

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商 品 分 類	追加型投信／内外／資産複合	
信 託 期 間	2023年5月12日まで（2013年7月1日設定）	
運 用 方 針	各マザーファンド受益証券等への投資を通じて、利子・配当等収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。各マザーファンドへの投資比率は、世界の金利・株価動向と市場のリスク水準に応じて決定し、適宜変更します。実質組入外貨建資産については、その相当額について米ドル売り、円買いの為替取引を行うことを基本とします。ただし、円と米ドルの金利差が拡大するなどの局面においては、機動的に当該為替取引の額を変動させることがあります。	
主要運用対象	ベビーファンド	TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、マネー・マーケット・マザーファンド受益証券およびコール・ローン等の短期金融資産を主要投資対象とします。このほか、上場投資信託証券に直接投資することがあります。
	TOPIXマザーファンド	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
	外国株式インデックスマザーファンド	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円換算ベース) に採用されている株式を主要投資対象とします。
	新興国株式インデックスマザーファンド	新興国の株式等 (DR (預託証券) を含みます。) を主要投資対象とします。
	日本債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI 総合インデックスに採用されている公社債を主要投資対象とします。
	外国債券インデックスマザーファンド	シティ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース) に採用されている国債を主要投資対象とします。
	新興国債券インデックスマザーファンド	新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	マネー・マーケット・マザーファンド	わが国の公社債等を主要投資対象とします。
	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40%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。
	TOPIXマザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	外国株式インデックスマザーファンド	株式および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
	新興国株式インデックスマザーファンド	株式および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
	日本債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分 配 方 針	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。
	マネー・マーケット・マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	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。

※公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA (ニーサ)」の適用対象です。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書 (全体版)

コアバランス

第 2 期 (決算日：2015年 5 月12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「コアバランス」は、去る5月12日に第2期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

三菱UFJ投信株式会社は2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、「三菱UFJ国際投信株式会社」となる予定です。



三菱UFJ投信

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

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

営業企画推進部

お客様専用フリーダイヤル

TEL. 0120-151034

(9:00~17:00、土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)

お客様のお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目次

コアバランスのご報告

◇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	10
◇1万口当たりの費用明細	11
◇売買及び取引の状況	12
◇株式売買比率	12
◇利害関係人との取引状況等	12
◇自社による当ファンドの設定・解約状況	15
◇組入資産の明細	15
◇有価証券の貸付及び借入の状況	15
◇投資信託財産の構成	16
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	17
◇損益の状況	17
◇お知らせ	18

マザーファンドのご報告

◇TOPIXマザーファンド	19
◇外国株式インデックスマザーファンド	52
◇新興国株式インデックスマザーファンド	94
◇日本債券インデックスマザーファンド	124
◇外国債券インデックスマザーファンド	153
◇新興国債券インデックスマザーファンド	180

本資料の表記にあたって

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

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 証 書 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 金	期 騰 落 中 率						
(設定日)	円	円		%	%	%	%	%	%	百万円
2013年7月1日	10,000	—		—	—	—	—	—	—	10
1期(2014年5月12日)	10,474		0	4.7	34.0	0.5	59.0	0.0	0.3	10
2期(2015年5月12日)	10,740		0	2.5	17.6	0.3	61.3	0.1	0.2	11

- (注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。
- (注) 当ファンドは、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産を実質的な主要投資対象とし、利子・配当等収益の確保および値上がり益の獲得をめざしますが、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。
- (注) 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	騰 落 率	株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%
2014年 5月12日	10,474	—	34.0	0.5	59.0	0.0	0.3
5月末	10,588	1.1	34.4	0.6	58.3	0.0	0.3
6月末	10,699	2.1	19.8	0.3	58.6	0.0	0.2
7月末	10,742	2.6	19.8	0.3	58.9	0.0	0.2
8月末	10,750	2.6	19.4	0.3	58.8	0.1	0.2
9月末	10,567	0.9	19.7	0.3	59.2	0.1	0.2
10月末	10,705	2.2	34.3	0.7	59.3	0.2	0.2
11月末	10,926	4.3	34.8	0.5	58.6	0.1	0.2
12月末	10,825	3.4	34.3	0.6	58.3	0.0	0.2
2015年 1月末	10,738	2.5	17.4	0.2	61.6	0.0	0.2
2月末	10,784	3.0	18.4	0.3	60.9	0.0	0.2
3月末	10,708	2.2	17.7	0.3	61.6	—	0.2
4月末	10,829	3.4	17.8	0.3	61.4	0.0	0.2
(期 末)							
2015年 5月12日	10,740	2.5	17.6	0.3	61.3	0.1	0.2

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 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。

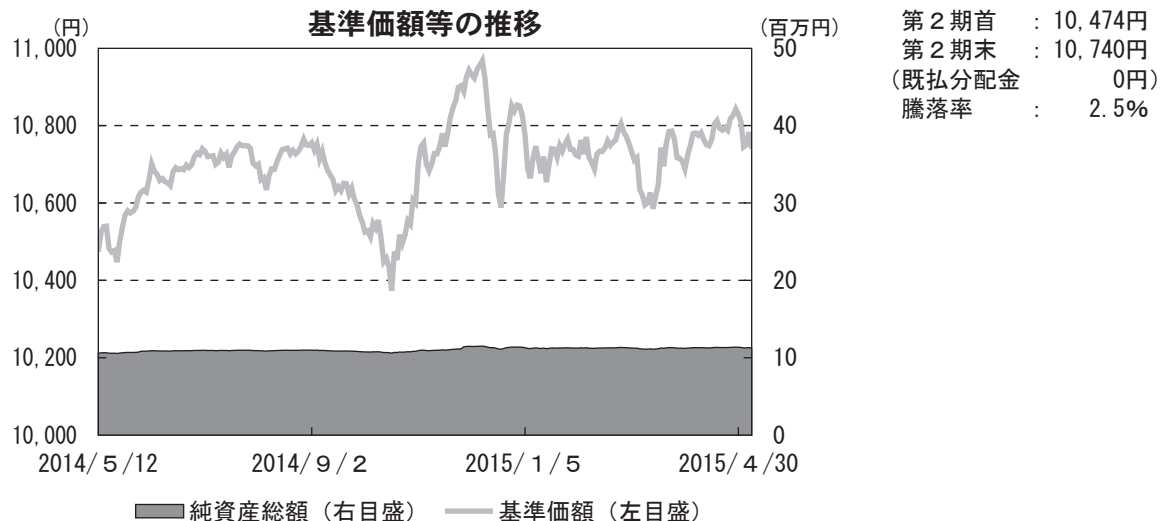
運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第2期：2014/5/13～2015/5/12)

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.5%の上昇となりました。



基準価額の主な変動要因

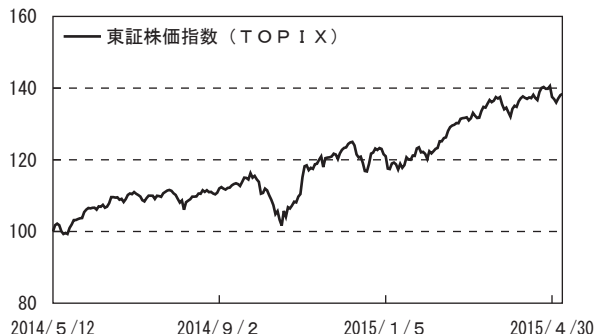
上昇要因

主として国内株式市況の上昇や、機動的な資産配分の変更が、基準価額のプラス要因となりました。

投資環境について

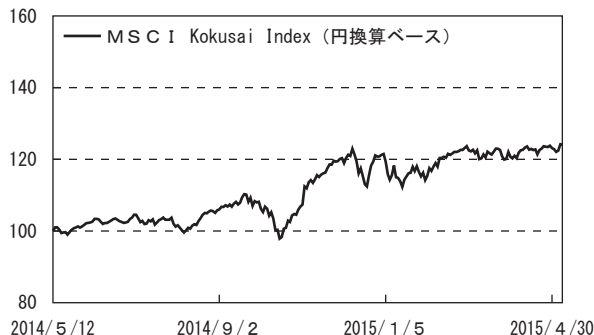
(第2期：2014/5/13～2015/5/12)

市況の推移
(期首を100として指数化)



(注) 東証株価指数 (TOPIX) とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

市況の推移
(期首を100として指数化)



(注) MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) とは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円換算ベース) は、MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ 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 Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) に対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

◎国内株式市況

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

◎外国株式市況

- ・欧州経済の先行き不透明感やギリシャ債務問題などを受けて下落する局面もありましたが、欧米での緩和的な金融政策や米国の良好な企業決算発表などを受けて外国株式市況は上昇しました。

市況の推移
(期首を100として指数化)

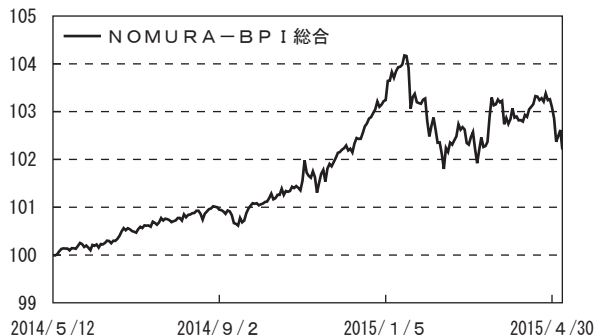


(注) MSCI エマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCI エマージング・マーケット・インデックス (円換算ベース) は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス (米ドルベース) をもとに、委託会社が計算したものです。また、MSCI エマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

◎新興国株式市況

- ・商品市況の下落などが嫌気される局面もありましたが、中国の金融緩和政策などを受けて外国株式市況は上昇しました。

市況の推移
(期首を100として指数化)

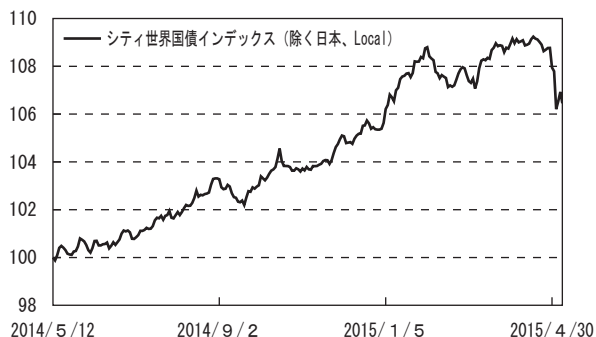


(注) NOMURA-BPI 総合とは、野村証券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI 総合は野村証券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し、野村証券株式会社は一切関係ありません。

◎国内債券市況

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

市況の推移
(期首を100として指数化)

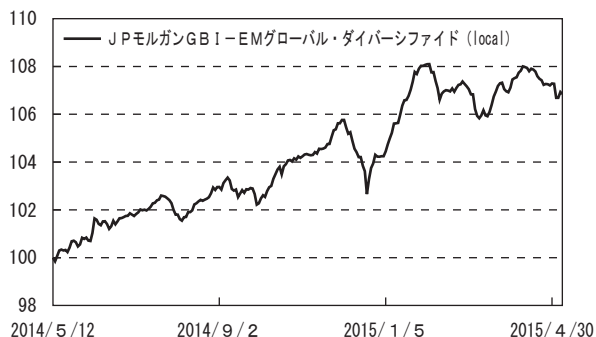


(注) シティ世界国債インデックス (除く日本) は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

◎外国債券市況

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

市況の推移
(期首を100として指数化)

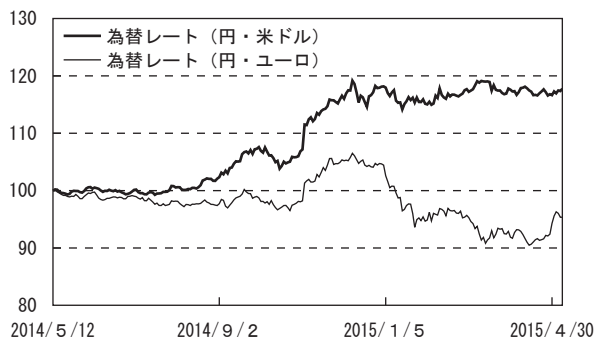


(注) J PモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

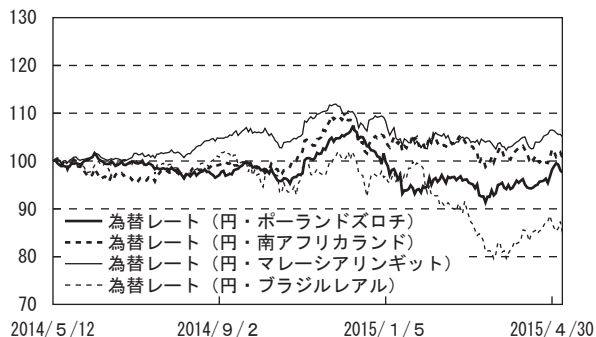
◎新興国債券市況

- ・新興国通貨建て債券市況の代表的な指標であるJ PモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド (local) は、債券価格が上昇（利回りは低下）したことなどを受けて、期首に比べて上昇しました。

為替市況の推移
(期首を100として指数化)



為替市況の推移
(期首を100として指数化)



◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、日銀による追加金融緩和策の発表・実施や、F R B（米連邦準備制度理事会）による利上げ観測の高まりなどから、米ドルが対円で買われました。期首との比較では、米ドルは対円で17.8%上昇しました。
- ・円・ユーロ相場は、E C B（欧州中央銀行）による追加緩和策の発表・実施や、ギリシャの情勢不安などを背景に、ユーロが対円で売られました。期首との比較では、ユーロは対円で4.6%下落しました。
- ・日銀による追加金融緩和策の発表・実施などを受けてタイやフィリピンなどアジア圏の通貨が対円で上昇した一方で、商品市況の低迷に伴いロシアルーブルやブラジルレアルなどの通貨が対円で下落しました。
- ・期首に比べて2.4%の円高・ポーランドズロチ安、0.8%の円安・南アフリカランド高、5.1%の円安・マレーシアリングギット高、14.9%の円高・ブラジルレアル安となりました。

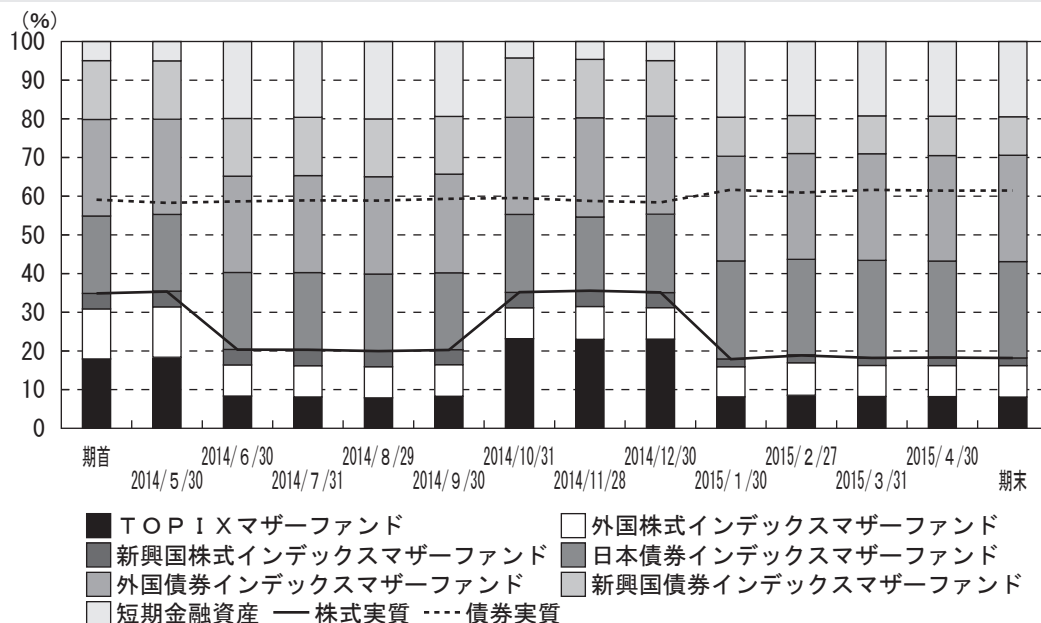
当該投資信託のポートフォリオについて

<コアバランス>

- ・主として景気動向と市場の変動をもとに「積極局面」、「中立局面」、「消極局面」に分け、判断した結果、期を通じて積極局面となりました。

	局面判断
当期	積極

- ・当期の資産配分の推移は以下の通りです。



- ・各マザーファンドへの投資比率は、期の序盤は局面判断を「積極局面」としながらも、内外株式の高値警戒感などから調整局面を想定し、リスクを抑制した運用を行いました。
- ・期の中盤は、世界経済は米国を中心として緩やかに拡大するとの見通しのもと、円安による企業業績上方修正や、株式需給面ではGPIF（年金積立金管理運用独立行政法人）や日銀などの買入れへの期待感から主に国内株式の比率を高めた運用を行いました。
- ・期の終盤は、基本的なマクロ経済の見通しおよび「積極局面」との判断に変更ないものの、相応に利益を獲得したことによる利益確定や原油をはじめとした資源価格の急落、ギリシャ債務問題などの不安材料が散見されたことから、リスクを抑制したアロケーションとしました。

こうした機動的な投資比率の変更が、基準価額へのプラス要因となりました。

基準価額は、投資した各資産の市況動向の影響を受けました。
要因別の内訳は以下の通りです。

（内訳）

ＴＯＰＩＸマザーファンド	5.5%程度
外国株式インデックスマザーファンド	2.2%程度
新興国株式インデックスマザーファンド	0.7%程度
日本債券インデックスマザーファンド	0.4%程度
外国債券インデックスマザーファンド	2.9%程度
新興国債券インデックスマザーファンド	0.7%程度
為替取引要因	△8.3%程度
その他（信託報酬など）	△1.6%程度

資産別騰落率および組入比率

		期中の 基準価額騰落率	期中の ベンチマーク騰落率	期末組入比率
国内株式	ＴＯＰＩＸマザーファンド	40.9%	38.4%	8.1%
先進国株式	外国株式インデックスマザーファンド	26.9%	24.2%	8.1%
新興国株式	新興国株式インデックスマザーファンド	23.1%	21.2%	2.0%
国内債券	日本債券インデックスマザーファンド	2.2%	2.2%	24.9%
先進国債券	外国債券インデックスマザーファンド	12.0%	12.2%	27.5%
新興国債券	新興国債券インデックスマザーファンド	3.2%	4.1%	10.0%

（注）基準価額とベンチマークの騰落率は、各マザーファンドの実際のパフォーマンスであり、ベビーファンドで行う米ドル売り・円買いの為替取引は考慮しておりません。

（注）期末組入比率は純資産総額に対する割合です。

<為替取引>

ファンドの基本方針に則り、概ね実質的な組入外貨建資産とほぼ同額の米ドル売り・円買いの為替取引を行いました。

日米金利差が拡大し円安が見込めると判断した局面（2014年5月～7月、2014年11月～2015年1月）では、米ドル売り比率を低下させたものの、期を通じて見ると米ドル高が進行したことなどから、為替取引要因はマイナスとなりました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・当ファンドは、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産を実質的な主要投資対象とし、利子・配当等収益の確保および値上がり益の獲得をめざしますが、特定の指数を上回るまたは運動をめざした運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。
- ・従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

分配金について

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

【分配原資の内訳】 (単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第2期
	2014年5月13日～2015年5月12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	739

(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

<コアバランス>

- ・各資産への配分比率は、引き続き各投資環境に応じた基本資産配分を基準に、各種経済指標などを勘案し決定します。
- ・投資環境は世界の景気動向と市場の変動などの状況に応じて、『積極、中立、消極』の3局面に分類しています。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2014年 5 月13日～2015年 5 月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 151	% 1.404	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(70)	(0.648)	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)	(75)	(0.702)	分配金・償還金・換金代金支払等の事務手続き、交付運用報告書等の送付、購入後の説明・情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(6)	(0.054)	投資信託財産の保管・管理、運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.003	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
(株 式)	(0)	(0.002)	有価証券等を売買する際に発生する費用
(新 株 予 約 権 証 券)	(0)	(0.000)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数
(株 式)	(0)	(0.001)	有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(新 株 予 約 権 証 券)	(0)	(0.000)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	24	0.221	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.023)	外国での資産の保管等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.003)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(21)	(0.196)	信託事務の処理等に要するその他諸費用（取引主体識別コードの登録（更新）手数料（固定額）に対し、ファンド規模が小さいため、金額・比率とも大きく表示されています。）
合 計	175	1.629	
期中の平均基準価額は、10,738円です。			

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

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

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

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

○売買及び取引の状況

(2014年5月13日～2015年5月12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
新興国株式インデックスマザーファンド	40	87	165	364
新興国債券インデックスマザーファンド	299	417	687	971
TOPIXマザーファンド	1,476	1,828	2,582	3,398
外国株式インデックスマザーファンド	94	195	451	884
日本債券インデックスマザーファンド	960	1,212	450	565
外国債券インデックスマザーファンド	464	965	398	814

○株式売買比率

(2014年5月13日～2015年5月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期		
	新興国株式インデックス マザーファンド	TOPIX マザーファンド	外国株式インデックス マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	11,584,253千円	126,813,999千円	76,575,341千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	30,733,053千円	232,375,052千円	205,745,833千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.37	0.54	0.37

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2014年5月13日～2015年5月12日)

利害関係人との取引状況

<コアバランス>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 56	百万円 13	% 23.2	百万円 58	百万円 16	% 27.6

< T O P I X マザーファンド >

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 35,521	百万円 6,087	% 17.1	百万円 91,292	百万円 18,629	% 20.4
株式先物取引	65,435	18,403	28.1	65,496	22,332	34.1

平均保有割合 0.0%

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

< 外国株式インデックスマザーファンド >

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 36,995	百万円 313	% 0.8	百万円 58,387	百万円 4,094	% 7.0

平均保有割合 0.0%

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

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

平均保有割合 0.0%

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

< 日本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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 140,321	百万円 38,627	% 27.5	百万円 81,907	百万円 24,091	% 29.4

平均保有割合 0.0%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

<外国債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 16,442	百万円 2,067	% 12.6	百万円 63,334	百万円 4,739	% 7.5

平均保有割合 0.0%

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

<新興国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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 6,035	百万円 155	% 2.6	百万円 919	百万円 20	% 2.2

平均保有割合 0.0%

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

利害関係人の発行する有価証券等

<TOPIXマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 1,025	百万円 2,397	百万円 7,368

<日本債券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
公社債	百万円 200	百万円 518	百万円 1,151

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

<TOPIXマザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 607

<日本債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額
公社債	百万円 300

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)	0.331千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.011千円
(B) / (A)	3.5%

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

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

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

○組入資産の明細

(2015年5月12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
新興国株式インデックスマザーファンド	218	93	223
新興国債券インデックスマザーファンド	1,196	807	1,120
TOPIXマザーファンド	1,676	570	910
外国株式インデックスマザーファンド	752	396	914
日本債券インデックスマザーファンド	1,720	2,230	2,803
外国債券インデックスマザーファンド	1,410	1,477	3,095

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。

○有価証券の貸付及び借入の状況

TOPIXマザーファンドにおいて2015年5月12日現在における貸付株数の総株数は23,118,000株です。うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUF G証券株式会社に対する貸付は、23,118,000株です。

○投資信託財産の構成

(2015年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
新興国株式インデックスマザーファンド	千円 223	% 2.0
新興国債券インデックスマザーファンド	1,120	9.9
T O P I Xマザーファンド	910	8.0
外国株式インデックスマザーファンド	914	8.0
日本債券インデックスマザーファンド	2,803	24.7
外国債券インデックスマザーファンド	3,095	27.2
コール・ローン等、その他	2,302	20.2
投資信託財産総額	11,367	100.0

(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 (39,376,310千円) の投資信託財産総額 (39,587,480千円) に対する比率は99.5%です。

(注) 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 (9,368,846千円) の投資信託財産総額 (9,429,649千円) に対する比率は99.4%です。

(注) 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産 (225,608,909千円) の投資信託財産総額 (230,900,633千円) に対する比率は97.7%です。

(注) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産 (159,819,513千円) の投資信託財産総額 (160,067,651千円) に対する比率は99.8%です。

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

1 アメリカドル=120.15円	1 カナダドル=99.26円	1 メキシコペソ=7.83円	1 ブラジルレアル=39.23円
100チリペソ=19.70円	100コロンビアペソ=5.03円	1 ペルーヌエボソル=38.11円	1 ユーロ=133.79円
1 イギリスポンド=187.06円	1 スイスフラン=128.37円	1 スウェーデンクローネ=14.44円	1 ノルウェークローネ=15.85円
1 デンマーククローネ=17.92円	1 トルコリラ=44.61円	1 チェココルナ=4.88円	100ハンガリーフォリント=43.87円
1 ポーランドズロチ=32.78円	1 ロシアルーブル=2.36円	1 オーストラリアドル=94.79円	1 ニュージーランドドル=88.11円
1 香港ドル=15.50円	1 シンガポールドル=89.72円	1 マレーシアリングgit=33.14円	1 タイバーツ=3.56円
1 フィリピンペソ=2.69円	100インドネシアルピア=0.92円	100韓国ウォン=10.96円	1 ニュー台湾ドル=3.91円
1 インドルピー=1.89円	1 アラブディルハム=32.77円	1 イスラエルシェケル=31.09円	1 カタールリアル=33.06円
1 南アフリカランド=9.94円	1 ナイジェリアナイラ=0.6014円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	16,681,935
コール・ローン等	2,270,030
新興国株式インデックスマザーファンド(評価額)	223,215
新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)	1,120,851
T O P I Xマザーファンド(評価額)	910,319
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	914,161
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	2,803,935
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	3,095,851
未収入金	5,343,570
未収利息	3
(B) 負債	5,423,890
未払金	5,345,340
未払信託報酬	78,367
その他未払費用	183
(C) 純資産総額(A－B)	11,258,045
元本	10,482,572
次期繰越損益金	775,473
(D) 受益権総口数	10,482,572口
1万口当たり基準価額(C／D)	10,740円

<注記事項>

①期首元本額	10,097,622円
期中追加設定元本額	384,950円
期中一部解約元本額	－円

○損益の状況 (2014年5月13日～2015年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	770
受取利息	770
(B) 有価証券売買損益	441,244
売買益	1,463,923
売買損	△1,022,679
(C) 信託報酬等	△ 177,049
(D) 当期繰越損益金(A＋B＋C)	264,965
(E) 前期繰越損益金	472,844
(F) 追加信託差損益金	37,664
(配当等相当額)	(18,646)
(売買損益相当額)	(19,018)
(G) 計(D＋E＋F)	775,473
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G＋H)	775,473
追加信託差損益金	37,664
(配当等相当額)	(19,325)
(売買損益相当額)	(18,339)
分配準備積立金	737,809

- (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

		第2期
費用控除後の配当等収益額	A	150,379円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	114,586円
収益調整金額	C	37,664円
分配準備積立金額	D	472,844円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	775,473円
当ファンドの期末残存口数	F	10,482,572口
1万口当たり収益分配対象額	G=E／F＊10,000	739円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F＊H／10,000	－円

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

【お 知 ら せ】

- ①対象インデックスとの連動を維持するために行う取引として、直物為替先渡取引を追加し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年8月12日)
- ②書面決議を行う場合の受益者数要件の撤廃を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ③併合手続要件の緩和を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ④買取請求の一部適用除外を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑤運用報告書の二段階化について信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑥新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑦デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑧2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。））の税率が適用されます。

T O P I X マザーファンド

《第14期》決算日2015年3月25日

[計算期間：2014年3月26日～2015年3月25日]

「T O P I X マザーファンド」は、3月25日に第14期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	東証株価指数（T O P I X）と連動する投資成果をめざして運用を行います。T O P I X からカイ離するリスクと運用コストの極小化を目的として、定量的なリスク管理に基づいたポートフォリオ構築と適切な売買執行を行います。株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は、原則として高位を維持します。
主 要 運 用 対 象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額	東 証 株 価 指 数 (T O P I X)	価 指 数	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰 落 中 率		期 騰 落 中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
10期(2011年3月25日)	7,748	△ 8.1	857.38	△10.0	98.1	1.9	179,093
11期(2012年3月26日)	7,888	1.8	851.82	△ 0.6	98.4	1.7	187,797
12期(2013年3月25日)	9,935	26.0	1,047.29	22.9	98.8	1.2	221,229
13期(2014年3月25日)	11,255	13.3	1,163.70	11.1	98.7	1.2	221,564
14期(2015年3月25日)	15,711	39.6	1,592.01	36.8	98.4	1.3	245,366

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

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 株 価 指 数 (T O P I X)	騰 落 率	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	円	騰 落 率				
(期 首) 2014年3月25日	11,255	% —	1,163.70	% —	% 98.7	% 1.2
3月末	11,746	4.4	1,202.89	3.4	98.0	2.1
4月末	11,351	0.9	1,162.44	△ 0.1	98.0	2.1
5月末	11,739	4.3	1,201.41	3.2	97.9	1.4
6月末	12,346	9.7	1,262.56	8.5	98.4	0.9
7月末	12,610	12.0	1,289.42	10.8	98.9	0.7
8月末	12,502	11.1	1,277.97	9.8	99.1	1.0
9月末	13,065	16.1	1,326.29	14.0	98.1	1.1
10月末	13,140	16.7	1,333.64	14.6	98.3	1.4
11月末	13,898	23.5	1,410.34	21.2	98.8	1.2
12月末	13,885	23.4	1,407.51	21.0	99.3	0.7
2015年1月末	13,960	24.0	1,415.07	21.6	98.3	0.7
2月末	15,038	33.6	1,523.85	30.9	97.8	1.1
(期 末) 2015年3月25日	15,711	39.6	1,592.01	36.8	98.4	1.3

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

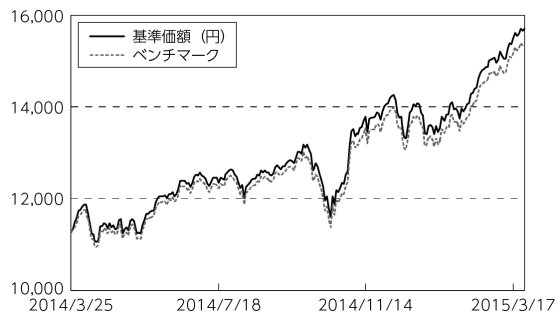
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ39.6%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(36.8%)を2.8%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

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは36.8%の上昇となったため、カイ離は2.8%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	2.8%程度	2.8%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、1.2%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2.8%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、再投資効果等	計 2.8%程度
マイナス要因	売買コスト等	計 △0.0%程度

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

信託財産の収益向上を目的に、保有株式の貸し付けを行っています。貸付契約額は、期末時点で概ね純資産総額の5割程度となり、信託財産に若干の収益寄与となりました。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2014年 3 月26日～2015年 3 月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 0	% 0.004	(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
(株 式)	(0)	(0.000)	有価証券等を売買する際に発生する費用
(先物・オプション)	(0)	(0.004)	
(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	0.004	
期中の平均基準価額は、12,940円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○ 売 買 及 び 取 引 の 状 況

(2014年 3 月26日～2015年 3 月25日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 30,195 (△ 751)	千円 34,719,638 ()	千株 70,804	千円 85,692,188

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円 62,695	百万円 63,330	百万円 —	百万円 —

○株式売買比率

(2014年3月26日～2015年3月25日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	120,411,827千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	230,104,102千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.52

(注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2014年3月26日～2015年3月25日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 34,719	百万円 5,427	% 15.6	百万円 85,692	百万円 19,228	% 22.4
株式先物取引	62,695	23,952	38.2	63,330	27,143	42.9

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 987	百万円 2,234	百万円 6,749

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 739

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	9,006千円
うち利害関係人への支払額 (B)	3,568千円
(B) / (A)	39.6%

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MUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2015年3月25日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
極洋	58	49	14,847
日本水産	182.2	142.9	52,158
マルハニチロ	—	22.3	39,738
マルハニチロホールディングス	285	—	—
サカタのタネ	21.9	18.7	36,820
ホクト	16.4	12.9	30,121
鉱業 (0.4%)			
住石ホールディングス	41.1	32.2	4,025
日鉄鉱業	38	32	15,232
三井松島産業	97	76	10,488
国際石油開発帝石	720.9	612.4	824,902
日本海洋掘削	3.7	3.5	14,192
石油資源開発	21.1	16.6	65,570
K&Oエナジーグループ	7.5	7.8	11,762
建設業 (2.5%)			
ショーボンドホールディングス	13.2	11.2	58,576
ミライト・ホールディングス	42.1	35.8	50,191
タマホーム	7.4	8.7	4,845
サンヨーホームズ	—	1.2	808
ダイセキ環境ソリューション	1.3	1.4	2,674
安藤・間	98.9	77.6	53,699
東急建設	52.6	41.3	29,033
コムシスホールディングス	72	51.7	74,396
ミサワホーム	15.9	13.7	14,796
高松コンストラクショングループ	11.2	8.8	23,012
東建コーポレーション	5.53	4.3	25,671
ヤマウラ	6.9	5.5	2,310
大成建設	750	604	431,860
大林組	445	349	283,388
清水建設	454	356	303,312
飛島建設	91.1	75.7	18,470
長谷工コーポレーション	197.7	145.3	167,530
松井建設	16	13	9,009

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
銭高組	16	17	6,596
鹿島建設	652	511	293,314
不動テトラ	104.7	88	21,296
大末建設	57	4.4	3,718
鉄建建設	90	71	30,104
日鉄住金テックスエンジ	24	22	12,958
西松建設	194	125	54,625
三井住友建設	398.5	471.6	79,700
大豊建設	46	32	19,904
前田建設工業	91	78	68,094
佐田建設	51	40	5,640
ナカノフドー建設	11.3	8.9	3,684
奥村組	131	110	64,900
大和小田急建設	8	6.3	5,852
東鉄工業	17.8	14	39,466
イチケン	16	13	4,264
浅沼組	45	37	5,624
戸田建設	172	146	75,628
熊谷組	160	146	55,626
青木あすなろ建設	9	7	6,314
北野建設	31	24	8,688
植木組	18	14	3,710
三井ホーム	19	15	8,280
矢作建設工業	20.2	14.4	11,779
ビーエス三菱	11.7	12.3	5,178
東日本ハウス	—	14.4	7,790
大東建託	56.3	44.1	608,139
新日本建設	17.6	13.8	6,541
N I P P O	34	27	51,732
東亜道路工業	28	22	9,086
前田道路	46	36	70,560
日本道路	40	35	22,120
東亜建設工業	129	87	18,096
若築建設	80	67	12,730

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東洋建設	46.1	34.8	17,156
五洋建設	176	129	56,373
大林道路	17	14	9,744
世紀東急工業	77	16.9	8,973
福田組	22	17	13,532
住友林業	102	85.7	114,066
日本基礎技術	16.5	14	6,174
日成ビルド工業	38	32	10,016
ヤマダ・エスバイエルホーム	67	53	5,088
巴コーポレーション	18.4	14.4	6,782
パナホーム	55	43	36,120
大和ハウス工業	407	340.4	807,428
ライト工業	30.9	18.6	18,376
積水ハウス	395	360.7	627,257
日特建設	18	15.6	7,909
北陸電気工事	7	6	4,254
ユアテック	23	18	15,228
西部電気工業	12	10	4,870
四電工	13	10	4,850
中電工	21.4	16.8	40,706
関電工	67	53	38,372
きんでん	99	77	114,730
東京エネシス	15	13	13,260
トーエネック	21	16	9,696
住友電設	10.2	9.2	12,466
日本電設工業	24	18.9	33,604
協和エクシオ	58.1	49.3	63,350
新日本空調	12.5	9.8	9,760
NDS	22	19	5,947
九電工	27	21	27,531
三機工業	32	23.6	21,877
日揮	149	117	278,050
中外炉工業	44	35	9,870
ヤマト	13	10	4,410
太平電業	22	16	13,808
高砂熱学工業	42.3	32.4	50,414
三晃金属工業	16	11	2,970
朝日工業社	17	13	6,214
明星工業	22	20.4	13,280

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大気社	19.6	16.6	49,800
ダイダン	20	16	13,632
日比谷総合設備	18.2	15	26,070
東芝プラントシステム	24.1	18.9	31,298
OSJBホールディングス	—	15.8	3,950
東洋エンジニアリング	79	56	18,760
千代田化工建設	118	84	86,604
新興プランテック	30.4	23.9	22,991
食料品 (4.1%)			
日本製粉	91	71	43,523
日清製粉グループ本社	147.8	127.5	183,855
日東富士製粉	12	9	3,267
昭和産業	61	48	24,384
鳥越製粉	11.8	9.2	6,587
協同飼料	51	—	—
中部飼料	14.2	11.1	7,636
日本配合飼料	45	—	—
フィード・ワンホールディングス	—	69.9	8,388
東洋精糖	22	18	1,872
日本甜菜製糖	76	59	12,508
三井製糖	58	46	20,608
塩水港精糖	8.6	12.4	3,496
森永製菓	145	105	45,360
中村屋	34	27	14,823
江崎グリコ	51	26.8	130,650
名糖産業	6.6	5.1	6,130
不二家	85	66	12,870
山崎製パン	109	85	182,325
第一屋製パン	20	16	2,032
モロゾフ	23	18	6,912
亀田製菓	8.3	6.5	30,777
寿スピリッツ	—	2.8	7,338
カルビー	54.4	43	223,170
森永乳業	125	104	49,296
六甲バター	6.6	5.2	6,245
ヤクルト本社	86.7	62.3	518,959
明治ホールディングス	43.9	34.4	507,056
雪印メグミルク	32	27.3	41,031
プリマハム	74	65	22,100

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本ハム	103	85	241,230
伊藤ハム	81	64	45,760
林兼産業	48	37	3,922
丸大食品	71	60	25,020
米久	4.7	3.7	6,915
S F o o d s	9.5	7.3	15,293
サッポロホールディングス	243	190	92,910
アサヒグループホールディングス	298	233.7	906,288
キリンホールディングス	634	497.4	824,191
宝ホールディングス	116	91.2	84,268
オエノンホールディングス	35	30	6,720
養命酒製造	11	7	7,028
コカ・コーラウエスト	45.7	39.4	78,051
コカ・コーライーストジャパン	30.6	35.3	83,661
サントリー食品インターナショナル	76.2	69.7	361,046
ダイドードリンコ	6.8	5.9	28,821
伊藤園	40.3	34.5	87,216
キーコーヒー	14	10.2	19,043
ユニカフェ	4	3.1	3,317
ジャパンフーズ	1.9	1.5	1,809
日清オイリオグループ	64	56	26,768
不二製油	36	31	58,466
かどや製油	1.5	1.1	3,159
Jーオイルミルズ	62	49	21,560
キッコーマン	121	95	364,325
味の素	353	268	731,908
キュービー	75.4	59.1	169,971
ハウス食品グループ本社	52.1	43	112,359
カゴメ	57.3	44.9	85,265
焼津水産化学工業	6.9	5.5	5,940
アリアケジャパン	13.5	10.6	43,142
エバラ食品工業	—	1.9	4,121
ニチレイ	158	124	82,832
東洋水産	73	60.7	276,488
イートアンド	0.8	1.3	2,672
日清食品ホールディングス	57.9	49.2	305,040
永谷園	14	11	12,980
一正蒲鉾	—	2	4,524
フジッコ	15	11	21,857

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ロック・フィールド	7.7	6	14,994
日本たばこ産業	821.6	644.2	2,459,233
ケンコーマヨネーズ	4.8	3.8	6,327
わらべや日洋	8.7	6.8	15,266
なとり	6.8	5.3	8,347
ユーグレナ	—	25.3	49,031
ミヨシ油脂	51	40	5,600
理研ビタミン	—	3.4	14,484
繊維製品 (0.8%)			
片倉工業	15.9	13.6	17,435
グンゼ	112	88	29,920
東洋紡	585	430	74,820
ユニチカ	380	316	17,696
富士紡ホールディングス	72	53	16,430
日清紡ホールディングス	88	69	84,042
倉敷紡績	142	111	24,864
シキボウ	80	62	7,688
日本毛織	44	34	28,798
大東紡織	21	16	1,200
トーア紡コーポレーション	59	49	3,675
ダイドーリミテッド	15.5	12.1	6,642
帝国繊維	14.5	11.4	19,836
帝人	566	444	184,260
東レ	1,005	841	884,311
サカイオーベックス	37	29	5,858
住江織物	38	27	8,424
日本フェルト	7.7	5.8	3,410
イチカワ	9	7	2,128
日本バイリーン	14	15	9,105
日東製網	16	13	2,184
芦森工業	30	23	3,680
アツギ	116	91	11,284
ダイニック	26	21	4,011
セーレン	37.2	27.1	29,484
東海染工	19	15	2,010
小松精練	23	18.1	10,516
ワコールホールディングス	82	65	94,770
ホギメディカル	8.7	6.8	40,936
レナウン	33.3	26.3	3,340

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
クラウドシア	1.6	2.5	1,592
T S I ホールディングス	66.6	48.5	40,546
三陽商会	73	57	17,784
ナイガイ	51	40	2,480
オンワードホールディングス	92	78	65,988
ルック	25	18	4,122
キムラタン	463	484	4,840
ゴールドウイン	32	25	19,550
デサント	32	24.8	35,811
キング	6.9	5.4	2,430
ヤマトインターナショナル	8.3	7.1	2,932
パルプ・紙 (0.2%)			
特種東海製紙	81	63	18,522
王子ホールディングス	612	446	230,582
日本製紙	71.6	52.4	97,568
三菱製紙	197	166	14,442
北越紀州製紙	94.5	67.4	38,687
中越パルプ工業	53	41	10,291
巴川製紙所	21	17	4,522
大王製紙	48	48	52,560
レンゴー	111	96	50,784
トーモク	44	34	9,962
ザ・バック	9.8	7.7	19,103
化学 (6.1%)			
クラレ	220.2	185	300,070
旭化成	864	678	821,736
共和レザー	9.1	7.1	5,893
コープケミカル	21	16	1,552
昭和電工	923	723	112,065
住友化学	1,020	800	496,000
日本化成	26	20	2,980
住友精化	29	23	20,171
日産化学工業	94.9	71.3	179,176
ラサ工業	52	41	5,822
クレハ	97	76	40,508
多木化学	9	7	5,096
テイカ	23	18	8,046
石原産業	249	182	21,112
片倉チッカリン	9	7	2,191

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本曹達	89	70	51,660
東ソー	370	271	158,264
トクヤマ	215	169	45,123
セントラル硝子	132	111	62,604
東亜合成	163	136	75,072
ダイソー	55	43	18,490
関東電化工業	33	26	20,072
電気化学工業	277	225	109,800
信越化学工業	248.5	194.9	1,591,163
日本カーバイド工業	40	37	8,880
堺化学工業	56	44	17,952
エア・ウォーター	114	96	210,912
大陽日酸	178	140	236,320
日本化学工業	51	40	10,960
日本パーカライジング	33	25.6	74,163
高圧ガス工業	21	16	10,208
チタン工業	16	13	3,120
四国化成工業	20	16	15,936
戸田工業	25	22	9,350
ステラ ケミファ	7.1	5.5	7,683
保土谷化学工業	41	33	6,831
日本触媒	117	85	153,425
大日精化工業	54	45	28,485
カネカ	173	147	128,772
三菱瓦斯化学	218	187	111,639
三井化学	630	494	191,672
J S R	127.1	107.3	228,441
東京応化工業	26.8	22.5	91,012
大阪有機化学工業	9.2	7.8	4,048
三菱ケミカルホールディングス	866.3	679.3	505,602
日本合成化学工業	28	25	20,300
ダイセル	180	152.8	233,172
住友ベークライト	108	102	56,610
積水化学工業	284	252	398,160
日本ゼオン	109	94	105,468
アイカ工業	38.9	32.7	91,952
宇部興産	698	547	108,853
積水樹脂	19.4	16.8	28,341
タキロン	32	23	12,673

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
旭有機材工業	49	38	10,260
日立化成	59.9	53.7	142,143
ニチバン	14	11	5,104
リケンテクノス	22	17.6	7,920
大倉工業	33	26	9,204
積水化成成品工業	39	31	14,384
群栄化学工業	37	29	10,121
タイガースポリマー	6.8	5.3	4,616
ミライアル	3.4	3.9	5,830
ダイキアクシス	—	1.2	1,329
ダイキョーニシカワ	—	2.6	9,126
日本化薬	97	71	106,287
カーリットホールディングス	11	8.6	5,908
日本精化	11.5	9	8,640
ADEKA	59.6	50.1	77,855
日油	115	90	80,640
新日本理化	16.4	17.1	3,847
ハリマ化成グループ	11.8	9.2	4,526
花王	360.4	292.2	1,765,764
第一工業製薬	25	24	9,960
三洋化成工業	44	34	33,456
大日本塗料	79	62	9,734
日本ペイントホールディングス	120	94	432,400
関西ペイント	168	132	300,168
神東塗料	8	8	1,864
中国塗料	40	31	34,069
日本特殊塗料	10.7	8.4	6,837
藤倉化成	17.5	14.8	8,421
太陽ホールディングス	11.3	8.8	38,412
DIC	491	435	149,640
サカタインクス	28.3	22.2	25,885
東洋インキＳＣホールディングス	125	107	62,809
T&K TOKA	5	3.6	8,708
富士フイルムホールディングス	317.1	248.7	1,070,777
資生堂	246.5	193.3	425,839
ライオン	160	125	92,625
高砂香料工業	50	36	19,980
マンダム	13.9	10.9	48,941
ミルボン	8.8	6.4	23,104

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ファンケル	32.1	25.2	39,639
コーセー	22.4	17.6	117,568
コタ	—	3.1	6,206
ドクターシーラボ	9.4	7.4	32,486
シーボン	1.2	1.2	3,672
ポーラ・オルビスホールディングス	14.1	12.9	82,431
ノエビアホールディングス	9.2	6.9	16,787
アジュバンコスメジヤパン	1.6	2	1,864
エステー	8.5	7.4	7,829
アグロ カネショウ	—	2.9	2,610
コニシ	10	8.5	17,391
長谷川香料	17.5	13.8	24,522
星光PMC	5.7	5.9	5,599
小林製薬	22.7	17.8	155,038
荒川化学工業	11.6	9.2	11,960
メック	10.7	8.4	7,215
日本高純度化学	0.039	3.1	7,932
JCU	2	3	16,230
新田ゼラチン	8.3	6.5	5,466
アース製薬	10	7.8	32,370
イハラケミカル工業	21.3	16.7	29,241
北興化学工業	14	12	4,884
大成ラミック	3.6	3	8,919
クミアイ化学工業	29	22.4	22,691
日本農薬	32	24.8	30,727
アキレス	110	92	14,536
有沢製作所	23.1	18.2	20,111
日東電工	114.2	84	694,932
レック	4.3	3.7	5,746
きもと	10.1	19.4	5,761
藤森工業	11.9	9.3	32,782
前澤化成工業	9.7	7.6	9,750
JSP	9	8.1	18,403
エフビコ	6.8	9.6	42,240
天馬	11	8.4	16,321
信越ポリマー	27.2	21.3	12,524
東リ	36	28	7,896
ニフコ	30.9	24.2	103,818
日本バルカー工業	58	45	14,760

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ユニ・チャーム	85	220	705,760
医薬品 (5.1%)			
協和発酵キリン	166	130	210,730
武田薬品工業	519.1	407.1	2,592,412
アステラス製薬	319.1	1,237.5	2,475,000
大日本住友製薬	98.1	76.9	116,811
塩野義製薬	216.4	169.7	709,346
田辺三菱製薬	115.3	126.6	267,505
わかもと製薬	16	12	3,744
あすか製薬	16.3	12.8	15,974
日本新薬	32	25	106,375
ピオフェルミン製薬	2.2	1.8	5,376
中外製薬	138	108.2	421,439
科研製薬	50	37	143,745
エーザイ	170.6	143.3	1,296,865
ロート製薬	58.1	49.4	85,462
小野薬品工業	62.9	49.4	691,600
久光製薬	43	30.7	152,272
有機合成薬品工業	9	7	2,009
持田製薬	10.2	7.8	63,258
参天製薬	50.9	39.9	361,095
扶桑薬品工業	47	37	12,099
日本ケミファ	19	14	8,778
ツムラ	40.7	34.2	103,284
日医工	32.4	25.4	72,263
キッセイ薬品工業	25.7	20.2	74,134
生化学工業	28.9	20.8	45,676
栄研化学	10.7	9.1	17,836
日水製薬	5.6	4.4	6,516
鳥居薬品	9.5	7.4	24,383
JCRファーマ	8	8.4	20,874
東和薬品	7.1	5.5	38,170
富士製薬工業	3.9	3.1	7,362
沢井製薬	21.9	17.2	126,248
ゼリア新薬工業	21.8	22.2	46,464
第一三共	436.9	365.4	738,838
キョーリン製薬ホールディングス	36.9	29	86,304
大幸薬品	6.6	4.8	9,460
ダイト	4.6	4.4	11,677

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大塚ホールディングス	275	215.6	808,392
大正製薬ホールディングス	33.3	26.1	238,554
石油・石炭製品 (0.4%)			
日本コークス工業	111.8	97.4	11,688
昭和シェル石油	123.9	97.1	109,528
コスモ石油	383	300	50,100
ニチレキ	17	13	14,599
東燃ゼネラル石油	209	164	178,596
ユシロ化学工業	7.5	6.4	10,227
ピーピー・カストロール	5.7	4.4	5,803
富士石油	35.3	25.2	10,281
MORESCO	3.3	2.8	5,639
出光興産	65.7	51.5	111,137
JXホールディングス	1,537.8	1,205.8	581,195
ゴム製品 (0.9%)			
横浜ゴム	155	121	148,830
東洋ゴム工業	115	49.2	115,177
ブリヂストン	434.2	340.5	1,639,167
住友ゴム工業	108.1	84.7	185,577
藤倉ゴム工業	8.7	9.1	6,952
オカモト	48	37	17,464
フコク	5.8	4.5	5,467
ニッタ	13.7	10.7	35,738
住友理工	25.6	20.1	21,708
三ツ星ベルト	35	28	27,440
バンドー化学	50	40	19,080
ガラス・土石製品 (0.9%)			
日東紡績	102	80	38,240
旭硝子	683	535	425,860
日本板硝子	668	524	62,356
石塚硝子	18	14	3,262
日本山村硝子	55	43	7,697
日本電気硝子	286	208	129,168
オハラ	5.2	4.1	2,443
住友大阪セメント	263	202	74,740
太平洋セメント	814	678	252,216
デイ・シイ	14.2	11.1	5,205
日本ヒューム	13	11.3	9,718
日本コンクリート工業	25	18.6	9,132

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三谷セキサン	6.9	5.4	10,692
ジャパンバイル	12.5	14.5	10,208
東海カーボン	129	94	32,900
日本カーボン	73	57	18,525
東洋炭素	8.5	6	13,926
ノリタケカンパニーリミテド	78	61	17,934
TOTO	204	160	279,360
日本碍子	175	137	356,748
日本特殊陶業	119	93.6	311,220
ダントーホールディングス	18	14	2,198
MARUWA	3.6	3.2	9,168
品川リフラクトリーズ	35	27	8,343
黒崎播磨	30	23	6,049
ヨータイ	8	6	2,400
イソライト工業	5	5.4	1,225
東京窯業	17	13	2,899
ニッカトー	4.9	3.9	1,634
フジミインコーポレーテッド	12.6	10.5	22,291
エーアンドエーマテリアル	29	23	2,714
ニチアス	67	48	33,360
ニチハ	16.9	14.4	20,116
鉄鋼 (1.5%)			
新日鐵住金	5,856	4,592	1,426,275
神戸製鋼所	2,209	1,878	430,062
中山製鋼所	78	81	7,452
合同製鐵	70	55	9,955
ジェイ エフ イー ホールディングス	353.4	277.1	771,169
日新製鋼	58.7	46	68,494
東京製鐵	76.4	54.9	46,061
共英製鋼	12.9	11.6	23,362
大和工業	28.7	24.7	74,223
東京鐵鋼	29	21	10,626
大阪製鐵	6.9	6.8	14,470
淀川製鋼所	98	77	39,193
東洋鋼板	33	26	14,560
丸一鋼管	46.3	33.3	96,736
モリ工業	21	17	7,378
大同特殊鋼	232	182	101,920
日本高周波鋼業	54	43	4,988

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本冶金工業	108	84.9	20,630
山陽特殊製鋼	76	65	32,305
愛知製鋼	74	64	37,824
日立金属	123	111	212,121
日本金属	36	28	4,088
大平洋金属	97	69	23,529
新日本電工	59	66.2	20,058
栗本鐵工所	72	56	13,272
虹技	15	15	3,315
日本鑄鉄管	15	11	2,552
三菱製鋼	84	71	18,673
日亜鋼業	19	15	5,175
日本精線	11	8	5,064
シンニッタン	13.1	11.2	6,630
新家工業	30	21	4,200
非鉄金属 (0.9%)			
大紀アルミニウム工業所	22	18	6,264
日本軽金属ホールディングス	313.5	263.4	50,572
三井金属鉱業	353	295	80,830
東邦亜鉛	78	61	23,912
三菱マテリアル	864	678	282,048
住友金属鉱山	358	300	558,000
DOWAホールディングス	153	130	137,930
古河機械金属	233	169	37,518
エス・サイエンス	47.2	52.6	2,472
大阪チタニウムテクノロジーズ	15.1	10.7	27,830
東邦チタニウム	23.4	18.4	15,640
UACJ	176	124	41,912
古河電気工業	435	319	68,904
住友電気工業	521.9	409.2	652,469
フジクラ	222	151	82,899
昭和電線ホールディングス	177	119	11,424
東京特殊電線	20	1.5	2,163
タツタ電線	20.2	20.3	10,434
沖電線	14	11	3,773
カナレ電気	1.9	1.7	4,355
平河ヒューテック	3	2.6	3,463
リョービ	84	61	22,875
アーレスティ	—	9.4	7,473

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	20.9	16.3	35,550
金属製品 (0.7%)			
稲葉製作所	5.9	4.6	6,177
宮地エンジニアリンググループ	45	31	6,200
トーカロ	8.4	7.1	16,535
アルファC o	4.6	3.6	5,119
SUMCO	84.7	74.7	165,385
川田テクノロジーズ	2.9	2	7,470
東洋製罐グループホールディングス	98.4	77.2	141,276
ホッカンホールディングス	33	26	7,644
コロナ	7.2	5.7	6,765
横河ブリッジホールディングス	26	20.5	26,588
O S J Bホールディングス	30.2	—	—
駒井ハルテック	27	19	5,054
高田機工	12	9	2,331
三和ホールディングス	117	104.7	94,125
文化シャッター	33	30	30,390
三協立山	16.9	14.2	32,688
アルインコ	—	4.6	5,267
東洋シャッター	3.7	2.7	2,292
L I X I Lグループ	192.9	161.3	475,835
日本フィルコン	9.1	7.9	3,831
ノーリツ	27.1	21.3	42,259
長府製作所	14.8	11.6	34,556
リンナイ	21.5	20.2	182,002
ダイニチ工業	7	5.5	4,460
日東精工	20	15	5,595
三洋工業	17	14	3,178
岡部	27.3	21.4	24,032
ジーテクト	—	7.4	8,539
中国工業	2.1	1.7	1,489
東ブレ	26.6	20.9	39,772
高周波熱錬	20.2	18.7	17,334
東京製鋼	94	73	14,016
サンコー	9	7	4,711
モリテック スチール	7	5.5	1,853
パイオラックス	6.5	5.5	28,820
日本発條	110.3	94.3	116,554
中央発條	18	14	4,942

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アドバネクス	27	20	3,620
三益半導体工業	11.7	8	11,400
機械 (5.0%)			
日本ドライケミカル	1	1.5	3,576
アタカ大機	9	—	—
日本製鋼所	198	156	82,524
三浦工業	20.6	48.4	66,985
タクマ	43	37	34,299
ツガミ	43	31	24,738
オークマ	90	71	81,508
東芝機械	75	59	30,680
アマダ	212	161.9	188,775
アイダエンジニアリング	32.5	23.7	32,706
滝澤鉄工所	34	34	8,160
富士機械製造	42.2	35.5	50,694
牧野フライス製作所	69	54	56,484
オーエスジー	56.9	49.5	117,859
ダイジェット工業	16	13	2,977
旭ダイヤモンド工業	35.6	29.7	41,995
DMG森精機	81.9	68.5	122,889
ディスコ	15.4	12.6	161,154
日東工器	8.1	6.3	14,175
パンチ工業	—	2.9	3,813
豊和工業	7.7	6.1	4,745
大阪機工	54	42	6,888
石川製作所	31	27	2,727
東洋機械金属	10.2	7.4	3,529
津田駒工業	34	26	3,848
エンシュウ	34	27	3,105
島精機製作所	18	15.3	32,742
日阪製作所	17	13.7	14,672
やまびこ	5.4	4.3	23,994
ベガサスミシン製造	12.7	9.5	5,785
ナブテスコ	63.2	66.1	239,943
三井海洋開発	11.4	10.9	20,481
レオン自動機	13	8.3	4,141
SMC	39.6	32.6	1,190,552
新川	11.5	9	7,452
ホソカワミクロン	23	18	11,538

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ユニオンツール	6	5.4	18,738
オイレス工業	13.1	13.6	33,116
日精エー・エス・ビー機械	3.8	3.5	8,904
サトーホールディングス	14.5	13.5	39,285
日本エアーテック	4.1	3.2	2,121
日精樹脂工業	10.1	7.9	10,720
ワイエイシイ	5.6	4.4	3,022
小松製作所	646.2	538.4	1,318,541
住友重機械工業	379	297	244,728
日立建機	70.7	48.5	105,293
日工	21	15	6,900
巴工業	4.8	4.1	7,298
井関農機	142	111	27,417
TOWA	11.3	8.9	6,408
丸山製作所	29	24	5,592
北川鉄工所	63	50	13,000
クボタ	723	524	1,052,454
荏原実業	3.6	3.2	4,604
三菱化工機	46	36	15,660
月島機械	22	19.1	24,944
帝国電機製作所	4.7	7.2	8,611
東京機械製作所	48	41	3,198
新東工業	32.5	25.5	24,327
澁谷工業	8.7	9.1	21,931
アイチ コーポレーション	19.6	15.4	9,532
小森コーポレーション	33.7	26.4	42,530
鶴見製作所	10	8.1	14,094
住友精密工業	22	17	8,228
酒井重工業	26	21	5,985
荏原製作所	306	225	120,825
石井鐵工所	20	16	3,648
西島製作所	14.7	10.6	9,614
北越工業	—	8	7,920
ダイキン工業	180.6	151.1	1,217,714
オルガノ	21	21	10,479
トーヨーカネツ	74	63	14,742
栗田工業	83.2	61.4	184,814
椿本チエイン	71	55	54,945
大同工業	27	21	5,754

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本コンベヤ	43	34	7,174
木村化工機	12.7	10	5,740
アネスト岩田	22	16.2	12,636
ダイフク	56	51.3	82,439
サムコ	1.7	1.4	1,745
加藤製作所	31	23	18,745
油研工業	26	20	5,400
タダノ	59	50	82,500
フジテック	39	30.2	39,380
CKD	37.1	29.1	34,134
キトー	7.8	11.3	14,125
平和	28.7	22.5	55,395
理想科学工業	10.2	12.6	26,334
SANKYO	40.1	31.4	141,300
日本金銭機械	12.2	9.6	17,376
マースエンジニアリング	7.5	5.9	13,251
福島工業	7.3	5.7	9,370
オーイズミ	4.6	3.6	3,384
ダイコク電機	5.5	4.3	8,096
アマノ	37.8	34.6	50,619
JUK I	85	77	32,417
サンデン	75	63	37,674
蛇の目ミシン工業	128	101	13,938
マックス	21	16	23,168
グローリー	39.5	33.2	112,382
新晃工業	9.2	7.2	9,655
大和冷機工業	21	15	11,430
セガサミーホールディングス	142.2	111.5	208,393
日本ピストンリング	52	40	10,400
リケン	52	45	22,230
TPR	14.7	11.6	37,932
ホンザギ電機	28.9	22.7	178,649
大豊工業	9.4	8.4	12,415
日本精工	294	213	381,057
NTN	306	240	150,240
ジェイテクト	140.6	110.6	212,462
不二越	123	96	62,976
日本トムソン	42	36	21,852
THK	82.5	69	217,695

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ユーシン精機	5.9	4.6	11,049
前澤給装工業	5	3.9	6,017
イーグル工業	16.4	14.4	35,438
前澤工業	9.7	7.6	2,644
日本ビラー工業	14.4	11.3	11,367
キッツ	59.4	46.5	28,179
日立工機	35.4	27.8	28,495
マキタ	86.3	67.7	439,373
日立造船	98.1	81.1	51,579
三菱重工業	2,356	1,739	1,183,389
I H I	913	747	426,537
電気機器 (13.1%)			
イビデン	80.6	68	143,412
コニカミノルタ	349.5	247.2	315,180
ブラザー工業	171	134.1	266,054
ミネベア	180	154	304,766
日立製作所	3,183	2,491	2,091,692
東芝	2,611	2,184	1,160,796
三菱電機	1,323	1,037	1,516,094
富士電機	368	289	162,418
東洋電機製造	28	20	8,600
安川電機	145	122.1	217,704
シンフォニアテクノロジ	80	72	14,976
明電舎	122	95	38,285
オリジン電気	19	15	7,845
山洋電気	20	23	19,757
デンヨー	13	9.4	17,371
東芝テック	83	74	58,460
芝浦メカトロニクス	23	17	5,168
マブチモーター	18.7	31.7	202,880
日本電産	71.5	112.2	906,351
東光高岳	7.4	5.2	9,183
宮越ホールディングス	4.5	3.5	1,809
ダイヘン	78	57	34,542
田淵電機	—	8.8	12,038
ヤーマン	1.7	1.3	2,262
JVCケンウッド	91.4	76.1	27,776
第一精工	5.5	3.8	10,993
日新電機	27	24	17,328

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大崎電気工業	21	17	13,906
オムロン	149.3	112	621,600
日東工業	19.4	16.6	38,196
I D E C	17.3	12.3	13,517
不二電機工業	—	1	1,386
ジーエス・ユアサ コーポレーション	255	200	113,800
サクサホールディングス	33	26	5,694
メルコホールディングス	6.4	5.7	12,870
テクノメディカ	3	2.3	5,745
日本電気	1,819	1,342	477,752
富士通	1,276	1,000	867,000
沖電気工業	511	359	93,340
岩崎通信機	62	45	4,140
電気興業	38	29	17,023
サンケン電気	72	53	44,202
ナカヨ	13	10	4,000
アイホン	7.6	6	11,106
ルネサスエレクトロニクス	68.5	53.7	46,826
セイコーエプソン	90.3	70.8	334,176
ワコム	104.2	81.7	52,369
アルバック	24.3	17.7	33,895
アクセル	6.6	4.8	8,059
ビクセラ	5.5	—	—
E I Z O	12.1	9.5	25,802
ジャパンディスプレイ	—	159.8	69,672
日本信号	36.5	28.6	34,691
京三製作所	31	24	9,456
能美防災	17	13.7	20,659
ホーチキ	10	7.5	6,337
エレコム	4.8	3.2	8,115
日本無線	34	22	9,372
パナソニック	1,511.6	1,264.3	1,955,239
シャープ	954	877	218,373
アンリツ	76.9	64.9	56,657
富士通ゼネラル	31	32	46,176
日立国際電気	26	27	45,792
ソニー	725.4	678	2,219,094
T D K	79.9	62.6	574,042
帝国通信工業	31	25	6,400

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ミツミ電機	50.3	36.6	33,562
タムラ製作所	51	40	18,520
アルプス電気	97	81.9	247,338
池上通信機	42	35	6,580
パイオニア	183.5	155.9	34,765
日本電波工業	11.9	9.4	10,114
鈴木	—	1.3	1,561
日本トリム	2.8	2.5	7,650
ローランド ディー. ジー.	5.9	4.2	14,196
フォスター電機	13.5	10.6	33,496
クラリオン	81	55	19,305
SMK	39	31	16,151
ヨコオ	11.1	8.1	5,613
東光	62	24	8,280
ティアック	71	56	3,360
ホシデン	38.8	31.4	22,294
ヒロセ電機	23	16.8	284,424
日本航空電子工業	34	30	92,850
TOA	14.2	11.1	13,486
日立マクセル	—	15.5	34,363
古野電気	12.8	12.3	14,341
ユニデン	42	28	6,468
アルパイン	28.7	24.7	48,239
スミダコーポレーション	10.8	9.3	6,175
アイコム	7.3	5.7	17,271
リオン	3.7	2.9	4,509
船井電機	13.4	10.5	15,760
横河電機	143.5	103.8	138,054
新電元工業	42	40	24,840
アズビル	40.1	33.9	113,734
東亜ディーケーケー	4.9	4.3	2,928
日本光電工業	28.2	22.1	140,998
チノー	24	3.7	4,554
共和電業	16	12.7	5,930
日本電子材料	5.7	4.4	3,599
堀場製作所	24.5	19.2	91,968
アドバンテスト	90.2	70.7	117,715
小野測器	14	5.2	5,200
エスベック	13.7	11.5	14,513

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	11.6	9.1	8,044
キーエンス	30	23.5	1,590,010
日置電機	6.9	5.4	10,843
シスメックス	55.4	80.3	519,541
メガチップス	11.9	10.8	15,400
OBARA GROUP	8.6	6.7	46,498
日本電産コパル電子	13.6	—	—
澤藤電機	8	6	1,542
コーセル	19.2	15.1	20,173
新日本無線	10	8	4,008
オプテックス	8.4	7.1	17,870
千代田インテグレ	5.8	4.6	12,870
レーザーテック	10.2	10.6	17,606
スタンレー電気	95.3	74.5	207,855
岩崎電気	48	35	8,225
ウシオ電機	80.3	63	100,737
岡谷電機産業	7.1	5.6	2,766
ヘリオス テクノ ホールディング	11.2	9.6	5,097
日本セラミック	7.6	5.9	9,876
遠藤照明	5.5	4.8	7,041
日本デジタル研究所	9.8	8.7	14,007
古河電池	9	7	6,251
双信電機	6.4	5.1	2,147
山一電機	14.4	12	11,772
図研	8.6	7.5	8,280
日本電子	51	44	26,752
カシオ計算機	137.6	104	234,312
ファナック	147.6	108	2,911,680
日本シイエムケイ	31.1	26.4	8,316
エンプラス	5	4.7	23,053
大真空	18	19	6,517
ローム	69.9	51.1	449,680
浜松ホトニクス	51.6	43.2	318,816
三井ハイテック	17.4	13.7	12,905
新光電気工業	44.4	39.2	36,024
京セラ	235.8	170.3	1,174,048
太陽誘電	64.3	54.3	97,631
村田製作所	138.8	108.8	1,929,024
ユージン	18.4	14.4	11,260

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	24.5	17.7	35,400
北陸電気工業	53	45	9,135
ニチコン	41.7	32.7	38,324
日本ケミコン	92	84	31,416
K O A	16.6	14.3	17,617
市光工業	32	25	6,025
小糸製作所	73	62.2	235,427
ミツバ	24.3	19.1	51,073
スター精密	25.1	19.7	33,824
S C R E E Nホールディングス	125	98	94,962
キャノン電子	12.1	9.5	23,455
キャノン	767.1	601.5	2,528,706
リコー	397.8	311.9	422,000
M U T O Hホールディングス	18	14	6,384
東京エレクトロン	118.7	87.3	768,676
輸送用機器 (11.8%)			
トヨタ紡織	46.3	36.3	56,446
鬼怒川ゴム工業	25	24	13,224
ユニプレス	21.4	19.9	48,635
豊田自動織機	120.5	94.5	668,115
モリタホールディングス	23	18.1	21,177
三機工業	16.8	13.2	11,880
デンソー	326.9	256.3	1,453,221
東海理化電機製作所	34.8	27.3	78,787
三井造船	512	402	84,420
佐世保重工業	93	—	—
川崎重工業	1,030	754	473,512
名村造船所	19.4	28.9	33,813
サノヤスホールディングス	12.1	12.6	3,628
日本車輛製造	48	38	13,376
ニチユ三菱フォークリフト	15	11.9	8,460
近畿車輛	23	16	6,288
日産自動車	1,857.2	1,456.2	1,866,120
いすゞ自動車	767	328	551,696
トヨタ自動車	1,841.4	1,431.3	12,445,153
日野自動車	165.2	148.1	263,618
三菱自動車工業	414.4	380.2	421,641
エフテック	5.5	5.9	6,926
レシップホールディングス	—	3.4	2,961

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
GMB	1.3	1.5	2,050
ファルテック	—	1.1	1,879
武蔵精密工業	14.1	11.1	28,515
日産車体	65	45.6	72,960
新明和工業	53	42	54,138
極東開発工業	22.8	19.3	27,116
日信工業	26.9	19	37,620
トビー工業	109	85	24,990
ティラド	51	40	10,600
曙ブレーキ工業	61.5	43.8	19,578
タチエス	19.5	16.4	28,962
N O K	64	50.2	187,246
フタバ産業	40.3	31.6	18,359
カヤバ工業	125	116	53,708
シロキ工業	29	23	7,314
大同メタル工業	18	14.5	18,154
プレス工業	52	51	25,551
カルソニックカンセイ	90	79	62,173
太平洋工業	26.9	21.1	21,395
ケーヒン	30.4	23.8	48,575
河西工業	18	12.7	12,839
アイシン精機	121.1	94.9	420,881
富士機工	15	12	7,080
マツダ	1,972	309.2	774,700
ダイハツ工業	140.4	123.8	228,534
今仙電機製作所	9.8	8.8	14,247
本田技研工業	1,190.7	933.6	3,837,096
スズキ	276.6	216.9	801,228
富士重工業	450.3	353.1	1,449,828
安永	—	3.4	2,261
ヤマハ発動機	201.2	157.8	449,572
ショーワ	31.2	24.5	30,747
T B K	15	13.3	8,645
エクセディ	16	14.1	40,368
豊田合成	42.7	33.5	95,307
愛三工業	16.1	16.1	17,806
盟和産業	—	8	1,264
ヨロズ	9.7	9.7	24,424
エフ・シー・シー	21.6	15.3	30,600

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	57.1	44.8	842,240
タカタ	23.9	18.8	25,060
テイ・エス テック	27.9	21.9	72,817
精密機器 (1.5%)			
テルモ	101.4	159	531,855
クリエートメディック	4.4	3.4	3,488
日機装	42.9	33.6	36,220
島津製作所	170	124	173,724
JMS	24	19	5,738
クボテック	3.4	2.2	715
ショットモリテックス	2.9	2.4	588
長野計器	8.5	6.6	4,917
ブイ・テクノロジー	0.027	2	4,988
東京計器	46	36	9,756
愛知時計電機	17	14	4,718
オーバル	—	7.6	2,538
東京精密	23.7	18.6	53,995
マニー	4	2.9	24,041
ニコン	247	193.7	324,060
トプコン	35.5	31.3	92,898
オリンパス	197.1	154.5	699,112
理研計器	11.7	9.1	11,966
タムロン	10.2	8	20,832
HOYA	321.7	246.9	1,294,002
ノーリツ銅機	11.9	9.3	6,528
エー・アンド・デイ	12	9.4	4,718
シチズンホールディングス	162.9	127.7	121,059
リズム時計工業	60	45	7,560
大研医器	4.6	7.2	9,187
松風	6.5	5.1	7,083
セイコーホールディングス	85	73	46,063
ニプロ	70.4	66.3	80,156
その他製品 (1.5%)			
パラマウントベッドホールディングス	12.7	10.9	35,425
SHO-BI	3.9	3.5	1,410
前田工繊	9.6	10.3	11,247
永大産業	17	15	6,945
アートネイチャー	4.2	7.5	8,775
ダンロップスポーツ	7.1	6.5	8,053

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
バンダイナムコホールディングス	145.9	114.4	266,437
共立印刷	24	18.8	5,715
フランスベッドホールディングス	83	72	13,176
パイロットコーポレーション	11.5	9	61,560
萩原工業	—	2.2	4,573
トッパン・フォームズ	23.6	18.5	25,641
フジシールインターナショナル	16.1	12.6	42,273
タカラトミー	43.5	37.2	27,081
廣済堂	12.3	9.6	5,875
A s - m e エステール	—	2.8	2,346
アーク	39.2	32.7	4,447
タカノ	5.8	4.6	2,875
プロネクサス	13.4	10.5	8,683
ホクシン	9.2	8.4	1,142
ウッドワン	22	17	4,692
大建工業	54	42	11,886
凸版印刷	374	293	280,108
大日本印刷	403	316	385,994
図書印刷	21	17	6,069
共同印刷	41	32	11,968
日本写真印刷	22.2	17.4	38,836
光村印刷	12	9	2,565
宝印刷	7.4	5.4	5,891
アシックス	131.4	103.1	353,117
ツツミ	6.6	5.2	14,398
ローランド	12.7	—	—
小松ウオール工業	4.5	3.2	8,371
ヤマハ	97.2	76.2	168,783
河合楽器製作所	46	3.6	8,733
クリナップ	13.5	9.5	8,768
ビジョン	21.7	19.6	190,708
兼松日産農林	20	13	1,937
キングジム	11	8.6	6,837
リンテック	31.5	24.7	72,766
TASAKI	2.6	1.9	4,069
イトーキ	27.8	21.8	16,633
任天堂	81.5	63.9	1,185,664
三菱鉛筆	10.9	8.5	37,697
タカラスタンダード	55	43	44,333

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コクヨ	68.8	53.9	62,470
ナカバヤシ	28	22	5,060
グローブライド	69	50	10,150
岡村製作所	51	39.8	37,173
美津濃	66	56	37,072
アデランス	16.5	12	14,724
電気・ガス業 (1.9%)			
東京電力	1,122.3	880	403,040
中部電力	436	317.4	461,817
関西電力	539.9	423.3	477,694
中国電力	182.9	143.4	231,877
北陸電力	129.6	101.6	166,319
東北電力	330.5	259.2	357,696
四国電力	119.1	93.4	140,847
九州電力	292.2	229.1	258,195
北海道電力	123.8	97.1	92,439
沖縄電力	8.6	6.8	28,186
電源開発	82.1	75.2	296,288
東京瓦斯	1,551	1,261	967,691
大阪瓦斯	1,369	1,074	546,773
東邦瓦斯	336	264	180,048
北海道瓦斯	26	20	5,820
西部瓦斯	149	117	31,239
静岡瓦斯	34.4	29.5	23,511
メタウォーター	—	4.8	11,851
陸運業 (4.3%)			
SBSホールディングス	2.8	7.7	6,622
東武鉄道	751	554	329,630
相鉄ホールディングス	227	178	106,800
東京急行電鉄	779	564	454,020
京浜急行電鉄	340	284	290,248
小田急電鉄	424	332	445,212
京王電鉄	370	290	299,570
京成電鉄	198	156	252,408
富士急行	36	28	31,780
新京成電鉄	17	13	5,629
東日本旅客鉄道	243.4	190.1	2,002,703
西日本旅客鉄道	119.4	99.9	705,294
東海旅客鉄道	118.5	92.9	2,217,987

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
西武ホールディングス	—	82.7	264,640
鴻池運輸	7	6.4	16,422
西日本鉄道	171	134	80,266
ハマキョウレックス	3.8	3.2	13,632
サカイ引越センター	2.1	1.8	7,290
近畿日本鉄道	1,332	1,044	503,208
阪急阪神ホールディングス	888	696	547,056
南海電気鉄道	276	232	122,264
京阪電気鉄道	279	232	175,160
神戸電鉄	32	25	9,325
名糖運輸	5.4	4.3	3,612
名古屋鉄道	462	378	198,450
山陽電気鉄道	48	38	18,126
日本通運	524	411	278,658
ヤマトホールディングス	246.4	182.4	534,158
山九	161	126	68,670
丸運	8.3	5.6	1,489
丸全昭和運輸	44	35	14,875
センコー	53	43	34,701
トナミホールディングス	27	21	9,492
日本梱包運輸倉庫	40.4	33.9	75,156
日本石油輸送	15	12	3,132
福山通運	80	63	41,454
セイノーホールディングス	94	80.3	108,405
神奈川中央交通	16	12	7,488
日立物流	27.6	21.6	40,953
海運業 (0.3%)			
日本郵船	1,118	876	332,004
商船三井	743	544	230,112
川崎汽船	579	454	158,900
N S ユナイテッド海運	57	45	14,175
乾汽船	15.7	—	—
明治海運	11.8	9.3	3,747
飯野海運	54.8	53.7	35,442
共栄タンカー	11	9	2,151
第一中央汽船	97	102	4,284
空運業 (0.6%)			
日本航空	111.8	198.6	774,540
ANAホールディングス	2,600	2,039	694,075

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スカイマーク	28.1	—	—
パスコ	12	10	3,610
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	3.8	3	16,320
日新	50	39	12,519
三菱倉庫	87	68	135,728
三井倉庫ホールディングス	66	60	25,740
住友倉庫	89	76	54,568
滋澤倉庫	31	27	9,909
東陽倉庫	23	18	5,544
乾汽船	—	6.9	6,969
日本トランスシティ	28	24	9,552
ケイヒン	24	19	3,876
中央倉庫	7.6	6	5,988
安田倉庫	10.3	8.1	8,642
東洋埠頭	38	32	6,688
宇徳	10.7	8.4	5,208
上組	158	124	153,388
サンリツ	3.2	2.5	1,437
キムラユニティー	3	2.6	2,841
キューソー流通システム	4.2	2.9	4,115
郵船ロジスティクス	12.1	9.5	14,953
近鉄エクスプレス	11.8	9.3	51,057
東海運	7.1	5.6	1,747
エーアイティー	4.9	4.8	5,664
情報・通信業 (6.6%)			
NECネットエスアイ	14.3	12.8	32,089
システナ	12.7	10	9,500
デジタルアーツ	3.5	5.5	6,831
新日鉄住金ソリューションズ	10.9	8.5	30,770
キューブシステム	—	4.4	3,053
コア	4.9	4.3	3,951
ソフトクリエイトホールディングス	4.2	3.3	3,267
ITホールディングス	46.9	33.9	73,325
ネオス	2.6	2.7	1,809
電算システム	3.1	3.5	5,495
グリー	78	62	50,096
コーエーテクモホールディングス	25.8	23.1	43,682
三菱総合研究所	5.1	4	11,088

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ボルテージ	2.3	1.8	1,801
電算	0.9	1.1	2,735
AGS	—	1.7	1,734
ファインデックス	—	1.5	7,950
ヒト・コミュニケーションズ	1.4	1.4	2,500
ブレインパッド	1	1.5	1,807
KL a b	8.8	10.8	14,472
ポールトゥウィン・ビットクルーホールディ	7.8	6.7	6,834
イーブックイニシアティブジャパン	1.9	2.3	2,295
ネクソン	108.3	97.3	122,598
アイスタイル	4.3	4.3	3,182
エムアップ	2.3	2.7	2,162
エイチーム	1.2	1.2	6,144
e n i s h	1.9	2.7	3,909
コロブラ	—	18	48,816
モバイルクリエイト	1	6	4,464
オルトプラス	—	1.9	1,717
ブロードリーフ	12.9	8.4	19,378
ハーツユナイテッドグループ	2.9	3.1	5,697
ドワンゴ	11.7	—	—
ベリサーブ	0.8	1.2	1,327
ティーガイア	13	10.2	16,269
豆蔵ホールディングス	7.6	8	5,016
テクマトリックス	4.2	4.4	3,102
GMOペイメントゲートウェイ	5	8.9	24,946
ザッパラス	7.3	5.7	3,659
インターネットイニシアティブ	19.2	16.7	35,036
GMOクラウド	—	1.7	1,553
ビットアイル	9.9	11.6	6,403
SRAホールディングス	6.3	5.4	9,325
システムインテグレータ	1	1.5	688
パイブドビッツ	—	1	1,893
朝日ネット	12	10.5	5,722
コムチュア	1.1	1.7	3,442
g u m i	—	7.7	11,727
パナソニック インフォメーションシステム	2.6	2.4	9,204
フェイス	3.9	3.1	4,051
野村総合研究所	73.9	58	266,800
サイバネットシステム	10.6	8.4	4,065

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
CEホールディングス	—	1.2	1,552
インテージホールディングス	7.1	5.8	12,609
東邦システムサイエンス	—	3	1,899
ソースネクスト	6.5	5.1	3,911
ティー・ワイ・オー	9.3	10	2,040
クレスコ	3	2.3	4,397
フジ・メディア・ホールディングス	126.3	106.6	185,697
オービック	45	35.3	177,206
ジャストシステム	—	14	10,346
TDCソフトウェアエンジニアリング	2.8	2.2	2,536
ヤフー	945.2	733.8	380,108
トレンドマイクロ	57.6	54.2	226,285
インフォメーション・ディベロプメント	—	1.9	1,943
日本オラクル	20.9	16.4	86,264
アルファシステムズ	4.3	3.3	5,893
フューチャーアーキテクト	15.7	10.7	7,950
CAC Holdings	8	6.9	7,990
ソフトバンク・テクノロジー	3.1	2.7	3,218
トーセ	3.2	2.5	2,040
オービックビジネスコンサルタント	6.6	6.5	27,170
伊藤忠テクノソリューションズ	14.8	11.6	59,972
アイティフォー	14.5	12.4	6,150
東計電算	2.3	1.8	3,304
エクスネット	1.2	0.9	1,399
大塚商会	11.7	27.5	147,400
サイボウズ	19.5	13.7	4,575
ソフトブレイン	17.8	14	2,674
アグレックス	3	—	—
電通国際情報サービス	8	6.3	7,257
EMシステムズ	1.8	1.2	2,223
ウェザーニューズ	3.9	3.1	10,943
C I J	12	9.3	4,557
東洋ビジネスエンジニアリング	—	1	1,402
日本エンタープライズ	—	6.9	2,539
WOWOW	4	2.4	18,528
フュージョンパートナー	—	4.3	3,878
日本コロムビア	6.5	3.6	1,432
イマジカ・ロボット ホールディングス	—	5.4	4,050
ネットワンシステムズ	51.2	41.6	34,361

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アルゴグラフィックス	4.9	4.2	7,845
マーベラス	19.8	17.3	28,147
エイベックス・グループ・ホールディングス	24	20.3	40,457
日本ユニシス	31.5	28.3	33,903
兼松エレクトロニクス	8.2	6.5	12,226
東京放送ホールディングス	70.4	61.3	96,976
日本テレビホールディングス	130.1	93.5	191,301
朝日放送	—	10.1	10,069
テレビ朝日ホールディングス	33.1	28	55,804
スカパー J S A Tホールディングス	99.1	77.7	59,440
テレビ東京ホールディングス	10.6	8.3	18,467
コネクション	11.5	7.2	8,460
クロップス	—	0.9	493
日本電信電話	513.1	400.7	3,069,362
KDD I	405.3	346.7	2,823,524
光通信	11.8	9.2	73,416
NTT ドコモ	1,075.9	843.6	1,844,109
GMOインターネット	43.6	34.2	51,129
KADOKAWA・DWANGO	—	25.1	47,564
学研ホールディングス	44	34	8,738
ゼンリン	17.3	13.5	20,398
昭文社	7.8	6.1	5,618
KADOKAWA	13	—	—
インプレスホールディングス	9.1	7.3	1,299
アイネット	5.5	5.2	5,148
松竹	86	67	74,705
東宝	93.2	73.1	221,127
東映	55	38	34,048
AOI Pro.	6	4.7	4,258
エヌ・ティ・ティ・データ	92.2	63.2	331,168
ビー・シー・エー	—	1.3	2,470
DTS	12.4	10.6	25,122
スクウェア・エニックス・ホールディングス	47.5	39.4	98,894
シーエーシー	7.7	6.7	5,842
カプコン	33.4	26.2	61,150
ジャストテック	8.3	5.9	5,374
S C S K	31.1	24.3	79,461
日本システムウエア	4.9	3.8	3,366
アイネス	17.7	13.9	13,177

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
TKC	11	8.6	21,749
富士ソフト	16.6	14.1	35,066
NSD	27.7	23.9	44,406
コナミ	59	41.6	92,726
福井コンピュータホールディングス	1.8	2.8	2,116
JBCホールディングス	10.9	8.6	6,983
ミロク情報サービス	8.5	6.7	4,669
ソフトバンク	641.2	541.5	3,796,998
卸売業 (4.0%)			
ハウスイ	10	8	1,080
高千穂交易	5.4	3.9	4,149
伊藤忠食品	3.2	2.5	11,200
エレマテック	6.1	4.8	14,832
JALUX	3.7	2.9	6,092
あらた	29	23	7,751
トーマンデバイス	2	1.5	2,977
東京エレクトロン デバイス	2.6	2	3,350
双日	874	685.3	143,913
アルフレッサ ホールディングス	38.6	121.1	210,592
横浜冷凍	32.3	25.3	21,454
神栄	18	15	3,030
山下医科器械	1	0.8	1,407
ラサ商事	5.6	4.8	3,048
アルコニックス	3.9	5.8	10,608
神戸物産	1.4	3.4	14,569
あい ホールディングス	20.9	16.4	36,293
ディーブイエックス	—	3	3,576
ダイワボウホールディングス	119	93	19,158
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24.5	19.2	17,990
八洲電機	10.1	7.9	4,850
UKCホールディングス	8.4	6.6	14,064
OCHIホールディングス	—	2.6	3,684
TOKAIホールディングス	63.8	50	27,550
三洋貿易	4.5	6.1	8,802
ウイン・パートナーズ	—	3.3	4,785
ミタチ産業	3	2.4	1,891
シップヘルスケアホールディングス	18.7	18.7	51,986
明治電機工業	—	2.9	3,256
デリカフーズ	—	1.8	1,949

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スターティア	—	0.9	1,451
富士興産	4.7	3.9	2,379
協栄産業	16	12	2,496
小野建	11.3	8.9	9,870
佐島電機	10.3	8.1	6,690
エコートレーディング	3.2	2.3	1,527
伯東	7.9	7	10,171
コンドーテック	10.6	7.4	6,082
中山福	7.5	5.9	5,510
ナガイレーベン	17.3	14.8	31,435
三菱食品	14.3	11.2	28,918
松田産業	9.5	7.4	11,840
メディパルホールディングス	130.6	102.4	165,580
アドヴァン	6.6	5.2	8,158
SPK	3	2.2	5,326
萩原電気	—	2.8	5,336
アズワン	8.5	7.3	26,462
スズデン	4.7	3.3	2,366
尾家産業	4.2	3.3	3,095
シモジマ	9	6.3	7,037
ドウシシャ	13.8	13.2	25,344
小津産業	—	2	4,648
高速	7.8	6.1	5,453
たけびし	—	3.6	4,114
黒田電気	18.8	17.2	33,677
丸文	11.5	9	7,173
ハビネット	7.9	6.2	9,163
トーマンエレクトロニクス	6.6	—	—
橋本総業	—	1.9	2,785
エクセル	6	4.7	6,415
マルカキカイ	4.2	3.3	5,814
ガリバーインターナショナル	43.9	31	31,031
日本エム・ディ・エム	10.9	8.5	5,278
進和	7.7	6	8,574
エスケイジャパン	3.1	2.6	605
ダイトエレクトロン	6	4.7	3,351
シークス	8.3	6.5	18,817
田中商事	4	3.1	2,154
オーハシテクニカ	6.7	6.3	9,878

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マクニカ	6.7	5.3	20,034
白銅	4.2	3.3	4,986
伊藤忠商事	1,041.8	857.1	1,163,513
丸紅	1,142	895.7	658,608
高島	24	19	5,396
長瀬産業	73.9	62.4	101,212
蝶理	8.3	6.5	12,265
豊田通商	145.5	114.1	376,530
三共生興	22.2	17.4	9,117
兼松	278	204	37,536
ツカモトコーポレーション	23	18	2,538
三井物産	1,202.3	868.1	1,478,808
日本紙パルプ商事	68	53	18,126
日立ハイテクノロジーズ	39.6	35.5	140,047
カメイ	17	13.3	12,049
東都水産	23	17	3,808
OUGホールディングス	19	16	3,888
スターゼン	47	40	16,040
山善	50.1	39.3	39,064
椿本興業	15	12	3,912
住友商事	770.6	604.3	833,631
内田洋行	30	25	9,150
三菱商事	1,018.9	784.7	1,957,826
第一実業	30	25	15,925
キャノンマーケティングジャパン	37.2	29.2	72,737
西華産業	45	34	11,662
佐藤商事	11.6	9.1	7,771
菱洋エレクトロ	15.4	11.8	18,006
東京産業	13	10.2	5,140
ユアサ商事	133	9	23,715
神鋼商事	33	26	7,098
小林産業	8.6	7.4	1,953
阪和興業	130	102	52,020
カナデン	13	10	8,970
菱電商事	19	16	13,760
フルサト工業	7.2	5.6	9,676
岩谷産業	145	113	93,338
すてきナイスグループ	56	44	8,668
昭光通商	42	36	5,472

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニチモウ	20	16	3,392
極東貿易	15	12	2,772
イワキ	20	15	3,600
三愛石油	30	26	21,424
稲畑産業	32.1	24.5	31,017
G S I クレオス	35	27	3,510
明和産業	12	8.2	3,673
ワキタ	19	21.8	26,160
東邦ホールディングス	41.8	35.3	75,259
サンゲツ	23.1	18.4	67,988
ミツウロコグループホールディングス	21	16.5	9,718
シナネン	28	22	10,934
伊藤忠エネクス	28.8	22.6	22,780
サンリオ	32.9	28.7	97,580
サンワテクノス	7	6.5	7,787
リョーサン	19.4	17.2	53,148
新光商事	14.3	12	14,712
トーホー	27	23	10,212
三信電気	15.6	14.1	14,283
東陽テクニカ	17.9	15	17,775
モスフードサービス	17.1	13.4	35,000
加賀電子	11.8	9.2	13,735
ソーダニッカ	13	11	6,479
立花エレテック	7.9	6.3	11,421
フォーバル	—	2	3,312
P a l t a c	18.3	16.4	28,782
太平洋興発	47	40	4,000
ヤマタネ	65	51	9,282
丸紅建材リース	11	9	2,493
日鉄住金物産	86	67	28,475
トラスコ中山	14.9	12.8	47,296
オートバックスセブン	45.8	37.7	75,550
加藤産業	18.8	14.7	36,823
イノテック	12	9.4	4,577
イエローハット	11.3	9.6	25,536
富士エレクトロニクス	6.7	5.3	7,944
J Kホールディングス	11.8	10.3	6,561
日伝	5.9	4.2	11,340
北沢産業	11	8.6	1,625

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
杉本商事	7	5.5	6,957
因幡電機産業	17.9	15.2	67,564
バイテック	4.4	3.5	3,752
ミスミグループ本社	52.3	38.2	183,742
江守グループホールディングス	4.2	4.4	2,640
アルテック	6.4	7.7	1,670
タキヒヨー	22	17	7,225
スズケン	54	42.4	173,840
ジェコス	9	7	9,527
ルネサスイーストン	—	4.8	3,144
小売業 (4.3%)			
ローソン	53.6	38.8	327,860
サンエー	9.9	7.7	35,420
キリン堂	4.7	—	—
ダイユーエイト	2.6	2.1	1,759
カワチ薬品	9.1	7.9	17,095
エービーシー・マート	18.6	14.6	105,996
ハードオフコーポレーション	6.3	4.9	6,002
アスクル	13.5	10.6	29,786
ゲオホールディングス	22.3	19.3	25,128
アダストリアホールディングス	10	8.6	27,047
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	17	13	1,599
くらコーポレーション	7.7	6	27,300
キャンドウ	6.2	4.9	7,746
パル	7.6	6	21,420
エディオン	59.8	46.9	42,538
サーラコーポレーション	11.2	8.8	5,174
ワッツ	—	4	3,608
あみやき亭	2.3	1.8	7,497
ひらまつ	13.5	14.1	9,207
ゲンキー	1.3	1	9,850
サッポロドラッグストアー	—	0.9	1,534
大黒天物産	3.1	2.4	11,712
ハニーズ	10.32	9	9,657
ファーマライズホールディングス	—	1.7	992
アルバン	11.6	9.1	17,153
クオール	9.5	10.4	11,055
ジェイアイエヌ	6.6	7	27,125
ビックカメラ	49.6	44.4	56,432

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
DCMホールディングス	64.4	49.5	46,183
MonotaRO	20.2	20	87,400
きちり	—	2	1,404
アークランドサービス	—	1.2	5,910
J. フロント リテイリング	308	129.6	254,016
ドトール・日レスホールディングス	22.9	17.9	37,142
マツモトキヨシホールディングス	26.9	22.9	102,363
ブロンコビリー	2	1.8	7,353
スタートトゥデイ	40.6	31.9	101,442
トレジャー・ファクトリー	—	0.9	2,376
物語コーポレーション	2.4	2.9	11,252
ココカラファイン	13.6	10.7	38,627
三越伊勢丹ホールディングス	259.5	203.5	422,669
ウエルシアホールディングス	5	9.2	39,330
クリエイトSDホールディングス	5.5	5	25,150
丸善CH I ホールディングス	11.4	11.9	4,462
エー・ピーカンパニー	1.1	1.4	2,584
チムニー	—	1.9	5,090
ネクステージ	—	1	872
ジョイフル本田	—	5.6	25,312
キリン堂ホールディングス	—	3.3	2,656
すかいらーく	—	37.5	55,725
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	—	33.6	37,766
ブックオフコーポレーション	7.2	5.8	5,730
あさひ	7.5	6.8	8,296
日本調剤	1.65	1.3	7,930
コスモス薬品	7.4	5.2	94,900
トーエル	6.9	5.4	4,438
一六堂	1.9	2.5	1,105
セブン&アイ・ホールディングス	546.2	428.3	2,192,039
薬王堂	—	1.4	3,309
クリエイト・レストランツ・ホールディング	1.6	7.1	11,253
ツルハホールディングス	12.8	21.8	203,612
サンマルクホールディングス	4.2	3.7	31,561
フェリシモ	3.7	2.6	2,607
トリドール	11.3	11	17,974
クスリのアオキ	2.2	4	34,520
メディカルシステムネットワーク	10.7	9.2	4,324
総合メディカル	3.2	2.5	17,175

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
はるやま商事	5.4	4.2	3,423
カッパ・クリエイトホールディングス	19.2	16	18,432
ライトオン	9.7	7.6	6,452
ジーンズメイト	4.2	3.3	904
良品計画	13.8	12.7	222,885
三城ホールディングス	16.1	12.6	6,350
コナカ	16.6	12	9,372
ハウス オブ ローゼ	1.4	1.1	1,618
G-7ホールディングス	3.8	2.1	2,192
イオン北海道	8.2	6.5	4,348
コジマ	19.2	15.2	5,107
ヒマラヤ	3	2.4	2,390
コーナン商事	17.1	15.6	21,715
エコス	4.5	3.5	3,356
ワタミ	15.4	12.1	15,475
マルシェ	3.2	2.5	2,295
ドンキホーテホールディングス	45	33	314,160
西松屋チェーン	25.7	20.2	21,290
ゼンショーホールディングス	59.9	52.7	66,138
幸楽苑	8	6.4	10,476
ハークスレイ	3.6	2.8	2,934
サイゼリヤ	19.3	15.2	35,400
ポプラ	3.3	2.6	1,365
ユナイテッドアローズ	17.1	13.4	48,776
ハイデイ日高	8.2	7.8	23,478
京都きもの友禅	8.6	6.4	6,688
コロワイド	43.5	34	57,018
老番屋	5.2	4.6	26,220
トップカルチャー	4.7	4.1	2,066
P L A N T	2.5	2.6	3,403
スギホールディングス	23.4	18.4	116,104
スクロール	16.9	13.3	3,843
ヨンドシーホールディングス	9.9	7.8	18,002
ファミリーマート	44.1	34.6	176,114
木曽路	16	12.5	26,225
サトレストランシシステムズ	12.2	9.5	10,811
千趣会	23.5	18.4	15,824
タカキュー	10.1	7.3	1,547
ケーヨー	22	19.2	11,001

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
上新電機	28	22	21,758
日本瓦斯	19.5	16.4	49,856
ベスト電器	42	33.3	4,828
マルエツ	26	—	—
ロイヤルホールディングス	21.8	17.1	35,927
東天紅	10	7	1,372
いなげや	14.5	11.4	16,074
島忠	29.6	24.8	81,468
チヨダ	15.4	12.1	33,444
ライフコーポレーション	9.9	6.5	13,728
カスミ	26.7	—	—
リンガーハット	12.7	10	21,490
さが美	10	8	776
M r M a x	13	10.3	2,914
テンアライド	9.8	8.7	3,393
A O K I ホールディングス	22.5	23.5	40,326
オークワ	20	16	14,576
コメリ	20.1	17.5	50,820
青山商事	32.8	25.7	100,615
しまむら	15.2	11.9	145,061
C F S コーポレーション	8.5	6.7	6,009
はせがわ	4.5	3.6	1,958
高島屋	177	149	181,482
松屋	26.3	20.6	37,883
エイチ・ツー・オー リテイリング	76	48.4	112,288
近鉄百貨店	50	39	13,377
丸栄	21	17	2,329
ニッセンホールディングス	26.1	21.5	5,848
パルコ	12.5	9.8	11,338
丸井グループ	170.2	123.2	177,777
アクシアル リテイリング	7.2	7.9	27,136
井筒屋	71	55	3,630
ダイエー	80.6	—	—
イズミヤ	49	—	—
イオン	521.6	422.3	570,527
ユニーグループ・ホールディングス	125	98	69,678
イズミ	29.2	22.9	102,019
東武ストア	17	13	3,705
平和堂	26.5	20.7	57,856

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
フジ	14.5	11.4	23,940
ヤオコー	6.6	5.8	54,404
ゼビオ	15.7	13.9	31,191
ケーズホールディングス	27.6	23.6	91,568
O l y m p i c グループ	7.7	6	4,890
日産東京販売ホールディングス	19	17.2	5,005
アインファーマシーズ	7.2	12.3	60,331
元気寿司	4	3.1	7,545
ヤマダ電機	516.2	404.7	202,350
アークランドサカモト	8.5	7.3	19,790
ニトリホールディングス	51.7	44.2	371,280
グルメ杵屋	9	7	7,021
愛眼	10.4	8.2	2,041
ケーユーホールディングス	2.7	5.3	3,858
吉野家ホールディングス	35.4	28.8	37,728
松屋フーズ	6.3	4.9	11,764
サガミチェーン	16	13	17,004
関西スーパーマーケット	9.7	7.6	6,254
王将フードサービス	6.5	7.5	32,700
ブレナス	14.6	11.4	25,479
ミニストップ	9.7	7.6	12,988
アークス	22.3	17.8	51,353
パロー	28.1	22.1	56,730
藤久	1	0.8	1,384
ベルク	6.4	4.5	15,885
大庄	6.1	5.5	7,755
ファーストリテイリング	30.5	20.5	961,962
サンドラッグ	27.6	21.6	136,296
サックスパー ホールディングス	6.5	7.7	15,015
ヤマザワ	3	2.1	3,643
やまや	2.7	1.7	3,053
ペルーナ	32.5	25.5	15,504
銀行業 (9.0%)			
島根銀行	2.7	2.2	3,504
じもとホールディングス	93.7	73.5	17,346
足利ホールディングス	51.3	64.4	31,105
東京ＴＹフィナンシャルグループ	—	13.2	43,560
新生銀行	1,130	975	241,800
あおぞら銀行	678	691	308,877

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	9,891.8	8,215.4	6,434,301
りそなホールディングス	1,241.2	1,197.8	766,472
三井住友トラスト・ホールディングス	2,566	2,263	1,176,533
三井住友フィナンシャルグループ	987.6	774.4	3,746,547
第四銀行	166	130	57,980
北越銀行	142	111	26,973
西日本シティ銀行	458	359	131,394
千葉銀行	504	395	359,845
横浜銀行	861	708	526,114
常陽銀行	486	370	239,390
群馬銀行	293	243	206,793
武蔵野銀行	20.8	16.3	68,704
千葉興業銀行	27.1	21.2	17,405
筑波銀行	54.3	42.5	17,552
東京都民銀行	23	—	—
七十七銀行	205	173	122,657
青森銀行	96	80	32,800
秋田銀行	90	68	25,908
山形銀行	79	62	32,612
岩手銀行	8.5	7.2	37,872
東邦銀行	117	92	47,012
東北銀行	66	55	9,680
みちのく銀行	70	51	11,067
ふくおかフィナンシャルグループ	530	415	274,315
静岡銀行	383	300	372,000
十六銀行	164	128	59,904
スルガ銀行	127	108.1	279,654
八十二銀行	241	185	165,945
山梨中央銀行	83	65	34,970
大垣共立銀行	163	128	51,456
福井銀行	112	87	23,751
北國銀行	147	114	49,818
清水銀行	4.4	3.5	11,007
滋賀銀行	123	103	65,096
南都銀行	127	99	42,867
百五銀行	117	98	56,252
京都銀行	249	195	251,160
紀陽銀行	51.3	40.2	71,355
三重銀行	54	46	13,248

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ほくほくフィナンシャルグループ	888	697	195,160
広島銀行	385	302	204,152
山陰合同銀行	81	63	65,772
中国銀行	97.2	73.7	137,819
鳥取銀行	41	33	8,910
伊予銀行	139.7	109.5	162,279
百十四銀行	143	112	46,368
四国銀行	94	79	20,303
阿波銀行	107	84	59,724
鹿児島銀行	91	71	60,350
大分銀行	82	63	30,366
宮崎銀行	87	68	31,688
肥後銀行	107	84	63,840
佐賀銀行	79	62	20,150
十八銀行	81	63	24,507
沖縄銀行	9.7	8.1	42,363
琉球銀行	25.3	21.1	37,832
八千代銀行	6.2	—	—
セブン銀行	489.3	345.3	208,561
みずほフィナンシャルグループ	16,919.7	14,189.5	3,184,123
高知銀行	51	40	7,280
山口フィナンシャルグループ	130	102	145,146
長野銀行	43	33	6,798
名古屋銀行	118	92	39,008
北洋銀行	196.7	154.3	71,286
愛知銀行	4.7	3.7	23,421
第三銀行	74	58	11,774
中京銀行	54	42	8,862
東日本銀行	57	45	17,685
大光銀行	46	36	8,676
愛媛銀行	77	60	15,360
トマト銀行	50	40	8,400
みなと銀行	118	93	26,319
京葉銀行	108	84	61,068
関西アーバン銀行	182	14.3	19,347
栃木銀行	66	51	32,793
北日本銀行	4.1	3.2	11,136
東和銀行	156	143	14,729
福島銀行	161	126	11,844

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大東銀行	83	65	10,790
トモニホールディングス	100.2	78.6	44,094
フィデアホールディングス	75.1	58.9	13,605
池田泉州ホールディングス	98	84.5	50,700
証券、商品先物取引業 (1.4%)			
F P G	8.6	8.8	30,756
S B I ホールディングス	156.8	123	187,575
日本アジア投資	89	71	5,538
ジャフコ	17.9	14	65,940
大和証券グループ本社	1,294	958	950,144
野村ホールディングス	2,669.6	2,093.3	1,542,971
岡三証券グループ	103	87	87,435
丸三証券	38.8	32.6	47,465
東洋証券	53	41	16,236
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	138.3	117.5	113,975
光世証券	31	24	6,000
水戸証券	38	31.7	15,120
いちよし証券	25.6	21.5	29,218
松井証券	66.4	52	61,100
だいちこう証券ビジネス	6.3	4.9	4,336
マネックスグループ	141.8	120.5	40,247
カブドットコム証券	50.6	45.4	37,954
極東証券	16.2	13.7	26,317
岩井コスモホールディングス	12.3	10.5	17,314
マネースクウェアHD	—	3.2	4,665
マネーパートナーズグループ	9.9	10.5	4,074
小林洋行	3.7	3	1,071
保険業 (2.5%)			
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	290.1	227.5	872,690
アニコム ホールディングス	—	4.3	8,191
MS&ADインシュアランスグループホール	390.2	326.4	1,139,462
ソニーフィナンシャルホールディングス	125.1	98.1	196,298
第一生命保険	657.3	656	1,159,480
東京海上ホールディングス	505.8	421.4	1,949,817
T & Dホールディングス	447.9	373.2	620,818
その他金融業 (1.3%)			
全国保証	31.2	26.6	119,301
クレディセゾン	106.7	83.6	184,839
アクリーティブ	8.8	7.1	2,165

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
芙蓉総合リース	13.7	10.7	45,903
興銀リース	22.8	19.2	48,576
東京センチュリーリース	30.7	24	85,200
日本証券金融	57.3	48.4	38,187
アイフル	237.6	171.3	69,719
ポケットカード	13	7.7	4,127
リコーリース	9	8.1	29,686
イオンフィナンシャルサービス	76	67.2	211,008
アコム	262.3	205.7	75,080
ジャックス	79	56	37,072
オリエントコーポレーション	291.8	236.6	45,427
日立キャピタル	25.6	20.1	51,516
アブラスフィナンシャル	47	49.1	6,383
オリックス	808.3	724.8	1,276,735
三菱UFJリース	331.2	259.7	156,339
日本取引所グループ	191.7	150.3	538,074
イー・ギャランティ	3.8	3	5,796
アサックス	2.3	1.8	3,056
NECキャピタルソリューション	4.4	4.2	8,211
不動産業 (3.0%)			
日本駐車場開発	141.6	111.2	20,127
ヒューリック	220.3	172.9	227,363
東京建物不動産販売	6.8	5.3	2,909
三栄建築設計	3.9	4.1	3,866
野村不動産ホールディングス	86.3	61.5	137,514
日本商業開発	—	3.1	6,023
プレサンスコーポレーション	2.4	3.5	14,052
常和ホールディングス	4.6	4.2	19,236
日本管理センター	—	5	7,640
サンセイランディック	—	1.1	915
エストラスト	—	1	689
フージャースホールディングス	19.4	15.2	9,652
オープンハウス	5.2	6.5	18,876
東急不動産ホールディングス	289.6	268.4	227,603
飯田グループホールディングス	57.2	66.4	101,193
エコナックホールディングス	39	36	2,088
パーク24	68.5	51.5	125,866
バラカ	3.3	3.8	4,940
三井不動産	615	543	1,995,253

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱地所	914	761	2,224,403
平和不動産	26.3	19.4	33,193
東京建物	267	223	201,369
ダイビル	38.4	26.3	32,322
京阪神ビルディング	21.6	17	12,665
住友不動産	313	245	1,090,005
大京	220	163	30,155
テーオーシー	45	35.3	34,523
東京楽天地	21	17	8,398
レオパレス21	150.1	112	72,912
スターツコーポレーション	—	11.7	21,656
フジ住宅	16.7	13.1	9,301
空港施設	15.8	12.4	8,630
明和地所	6.4	5.9	2,991
住友不動産販売	9.4	7.4	24,457
ゴールドクレスト	10.3	9.2	20,102
日本エスリード	5.1	4	5,100
日神不動産	17.4	13.7	6,452
タカラレーベン	43.4	45.4	30,281
サンヨーハウジング名古屋	6.7	5.8	7,342
イオンモール	84.3	66.1	162,804
ファースト住建	3.6	3.8	5,608
ランド	37.2	39.6	871
トーセイ	17.9	14	10,892
穴吹興産	9	9	2,268
エヌ・ティ・ティ都市開発	81.1	63.6	78,991
サンフロンティア不動産	12.3	11	12,166
エフ・ジェー・ネクスト	5.2	7.8	4,290
ランドビジネス	8.8	5.2	2,158
グランディハウス	7.6	8.9	2,803
日本空港ビルデング	45.1	35.4	250,986
サービス業 (3.1%)			
日本工営	46	36	17,676
ネクスト	11.6	12.7	14,668
日本M&Aセンター	7.1	16.7	67,635
ノバレーゼ	3.5	2.8	2,570
アコーディア・ゴルフ	56.3	40.7	50,264
タケエイ	9.5	10.6	11,130
トラスト・テック	1.8	1.9	4,294

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	10.3	8.1	6,083
CDS	2.1	2.5	2,542
リンクアンドモチベーション	0.177	14.9	2,369
GCAサヴィアン	8.2	8.5	12,546
エス・エム・エス	7.7	12.1	18,670
テンブホールディングス	30.2	21.3	88,395
リニカル	2.7	2.8	2,842
クックパッド	6.8	6.9	34,914
エスクリ	4.8	3.8	4,753
アイ・ケイ・ケイ	3.1	2.9	3,596
学情	4.5	4	4,872
スタジオアリス	5.6	5	11,155
シミックホールディングス	5.2	4.3	8,036
NECフィールディング	11.2	—	—
日本上下水道設計	—	2.4	3,832
総合警備保障	50.3	36.2	153,669
カカココム	83.8	71.4	146,013
アイロムホールディングス	3.1	2.6	4,513
ルネサンス	6.1	5.5	7,293
ディップ	2.3	2.4	16,824
オプト	5.5	4.8	3,393
新日本科学	11.4	10.3	8,528
ツクイ	14.9	12.8	12,019
総合臨床ホールディングス	4	5	2,420
キャリアデザインセンター	0.028	3.2	3,260
エムスリー	0.465	93.8	238,064
ツカダ・グローバルホールディング	8	7.9	6,169
アウトソーシング	4.3	4.1	6,990
ウェルネット	—	2.8	7,663
ディー・エヌ・エー	74.3	53.4	113,902
博報堂DYホールディングス	191.6	150.2	196,912
ぐるなび	9.6	12.5	28,650
エスアールジータカミヤ	—	8.7	7,151
一休	0.098	8.5	17,280
ジャパンバストレスキューシステム	0.085	8.9	2,314
ファンコミュニケーションズ	—	18.7	18,438
ジェイコムホールディングス	2.8	2.5	2,140
PGMホールディングス	19.5	15.3	21,205
WDBホールディングス	1.2	3.9	3,432

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ティア	—	2.9	1,722
バリューコマース	8.5	8.9	4,948
J Pホールディングス	23.1	26.9	9,818
E P Sホールディングス	0.149	13.6	20,168
プレステージ・インターナショナル	9.4	8.2	7,224
アミューズ	3.8	3.3	11,583
ドリームインキュベータ	0.036	3.5	8,351
クイック	—	3.7	3,108
TAC	8.4	5.4	1,171
ケネディクス	162.9	154	77,000
電通	130.3	120.8	641,448
テイクアンドギヴ・ニーズ	5.9	4.2	3,780
びあ	4.1	3.2	8,153
イオンファンタジー	4.5	3.5	6,478
ネクシィーズ	5	3.9	2,406
みらかホールディングス	36.3	28.5	169,290
アルプス技研	5.5	4.3	9,928
サニックス	20.1	12.7	4,749
ダイオーズ	2.5	2.3	2,118
日本空調サービス	3.4	5.3	4,605
オリエンタルランド	37.4	29.3	1,077,800
ダスキン	37.4	30.7	66,465
明光ネットワークジャパン	13.7	10.7	13,728
ファルコホールディングス	7.1	5.1	7,471
秀英予備校	2.2	2.3	784
田谷	2.1	1.8	1,535
ラウンドワン	39.2	30.7	21,090
リゾートトラスト	46.7	40	129,000
ビー・エム・エル	9	6.4	23,200
ワタバウエディング	4.5	3.5	1,778
もしもしホットライン	25.7	20.1	29,305
リソー教育	15.5	16.8	5,594
早稲田アカデミー	2.1	1.6	1,419
ユー・エス・エス	167.3	131.2	276,832
東京個別指導学院	6.7	5.2	2,750
サイバーエージェント	—	19.9	135,718
楽天	448.7	470.8	1,004,216
デー・オー・ダブリュー	4.5	3.3	2,884
セントラルスボーツ	4.2	3.7	8,831

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
フルキャストホールディングス	12.6	11.2	8,377
リゾートソリューション	11	11	2,981
テクノプロ・ホールディングス	—	11.5	32,729
リブセンス	6.8	6.3	3,805
ジャパンマテリアル	1.2	4.5	7,677
ベクトル	—	1.8	2,698
ウチヤマホールディングス	—	4.7	2,655
サクセスホールディングス	—	0.9	1,095
キャリアリンク	—	1.1	1,645
アサンテ	—	2.7	3,572
M&Aキャピタルパートナーズ	—	0.2	700
ERIホールディングス	2.4	2.8	2,783
ウィルグループ	—	0.9	1,242
リクルートホールディングス	—	122.9	471,936
リロ・ホールディング	5.2	3.7	38,961
東祥	—	2.3	6,444
エイチ・アイ・エス	11.3	17.7	72,570
共立メンテナンス	6.8	5.4	35,910
イチネンホールディングス	14.5	11.3	12,904
建設技術研究所	8.1	6.4	7,980
スペース	6.7	5.8	7,441
燦ホールディングス	2.7	2.2	4,030
スバル興業	10	8	3,520
東京テアトル	53	41	6,027
よみうりランド	27	22	10,604
東京都競馬	106	74	22,422
常磐興産	45	40	6,440
カナモト	17.6	15.1	52,699

銘柄		期首(前期末)	当 期 末	
		株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
東京ドーム		102	74	39,812
西尾レントオール		7.5	8.7	31,059
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ		56	45	1,980
トランス・コスモス		18	14.1	34,601
乃村工藝社		27.1	21.2	24,655
藤田観光		35	39	19,734
KNT－CTホールディングス		44	52	8,788
日本管財		5.9	5.3	15,613
トーカイ		6.1	4.8	18,840
白洋舎		14	11	2,794
セコム		143.8	105.2	865,480
セントラル警備保障		6.1	4.8	6,422
丹青社		17.2	12.5	10,600
メイテック		19	14.7	57,991
アサツー ディ・ケイ		24.2	20.4	70,584
応用地質		13.2	11.4	18,285
船井総研ホールディングス		14.1	11.7	13,267
進学会		5.8	4.5	2,286
ベネッセホールディングス		46.3	39.6	158,796
イオンディライト		13.4	10.5	31,374
ナック		6.9	7.2	7,660
ニチイ学館		30	21.2	23,786
ダイセキ		20.4	17.4	38,819
ステップ		4.1	3.6	3,344
合 計	株 数 ・ 金 額	213,773	172,412	241,430,274
	銘柄数＜比率＞	1,777	1,858	＜98.4％＞

(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、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄 別			当 期 末
			買 建 額 売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 百万円
			3,196 —

○有価証券の貸付および借入の状況

2015年3月25日現在における貸付株数の総株数は15,683,400株です。

うち利害関係人であるモルガン・スタンレーM U F G証券株式会社に対する貸付は、15,683,400株です。

○投資信託財産の構成

(2015年3月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	241,430,274	91.8
コール・ローン等、その他	21,664,402	8.2
投資信託財産総額	263,094,676	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年3月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	263,071,440,122
コール・ローン等	17,818,273,430
株式(評価額)	241,430,274,430
未収入金	3,543,057,585
未収配当金	215,795,053
未収利息	24,364
その他未収収益	29,651,260
差入委託証拠金	34,364,000
(B) 負債	17,704,527,488
未払解約金	3,114,852,556
未払利息	475,185
受入担保金	14,589,199,747
(C) 純資産総額(A－B)	245,366,912,634
元本	156,174,324,083
次期繰越損益金	89,192,588,551
(D) 受益権総口数	156,174,324,083口
1万口当たり基準価額(C／D)	15,711円

○損益の状況 (2014年3月26日～2015年3月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,631,758,236
受取配当金	4,220,584,780
受取利息	19,266,102
その他収益金	402,101,389
支払利息	△ 10,194,035
(B) 有価証券売買損益	73,647,751,072
売買益	75,831,797,162
売買損	△ 2,184,046,090
(C) 先物取引等取引損益	1,104,628,680
取引益	1,531,287,016
取引損	△ 426,658,336
(D) 保管費用等	△ 1,046,177
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	79,383,091,811
(F) 前期繰越損益金	24,699,109,110
(G) 追加信託差損益金	21,936,193,747
(H) 解約差損益金	△36,825,806,117
(I) 計(E＋F＋G＋H)	89,192,588,551
次期繰越損益金(I)	89,192,588,551

(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。

<注記事項>

①期首元本額	196,865,740,751円		
期中追加設定元本額	70,136,268,196円		
期中一部解約元本額	110,827,684,864円		
②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）			
ファンド・マネジャー（国内株式）	3,564,795,993円	三菱UFJ TOPIX・ライト	404,286,009円
eMAXIS TOPIXインデックス	8,705,160,746円	インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	33,360,818円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	909,285,619円	インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	137,612,969円
eMAXIS バランス（波乗り型）	729,678,462円	インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	186,882,380円
コアバランス	599,238円	インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	158,949,292円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	2,255,796,669円	三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	4,005,229,859円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	5,138,586,333円	三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	1,302,040,416円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	26,441,896,738円	三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	144,822,356円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	15,240,818,423円	三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	1,380,080,180円
三菱UFJ バランスファンドVA20型（適格機関投資家限定）	553,173,927円	三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	160,084,461円
三菱UFJ バランスファンドVA40型（適格機関投資家限定）	4,415,307,879円	三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	1,211,845,201円
MUAM 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	12,278,588,913円	三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	2,019,775,189円
三菱UFJ バランスファンドVA50型（適格機関投資家限定）	7,954,377,935円	三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	493,134,259円
三菱UFJ バランスファンドVA75型（適格機関投資家限定）	3,323,922,337円	三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	2,019,813,463円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	743,559,346円	三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	1,591,554,273円
三菱UFJ バランスファンドVA45型（適格機関投資家限定）	451,509,718円	三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	1,250,796,283円
三菱UFJ バランスファンドVA30型（適格機関投資家限定）	205,219,114円	三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	35,476,494,161円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	600,280,127円	三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	105,699,076円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	1,351,889,885円	三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	26,537,331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）	37,945,812円	三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	170,025,595円
MUAM トピックスリスクコントロール（5%）インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	65,613,761円	三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	52,097,609円
MUAM トピックスリスクコントロール（0%）インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	335,052,479円	三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	3,808,729円
MUAM インデックスファンドTOPIXi（適格機関投資家限定）	8,726,654円	合計	156,174,324,083円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	8,527,608,066円		

【お知らせ】

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

外国株式インデックスマザーファンド

《第14期》決算日2015年5月12日

[計算期間：2014年5月13日～2015年5月12日]

「外国株式インデックスマザーファンド」は、5月12日に第14期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円換算ベース) と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をMSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円換算ベース) の動きにできるだけ連動させるため、株式の実質投資比率 (組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。) は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
主 要 運 用 対 象	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円換算ベース) に採用されている株式を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 円	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ 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 百万円
		期 騰 落 率 %	期 騰 落 率 %				
10期(2011年5月12日)	10,647	7.3	82.70	5.0	95.3	2.9	141,974
11期(2012年5月14日)	9,921	△ 6.8	74.99	△ 9.3	95.2	2.6	142,226
12期(2013年5月13日)	15,535	56.6	114.32	52.4	96.3	1.0	199,188
13期(2014年5月12日)	18,176	17.0	130.71	14.3	96.7	1.1	197,280
14期(2015年5月12日)	23,063	26.9	162.29	24.2	96.5	1.2	227,514

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

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

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイインデックス) (円換算ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2014年5月12日	円 18,176	% —	% —	% 96.7	% 1.1	% 2.1
5月末	18,457	1.5	1.3	96.8	1.0	2.1
6月末	18,691	2.8	2.4	96.4	1.5	2.1
7月末	18,954	4.3	3.7	96.6	1.2	2.1
8月末	19,245	5.9	5.1	96.7	0.6	2.1
9月末	19,806	9.0	8.0	96.2	1.5	2.0
10月末	19,703	8.4	7.4	96.6	1.9	2.2
11月末	22,081	21.5	20.1	96.6	1.3	2.2
12月末	22,369	23.1	21.5	95.1	3.3	2.2
2015年1月末	21,419	17.8	16.2	96.1	1.7	2.5
2月末	22,648	24.6	22.6	95.9	1.1	2.2
3月末	22,610	24.4	22.0	96.2	1.4	2.3
4月末	22,826	25.6	23.1	96.2	1.3	2.2
(期 末) 2015年5月12日	23,063	26.9	24.2	96.5	1.2	2.2

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

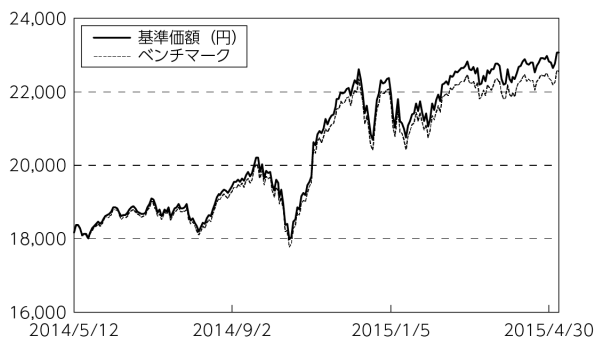
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ26.9%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
(24.2%)を2.7%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国株式市況

- ・欧州経済の先行き不透明感やギリシャ債務問題などを受けて下落する局面もありましたが、欧米での緩和的な金融政策や米国の良好な企業決算発表などを受けて外国株式市況は上昇しました。

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて17.8%の円安・米ドル高、4.6%の円高・ユーロ安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

(注) マルチファクターモデル

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは24.2%の上昇となったため、カイ離は2.7%程度となりました。

	組入比率 要因	銘柄選択 要因	その他の 要因	合計
ベンチマーク とのカイ離	△0.0%程度	△0.0%程度	2.7%程度	2.7%程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は△0.0%程度でした。

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

- ・効率的に運用を行うため、円貨、外貨現金などを若干保有しました。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

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

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

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.7%程度でした。

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

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

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

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

◎今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2014年 5 月13日～2015年 5 月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	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
(株 式)	(1)	(0.004)	有価証券等を売買する際に発生する費用
(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	2	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
(株 式)	(2)	(0.008)	有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	7	0.032	(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)	(6)	(0.030)	外国での資産の保管等に要する費用
(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	10	0.046	
期中の平均基準価額は、20,734円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2014年5月13日～2015年5月12日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 27,271 (6,230)	千アメリカドル 157,660 (△ 89)	百株 43,545 (255)	千アメリカドル 252,034 (3,213)
	カナダ	3,854 (474)	千カナダドル 14,155 (ー)	6,571 (79)	千カナダドル 20,326 (475)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	2,638 (1,120)	9,716 (△ 99)	3,651 (ー)	12,025 (92)
	イタリア	8,252 (△ 478)	2,588 (△ 407)	7,076	2,857
	フランス	2,592 (447)	8,687 (△ 132)	3,482 (0.01)	11,748 (0.31526)
	オランダ	1,615 (541)	2,998 (407)	2,527	4,774
	スペイン	7,591 (66,817)	5,830 (671)	62,134 (9,591)	5,294 (109)
	ベルギー	151	1,046	257	1,674
	オーストリア	194	163	437	342
	ルクセンブルク	187	504	228	379
	フィンランド	476	693	834	1,229
	アイルランド	4,274	406	2,497	321
	ポルトガル	27,129 (1,173)	554 (ー)	8,667	388
	イギリス	27,479 (262,007)	千イギリスポンド 14,125 (△ 125)	34,291 (270,239)	千イギリスポンド 20,763 (41)
	スイス	3,470 (2,261)	千スイスフラン 12,034 (2,998)	4,241 (2,261)	千スイスフラン 17,501 (3,860)
	スウェーデン	1,790	千スウェーデンクローネ 24,841	2,823	千スウェーデンクローネ 40,550
	ノルウェー	564 (94)	千ノルウェークローネ 5,549 (ー)	974	千ノルウェークローネ 8,624
	デンマーク	575	千デンマーククローネ 19,180	507	千デンマーククローネ 14,562
	オーストラリア	8,526 (42)	千オーストラリアドル 9,385 (△ 53)	9,640 (40)	千オーストラリアドル 13,180 (2)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ニュージーランド	百株 1,459 (—)	千ニュージーランドドル 477 (39)	百株 416	千ニュージーランドドル 264
	香港	10,199 (4,548)	千香港ドル 26,771 (—)	15,356	千香港ドル 38,323
	シンガポール	4,711 (201)	千シンガポールドル 2,099 (—)	9,321	千シンガポールドル 3,548
	イスラエル	289 (11)	千イスラエルシェケル 1,901 (—)	601	千イスラエルシェケル 3,023

(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	3	143	5	243
	MACERICH CO/THE	0. 952	72	1	116
	PROLOGIS INC	2	126	5	216
	CAMDEN PROPERTY TRUST	0. 515	39	0. 797	60
	DIGITAL REALTY TRUST INC	1	114	1	125
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0. 559	119	0. 661	137
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	0. 512	69	0. 568	77
	HEALTH CARE REIT INC	5	406	3	262
	BOSTON PROPERTIES INC	1	161	2	260
	REALTY INCOME CORP	1	75	2	121
	REGENCY CENTERS CORP	0. 798	53	1	67
	SL GREEN REALTY CORP	0. 733	90	0. 979	116
	UDR INC	2	75	3	106
	VENTAS INC	4	303	3	274
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	7	83	13	151
	RAYONIER INC	1	41	2	59
	WEYERHAEUSER CO	4	154	10	364
	AMERICAN TOWER CORP	4	393	4	438
	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	1	33	5	122
	AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	17	193	10	100
	DUKE REALTY CORP	2	51	2	55
	WP GLIMCHER INC	— (9)	— (—)	9	194
	RAYONIER ADVANCED MATERIALS	— (2)	— (—)	2	115
	IRON MOUNTAIN INC	0. 353 (11)	14 (310)	1	62
	URBAN EDGE PROPERTIES	— (4)	— (—)	4	120
	EQUINIX INC	0. 268 (3)	63 (626)	0. 224	51
	COMMUNICATIONS SALES & LE	— (7)	— (244)	—	—
	EQUITY RESIDENTIAL	2	168	3	271
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	2	71	6	171
	HOST HOTELS & RESORTS INC	2	66	6	151
	LIBERTY PROPERTY TRUST	1	56	2	75
	PLUM CREEK TIMBER CO	1	56	2	94
	PUBLIC STORAGE	1	191	1	336
	SIMON PROPERTY GROUP INC	2	389	3	658
	VORNADO REALTY TRUST	1	148	2	246
KIMCO REALTY CORP	3	80	5	129	

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	1	170	1	181
	小計	85 (38)	4,281 (1,181)	138	6,341
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.6	17	0.9	24
	小計	0.6	17	0.9	24
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	GECINA SA	0.644	73	0.369	42
	KLEPIERRE	5	214	1	47
	UNIBAIL-RODAMCO SE	0.689	155	1	246
	FONCIERE DES REGIONS	0.392 (ー)	33 (△ 4)	0.352 (ー)	29 (0.00001)
	FONCIERE DES REGIONS-RTS	ー (1)	ー (ー)	1	2
	ICADE	0.148	11	0.287	19
	小計	7 (1)	487 (△ 4)	4 (ー)	388 (0.00001)
	オランダ				
	CORIO NV	0.692	27	4	212
	小計	0.692	27	4	212
	ユ ー ロ 計	7 (1)	514 (△ 4)	9 (ー)	601 (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	9	71	12	99
	HAMMERSON PLC	12	76	11	70
	LAND SECURITIES GROUP PLC	6	72	9	110
	INTU PROPERTIES PLC	10	35	12	43
	SEGRO PLC	11	45	15	61
	小計	49	300	62	385
	オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
	FEDERATION CENTRES	14	41	13	40
	WESTFIELD RETAIL TRUST	ー	ー	ー (190)	ー (613)
	SCENTRE GROUP	24 (331)	87 (558)	39	140
	NOVION PROPERTY GROUP	24	58	24	58
	GPT GROUP	14	58	22	91
	MIRVAC GROUP	41	76	57	104
	STOCKLAND	13	54	23	96
	WESTFIELD CORP	14	126	24	215
	DEXUS PROPERTY GROUP	40 (△ 297)	79 (ー)	47	101

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	オーストラリア	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
	GOODMAN GROUP	3	17	8	45
	小 計	189 (34)	600 (558)	261 (190)	893 (613)
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	20	975	32	1,507
	小 計	20	975	32	1,507
	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	153 (ー)	296 (△0.2574)	10	19
	CAPITALAND MALL TRUST	14 (ー)	29 (△0.1872)	33	67
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	ー (ー)	ー (△0.0759)	9	21
	小 計	167 (ー)	325 (△0.5205)	52	107

(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 61,990	百万円 61,960	百万円 ー	百万円 ー

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

○株式売買比率

(2014年5月13日～2015年5月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	76,575,341千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	205,745,833千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.37

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2014年5月13日～2015年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	36,995	313	0.8	58,387	4,094	7.0

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

○組入資産の明細

(2015年5月12日現在)

外国株式

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
ALCOA INC		693	698	953	114,526	素材
AMERICAN EXPRESS CO		618	551	4,397	528,334	各種金融
AVON PRODUCTS INC		272	252	178	21,421	家庭用品・パーソナル用品
ABBOTT LABORATORIES		994	892	4,223	507,509	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC		211	198	844	101,448	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP		33	33	738	88,729	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING		310	285	2,488	298,987	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC		—	42	270	32,450	小売
AES CORP		443	404	553	66,543	公益事業
AFLAC INC		300	266	1,703	204,721	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP		897	829	4,910	590,041	保険
ALLERGAN INC		190	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
APACHE CORP		256	222	1,407	169,116	エネルギー
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP		31	37	1,140	137,021	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A		408	371	3,568	428,812	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC		136	126	1,848	222,060	素材
ANTHEM INC		190	159	2,540	305,220	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP		322	300	2,591	311,358	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP		854	785	1,372	164,905	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC		349	320	2,223	267,144	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE		458	401	5,857	703,759	資本財
BECTON DICKINSON AND CO		124	123	1,754	210,849	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC		176	177	656	78,848	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO		1,057	983	6,697	804,740	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC		85	78	2,877	345,688	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC		2,653	2,459	12,250	1,471,849	電気通信サービス
CR BARD INC		47	44	753	90,474	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP		86	77	559	67,247	素材
BAKER HUGHES INC		285	256	1,704	204,736	エネルギー
ALLSTATE CORP		293	248	1,661	199,583	保険
AVERY DENNISON CORP		63	53	313	37,621	素材
ACE LTD		218	196	2,127	255,617	保険
ANALOG DEVICES INC		200	185	1,164	139,896	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC		21	18	1,285	154,477	小売
CVS HEALTH CORP		763	679	6,830	820,649	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ENTERPRISES		157	136	624	74,999	食品・飲料・タバコ
CORNING INC		931	758	1,617	194,285	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO		2,413	2,216	14,503	1,742,629	銀行
CIGNA CORP		177	154	1,988	238,874	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC		409	340	3,023	363,231	資本財
COCA-COLA CO/THE		2,550	2,337	9,568	1,149,640	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP		370	329	2,741	329,359	各種金融
CAMPBELL SOUP CO		130	121	555	66,771	食品・飲料・タバコ
CSX CORP		650	590	2,128	255,701	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A		122	118	237	28,548	メディア
CHEVRON CORP		1,234	1,120	12,029	1,445,379	エネルギー

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
COACH INC		178	163	626	75,243	耐久消費財・アパレル
ROCKWELL COLLINS INC		82	70	683	82,138	資本財
COMPUTER SCIENCES CORP		93	83	544	65,427	ソフトウェア・サービス
CONOCOPHILLIPS		746	729	4,763	572,363	エネルギー
CME GROUP INC		203	189	1,807	217,164	各種金融
CARDINAL HEALTH INC		218	195	1,692	203,351	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO		594	540	3,665	440,364	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION RESOURCES INC/VA		374	347	2,466	296,362	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE		779	698	3,624	435,513	素材
DEVON ENERGY CORP		248	230	1,530	183,842	エネルギー
DEERE & CO		235	201	1,837	220,794	資本財
DANAHER CORP		379	374	3,130	376,128	資本財
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS		595	536	4,048	486,430	素材
WALT DISNEY CO/THE		1,070	954	10,370	1,246,033	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC		84	79	510	61,377	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP		455	420	3,220	387,002	公益事業
DR HORTON INC		189	194	495	59,582	耐久消費財・アパレル
DICK’S SPORTING GOODS INC		63	57	319	38,412	小売
TARGET CORP		383	358	2,888	347,014	小売
DENBURY RESOURCES INC		239	—	—	—	エネルギー
DUN & BRADSTREET CORP		24	21	273	32,819	商業・専門サービス
DIAMOND OFFSHORE DRILLING		42	39	132	15,912	エネルギー
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I		115	101	830	99,755	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP		109	98	738	88,737	資本財
DTE ENERGY COMPANY		113	105	834	100,210	公益事業
EXXON MOBIL CORP		2,804	2,510	21,784	2,617,435	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP		69	63	810	97,330	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC		350	324	2,976	357,593	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO		452	410	2,434	292,484	資本財
EXELON CORP		552	510	1,704	204,833	公益事業
ECOLAB INC		174	159	1,816	218,209	素材
EQUIFAX INC		77	71	709	85,224	商業・専門サービス
ENSCO PLC-CL A		149	138	361	43,479	エネルギー
EMC CORP/MA		1,324	1,205	3,233	388,546	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A		152	137	1,206	144,942	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC		304	280	2,028	243,781	資本財
EDISON INTERNATIONAL		200	184	1,111	133,582	公益事業
ENTERGY CORP		115	107	819	98,425	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD		30	26	483	58,144	保険
ENERGIZER HOLDINGS INC		39	36	510	61,340	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC		281	259	2,597	312,072	公益事業
MACY’S INC		237	204	1,350	162,208	小売
FEDEX CORP		192	159	2,780	334,065	運輸
FMC TECHNOLOGIES INC		153	137	569	68,464	エネルギー
FAMILY DOLLAR STORES		66	60	478	57,466	小売
FORD MOTOR CO		2,370	2,127	3,328	399,970	自動車・自動車部品
FOREST LABORATORIES INC		154	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FRANKLIN RESOURCES INC		263	238	1,237	148,638	各種金融
FOOT LOCKER INC		—	84	519	62,381	小売
FIRSTENERGY CORP		271	250	874	105,060	公益事業
FLUOR CORP		104	92	554	66,637	資本財
FREEPORT-MCMORAN INC		663	614	1,411	169,564	素材

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
GENERAL MILLS INC		408	357	2,004	240,867	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP		191	166	2,338	281,015	資本財
WW GRAINGER INC		37	36	907	109,055	資本財
GENERAL ELECTRIC CO		6,497	5,953	16,026	1,925,625	資本財
GENUINE PARTS CO		99	90	851	102,326	小売
GAP INC/THE		157	143	570	68,531	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC		276	232	4,684	562,900	各種金融
HALLIBURTON CO		545	502	2,370	284,775	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC		479	440	4,525	543,695	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC		143	126	720	86,540	自動車・自動車部品
HEWLETT-PACKARD CO		1,234	1,106	3,727	447,878	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP		274	254	1,059	127,275	保険
HERSHEY CO/THE		99	90	845	101,627	食品・飲料・タバコ
DIRECTV		320	282	2,526	303,570	メディア
HOSPIRA INC		105	100	884	106,233	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HOME DEPOT INC		904	781	8,739	1,050,091	小売
HASBRO INC		73	66	480	57,709	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC		188	157	1,058	127,150	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP		662	557	9,536	1,145,853	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO		270	237	1,256	150,991	素材
ILLINOIS TOOL WORKS		270	219	2,105	253,002	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC		266	246	518	62,281	メディア
IRON MOUNTAIN INC		89	—	—	—	商業・専門サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES		52	48	575	69,089	素材
INTERNATIONAL GAME TECHNOLOG		152	—	—	—	消費者サービス
JOHNSON & JOHNSON		1,811	1,659	16,764	2,014,256	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC		439	394	1,985	238,553	自動車・自動車部品
KANSAS CITY SOUTHERN		70	66	666	80,078	運輸
KELLOGG CO		163	157	1,004	120,648	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP		245	221	2,435	292,638	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A		1,071	995	3,915	470,399	食品・飲料・タバコ
KROGER CO		318	276	1,986	238,628	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP		133	121	902	108,375	小売
ELI LILLY & CO		652	593	4,363	524,278	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		56	59	698	83,971	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO		114	101	437	52,531	運輸
LENNAR CORP-A		106	101	475	57,187	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC		672	584	4,281	514,479	小売
LEGGETT & PLATT INC		88	81	379	45,564	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC		158	147	1,314	157,913	小売
LAS VEGAS SANDS CORP		263	237	1,229	147,782	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP		175	159	3,031	364,191	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP		167	154	910	109,385	保険
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS		56	50	588	70,716	資本財
LEGG MASON INC		71	61	334	40,200	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A		152	134	1,071	128,694	消費者サービス
MCDONALD'S CORP		639	576	5,624	675,815	消費者サービス
MCGRAW HILL FINANCIAL INC		164	160	1,728	207,710	各種金融
MEDTRONIC PLC		642	839	6,383	766,919	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.		1,875	1,690	10,140	1,218,407	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC		677	635	1,764	212,009	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC		216	202	554	66,652	耐久消費財・アパレル

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
3M CO		410	360	5,769	693,206	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC		150	133	795	95,567	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL		251	234	454	54,577	消費者サービス
MASCO CORP		230	209	558	67,156	資本財
MONSANTO CO		337	286	3,385	406,729	素材
MEADWESTVACO CORP		114	97	482	57,945	素材
M & T BANK CORP		75	70	856	102,924	銀行
MARSH & MCLENNAN COS		353	320	1,856	223,021	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC		39	37	675	81,206	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY		937	869	3,326	399,700	各種金融
MCKESSON CORP		147	137	3,141	377,452	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC		612	571	3,047	366,109	保険
MANPOWERGROUP INC		50	47	402	48,311	商業・専門サービス
MOODY'S CORP		123	111	1,184	142,327	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP		199	183	1,837	220,743	運輸
BANK OF AMERICA CORP		6,847	6,233	10,279	1,235,064	銀行
NISOURCE INC		201	188	837	100,657	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP		135	113	1,775	213,383	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP		287	265	455	54,729	銀行
NEWMONT MINING CORP		318	292	772	92,772	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A		948	804	2,638	317,056	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS		77	69	538	64,675	食品・飲料・タバコ
NUCOR CORP		204	189	928	111,511	素材
SAFEWAY INC		155	—	—	—	食品・生活必需品小売り
NEWELL RUBBERMAID INC		184	160	644	77,425	耐久消費財・アパレル
NOBLE CORP PLC		160	149	256	30,812	エネルギー
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B		288	259	843	101,358	メディア
NOBLE ENERGY INC		230	229	1,055	126,836	エネルギー
PALL CORP		71	62	622	74,790	資本財
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP		518	461	3,541	425,534	エネルギー
OMNICARE INC		65	57	516	62,069	ヘルスケア機器・サービス
OMNICOM GROUP		166	146	1,126	135,323	メディア
PEPSICO INC		984	887	8,549	1,027,259	食品・飲料・タバコ
ALTRIA GROUP INC		1,285	1,171	6,016	722,861	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL		72	66	395	47,524	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE		1,744	1,602	12,859	1,545,126	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP		340	311	2,918	350,636	銀行
PFIZER INC		4,160	3,735	12,684	1,524,079	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC		296	269	2,341	281,350	保険
PULTEGROUP INC		216	196	383	46,062	耐久消費財・アパレル
PEPCO HOLDINGS INC		160	151	376	45,225	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP		95	88	1,078	129,549	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO		89	88	1,349	162,163	エネルギー
CITIGROUP INC		1,948	1,795	9,690	1,164,310	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP		189	174	911	109,558	保険
PPG INDUSTRIES INC		91	81	1,847	221,923	素材
PEABODY ENERGY CORP		172	—	—	—	エネルギー
PENTAIR PLC		127	111	692	83,147	資本財
PRAXAIR INC		189	172	2,056	247,034	素材
P G & E CORP		290	282	1,471	176,829	公益事業
PPL CORP		406	396	1,336	160,608	公益事業
PROGRESSIVE CORP		368	330	895	107,535	保険

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP		323	301	1,266	152,145	公益事業
STARWOOD HOTELS & RESORTS		122	106	896	107,745	消費者サービス
SPX CORP		26	20	160	19,239	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD		98	98	717	86,169	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY		204	182	1,948	234,151	資本財
REPUBLIC SERVICES INC		189	168	673	80,888	商業・専門サービス
ROWAN COMPANIES PLC-A		82	—	—	—	エネルギー
REGIONS FINANCIAL CORP		879	819	825	99,210	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD		28	27	290	34,851	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC		63	59	1,017	122,209	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC		260	245	503	60,495	公益事業
ROBERT HALF INTL INC		87	80	457	54,998	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC		88	80	972	116,867	資本財
SCHLUMBERGER LTD		844	763	7,003	841,439	エネルギー
STRYKER CORP		193	201	1,902	228,538	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP		747	695	2,229	267,905	各種金融
SEMPRA ENERGY		149	139	1,463	175,859	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE		55	48	1,386	166,627	素材
ST JUDE MEDICAL INC		187	169	1,226	147,344	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC		94	88	915	109,995	資本財
SUNTRUST BANKS INC		344	308	1,313	157,831	銀行
TRAVELERS COS INC/THE		233	196	2,005	240,967	保険
SOUTHERN CO/THE		567	535	2,334	280,496	公益事業
AT&T INC		3,380	3,074	10,295	1,237,003	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP		136	130	1,254	150,675	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP		280	246	1,926	231,437	各種金融
SYSCO CORP		373	347	1,268	152,467	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP		121	119	580	69,787	素材
SCANA CORP		86	81	426	51,184	公益事業
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC		100	92	221	26,595	エネルギー
TEXAS INSTRUMENTS INC		704	625	3,407	409,412	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO		81	77	675	81,112	小売
TORCHMARK CORP		57	74	428	51,478	保険
TYCO INTERNATIONAL PLC		299	248	979	117,742	商業・専門サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC		231	237	3,077	369,811	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC		182	164	748	89,949	資本財
UNION PACIFIC CORP		296	527	5,628	676,251	運輸
UNUM GROUP		166	150	523	62,875	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP		559	513	6,041	725,877	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC		646	569	6,531	784,711	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP		1,173	1,060	4,639	557,437	銀行
MARATHON OIL CORP		448	399	1,134	136,316	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B		461	416	4,190	503,511	運輸
VALERO ENERGY CORP		347	308	1,798	216,083	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC		67	59	521	62,716	ヘルスケア機器・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING		361	284	1,695	203,760	メディア
VF CORP		225	204	1,466	176,174	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO		84	78	717	86,201	素材
TOWERS WATSON & CO-CL A		42	41	548	65,847	商業・専門サービス
WILLIAMS COS INC		440	420	2,088	250,886	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC		579	516	4,355	523,259	食品・生活必需品小売り
WISCONSIN ENERGY CORP		146	136	652	78,403	公益事業

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
WAL-MART STORES INC		1,044	955	7,461	896,491	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO		3,211	2,921	16,219	1,948,748	銀行
WASTE MANAGEMENT INC		288	257	1,270	152,644	商業・専門サービス
WATERS CORP		55	49	651	78,282	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL		492	461	657	78,996	エネルギー
WHIRLPOOL CORP		50	46	866	104,083	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP		753	636	715	85,955	ソフトウェア・サービス
XL GROUP PLC		183	178	657	78,968	保険
XCEL ENERGY INC		328	301	1,009	121,241	公益事業
KEYCORP		576	511	754	90,665	銀行
CARMAX INC		142	127	911	109,524	小売
ZIMMER HOLDINGS INC		110	100	1,133	136,230	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC		105	101	368	44,304	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC		285	259	2,325	279,389	消費者サービス
TJX COMPANIES INC		458	410	2,741	329,448	小売
CA INC		203	196	610	73,333	ソフトウェア・サービス
CAMERON INTERNATIONAL CORP		153	116	602	72,426	エネルギー
CLOROX COMPANY		82	76	818	98,315	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A		100	91	604	72,654	素材
CARNIVAL CORP		248	228	1,056	126,926	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV		185	167	1,081	129,941	ソフトウェア・サービス
CHUBB CORP		162	139	1,389	166,895	保険
CONAGRA FOODS INC		272	251	939	112,851	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC		190	174	1,074	129,155	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP		566	487	989	118,905	銀行
STERICYCLE INC		54	50	669	80,466	商業・専門サービス
INTEL CORP		3,192	2,866	9,369	1,125,789	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC		3,434	3,030	8,853	1,063,750	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP		65	59	496	59,636	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A		82	76	884	106,264	電気通信サービス
COSTCO WHOLESALE CORP		281	259	3,743	449,766	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC		770	721	1,436	172,575	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC		196	184	1,153	138,619	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A		174	180	748	89,908	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP		442	408	1,037	124,688	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC		138	124	1,267	152,274	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC		129	120	594	71,422	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B		457	405	4,164	500,381	耐久消費財・アパレル
AMGEN INC		484	450	7,262	872,614	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC		118	106	518	62,255	銀行
NORTHERN TRUST CORP		146	132	995	119,659	各種金融
MICROSOFT CORP		5,092	4,642	21,991	2,642,218	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC		59	54	474	56,988	ソフトウェア・サービス
STAPLES INC		412	381	634	76,290	小売
STARBUCKS CORP		484	887	4,390	527,548	消費者サービス
ORACLE CORP		2,340	2,101	9,212	1,106,907	ソフトウェア・サービス
ALTERA CORP		205	181	803	96,541	半導体・半導体製造装置
WHOLE FOODS MARKET INC		225	213	911	109,511	食品・生活必需品小売り
PETSMART INC		63	—	—	—	小売
NETFLIX INC		34	33	2,000	240,360	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC		68	60	1,323	159,049	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC		288	299	737	88,663	ソフトウェア・サービス

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
URBAN OUTFITTERS INC		73	63	256	30,853	小売
SKYWORKS SOLUTIONS INC		—	113	1,101	132,322	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC		54	49	678	81,525	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY		90	80	701	84,315	小売
LAM RESEARCH CORP		103	94	739	88,865	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD		51	47	545	65,559	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A		1,373	1,274	7,362	884,610	メディア
XILINX INC		171	157	691	83,047	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC		227	209	1,397	167,858	資本財
DENTSPLY INTERNATIONAL INC		93	84	425	51,070	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC		984	894	9,367	1,125,451	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC		120	96	638	76,732	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC		24	21	1,066	128,163	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC		174	160	1,642	197,312	ソフトウェア・サービス
COMCAST CORP-SPECIAL CL A		298	246	1,422	170,865	メディア
NUANCE COMMUNICATIONS INC		162	152	255	30,737	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC		210	193	948	114,006	ソフトウェア・サービス
YAHOO! INC		618	532	2,323	279,203	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC		53	48	224	27,017	ヘルスケア機器・サービス
AUTODESK INC		143	135	776	93,350	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A		137	147	744	89,455	メディア
SALESFORCE.COM INC		368	355	2,528	303,776	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC		97	83	645	77,544	小売
GOOGLE INC-CL A		177	168	9,215	1,107,241	ソフトウェア・サービス
JOY GLOBAL INC		69	58	259	31,139	資本財
B/E AEROSPACE INC		64	62	371	44,674	資本財
GARMIN LTD		75	67	315	37,868	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE NAVIGATION LTD		165	150	384	46,251	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC		1,084	985	6,803	817,406	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC		173	133	456	54,875	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC		97	91	442	53,190	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP		148	142	659	79,220	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS		183	168	555	66,799	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC		235	233	10,098	1,213,321	小売
T ROWE PRICE GROUP INC		168	153	1,256	150,920	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC		93	85	603	72,457	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP		108	98	588	70,740	半導体・半導体製造装置
CERNER CORP		200	182	1,242	149,325	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC		—	87	518	62,306	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC		86	68	437	52,535	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC		98	169	958	115,180	電気通信サービス
BROADCOM CORP-CL A		334	320	1,474	177,143	半導体・半導体製造装置
EBAY INC		748	662	3,865	464,389	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP		367	323	667	80,225	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC		132	122	967	116,188	小売
PRICELINE GROUP INC/THE		33	31	3,680	442,170	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B		712	684	10,010	1,202,755	各種金融
BB&T CORP		453	425	1,661	199,654	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP		740	666	2,882	346,382	各種金融
BORGWARNER INC		145	135	822	98,848	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC		172	163	516	62,021	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE		67	60	703	84,531	食品・飲料・タバコ

銘柄	柄	期首(前期末)	当期		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
TIME WARNER INC		582	496	4,125	495,630	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP		146	129	1,488	178,820	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC		45	42	273	32,870	保険
AETNA INC		236	208	2,277	273,587	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION		155	146	589	70,834	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER		314	291	1,614	194,003	公益事業
AON PLC		184	160	1,606	193,062	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO		424	381	1,966	236,278	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD		65	56	313	37,691	保険
HESS CORP		195	159	1,142	137,231	エネルギー
CROWN CASTLE INTL CORP		214	197	1,635	196,522	不動産
JUNIPER NETWORKS INC		326	231	628	75,457	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP		142	160	597	71,729	各種金融
RED HAT INC		120	111	853	102,526	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC		50	43	547	65,742	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A		140	131	875	105,165	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC		115	105	801	96,325	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC		219	185	646	77,722	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP		—	90	943	113,383	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD		249	224	315	37,950	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC		151	140	5,556	667,642	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC		81	84	1,661	199,654	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC		304	280	2,155	258,956	ソフトウェア・サービス
EQUINIX INC		32	—	—	—	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		150	142	1,768	212,501	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC		138	110	776	93,317	小売
CELGENE CORP		264	473	5,369	645,116	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CREE INC		75	71	223	26,844	半導体・半導体製造装置
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A		388	360	2,260	271,545	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO		518	435	3,746	450,118	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC		132	116	558	67,132	運輸
FASTENAL CO		181	166	705	84,711	資本財
FISERV INC		164	144	1,156	138,901	ソフトウェア・サービス
FLEXTRONICS INTL LTD		388	347	418	50,273	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOSSIL GROUP INC		31	27	221	26,669	耐久消費財・アパレル
SIRIUS XM HOLDINGS INC		1,986	1,451	555	66,786	メディア
SANDISK CORP		145	130	885	106,358	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC		577	3,477	43,923	5,277,467	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP		99	91	467	56,118	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC		—	485	538	64,753	銀行
SIGMA-ALDRICH		76	70	981	117,891	素材
SEARS HOLDINGS CORP		24	—	—	—	小売
NABORS INDUSTRIES LTD		189	150	240	28,930	エネルギー
ALEXION PHARMACEUTICALS INC		125	117	1,892	227,350	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHLAND INC		47	39	517	62,165	素材
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC		98	88	575	69,097	運輸
CENTURYLINK INC		378	337	1,159	139,349	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC		88	85	268	32,212	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV		245	246	1,762	211,716	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP		72	65	689	82,859	自動車・自動車部品
ONEOK INC		131	123	537	64,546	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC		207	188	1,426	171,439	食品・飲料・タバコ

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A		—	299	251	30,266	保険
SEAGATE TECHNOLOGY		208	193	1,099	132,056	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD		94	85	769	92,490	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC		46	43	634	76,191	小売
CONSOL ENERGY INC		147	136	440	52,872	エネルギー
NATIONAL OILWELL VARCO INC		275	255	1,309	157,290	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A		106	100	1,177	141,431	食品・飲料・タバコ
CHESAPEAKE ENERGY CORP		343	315	478	57,464	エネルギー
PARTNERRE LTD		30	26	352	42,406	保険
COOPER COS INC/THE		—	28	519	62,441	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP		96	90	810	97,440	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A		102	183	1,046	125,775	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP		74	63	314	37,820	保険
OWENS-ILLINOIS INC		101	99	239	28,830	素材
AGCO CORP		61	52	267	32,174	資本財
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A		94	87	269	32,331	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP		90	84	1,132	136,034	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA INC		68	61	635	76,358	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC		36	29	909	109,232	素材
HUDSON CITY BANCORP INC		295	277	260	31,307	銀行
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C		340	375	1,820	218,783	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC		124	109	1,367	164,299	各種金融
TESORO CORP		86	75	665	79,960	エネルギー
FNF GROUP		157	149	569	68,448	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN		73	66	1,601	192,364	各種金融
NASDAQ OMX GROUP/THE		77	70	359	43,138	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A		106	99	780	93,803	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B		254	212	1,389	166,960	メディア
AUTOLIV INC		60	53	646	77,657	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A		177	178	684	82,242	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC		19	18	1,170	140,607	消費者サービス
IHS INC-CLASS A		40	39	501	60,272	商業・専門サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B		78	73	678	81,533	食品・飲料・タバコ
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A		307	265	726	87,342	小売
ARROW ELECTRONICS INC		65	57	353	42,490	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC		114	102	1,456	175,008	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC		84	78	341	41,080	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP		196	185	445	53,521	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS		30	33	515	61,878	素材
RANGE RESOURCES CORP		104	100	632	75,961	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO		227	226	651	78,217	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO		55	51	597	71,805	エネルギー
RALPH LAUREN CORP		38	35	484	58,156	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP		72	66	399	47,982	公益事業
OCEANEERING INTL INC		70	63	338	40,691	エネルギー
WINDSTREAM HOLDINGS INC		382	—	—	—	電気通信サービス
WYNDHAM WORLDWIDE CORP		82	72	636	76,467	消費者サービス
HANESBRANDS INC		—	237	757	90,972	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC-CLASS A		668	593	5,492	659,873	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO		356	310	674	81,050	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC		47	—	—	—	ソフトウェア・サービス
KBR INC		91	—	—	—	資本財

銘	柄	期首(前期末)	当		期		業	種	等	
		株	数	株	数	価				
						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		90		82		366	44,071	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
MOSAIC CO/THE		191		190		855	102,787	素材		
SPECTRA ENERGY CORP		430		397		1,430	171,874	エネルギー		
TRANSDIGM GROUP INC		32		29		655	78,765	資本財		
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC		109		94		450	54,154	保険		
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL		200		184		282	33,975	銀行		
TE CONNECTIVITY LTD		262		240		1,674	201,141	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
COVIDIEN PLC		289		—		—	—	ヘルスケア機器・サービス		
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		307		268		1,593	191,454	各種金融		
LULULEMON ATHLETICA INC		63		63		418	50,292	耐久消費財・アパレル		
PRECISION CASTPARTS CORP		93		84		1,765	212,072	資本財		
VMWARE INC-CLASS A		55		49		445	53,529	ソフトウェア・サービス		
LOEWS CORP		212		198		817	98,171	保険		
TIME WARNER CABLE		180		166		2,571	308,986	メディア		
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR		37		36		555	66,727	小売		
LKQ CORP		196		181		499	60,046	小売		
HORMEL FOODS CORP		94		86		483	58,120	食品・飲料・タバコ		
EASTMAN CHEMICAL CO		98		88		707	84,999	素材		
GAMESTOP CORP-CLASS A		73		66		265	31,854	小売		
HARRIS CORP		68		62		486	58,495	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
HUMANA INC		99		90		1,513	181,816	ヘルスケア機器・サービス		
MURPHY OIL CORP		114		99		448	53,841	エネルギー		
NRG ENERGY INC		206		203		528	63,477	公益事業		
INVESCO LTD		287		254		1,048	125,978	各種金融		
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC		92		92		1,118	134,360	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
SEI INVESTMENTS COMPANY		91		83		391	47,036	各種金融		
TERADATA CORP		105		89		357	42,968	ソフトウェア・サービス		
TOTAL SYSTEM SERVICES INC		106		99		407	48,932	ソフトウェア・サービス		
CONCHO RESOURCES INC		66		70		816	98,082	エネルギー		
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK		29		54		258	31,005	エネルギー		
MOLSON COORS BREWING CO -B		96		90		681	81,907	食品・飲料・タバコ		
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL		1,029		921		7,749	931,068	食品・飲料・タバコ		
VISA INC-CLASS A SHARES		324		1,169		8,071	969,746	ソフトウェア・サービス		
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC		128		115		880	105,843	食品・飲料・タバコ		
CORE LABORATORIES N.V.		29		26		332	39,911	エネルギー		
CABOT OIL & GAS CORP		272		246		862	103,641	エネルギー		
FLOWSERVE CORP		89		80		445	53,571	資本財		
HELMERICH & PAYNE		68		63		479	57,631	エネルギー		
MDU RESOURCES GROUP INC		114		111		226	27,204	公益事業		
ENERGEN CORP		46		43		296	35,626	エネルギー		
T-MOBILE US INC		155		144		492	59,124	電気通信サービス		
LORILLARD INC		237		213		1,520	182,676	食品・飲料・タバコ		
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A		53		45		305	36,654	メディア		
RACKSPACE HOSTING INC		78		72		383	46,108	ソフトウェア・サービス		
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C		54		164		468	56,344	メディア		
RESMED INC		90		82		538	64,678	ヘルスケア機器・サービス		
AMETEK INC		157		145		768	92,305	資本財		
ARCH CAPITAL GROUP LTD		86		76		482	57,954	保険		
CHURCH & DWIGHT CO INC		88		78		655	78,774	家庭用品・パーソナル用品		
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC		60		56		490	58,879	運輸		
INTEGRYS ENERGY GROUP INC		52		48		346	41,643	公益事業		
PERRIGO CO PLC		86		83		1,613	193,860	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
QUANTA SERVICES INC		136	126	370	44,466	資本財
FMC CORP		85	79	482	57,961	素材
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC		79	72	729	87,709	食品・飲料・タバコ
WABTEC CORP		—	56	560	67,380	資本財
EVERSOURCE ENERGY		202	189	917	110,210	公益事業
NETSUITE INC		22	20	197	23,680	ソフトウェア・サービス
ACTAVIS PLC		111	223	6,735	809,263	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRGAS INC		42	40	403	48,459	素材
CROWN HOLDINGS INC		86	81	450	54,136	素材
CALPINE CORP		227	196	419	50,419	公益事業
EATON VANCE CORP		76	70	290	34,900	各種金融
DELTA AIR LINES INC		137	124	581	69,892	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO		129	119	1,141	137,097	食品・飲料・タバコ
AVAGO TECHNOLOGIES LTD		158	149	1,840	221,098	半導体・半導体製造装置
AMERICAN WATER WORKS CO INC		117	107	564	67,846	公益事業
CAREFUSION CORP		134	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
OCWEN FINANCIAL CORP		75	—	—	—	銀行
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A		97	95	702	84,347	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP		198	179	1,343	161,370	小売
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS		61	55	348	41,871	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL		19	17	555	66,777	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC		120	108	500	60,124	銀行
QEP RESOURCES INC		116	99	204	24,540	エネルギー
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP		646	599	350	42,083	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO		785	761	2,681	322,196	自動車・自動車部品
LYONDELLBASELL INDU-CL A		301	252	2,607	313,282	素材
HCA HOLDINGS INC		202	179	1,396	167,759	ヘルスケア機器・サービス
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC		291	268	553	66,550	運輸
WHITING PETROLEUM CORP		76	121	420	50,486	エネルギー
ROCK-TENN COMPANY -CL A		45	83	533	64,071	素材
HOLLYFRONTIER CORP		122	111	461	55,499	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP		193	165	1,697	203,910	エネルギー
ZILLOW GROUP INC - CL A		—	28	284	34,142	ソフトウェア・サービス
XYLEM INC		118	107	395	47,500	資本財
HERBALIFE LTD		56	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
TRIPADVISOR INC		75	69	570	68,596	小売
MEDIVATION INC		—	46	572	68,727	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC		—	35	627	75,350	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA		57	77	458	55,087	銀行
ALLEGHANY CORP		10	9	462	55,533	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS		49	47	2,257	271,229	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66		365	327	2,640	317,237	エネルギー
FACEBOOK INC-A		1,184	1,186	9,256	1,112,179	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP		173	166	558	67,133	公益事業
ALBEMARLE CORP		51	66	418	50,331	素材
PVH CORP		51	48	513	61,690	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A		64	64	1,284	154,376	ソフトウェア・サービス
KINDER MORGAN INC		431	1,067	4,550	546,783	エネルギー
COBALT INTERNATIONAL ENERGY		182	166	176	21,254	エネルギー
NIELSEN NV		184	207	931	111,949	商業・専門サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC		187	175	1,487	178,672	自動車・自動車部品
CHARTER COMMUNICATION-A		40	45	806	96,919	メディア

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		95	95	540	64,957	資本財
ADT CORP/THE		124	103	389	46,751	商業・専門サービス
KRAFT FOODS GROUP INC		381	348	3,008	361,446	食品・飲料・タバコ
OGE ENERGY CORP		126	121	386	46,466	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC		42	37	539	64,871	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC		1,022	944	6,157	739,822	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LIBERTY MEDIA CORP - A		63	52	195	23,531	メディア
TESLA MOTORS INC		55	52	1,248	149,973	自動車・自動車部品
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC		72	—	—	—	エネルギー
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC-NEW		1	—	—	—	エネルギー
CHENIERE ENERGY INC		131	133	1,032	124,102	エネルギー
REALOGY HOLDINGS CORP		95	85	390	46,901	不動産
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		81	74	435	52,367	各種金融
ZOETIS INC		325	296	1,367	164,326	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC		—	69	856	102,954	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A		240	224	353	42,430	メディア
SPRINT CORP		638	479	225	27,062	電気通信サービス
SNAP-ON INC		—	34	540	64,976	資本財
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD		125	122	772	92,770	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC		—	226	844	101,459	ソフトウェア・サービス
VANTIV INC - CL A		91	86	349	42,033	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A		54	58	531	63,853	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC		80	79	589	70,825	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B		57	54	667	80,222	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV		61	56	277	33,371	資本財
PHARMACYCLICS INC		40	38	970	116,629	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC		45	46	710	85,358	ソフトウェア・サービス
GOOGLE INC-CL C		177	171	9,184	1,103,462	ソフトウェア・サービス
NAVIENT CORP		286	246	491	59,109	各種金融
ENDO INTERNATIONAL PLC		—	102	889	106,829	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED RENTALS INC		—	59	605	72,790	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC		—	107	532	64,014	運輸
VOYA FINANCIAL INC		—	135	613	73,738	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP		—	28	195	23,547	素材
ANTERO RESOURCES CORP		—	32	143	17,196	エネルギー
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD		—	41	264	31,820	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIREEYE INC		—	49	209	25,149	ソフトウェア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP - C		—	124	458	55,123	メディア
ALLY FINANCIAL INC		—	255	576	69,294	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN		—	235	698	83,908	消費者サービス
JARDEN CORP		—	108	569	68,425	耐久消費財・アパレル
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN		—	67	357	42,939	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC		—	41	622	74,843	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIGNET JEWELERS LTD		—	45	613	73,662	小売
SYNCHRONY FINANCIAL		—	99	327	39,296	各種金融
QORVO INC		—	86	643	77,346	半導体・半導体製造装置
ISIS PHARMACEUTICALS INC		—	70	434	52,246	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	194,839	184,539	1,136,085	136,500,690	
	銘柄 数 < 比 率 >	579	593	—	<60.0%>	
(カナダ)				千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA		924	855	6,769	671,894	銀行
IMPERIAL OIL LTD		190	176	879	87,331	エネルギー

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円	
THOMSON REUTERS CORP		239	213	1,047	103,978	メディア
TRANSCANADA CORP		455	420	2,264	224,746	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B		233	214	930	92,358	電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC		388	362	1,482	147,142	保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B		364	340	591	58,755	素材
BARRICK GOLD CORP		748	690	1,068	106,021	素材
BCE INC		164	85	455	45,222	電気通信サービス
AGRIUM INC		93	85	1,114	110,627	素材
BOMBARDIER INC-B		905	847	220	21,859	資本財
BANK OF MONTREAL		414	382	2,982	296,058	銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		353	330	2,183	216,777	不動産
BANK OF NOVA SCOTIA		776	720	4,723	468,824	銀行
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE		204	189	5,120	508,230	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC		166	160	240	23,917	資本財
CAMECO CORP		255	237	486	48,296	エネルギー
CI FINANCIAL CORP		98	132	474	47,050	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		258	235	2,240	222,391	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES		698	647	2,467	244,875	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO		541	483	3,783	375,582	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A		50	44	559	55,545	小売
ENBRIDGE INC		507	503	3,132	310,950	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		14	12	760	75,517	保険
CGI GROUP INC - CLASS A		135	133	695	69,031	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC		219	206	514	51,098	エネルギー
IGM FINANCIAL INC		67	61	265	26,308	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD		139	135	860	85,398	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP		1,180	1,166	2,691	267,121	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC		144	246	1,686	167,409	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA		208	193	946	93,965	銀行
ONEX CORPORATION		57	53	363	36,115	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN		553	491	1,922	190,804	素材
POWER CORP OF CANADA		224	220	737	73,241	保険
POWER FINANCIAL CORP		158	147	547	54,366	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		248	236	641	63,670	メディア
SUNCOR ENERGY INC		958	860	3,167	314,394	エネルギー
TRANSALTA CORP		169	169	191	18,989	公益事業
TALISMAN ENERGY INC		668	—	—	—	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD		32	30	303	30,099	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		113	101	2,286	226,931	運輸
ENCANA CORP		478	492	827	82,142	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD		112	124	486	48,297	素材
FINNING INTERNATIONAL INC		107	103	262	26,009	資本財
GOLDCORP INC		521	484	1,089	108,094	素材
KINROSS GOLD CORP		749	689	210	20,858	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC		99	90	401	39,860	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC		190	179	658	65,384	保険
METHANEX CORP		62	56	391	38,898	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD		539	491	252	25,099	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A		—	46	105	10,428	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC		76	139	528	52,415	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC		79	152	538	53,409	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD		293	299	378	37,602	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	価額	
期首(前期末)	株数	株数	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	
TELUS CORP	140	116	491	48,797	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	356	359	647	64,284	素材
YAMANA GOLD INC	492	546	257	25,526	素材
FORTIS INC	137	163	641	63,682	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	270	248	1,149	114,146	食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP	457	431	263	26,182	素材
TORONTO-DOMINION BANK	1,182	1,091	6,068	602,323	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	96	93	600	59,605	素材
SILVER WHEATON CORP	225	241	583	57,890	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	37	33	291	28,956	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	64	59	252	25,094	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	81	74	272	27,067	公益事業
METRO INC	61	148	518	51,446	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	76	71	417	41,403	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	84	78	694	68,890	保険
CRESCENT POINT ENERGY CORP	255	248	741	73,554	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	483	489	1,023	101,590	エネルギー
TIM HORTONS INC	95	—	—	—	消費者サービス
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	199	—	—	—	エネルギー
ATHABASCA OIL CORP	199	—	—	—	エネルギー
MEG ENERGY CORP	90	94	178	17,737	エネルギー
PENN WEST PETROLEUM LTD	317	—	—	—	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	203	188	442	43,946	エネルギー
CANADIAN OIL SANDS LTD	311	289	345	34,279	エネルギー
BAYTEX ENERGY CORP	78	121	262	26,038	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	104	102	404	40,113	エネルギー
ENERPLUS CORP	128	118	157	15,636	エネルギー
NEW GOLD INC	321	313	126	12,520	素材
PEMBINA PIPELINE CORP	199	201	831	82,558	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	61	63	350	34,775	エネルギー
PENGROWTH ENERGY CORP	337	—	—	—	エネルギー
CATAMARAN CORP	131	122	883	87,722	ヘルスケア機器・サービス
BELL ALIANT INC	48	—	—	—	電気通信サービス
DOLLARAMA INC	44	75	531	52,759	小売
KEYERA CORP	52	100	406	40,329	エネルギー
ALTAGAS LTD	77	79	317	31,468	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	92	87	293	29,179	エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	50	47	208	20,722	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	66	60	115	11,416	不動産
INTER PIPELINE LTD	195	193	592	58,812	エネルギー
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	—	79	264	26,269	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	—	11	535	53,173	ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION SOFTWARE INC-RTS	—	11	0.1815	18	ソフトウェア・サービス
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	—	35	111	11,023	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	—	116	575	57,090	消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	—	41	267	26,542	素材
小計	株数・金額	25,507	23,185	93,048	9,235,979
銘柄数<比率>		93	93	—	<4.1%>
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
COMMERZBANK AG	625	631	783	104,759	銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	656	816	2,374	317,730	各種金融
METRO AG	84	95	295	39,544	食品・生活必需品小売り

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
SIEMENS AG-REG		509	469	4,547	608,363	資本財
RWE AG		314	290	676	90,473	公益事業
BASF SE		589	544	4,766	637,705	素材
VOLKSWAGEN AG		18	17	393	52,580	自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		618	570	5,026	672,549	自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		114	105	1,114	149,136	家庭用品・パーソナル用品
E. ON SE	1,156	1,188	1,664	222,732	222,732	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		213	196	2,145	287,010	自動車・自動車部品
BAYER AG-REG		531	490	6,490	868,401	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINDE AG		119	110	1,965	262,933	素材
ALLIANZ SE-REG		292	270	4,046	541,319	保険
MAN SE		22	20	195	26,170	資本財
CONTINENTAL AG		70	65	1,399	187,256	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG		692	671	767	102,714	半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		98	90	770	103,028	自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		151	136	186	24,995	運輸
HUGO BOSS AG -ORD		20	39	421	56,339	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE POST AG-REG		580	574	1,708	228,603	運輸
SAP SE		591	546	3,713	496,853	ソフトウェア・サービス
CELESIO AG		31	31	84	11,290	ヘルスケア機器・サービス
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG		141	129	611	81,852	メディア
DEUTSCHE BOERSE AG		123	114	871	116,643	各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		139	129	989	132,451	ヘルスケア機器・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT		25	22	135	18,165	運輸
ADIDAS AG		134	123	915	122,432	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,855	1,881	3,172	424,414	電気通信サービス	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		115	102	1,778	237,995	保険
THYSSENKRUPP AG		291	270	673	90,136	素材
BEIERSDORF AG		64	58	476	63,724	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG		89	84	630	84,383	素材
MERCK KGAA		41	77	766	102,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOLKSWAGEN AG-PREF		93	96	2,191	293,156	自動車・自動車部品
SUEDZUCKER AG		54	—	—	—	食品・飲料・タバコ
LANXESS AG		54	53	275	36,825	素材
FRESENIUS SE & CO KGAA		80	224	1,238	165,739	ヘルスケア機器・サービス
SKY DEUTSCHLAND AG		282	—	—	—	メディア
HOCHTIEF AG		20	—	—	—	資本財
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR		183	171	403	54,044	不動産
GEA GROUP AG		117	109	492	65,878	資本財
SYMRISE AG		—	73	426	57,124	素材
K+S AG-REG		111	102	327	43,829	素材
HENKEL AG & CO KGAA		83	68	625	83,645	家庭用品・パーソナル用品
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		70	73	299	40,089	ソフトウェア・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		33	32	271	36,281	自動車・自動車部品
HANNOVER RUECK SE		37	35	311	41,686	保険
BRENTTAG AG		33	92	516	69,134	資本財
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG		14	12	156	20,956	メディア
AXEL SPRINGER SE		24	24	124	16,668	メディア
FUCHS PETROLUB SE -PREF		22	40	152	20,344	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		180	347	192	25,795	電気通信サービス
OSRAM LICHT AG		54	52	245	32,894	資本財

銘柄		柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
			株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)			百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIE			—	203	603	80,778	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額		12,678	12,785	65,416	8,752,113	
	銘柄 数 < 比 率 >		53	52	—	<3.8%>	
(ユーロ…イタリア)							
ASSICURAZIONI GENERALI			752	692	1,208	161,691	保険
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA			42	2,544	152	20,459	銀行
INTESA SANPAOLO			7,450	7,501	2,404	321,745	銀行
TELECOM ITALIA SPA			6,542	5,980	622	83,289	電気通信サービス
ENI SPA			1,630	1,505	2,571	344,038	エネルギー
UNICREDIT SPA			2,786	2,601	1,697	227,109	銀行
ENEL SPA			4,229	3,904	1,641	219,614	公益事業
SAIPEM SPA			166	160	202	27,114	エネルギー
FIAT SPA			564	—	—	—	自動車・自動車部品
ATLANTIA SPA			243	246	584	78,254	運輸
INTESA SANPAOLO-RSP			—	556	159	21,404	銀行
LUXOTTICA GROUP SPA			108	99	599	80,268	耐久消費財・アパレル
MEDIOBANCA SPA			324	360	323	43,229	各種金融
SNAM SPA			1,317	1,246	584	78,218	公益事業
TELECOM ITALIA-RSP			3,901	3,577	300	40,202	電気通信サービス
BANCO POPOLARE SC			221	214	310	41,501	銀行
FINMECCANICA SPA			267	244	279	37,423	資本財
PIRELLI & C.			156	139	214	28,732	自動車・自動車部品
UBI BANCA SCPA			550	509	366	49,048	銀行
TERNA SPA			962	917	387	51,788	公益事業
UNIPOLSAI SPA			587	523	130	17,435	保険
PRYSMIAN SPA			130	123	250	33,465	資本財
EXOR SPA			64	56	241	32,268	各種金融
ENEL GREEN POWER SPA			1,092	1,081	192	25,709	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額		34,091	34,788	15,427	2,064,012	
	銘柄 数 < 比 率 >		23	23	—	<0.9%>	
(ユーロ…フランス)							
MICHELIN (CGDE)			119	109	1,106	148,104	自動車・自動車部品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI			163	165	2,620	350,558	耐久消費財・アパレル
PEUGEOT SA			251	232	400	53,535	自動車・自動車部品
AXA SA			1,152	1,077	2,404	321,720	保険
DANONE			364	343	2,162	289,257	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA			395	326	1,007	134,775	食品・生活必需品小売り
VIVENDI			769	719	1,631	218,264	メディア
ALCATEL-LUCENT			1,785	1,680	581	77,741	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA			460	429	1,894	253,474	銀行
AIR LIQUIDE SA			201	204	2,430	325,190	素材
TOTAL SA			1,373	1,268	6,029	806,675	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN			267	266	1,098	147,016	資本財
ZODIAC AEROSPACE			112	110	360	48,262	資本財
VINCI SA			310	279	1,485	198,762	資本財
LAFARGE SA			119	110	721	96,571	素材
SANOFI			767	708	6,296	842,469	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT			226	254	475	63,583	公益事業
L'OREAL			155	149	2,539	339,712	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA			100	124	608	81,377	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE			353	311	2,116	283,111	資本財
BNP PARIBAS			640	627	3,570	477,662	銀行

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等			
		株 数	株 数	評 価 額				
				外貨建金額		邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円			
ESSILOR INTERNATIONAL		131	121	1,329	177,890	ヘルスケア機器・サービス		
CAP GEMINI		92	84	683	91,384	ソフトウェア・サービス		
CASINO GUICHARD PERRACHON		36	32	261	35,016	食品・生活必需品小売り		
VALEO SA		47	45	662	88,680	自動車・自動車部品		
HERMES INTERNATIONAL		—	15	531	71,168	耐久消費財・アパレル		
VALLOUREC SA		67	63	139	18,634	資本財		
SODEXO		60	56	521	69,760	消費者サービス		
KERING		48	44	736	98,599	耐久消費財・アパレル		
DASSAULT SYSTEMES SA		40	76	526	70,456	ソフトウェア・サービス		
TECHNIP SA		65	59	369	49,387	エネルギー		
CHRISTIAN DIOR SE		35	32	575	76,937	耐久消費財・アパレル		
ATOS		45	47	336	44,963	ソフトウェア・サービス		
ORANGE		1,191	1,098	1,591	212,957	電気通信サービス		
CNP ASSURANCES		106	100	153	20,503	保険		
IMERYS SA		22	19	129	17,301	素材		
SAFRAN SA		173	173	1,152	154,230	資本財		
RENAULT SA		123	113	1,085	145,287	自動車・自動車部品		
PUBLICIS GROUPE		117	111	837	112,027	メディア		
LAGARDERE SCA		69	71	191	25,680	メディア		
JC DECAUX SA		41	40	141	18,911	メディア		
SOCIETE BIC SA		19	17	255	34,191	商業・専門サービス		
BOUYGUES SA		120	99	365	48,849	資本財		
THALES SA		58	54	293	39,331	資本財		
PERNOD RICARD SA		136	125	1,390	186,088	食品・飲料・タバコ		
CREDIT AGRICOLE SA		640	610	848	113,553	銀行		
GDF SUEZ		857	860	1,584	211,923	公益事業		
ALSTOM		135	127	359	48,143	資本財		
ARKEMA		39	39	281	37,677	素材		
LEGRAND SA		171	157	790	105,706	資本財		
SCOR SE		99	91	281	37,605	保険		
ADP		18	17	202	27,053	運輸		
EDF		155	145	327	43,878	公益事業		
CGG		104	—	—	—	エネルギー		
NATIXIS		596	554	400	53,542	銀行		
WENDEL		20	18	200	26,759	各種金融		
BUREAU VERITAS SA		140	157	333	44,677	商業・専門サービス		
EURAZEO		20	22	135	18,110	各種金融		
EURAZEO-NEW		—	1	6	899	各種金融		
SUEZ ENVIRONNEMENT CO		178	179	331	44,331	公益事業		
ILIAD SA		16	15	324	43,418	電気通信サービス		
EUTELSAT COMMUNICATIONS		89	92	286	38,341	メディア		
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR		355	282	391	52,369	運輸		
EDENRED		133	120	294	39,440	商業・専門サービス		
REMY COINTREAU		16	14	92	12,429	食品・飲料・タバコ		
REXEL SA		155	163	265	35,508	資本財		
BOLLORE		—	511	258	34,629	運輸		
NUMERICABLE-SFR		—	58	300	40,269	メディア		
小 計		株 数	金 額	16,890	16,447	64,103	8,576,340	
銘 柄 数 < 比 率 >		64	67	—	<3.8%>			
(ユーロ…オランダ)								
QIAGEN N.V.		153	135	296	39,684	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
CNH INDUSTRIAL NV		602	566	444	59,513	資本財		

銘柄		株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
			株数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		—	535	720	96,381	自動車・自動車部品
AIRBUS GROUP NV		377	348	2,166	289,798	資本財
STMICROELECTRONICS NV		411	371	261	34,958	半導体・半導体製造装置
GEMALTO		51	46	377	50,445	ソフトウェア・サービス
WOLTERS KLUWER		193	180	522	69,911	メディア
KONINKLIJKE KPN NV		2,042	1,900	648	86,774	電気通信サービス
AKZO NOBEL		153	145	997	133,499	素材
HEINEKEN NV		146	136	975	130,496	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV		601	554	1,372	183,638	資本財
REED ELSEVIER NV		449	414	910	121,755	メディア
AEGON NV		1,166	1,074	776	103,912	保険
KONINKLIJKE AHOLD NV		593	530	964	129,014	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD HOLDING NV		79	75	401	53,748	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV		65	59	370	49,606	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV		98	101	512	68,537	素材
ING GROEP NV-CVA		2,462	2,287	3,281	439,059	銀行
ASML HOLDING NV		229	207	2,024	270,846	半導体・半導体製造装置
UNILEVER NV-CVA		1,046	966	3,794	507,694	食品・飲料・タバコ
FUGRO NV-CVA		46	—	—	—	エネルギー
VOPAK		45	41	187	25,139	エネルギー
BOSKALIS WESTMINSTER		50	51	240	32,224	資本財
DELTA LLOYD NV		121	130	221	29,664	保険
TNT EXPRESS NV		285	259	198	26,499	運輸
ZIGGO NV		96	—	—	—	電気通信サービス
OCI NV		62	49	132	17,766	素材
NN GROUP NV		—	93	243	32,621	保険
小 計	株数・金額	11,634	11,264	23,045	3,083,194	
	銘柄数<比率>	26	26	—	<1.4%>	
(ユーロ…スペイン)						
BANCO POPULAR ESPANOL		1,048	1,061	513	68,677	銀行
ENDESA SA		—	191	331	44,396	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		114	102	319	42,679	資本財
IBERDROLA SA		3,095	3,070	1,877	251,173	公益事業
TELEFONICA SA		2,631	2,651	3,673	491,505	電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA		7,603	8,525	5,789	774,634	銀行
BANKINTER SA		—	403	274	36,667	銀行
REPSOL SA		556	615	1,119	149,775	エネルギー
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		3,790	3,743	3,403	455,413	銀行
GAS NATURAL SDG SA		223	208	457	61,185	公益事業
INDITEX		140	645	1,867	249,823	小売
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		254	239	384	51,497	運輸
MAPFRE SA		709	539	173	23,262	保険
FERROVIAL SA		255	246	486	65,097	資本財
FERROVIAL SA-RTS		—	237	7	948	資本財
ZARDOYA OTIS SA		103	103	120	16,164	資本財
ENAGAS SA		123	122	334	44,731	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		70	65	491	65,751	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		2,208	2,560	606	81,077	銀行
CAIXABANK S.A		1,117	1,364	607	81,301	銀行
GRIFOLS SA		95	88	318	42,660	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		243	264	1,079	144,385	ソフトウェア・サービス
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI		668	493	389	52,061	運輸

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	372	371	276	36,942	食品・生活必需品小売り
BANKIA SA	2,561	2,716	334	44,735	銀行
AENA SA	—	36	319	42,777	運輸
小計	27,986	30,669	25,557	3,419,330	
銘柄数 < 比率 >	22	26	—	< 1.5% >	
(ユーロ…ベルギー)					
AGEAS	143	128	430	57,540	保険
UCB SA	71	74	460	61,594	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	516	477	5,221	698,603	食品・飲料・タバコ
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	51	48	364	48,750	各種金融
DELHAIZE GROUP	65	60	501	67,101	食品・生活必需品小売り
UMICORE	72	55	251	33,639	素材
COLRUYT SA	47	42	179	24,035	食品・生活必需品小売り
KBC GROEP NV	160	149	869	116,369	銀行
SOLVAY SA	38	34	449	60,118	素材
BELGACOM SA	97	90	299	40,084	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	33	30	162	21,724	メディア
小計	1,299	1,193	9,190	1,229,561	
銘柄数 < 比率 >	11	11	—	< 0.5% >	
(ユーロ…オーストリア)					
ERSTE GROUP BANK AG	165	166	434	58,088	銀行
OMV AG	96	85	260	34,794	エネルギー
TELEKOM AUSTRIA AG	134	—	—	—	電気通信サービス
VOESTALPINE AG	73	65	254	33,984	素材
IMMOFINANZ AG	635	554	145	19,423	不動産
ANDRITZ AG	45	42	238	31,900	資本財
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	75	69	106	14,248	銀行
VIENNA INSURANCE GROUP AG	24	24	89	11,993	保険
小計	1,251	1,008	1,528	204,431	
銘柄数 < 比率 >	8	7	—	< 0.1% >	
(ユーロ…ルクセンブルク)					
RTL GROUP	24	22	188	25,228	メディア
TENARIS SA	304	276	373	50,018	エネルギー
SES	195	180	554	74,220	メディア
ARCELORMITTAL	639	590	560	75,052	素材
ALTICE SA	—	51	499	66,799	メディア
小計	1,164	1,122	2,177	291,318	
銘柄数 < 比率 >	4	5	—	< 0.1% >	
(ユーロ…フィンランド)					
NOKIA OYJ	2,416	2,219	1,386	185,471	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS	341	323	301	40,308	素材
NOKIAN RENKAAT OYJ	72	67	212	28,458	自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ	341	314	500	66,985	素材
FORTUM OYJ	292	267	481	64,354	公益事業
KONE OYJ-B	200	187	734	98,249	資本財
METSO OYJ	80	67	175	23,517	資本財
SAMPO OYJ-A SHS	288	265	1,169	156,475	保険
WARTSILA OYJ ABP	113	86	346	46,398	資本財
ELISA OYJ	87	84	231	31,007	電気通信サービス
NESTE OIL OYJ	79	73	168	22,598	エネルギー

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額			
(ユーロ…フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ORION OYJ-CLASS B		64	60	178	23,893	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	株 数 ・ 金 額	4,377	4,019	5,887	787,719	
	銘柄 数 < 比 率 >	12	12	—	<0.3%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A		98	96	614	82,202	食品・飲料・タバコ
IRISH BANK RESOLUTION CORPOR		472	472	—	—	銀行
BANK OF IRELAND		14,675	16,439	585	78,301	銀行
CRH PLC		476	490	1,261	168,800	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	15,722	17,499	2,461	329,303	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.1%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		1,279	1,362	497	66,622	公益事業
JERONIMO MARTINS		168	149	198	26,555	食品・生活必需品小売り
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG		380	—	—	—	電気通信サービス
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R		—	21,117	189	25,314	銀行
BANCO ESPIRITO SANTO-REG		1,173	—	—	—	銀行
GALP ENERGIA SGPS SA		219	227	271	36,310	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	3,221	22,857	1,157	154,802	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	4	—	<0.1%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	130,318	153,656	215,951	28,892,130	
	銘柄 数 < 比 率 >	232	237	—	<12.7%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC		9,843	9,750	2,542	475,666	銀行
BP PLC		11,969	10,812	4,948	925,737	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC		32,082	33,849	2,931	548,333	銀行
ASTRAZENECA PLC		806	748	3,389	634,095	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC		257	235	270	50,528	資本財
NEXT PLC		99	90	667	124,952	小売
DIAGEO PLC		1,613	1,490	2,659	497,418	食品・飲料・タバコ
SKY PLC		658	611	659	123,425	メディア
BAE SYSTEMS PLC		2,057	1,867	952	178,176	資本財
UNILEVER PLC		822	760	2,172	406,347	食品・飲料・タバコ
TESCO PLC		5,192	4,811	1,118	209,260	食品・生活必需品小売り
REED ELSEVIER PLC		756	671	728	136,255	メディア
MARKS & SPENCER GROUP PLC		1,032	966	544	101,927	小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		415	383	2,223	415,929	家庭用品・パーソナル用品
PRUDENTIAL PLC		1,642	1,521	2,507	468,981	保険
BG GROUP PLC		2,191	2,023	2,397	448,474	エネルギー
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		3,795	3,519	945	176,774	保険
SAGE GROUP PLC/THE		706	637	354	66,273	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC		12,032	11,377	7,193	1,345,663	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		1,213	1,105	4,001	748,560	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC		434	406	406	76,028	公益事業
SCHRODERS PLC		63	74	252	47,143	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP		1,408	1,501	537	100,454	銀行
BHP BILLITON PLC		1,356	1,250	1,965	367,714	素材
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC		618	567	1,847	345,666	食品・飲料・タバコ
WPP PLC		867	778	1,199	224,385	メディア
CENTRICA PLC		3,313	2,950	828	154,893	公益事業
BT GROUP PLC		5,078	4,824	2,267	424,180	電気通信サービス
SSE PLC		621	587	961	179,826	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC		1,564	1,464	1,534	287,122	銀行

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)		百株	百株	千イギリスポンド	千円	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		1,209	1,117	1,139	213,201	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF C		163,471	158,293	15	2,961	資本財
COMPASS GROUP PLC		1,149	987	1,163	217,652	消費者サービス
KINGFISHER PLC		1,534	1,400	518	97,079	小売
PEARSON PLC		529	486	641	119,909	メディア
SEVERN TRENT PLC		153	144	308	57,729	公益事業
RIO TINTO PLC		816	753	2,283	427,083	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC		3,121	2,881	4,257	796,436	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SABMILLER PLC		617	573	2,063	386,050	食品・飲料・タバコ
3I GROUP PLC		623	582	300	56,189	各種金融
GKN PLC		1,047	968	343	64,333	自動車・自動車部品
VODAFONE GROUP PLC		16,967	15,710	3,687	689,873	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS		1,428	1,256	229	42,997	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC		785	721	203	37,984	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC		1,895	2,370	1,282	239,911	保険
CAPITA PLC		425	394	491	91,920	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC		—	588	269	50,352	小売
JOHNSON MATTHEY PLC		130	122	412	77,254	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC		3,285	609	263	49,330	保険
WHITBREAD PLC		115	108	565	105,795	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC		2,402	2,230	2,019	377,723	公益事業
ARM HOLDINGS PLC		900	831	950	177,884	半導体・半導体製造装置
WOLSELEY PLC		171	155	618	115,624	資本財
SERCO GROUP PLC		307	—	—	—	商業・専門サービス
BUNZL PLC		217	199	377	70,659	資本財
COBHAM PLC		706	670	200	37,499	資本財
ANGLO AMERICAN PLC		893	825	930	174,141	素材
INTERTEK GROUP PLC		102	95	253	47,467	商業・専門サービス
WILLIAM HILL PLC		541	518	202	37,889	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC		287	265	471	88,253	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		168	140	391	73,220	消費者サービス
CARNIVAL PLC		117	107	333	62,448	消費者サービス
PERSIMMON PLC		193	180	318	59,572	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC		513	483	252	47,244	資本財
ICAP PLC		341	332	187	35,109	各種金融
ITV PLC		2,478	2,282	604	113,083	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		111	185	469	87,805	各種金融
G4S PLC		991	933	274	51,420	商業・専門サービス
AMEC FOSTER WHEELER PLC		187	228	198	37,093	エネルギー
IMI PLC		172	160	191	35,842	資本財
REXAM PLC		514	417	237	44,397	素材
SMITH & NEPHEW PLC		567	531	603	112,863	ヘルスケア機器・サービス
TATE & LYLE PLC		293	276	166	31,205	食品・飲料・タバコ
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		2,480	2,318	4,756	889,776	エネルギー
PETROFAC LTD		168	153	130	24,454	エネルギー
TRAVIS PERKINS PLC		156	145	310	58,032	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		1,590	1,446	3,015	564,113	エネルギー
OLD MUTUAL PLC		3,165	2,904	675	126,436	保険
INVESTEC PLC		379	327	199	37,264	各種金融
STANDARD LIFE PLC		1,525	1,166	553	103,593	保険
EXPERIAN PLC		651	587	691	129,276	商業・専門サービス
TUI TRAVEL PLC		294	—	—	—	消費者サービス

銘柄		柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
			株 数	株 数	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)			百株	百株	千イギリスポンド	千円	
WEIR GROUP PLC/THE			136	125	241	45,107	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC			228	211	608	113,918	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC			255	233	182	34,222	素材
TULLOW OIL PLC			581	532	216	40,556	エネルギー
SHIRE PLC			377	349	1,832	342,865	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INMARSAT PLC			290	251	255	47,836	電気通信サービス
ADMIRAL GROUP PLC			123	117	176	33,063	保険
FRESNILLO PLC			117	130	91	17,119	素材
RANDGOLD RESOURCES LTD			57	51	241	45,217	素材
FRIENDS LIFE GROUP LTD			906	—	—	—	保険
AGGREKO PLC			172	151	249	46,743	商業・専門サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC			324	148	160	30,067	商業・専門サービス
GLENCORE PLC			6,814	6,585	2,015	376,980	素材
ABERDEEN ASSET MGMT PLC			618	551	248	46,413	各種金融
HARGREAVES LANSDOWN PLC			132	140	173	32,536	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC			85	79	225	42,200	素材
MELROSE INDUSTRIES PLC			685	584	153	28,773	資本財
COCA-COLA HBC AG-CDI			129	115	163	30,666	食品・飲料・タバコ
EASYJET PLC			105	96	176	33,074	運輸
DIRECT LINE INSURANCE GROUP			728	886	286	53,591	保険
ASOS PLC			35	—	—	—	小売
ROYAL MAIL PLC			416	382	190	35,649	運輸
ASSTEAD GROUP PLC			—	300	353	66,075	資本財
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL			—	165	107	20,184	小売
MERLIN ENTERTAINMENT			—	418	192	35,941	消費者サービス
TUI AG-DI			—	269	342	64,128	消費者サービス
小 計		株 数 ・ 金 額	340,739	325,695	104,932	19,628,581	
銘 柄 数 < 比 率 >			103	104	—	< 8.6% >	
(スイス)					千スイスフラン		
NESTLE SA-REG			2,071	1,912	13,893	1,783,519	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG			336	309	2,539	325,943	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG			974	904	2,226	285,876	各種金融
HOLCIM LTD-REG			146	135	1,017	130,630	素材
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN			451	416	11,126	1,428,353	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GIVAUDAN-REG			5	5	954	122,473	素材
SONOVA HOLDING AG-REG			33	31	430	55,261	ヘルスケア機器・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG			95	88	2,637	338,593	保険
SYNGENTA AG-REG			59	55	2,219	284,945	素材
LONZA GROUP AG-REG			33	31	420	53,934	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			27	29	228	29,379	耐久消費財・アパレル
SCHINDLER HOLDING-PART CERT			29	26	428	55,044	資本財
GEBERIT AG-REG			24	22	733	94,138	資本財
SWISS RE AG			225	208	1,715	220,255	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR			19	18	713	91,541	耐久消費財・アパレル
PARGESA HOLDING SA-BR			18	19	125	16,142	各種金融
NOVARTIS AG-REG			1,477	1,364	13,053	1,675,675	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO SA-REG			84	101	741	95,236	商業・専門サービス
UBS AG-REG			2,348	—	—	—	各種金融
SWISSCOM AG-REG			14	13	761	97,698	電気通信サービス
ABB LTD-REG			1,407	1,302	2,668	342,518	資本財
SGS SA-REG			3	3	598	76,775	商業・専門サービス
SULZER AG-REG			15	13	153	19,741	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	
(スイス)		百株	百株	千スイスフラン	千円	
SCHINDLER HOLDING AG-REG		13	12	197	25,395	資本財
ACTELION LTD-REG		65	60	777	99,868	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		34	32	439	56,478	運輸
BALOISE HOLDING AG - REG		30	28	338	43,471	保険
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		20	18	429	55,126	保険
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.07	0.06	354	45,493	食品・飲料・タバコ
ARYZTA AG		55	52	323	41,497	食品・飲料・タバコ
JULIUS BAER GROUP LTD		142	133	648	83,290	各種金融
SIKA AG-BR		1	1	394	50,637	素材
TRANSOCEAN LTD		229	211	381	48,951	エネルギー
SWISS PRIME SITE-REG		35	34	282	36,227	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.55	0.55	278	35,795	食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG		10	10	302	38,869	各種金融
BARRY CALLEBAUT AG-REG		1	1	146	18,817	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		5	5	200	25,698	素材
UBS GROUP AG		—	2,164	4,289	550,689	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額	10,553	9,781	69,174	8,879,988	
	銘 柄 数 < 比 率 >	38	38	—	<3.9%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-SER B		158	140	3,563	51,450	耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS		1,948	1,804	16,913	244,227	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS		246	234	5,362	77,431	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		970	901	9,111	131,563	銀行
INVESTOR AB-B SHS		291	271	9,157	132,236	各種金融
NORDEA BANK AB		1,945	1,801	19,332	279,165	銀行
GETINGE AB-B SHS		125	118	2,455	35,450	ヘルスケア機器・サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		322	296	11,184	161,500	銀行
ATLAS COPCO AB-A SHS		437	400	10,180	146,999	資本財
SKF AB-B SHARES		251	233	4,727	68,259	資本財
ASSA ABLOY AB-B		216	198	9,596	138,578	資本財
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		611	562	18,771	271,063	小売
SANDVIK AB		692	635	6,491	93,742	資本財
SWEDBANK AB - A SHARES		581	537	10,326	149,120	銀行
SECURITAS AB-B SHS		196	182	2,129	30,753	商業・専門サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B		378	348	7,623	110,085	家庭用品・パーソナル用品
SKANSKA AB-B SHS		241	223	3,976	57,419	資本財
SWEDISH MATCH AB		131	120	3,019	43,597	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS		201	188	2,089	30,176	電気通信サービス
TELIASONERA AB		1,535	1,536	7,891	113,959	電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS		977	909	9,986	144,203	資本財
ALFA LAVAL AB		199	188	2,993	43,230	資本財
SCANIA AB-B SHS		202	—	—	—	資本財
ELEKTA AB-B SHS		231	214	1,652	23,868	ヘルスケア機器・サービス
LUNDIN PETROLEUM AB		140	125	1,774	25,623	エネルギー
BOLIDEN AB		171	159	2,866	41,394	素材
HUSQVARNA AB-B SHS		254	240	1,465	21,167	耐久消費財・アパレル
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR		41	38	2,551	36,848	電気通信サービス
HEXAGON AB-B SHS		153	150	4,480	64,700	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS		142	140	3,828	55,280	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		81	95	1,594	23,027	各種金融

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	評価額	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円	
ICA GRUPPEN AB	—	46	1,458	21,057	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	14,081	13,047	198,558	2,867,185
	銘柄数<比率>	31	31	—	<1.3%>
(ノルウェー)	株数	株数	千ノルウェークローネ	千円	
DNB ASA	623	580	8,038	127,408	銀行
NORSK HYDRO ASA	861	805	2,916	46,229	素材
ORKLA ASA	501	475	2,863	45,378	食品・飲料・タバコ
STATOIL ASA	718	662	10,394	164,755	エネルギー
TELENOR ASA	441	445	8,131	128,879	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	115	105	4,294	68,072	素材
SUBSEA 7 SA	172	166	1,413	22,411	エネルギー
SEADRILL LTD	241	233	2,438	38,645	エネルギー
AKASTOR ASA	107	—	—	—	エネルギー
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	128	119	1,501	23,806	保険
小計	株数・金額	3,911	3,595	41,992	665,586
	銘柄数<比率>	10	9	—	<0.3%>
(デンマーク)	株数	株数	千デンマーククローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	1,279	1,189	44,752	801,971	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	143	142	4,416	79,145	素材
DANSKE BANK A/S	419	388	7,581	135,868	銀行
WILLIAM DEMANT HOLDING	16	12	693	12,435	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	—	131	4,354	78,029	資本財
TDC A/S	530	478	2,394	42,905	電気通信サービス
CARLSBERG AS-B	68	63	4,039	72,393	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B	71	66	3,444	61,725	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S	120	105	2,443	43,793	運輸
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	4	4	5,825	104,397	運輸
TRYG A/S	14	13	970	17,384	保険
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	1	2	3,084	55,281	運輸
PANDORA A/S	—	68	4,851	86,944	耐久消費財・アパレル
ISS A/S	—	71	1,610	28,856	商業・専門サービス
小計	株数・金額	2,671	2,739	90,465	1,621,132
	銘柄数<比率>	11	14	—	<0.7%>
(オーストラリア)	株数	株数	千オーストラリアドル	千円	
BHP BILLITON LIMITED	2,063	1,904	6,061	574,571	素材
CSL LTD	314	282	2,513	238,259	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINA LTD	1,621	1,564	267	25,357	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	423	441	1,522	144,309	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,766	1,639	5,232	495,960	銀行
RIO TINTO LTD	281	258	1,515	143,632	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	787	815	1,125	106,670	保険
LEND LEASE GROUP	357	329	535	50,744	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	1,036	963	7,915	750,350	銀行
WESTPAC BANKING CORP	2,000	1,848	6,227	590,332	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,513	1,387	4,884	462,984	銀行
BRAMBLES LTD	1,009	940	1,028	97,534	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	846	373	124	11,759	運輸
BORAL LTD	491	466	289	27,479	素材
WOOLWORTHS LTD	809	750	2,037	193,091	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	2,821	2,553	1,544	146,412	電気通信サービス
AMP LTD	1,900	1,763	1,120	106,166	保険
TABCORP HOLDINGS LTD	508	518	236	22,374	消費者サービス

銘 柄	株 数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
AMCOR LIMITED	781	722	980	92,973	素材
COMPUTERSHARE LTD	310	287	350	33,210	ソフトウェア・サービス
MACQUARIE GROUP LTD	187	172	1,356	128,583	各種金融
CIMIC GROUP LTD	113	64	139	13,179	資本財
ASX LTD	127	117	485	46,051	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	365	351	344	32,636	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	38	35	282	26,799	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	281	276	407	38,638	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	320	354	155	14,745	小売
NEWCREST MINING LTD	483	454	626	59,424	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,459	1,392	761	72,210	保険
ORIGIN ENERGY LTD	710	664	848	80,385	エネルギー
ORICA LTD	234	222	449	42,635	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	250	229	445	42,244	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	624	590	507	48,106	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	828	776	1,005	95,285	保険
TRANSURBAN GROUP	1,117	1,097	1,070	101,457	運輸
WESFARMERS LTD	734	668	2,896	274,589	食品・生活必需品小売り
TOLL HOLDINGS LTD	469	412	370	35,135	運輸
SYDNEY AIRPORT	705	667	348	33,038	運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD	86	163	540	51,237	エネルギー
WORLEYPARSONS LTD	128	128	128	12,162	エネルギー
AGL ENERGY LTD	365	405	595	56,471	公益事業
TATTS GROUP LTD	958	891	349	33,138	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,006	911	234	22,197	素材
ASCIANO LTD	658	585	373	35,381	運輸
ILUKA RESOURCES LTD	282	251	216	20,565	素材
AUSNET SERVICES	1,215	1,155	167	15,831	公益事業
CROWN RESORTS LTD	265	212	271	25,761	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD	1,031	1,020	385	36,560	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	273	270	327	31,023	銀行
METCASH LTD	551	—	—	—	食品・生活必需品小売り
AURIZON HOLDINGS LTD	1,321	1,304	636	60,338	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	425	382	193	18,333	食品・飲料・タバコ
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	549	—	—	—	消費者サービス
ALS LTD	252	252	139	13,270	商業・専門サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	85	79	491	46,569	ヘルスケア機器・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	36	34	151	14,396	消費者サービス
SEEK LTD	203	190	297	28,169	商業・専門サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	210	228	296	28,122	銀行
REA GROUP LTD	36	33	139	13,269	メディア
TPG TELECOM LTD	—	176	159	15,090	電気通信サービス
HEALTHSCOPE LTD	—	705	198	18,861	ヘルスケア機器・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	—	1,652	358	33,984	保険
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	—	139	101	9,631	各種金融
小計	株数・金額	40,647	39,535	64,771	6,139,693
	銘柄数<比率>	59	61	—	<2.7%>
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,138	1,069	302	26,658	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	592	556	257	22,677	運輸
CONTACT ENERGY LTD	260	231	128	11,308	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD	437	393	334	29,448	素材

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ニュージーランド)		百株	百株	千ニュージーランドドル	千円	
RYMAN HEALTHCARE LTD		239	213	175	15,475	ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD		—	797	194	17,103	公益事業
MIGHTY RIVER POWER		—	452	131	11,552	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	2,669	3,713	1,523	134,223	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	7	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
WHARF HOLDINGS LTD		970	900	5,076	78,678	不動産
HUTCHISON WHAMPOA LTD		1,370	1,270	14,071	218,109	資本財
SWIRE PACIFIC LTD-A		430	375	3,926	60,856	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		890	820	13,341	206,791	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES		1,030	1,000	13,150	203,825	不動産
MTR CORP		965	875	3,298	51,130	運輸
HONG KONG & CHINA GAS		3,702	3,782	7,027	108,933	公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT		3,260	3,050	3,251	50,395	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		890	830	6,449	99,961	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		710	658	19,029	294,955	各種金融
CATHAY PACIFIC AIRWAYS		790	720	1,386	21,494	運輸
HOPEWELL HOLDINGS LTD		380	—	—	—	資本財
HANG LUNG PROPERTIES LTD		1,460	1,310	3,248	50,356	不動産
CLP HOLDINGS LTD		1,150	1,135	7,746	120,068	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		678	618	3,873	60,042	不動産
BANK OF EAST ASIA		784	698	2,363	36,632	銀行
HANG SENG BANK LTD		491	452	6,856	106,281	銀行
HYSAN DEVELOPMENT CO		420	380	1,362	21,115	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD		1,040	600	696	10,788	消費者サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		146	137	1,188	18,421	半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO		1,854	1,774	2,441	37,835	不動産
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		495	435	1,298	20,126	耐久消費財・アパレル
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE		400	370	2,395	37,134	公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		2,365	2,200	6,622	102,641	銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		—	805	2,173	33,689	耐久消費財・アパレル
PCCW LTD		2,470	2,510	1,297	20,113	電気通信サービス
LI & FUNG LTD		3,740	3,400	2,512	38,945	耐久消費財・アパレル
KERRY PROPERTIES LTD		420	395	1,260	19,530	不動産
NWS HOLDINGS LTD		895	895	1,215	18,838	資本財
SANDS CHINA LTD		1,544	1,436	4,738	73,451	消費者サービス
WHEELOK & CO LTD		600	550	2,389	37,041	不動産
WYNN MACAU LTD		980	904	1,421	22,026	消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD		1,260	1,150	1,168	18,110	消費者サービス
FIRST PACIFIC CO		1,560	1,420	1,050	16,287	各種金融
ATA GROUP LTD		7,758	7,146	36,766	569,875	保険
SWIRE PROPERTIES LTD		762	704	1,883	29,189	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		1,360	1,370	5,144	79,737	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD		608	552	824	12,782	消費者サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		1,380	1,530	1,542	23,904	電気通信サービス
WH GROUP LTD		—	2,240	1,223	18,957	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	52,007	51,397	196,713	3,049,056	
	銘 柄 数 < 比 率 >	38	39	—	<1.3%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		1,670	1,794	1,885	169,166	銀行
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		1,042	972	402	36,122	メディア
KEPPEL LAND LTD		420	—	—	—	不動産

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円	
SEMCORP INDUSTRIES LTD		660	590	253	22,709	資本財
CAPITALAND LTD		1,710	1,530	547	49,143	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		270	250	257	23,125	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		70	64	263	23,651	小売
DBS GROUP HOLDINGS LTD		1,110	1,040	2,197	197,161	銀行
KEPPEL CORP LTD		940	870	763	68,533	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD		820	773	1,886	169,222	銀行
SINGAPORE TECH ENGINEERING		1,050	950	348	31,280	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		5,122	4,762	2,076	186,303	電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD		373	343	406	36,478	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD		580	500	431	38,714	各種金融
SEMCORP MARINE LTD		570	500	148	13,278	資本財
UOL GROUP LTD		290	290	219	19,670	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD		1,380	1,230	378	33,989	運輸
NOBLE GROUP LTD		2,770	2,710	233	20,917	資本財
STARHUB LTD		420	400	172	15,467	電気通信サービス
OLAM INTERNATIONAL LTD		920	—	—	—	食品・生活必需品小売り
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		4,793	4,393	184	16,556	食品・飲料・タバコ
WILMAR INTERNATIONAL LTD		1,220	1,150	368	33,016	食品・飲料・タバコ
GENTING SINGAPORE PLC		3,920	3,700	381	34,192	消費者サービス
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L		2,020	1,880	503	45,204	不動産
CAPITAMALLS ASIA LTD		840	—	—	—	不動産
YANGZIJIANG SHIPBUILDING		1,270	1,150	166	14,960	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	36,253	31,844	14,476	1,298,866	
	銘 柄 数 < 比 率 >	26	23	—	< 0.6% >	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
ISRAEL CHEMICALS LTD		278	258	695	21,636	素材
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD		546	510	12,110	376,522	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANK HAPOALIM BM		698	616	1,188	36,943	銀行
NICE SYSTEMS LTD		34	34	848	26,372	ソフトウェア・サービス
BANK LEUMI LE-ISRAEL		783	777	1,168	36,333	銀行
ISRAEL CORP LIMITED/THE		1	1	241	7,496	素材
DELEK GROUP LTD		2	2	318	9,888	エネルギー
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO		1,282	1,127	785	24,427	電気通信サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		80	80	343	10,693	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	3,708	3,409	17,700	550,314	
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	9	—	< 0.2% >	
合 計	株 数 ・ 金 額	857,907	846,139	—	219,463,429	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1,234	1,258	—	< 96.5% >	

(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) 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		29	27	1,061	127,502	0.1
MACERICH CO/THE		8	8	687	82,616	0.0
PROLOGIS INC		31	29	1,200	144,279	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST		5	5	380	45,719	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC		8	8	518	62,263	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC		3	3	840	100,940	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST		4	4	537	64,527	0.0
HEALTH CARE REIT INC		18	20	1,452	174,458	0.1
BOSTON PROPERTIES INC		9	9	1,182	142,112	0.1
REALTY INCOME CORP		14	13	611	73,510	0.0
REGENCY CENTERS CORP		5	5	356	42,873	0.0
SL GREEN REALTY CORP		6	5	698	83,917	0.0
UDR INC		16	15	500	60,112	0.0
VENTAS INC		18	19	1,298	156,041	0.1
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		61	55	554	66,645	0.0
RAYONIER INC		8	7	195	23,456	0.0
WEYERHAEUSER CO		37	30	998	120,024	0.1
AMERICAN TOWER CORP		25	24	2,327	279,624	0.1
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP		24	20	424	50,979	0.0
AMERICAN REALTY CAPITAL PROP		47	53	480	57,702	0.0
DUKE REALTY CORP		20	20	402	48,339	0.0
IRON MOUNTAIN INC		—	9	348	41,914	0.0
EQUINIX INC		—	3	859	103,210	0.0
COMMUNICATIONS SALES & LE		—	7	193	23,217	0.0
EQUITY RESIDENTIAL		21	20	1,491	179,181	0.1
GENERAL GROWTH PROPERTIES		35	31	850	102,213	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC		48	44	901	108,255	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST		9	8	306	36,793	0.0
PLUM CREEK TIMBER CO		11	10	445	53,576	0.0
PUBLIC STORAGE		9	8	1,683	202,326	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC		19	18	3,388	407,177	0.2
VORNADO REALTY TRUST		10	9	1,004	120,698	0.1
KIMCO REALTY CORP		26	24	585	70,335	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC		7	7	1,291	155,218	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	606	592	30,060	3,611,768	
	銘 柄 数 < 比 率 >	31	34	—	<1.6%>	
(カナダ)				千カナダドル		
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		7	7	179	17,776	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		9	9	265	26,348	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	17	17	444	44,125	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		1	1	199	26,629	0.0

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
KLEPIERRE		6	10	431	57,704	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		6	5	1,397	187,018	0.1
FONCIERE DES REGIONS		1	1	142	19,007	0.0
ICADE		2	2	154	20,708	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	17	21	2,325	311,068	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…オランダ)						
CORIO NV		4	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	4	—	—	—	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	—	—	<—%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	22	21	2,325	311,068	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	5	—	<0.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		60	57	482	90,347	0.0
HAMMERSON PLC		45	46	313	58,695	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		50	46	590	110,470	0.0
INTU PROPERTIES PLC		56	54	186	34,807	0.0
SEGRO PLC		48	44	184	34,529	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	262	249	1,757	328,850	
	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		
FEDERATION CENTRES		90	90	270	25,663	0.0
WESTFIELD RETAIL TRUST		190	—	—	—	—
SCENTRE GROUP		—	316	1,208	114,565	0.1
NOVION PROPERTY GROUP		132	132	333	31,569	0.0
GPT GROUP		110	102	445	42,182	0.0
MIRVAC GROUP		241	226	439	41,679	0.0
STOCKLAND		151	141	614	58,254	0.0
WESTFIELD CORP		128	117	1,116	105,826	0.0
DEXUS PROPERTY GROUP		361	57	419	39,770	0.0
GOODMAN GROUP		109	104	645	61,223	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,517	1,289	5,493	520,734	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.2%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		147	135	6,375	98,816	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	147	135	6,375	98,816	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		—	143	251	22,580	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		131	131	212	19,099	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		165	146	313	28,163	0.0

銘柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポールドル	千円	%
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		131	122	298	26,817	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	427	542	1,077	96,660	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	4	—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	2,999	2,847	—	5,012,024	
	銘 柄 数 < 比 率 >	57	60	—	<2.2%>	

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引		百万円	百万円
		SP EMINI	1,676	—
		SP/TSE60	105	—
		SWISS IX	93	—
		EURO ST	398	—
		SPI 200	184	—
		FTSE100	222	—

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

○投資信託財産の構成

(2015年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 219,463,429	% 95.0
投資証券	5,012,024	2.2
コール・ローン等、その他	6,425,180	2.8
投資信託財産総額	230,900,633	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（225,608,909千円）の投資信託財産総額（230,900,633千円）に対する比率は97.7%です。

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

1 アメリカドル＝120.15円	1 カナダドル＝99.26円	1 ユーロ＝133.79円	1 イギリスポンド＝187.06円
1 スイスフラン＝128.37円	1 スウェーデンクローネ＝14.44円	1 ノルウェークローネ＝15.85円	1 デンマーククローネ＝17.92円
1 オーストラリアドル＝94.79円	1 ニュージーランドドル＝88.11円	1 香港ドル＝15.50円	1 シンガポールドル＝89.72円
1 イスラエルシェケル＝31.09円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	232,923,528,071
コール・ローン等	5,051,491,441
株式(評価額)	219,463,429,626
投資証券(評価額)	5,012,024,726
未収入金	2,131,637,175
未収配当金	412,041,597
未収利息	3,132
差入委託証拠金	852,900,374
(B) 負債	5,408,689,446
未払金	5,076,339,990
未払株式払込金	3,512,065
未払解約金	328,837,391
(C) 純資産総額(A－B)	227,514,838,625
元本	98,648,858,071
次期繰越損益金	128,865,980,554
(D) 受益権総口数	98,648,858,071口
1万口当たり基準価額(C／D)	23.063円

<注記事項>

①期首元本額	108,538,790,996円
期中追加設定元本額	32,543,405,938円
期中一部解約元本額	42,433,338,863円

○損益の状況 (2014年5月13日～2015年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,000,513,320
受取配当金	4,984,629,439
受取利息	1,903,384
その他収益金	15,272,016
支払利息	△ 1,291,519
(B) 有価証券売買損益	46,136,068,440
売買益	55,351,288,385
売買損	△ 9,215,219,945
(C) 先物取引等取引損益	259,343,651
取引益	828,688,860
取引損	△ 569,345,209
(D) 保管費用等	△ 68,171,160
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	51,327,754,251
(F) 前期繰越損益金	88,741,619,618
(G) 追加信託差損益金	35,951,545,914
(H) 解約差損益金	△ 47,154,939,229
(I) 計(E+F+G+H)	128,865,980,554
次期繰越損益金(I)	128,865,980,554

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

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

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

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

ファンド・マネジャー（海外株式）	419,237,124円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,438,419,729円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	678,058,866円
eMAXIS バランス（波乗り型）	65,607,142円
コアバランス	396,376円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	3,852,279,678円
eMAXIS 全世界株式インデックス	1,973,979,341円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	1,585,466,737円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	3,398,728,270円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	45,953,259円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	20,636,787,211円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	17,061,005,058円
三菱UFJ バランスファンドVA20型（適格機関投資家限定）	363,096,767円
三菱UFJ バランスファンドVA40型（適格機関投資家限定）	2,966,673,917円
MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	9,671,569,256円
三菱UFJ バランスファンドVA45型（適格機関投資家限定）	362,510,423円
三菱UFJ バランスファンドVA30型（適格機関投資家限定）	136,711,379円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	2,018,111,151円
MSCI コクサイインデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	2,594,914,963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）	76,098,141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）	7,059,629,747円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,104,557,887円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	11,183,462円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	46,103,861円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	70,135,069円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	62,920,676円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	404,785,459円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	45,567,189円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	442,825,166円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	103,397,229円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	806,099,405円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	3,904,644,158円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	166,069,238円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	696,246,579円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	623,188,698円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	536,974,536円
アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）	130,270,986円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	53,480,918円
アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）	26,261,389円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	8,911,631円
合計	98,648,858,071円

【お 知 ら せ】

①新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。

（2014年12月1日）

②デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。

（2014年12月1日）

新興国株式インデックスマザーファンド

《第6期》決算日2015年5月12日

[計算期間：2014年5月13日～2015年5月12日]

「新興国株式インデックスマザーファンド」は、5月12日に第6期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第6期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 円	期 中 騰 落 率 %	MSCI エマージング・マーケット・インデックス (円換算ベース)		株 式 組 入 比 率 %	株 式 先 物 比 率 %	投 資 信 託 組 入 比 率 %	純 資 産 総 額 百万円
			期 中 騰 落 率 (円換算ベース)	期 中 騰 落 率 (円換算ベース)				
2期(2011年5月12日)	16,655	8.8	94,613.52	6.3	94.3	4.9	1.3	8,679
3期(2012年5月14日)	14,047	△15.7	77,807.35	△17.8	96.2	2.9	0.5	14,336
4期(2013年5月13日)	19,772	40.8	107,091.73	37.6	98.2	1.7	—	24,079
5期(2014年5月12日)	19,482	△1.5	102,729.55	△4.1	96.6	3.0	0.4	24,665
6期(2015年5月12日)	23,973	23.1	124,478.28	21.2	94.8	5.0	0.4	39,530

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

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

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ23.1%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎新興国株式市況

- ・商品市況の下落などが嫌気される局面もありましたが、中国の金融緩和政策などを受けて新興国株式市況は上昇しました。

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて17.8%の円安・香港ドル高、14.9%の円高・ブラジルレアル安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

(注) マルチファクターモデル

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

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

	組入比率 要 因	銘柄選択 要 因	コ ス ト 要 因	その他の 要 因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	0.1% 程度	0.4% 程度	△0.2% 程度	1.6% 程度	1.9% 程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.1%程度でした。

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

- ・効率的に運用を行うため、円貨、外貨現金などを若干保有しました。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.4%程度でした。

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

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

◎コスト要因

売買にかかるコストおよび保管料等による影響は△0.2%程度でした。

◎その他の要因

その他配当・利子収入等による影響は1.6%程度でした。

○今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2014年 5 月13日～2015年 5 月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	12	0.055	(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
(株 式)	(10)	(0.048)	有価証券等を売買する際に発生する費用
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(2)	(0.007)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	5	0.022	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数
(株 式)	(5)	(0.022)	有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	33	0.149	(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)	(30)	(0.135)	外国での資産の保管等に要する費用
(そ の 他)	(3)	(0.014)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	50	0.226	
期中の平均基準価額は、21,864円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2014年5月13日～2015年5月12日)

株式

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

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

(注) 金額は受渡代金。

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

新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	タイ	証券 - (21,423)	千タイバーツ - (68)	証券 21,423	千タイバーツ 93

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株主割当および権利行使等による増減分です。

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	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	104 (－)	4,720 (△ 183)	8 (－)	400 (0.00001)
	小計	104 (－)	4,720 (△ 183)	8 (－)	400 (0.00001)
	トルコ		千トルコリラ		千トルコリラ
	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	22	53	－	－
	小計	22	53	－	－
	南アフリカ		千南アフリカランド		千南アフリカランド
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	43	1,196	－	－
	REDEFINE PROPERTIES LTD	80	860	－	－
	RESILIENT PROPERTY INCOME	19	1,623	－	－
	小計	142	3,680	－	－

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 12,879	百万円 11,929	百万円 －	百万円 －

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

○株式売買比率

(2014年5月13日～2015年5月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2014年 5 月13日～2015年 5 月12日)

利害関係人との取引状況

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

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

○組入資産の明細

(2015年5月12日現在)

外国株式

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AMBEV SA-ADR	70	85	55	6,638	食品・飲料・タバコ
AMERICA MOVIL-SPN ADR CL L	20	8	16	1,963	電気通信サービス
VALE SA-SP ADR	40	20	15	1,840	素材
PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	20	40	38	4,628	エネルギー
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	36	28	68	8,239	半導体・半導体製造装置
INFOSYS LTD-SP ADR	9	18	56	6,769	ソフトウェア・サービス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	108	153	171	20,570	素材
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	310	382	462	55,535	電気通信サービス
SOUTHERN COPPER CORP	104	122	393	47,241	素材
BANCO BRADESCO-ADR	29	35	36	4,336	銀行
ITAU UNIBANCO H-SPON PRF ADR	32	36	45	5,422	銀行
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	14	14	22	2,674	エネルギー
SASOL LTD-SPONSORED ADR	10	11	41	5,016	エネルギー
CREDICORP LTD	41	51	794	95,433	銀行
AK TRANSNEFT OAO-PREF	0.87	1	282	33,939	エネルギー
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS	710	980	143	17,200	各種金融
SBERBANK	5,930	500	75	9,016	銀行
GAZPROM OAO	6,710	360	111	13,371	エネルギー
FEDERAL GRID CO UNIFIED	150,000	—	—	—	公益事業
RUSHYDRO JSC	72,000	100,000	121	14,645	公益事業
MMC NORILSK NICKEL OJSC	33	42	879	105,727	素材
LUKOIL OAO	283	19	104	12,535	エネルギー
TATNEFT-CLS	855	1,077	649	78,003	エネルギー
ROSNEFT OAO	710	869	448	53,848	エネルギー
VTB BANK OJSC	3,260,000	3,740,000	501	60,290	銀行
URALKALI PJSC	810	995	304	36,632	素材
SBERBANK-PREFERENCE	600	820	82	9,946	銀行
SURGUTNEFTGAS	4,350	5,430	393	47,271	エネルギー
SURGUTNEFTGAS-PREFERENCE	4,200	5,230	425	51,088	エネルギー
SEVERSTAL PAO	135	158	185	22,256	素材
ROSTELECOM	500	650	103	12,403	電気通信サービス
DP WORLD LTD	—	123	275	33,103	運輸
ALROSA AO	—	1,410	190	22,943	素材
SAMSUNG ELECTR-GDR	0.8	0.8	49	5,896	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HON HAI PRECISION-GDR REG S	102	99	60	7,274	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
RELIANCE INDS-SPONS GDR 144A	23	8	23	2,834	エネルギー
LUKOIL OAO-SPON ADR	29	370	1,946	233,929	エネルギー
GAZPROM OAO-SPON ADR	260	4,359	2,630	316,021	エネルギー
SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	73	120	93	11,246	電気通信サービス
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	54	69	691	83,086	エネルギー
GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR	450	620	119	14,377	電気通信サービス
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	160	197	1,104	132,735	食品・生活必需品小売り
SBERBANK-SPONSORED ADR	170	1,871	1,097	131,868	銀行
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	626	731	514	61,827	銀行
MEGAFON-REG S GDR	55	64	109	13,174	電気通信サービス

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

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

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

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

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	価額	
(チェコ)	百株	百株	千チェココ罗纳	千円	
KOMERCNI BANKA AS	9	12	6,379	31,130	銀行
小計	株数・金額	201	15,631	76,280	
	銘柄数<比率>	3	—	<0.2%>	
(ハンガリー)			千ハンガリーフォリント		
RICHTER GEDEON NYRT	80	111	50,061	21,961	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OTP BANK PLC	131	170	101,320	44,449	銀行
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	25	30	46,848	20,552	エネルギー
小計	株数・金額	311	198,229	86,963	
	銘柄数<比率>	3	—	<0.2%>	
(ポーランド)			千ポーランドズロチ		
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	195	244	1,703	55,828	エネルギー
ORANGE POLSKA SA	390	455	464	15,213	電気通信サービス
PKO BANK POLSKI SA	533	655	2,439	79,979	銀行
BANK PEKAO SA	79	96	1,853	60,749	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA	88	108	1,379	45,204	素材
BANK ZACHODNI WBK SA	17	25	958	31,435	銀行
MBANK SA	9	11	552	18,105	銀行
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	1,022	1,312	885	29,029	エネルギー
GRUPA LOTOS SA	40	78	241	7,913	エネルギー
EUROCASH SA	51	71	274	8,992	食品・生活必需品小売り
BANK MILLENNIUM SA	230	330	259	8,491	銀行
CYFROWY POLSAT SA	95	163	411	13,475	メディア
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	18	26	291	9,541	銀行
PGE SA	460	636	1,281	42,008	公益事業
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	34	42	2,027	66,453	保険
KERNEL HOLDING SA	35	—	—	—	食品・飲料・タバコ
TAURON POLSKA ENERGIA SA	600	730	351	11,533	公益事業
ENEA SA	140	140	233	7,663	公益事業
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	22	—	—	—	素材
SYNTHOS SA	290	430	206	6,779	素材
GETIN NOBLE BANK SA	—	820	153	5,026	銀行
GRUPA AZOTY SA	28	36	313	10,266	素材
ALIOR BANK SA	27	38	347	11,397	銀行
ENERGA SA	—	175	401	13,153	公益事業
LPP SA	—	0.66	466	15,284	耐久消費財・アパレル
CCC SA	—	18	341	11,188	耐久消費財・アパレル
小計	株数・金額	6,642	17,837	584,719	
	銘柄数<比率>	24	—	<1.5%>	
(香港)			千香港ドル		
PETROCHINA CO LTD-H	12,930	15,910	15,146	234,767	エネルギー
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	15,460	19,360	13,745	213,056	エネルギー
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	2,920	4,440	6,464	100,201	電気通信サービス
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1,820	2,280	3,169	49,122	自動車・自動車部品
CITIC LTD	920	1,700	2,614	40,526	資本財
CNOOC LTD	10,940	13,500	17,361	269,095	エネルギー
YANZHOU COAL MINING CO-H	1,060	1,360	975	15,114	エネルギー
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	2,210	2,810	1,109	17,204	素材
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	1,000	1,000	810	12,555	運輸
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	980	980	1,160	17,984	運輸
CHINA RESOURCES ENTERPRISE	700	880	2,147	33,281	食品・生活必需品小売り
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	1,200	1,480	2,439	37,805	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	320	400	1,216	18,848	資本財

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	外 貨 換 算 金 額	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL		680	840	2,860	44,333	運輸
COSCO PACIFIC LTD		1,000	1,340	1,575	24,425	運輸
BYD CO LTD-H		305	445	2,182	33,832	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD-H		8,340	10,560	5,924	91,824	電気通信サービス
DATANG INTL POWER GEN CO-H		1,640	2,100	942	14,614	公益事業
BEIJING ENTERPRISES HLDGS		325	385	2,745	42,548	資本財
CHINA EVERBRIGHT LTD		540	660	1,824	28,285	各種金融
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H		700	920	978	15,172	運輸
CHINA MOBILE LTD		3,680	4,625	49,811	772,074	電気通信サービス
HUANENG POWER INTL INC-H		1,960	2,720	3,035	47,050	公益事業
HUADIAN POWER INTL CORP-H		—	1,280	1,102	17,082	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H		745	905	2,918	45,238	素材
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT		1,020	3,120	2,430	37,672	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LENOVO GROUP LTD		3,700	5,080	7,040	109,133	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD		440	840	2,515	38,994	保険
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H		220	260	1,275	19,767	食品・飲料・タバコ
SINOTRANS LIMITED-H		—	1,450	849	13,170	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H		2,600	3,200	1,529	23,708	素材
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN		1,000	1,000	468	7,254	素材
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H		1,200	1,560	1,330	20,625	資本財
PICC PROPERTY & CASUALTY-H		1,920	2,620	4,668	72,367	保険
CHINA LIFE INSURANCE CO-H		4,570	5,600	21,392	331,576	保険
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS		410	540	760	11,784	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING		—	19,400	1,629	25,258	半導体・半導体製造装置
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN		1,180	1,460	3,299	51,143	公益事業
CHINA SHIPPING CONTAINER-H		2,410	3,150	1,203	18,651	運輸
CHINA MENGNIU DAIRY CO		850	1,060	4,420	68,513	食品・飲料・タバコ
PING AN INSURANCE GROUP CO-H		1,140	1,965	21,968	340,514	保険
ATR CHINA LTD-H		1,160	1,460	1,351	20,955	運輸
SINO BIOPHARMACEUTICAL		1,880	2,120	1,886	29,245	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OILFIELD SERVICES-H		1,120	1,360	2,064	31,999	エネルギー
TENCENT HOLDINGS LTD		624	3,894	61,758	957,262	ソフトウェア・サービス
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H		5,279	6,519	5,026	77,905	銀行
ZTE CORP-H		382	492	1,234	19,132	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H		3,740	4,640	1,387	21,504	素材
CHINA CONSTRUCTION BANK-H		44,045	54,475	40,148	622,300	銀行
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H		560	700	696	10,795	不動産
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP		350	430	1,554	24,093	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H		1,680	2,100	2,797	43,356	自動車・自動車部品
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H		1,960	2,180	1,698	26,322	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H		2,100	2,535	4,922	76,306	エネルギー
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS		900	1,200	804	12,462	素材
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD		760	—	—	—	不動産
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP		400	—	—	—	小売
JIANGXI COPPER CO LTD-H		820	970	1,542	23,905	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H		1,040	1,280	872	13,530	ヘルスケア機器・サービス
BANK OF CHINA LTD-H		46,050	60,040	31,340	485,783	銀行
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD		1,580	1,900	2,907	45,058	商業・専門サービス
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD		880	1,090	2,007	31,120	不動産
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN		435	570	2,433	37,725	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS BANK-H		2,775	3,475	7,976	123,632	銀行
CHINA BLUECHEMICAL LTD - H		1,000	—	—	—	素材

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

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

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

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

銘柄		柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
			株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額
(インドネシア)			百株	百株	千円		
LIPPO KARAWACI TBK PT			13,000	15,500	1,929,750	17,753	不動産
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT			5,730	7,090	7,887,625	72,566	銀行
UNILEVER INDONESIA TBK PT			940	1,120	4,888,800	44,976	家庭用品・パーソナル用品
ADARO ENERGY TBK PT			8,200	10,400	941,200	8,659	エネルギー
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT			1,400	1,400	896,000	8,243	運輸
BANK NEGARA INDONESIA PERSER			4,500	5,650	3,757,250	34,566	銀行
INDO TAMBANGRAYA MEGAH TBK P			220	220	330,000	3,036	エネルギー
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT			4,700	5,500	1,606,000	14,775	食品・飲料・タバコ
XL AXIATA TBK PT			1,750	2,250	858,375	7,897	電気通信サービス
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT			2,600	3,850	877,800	8,075	メディア
BUMI SERPONG DAMAI PT			5,000	6,200	1,137,700	10,466	不動産
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T			650	910	1,248,975	11,490	食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE			900	1,350	1,201,500	11,053	電気通信サービス
SURYA CITRA MEDIA PT TBK			2,400	4,650	1,420,575	13,069	メディア
GLOBAL MEDIACOM TBK PT			4,400	4,400	642,400	5,910	メディア
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB			900	1,460	2,463,750	22,666	小売
小 計		株 数 ・ 金 額	141,160	178,155	97,775,572	899,535	
		銘柄 数 < 比 率 >	30	30	—	< 2.3% >	
(韓国)					千韓国ウォン		
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD			67	83	11,138,232	1,220,750	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KOREA ELECTRIC POWER CORP			155	195	912,600	100,020	公益事業
SHINSEGAE CO LTD			3	4	102,752	11,261	小売
CJ CORP			9	11	241,920	26,514	資本財
SAMSUNG C&T CORP			76	95	546,832	59,932	資本財
SK TELECOM			6	7	183,230	20,082	電気通信サービス
HYUNDAI MOTOR CO			94	117	1,986,540	217,724	自動車・自動車部品
POSCO			40	49	1,272,150	139,427	素材
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO			35	44	279,905	30,677	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KT CORP			39	22	68,062	7,459	電気通信サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD			35	45	286,556	31,406	各種金融
HYUNDAI MOBIS CO LTD			41	51	1,208,320	132,431	自動車・自動車部品
CHEIL WORLDWIDE INC			53	66	146,850	16,094	メディア
KB FINANCIAL GROUP INC			235	290	1,179,430	129,265	銀行
SAMSUNG FIRE & MARINE INS			21	24	716,720	78,552	保険
SAMSUNG SDI CO LTD			21	42	490,348	53,742	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD			262	320	1,406,995	154,206	銀行
LG ELECTRONICS INC			65	82	481,750	52,799	耐久消費財・アパレル
AMOREPACIFIC GROUP			1	21	341,320	37,408	家庭用品・パーソナル用品
HYUNDAI DEPT STORE CO			9	10	154,235	16,904	小売
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD			16	19	162,313	17,789	資本財
GS ENGINEERING & CONSTRUCT			31	41	133,045	14,581	資本財
KT&G CORP			66	81	784,462	85,977	食品・飲料・タバコ
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE			56	82	146,850	16,094	資本財
NCSOFT CORP			9	11	225,120	24,673	ソフトウェア・サービス
LG DISPLAY CO LTD			143	179	536,705	58,822	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES			25	31	427,245	46,826	資本財
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES			99	118	215,350	23,602	資本財
AMOREPACIFIC CORP			1	24	935,080	102,484	家庭用品・パーソナル用品
HANA FINANCIAL GROUP			170	218	677,980	74,306	銀行
HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN			35	42	255,425	27,994	資本財
LG CHEM LTD			28	34	946,560	103,742	素材
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES			27	47	141,000	15,453	資本財

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(韓国)		百株	百株	千韓国ウォン	千円	
LS CORP		9	12	68,352	7,491	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE		5	7	597,025	65,433	家庭用品・パーソナル用品
SK INNOVATION CO LTD		36	45	519,800	56,970	エネルギー
DAUM KAKAO CORP		—	19	200,256	21,948	ソフトウェア・サービス
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO		22	31	205,220	22,492	各種金融
COWAY CO LTD		32	39	356,058	39,023	耐久消費財・アパレル
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT		16	16	95,760	10,495	各種金融
S-1 CORPORATION		9	13	106,990	11,726	商業・専門サービス
DOOSAN INFRACORE CO LTD		82	107	126,260	13,838	資本財
KIA MOTORS CORP		162	198	1,005,888	110,245	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC		323	441	2,042,293	223,835	半導体・半導体製造装置
LG CORP		59	73	494,832	54,233	資本財
SK HOLDINGS CO LTD		15	19	353,430	38,735	資本財
HYUNDAI STEEL CO		44	52	406,877	44,593	素材
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF		12	15	1,549,380	169,812	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OCI CO LTD		10	13	135,048	14,801	素材
SAMSUNG TECHWIN CO LTD		23	—	—	—	資本財
INDUSTRIAL BANK OF KOREA		130	213	313,110	34,316	銀行
KANGWON LAND INC		61	92	343,160	37,610	消費者サービス
NAVER CORP		17	21	1,273,812	139,609	ソフトウェア・サービス
DAEWOO SECURITIES CO LTD		107	132	207,174	22,706	各種金融
CELLTRION INC		37	50	413,854	45,358	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HYUNDAI SECURITIES CO		85	—	—	—	各種金融
KOREA GAS CORPORATION		16	22	113,061	12,391	公益事業
LG UPLUS CORP		137	162	155,682	17,062	電気通信サービス
LOTTE SHOPPING CO		7	8	216,630	23,742	小売
YUHAN CORP		4	5	151,294	16,581	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONGBU INSURANCE CO LTD		25	29	156,350	17,135	保険
S-OIL CORP		26	33	235,431	25,803	エネルギー
KCC CORP		3	4	225,250	24,687	資本財
DAEWOO INTERNATIONAL CORP		26	32	96,057	10,527	資本財
SAMSUNG CARD CO		20	25	110,670	12,129	各種金融
LS INDUSTRIAL SYSTEMS		9	9	51,775	5,674	資本財
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD		18	—	—	—	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF		23	27	313,005	34,305	自動車・自動車部品
HYUNDAI ENGINEERING & CONST		45	56	296,736	32,522	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD		15	28	128,760	14,112	運輸
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT		37	44	477,120	52,292	保険
CHEIL INDUSTRIES INC		28	—	—	—	素材
LOTTE CHEMICAL CORP		10	11	293,480	32,165	素材
GS HOLDINGS		31	38	187,530	20,553	エネルギー
NH INVESTMENT & SECURITIES C		65	113	158,179	17,336	各種金融
HANWHA CHEMICAL CORP		51	86	137,170	15,033	素材
HYOSUNG CORPORATION		15	18	229,075	25,106	素材
HYUNDAI MIPO DOCKYARD		6	6	61,171	6,704	資本財
HANWHA CORPORATION		25	34	146,710	16,079	素材
CJ CHEILJEDANG CORP		4	5	255,080	27,956	食品・飲料・タバコ
BNK FINANCIAL GROUP INC		95	142	229,330	25,134	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD		8	14	326,160	35,747	運輸
DGB FINANCIAL GROUP INC		85	123	151,290	16,581	銀行
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF		14	18	212,750	23,317	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD		5	6	306,495	33,591	素材

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

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

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

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

銘柄		柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
			株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額
(インド)			百株	百株	千インドルピー	千円	
YES BANK LTD			100	—	—	—	銀行
NESTLE INDIA LTD			14	16	11,434	21,611	食品・飲料・タバコ
TECH MAHINDRA LTD			33	157	9,924	18,756	ソフトウェア・サービス
AUROBINDO PHARMA LTD			—	104	14,173	26,787	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD			—	167	8,547	16,153	自動車・自動車部品
BOSCH LTD			—	5	12,826	24,241	自動車・自動車部品
小 計			株 数 ・ 金 額	17,651	23,268	1,342,299	2,536,945
銘 柄 数 < 比 率 >			69	64	—	<6.4%>	
(アラブ首長国連邦)					アラブディルハム		
EMAAR PROPERTIES PJSC			—	2,625	2,068,500	67,784	不動産
ALDAR PROPERTIES PJSC			—	2,340	624,780	20,474	不動産
ABU DHABI COMMERCIAL BANK			—	750	547,500	17,941	銀行
NATIONAL BANK OF ABU DHABI			—	484	539,660	17,684	銀行
ARABTEC HOLDING CO PJSC			—	1,774	459,595	15,060	資本財
FIRST GULF BANK			—	675	1,036,125	33,953	銀行
DUBAI FINANCIAL MARKET PJSC			—	1,520	297,920	9,762	各種金融
DUBAI ISLAMIC BANK			—	780	523,380	17,151	銀行
小 計			株 数 ・ 金 額	—	10,948	6,097,460	199,813
銘 柄 数 < 比 率 >			—	8	—	<0.5%>	
(カタール)					千カタールリアル		
MASRAF AL RAYAN			—	281	1,347	44,544	銀行
OOREDOO QSC			—	61	613	20,267	電気通信サービス
QATAR NATIONAL BANK			—	127	2,556	84,513	銀行
INDUSTRIES QATAR			—	114	1,661	54,925	資本財
VODAFONE QATAR			—	265	465	15,384	電気通信サービス
QATAR ELECTRICITY & WATER CO			—	21	465	15,395	公益事業
QATAR ISLAMIC BANK			—	43	458	15,168	銀行
BARWA REAL ESTATE CO			—	77	389	12,880	不動産
COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC			—	67	378	12,511	銀行
DOHA BANK QSC			—	55	301	9,964	銀行
GULF INTERNATIONAL SERVICES			—	30	255	8,440	エネルギー
小 計			株 数 ・ 金 額	—	1,142	8,892	293,996
銘 柄 数 < 比 率 >			—	11	—	<0.7%>	
(南アフリカ)					千南アフリカランド		
BARLOWORLD LTD			127	160	1,535	15,259	資本財
REUNERT LTD			110	—	—	—	資本財
SAPPI LIMITED			305	435	2,085	20,728	素材
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD			43	35	1,131	11,251	素材
NEDBANK GROUP LTD			120	146	3,694	36,720	銀行
SASOL LTD			328	409	18,668	185,567	エネルギー
ANGLOGOLD ASHANTI LTD			247	300	4,026	40,021	素材
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD			320	410	2,720	27,040	素材
GOLD FIELDS LTD			480	550	2,378	23,644	素材
NORTHAM PLATINUM LTD			210	—	—	—	素材
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD			460	699	6,464	64,255	小売
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD			275	280	2,510	24,956	小売
TELKOM SA SOC LTD			—	190	1,393	13,852	電気通信サービス
TIGER BRANDS LTD			103	125	3,841	38,182	食品・飲料・タバコ
SANLAM LTD			1,090	1,389	10,171	101,106	保険
SHOPRITE HOLDINGS LTD			267	352	5,884	58,490	食品・生活必需品小売り
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD			1,115	1,616	12,446	123,721	耐久消費財・アパレル
STANDARD BANK GROUP LTD			737	914	15,546	154,532	銀行

銘柄		期首(前期末)	当期末		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(南アフリカ)		百株	百株	千南アフリカランド	千円	
RMB HOLDINGS LTD		424	519	3,579	35,575	各種金融
REMGRO LTD		298	364	9,544	94,868	各種金融
PPC LTD		320	410	668	6,642	素材
NETCARE LTD		559	734	2,934	29,169	ヘルスケア機器・サービス
NASPERS LTD-N SHS		241	300	53,968	536,449	メディア
MTN GROUP LTD		1,031	1,259	29,152	289,772	電気通信サービス
MASSMART HOLDINGS LTD		70	86	1,308	13,004	食品・生活必需品小売り
KUMBA IRON ORE LTD		51	41	664	6,604	素材
IMPERIAL HOLDINGS LTD		115	143	2,752	27,356	小売
INVESTEC LTD		158	186	2,097	20,849	各種金融
HARMONY GOLD MINING CO LTD		220	—	—	—	素材
FIRSTRAND LTD		1,890	2,552	13,913	138,300	各種金融
THE FOSCHINI GROUP LTD		110	154	2,775	27,584	小売
EXXARO RESOURCES LTD		81	101	981	9,755	エネルギー
BIDVEST GROUP LTD		181	244	7,597	75,518	資本財
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD		199	258	4,721	46,930	銀行
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD		61	75	813	8,086	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT		212	258	9,159	91,040	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD		780	—	—	—	銀行
DISCOVERY LTD		172	275	3,509	34,879	保険
VODACOM GROUP LTD		226	271	4,005	39,816	電気通信サービス
PICK N PAY STORES LTD		165	165	917	9,123	食品・生活必需品小売り
MMI HOLDINGS LTD		650	860	2,819	28,021	保険
SPAR GROUP LIMITED/THE		98	121	2,341	23,279	食品・生活必需品小売り
RMI HOLDINGS		440	520	2,340	23,259	保険
LIBERTY HOLDINGS LTD		75	95	1,573	15,638	保険
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN		550	680	2,737	27,205	ヘルスケア機器・サービス
MR PRICE GROUP LTD		150	177	4,356	43,303	小売
ASSORE LTD		23	23	253	2,516	素材
NAMPAK LTD		340	430	1,838	18,272	素材
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD		222	290	3,503	34,821	ヘルスケア機器・サービス
CORONATION FUND MANAGERS LTD		—	185	1,628	16,182	各種金融
BRAIT SE		—	240	2,158	21,458	各種金融
TSOGO SUN HOLDINGS LTD		—	295	802	7,981	消費者サービス
小計	株数・金額	16,450	20,322	275,915	2,742,602	
	銘柄数<比率>	48	48	—	<6.9%>	
合計	株数・金額	4,636,294	5,383,479	—	37,477,479	
	銘柄数<比率>	832	842	—	<94.8%>	

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

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

外国投資信託証券

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

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の割合です。

先物取引の銘柄別期末残高

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

○投資信託財産の構成

(2015年5月12日現在)

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

(注) 期末における外貨建純資産 (39,376,310千円) の投資信託財産総額 (39,587,480千円) に対する比率は99.5%です。

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	39,731,709,366
コール・ローン等	1,639,535,378
株式(評価額)	37,477,479,628
投資証券(評価額)	168,833,007
未収入金	171,760,942
未収配当金	42,409,153
未収利息	263
差入委託証拠金	231,690,995
(B) 負債	200,852,089
未払金	169,149,330
未払解約金	31,702,759
(C) 純資産総額(A-B)	39,530,857,277
元本	16,489,570,857
次期繰越損益金	23,041,286,420
(D) 受益権総口数	16,489,570,857口
1万口当たり基準価額(C/D)	23.973円

<注記事項>

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

○損益の状況 (2014年5月13日～2015年5月12日)

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

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

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

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

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

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

【お 知 ら せ】

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

日本債券インデックスマザーファンド

《第14期》決算日2015年5月12日

[計算期間：2014年5月13日～2015年5月12日]

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第14期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		N O M U R A - B P I 総 合 イ ン デ ッ ク ス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
10期(2011年5月12日)	11,540	1.9	331.63	1.9	99.4	—	207,058
11期(2012年5月14日)	11,862	2.8	340.97	2.8	99.4	0.1	203,547
12期(2013年5月13日)	12,036	1.5	345.99	1.5	98.9	0.8	269,276
13期(2014年5月12日)	12,299	2.2	353.58	2.2	99.4	0.2	283,162
14期(2015年5月12日)	12,572	2.2	361.38	2.2	99.4	0.3	343,834

(注) NOMURA-BPI 総合インデックスとは、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 総合インデックスは野村證券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	N O M U R A - B P I 総 合 イ ン デ ッ ク ス	騰 落 率	債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
(期 首) 2014年5月12日	円 12,299	% —	353.58	% —	% 99.4	% 0.2
5月末	12,328	0.2	354.39	0.2	99.5	0.1
6月末	12,364	0.5	355.41	0.5	99.7	0.1
7月末	12,384	0.7	356.01	0.7	99.6	0.1
8月末	12,424	1.0	357.15	1.0	99.3	0.3
9月末	12,433	1.1	357.41	1.1	99.5	0.4
10月末	12,491	1.6	359.08	1.6	98.3	1.1
11月末	12,565	2.2	361.19	2.2	98.9	0.7
12月末	12,695	3.2	364.96	3.2	99.2	0.2
2015年1月末	12,699	3.3	365.07	3.2	100.2	0.2
2月末	12,630	2.7	363.04	2.7	99.5	0.1
3月末	12,637	2.7	363.28	2.7	100.1	—
4月末	12,678	3.1	364.50	3.1	99.7	0.2
(期 末) 2015年5月12日	12,572	2.2	361.38	2.2	99.4	0.3

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率
(2.2%) とほぼ同程度となりました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内債券市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について ベンチマークは2.2%の上昇となったため、カイ離は0.0%程度となりました。

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

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2014年 5 月13日～2015年 5 月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等を売買する際に発生する費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、12,527円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○ 売 買 及 び 取 引 の 状 況

(2014年 5 月13日～2015年 5 月12日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内		千円	千円
	国債証券	124,120,865	73,164,875
	地方債証券	4,545,751	2,079,656
	特殊債券	6,813,914	3,855,323
	社債券	4,840,919	(421,588)
			2,808,070
			(100,000)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債券先物取引	百万円 15,425	百万円 14,852	百万円 —	百万円 —

○利害関係人との取引状況等

(2014年 5 月13日～2015年 5 月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 140,321	百万円 38,627	% 27.5	百万円 81,907	百万円 24,091	% 29.4

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 200	百万円 518	百万円 1,151

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公社債	百万円 300

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

○組入資産の明細

(2015年5月12日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	259,668,000 (100,000)	276,063,134 (100,693)	80.3 (0.0)	— (—)	47.8 (—)	22.4 (0.0)	10.2 (—)
地方債証券	18,432,040 (18,432,040)	19,456,471 (19,456,471)	5.7 (5.7)	— (—)	3.6 (3.6)	1.6 (1.6)	0.5 (0.5)
特殊債券 (除く金融債)	23,778,319 (23,778,319)	25,080,571 (25,080,571)	7.3 (7.3)	— (—)	4.7 (4.7)	2.1 (2.1)	0.5 (0.5)
金融債券	3,190,000 (3,190,000)	3,205,684 (3,205,684)	0.9 (0.9)	— (—)	— (—)	0.7 (0.7)	0.2 (0.2)
普通社債券	17,347,000 (17,347,000)	17,990,217 (17,990,217)	5.2 (5.2)	0.2 (0.2)	1.9 (1.9)	2.3 (2.3)	1.1 (1.1)
合 計	322,415,359 (62,847,359)	341,796,080 (65,833,638)	99.4 (19.1)	0.2 (0.2)	58.0 (10.3)	29.0 (6.7)	12.4 (2.2)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第341回利付国債（2年）		0.1	800,000	800,864	2016/6/15
第342回利付国債（2年）		0.1	1,110,000	1,111,287	2016/7/15
第343回利付国債（2年）		0.1	1,400,000	1,401,750	2016/8/15
第344回利付国債（2年）		0.1	1,430,000	1,431,901	2016/9/15
第345回利付国債（2年）		0.1	940,000	941,334	2016/10/15
第346回利付国債（2年）		0.1	1,250,000	1,251,875	2016/11/15
第347回利付国債（2年）		0.1	350,000	350,553	2016/12/15
第348回利付国債（2年）		0.1	1,050,000	1,051,753	2017/1/15
第349回利付国債（2年）		0.1	1,220,000	1,222,135	2017/2/15
第350回利付国債（2年）		0.1	1,200,000	1,202,196	2017/3/15
第351回利付国債（2年）		0.1	1,240,000	1,242,380	2017/4/15
第97回利付国債（5年）		0.4	1,210,000	1,215,396	2016/6/20
第98回利付国債（5年）		0.3	1,000,000	1,003,350	2016/6/20
第99回利付国債（5年）		0.4	990,000	995,355	2016/9/20
第100回利付国債（5年）		0.3	1,360,000	1,365,521	2016/9/20
第101回利付国債（5年）		0.4	850,000	855,448	2016/12/20
第102回利付国債（5年）		0.3	2,990,000	3,004,352	2016/12/20
第103回利付国債（5年）		0.3	1,360,000	1,367,534	2017/3/20
第104回利付国債（5年）		0.2	1,150,000	1,154,243	2017/3/20
第105回利付国債（5年）		0.2	2,640,000	2,650,533	2017/6/20
第106回利付国債（5年）		0.2	3,130,000	3,143,991	2017/9/20
第107回利付国債（5年）		0.2	1,570,000	1,577,755	2017/12/20
第108回利付国債（5年）		0.1	2,130,000	2,134,984	2017/12/20
第109回利付国債（5年）		0.1	2,450,000	2,455,929	2018/3/20
第110回利付国債（5年）		0.3	1,080,000	1,088,758	2018/3/20
第111回利付国債（5年）		0.4	1,410,000	1,425,453	2018/3/20
第112回利付国債（5年）		0.4	1,200,000	1,213,944	2018/6/20
第113回利付国債（5年）		0.3	2,700,000	2,723,004	2018/6/20
第114回利付国債（5年）		0.3	1,390,000	1,402,329	2018/9/20
第115回利付国債（5年）		0.2	2,170,000	2,181,978	2018/9/20
第116回利付国債（5年）		0.2	3,780,000	3,800,374	2018/12/20
第117回利付国債（5年）		0.2	3,990,000	4,010,668	2019/3/20
第118回利付国債（5年）		0.2	1,690,000	1,698,281	2019/6/20
第119回利付国債（5年）		0.1	1,670,000	1,671,352	2019/6/20
第120回利付国債（5年）		0.2	2,440,000	2,451,102	2019/9/20
第121回利付国債（5年）		0.1	2,360,000	2,360,495	2019/9/20
第122回利付国債（5年）		0.1	3,580,000	3,578,353	2019/12/20
第123回利付国債（5年）		0.1	1,960,000	1,957,628	2020/3/20
第1回利付国債（40年）		2.4	275,000	335,368	2048/3/20
第2回利付国債（40年）		2.2	500,000	584,480	2049/3/20
第3回利付国債（40年）		2.2	493,000	576,593	2050/3/20
第4回利付国債（40年）		2.2	708,000	828,367	2051/3/20
第5回利付国債（40年）		2.0	645,000	719,826	2052/3/20
第6回利付国債（40年）		1.9	690,000	750,292	2053/3/20
第7回利付国債（40年）		1.7	700,000	720,216	2054/3/20

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8回利付国債(40年)		1.4	170,000	159,781	2055/3/20
第280回利付国債(10年)		1.9	600,000	612,588	2016/6/20
第281回利付国債(10年)		2.0	1,053,000	1,076,250	2016/6/20
第282回利付国債(10年)		1.7	1,790,000	1,831,295	2016/9/20
第283回利付国債(10年)		1.8	1,732,000	1,774,312	2016/9/20
第284回利付国債(10年)		1.7	2,866,000	2,944,299	2016/12/20
第285回利付国債(10年)		1.7	3,468,000	3,577,346	2017/3/20
第286回利付国債(10年)		1.8	1,070,000	1,110,349	2017/6/20
第287回利付国債(10年)		1.9	2,400,000	2,495,544	2017/6/20
第288回利付国債(10年)		1.7	1,596,000	1,659,456	2017/9/20
第289回利付国債(10年)		1.5	1,593,000	1,654,760	2017/12/20
第290回利付国債(10年)		1.4	350,000	363,856	2018/3/20
第291回利付国債(10年)		1.3	940,000	974,535	2018/3/20
第292回利付国債(10年)		1.7	794,000	832,215	2018/3/20
第293回利付国債(10年)		1.8	521,000	549,743	2018/6/20
第294回利付国債(10年)		1.7	940,000	988,945	2018/6/20
第295回利付国債(10年)		1.5	1,040,000	1,087,704	2018/6/20
第296回利付国債(10年)		1.5	1,600,000	1,678,224	2018/9/20
第297回利付国債(10年)		1.4	836,000	876,579	2018/12/20
第298回利付国債(10年)		1.3	1,240,000	1,295,738	2018/12/20
第299回利付国債(10年)		1.3	1,260,000	1,319,749	2019/3/20
第300回利付国債(10年)		1.5	957,000	1,009,721	2019/3/20
第301回利付国債(10年)		1.5	1,512,000	1,600,089	2019/6/20
第302回利付国債(10年)		1.4	1,250,000	1,317,712	2019/6/20
第303回利付国債(10年)		1.4	1,615,000	1,706,732	2019/9/20
第304回利付国債(10年)		1.3	800,000	841,976	2019/9/20
第305回利付国債(10年)		1.3	2,938,000	3,098,796	2019/12/20
第306回利付国債(10年)		1.4	2,488,000	2,641,534	2020/3/20
第307回利付国債(10年)		1.3	1,260,000	1,331,681	2020/3/20
第308回利付国債(10年)		1.3	1,474,000	1,561,393	2020/6/20
第309回利付国債(10年)		1.1	2,190,000	2,297,638	2020/6/20
第310回利付国債(10年)		1.0	2,036,000	2,128,454	2020/9/20
第311回利付国債(10年)		0.8	1,230,000	1,272,791	2020/9/20
第312回利付国債(10年)		1.2	2,430,000	2,571,037	2020/12/20
第313回利付国債(10年)		1.3	1,859,000	1,981,229	2021/3/20
第314回利付国債(10年)		1.1	950,000	1,001,452	2021/3/20
第315回利付国債(10年)		1.2	2,013,000	2,136,900	2021/6/20
第316回利付国債(10年)		1.1	830,000	876,081	2021/6/20
第317回利付国債(10年)		1.1	657,000	694,527	2021/9/20
第318回利付国債(10年)		1.0	1,790,000	1,881,003	2021/9/20
第319回利付国債(10年)		1.1	719,000	760,917	2021/12/20
第320回利付国債(10年)		1.0	2,100,000	2,208,759	2021/12/20
第321回利付国債(10年)		1.0	1,575,000	1,656,774	2022/3/20
第322回利付国債(10年)		0.9	750,000	783,877	2022/3/20
第323回利付国債(10年)		0.9	1,875,000	1,959,337	2022/6/20
第324回利付国債(10年)		0.8	1,250,000	1,297,062	2022/6/20

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325回利付国債 (10年)		0.8	2,885,000	2,992,004	2022/ 9 /20
第326回利付国債 (10年)		0.7	1,000,000	1,029,350	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)		0.8	1,110,000	1,150,825	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)		0.6	2,330,000	2,379,931	2023/ 3 /20
第329回利付国債 (10年)		0.8	3,210,000	3,327,710	2023/ 6 /20
第330回利付国債 (10年)		0.8	1,990,000	2,062,674	2023/ 9 /20
第331回利付国債 (10年)		0.6	1,480,000	1,510,029	2023/ 9 /20
第332回利付国債 (10年)		0.6	3,260,000	3,323,896	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)		0.6	3,650,000	3,717,123	2024/ 3 /20
第334回利付国債 (10年)		0.6	3,170,000	3,225,665	2024/ 6 /20
第335回利付国債 (10年)		0.5	2,810,000	2,831,496	2024/ 9 /20
第336回利付国債 (10年)		0.5	1,360,000	1,368,772	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)		0.3	2,100,000	2,073,855	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)		0.4	2,210,000	2,199,568	2025/ 3 /20
第 1 回利付国債 (30年)		2.8	76,000	96,564	2029/ 9 /20
第 2 回利付国債 (30年)		2.4	98,000	119,266	2030/ 2 /20
第 3 回利付国債 (30年)		2.3	117,000	140,809	2030/ 5 /20
第 4 回利付国債 (30年)		2.9	127,000	163,934	2030/11/20
第 5 回利付国債 (30年)		2.2	108,000	128,372	2031/ 5 /20
第 6 回利付国債 (30年)		2.4	169,000	205,754	2031/11/20
第 7 回利付国債 (30年)		2.3	164,000	197,152	2032/ 5 /20
第 8 回利付国債 (30年)		1.8	142,000	159,177	2032/11/22
第 9 回利付国債 (30年)		1.4	116,000	122,577	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)		1.1	185,000	186,110	2033/ 3 /20
第11回利付国債 (30年)		1.7	137,000	150,658	2033/ 6 /20
第12回利付国債 (30年)		2.1	220,000	255,939	2033/ 9 /20
第13回利付国債 (30年)		2.0	205,000	234,759	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)		2.4	493,000	596,781	2034/ 3 /20
第15回利付国債 (30年)		2.5	346,000	424,804	2034/ 6 /20
第16回利付国債 (30年)		2.5	302,000	370,348	2034/ 9 /20
第17回利付国債 (30年)		2.4	327,000	395,228	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)		2.3	427,000	507,997	2035/ 3 /20
第19回利付国債 (30年)		2.3	303,000	360,185	2035/ 6 /20
第20回利付国債 (30年)		2.5	435,000	531,852	2035/ 9 /20
第21回利付国債 (30年)		2.3	379,000	449,349	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)		2.5	370,000	452,099	2036/ 3 /20
第23回利付国債 (30年)		2.5	354,000	432,577	2036/ 6 /20
第24回利付国債 (30年)		2.5	341,000	417,060	2036/ 9 /20
第25回利付国債 (30年)		2.3	412,000	488,487	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)		2.4	834,000	1,003,769	2037/ 3 /20
第27回利付国債 (30年)		2.5	650,000	794,729	2037/ 9 /20
第28回利付国債 (30年)		2.5	801,000	980,688	2038/ 3 /20
第29回利付国債 (30年)		2.4	850,000	1,024,845	2038/ 9 /20
第30回利付国債 (30年)		2.3	926,000	1,099,578	2039/ 3 /20
第31回利付国債 (30年)		2.2	888,000	1,037,743	2039/ 9 /20
第32回利付国債 (30年)		2.3	1,079,000	1,284,063	2040/ 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33回利付国債（30年）		2.0	1,204,000	1,358,232	2040/ 9 /20
第34回利付国債（30年）		2.2	1,206,000	1,411,900	2041/ 3 /20
第35回利付国債（30年）		2.0	1,259,000	1,420,831	2041/ 9 /20
第36回利付国債（30年）		2.0	1,069,000	1,204,741	2042/ 3 /20
第37回利付国債（30年）		1.9	1,157,000	1,279,005	2042/ 9 /20
第38回利付国債（30年）		1.8	885,000	956,888	2043/ 3 /20
第39回利付国債（30年）		1.9	900,000	993,753	2043/ 6 /20
第40回利付国債（30年）		1.8	700,000	756,063	2043/ 9 /20
第41回利付国債（30年）		1.7	660,000	696,880	2043/12/20
第42回利付国債（30年）		1.7	760,000	801,906	2044/ 3 /20
第43回利付国債（30年）		1.7	900,000	947,979	2044/ 6 /20
第44回利付国債（30年）		1.7	850,000	894,667	2044/ 9 /20
第45回利付国債（30年）		1.5	970,000	972,987	2044/12/20
第46回利付国債（30年）		1.5	580,000	581,194	2045/ 3 /20
第33回利付国債（20年）		3.8	36,000	37,851	2016/ 9 /20
第35回利付国債（20年）		3.3	117,000	124,139	2017/ 3 /20
第36回利付国債（20年）		3.0	201,000	215,164	2017/ 9 /20
第38回利付国債（20年）		2.7	400,000	430,648	2018/ 3 /20
第40回利付国債（20年）		2.3	601,000	646,591	2018/ 9 /20
第42回利付国債（20年）		2.6	869,000	953,762	2019/ 3 /20
第43回利付国債（20年）		2.9	74,000	83,016	2019/ 9 /20
第44回利付国債（20年）		2.5	480,000	535,464	2020/ 3 /20
第47回利付国債（20年）		2.2	114,000	126,551	2020/ 9 /21
第48回利付国債（20年）		2.5	209,000	236,234	2020/12/21
第49回利付国債（20年）		2.1	515,000	572,947	2021/ 3 /22
第51回利付国債（20年）		2.0	200,000	222,110	2021/ 6 /21
第52回利付国債（20年）		2.1	214,000	239,744	2021/ 9 /21
第54回利付国債（20年）		2.2	480,000	542,380	2021/12/20
第55回利付国債（20年）		2.0	241,000	269,956	2022/ 3 /21
第56回利付国債（20年）		2.0	449,000	503,472	2022/ 6 /20
第58回利付国債（20年）		1.9	147,000	164,157	2022/ 9 /20
第59回利付国債（20年）		1.7	589,000	650,291	2022/12/20
第61回利付国債（20年）		1.0	289,000	304,163	2023/ 3 /20
第63回利付国債（20年）		1.8	442,000	493,457	2023/ 6 /20
第64回利付国債（20年）		1.9	441,000	496,676	2023/ 9 /20
第65回利付国債（20年）		1.9	318,000	359,161	2023/12/20
第66回利付国債（20年）		1.8	500,000	560,545	2023/12/20
第68回利付国債（20年）		2.2	846,000	979,075	2024/ 3 /20
第70回利付国債（20年）		2.4	422,000	496,769	2024/ 6 /20
第71回利付国債（20年）		2.2	160,000	185,534	2024/ 6 /20
第72回利付国債（20年）		2.1	534,000	616,401	2024/ 9 /20
第73回利付国債（20年）		2.0	620,000	710,749	2024/12/20
第74回利付国債（20年）		2.1	318,000	367,480	2024/12/20
第75回利付国債（20年）		2.1	575,000	666,045	2025/ 3 /20
第76回利付国債（20年）		1.9	200,000	227,780	2025/ 3 /20
第77回利付国債（20年）		2.0	210,000	241,266	2025/ 3 /20

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第78回利付国債 (20年)	1.9	410,000	467,666	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	50,000	57,543	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	315,000	365,570	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	200,000	230,438	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	662,000	769,674	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	293,000	341,060	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	670,000	773,133	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	330,000	384,532	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	515,000	610,707	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	250,000	293,887	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	504,000	598,782	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	410,000	482,799	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	670,000	790,244	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	468,000	557,303	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	902,000	1,055,060	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	270,000	313,027	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	665,000	778,794	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	677,000	809,123	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	380,000	445,310	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	853,000	1,010,540	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	220,000	257,952	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	1,075,000	1,261,706	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	620,000	735,704	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	573,000	693,971	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	680,000	824,166	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	550,000	659,961	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	280,000	329,016	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	690,000	810,936	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	381,000	452,445	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	607,000	713,874	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	630,000	724,796	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	940,000	1,081,723	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	246,000	289,480	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	381,000	453,473	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	860,000	1,012,572	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	1,252,000	1,473,879	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	1,020,000	1,200,438	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	494,000	588,270	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	596,000	709,567	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	890,000	1,047,031	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	296,000	344,088	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	460,000	521,626	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	800,000	884,440	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	929,000	1,065,813	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	620,000	702,850	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	828,000	973,256	2030/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第124回利付国債 (20年)		2.0	500,000	580,405	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)		2.2	724,000	861,719	2031/ 3 /20
第126回利付国債 (20年)		2.0	220,000	255,336	2031/ 3 /20
第127回利付国債 (20年)		1.9	520,000	595,842	2031/ 3 /20
第128回利付国債 (20年)		1.9	644,000	737,154	2031/ 6 /20
第129回利付国債 (20年)		1.8	600,000	677,844	2031/ 6 /20
第130回利付国債 (20年)		1.8	852,000	961,303	2031/ 9 /20
第131回利付国債 (20年)		1.7	400,000	445,296	2031/ 9 /20
第132回利付国債 (20年)		1.7	827,000	919,243	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)		1.8	650,000	732,381	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)		1.8	965,000	1,085,711	2032/ 3 /20
第135回利付国債 (20年)		1.7	170,000	188,654	2032/ 3 /20
第136回利付国債 (20年)		1.6	330,000	361,152	2032/ 3 /20
第137回利付国債 (20年)		1.7	812,000	899,606	2032/ 6 /20
第138回利付国債 (20年)		1.5	410,000	441,549	2032/ 6 /20
第139回利付国債 (20年)		1.6	150,000	163,860	2032/ 6 /20
第140回利付国債 (20年)		1.7	1,507,000	1,666,681	2032/ 9 /20
第141回利付国債 (20年)		1.7	1,200,000	1,324,728	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)		1.8	620,000	694,238	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)		1.6	990,000	1,075,080	2033/ 3 /20
第144回利付国債 (20年)		1.5	610,000	652,730	2033/ 3 /20
第145回利付国債 (20年)		1.7	1,670,000	1,836,499	2033/ 6 /20
第146回利付国債 (20年)		1.7	1,580,000	1,734,018	2033/ 9 /20
第147回利付国債 (20年)		1.6	1,800,000	1,941,966	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	1,610,000	1,706,535	2034/ 3 /20
第149回利付国債 (20年)		1.5	1,800,000	1,903,122	2034/ 6 /20
第150回利付国債 (20年)		1.4	1,600,000	1,660,688	2034/ 9 /20
第151回利付国債 (20年)		1.2	1,630,000	1,630,000	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	1,250,000	1,246,000	2035/ 3 /20
第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013)		0.67	100,000	100,693	2018/11/15
小 計			259,668,000	276,063,134	
地方債証券					
第 1 回東京都公募公債 (20年)		1.54	20,000	21,818	2023/ 6 /20
第 7 回東京都公募公債 (30年)		2.51	10,000	11,941	2038/ 9 /17
第 8 回東京都公募公債 (30年)		2.23	80,000	91,089	2038/ 9 /17
第16回東京都公募公債 (20年)		2.01	100,000	115,474	2028/12/20
第20回東京都公募公債 (20年)		2.09	80,000	93,284	2029/ 9 /20
第21回東京都公募公債 (20年)		2.19	80,000	94,324	2029/12/20
第22回東京都公募公債 (20年)		1.92	120,000	136,918	2030/ 6 /20
第24回東京都公募公債 (20年)		1.98	70,000	80,186	2031/ 6 /20
第28回東京都公募公債 (20年)		1.59	100,000	107,314	2033/ 3 /18
第638回東京都公募公債		1.9	100,000	102,485	2016/ 9 /20
第648回東京都公募公債		1.84	100,000	103,745	2017/ 6 /20
第666回東京都公募公債		1.46	100,000	105,141	2019/ 3 /20
第669回東京都公募公債		1.63	50,000	53,065	2019/ 6 /20
第678回東京都公募公債		1.38	100,000	105,579	2019/12/20

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680回東京都公募公債		1.39	100,000	105,871	2020/3/19
第681回東京都公募公債		1.4	100,000	105,920	2020/3/19
第692回東京都公募公債		1.35	100,000	106,312	2020/12/18
第693回東京都公募公債		1.38	100,000	106,702	2021/3/19
第701回東京都公募公債		0.99	120,000	125,587	2021/9/17
第705回東京都公募公債		1.06	70,000	73,669	2022/3/18
第717回東京都公募公債		0.63	100,000	101,944	2023/3/20
第719回東京都公募公債		0.86	150,000	155,554	2023/3/20
第728回東京都公募公債		0.65	200,000	203,816	2023/12/20
第730回東京都公募公債		0.664	100,000	101,948	2024/3/19
第733回東京都公募公債		0.581	100,000	101,095	2024/6/20
平成18年度第6回北海道公募公債		2.1	118,000	121,034	2016/8/31
平成19年度第2回北海道公募公債		1.84	112,000	115,952	2017/5/31
平成19年度第4回北海道公募公債		1.98	20,000	20,790	2017/6/29
平成19年度第16回北海道公募公債		1.58	100,000	104,165	2018/3/23
平成20年度第6回北海道公募公債		1.72	53,990	56,774	2018/8/29
平成21年度第2回北海道公募公債		1.66	100,000	105,926	2019/5/29
平成21年度第12回北海道公募公債		1.42	100,000	105,512	2019/12/25
平成22年度第8回北海道公募公債		0.96	100,000	103,769	2020/10/29
平成24年度第9回北海道公募公債		0.79	100,000	102,826	2022/10/31
第1回神奈川県公募公債（20年）		2.55	100,000	118,668	2024/6/20
第2回神奈川県公募公債（20年）		2.23	80,000	92,696	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債（30年）		2.87	80,000	100,556	2036/6/20
第3回神奈川県公募公債（20年）		2.11	100,000	115,375	2025/6/20
第27回神奈川県公募公債（20年）		1.398	100,000	102,446	2034/9/20
第152回神奈川県公募公債		1.53	110,000	114,592	2018/3/20
第162回神奈川県公募公債		1.62	140,450	149,002	2019/6/20
第165回神奈川県公募公債		1.4	54,660	57,630	2019/9/20
第170回神奈川県公募公債		1.38	100,000	105,827	2020/3/20
第176回神奈川県公募公債		1.16	128,900	135,453	2020/9/18
第5回大阪府公募公債（20年）		2.16	100,000	116,776	2030/5/28
第74回大阪府公募公債（5年）		0.46	100,000	100,407	2016/6/29
第285回大阪府公募公債		1.5	50,000	50,434	2015/12/25
第300回大阪府公募公債		1.8	135,000	139,306	2017/3/29
第306回大阪府公募公債		1.83	30,000	31,231	2017/9/27
第313回大阪府公募公債		1.66	100,000	104,596	2018/4/27
第314回大阪府公募公債		1.8	30,000	31,540	2018/5/29
第316回大阪府公募公債		1.85	100,000	105,553	2018/7/30
第325回大阪府公募公債		1.66	53,000	56,125	2019/4/26
第326回大阪府公募公債		1.66	10,000	10,600	2019/5/28
第331回大阪府公募公債		1.41	100,000	105,423	2019/10/29
第332回大阪府公募公債		1.58	71,600	76,083	2019/11/27
第334回大阪府公募公債		1.47	44,000	46,609	2020/1/28
第337回大阪府公募公債		1.44	110,000	116,631	2020/4/28
第343回大阪府公募公債		0.98	70,000	72,790	2020/10/28
第348回大阪府公募公債		1.32	10,000	10,616	2021/3/30

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351回大阪府公募公債		1.19	100,000	105,584	2021/ 7 /28
第358回大阪府公募公債		0.97	56,000	58,444	2022/ 2 /28
第359回大阪府公募公債		0.99	56,000	58,522	2022/ 3 /29
平成21年度第 5 回京都府公募公債		1.35	20,000	21,081	2019/12/24
平成22年度第 5 回京都府公募公債		1.26	110,000	116,339	2020/12/21
平成23年度第 9 回京都府公募公債		1.01	140,000	146,763	2022/ 3 /16
平成25年度第 2 回京都府公募公債 (15年)		1.05	100,000	103,545	2028/ 4 /28
第 2 回兵庫県公募公債 (30年)		2.36	40,000	46,217	2040/ 3 /19
第 4 回兵庫県公募公債 (15年)		1.31	100,000	106,535	2027/12/24
第 8 回兵庫県公募公債 (15年)		1.09	100,000	102,886	2029/ 4 /16
第16回兵庫県公募公債 (20年)		1.7	100,000	108,559	2032/11/19
平成20年度第 5 回兵庫県公募公債		1.93	50,000	52,826	2018/ 6 /20
平成21年度第 1 回兵庫県公募公債		1.62	20,000	21,149	2019/ 4 /23
平成21年度第 3 回兵庫県公募公債		1.62	90,000	95,278	2019/ 5 /22
平成21年度第25回兵庫県公募公債		1.54	100,000	106,080	2019/11/20
平成18年度第 2 回静岡県公募公債		2.0	41,300	42,197	2016/ 6 /27
平成19年度第 1 回静岡県公募公債		1.77	66,900	69,232	2017/ 5 /30
平成20年度第 1 回静岡県公募公債		1.73	14,500	15,227	2018/ 5 /28
平成20年度第 4 回静岡県公募公債		1.65	100,000	105,114	2018/ 8 /28
平成20年度第 5 回静岡県公募公債		1.59	11,000	11,563	2018/10/30
平成21年度第 4 回静岡県公募公債		1.56	52,920	56,104	2019/ 8 /20
平成22年度第 6 回静岡県公募公債		1.178	100,000	105,045	2020/ 7 /22
平成22年度第 8 回静岡県公募公債		1.059	100,000	104,473	2020/ 8 /25
平成23年度第 5 回静岡県公募公債		1.158	100,000	105,540	2021/ 6 /28
平成25年度第 9 回静岡県公募公債		0.679	100,000	102,131	2023/11/22
平成26年度第 5 回静岡県公募公債		0.61	100,000	101,277	2024/ 7 /25
平成18年度第 4 回愛知県公募公債		1.8	110,700	113,449	2016/10/17
平成23年度第 7 回愛知県公募公債		1.11	100,000	105,323	2021/ 7 /29
平成23年度第17回愛知県公募公債		0.996	100,000	104,776	2022/ 1 /31
平成25年度第 2 回愛知県公募公債		0.576	200,000	202,944	2023/ 4 /26
平成25年度第 9 回愛知県公募公債		0.849	140,000	145,052	2023/ 7 /25
平成19年度第 2 回広島県公募公債		1.94	46,050	48,005	2017/ 8 /24
平成20年度第 4 回広島県公募公債		1.73	60,000	63,398	2018/11/26
平成22年度第 8 回広島県公募公債		1.33	26,650	28,338	2021/ 3 /25
平成23年度第 1 回広島県公募公債		1.19	100,000	105,599	2021/ 5 /27
平成18年度第 3 回埼玉県公募公債		2.1	107,600	110,243	2016/ 7 /28
平成18年度第 5 回埼玉県公募公債		1.9	62,100	63,861	2016/11/29
平成18年度第 7 回埼玉県公募公債		1.85	112,600	116,197	2017/ 2 /27
平成19年度第 3 回埼玉県公募公債		1.94	39,100	40,776	2017/ 8 /28
平成19年度第 6 回埼玉県公募公債		1.63	100,000	104,236	2018/ 1 /30
平成23年度第 1 回埼玉県公募公債		1.37	100,000	106,687	2021/ 4 /27
平成23年度第 4 回埼玉県公募公債		1.2	100,000	105,837	2021/ 7 /27
平成24年度第 6 回埼玉県公募公債		0.801	100,000	103,277	2022/10/26
平成26年度第 6 回埼玉県公募公債		0.554	150,000	150,996	2024/ 9 /26
平成18年度第 3 回福岡県公募公債		1.9	100,000	102,683	2016/10/31
平成19年度第 1 回福岡県公募公債 (30年)		2.62	70,000	84,812	2037/ 9 /18

銘	柄	当期末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
平成20年度第1回福岡県公募公債 (30年)		2.28	80,000	91,792	2038/9/17
平成21年度第11回福岡県公募公債		1.44	100,000	105,986	2020/2/25
平成22年度第3回福岡県公募公債		1.11	100,000	104,711	2020/8/24
平成22年度第5回福岡県公募公債		0.94	20,000	20,782	2020/10/28
第9回千葉県公募公債 (20年)		1.84	80,000	90,235	2030/10/11
平成20年度第2回千葉県公募公債		1.8	90,000	94,692	2018/5/25
平成20年度第3回千葉県公募公債		1.78	80,000	84,326	2018/7/25
平成20年度第5回千葉県公募公債		1.6	80,000	84,033	2018/9/25
平成22年度第7回千葉県公募公債		0.92	120,000	124,586	2020/10/23
平成22年度第11回千葉県公募公債		1.26	80,000	84,688	2021/1/25
平成23年度第9回千葉県公募公債		1.0	20,000	20,962	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債		1.05	20,000	21,025	2022/4/25
平成24年度第6回千葉県公募公債		0.81	100,000	103,337	2022/11/25
平成25年度第1回千葉県公募公債		0.58	82,500	83,706	2023/4/25
平成21年度第1回新潟県公募公債		1.42	23,000	24,210	2019/7/29
平成23年度第1回新潟県公募公債		1.02	119,000	124,632	2021/11/30
第45回共同発行市場公募地方債		1.7	37,500	38,482	2016/12/22
第47回共同発行市場公募地方債		1.8	117,000	120,605	2017/2/24
第50回共同発行市場公募地方債		1.7	29,100	30,066	2017/5/25
第52回共同発行市場公募地方債		1.9	102,000	106,112	2017/7/25
第53回共同発行市場公募地方債		1.8	300	311	2017/8/25
第58回共同発行市場公募地方債		1.59	21,000	21,859	2018/1/25
第59回共同発行市場公募地方債		1.57	100,800	104,990	2018/2/23
第62回共同発行市場公募地方債		1.74	100,000	105,032	2018/5/25
第63回共同発行市場公募地方債		1.88	100,000	105,603	2018/6/25
第64回共同発行市場公募地方債		1.78	100,000	105,408	2018/7/25
第65回共同発行市場公募地方債		1.62	90,000	94,500	2018/8/24
第74回共同発行市場公募地方債		1.57	100,000	105,778	2019/5/24
第75回共同発行市場公募地方債		1.64	100,000	106,168	2019/6/25
第77回共同発行市場公募地方債		1.54	10,000	10,594	2019/8/23
第78回共同発行市場公募地方債		1.39	30,000	31,615	2019/9/25
第81回共同発行市場公募地方債		1.32	109,500	115,299	2019/12/25
第90回共同発行市場公募地方債		1.12	30,000	31,458	2020/9/25
第95回共同発行市場公募地方債		1.28	100,000	106,030	2021/2/25
第101回共同発行市場公募地方債		1.05	100,000	104,949	2021/8/25
第104回共同発行市場公募地方債		1.03	200,000	209,850	2021/11/25
第107回共同発行市場公募地方債		1.01	100,000	104,873	2022/2/25
第109回共同発行市場公募地方債		1.05	70,000	73,590	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債		0.89	100,000	104,000	2022/5/25
第113回共同発行市場公募地方債		0.77	100,000	103,094	2022/8/25
第114回共同発行市場公募地方債		0.82	100,000	103,451	2022/9/22
第116回共同発行市場公募地方債		0.8	250,000	258,160	2022/11/25
第117回共同発行市場公募地方債		0.72	100,000	102,623	2022/12/22
第118回共同発行市場公募地方債		0.84	100,000	103,519	2023/1/25
第119回共同発行市場公募地方債		0.8	300,000	309,645	2023/2/24
第120回共同発行市場公募地方債		0.68	100,000	102,290	2023/3/24

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128回共同発行市場公募地方債		0.66	300,000	305,799	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債		0.76	130,000	133,598	2024/ 1 /25
第132回共同発行市場公募地方債		0.66	200,000	203,660	2024/ 3 /25
第135回共同発行市場公募地方債		0.659	100,000	101,737	2024/ 6 /25
第137回共同発行市場公募地方債		0.566	300,000	302,556	2024/ 8 /23
第138回共同発行市場公募地方債		0.554	100,000	100,664	2024/ 9 /25
第142回共同発行市場公募地方債		0.345	200,000	197,120	2025/ 1 /24
平成18年度第 1 回堺市公募公債		1.84	30,000	30,839	2016/12/26
平成19年度第 1 回堺市公募公債		1.73	100,000	104,195	2017/12/19
平成18年度第 2 回熊本県公募公債		1.8	84,540	86,661	2016/10/27
平成24年度第 2 回熊本県公募公債		0.8	50,000	51,597	2022/10/26
平成22年度第 1 回新潟市公募公債		1.21	54,980	57,984	2020/12/24
平成23年度第 1 回浜松市公募公債		1.045	38,200	40,079	2021/11/25
平成25年度第 1 回浜松市公募公債		0.761	61,000	62,614	2024/ 1 /24
第 1 回大阪市公募公債（15年）		1.753	200,000	223,658	2026/ 7 /17
第 5 回大阪市公募公債（20年）		2.47	100,000	120,746	2028/ 9 /21
平成18年度第 6 回大阪市公募公債		2.0	75,000	77,080	2016/10/26
平成19年度第 4 回大阪市公募公債		1.9	30,000	31,143	2017/ 6 /21
平成21年度第 6 回大阪市公募公債		1.57	125,000	132,791	2019/11/25
平成23年度第10回大阪市公募公債		0.956	10,000	10,429	2022/ 1 /27
平成26年度第 5 回大阪市公募公債		0.593	100,000	100,788	2024/ 9 /27
第 1 回名古屋市公募公債（12年）		1.033	100,000	104,846	2025/ 6 /20
第 2 回名古屋市公募公債（20年）		2.56	100,000	118,600	2024/ 6 /20
第10回名古屋市公募公債（20年）		2.26	80,000	95,127	2029/ 8 /17
第477回名古屋市公募公債		1.034	100,000	104,958	2021/12/20
第 5 回京都市公募公債（20年）		2.36	50,000	59,417	2026/12/18
平成18年度第 3 回神戸市公募公債（20年）		2.54	120,000	144,304	2026/ 6 /19
平成22年度第 9 回神戸市公募公債（20年）		2.09	80,000	92,712	2031/ 1 /24
第 7 回横浜市公募公債（20年）		2.06	100,000	115,190	2025/12/19
第17回横浜市公募公債（20年）		2.07	80,000	93,031	2028/12/20
平成20年度第 4 回横浜市公募公債		1.71	100,000	105,572	2018/11/16
第20回横浜市公募公債（20年）		2.1	80,000	93,384	2029/10/19
平成24年度第 4 回横浜市公募公債		0.81	100,000	103,247	2023/ 2 /20
平成24年度第 3 回横浜市公募公債		0.729	100,000	102,651	2022/12/22
第25回横浜市公募公債（20年）		1.72	100,000	109,989	2032/ 7 /16
第27回横浜市公募公債（20年）		1.599	60,000	64,356	2033/ 5 /20
平成21年度第 5 回札幌市公募公債		1.36	112,000	117,815	2019/ 9 /20
平成22年度第 8 回札幌市公募公債（30年）		2.277	80,000	91,835	2040/ 9 /20
第82回川崎市公募公債		1.52	100,000	105,931	2019/ 9 /20
第17回北九州市公募公債（20年）		1.529	100,000	104,779	2034/ 6 /20
平成17年度第 3 回福岡市公募公債		1.6	60,000	60,502	2015/11/30
平成18年度第 6 回福岡市公募公債		1.8	70,000	71,954	2016/12/26
平成20年度第 5 回福岡市公募公債		1.57	91,000	95,546	2018/10/24
平成24年度第 1 回福岡市公募公債（5年）		0.25	34,700	34,828	2017/ 6 /26
平成24年度第 3 回福岡市公募公債（5年）		0.25	42,500	42,671	2017/ 9 /28
平成25年度第 3 回福岡市公募公債（5年）		0.31	31,500	31,706	2018/ 9 /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25年度第 4 回福岡市公募公債	(20年)	0.68	50,000	51,018	2023/10/24
平成26年度第 6 回福岡市公募公債		1.371	100,000	102,183	2034/ 9 /20
平成18年度第 1 回千葉市公募公債		1.8	50,000	51,250	2016/10/25
平成24年度第 2 回千葉市公募公債		0.81	100,000	103,258	2022/11/22
平成22年度第 1 回三重県公募公債		1.056	87,050	91,065	2020/11/30
平成23年度第 1 回三重県公募公債		1.021	12,750	13,371	2021/11/30
平成24年度第 1 回三重県公募公債		0.801	40,400	41,723	2022/10/25
平成24年度第 4 回福井県公募公債		0.46	100,000	100,457	2023/ 4 /26
平成20年度第 1 回徳島県公募公債		1.73	36,000	38,022	2018/11/28
平成26年度第 1 回徳島県公募公債		0.495	100,000	99,815	2024/11/28
平成20年度第 1 回岡山県公募公債		1.56	48,700	51,218	2018/12/25
小		計		18,432,040	19,456,471
特殊債券(除く金融債)					
第16回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	120,000	122,833	2016/ 7 /28	
第17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	102,542	2016/ 8 /31	
第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	100,000	102,680	2016/12/28	
第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	200,000	208,214	2017/ 7 /31	
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	112,000	116,757	2017/ 8 /31	
第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	90,000	93,519	2017/ 9 /28	
第42回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	106,000	110,565	2017/10/31	
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	103,929	2018/ 1 /31	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	56,000	58,216	2018/ 4 /20	
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	100,000	104,996	2018/ 5 /30	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	34,000	35,783	2018/ 7 /31	
第64回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	56,000	58,803	2018/ 8 /29	
第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	124,000	129,913	2018/ 9 /28	
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	115,000	121,123	2018/11/28	
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	159,000	166,185	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	123,000	128,638	2019/ 3 /19	
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	234,080	2029/ 5 /31	
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	110,000	116,260	2019/ 6 /28	
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	79,000	83,011	2019/ 9 /30	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	116,982	2029/ 9 /28	
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	116,988	2029/10/31	
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	139,000	145,703	2019/12/27	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	210,000	221,323	2020/ 1 /31	
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	117,538	2040/ 2 /29	
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	50,000	52,757	2020/ 3 /19	
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	116,986	2030/ 4 /30	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	105,749	2020/ 6 /30	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	104,316	2020/ 9 /30	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	112,000	116,334	2020/11/30	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	71,000	74,972	2020/12/28	
第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	100,000	115,387	2031/ 1 /31	
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	91,000	95,785	2021/ 5 /31	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	60,000	63,216	2021/ 7 /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142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	122,000	127,834	2021/8/31
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	100,000	104,856	2021/10/29
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	100,000	112,027	2031/10/31
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	136,000	142,630	2021/11/30
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	112,000	116,756	2022/2/28
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	270,000	281,529	2022/3/18
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.977	100,000	104,778	2022/4/28
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.737	100,000	110,690	2032/4/30
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.83	200,000	214,782	2042/5/30
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	150,000	155,040	2022/10/31
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.805	100,000	103,421	2022/11/30
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.734	117,000	120,376	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	207,276	2023/1/31
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.668	100,000	102,350	2023/3/17
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	300,000	305,388	2023/5/31
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.882	100,000	104,005	2023/6/30
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.911	121,000	126,124	2023/7/31
第197回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.835	100,000	103,581	2023/8/31
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.644	100,000	101,787	2024/6/28
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.39	100,000	102,962	2034/8/31
第344回政府保証道路債券		1.6	100,000	107,303	2020/7/15
第3回政府保証首都高速道路債券		1.7	9,000	9,278	2017/3/27
第4回政府保証首都高速道路債券		1.7	179,000	185,998	2017/9/25
第1回政府保証阪神高速道路債券		1.6	5,000	5,068	2016/3/31
第2回政府保証成田国際空港債券		1.6	38,000	38,461	2016/2/22
第4回政府保証東日本高速道路債券		1.9	75,000	76,562	2016/6/27
第6回政府保証東日本高速道路債券		1.8	62,000	63,662	2016/11/24
第7回政府保証東日本高速道路債券		1.9	34,000	35,432	2017/8/24
第10回政府保証東日本高速道路債券		1.5	107,000	111,045	2017/12/21
第13回政府保証東日本高速道路債券		1.6	28,000	29,452	2018/10/19
第3回政府保証中日本高速道路債券		1.6	27,000	27,328	2016/2/24
第17回政府保証中日本高速道路債券		1.7	100,000	103,853	2017/9/15
第20回政府保証中日本高速道路債券		1.4	10,000	10,383	2018/3/16
第23回政府保証中日本高速道路債券		1.5	46,000	48,178	2018/9/14
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.5	10,000	10,564	2019/6/14
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.4	25,000	26,325	2019/7/12
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.5	100,000	105,816	2019/8/16
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券（6年）		0.4	200,000	201,900	2018/1/30
第4回政府保証公営企業債券（15年）		2.0	100,000	111,791	2022/4/22
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）		0.093	200,000	200,154	2017/2/24
第5回政府保証公営企業債券（15年）		2.2	100,000	113,403	2022/7/15
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.4	100,000	105,043	2019/4/15
第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.5	48,000	50,669	2019/5/24
第12回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.3	100,000	105,642	2020/5/22
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.0	100,000	104,311	2020/9/14
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.0	21,000	22,015	2021/10/18

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31回政府保証地方公共団体金融機構債券		1. 1	50,000	52,774	2021/12/14
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券		0. 895	100,000	104,170	2022/ 6 /17
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券		0. 815	254,000	262,834	2023/ 2 /17
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券		0. 605	36,000	36,643	2023/ 5 /16
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券		0. 835	150,000	155,404	2023/ 8 /14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券		0. 693	39,000	39,932	2023/12/18
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券		0. 645	200,000	203,830	2024/ 3 /15
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券		0. 601	100,000	101,372	2024/ 7 /16
第63回政府保証地方公共団体金融機構債券		0. 556	200,000	201,882	2024/ 8 /16
第864回政府保証公営企業債券		1. 9	14,000	14,287	2016/ 6 /22
第866回政府保証公営企業債券		2. 0	63,000	64,553	2016/ 8 /18
第870回政府保証公営企業債券		1. 7	52,000	53,381	2016/12/21
第879回政府保証公営企業債券		1. 7	102,000	105,948	2017/ 9 /19
第883回政府保証公営企業債券		1. 4	100,000	103,845	2018/ 3 /19
第884回政府保証公営企業債券		1. 4	114,000	118,482	2018/ 4 /17
第885回政府保証公営企業債券		1. 7	104,000	109,159	2018/ 5 /22
第 2 回政府保証公営企業債券 (15年)		2. 1	100,000	111,094	2021/ 4 /16
第23回政府保証日本政策金融公庫債券		0. 734	30,000	30,873	2022/12/16
第25回政府保証日本政策金融公庫債券		0. 815	100,000	103,487	2023/ 2 /24
第190回政府保証中小企業債券		1. 8	13,000	13,386	2017/ 1 /24
第191回政府保証中小企業債券		1. 7	211,000	219,129	2017/ 9 /15
第16回政府保証民間都市開発債券		0. 699	80,000	81,985	2023/10/20
第17回政府保証国民生活債券		1. 6	41,000	41,537	2016/ 3 /17
第21回政府保証国民生活債券		1. 5	2,000	2,075	2017/12/18
第201回政府保証預金保険機構債券		0. 1	200,000	199,956	2019/ 2 /13
第 7 回政府保証日本政策投資銀行		1. 4	100,000	105,894	2020/ 2 /17
第11回政府保証日本政策投資銀行		1. 0	137,000	143,591	2021/ 9 /14
第17回政府保証日本政策投資銀行		0. 257	200,000	201,140	2018/11/ 9
第22回政府保証日本政策投資銀行		0. 693	20,000	20,478	2023/12/18
第27回政府保証日本政策投資銀行		0. 11	200,000	198,904	2021/ 2 /12
第53回政府保証関西国際空港債券		1. 5	151,000	156,892	2018/ 1 /24
第11回政府保証中部国際空港債券		0. 7	100,000	101,160	2017/ 2 /23
第 5 回政府保証西日本高速道路債券		1. 8	41,000	42,220	2017/ 1 /25
第 6 回政府保証西日本高速道路債券		1. 8	51,000	52,597	2017/ 2 /27
第 8 回政府保証西日本高速道路債券		1. 7	100,000	103,335	2017/ 5 /19
第11回政府保証西日本高速道路債券		1. 7	31,000	32,297	2017/11/28
第21回日本政策投資銀行債券 (財投機関債)		0. 46	100,000	100,645	2017/ 3 /17
第27回日本政策投資銀行債券 (財投機関債)		1. 98	100,000	102,538	2016/ 9 /20
第46回日本政策投資銀行債券 (財投機関債)		1. 69	50,000	52,248	2018/ 3 /20
第 7 回道路債券 (財投機関債)		2. 7	100,000	116,153	2022/ 6 /20
第 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)		2. 45	20,000	23,733	2026/ 3 /19
第 9 回道路債券 (財投機関債)		2. 9	100,000	127,051	2032/ 5 /20
第13回道路債券 (財投機関債)		2. 28	100,000	113,501	2022/ 9 /20
第15回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)		2. 05	100,000	102,626	2016/ 9 /20
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)		2. 87	30,000	37,329	2046/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)		2. 75	100,000	121,296	2047/ 3 /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22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.67	130,000	155,048	2047/3/20
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.39	60,000	71,344	2027/7/20
第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.82	200,000	208,046	2017/9/20
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.34	100,000	118,428	2027/10/20
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.61	100,000	104,269	2018/3/20
第42回道路債券(財投機関債)		2.22	30,000	34,696	2025/3/21
第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.63	100,000	105,290	2018/12/20
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.41	100,000	119,837	2029/4/20
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.9	50,000	55,923	2032/3/19
第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.711	100,000	108,787	2032/6/18
第100回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		0.784	100,000	102,675	2022/12/20
第101回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		0.781	100,000	102,653	2022/12/20
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		0.85	200,000	206,176	2023/6/20
第1回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.648	100,000	106,038	2019/6/28
第1回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		2.266	50,000	58,985	2029/6/28
第2回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.406	80,000	84,087	2019/7/26
第3回回営企業債券(20年)(財投機関債)		1.03	20,000	20,921	2023/3/22
第3回回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債)		1.176	100,000	104,017	2029/1/26
第6回回営企業債券(20年)(財投機関債)		2.03	100,000	112,975	2023/12/20
第9回回営企業債券(20年)(財投機関債)		2.33	50,000	58,157	2024/9/24
第10回回地方公共団体金融機構債券(5年)(財投機関債)		0.28	100,000	100,353	2017/5/26
第14回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		2.187	80,000	93,330	2031/4/28
第16回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.164	100,000	104,823	2020/9/28
第16回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.846	80,000	89,291	2031/8/28
第17回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.87	100,000	111,924	2031/9/26
第19回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.274	50,000	52,797	2020/12/28
第20回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.28	100,000	105,683	2021/1/28
F23回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.075	100,000	102,903	2018/5/29
第23回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.418	100,000	106,658	2021/4/28
第23回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.68	250,000	270,955	2032/7/28
F24回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.681	70,000	76,715	2023/3/17
第27回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.034	100,000	104,530	2021/8/27
第35回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.006	100,000	104,476	2022/4/28
第44回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.791	200,000	205,534	2023/1/27
第49回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.887	200,000	206,936	2023/6/28
F89回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.602	100,000	109,856	2027/8/20
F110回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.562	100,000	101,538	2019/4/25
F123回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.6	100,000	108,916	2030/3/19
F131回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.546	100,000	107,221	2031/7/30
F147回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.291	100,000	106,371	2027/3/19
F226回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.096	100,000	102,926	2029/2/28
第10回首都高速道路		0.336	100,000	100,531	2017/9/20
第13回首都高速道路(財投機関債)		0.223	100,000	100,072	2019/9/20
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)		2.167	80,000	93,266	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)		1.911	80,000	90,296	2030/10/29
第21回都市再生債券(財投機関債)		1.72	100,000	105,283	2018/9/20

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54回都市再生債券（財投機関債）		0.434	100,000	100,440	2016/9/20
第100回都市再生債券（財投機関債）		0.569	100,000	100,306	2024/11/20
第10回福祉医療機構債券（財投機関債）		2.16	100,000	102,267	2016/6/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	32,819	35,277	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		2.08	26,188	28,163	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.19	33,979	36,637	2042/6/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		2.27	27,045	29,348	2037/11/10
第2回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）		1.8	100,000	103,124	2017/3/17
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.29	33,693	36,484	2042/8/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.76	23,189	24,578	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.26	24,112	26,089	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	33,025	35,528	2042/10/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.94	28,402	30,302	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.25	24,166	26,126	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	17,570	18,324	2037/10/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.99	34,639	37,050	2042/12/10
第8回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）		1.73	70,000	72,667	2017/9/20
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.52	17,044	17,673	2037/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.19	24,831	26,818	2037/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		2.24	30,322	32,544	2039/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.43	36,536	37,860	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.15	25,613	27,630	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.16	37,789	40,676	2043/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	20,521	21,504	2039/1/10
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.7	37,850	39,671	2032/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.64	40,542	42,526	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	41,354	43,507	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	124,686	130,478	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	22,501	23,728	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.12	23,671	25,265	2039/7/10
第21回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）		1.92	100,000	105,952	2018/9/20
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	29,877	31,544	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	66,990	70,915	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	36,000	38,080	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.88	58,191	62,006	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.87	63,751	67,895	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	65,022	69,161	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.88	34,177	36,474	2040/12/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	32,392	34,496	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	73,698	76,709	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.09	34,607	37,297	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	31,839	34,696	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.6	77,865	82,248	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	78,179	83,439	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	74,823	79,857	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.92	73,034	78,474	2046/4/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	147,680	158,442	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	73,895	78,672	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	73,997	78,379	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.21	31,992	34,726	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	78,221	82,760	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	79,876	83,896	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	80,668	84,586	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.42	82,694	86,420	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	249,591	261,164	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	83,868	87,747	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	84,153	87,561	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	85,975	88,657	2047/7/10
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.11	86,049	88,151	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	87,646	89,851	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.25	88,406	91,504	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.32	90,881	94,518	2048/7/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.066	80,000	91,754	2031/6/13
第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.751	30,000	33,429	2026/6/19
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	185,814	189,844	2049/1/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	92,875	94,877	2049/2/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	94,357	96,113	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	190,094	193,221	2049/5/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.863	100,000	111,360	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.95	97,714	98,741	2049/10/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	98,541	97,884	2050/1/10
第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.441	200,000	215,914	2027/3/19
第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.227	130,000	144,517	2042/9/19
第6回沖縄振興開発金融公庫債券(財投機関債)		2.04	50,000	57,075	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)		1.991	70,000	79,722	2031/6/13
第11回国際協力機構債券(財投機関債)		1.14	30,000	31,622	2021/12/20
第16回国際協力機構債券(財投機関債)		0.3	85,800	86,229	2018/12/26
第18回東日本高速道路		0.387	100,000	100,639	2017/9/20
第22回東日本高速道路		0.401	100,000	100,838	2018/6/20
第28回東日本高速道路		0.248	100,000	100,122	2019/12/20
第21回中日本高速道路		0.592	100,000	101,134	2017/9/20
第42回中日本高速道路		0.942	100,000	103,852	2022/3/18
第46回中日本高速道路		0.351	200,000	201,134	2017/9/20
第20回西日本高速道路		0.759	100,000	102,156	2023/9/20
第21回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		1.86	200,000	211,502	2018/9/20
第43回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		1.026	100,000	104,586	2021/9/17
第64回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		0.193	100,000	100,225	2018/6/20
第5回東京都住宅供給公社債券		2.02	100,000	104,053	2017/9/20
小	計		23,778,319	25,080,571	
金融債券					
い第733号商工債券		0.55	100,000	100,450	2016/6/27
い第735号商工債券		0.4	100,000	100,322	2016/8/26

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	
い第736号商工債券		0.45	100,000	100,413	2016/9/27
い第745号商工債券		0.35	100,000	100,433	2017/6/27
い第773号商工債券		0.2	100,000	99,818	2019/10/25
い第734号農林債券		0.6	50,000	50,253	2016/7/27
い第740号農林債券		0.5	100,000	100,547	2017/1/27
い第741号農林債券		0.5	100,000	100,573	2017/2/27
い第744号農林債券		0.4	100,000	100,454	2017/5/26
い第749号農林債券		0.3	200,000	200,586	2017/10/27
い第752号農林債券		0.3	150,000	150,465	2018/1/26
い第760号農林債券		0.4	200,000	201,236	2018/9/27
い第761号農林債券		0.3	250,000	250,707	2018/10/26
い第763号農林債券		0.3	340,000	340,843	2018/12/27
い第765号農林債券		0.3	100,000	100,242	2019/2/27
い第769号農林債券		0.3	100,000	100,201	2019/6/27
い第774号農林債券		0.24	100,000	99,837	2019/11/27
第263回信金中金債		0.5	100,000	100,525	2016/10/27
第269回信金中金債		0.4	50,000	50,255	2017/4/27
第270回信金中金債		0.35	50,000	50,217	2017/5/26
第271回信金中金債		0.35	100,000	100,454	2017/6/27
第286回信金中金債		0.35	100,000	100,586	2018/9/27
第288回信金中金債		0.3	200,000	200,812	2018/11/27
第291回信金中金債		0.25	100,000	100,204	2019/2/27
第8号商工債券（10年）		1.66	100,000	105,247	2018/12/20
第175号商工債券（3年）		0.15	100,000	100,003	2017/8/25
小 計			3,190,000	3,205,684	
普通社債券					
第459回東京電力		2.7	80,000	84,313	2019/1/29
第524回東京電力		1.795	100,000	101,508	2017/3/14
第532回東京電力		1.75	120,000	122,220	2017/9/28
第534回東京電力		2.055	100,000	103,028	2019/10/29
第536回東京電力		1.672	100,000	101,630	2018/1/29
第544回東京電力		1.976	100,000	102,765	2018/6/25
第559回東京電力		1.377	60,000	60,063	2019/10/29
第567回東京電力		1.958	100,000	97,149	2030/7/29
第490回中部電力		1.444	70,000	73,271	2019/7/25
第498回中部電力		0.566	100,000	100,888	2017/9/25
第499回中部電力		1.194	50,000	52,176	2023/6/23
第448回関西電力		2.16	100,000	105,482	2018/6/20
第456回関西電力		2.01	100,000	103,703	2017/7/25
第473回関西電力		1.665	100,000	104,658	2019/4/25
第485回関西電力		1.285	100,000	103,539	2020/12/18
第374回中国電力		0.814	100,000	102,063	2020/2/25
第376回中国電力		0.628	100,000	101,138	2018/6/25
第379回中国電力		0.619	100,000	100,989	2021/1/25
第288回北陸電力		1.89	100,000	104,179	2017/10/25
第303回北陸電力		0.756	100,000	101,710	2019/6/25

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第383回東北電力	2.9	100,000	106,945	2017/12/25
第445回東北電力	1.792	100,000	105,218	2018/11/22
第448回東北電力	1.608	100,000	105,129	2019/5/24
第456回東北電力	1.176	100,000	103,863	2020/11/25
第245回四国電力	2.0	100,000	109,362	2021/6/25
第279回四国電力	0.579	100,000	100,994	2018/2/23
第394回九州電力	1.86	100,000	103,773	2017/9/25
第400回九州電力	1.777	100,000	106,365	2020/4/24
第408回九州電力	1.672	100,000	105,199	2019/6/25
第423回九州電力	0.959	100,000	102,310	2019/9/25
第429回九州電力	0.909	100,000	99,463	2024/9/25
第256回北海道電力	3.7	80,000	82,175	2016/2/25
第261回北海道電力	2.775	24,000	25,482	2017/11/24
第310回北海道電力	1.286	50,000	52,118	2020/12/25
第315回北海道電力	0.82	100,000	101,427	2018/4/25
第19回沖縄電力	1.452	80,000	84,653	2020/4/24
第7回新関西国際空港	0.217	200,000	200,298	2016/12/20
第344回東京交通債券	1.67	100,000	109,292	2023/2/17
第347回東京交通債券	2.05	100,000	113,118	2024/3/8
第25回関西国際空港	1.361	100,000	105,493	2020/6/19
第38回関西国際空港	1.112	50,000	52,476	2021/12/20
第10回成田国際空港	1.094	160,000	167,808	2021/9/17
第11回成田国際空港	1.067	100,000	104,752	2022/2/18
第12回成田国際空港	0.879	100,000	103,351	2022/9/20
第13回成田国際空港	0.802	100,000	102,707	2023/2/8
第3回セブン&アイ・ホールディングス	1.94	100,000	105,540	2018/6/20
第8回旭化成	1.455	100,000	105,530	2019/12/11
第48回住友化学	0.623	100,000	101,208	2018/6/12
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	103,375	2022/12/2
第18回豊田自動織機	2.109	100,000	107,364	2019/3/20
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	104,973	2021/9/17
第10回小松製作所	0.275	100,000	100,346	2019/6/20
第1回日本電産	0.386	100,000	100,536	2017/9/20
第12回パナソニック	0.387	100,000	99,857	2020/3/19
第22回三菱重工業	2.03	100,000	104,428	2017/9/12
第29回三菱重工業	0.662	100,000	100,232	2024/9/3
第1回B号日本生命2011基金	1.12	100,000	101,780	2017/8/5
第1回日本生命2012基金	0.87	100,000	101,580	2018/8/3
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,158	2019/8/7
第55回日産自動車	0.415	100,000	100,605	2018/3/20
第57回日産自動車	0.314	100,000	100,229	2019/3/20
第5回凸版印刷	1.397	100,000	105,949	2020/12/16
第3回大日本印刷	1.358	100,000	105,728	2020/12/18
第48回伊藤忠商事	1.9	100,000	104,353	2017/11/20
第59回三井物産	2.11	100,000	107,225	2019/3/20
第69回三菱商事	1.99	100,000	105,488	2018/5/22

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78回三菱商事		1.155	100,000	105,100	2022/3/9
第7回みずほコーポレート銀行 (同順位特約付)		2.08	100,000	104,164	2017/7/27
第7回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)		2.5	100,000	108,521	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	106,950	2021/10/29
第9回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)		2.2	100,000	113,366	2026/10/30
第27回みずほコーポレート銀行		0.515	200,000	200,950	2016/10/20
第28回みずほコーポレート銀行		0.515	200,000	201,124	2017/1/25
第29回みずほコーポレート銀行		0.46	100,000	100,532	2017/4/21
第30回みずほコーポレート銀行		0.34	100,000	100,336	2017/7/25
第31回みずほコーポレート銀行		0.33	200,000	200,690	2017/10/25
第32回みずほコーポレート銀行		0.27	100,000	100,213	2018/1/24
第9回三菱東京UFJ銀行		2.69	100,000	111,596	2020/2/27
第12回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)		2.16	100,000	104,286	2017/7/28
第28回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)		1.56	100,000	106,366	2021/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)		2.46	100,000	117,405	2031/1/20
第87回三菱東京UFJ銀行		1.87	100,000	103,330	2017/4/20
第124回三菱東京UFJ銀行		1.51	100,000	106,882	2021/4/16
第126回三菱東京UFJ銀行		0.545	200,000	200,926	2016/7/14
第1回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位)		0.345	100,000	100,401	2017/6/7
第5回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位)		0.285	200,000	200,656	2018/11/28
第6回住友信託銀行 (劣後特約付)		2.78	100,000	119,577	2026/4/27
第6回セブン銀行		0.398	100,000	100,519	2017/6/20
第22回三井住友銀行 (劣後特約付)		1.43	100,000	105,449	2020/9/28
第23回三井住友銀行 (劣後特約付)		1.61	100,000	106,585	2020/12/17
第25回三井住友銀行 (劣後特約付)		2.21	100,000	114,182	2026/6/1
第54回三井住友銀行		0.49	100,000	100,405	2016/7/20
第57回三井住友銀行		0.28	200,000	200,614	2017/10/20
第5回みずほ銀行 (劣後特約付)		2.49	100,000	116,154	2026/1/30
第6回みずほ銀行 (劣後特約付)		2.25	100,000	102,894	2016/11/4
第8回みずほ銀行 (劣後特約付)		1.99	100,000	103,321	2017/4/27
第9回みずほ銀行 (劣後特約付)		2.52	100,000	117,021	2027/4/27
第28回日産フィナンシャルサービス		0.253	100,000	100,151	2019/6/20
第29回ホンダファイナンス		0.428	100,000	100,359	2021/3/19
第62回トヨタファイナンス		0.203	100,000	99,871	2019/12/20
第52回日立キャピタル		0.508	200,000	201,196	2021/6/18
第152回オリックス		0.92	100,000	100,944	2016/8/31
第176回オリックス		0.354	100,000	100,095	2019/2/27
第9回三井住友ファイナンス&リース		0.518	200,000	202,120	2021/1/29
第27回野村ホールディングス		2.107	100,000	110,948	2025/9/24
第39回野村ホールディングス		0.853	100,000	101,585	2018/2/26
第43回野村ホールディングス		0.454	100,000	100,394	2019/2/25
第2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回		1.98	100,000	104,812	2018/6/20
第87回三菱地所		1.77	100,000	104,135	2017/11/15
第98回三菱地所		1.165	100,000	104,646	2020/6/19
第105回三菱地所		1.178	100,000	105,457	2022/3/23
第112回三菱地所		0.577	100,000	101,682	2020/12/25

銘柄	当 期 末	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券		%	千円	千円	
第114回三菱地所		0.187	100,000	100,156	2018/3/15
第116回三菱地所		0.643	100,000	100,764	2024/9/19
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発		1.12	100,000	104,628	2021/9/17
第17回エヌ・ティ・ティ都市開発		0.61	100,000	99,713	2024/9/20
第54回小田急電鉄		0.956	100,000	102,136	2017/12/15
第25回京王電鉄		1.695	100,000	104,007	2017/11/29
第5回東日本旅客鉄道		3.3	100,000	105,705	2017/2/25
第15回東日本旅客鉄道		2.65	100,000	112,391	2020/8/25
第26回東日本旅客鉄道		1.19	100,000	105,714	2022/12/20
第56回東日本旅客鉄道		1.7	100,000	105,466	2018/12/20
第58回東日本旅客鉄道		1.58	100,000	105,258	2019/3/20
第60回東日本旅客鉄道		1.449	100,000	105,128	2019/7/24
第62回東日本旅客鉄道		1.424	100,000	105,173	2019/9/27
第79回東日本旅客鉄道		1.131	100,000	105,002	2021/9/29
第83回東日本旅客鉄道		1.633	100,000	110,172	2026/12/22
第100回東日本旅客鉄道		1.981	100,000	105,096	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道		2.28	123,000	138,980	2022/3/25
第53回東海旅客鉄道		1.797	100,000	111,096	2030/10/25
第56回東海旅客鉄道		2.083	100,000	114,968	2031/5/26
第11回東京地下鉄		1.16	100,000	105,312	2021/12/9
第5回日本通運		1.818	100,000	106,440	2019/5/31
第5回関西高速鉄道		1.238	100,000	105,114	2020/9/10
第52回日本電信電話		1.77	100,000	103,059	2017/3/17
第59回日本電信電話		1.69	100,000	106,093	2019/6/20
第63回日本電信電話		0.69	100,000	101,818	2023/3/20
第19回KDDI		1.151	100,000	104,260	2020/6/19
第21回KDDI		0.669	100,000	100,636	2024/9/20
第15回エヌ・ティ・ティ・ドコモ		1.96	100,000	105,570	2018/6/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ		0.73	100,000	101,936	2023/9/20
第29回電源開発		1.405	100,000	104,613	2019/11/20
第40回電源開発		0.889	100,000	101,301	2024/6/20
第23回東京ガス		1.01	100,000	104,448	2023/6/9
第9回大阪ガス		2.9	100,000	107,510	2018/1/30
第25回エヌ・ティ・ティ・データ		1.47	100,000	105,925	2020/3/19
第14回GEキャピタルコーポレーション		1.84	100,000	100,901	2015/11/20
第23回GEキャピタルコーポレーション		0.45	200,000	200,758	2016/9/20
第8回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー		1.05	100,000	100,670	2016/2/22
第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー		1.32	100,000	101,873	2017/2/9
第5回バークレイズ・バンク		1.29	100,000	100,364	2015/9/9
第5回ナショナル・オーストラリア銀行		1.01	100,000	100,636	2016/2/4
第8回ナショナル・オーストラリア銀行		1.3	100,000	101,919	2017/1/20
第11回ナショナル・オーストラリア銀行		0.284	100,000	99,795	2020/1/16
第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行		0.89	200,000	201,606	2016/6/10
第7回ウエストバック・バンキング・コーポレーション		1.07	100,000	100,295	2015/9/3
第8回ウエストバック・バンキング・コーポレーション		1.0	100,000	101,070	2016/8/12
第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行		0.98	200,000	201,164	2016/1/21

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第9回ラボバンク・ネダーランド	1.81	100,000	106,490	2021/1/28
第17回ラボバンク・ネダーランド	0.563	100,000	100,192	2015/11/2
第22回ラボバンク・ネダーランド	0.377	100,000	100,246	2016/12/19
第23回ラボバンク・ネダーランド	0.557	100,000	100,544	2018/12/19
第4回ウォルマート・ストアーズ・インク	0.94	100,000	100,179	2015/7/28
第2回エイチエスビーシー・バンク・ビーエルシー	1.01	100,000	100,286	2015/9/10
小 計		17,347,000	17,990,217	
合 計		322,415,359	341,796,080	

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
			1,172 百万円 —

○投資信託財産の構成

(2015年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 341,796,080	% 99.0
コール・ローン等、その他	3,417,894	1.0
投資信託財産総額	345,213,974	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	345,213,974,303
コール・ローン等	2,445,886,194
公社債(評価額)	341,796,080,298
未収利息	901,049,847
前払費用	63,447,964
差入委託証拠金	7,510,000
(B) 負債	1,379,465,348
未払金	1,049,268,240
未払解約金	330,197,108
(C) 純資産総額(A-B)	343,834,508,955
元本	273,489,284,775
次期繰越損益金	70,345,224,180
(D) 受益権総口数	273,489,284,775口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,572円

<注記事項>

①期首元本額	230,228,174,698円
期中追加設定元本額	135,484,008,244円
期中一部解約元本額	92,222,898,167円

○損益の状況 (2014年5月13日～2015年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,580,137,465
受取利息	3,580,137,465
(B) 有価証券売買損益	2,569,001,889
売買益	3,955,960,885
売買損	△ 1,386,958,996
(C) 先物取引等取引損益	20,317,520
取引益	37,611,520
取引損	△ 17,294,000
(D) 当期損益金(A+B+C)	6,169,456,874
(E) 前期繰越損益金	52,934,367,849
(F) 追加信託差損益金	35,101,089,484
(G) 解約差損益金	△23,859,690,027
(H) 計(D+E+F+G)	70,345,224,180
次期繰越損益金(H)	70,345,224,180

(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）

ファンド・マネジャー（国内債券）	11,743,442,447円
eMAXIS 国内債券インデックス	15,203,434,833円
eMAXIS バランス（８資産均等型）	1,125,523,640円
eMAXIS バランス（波乗り型）	68,871,133円
コアバランス	2,230,302円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	10,259,490,415円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	5,114,470,182円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	159,053,540円
三菱UFJ バランスファンド４５VA（適格機関投資家限定）	44,439,863,200円
三菱UFJ バランスファンド４０VA（適格機関投資家限定）	18,281,244,331円
三菱UFJ バランスファンドVA ２０型（適格機関投資家限定）	2,609,072,273円
三菱UFJ バランスファンドVA ４０型（適格機関投資家限定）	7,926,797,815円
MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	113,326,227,570円
三菱UFJ バランスファンドVA ５０型（適格機関投資家限定）	8,784,466,902円
三菱UFJ バランスファンドVA ７５型（適格機関投資家限定）	3,742,701,820円
三菱UFJ バランスファンド５５VA（適格機関投資家限定）	2,524,370,601円
三菱UFJ バランスファンドVA ４５型（適格機関投資家限定）	915,214,832円
三菱UFJ バランスファンドVA ３０型（適格機関投資家限定）	241,721,037円
三菱UFJ バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	6,553,563,529円
三菱UFJ バランスファンド２０VA（適格機関投資家限定）	4,817,510,263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）	63,861,023円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	114,650,402円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	231,532,019円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	202,662,382円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	122,882,547円
三菱UFJ 日本債券インデックスファンドVA	26,872,804円
三菱UFJ バランスVA３０D（適格機関投資家限定）	409,759,981円
三菱UFJ バランスVA６０D（適格機関投資家限定）	1,194,737,135円
三菱UFJ バランスVA３０G（適格機関投資家限定）	494,881,793円
三菱UFJ バランスVA６０G（適格機関投資家限定）	1,203,556,358円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	2,494,686,393円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	1,702,858,889円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	3,505,625,283円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	1,792,846,196円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	1,044,074,228円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	533,454,470円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	228,713,599円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	224,657,170円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	57,701,438円
合計	273,489,284,775円

【お 知 ら せ】

①新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。

（2014年12月1日）

②デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。

（2014年12月1日）

外国債券インデックスマザーファンド

《第14期》決算日2015年5月12日

[計算期間：2014年5月13日～2015年5月12日]

「外国債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第14期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
主 要 運 用 対 象	シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	シティ世界国債インデックス		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 額	
		期 騰 落 率	(除く日本、円換算ベース) 期 騰 落 率				
	円	%	%	%	%	百万円	
10期(2011年5月12日)	13,067	△ 4.4	73,213.13	△ 4.5	98.5	—	158,541
11期(2012年5月14日)	13,365	2.3	74,734.13	2.1	98.7	—	158,535
12期(2013年5月13日)	17,815	33.3	99,491.98	33.1	98.8	—	195,142
13期(2014年5月12日)	18,707	5.0	104,415.94	4.9	98.8	—	185,030
14期(2015年5月12日)	20,959	12.0	117,169.90	12.2	98.8	—	159,683

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額	シティ世界国債インデックス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率	(除く日本、 円換算ベース)	騰 落 率		
(期 首) 2014年 5月12日	円	% —	104,415.94	% —	% 98.8	% —
5 月末	18,674	△ 0.2	104,276.02	△ 0.1	98.6	—
6 月末	18,744	0.2	104,586.39	0.2	98.7	—
7 月末	18,924	1.2	105,597.74	1.1	98.6	—
8 月末	19,232	2.8	107,314.36	2.8	98.9	—
9 月末	19,776	5.7	110,380.11	5.7	98.7	—
10月末	19,819	5.9	110,709.92	6.0	98.7	—
11月末	21,500	14.9	120,157.50	15.1	98.8	—
12月末	21,729	16.2	121,431.58	16.3	97.9	—
2015年 1 月末	21,087	12.7	117,794.90	12.8	98.7	—
2 月末	21,142	13.0	118,061.84	13.1	98.8	—
3 月末	21,057	12.6	117,453.68	12.5	98.6	—
4 月末	21,051	12.5	117,705.99	12.7	98.7	—
(期 末) 2015年 5月12日	20,959	12.0	117,169.90	12.2	98.8	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ12.0%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(12.2%)を0.2%下回りました。

基準価額の推移

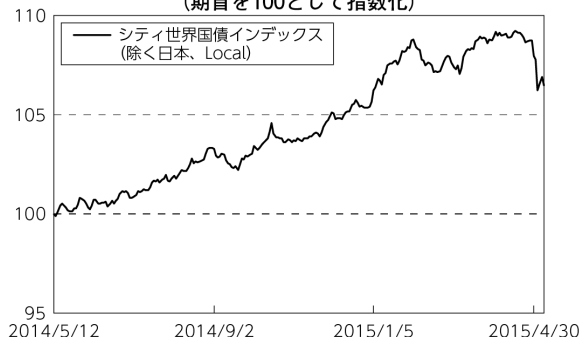


(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●投資環境について

債券市況の推移

(期首を100として指数化)

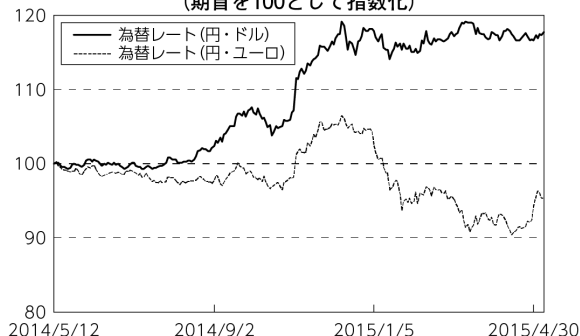


◎外国債券市況

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

為替市況の推移

(期首を100として指数化)



◎為替市況

- ・円・ドル相場は、日銀による追加金融緩和策の発表・実施や、FRB(米連邦準備制度理事会)による利上げ観測の高まりなどから、ドルが対円で買われました。期首との比較では、ドルは対円で17.8%上昇しました。

- ・円・ユーロ相場は、ECBによる追加緩和策の発表・実施や、ギリシャの情勢不安などを背景に、ユーロが対円で売られました。期首との比較では、ユーロは対円で4.6%下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは12.2%の上昇となったため、カイ離は△0.2%程度となりました。

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

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は0.0%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

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

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は△0.2%程度でした。
為替の効果および債券の効果による要因です。
為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。
債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

○今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2014年 5 月13日～2015年 5 月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 3	% 0.013	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(3)	(0.013)	外国での資産の保管等に要する費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	3	0.013	
期中の平均基準価額は、20,227円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2014年5月13日～2015年5月12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 177,776	千アメリカドル 320,299
	カナダ	国債証券	千カナダドル 10,576	千カナダドル 19,903
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 47,517	千メキシコペソ 84,898
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	17,825	46,891
	イタリア	国債証券	21,435	50,308
	フランス	国債証券	21,009	52,647
	オランダ	国債証券	4,271	12,205
	スペイン	国債証券	17,142	31,203
	ベルギー	国債証券	3,511	11,746
	オーストリア	国債証券	2,571	8,295
	フィンランド	国債証券	1,202	3,770
	アイルランド	国債証券	1,822	4,387
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 11,876	千イギリスポンド 30,835
	スイス	国債証券	千スイスフラン 57	千スイスフラン 2,684
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 7,497	千スウェーデンクローネ 23,858
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 6,347	千ノルウェークローネ 17,616
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 6,762	千デンマーククローネ 29,794
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 10,451	千ポーランドズロチ 19,786
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 6,676	千オーストラリアドル 9,586
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 1,817	千シンガポールドル 3,485
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリングgit 6,524	千マレーシアリングgit 11,303
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 19,422	千南アフリカランド 30,363

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2014年5月13日～2015年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	16,442	2,067	12.6	63,334	4,739	7.5

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

○組入資産の明細

(2015年5月12日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 533,400	千アメリカドル 549,586	千円 66,032,792	% 41.4	% —	% 15.6	% 15.7	% 10.0
カナダ	千カナダドル 33,250	千カナダドル 37,092	3,681,828	2.3	—	1.1	0.7	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 194,300	千メキシコペソ 216,031	1,691,524	1.1	—	0.6	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	76,140	90,255	12,075,349	7.6	—	4.4	2.1	1.1
イタリア	97,650	116,776	15,623,525	9.8	—	6.0	2.8	0.9
フランス	93,450	112,926	15,108,466	9.5	—	5.8	2.6	1.1
オランダ	25,650	30,103	4,027,612	2.5	—	1.5	0.7	0.3
スペイン	54,250	64,246	8,595,565	5.4	—	3.0	1.6	0.8
ベルギー	24,400	30,460	4,075,323	2.6	—	1.8	0.6	0.2
オーストリア	15,400	18,770	2,511,327	1.6	—	1.0	0.4	0.2
フィンランド	6,100	6,941	928,685	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	7,700	9,237	1,235,820	0.8	—	0.4	0.4	—
イギリス	千イギリスポンド 60,435	千イギリスポンド 71,725	13,416,909	8.4	—	6.2	1.8	0.4
スイス	千スイスフラン 3,130	千スイスフラン 3,779	485,129	0.3	—	0.2	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 46,800	千スウェーデンクローネ 54,819	791,599	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 27,000	千ノルウェークローネ 29,479	467,247	0.3	—	0.2	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 48,700	千デンマーククローネ 61,714	1,105,930	0.7	—	0.5	0.2	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 25,900	千ポーランドズロチ 28,058	919,744	0.6	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 26,800	千オーストラリアドル 29,356	2,782,667	1.7	—	0.9	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 6,240	千シンガポールドル 6,484	581,784	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 25,200	千マレーシアリンギット 25,433	842,880	0.5	—	0.2	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 87,600	千南アフリカランド 84,938	844,293	0.5	—	0.4	0.1	—
合 計	—	—	157,826,009	98.8	—	50.8	31.8	16.3

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄			柄		当 期 末				償還年月日
					利 率	額面金額	評 価 額		
							外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
国債証券	0.25 T-NOTE 160515	0.25	3,000	2,998	360,238	2016/ 5 /15			
	0.375 T-NOTE 160430	0.375	1,000	1,000	120,267	2016/ 4 /30			
	0.375 T-NOTE 161031	0.375	1,500	1,498	179,992	2016/10/31			
	0.5 T-NOTE 160615	0.5	4,000	4,007	481,538	2016/ 6 /15			
	0.5 T-NOTE 160731	0.5	2,300	2,303	276,722	2016/ 7 /31			
	0.5 T-NOTE 160831	0.5	1,300	1,301	156,347	2016/ 8 /31			
	0.5 T-NOTE 160930	0.5	2,300	2,301	276,550	2016/ 9 /30			
	0.5 T-NOTE 161130	0.5	500	500	60,079	2016/11/30			
	0.5 T-NOTE 170731	0.5	2,800	2,785	334,659	2017/ 7 /31			
	0.625 T-NOTE 160715	0.625	4,000	4,011	482,008	2016/ 7 /15			
	0.625 T-NOTE 160815	0.625	3,000	3,008	361,421	2016/ 8 /15			
	0.625 T-NOTE 161015	0.625	3,000	3,007	361,308	2016/10/15			
	0.625 T-NOTE 161115	0.625	2,500	2,504	300,973	2016/11/15			
	0.625 T-NOTE 161215	0.625	3,100	3,105	373,090	2016/12/15			
	0.625 T-NOTE 170215	0.625	3,500	3,503	420,968	2017/ 2 /15			
	0.625 T-NOTE 170531	0.625	3,400	3,397	408,206	2017/ 5 /31			
	0.625 T-NOTE 170831	0.625	3,200	3,188	383,128	2017/ 8 /31			
	0.625 T-NOTE 171130	0.625	600	596	71,647	2017/11/30			
	0.75 T-NOTE 170115	0.75	3,400	3,411	409,866	2017/ 1 /15			
	0.75 T-NOTE 170315	0.75	3,000	3,009	361,534	2017/ 3 /15			
	0.75 T-NOTE 170630	0.75	2,700	2,702	324,709	2017/ 6 /30			
	0.75 T-NOTE 171031	0.75	2,700	2,693	323,682	2017/10/31			
	0.75 T-NOTE 171231	0.75	3,100	3,088	371,082	2017/12/31			
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	2,000	1,988	238,910	2018/ 2 /28			
	0.75 T-NOTE 180331	0.75	500	496	59,664	2018/ 3 /31			
	0.75 T-NOTE 180415	0.75	1,300	1,290	155,102	2018/ 4 /15			
	0.875 T-NOTE 160915	0.875	2,300	2,313	277,975	2016/ 9 /15			
	0.875 T-NOTE 161130	0.875	3,000	3,017	362,519	2016/11/30			
	0.875 T-NOTE 161231	0.875	3,200	3,218	386,747	2016/12/31			
	0.875 T-NOTE 170131	0.875	3,700	3,719	446,951	2017/ 1 /31			
	0.875 T-NOTE 170228	0.875	3,600	3,619	434,888	2017/ 2 /28			
	0.875 T-NOTE 170415	0.875	3,500	3,517	422,611	2017/ 4 /15			
	0.875 T-NOTE 170430	0.875	3,800	3,818	458,763	2017/ 4 /30			
	0.875 T-NOTE 170515	0.875	2,800	2,812	337,931	2017/ 5 /15			
	0.875 T-NOTE 170615	0.875	3,300	3,313	398,090	2017/ 6 /15			
	0.875 T-NOTE 170715	0.875	1,800	1,806	217,004	2017/ 7 /15			
	0.875 T-NOTE 170815	0.875	3,400	3,408	409,547	2017/ 8 /15			
	0.875 T-NOTE 171115	0.875	2,300	2,300	276,463	2017/11/15			
	0.875 T-NOTE 180115	0.875	1,200	1,198	144,027	2018/ 1 /15			
	0.875 T-NOTE 180131	0.875	2,300	2,297	275,988	2018/ 1 /31			
1 T-NOTE 160831	1.0	3,500	3,525	423,646	2016/ 8 /31				
1 T-NOTE 160930	1.0	4,200	4,231	508,473	2016/ 9 /30				
1 T-NOTE 161031	1.0	2,500	2,519	302,686	2016/10/31				
1 T-NOTE 170331	1.0	3,600	3,627	435,800	2017/ 3 /31				

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	1 T-NOTE 170915	1.0	5,000	5,024	603,636	2017/9/15
		1 T-NOTE 171215	1.0	3,300	3,309	397,656	2017/12/15
		1 T-NOTE 180215	1.0	1,000	1,001	120,342	2018/2/15
		1 T-NOTE 180315	1.0	1,000	1,000	120,248	2018/3/15
		1 T-NOTE 180531	1.0	3,200	3,195	383,969	2018/5/31
		1 T-NOTE 190630	1.0	3,600	3,540	425,443	2019/6/30
		1 T-NOTE 190831	1.0	1,000	980	117,850	2019/8/31
		1 T-NOTE 190930	1.0	1,800	1,762	211,792	2019/9/30
		1 T-NOTE 191130	1.0	2,200	2,148	258,114	2019/11/30
		1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,600	1,583	190,287	2019/5/31
		1.125 T-NOTE 191231	1.125	2,600	2,550	306,435	2019/12/31
		1.125 T-NOTE 200331	1.125	2,000	1,955	234,949	2020/3/31
		1.125 T-NOTE 200430	1.125	2,500	2,443	293,569	2020/4/30
		1.25 T-NOTE 181031	1.25	1,900	1,903	228,659	2018/10/31
		1.25 T-NOTE 181130	1.25	2,500	2,501	300,539	2018/11/30
		1.25 T-NOTE 190131	1.25	700	698	83,967	2019/1/31
		1.25 T-NOTE 191031	1.25	3,100	3,066	368,420	2019/10/31
		1.25 T-NOTE 200131	1.25	1,900	1,872	224,985	2020/1/31
		1.25 T-NOTE 200229	1.25	1,800	1,771	212,882	2020/2/29
		1.375 T-NOTE 180630	1.375	1,600	1,614	194,012	2018/6/30
		1.375 T-NOTE 180731	1.375	3,300	3,328	399,871	2018/7/31
		1.375 T-NOTE 180930	1.375	3,800	3,826	459,744	2018/9/30
		1.375 T-NOTE 181130	1.375	1,400	1,407	169,064	2018/11/30
		1.375 T-NOTE 181231	1.375	2,000	2,008	241,276	2018/12/31
		1.375 T-NOTE 190228	1.375	2,100	2,104	252,847	2019/2/28
		1.375 T-NOTE 200131	1.375	2,300	2,280	273,991	2020/1/31
		1.375 T-NOTE 200229	1.375	2,400	2,377	285,656	2020/2/29
		1.375 T-NOTE 200331	1.375	1,500	1,484	178,380	2020/3/31
		1.375 T-NOTE 200531	1.375	2,500	2,470	296,831	2020/5/31
		1.5 T-NOTE 160630	1.5	3,900	3,950	474,625	2016/6/30
		1.5 T-NOTE 160731	1.5	4,300	4,358	523,668	2016/7/31
		1.5 T-NOTE 180831	1.5	4,800	4,855	583,343	2018/8/31
		1.5 T-NOTE 181231	1.5	3,300	3,328	399,871	2018/12/31
		1.5 T-NOTE 190131	1.5	3,600	3,627	435,817	2019/1/31
		1.5 T-NOTE 190228	1.5	3,000	3,020	362,928	2019/2/28
		1.5 T-NOTE 190331	1.5	1,000	1,006	120,886	2019/3/31
		1.5 T-NOTE 190531	1.5	2,400	2,410	289,576	2019/5/31
		1.5 T-NOTE 191031	1.5	200	199	24,016	2019/10/31
		1.5 T-NOTE 191130	1.5	2,900	2,896	348,067	2019/11/30
		1.5 T-NOTE 220131	1.5	3,900	3,781	454,307	2022/1/31
		1.625 T-NOTE 190331	1.625	3,100	3,134	376,567	2019/3/31
		1.625 T-NOTE 190430	1.625	4,000	4,040	485,443	2019/4/30
		1.625 T-NOTE 190630	1.625	5,300	5,345	642,267	2019/6/30
		1.625 T-NOTE 190731	1.625	800	805	96,825	2019/7/31
		1.625 T-NOTE 190831	1.625	5,000	5,034	604,880	2019/8/31

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	1.625 T-NOTE 191231	1.625	500	501	60,281	2019/12/31
		1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,700	1,653	198,622	2022/ 8 /15
		1.625 T-NOTE 221115	1.625	3,000	2,910	349,664	2022/11/15
		1.75 T-NOTE 160531	1.75	2,700	2,740	329,296	2016/ 5 /31
		1.75 T-NOTE 181031	1.75	500	509	61,215	2018/10/31
		1.75 T-NOTE 190930	1.75	2,800	2,830	340,125	2019/ 9 /30
		1.75 T-NOTE 201031	1.75	3,300	3,304	396,990	2020/10/31
		1.75 T-NOTE 220228	1.75	2,700	2,658	319,412	2022/ 2 /28
		1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,800	1,771	212,789	2022/ 5 /15
		1.75 T-NOTE 230515	1.75	4,700	4,570	549,087	2023/ 5 /15
		1.875 T-NOTE 170831	1.875	3,400	3,485	418,834	2017/ 8 /31
		1.875 T-NOTE 170930	1.875	1,700	1,742	209,369	2017/ 9 /30
		1.875 T-NOTE 171031	1.875	2,500	2,563	307,989	2017/10/31
		1.875 T-NOTE 200630	1.875	2,100	2,124	255,311	2020/ 6 /30
		1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,400	2,387	286,906	2021/11/30
		2 T-NOTE 160430	2.0	2,100	2,134	256,484	2016/ 4 /30
		2 T-NOTE 200731	2.0	1,000	1,017	122,224	2020/ 7 /31
		2 T-NOTE 200930	2.0	1,600	1,624	195,168	2020/ 9 /30
		2 T-NOTE 201130	2.0	1,200	1,215	146,072	2020/11/30
		2 T-NOTE 210228	2.0	2,000	2,020	242,796	2021/ 2 /28
		2 T-NOTE 210531	2.0	2,300	2,317	278,428	2021/ 5 /31
		2 T-NOTE 210831	2.0	4,100	4,119	495,001	2021/ 8 /31
		2 T-NOTE 211031	2.0	3,700	3,712	446,013	2021/10/31
		2 T-NOTE 211115	2.0	2,900	2,910	349,714	2021/11/15
		2 T-NOTE 220215	2.0	1,000	1,002	120,403	2022/ 2 /15
		2 T-NOTE 230215	2.0	4,500	4,472	537,422	2023/ 2 /15
		2 T-NOTE 250215	2.0	6,400	6,248	750,757	2025/ 2 /15
		2.125 T-NOTE 200831	2.125	2,800	2,862	343,936	2020/ 8 /31
		2.125 T-NOTE 210131	2.125	3,400	3,460	415,786	2021/ 1 /31
		2.125 T-NOTE 210630	2.125	2,100	2,129	255,843	2021/ 6 /30
		2.125 T-NOTE 210815	2.125	5,100	5,164	620,544	2021/ 8 /15
		2.125 T-NOTE 210930	2.125	2,500	2,529	303,871	2021/ 9 /30
		2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,500	2,524	303,331	2021/12/31
		2.25 T-NOTE 171130	2.25	2,600	2,690	323,262	2017/11/30
		2.25 T-NOTE 210331	2.25	2,400	2,456	295,118	2021/ 3 /31
		2.25 T-NOTE 210430	2.25	1,400	1,432	172,060	2021/ 4 /30
		2.25 T-NOTE 210731	2.25	4,000	4,083	490,587	2021/ 7 /31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	5,000	4,994	600,092	2024/11/15
		2.375 T-NOTE 170731	2.375	3,200	3,316	398,462	2017/ 7 /31
		2.375 T-NOTE 180531	2.375	1,100	1,144	137,467	2018/ 5 /31
		2.375 T-NOTE 180630	2.375	1,000	1,039	124,946	2018/ 6 /30
		2.375 T-NOTE 201231	2.375	1,100	1,135	136,460	2020/12/31
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	6,000	6,067	729,066	2024/ 8 /15
		2.5 T-BOND 450215	2.5	3,500	3,134	376,566	2045/ 2 /15
		2.5 T-NOTE 170630	2.5	2,400	2,491	299,387	2017/ 6 /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	2.5 T-NOTE 230815	2.5	3,100	3,187	383,027	2023/8/15			
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	6,500	6,650	799,035	2024/5/15			
	2.625 T-NOTE 160430	2.625	1,300	1,329	159,727	2016/4/30			
	2.625 T-NOTE 180131	2.625	1,500	1,568	188,468	2018/1/31			
	2.625 T-NOTE 180430	2.625	900	942	113,271	2018/4/30			
	2.625 T-NOTE 200815	2.625	2,300	2,410	289,600	2020/8/15			
	2.625 T-NOTE 201115	2.625	5,700	5,963	716,556	2020/11/15			
	2.75 T-BOND 420815	2.75	3,300	3,125	375,555	2042/8/15			
	2.75 T-BOND 421115	2.75	4,300	4,069	488,996	2042/11/15			
	2.75 T-NOTE 161130	2.75	1,300	1,345	161,643	2016/11/30			
	2.75 T-NOTE 170531	2.75	1,500	1,562	187,793	2017/5/31			
	2.75 T-NOTE 171231	2.75	2,200	2,305	277,061	2017/12/31			
	2.75 T-NOTE 180228	2.75	1,500	1,574	189,201	2018/2/28			
	2.75 T-NOTE 190215	2.75	3,200	3,371	405,070	2019/2/15			
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	4,000	4,185	502,940	2023/11/15			
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	4,100	4,282	514,590	2024/2/15			
	2.875 T-BOND 430515	2.875	4,000	3,879	466,144	2043/5/15			
	2.875 T-NOTE 180331	2.875	1,400	1,475	177,270	2018/3/31			
	3 T-BOND 420515	3.0	1,500	1,493	179,450	2042/5/15			
	3 T-BOND 441115	3.0	3,500	3,482	418,389	2044/11/15			
	3 T-NOTE 160831	3.0	3,000	3,100	372,572	2016/8/31			
	3 T-NOTE 160930	3.0	3,000	3,106	373,248	2016/9/30			
	3 T-NOTE 170228	3.0	2,400	2,503	300,851	2017/2/28			
	3.125 T-BOND 411115	3.125	800	818	98,316	2041/11/15			
	3.125 T-BOND 420215	3.125	500	510	61,332	2042/2/15			
	3.125 T-BOND 430215	3.125	4,400	4,480	538,283	2043/2/15			
	3.125 T-BOND 440815	3.125	2,800	2,853	342,885	2044/8/15			
	3.125 T-NOTE 161031	3.125	2,800	2,907	349,390	2016/10/31			
	3.125 T-NOTE 170131	3.125	3,100	3,235	388,803	2017/1/31			
	3.125 T-NOTE 170430	3.125	2,100	2,202	264,585	2017/4/30			
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	3,400	3,632	436,403	2019/5/15			
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	2,800	3,002	360,705	2021/5/15			
	3.25 T-NOTE 160531	3.25	2,100	2,164	260,101	2016/5/31			
	3.25 T-NOTE 160630	3.25	2,400	2,478	297,833	2016/6/30			
	3.25 T-NOTE 160731	3.25	2,800	2,897	348,168	2016/7/31			
	3.25 T-NOTE 161231	3.25	2,800	2,923	351,309	2016/12/31			
	3.25 T-NOTE 170331	3.25	1,400	1,469	176,515	2017/3/31			
	3.375 T-BOND 440515	3.375	2,900	3,098	372,253	2044/5/15			
	3.375 T-NOTE 191115	3.375	3,300	3,567	428,679	2019/11/15			
	3.5 T-BOND 390215	3.5	800	872	104,860	2039/2/15			
	3.5 T-NOTE 180215	3.5	1,600	1,711	205,689	2018/2/15			
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	1,500	1,636	196,586	2020/5/15			
	3.625 T-BOND 430815	3.625	4,600	5,135	617,026	2043/8/15			
	3.625 T-BOND 440215	3.625	2,600	2,905	349,047	2044/2/15			
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	2,600	2,834	340,529	2019/8/15			

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	3.625 T-NOTE 200215	3.625	4,400	4,816	578,717	2020/ 2 /15
		3.625 T-NOTE 210215	3.625	2,300	2,530	304,044	2021/ 2 /15
		3.75 T-BOND 410815	3.75	300	342	41,111	2041/ 8 /15
		3.75 T-BOND 431115	3.75	2,200	2,511	301,769	2043/11/15
		3.75 T-NOTE 181115	3.75	3,000	3,262	391,961	2018/11/15
		3.875 T-BOND 400815	3.875	1,600	1,851	222,502	2040/ 8 /15
		3.875 T-NOTE 180515	3.875	1,100	1,193	143,430	2018/ 5 /15
		4 T-NOTE 180815	4.0	1,900	2,078	249,758	2018/ 8 /15
		4.25 T-BOND 390515	4.25	800	976	117,349	2039/ 5 /15
		4.25 T-BOND 401115	4.25	1,700	2,084	250,451	2040/11/15
		4.25 T-NOTE 171115	4.25	1,500	1,627	195,593	2017/11/15
		4.375 T-BOND 380215	4.375	600	746	89,712	2038/ 2 /15
		4.375 T-BOND 391115	4.375	1,300	1,617	194,334	2039/11/15
		4.375 T-BOND 400515	4.375	1,800	2,245	269,746	2040/ 5 /15
		4.375 T-BOND 410515	4.375	1,200	1,505	180,833	2041/ 5 /15
		4.5 T-BOND 360215	4.5	1,300	1,649	198,221	2036/ 2 /15
		4.5 T-BOND 380515	4.5	800	1,011	121,569	2038/ 5 /15
		4.5 T-BOND 390815	4.5	1,200	1,518	182,455	2039/ 8 /15
		4.5 T-NOTE 170515	4.5	1,100	1,184	142,294	2017/ 5 /15
		4.625 T-BOND 400215	4.625	2,000	2,580	310,043	2040/ 2 /15
		4.625 T-NOTE 161115	4.625	1,600	1,699	204,217	2016/11/15
		4.625 T-NOTE 170215	4.625	900	964	115,894	2017/ 2 /15
		4.75 T-BOND 410215	4.75	1,700	2,245	269,847	2041/ 2 /15
		4.75 T-NOTE 170815	4.75	2,400	2,616	314,368	2017/ 8 /15
		4.875 T-NOTE 160815	4.875	2,100	2,218	266,527	2016/ 8 /15
		5 T-BOND 370515	5.0	700	947	113,830	2037/ 5 /15
		5.125 T-NOTE 160515	5.125	1,700	1,782	214,148	2016/ 5 /15
		5.25 T-BOND 281115	5.25	800	1,048	126,014	2028/11/15
		5.25 T-BOND 290215	5.25	600	787	94,612	2029/ 2 /15
		5.375 T-BOND 310215	5.375	1,200	1,623	195,014	2031/ 2 /15
		5.5 T-BOND 280815	5.5	600	801	96,335	2028/ 8 /15
		6 T-BOND 260215	6.0	900	1,216	146,210	2026/ 2 /15
		6.125 T-BOND 271115	6.125	600	838	100,706	2027/11/15
		6.25 T-BOND 230815	6.25	1,700	2,237	268,802	2023/ 8 /15
		6.25 T-BOND 300515	6.25	700	1,016	122,149	2030/ 5 /15
		6.5 T-BOND 261115	6.5	400	566	68,049	2026/11/15
		7.25 T-BOND 160515	7.25	1,700	1,819	218,560	2016/ 5 /15
		7.5 T-BOND 161115	7.5	1,100	1,216	146,140	2016/11/15
		8 T-BOND 211115	8.0	1,200	1,647	197,988	2021/11/15
		8.125 T-BOND 190815	8.125	600	767	92,173	2019/ 8 /15
		8.75 T-BOND 170515	8.75	1,300	1,510	181,485	2017/ 5 /15
		8.75 T-BOND 200815	8.75	700	951	114,356	2020/ 8 /15
		8.875 T-BOND 190215	8.875	1,000	1,283	154,158	2019/ 2 /15
小	計					66,032,792	

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
カナダ	国債証券	1 CAN GOVT 160501	1.0	800	802	79,620	2016/5/1
		1 CAN GOVT 160801	1.0	1,900	1,907	189,314	2016/8/1
		1 CAN GOVT 161101	1.0	500	502	49,860	2016/11/1
		1.25 CAN GOVT 170801	1.25	900	910	90,405	2017/8/1
		1.25 CAN GOVT 180201	1.25	700	710	70,476	2018/2/1
		1.25 CAN GOVT 180301	1.25	800	812	80,665	2018/3/1
		1.25 CAN GOVT 180901	1.25	800	814	80,800	2018/9/1
		1.5 CAN GOVT 170201	1.5	400	405	40,252	2017/2/1
		1.5 CAN GOVT 170301	1.5	1,200	1,217	120,872	2017/3/1
		1.5 CAN GOVT 170901	1.5	1,100	1,120	111,234	2017/9/1
		1.5 CAN GOVT 200301	1.5	600	611	60,693	2020/3/1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	1,400	1,388	137,841	2023/6/1
		1.75 CAN GOVT 190301	1.75	900	929	92,301	2019/3/1
		1.75 CAN GOVT 190901	1.75	900	929	92,230	2019/9/1
		2 CAN GOVT 160601	2.0	800	810	80,474	2016/6/1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,100	1,145	113,744	2025/6/1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,100	1,173	116,522	2024/6/1
		2.75 CAN GOVT 160901	2.75	1,000	1,026	101,910	2016/9/1
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	1,000	1,086	107,800	2022/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	100	108	10,746	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	400	444	44,147	2064/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	1,000	1,116	110,818	2021/6/1
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	1,200	1,339	132,943	2020/6/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,700	2,109	209,425	2045/12/1
		3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,800	2,003	198,882	2019/6/1
		4 CAN GOVT 160601	4.0	1,800	1,861	184,819	2016/6/1
		4 CAN GOVT 170601	4.0	1,150	1,227	121,864	2017/6/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	1,400	1,833	181,967	2041/6/1
		4.25 CAN GOVT 180601	4.25	1,100	1,216	120,770	2018/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	1,200	1,748	173,542	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	1,000	1,444	143,369	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,100	1,672	166,019	2033/6/1
	8 CAN GOVT 270601	8.0	400	659	65,489	2027/6/1	
小 計						3,681,828	
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	18,700	24,160	189,173	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	5,300	7,330	57,398	2036/11/20
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	18,100	18,090	141,650	2018/6/14
		5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	7,800	7,927	62,068	2017/6/15
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	6,000	5,932	46,455	2019/12/11
		6.25 MEXICAN BONO 160616	6.25	11,000	11,309	88,551	2016/6/16
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	10,600	11,078	86,746	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	9,700	10,109	79,155	2022/6/9
		7.25 MEXICAN BONO 161215	7.25	12,100	12,727	99,658	2016/12/15
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	7,600	8,400	65,774	2027/6/3

銘 柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券	7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	13,100	14,133	110,661	2017/12/14
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	12,000	13,457	105,373	2031/ 5 /29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	4,600	5,170	40,488	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	10,500	11,851	92,797	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	8,500	9,496	74,357	2020/ 6 /11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	7,200	8,183	64,079	2023/12/ 7
		8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	13,900	15,514	121,479	2018/12/13
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	8,400	10,021	78,467	2029/ 5 /31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	9,200	11,135	87,188	2038/11/18
小 計						1,691,524	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 OBL 200417	—	1,100	1,095	146,550	2020/ 4 /17
		0 SCHATS 160916	—	1,400	1,404	187,914	2016/ 9 /16
		0 SCHATS 161216	—	1,000	1,003	134,291	2016/12/16
		0 SCHATS 170310	—	200	200	26,866	2017/ 3 /10
		0.25 OBL 180413	0.25	1,500	1,517	202,982	2018/ 4 /13
		0.25 OBL 191011	0.25	700	706	94,575	2019/10/11
		0.25 SCHATS 160610	0.25	1,300	1,306	174,831	2016/ 6 /10
		0.5 BUND 250215	0.5	1,300	1,286	172,118	2025/ 2 /15
		0.5 OBL 170407	0.5	1,700	1,723	230,524	2017/ 4 / 7
		0.5 OBL 171013	0.5	1,400	1,423	190,405	2017/10/13
		0.5 OBL 180223	0.5	1,500	1,527	204,307	2018/ 2 /23
		0.5 OBL 190412	0.5	1,600	1,633	218,484	2019/ 4 /12
		0.75 OBL 170224	0.75	1,300	1,322	176,944	2017/ 2 /24
		1 BUND 240815	1.0	1,500	1,558	208,521	2024/ 8 /15
		1 OBL 181012	1.0	1,200	1,244	166,512	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,400	1,455	194,704	2019/ 2 /22
		1.25 OBL 161014	1.25	1,700	1,736	232,264	2016/10/14
		1.5 BUND 220904	1.5	1,400	1,516	202,936	2022/ 9 / 4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,600	1,735	232,152	2023/ 2 /15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,800	1,953	261,412	2023/ 5 /15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,500	1,627	217,743	2024/ 5 /15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,700	1,872	250,460	2022/ 7 / 4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,800	1,993	266,686	2024/ 2 /15
		2 BUND 220104	2.0	1,500	1,671	223,673	2022/ 1 / 4
		2 BUND 230815	2.0	1,700	1,915	256,271	2023/ 8 /15
		2.25 BUND 200904	2.25	1,400	1,558	208,555	2020/ 9 / 4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,400	1,578	211,178	2021/ 9 / 4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,700	1,924	257,533	2021/ 1 / 4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,600	2,112	282,585	2044/ 7 / 4
		2.5 BUND 460815	2.5	800	1,062	142,127	2046/ 8 /15
		3 BUND 200704	3.0	1,900	2,183	292,127	2020/ 7 / 4
		3.25 BUND 200104	3.25	2,100	2,413	322,835	2020/ 1 / 4
		3.25 BUND 210704	3.25	2,000	2,372	317,443	2021/ 7 / 4
3.25 BUND 420704	3.25	1,100	1,626	217,567	2042/ 7 / 4		

銘			柄	当 期 末				
				利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ドイツ	国債証券	3.5 BUND 190704	3.5	2,800	3,206	429,024	2019/7/4	
		3.75 BUND 170104	3.75	1,800	1,918	256,656	2017/1/4	
		3.75 BUND 190104	3.75	1,900	2,164	289,534	2019/1/4	
		4 BUND 160704	4.0	2,100	2,201	294,571	2016/7/4	
		4 BUND 180104	4.0	1,800	1,998	267,384	2018/1/4	
		4 BUND 370104	4.0	2,200	3,416	457,077	2037/1/4	
		4.25 BUND 170704	4.25	2,000	2,191	293,133	2017/7/4	
		4.25 BUND 180704	4.25	1,800	2,047	273,935	2018/7/4	
		4.25 BUND 390704	4.25	1,200	1,977	264,607	2039/7/4	
		4.75 BUND 280704	4.75	900	1,343	179,701	2028/7/4	
		4.75 BUND 340704	4.75	1,700	2,788	373,052	2034/7/4	
		4.75 BUND 400704	4.75	1,300	2,309	309,016	2040/7/4	
		5.5 BUND 310104	5.5	1,500	2,492	333,468	2031/1/4	
		5.625 BUND 280104	5.625	1,100	1,742	233,152	2028/1/4	
		6 BUND 160620	6.0	140	149	20,016	2016/6/20	
		6.25 BUND 240104	6.25	1,100	1,641	219,554	2024/1/4	
6.25 BUND 300104	6.25	900	1,567	209,707	2030/1/4			
6.5 BUND 270704	6.5	1,100	1,836	245,661	2027/7/4			
イタリア	国債証券	0.75 ITALY GOVT 180115	0.75	900	911	121,886	2018/1/15	
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	200	202	27,155	2019/12/1	
		1.15 ITALY GOVT 170515	1.15	1,500	1,529	204,678	2017/5/15	
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	700	700	93,756	2022/4/15	
		1.5 ITALY GOVT 161215	1.5	1,300	1,328	177,762	2016/12/15	
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,000	1,035	138,559	2019/8/1	
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	400	390	52,236	2025/6/1	
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	700	639	85,608	2032/3/1	
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,300	1,372	183,675	2021/12/15	
		2.25 ITALY GOVT 160515	2.25	1,200	1,226	164,088	2016/5/15	
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,900	2,041	273,189	2019/5/1	
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,700	1,802	241,112	2024/12/1	
		2.75 ITALY GOVT 161115	2.75	900	935	125,185	2016/11/15	
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	700	766	102,540	2046/9/1	
		3.5 ITALY GOVT 171101	3.5	1,700	1,835	245,627	2017/11/1	
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	1,500	1,642	219,760	2018/6/1	
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,700	1,882	251,813	2018/12/1	
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,400	1,614	215,982	2030/3/1	
		3.75 ITALY GOVT 160801	3.75	2,400	2,508	335,545	2016/8/1	
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	2,100	2,418	323,622	2021/3/1	
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,700	1,958	261,991	2021/5/1	
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,800	3,232	432,508	2021/8/1	
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	2,100	2,450	327,907	2024/9/1	
		4 ITALY GOVT 170201	4.0	2,200	2,346	313,940	2017/2/1	
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,900	2,202	294,695	2020/9/1	
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,400	2,917	390,276	2037/2/1	
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	2,300	2,616	349,997	2019/2/1	

銘柄	銘柄		当期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	2,900	3,343	447,276	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	2,200	2,560	342,550	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	2,200	2,449	327,671	2018/2/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	2,100	2,375	317,820	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	2,200	2,529	338,400	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	2,400	2,816	376,870	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,100	1,341	179,413	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,100	2,572	344,202	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	2,000	2,498	334,274	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 160915	4.75	1,500	1,593	213,227	2016/9/15
		4.75 ITALY GOVT 170501	4.75	1,200	1,308	175,013	2017/5/1
		4.75 ITALY GOVT 170601	4.75	1,300	1,421	190,154	2017/6/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	2,500	3,037	406,370	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	2,300	2,851	381,492	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	1,500	1,936	259,144	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,400	1,949	260,814	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,700	2,108	282,063	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,800	2,312	309,408	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,000	2,743	367,093	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,700	2,377	318,067	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,600	2,244	300,310	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 170801	5.25	2,500	2,778	371,785	2017/8/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,600	3,548	474,768	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,800	2,304	308,312	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	2,000	2,562	342,823	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,150	1,693	226,572	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,700	4,016	537,334	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,400	3,550	475,061	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	800	1,229	164,481	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,400	2,209	295,643	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O.A.T 180225	—	100	100	13,403	2018/2/25
		0 O.A.T 200525	—	1,000	989	132,324	2020/5/25
		0.25 O.A.T 161125	0.25	1,500	1,509	201,959	2016/11/25
		0.5 O.A.T 191125	0.5	1,900	1,929	258,141	2019/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	1,200	1,153	154,390	2025/5/25
		1 BTAN 170725	1.0	2,200	2,255	301,696	2017/7/25
		1 O.A.T 180525	1.0	2,000	2,063	276,022	2018/5/25
		1 O.A.T 181125	1.0	2,000	2,068	276,771	2018/11/25
		1 O.A.T 190525	1.0	2,000	2,073	277,426	2019/5/25
		1.75 BTAN 170225	1.75	2,500	2,585	345,897	2017/2/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	2,500	2,718	363,641	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	2,600	2,817	376,917	2024/11/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	2,200	2,473	330,909	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	2,600	2,933	392,535	2024/5/25
		2.5 BTAN 160725	2.5	2,400	2,476	331,387	2016/7/25

銘 柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	2.5 O.A.T 201025	2.5	2,800	3,140	420,146	2020/10/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	1,800	2,113	282,700	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	3,100	3,695	494,380	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	3,000	3,517	470,666	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	3,500	4,135	553,278	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	1,300	1,775	237,566	2045/5/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	3,500	4,069	544,428	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	2,600	3,286	439,757	2026/4/25
		3.75 O.A.T 170425	3.75	3,200	3,444	460,794	2017/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	3,200	3,714	496,949	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	3,400	4,086	546,772	2021/4/25
		4 O.A.T 180425	4.0	2,600	2,911	389,561	2018/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	1,950	2,894	387,278	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,250	2,029	271,543	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	1,000	1,653	221,201	2060/4/25
		4.25 O.A.T 171025	4.25	3,100	3,431	459,106	2017/10/25
		4.25 O.A.T 181025	4.25	2,200	2,521	337,370	2018/10/25
		4.25 O.A.T 190425	4.25	2,600	3,028	405,215	2019/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	3,100	4,008	536,311	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	2,200	3,563	476,709	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	2,000	3,155	422,107	2035/4/25
		5 O.A.T 161025	5.0	2,500	2,687	359,610	2016/10/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	2,400	3,740	500,379	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	2,550	4,318	577,710	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	1,900	2,870	384,034	2025/10/25
		8.5 O.A.T 191025	8.5	1,000	1,371	183,466	2019/10/25
		8.5 O.A.T 230425	8.5	1,000	1,614	215,990	2023/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	100	100	13,409	2018/4/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	600	603	80,695	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	700	663	88,726	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 170415	0.5	1,000	1,012	135,502	2017/4/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	1,400	1,450	194,086	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	1,400	1,463	195,744	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,400	1,529	204,697	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,300	1,451	194,250	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,800	2,028	271,442	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 170115	2.5	1,200	1,254	167,796	2017/1/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	900	1,103	147,696	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	500	681	91,197	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,500	1,769	236,788	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	1,300	1,521	203,546	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	900	1,119	149,815	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,350	2,124	284,281	2042/1/15
		4 NETH GOVT 160715	4.0	1,300	1,364	182,527	2016/7/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	1,600	1,805	241,496	2018/7/15

銘柄				当期末			
				利 率	額面金額	評 価 額	
						外貨建金額	邦貨換算金額
ユーロ				%	千ユーロ	千ユーロ	千円
オランダ	国債証券	4 NETH GOVT 190715	4.0	1,400	1,628	217,930	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,200	1,851	247,709	2037/1/15
		4.5 NETH GOVT 170715	4.5	1,700	1,872	250,460	2017/7/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,100	1,702	227,810	2028/1/15
スペイン	国債証券	0.5 SPAIN GOVT 171031	0.5	700	705	94,355	2017/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	1,600	1,653	221,160	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,600	1,578	211,195	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	500	479	64,169	2030/7/30
		2.1 SPAIN GOVT 170430	2.1	2,000	2,077	278,002	2017/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	2,000	2,177	291,367	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,200	2,395	320,489	2024/10/31
		3.25 SPAIN GOVT 160430	3.25	1,500	1,546	206,916	2016/4/30
		3.3 SPAIN GOVT 160730	3.3	1,600	1,663	222,540	2016/7/30
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	1,600	1,786	239,055	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 170131	3.8	1,900	2,021	270,457	2017/1/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,800	2,117	283,303	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	2,100	2,431	325,266	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	1,700	1,905	254,906	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,500	1,877	251,237	2037/1/31
		4.25 SPAIN GOVT 161031	4.25	2,000	2,123	284,062	2016/10/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	2,000	2,323	310,901	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,700	2,080	278,287	2023/10/31
		4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	1,800	2,008	268,661	2018/1/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,800	2,103	281,460	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,400	1,773	237,269	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,100	1,493	199,870	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,200	1,509	201,985	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,600	1,939	259,466	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,150	1,598	213,809	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	800	1,073	143,636	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	800	1,177	157,529	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	1,600	2,061	275,767	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 170730	5.5	2,000	2,236	299,234	2017/7/30
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	2,100	2,645	353,910	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,600	2,359	315,733	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	2,000	2,598	347,653	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,100	1,540	206,124	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	2,200	3,182	425,774	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	800	792	106,052	2025/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	1,000	1,039	139,128	2018/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,200	1,352	180,905	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,400	1,622	217,087	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	1,000	1,125	150,594	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	800	1,014	135,770	2034/6/22
		3.25 BEL GOVT 160928	3.25	1,150	1,204	161,120	2016/9/28

銘			柄	当 期 末				
				利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ベルギー	国債証券	3.5 BEL GOVT 170628	3.5	1,100	1,185	158,596	2017/6/28	
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,600	1,902	254,511	2020/9/28	
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	600	895	119,768	2045/6/22	
		4 BEL GOVT 170328	4.0	1,000	1,078	144,292	2017/3/28	
		4 BEL GOVT 180328	4.0	1,000	1,117	149,557	2018/3/28	
		4 BEL GOVT 190328	4.0	1,200	1,382	184,999	2019/3/28	
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,200	1,489	199,296	2022/3/28	
		4 BEL GOVT 320328	4.0	700	984	131,657	2032/3/28	
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,300	1,619	216,626	2021/9/28	
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,300	1,651	220,922	2022/9/28	
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,300	2,044	273,491	2041/3/28	
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	800	1,093	146,291	2026/3/28	
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,650	2,666	356,770	2035/3/28	
		5.5 BEL GOVT 170928	5.5	800	907	121,427	2017/9/28	
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,500	2,290	306,456	2028/3/28	
オーストリア	国債証券	1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	400	433	57,933	2024/10/21	
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	1,300	1,419	189,876	2023/10/20	
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	1,300	1,399	187,180	2019/6/18	
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	400	481	64,395	2034/5/23	
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	650	929	124,331	2044/6/20	
		3.2 AUSTRIA GOVT 170220	3.2	800	847	113,400	2017/2/20	
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	800	969	129,754	2022/11/22	
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,200	1,437	192,336	2021/9/15	
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	600	732	97,934	2022/4/20	
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	100	176	23,640	2062/1/26	
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	1,100	1,309	175,138	2020/7/15	
		4 AUSTRIA GOVT 160915	4.0	1,100	1,161	155,425	2016/9/15	
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,350	2,098	280,723	2037/3/15	
		4.3 AUSTRIA GOVT 170915	4.3	500	551	73,805	2017/9/15	
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	1,300	1,514	202,607	2019/3/15	
		4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	1,200	1,352	180,921	2018/1/15	
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	700	989	132,444	2026/3/15	
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	600	967	129,477	2027/7/15	
フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	300	302	40,474	2020/9/15	
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	250	237	31,748	2031/4/15	
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	200	207	27,780	2018/9/15	
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	300	321	42,996	2023/4/15	
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	700	756	101,229	2022/9/15	
		1.875 FINNISH GOV 170415	1.875	500	519	69,554	2017/4/15	
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	300	334	44,728	2024/4/15	
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	350	462	61,815	2042/7/4	
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	400	486	65,142	2028/7/4	
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	500	578	77,377	2020/4/15	
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	600	712	95,385	2021/4/15	
		3.875 FINNISH GOVT170915	3.875	600	656	87,851	2017/9/15	

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	
	フィンランド	国債証券	4 FINNISH GOVT 250704	4.0	500	658	88,094	2025/ 7 / 4
			4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	600	706	94,506	2019/ 7 / 4
	アイルランド	国債証券	2 IRISH GOVT 450218	2.0	450	448	59,946	2045/ 2 /18
			2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	500	553	74,049	2030/ 5 /15
			3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	700	835	111,774	2024/ 3 /18
			3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	500	610	81,611	2023/ 3 /20
			4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	600	702	94,045	2019/ 6 /18
			4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	850	976	130,626	2018/10/18
			4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	1,100	1,315	176,014	2020/ 4 /18
			5 IRISH GOVT 201018	5.0	700	867	115,998	2020/10/18
			5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,000	1,377	184,268	2025/ 3 /13
			5.5 IRISH GOVT 171018	5.5	600	680	91,022	2017/10/18
			5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	700	870	116,462	2019/10/18
小 計						64,181,677		
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド			
	国債証券	1 GILT 170907	1.0	2,500	2,514	470,432	2017/ 9 / 7	
		1.25 GILT 180722	1.25	2,800	2,820	527,512	2018/ 7 /22	
		1.75 GILT 170122	1.75	1,500	1,529	286,173	2017/ 1 /22	
		1.75 GILT 190722	1.75	2,100	2,140	400,328	2019/ 7 /22	
		1.75 GILT 220907	1.75	2,200	2,200	411,676	2022/ 9 / 7	
		2 GILT 200722	2.0	1,700	1,744	326,285	2020/ 7 /22	
		2 GILT 250907	2.0	200	198	37,213	2025/ 9 / 7	
		2.25 GILT 230907	2.25	2,100	2,162	404,512	2023/ 9 / 7	
		2.75 GILT 240907	2.75	2,100	2,240	419,145	2024/ 9 / 7	
		3.25 GILT 440122	3.25	2,200	2,506	468,878	2044/ 1 /22	
		3.5 GILT 450122	3.5	1,300	1,551	290,232	2045/ 1 /22	
		3.5 GILT 680722	3.5	1,400	1,813	339,257	2068/ 7 /22	
		3.75 GILT 190907	3.75	1,500	1,657	310,009	2019/ 9 / 7	
		3.75 GILT 200907	3.75	1,700	1,900	355,558	2020/ 9 / 7	
		3.75 GILT 210907	3.75	2,000	2,261	422,961	2021/ 9 / 7	
		3.75 GILT 520722	3.75	1,100	1,424	266,456	2052/ 7 /22	
		4 GILT 160907	4.0	2,000	2,092	391,404	2016/ 9 / 7	
		4 GILT 220307	4.0	1,200	1,383	258,771	2022/ 3 / 7	
		4 GILT 600122	4.0	1,250	1,760	329,307	2060/ 1 /22	
		4.25 GILT 271207	4.25	1,200	1,477	276,392	2027/12/ 7	
		4.25 GILT 320607	4.25	1,800	2,275	425,565	2032/ 6 / 7	
		4.25 GILT 360307	4.25	1,735	2,235	418,116	2036/ 3 / 7	
		4.25 GILT 390907	4.25	1,100	1,447	270,716	2039/ 9 / 7	
		4.25 GILT 401207	4.25	1,600	2,118	396,237	2040/12/ 7	
		4.25 GILT 461207	4.25	1,600	2,196	410,933	2046/12/ 7	
		4.25 GILT 491207	4.25	1,300	1,821	340,777	2049/12/ 7	
		4.25 GILT 551207	4.25	1,250	1,815	339,677	2055/12/ 7	
		4.5 GILT 190307	4.5	1,600	1,800	336,887	2019/ 3 / 7	
		4.5 GILT 340907	4.5	1,900	2,501	467,849	2034/ 9 / 7	
		4.5 GILT 421207	4.5	1,650	2,296	429,593	2042/12/ 7	

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券	4.75 GILT 200307	4.75	1,800	2,084	389,891	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75	1,600	2,115	395,684	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	1,500	2,103	393,555	2038/12/7
		5 GILT 180307	5.0	1,800	2,007	375,580	2018/3/7
		5 GILT 250307	5.0	1,600	2,034	380,554	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	900	1,307	244,492	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	1,200	1,648	308,390	2021/6/7
		8.75 GILT 170825	8.75	450	534	99,892	2017/8/25
小 計						13,416,909	
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	350	397	50,999	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	400	454	58,310	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 180108	3.0	600	660	84,801	2018/1/8
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	470	537	68,991	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	360	473	60,788	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	550	813	104,471	2028/4/8
		4.25 SWISS GOVT 170605	4.25	400	442	56,765	2017/6/5
小 計						485,129	
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	5,500	5,873	84,807	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	5,700	6,635	95,812	2025/5/12
		3 SWD GOVT 160712	3.0	4,600	4,778	68,998	2016/7/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	6,600	7,953	114,854	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,900	5,476	79,086	2039/3/30
		3.75 SWD GOVT 170812	3.75	5,800	6,318	91,236	2017/8/12
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	7,400	8,600	124,197	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	7,300	9,183	132,605	2020/12/1
小 計						791,599	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	1,800	1,802	28,577	2025/3/13
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	4,400	4,542	71,996	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	3,900	4,326	68,580	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	6,000	6,821	108,123	2021/5/25
		4.25 NORWE GOVT 170519	4.25	5,600	5,972	94,658	2017/5/19
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	5,300	6,013	95,312	2019/5/22
小 計						467,247	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	5,800	6,265	112,271	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	3,900	4,288	76,841	2025/11/15
		2.5 DMK GOVT 161115	2.5	4,700	4,905	87,900	2016/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	8,000	9,379	168,075	2021/11/15
		4 DMK GOVT 171115	4.0	4,600	5,090	91,223	2017/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	8,700	10,261	183,888	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	10,800	18,020	322,934	2039/11/15

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	
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	千円				
	国債証券	7 DMK GOVT 241110	7.0	2,200	3,504	62,794	2024/11/10			
小 計						1,105,930				
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	1,600	1,537	50,405	2020/ 4 /25			
		2.5 POLAND 180725	2.5	2,400	2,434	79,808	2018/ 7 /25			
		3.25 POLAND 190725	3.25	1,400	1,457	47,771	2019/ 7 /25			
		3.25 POLAND 250725	3.25	1,900	1,976	64,801	2025/ 7 /25			
		3.75 POLAND 180425	3.75	1,300	1,367	44,810	2018/ 4 /25			
		4 POLAND 231025	4.0	2,400	2,638	86,495	2023/10/25			
		4.75 POLAND 161025	4.75	2,200	2,295	75,249	2016/10/25			
		4.75 POLAND 170425	4.75	1,900	2,009	65,856	2017/ 4 /25			
		5.25 POLAND 171025	5.25	1,900	2,055	67,386	2017/10/25			
		5.25 POLAND 201025	5.25	1,500	1,721	56,439	2020/10/25			
		5.5 POLAND 191025	5.5	1,800	2,048	67,140	2019/10/25			
		5.75 POLAND 211025	5.75	1,400	1,671	54,781	2021/10/25			
		5.75 POLAND 220923	5.75	2,000	2,421	79,380	2022/ 9 /23			
		5.75 POLAND 290425	5.75	800	1,053	34,545	2029/ 4 /25			
		POLAND 160725	—	1,200	1,176	38,566	2016/ 7 /25			
	POLAND 170725	—	200	192	6,303	2017/ 7 /25				
小 計						919,744				
オーストラリア				千オーストラリアドル	千オーストラリアドル					
	国債証券	2.75 AUST GOVT 191021	2.75	500	510	48,435	2019/10/21			
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,900	1,894	179,582	2024/ 4 /21			
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	400	365	34,606	2035/ 6 /21			
		3.25 AUST GOVT 181021	3.25	900	933	88,458	2018/10/21			
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,400	1,447	137,183	2025/ 4 /21			
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	800	812	77,007	2029/ 4 /21			
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	700	739	70,095	2037/ 4 /21			
		4.25 AUST GOVT 170721	4.25	1,700	1,779	168,661	2017/ 7 /21			
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,400	1,573	149,160	2026/ 4 /21			
		4.5 AUST GOVT 200415	4.5	1,800	1,985	188,226	2020/ 4 /15			
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	900	1,051	99,628	2033/ 4 /21			
		4.75 AUST GOVT 160615	4.75	2,000	2,059	195,178	2016/ 6 /15			
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,300	1,530	145,087	2027/ 4 /21			
		5.25 AUST GOVT 190315	5.25	2,300	2,560	242,713	2019/ 3 /15			
		5.5 AUST GOVT 180121	5.5	1,800	1,959	185,781	2018/ 1 /21			
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	2,000	2,400	227,564	2023/ 4 /21			
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,800	2,129	201,864	2021/ 5 /15			
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,500	1,807	171,325	2022/ 7 /15			
	6 AUST GOVT 170215	6.0	1,700	1,815	172,103	2017/ 2 /15				
小 計						2,782,667				
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 SINGAPORG0VT 180401	0.5	200	195	17,534	2018/ 4 / 1			
		2.25 SINGAPORG0VT 210601	2.25	500	505	45,331	2021/ 6 / 1			
		2.375 SINGAPORG0V 170401	2.375	500	511	45,900	2017/ 4 / 1			

銘			柄	当 期 末				
				利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
シンガポール			%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円		
	国債証券	2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	800	829	74,381	2019/6/1	
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	350	361	32,391	2023/7/1	
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	450	436	39,142	2042/4/1	
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	100	102	9,213	2029/7/1	
		2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	250	254	22,788	2030/9/1	
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	550	577	51,837	2024/9/1	
		3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	420	445	39,981	2022/9/1	
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	450	479	43,058	2020/9/1	
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	200	215	19,325	2033/9/1	
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	520	572	51,343	2027/3/1	
	3.75 SINGAPORGOVT 160901	3.75	650	672	60,341	2016/9/1		
	4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	300	325	29,211	2018/9/1		
小 計						581,784		
マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット			
	国債証券	3.172 MALAYSIA 160715	3.172	500	499	16,564	2016/7/15	
		3.26 MALAYSIAGOV 180301	3.26	900	894	29,656	2018/3/1	
		3.314 MALAYSIA 171031	3.314	1,000	999	33,114	2017/10/31	
		3.394 MALAYSIAGOV 170315	3.394	600	600	19,907	2017/3/15	
		3.418MALAYSIAGOV 220815	3.418	900	873	28,964	2022/8/15	
		3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	1,100	1,066	35,343	2023/3/15	
		3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	1,000	991	32,845	2020/3/31	
		3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	500	471	15,618	2027/5/31	
		3.58 MALAYSIAGOV 180928	3.58	800	801	26,569	2018/9/28	
		3.654 MALAYSIAGOV 191031	3.654	100	100	3,316	2019/10/31	
		3.659 MALAYSIAGOV 201015	3.659	400	401	13,301	2020/10/15	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	600	575	19,070	2028/6/15	
		3.814MALAYSIAGOV 170215	3.814	100	100	3,342	2017/2/15	
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	100	95	3,170	2033/4/15	
		3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	600	605	20,049	2020/7/31	
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	500	490	16,253	2027/3/15	
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	100	100	3,331	2025/9/15	
		4.012 MALAYSIAGOV 170915	4.012	1,800	1,825	60,505	2017/9/15	
		4.048 MALAYSIA 210930	4.048	1,000	1,013	33,574	2021/9/30	
		4.127 MALAYSIA 320415	4.127	1,400	1,379	45,709	2032/4/15	
		4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	1,200	1,224	40,582	2021/7/15	
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	900	914	30,303	2024/7/15	
		4.24 MALAYSIAGOV 180207	4.24	1,200	1,223	40,555	2018/2/7	
		4.262MALAYSIAGOV 160915	4.262	2,500	2,533	83,962	2016/9/15	
		4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	2,200	2,266	75,115	2019/11/29	
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	1,000	1,030	34,155	2026/4/15	
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	500	522	17,322	2030/4/15	
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	500	526	17,451	2043/9/30	
		5.248 MALAYSIA 280915	5.248	200	222	7,357	2028/9/15	
		5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	1,000	1,082	35,863	2019/7/30	
小 計						842,880		

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
南アフリカ			%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円	
	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	13,000	15,329	152,378	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	7,400	5,684	56,499	2036/ 3 /31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	7,100	5,495	54,626	2041/ 2 /28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	7,300	6,988	69,465	2021/ 3 /31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	7,900	6,839	67,983	2031/ 2 /28
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	6,800	6,724	66,838	2020/ 1 /15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	5,100	5,064	50,338	2023/ 2 /28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	5,600	5,720	56,859	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	4,800	4,593	45,663	2030/ 1 /31
		8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	5,200	5,330	52,989	2017/9/15
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	3,200	3,095	30,771	2032/ 3 /31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	4,700	4,596	45,686	2037/ 1 /31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	2,200	2,191	21,781	2044/ 1 /31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	7,300	7,284	72,411	2048/ 2 /28
小 計						844,293	
合 計						157,826,009	

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

○投資信託財産の構成

(2015年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	157,826,009	98.6
コール・ローン等、その他	2,241,642	1.4
投資信託財産総額	160,067,651	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (159,819,513千円) の投資信託財産総額 (160,067,651千円) に対する比率は99.8%です。

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

1 アメリカドル=120.15円	1 カナダドル=99.26円	1 メキシコペソ=7.83円	1 ユーロ=133.79円
1 イギリスポンド=187.06円	1 スイスフラン=128.37円	1 スウェーデンクローネ=14.44円	1 ノルウェークローネ=15.85円
1 デンマーククローネ=17.92円	1 ポーランドズロチ=32.78円	1 オーストラリアドル=94.79円	1 シンガポールドル=89.72円
1 マレーシアリンギット=33.14円	1 南アフリカランド=9.94円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	160,255,051,946
コール・ローン等	643,690,726
公社債(評価額)	157,826,009,985
未収入金	319,254,350
未収利息	1,410,543,470
前払費用	55,553,415
(B) 負債	571,062,061
未払金	187,801,964
未払解約金	383,260,097
(C) 純資産総額(A-B)	159,683,989,885
元本	76,187,578,939
次期繰越損益金	83,496,410,946
(D) 受益権総口数	76,187,578,939口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,959円

<注記事項>

①期首元本額	98,907,969,030円
期中追加設定元本額	13,627,051,732円
期中一部解約元本額	36,347,441,823円

○損益の状況 (2014年5月13日～2015年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,900,541,634
受取利息	4,900,081,538
その他収益金	460,096
(B) 有価証券売買損益	16,672,194,844
売買益	21,236,842,228
売買損	△ 4,564,647,384
(C) 保管費用等	△ 23,988,595
(D) 当期損益金(A+B+C)	21,548,747,883
(E) 前期繰越損益金	86,122,704,473
(F) 追加信託差損益金	13,921,816,333
(G) 解約差損益金	△38,096,857,743
(H) 計(D+E+F+G)	83,496,410,946
次期繰越損益金(H)	83,496,410,946

(注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (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）

ファンド・マネジャー（海外債券）	1,095,227,354円
eMAXIS 先進国債券インデックス	5,695,791,350円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	734,640,836円
eMAXIS バランス（波乗り型）	206,820,005円
コアバランス	1,477,099円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	5,592,258,883円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	22,371,418,822円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	3,689,506,930円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	2,405,236,412円
MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	9,333,697,809円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	10,689,475,274円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）	3,415,294,147円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	762,475,708円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	316,982,013円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	98,461,225円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	2,928,550,161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）	68,760,804円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	12,191,895円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	33,411,752円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	37,993,445円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	13,746,665円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	535,294,846円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	99,137,884円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	239,863,374円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	224,334,960円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	436,610,940円
外国債券インデックスファンドi（適格機関投資家限定）	1,835,187,937円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	2,031,345,708円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	178,819,634円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	502,632,072円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	337,650,546円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	116,431,081円
アドバンスト・バランスⅡ（FOFs用）（適格機関投資家限定）	75,879,316円
アドバンスト・バランスⅠ（FOFs用）（適格機関投資家限定）	70,972,052円
合計	76,187,578,939円

【お 知 ら せ】

①新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。

（2014年12月1日）

②デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。

（2014年12月1日）

新興国債券インデックスマザーファンド

《第5期》決算日2015年1月26日

〔計算期間：2014年1月28日～2015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5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5期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、J PモルガンG B I－E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債、および新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価額等が連動する債券に投資することがあります。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主 要 運 用 対 象	新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		J PモルガンG B I－E M グローバル・ダイバーシファイド		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	(円換算ベース)	期 騰 落	中 率		
(設定日)	円	%		%			百万円
2010年6月25日	10,000	—	22,386.80	—	—	—	999
1期(2011年1月26日)	10,087	0.9	22,663.94	1.2	96.8	—	1,142
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

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は期首比。

(注) J PモルガンG B I－E Mグローバル・ダイバーシファイドとは、J . P .モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。J PモルガンG B I－E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）とは、J . P .モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているJ PモルガンG B I－E Mグローバル・ダイバーシファイド（ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。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。

(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。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		J P モ ル ガ ン G B I - E M グ ロー パ ル ・ ダ イ バ ー シ フ ァ イ ド (円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2014年1月27日	円	%		%	%	%
	12,503	—	28,701.99	—	95.2	—
1 月 末	12,454	△ 0.4	28,655.66	△ 0.2	95.0	—
2 月 末	12,733	1.8	29,183.89	1.7	95.5	—
3 月 末	13,151	5.2	30,194.98	5.2	95.4	—
4 月 末	13,266	6.1	30,546.59	6.4	95.2	—
5 月 末	13,509	8.0	31,102.47	8.4	94.6	—
6 月 末	13,550	8.4	31,166.27	8.6	95.4	—
7 月 末	13,683	9.4	31,537.51	9.9	95.1	—
8 月 末	13,738	9.9	31,658.34	10.3	94.7	—
9 月 末	13,770	10.1	31,764.25	10.7	96.0	—
10 月 末	14,065	12.5	32,480.21	13.2	96.0	—
11 月 末	14,987	19.9	34,717.41	21.0	95.8	—
12 月 末	14,260	14.1	33,000.80	15.0	93.5	—
(期 末) 2015年1月26日	14,203	13.6	32,849.46	14.5	95.0	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

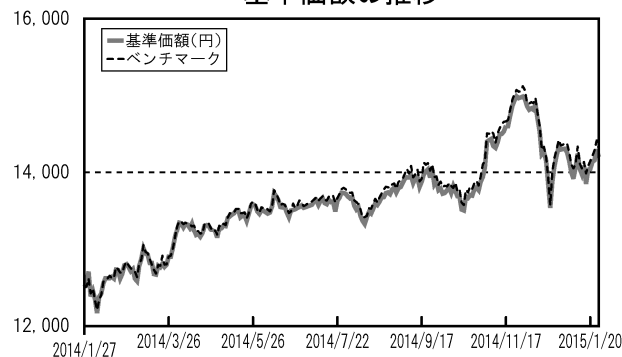
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ13.6%の上昇となりました。

■ベンチマークとの差異

ベンチマークは14.5%の上昇となったため、カイ離は△0.9%程度となりました。

基準価額の推移



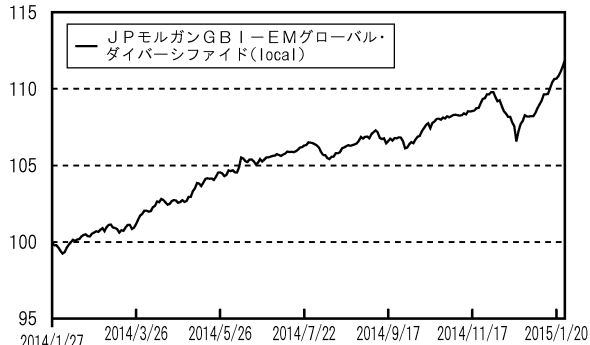
(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●投資環境について

◎債券市況

- ・新興国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、債券価格が上昇(利回りは低下)したことなどを受けて、期首に比べて上昇しました。

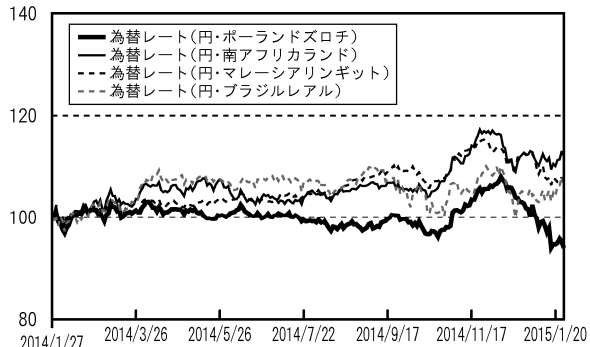
債券市況の推移
(期首を100として指数化)



◎為替市況

- ・日銀による追加金融緩和策の発表・実施などを受け、大部分の通貨が対円で上昇した一方で、商品市況の低迷に伴いロシアルーブルなどの一部通貨は対円で下落しました。

為替市況の推移
(期首を100として指数化)



●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。
- ・当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14.5%の上昇となったため、ベンチマークとの乖離は△0.9%程度となりました。

	ポートフォリオ 要因	管理コスト等 要因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマーク との乖離	△0.3%程度	△0.1%程度	△0.5%程度	△0.9%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。

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は△0.3%程度でした。

当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△0.1%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△0.5%程度でした。

為替の効果および債券の効果による要因です。

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

○今後の運用方針

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

(2014 年 1 月 28 日～2015 年 1 月 26 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 13	% 0.097	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(13)	(0.096)	外国での資産の保管等に要する費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	13	0.097	
期中の平均基準価額は、13,597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）を各期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第 3 位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2014年1月28日～2015年1月26日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 54,873	千メキシコペソ 6,587
	ブラジル	国債証券	千ブラジルレアル 12,051	千ブラジルレアル 2,947
	チリ	国債証券	千チリペソ 50,269	千チリペソ －
	コロンビア	国債証券	千コロンビアペソ 10,373,711	千コロンビアペソ 1,019,983
	ペルー	国債証券	千ペルーヌエボソル 1,644	千ペルーヌエボソル －
	トルコ	国債証券	千トルコリラ 10,180	千トルコリラ 2,935
	ハンガリー	国債証券	千ハンガリーフォリント 475,255	千ハンガリーフォリント 86,312
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 14,682	千ポーランドズロチ 3,235
	ロシア	国債証券	千ロシアルーブル 110,491	千ロシアルーブル 28,326
	国	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 12,689
タイ		国債証券	千タイバーツ 72,479	千タイバーツ 13,379
フィリピン		国債証券	千フィリピンペソ 5,267	千フィリピンペソ －
インドネシア		国債証券	千インドネシアルピア 36,343,660	千インドネシアルピア －
南アフリカ		国債証券	千南アフリカランド 41,830	千南アフリカランド 7,037
ナイジェリア		国債証券	千ナイジェリアナaira 110,702	千ナイジェリアナaira －

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2014年 1 月28日～2015年 1 月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 4,363	百万円 61	% 1.4	百万円 611	百万円 5	% 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銀行です。

○組入資産の明細

(2015年1月26日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
メキシコ	千メキシコペソ 86,100	千メキシコペソ 100,205	千円 801,643	% 10.4	% —	% 6.6	% 2.8	% 1.0
ブラジル	千ブラジルレアル 20,300	千ブラジルレアル 17,444	795,646	10.3	—	3.3	2.9	4.0
チリ	千チリペソ 50,000	千チリペソ 53,025	9,974	0.1	—	0.1	—	—
コロンビア	千コロンビアペソ 10,330,000	千コロンビアペソ 11,197,784	552,050	7.1	—	5.9	0.4	0.8
ペルー	千ペルーヌエボソル 2,850	千ペルーヌエボソル 3,211	125,207	1.6	—	1.6	—	—
トルコ	千トルコリラ 14,500	千トルコリラ 15,766	785,467	10.1	—	4.1	5.3	0.7
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 793,800	千ハンガリーフォリント 930,472	393,310	5.1	5.1	2.3	2.3	0.5
ポーランド	千ポーランドズロチ 21,000	千ポーランドズロチ 23,467	734,303	9.5	—	3.9	3.8	1.7
ロシア	千ロシアルーブル 198,800	千ロシアルーブル 153,619	284,196	3.7	—	1.4	1.8	0.4
マレーシア	千マレーシアリンギット 22,520	千マレーシアリンギット 22,430	732,367	9.5	—	4.7	3.9	0.8
タイ	千タイバーツ 143,700	千タイバーツ 155,897	562,788	7.3	—	3.6	3.2	0.5
フィリピン	千フィリピンペソ 10,000	千フィリピンペソ 10,580	28,142	0.4	—	0.4	—	—
インドネシア	千インドネシアルピア 66,220,000	千インドネシアルピア 70,534,611	670,078	8.7	—	7.4	1.0	0.2
南アフリカ	千南アフリカランド 72,200	千南アフリカランド 74,258	765,609	9.9	—	7.5	2.4	—
ナイジェリア	千ナイジェリアナイラ 202,000	千ナイジェリアナイラ 190,711	117,325	1.5	1.5	0.6	1.0	—
合 計	—	—	7,358,113	95.0	6.6	53.4	30.8	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	7,400	10,057	80,462	2024/12/5	
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	2,100	3,159	25,277	2036/11/20	
	4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	7,700	7,797	62,382	2018/6/14	
	5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	3,800	3,910	31,287	2017/6/15	
	5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	1,000	1,013	8,108	2019/12/11	
	6.25 MEXICAN BONO 160616	6.25	2,900	3,012	24,101	2016/6/16	
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	4,500	4,865	38,922	2021/6/10	
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	5,200	5,625	45,000	2022/6/9	
	7.25 MEXICAN BONO 161215	7.25	2,800	2,992	23,940	2016/12/15	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	4,200	4,939	39,519	2027/6/3	
	7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	9,100	10,014	80,115	2017/12/14	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	4,900	5,957	47,663	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	2,000	2,460	19,682	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	6,000	7,474	59,796	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 151217	8.0	3,100	3,232	25,860	2015/12/17	
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	3,900	4,497	35,983	2020/6/11	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	3,500	4,167	33,340	2023/12/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	3,900	4,447	35,579	2018/12/13	
8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	3,900	5,002	40,016	2029/5/31		
8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	4,200	5,575	44,600	2038/11/18		
小 計					801,643		
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	400	383	17,510	2018/1/1	
	10 (IN)BRAZIL NTN 190101	10.0	1,600	1,520	69,363	2019/1/1	
	10 (IN)BRAZIL NTN 250101	10.0	1,450	1,323	60,349	2025/1/1	
	10(IN)BRAZIL NTN-F170101	10.0	1,400	1,356	61,870	2017/1/1	
	10(IN)BRAZIL NTN-F210101	10.0	2,200	2,057	93,822	2021/1/1	
	10(IN)BRAZIL NTN-F230101	10.0	1,550	1,431	65,288	2023/1/1	
	12.5 BRAZIL (GL) 220105	12.5	750	843	38,466	2022/1/5	
	BRAZIL-LTN 160701	—	2,700	2,279	103,972	2016/7/1	
	BRAZIL-LTN 161001	—	1,500	1,229	56,086	2016/10/1	
	BRAZIL-LTN 170101	—	2,500	1,996	91,068	2017/1/1	
	BRAZIL-LTN 170701	—	900	680	31,023	2017/7/1	
	BRAZIL-LTN 180101	—	1,850	1,325	60,459	2018/1/1	
	BRAZIL-LTN 180701	—	1,500	1,016	46,365	2018/7/1	
	小 計					795,646	
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	53,025	9,974	2020/8/5	
小 計					9,974		
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	12 COLOMBIA (GL) 151022	12.0	1,250,000	1,318,562	65,005	2015/10/22	
	4.375 COLOMBI(GL) 230321	4.375	1,680,000	1,522,752	75,071	2023/3/21	
	7 TITULOS DE TESO 190911	7.0	550,000	586,124	28,895	2019/9/11	
	7 TITULOS DE TESO 220504	7.0	1,400,000	1,456,392	71,800	2022/5/4	

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
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	4,160,000	4,604,704	227,011	2021/4/14
		9.85 COLOMBI (GL) 270628	9.85	1,290,000	1,709,250	84,266	2027/6/28
小 計						552,050	
ペルー				千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル		
	国債証券	5.7 PERU 240812	5.7	1,000	1,021	39,809	2024/8/12
		6.9 PERU 370812	6.9	300	332	12,955	2037/8/12
		7.84 PERU 200812	7.84	650	750	29,258	2020/8/12
		8.2 PERU 260812	8.2	900	1,107	43,183	2026/8/12
小 計						125,207	
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	700	788	39,279	2019/3/27
		10.4 TURKEY GOVT 240320	10.4	1,200	1,471	73,287	2024/3/20
		10.5 TURKEY GOVT 200115	10.5	2,000	2,316	115,405	2020/1/15
		10.7 TURKEY GOVT 160224	10.7	600	621	30,983	2016/2/24
		6.3 TURKEY GOVT 180214	6.3	1,100	1,085	54,081	2018/2/14
		7.1 TURKEY GOVT 230308	7.1	1,300	1,306	65,108	2023/3/8
		8.2 TURKEY GOVT 160713	8.2	500	508	25,316	2016/7/13
		8.3 TURKEY GOVT 180620	8.3	900	937	46,730	2018/6/20
		8.5 TURKEY GOVT 190710	8.5	1,000	1,063	52,991	2019/7/10
		8.5 TURKEY GOVT 220914	8.5	1,000	1,080	53,845	2022/9/14
		8.8 TURKEY GOVT 181114	8.8	1,000	1,064	53,024	2018/11/14
		8.8 TURKEY GOVT 230927	8.8	1,000	1,114	55,530	2023/9/27
		9 TURKEY GOVT 170308	9.0	1,000	1,040	51,846	2017/3/8
		9 TURKEY GOVT 240724	9.0	500	573	28,585	2024/7/24
		9.5 TURKEY GOVT 220112	9.5	700	791	39,450	2022/1/12
小 計						785,467	
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	4 HUNGARY 180425	4.0	75,000	79,448	33,582	2018/4/25
		5.5 HUNGARY 160212	5.5	42,000	43,795	18,512	2016/2/12
		5.5 HUNGARY 161222	5.5	51,000	55,013	23,254	2016/12/22
		5.5 HUNGARY 181220	5.5	55,000	61,711	26,085	2018/12/20
		5.5 HUNGARY 250624	5.5	77,000	95,215	40,247	2025/6/24
		6 HUNGARY 231124	6.0	93,000	116,289	49,155	2023/11/24
		6.5 HUNGARY 190624	6.5	105,800	124,382	52,576	2019/6/24
		6.75 HUNGARY 170224	6.75	60,000	66,370	28,054	2017/2/24
		6.75 HUNGARY 171124	6.75	77,000	87,197	36,858	2017/11/24
		7 HUNGARY 220624	7.0	76,000	97,348	41,149	2022/6/24
		7.5 HUNGARY 201112	7.5	82,000	103,699	43,833	2020/11/12
小 計						393,310	
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	2.5 POLAND 180725	2.5	1,800	1,850	57,901	2018/7/25
		3.25 POLAND 190725	3.25	1,800	1,916	59,960	2019/7/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	1,100	1,219	38,160	2025/7/25
		3.75 POLAND 180425	3.75	1,500	1,599	50,046	2018/4/25
		4 POLAND 231025	4.0	2,000	2,315	72,448	2023/10/25

銘 柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
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	4.75 POLAND 161025	4.75	1,600	1,687	52,799	2016/10/25
		4.75 POLAND 170425	4.75	1,100	1,176	36,819	2017/4/25
		5 POLAND 160425	5.0	1,800	1,874	58,664	2016/4/25
		5.25 POLAND 171025	5.25	1,400	1,537	48,096	2017/10/25
		5.25 POLAND 201025	5.25	1,300	1,541	48,242	2020/10/25
		5.5 POLAND 191025	5.5	1,200	1,403	43,929	2019/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	1,200	1,492	46,687	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	2,500	3,168	99,150	2022/9/23
		POLAND 160725	—	700	683	21,393	2016/7/25
小 計						734,303	
ロシア				千ロシアルーブル	千ロシアルーブル		
	国債証券	6 RUSSIA GOVT 160511	6.0	7,500	6,742	12,473	2016/5/11
		6.2 RUSSIA GOVT 180131	6.2	4,000	3,209	5,937	2018/1/31
		6.7 RUSSIA GOVT B 190515	6.7	10,000	7,629	14,113	2019/5/15
		6.8 RUSSIA GOVT 191211	6.8	14,000	10,437	19,309	2019/12/11
		6.9 RUSSIA GOVT 160803	6.9	13,000	11,668	21,587	2016/8/3
		7 RUSSIA GOVT 230125	7.0	11,000	7,535	13,940	2023/1/25
		7 RUSSIA GOVT BON 230816	7.0	11,300	7,729	14,299	2023/8/16
		7.05 RUSSIA GOVT 280119	7.05	13,000	8,250	15,262	2028/1/19
		7.4 RUSSIA GOVT 170419	7.4	11,000	9,533	17,636	2017/4/19
		7.4 RUSSIA GOVT 170614	7.4	9,000	7,728	14,297	2017/6/14
		7.5 RUSSIA GOVT 190227	7.5	10,500	8,346	15,441	2019/2/27
		7.6 RUSSIA GOVT 210414	7.6	11,500	8,453	15,639	2021/4/14
		7.6 RUSSIA GOVT 220720	7.6	23,000	16,453	30,438	2022/7/20
		7.85 RUSSIA (GL) 180310	7.85	35,000	29,137	53,904	2018/3/10
8.15 RUSSIA GOVT 270203	8.15	15,000	10,764	19,914	2027/2/3		
小 計						284,196	
マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	3.172 MALAYSIA 160715	3.172	1,100	1,095	35,765	2016/7/15
		3.26 MALAYSIA GOVT 180301	3.26	1,700	1,678	54,794	2018/3/1
		3.314 MALAYSIA 171031	3.314	700	694	22,674	2017/10/31
		3.394 MALAYSIA GOV 170315	3.394	1,000	996	32,540	2017/3/15
		3.418MALAYSIA GOVT 220815	3.418	1,100	1,058	34,549	2022/8/15
		3.48 MALAYSIA GOVT 230315	3.48	1,200	1,154	37,682	2023/3/15
		3.492 MALAYSIA GOV 200331	3.492	1,100	1,079	35,249	2020/3/31
		3.58 MALAYSIA GOVT 180928	3.58	1,300	1,292	42,208	2018/9/28
		3.654 MALAYSIA GOV 191031	3.654	1,100	1,093	35,717	2019/10/31
		3.733 MALAYSIA GO 280615	3.733	700	656	21,444	2028/6/15
		3.844 MALAYSIA GOV 330415	3.844	400	373	12,198	2033/4/15
		3.889 MALAYSIA GO 200731	3.889	1,000	999	32,630	2020/7/31
		3.892 MALAYSIA GOV 270315	3.892	300	287	9,400	2027/3/15
		4.012 MALAYSIA GOV 170915	4.012	900	908	29,667	2017/9/15
		4.048 MALAYSIA 210930	4.048	920	929	30,337	2021/9/30
		4.127 MALAYSIA 320415	4.127	800	772	25,209	2032/4/15
4.16 MALAYSIA GOVT 210715	4.16	1,000	1,010	32,997	2021/7/15		

銘柄			当期末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
マレーシア			%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
	国債証券	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,000	1,018	33,254	2024/7/15
		4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	200	196	6,400	2031/6/30
		4.24 MALAYSIAGOV 180207	4.24	500	507	16,574	2018/2/7
		4.262MALAYSIAGOV 160915	4.262	900	910	29,742	2016/9/15
		4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	1,300	1,329	43,398	2019/11/29
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	1,100	1,114	36,392	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	500	516	16,871	2030/4/15
		5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	700	755	24,662	2019/7/30
小計						732,367	
タイ				千タイバーツ	千タイバーツ		
	国債証券	2.8 THAILAND 171010	2.8	6,600	6,716	24,246	2017/10/10
		3.25 THAILAND 170616	3.25	15,500	15,940	57,543	2017/6/16
		3.45 THAILAND 190308	3.45	6,200	6,481	23,397	2019/3/8
		3.58 THAILAND 271217	3.58	6,600	7,147	25,802	2027/12/17
		3.625 THAILAND 230616	3.625	17,700	19,227	69,410	2023/6/16
		3.65 THAILAND 211217	3.65	21,000	22,700	81,949	2021/12/17
		3.85 THAILAND 251212	3.85	6,800	7,604	27,452	2025/12/12
		3.875 THAILAND 190613	3.875	27,700	29,663	107,084	2019/6/13
		4.125 THAILAND 161118	4.125	10,000	10,371	37,439	2016/11/18
		4.75 THAILAND 241220	4.75	5,300	6,240	22,527	2024/12/20
		4.875 THAILAND 290622	4.875	11,800	14,566	52,584	2029/6/22
		5.125 THAILAND 180313	5.125	8,500	9,238	33,350	2018/3/13
小計						562,788	
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	10,580	28,142	2021/1/15
小計						28,142	
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	1,069,320	10,158	2017/7/15
		10.5 INDONESIA 300815	10.5	2,650,000	3,374,324	32,056	2030/8/15
		11 INDONESIA 201115	11.0	1,500,000	1,777,260	16,883	2020/11/15
		11 INDONESIA 250915	11.0	2,050,000	2,606,718	24,763	2025/9/15
		12.8 INDONESIA 210615	12.8	1,590,000	2,050,320	19,478	2021/6/15
		5.25 INDONESIA 180515	5.25	1,300,000	1,237,600	11,757	2018/5/15
		5.625 INDONESIA 230515	5.625	3,900,000	3,539,679	33,626	2023/5/15
		6.125 INDONESIA 280515	6.125	2,750,000	2,456,932	23,340	2028/5/15
		6.25 INDONESIA 170415	6.25	1,200,000	1,185,432	11,261	2017/4/15
		6.625 INDONESIA 330515	6.625	4,400,000	3,998,456	37,985	2033/5/15
		7 INDONESIA 220515	7.0	2,850,000	2,838,486	26,965	2022/5/15
		7 INDONESIA 270515	7.0	2,300,000	2,235,738	21,239	2027/5/15
		7.375 INDONESIA 160915	7.375	1,800,000	1,814,292	17,235	2016/9/15
		7.875 INDONESIA 190415	7.875	4,550,000	4,707,384	44,720	2019/4/15
		8.25 INDONESIA 210715	8.25	1,500,000	1,591,050	15,114	2021/7/15
		8.25 INDONESIA 320615	8.25	4,000,000	4,251,960	40,393	2032/6/15
		8.375 INDONESIA 240315	8.375	8,500,000	9,206,945	87,465	2024/3/15
		8.375 INDONESIA 260915	8.375	1,830,000	1,978,962	18,800	2026/9/15

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
インドネシア			%	千インドネシアルピア	千インドネシアルピア	千円	
	国債証券	8.375 INDONESIA 340315	8.375	6,700,000	7,263,671	69,004	2034/3/15
		9 INDONESIA 290315	9.0	7,200,000	8,209,512	77,990	2029/3/15
		9.5 INDONESIA 310715	9.5	2,650,000	3,140,568	29,835	2031/7/15
小 計						670,078	
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	12,100	15,281	157,553	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	6,900	5,761	59,405	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	6,900	5,807	59,874	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	7,700	7,715	79,544	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	7,100	6,662	68,694	2031/2/28
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	7,100	7,296	75,229	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	4,800	5,053	52,098	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	6,600	6,955	71,707	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	4,300	4,439	45,768	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	3,600	3,777	38,949	2017/9/15
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	5,100	5,507	56,784	2048/2/28	
小 計						765,609	
ナイジェリア				千ナイジェリアナイラ	千ナイジェリアナイラ		
	国債証券	14.2 NIGERIA GOVE 240314	14.2	30,000	28,201	17,349	2024/3/14
		15.1 NIGERIA TREA 170427	15.1	58,000	57,763	35,536	2017/4/27
		16 NIGERIA GOVERN 190629	16.0	30,000	30,679	18,873	2019/6/29
		16.39 NIGERIA GOV 220127	16.39	41,000	42,888	26,385	2022/1/27
		7 NIGERIA TREAS 191023	7.0	43,000	31,178	19,181	2019/10/23
小 計						117,325	
合 計						7,358,113	

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

○投資信託財産の構成

(2015年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	7,358,113	93.7
コール・ローン等、その他	495,517	6.3
投資信託財産総額	7,853,630	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (7,714,360千円) の投資信託財産総額 (7,853,630千円) 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=117.67円	1 メキシコペソ=8.00円	1 ブラジルレアル=45.61円	100チリペソ=18.81円
100コロンビアペソ=4.93円	1 ペルーヌエボソル=38.99円	1 トルコリラ=49.82円	100ハンガリーフォリント=42.27円
1 ポーランドズロチ=31.29円	1 ロシアルーブル=1.85円	1 マレーシアリンギット=32.65円	1 タイバーツ=3.61円
1 フィリピンペソ=2.66円	100インドネシアルピア=0.95円	1 南アフリカランド=10.31円	1 ナイジェリアナイラ=0.6152円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	7,899,834,605
コール・ローン等	373,997,047
公社債(評価額)	7,358,113,921
未収入金	46,290,000
未収利息	92,959,905
前払費用	28,473,732
(B) 負債	157,467,475
未払金	157,350,520
未払解約金	116,955
(C) 純資産総額(A－B)	7,742,367,130
元本	5,451,142,583
次期繰越損益金	2,291,224,547
(D) 受益権総口数	5,451,142,583口
1万口当たり基準価額(C／D)	14,203円

<注記事項>

①期首元本額	2,752,156,629円
期中追加設定元本額	3,011,729,534円
期中一部解約元本額	312,743,580円

②期末における元本の内訳(当期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)	859,718,489円
eMAXIS バランス(波乗り型)	274,482,825円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	33,952,397円
コアバランス	999,974円
eMAXIS 新興国債券インデックス	3,227,024,174円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	858,845,660円
新興国債券インデックスオープン	91,144,870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)	37,931,320円
三菱UFJ 新興国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	67,042,874円
合計	5,451,142,583円

○損益の状況 (2014年1月28日～2015年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	335,352,329
受取利息	335,352,329
(B) 有価証券売買損益	234,284,537
売買益	638,857,370
売買損	△ 404,572,833
(C) 保管費用等	△ 4,807,879
(D) 当期損益金(A+B+C)	564,828,987
(E) 前期繰越損益金	689,002,331
(F) 追加信託差損益金	1,156,109,624
(G) 解約差損益金	△ 118,716,395
(H) 計(D+E+F+G)	2,291,224,547
次期繰越損益金(H)	2,291,224,547

(注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

[お 知 ら せ]

- ①対象インデックスとの連動を維持するために行う取引として、直物為替先渡取引を追加し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年10月25日)
- ②書面決議を行う場合の受益者数要件の撤廃を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ③併合手続要件の緩和を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ④買取請求の一部適用除外を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑤新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑥デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)