金融債券	%	千円	千円	
第274回信金中金債	0.3	100,000	100,401	2017/9/27
第288回信金中金債	0.3	200,000	201,258	2018/11/27
第178号商工債券（３年）	0.15	300,000	300,639	2017/11/27
小計		2,030,000	2,041,508	
普通社債券				
第459回東京電力	2.7	20,000	21,221	2019/1/29
第522回東京電力	2.06	100,000	100,521	2016/8/31
第526回東京電力	1.78	100,000	101,525	2017/5/31
第532回東京電力	1.75	30,000	30,574	2017/9/28
第536回東京電力	1.672	100,000	102,232	2018/1/29
第542回東京電力	1.602	100,000	102,392	2018/4/25
第548回東京電力	2.347	100,000	112,266	2028/9/29
第559回東京電力	1.377	140,000	144,095	2019/10/29
第497回中部電力	0.986	100,000	103,610	2020/10/23
第499回中部電力	1.194	50,000	53,439	2023/6/23
第410回関西電力	2.0	100,000	104,572	2018/11/22
第460回関西電力	1.77	100,000	102,636	2017/12/20
第478回関西電力	1.448	100,000	104,580	2020/1/24
第365回中国電力	1.405	100,000	104,605	2019/12/25
第287回北陸電力	2.01	50,000	51,082	2017/6/23
第288回北陸電力	1.89	30,000	30,799	2017/10/25
第297回北陸電力	0.976	20,000	20,713	2020/10/23
第431回東北電力	2.05	80,000	82,844	2018/3/23
第432回東北電力	2.09	20,000	20,005	2016/5/25
第267回四国電力	1.89	100,000	105,943	2019/9/25
第400回九州電力	1.777	70,000	74,317	2020/4/24
第409回九州電力	1.483	100,000	104,308	2019/8/23
第296回北海道電力	2.027	100,000	103,938	2018/6/25
第315回北海道電力	0.82	100,000	101,290	2018/4/25
第316回北海道電力	1.164	100,000	103,900	2020/6/25
第319回北海道電力	0.514	100,000	101,131	2019/9/25
第16回沖縄電力	1.83	70,000	71,373	2017/6/20
第26回関西国際空港	1.156	100,000	104,802	2020/9/18
第15回成田国際空港	0.739	100,000	105,124	2024/2/20
第11回セブン＆アイ・ホールディングス	0.514	200,000	204,318	2022/6/20
第３回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	104,907	2022/12/2
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	105,348	2021/9/17
第12回パナソニック	0.387	100,000	100,935	2020/3/19
第１回Ｂ号日本生命2011基金	1.12	100,000	101,103	2017/8/5
第１回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	101,028	2019/8/7
第78回三菱商事	1.155	100,000	105,620	2022/3/9
第79回三菱商事	1.022	100,000	104,991	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	103,669	2018/3/2
第７回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	2.5	200,000	213,866	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	107,200	2021/10/29
第10回みずほコーポレート銀行	1.945	100,000	102,751	2017/10/27

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33回みずほコーポレート銀行	0.41	400,000	402,640	2018/4/20
第12回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	2.16	100,000	102,471	2017/7/28
第88回三菱東京ＵＦＪ銀行	2.34	100,000	121,834	2027/4/20
第６回りそな銀行（劣後特約付）	2.084	100,000	106,936	2020/3/4
第９回三菱ＵＦＪ信託銀行（劣後特約付）	1.68	100,000	107,143	2021/4/28
第12回住友信託銀行（劣後特約付）	1.373	100,000	104,999	2020/11/11
第15回住友信託銀行（劣後特約付）	1.62	100,000	107,842	2022/3/22
第11回三井住友銀行（劣後特約付）	2.17	100,000	103,235	2017/12/20
第17回三井住友銀行（劣後特約付）	2.8	200,000	214,434	2019/2/12
第20回三井住友銀行（劣後特約付）	2.21	100,000	106,537	2019/7/24
第22回三井住友銀行（劣後特約付）	1.43	100,000	105,269	2020/9/28
第23回三井住友銀行（劣後特約付）	1.61	100,000	106,375	2020/12/17
第57回三井住友銀行	0.28	100,000	100,381	2017/10/20
第18回みずほ銀行（劣後特約付）	2.14	100,000	116,418	2026/9/11
第19回みずほ銀行（劣後特約付）	1.67	100,000	107,695	2022/2/24
第28回日産フィナンシャルサービス	0.253	100,000	100,397	2019/6/20
第69回トヨタファイナンス	0.02	100,000	99,962	2019/4/26
第52回日立キャピタル	0.508	100,000	101,636	2021/6/18
第９回三井住友ファイナンス＆リース	0.518	100,000	101,579	2021/1/29
第14回三井住友ファイナンス＆リース	0.321	100,000	100,712	2020/10/30
第８回野村ホールディングス	2.12	100,000	102,535	2017/8/14
第10回野村ホールディングス	1.91	100,000	102,798	2017/11/27
第23回野村ホールディングス	1.808	100,000	106,637	2020/6/24
第24回野村ホールディングス	2.329	100,000	116,653	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	103,674	2018/6/20
第72回三菱地所	2.28	100,000	116,596	2024/9/20
第80回三菱地所	2.305	100,000	120,203	2027/3/19
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	105,114	2021/9/17
第15回東日本旅客鉄道	2.65	20,000	22,192	2020/8/25
第19回東日本旅客鉄道	2.36	100,000	113,190	2022/2/25
第32回東日本旅客鉄道	2.26	100,000	116,866	2024/3/19
第34回東日本旅客鉄道	2.53	100,000	119,480	2024/6/20
第43回東日本旅客鉄道	1.86	100,000	108,149	2020/12/18
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	132,838	2044/1/29
第９回西日本旅客鉄道	2.28	100,000	112,901	2022/3/25
第27回西日本旅客鉄道	1.36	100,000	105,202	2020/6/11
第６回東海旅客鉄道	2.39	21,000	23,792	2022/2/15
第42回東海旅客鉄道	2.312	100,000	126,136	2029/4/24
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	120,902	2030/10/25
第63回日本電信電話	0.69	200,000	208,368	2023/3/20
第19回ＫＤＤＩ	1.151	100,000	104,206	2020/6/19
第21回ＫＤＤＩ	0.669	100,000	103,826	2024/9/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	104,636	2023/9/20
第８回電源開発	2.11	100,000	115,077	2024/12/20
第23回東京ガス	1.01	100,000	106,484	2023/6/9
第４回ファーストリテイリング	0.749	100,000	104,031	2025/12/18

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20回ＧＥキャピタルコーポレーション	2.885	100,000	105,390	2018/５/29
第９回ＪＰモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.32	200,000	201,716	2017/２/９
第６回ナショナル・オーストラリア銀行	1.03	100,000	100,134	2016/７/８
第８回ナショナル・オーストラリア銀行	1.3	100,000	100,768	2017/１/20
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	100,681	2020/１/16
第８回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.407	100,000	100,971	2019/５/２
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	100,844	2017/３/９
第18回ラボバンク・ネダーランド	0.778	100,000	100,928	2017/11/２
第23回ラボバンク・ネダーランド	0.557	100,000	101,226	2018/12/19
第27回ラボバンク・ネダーランド	0.38	100,000	100,946	2020/５/22
小計		9,821,000	10,380,161	
合計		193,709,237	218,388,657	

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
国内	債券先物取引	１０年国債標準物	百万円 607	百万円 －

○投資信託財産の構成

（2016年５月20日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	218,388,657	99.1
コール・ローン等、その他	2,060,126	0.9
投資信託財産総額	220,448,783	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年５月20日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	220,448,783,747
コール・ローン等	1,151,083,926
公社債(評価額)	218,388,657,037
未収入金	281,589,100
未収利息	617,374,535
前払費用	5,859,149
差入委託証拠金	4,220,000
(B) 負債	546,120,829
未払金	184,320
未払解約金	545,933,508
未払利息	1,873
その他未払費用	1,128
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	219,902,662,918
元本	156,236,987,608
次期繰越損益金	63,665,675,310
(D) 受益権総口数	156,236,987,608口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	14,075円

＜注記事項＞

①期首元本額　194,532,901,496円
　期中追加設定元本額　35,141,302,845円
　期中一部解約元本額　73,437,216,733円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.4075円です。

○損益の状況 (2015年５月21日～2016年５月20日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	2,740,172,135
受取利息	2,740,257,904
支払利息	△ 85,769
(B) 有価証券売買損益	12,364,381,209
売買益	12,878,060,435
売買損	△ 513,679,226
(C) 先物取引等取引損益	△ 335,600
取引益	3,727,600
取引損	△ 4,063,200
(D) 保管費用等	△ 1,128
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	15,104,216,616
(F) 前期繰越損益金	62,098,845,367
(G) 追加信託差損益金	11,927,318,479
(H) 解約差損益金	△25,464,705,152
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	63,665,675,310
次期繰越損益金(Ｉ)	63,665,675,310

(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）

三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	3,474,461,523円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	4,013,687,275円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	995,870,644円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	26,078,973,744円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	39,433,106,342円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	9,566,943,379円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	243,447,663円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	156,299,901円
三菱ＵＦＪ 国内債券インデックスファンド	2,131,354,864円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	1,966,065,487円
三菱ＵＦＪ 国内債券インデックスファンド（確定拠出年金）	8,402,293,348円
三菱ＵＦＪ 日本債券ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	59,767,950,667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）	1,245,106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）	5,287,665円
合計	156,236,987,608円

［お知らせ］

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

三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド

《第16期》決算日2016年５月20日

［計算期間：2015年５月21日～2016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16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16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）		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
16期(2016年５月20日)	25,716	△ 6.5	436.8953	△ 6.3	98.7	－	73,559

(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	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
（期首）2015年５月20日	27,492	－	466.3665	－	98.8	－
５月末	27,995	1.8	477.0137	2.3	98.8	－
６月末	27,567	0.3	468.9247	0.5	98.6	－
７月末	27,947	1.7	475.9564	2.1	98.7	－
８月末	27,512	0.1	467.1813	0.2	98.0	－
９月末	27,440	△0.2	465.8771	△0.1	98.8	－
10月末	27,460	△0.1	467.3170	0.2	98.7	－
11月末	27,440	△0.2	467.1041	0.2	98.6	－
12月末	27,060	△1.6	459.3212	△1.5	98.7	－
2016年１月末	27,477	△0.1	459.2838	△1.5	97.9	－
２月末	26,073	△5.2	444.8363	△4.6	98.2	－
３月末	26,542	△3.5	451.2808	△3.2	98.8	－
４月末	25,684	△6.6	443.0580	△5.0	99.3	－
（期末）2016年５月20日	25,716	△6.5	436.8953	△6.3	98.7	－

（注）騰落率は期首比。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

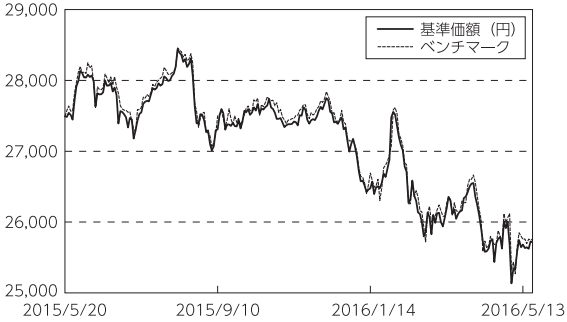
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－6.3%）を0.2%下回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国債券市況

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

◎為替市況

・円・ドル相場は、ＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）による政策金利の引き上げが意識されてドルが対円で上昇する局面もありましたが、世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景にドルが対円で売られました。期首との比較では、ドルは対円で9.0%下落しました。

・円・ユーロ相場は、ユーロ圏の景況感の改善などを背景に上昇する局面もありましたが、ＥＣＢ（欧州中央銀行）が緩和的な金融政策を維持したことなどを背景に、ユーロが対円で売られました。期首との比較では、ユーロは対円で8.4%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6.3%の下落となったため、カイ離は△0.2%程度となりました。

	ポートフォリオ要因	管理コスト等要因	評価時価差異に基づく要因	合計
ベンチマークとのカイ離	△0.0%程度	△0.0%程度	△0.1%程度	△0.2%程度

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は△0.0%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は△0.0%程度でした。

・カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は△0.1%程度でした。

・為替の効果および債券の効果による要因です。

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

債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

○今後の運用方針

・今後の運用についても、運用方針を堅持します。

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2015年５月21日～2016年５月20日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	9	0.033	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(9)	(0.033)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	9	0.033	
期中の平均基準価額は、27,183円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2015年５月21日～2016年５月20日）

公社債

			買　　付　　額	売　　付　　額
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 110,713	千アメリカドル 271,940
	カナダ	国債証券	千カナダドル 3,839	千カナダドル 16,264
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 23,784	千メキシコペソ 82,387
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	10,160	38,773
	イタリア	国債証券	11,509	46,337
	フランス	国債証券	11,635	43,941
	オランダ	国債証券	2,223	12,146
	スペイン	国債証券	6,667	25,125
	ベルギー	国債証券	2,747	11,719
	オーストリア	国債証券	1,860	7,773
	フィンランド	国債証券	219	2,167
	アイルランド	国債証券	110	2,710
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 6,260	千イギリスポンド 28,377
	スイス	国債証券	千スイスフラン 90	千スイスフラン 1,343
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 5,068	千スウェーデンクローネ 21,047
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 3,019	千ノルウェークローネ 9,934
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 3,823	千デンマーククローネ 23,208
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 4,090	千ポーランドズロチ 11,030
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 4,072	千オーストラリアドル 11,495
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 593	千シンガポールドル 2,553
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 1,781	千マレーシアリンギット 9,790
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 8,332	千南アフリカランド 28,025

（注）金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）

○利害関係人との取引状況等

（2015年５月21日～2016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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	5,876	3,836	65.3	54,626	41,821	76.6

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

○組入資産の明細

（2016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
	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	270,600	282,904	31,144,976	42.3	－	17.2	17.0	8.2
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	15,600	17,645	1,484,480	2.0	－	1.0	0.6	0.5
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	101,300	111,846	668,839	0.9	－	0.6	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	36,480	43,972	5,420,943	7.4	－	4.3	2.1	1.0
イタリア	48,900	58,331	7,191,094	9.8	－	6.1	2.6	1.1
フランス	47,200	58,002	7,150,540	9.7	－	6.0	2.9	0.7
オランダ	11,750	14,245	1,756,137	2.4	－	1.5	0.6	0.3
スペイン	27,500	32,512	4,008,144	5.4	－	3.1	1.7	0.6
ベルギー	11,800	15,280	1,883,804	2.6	－	1.9	0.4	0.3
オーストリア	7,550	9,149	1,127,970	1.5	－	1.0	0.4	0.1
フィンランド	3,150	3,631	447,666	0.6	－	0.3	0.2	0.1
アイルランド	4,050	4,761	587,036	0.8	－	0.4	0.4	0.1
	千イギリスポンド	千イギリスポンド						
イギリス	29,820	36,454	5,859,411	8.0	－	5.7	1.7	0.5
	千スイスフラン	千スイスフラン						
スイス	1,480	1,765	195,968	0.3	－	0.1	0.1	0.1
	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ						
スウェーデン	23,600	27,355	360,539	0.5	－	0.3	0.2	0.0
	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
ノルウェー	15,350	16,692	219,836	0.3	－	0.2	0.1	0.0
	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
デンマーク	23,250	29,716	492,702	0.7	－	0.5	0.1	0.0
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	14,300	15,199	424,834	0.6	－	0.2	0.2	0.1
	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル						
オーストラリア	14,650	16,238	1,293,106	1.8	－	1.0	0.6	0.2
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	3,040	3,199	255,501	0.3	－	0.2	0.1	0.0
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	12,100	12,199	329,762	0.4	－	0.2	0.1	0.1
	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
南アフリカ	48,200	42,462	295,964	0.4	－	0.3	0.1	0.0
合計	－	－	72,599,265	98.7	－	52.1	32.5	14.1

（注）邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

（Ｂ）外国（外貨建）公社債　銘柄別開示

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	0.5 T-NOTE 170731	0.5	1,900	1,894	208,525	2017/7/31
		0.625 T-NOTE 170531	0.625	3,400	3,397	374,013	2017/5/31
		0.625 T-NOTE 170731	0.625	500	499	54,956	2017/7/31
		0.625 T-NOTE 170831	0.625	2,800	2,794	307,661	2017/8/31
		0.625 T-NOTE 170930	0.625	1,600	1,596	175,751	2017/9/30
		0.625 T-NOTE 171130	0.625	1,200	1,196	131,690	2017/11/30
		0.625 T-NOTE 180430	0.625	700	696	76,677	2018/4/30
		0.75 T-NOTE 170630	0.75	2,400	2,400	264,267	2017/6/30
		0.75 T-NOTE 171031	0.75	2,300	2,297	252,979	2017/10/31
		0.75 T-NOTE 171231	0.75	1,200	1,198	131,911	2017/12/31
		0.75 T-NOTE 180228	0.75	1,500	1,497	164,806	2018/2/28
		0.75 T-NOTE 180331	0.75	400	399	43,934	2018/3/31
		0.75 T-NOTE 180415	0.75	500	498	54,903	2018/4/15
		0.875 T-NOTE 170430	0.875	2,100	2,104	231,667	2017/4/30
		0.875 T-NOTE 170515	0.875	3,000	3,005	330,927	2017/5/15
		0.875 T-NOTE 170615	0.875	1,100	1,101	121,292	2017/6/15
		0.875 T-NOTE 170715	0.875	500	500	55,122	2017/7/15
		0.875 T-NOTE 170815	0.875	900	901	99,220	2017/8/15
		0.875 T-NOTE 171015	0.875	2,000	2,001	220,386	2017/10/15
		0.875 T-NOTE 171115	0.875	400	400	44,065	2017/11/15
		0.875 T-NOTE 180131	0.875	1,200	1,200	132,144	2018/1/31
		0.875 T-NOTE 181015	0.875	2,400	2,395	263,689	2018/10/15
		0.875 T-NOTE 190415	0.875	1,500	1,492	164,341	2019/4/15
		0.875 T-NOTE 190731	0.875	200	198	21,879	2019/7/31
		1 T-NOTE 170915	1.0	500	501	55,201	2017/9/15
		1 T-NOTE 171215	1.0	300	300	33,108	2017/12/15
		1 T-NOTE 180315	1.0	200	200	22,065	2018/3/15
		1 T-NOTE 180815	1.0	700	700	77,168	2018/8/15
		1 T-NOTE 180915	1.0	2,300	2,302	253,493	2018/9/15
		1 T-NOTE 190630	1.0	700	698	76,924	2019/6/30
		1 T-NOTE 190831	1.0	700	697	76,804	2019/8/31
		1 T-NOTE 190930	1.0	700	697	76,786	2019/9/30
		1 T-NOTE 191130	1.0	900	895	98,601	2019/11/30
		1.125 T-NOTE 180615	1.125	1,200	1,205	132,701	2018/6/15
		1.125 T-NOTE 190531	1.125	100	100	11,035	2019/5/31
		1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,000	998	109,926	2019/12/31
		1.125 T-NOTE 200331	1.125	900	897	98,813	2020/3/31
		1.125 T-NOTE 210228	1.125	2,200	2,176	239,605	2021/2/28
		1.25 T-NOTE 181031	1.25	300	302	33,251	2018/10/31
		1.25 T-NOTE 181115	1.25	2,300	2,315	254,918	2018/11/15
		1.25 T-NOTE 181130	1.25	800	805	88,670	2018/11/30
		1.25 T-NOTE 181215	1.25	1,300	1,308	144,084	2018/12/15
		1.25 T-NOTE 190131	1.25	2,000	2,013	221,624	2019/1/31
		1.25 T-NOTE 190430	1.25	800	805	88,629	2019/4/30

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	1.25 T-NOTE 191031	1.25	900	903	99,452	2019/10/31
		1.25 T-NOTE 200131	1.25	1,500	1,503	165,522	2020/1/31
		1.25 T-NOTE 200229	1.25	100	100	11,031	2020/2/29
		1.25 T-NOTE 210331	1.25	1,300	1,292	142,289	2021/3/31
		1.375 T-NOTE 180731	1.375	1,300	1,312	144,514	2018/7/31
		1.375 T-NOTE 180930	1.375	2,700	2,726	300,192	2018/9/30
		1.375 T-NOTE 181130	1.375	1,100	1,111	122,314	2018/11/30
		1.375 T-NOTE 181231	1.375	1,400	1,413	155,649	2018/12/31
		1.375 T-NOTE 190228	1.375	1,700	1,716	189,002	2019/2/28
		1.375 T-NOTE 200131	1.375	800	805	88,705	2020/1/31
		1.375 T-NOTE 200229	1.375	1,500	1,509	166,167	2020/2/29
		1.375 T-NOTE 200331	1.375	1,900	1,911	210,412	2020/3/31
		1.375 T-NOTE 200430	1.375	1,900	1,910	210,314	2020/4/30
		1.375 T-NOTE 200831	1.375	600	601	66,244	2020/8/31
		1.375 T-NOTE 200930	1.375	2,400	2,405	264,855	2020/9/30
		1.375 T-NOTE 201031	1.375	3,100	3,106	341,945	2020/10/31
		1.375 T-NOTE 210131	1.375	2,100	2,101	231,315	2021/1/31
		1.5 T-NOTE 180831	1.5	1,000	1,012	111,517	2018/8/31
		1.5 T-NOTE 181231	1.5	1,500	1,519	167,328	2018/12/31
		1.5 T-NOTE 190131	1.5	2,300	2,330	256,569	2019/1/31
		1.5 T-NOTE 190228	1.5	1,500	1,520	167,354	2019/2/28
		1.5 T-NOTE 190331	1.5	900	912	100,451	2019/3/31
		1.5 T-NOTE 190531	1.5	1,700	1,722	189,645	2019/5/31
		1.5 T-NOTE 191031	1.5	1,800	1,822	200,592	2019/10/31
		1.5 T-NOTE 191130	1.5	500	506	55,713	2019/11/30
		1.5 T-NOTE 200531	1.5	1,900	1,917	211,148	2020/5/31
		1.5 T-NOTE 220131	1.5	400	399	44,032	2022/1/31
		1.5 T-NOTE 230331	1.5	1,100	1,089	119,888	2023/3/31
		1.625 T-NOTE 190331	1.625	1,300	1,321	145,532	2019/3/31
		1.625 T-NOTE 190430	1.625	1,400	1,423	156,738	2019/4/30
		1.625 T-NOTE 190630	1.625	1,900	1,932	212,782	2019/6/30
		1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,400	1,423	156,762	2019/7/31
		1.625 T-NOTE 190831	1.625	3,400	3,457	380,666	2019/8/31
		1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,300	1,321	145,431	2019/12/31
		1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,800	1,823	200,731	2020/11/30
		1.625 T-NOTE 220815	1.625	600	602	66,286	2022/8/15
		1.625 T-NOTE 221115	1.625	2,200	2,202	242,425	2022/11/15
		1.625 T-NOTE 260215	1.625	1,100	1,076	118,554	2026/2/15
		1.75 T-NOTE 181031	1.75	1,100	1,121	123,416	2018/10/31
		1.75 T-NOTE 190930	1.75	500	510	56,188	2019/9/30
		1.75 T-NOTE 201031	1.75	1,500	1,527	168,140	2020/10/31
		1.75 T-NOTE 220228	1.75	300	303	33,457	2022/2/28
		1.75 T-NOTE 220331	1.75	1,400	1,417	156,064	2022/3/31
		1.75 T-NOTE 220430	1.75	1,200	1,214	133,687	2022/4/30
		1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,400	1,417	156,040	2022/5/15

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	1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,400	1,412	155,534	2022/9/30
		1.75 T-NOTE 230131	1.75	1,300	1,309	144,134	2023/1/31
		1.75 T-NOTE 230515	1.75	2,100	2,113	232,688	2023/5/15
		1.875 T-NOTE 170831	1.875	1,500	1,521	167,450	2017/8/31
		1.875 T-NOTE 170930	1.875	1,700	1,724	189,879	2017/9/30
		1.875 T-NOTE 171031	1.875	1,700	1,725	189,982	2017/10/31
		1.875 T-NOTE 200630	1.875	2,900	2,971	327,130	2020/6/30
		1.875 T-NOTE 211130	1.875	700	715	78,724	2021/11/30
		1.875 T-NOTE 220531	1.875	100	101	11,215	2022/5/31
		1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,300	1,322	145,599	2022/8/31
		1.875 T-NOTE 221031	1.875	1,400	1,423	156,666	2022/10/31
		2 T-NOTE 200731	2.0	900	926	101,976	2020/7/31
		2 T-NOTE 200930	2.0	1,000	1,029	113,332	2020/9/30
		2 T-NOTE 201130	2.0	800	823	90,617	2020/11/30
		2 T-NOTE 210228	2.0	800	823	90,652	2021/2/28
		2 T-NOTE 210531	2.0	1,700	1,749	192,650	2021/5/31
		2 T-NOTE 210831	2.0	1,300	1,336	147,170	2021/8/31
		2 T-NOTE 211031	2.0	1,200	1,233	135,792	2021/10/31
		2 T-NOTE 211115	2.0	1,500	1,542	169,856	2021/11/15
		2 T-NOTE 220215	2.0	1,400	1,438	158,376	2022/2/15
		2 T-NOTE 220731	2.0	1,800	1,845	203,177	2022/7/31
		2 T-NOTE 221130	2.0	1,300	1,330	146,482	2022/11/30
		2 T-NOTE 230215	2.0	3,900	3,992	439,581	2023/2/15
		2 T-NOTE 250215	2.0	2,600	2,640	290,728	2025/2/15
		2 T-NOTE 250815	2.0	3,700	3,751	413,029	2025/8/15
		2.125 T-NOTE 200831	2.125	1,600	1,654	182,157	2020/8/31
		2.125 T-NOTE 210131	2.125	100	103	11,391	2021/1/31
		2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,400	1,449	159,568	2021/6/30
		2.125 T-NOTE 210815	2.125	2,000	2,069	227,869	2021/8/15
		2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,200	1,241	136,659	2021/9/30
		2.125 T-NOTE 211231	2.125	800	827	91,078	2021/12/31
		2.125 T-NOTE 220630	2.125	2,400	2,480	273,071	2022/6/30
		2.125 T-NOTE 221231	2.125	500	515	56,769	2022/12/31
		2.125 T-NOTE 250515	2.125	3,000	3,075	338,604	2025/5/15
		2.25 T-NOTE 171130	2.25	900	919	101,217	2017/11/30
		2.25 T-NOTE 180731	2.25	1,200	1,234	135,926	2018/7/31
		2.25 T-NOTE 210331	2.25	200	208	22,922	2021/3/31
		2.25 T-NOTE 210430	2.25	1,600	1,666	183,437	2021/4/30
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	2,000	2,073	228,230	2024/11/15
		2.25 T-NOTE 251115	2.25	3,500	3,621	398,650	2025/11/15
		2.375 T-NOTE 170731	2.375	1,600	1,630	179,515	2017/7/31
		2.375 T-NOTE 180531	2.375	300	308	34,007	2018/5/31
		2.375 T-NOTE 180630	2.375	100	103	11,343	2018/6/30
		2.375 T-NOTE 201231	2.375	2,100	2,196	241,809	2020/12/31
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	2,200	2,303	253,569	2024/8/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	2.5 T-BOND 450215	2.5	2,650	2,577	283,784	2045/2/15
		2.5 T-BOND 460215	2.5	900	874	96,232	2046/2/15
		2.5 T-NOTE 170630	2.5	1,800	1,835	202,024	2017/6/30
		2.5 T-NOTE 230815	2.5	2,200	2,325	255,973	2023/8/15
		2.5 T-NOTE 240515	2.5	2,100	2,219	244,355	2024/5/15
		2.625 T-NOTE 180131	2.625	1,000	1,029	113,328	2018/1/31
		2.625 T-NOTE 180430	2.625	700	723	79,657	2018/4/30
		2.625 T-NOTE 200815	2.625	2,200	2,320	255,481	2020/8/15
		2.625 T-NOTE 201115	2.625	1,200	1,267	139,513	2020/11/15
		2.75 T-BOND 420815	2.75	600	619	68,205	2042/8/15
		2.75 T-BOND 421115	2.75	1,400	1,442	158,809	2042/11/15
		2.75 T-NOTE 170531	2.75	1,300	1,327	146,124	2017/5/31
		2.75 T-NOTE 171231	2.75	500	515	56,722	2017/12/31
		2.75 T-NOTE 180228	2.75	1,000	1,033	113,766	2018/2/28
		2.75 T-NOTE 190215	2.75	1,000	1,047	115,349	2019/2/15
		2.75 T-NOTE 231115	2.75	2,400	2,579	284,011	2023/11/15
		2.75 T-NOTE 240215	2.75	1,700	1,827	201,233	2024/2/15
		2.875 T-BOND 430515	2.875	2,800	2,949	324,724	2043/5/15
		2.875 T-BOND 450815	2.875	1,400	1,469	161,735	2045/8/15
		2.875 T-NOTE 180331	2.875	500	518	57,081	2018/3/31
		3 T-BOND 420515	3.0	100	108	11,927	2042/5/15
		3 T-BOND 441115	3.0	2,300	2,476	272,692	2044/11/15
		3 T-BOND 450515	3.0	2,100	2,259	248,762	2045/5/15
		3 T-BOND 451115	3.0	1,200	1,290	142,098	2045/11/15
		3.125 T-BOND 411115	3.125	800	887	97,691	2041/11/15
		3.125 T-BOND 420215	3.125	350	388	42,757	2042/2/15
		3.125 T-BOND 430215	3.125	2,100	2,322	255,644	2043/2/15
		3.125 T-BOND 440815	3.125	2,300	2,537	279,378	2044/8/15
		3.125 T-NOTE 170430	3.125	1,600	1,637	180,217	2017/4/30
		3.125 T-NOTE 190515	3.125	1,600	1,698	186,987	2019/5/15
		3.125 T-NOTE 210515	3.125	1,600	1,733	190,854	2021/5/15
		3.375 T-BOND 440515	3.375	2,200	2,543	280,060	2044/5/15
		3.375 T-NOTE 191115	3.375	500	538	59,298	2019/11/15
		3.5 T-BOND 390215	3.5	500	594	65,434	2039/2/15
		3.5 T-NOTE 180215	3.5	800	836	92,114	2018/2/15
		3.5 T-NOTE 200515	3.5	1,400	1,523	167,720	2020/5/15
		3.625 T-BOND 430815	3.625	1,300	1,574	173,328	2043/8/15
		3.625 T-BOND 440215	3.625	1,300	1,572	173,115	2044/2/15
		3.625 T-NOTE 190815	3.625	800	864	95,214	2019/8/15
		3.625 T-NOTE 200215	3.625	1,900	2,070	227,947	2020/2/15
		3.625 T-NOTE 210215	3.625	2,100	2,317	255,120	2021/2/15
		3.75 T-BOND 410815	3.75	950	1,167	128,546	2041/8/15
		3.75 T-BOND 431115	3.75	300	371	40,925	2043/11/15
		3.75 T-NOTE 181115	3.75	1,800	1,924	211,886	2018/11/15
		3.875 T-BOND 400815	3.875	800	1,001	110,296	2040/8/15

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	3.875 T-NOTE 180515	3.875	700	742	81,695	2018/5/15
		4 T-NOTE 180815	4.0	1,300	1,390	153,118	2018/8/15
		4.25 T-BOND 390515	4.25	500	660	72,745	2039/5/15
		4.25 T-BOND 401115	4.25	300	396	43,657	2040/11/15
		4.25 T-NOTE 171115	4.25	1,500	1,575	173,501	2017/11/15
		4.375 T-BOND 380215	4.375	500	674	74,216	2038/2/15
		4.375 T-BOND 391115	4.375	500	672	74,005	2039/11/15
		4.375 T-BOND 400515	4.375	800	1,076	118,491	2040/5/15
		4.375 T-BOND 410515	4.375	800	1,078	118,704	2041/5/15
		4.5 T-BOND 360215	4.5	600	820	90,308	2036/2/15
		4.5 T-BOND 380515	4.5	400	548	60,370	2038/5/15
		4.5 T-BOND 390815	4.5	700	958	105,498	2039/8/15
		4.5 T-NOTE 170515	4.5	1,100	1,141	125,626	2017/5/15
		4.625 T-BOND 400215	4.625	900	1,252	137,846	2040/2/15
		4.75 T-BOND 410215	4.75	400	567	62,493	2041/2/15
		4.75 T-NOTE 170815	4.75	1,000	1,049	115,564	2017/8/15
		5 T-BOND 370515	5.0	400	583	64,223	2037/5/15
		5.25 T-BOND 281115	5.25	300	407	44,862	2028/11/15
		5.25 T-BOND 290215	5.25	50	68	7,503	2029/2/15
		5.375 T-BOND 310215	5.375	600	853	93,920	2031/2/15
		5.5 T-BOND 280815	5.5	100	138	15,204	2028/8/15
		6 T-BOND 260215	6.0	1,700	2,335	257,064	2026/2/15
		6.125 T-BOND 271115	6.125	300	429	47,246	2027/11/15
		6.25 T-BOND 230815	6.25	300	394	43,427	2023/8/15
		6.25 T-BOND 300515	6.25	600	907	99,906	2030/5/15
		6.5 T-BOND 261115	6.5	400	576	63,470	2026/11/15
		8 T-BOND 211115	8.0	700	942	103,746	2021/11/15
		8.125 T-BOND 190815	8.125	300	366	40,401	2019/8/15
		8.75 T-BOND 170515	8.75	500	539	59,437	2017/5/15
		8.75 T-BOND 200815	8.75	700	915	100,826	2020/8/15
		8.875 T-BOND 190215	8.875	600	728	80,206	2019/2/15
小計						31,144,976	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	0.25 CAN GOVT 170501	0.25	300	299	25,158	2017/5/1
		0.25 CAN GOVT 180501	0.25	200	198	16,705	2018/5/1
		0.75 CAN GOVT 200901	0.75	600	601	50,570	2020/9/1
		0.75 CAN GOVT 210301	0.75	300	299	25,236	2021/3/1
		1.25 CAN GOVT 170801	1.25	400	403	33,906	2017/8/1
		1.25 CAN GOVT 180201	1.25	400	404	34,006	2018/2/1
		1.25 CAN GOVT 180301	1.25	800	808	68,059	2018/3/1
		1.25 CAN GOVT 180901	1.25	400	405	34,131	2018/9/1
		1.5 CAN GOVT 170901	1.5	900	910	76,568	2017/9/1
		1.5 CAN GOVT 200301	1.5	500	515	43,358	2020/3/1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	500	516	43,426	2023/6/1
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	500	507	42,689	2026/6/1

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	500	515	43,379	2019/3/1
		1.75 CAN GOVT 190901	1.75	400	414	34,840	2019/9/1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	500	543	45,725	2025/6/1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	650	718	60,418	2024/6/1
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	600	664	55,908	2022/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	330	389	32,738	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	200	249	21,029	2064/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	500	560	47,178	2021/6/1
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	500	555	46,732	2020/6/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	630	843	70,996	2045/12/1
		3.75 CAN GOVT 190601	3.75	900	983	82,719	2019/6/1
		4 CAN GOVT 170601	4.0	900	931	78,341	2017/6/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	850	1,184	99,630	2041/6/1
		4.25 CAN GOVT 180601	4.25	800	858	72,201	2018/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	470	714	60,134	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	450	666	56,073	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	520	815	68,591	2033/6/1
		8 CAN GOVT 270601	8.0	100	166	14,021	2027/6/1
小計						1,484,480	
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	11,200	14,193	84,874	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	2,400	3,271	19,565	2036/11/20
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	7,600	7,596	45,427	2018/6/14
		5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	2,100	2,115	12,649	2017/6/15
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	4,900	4,843	28,961	2019/12/11
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	1,800	1,751	10,475	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	9,500	9,857	58,945	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	4,200	4,347	25,995	2022/6/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	4,000	4,382	26,210	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	7,900	8,325	49,787	2017/12/14
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	5,900	6,546	39,148	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	3,400	3,775	22,576	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	6,000	6,713	40,143	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	5,900	6,447	38,558	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	3,400	3,823	22,865	2023/12/7
		8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	12,100	13,128	78,509	2018/12/13
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	4,100	4,849	28,997	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	4,900	5,877	35,146	2038/11/18
小計						668,839	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 OBL 200417	－	1,100	1,119	138,021	2020/4/17
		0 OBL 210409	－	700	712	87,801	2021/4/9
		0 SCHATS 170616	－	400	402	49,575	2017/6/16
		0 SCHATS 170915	－	600	603	74,459	2017/9/15
		0 SCHATS 171215	－	100	100	12,424	2017/12/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	0.25 OBL 180413	0.25	1,000	1,014	125,061	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	500	512	63,199	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	400	411	50,764	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	1,000	1,041	128,340	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	500	515	63,603	2026/2/15
		0.5 OBL 171013	0.5	800	811	99,999	2017/10/13
		0.5 OBL 180223	0.5	1,100	1,119	138,008	2018/2/23
		0.5 OBL 190412	0.5	900	926	114,202	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	1,000	1,085	133,832	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	900	974	120,144	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	700	725	89,437	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,000	1,042	128,457	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	800	888	109,590	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	600	669	82,511	2023/2/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,000	1,126	138,819	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,200	1,348	166,287	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,100	1,258	155,176	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	900	1,017	125,458	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	800	926	114,181	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	800	893	110,118	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	700	796	98,243	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	700	794	97,958	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	800	1,127	139,049	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	600	856	105,648	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,300	1,485	183,189	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	1,000	1,136	140,083	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	600	711	87,740	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	600	940	115,911	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	700	787	97,113	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	700	778	95,991	2019/1/4
		4 BUND 180104	4.0	800	858	105,882	2018/1/4
		4 BUND 370104	4.0	1,230	2,009	247,709	2037/1/4
		4.25 BUND 170704	4.25	800	842	103,880	2017/7/4
		4.25 BUND 180704	4.25	1,000	1,101	135,762	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	500	869	107,179	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	400	614	75,730	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	850	1,455	179,459	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	500	935	115,322	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	700	1,200	148,014	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	700	1,132	139,618	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	600	893	110,153	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	400	715	88,204	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	400	678	83,613	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	500	502	61,979	2018/5/15
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	100	101	12,475	2020/11/1

銘柄				当期末				
				利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	イタリア	国債証券	0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	700	711	87,771	2020/5/1
			0.75 ITALY GOVT 180115	0.75	900	911	112,416	2018/1/15
			0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	300	300	37,026	2023/3/15
			1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	1,200	1,237	152,544	2019/12/1
			1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	900	932	114,996	2022/4/15
			1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	500	519	64,080	2022/9/15
			1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	600	626	77,218	2019/8/1
			1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	900	908	111,939	2025/6/1
			1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	700	702	86,619	2026/6/1
			2 ITALY GOVT 251201	2.0	600	627	77,315	2025/12/1
			2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	900	974	120,194	2021/12/15
			2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	700	749	92,375	2019/5/1
			2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	900	984	121,381	2024/12/1
			2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	400	402	49,620	2047/3/1
			3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	600	675	83,295	2046/9/1
			3.5 ITALY GOVT 171101	3.5	1,000	1,051	129,616	2017/11/1
			3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	1,100	1,177	145,222	2018/6/1
			3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,100	1,196	147,507	2018/12/1
			3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	700	833	102,692	2030/3/1
			3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	900	1,040	128,243	2021/3/1
			3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	600	695	85,680	2021/5/1
			3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	900	1,047	129,175	2021/8/1
			3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	800	953	117,545	2024/9/1
			4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,000	1,155	142,468	2020/9/1
			4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,050	1,327	163,617	2037/2/1
			4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	1,200	1,336	164,704	2019/2/1
			4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	600	680	83,872	2019/9/1
			4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,400	1,612	198,791	2020/3/1
			4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	1,600	1,722	212,406	2018/2/1
			4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	900	988	121,891	2018/8/1
			4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	800	898	110,794	2019/3/1
			4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	1,200	1,389	171,324	2020/2/1
			4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	900	1,115	137,480	2023/5/1
			4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,100	1,370	168,933	2024/3/1
			4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	800	1,015	125,198	2026/3/1
			4.75 ITALY GOVT 170601	4.75	600	629	77,651	2017/6/1
			4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	1,300	1,583	195,153	2021/9/1
			4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,000	1,261	155,474	2023/8/1
			4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	900	1,188	146,512	2028/9/1
			4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	800	1,138	140,312	2044/9/1
			5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,000	1,243	153,274	2022/3/1
			5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,200	1,558	192,191	2025/3/1
			5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,350	1,902	234,497	2034/8/1
			5 ITALY GOVT 390801	5.0	900	1,296	159,848	2039/8/1
			5 ITALY GOVT 400901	5.0	900	1,294	159,643	2040/9/1

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
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	1,400	1,489	183,603	2017/8/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	1,300	1,810	223,255	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	900	1,158	142,856	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	900	1,161	143,211	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,100	1,652	203,689	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	800	1,207	148,858	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	800	1,190	146,787	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	400	616	75,979	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	300	469	57,876	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O.A.T 180225	－	200	201	24,847	2018/2/25
		0 O.A.T 190225	－	200	202	24,907	2019/2/25
		0 O.A.T 200525	－	700	708	87,284	2020/5/25
		0.25 O.A.T 201125	0.25	600	612	75,554	2020/11/25
		0.5 O.A.T 191125	0.5	1,200	1,235	152,292	2019/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	1,500	1,519	187,360	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	400	399	49,287	2026/5/25
		1 BTAN 170725	1.0	700	712	87,780	2017/7/25
		1 O.A.T 180525	1.0	1,300	1,337	164,831	2018/5/25
		1 O.A.T 181125	1.0	1,000	1,035	127,637	2018/11/25
		1 O.A.T 190525	1.0	700	729	89,881	2019/5/25
		1 O.A.T 251125	1.0	800	842	103,905	2025/11/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	300	299	36,910	2036/5/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	1,400	1,567	193,234	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	1,300	1,462	180,329	2024/11/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	1,100	1,260	155,427	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	1,500	1,747	215,422	2024/5/25
		2.5 O.A.T 201025	2.5	1,900	2,132	262,890	2020/10/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	1,400	1,701	209,759	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	1,200	1,478	182,234	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	1,700	2,011	248,001	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	1,750	2,072	255,554	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	650	922	113,711	2045/5/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	1,800	2,070	255,245	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	1,700	2,203	271,652	2026/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	1,600	1,826	225,158	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	1,600	1,912	235,750	2021/4/25
		4 O.A.T 180425	4.0	1,600	1,737	214,142	2018/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	750	1,144	141,149	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	650	1,088	134,136	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	600	1,019	125,660	2060/4/25
		4.25 O.A.T 171025	4.25	1,700	1,814	223,701	2017/10/25
		4.25 O.A.T 181025	4.25	1,500	1,670	205,917	2018/10/25
		4.25 O.A.T 190425	4.25	1,200	1,363	168,114	2019/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	1,700	2,226	274,450	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	1,500	2,500	308,280	2041/4/25

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	4.75 O.A.T 350425	4.75	1,350	2,184	269,313	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	1,300	2,063	254,387	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	1,250	2,158	266,099	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	800	1,219	150,347	2025/10/25
		8.5 O.A.T 191025	8.5	500	652	80,464	2019/10/25
		8.5 O.A.T 230425	8.5	600	953	117,520	2023/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	－	300	302	37,302	2018/4/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	500	512	63,137	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	600	599	73,923	2025/7/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	1,000	1,028	126,787	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	400	418	51,553	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	500	563	69,455	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	900	1,038	127,972	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	600	688	84,833	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	500	639	78,819	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	450	654	80,717	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	800	945	116,534	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	800	929	114,596	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	550	690	85,161	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	650	1,070	131,993	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	1,000	1,096	135,145	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	600	684	84,378	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	600	963	118,740	2037/1/15
		4.5 NETH GOVT 170715	4.5	300	317	39,103	2017/7/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	700	1,103	135,980	2028/1/15
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	200	201	24,806	2018/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25	100	100	12,400	2019/1/31
		0.5 SPAIN GOVT 171031	0.5	700	705	87,029	2017/10/31
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	200	206	25,469	2020/7/30
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	1,400	1,458	179,858	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,100	1,116	137,676	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	600	619	76,379	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	400	395	48,784	2030/7/30
		2.1 SPAIN GOVT 170430	2.1	800	816	100,714	2017/4/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	600	633	78,084	2025/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	700	754	93,005	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	1,300	1,443	177,949	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	150	152	18,805	2046/10/31
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	1,200	1,310	161,553	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,100	1,309	161,495	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	1,200	1,372	169,209	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	1,100	1,199	147,914	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	600	765	94,353	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	900	1,026	126,529	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	500	618	76,224	2023/10/31

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	900	969	119,556	2018/1/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	600	684	84,419	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	700	890	109,781	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	700	962	118,644	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	800	1,013	124,971	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	800	955	117,826	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	750	1,054	130,017	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	700	949	117,103	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	400	590	72,757	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	900	1,163	143,427	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 170730	5.5	1,000	1,066	131,527	2017/7/30
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	1,100	1,368	168,737	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	800	1,192	147,058	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,100	1,421	175,212	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	400	559	68,940	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,000	1,459	179,920	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	600	621	76,579	2025/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	500	577	71,218	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	800	951	117,328	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	500	557	68,676	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	300	391	48,230	2034/6/22
		3.5 BEL GOVT 170628	3.5	700	730	90,093	2017/6/28
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	800	942	116,164	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	400	614	75,706	2045/6/22
		4 BEL GOVT 180328	4.0	700	758	93,471	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	600	676	83,410	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	800	994	122,584	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	350	504	62,146	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	600	743	91,620	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	600	764	94,294	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	800	1,286	158,557	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	400	557	68,671	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,050	1,736	214,029	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 170928	5.5	300	324	39,987	2017/9/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,000	1,549	191,034	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	100	102	12,589	2019/10/18
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	300	306	37,766	2026/10/20
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	400	415	51,193	2018/10/19
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	200	215	26,550	2025/10/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	800	897	110,606	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	300	338	41,703	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	400	428	52,864	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	200	245	30,238	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	300	432	53,301	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	300	368	45,399	2022/11/22

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	700	838	103,356	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	500	612	75,496	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	150	261	32,211	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	700	823	101,535	2020/7/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	500	781	96,337	2037/3/15
		4.3 AUSTRIA GOVT 170915	4.3	100	106	13,103	2017/9/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	600	680	83,898	2019/3/15
		4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	500	542	66,863	2018/1/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	300	429	52,887	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	200	325	40,066	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	300	308	38,019	2020/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	150	148	18,272	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	100	104	12,895	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	200	207	25,560	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	100	110	13,583	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	200	221	27,260	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	200	229	28,238	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	250	339	41,845	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	200	249	30,796	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	200	229	28,232	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	300	354	43,737	2021/4/15
		3.875 FINNISH GOVT170915	3.875	300	317	39,114	2017/9/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	350	466	57,565	2025/7/4
		4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	300	345	42,542	2019/7/4
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	200	206	25,501	2022/3/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	300	310	38,304	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	400	458	56,481	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	300	364	44,876	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	200	247	30,516	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	300	342	42,259	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	500	557	68,768	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	400	471	58,141	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	400	488	60,185	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	450	627	77,358	2025/3/13
		5.5 IRISH GOVT 171018	5.5	300	324	40,035	2017/10/18
		5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	300	361	44,606	2019/10/18
小計						29,573,339	
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	1,300	1,309	210,537	2017/9/7
		1.25 GILT 180722	1.25	1,300	1,322	212,626	2018/7/22
		1.5 GILT 210122	1.5	400	411	66,133	2021/1/22
		1.75 GILT 190722	1.75	1,200	1,242	199,771	2019/7/22
		1.75 GILT 220907	1.75	1,000	1,041	167,448	2022/9/7
		2 GILT 200722	2.0	1,500	1,575	253,185	2020/7/22
		2 GILT 250907	2.0	900	943	151,694	2025/9/7

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
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	2.25 GILT 230907	2.25	800	857	137,899	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	200	221	35,604	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	1,000	1,110	178,530	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	1,250	1,488	239,316	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	680	848	136,390	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	1,000	1,424	228,879	2068/7/22
		3.75 GILT 190907	3.75	500	552	88,779	2019/9/7
		3.75 GILT 200907	3.75	1,000	1,128	181,303	2020/9/7
		3.75 GILT 210907	3.75	700	803	129,134	2021/9/7
		3.75 GILT 520722	3.75	670	929	149,364	2052/7/22
		4 GILT 220307	4.0	650	762	122,600	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	390	595	95,653	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	600	765	123,035	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	800	1,046	168,265	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	900	1,199	192,777	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	590	803	129,097	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	900	1,237	198,888	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	800	1,145	184,100	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	700	1,033	166,094	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	520	811	130,413	2055/12/7
		4.5 GILT 190307	4.5	700	779	125,241	2019/3/7
		4.5 GILT 340907	4.5	900	1,225	197,015	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	1,000	1,443	231,933	2042/12/7
		4.75 GILT 200307	4.75	800	923	148,373	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75	750	1,022	164,378	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	470	679	109,220	2038/12/7
		5 GILT 180307	5.0	1,000	1,084	174,239	2018/3/7
		5 GILT 250307	5.0	800	1,043	167,750	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	600	896	144,121	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	550	744	119,607	2021/6/7
小計						5,859,411	
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	180	204	22,743	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	250	282	31,327	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 180108	3.0	330	350	38,950	2018/1/8
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	110	122	13,637	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	190	249	27,727	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	250	375	41,713	2028/4/8
		4.25 SWISS GOVT 170605	4.25	170	178	19,869	2017/6/5
小計						195,968	
スウェーデン				千ｽｳｪｰﾃﾞﾝｸﾛｰﾈ	千ｽｳｪｰﾃﾞﾝｸﾛｰﾈ		
	国債証券	1 SWD GOVT 261112	1.0	1,700	1,737	22,906	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	3,300	3,575	47,129	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	2,400	2,812	37,070	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	3,700	4,446	58,601	2022/6/1

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
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	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	2,000	2,679	35,311	2039/3/30
		3.75 SWD GOVT 170812	3.75	2,400	2,528	33,322	2017/8/12
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	4,200	4,756	62,686	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	3,900	4,818	63,511	2020/12/1
小計						360,539	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	850	857	11,288	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	1,600	1,654	21,795	2025/3/13
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	2,200	2,330	30,695	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	2,000	2,264	29,819	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	3,200	3,643	47,985	2021/5/25
		4.25 NORWE GOVT 170519	4.25	2,400	2,485	32,736	2017/5/19
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	3,100	3,456	45,515	2019/5/22
小計						219,836	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	0.25 DMK GOVT 181115	0.25	1,500	1,521	25,229	2018/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	2,900	3,183	52,786	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	2,700	3,021	50,104	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	4,100	4,787	79,374	2021/11/15
		4 DMK GOVT 171115	4.0	1,700	1,813	30,063	2017/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	4,200	4,831	80,105	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	5,350	9,297	154,152	2039/11/15
		7 DMK GOVT 241110	7.0	800	1,259	20,886	2024/11/10
小計						492,702	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	1,000	980	27,406	2020/4/25
		1.75 POLAND 210725	1.75	200	193	5,417	2021/7/25
		2 POLAND 210425	2.0	1,200	1,186	33,150	2021/4/25
		2.5 POLAND 180725	2.5	900	916	25,607	2018/7/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	750	715	19,988	2026/7/25
		3.25 POLAND 190725	3.25	900	939	26,264	2019/7/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	1,150	1,181	33,010	2025/7/25
		3.75 POLAND 180425	3.75	900	936	26,186	2018/4/25
		4 POLAND 231025	4.0	1,200	1,300	36,355	2023/10/25
		5.25 POLAND 171025	5.25	1,300	1,368	38,246	2017/10/25
		5.25 POLAND 201025	5.25	1,000	1,134	31,716	2020/10/25
		5.5 POLAND 191025	5.5	900	1,008	28,192	2019/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	800	938	26,242	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	1,000	1,188	33,212	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	5.75	500	627	17,535	2029/4/25
		POLAND 170725	—	300	294	8,244	2017/7/25
		POLAND 181025	—	300	288	8,055	2018/10/25
小計						424,834	
オーストラリア				千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	1.75	600	598	47,693	2020/11/21

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
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 191021	2.75	700	725	57,756	2019/10/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,200	1,245	99,169	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	500	513	40,920	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	250	241	19,210	2035/6/21
		3.25 AUST GOVT 181021	3.25	600	622	49,579	2018/10/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,000	1,076	85,693	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	300	321	25,598	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	220	223	17,824	2039/6/21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	380	421	33,530	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 170721	4.25	700	720	57,376	2017/7/21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,100	1,283	102,206	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 200415	4.5	900	995	79,234	2020/4/15
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	450	551	43,929	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,000	1,223	97,414	2027/4/21
		5.25 AUST GOVT 190315	5.25	1,000	1,099	87,526	2019/3/15
		5.5 AUST GOVT 180121	5.5	1,000	1,062	84,624	2018/1/21
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	850	1,034	82,414	2023/4/21
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,000	1,184	94,309	2021/5/15
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	900	1,093	87,091	2022/7/15
小計						1,293,106	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	0.5 SINGAPORGOVT 180401	0.5	200	197	15,808	2018/4/1
		1.375 SINGAPORGOV 171001	1.375	130	130	10,448	2017/10/1
		1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	110	111	8,892	2019/10/1
		2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	150	153	12,270	2020/7/1
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	290	298	23,845	2021/6/1
		2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	50	51	4,084	2025/6/1
		2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	220	228	18,243	2019/6/1
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	130	136	10,935	2023/7/1
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	250	260	20,796	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	50	52	4,154	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	100	106	8,485	2029/7/1
		2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	160	169	13,521	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	350	375	29,976	2024/9/1
		3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	200	215	17,215	2022/9/1
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	200	215	17,177	2020/9/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	90	101	8,106	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	200	224	17,918	2027/3/1
		4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	160	170	13,619	2018/9/1
小計						255,501	
マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	3.26 MALAYSIAGOVT 180301	3.26	400	402	10,877	2018/3/1
		3.314 MALAYSIA 171031	3.314	600	603	16,302	2017/10/31
		3.418MALAYSIAGOVT 220815	3.418	500	490	13,251	2022/8/15
		3.48 MALAYSIAGOVT 230315	3.48	400	391	10,585	2023/3/15

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
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	3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	700	702	18,985	2020/3/31
		3.502MALAYSIAGOVT 270531	3.502	500	473	12,786	2027/5/31
		3.654 MALAYSIAGOV 191031	3.654	200	202	5,464	2019/10/31
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	100	95	2,593	2028/6/15
		3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	500	500	13,517	2022/9/30
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	200	188	5,091	2033/4/15
		3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	600	611	16,520	2020/7/31
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	500	486	13,142	2027/3/15
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	500	504	13,627	2025/9/15
		4.012 MALAYSIAGOV 170915	4.012	500	507	13,706	2017/9/15
		4.048 MALAYSIA 210930	4.048	600	612	16,549	2021/9/30
		4.127 MALAYSIA 320415	4.127	500	488	13,215	2032/4/15
		4.16 MALAYSIAGOVT 210715	4.16	600	616	16,664	2021/7/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	500	509	13,772	2024/7/15
		4.24 MALAYSIAGOVT 180207	4.24	800	817	22,104	2018/2/7
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	200	198	5,366	2035/5/31
		4.378MALAYSIAGOVT 191129	4.378	1,200	1,240	33,539	2019/11/29
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	300	309	8,362	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	500	512	13,865	2030/4/15
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	400	413	11,175	2043/9/30
		5.734MALAYSIAGOVT 190730	5.734	300	321	8,693	2019/7/30
小計						329,762	
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	7,300	7,798	54,352	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	3,500	2,382	16,607	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	4,000	2,698	18,811	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	2,800	2,561	17,855	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	4,400	3,419	23,833	2031/2/28
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	2,900	2,761	19,247	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	2,400	2,226	15,515	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	2,200	2,175	15,164	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	3,000	2,584	18,011	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	1,700	1,703	11,872	2017/9/15
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	3,000	2,586	18,030	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	3,500	3,017	21,031	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	1,700	1,476	10,293	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	4,300	3,720	25,933	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	800	721	5,025	2035/2/28
		9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	700	627	4,376	2040/1/31
小計						295,964	
合計						72,599,265	

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

○投資信託財産の構成

（2016年５月20日現在）

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
公社債	72,599,265	98.3
コール・ローン等、その他	1,263,043	1.7
投資信託財産総額	73,862,308	100.0

（注）期末における外貨建純資産（73,799,116千円）の投資信託財産総額（73,862,308千円）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＝110.09円	１カナダドル＝84.13円	１メキシコペソ＝5.98円	１ユーロ＝123.28円
１イギリスポンド＝160.73円	１スイスフラン＝111.03円	１スウェーデンクローネ＝13.18円	１ノルウェークローネ＝13.17円
１デンマーククローネ＝16.58円	１ポーランドズロチ＝27.95円	１オーストラリアドル＝79.63円	１シンガポールドル＝79.85円
１マレーシアリンギット＝27.03円	１南アフリカランド＝6.97円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年５月20日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	74,227,871,302
コール・ローン等	349,393,660
公社債(評価額)	72,599,265,135
未収入金	697,161,641
未収利息	558,004,764
前払費用	24,046,102
(B) 負債	668,093,021
未払金	376,375,592
未払解約金	291,717,030
未払利息	84
その他未払費用	315
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	73,559,778,281
元本	28,604,779,095
次期繰越損益金	44,954,999,186
(D) 受益権総口数	28,604,779,095口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	25,716円

＜注記事項＞

①期首元本額　46,627,128,292円
　期中追加設定元本額　2,802,793,513円
　期中一部解約元本額　20,825,142,710円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.5716円です。

○損益の状況 (2015年５月21日～2016年５月20日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	2,467,941,776
受取利息	2,467,961,693
支払利息	△ 19,917
(B) 有価証券売買損益	△ 8,012,222,758
売買益	2,117,722,366
売買損	△10,129,945,124
(C) 保管費用等	△ 33,570,008
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	△ 5,577,850,990
(E) 前期繰越損益金	81,559,629,107
(F) 追加信託差損益金	4,764,215,467
(G) 解約差損益金	△35,790,994,398
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	44,954,999,186
次期繰越損益金(Ｈ)	44,954,999,186

(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 ライフセレクトファンド（安定型）	141,795,999円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	261,304,013円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	160,179,013円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン	1,628,310,178円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	1,064,308,305円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	2,567,222,628円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	1,538,777,805円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	649,701,085円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	85,661,921円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	127,996,840円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン（確定拠出年金）	2,070,086,833円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（毎月分配型）	466,436,440円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド（年１回決算型）	1,305,529,740円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	15,532,981,085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）	50,813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）	344,244円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドＶＡ２（適格機関投資家限定）	54,786,002円
ＭＵＡＭ 世界債券オープン（適格機関投資家限定）	949,306,151円
合計	28,604,779,095円

［お知らせ］

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

新興国債券インデックスマザーファンド

《第６期》決算日2016年１月26日

［計算期間：2015年１月27日～2016年１月26日］

「新興国債券インデックスマザーファンド」は、１月26日に第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	新興国の現地通貨建の公社債を主要投資対象とし、ＪＰモルガンＧＢＩ-ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債、および新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価額等が連動する債券に投資することがあります。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
２期(2012年１月26日)	9,940	△ 1.5	22,308.16	△ 1.6	97.6	－	1,744
３期(2013年１月28日)	12,776	28.5	29,209.25	30.9	96.5	－	2,679
４期(2014年１月27日)	12,503	△ 2.1	28,701.99	△ 1.7	95.2	－	3,441
５期(2015年１月26日)	14,203	13.6	32,849.46	14.5	95.0	－	7,742
６期(2016年１月26日)	11,515	△18.9	26,826.64	△18.3	95.9	－	9,861

（注）ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイドとは、Ｊ.Ｐ.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はＪ.Ｐ.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）とは、Ｊ.Ｐ.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。
（注）外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年　月　日	基準価額		ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭ グローバル・ダイバーシファイド (円換算ベース)		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
(期　首)	円	%		%	%	%
2015年１月26日	14,203	－	32,849.46	－	95.0	－
１月末	14,191	△ 0.1	32,771.81	△ 0.2	94.3	－
２月末	14,020	△ 1.3	32,442.87	△ 1.2	95.2	－
３月末	13,688	△ 3.6	31,531.29	△ 4.0	94.5	－
４月末	14,016	△ 1.3	32,461.89	△ 1.2	95.0	－
５月末	14,132	△ 0.5	32,557.20	△ 0.9	95.2	－
６月末	13,755	△ 3.2	31,765.24	△ 3.3	93.9	－
７月末	13,571	△ 4.4	31,302.36	△ 4.7	94.9	－
８月末	12,618	△11.2	29,219.41	△11.1	95.1	－
９月末	11,947	△15.9	27,639.62	△15.9	93.5	－
10月末	12,612	△11.2	29,247.64	△11.0	95.0	－
11月末	12,615	△11.2	29,451.50	△10.3	96.0	－
12月末	12,193	△14.2	28,342.51	△13.7	95.1	－
(期　末)						
2016年１月26日	11,515	△18.9	26,826.64	△18.3	95.9	－

(注) 騰落率は期首比。
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

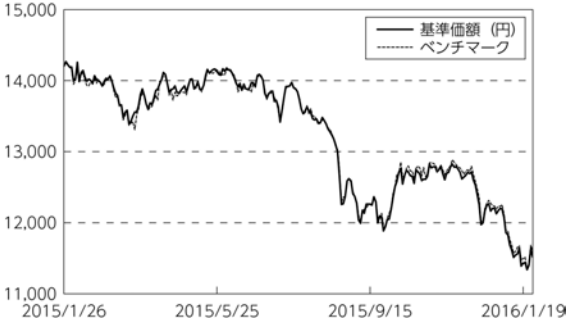
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ18.9%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－18.3%）を0.6%下回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎債券市況

・ＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）が2008年12月から過去最低水準で維持してきた政策金利の引き上げに踏み切ったことや、原油を始めとした資源価格が低迷したことなどを受けて、新興国から資金が流出する動きが強まりましたが、新興国の現地通貨建て債券市況の代表的な指標であるＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（ｌｏｃａｌ）は期首に比べて上昇しました。

◎為替市況

・ＦＲＢが2008年12月から過去最低水準で維持してきた政策金利の引き上げに踏み切ったことや、原油を始めとした資源価格が低迷したことなどを受けて、新興国から資金が流出する動きが強まったことから、新興国通貨は対円で下落しました。特に国内の政治的混乱なども伴ったブラジルレアルや南アフリカランドなどの通貨が対円で下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

・新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは18.3%の下落となったため、ベンチマークとのカイ離は△0.6%程度となりました。

	ポートフォリオ要因	管理コスト等要因	評価時価差異に基づく要因	合計
ベンチマークとのカイ離	△0.4%程度	△0.2%程度	0.0%程度	△0.6%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。

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は△0.4%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は△0.2%程度でした。

・カストディーフィー、取引コスト、税金等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.0%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、運用方針を堅持します。

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

・新興国の現地通貨建て国際機関債、および新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価額などが連動する債券に投資することがあります。

○１万口当たりの費用明細

（2015年１月27日～2016年１月26日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	17	0.128	(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）	(16)	(0.122)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（監査費用）	(0)	(0.000)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（その他）	(1)	(0.006)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	17	0.128	
期中の平均基準価額は、13,279円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2015年１月27日～2016年１月26日）

公社債

			買　　付　　額	売　　付　　額
外国	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 94,341	千メキシコペソ 39,995
	ブラジル	国債証券	千ブラジルレアル 31,300	千ブラジルレアル 15,318
	コロンビア	国債証券	千コロンビアペソ 10,180,946	千コロンビアペソ 4,311,268
	ペルー	国債証券	千ペルーヌエボソル 2,107	千ペルーヌエボソル －
	トルコ	国債証券	千トルコリラ 18,803	千トルコリラ 8,224
	ハンガリー	国債証券	千ハンガリーフォリント 1,263,866	千ハンガリーフォリント 413,203
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 28,943	千ポーランドズロチ 12,676
	ロシア	国債証券	千ロシアルーブル 157,481	千ロシアルーブル 42,906
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 20,406	千マレーシアリンギット 7,779
	タイ	国債証券	千タイバーツ 160,830	千タイバーツ 35,006
	フィリピン	国債証券	千フィリピンペソ 11,625	千フィリピンペソ 5,125
	インドネシア	国債証券	千インドネシアルピア 57,704,250	千インドネシアルピア 11,872,780
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 79,794	千南アフリカランド 20,001
	ナイジェリア	国債証券	千ナイジェリアナイラ 58,224	千ナイジェリアナイラ 239,795

（注）金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）

○利害関係人との取引状況等

（2015年１月27日～2016年１月26日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	6,731	135	2.0	2,613	20	0.8

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

○組入資産の明細

（2016年１月26日現在）

外国公社債

（A）外国（外貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	%	%	%	%	%
メキシコ	133,900	147,967	939,590	9.5	－	5.8	2.5	1.2
	千ブラジルレアル	千ブラジルレアル						
ブラジル	43,750	32,329	933,998	9.5	－	2.0	4.9	2.5
	千チリペソ	千チリペソ						
チリ	50,000	51,222	8,395	0.1	－	－	0.1	－
	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ						
コロンビア	16,380,000	15,416,285	536,486	5.4	－	3.8	1.6	－
	千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル						
ペルー	4,950	4,733	161,413	1.6	－	1.4	0.3	－
	千トルコリラ	千トルコリラ						
トルコ	25,400	23,355	913,211	9.3	－	4.1	4.5	0.7
	千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント						
ハンガリー	1,542,300	1,742,539	715,486	7.3	7.3	2.6	3.9	0.8
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	36,200	38,443	1,099,489	11.1	－	4.3	5.0	1.9
	千ロシアルーブル	千ロシアルーブル						
ロシア	338,900	298,450	441,707	4.5	－	2.1	1.9	0.5
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	35,120	35,328	974,001	9.9	－	4.8	3.8	1.3
	千タイバーツ	千タイバーツ						
タイ	259,800	284,059	931,715	9.4	－	5.2	2.9	1.3
	千フィリピンペソ	千フィリピンペソ						
フィリピン	15,000	16,225	39,915	0.4	－	0.3	0.1	－
	千インドネシアルピア	千インドネシアルピア						
インドネシア	112,370,000	109,059,501	927,005	9.4	－	8.3	0.9	0.2
	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
南アフリカ	134,700	117,380	838,099	8.5	－	6.8	1.2	0.5
合計	－	－	9,460,517	95.9	7.3	51.3	33.8	10.8

（注）邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	14,300	18,185	115,476	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	3,500	4,676	29,694	2036/11/20
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	10,700	10,775	68,424	2018/6/14
		5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	4,900	4,978	31,613	2017/6/15
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	5,500	5,475	34,768	2019/12/11
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	1,200	1,155	7,334	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	10,500	10,976	69,702	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	6,800	7,072	44,911	2022/6/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	4,700	5,118	32,502	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	12,200	13,055	82,905	2017/12/14
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	7,500	8,215	52,166	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	4,500	4,903	31,138	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	8,200	8,920	56,642	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	7,000	7,757	49,261	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	5,900	6,644	42,193	2023/12/7
		8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	14,100	15,539	98,674	2018/12/13
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	6,400	7,476	47,478	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	6,000	7,039	44,702	2038/11/18
小計						939,590	
ブラジル				千ブラジルレアル	千ブラジルレアル		
	国債証券	10 (IN)BRAZIL NTN 180101	10.0	900	828	23,933	2018/1/1
		10 (IN)BRAZIL NTN 190101	10.0	1,700	1,484	42,875	2019/1/1
		10 (IN)BRAZIL NTN 250101	10.0	4,850	3,468	100,217	2025/1/1
		10(IN)BRAZIL NTN-F210101	10.0	7,400	5,966	172,367	2021/1/1
		10(IN)BRAZIL NTN-F230101	10.0	4,650	3,507	101,321	2023/1/1
		BRAZIL-LTN 170701	—	3,600	2,937	84,863	2017/7/1
		BRAZIL-LTN 171001	—	2,600	2,037	58,858	2017/10/1
		BRAZIL-LTN 180101	—	3,750	2,831	81,816	2018/1/1
		BRAZIL-LTN 180701	—	4,500	3,137	90,628	2018/7/1
		BRAZIL-LTN 190101	—	6,100	3,927	113,458	2019/1/1
		BRAZIL-LTN 190701	—	3,700	2,203	63,657	2019/7/1
小計						933,998	
チリ				千チリペソ	千チリペソ		
	国債証券	5.5 CHILE (GL) 200805	5.5	50,000	51,222	8,395	2020/8/5
小計						8,395	
コロンビア				千コロンビアペソ	千コロンビアペソ		
	国債証券	10 TITULOS DE TES 240724	10.0	1,950,000	2,093,110	72,840	2024/7/24
		11 TITULOS DE TES 200724	11.0	600,000	661,878	23,033	2020/7/24
		4.375 COLOMBI(GL) 230321	4.375	1,680,000	1,382,640	48,115	2023/3/21
		5 TITULOS DE TESO 181121	5.0	3,700,000	3,472,228	120,833	2018/11/21
		6 TITULOS DE TESO 280428	6.0	1,550,000	1,171,707	40,775	2028/4/28
		7 TITULOS DE TESO 190911	7.0	550,000	533,841	18,577	2019/9/11
		7 TITULOS DE TESO 220504	7.0	1,400,000	1,290,394	44,905	2022/5/4
		7.5 TITULOS DE TE 260826	7.5	600,000	534,294	18,593	2026/8/26

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
コロンビア			%	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ	千円	
	国債証券	7.75 COLOMBI (GL) 210414	7.75	1,310,000	1,323,100	46,043	2021/4/14
		7.75 TITULOS DE T 300918	7.75	1,750,000	1,504,422	52,353	2030/9/18
		9.85 COLOMBI (GL) 270628	9.85	1,290,000	1,448,670	50,413	2027/6/28
小計						536,486	
ペルー				千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル		
	国債証券	5.2 PERU 230912	5.2	300	267	9,106	2023/9/12
		5.7 PERU 240812	5.7	1,000	903	30,792	2024/8/12
		6.9 PERU 370812	6.9	600	534	18,226	2037/8/12
		6.95 PERU 310812	6.95	1,400	1,290	44,017	2031/8/12
		7.84 PERU 200812	7.84	750	788	26,901	2020/8/12
		8.2 PERU 260812	8.2	900	949	32,367	2026/8/12
小計						161,413	
トルコ				千トルコリラ	千トルコリラ		
	国債証券	10.4 TURKEY GOVT 190327	10.4	1,100	1,086	42,479	2019/3/27
		10.4 TURKEY GOVT 240320	10.4	1,000	974	38,118	2024/3/20
		10.5 TURKEY GOVT 200115	10.5	1,400	1,390	54,352	2020/1/15
		6.3 TURKEY GOVT 180214	6.3	1,400	1,284	50,217	2018/2/14
		7.1 TURKEY GOVT 230308	7.1	2,000	1,635	63,939	2023/3/8
		7.4 TURKEY GOVT 200205	7.4	1,600	1,425	55,718	2020/2/5
		8 TURKEY GOVT 250312	8.0	2,200	1,848	72,267	2025/3/12
		8.3 TURKEY GOVT 180620	8.3	1,600	1,514	59,214	2018/6/20
		8.5 TURKEY GOVT 190710	8.5	2,000	1,865	72,944	2019/7/10
		8.5 TURKEY GOVT 220914	8.5	1,400	1,249	48,868	2022/9/14
		8.8 TURKEY GOVT 181114	8.8	1,600	1,520	59,462	2018/11/14
		8.8 TURKEY GOVT 230927	8.8	1,800	1,611	62,999	2023/9/27
		9 TURKEY GOVT 170308	9.0	1,700	1,665	65,122	2017/3/8
		9 TURKEY GOVT 240724	9.0	1,700	1,538	60,141	2024/7/24
		9.4 TURKEY GOVT 200708	9.4	1,400	1,331	52,069	2020/7/8
		9.5 TURKEY GOVT 220112	9.5	1,500	1,414	55,295	2022/1/12
小計						913,211	
ハンガリー				千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント		
	国債証券	2.5 HUNGARY 180622	2.5	109,000	110,679	45,445	2018/6/22
		3.5 HUNGARY 200624	3.5	163,000	170,467	69,993	2020/6/24
		4 HUNGARY 180425	4.0	149,000	156,403	64,219	2018/4/25
		5.5 HUNGARY 181220	5.5	103,000	113,332	46,534	2018/12/20
		5.5 HUNGARY 250624	5.5	157,000	183,313	75,268	2025/6/24
		6 HUNGARY 231124	6.0	173,000	205,321	84,305	2023/11/24
		6.5 HUNGARY 190624	6.5	184,800	210,705	86,515	2019/6/24
		6.75 HUNGARY 170224	6.75	60,000	63,624	26,124	2017/2/24
		6.75 HUNGARY 171124	6.75	110,000	120,167	49,340	2017/11/24
		7 HUNGARY 220624	7.0	182,500	224,066	92,001	2022/6/24
		7.5 HUNGARY 201112	7.5	151,000	184,458	75,738	2020/11/12
小計						715,486	
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	3,300	3,196	91,416	2020/4/25

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ポーランド			%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
	国債証券	2 POLAND 210425	2.0	1,100	1,070	30,629	2021/4/25
		2.5 POLAND 180725	2.5	2,900	2,958	84,619	2018/7/25
		3.25 POLAND 190725	3.25	3,300	3,440	98,410	2019/7/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	3,800	3,833	109,641	2025/7/25
		3.75 POLAND 180425	3.75	1,800	1,885	53,912	2018/4/25
		4 POLAND 231025	4.0	3,300	3,530	100,967	2023/10/25
		4.75 POLAND 170425	4.75	1,700	1,768	50,591	2017/4/25
		5.25 POLAND 171025	5.25	3,300	3,509	100,382	2017/10/25
		5.25 POLAND 201025	5.25	2,600	2,935	83,952	2020/10/25
		5.5 POLAND 191025	5.5	2,400	2,698	77,175	2019/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	2,200	2,567	73,424	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	3,200	3,775	107,984	2022/9/23
		POLAND 170725	－	1,300	1,272	36,380	2017/7/25
小計						1,099,489	
ロシア				千ロシアルーブル	千ロシアルーブル		
	国債証券	6.2 RUSSIA GOVT 180131	6.2	14,000	12,954	19,172	2018/1/31
		6.4 RUSSIA OFZ 200527	6.4	22,000	18,965	28,069	2020/5/27
		6.7 RUSSIA GOVT B 190515	6.7	32,500	29,179	43,186	2019/5/15
		6.8 RUSSIA GOVT 191211	6.8	18,000	15,963	23,625	2019/12/11
		7 RUSSIA GOVT 230125	7.0	21,000	17,539	25,958	2023/1/25
		7 RUSSIA GOVT BON 230816	7.0	36,600	30,266	44,794	2023/8/16
		7.05 RUSSIA GOVT 280119	7.05	36,300	28,328	41,925	2028/1/19
		7.4 RUSSIA GOVT 170419	7.4	17,000	16,435	24,325	2017/4/19
		7.4 RUSSIA GOVT 170614	7.4	16,000	15,408	22,804	2017/6/14
		7.5 RUSSIA GOVT 180315	7.5	4,000	3,783	5,599	2018/3/15
		7.5 RUSSIA GOVT 190227	7.5	16,500	15,241	22,557	2019/2/27
		7.6 RUSSIA GOVT 210414	7.6	23,000	20,444	30,257	2021/4/14
		7.6 RUSSIA GOVT 220720	7.6	21,000	18,273	27,045	2022/7/20
		7.85 RUSSIA (GL) 180310	7.85	35,000	33,302	49,287	2018/3/10
		8.15 RUSSIA GOVT 270203	8.15	26,000	22,362	33,096	2027/2/3
小計						441,707	
マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	3.26 MALAYSIAGOVT 180301	3.26	1,400	1,401	38,639	2018/3/1
		3.314 MALAYSIA 171031	3.314	1,700	1,716	47,324	2017/10/31
		3.394 MALAYSIAGOV 170315	3.394	1,200	1,209	33,349	2017/3/15
		3.418MALAYSIAGOVT 220815	3.418	1,100	1,074	29,624	2022/8/15
		3.48 MALAYSIAGOVT 230315	3.48	1,500	1,459	40,227	2023/3/15
		3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	1,400	1,400	38,612	2020/3/31
		3.58 MALAYSIAGOVT 180928	3.58	1,600	1,614	44,522	2018/9/28
		3.654 MALAYSIAGOV 191031	3.654	1,500	1,513	41,732	2019/10/31
		3.659 MALAYSIAGOV 201015	3.659	1,600	1,621	44,692	2020/10/15
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	900	850	23,452	2028/6/15
		3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	1,300	1,304	35,960	2022/9/30
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	700	637	17,569	2033/4/15
		3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	1,200	1,218	33,595	2020/7/31

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
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	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	600	581	16,030	2027/3/15
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	2,000	1,992	54,924	2025/9/15
		4.012 MALAYSIAGOV 170915	4.012	1,600	1,632	45,002	2017/9/15
		4.048 MALAYSIA 210930	4.048	2,420	2,461	67,854	2021/9/30
		4.127 MALAYSIA 320415	4.127	800	758	20,925	2032/4/15
		4.16 MALAYSIAGOVT 210715	4.16	1,400	1,432	39,493	2021/7/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,300	1,318	36,340	2024/7/15
		4.24 MALAYSIAGOVT 180207	4.24	1,500	1,532	42,238	2018/2/7
		4.378MALAYSIAGOVT 191129	4.378	2,500	2,585	71,270	2019/11/29
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	1,300	1,314	36,242	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	1,800	1,835	50,617	2030/4/15
		5.734MALAYSIAGOVT 190730	5.734	800	861	23,758	2019/7/30
小計						974,001	
タイ				千タイバーツ	千タイバーツ		
	国債証券	2.55 THAILAND 200626	2.55	17,400	17,964	58,922	2020/6/26
		2.8 THAILAND 171010	2.8	10,000	10,219	33,518	2017/10/10
		3.25 THAILAND 170616	3.25	28,900	29,640	97,221	2017/6/16
		3.45 THAILAND 190308	3.45	11,700	12,355	40,525	2019/3/8
		3.58 THAILAND 271217	3.58	9,500	10,415	34,161	2027/12/17
		3.625 THAILAND 230616	3.625	28,200	30,769	100,925	2023/6/16
		3.65 THAILAND 211217	3.65	45,900	49,935	163,787	2021/12/17
		3.85 THAILAND 251212	3.85	19,500	21,867	71,724	2025/12/12
		3.875 THAILAND 190613	3.875	40,900	43,985	144,271	2019/6/13
		4.75 THAILAND 241220	4.75	8,300	9,791	32,116	2024/12/20
		4.875 THAILAND 290622	4.875	27,100	33,780	110,801	2029/6/22
		5.125 THAILAND 180313	5.125	12,400	13,335	43,740	2018/3/13
小計						931,715	
フィリピン				千フィリピンペソ	千フィリピンペソ		
	国債証券	4.95 PHILIPPI(GL) 210115	4.95	5,000	5,133	12,629	2021/1/15
		6.25 PHILIPPI(GL) 360114	6.25	10,000	11,092	27,286	2036/1/14
小計						39,915	
インドネシア				千インドネシアルピア	千インドネシアルピア		
	国債証券	10 INDONESIA 170715	10.0	1,000,000	1,025,030	8,712	2017/7/15
		10.5 INDONESIA 300815	10.5	3,550,000	4,022,043	34,187	2030/8/15
		11 INDONESIA 201115	11.0	2,200,000	2,416,304	20,538	2020/11/15
		11 INDONESIA 250915	11.0	3,450,000	3,960,220	33,661	2025/9/15
		12.8 INDONESIA 210615	12.8	2,590,000	3,062,234	26,028	2021/6/15
		5.25 INDONESIA 180515	5.25	1,550,000	1,450,986	12,333	2018/5/15
		5.625 INDONESIA 230515	5.625	4,800,000	4,026,864	34,228	2023/5/15
		6.125 INDONESIA 280515	6.125	5,050,000	4,041,515	34,352	2028/5/15
		6.25 INDONESIA 170415	6.25	1,200,000	1,174,068	9,979	2017/4/15
		6.625 INDONESIA 330515	6.625	7,300,000	5,868,616	49,883	2033/5/15
		7 INDONESIA 220515	7.0	5,650,000	5,226,984	44,429	2022/5/15
		7 INDONESIA 270515	7.0	4,050,000	3,558,694	30,248	2027/5/15
		7.875 INDONESIA 190415	7.875	7,000,000	6,906,340	58,703	2019/4/15

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
インドネシア			%	㻱インドネシアルピア	㻱インドネシアルピア	千円	
	国債証券	8.25 INDONESIA 210715	8.25	5,600,000	5,572,952	47,370	2021/7/15
		8.25 INDONESIA 320615	8.25	7,000,000	6,633,760	56,386	2032/6/15
		8.375 INDONESIA 240315	8.375	17,200,000	17,084,244	145,216	2024/3/15
		8.375 INDONESIA 260915	8.375	6,330,000	6,317,909	53,702	2026/9/15
		8.375 INDONESIA 340315	8.375	12,100,000	11,628,463	98,841	2034/3/15
		9 INDONESIA 290315	9.0	11,600,000	11,763,212	99,987	2029/3/15
		9.5 INDONESIA 310715	9.5	3,150,000	3,319,060	28,212	2031/7/15
小計						927,005	
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	19,400	20,525	146,555	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	11,700	7,836	55,954	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	10,500	6,987	49,890	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	9,000	8,072	57,638	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	12,000	9,220	65,834	2031/2/28
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	9,300	8,729	62,327	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	6,500	5,927	42,324	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	7,500	7,335	52,375	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	12,100	10,309	73,607	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	7,500	7,481	53,420	2017/9/15
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	7,600	6,491	46,346	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	8,900	7,579	54,117	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	12,700	10,883	77,706	2048/2/28
小計						838,099	
合計						9,460,517	

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

○投資信託財産の構成

（2016年１月26日現在）

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
公社債	9,460,517	95.6
コール・ローン等、その他	435,917	4.4
投資信託財産総額	9,896,434	100.0

（注）期末における外貨建純資産（9,828,189千円）の投資信託財産総額（9,896,434千円）に対する比率は99.3%です。

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

１アメリカドル＝118.14円	１メキシコペソ＝6.35円	１ブラジルレアル＝28.89円	100チリペソ＝16.39円
100コロンビアペソ＝3.48円	１ペルーヌエボソル＝34.10円	１トルコリラ＝39.10円	100ハンガリーフォリント＝41.06円
１ポーランドズロチ＝28.60円	１ロシアルーブル＝1.48円	１マレーシアリンギット＝27.57円	１タイバーツ＝3.28円
１フィリピンペソ＝2.46円	100インドネシアルピア＝0.85円	１南アフリカランド＝7.14円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年１月26日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	9,930,850,855
コール・ローン等	281,171,834
公社債(評価額)	9,460,517,527
未収入金	34,416,000
未収利息	136,351,279
前払費用	18,394,215
(B) 負債	69,538,657
未払金	54,091,224
未払解約金	15,447,433
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	9,861,312,198
元本	8,564,024,345
次期繰越損益金	1,297,287,853
(D) 受益権総口数	8,564,024,345口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	11,515円

＜注記事項＞

①期首元本額　5,451,142,583円
　期中追加設定元本額　4,580,062,637円
　期中一部解約元本額　1,467,180,875円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.1515円です。

○損益の状況 (2015年１月27日～2016年１月26日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	547,728,067
受取利息	547,660,698
その他収益金	67,369
(B) 有価証券売買損益	△2,564,004,726
売買益	95,887,008
売買損	△2,659,891,734
(C) 保管費用等	△　12,316,706
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	△2,028,593,365
(E) 前期繰越損益金	2,291,224,547
(F) 追加信託差損益金	1,500,075,091
(G) 解約差損益金	△　465,418,420
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	1,297,287,853
次期繰越損益金(Ｈ)	1,297,287,853

(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）

ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,730,806,829円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	365,846,277円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	198,944,668円
コアバランス	681,024円
ｅＭＡＸＩＳ 新興国債券インデックス	4,426,397,507円
三菱ＵＦＪ ＤＣ新興国債券インデックスファンド	1,434,216,167円
新興国債券インデックスオープン	934,480円
新興国債券インデックスファンド（ラップ向け）	168,879,662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）	30,527,848円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	46,123,613円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	69,400,009円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	91,266,261円
合計	8,564,024,345円

［お知らせ］

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

東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド

《第７期》決算日2016年１月26日

［計算期間：2015年１月27日～2016年１月26日］

「東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド」は、１月26日に第７期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第７期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）		投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
３期(2012年１月26日)	10,328	△20.0	1,283.37	△20.7	98.2	－	1,008
４期(2013年１月28日)	15,186	47.0	1,892.12	47.4	99.0	－	2,449
５期(2014年１月27日)	19,623	29.2	2,454.67	29.7	96.9	2.4	5,919
６期(2015年１月26日)	26,667	35.9	3,336.13	35.9	96.5	3.5	12,810
７期(2016年１月26日)	23,985	△10.1	2,998.39	△10.1	98.1	2.2	15,494

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

（注）「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）		投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率
		騰落率		騰落率		
（期　首）	円	%		%	%	%
2015年１月26日	26,667	－	3,336.13	－	96.5	3.5
１月末	26,060	△ 2.3	3,260.64	△ 2.3	96.3	3.7
２月末	26,423	△ 0.9	3,306.03	△ 0.9	97.3	2.7
３月末	25,910	△ 2.8	3,241.62	△ 2.8	98.4	1.6
４月末	26,117	△ 2.1	3,267.36	△ 2.1	97.5	2.5
５月末	26,047	△ 2.3	3,257.97	△ 2.3	98.3	1.7
６月末	25,246	△ 5.3	3,157.69	△ 5.3	97.8	2.2
７月末	24,794	△ 7.0	3,100.40	△ 7.1	97.7	2.2
８月末	23,036	△13.6	2,881.06	△13.6	96.7	3.3
９月末	23,706	△11.1	2,964.58	△11.1	96.5	3.5
10月末	24,487	△ 8.2	3,061.58	△ 8.2	98.0	1.9
11月末	24,880	△ 6.7	3,110.54	△ 6.8	97.3	2.7
12月末	24,916	△ 6.6	3,115.04	△ 6.6	97.6	2.4
（期　末）						
2016年１月26日	23,985	△10.1	2,998.39	△10.1	98.1	2.2

（注）騰落率は期首比。
（注）「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ10.1%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－10.1%）と同程度となりました。

基準価額の推移

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

●投資環境について

◎国内ＲＥＩＴ市況

・期首から2015年９月上旬にかけては、相次ぐ公募増資の発表や、中国の景気減速懸念を受けた世界的なリスク回避の流れなどから、国内ＲＥＩＴ市況は下落しました。

・９月上旬から期末にかけては、日本の長期金利が低下傾向となったことや、日銀によるＲＥＩＴ買入れの個別銘柄ごとの上限引き上げが発表されたことなどから、国内ＲＥＩＴ市況は反発しました。

●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ＲＥＩＴ（不動産投資信託証券）（先物を含む）に投資しました。

・ポートフォリオはベンチマークである東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークとのカイ離は0.0%程度となりました。カイ離幅を低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

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

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.1%程度でした。

・期を通じて、運用資産のほぼ全額をＲＥＩＴ（不動産投資信託証券）（先物を含む）に投資しました。

・期中における先物組入比率の平均は、2.5%程度となりました。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は△0.0%程度でした。

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

○今後の運用方針

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2015年１月27日～2016年１月26日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	4	0.014	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（投資信託証券）	(0)	(0.002)	
（先物・オプション）	(3)	(0.013)	
合計	4	0.014	
期中の平均基準価額は、25,135円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2015年１月27日～2016年１月26日）

投資信託証券

	銘柄	買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
		千口	千円	千口	千円
国内	日本アコモデーションファンド投資法人	0.263 (0.013)	117,405 (5,770)	0.086	38,019
	ＭＣＵＢＳ ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	0.22	70,047	0.035	11,394
	森ヒルズリート投資法人	0.801	125,644	0.279	43,843
	野村不動産レジデンシャル投資法人	0.067 (△0.227)	45,086 (△ 156,518)	0.025	16,396
	産業ファンド投資法人	0.206	113,926	0.062	33,981
	大和ハウスリート投資法人	0.238	121,679	0.053	26,389
	アドバンス・レジデンス投資法人	0.672	189,119	0.232	64,407
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	0.263	88,095	0.065	21,804
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.237 (0.391)	181,477 (－)	0.053	49,619
	ＧＬＰ投資法人	1 (0.05)	179,240 (5,708)	0.433	51,942
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.302 (0.036)	74,793 (9,895)	0.084	20,621
	日本プロロジスリート投資法人	0.894	218,075	0.309	74,108
	野村不動産マスターファンド投資法人	0.695 (△ 2)	101,447 (△ 357,262)	0.265	38,697
	星野リゾート・リート投資法人	0.055 (0.021)	72,292 (25,371)	0.01	12,885
	ＳＩＡ不動産投資法人	0.038	17,967	0.013	6,062
	イオンリート投資法人	0.724	112,980	0.194	30,193
	ヒューリックリート投資法人	0.404	68,324	0.14	23,678
	日本リート投資法人	0.42 (0.05)	130,697 (14,145)	0.061	17,907
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	0.396	42,484	0.087	9,241
	日本ヘルスケア投資法人	0.052	11,511	0.011	2,698
	積水ハウス・リート投資法人	1	178,588	0.128	16,766
	トーセイ・リート投資法人	0.147	17,337	0.018	2,265
	ケネディクス商業リート投資法人	0.456 (0.107)	124,385 (23,170)	0.033	8,802
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	0.193	31,262	0.013	1,549
	サムティ・レジデンシャル投資法人	0.249	23,398	0.006	483
	ジャパン・シニアリビング投資法人	0.129	23,158	0.003	448
	野村不動産マスターファンド投資法人	0.367 (5)	54,386 (823,563)	0.071	10,488
	いちごホテルリート投資法人	0.206	27,905	－	－
	日本ビルファンド投資法人	0.728	414,967	0.251	143,688
	ジャパンリアルエステイト投資法人	0.727	411,736	0.218	124,512
	日本リテールファンド投資法人	1	333,372	0.4	96,481
	オリックス不動産投資法人	1 (0.044)	227,860 (6,576)	0.401	66,563
	日本プライムリアルティ投資法人	0.503	202,067	0.153	61,867
	プレミア投資法人	0.18 (1)	87,356 (－)	0.066	29,857
	東急リアル・エステート投資法人	0.504	75,885	0.174	26,079

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千円	千口	千円
国内	グローバル・ワン不動産投資法人	0.1	43,952	0.034	14,396
	野村不動産オフィスファンド投資法人	0.155 (△0.526)	86,871 (△ 309,783)	0.058	31,841
	ユナイテッド・アーバン投資法人	1	266,773	0.473	83,206
	森トラスト総合リート投資法人	0.681	157,990	0.234	54,229
	インヴィンシブル投資法人	2	134,452	0.526	33,311
	フロンティア不動産投資法人	0.255	134,593	0.088	46,897
	平和不動産リート投資法人	0.586	52,923	0.169	15,131
	日本ロジスティクスファンド投資法人	0.504	117,871	0.149	35,855
	福岡リート投資法人	0.449	94,721	0.13	26,915
	ケネディクス・オフィス投資法人	0.21	130,394	0.073	44,359
	積水ハウス・ＳＩ　レジデンシャル投資法人	0.525	65,673	0.181	21,775
	いちごオフィスリート投資法人	0.765 (0.274)	67,900 (24,444)	0.231	20,615
	大和証券オフィス投資法人	0.281 (0.015)	175,123 (8,745)	0.083	51,501
	阪急リート投資法人	0.308	43,123	0.106	14,420
	スターツプロシード投資法人	0.09	17,611	0.031	5,928
	トップリート投資法人	0.092	45,294	0.033	16,158
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	0.349 (0.469)	100,088 (―)	0.134	34,106
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	2	181,495	0.548	44,347
	日本賃貸住宅投資法人	1	85,700	0.28	23,531
	ジャパンエクセレント投資法人	0.707	100,815	0.22	31,203
	日本アコモデーションファンド投資法人（新）	0.013 (△0.013)	5,770 (△ 5,770)	―	―
	森ヒルズリート投資法人（新）	0.134	18,268	―	―
	ＧＬＰ投資法人（新）	0.05 (△ 0.05)	5,708 (△ 5,708)	―	―
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人（新）	0.017 (△0.036)	3,329 (△ 9,895)	―	―
	星野リゾート・リート投資法人（新）	0.021 (△0.021)	25,371 (△ 25,371)	―	―
	日本リート投資法人（新）	0.05 (△ 0.05)	14,145 (△ 14,145)	―	―
	ケネディクス商業リート（新）	0.107 (△0.107)	23,170 (△ 23,170)	―	―
	オリックス不動産投資法人（新）	0.044 (△0.044)	6,576 (△ 6,576)	―	―
	いちごオフィスリート投資法人（新）	0.274 (△0.274)	24,444 (△ 24,444)	―	―
	大和証券オフィス投資法人（新）	0.015 (△0.015)	8,745 (△ 8,745)	―	―
合計		30 (4)	6,554,871 (―)	8	1,833,483

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内	不動産投信指数先物取引	百万円 7,610	百万円 7,656	百万円 －	百万円 －

○利害関係人との取引状況等

（2015年１月27日～2016年１月26日）

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	6,554	999	15.2	1,833	358	19.5

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種類	買付額
	百万円
投資信託証券	462

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	当期
売買委託手数料総額（A）	2,125千円
うち利害関係人への支払額（B）	4千円
（B）／（A）	0.2%

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

○組入資産の明細

（2016年１月26日現在）

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当期末		
	口数	口数	評価額	比率
	千口	千口	千円	%
日本アコモデーションファンド投資法人	0.532	0.722	286,995	1.9
ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	0.212	0.397	132,002	0.9
森ヒルズリート投資法人	1	2	333,242	2.2
野村不動産レジデンシャル投資法人	0.185	－	－	－
産業ファンド投資法人	0.382	0.526	277,202	1.8
大和ハウスリート投資法人	0.338	0.523	225,413	1.5
アドバンス・レジデンス投資法人	1	1	475,779	3.1
ケネディクス・レジデンシャル投資法人	0.322	0.52	136,500	0.9
アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.319	0.894	446,106	2.9
ＧＬＰ投資法人	2	3	437,244	2.8
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.45	0.704	148,966	1.0
日本プロロジスリート投資法人	1	2	530,964	3.4
野村不動産マスターファンド投資法人	1	－	－	－
星野リゾート・リート投資法人	0.05	0.116	132,820	0.9
ＳＩＡ不動産投資法人	0.087	0.112	47,040	0.3
イオンリート投資法人	1	1	197,112	1.3
ヒューリックリート投資法人	0.9	1	193,689	1.3
日本リート投資法人	0.175	0.584	147,401	1.0
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	0.499	0.808	78,699	0.5
日本ヘルスケア投資法人	0.07	0.111	18,481	0.1
積水ハウス・リート投資法人	－	1	143,619	0.9
トーセイ・リート投資法人	0.111	0.24	26,256	0.2
ケネディクス商業リート投資法人	－	0.53	124,815	0.8
ヘルスケア＆メディカル投資法人	－	0.18	18,810	0.1
サムティ・レジデンシャル投資法人	－	0.243	19,707	0.1
ジャパン・シニアリビング投資法人	－	0.126	16,254	0.1
野村不動産マスターファンド投資法人	－	5	780,603	5.0
いちごホテルリート投資法人	－	0.206	26,903	0.2
日本ビルファンド投資法人	1	2	1,225,110	7.9
ジャパンリアルエステイト投資法人	1	1	1,167,296	7.5
日本リテールファンド投資法人	2	3	930,078	6.0
オリックス不動産投資法人	2	3	547,213	3.5
日本プライムリアルティ投資法人	0.951	1	528,206	3.4
プレミア投資法人	0.301	1	249,301	1.6
東急リアル・エステート投資法人	1	1	198,589	1.3
グローバル・ワン不動産投資法人	0.223	0.289	116,322	0.8
野村不動産オフィスファンド投資法人	0.429	－	－	－
ユナイテッド・アーバン投資法人	3	4	647,137	4.2
森トラスト総合リート投資法人	1	1	382,579	2.5
インヴィンシブル投資法人	3	4	316,606	2.0
フロンティア不動産投資法人	0.572	0.739	339,940	2.2
平和不動産リート投資法人	1	1	118,467	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.957	1	297,168	1.9
福岡リート投資法人	0.795	1	207,204	1.3
ケネディクス・オフィス投資法人	0.467	0.604	348,508	2.2
積水ハウス・ＳＩ　レジデンシャル投資法人	1	1	148,156	1.0

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	%
いちごオフィスリート投資法人		1	2	173,735	1.1
大和証券オフィス投資法人		0.508	0.721	464,324	3.0
阪急リート投資法人		0.689	0.891	109,860	0.7
スターツプロシード投資法人		0.2	0.259	41,388	0.3
トップリート投資法人		0.203	0.262	111,481	0.7
大和ハウス・レジデンシャル投資法人		0.431	1	255,335	1.6
ジャパン・ホテル・リート投資法人		3	4	419,900	2.7
日本賃貸住宅投資法人		1	2	186,553	1.2
ジャパンエクセレント投資法人		1	1	241,280	1.6
森ヒルズリート投資法人（新）		－	0.134	18,817	0.1
コンフォリア・レジデンシャル投資法人（新）		0.036	0.017	3,524	0.0
合計	口数・金額	49	76	15,196,712	
	銘柄数<比率>	49	54	<98.1%>	

（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です。
（注）日本アコモデーションファンド投資法人、ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人、森ヒルズリート投資法人、産業ファンド投資法人、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、星野リゾート・リート投資法人、ＳＩＡ不動産投資法人、イオンリート投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本リート投資法人、インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人、積水ハウス・リート投資法人、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、ジャパン・シニアリビング投資法人、野村不動産マスターファンド投資法人、いちごホテルリート投資法人、日本ビルファンド投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、日本リテールファンド投資法人、オリックス不動産投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、プレミア投資法人、東急リアル・エステート投資法人、グローバル・ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、森トラスト総合リート投資法人、インヴィンシブル投資法人、フロンティア不動産投資法人、平和不動産リート投資法人、日本ロジスティクスファンド投資法人、福岡リート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、積水ハウス・ＳＩ　レジデンシャル投資法人、いちごオフィスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、阪急リート投資法人、スターツプロシード投資法人、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人である三菱ＵＦＪ信託銀行、三菱東京ＵＦＪ銀行、三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券が当該ファンドの一般事務受託会社となっています。（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より記載）

純資産総額の10％を超える不動産ファンドに関する組入投資証券の内容

当期末において10％を超える銘柄の組入れはございません。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
国内	不動産投信指数先物取引	東証ＲＥＩＴ指数	347	－

○投資信託財産の構成

（2016年１月26日現在）

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
投資証券	15,196,712	97.3
コール・ローン等、その他	417,786	2.7
投資信託財産総額	15,614,498	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年１月26日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	15,611,939,932
コール・ローン等	288,883,581
投資証券(評価額)	15,196,712,870
未収配当金	107,937,010
未収利息	471
差入委託証拠金	18,406,000
(B) 負債	117,879,008
未払金	53,085,738
未払解約金	64,793,270
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	15,494,060,924
元本	6,460,011,075
次期繰越損益金	9,034,049,849
(D) 受益権総口数	6,460,011,075口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	23,985円

＜注記事項＞

①期首元本額　4,803,905,004円
　期中追加設定元本額　2,932,737,021円
　期中一部解約元本額　1,276,630,950円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.3985円です。

○損益の状況 (2015年１月27日～2016年１月26日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	478,726,083
受取配当金	471,038,965
受取利息	215,031
その他収益金	7,472,087
(B) 有価証券売買損益	△1,892,243,458
売買益	108,234,924
売買損	△2,000,478,382
(C) 先物取引等取引損益	△　48,475,752
取引益	95,911,124
取引損	△　144,386,876
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	△1,461,993,127
(E) 前期繰越損益金	8,006,474,362
(F) 追加信託差損益金	4,369,887,732
(G) 解約差損益金	△1,880,319,118
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	9,034,049,849
次期繰越損益金(Ｈ)	9,034,049,849

(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。

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

ｅＭＡＸＩＳ 国内リートインデックス	5,016,505,803円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	848,938,787円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	177,438,102円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド	942,326円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	72,888,039円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（ラップ向け）	184,313,211円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	41,883,300円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	117,101,507円
合計	6,460,011,075円

［お知らせ］

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

ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド

《第10期》決算日2016年１月５日

［計算期間：2015年１月６日～2016年１月５日］

「ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド」は、１月５日に第10期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第10期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）		投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
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
10期(2016年１月５日)	15,105	△ 1.8	15,914.11	△ 1.5	98.7	16,191

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

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ＳＡＮＰ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）		投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率	
（期首）	円	%		%	%
2015年１月５日	15,384	－	16,149.24	－	99.1
１月末	16,130	4.8	16,930.43	4.8	99.2
２月末	15,611	1.5	16,389.96	1.5	99.4
３月末	16,021	4.1	16,809.90	4.1	98.7
４月末	15,407	0.1	16,189.92	0.3	99.3
５月末	15,809	2.8	16,586.63	2.7	99.1
６月末	14,879	△3.3	15,620.85	△3.3	97.8
７月末	15,634	1.6	16,427.43	1.7	99.4
８月末	14,730	△4.3	15,485.00	△4.1	99.4
９月末	14,477	△5.9	15,219.26	△5.8	99.1
10月末	15,705	2.1	16,516.15	2.3	99.4
11月末	15,675	1.9	16,514.01	2.3	98.5
12月末	15,680	1.9	16,531.64	2.4	98.0
（期末） 2016年１月５日	15,105	△1.8	15,914.11	△1.5	98.7

（注）騰落率は期首比。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.8%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－1.5%）を0.3%下回りました。

基準価額の推移

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

●投資環境について

◎外国ＲＥＩＴ市況（現地通貨ベース）

・中国経済の減速懸念などによる世界経済の先行き不安や米国の利上げを巡る警戒感などから下落する局面もありましたが、米国の堅調な企業決算内容などを受けて外国ＲＥＩＴ市況は上昇しました。

◎為替市況

・為替市況は、期首に比べて0.9%の円高・米ドル安、10.3%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

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

・不動産投資信託証券の組入比率は高位を保ち、国別比率や用途別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは1.5%の下落となったため、ベンチマークとのカイ離は△0.3%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	0.2%程度	0.0%程度	△0.3%程度

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

◎売買コスト要因

売買コストによる影響は△0.1%程度でした。

◎配当課税要因

配当課税による影響は△0.4%程度でした。

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

◎為替評価要因

為替評価による影響は0.2%程度でした。

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

◎その他の要因

その他の要因による影響は0.0%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

（2015年１月６日～2016年１月５日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	3	0.022	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(3)	(0.022)	
(b) 有価証券取引税	3	0.019	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(3)	(0.019)	
(c) その他費用	10	0.062	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(8)	(0.053)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（その他）	(2)	(0.010)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	16	0.103	
期中の平均基準価額は、15,479円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2015年１月６日～2016年１月５日）

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 － (9)	千アメリカドル － (15)	百株 9	千アメリカドル 14

（注）金額は受渡代金。
（注）（　）内は株式分割・増資割当および合併等による増減分です。

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	DDR CORP	12	221	1	22
	HCP INC	20	815	2	103
	MACERICH CO/THE	5	459	1	124
	ACADIA REALTY TRUST	2	73	－	－
	AGREE REALTY CORP	1	48	0.5	15
	ALEXANDER'S INC	0.185	74	－	－
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3	302	0.45	42
	PROLOGIS INC	23	974	2	91
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	4	201	0.5	18
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4	38	－ (　－)	－ (0.14644)
	ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	1	50	7	215
	BIOMED REALTY TRUST INC	7	172	－	－
	BRANDYWINE REALTY TRUST	5	81	－	－
	CAMDEN PROPERTY TRUST	3	259	0.2	15
	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7	121	4	59
	CEDAR REALTY TRUST INC	5	34	－	－
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	5	209	－	－
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	3	85	－	－
	COUSINS PROPERTIES INC	8	91	－	－
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	6	90	－	－
	DIGITAL REALTY TRUST INC	6	464	0.32	21
	EASTGROUP PROPERTIES INC	1	71	－	－
	EDUCATION REALTY TRUST INC	2	98	－	－
	EPR PROPERTIES	2	171	0.64	37
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2	165	0.3	18
	EQUITY ONE INC	3	84	0.7	17
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2	637	0.21	47
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5	432	0.24	16
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	2	379	0.18	26

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	TRADE STREET RESIDENTIAL INC	－ (△ 0.9)	－ (△ 6)	－	－
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	3	75	－	－
	FIRST POTOMAC REALTY TRUST	2	32	－	－
	GETTY REALTY CORP	0.8	14	－	－
	GLIMCHER REALTY TRUST	－ (△ 14)	－ (△ 202)	－	－
	WELLTOWER INC	16	1,185	0.97	71
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	4	179	0.38	17
	HOME PROPERTIES INC	2	145	－ (7)	－ (524)
	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	6	185	0.55 (－)	18 (5)
	EQUITY COMMONWEALTH	4	127	－	－
	INLAND REAL ESTATE CORP	5	50	1	15
	KILROY REALTY CORP	4	296	－	－
	KITE REALTY GROUP TRUST	4	117	1	36
	LEXINGTON REALTY TRUST	7	75	－	－
	LTC PROPERTIES INC	1	55	－	－
	MACK-CALI REALTY CORP	4	77	－	－
	BOSTON PROPERTIES INC	6	835	0.82	109
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	16	220	1	14
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	2	223	－	－
	NATL HEALTH INVESTORS INC	1	83	－	－
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	7 (2)	281 (92)	－	－
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0.6	14	－	－
	PARKWAY PROPERTIES INC	3	58	0.85	15
	PENN REAL ESTATE INVEST TST	2	51	－	－
	POST PROPERTIES INC	1	111	－	－
	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	4	74	1	17
	REALTY INCOME CORP	12	610	0.87	43
	REGENCY CENTERS CORP	3	238	0.32	21
	SAUL CENTERS INC	0.58	32	－	－
	SENIOR HOUSING PROP TRUST	12	249	1 (－)	18 (6)
	SL GREEN REALTY CORP	4	503	0.22	28
	SOVRAN SELF STORAGE INC	1	153	－	－
	STRATEGIC HOTELS & RESORTS I	10	141	－ (37)	－ (497)
	SUN COMMUNITIES INC	3	227	0.26	18
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	8 (0.187)	138 (3)	1	18
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	4	144	0.65	23
	TAUBMAN CENTERS INC	2	159	－	－
	CUBESMART	8	215	1	36

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	UDR INC	11	392	1	59
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.28	15	－	－
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	0.7	14	－	－
	VENTAS INC	17	1,195	1	88
	WASHINGTON REIT	2	79	0.7	18
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	4	155	0.5	17
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	3 (△ 17)	38 (－)	－	－
	PS BUSINESS PARKS INC/CA	0.85	67	0.2	16
	UMH PROPERTIES INC	1	13	－	－
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	0.8	14	－	－
	MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	2	19	－	－
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	3	88	－	－
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	3	40	－	－
	WINTHROP REALTY TRUST	5	75	－	－
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	3	109	－	－
	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	4	30	－	－
	DOUGLAS EMMETT INC	6	189	0.7	21
	GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	6 (△ 23)	89 (△ 204)	－	－
	DUPONT FABROS TECHNOLOGY	2	76	－	－
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	2	113	－	－
	EXCEL TRUST INC	1	27	－ (7)	－ (101)
	CHESAPEAKE LODGING TRUST	2	92	－	－
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	5	96	－	－
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	4	152	0.5	16
	CORESITE REALTY CORP	2	123	0.65	31
	CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	2	12	－	－
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	2	88	0.37	16
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	3	39	－	－
	GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	3	71	0.95 (－)	17 (1)
	RLJ LODGING TRUST	4	134	－	－
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	4	69	－	－
	ROUSE PROPERTIES INC	2	37	1	17
	STAG INDUSTRIAL INC	3	71	－	－
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	4	107	－	－
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	8	137	－	－
	SELECT INCOME REIT	4	90	－ (－)	－ (2)
	HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	5	149	0.7	18
	WP CAREY INC	3	253	0.28	19
	WHITESTONE REIT	1	21	－	－
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2	141	0.54	32
	CHATHAM LODGING TRUST	1	53	－	－

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	TERRENO REALTY CORP	1	28	－	－
	SILVER BAY REALTY TRUST CORP	0.95	14	－	－
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22	248	3	37
	CORRECTIONS CORP OF AMERICA	4	166	0.6	18
	AVIV REIT INC	0.42 (△ 2)	15 (△ 92)	0.4	14
	GEO GROUP INC/THE	2	82	－	－
	VEREIT INC	37	328	5	44
	AMREIT INC	－	－	1	47
	DUKE REALTY CORP	13	267	－	－
	ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	1	13	－	－
	AMERICAN RESIDENTIAL PROPERT	1	29	－	－
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	3	50	－	－
	PHYSICIANS REALTY TRUST	6	114	－	－
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	7	123	1	18
	GRAMERCY PROPERTY TRUST	9 (23)	79 (204)	－	－
	CYRUSONE INC	5	171	－	－
	ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	0.8 (0.402)	13 (0.14644)	－	－
	EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	6	115	－	－
	QTS REALTY TRUST INC-CL A	4	161	－	－
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	9	250	0.7	17
	STARWOOD WAYPOINT RESIDE	1	32	－	－
	COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	4	118	0.64	17
	WP GLIMCHER INC	7 (2)	114 (202)	1 (－)	18 (152)
	CARETRUST REIT INC	3 (－)	39 (12)	1	18
	NEW YORK REIT INC	7	74	－	－
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	3	122	－	－
	INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	－ (0.369)	－ (6)	－ (－)	－ (3)
	IRON MOUNTAIN INC	7	276	0.51	19
	STORE CAPITAL CORP	9	199	－	－
	NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	5	70	－	－
	URBAN EDGE PROPERTIES	3 (8)	85 (－)	－	－
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	1	30	－	－
	MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	22	221	－	－
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	14	352	－	－
	NORTHSTAR REALTY FINANCE	49 (△ 23)	858 (－)	－	－
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3	47	－	－
	NEXPOINT RESIDENTIAL	2	36	－	－

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	CARE CAPITAL PROPERTIES INC	1 (10)	40 (－)	0.5	17
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	22	416	0.85	16
	BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	2	34	－	－
	GLOBAL NET LEASE INC	23	200	－	－
	CITY OFFICE REIT INC	2	29	－	－
	NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	－ (7)	－ (－)	－	－
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1	77	－	－
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	5	115	－	－
	EQUITY RESIDENTIAL	15	1,173	2	155
	FELCOR LODGING TRUST INC	8	90	1	17
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	27	752	9	264
	HOST HOTELS & RESORTS INC	32	660	6	127
	LIBERTY PROPERTY TRUST	5	203	0.52	19
	LASALLE HOTEL PROPERTIES	4	149	－	－
	PUBLIC STORAGE	6	1,277	0.77	153
	SIMON PROPERTY GROUP INC	13	2,517	2	450
	VORNADO REALTY TRUST	7	811	1	117
	KIMCO REALTY CORP	16	409	0.88	23
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	6	1,047	0.68	118
	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	6	268	0.56	22
	小計	1,008 (△ 25)	34,327 (16)	92 (52)	3,586 (1,295)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1	77	0.8	45
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	3	104	1	29
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3	86	－	－
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	1	59	－	－
	CHARTWELL RETIREMENT RESIDEN	1	17	9	105
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	2	48	－	－
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2	53	－	－
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	6	132	－	－
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	2	38	1	19
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	1	25	－	－
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5	154	－	－
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	1	53	－	－
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	3	39	－	－
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	1	23	4	51
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO	0.5	14	－	－
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	2	21	－	－
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	2	23	－	－
	ONEREIT	6	21	7	23
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	0.8	34	－	－
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	2	18	－	－
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	2	17	－	－

銘柄			買付		売付	
			口数	金額	口数	金額
外国	カナダ		千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
		MILESTONE APARTMENTS REAL ES	1	16	－	－
		PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	4	20	－	－
		CHOICE PROPERTIES REIT	1	17	－	－
		SLATE RETAIL REIT - U	2	34	－	－
	小計		64	1,156	24	274
	ユーロ			千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ					
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	5 (－)	71 (△4)	－	－
		HAMBORNER REIT AG	4	39	－	－
		HAMBORNER REIT AG-RTS	－ (5)	－ (－)	5	0.28325
	小計		10 (5)	110 (△4)	5	0.28325
	イタリア					
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	－ (－)	－ (△0.46489)	－	－
		BENI STABILI SPA	62 (－)	44 (△1)	16	11
	小計		62 (－)	44 (△2)	16	11
	フランス					
		GECINA SA	1	156	0.15	16
		KLEPIERRE	20	838	4	195
		UNIBAIL-RODAMCO SE	4	999	0.585	141
		AFFINE	1	17	－	－
		FONCIERE DES REGIONS	2 (－)	186 (△7)	0.77 (－)	60 (0.00001)
		FONCIERE DES REGIONS-RTS	－ (5)	－ (－)	5	6
		MERCIALYS	2	49	5	107
		ICADE	1	96	－	－
		ALTAREA	0.08 (－)	10 (△2)	－	－
		FONCIERE DES MURS	1	35	－	－
	小計		34 (5)	2,391 (△9)	17 (－)	527 (0.00001)
	オランダ					
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	2	89	－	－
		NSI NV	9	31	－	－
		VASTNED RETAIL NV	0.6	26	－	－
		CORIO NV	0.4	16	10	452
		WERELDHAVE NV	2	132	0.25	13
	小計		14	297	10	465
	スペイン					
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	5	44	－	－

銘柄			買付		売付	
			口数	金額	口数	金額
外国	ユーロ		千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	スペイン					
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM-RTS	－ (4)	－ (－)	4	4
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	29	324	2	20
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA-RTS	－ (38)	－ (－)	38	39
		AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	5	57	1	16
		AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA-RTS	－ (3)	－ (－)	3	0.2358
	小計		39 (47)	426 (－)	50	82
	ベルギー					
		BEFIMMO	0.7	42	－	－
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	1	29	－	－
		RETAIL ESTATES	0.78	57	－	－
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	0.43	29	－	－
		WERELDHAVE BELGIUM NV	0.32	32	－	－
		AEDIFICA	1	58	－	－
		AEDIFICA-RTS	－ (1)	－ (－)	1	0.21613
		COFINIMMO	1	139	0.3	30
		COFINIMMO-RTS	－ (2)	－ (－)	2	1
	小計		6 (3)	390 (－)	3	33
	アイルランド					
		GREEN REIT PLC	23	33	－	－
		HIBERNIA REIT PLC	24	29	－	－
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	41	45	－	－
	小計		88	108	－	－
	ユーロ計		256 (60)	3,768 (△ 16)	103 (－)	1,120 (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	43	356	6	51
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	13	106	1	12
		HAMMERSON PLC	32	208	3	23
		LAND SECURITIES GROUP PLC	34	436	2	37
		INTU PROPERTIES PLC	39	134	23	77
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	5 (45)	20 (－)	－	－
		SEGRO PLC	30	129	5	22
		WORKSPACE GROUP PLC	5	50	1	9
		MCKAY SECURITIES PLC-ORD	3	8	－	－
		SHAFTESBURY PLC	10	92	1	10
		BIG YELLOW GROUP PLC	5	33	－	－
		DERWENT LONDON PLC	5	184	0.4	14

銘柄		買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
外国	イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
	MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	1	8	7	33
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	24	39	－	－
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	36	41	－	－
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	42	23	－	－
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	7	22	－	－
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	46	54	－	－
	ASSURA PLC	124	68	－	－
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70	42	－	－
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	51	57	－	－
	REGIONAL REIT LTD	25	25	－	－
	小計	657 (45)	2,146 (－)	52	292
	オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
	VICINITY CENTRES	94	277	23	70
	ABACUS PROPERTY GROUP	10	29	－	－
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	91 (△ 99)	37 (－)	46	18
	360 CAPITAL GROUP LTD	15	17	－	－
	ALE PROPERTY GROUP	13	49	4	17
	CHARTER HALL GROUP	14	67	－	－
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	11	21	－	－
	CROMWELL PROPERTY GROUP	51	53	－	－
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	29	60	－	－
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	8	25	－	－
	NATIONAL STORAGE REIT	11	17	－	－
	GDI PROPERTY GROUP	17	16	－	－
	AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT	8	19	14	34
	SCENTRE GROUP	219	843	26	103
	ARENA REIT	11	18	－	－
	FEDERATION CENTRES	－ (226)	－ (599)	－	－
	NOVION PROPERTY GROUP	35 (△ 275)	84 (△ 599)	－	－
	GPT GROUP	77	348	－	－
	MIRVAC GROUP	155	290	26	49
	STOCKLAND	105	448	13	57
	WESTFIELD CORP	81	775	11	110
	DEXUS PROPERTY GROUP	45	340	3	26
	BWP TRUST	21	64	7	21
	INVESTA OFFICE FUND	24	96	6	23
	CHARTER HALL RETAIL REIT	16	70	－	－
	GOODMAN GROUP	64	397	－	－
	小計	1,234 (△ 148)	4,471 (－)	183	532
	ニュージーランド		千ニュージーランドドル		千ニュージーランドドル
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	13	23	－	－

銘柄		買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
外国	ニュージーランド	千口	千ニュージーランドドル	千口	千ニュージーランドドル
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	61	78	－	－
	GOODMAN PROPERTY TRUST	40	47	－	－
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	22	33	－	－
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD-RTS	－ (4)	－ (－)	4	0.13444
	STRIDE PROPERTY LTD	19	38	－	－
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	73	85	19	23
	ARGOSY PROPERTY LTD	25	28	－	－
	小計	255 (4)	336 (－)	24	23
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	92	4,391	15	701
	CHAMPION REIT	79	322	65	250
	PROSPERITY REIT	44	120	－	－
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	35	149	－	－
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	40	89	－	－
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	62	242	－	－
	FORTUNE REIT	46	377	－	－
	SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	24	89	－	－
	NEW CENTURY REIT	33	98	－	－
	小計	455	5,883	80	952
	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	84 (－)	149 (△1)	－	－
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	53	90	－	－
	KEPPEL REIT	62 (－)	74 (△1)	－	－
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	32 (－)	45 (△0.07737)	－ (－)	－ (0.00002)
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	52 (－)	64 (△4)	24	29
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	29 (－)	19 (△0.25657)	－	－
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	29	45	－	－
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	20	40	－	－
	STARHILL GLOBAL REIT	51 (－)	43 (△ 0.6696)	－	－
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	40 (－)	46 (△1)	－	－
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	28 (－)	46 (△6)	－	－
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	51 (－)	64 (△2)	20	25
	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	45 (－)	65 (△0.40148)	14	20

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	50 (－)	17 (△ 2)	－	－
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	16 (－)	39 (△ 1)	－	－
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	36 (－)	55 (△ 0.1185)	－	－
	CACHE LOGISTICS TRUST	34 (－)	39 (△0.53073)	－ (－)	－ (0.03737)
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	62	95	15	23
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	21	17	－	－
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	19	17	－	－
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	37 (－)	26 (△ 0.7564)	－	－
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	64 (－)	65 (△ 2)	－	－
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	74	61	28	23
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	45 (－)	31 (△ 0.5998)	－	－
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE-RTS	－ (13)	－ (－)	13	1
	OUE HOSPITALITY TRUST	35	28	－	－
	SPH REIT	24	26	－	－
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	73 (－)	54 (△ 2)	32	23
	KEPPEL DC REIT	111	115	－	－
	CAPITALAND MALL TRUST	102 (－)	213 (△ 0.3276)	－	－
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	103 (－)	250 (△0.20117)	9	22
	小計	1,488 (13)	1,953 (△ 29)	155 (－)	170 (0.03739)
	イスラエル		千イスラエルシェケル		千イスラエルシェケル
	REIT 1 LTD	5	61	－	－
	小計	5	61	－	－

(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

（2015年１月６日～2016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	1,808千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	－千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	－

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2015年１月６日～2016年１月５日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	5,690	－	－	1,181	30	2.5

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

○組入資産の明細

（2016年１月５日現在）

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（アメリカ）	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
DDR CORP	29	41	680	81,077	0.5
HCP INC	45	63	2,415	288,030	1.8
MACERICH CO/THE	14	18	1,441	171,919	1.1
ACADIA REALTY TRUST	6	9	295	35,206	0.2
AGREE REALTY CORP	1	2	83	9,974	0.1
ALEXANDER'S INC	0.325	0.51	193	23,045	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7	9	882	105,183	0.6
PROLOGIS INC	49	71	2,984	355,886	2.2
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	10	15	612	72,996	0.5
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	8	12	73	8,713	0.1
ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	5	－	－	－	－
BIOMED REALTY TRUST INC	19	27	648	77,336	0.5
BRANDYWINE REALTY TRUST	18	23	322	38,510	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	8	11	899	107,262	0.7
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	17	20	248	29,624	0.2
CEDAR REALTY TRUST INC	5	10	73	8,804	0.1
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	13	18	729	86,929	0.5
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	9	12	278	33,189	0.2
COUSINS PROPERTIES INC	19	28	265	31,676	0.2
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	19	26	253	30,249	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	13	19	1,519	181,161	1.1
EASTGROUP PROPERTIES INC	3	4	235	28,102	0.2
EDUCATION REALTY TRUST INC	4	7	272	32,468	0.2
EPR PROPERTIES	5	8	472	56,371	0.3
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8	10	698	83,308	0.5
EQUITY ONE INC	7	10	270	32,305	0.2
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6	8	2,130	254,010	1.6
EXTRA SPACE STORAGE INC	11	16	1,476	176,013	1.1
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6	9	1,355	161,610	1.0
TRADE STREET RESIDENTIAL INC	0.9	－	－	－	－
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	11	14	322	38,468	0.2
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	5	8	88	10,599	0.1
GETTY REALTY CORP	2	3	55	6,582	0.0
GLIMCHER REALTY TRUST	14	－	－	－	－
WELLTOWER INC	32	48	3,287	391,969	2.4
HIGHWOODS PROPERTIES INC	9	12	550	65,605	0.4
HOME PROPERTIES INC	5	－	－	－	－
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	15	20	544	64,869	0.4
EQUITY COMMONWEALTH	12	17	480	57,238	0.4
INLAND REAL ESTATE CORP	9	12	136	16,278	0.1

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
KILROY REALTY CORP	8	12	771	92,033	0.6
KITE REALTY GROUP TRUST	8	11	288	34,359	0.2
LEXINGTON REALTY TRUST	20	27	219	26,207	0.2
LTC PROPERTIES INC	3	4	201	24,039	0.1
MACK-CALI REALTY CORP	7	11	271	32,371	0.2
BOSTON PROPERTIES INC	15	20	2,591	308,976	1.9
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	17	32	376	44,924	0.3
MID-AMERICA APARTMENT COMM	7	10	926	110,455	0.7
NATL HEALTH INVESTORS INC	3	4	277	33,141	0.2
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	12	22	787	93,865	0.6
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1	1	37	4,501	0.0
PARKWAY PROPERTIES INC	8	11	172	20,609	0.1
PENN REAL ESTATE INVEST TST	6	9	188	22,530	0.1
POST PROPERTIES INC	5	7	433	51,666	0.3
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	7	10	169	20,230	0.1
REALTY INCOME CORP	22	33	1,737	207,169	1.3
REGENCY CENTERS CORP	9	12	859	102,512	0.6
SAUL CENTERS INC	1	1	83	9,904	0.1
SENIOR HOUSING PROP TRUST	20	31	479	57,217	0.4
SL GREEN REALTY CORP	9	13	1,493	178,104	1.1
SOVRAN SELF STORAGE INC	3	4	523	62,386	0.4
STRATEGIC HOTELS & RESORTS I	26	－	－	－	－
SUN COMMUNITIES INC	4	7	514	61,350	0.4
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	20	28	341	40,697	0.3
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	9	13	426	50,864	0.3
TAUBMAN CENTERS INC	6	8	621	74,110	0.5
CUBESMART	16	23	707	84,300	0.5
UDR INC	25	35	1,307	155,846	1.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1	1	79	9,433	0.1
URSTADT BIDDLE - CLASS A	2	3	66	7,934	0.0
VENTAS INC	29	45	2,566	306,026	1.9
WASHINGTON REIT	6	8	236	28,225	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	11	15	522	62,252	0.4
HERSHA HOSPITALITY TRUST	20	6	135	16,205	0.1
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1	2	219	26,152	0.2
UMH PROPERTIES INC	1	2	28	3,381	0.0
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1	2	35	4,245	0.0
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	6	8	82	9,891	0.1
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	9	13	371	44,340	0.3
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	8	12	124	14,794	0.1
WINTHROP REALTY TRUST	－	5	67	8,022	0.0
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	8	12	438	52,230	0.3
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	12	16	112	13,438	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	13	19	579	69,093	0.4
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	16	－	－	－	－

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	6	8	274	32,704	0.2
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	7	10	271	32,418	0.2
EXCEL TRUST INC	5	－	－	－	－
CHESAPEAKE LODGING TRUST	5	8	199	23,748	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14	20	376	44,880	0.3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	5	9	267	31,908	0.2
CORESITE REALTY CORP	2	4	224	26,769	0.2
CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	7	9	64	7,681	0.0
AMERICAN ASSETS TRUST INC	3	5	199	23,804	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	8	11	130	15,535	0.1
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	6	9	142	17,020	0.1
RLJ LODGING TRUST	12	17	360	42,937	0.3
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	8	13	227	27,093	0.2
ROUSE PROPERTIES INC	3	5	70	8,446	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	6	9	171	20,453	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	5	9	185	22,133	0.1
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	23	32	471	56,171	0.3
SELECT INCOME REIT	3	8	163	19,526	0.1
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	12	17	453	54,078	0.3
WP CAREY INC	9	13	784	93,496	0.6
WHITESTONE REIT	2	4	47	5,613	0.0
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	5	7	349	41,647	0.3
CHATHAM LODGING TRUST	3	5	101	12,117	0.1
TERRENO REALTY CORP	4	5	129	15,427	0.1
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	3	4	70	8,364	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	40	59	580	69,220	0.4
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	11	15	427	50,966	0.3
AVIV REIT INC	2	－	－	－	－
GEO GROUP INC/THE	7	9	279	33,376	0.2
VEREIT INC	90	123	968	115,518	0.7
AMREIT INC	1	－	－	－	－
DUKE REALTY CORP	34	47	985	117,449	0.7
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	2	3	34	4,088	0.0
AMERICAN RESIDENTIAL PROPERT	2	4	84	10,129	0.1
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	4	7	121	14,476	0.1
PHYSICIANS REALTY TRUST	4	11	189	22,545	0.1
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	14	20	338	40,416	0.2
GRAMERCY PROPERTY TRUST	22	56	428	51,092	0.3
CYRUSONE INC	3	9	338	40,300	0.2
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	2	3	46	5,514	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	9	16	284	33,976	0.2
QTS REALTY TRUST INC-CL A	1	5	234	27,977	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	13	22	574	68,468	0.4
STARWOOD WAYPOINT RESIDE	3	5	114	13,610	0.1
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	12	16	379	45,302	0.3

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
WP GLIMCHER INC	15	24	258	30,849	0.2
CARETRUST REIT INC	2	5	61	7,377	0.0
NEW YORK REIT INC	15	22	257	30,745	0.2
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	2	2	32	3,839	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	9	12	351	41,951	0.3
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	3	3	25	3,004	0.0
IRON MOUNTAIN INC	18	25	690	82,339	0.5
STORE CAPITAL CORP	－	9	204	24,423	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	7	12	126	15,022	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES	－	12	293	35,033	0.2
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	－	1	31	3,808	0.0
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	－	22	217	25,922	0.2
XENIA HOTELS & RESORTS INC	－	14	222	26,559	0.2
NORTHSTAR REALTY FINANCE	－	25	430	51,271	0.3
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	－	3	58	7,002	0.0
NEXPOINT RESIDENTIAL	－	2	32	3,913	0.0
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	－	11	347	41,440	0.3
APPLE HOSPITALITY REIT INC	－	21	417	49,829	0.3
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	－	2	34	4,118	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	－	23	183	21,910	0.1
CITY OFFICE REIT INC	－	2	32	3,885	0.0
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	－	7	90	10,812	0.1
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	－	1	75	9,004	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	－	5	120	14,326	0.1
EQUITY RESIDENTIAL	35	49	3,951	471,131	2.9
FELCOR LODGING TRUST INC	10	16	118	14,175	0.1
GENERAL GROWTH PROPERTIES	62	79	2,115	252,216	1.6
HOST HOTELS & RESORTS INC	75	101	1,535	183,033	1.1
LIBERTY PROPERTY TRUST	14	19	618	73,773	0.5
LASALLE HOTEL PROPERTIES	11	15	375	44,752	0.3
PUBLIC STORAGE	14	19	4,881	581,967	3.6
SIMON PROPERTY GROUP INC	30	41	8,071	962,324	5.9
VORNADO REALTY TRUST	17	24	2,371	282,722	1.7
KIMCO REALTY CORP	41	56	1,450	172,942	1.1
AVALONBAY COMMUNITIES INC	13	18	3,359	400,498	2.5
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	14	20	830	99,064	0.6
小計 口数・金額	1,834	2,674	96,184	11,468,036	
小計 銘柄数＜比率＞	149	157	－	＜70.8%＞	
(カナダ)			千カナダドル		
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2	2	138	11,817	0.1
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	6	8	267	22,931	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5	8	232	19,903	0.1
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	3	4	195	16,729	0.1
CHARTWELL RETIREMENT RESIDEN	8	－	－	－	－
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	7	10	155	13,300	0.1

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV		5	7	124	10,668	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		13	19	382	32,722	0.2
INNVEST REAL ESTATE INVESTME		7	7	37	3,202	0.0
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS		2	4	55	4,708	0.0
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST		1	3	54	4,688	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		15	20	493	42,219	0.3
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT		3	5	160	13,716	0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT		7	10	128	11,012	0.1
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME		6	4	62	5,354	0.0
BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO		1	2	52	4,459	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		2	4	41	3,544	0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV		5	7	68	5,856	0.0
ONEREIT		2	1	5	447	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		2	3	119	10,205	0.1
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		2	5	38	3,256	0.0
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		2	4	33	2,884	0.0
MILESTONE APARTMENTS REAL ES		2	3	56	4,840	0.0
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI		2	2	27	2,361	0.0
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE		10	14	63	5,473	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT		4	5	68	5,898	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		3	3	43	3,766	0.0
PLAZA RETAIL REIT		4	4	20	1,768	0.0
SLATE RETAIL REIT - U		—	2	35	3,060	0.0
小計	口数・金額	143	184	3,163	270,798	
	銘柄数＜比率＞	28	28	—	＜1.7%＞	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		8	13	168	21,750	0.1
HAMBORNER REIT AG		3	8	78	10,116	0.1
小計	口数・金額	11	21	246	31,867	
	銘柄数＜比率＞	2	2	—	＜0.2%＞	
(ユーロ…イタリア)						
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		36	36	31	4,131	0.0
BENI STABILI SPA		100	147	104	13,457	0.1
小計	口数・金額	137	184	136	17,589	
	銘柄数＜比率＞	2	2	—	＜0.1%＞	
(ユーロ…フランス)						
GECINA SA		3	4	537	69,398	0.4
KLEPIERRE		9	25	1,028	132,813	0.8
UNIBAIL-RODAMCO SE		9	13	3,057	394,760	2.4
AFFINE		—	1	17	2,232	0.0
FONCIERE DES REGIONS		4	5	474	61,310	0.4
MERCIALYS		5	2	43	5,553	0.0
ANF IMMOBILIER		1	1	22	2,850	0.0
ICADE		3	4	289	37,364	0.2
ALTAREA		0.2	0.28	50	6,508	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	%
FONCIERE DES MURS		－	1	35	4,585	0.0
小計	口数・金額	37	60	5,555	717,378	
	銘柄数＜比率＞	8	10	－	＜4.4%＞	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV		4	6	254	32,914	0.2
NSI NV		10	19	76	9,910	0.1
VASTNED RETAIL NV		1	2	106	13,775	0.1
CORIO NV		9	－	－	－	－
WERELDHAVE NV		3	5	279	36,107	0.2
小計	口数・金額	29	33	717	92,707	
	銘柄数＜比率＞	5	4	－	＜0.6%＞	
(ユーロ…スペイン)						
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		3	8	80	10,337	0.1
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		13	41	467	60,399	0.4
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA		3	7	95	12,301	0.1
小計	口数・金額	20	56	643	83,038	
	銘柄数＜比率＞	3	3	－	＜0.5%＞	
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO		1	2	142	18,395	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES		－	1	33	4,313	0.0
RETAIL ESTATES		－	0.78	60	7,842	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA		1	1	134	17,326	0.1
WERELDHAVE BELGIUM NV		－	0.32	34	4,462	0.0
AEDIFICA		0.97	2	122	15,859	0.1
COFINIMMO		1	2	275	35,594	0.2
小計	口数・金額	5	11	803	103,793	
	銘柄数＜比率＞	4	7	－	＜0.6%＞	
(ユーロ…アイルランド)						
GREEN REIT PLC		66	89	139	18,020	0.1
HIBERNIA REIT PLC		66	90	123	15,975	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		12	53	60	7,870	0.0
小計	口数・金額	144	233	324	41,866	
	銘柄数＜比率＞	3	3	－	＜0.3%＞	
ユーロ計	口数・金額	387	601	8,427	1,088,240	
	銘柄数＜比率＞	27	31	－	＜6.7%＞	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		101	139	1,073	188,275	1.2
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		34	46	381	66,975	0.4
HAMMERSON PLC		77	105	627	110,112	0.7
LAND SECURITIES GROUP PLC		77	108	1,270	222,917	1.4
INTU PROPERTIES PLC		93	109	339	59,643	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		9	60	65	11,498	0.1
SEGRO PLC		73	98	419	73,609	0.5
WORKSPACE GROUP PLC		11	16	155	27,344	0.2
MCKAY SECURITIES PLC-ORD		8	11	31	5,454	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	
(イギリス)	千口	千口	千イギリスポンド	千円	%
SHAFTESBURY PLC	28	37	339	59,606	0.4
BIG YELLOW GROUP PLC	14	19	160	28,190	0.2
DERWENT LONDON PLC	10	14	543	95,425	0.6
MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	5	—	—	—	—
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	59	83	137	24,157	0.1
HANSTEEN HOLDINGS PLC	66	102	117	20,637	0.1
REDEFINE INTERNATIONAL PLC	95	138	68	12,069	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	20	28	100	17,625	0.1
TRITAX BIG BOX REIT PLC	46	92	118	20,819	0.1
ASSURA PLC	94	218	120	21,133	0.1
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	—	70	41	7,338	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	—	51	58	10,210	0.1
REGIONAL REIT LTD	—	25	25	4,518	0.0
小計 口数・金額	929	1,578	6,198	1,087,563	
小計 銘柄数＜比率＞	19	21	—	＜6.7%＞	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES	142	440	1,247	106,874	0.7
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	6	6	34	2,979	0.0
ABACUS PROPERTY GROUP	26	36	116	10,011	0.1
ASPEN GROUP	11	11	14	1,221	0.0
INGENIA COMMUNITIES GROUP	75	19	58	4,970	0.0
360 CAPITAL GROUP LTD	19	34	32	2,778	0.0
ALE PROPERTY GROUP	16	25	94	8,128	0.1
CHARTER HALL GROUP	27	41	187	16,027	0.1
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	16	27	60	5,182	0.0
GALILEO JAPAN TRUST	15	15	29	2,500	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP	123	174	181	15,592	0.1
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	62	92	198	16,986	0.1
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	17	26	78	6,750	0.0
NATIONAL STORAGE REIT	24	35	54	4,661	0.0
GDI PROPERTY GROUP	49	66	56	4,835	0.0
INDUSTRIA REIT	13	13	27	2,339	0.0
AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT	6	—	—	—	—
360 CAPITAL OFFICE FUND	7	7	15	1,370	0.0
SCENTRE GROUP	530	723	3,018	258,618	1.6
ARENA REIT	16	27	47	4,112	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	16	16	43	3,690	0.0
NOVION PROPERTY GROUP	239	—	—	—	—
GPT GROUP	168	245	1,162	99,633	0.6
MIRVAC GROUP	359	488	968	83,033	0.5
STOCKLAND	232	324	1,331	114,058	0.7
WESTFIELD CORP	190	260	2,448	209,810	1.3
DEXUS PROPERTY GROUP	89	131	985	84,409	0.5
BWP TRUST	51	65	205	17,600	0.1
INVESTA OFFICE FUND	61	80	321	27,569	0.2

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリアドル	千円	%
CHARTER HALL RETAIL REIT		29	46	193	16,612	0.1
GOODMAN GROUP		151	215	1,351	115,782	0.7
小計	口数・金額	2,796	3,697	14,565	1,248,145	
	銘柄数＜比率＞	31	29	－	＜7.7%＞	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR		27	40	76	6,149	0.0
KIWI PROPERTY GROUP LTD		95	156	210	16,932	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST		103	143	177	14,305	0.1
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD		41	63	101	8,142	0.1
STRIDE PROPERTY LTD		28	48	105	8,481	0.1
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL		90	143	179	14,400	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD		83	108	124	10,025	0.1
小計	口数・金額	468	704	975	78,436	
	銘柄数＜比率＞	7	7	－	＜0.5%＞	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		229	306	13,968	214,841	1.3
CHAMPION REIT		266	280	1,080	16,622	0.1
PROSPERITY REIT		134	178	494	7,610	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN		115	150	619	9,527	0.1
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT		75	115	219	3,378	0.0
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		91	153	579	8,918	0.1
FORTUNE REIT		131	177	1,373	21,124	0.1
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN		66	90	270	4,152	0.0
NEW CENTURY REIT		30	63	182	2,809	0.0
小計	口数・金額	1,137	1,512	18,789	288,986	
	銘柄数＜比率＞	9	9	－	＜1.8%＞	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		249	333	519	43,419	0.3
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		209	263	352	29,502	0.2
KEPPEL REIT		161	223	208	17,457	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST		51	83	104	8,769	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST		92	120	140	11,744	0.1
CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST		115	144	81	6,805	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS		66	95	125	10,489	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		58	78	144	12,084	0.1
STARHILL GLOBAL REIT		135	186	141	11,824	0.1
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		151	191	189	15,817	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS		58	86	129	10,790	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		51	82	98	8,216	0.1
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL		52	83	115	9,627	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL		184	234	73	6,165	0.0
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		32	48	112	9,369	0.1
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		117	153	234	19,581	0.1
CACHE LOGISTICS TRUST		67	101	91	7,646	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		131	178	233	19,518	0.1

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポールドル	千円	%
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		78	99	64	5,424	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		56	75	53	4,454	0.0
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST		84	121	90	7,591	0.0
MAPLETREE GREATER CHINA COMM		173	237	215	18,040	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI		51	97	74	6,207	0.0
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		31	76	49	4,132	0.0
OUE HOSPITALITY TRUST		80	115	86	7,262	0.0
SPH REIT		81	105	100	8,415	0.1
FRASERS HOSPITALITY TRUST		51	92	68	5,733	0.0
KEPPEL DC REIT		—	111	112	9,449	0.1
CAPITALAND MALL TRUST		262	364	696	58,284	0.4
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		198	292	657	55,014	0.3
小計	口数・金額	3,125	4,471	5,365	448,842	
	銘柄数＜比率＞	29	30	—	＜2.8%＞	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
REIT 1 LTD		15	20	218	6,643	0.0
小計	口数・金額	15	20	218	6,643	
	銘柄数＜比率＞	1	1	—	＜0.0%＞	
合計	口数・金額	10,836	15,444	—	15,985,693	
	銘柄数＜比率＞	300	313	—	＜98.7%＞	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 比率および合計欄の＜　＞内は、純資産総額に対する評価額の比率。

○投資信託財産の構成

(2016年１月５日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資証券	15,985,693	97.6
コール・ローン等、その他	399,469	2.4
投資信託財産総額	16,385,162	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（16,179,662千円）の投資信託財産総額（16,385,162千円）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＝119.23円	１カナダドル＝85.60円	１ユーロ＝129.13円	１イギリスポンド＝175.46円
１オーストラリアドル＝85.69円	１ニュージーランドドル＝80.40円	１香港ドル＝15.38円	１シンガポールドル＝83.65円
１イスラエルシェケル＝30.42円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年１月５日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	16,403,775,260
コール・ローン等	330,834,232
投資証券(評価額)	15,985,693,734
未収入金	20,017,479
未収配当金	67,229,682
未収利息	133
(B) 負債	212,549,629
未払金	197,585,434
未払解約金	14,964,195
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	16,191,225,631
元本	10,718,844,576
次期繰越損益金	5,472,381,055
(D) 受益権総口数	10,718,844,576口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	15,105円

＜注記事項＞

①期首元本額　7,791,829,073円
　期中追加設定元本額　4,243,268,254円
　期中一部解約元本額　1,316,252,751円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.5105円です。

○損益の状況 (2015年１月６日～2016年１月５日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	532,771,488
受取配当金	531,902,777
受取利息	201,928
その他収益金	666,783
(B) 有価証券売買損益	△ 837,602,058
売買益	735,584,520
売買損	△1,573,186,578
(C) 保管費用等	△ 9,344,466
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	△ 314,175,036
(E) 前期繰越損益金	4,194,829,368
(F) 追加信託差損益金	2,307,071,131
(G) 解約差損益金	△ 715,344,408
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	5,472,381,055
次期繰越損益金(Ｈ)	5,472,381,055

(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）	226,890,488円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	148,348,798円
三菱ＵＦＪ 資産設計ファンド（分配型）	29,011,088円
三菱ＵＦＪ 資産設計ファンド（バランス型）	54,577,143円
三菱ＵＦＪ 資産設計ファンド（株式重視型）	22,812,540円
ファンド・マネジャー（海外リート）	249,714,688円
ＦＰバランスファンド（安定型）	13,565,884円
ＦＰバランスファンド（安定成長型）	20,563,159円
ｅＭＡＸＩＳ 先進国リートインデックス	6,992,095,643円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,351,847,191円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	282,841,780円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞先進国ＲＥＩＴインデックスファンド	1,002,242,363円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	114,395,634円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	49,818,201円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	160,119,976円
合計	10,718,844,576円

［ お 知 ら せ ］

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