

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 (預託証書) を含みま) 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。
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。	
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の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。
	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。	
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益 (評価益を含みま) 等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

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

運用報告書 (全体版)

コアバランス

第3期 (決算日: 2016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3期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

三菱UFJ投信株式会社は2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、「三菱UFJ国際投信株式会社」となりました。



三菱UFJ国際投信

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

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034
 (9:00~17:00、土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)
 お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目次

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	95
◇日本債券インデックスマザーファンド	125
◇外国債券インデックスマザーファンド	157
◇新興国債券インデックスマザーファンド	183

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	基準価額 (分配落)	標準価額			株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		税金	込み	期中騰落率						
	円	円	円	%	%	%	%	%	%	百万円
(設定日)	10,000	—	—	—	—	—	—	—	—	10
2013年7月1日	10,474	0	0	4.7	34.0	0.5	59.0	0.0	0.3	10
1期(2014年5月12日)	10,740	0	0	2.5	17.6	0.3	61.3	0.1	0.2	11
2期(2015年5月12日)	10,649	0	0	△0.8	12.3	0.4	71.5	—	0.1	11
3期(2016年5月12日)										

(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		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
	円	騰 落 率					
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%
2015年5月12日	10,740	—	17.6	0.3	61.3	0.1	0.2
5月末	10,751	0.1	17.7	0.3	60.9	0.1	0.2
6月末	10,643	△0.9	19.0	0.3	61.5	0.1	0.2
7月末	10,630	△1.0	19.8	0.3	61.7	0.1	0.2
8月末	10,499	△2.2	18.3	0.4	62.2	0.1	0.2
9月末	10,324	△3.9	18.2	0.5	62.1	0.0	0.2
10月末	10,528	△2.0	16.7	0.3	65.6	0.0	0.2
11月末	10,456	△2.6	15.8	0.6	66.6	0.0	0.2
12月末	10,446	△2.7	18.2	0.4	66.6	—	0.2
2016年1月末	10,337	△3.8	20.0	0.4	68.4	0.0	0.3
2月末	10,325	△3.9	20.6	0.4	67.4	0.1	0.3
3月末	10,621	△1.1	18.0	0.5	72.4	0.0	0.2
4月末	10,640	△0.9	12.5	0.3	71.0	—	0.1
(期 末)							
2016年5月12日	10,649	△0.8	12.3	0.4	71.5	—	0.1

(注) 騰落率は期首比。

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

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第3期：2015/5/13～2016/5/12)

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.8%の下落となりました。



基準価額の主な変動要因

上昇要因	主として日本債券市況の上昇や、円高局面において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っていたことが基準価額のプラス要因となりました。
下落要因	資産配分効果がマイナスに影響したことに加え、国内株式市況の下落や米ドル以外の他通貨に対する円高の進行などが基準価額のマイナス要因となりました。

投資環境について

(第3期：2015/5/13～2016/5/12)

市況の推移
(期首を100として指数化)



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

市況の推移
(期首を100として指数化)



・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。

◎国内株式市況

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

◎外国株式市況

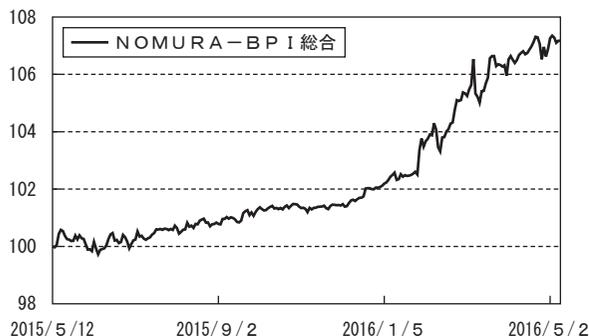
- ・米国の利上げを巡る警戒感に加え、原油価格の下落や中国経済の減速懸念などから、外国株式市況は下落しました。

市況の推移
(期首を100として指数化)



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

市況の推移
(期首を100として指数化)



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

◎新興国株式市況

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

◎国内債券市況

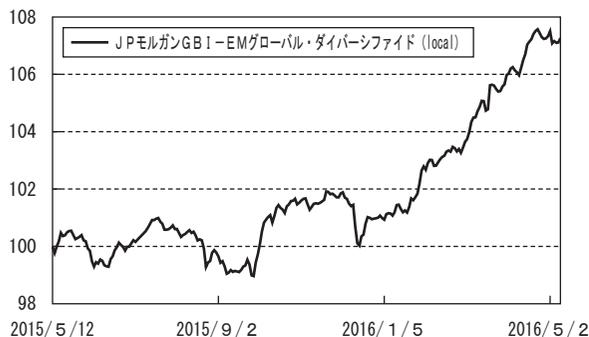
- ・原油価格など商品市況の下落を受けた期待インフレ率の低下や新興国を中心とした海外景気の先行きに対する懸念などから、債券市況は上昇 (金利は低下) 基調で推移し、2016年1月29日に日銀が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を決定したことから、債券市況は一段と上昇しました。

市況の推移
(期首を100として指数化)



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

市況の推移
(期首を100として指数化)



・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。

◎外国債券市況

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

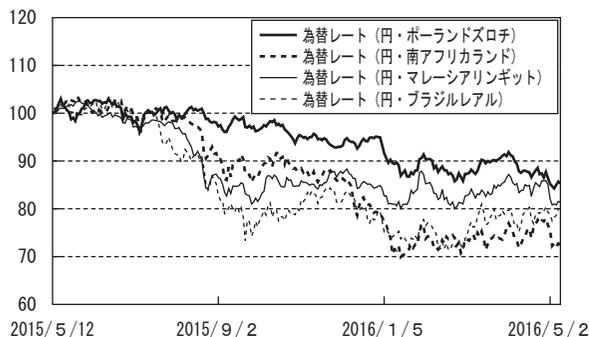
◎新興国債券市況

- ・FRB (米連邦準備制度理事会) が2008年12月から過去最低水準で維持してきた政策金利の引き上げに踏み切ったことや、原油を始めとした資源価格が低迷したことなどを受けて、新興国から資金が流出する動きが強まりましたが、2016年1月以降落ち着きを取り戻し、新興国の現地通貨建て債券市況は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、FRBによる政策金利の引き上げが意識されて米ドルが対円で上昇する局面もありましたが、世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に米ドルが対円で売られました。期首との比較では、米ドルは対円で9.8%下落しました。
- ・円・ユーロ相場は、ユーロ圏の景況感の改善などを背景に上昇する局面もありましたが、ECB（欧州中央銀行）が緩和的な金融政策を維持したことなどを背景に、ユーロが対円で売られました。期首との比較では、ユーロは対円で7.5%下落しました。
- ・FRBが2008年12月から過去最低水準で維持してきた政策金利の引き上げに踏み切ったことや、原油を始めとした資源価格が低迷したことなどをを受けて、新興国から資金が流出する動きが強まったことから、新興国通貨は対円で下落しました。特にコロンビアペソや南アフリカランドなどの通貨が対円で下落しました。
- ・期首に比べて14.7%の円高・ポーランドズロチ安、27.5%の円高・南アフリカランド安、18.6%の円高・マレーシアリングgit安、20.0%の円高・ブラジルリ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>

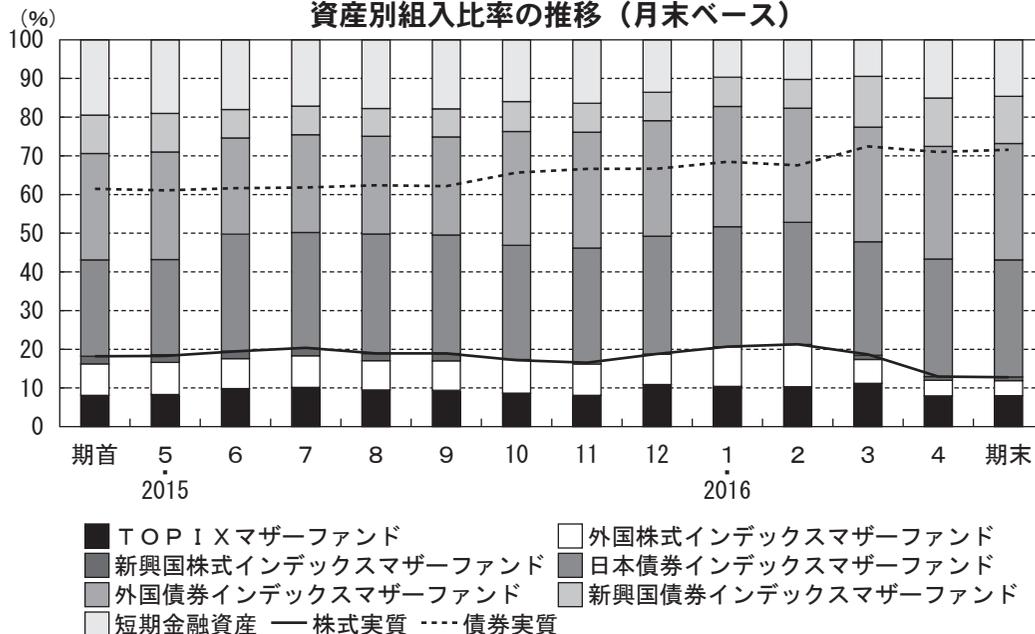
- ・主として景気動向と市場の変動をもとに「積極局面」、「中立局面」、「消極局面」に分け、判断した結果、期を通じて概ね積極局面となりましたが、主要国の金融政策などに対する先行き不透明感を背景にやや慎重な運用を行いました。

当期	局面判断 積極
----	------------

- ・当期の資産配分の推移は以下の通りです。

(ご参考)

資産別組入比率の推移（月末ベース）



- ・各マザーファンドへの投資比率は、期の前半は局面判断を「積極局面」としながらも原油価格の下落やギリシャ情勢などの不安要素が台頭したことなどから、リスクを抑制した運用を行いました。
- ・期中盤は、株価のバリュエーション（投資価値基準）などの観点から国内株式の比率を高める一方、金利などの不透明感に残るものの、為替動向を勘案し、先進国・新興国債券の比率を抑えた運用を行いました。
- ・期の終盤は、世界経済への先行き不透明感から市場の変動性が高まるなか、外国株式の比率を抑えるなど機動的な資産配分比率の変更を行いました。

前記のように機動的な投資比率の変更を行ったものの、資産配分効果はマイナスとなりました。

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	△1.7%程度
外国株式インデックスマザーファンド	△1.1%程度
新興国株式インデックスマザーファンド	△0.5%程度
日本債券インデックスマザーファンド	2.1%程度
外国債券インデックスマザーファンド	△1.8%程度
新興国債券インデックスマザーファンド	△0.9%程度
為替取引要因	4.4%程度
その他（信託報酬等）	△1.3%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	-14.8%	-16.5%	8.0%
先進国株式	外国株式インデックスマザーファンド	-14.5%	-16.4%	3.9%
新興国株式	新興国株式インデックスマザーファンド	-27.7%	-29.7%	1.0%
国内債券	日本債券インデックスマザーファンド	7.2%	7.2%	30.2%
先進国債券	外国債券インデックスマザーファンド	-6.1%	-6.2%	30.1%
新興国債券	新興国債券インデックスマザーファンド	-13.4%	-13.1%	12.2%

(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、ペ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いません。

(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。また、短期的に円安が見込めると判断した局面（2015年9月～10月）では米ドル売り比率を低下させ、機動的な運用を行いました。期を通じてみると、円高・米ドル安となる中、米ドル売り・円買いの為替取引を行ったことで為替取引要因はプラスとなりました。

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3期
	2015年5月13日～2016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	776

(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

(2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	148	1.404	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
（ 投 信 会 社 ）	(68)	(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 ）	(74)	(0.702)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(6)	(0.054)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（ 株 式 ）	(0)	(0.001)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.003	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	(0)	(0.003)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	13	0.123	(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)	(0.020)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.003)	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 ）	(10)	(0.099)	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	161	1.532	
期中の平均基準価額は、10,516円です。			

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

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2015年5月13日～2016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	97	185	129	243
新興国債券インデックスマザーファンド	773	932	448	590
TOPIXマザーファンド	687	1,028	601	858
外国株式インデックスマザーファンド	360	735	536	1,097
日本債券インデックスマザーファンド	1,198	1,538	933	1,208
外国債券インデックスマザーファンド	854	1,753	630	1,310

○株式売買比率

(2015年5月13日～2016年5月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期		
	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	9,679,052千円	186,175,306千円	233,432,694千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	34,714,215千円	228,672,502千円	224,041,096千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.27	0.81	1.04

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

<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		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	
			B/A			D/C
為替先物取引	百万円 58	百万円 17	% 29.3	百万円 59	百万円 15	% 25.4

<TOPIX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		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	
			B/A			D/C
株式	百万円 106,204	百万円 37,561	% 35.4	百万円 79,971	百万円 17,549	% 21.9

平均保有割合 0.0%

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

<外国株式インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 192,818	百万円 3,670	% 1.9	百万円 114,849	百万円 7,344	% 6.4

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。

<新興国株式インデックスマザーファンド>

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

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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 286,063	百万円 84,760	% 29.6	百万円 126,250	百万円 49,856	% 39.5

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。

(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			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 34,058	百万円 1,659	% 4.9	百万円 27,994	百万円 1,524	% 5.4

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。

<新興国債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 6,205	百万円 486	% 7.8	百万円 3,071	百万円 132	% 4.3

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。

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 2,615	百万円 2,093	百万円 4,998

<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 1,136	百万円 302	百万円 1,990

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 276

<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 1,600

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)	0.224千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0千円
(B) / (A)	0.2%

(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MUFJ証券です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 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

(2016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
新興国株式インデックスマザーファンド	千口 93	千口 60	千円 105
新興国債券インデックスマザーファンド	807	1,132	1,360
TOPIXマザーファンド	570	656	892
外国株式インデックスマザーファンド	396	219	433
日本債券インデックスマザーファンド	2,230	2,495	3,361
外国債券インデックスマザーファンド	1,477	1,700	3,346

○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、2016年5月12日現在における貸付株数の総株数は40,591,300株です。うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUF G証券株式会社に対する貸付は、40,591,300株です。

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
新興国株式インデックスマザーファンド	105	0.9
新興国債券インデックスマザーファンド	1,360	12.0
TOPIXマザーファンド	892	7.9
外国株式インデックスマザーファンド	433	3.8
日本債券インデックスマザーファンド	3,361	29.8
外国債券インデックスマザーファンド	3,346	29.6
コール・ローン等、その他	1,795	16.0
投資信託財産総額	11,292	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 (35,622,785千円) の投資信託財産総額 (35,993,604千円) に対する比率は99.0%です。

(注) 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 (11,312,879千円) の投資信託財産総額 (11,363,525千円) に対する比率は99.6%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 (269,579,000千円) の投資信託財産総額 (270,164,641千円) に対する比率は99.8%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 (156,139,125千円) の投資信託財産総額 (156,472,309千円) 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=108.37円	1 カナダドル=84.33円	1 メキシコペソ=6.03円	1 ブラジルレアル=31.39円
100チリペソ=15.93円	100コロンビアペソ=3.69円	1 ペルーヌエボソル=32.55円	1 ユーロ=123.81円
1 イギリスポンド=156.52円	1 スイスフラン=111.63円	1 スウェーデンクローネ=13.33円	1 ノルウェークローネ=13.28円
1 デンマーククローネ=16.64円	1 トルコリラ=36.71円	1 チェココルナ=4.58円	100ハンガリーフォリント=39.20円
1 ポーランドズロチ=27.97円	1 ロシアルーブル=1.67円	1 ルーマニアレイ=27.56円	1 オーストラリアドル=79.91円
1 ニューゼーランドドル=74.03円	1 香港ドル=13.97円	1 シンガポールドル=79.31円	1 マレーシアリンギット=26.97円
1 タイバーツ=3.07円	1 フィリピンペソ=2.33円	100インドネシアルピア=0.82円	100韓国ウォン=9.32円
1 ニュー台湾ドル=3.33円	1 インドルピー=1.64円	1 アラブディルハム=29.56円	1 イスラエルシェケル=28.84円
1 カタールリアル=29.82円	1 南アフリカランド=7.21円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	16,441,190
コール・ローン等	1,740,624
新興国株式インデックスマザーファンド(評価額)	105,737
新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)	1,360,393
T O P I Xマザーファンド(評価額)	892,001
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	433,419
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	3,361,541
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	3,346,120
未収入金	5,201,355
(B) 負債	5,318,102
未払金	5,241,720
未払信託報酬	76,196
未払利息	3
その他未払費用	183
(C) 純資産総額(A-B)	11,123,088
元本	10,445,499
次期繰越損益金	677,589
(D) 受益権総口数	10,445,499口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,649円

<注記事項>

- ①期首元本額 10,482,572円
 期中追加設定元本額 12,927円
 期中一部解約元本額 50,000円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0649円です。

②分配金の計算過程

項 目	2015年5月13日～ 2016年5月12日
費用控除後の配当等収益額	56,902円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	-円
収益調整金額	20,179円
分配準備積立金額	734,290円
当ファンドの分配対象収益額	811,371円
1万口当たり収益分配対象額	776円
1万口当たり分配金額	-円
収益分配金金額	-円

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,350
受取利息	763
その他収益金	2,655
支払利息	△ 68
(B) 有価証券売買損益	67,356
売買益	1,312,731
売買損	△1,245,375
(C) 信託報酬等	△ 165,450
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 94,744
(E) 前期繰越損益金	734,290
(F) 追加信託差損益金	38,043
(配当等相当額)	(20,167)
(売買損益相当額)	(17,876)
(G) 計(D+E+F)	677,589
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	677,589
追加信託差損益金	38,043
(配当等相当額)	(20,179)
(売買損益相当額)	(17,864)
分配準備積立金	791,192
繰越損益金	△ 151,646

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

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

[お 知 ら せ]

- ①2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年7月1日)
- ②2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5% (法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。)) の税率が適用されます。

TOPIXマザーファンド

《第15期》決算日2016年3月25日

[計算期間：2015年3月26日～2016年3月25日]

「TOPIXマザーファンド」は、3月25日に第15期の決算を行いました。

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

運用方針	東証株価指数(TOPIX)と連動する投資成果をめざして運用を行います。TOPIX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(TOPIX)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	期騰落	期中率	(TOPIX)	期中率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
15期(2016年3月25日)	13,743	△12.5	1,366.05	△14.2	98.2	1.9	220,801

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

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 株 価 指 数 (TOPIX)		株 組 入 比 率 %	株 先 物 比 率 %
	円	騰 落 率 %	(TOPIX)	騰 落 率 %		
(期 首) 2015年3月25日	15,711	—	1,592.01	—	98.4	1.3
3月末	15,347	△ 2.3	1,543.11	△ 3.1	98.0	1.5
4月末	15,846	0.9	1,592.79	0.0	97.8	1.4
5月末	16,659	6.0	1,673.65	5.1	96.5	1.7
6月末	16,242	3.4	1,630.40	2.4	99.0	0.8
7月末	16,534	5.2	1,659.52	4.2	99.0	1.0
8月末	15,318	△ 2.5	1,537.05	△ 3.5	98.9	1.2
9月末	14,171	△ 9.8	1,411.16	△11.4	98.2	2.0
10月末	15,649	△ 0.4	1,558.20	△ 2.1	97.7	1.5
11月末	15,873	1.0	1,580.25	△ 0.7	100.1	1.6
12月末	15,560	△ 1.0	1,547.30	△ 2.8	99.2	0.8
2016年1月末	14,404	△ 8.3	1,432.07	△10.0	98.8	1.6
2月末	13,055	△16.9	1,297.85	△18.5	99.1	1.5
(期 末) 2016年3月25日	13,743	△12.5	1,366.05	△14.2	98.2	1.9

(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12.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−14.2%)を1.7%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内株式市況

- ・期首から2015年8月上旬にかけては、国内企業業績改善への期待が高まったことや、円安・米ドル高の進行などを受けて国内株式市況は上昇しました。
- ・8月中旬から期末にかけては、2015年内の米利上げ観測の高まりを受けて円安が進んだことなどから国内株式市況が一時上昇する場面もありましたが、中国経済減速への不安から世界同時株安となったことなどにより、国内株式市況は下落しました。
- ・期を通じてみると、国内株式市況は下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・株式ポートフォリオはベンチマークである東証株価指数（TOPIX）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14.2%の下落となったため、カイ離は1.7%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

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

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

- ・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・期中における先物組入比率の平均は、1.5%程度となりました。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.7%程度でした。

- ・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

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

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

(2015年3月26日～2016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	%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	1	0.004	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
	(1)	(0.004)	
合 計	1	0.004	
期中の平均基準価額は、15,388円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年3月26日～2016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	千円	千株	千円
		60,807	81,253,363	52,180	71,378,260
		(△ 2,998)	()		

(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	百万円	百万円	百万円
		75,143	73,705	—	—

○株式売買比率

(2015年3月26日～2016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	152,631,624千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	230,566,570千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.66

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年3月26日～2016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		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
株式	百万円 81,253	百万円 18,121	% 22.3	百万円 71,378	百万円 8,859	% 12.4

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 2,092	百万円 1,952	百万円 4,875

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 294

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)	9,191千円
うち利害関係人への支払額 (B)	72千円
(B) / (A)	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

(2016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	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				
極洋	49	51	13,770	
日本水産	142.9	138.6	77,200	
マルハニチロ	22.3	24.6	54,562	
サカタのタネ	18.7	17.8	50,819	
ホクト	12.9	12.2	26,876	
鉱業 (0.3%)				
住石ホールディングス	32.2	35.6	3,560	
日鉄鉱業	32	33	14,421	
三井松島産業	76	79	9,796	
国際石油開発帝石	612.4	633.7	561,711	
日本海洋掘削	3.5	3.6	8,913	
石油資源開発	16.6	19.1	48,628	
K&Oエナジーグループ	7.8	8.1	11,340	
建設業 (3.2%)				
ショーボンドホールディングス	11.2	12.6	51,723	
ミライト・ホールディングス	35.8	37	34,151	
タマホーム	8.7	9.1	3,922	
サンヨーホームズ	1.2	2.5	1,385	
ダイセキ環境ソリューション	1.4	2.8	3,038	
安藤・間	77.6	80.3	43,683	
東急建設	41.3	39.1	36,636	
コムシスホールディングス	51.7	51.7	91,560	
ミサワホーム	13.7	14.2	11,076	
高松コンストラクショングループ	8.8	9.1	22,194	
東建コーポレーション	4.3	4.9	45,129	
ヤマウラ	5.5	5.7	2,764	
大成建設	604	625	473,125	
大林組	349	360.8	406,621	
清水建設	356	368	352,912	
飛鳥建設	75.7	96.6	18,354	
長谷工コーポレーション	145.3	140.4	145,314	
松井建設	13	13.3	9,881	
銭高組	17	17	8,415	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
鹿島建設	511	564	406,080	
不動産トラ	88	84.9	10,867	
大末建設	4.4	4.6	3,822	
鉄建建設	71	73	20,951	
日鉄住金テックスエンジ	22	—	—	
西松建設	125	139	68,805	
三井住友建設	471.6	460.9	48,394	
大豊建設	32	46	22,908	
前田建設工業	78	74	61,346	
佐田建設	40	8.4	3,679	
ナカノフド一建設	8.9	9.2	5,354	
奥村組	110	114	69,312	
大和小田急建設	6.3	—	—	
東鉄工業	14	14.4	49,320	
イチケン	13	13	4,394	
浅沼組	37	39	12,168	
戸田建設	146	140	77,140	
熊谷組	146	176	50,160	
青木あすなろ建設	7	7.9	6,004	
北野建設	24	25	7,325	
植木組	14	15	3,555	
三井ホーム	15	15	8,115	
矢作建設工業	14.4	16.4	13,218	
ピーエス三菱	12.3	14.2	5,651	
日本ハウスホールディングス	14.4	24.5	10,045	
大東建託	44.1	45	727,650	
新日本建設	13.8	14.3	8,008	
N I P P O	27	28	51,044	
東亜道路工業	22	23	8,786	
前田道路	36	38	70,680	
日本道路	35	36	19,260	
東亜建設工業	87	105	27,930	
若築建設	67	69	9,039	
東洋建設	34.8	37.7	18,925	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
五洋建設	129	133.5	64,747	
大林道路	14	14	10,612	
世紀東急工業	16.9	19	9,462	
福田組	17	19	21,717	
住友林業	85.7	82.8	106,563	
日本基礎技術	14	13.5	5,805	
日成ビルド工業	32	33	13,431	
ヤマダ・エスバイエルホーム	53	61	5,002	
巴コーポレーション	14.4	14.9	5,453	
パナホーム	43	45	38,340	
大和ハウス工業	340.4	355.3	1,151,172	
ライト工業	18.6	23.1	24,301	
積水ハウス	360.7	402.2	780,871	
日特建設	15.6	13.3	5,586	
北陸電気工事	6	4.4	4,298	
ユアテック	18	19	18,183	
西部電気工業	10	10	4,190	
四電工	10	9	3,501	
中電工	16.8	17.4	38,541	
関電工	53	48	38,208	
きんでん	77	72.7	101,053	
東京エネシス	13	14	12,992	
トーエネック	16	17	12,019	
住友電設	9.2	9.5	14,383	
日本電設工業	18.9	19.6	43,139	
協和エクシオ	49.3	47.1	60,240	
新日本空調	9.8	10.1	10,271	
NDS	19	19	5,757	
九電工	21	22	56,804	
三機工業	23.6	26.7	24,350	
日揮	117	121	214,170	
中外炉工業	35	36	7,416	
ヤマト	10	10.9	5,330	
太平電業	16	18	18,018	
高砂熱学工業	32.4	35.9	52,737	
三晃金属工業	11	12	3,828	
朝日工業社	13	14	6,300	
明星工業	20.4	21.8	10,485	
大気社	16.6	14.7	41,439	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ダイダシ	16	16	12,432	
日比谷総合設備	15	14.5	23,751	
東芝プラントシステム	18.9	19.5	28,099	
OSJBホールディングス	15.8	24.5	6,198	
東洋エンジニアリング	56	64	18,880	
千代田化工建設	84	87	75,342	
新興ブランテック	23.9	24.7	21,365	
食料品 (5.0%)				
日本製粉	71	79	74,576	
日清製粉グループ本社	127.5	131.9	250,478	
日東富士製粉	9	9	3,339	
昭和産業	48	49	24,402	
鳥越製粉	9.2	9.5	6,194	
中部飼料	11.1	11.1	9,690	
フィード・ワン	69.9	72.4	9,267	
東洋精糖	18	18	1,872	
日本甜菜製糖	59	61	12,017	
三井製糖	46	47	24,158	
塩水港精糖	12.4	12.9	3,366	
日新製糖	—	5.1	7,558	
森永製菓	105	108	64,368	
中村屋	27	28	13,412	
江崎グリコ	26.8	27.8	160,406	
名糖産業	5.1	5.3	7,197	
不二家	66	69	13,317	
山崎製パン	85	88	206,008	
第一屋製パン	16	18	1,872	
モロゾフ	18	18	7,686	
亀田製菓	6.5	6.7	30,150	
寿スピリッツ	2.8	2.9	20,590	
カルビー	43	44.6	205,606	
森永乳業	104	108	64,800	
六甲バター	5.2	5.4	9,849	
ヤクルト本社	62.3	64.5	336,690	
明治ホールディングス	34.4	71.3	645,265	
雪印メグミルク	27.3	28.3	81,673	
プリマハム	65	76	21,584	
日本ハム	85	88	226,248	
伊藤ハム	64	58	43,152	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
林兼産業	37	39	3,978
丸大食品	60	62	28,520
米久	3.7	3.8	10,263
S Foods	7.3	7.5	18,757
サッポロホールディングス	190	184	105,800
アサヒグループホールディングス	233.7	225.7	773,022
キリンホールディングス	497.4	487.5	774,150
宝ホールディングス	91.2	87.1	80,219
オエノンホールディングス	30	33	6,765
養命酒製造	7	3.7	7,396
コカ・コーラウエスト	39.4	40.7	111,721
コカ・コーライーストジャパン	35.3	42.6	81,706
サントリー食品インターナショナル	69.7	82.4	400,876
ダイドードリンコ	5.9	6.1	32,452
伊藤園	34.5	35.7	127,627
キーコーヒー	10.2	10.6	20,691
ユニカフェ	3.1	3.2	3,072
ジャパンフーズ	1.5	1.5	1,795
日清オイリオグループ	56	64	30,528
不二製油グループ本社	31	32.1	66,093
かどや製油	1.1	1.2	3,567
J-オイルミルズ	49	50	18,450
キッコーマン	95	91	343,980
味の素	268	258	705,888
キュービー	59.1	61.2	157,528
ハウス食品グループ本社	43	41.1	89,762
カゴメ	44.9	43.2	94,176
焼津水産化学工業	5.5	5.7	5,853
アリアケジャパン	10.6	9.8	65,072
ピエトロ	—	1.1	2,251
エバラ食品工業	1.9	2.9	5,988
ニチレイ	124	128	117,632
東洋水産	60.7	59.1	244,378
イートアンド	1.3	1.3	3,035
日清食品ホールディングス	49.2	50.9	280,968
永谷園ホールディングス	11	11	12,397
一正蒲鉾	2	4.2	4,170
フジッコ	11	11.7	28,126
ロック・フィールド	6	6.3	22,239

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本たばこ産業	644.2	711.1	3,290,970
ケンコーマヨネーズ	3.8	3.9	9,192
わらべや日洋	6.8	6.5	16,061
なとり	5.3	6	10,206
北の達人コーポレーション	—	1.7	799
ユーグレナ	25.3	40.7	65,852
ミヨシ油脂	40	41	5,166
理研ビタミン	3.4	3.5	14,350
繊維製品 (0.7%)			
片倉工業	13.6	14.1	16,186
グンゼ	88	91	30,303
東洋紡	430	445	76,095
ユニチカ	316	327	18,312
富士紡ホールディングス	53	55	12,375
日清紡ホールディングス	69	—	—
倉敷紡績	111	115	23,805
シキボウ	62	69	7,866
日本毛織	34	34.6	26,884
大東紡織	16	16	960
トーア紡コーポレーション	49	4.8	2,448
ダイドーリミテッド	12.1	12.7	6,197
帝国繊維	11.4	11.8	18,349
帝人	444	460	180,320
東レ	841	816	776,016
サカイオーベックス	29	30	5,370
住江織物	27	28	9,072
日本フェルト	5.8	6	2,802
イチカワ	7	7	2,002
日本バイリーン	15	—	—
日東製網	13	12	1,692
芦森工業	23	24	3,960
アツギ	91	87	10,005
ダイニック	21	21	3,360
セーレン	27.1	28	36,232
東海染工	15	16	2,160
小松精練	18.1	17.3	11,072
ワコールホールディングス	65	67	93,130
ホギメディカル	6.8	7.1	42,955
レナウン	26.3	30.7	3,499

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
クラウディア	2.5	2.9	1,557	
T S Iホールディングス	48.5	50.2	38,352	
三陽商会	57	63	16,191	
ナイガイ	40	41	2,009	
オンワードホールディングス	78	75	57,375	
ルック	18	20	3,100	
キムラタン	484	478	2,868	
ゴールドウイン	25	4.8	22,752	
デサント	24.8	25.6	41,472	
キング	5.4	5.6	2,223	
ヤマトインターナショナル	7.1	7	2,737	
パルプ・紙 (0.3%)				
特種東海製紙	63	65	26,065	
王子ホールディングス	446	461	214,826	
日本製紙	52.4	58.1	121,661	
三菱製紙	166	171	14,193	
北越紀州製紙	67.4	69.8	47,813	
中越パルプ工業	41	45	8,775	
巴川製紙所	17	17	3,400	
大王製紙	48	49.8	48,804	
レンゴー	96	99	57,519	
トーモク	34	35	9,695	
ザ・バック	7.7	8	21,352	
化学 (6.1%)				
クラレ	185	177.4	235,587	
旭化成	678	701	510,468	
共和レザー	7.1	7.4	6,578	
コープケミカル	16	—	—	
昭和電工	723	749	84,637	
住友化学	800	828	424,764	
日本化成	20	21	2,499	
住友精化	23	23	14,536	
日産化学工業	71.3	67.6	196,580	
ラサ工業	41	42	4,620	
クレハ	76	85	30,005	
多木化学	7	7	4,697	
テイカ	18	19	10,374	
石原産業	182	202	15,554	
片倉コープアグリ	7	14	3,318	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日東エフシー	—	6.6	5,867	
日本曹達	70	73	41,099	
東ソー	271	303	146,955	
トクヤマ	169	186	31,806	
セントラル硝子	111	122	74,908	
東亜合成	136	70.4	64,627	
大阪ソーダ	43	48	20,112	
関東電化工業	26	27	21,789	
デンカ	225	233	107,646	
信越化学工業	194.9	201.7	1,189,626	
日本カーバイド工業	37	38	4,978	
堺化学工業	44	45	13,860	
エア・ウォーター	96	93	156,798	
大陽日酸	140	86.6	92,575	
日本化学工業	40	42	9,030	
日本パーカラライジング	25.6	57.5	58,477	
高圧ガス工業	16	17	11,118	
チタン工業	13	13	2,483	
四国化成工業	16	16	15,408	
戸田工業	22	22	6,798	
ステラ ケミファ	5.5	5.7	12,431	
保土谷化学工業	33	34	6,460	
日本触媒	85	16.3	94,377	
大日精化工業	45	43	20,425	
カネカ	147	152	146,072	
三菱瓦斯化学	187	193	117,923	
三井化学	494	477	178,398	
J S R	107.3	105.5	172,809	
東京応化工業	22.5	22.6	65,110	
大阪有機化学工業	7.8	8	4,688	
三菱ケミカルホールディングス	679.3	753.2	454,857	
日本合成化学工業	25	26	18,356	
ダイセル	152.8	158.1	236,359	
住友ベークライト	102	105	46,830	
積水化学工業	252	255.3	350,782	
日本ゼオン	94	97	70,907	
アイカ工業	32.7	33.8	77,334	
宇部興産	547	602	121,002	
積水樹脂	16.8	17.3	25,880	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
タキロン	23	26	14,456	
旭有機材工業	38	36	7,776	
日立化成	53.7	55.6	112,868	
ニチバン	11	11	7,227	
リケンテクノス	17.6	18.3	7,411	
大倉工業	26	27	8,019	
積水化成成品工業	31	29	9,976	
群栄化学工業	29	30	9,000	
タイガースポリマー	5.3	5.5	3,360	
ミライアル	3.9	4	3,348	
ダイキアクシス	1.2	2.1	1,873	
ダイキョーニシカワ	2.6	14.5	22,330	
日本化薬	71	73	82,563	
カーリットホールディングス	8.6	10.4	5,366	
日本精化	9	9.3	7,319	
扶桑化学工業	—	7.1	11,942	
ADEKA	50.1	55.3	88,645	
日油	90	86	69,574	
新日本理化	17.1	17.9	2,488	
ハリマ化成グループ	9.2	9.6	5,299	
花王	292.2	302.4	1,846,454	
第一工業製薬	24	25	8,625	
ニイタカ	—	1.6	2,102	
三洋化成工業	34	35	27,895	
大日本塗料	62	64	12,864	
日本ペイントホールディングス	94	86.8	220,819	
関西ペイント	132	127.2	224,889	
神東塗料	8	8	1,432	
中国塗料	31	32	24,448	
日本特殊塗料	8.4	7.9	7,370	
藤倉化成	14.8	15.3	7,833	
太陽ホールディングス	8.8	8.2	30,709	
D I C	435	444	115,440	
サカタインクス	22.2	23	27,301	
東洋インキＳＣホールディングス	107	111	50,838	
T&K TOKA	3.6	8.1	7,808	
富士フイルムホールディングス	248.7	257.3	1,166,598	
資生堂	193.3	213.3	543,381	
ライオン	125	130	165,620	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
高砂香料工業	36	7.4	18,773	
マンダム	10.9	10.5	51,922	
ミルボン	6.4	6.6	29,898	
ファンケル	25.2	26.1	41,786	
コーセー	17.6	18.2	198,380	
コタ	3.1	3.5	4,704	
シーズ・ホールディングス	7.4	14.2	33,100	
シーボン	1.2	1.3	3,307	
ポーラ・オルビスホールディングス	12.9	11.5	107,985	
ノエビアホールディングス	6.9	7.1	23,607	
アジupanコスメジャパン	2	2.1	1,955	
エステー	7.4	7.7	8,870	
アグロ カネショウ	2.9	4.4	4,637	
コニシ	8.5	8.8	23,865	
長谷川香料	13.8	14.2	24,140	
星光PMC	5.9	6.1	6,996	
小林製薬	17.8	17	169,320	
荒川化学工業	9.2	9.6	9,264	
メック	8.4	8.7	7,447	
日本高純度化学	3.1	3.2	6,688	
J C U	3	3.3	12,391	
新田ゼラチン	6.5	7.3	5,526	
OATアグリオ	—	1	1,430	
デクセリアルズ	—	25.2	29,509	
アース製薬	7.8	8.1	36,612	
イハラケミカル工業	16.7	17.3	24,444	
北興化学工業	12	12	3,660	
大成ラミック	3	3.2	9,712	
クミアイ化学工業	22.4	23.2	23,501	
日本農薬	24.8	25.7	14,623	
アキレス	92	92	13,708	
有沢製作所	18.2	16.6	9,910	
日東電工	84	86.9	560,765	
レック	3.7	3.5	4,669	
きもと	19.4	18.4	3,201	
藤森工業	9.3	9.6	25,238	
前澤化成工業	7.6	7.9	8,405	
J S P	8.1	7.3	15,716	
エフビコ	9.6	10	47,350	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
天馬	8.4	8.6	16,185	
信越ポリマー	21.3	22	13,508	
東リ	28	29	8,497	
ニフコ	24.2	21.5	116,960	
日本バルカー工業	45	44	13,156	
ユニ・チャーム	220	227.6	570,024	
医薬品 (5.7%)				
協和発酵キリン	130	134.5	239,813	
武田薬品工業	407.1	447.8	2,430,210	
アステラス製薬	1,237.5	1,259	1,955,856	
大日本住友製薬	76.9	79.6	103,559	
塩野義製薬	169.7	163.9	896,533	
田辺三菱製薬	126.6	131	262,393	
わかもと製薬	12	13	3,458	
あすか製薬	12.8	14.3	19,691	
日本新薬	25	25.8	108,231	
ピオフェルミン製薬	1.8	1.8	6,858	
中外製薬	108.2	111.9	381,019	
科研製薬	37	19.4	133,084	
エーザイ	143.3	138.4	962,433	
ロート製薬	49.4	55	116,490	
小野薬品工業	49.4	51.1	1,190,885	
久光製薬	30.7	34.9	174,325	
有機合成薬品工業	7	7	1,764	
持田製薬	7.8	7.7	62,832	
参天製薬	39.9	207	349,623	
扶桑薬品工業	37	38	10,602	
日本ケミファ	14	16	8,000	
ツムラ	34.2	35.4	97,243	
日医工	25.4	26.3	69,063	
キッセイ薬品工業	20.2	19.9	51,879	
生化学工業	20.8	21.5	33,110	
栄研化学	9.1	9.4	20,933	
日水製薬	4.4	4.5	5,976	
鳥居薬品	7.4	7.7	20,227	
JCRファーマ	8.4	8.6	20,124	
東和薬品	5.5	5.2	24,518	
富士製薬工業	3.1	3.1	5,927	
沢井製薬	17.2	19.1	135,801	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ゼリア新薬工業	22.2	23	34,132	
第一三共	365.4	378.1	957,160	
キョーリン製薬ホールディングス	29	30	64,980	
大幸薬品	4.8	5.5	7,612	
ダイト	4.4	4.7	13,921	
大塚ホールディングス	215.6	241.7	1,005,472	
大正製薬ホールディングス	26.1	27	243,810	
ペプチドリーム	—	13.8	82,524	
石油・石炭製品 (0.5%)				
日本コークス工業	97.4	90.7	7,437	
昭和シェル石油	97.1	113.1	112,308	
コスモ石油	300	—	—	
ニチレキ	13	13.7	11,398	
東燃ゼネラル石油	164	170	171,360	
ユシロ化学工業	6.4	6	8,040	
ピーピー・カストロール	4.4	4.6	5,846	
富士石油	25.2	26.1	8,117	
MORESCO	2.8	3.5	4,718	
出光興産	51.5	58.7	115,580	
JXホールディングス	1,205.8	1,330.9	595,178	
コスモエネルギーホールディングス	—	33.9	42,849	
ゴム製品 (1.0%)				
横浜ゴム	121	67.8	131,871	
東洋ゴム工業	49.2	50.9	85,664	
ブリヂストン	340.5	379.5	1,595,038	
住友ゴム工業	84.7	105.2	181,575	
藤倉ゴム工業	9.1	9.5	4,227	
オカモト	37	35	32,095	
フコク	4.5	4.1	3,792	
ニッタ	10.7	12.1	34,908	
住友理工	20.1	24.3	23,692	
三ツ星ベルト	28	27	23,463	
パンドー化学	40	41	20,664	
ガラス・土石製品 (0.9%)				
日東紡績	80	74	26,936	
旭硝子	535	593	357,579	
日本板硝子	524	542	43,360	
石塚硝子	14	16	3,440	
日本山村硝子	43	45	7,830	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本電気硝子	208	232	134,096	
オハラ	4.1	4.2	2,318	
住友大阪セメント	202	223	98,789	
太平洋セメント	678	701	185,064	
デイ・シイ	11.1	10.5	3,811	
日本ヒューム	11.3	10.8	6,404	
日本コンクリート工業	18.6	23.1	6,352	
三谷セキサン	5.4	5.6	9,077	
アジアパイルホールディングス	14.5	13.9	5,838	
東海カーボン	94	97	25,317	
日本カーボン	57	55	13,255	
東洋炭素	6	6.2	8,859	
ノリタケカンパニーリミテド	61	63	16,254	
TOTO	160	82.6	294,882	
日本碍子	137	142	292,946	
日本特殊陶業	93.6	96.9	211,726	
ダントーホールディングス	14	13	2,522	
MARUWA	3.2	4.1	11,389	
品川リフラクトリーズ	27	28	5,768	
黒崎播磨	23	24	6,360	
ヨータイ	6	6	1,812	
イソライト工業	5.4	5.6	1,086	
東京窯業	13	13.8	2,470	
ニッカトー	3.9	4	1,548	
フジミインコーポレーテッド	10.5	9.9	14,701	
エーアンドエーマテリアル	23	23	1,817	
ニチアス	48	57	39,786	
ニチハ	14.4	14.9	26,089	
鉄鋼 (1.2%)				
新日鐵住金	4,592	506.8	1,105,584	
神戸製鋼所	1,878	2,065	214,760	
中山製鋼所	81	126	8,442	
合同製鐵	55	63	12,159	
ジェイ エフ イー ホールディングス	277.1	307.2	475,699	
日新製鋼	46	51.3	68,485	
東京製鐵	54.9	62	41,416	
共英製鋼	11.6	12	21,156	
大和工業	24.7	24.8	61,876	
東京鐵鋼	21	23	8,372	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
大阪製鐵	6.8	7	13,188	
淀川製鋼所	77	16.7	40,664	
東洋鋼板	26	26.9	8,930	
丸一鋼管	33.3	37.6	119,004	
モリ工業	17	18	5,616	
大同特殊鋼	182	188	75,952	
日本高周波鋼業	43	44	3,520	
日本冶金工業	84.9	82.7	11,412	
山陽特殊製鋼	65	67	34,907	
愛知製鋼	64	66	29,238	
日立金属	111	128.7	151,866	
日本金属	28	29	2,958	
大平洋金属	69	78	26,598	
新日本電工	66.2	63.6	11,638	
栗本鐵工所	56	54	8,424	
缸技	15	16	2,688	
日本鑄鉄管	11	12	1,680	
三菱製鋼	71	78	14,508	
日亜鋼業	15	15.5	3,921	
日本精線	8	8	3,800	
シンニッタン	11.2	10.1	6,948	
新家工業	21	22	2,948	
非鉄金属 (0.8%)				
大紀アルミニウム工業所	18	17	4,896	
日本軽金属ホールディングス	263.4	254.4	48,844	
三井金属鉱業	295	286	52,624	
東邦亜鉛	61	59	17,759	
三菱マテリアル	678	701	232,031	
住友金属鉱山	300	310	367,970	
DOWAホールディングス	130	145	99,325	
古河機械金属	169	175	30,625	
エス・サイエンス	52.6	51.5	1,802	
大阪チタニウムテクノロジーズ	10.7	11	17,149	
東邦チタニウム	18.4	19	17,328	
UACJ	124	157	36,738	
古河電気工業	319	353	85,426	
住友電気工業	409.2	449.9	626,485	
フジクラ	151	156	86,736	
昭和電線ホールディングス	119	134	8,710	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東京特殊電線	1.5	1.6	1,452	
タツタ電線	20.3	23.4	8,564	
沖電線	11	13	2,795	
カナレ電気	1.7	1.8	3,330	
平河ヒューテック	2.6	5.3	4,971	
リョービ	61	68	30,056	
アーレスティ	9.4	13	9,880	
アサヒホールディングス	16.3	16.9	25,907	
金属製品 (0.7%)				
稲葉製作所	4.6	6	7,806	
宮地エンジニアリンググループ	31	35	5,145	
トーカロ	7.1	7.9	16,977	
アルファC o	3.6	3.7	4,236	
SUMCO	74.7	88	65,120	
川田テクノロジーズ	2	2.1	7,518	
東洋製織グループホールディングス	77.2	79.9	171,305	
ホッカンホールディングス	26	29	9,048	
コロナ	5.7	5.9	6,478	
横河ブリッジホールディングス	20.5	21.3	24,984	
駒井ハルテック	19	20	4,800	
高田機工	9	10	2,070	
三和ホールディングス	104.7	113.8	94,681	
文化シャッター	30	31.3	29,860	
三協立山	14.2	14.7	21,535	
アルインコ	4.6	6.3	6,419	
東洋シャッター	2.7	2.8	1,584	
L I X I Lグループ	161.3	156.5	365,114	
日本フィルコン	7.9	8.2	3,526	
ノーリツ	21.3	22	39,974	
長府製作所	11.6	12	30,612	
リンナイ	20.2	20.9	212,135	
ダイニチ工業	5.5	5.7	3,511	
日東精工	15	16	4,608	
三洋工業	14	14	2,212	
岡部	21.4	23.3	18,057	
ジーテクト	7.4	11.7	15,572	
中国工業	1.7	1.7	1,190	
東プレ	20.9	21.6	46,396	
高周波熱練	18.7	20.9	16,448	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東京製綱	73	76	12,540	
サンコール	7	6	3,132	
モリテック スチール	5.5	5.7	1,556	
バイオラックス	5.5	5.7	32,034	
日本発條	94.3	105.8	115,216	
中央発條	14	14	4,116	
アドバネクス	20	2.1	2,727	
立川ブラインド工業	—	4.7	3,275	
三益半導体工業	8	8.3	8,640	
機械 (4.6%)				
日本ドライケミカル	1.5	1.4	3,224	
日本製鋼所	156	186	69,750	
三浦工業	48.4	50.1	104,608	
タクマ	37	42	45,192	
ツガミ	31	32	13,344	
オークマ	71	73	59,568	
東芝機械	59	61	21,411	
アマダホールディングス	161.9	163.9	182,420	
アイダエンジニアリング	23.7	29.5	29,087	
滝澤鉄工所	34	35	4,585	
富士機械製造	35.5	36.7	43,416	
牧野フライス製作所	54	56	39,984	
オーエスジー	49.5	51.2	106,342	
ダイジェット工業	13	13	1,872	
旭ダイヤモンド工業	29.7	30.8	31,323	
DMG森精機	68.5	62	64,852	
ソディック	—	21.4	18,297	
ディスコ	12.6	14.3	134,849	
日東工器	6.3	6.5	14,397	
パンチ工業	2.9	4.4	3,467	
豊和工業	6.1	6.3	3,578	
OKK	42	43	5,203	
石川製作所	27	28	2,212	
東洋機械金属	7.4	8.4	2,923	
津田駒工業	26	27	2,862	
エンシュウ	27	28	2,128	
島精機製作所	15.3	15.9	29,971	
フリーユー	—	1.7	4,991	
日阪製作所	13.7	14.2	11,644	

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
やまびこ	4.3	20.6	16,830
ベガサスミシン製造	9.5	11.6	6,159
ナブテスコ	66.1	58.4	140,627
三井海洋開発	10.9	13.2	22,255
レオン自動車	8.3	9.5	6,697
SMC	32.6	33.7	879,401
新川	9	10	4,920
ホソカワミクロン	18	19	10,944
ユニオンツール	5.4	4.9	13,911
オイレス工業	13.6	14.5	25,244
日精エー・エス・ビー機械	3.5	4.1	8,954
サトーホールディングス	13.5	15.1	35,318
日本エアータック	3.2	3.9	2,453
日精樹脂工業	7.9	8.2	5,756
ワイエイシイ	4.4	4.5	4,077
小松製作所	538.4	550.8	1,068,276
住友重機械工業	297	328	156,128
日立建機	48.5	50.2	90,159
日工	15	17	5,882
巴工業	4.1	4.6	6,693
井関農機	111	115	25,990
TOWA	8.9	10.8	7,754
丸山製作所	24	23	4,140
北川鉄工所	50	51	11,118
タカキタ	—	2.8	1,442
クボタ	524	539.5	835,955
荏原実業	3.2	3.4	4,059
三菱化工機	36	37	8,843
月島機械	19.1	21.3	20,724
帝国電機製作所	7.2	8.2	6,002
東京機械製作所	41	43	1,849
新東工業	25.5	25.5	25,041
澁谷工業	9.1	9.4	12,267
アイチ コーポレーション	15.4	15.9	12,131
小森コーポレーション	26.4	27.3	35,899
鶴見製作所	8.1	8.3	14,002
住友精密工業	17	18	6,426
酒井重工業	21	21	3,948
荏原製作所	225	248	117,304

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
石井鐵工所	16	16	2,624
西島製作所	10.6	12	11,928
北越工業	8	12.1	8,639
ダイキン工業	151.1	156.3	1,313,076
オルガノ	21	19	8,189
トーヨーカネツ	63	60	14,940
栗田工業	61.4	67.5	171,855
椿本チエイン	55	64	43,072
大同工業	21	22	4,488
日本コンパヤ	34	37	5,550
木村化工機	10	9.7	3,783
アネスト岩田	16.2	18.1	19,095
ダイフク	51.3	57.7	110,610
サムコ	1.4	1.8	1,672
加藤製作所	23	25	11,375
油研工業	20	21	4,242
タダノ	50	52	54,392
フジテック	30.2	31.3	35,713
CKD	29.1	29.9	28,285
キトー	11.3	13.5	11,596
平和	22.5	33.3	80,286
理想科学工業	12.6	11.9	21,122
SANKYO	31.4	29.9	128,121
日本金銭機械	9.6	9.9	9,266
マースエンジニアリング	5.9	6.1	12,120
福島工業	5.7	6.6	16,671
オーイズミ	3.6	4.5	2,286
ダイコク電機	4.3	4.4	6,226
竹内製作所	—	15.9	25,392
アマノ	34.6	33.2	57,436
JUKI	77	15.9	16,170
サンデンホールディングス	63	65	22,425
蛇の目シン工業	101	10.4	6,520
マックス	16	17	20,961
グローリー	33.2	36.6	138,348
新晃工業	7.2	7.5	12,652
大和冷機工業	15	17.2	16,494
セガサミーホールディングス	111.5	115.4	145,057
日本ビストンリング	40	4.5	7,159

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
リケン	45	50	18,550	
T P R	11.6	13.2	39,006	
ツバキ・ナカシマ	—	9.9	15,156	
ホシザキ電機	22.7	23.5	224,190	
大豊工業	8.4	8.7	9,909	
日本精工	213	220.5	227,997	
NTN	240	266	96,292	
ジェイテクト	110.6	114.4	170,570	
不二越	96	100	39,800	
日本トムソン	36	37	14,689	
THK	69	71.4	144,442	
ユーシン精機	4.6	4.2	8,001	
前澤給装工業	3.9	4.4	6,569	
イーグル工業	14.4	13.3	20,482	
前澤工業	7.6	7.9	2,377	
日本ビラー工業	11.3	10.9	10,605	
キッツ	46.5	52.2	26,778	
日立工機	27.8	28.7	21,266	
マキタ	67.7	70	495,600	
日立造船	81.1	85.1	45,954	
三菱重工業	1,739	1,912	823,116	
I H I	747	825	187,275	
電気機器 (11.5%)				
日清紡ホールディングス	—	59.6	69,732	
イビデン	68	65.7	90,206	
コニカミノルタ	247.2	268.1	265,955	
ブラザー工業	134.1	138.8	183,632	
ミネベア	154	173	153,105	
日立製作所	2,491	2,739	1,447,561	
東芝	2,184	2,260	470,758	
三菱電機	1,037	1,145	1,356,252	
富士電機	289	323	127,262	
東洋電機製造	20	21	7,917	
安川電機	122.1	133.3	171,023	
シンフォニアテクノロジー	72	70	11,200	
明電舎	95	99	51,579	
オリジン電気	15	16	4,544	
山洋電気	23	28	14,644	
デンヨー	9.4	9.9	11,454	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東芝テック	74	77	33,418	
芝浦メカトロニクス	17	17	3,740	
マブチモーター	31.7	30.7	158,412	
日本電産	112.2	129.2	1,044,065	
東光高岳	5.2	6	8,724	
ダブル・スコープ	—	3.2	16,352	
宮越ホールディングス	3.5	3.7	1,435	
ダイヘン	57	63	32,634	
田淵電機	8.8	12.2	6,478	
ヤーマン	1.3	1.4	3,010	
J V Cケンウッド	76.1	78.8	22,930	
ミマキエンジニアリング	—	7.2	4,485	
第一精工	3.8	4.5	5,602	
日新電機	24	25.2	31,374	
大崎電気工業	17	20	15,700	
オムロン	112	121.2	412,080	
日東工業	16.6	17.2	31,114	
I D E C	12.3	14	15,316	
不二電機工業	1	1	1,397	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	200	207	100,395	
サクサホールディングス	26	27	5,886	
メルコホールディングス	5.7	5.9	13,988	
テクノメディカ	2.3	2.4	5,090	
日本電気	1,342	1,476	413,280	
富士通	1,000	1,035	431,595	
沖電気工業	359	465	73,005	
岩崎通信機	45	50	3,700	
電気興業	29	28	14,840	
サンケン電気	53	59	20,532	
ナカヨ	10	10	3,600	
アイホン	6	6.1	11,791	
ルネサスエレクトロニクス	53.7	55.6	41,422	
セイコーエプソン	70.8	159.9	300,292	
ワコム	81.7	84.5	42,250	
アルバック	17.7	19.7	68,063	
アクセル	4.8	4.8	4,276	
E I Z O	9.5	10.6	30,157	
ジャパンディスプレイ	159.8	200.5	42,907	
日本信号	28.6	29.6	26,995	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
京三製作所	24	25	9,000	
能美防災	13.7	12.2	19,995	
ホーチキ	7.5	7.8	10,311	
エレコム	3.2	9.3	17,251	
日本無線	22	28	8,400	
パナソニック	1,264.3	1,226.5	1,225,886	
シャープ	877	907	114,282	
アンリツ	64.9	64.5	43,795	
富士通ゼネラル	32	33	55,968	
日立国際電気	27	24.6	32,472	
ソニー	678	757.5	2,193,720	
TDK	62.6	64.8	415,368	
帝国通信工業	25	25	4,450	
ミツミ電機	36.6	40.8	23,460	
タムラ製作所	40	41	12,341	
アルプス電気	81.9	91.1	189,396	
池上通信機	35	34	4,862	
バイオニア	155.9	173.7	46,725	
日本電波工業	9.4	9.7	7,275	
鈴木	1.3	3.1	1,596	
日本トリム	2.5	2.9	15,979	
ローランド ディー. ジー.	4.2	5.3	11,850	
フォスター電機	10.6	13.5	32,319	
クラリオン	55	57	19,380	
SMK	31	32	18,656	
ヨコオ	8.1	7.6	4,020	
東光	24	22	8,272	
ティアック	56	78	3,354	
ホシデン	31.4	32.5	21,255	
ヒロセ電機	16.8	17.3	219,191	
日本航空電子工業	30	31	40,362	
TOA	11.1	12.7	13,944	
日立マクセル	15.5	17.8	30,669	
古野電気	12.3	12.8	8,601	
ユニデンホールディングス	28	34	4,488	
アルパイン	24.7	25.6	33,024	
スミダコーポレーション	9.3	8.8	6,512	
アイコム	5.7	5.9	12,649	
リオン	2.9	4.1	6,629	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
船井電機	10.5	10.8	10,530	
横河電機	103.8	107.5	124,055	
新元元工業	40	38	15,618	
アズビル	33.9	35.1	99,719	
東亜ディーケーケー	4.3	4.5	2,389	
日本光電工業	22.1	44.9	130,524	
チノー	3.7	3.8	4,176	
共和電業	12.7	13.2	5,029	
日本電子材料	4.4	4.3	1,909	
堀場製作所	19.2	19.8	82,269	
アドバンテスト	70.7	73.2	77,592	
小野測器	5.2	5.2	3,764	
エスベック	11.5	11.1	16,372	
パナソニック デバイスSUNX	9.1	9.4	5,724	
キーエンス	23.5	24.3	1,470,150	
日置電機	5.4	5.6	13,636	
シスメックス	80.3	83.3	588,098	
日本マイクロニクス	—	14	15,750	
メガチップス	10.8	11.2	14,739	
OBARA GROUP	6.7	7	28,490	
澤藤電機	6	6	1,116	
コーセル	15.1	14.9	16,509	
新日本無線	8	7.9	3,476	
オブテックス	7.1	7.9	26,465	
千代田インテグレ	4.6	5.7	14,478	
レーザーテック	10.6	12.6	19,479	
スタンレー電気	74.5	77	194,425	
岩崎電気	35	37	6,919	
ウシオ電機	63	65.2	97,474	
岡谷電機産業	5.6	5.8	2,262	
ヘリオス テクノ ホールディング	9.6	9.2	3,864	
日本セラミック	5.9	6.1	11,962	
遠藤照明	4.8	5.4	5,659	
日本デジタル研究所	8.7	9.1	14,596	
古河電池	7	8	5,312	
双信電機	5.1	5.2	1,450	
山一電機	12	9.3	5,440	
図研	7.5	7.8	9,375	
日本電子	44	42	22,554	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
カシオ計算機	104	107.6	243,391	
ファナック	108	109.8	1,930,833	
日本シイエムケイ	26.4	23.1	10,140	
エンブラス	4.7	5.5	23,045	
大真空	19	20	4,880	
ローム	51.1	52.9	262,384	
浜松ホトニクス	43.2	83.8	262,294	
三井ハイテック	13.7	15.6	10,935	
新光電気工業	39.2	40.6	26,633	
京セラ	170.3	176.2	888,048	
太陽誘電	54.3	52.2	61,074	
村田製作所	108.8	112.6	1,587,660	
ユーシン	14.4	14.2	9,741	
双葉電子工業	17.7	18.4	29,495	
北陸電気工業	45	43	6,020	
ニチコン	32.7	33.8	27,141	
日本ケミコン	84	87	14,181	
KOA	14.3	14.8	12,876	
市光工業	25	26	5,902	
小糸製作所	62.2	64.3	327,287	
ミツバ	19.1	18.2	30,903	
スター精密	19.7	20.4	24,949	
SCREENホールディングス	98	110	91,300	
キャノン電子	9.5	9.8	16,513	
キャノン	601.5	578	1,949,594	
リコー	311.9	347.6	410,168	
MUTOHホールディングス	14	13	3,289	
東京エレクトロン	87.3	88.1	643,570	
輸送用機器 (9.9%)				
トヨタ紡織	36.3	37.5	70,387	
鬼怒川ゴム工業	24	25	19,225	
ユニプレス	19.9	22.3	44,689	
豊田自動織機	94.5	97.8	497,802	
モリタホールディングス	18.1	18.8	25,756	
三櫻工業	13.2	13.6	8,704	
デンソー	256.3	265.2	1,197,908	
東海理化電機製作所	27.3	31.4	67,070	
三井造船	402	415	70,550	
川崎重工業	754	835	268,870	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
名村造船所	28.9	32.2	27,724	
サノヤスホールディングス	12.6	13.2	3,115	
日本車輛製造	38	44	12,056	
ニチユ三菱フォークリフト	11.9	12.5	5,737	
近畿車輛	16	16	5,312	
日産自動車	1,456.2	1,506.9	1,639,507	
いすゞ自動車	328	311.1	375,964	
トヨタ自動車	1,431.3	1,335.2	8,251,536	
日野自動車	148.1	153.2	192,266	
三菱自動車工業	380.2	426.3	367,044	
エフテック	5.9	5.6	6,070	
レシップホールディングス	3.4	3.5	2,719	
GMB	1.5	1.7	1,368	
ファルテック	1.1	1.9	2,760	
武蔵精密工業	11.1	11.4	26,254	
日産車体	45.6	52.4	59,945	
新明和工業	42	47	37,600	
極東開発工業	19.3	21.4	24,417	
日信工業	19	24	37,032	
トビー工業	85	88	20,856	
ティラド	40	42	8,148	
曙ブレーキ工業	43.8	54.4	14,960	
タチエス	16.4	17	28,594	
NOK	50.2	51.9	100,478	
フタバ産業	31.6	32.7	15,238	
KYB	116	120	38,880	
シロキ工業	23	27	8,694	
大同メタル工業	14.5	15	13,350	
プレス工業	51	57	22,971	
ミクニ	—	10.3	3,924	
カルソニックカンセイ	79	82	67,322	
太平洋工業	21.1	23.8	26,370	
ケーヒン	23.8	24.7	41,471	
河西工業	12.7	13.2	15,985	
アイシン精機	94.9	108	471,960	
富士機工	12	12.5	5,812	
マツダ	309.2	339.9	589,896	
ダイハツ工業	123.8	128.1	207,393	
今仙電機製作所	8.8	9.8	9,770	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
本田技研工業	933.6	966.1	2,988,147	
スズキ	216.9	224.4	675,444	
富士重工業	353.1	339.2	1,377,152	
安永	3.4	3.6	1,918	
ヤマハ発動機	157.8	151.6	273,638	
ショーワ	24.5	27.9	27,676	
TBK	13.3	12.9	5,379	
エクセディ	14.1	14.6	37,157	
豊田合成	33.5	39	86,268	
愛三工業	16.1	18.8	17,164	
盟和産業	8	1.3	1,409	
ヨロズ	9.7	10	24,010	
エフ・シー・シー	15.3	17.5	33,652	
シマノ	44.8	43.3	779,400	
タカタ	18.8	19.4	9,797	
ティ・エス テック	21.9	24.9	65,960	
ジャムコ	—	4.7	13,540	
精密機器 (1.6%)				
テルモ	159	164.6	683,090	
クリエートメディック	3.4	3.5	3,013	
日機装	33.6	38.6	31,150	
島津製作所	124	138	239,016	
JMS	19	20	5,880	
クボテック	2.2	2.3	1,159	
モリテックス	2.4	2.3	657	
長野計器	6.6	6.5	4,251	
ブイ・テクノロジー	2	2.6	13,156	
東京計器	36	34	5,780	
愛知時計電機	14	14	4,326	
オーバル	7.6	10.6	2,692	
東京精密	18.6	20.7	47,547	
マニー	2.9	9.8	18,669	
ニコン	193.7	200.4	361,120	
トプコン	31.3	36	53,928	
オリンパス	154.5	159.9	671,580	
理研計器	9.1	8.7	9,126	
タムロン	8	8.7	16,086	
HOYA	246.9	249.8	1,112,359	
ノーリツ鋼機	9.3	9.7	4,520	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
エー・アンド・デイ	9.4	9.8	3,900	
シチズンホールディングス	127.7	132.1	86,393	
リズム時計工業	45	47	7,144	
大研医器	7.2	8.5	7,624	
メニコン	—	5.4	21,141	
松風	5.1	5.2	7,462	
セイコーホールディングス	73	69	31,395	
ニプロ	66.3	80	86,240	
その他製品 (1.6%)				
スノーピーク	—	0.9	3,163	
パラマウントベッドホールディングス	10.9	11.3	47,064	
トランザクション	—	1.6	1,043	
SHO-BI	3.5	3.6	1,418	
ニホンフラッシュ	—	3.1	3,437	
前田工織	10.3	11.8	13,216	
永大産業	15	15	6,270	
アートネイチャー	7.5	8.6	8,892	
ダンロップスポーツ	6.5	6.8	6,514	
バンダイナムコホールディングス	114.4	111	266,733	
アイフィスジャパン	—	1.8	766	
共立印刷	18.8	17.8	5,126	
SHOEI	—	5.2	9,495	
フランスベッドホールディングス	72	15	15,360	
パイロットコーポレーション	9	18.7	80,129	
萩原工業	2.2	2.2	4,985	
トッパン・フォームズ	18.5	19.2	24,019	
フジシールインターナショナル	12.6	13	51,350	
タカラトミー	37.2	35.3	30,463	
廣済堂	9.6	10.1	3,373	
A s - m e エステール	2.8	2.9	1,914	
アーク	32.7	45.6	4,058	
タカノ	4.6	4.7	2,965	
プロネクス	10.5	10	12,090	
ホクシン	8.4	8.6	1,014	
ウツドワン	17	20	5,100	
大建工業	42	42	13,020	
凸版印刷	293	303	297,243	
大日本印刷	316	318	332,628	
図書印刷	17	20	10,780	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
共同印刷	32	36	12,132	
日本写真印刷	17.4	18	30,438	
光村印刷	9	11	2,442	
宝印刷	5.4	5.2	6,910	
アシックス	103.1	100	204,300	
ツツミ	5.2	5.4	13,489	
小松ウオール工業	3.2	3.6	6,739	
ヤマハ	76.2	78.9	276,544	
河合楽器製作所	3.6	4	7,988	
クリナップ	9.5	12.6	9,651	
ビジョン	19.6	60.8	176,441	
兼松日産農林	13	11	1,672	
キングジム	8.6	8.9	7,431	
リンテック	24.7	25.5	53,805	
TASAKI	1.9	2	3,464	
イトーキ	21.8	22.6	18,238	
任天堂	63.9	66.1	1,111,471	
三菱鉛筆	8.5	8	37,960	
タカラスタンダード	43	44	46,288	
コクヨ	53.9	55.8	72,986	
ナカバヤシ	22	22	6,028	
グローブライド	50	5.2	7,472	
岡村製作所	39.8	37.5	40,200	
美津濃	56	58	31,204	
アデランス	12	18.6	12,331	
電気・ガス業 (2.1%)				
東京電力	880	910.7	533,670	
中部電力	317.4	328.5	511,967	
関西電力	423.3	438.1	434,770	
中国電力	143.4	148.4	226,755	
北陸電力	101.6	105.2	167,583	
東北電力	259.2	268.2	389,694	
四国電力	93.4	96.7	144,179	
九州電力	229.1	237.1	249,429	
北海道電力	97.1	100.5	94,369	
沖縄電力	6.8	11.4	33,356	
電源開発	75.2	91.5	318,420	
イーレックス	—	2.1	3,460	
東京瓦斯	1,261	1,198	630,866	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
大阪瓦斯	1,074	1,111	479,729	
東邦瓦斯	264	271	215,716	
北海道瓦斯	20	26	7,280	
広島ガス	—	18.7	7,236	
西部瓦斯	117	121	31,944	
静岡ガス	29.5	30.5	23,790	
メタウォーター	4.8	6.9	18,623	
陸運業 (4.6%)				
SBSホールディングス	7.7	10.6	7,759	
東武鉄道	554	574	327,180	
相鉄ホールディングス	178	184	127,144	
東京急行電鉄	564	625	593,750	
京浜急行電鉄	284	294	289,884	
小田急電鉄	332	344	424,496	
京王電鉄	290	300	298,800	
京成電鉄	156	161	251,482	
富士急行	28	29	43,036	
新京成電鉄	13	14	6,300	
東日本旅客鉄道	190.1	196.3	1,979,685	
西日本旅客鉄道	99.9	103.3	737,148	
東海旅客鉄道	92.9	96.1	1,964,764	
西武ホールディングス	82.7	85.5	200,326	
鴻池運輸	6.4	15.2	19,684	
西日本鉄道	134	139	106,196	
ハマキョウレックス	3.2	8.2	15,875	
サカイ引越センター	1.8	4.2	14,637	
近鉄グループホールディングス	1,044	1,080	506,520	
阪急阪神ホールディングス	696	720	515,520	
南海電気鉄道	232	241	146,769	
京阪電気鉄道	232	241	194,969	
神戸電鉄	25	26	9,568	
名糖運輸	4.3	—	—	
名古屋鉄道	378	391	207,621	
山陽電気鉄道	38	39	19,188	
日本通運	411	415	225,760	
ヤマトホールディングス	182.4	198.4	459,196	
山九	126	141	73,179	
丸運	5.6	5.8	1,484	
丸全昭和運輸	35	36	14,544	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
センコー	43	48	33,408	
トナミホールディングス	21	22	6,424	
ニッコンホールディングス	33.9	35.1	72,411	
日本石油輸送	12	12	2,880	
福山通運	63	65	36,205	
セイノーホールディングス	80.3	76.1	94,287	
神奈川中央交通	12	13	9,165	
日立物流	21.6	22.4	39,491	
丸和運輸機関	—	2.4	6,216	
C&Fロジホールディングス	—	10.3	8,940	
海運業 (0.2%)				
日本郵船	876	964	212,080	
商船三井	544	523	120,813	
川崎汽船	454	470	104,810	
NSユニテッド海運	45	48	7,872	
明治海運	9.3	9.7	3,579	
飯野海運	53.7	55.5	25,474	
共栄タンカー	9	9	1,341	
第一中央汽船	102	—	—	
乾汽船	—	8.5	7,505	
空運業 (0.7%)				
日本航空	198.6	205.5	866,799	
ANAホールディングス	2,039	1,993	651,312	
バスコ	10	10	4,540	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
トランコム	3	3.1	19,902	
日新	39	44	13,464	
三菱倉庫	68	76	113,240	
三井倉庫ホールディングス	60	62	18,724	
住友倉庫	76	78	44,304	
澁澤倉庫	27	28	8,148	
東陽倉庫	18	18	4,464	
乾汽船	6.9	—	—	
日本トランスシティ	24	25	9,650	
ケイヒン	19	20	3,020	
中央倉庫	6	6.2	6,051	
安田倉庫	8.1	8.3	6,067	
東洋埠頭	32	31	4,774	
宇徳	8.4	8.8	2,992	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
上組	124	128	135,552	
サンリツ	2.5	2.6	1,393	
キムラユニティー	2.6	2.7	3,129	
キューソー流通システム	2.9	3	7,368	
郵船ロジスティクス	9.5	9.9	12,711	
近鉄エクスプレス	9.3	19.2	29,356	
東海運	5.6	5.8	1,664	
エーアイテイー	4.8	4.9	4,650	
内外トランスライン	—	2.7	2,840	
情報・通信業 (8.2%)				
NECネットエスアイ	12.8	13.3	24,339	
システナ	10	10.3	17,849	
デジタルアーツ	5.5	5.2	12,084	
新日鉄住金ソリューションズ	8.5	17.7	39,506	
キューブシステム	4.4	4.6	3,289	
コア	4.3	4.5	6,786	
ソフトクリエイトホールディングス	3.3	3.8	3,138	
ITホールディングス	33.9	35.1	91,856	
ネオス	2.7	3.1	1,608	
電算システム	3.5	3.7	6,019	
グリー	62	64.3	37,744	
コーエーテックモホールディングス	23.1	25.1	45,255	
三菱総合研究所	4	4.1	14,657	
ボルテージ	1.8	2.1	2,610	
電算	1.1	1.2	2,988	
AGS	1.7	1.8	1,776	
ファインデックス	1.5	7	8,890	
ヒト・コミュニケーションズ	1.4	2.4	4,860	
ブレインパッド	1.5	1.6	1,161	
KL a b	10.8	16.4	10,348	
ポールトゥウィン・ビットクルーホールディ	6.7	7	6,405	
イーブックイニシアティブジャパン	2.3	2.3	1,474	
ネクソン	97.3	101.3	191,659	
アイスタイル	4.3	16.1	17,597	
エムアップ	2.7	2.7	1,674	
エイチーム	1.2	3.9	6,372	
テクノスジャパン	—	1.1	3,685	
e n i s h	2.7	3.1	1,918	
コロブラ	18	29.4	69,795	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
モバイルクリエイト	6	7	3,269
オルトプラス	1.9	3.9	1,532
ブロードリーフ	8.4	10.9	14,834
ハーツユナイテッドグループ	3.1	3.2	7,532
ブイキューブ	—	5.2	8,002
サイバーリンクス	—	1.2	1,098
VOYAGE GROUP	—	2.4	3,434
オブティム	—	0.7	3,507
ベリサーブ	1.2	1.2	4,536
ティーガイア	10.2	10.5	14,595
日本アジアグループ	—	9	5,031
豆蔵ホールディングス	8	8.3	6,200
テクマトリックス	4.4	4.5	8,356
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	—	185.1	56,085
GMOペイメントゲートウェイ	8.9	9.2	68,172
ザッパラス	5.7	6	2,364
インターネットイニシアティブ	16.7	17.1	38,936
さくらインターネット	—	5.2	7,144
GMOクラウド	1.7	2.3	2,295
ビットアイル	11.6	—	—
SRAホールディングス	5.4	6.1	16,152
Minor iソリューションズ	—	1.5	1,408
システムインテグレータ	1.5	1.5	1,275
パイブドビッツ	1	—	—
朝日ネット	10.5	9.6	4,771
コムチュア	1.7	1.8	4,230
gumi	7.7	10.9	7,139
パイブドHD	—	1.3	1,518
パナソニック インフォメーションシステム	2.4	—	—
フェイス	3.1	2.8	3,712
ハイマックス	—	1.4	1,692
野村総合研究所	58	74.3	280,111
サイバネットシステム	8.4	8.6	7,980
CEホールディングス	1.2	1.6	1,316
インテージホールディングス	5.8	5.5	8,112
東邦システムサイエンス	3	3.1	1,990
ソースネクスト	5.1	5.3	2,321
ディー・ワイ・オー	10	14.7	2,366
クレスコ	2.3	2.4	4,408

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
フジ・メディア・ホールディングス	106.6	110.3	143,059
オービック	35.3	36.5	217,540
ジャストシステム	14	19.3	17,447
TDCソフトウェアエンジニアリング	2.2	2.3	3,270
ヤフー	733.8	759.4	360,715
トレンドマイクロ	54.2	51.4	215,880
インフォメーション・ディベロプメント	1.9	2	1,836
日本オラクル	16.4	17	106,080
アルファシステムズ	3.3	3.5	6,076
フューチャーアーキテクト	10.7	12.7	11,226
CAC Holdings	6.9	7.9	6,375
ソフトバンク・テクノロジー	2.7	2.9	4,329
トーセ	2.5	2.8	1,985
オービックビジネスコンサルタント	6.5	5.4	26,082
伊藤忠テクノソリューションズ	11.6	24	53,184
アイティフォー	12.4	13.7	7,110
東計電算	1.8	1.9	3,775
エクスネット	0.9	1	1,580
大塚商会	27.5	28.5	169,290
サイボウズ	13.7	14.2	4,884
ソフトブレーン	14	15.6	2,511
電通国際情報サービス	6.3	6.5	14,683
EMシステムズ	1.2	1.8	4,696
ウェザーニューズ	3.1	3.6	14,706
C I J	9.3	9.7	4,297
東洋ビジネスエンジニアリング	1	1.1	1,502
日本エンタープライズ	6.9	10.9	2,365
WOWOW	2.4	5	12,870
フュージョンパートナー	4.3	6	3,036
日本コロムビア	3.6	3.6	1,630
イマジカ・ロボット ホールディングス	5.4	9	3,708
ネットワンシステムズ	41.6	45.9	28,320
アルゴグラフィックス	4.2	4.8	8,313
マーベラス	17.3	17.9	17,935
エイベックス・グループ・ホールディングス	20.3	19.5	27,651
日本ユニシス	28.3	29.2	42,252
兼松エレクトロニクス	6.5	6.7	12,957
東京放送ホールディングス	61.3	63.5	110,998
日本テレビホールディングス	93.5	96.7	179,088

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
朝日放送	10.1	10.5	7,392
テレビ朝日ホールディングス	28	28.9	59,273
スカパーJ SATホールディングス	77.7	80.4	52,581
テレビ東京ホールディングス	8.3	9.6	19,372
日本BS放送	—	1.8	1,913
U-NEXT	—	2.5	2,827
コネクシオ	7.2	9.3	11,094
日本通信	—	56.2	11,071
クロップス	0.9	1.9	1,031
日本電信電話	400.7	819	4,047,498
KDDI	346.7	1,076.4	3,321,770
光通信	9.2	12.7	107,569
NTTドコモ	843.6	817.2	2,155,773
エムティーアイ	—	13.6	10,186
GMOインターネット	34.2	39.3	53,998
カドカワ	25.1	33.1	55,905
学研ホールディングス	34	35	8,610
ゼンリン	13.5	14	31,220
昭文社	6.1	5.8	3,775
インプレスホールディングス	7.3	8.8	1,302
アイネット	5.2	5.9	6,849
松竹	67	70	73,080
東宝	73.1	75.6	226,497
東映	38	39	36,465
AOI Pro.	4.7	5.3	5,162
エヌ・ティ・ティ・データ	63.2	65.5	369,420
ピー・シー・エー	1.3	1.3	1,994
ビジネスブレイン太田昭和	—	1.6	1,572
DTS	10.6	11.8	25,523
スクウェア・エニックス・ホールディングス	39.4	44.8	136,192
シーイーシー	6.7	6.9	8,914
カブコン	26.2	27.1	73,088
アイ・エス・ピー	—	1.3	972
ジャステック	5.9	6.7	6,076
CSK	24.3	25.2	111,888
日本システムウエア	3.8	4	3,748
アイネス	13.9	15	17,175
TKC	8.6	9.8	30,282
富士ソフト	14.1	15.7	38,402

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
NSD	23.9	22.5	38,227
コナミホールディングス	41.6	47.8	146,746
福井コンピュータホールディングス	2.8	2.3	2,757
JBCホールディングス	8.6	8.9	6,230
ミロク情報サービス	6.7	7.8	7,761
ソフトバンクグループ	541.5	600.3	3,323,260
卸売業 (4.3%)			
ハウスイ	8	8	952
高千穂交易	3.9	4.1	3,944
伊藤忠食品	2.5	2.6	11,362
エレマテック	4.8	4.9	10,363
JALUX	2.9	3.4	7,837
あらた	23	4.8	12,187
トーマンデバイス	1.5	1.6	2,880
東京エレクトロン デバイス	2	3.8	5,977
フィールズ	—	6.9	13,489
双日	685.3	667.5	156,862
アルフレッサ ホールディングス	121.1	133.2	291,175
横浜冷凍	25.3	26.2	28,767
神栄	15	15	1,620
山下医科器械	0.8	0.9	1,594
ラサ商事	4.8	5	2,935
アルコニックス	5.8	6	9,696
神戸物産	3.4	6.8	18,645
あい ホールディングス	16.4	18.9	58,306
ディーブイエックス	3	2.8	3,200
ダイワボウホールディングス	93	96	21,120
マクニカ・富士エレホールディングス	—	19.1	26,587
バイタルケーエスケー・ホールディングス	19.2	18.4	16,228
八洲電機	7.9	8.2	4,674
UKCホールディングス	6.6	6.8	15,986
OCHIホールディングス	2.6	3.1	3,379
TOKAIホールディングス	50	46.6	28,146
三洋貿易	6.1	5.8	8,607
ウイン・パートナーズ	3.3	3.8	5,833
ミタチ産業	2.4	2.7	1,722
シップヘルスケアホールディングス	18.7	21.5	62,651
明治電機工業	2.9	3.3	3,801
デリカフーズ	1.8	2.2	2,105

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
スターティア	0.9	2	1,100	
富士興産	3.9	4.1	1,767	
協栄産業	12	14	1,918	
小野建	8.9	9.2	9,301	
佐鳥電機	8.1	8.4	6,081	
エコートレーディング	2.3	2.4	1,394	
伯東	7	8	8,024	
コンドーテック	7.4	8.4	7,072	
中山福	5.9	6.6	5,200	
ナガイレーベン	14.8	15.3	34,272	
三菱食品	11.2	11.6	34,544	
松田産業	7.4	7.7	9,732	
第一興商	—	18.7	91,630	
メディバルホールディングス	102.4	106	191,754	
アドヴァン	5.2	10.8	11,070	
SPK	2.2	2.4	4,963	
萩原電気	2.8	2.7	5,467	
アズワン	7.3	8.3	34,818	
スズデン	3.3	3.4	3,852	
尾家産業	3.3	3.4	3,151	
シモジマ	6.3	7.3	8,285	
ドウシシャ	13.2	12.5	27,275	
小津産業	2	2.3	5,135	
高速	6.1	6.3	5,556	
たけびし	3.6	3.7	3,751	
黒田電気	17.2	19.7	34,140	
丸文	9	9.4	7,463	
ハビネット	6.2	9.6	9,753	
橋本総業	1.9	2.2	3,473	
エクセル	4.7	5.1	7,252	
マルカキカイ	3.3	3.4	5,205	
ガリバーインターナショナル	31	28.5	37,306	
日本エム・ディ・エム	8.5	8.8	5,350	
進和	6	6.2	9,262	
エスケイジャパン	2.6	2.6	1,016	
ダイトエレクトロン	4.7	4.8	3,628	
シークス	6.5	6.7	23,282	
田中商事	3.1	3.2	2,121	
オーハシテクニカ	6.3	6	7,512	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
マクニカ	5.3	—	—	
白銅	3.3	3	3,387	
伊藤忠商事	857.1	831.5	1,199,854	
丸紅	895.7	1,042.8	620,883	
高島	19	20	3,800	
長瀬産業	62.4	63.7	80,389	
蝶理	6.5	6.7	9,889	
豊田通商	114.1	118	309,514	
三共生興	17.4	16.1	6,584	
兼松	204	225	38,025	
ツカモトコーポレーション	18	19	2,166	
三井物産	868.1	958.1	1,287,686	
日本紙パルプ商事	53	55	18,315	
日立ハイテクノロジーズ	35.5	36.7	114,504	
カメイ	13.3	13.8	15,801	
東都水産	17	17	3,077	
OUGホールディングス	16	15	3,525	
スターゼン	40	3.8	12,844	
山善	39.3	40.7	36,100	
椿本興業	12	12	3,780	
住友商事	604.3	667	780,390	
内田洋行	25	26	11,154	
三菱商事	784.7	795	1,574,895	
第一実業	25	24	11,880	
キヤノンマーケティングジャパン	29.2	30.2	60,611	
西華産業	34	35	8,295	
佐藤商事	9.1	9.4	6,420	
菱洋エレクトロ	11.8	12.2	16,274	
東京産業	10.2	10.6	4,515	
ユアサ商事	9	10	26,730	
神鋼商事	26	24	5,064	
小林産業	7.4	7.1	1,434	
阪和興業	102	106	51,516	
カナデン	10	10.1	9,009	
菱電商事	16	17	11,237	
フルサト工業	5.6	5.8	9,871	
岩谷産業	113	126	82,152	
すてきナイスグループ	44	45	6,570	
昭光通商	36	38	2,964	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ニチモウ	16	16	16	2,944
極東貿易	12	15	15	3,735
イワキ	15	16	16	3,024
三菱石油	26	27	27	22,815
稲畑産業	24.5	25.4	25.4	28,067
G S Iクレオス	27	28	28	3,528
明和産業	8.2	9.8	9.8	3,567
ワキタ	21.8	22.5	22.5	20,902
東邦ホールディングス	35.3	33.9	33.9	79,834
サンゲツ	18.4	36.9	36.9	77,342
ミツウロコグループホールディングス	16.5	17	17	9,775
シナネンホールディングス	22	23	23	10,511
伊藤忠エネクス	22.6	27.3	27.3	25,088
サンリオ	28.7	32.7	32.7	74,719
サンワテクノス	6.5	6.7	6.7	4,917
リョーサン	17.2	16.8	16.8	49,761
新光商事	12	12.4	12.4	14,272
トーヨー	23	4.8	4.8	11,769
三信電気	14.1	14.6	14.6	13,928
東陽テクニカ	15	15	15	17,430
モスフードサービス	13.4	13.9	13.9	42,047
加賀電子	9.2	9.6	9.6	14,620
ソーダニッカ	11	11	11	5,335
立花エレテック	6.3	7.8	7.8	9,461
フォーバル	2	4.2	4.2	3,024
PAL TAC	16.4	16.9	16.9	35,067
三谷産業	—	11.3	11.3	4,101
太平洋興発	40	44	44	3,476
ヤマタネ	51	49	49	7,742
丸紅建材リース	9	9	9	1,791
日鉄住金物産	67	70	70	26,600
トラスコ中山	12.8	12.1	12.1	53,663
オートバックスセブン	37.7	40.6	40.6	78,764
加藤産業	14.7	16.5	16.5	48,031
イノテック	9.4	9.8	9.8	4,429
イエローハット	9.6	10	10	22,670
富士エレクトロニクス	5.3	—	—	—
J Kホールディングス	10.3	10.6	10.6	5,300
日伝	4.2	4.4	4.4	12,949

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
北沢産業	8.6	8.8	8.8	1,592
杉本商事	5.5	6.1	6.1	7,838
因幡電機産業	15.2	14.8	14.8	52,392
バイテックホールディングス	3.5	3.2	3.2	3,452
ミスミグループ本社	38.2	119	119	190,043
江守グループホールディングス	4.4	—	—	—
アルテック	7.7	9.1	9.1	1,419
タキヒヨー	17	18	18	8,532
蔵王産業	—	1.7	1.7	2,339
スズケン	42.4	48.2	48.2	187,257
ジェコス	7	7.3	7.3	7,599
ルネサスイーストン	4.8	6.7	6.7	3,075
小売業 (5.0%)				
ローソン	38.8	40.1	40.1	378,945
サンエー	7.7	7.2	7.2	38,304
ダイユーエイト	2.1	2.8	2.8	1,979
カワチ薬品	7.9	8.2	8.2	16,908
エービーシー・マート	14.6	13.7	13.7	97,407
ハードオフコーポレーション	4.9	5.1	5.1	8,052
アスクル	10.6	12.9	12.9	58,953
ゲオホールディングス	19.3	20.1	20.1	40,179
アダストリア	8.6	19.5	19.5	66,982
ジーフット	—	6.4	6.4	5,120
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	13	15	15	1,350
くらコーポレーション	6	6.2	6.2	32,736
キャンドウ	4.9	5.6	5.6	8,624
バル	6	6.2	6.2	17,347
エディオン	46.9	44.8	44.8	40,544
サーラコーポレーション	8.8	9.1	9.1	6,024
ワッツ	4	4.2	4.2	3,628
ハローズ	—	3.2	3.2	7,356
あみやき亭	1.8	2.1	2.1	9,555
ひらまつ	14.1	14.6	14.6	10,366
ゲンキー	1	2.1	2.1	8,557
サッポロドラッグストアー	0.9	1	1	2,400
大黒天物産	2.4	2.5	2.5	11,775
ハニーズ	9	9.3	9.3	12,108
ファーマライズホールディングス	1.7	2.4	2.4	1,459
アルバン	9.1	9.4	9.4	17,361

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
クオール	10.4	10.8	18,565	
ジェイアイエヌ	7	7.2	31,032	
ビックカメラ	44.4	54.7	55,356	
DCMホールディングス	49.5	52.1	43,034	
MonotaRO	20	37.4	119,680	
東京一番フーズ	—	1.8	1,107	
ダイヤモンドダイニング	—	1.7	1,700	
きちり	2	2.8	1,867	
アークランドサービス	1.2	3.3	9,966	
J. フロント リテイリング	129.6	134.1	193,908	
ドトール・日レスホールディングス	17.9	18.6	34,503	
マツモトキヨシホールディングス	22.9	21.9	130,305	
ブロンコビリー	1.8	4.1	10,754	
スタートトゥデイ	31.9	32.2	145,383	
トレジャー・ファクトリー	0.9	3	3,456	
物語コーポレーション	2.9	2.8	15,512	
ココカラファイン	10.7	11	54,175	
三越伊勢丹ホールディングス	203.5	210.7	278,966	
ウエルシアホールディングス	9.2	9.2	59,800	
クリエイトSDホールディングス	5	15.6	43,898	
丸善CHIホールディングス	11.9	12.4	4,451	
ミサワ	—	1.2	637	
エー・ピーカンパニー	1.4	1.7	1,968	
チムニー	1.9	2.6	7,677	
シュッピン	—	3	3,573	
ネクステージ	1	1.7	933	
ジョイフル本田	5.6	17.2	43,378	
キリン堂ホールディングス	3.3	3.4	3,468	
ホットランド	—	2.8	3,318	
すかいらーく	37.5	32.4	47,725	
綿半ホールディングス	—	3	4,209	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	33.6	35.1	36,679	
ブックオフコーポレーション	5.8	6	5,598	
ゴルフダイジェスト・オンライン	—	2.2	1,738	
あさひ	6.8	7.9	11,929	
日本調剤	1.3	2.7	11,610	
コスモス薬品	5.2	5.3	100,011	
トーエル	5.4	5.1	4,151	
一六堂	2.5	2.6	910	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
セブン&アイ・ホールディングス	428.3	443.2	2,134,451	
薬王堂	1.4	1.5	4,792	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	7.1	28.4	29,223	
ツルハホールディングス	21.8	24.3	274,590	
サンマルクホールディングス	3.7	8.4	26,628	
フェリシモ	2.6	3	3,105	
トリドール	11	13	28,795	
クスリのアオキ	4	9.4	57,998	
メディカルシステムネットワーク	9.2	12.1	5,795	
総合メディカル	2.5	5.1	19,380	
はるやま商事	4.2	4.4	3,366	
カップ・クリエイト	16	14.8	18,766	
ライトオン	7.6	7.9	14,251	
ジーンズメイト	3.3	3.4	710	
良品計画	12.7	12.2	291,946	
三城ホールディングス	12.6	13.2	6,098	
アルビス	—	2.8	5,622	
コナカ	12	12.5	7,187	
ハウス オブ ローゼ	1.1	1.3	1,933	
G-7ホールディングス	2.1	3.1	4,026	
イオン北海道	6.5	7.1	3,777	
コジマ	15.2	15.7	3,752	
ヒマラヤ	2.4	3.3	3,217	
コーナン商事	15.6	15	25,965	
エコス	3.5	3.9	4,699	
ワタミ	12.1	12.5	12,812	
マルシェ	2.5	2.6	2,194	
ドンキホーテホールディングス	33	68.5	273,315	
西松屋チェーン	20.2	20.9	23,449	
ゼンショーホールディングス	52.7	54.5	79,079	
幸楽苑ホールディングス	6.4	6.7	10,733	
ハークスレイ	2.8	2.9	3,390	
サイゼリヤ	15.2	17.4	40,576	
VTホールディングス	—	35.8	24,236	
魚力	—	3.3	4,303	
ポプラ	2.6	2.7	1,287	
ユナイテッドアローズ	13.4	15.1	75,349	
ハイデイ日高	7.8	9.6	27,187	
京都きもの友禅	6.4	7.2	6,530	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コロワイド	34	35.1	62,864
ビーシーデポコーポレーション	—	8.8	9,653
栲番屋	4.6	4.8	31,824
トップカルチャー	4.1	3.8	1,748
PLANT	2.6	2.4	2,968
スギホールディングス	18.4	19	114,380
スクロール	13.3	16	6,656
ヨンドシーホールディングス	7.8	8.1	23,149
ファミリーマート	34.6	32.6	190,058
木曽路	12.5	13	29,471
サトレストランシシステムズ	9.5	12.5	10,200
千趣会	18.4	20.9	14,964
タカキュー	7.3	8.2	1,525
ケーヨー	19.2	17.8	9,006
上新電機	22	25	22,100
日本瓦斯	16.4	12.1	30,806
ベスト電器	33.3	34.4	4,128
ロイヤルホールディングス	17.1	17.6	39,547
東天紅	7	8	1,088
いなげや	11.4	11.8	16,944
島忠	24.8	27.4	73,706
チョダ	12.1	12.5	39,875
ライフコーポレーション	6.5	6.7	18,297
リンガーハット	10	9.6	23,529
さが美	8	8	744
MrMax	10.3	9.3	2,687
テンアライド	8.7	9.8	3,704
AOKIホールディングス	23.5	24.2	33,783
オークワ	16	17	17,850
コメリ	17.5	16.3	38,044
青山商事	25.7	20.3	89,726
しまむら	11.9	12.3	174,045
CFSコーポレーション	6.7	—	—
はせがわ	3.6	3.8	1,729
高島屋	149	154	141,680
松屋	20.6	21.3	20,639
エイチ・ツー・オー リテイリング	48.4	54.3	106,373
近鉄百貨店	39	40	11,840
丸栄	17	22	1,980

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニッセンホールディングス	21.5	15.7	2,182
バルコ	9.8	10.1	9,201
丸井グループ	123.2	130	204,360
アクシアル リテイリング	7.9	8.2	30,750
井筒屋	55	57	3,135
イオン	422.3	436	716,348
ユニグループ・ホールディングス	98	101.4	81,018
イズミ	22.9	21	101,535
東武ストア	13	13	3,731
平和堂	20.7	21.5	52,911
フジ	11.4	11.8	27,199
ヤオコー	5.8	12	58,620
ゼビオホールディングス	13.9	14.4	26,020
ケーズホールディングス	23.6	22.4	87,808
Olympicグループ	6	6.2	3,155
日産東京販売ホールディングス	17.2	17.9	5,208
アインホールディングス	12.3	12.8	75,392
元氣寿司	3.1	3	6,885
ヤマダ電機	404.7	322.2	175,921
アークランドサカモト	7.3	17.9	21,551
ニトリホールディングス	44.2	45.8	447,008
グルメ軒屋	7	8	8,240
愛眼	8.2	8.5	1,929
ケーユーホールディングス	5.3	5.5	4,218
吉野家ホールディングス	28.8	39.1	53,645
松屋フーズ	4.9	5.1	14,545
サガミチェーン	13	14.1	18,358
関西スーパーマーケット	7.6	8.6	6,991
王将フードサービス	7.5	7.8	33,423
プレナス	11.4	11.8	24,331
ミニストップ	7.6	7.8	15,943
アークス	17.8	19.8	50,133
パローホールディングス	22.1	22.8	64,569
藤久	0.8	0.8	1,356
ベルク	4.5	5.2	22,334
大庄	5.5	4.9	7,193
ファーストリテイリング	20.5	21.2	771,892
サンドラッグ	21.6	22.4	190,848
サックスパー ホールディングス	7.7	10	15,690

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ヤマザワ	2.1	2.2	3,729	
やまや	1.7	2.2	4,415	
ペルーナ	25.5	26.4	15,153	
銀行業 (7.5%)				
島根銀行	2.2	2.2	2,739	
じもとホールディングス	73.5	76	11,400	
足利ホールディングス	64.4	77.8	25,051	
東京TYフィナンシャルグループ	13.2	14.6	40,646	
九州フィナンシャルグループ	—	162.2	107,538	
ゆうちょ銀行	—	203.6	289,519	
新生銀行	975	917	139,384	
あおぞら銀行	691	670	268,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,215.4	8,501.4	4,554,199	
りそなホールディングス	1,197.8	1,239.5	499,518	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,263	2,212	739,914	
三井住友フィナンシャルグループ	774.4	848.4	2,996,548	
第四銀行	130	134	52,930	
北越銀行	111	114	21,432	
西日本シティ銀行	359	345	69,345	
千葉銀行	395	409	224,950	
横浜銀行	708	711	370,857	
常陽銀行	370	383	151,285	
群馬銀行	243	235	114,680	
武蔵野銀行	16.3	16.9	49,483	
千葉興業銀行	21.2	29	14,790	
筑波銀行	42.5	44	13,376	
七十七銀行	173	166	65,736	
青森銀行	80	78	26,988	
秋田銀行	68	69	20,631	
山形銀行	62	60	25,080	
岩手銀行	7.2	7.4	31,043	
東邦銀行	92	95	34,675	
東北銀行	55	54	7,722	
みちのく銀行	51	53	9,805	
ふくおかフィナンシャルグループ	415	459	170,289	
静岡銀行	300	310	254,510	
十六銀行	128	133	44,555	
スルガ銀行	108.1	100.6	198,081	
八十二銀行	185	192	96,960	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
山梨中央銀行	65	66	27,786	
大垣共立銀行	128	141	48,363	
福井銀行	87	91	18,473	
北國銀行	114	118	35,518	
清水銀行	3.5	3.6	8,593	
富山銀行	—	2	7,860	
滋賀銀行	103	100	48,200	
南都銀行	99	102	30,906	
百五銀行	98	95	40,945	
京都銀行	195	202	148,470	
紀陽銀行	40.2	41.6	54,828	
三重銀行	46	47	9,494	
ほくほくフィナンシャルグループ	697	721	113,197	
広島銀行	302	313	132,086	
山陰合同銀行	63	64.2	46,095	
中国銀行	73.7	75.1	89,969	
鳥取銀行	33	34	5,848	
伊予銀行	109.5	113.3	84,181	
百十四銀行	112	116	37,468	
四国銀行	79	82	17,958	
阿波銀行	84	87	47,850	
鹿児島銀行	71	—	—	
大分銀行	63	61	21,777	
宮崎銀行	68	71	19,880	
肥後銀行	84	—	—	
佐賀銀行	62	64	14,016	
十八銀行	63	65	16,445	
沖縄銀行	8.1	8.4	30,702	
琉球銀行	21.1	21.8	27,577	
セブン銀行	345.3	397	190,163	
みずほフィナンシャルグループ	14,189.5	14,934.3	2,583,633	
高知銀行	40	41	4,879	
山口フィナンシャルグループ	102	99	101,970	
長野銀行	33	35	6,580	
名古屋銀行	92	89	33,108	
北洋銀行	154.3	159.6	45,964	
愛知銀行	3.7	3.6	17,046	
第三銀行	58	60	9,480	
中京銀行	42	43	8,514	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東日本銀行	45	51	14,229	
大光銀行	36	38	7,942	
愛媛銀行	60	62	14,694	
トマト銀行	40	41	6,109	
みなと銀行	93	96	15,456	
京葉銀行	84	87	35,931	
関西アーバン銀行	14.3	14.8	16,753	
栃木銀行	51	57	24,909	
北日本銀行	3.2	3.3	9,612	
東和銀行	143	149	14,006	
福島銀行	126	130	11,050	
大東銀行	65	64	11,136	
トモニホールディングス	78.6	81.3	27,154	
フィデアホールディングス	58.9	64.8	11,988	
池田泉州ホールディングス	84.5	112.4	46,084	
証券、商品先物取引業 (1.1%)				
F P G	8.8	31.4	41,416	
S B I ホールディングス	123	127.3	149,195	
日本アジア投資	71	7.2	1,864	
ジャフコ	14	17.7	62,569	
大和証券グループ本社	958	991	697,763	
野村ホールディングス	2,093.3	2,038.7	1,050,949	
岡三証券グループ	87	90	56,700	
丸三証券	32.6	31.5	39,186	
東洋証券	41	41	12,382	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	117.5	121.6	77,459	
光世証券	24	25	3,700	
水戸証券	31.7	32.8	10,824	
いちよし証券	21.5	23.7	24,671	
松井証券	52	53.9	54,007	
だいこう証券ビジネス	4.9	5.1	4,778	
マネックスグループ	120.5	124.7	38,657	
カブドットコム証券	45.4	93.9	35,118	
極東証券	13.7	14.2	20,760	
岩井コスモホールディングス	10.5	10	11,690	
藍澤証券	—	14.9	9,297	
マネースクウェアHD	3.2	3.6	4,078	
マネーパートナーズグループ	10.5	9.8	7,418	
小林洋行	3	3.1	818	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
保険業 (2.4%)				
かんぽ生命保険	—	32.3	85,304	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	227.5	235.4	760,106	
アニコム ホールディングス	4.3	7.2	21,852	
MS&ADインシュアランスグループホール	326.4	316.6	1,002,988	
ソニーフィナンシャルホールディングス	98.1	101.5	156,208	
第一生命保険	656	678.9	948,423	
東京海上ホールディングス	421.4	429.3	1,711,619	
T&Dホールディングス	373.2	386.2	425,206	
その他金融業 (1.4%)				
全国保証	26.6	27.5	103,537	
クレディセゾン	83.6	80.4	158,950	
アクリーティブ	7.1	8.8	3,678	
芙蓉総合リース	10.7	12.1	56,688	
興銀リース	19.2	19.9	40,257	
東京センチュリーリース	24	24.9	100,222	
日本証券金融	48.4	46.7	21,435	
アイフル	171.3	177.4	68,121	
ポケットカード	7.7	10.6	5,639	
リコーリース	8.1	8.3	27,182	
イオンフィナンシャルサービス	67.2	69.5	191,820	
アコム	205.7	212.8	117,678	
ジャックス	56	58	26,100	
オリエントコーポレーション	236.6	458.1	99,865	
日立キャピタル	20.1	25	61,650	
アプラスフィナンシャル	49.1	50.8	5,232	
オリックス	724.8	750.3	1,216,611	
三菱UFJリース	259.7	268.8	133,862	
日本取引所グループ	150.3	311.1	560,291	
イー・ギャランティ	3	3.4	8,598	
アサックス	1.8	1.8	2,534	
NECキャピタルソリューション	4.2	4.3	7,099	
不動産業 (2.8%)				
いちごグループホールディングス	—	87.9	39,906	
日本駐車場開発	111.2	115.8	14,475	
ヒューリック	172.9	220.9	237,688	
東京建物不動産販売	5.3	—	—	
三栄建築設計	4.1	4.2	5,002	
野村不動産ホールディングス	61.5	70.3	148,825	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
三重交通グループホールディングス	—	18.8	10,076	
サムティ	—	5.7	6,760	
ディア・ライフ	—	5.4	1,960	
ユー・ディー・ワークス	—	73.4	3,229	
日本商業開発	3.1	3.5	7,763	
ブレサンスコーポレーション	3.5	3.6	14,706	
ユニゾホールディングス	4.2	6.6	30,822	
日本管理センター	5	6.9	12,882	
サンセイランディック	1.1	2.4	2,196	
エストラスト	1	1.9	1,056	
フージャースホールディングス	15.2	14.7	7,835	
オープンハウス	6.5	15.3	31,793	
東急不動産ホールディングス	268.4	256.3	190,687	
飯田グループホールディングス	66.4	98.1	217,880	
エコナックホールディングス	36	34	1,700	
パーク24	51.5	53.5	167,722	
バラカ	3.8	3.7	5,257	
三井不動産	543	562	1,550,558	
三菱地所	761	788	1,670,560	
平和不動産	19.4	20	27,980	
東京建物	223	115.7	162,558	
ダイビル	26.3	27.3	26,535	
京阪神ビルディング	17	17.5	10,815	
住友不動産	245	254	836,676	
大京	163	197	35,854	
テーオーシー	35.3	41.1	39,332	
東京楽天地	17	17	8,177	
レオパレス21	112	124.8	83,491	
スターツコーポレーション	11.7	12.1	29,499	
フジ住宅	13.1	13.5	9,423	
空港施設	12.4	12.8	6,758	
明和地所	5.9	5.8	3,944	
住友不動産販売	7.4	7.6	16,925	
ゴールドクレスト	9.2	8.3	14,002	
日本エスリード	4	4.1	4,596	
日神不動産	13.7	14.2	5,467	
タカラレーベン	45.4	46.2	31,878	
サンヨーハウジング名古屋	5.8	6	5,760	
イオンモール	66.1	68.4	114,570	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ファースト住建	3.8	3.9	5,120	
ランド	39.6	49.9	698	
トーセイ	14	16.1	12,719	
穴吹興産	9	12	3,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	63.6	65.8	72,314	
サンフロンティア不動産	11	12.8	14,425	
エフ・ジェー・ネクスト	7.8	9.2	4,912	
ランドビジネス	5.2	7.2	1,980	
グランディハウス	8.9	9.3	3,534	
日本空港ビルデング	35.4	33.8	136,383	
サービス業 (3.8%)				
日本工営	36	38	13,642	
ネクスト	12.7	31.7	40,893	
ジェイエイシーリクルートメント	—	5.2	6,593	
日本M&Aセンター	16.7	17.3	108,298	
ノバレーゼ	2.8	2.9	2,407	
アコーディア・ゴルフ	40.7	31.1	34,085	
中広	—	1.1	663	
タケエイ	10.6	9.8	8,986	
トラスト・テック	1.9	2.3	6,635	
パソナグループ	8.1	9.7	7,837	
CDS	2.5	2.5	2,195	
リンクアンドモチベーション	14.9	22.8	3,192	
GCAサヴィアン	8.5	9.9	11,375	
エス・エム・エス	12.1	14	29,470	
テンブホールディングス	21.3	78.6	123,637	
リニカル	2.8	6.6	12,177	
クックパッド	6.9	25	45,975	
エスクリ	3.8	4.7	2,998	
アイ・ケイ・ケイ	2.9	6	4,044	
学情	4	4.1	5,047	
スタジオアリス	5	5.2	13,010	
シミックホールディングス	4.3	5	7,080	
NJS	2.4	2.3	2,718	
総合警備保障	36.2	37.4	233,750	
カカコム	71.4	81.3	169,510	
アイロムグループ	2.6	3.2	3,638	
ルネサンス	5.5	5.7	7,301	
ディップ	2.4	12.4	32,798	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
オプトホールディング	4.8	7	4,130	
新日本科学	10.3	10.7	4,461	
ツクイ	12.8	13.3	19,763	
総合臨床ホールディングス	5	—	—	
キャリアデザインセンター	3.2	3.1	3,003	
エムスリー	93.8	97.1	265,956	
ツカダ・グローバルホールディング	7.9	8.2	6,051	
アウトソーシング	4.1	5.2	19,630	
ウェルネット	2.8	4.2	14,952	
ディー・エヌ・エー	53.4	50.3	99,091	
博報堂DYホールディングス	150.2	155.4	196,114	
ぐるなび	12.5	13	33,449	
エスアールジータカミヤ	8.7	9.1	3,931	
一休	8.5	—	—	
ジャパンバストレスキューシステム	8.9	12.8	2,969	
ファンコムコミュニケーションズ	18.7	25.9	21,652	
ジェイコムホールディングス	2.5	2.3	6,074	
PGMホールディングス	15.3	—	—	
WDBホールディングス	3.9	4	4,100	
ティア	2.9	4.7	3,026	
バリューコマース	8.9	10.4	3,910	
インフォマート	—	16.2	16,572	
J Pホールディングス	26.9	27.8	9,424	
E P Sホールディングス	13.6	12.5	17,562	
レッグス	—	1.6	1,072	
プレスステージ・インターナショナル	8.2	9.4	12,248	
アミューズ	3.3	3.1	14,275	
ドリームインキュベータ	3.5	3.7	9,009	
クイック	3.7	5.7	4,628	
TAC	5.4	6.2	1,233	
ケネディクス	154	150.5	73,293	
電通	120.8	125	700,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4.2	5.3	2,528	
びあ	3.2	3.3	6,999	
イオンファンタジー	3.5	3.9	8,556	
シーティーエス	—	2.5	1,985	
ネクシィーズ	3.9	4	3,600	
みらかホールディングス	28.5	28.6	135,707	
アルプス技研	4.3	4.1	9,430	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
サニックス	12.7	18.1	3,945	
ダイオーズ	2.3	2	2,160	
日本空調サービス	5.3	5.5	6,407	
オリエンタルランド	29.3	121.2	983,659	
ダスキン	30.7	31.7	65,904	
明光ネットワークジャパン	10.7	13	15,847	
ファルコホールディングス	5.1	4.9	6,977	
秀英予備校	2.3	2	900	
田谷	1.8	1.9	1,352	
ラウンドワン	30.7	35	23,625	
リゾートトラスト	40	47	119,521	
ビー・エム・エル	6.4	6.6	29,106	
ワタベウエディング	3.5	3.3	1,369	
りらいあコミュニケーションズ	20.1	18.5	18,592	
リソー教育	16.8	20.8	7,113	
早稲田アカデミー	1.6	1.5	1,380	
ユー・エス・エス	131.2	135.7	245,481	
東京個別指導学院	5.2	5.4	3,607	
サイバーエージェント	19.9	27.4	133,849	
楽天	470.8	524.6	540,600	
テー・オー・ダブリュー	3.3	6.7	4,790	
セントラルスポーツ	3.7	3.8	9,089	
フルキャストホールディングス	11.2	10.3	8,034	
リゾートソリューション	11	11	3,509	
テクノプロ・ホールディングス	11.5	18.2	58,058	
インターワークス	—	1.5	1,161	
リブセンス	6.3	7.6	3,435	
ジャパンマテリアル	4.5	4.7	14,899	
ベクトル	1.8	3.5	10,097	
ウチヤマホールディングス	4.7	5.8	2,975	
サクセスホールディングス	0.9	1	1,382	
キャリアリンク	1.1	1.5	2,436	
I B J	—	6.6	3,042	
アサンテ	2.7	4.1	6,699	
N・フィールド	—	4	5,976	
M&Aキャピタルパートナーズ	0.2	0.9	1,699	
ライドオン・エクスプレス	—	1.8	3,231	
ER Iホールディングス	2.8	2.9	2,433	
アビスト	—	1.2	2,953	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ウィルグループ	0.9	2.5	2,507
日本ビューホテル	—	1.2	2,191
リクルートホールディングス	122.9	226.1	782,306
エラン	—	0.9	855
日本郵政	—	247.3	381,831
ベルシステム24ホールディングス	—	16.4	19,450
リロ・ホールディング	3.7	4.2	61,698
東祥	2.3	3.4	14,807
エイチ・アイ・エス	17.7	18.3	56,821
ラックランド	—	1.6	2,596
共立メンテナンス	5.4	8.4	81,816
イチネンホールディングス	11.3	11.7	12,179
建設技術研究所	6.4	6.6	6,388
スペース	5.8	6	8,160
燦ホールディングス	2.2	2.2	3,231
スバル興業	8	8	3,024
東京テアトル	41	43	5,375
ナガワ	—	2	5,506
よみうりランド	22	22	11,066
東京都競馬	74	77	17,094
常磐興産	40	41	6,396
カナモト	15.1	15.6	42,416
東京ドーム	74	89	47,437
西尾レントオール	8.7	9	23,778
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	45	56	2,240
トランス・コスモス	14.1	13	36,634

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
乃村工藝社	21.2	24	39,240
藤田観光	39	41	23,083
KNT-CTホールディングス	52	54	9,990
日本管財	5.3	9.6	16,992
トーカイ	4.8	5	16,750
白洋舎	11	12	3,096
セコム	105.2	116.6	1,009,173
セントラル警備保障	4.8	4.9	12,823
丹青社	12.5	21	17,304
メイテック	14.7	14	56,070
アサツー デイ・ケイ	20.4	19.7	55,810
応用地質	11.4	11.8	13,994
船井総研ホールディングス	11.7	15.6	27,144
進学会	4.5	5.3	3,455
オオバ	—	6.1	2,671
学究社	—	1.6	2,112
ベネッセホールディングス	39.6	37.6	127,276
イオンディライト	10.5	10.8	40,338
ナック	7.2	6.9	6,430
ニチイ学館	21.2	19.5	15,502
ダイセキ	17.4	21.1	39,963
ステップ	3.6	3.8	3,826
合 計	株数・金額 172,412	178,041	216,833,264
	銘柄数<比率> 1,858	1,933	<98.2%>

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	百万円 4,104	百万円 —
	TOPIX		

○有価証券の貸付及び借入の状況

2016年3月25日現在における貸付株数の総株数は24,569,000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、24,569,000株です。

○投資信託財産の構成

(2016年3月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	216,833,264	86.4
コール・ローン等、その他	34,136,616	13.6
投資信託財産総額	250,969,880	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年3月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	250,966,747,126
コール・ローン等	31,712,659,281
株式(評価額)	216,833,264,380
未収入金	1,935,172,170
未収配当金	234,829,742
未収利息	42
その他未収収益	61,909,511
差入委託証拠金	188,912,000
(B) 負債	30,165,109,370
未払解約金	2,156,728,768
未払利息	19,375
受入担保金	28,008,361,227
(C) 純資産総額(A-B)	220,801,637,756
元本	160,669,331,010
次期繰越損益金	60,132,306,746
(D) 受益権総口数	160,669,331,010口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,743円

○損益の状況 (2015年3月26日～2016年3月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,410,669,755
受取配当金	4,088,217,414
受取利息	19,554,385
その他収益金	311,787,362
支払利息	△ 8,889,406
(B) 有価証券売買損益	△34,472,113,100
売買益	10,330,677,364
売買損	△44,802,790,464
(C) 先物取引等取引損益	△ 530,199,280
取引益	1,141,323,840
取引損	△ 1,671,523,120
(D) 当期損益金(A+B+C)	△30,591,642,625
(E) 前期繰越損益金	89,192,588,551
(F) 追加信託差損益金	48,019,670,206
(G) 解約差損益金	△46,488,309,386
(H) 計(D+E+F+G)	60,132,306,746
次期繰越損益金(H)	60,132,306,746

(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。

<注記事項>

①期首元本額	156,174,324,083円		
期中追加設定元本額	90,299,508,544円		
期中一部解約元本額	85,804,501,617円		
また、1口当たり純資産額は、期末1.3743円です。			
②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）			
ファンド・マネジャー（国内株式）	2,419,679,844円	インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	22,906,682円
eMAXIS TOPIXインデックス	21,330,711,385円	インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	76,085,335円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,592,208,146円	インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	142,479,268円
eMAXIS バランス（波乗り型）	111,177,712円	インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	120,583,422円
コアバランス	912,057円	三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	3,150,098,815円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	19,945,917,827円	三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	834,278,300円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	14,790,783,904円	三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	107,865,555円
三菱UFJ バランスファンドVA20型（適格機関投資家限定）	527,242,271円	三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	896,042,538円
三菱UFJ バランスファンドVA40型（適格機関投資家限定）	4,309,348,804円	三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	104,323,312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）	15,138,673,776円	三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	802,533,806円
三菱UFJ バランスファンドVA50型（適格機関投資家限定）	6,747,383,047円	三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	2,128,408,178円
三菱UFJ バランスファンドVA75型（適格機関投資家限定）	2,669,566,608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）	566,144,963円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	636,641,903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）	2,248,685,858円
三菱UFJ バランスファンドVA45型（適格機関投資家限定）	315,038,965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）	1,775,755,051円
三菱UFJ バランスファンドVA30型（適格機関投資家限定）	176,444,031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）	1,347,664,902円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	595,935,508円	三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	44,719,222,766円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	1,406,064,878円	三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	636,768,073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）	26,070,308円	三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	107,973,296円
MJAMトピックスリソースコントロール(5%)インデックスファンド(FOF)用 適格機関投資家限定	1,399,846円	三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	94,918,456円
MJAMトピックスリソースコントロール(10%)インデックスファンド(FOF)用 適格機関投資家限定	143,580,107円	三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	170,809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	三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	255,117円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	7,499,823,663円	三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	298,365円
三菱UFJ TOPIX・ライト	373,640,163円	eMAXIS バランス（4資産均等型）	18,896,736円
		合計	160,669,331,010円

【お知らせ】

- ①2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年7月1日)
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資制限について、買付基準の記載部分の「取得時において」の削除を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年12月2日)
- ③信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため（分散型に分類）、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行うための、所要の約款変更を行いました。
(2016年3月2日)

外国株式インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2016年5月12日

[計算期間：2015年5月13日～2016年5月12日]

「外国株式インデックスマザーファンド」は、5月12日に第15期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	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		MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス)		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落 中 率	中 率	(円換算ベース)	期 騰 落 中 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
11期(2012年5月14日)	9,921	△ 6.8	74.99	△ 9.3	95.2	2.6	2.0	142,226
12期(2013年5月13日)	15,535	56.6	114.32	52.4	96.3	1.0	2.3	199,188
13期(2014年5月12日)	18,176	17.0	130.71	14.3	96.7	1.1	2.1	197,280
14期(2015年5月12日)	23,063	26.9	162.29	24.2	96.5	1.2	2.2	227,514
15期(2016年5月12日)	19,726	△14.5	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7	270,065

(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		M S C I K o k u s a i I n d e x (MSCIコクサイインデックス)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
	円	騰 落 率	(円換算ベース)	騰 落 率			
(期 首) 2015年5月12日	23,063	—	162.29	—	96.5	1.2	2.2
5月末	23,848	3.4	167.17	3.0	94.8	1.2	2.2
6月末	22,902	△ 0.7	160.34	△ 1.2	96.0	1.8	2.2
7月末	23,546	2.1	164.73	1.5	98.2	1.1	2.3
8月末	21,677	△ 6.0	151.30	△ 6.8	94.5	3.0	2.4
9月末	20,196	△12.4	140.71	△13.3	95.4	2.3	2.5
10月末	22,402	△ 2.9	155.86	△ 4.0	95.1	1.4	2.5
11月末	22,647	△ 1.8	157.46	△ 3.0	94.8	5.3	2.4
12月末	22,114	△ 4.1	153.40	△ 5.5	94.3	3.8	2.5
2016年1月末	20,152	△12.6	139.74	△13.9	95.2	2.3	2.6
2月末	19,318	△16.2	133.62	△17.7	95.4	2.1	2.6
3月末	20,436	△11.4	141.17	△13.0	99.9	2.3	2.8
4月末	20,342	△11.8	140.05	△13.7	94.9	3.0	2.6
(期 末) 2016年5月12日	19,726	△14.5	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−16.4%)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

◎外国株式市況

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

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて9.8%の円高・米ドル安、7.5%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16.4%の下落となったため、カイ離は1.9%程度となりました。

	組入比率 要因	銘柄選択 要因	その他の 要因	合計
ベンチマーク とのカイ離	Δ0.0%程度	Δ0.0%程度	1.9%程度	1.9%程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響はΔ0.0%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Δ0.0%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1.9%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入・為替効果等	計 2.0%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料等	計 Δ0.1%程度

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

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

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

◎今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016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	円	%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(2)	(0.011)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.004)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	8	0.036	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(8)	(0.036)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(c) そ の 他 費 用	11	0.051	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保 管 費 用)	(11)	(0.051)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	22	0.103	
期中の平均基準価額は、21,631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。

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	オーストラリア	百株 37,928 (4,668)	千オーストラリアドル 50,029 (247)	百株 18,319 (412)	千オーストラリアドル 23,475 (370)
	ニュージーランド	2,729	千ニュージーランドドル 1,167	831	千ニュージーランドドル 317
	香港	44,149 (2,980)	千香港ドル 127,962 (-)	20,283 (1,270)	千香港ドル 64,359 (-)
	シンガポール	24,000 (7)	千シンガポールドドル 9,166 (-)	10,988	千シンガポールドドル 4,495
	イスラエル	2,648	千イスラエルシケル 14,127	1,044	千イスラエルシケル 6,150

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
HCP INC	21	759	10	387
MACERICH CO/THE	6	514	3	302
PROLOGIS INC	24	1,006	10	455
CAMDEN PROPERTY TRUST	4	315	1	155
DIGITAL REALTY TRUST INC	7	589	3	261
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3	691	1	321
EXTRA SPACE STORAGE INC	11	918	2	191
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3	467	1	213
WELLTOWER INC	16	1,096	7	532
BOSTON PROPERTIES INC	6	854	3	414
MID-AMERICA APARTMENT COMM	6	595	0.2	20
REALTY INCOME CORP	12	682	5	262
REGENCY CENTERS CORP	4	288	1	130
SL GREEN REALTY CORP	4	490	2	246
UDR INC	12	445	5	209
VENTAS INC	15	893	6	412
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	46	465	24	242
RAYONIER INC	—	—	7	193
WEYERHAEUSER CO	28 (18)	838 (484)	12	387
AMERICAN TOWER CORP	19	1,866	9	895
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	14	270	7	133
VEREIT INC	38	321	17	147
DUKE REALTY CORP	15	315	6	143
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	17	443	2	58
IRON MOUNTAIN INC	11	346	3	103
EQUINIX INC	2 (0.089)	880 (26)	0.763	226
COMMUNICATIONS SALES & LE	1	23	8	164
CROWN CASTLE INTL CORP	13 (20)	1,183 (1,658)	6	547
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	— (4)	— (—)	4	143
EQUITY RESIDENTIAL	17	1,285	7	562
GENERAL GROWTH PROPERTIES	28	773	11	323
HOST HOTELS & RESORTS INC	33	554	16	280
LIBERTY PROPERTY TRUST	6	195	2	91
PLUM CREEK TIMBER CO	4 (△ 11)	187 (△ 484)	3	153
PUBLIC STORAGE	6	1,589	3	717
SIMON PROPERTY GROUP INC	13	2,670	6	1,264
VORNADO REALTY TRUST	7	697	3	325
KIMCO REALTY CORP	18	488	8	221

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
AVALONBAY COMMUNITIES INC	6	1,127	2	511
小 計	513 (31)	27,136 (1,685)	245	12,357
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	6	195	0.9	27
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	7	147	4	83
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7	192	3	87
小 計	20	536	8	199
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
GECINA SA	1	217	0.714	84
KLEPIERRE	13	543	5	220
UNIBAIL-RODAMCO SE	4	1,067	2	514
FONCIERE DES REGIONS	1	116	0.709	56
ICADE	1	110	1	73
小 計	22	2,056	10	948
ユ ー ロ 計	22	2,056	10	948
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	44	338	20	165
HAMMERSON PLC	36	219	18	113
LAND SECURITIES GROUP PLC	36	429	18	224
INTU PROPERTIES PLC	42	134	18	59
SEGRO PLC	32	137	14	62
小 計	192	1,259	90	625
オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
VICINITY CENTRES	164	486	73	213
SCENTRE GROUP	246	1,037	115	480
FEDERATION CENTRES	— (103)	— (316)	—	—
NOVION PROPERTY GROUP	— (△ 126)	— (△ 316)	6	16
GPT GROUP	92	440	41	196
MIRVAC GROUP	166	307	74	144
STOCKLAND	113	464	53	223
WESTFIELD CORP	90	897	43	420
DEXUS PROPERTY GROUP	44	334	17	135
GOODMAN GROUP	88	564	43	283
小 計	1,007 (△ 22)	4,533 (—)	470	2,113
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	106	4,778	55	2,497
小 計	106	4,778	55	2,497
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	113 (—)	181 (△ 1)	44	68

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	89	126	47	68
	CAPITALAND MALL TRUST	93	193	24	46
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	77 (-)	184 (△0.24159)	15	35
小計		373 (-)	684 (△ 1)	131	218

(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 141,684	百万円 135,556	百万円 -	百万円 -

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

○株式売買比率

(2015年5月13日～2016年5月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	233,432,694千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	224,041,096千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.04

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$	%
為替直物取引	百万円 3,670	1.9	%	百万円 7,344	6.4	%
	百万円 192,818			百万円 114,849		

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

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ALCOA INC	698	1,083	1,033	112,050	素材
AMERICAN EXPRESS CO	551	692	4,470	484,457	各種金融
AVON PRODUCTS INC	252	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
ABBOTT LABORATORIES	892	1,233	4,688	508,145	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	198	274	1,165	126,294	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	33	44	740	80,239	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	285	381	3,306	358,302	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	42	58	276	29,970	小売
AES CORP	404	566	641	69,479	公益事業
AFLAC INC	266	352	2,422	262,531	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	829	1,022	5,723	620,234	保険
APACHE CORP	222	313	1,692	183,470	エネルギー
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	37	50	1,039	112,614	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	371	516	5,993	649,553	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	126	169	2,410	261,252	素材
ANTHEM INC	159	215	3,013	326,522	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	300	421	2,018	218,738	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	785	1,112	2,455	266,066	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	320	472	2,190	237,343	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	401	526	7,003	758,941	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	123	174	2,913	315,756	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	177	256	807	87,510	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	983	1,380	9,774	1,059,259	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	78	101	3,595	389,684	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,459	3,367	17,223	1,866,514	電気通信サービス
CR BARD INC	44	61	1,340	145,257	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	77	108	784	84,995	素材
BAKER HUGHES INC	256	361	1,618	175,449	エネルギー
ALLSTATE CORP	248	319	2,154	233,434	保険
VERY DENNISON CORP	53	75	570	61,797	素材
CHUBB LTD	196	380	4,713	510,750	保険
ANALOG DEVICES INC	185	258	1,438	155,922	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	18	25	1,943	210,587	小売
CVS HEALTH CORP	679	916	9,541	1,033,975	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ENTERPRISES	136	178	965	104,598	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	758	978	1,846	200,089	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	2,216	3,045	18,822	2,039,781	銀行
CIGNA CORP	154	212	2,779	301,225	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	340	481	3,490	378,215	資本財
COCA-COLA CO/THE	2,337	3,417	15,535	1,683,562	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	329	440	3,095	335,463	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	121	153	1,005	108,926	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	590	807	2,090	226,506	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	118	166	576	62,437	メディア
CHEVRON CORP	1,120	1,557	15,753	1,707,213	エネルギー
COACH INC	163	229	876	94,977	耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ROCKWELL COLLINS INC	70	108	983	106,593	資本財
COMPUTER SCIENCES CORP	83	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CONOCOPHILLIPS	729	1,022	4,465	483,916	エネルギー
CME GROUP INC	189	265	2,483	269,182	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	195	271	2,093	226,827	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	540	705	5,075	550,003	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION RESOURCES INC/VA	347	495	3,554	385,171	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE	698	930	4,766	516,524	素材
DEVON ENERGY CORP	230	381	1,240	134,378	エネルギー
DEERE & CO	201	258	2,167	234,898	資本財
DANAHER CORP	374	509	4,993	541,125	資本財
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	536	724	4,662	505,265	素材
WALT DISNEY CO/THE	954	1,299	13,288	1,440,107	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC	79	94	599	64,955	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	420	571	4,601	498,711	公益事業
DR HORTON INC	194	280	815	88,376	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC	57	74	311	33,776	小売
TARGET CORP	358	483	3,662	396,857	小売
DUN & BRADSTREET CORP	21	29	351	38,088	商業・専門サービス
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	39	—	—	—	エネルギー
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I	101	140	1,069	115,857	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	98	128	847	91,835	資本財
DTE ENERGY COMPANY	105	150	1,366	148,099	公益事業
EXXON MOBIL CORP	2,510	3,444	30,592	3,315,344	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	63	178	1,874	203,176	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	324	455	3,657	396,349	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	410	541	2,860	310,017	資本財
EXELON CORP	510	763	2,698	292,443	公益事業
ECOLAB INC	159	219	2,564	277,893	素材
EQUIFAX INC	71	98	1,197	129,784	商業・専門サービス
ENSCO PLC-CL A	138	—	—	—	エネルギー
EMC CORP/MA	1,205	1,603	4,352	471,703	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	137	183	1,745	189,167	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	280	382	2,372	257,153	資本財
EDISON INTERNATIONAL	184	271	1,956	212,057	公益事業
ENTERGY CORP	107	149	1,148	124,409	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	26	35	643	69,746	保険
EDGEMOUNT PERSONAL CARE CO	36	49	389	42,176	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC	259	382	4,580	496,353	公益事業
MACY'S INC	204	260	815	88,416	小売
FEDEX CORP	159	222	3,581	388,156	運輸
FMC TECHNOLOGIES INC	137	189	532	57,653	エネルギー
FAMILY DOLLAR STORES	60	—	—	—	小売
FORD MOTOR CO	2,127	3,065	4,083	442,505	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	238	322	1,149	124,556	各種金融
FOOT LOCKER INC	84	114	675	73,229	小売
FIRSTENERGY CORP	250	353	1,201	130,201	公益事業
FLUOR CORP	92	117	604	65,513	資本財
FREEPORT-MCMORAN INC	614	957	1,111	120,433	素材
GENERAL MILLS INC	357	494	3,163	342,787	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	166	222	3,218	348,841	資本財
WW GRAINGER INC	36	46	1,079	116,971	資本財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
GENERAL ELECTRIC CO	5,953	7,808	23,691	2,567,458	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	—	111	825	89,460	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	90	124	1,196	129,633	小売
TEGNA INC	—	174	404	43,791	メディア
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	—	222	622	67,415	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	143	200	371	40,296	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	232	317	5,064	548,817	各種金融
HALLIBURTON CO	502	708	2,802	303,682	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	440	605	6,908	748,656	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	126	159	727	78,787	自動車・自動車部品
HP INC	1,106	1,487	1,739	188,493	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	254	338	1,497	162,230	保険
HERSHEY CO/THE	90	122	1,131	122,611	食品・飲料・タバコ
DIRECTV	282	—	—	—	メディア
HOSPIRA INC	100	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARMAN INTERNATIONAL	—	58	435	47,178	耐久消費財・アパレル
HOME DEPOT INC	781	1,048	14,086	1,526,520	小売
HASBRO INC	66	92	784	84,997	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	157	215	1,423	154,273	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	557	762	11,358	1,230,870	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	237	325	1,394	151,162	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	219	270	2,822	305,834	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	246	336	798	86,515	メディア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	48	66	821	88,980	素材
JOHNSON & JOHNSON	1,659	2,288	26,179	2,837,025	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC	394	535	2,196	238,038	自動車・自動車部品
KANSAS CITY SOUTHERN	66	90	830	90,013	運輸
KELLOGG CO	157	219	1,674	181,466	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	221	300	3,869	419,285	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	995	1,314	5,836	632,483	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	276	765	2,655	287,779	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	121	160	622	67,429	小売
ELI LILLY & CO	593	825	6,296	682,334	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	59	83	1,062	115,102	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	101	137	578	62,701	運輸
LENNAR CORP-A	101	148	654	70,963	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	584	758	5,699	617,607	小売
LEGGETT & PLATT INC	81	112	553	60,026	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	147	204	1,378	149,355	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	237	329	1,496	162,140	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	159	228	5,536	599,959	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	154	204	879	95,263	保険
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	50	64	880	95,420	資本財
LEGG MASON INC	61	82	252	27,387	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	134	170	1,172	127,112	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	576	759	9,806	1,062,772	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	160	223	2,354	255,157	各種金融
MEDTRONIC PLC	839	1,169	9,482	1,027,617	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	1,690	2,310	12,550	1,360,132	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	635	899	908	98,413	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	202	280	867	94,056	耐久消費財・アパレル
3M CO	360	509	8,645	936,880	資本財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	133	132	925	100,340	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	234	373	822	89,154	消費者サービス
MASCO CORP	209	279	883	95,704	資本財
MONSANTO CO	286	363	3,287	356,273	素材
MEADWESTVACO CORP	97	—	—	—	素材
M & T BANK CORP	70	118	1,373	148,810	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	320	431	2,757	298,813	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	37	52	1,023	110,869	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	869	1,201	3,168	343,361	各種金融
MCKESSON CORP	137	190	3,215	348,445	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	571	781	3,392	367,601	保険
MANPOWERGROUP INC	47	60	470	50,940	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	111	147	1,400	151,806	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	183	247	2,196	238,007	運輸
BANK OF AMERICA CORP	6,233	8,614	12,232	1,325,653	銀行
NISOURCE INC	188	—	—	—	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	113	143	3,070	332,756	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	265	402	599	64,974	銀行
NEWMONT MINING CORP	292	437	1,482	160,664	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	804	966	2,841	307,972	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	69	96	936	101,529	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	—	11	1,101	119,338	保険
NUCOR CORP	189	264	1,258	136,427	素材
NEWELL BRANDS INC	160	367	1,777	192,661	耐久消費財・アパレル
NOBLE CORP PLC	149	—	—	—	エネルギー
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	259	366	1,083	117,424	メディア
NOBLE ENERGY INC	229	355	1,294	140,241	エネルギー
PALL CORP	62	—	—	—	資本財
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	461	632	4,825	522,935	エネルギー
OMNICARE INC	57	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
OMNICOM GROUP	146	200	1,685	182,658	メディア
PEPSICO INC	887	1,205	12,741	1,380,805	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	—	80	531	57,587	素材
ALTRIA GROUP INC	1,171	1,622	10,481	1,135,913	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	66	94	694	75,293	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,602	2,249	18,482	2,002,994	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	311	419	3,624	392,774	銀行
PFIZER INC	3,735	5,106	16,934	1,835,178	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	269	371	2,828	306,536	保険
PULTEGROUP INC	196	260	471	51,145	耐久消費財・アパレル
PEPCO HOLDINGS LLC	151	—	—	—	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	88	112	1,269	137,606	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	88	133	2,196	238,037	エネルギー
CITIGROUP INC	1,795	2,465	10,962	1,188,003	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	174	242	1,029	111,524	保険
PPG INDUSTRIES INC	81	222	2,392	259,328	素材
PENTAIR PLC	111	149	880	95,381	資本財
PRAXAIR INC	172	235	2,674	289,793	素材
P G & E CORP	282	408	2,418	262,121	公益事業
PPL CORP	396	560	2,171	235,301	公益事業
PROGRESSIVE CORP	330	482	1,600	173,472	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	301	421	1,955	211,904	公益事業

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	106	145	1,184	128,389	消費者サービス
SPX CORP	20	—	—	—	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	98	145	1,093	118,529	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	182	248	3,253	352,542	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	168	200	976	105,789	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	819	1,078	993	107,714	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	27	36	409	44,324	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	59	83	1,468	159,157	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	245	345	760	82,464	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	80	109	428	46,487	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	80	109	1,244	134,837	資本財
SCHLUMBERGER LTD	763	1,152	8,503	921,476	エネルギー
STRYKER CORP	201	279	3,118	337,920	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	695	980	2,724	295,218	各種金融
SEMPRA ENERGY	139	196	2,074	224,784	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	48	65	1,926	208,815	素材
ST JUDE MEDICAL INC	169	234	1,770	191,913	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	88	123	1,398	151,550	資本財
SUNTRUST BANKS INC	308	420	1,741	188,676	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	196	251	2,812	304,762	保険
SOUTHERN CO/THE	535	755	3,802	412,031	公益事業
AT&T INC	3,074	5,089	19,939	2,160,846	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	130	189	697	75,608	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	246	333	2,013	218,189	各種金融
SYSCO CORP	347	466	2,343	254,015	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	119	163	764	82,871	素材
SCANA CORP	81	114	802	86,918	公益事業
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	92	—	—	—	エネルギー
TEXAS INSTRUMENTS INC	625	839	4,835	524,029	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	77	106	704	76,367	小売
TORCHMARK CORP	74	101	596	64,660	保険
TYCO INTERNATIONAL PLC	248	349	1,344	145,752	商業・専門サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	237	330	4,886	529,556	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	164	226	864	93,683	資本財
UNION PACIFIC CORP	527	706	5,972	647,213	運輸
UNUM GROUP	150	201	679	73,679	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	513	696	7,081	767,413	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	569	788	10,303	1,116,544	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,060	1,446	6,054	656,133	銀行
MARATHON OIL CORP	399	682	849	92,105	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	416	576	5,907	640,170	運輸
VALERO ENERGY CORP	308	398	2,226	241,289	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	59	80	656	71,109	ヘルスケア機器・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	284	359	2,003	217,094	メディア
VF CORP	204	282	1,711	185,514	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	78	110	1,271	137,799	素材
TOWERS WATSON & CO-CL A	41	—	—	—	商業・専門サービス
WILLIAMS COS INC	420	590	1,151	124,749	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	516	720	5,780	626,484	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	136	264	1,589	172,220	公益事業
WAL-MART STORES INC	955	1,325	8,803	954,086	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO	2,921	4,013	19,700	2,134,939	銀行

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
WASTE MANAGEMENT INC	257	369	2,263	245,315	商業・専門サービス
WATERS CORP	49	67	910	98,714	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	461	731	410	44,453	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	46	64	1,115	120,913	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	636	754	700	75,954	ソフトウェア・サービス
XL GROUP PLC	178	244	825	89,427	保険
XCEL ENERGY INC	301	424	1,757	190,495	公益事業
KEYCORP	511	684	818	88,732	銀行
CARMAX INC	127	168	856	92,857	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	100	156	1,827	198,084	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	101	139	369	40,046	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	259	356	2,878	311,964	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	410	553	4,097	444,060	小売
CA INC	196	271	814	88,227	ソフトウェア・サービス
CAMERON INTERNATIONAL CORP	116	—	—	—	エネルギー
CLOROX COMPANY	76	106	1,413	153,138	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	91	121	855	92,692	素材
CARNIVAL CORP	228	341	1,715	185,870	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	167	233	1,717	186,168	ソフトウェア・サービス
CHUBB CORP	139	—	—	—	保険
CONAGRA FOODS INC	251	358	1,641	177,913	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	174	244	1,823	197,560	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	487	656	1,158	125,582	銀行
STERICYCLE INC	50	70	665	72,165	商業・専門サービス
INTEL CORP	2,866	3,903	11,734	1,271,637	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	3,030	4,199	11,213	1,215,188	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	59	75	694	75,231	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	76	105	1,067	115,688	電気通信サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	259	361	5,321	576,720	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	721	993	1,987	215,425	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	184	257	1,887	204,538	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	180	244	1,673	181,358	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	408	558	933	101,209	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	124	337	1,835	198,924	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	120	177	855	92,695	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	405	1,121	6,394	692,974	耐久消費財・アパレル
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	—	6	80	8,712	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	450	624	9,621	1,042,726	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	106	145	627	68,002	銀行
NORTHERN TRUST CORP	132	181	1,258	136,407	各種金融
MICROSOFT CORP	4,642	6,278	32,051	3,473,441	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	54	73	635	68,909	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	—	140	806	87,420	ヘルスケア機器・サービス
STAPLES INC	381	538	455	49,346	小売
STARBUCKS CORP	887	1,227	6,903	748,165	消費者サービス
ORACLE CORP	2,101	2,646	10,492	1,137,093	ソフトウェア・サービス
ALTERA CORP	181	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WHOLE FOODS MARKET INC	213	282	861	93,353	食品・生活必需品小売り
NETFLIX INC	33	336	3,024	327,783	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	60	81	2,143	232,244	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	299	423	1,572	170,427	ソフトウェア・サービス
URBAN OUTFITTERS INC	63	—	—	—	小売

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	113	158	1,021	110,740	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	49	68	1,173	127,221	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	80	111	1,027	111,298	小売
LAM RESEARCH CORP	94	130	989	107,273	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	47	67	626	67,858	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,274	2,054	12,749	1,381,662	メディア
XILINX INC	157	212	914	99,151	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	209	292	1,665	180,446	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	84	199	1,235	133,837	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	894	1,192	10,002	1,083,968	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	96	127	1,052	114,113	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	21	30	1,938	210,122	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	160	207	2,124	230,251	ソフトウェア・サービス
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	246	-	-	-	メディア
NUANCE COMMUNICATIONS INC	152	205	343	37,206	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	193	268	1,400	151,781	ソフトウェア・サービス
YAHOO! INC	532	741	2,772	300,457	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	48	72	317	34,387	ヘルスケア機器・サービス
SIGNATURE BANK	-	42	559	60,675	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	-	57	462	50,164	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	135	187	1,106	119,913	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	147	208	776	84,156	メディア
SALESFORCE.COM INC	355	522	3,958	429,008	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	83	114	518	56,184	小売
ALPHABET INC-CL A	168	240	17,604	1,907,831	ソフトウェア・サービス
JOY GLOBAL INC	58	-	-	-	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	-	37	408	44,303	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B/E AEROSPACE INC	62	87	412	44,704	資本財
GARMIN LTD	67	94	380	41,180	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE NAVIGATION LTD	150	207	490	53,152	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	985	1,243	6,484	702,757	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	133	199	680	73,737	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	91	129	622	67,450	ソフトウェア・サービス
LINER TECHNOLOGY CORP	142	197	874	94,744	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	168	235	855	92,758	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	233	329	23,514	2,548,264	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	153	206	1,558	168,898	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	85	118	903	97,918	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	98	128	895	97,076	半導体・半導体製造装置
E*TRADE FINANCIAL CORP	-	242	613	66,466	各種金融
CERNER CORP	182	254	1,384	150,029	ヘルスケア機器・サービス
BROADCOM LTD	-	321	4,622	500,937	半導体・半導体製造装置
ALKERMES PLC	87	124	471	51,056	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	68	83	707	76,670	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	169	250	1,322	143,361	電気通信サービス
BROADCOM CORP-CL A	320	-	-	-	半導体・半導体製造装置
WASTE CONNECTIONS INC	-	101	701	75,982	商業・専門サービス
EBAY INC	662	893	2,121	229,935	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	323	445	1,604	173,929	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	122	184	1,457	157,946	小売
PRICELINE GROUP INC/THE	31	41	5,220	565,696	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	684	980	14,010	1,518,322	各種金融

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
BB&T CORP	425	670	2,276	246,674	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	666	903	3,601	390,272	各種金融
BORGWARNER INC	135	185	631	68,433	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	163	194	378	40,973	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	60	97	1,266	137,251	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC	496	661	4,903	531,437	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP	129	161	1,227	132,970	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	42	54	470	50,967	保険
AETNA INC	208	288	3,236	350,759	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	146	204	984	106,729	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	291	408	2,666	289,018	公益事業
AON PLC	160	226	2,391	259,177	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	381	493	1,872	202,950	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	56	78	423	45,902	保険
HESS CORP	159	232	1,354	146,747	エネルギー
CROWN CASTLE INTL CORP	197	—	—	—	不動産
JUNIPER NETWORKS INC	231	288	658	71,318	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	160	221	640	69,386	各種金融
RED HAT INC	111	151	1,093	118,550	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	43	58	605	65,629	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	131	186	885	95,952	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	105	147	747	80,980	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	185	242	565	61,244	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	90	138	979	106,186	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	224	342	333	36,117	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	140	184	4,928	534,115	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	84	121	1,683	182,430	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC	280	412	3,968	430,040	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	142	203	1,701	184,359	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC	110	137	600	65,105	小売
CELGENE CORP	473	650	6,517	706,339	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CREE INC	71	—	—	—	半導体・半導体製造装置
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	360	503	3,074	333,222	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	435	559	4,118	446,292	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	116	154	738	80,027	運輸
FASTENAL CO	166	227	1,052	114,083	資本財
FISERV INC	144	189	1,996	216,368	ソフトウェア・サービス
FLEXTRONICS INTL LTD	347	462	556	60,292	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOSSIL GROUP INC	27	—	—	—	耐久消費財・アパレル
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,451	1,745	685	74,323	メディア
SANDISK CORP	130	166	1,265	137,117	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	3,477	4,612	42,674	4,624,644	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	91	128	861	93,387	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	485	659	657	71,206	銀行
SIGMA-ALDRICH	70	—	—	—	素材
NABORS INDUSTRIES LTD	150	—	—	—	エネルギー
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	117	186	2,589	280,604	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHLAND INC	39	52	590	64,014	素材
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	88	118	863	93,588	運輸
CENTURYLINK INC	337	454	1,286	139,420	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	85	114	350	38,005	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	246	345	1,371	148,595	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	65	—	—	—	自動車・自動車部品
ONEOK INC	123	173	696	75,518	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC	188	709	3,607	390,945	食品・飲料・タバコ
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	299	—	—	—	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	193	247	463	50,260	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	85	117	721	78,155	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	43	60	897	97,216	小売
CONSOL ENERGY INC	136	—	—	—	エネルギー
NATIONAL OILWELL VARCO INC	255	311	1,006	109,119	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	100	143	2,335	253,054	食品・飲料・タバコ
CHESAPEAKE ENERGY CORP	315	—	—	—	エネルギー
PARTNERRE LTD	26	—	—	—	保険
COOPER COS INC/THE	28	40	624	67,634	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	90	132	929	100,690	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	183	255	1,435	155,538	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	63	81	455	49,330	保険
OWENS-ILLINOIS INC	99	—	—	—	素材
AGCO CORP	52	55	287	31,164	資本財
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	87	122	356	38,584	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP	84	117	1,766	191,402	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA INC	61	102	1,149	124,569	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	29	193	568	61,645	素材
HUDSON CITY BANCORP INC	277	—	—	—	銀行
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	375	495	1,796	194,637	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC	109	144	1,371	148,597	各種金融
TESORO CORP	75	99	775	83,994	エネルギー
FNF GROUP	149	207	693	75,202	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	66	98	2,536	274,895	各種金融
NASDAQ INC	70	94	600	65,084	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	99	149	558	60,507	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	212	288	1,166	126,366	メディア
AUTOLIV INC	53	72	908	98,437	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	178	249	729	79,104	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	18	25	1,170	126,886	消費者サービス
IHS INC-CLASS A	39	56	684	74,132	商業・専門サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	73	95	937	101,638	食品・飲料・タバコ
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	265	367	965	104,617	小売
ARROW ELECTRONICS INC	57	77	470	51,029	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	102	139	1,599	173,329	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	78	101	507	54,977	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP	185	271	480	52,038	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	33	46	868	94,152	素材
RANGE RESOURCES CORP	100	140	606	65,756	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO	226	315	385	41,825	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	51	78	899	97,437	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	35	48	411	44,550	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	66	96	707	76,703	公益事業
OCEANEERING INTL INC	63	80	265	28,719	エネルギー
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	72	96	666	72,272	消費者サービス
HANESBRANDS INC	237	324	871	94,447	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC-CLASS A	593	819	7,900	856,209	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	310	418	801	86,846	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AERCAP HOLDINGS NV	—	76	305	33,150	資本財
AVNET INC	82	109	431	46,778	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	190	263	686	74,418	素材
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	—	80	117	12,692	消費者サービス
SPECTRA ENERGY CORP	397	556	1,719	186,357	エネルギー
TRANSIGM GROUP INC	29	44	1,104	119,676	資本財
WILLIS TOWERS WATSON PLC	94	108	1,345	145,765	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	184	253	386	41,832	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	240	319	1,885	204,336	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	268	353	1,959	212,337	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	63	93	576	62,516	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	—	45	481	52,203	資本財
PRECISION CASTPARTS CORP	84	—	—	—	資本財
VMWARE INC-CLASS A	49	65	366	39,693	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	198	234	929	100,733	保険
TIME WARNER CABLE	166	234	5,076	550,133	メディア
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	36	50	1,018	110,419	小売
LKQ CORP	181	252	823	89,292	小売
HORMEL FOODS CORP	86	240	960	104,069	食品・飲料・タバコ
EASTMAN CHEMICAL CO	88	123	927	100,543	素材
GAMESTOP CORP-CLASS A	66	85	248	26,910	小売
HARRIS CORP	62	103	786	85,233	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	90	122	2,084	225,944	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP	99	135	410	44,485	エネルギー
NRG ENERGY INC	203	262	414	44,944	公益事業
INVESCO LTD	254	350	1,018	110,364	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	92	133	1,098	119,013	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	83	115	560	60,705	各種金融
TERADATA CORP	89	113	313	33,963	ソフトウェア・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	99	137	731	79,321	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	70	107	1,248	135,287	エネルギー
MSCI INC	—	81	620	67,230	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	54	76	305	33,124	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	90	153	1,526	165,413	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	921	1,281	13,050	1,414,277	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,169	1,610	12,447	1,348,965	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	115	156	1,479	160,369	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N.V.	26	34	428	46,408	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP	246	380	931	100,925	エネルギー
FLOWERVE CORP	80	108	505	54,744	資本財
HELMERICH & PAYNE	63	89	532	57,725	エネルギー
MDU RESOURCES GROUP INC	111	—	—	—	公益事業
ENERGEN CORP	43	—	—	—	エネルギー
T-MOBILE US INC	144	237	968	104,907	電気通信サービス
LORILLARD INC	213	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	45	62	416	45,144	メディア
RACKSPACE HOSTING INC	72	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	164	228	641	69,468	メディア
RESMED INC	82	115	664	71,990	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	—	69	675	73,193	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	145	197	924	100,152	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	76	101	727	78,843	保険

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
CHURCH & DWIGHT CO INC	78	108	1,045	113,296	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	56	76	635	68,891	運輸
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	48	—	—	—	公益事業
PERRIGO CO PLC	83	121	1,124	121,832	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUANTA SERVICES INC	126	129	305	33,103	資本財
FMC CORP	79	110	521	56,506	素材
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	72	—	—	—	食品・飲料・タバコ
WABTEC CORP	56	79	635	68,914	資本財
EVERSOURCE ENERGY	189	265	1,524	165,248	公益事業
NETSUITE INC	20	32	257	27,896	ソフトウェア・サービス
ALLERGAN PLC	223	326	7,264	787,286	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRGAS INC	40	53	764	82,889	素材
CROWN HOLDINGS INC	81	116	633	68,642	素材
CALPINE CORP	196	285	429	46,515	公益事業
EATON VANCE CORP	70	95	330	35,773	各種金融
DELTA AIR LINES INC	124	165	702	76,090	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	119	163	1,389	150,630	食品・飲料・タバコ
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	149	—	—	—	半導体・半導体製造装置
AMERICAN WATER WORKS CO INC	107	151	1,127	122,210	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	95	133	1,033	111,955	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	179	243	2,024	219,393	小売
FORTINET INC	—	121	395	42,836	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	55	79	361	39,210	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	17	22	824	89,361	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	108	141	466	50,579	銀行
QEP RESOURCES INC	99	—	—	—	エネルギー
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	599	970	524	56,819	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO	761	1,169	3,635	393,967	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	112	958	103,884	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	252	315	2,586	280,318	素材
HCA HOLDINGS INC	179	270	2,168	235,045	ヘルスケア機器・サービス
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	268	321	283	30,757	運輸
WHITING PETROLEUM CORP	121	—	—	—	エネルギー
ROCK-TENN COMPANY -CL A	83	—	—	—	素材
HOLLYFRONTIER CORP	111	144	421	45,721	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	165	441	1,584	171,733	エネルギー
ZILLOW GROUP INC - A	28	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ATMOS ENERGY CORP	—	87	648	70,268	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	—	132	738	80,018	資本財
XYLEM INC	107	148	636	68,936	資本財
TRIPADVISOR INC	69	97	642	69,664	小売
MEDIVATION INC	46	140	858	92,999	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	35	50	758	82,185	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	77	120	826	89,601	銀行
ALLEGHANY CORP	9	12	670	72,686	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	47	63	2,357	255,492	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	327	441	3,505	379,938	エネルギー
FACEBOOK INC-A	1,186	1,878	22,452	2,433,182	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP	166	235	979	106,096	公益事業
ALBEMARLE CORP	66	92	693	75,202	素材
PVH CORP	48	68	568	61,635	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A	64	95	1,231	133,407	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
KINDER MORGAN INC	1,067	1,570	2,679	290,397	エネルギー
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	166	—	—	—	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	207	286	1,490	161,539	商業・専門サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	175	231	1,630	176,689	自動車・自動車部品
CHARTER COMMUNICATION-A	45	69	1,519	164,639	メディア
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	95	141	492	53,351	資本財
SPLUNK INC	—	106	513	55,700	ソフトウェア・サービス
ADT CORP/THE	103	—	—	—	商業・専門サービス
KRAFT FOODS GROUP INC	348	—	—	—	食品・飲料・タバコ
OGE ENERGY CORP	121	169	520	56,427	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	37	51	442	47,969	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	944	1,352	8,481	919,193	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LIBERTY MEDIA CORP - A	52	—	—	—	メディア
TESLA MOTORS INC	52	81	1,699	184,149	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	133	186	610	66,190	エネルギー
REALOGY HOLDINGS CORP	85	122	387	41,973	不動産
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	74	106	545	59,087	各種金融
ZOETIS INC	296	392	1,804	195,542	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC	69	96	554	60,105	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	224	314	384	41,639	メディア
SPRINT CORP	479	644	224	24,374	電気通信サービス
TECO ENERGY INC	—	197	548	59,450	公益事業
SNAP-ON INC	34	48	782	84,786	資本財
AGL RESOURCES INC	—	102	671	72,758	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	122	152	670	72,618	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	226	481	702	76,092	ソフトウェア・サービス
VANTIV INC - CL A	86	130	723	78,456	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	58	93	666	72,194	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	79	125	860	93,293	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	54	75	1,024	111,050	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	56	76	287	31,164	資本財
PHARMACYCLICS INC	38	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	46	65	988	107,102	ソフトウェア・サービス
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	—	158	376	40,851	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL C	171	257	18,405	1,994,641	ソフトウェア・サービス
IMS HEALTH HOLDINGS INC	—	137	344	37,377	ヘルスケア機器・サービス
NAVIENT CORP	246	300	383	41,571	各種金融
ENDO INTERNATIONAL PLC	102	178	241	26,148	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED RENTALS INC	59	77	476	51,642	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	107	133	437	47,365	運輸
VOYA FINANCIAL INC	135	177	542	58,831	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	28	36	168	18,295	素材
ANTERO RESOURCES CORP	32	67	174	18,954	エネルギー
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	41	77	508	55,060	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIREEYE INC	49	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP - C	124	—	—	—	メディア
ALLY FINANCIAL INC	255	360	612	66,428	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	235	408	911	98,735	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	—	112	580	62,917	ソフトウェア・サービス
JARDEN CORP	108	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	67	133	621	67,316	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	41	67	944	102,384	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
SIGNET JEWELERS LTD	45	62	649	70,426	小売	
SYNCHRONY FINANCIAL	99	689	2,064	223,770	各種金融	
QORVO INC	86	116	538	58,307	半導体・半導体製造装置	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	70	99	328	35,600	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	—	146	690	74,830	保険	
ACUITY BRANDS INC	—	36	913	98,995	資本財	
JONES LANG LASALLE INC	—	37	417	45,228	不動産	
ARAMARK	—	188	621	67,363	消費者サービス	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	—	435	967	104,862	銀行	
LEAR CORP	—	62	718	77,836	自動車・自動車部品	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	63	340	36,872	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WHITEWAVE FOODS CO	—	146	644	69,883	食品・飲料・タバコ	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	—	119	336	36,459	素材	
RITE AID CORP	—	857	686	74,344	食品・生活必需品小売り	
BAXALTA INC	—	588	2,503	271,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLUMBIA PIPELINE GROUP	—	322	823	89,256	エネルギー	
WESTROCK CO	—	223	955	103,546	素材	
KRAFT HEINZ CO/THE	—	502	4,277	463,512	食品・飲料・タバコ	
PAYPAL HOLDINGS INC	—	909	3,613	391,572	ソフトウェア・サービス	
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	—	42	208	22,570	ソフトウェア・サービス	
ZILLOW GROUP INC - C	—	83	226	24,531	ソフトウェア・サービス	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	—	1,492	2,391	259,164	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MOBILEYE NV	—	65	239	25,950	ソフトウェア・サービス	
AMERCO	—	6	241	26,152	運輸	
CDW CORP/DE	—	119	494	53,599	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MEDNAX INC	—	77	538	58,397	ヘルスケア機器・サービス	
SABRE CORP	—	172	503	54,556	ソフトウェア・サービス	
WR GRACE & CO	—	59	461	49,986	素材	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	—	143	503	54,607	耐久消費財・アパレル	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	—	167	529	57,329	メディア	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	—	74	240	26,018	メディア	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	—	480	294	31,938	不動産	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	—	200	1,066	115,522	資本財	
小 計	株 数	金 額	184,539	260,387	1,520,759	164,804,668
	銘柄 数 < 比 率 >		593	596	—	< 61.0% >
(カナダ)			千カナダドル			
ROYAL BANK OF CANADA	855	1,228	9,408	793,455	銀行	
IMPERIAL OIL LTD	176	247	1,000	84,359	エネルギー	
THOMSON REUTERS CORP	213	286	1,508	127,176	メディア	
TRANSCANADA CORP	420	588	3,044	256,756	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	214	301	1,486	125,393	電気通信サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	362	506	2,182	184,082	保険	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	340	470	592	49,940	素材	
BARRICK GOLD CORP	690	965	2,288	192,948	素材	
BCE INC	85	120	715	60,302	電気通信サービス	
AGRIUM INC	85	109	1,213	102,352	素材	
BOMBARDIER INC-B	847	1,596	323	27,321	資本財	
BANK OF MONTREAL	382	530	4,319	364,263	銀行	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	330	733	3,192	269,261	不動産	
BANK OF NOVA SCOTIA	720	995	6,247	526,860	銀行	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	189	268	906	76,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAE INC	160	218	338	28,568	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
CAMECO CORP	237	330	499	42,132	エネルギー
CI FINANCIAL CORP	132	195	527	44,481	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	235	328	3,297	278,068	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	647	907	3,364	283,691	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	483	659	5,040	425,081	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	44	59	820	69,188	小売
ENBRIDGE INC	503	760	3,895	328,465	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	12	18	1,160	97,857	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	133	183	1,067	90,047	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	206	292	442	37,331	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	61	80	297	25,056	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	135	188	1,297	109,392	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,166	1,631	2,984	251,702	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	246	335	1,755	148,061	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	193	284	1,185	99,942	銀行
ONEX CORPORATION	53	71	563	47,480	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	491	691	1,415	119,399	素材
POWER CORP OF CANADA	220	310	894	75,394	保険
POWER FINANCIAL CORP	147	208	650	54,867	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	236	337	810	68,348	メディア
SUNCOR ENERGY INC	860	1,310	4,515	380,798	エネルギー
TRANSALTA CORP	169	—	—	—	公益事業
WESTON (GEORGE) LTD	30	43	473	39,967	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	101	120	2,124	179,116	運輸
ENCANA CORP	492	699	627	52,875	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	124	180	1,078	90,985	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	103	145	318	26,840	資本財
GOLDCORP INC	484	687	1,654	139,506	素材
KINROSS GOLD CORP	689	1,019	686	57,918	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	90	124	638	53,874	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC	179	247	845	71,278	保険
METHANEX CORP	56	73	285	24,088	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	491	849	302	25,488	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	46	70	133	11,298	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	139	192	732	61,753	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	152	211	879	74,181	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	299	424	365	30,785	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELUS CORP	116	116	471	39,735	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	359	571	527	44,444	素材
YAMANA GOLD INC	546	785	484	40,844	素材
FORTIS INC	163	236	959	80,881	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	248	347	1,872	157,929	食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP	431	580	361	30,471	素材
TORONTO-DOMINION BANK	1,091	1,533	8,592	724,602	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	93	145	1,301	109,732	素材
SILVER WHEATON CORP	241	361	893	75,377	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	33	133	285	24,114	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	59	87	360	30,425	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	74	107	390	32,962	公益事業
METRO INC	148	199	851	71,825	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	71	101	719	60,677	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	78	109	964	81,367	保険

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
CRESCENT POINT ENERGY CORP	248	419	853	71,940	エネルギー	
CENOVUS ENERGY INC	489	692	1,314	110,877	エネルギー	
MEG ENERGY CORP	94	—	—	—	エネルギー	
ARC RESOURCES LTD	188	288	592	49,934	エネルギー	
CANADIAN OIL SANDS LTD	289	—	—	—	エネルギー	
BAYTEX ENERGY CORP	121	—	—	—	エネルギー	
TOURMALINE OIL CORP	102	160	491	41,463	エネルギー	
ENERPLUS CORP	118	—	—	—	エネルギー	
NEW GOLD INC	313	—	—	—	素材	
PEMBINA PIPELINE CORP	201	309	1,142	96,388	エネルギー	
VERMILION ENERGY INC	63	93	390	32,892	エネルギー	
CATAMARAN CORP	122	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
DOLLARAMA INC	75	99	903	76,181	小売	
KEYERA CORP	100	143	527	44,522	エネルギー	
ALTAGAS LTD	79	126	374	31,579	エネルギー	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	87	124	395	33,336	エネルギー	
ATCO LTD -CLASS I	47	66	279	23,548	公益事業	
FIRST CAPITAL REALTY INC	60	97	205	17,349	不動産	
INTER PIPELINE LTD	193	280	724	61,085	エネルギー	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	79	151	370	31,261	エネルギー	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	—	133	320	27,030	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	11	16	816	68,825	ソフトウェア・サービス	
CONSTELLATION SOFTWARE INC-RTS	11	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	35	—	—	—	エネルギー	
RESTAURANT BRANDS INTERN	116	168	888	74,962	消費者サービス	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	41	57	247	20,875	素材	
VERESEN INC	—	258	235	19,886	エネルギー	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	—	23	517	43,675	素材	
ELEMENT FINANCIAL CORP	—	323	485	40,912	各種金融	
LINAMAR CORP	—	39	203	17,125	自動車・自動車部品	
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	—	92	395	33,314	商業・専門サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	23,185	32,985	118,114	9,960,633	
	銘柄 数 < 比 率 >	93	90	—	< 3.7% >	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
COMMERZBANK AG	631	882	620	76,814	銀行	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	816	1,141	1,679	207,947	各種金融	
METRO AG	95	147	416	51,589	食品・生活必需品小売り	
SIEMENS AG-REG	469	655	6,184	765,698	資本財	
RWE AG	290	407	466	57,805	公益事業	
BASF SE	544	759	5,194	643,140	素材	
VOLKSWAGEN AG	17	29	408	50,600	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	570	796	4,728	585,485	自動車・自動車部品	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	105	146	1,497	185,453	家庭用品・パーソナル用品	
E.ON SE	1,188	1,661	1,332	164,978	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	196	274	2,107	260,903	自動車・自動車部品	
BAYER AG-REG	490	684	6,841	847,033	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LINDE AG	110	153	1,942	240,552	素材	
ALLIANZ SE-REG	270	377	5,241	648,960	保険	
MAN SE	20	29	278	34,526	資本財	
CONTINENTAL AG	65	90	1,700	210,568	自動車・自動車部品	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	671	933	1,123	139,043	半導体・半導体製造装置	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	90	126	611	75,763	自動車・自動車部品	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	136	204	255	31,656	運輸	
HUGO BOSS AG -ORD	39	55	309	38,286	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE POST AG-REG	574	801	2,117	262,204	運輸	
SAP SE	546	812	5,541	686,046	ソフトウェア・サービス	
CELESIO AG	31	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	129	181	773	95,727	メディア	
DEUTSCHE BOERSE AG	114	159	1,215	150,532	各種金融	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	129	180	1,353	167,604	ヘルスケア機器・サービス	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	22	34	174	21,612	運輸	
ADIDAS AG	123	173	1,960	242,706	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,881	2,669	4,176	517,039	電気通信サービス	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	102	137	2,181	270,083	保険	
THYSSENKRUPP AG	270	305	581	72,000	素材	
BEIERSDORF AG	58	82	657	81,376	家庭用品・パーソナル用品	
HEIDELBERGCEMENT AG	84	116	883	109,365	素材	
MERCK KGAA	77	106	858	106,315	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VOLKSWAGEN AG-PREF	96	153	1,998	247,389	自動車・自動車部品	
LANXESS AG	53	75	334	41,392	素材	
FRESENIUS SE & CO KGAA	224	315	2,044	253,173	ヘルスケア機器・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	171	279	760	94,121	不動産	
GEA GROUP AG	109	150	608	75,315	資本財	
SYMRISE AG	73	102	584	72,372	素材	
K+S AG-REG	102	158	355	44,066	素材	
HENKEL AG & CO KGAA	68	85	775	95,956	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	73	102	443	54,900	ソフトウェア・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	32	44	309	38,288	自動車・自動車部品	
HANNOVER RUECK SE	35	49	477	59,157	保険	
BRENNTAG AG	92	127	609	75,516	資本財	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	12	—	—	—	メディア	
AXEL SPRINGER SE	24	37	187	23,168	メディア	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	40	57	212	26,257	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	347	625	285	35,341	電気通信サービス	
OSRAM LICHT AG	52	73	337	41,728	資本財	
VONOVIA SE	203	386	1,174	145,390	不動産	
EVONIK INDUSTRIES AG	—	114	331	41,005	素材	
ZALANDO SE	—	69	206	25,546	小売	
小 計	株 数	金 額	12,785	18,327	77,453	9,589,511
	銘柄 数 < 比率 >		52	52	—	< 3.6% >
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	692	961	1,260	156,119	保険	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	2,544	—	—	—	銀行	
INTESA SANPAOLO	7,501	10,499	2,368	293,275	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	5,980	9,508	805	99,707	電気通信サービス	
ENI SPA	1,505	2,105	2,827	350,055	エネルギー	
UNICREDIT SPA	2,601	3,948	1,120	138,745	銀行	
ENEL SPA	3,904	6,331	2,513	311,218	公益事業	
SAIPEM SPA	160	4,956	181	22,465	エネルギー	
ATLANTIA SPA	246	342	823	101,976	運輸	
INTESA SANPAOLO-RSP	556	762	165	20,505	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	99	139	664	82,317	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	360	466	298	37,009	各種金融	
SNAM SPA	1,246	1,760	930	115,227	公益事業	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
TELECOM ITALIA-RSP	3,577	4,971	338	41,914	電気通信サービス	
BANCO POPOLARE SC	214	308	135	16,801	銀行	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	244	350	377	46,698	資本財	
PIRELLI & C.	139	—	—	—	自動車・自動車部品	
UBI BANCA SPA	509	734	232	28,795	銀行	
TERNA SPA	917	1,281	620	76,875	公益事業	
UNIPOLSAI SPA	523	908	173	21,433	保険	
PRYSMIAN SPA	123	160	345	42,738	資本財	
EXOR SPA	56	93	299	37,096	各種金融	
ENEL GREEN POWER SPA	1,081	—	—	—	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	34,788	50,592	16,484	2,040,977	< 0.8% >
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)	109	154	1,402	173,647	自動車・自動車部品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	165	231	3,384	419,048	耐久消費財・アパレル	
PEUGEOT SA	232	366	499	61,849	自動車・自動車部品	
AXA SA	1,077	1,627	3,391	419,891	保険	
DANONE	343	487	2,952	365,563	食品・飲料・タバコ	
CARREFOUR SA	326	458	1,106	137,014	食品・生活必需品小売り	
VIVENDI	719	960	1,580	195,653	メディア	
INGENICO GROUP	—	45	465	57,623	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ALCATEL-LUCENT SA	1,680	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SOCIETE GENERALE SA	429	600	1,981	245,282	銀行	
AIR LIQUIDE SA	204	284	2,711	335,660	素材	
TOTAL SA	1,268	1,816	7,788	964,328	エネルギー	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	266	394	1,517	187,926	資本財	
ZODIAC AEROSPACE	110	168	351	43,524	資本財	
VINCI SA	279	396	2,560	317,049	資本財	
LAFARGE SA	110	—	—	—	素材	
SANOFI	708	971	6,752	836,076	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	254	380	755	93,545	公益事業	
L'OREAL	149	207	3,310	409,841	家庭用品・パーソナル用品	
ACCOR SA	124	175	680	84,200	消費者サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	311	461	2,535	313,981	資本財	
BNP PARIBAS	627	876	3,866	478,694	銀行	
ESSILOR INTERNATIONAL	121	169	1,936	239,786	ヘルスケア機器・サービス	
CAPGEMINI	84	135	1,105	136,853	ソフトウェア・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	32	48	245	30,371	食品・生活必需品小売り	
VALEO SA	45	65	912	112,927	自動車・自動車部品	
HERMES INTERNATIONAL	15	21	697	86,299	耐久消費財・アパレル	
VALLOUREC SA	63	—	—	—	エネルギー	
SODEXO	56	77	691	85,612	消費者サービス	
KERING	44	62	904	111,985	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	76	106	734	90,985	ソフトウェア・サービス	
TECHNIP SA	59	87	411	50,911	エネルギー	
CHRISTIAN DIOR SE	32	45	684	84,698	耐久消費財・アパレル	
ATOS SE	47	72	584	72,428	ソフトウェア・サービス	
ORANGE	1,098	1,644	2,416	299,232	電気通信サービス	
CNP ASSURANCES	100	142	200	24,768	保険	
IMERYS SA	19	29	183	22,704	素材	
SAFRAN SA	173	258	1,548	191,736	資本財	
RENAULT SA	113	158	1,291	159,885	自動車・自動車部品	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
PUBLICIS GROUPE	111	156	982	121,689	メディア
LAGARDERE SCA	71	95	202	25,118	メディア
JC DECAUX SA	40	61	218	27,078	メディア
SOCIETE BIC SA	17	23	294	36,493	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	99	167	487	60,359	資本財
THALES SA	54	86	666	82,567	資本財
PERNOD RICARD SA	125	175	1,679	207,901	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	610	874	795	98,490	銀行
ENGIE	860	1,215	1,595	197,600	公益事業
ALSTOM	127	128	284	35,219	資本財
ARKEMA	39	55	396	49,122	素材
LEGRAND SA	157	220	1,074	133,056	資本財
SCOR SE	91	126	371	45,943	保険
ADP	17	24	263	32,653	運輸
EDF	145	201	228	28,335	公益事業
NATIXIS	554	779	327	40,543	銀行
WENDEL	18	23	247	30,634	各種金融
BUREAU VERITAS SA	157	221	446	55,337	商業・専門サービス
EURAZEO	22	32	202	25,084	各種金融
EURAZEO-NEW	1	—	—	—	各種金融
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	179	255	386	47,864	公益事業
ILIAD SA	15	21	426	52,751	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	92	141	384	47,600	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	282	393	442	54,794	運輸
EDENRED	120	172	295	36,566	商業・専門サービス
REMY COINTREAU	14	19	140	17,357	食品・飲料・タバコ
REXEL SA	163	255	335	41,582	資本財
BOLLORE	511	711	239	29,617	運輸
NUMERICABLE-SFR	58	91	252	31,274	電気通信サービス
小 計	株 数	金 額			
銘柄数 < 比率 >	16,447	20,923	77,814	9,634,233	
(ユーロ…オランダ)					
QIAGEN N. V.	135	183	351	43,569	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV	566	786	490	60,697	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	535	743	499	61,847	自動車・自動車部品
FERRARI NV	—	105	400	49,595	自動車・自動車部品
AIRBUS GROUP SE	348	489	2,714	336,104	資本財
STMICROELECTRONICS NV	371	512	242	29,992	半導体・半導体製造装置
GEMALTO	46	66	380	47,085	ソフトウェア・サービス
WOLTERS KLUWER	180	249	852	105,562	メディア
KONINKLIJKE KPN NV	1,900	2,654	921	114,127	電気通信サービス
AKZO NOBEL	145	204	1,254	155,337	素材
HEINEKEN NV	136	190	1,575	195,012	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV	554	787	1,819	225,240	資本財
RELX NV	414	822	1,221	151,245	メディア
AEGON NV	1,074	1,506	727	90,046	保険
KONINKLIJKE AHOLD NV	530	688	1,327	164,408	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD HOLDING NV	75	105	492	60,973	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV	59	83	602	74,621	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	101	149	788	97,564	素材
ING GROEP NV-CVA	2,287	3,201	3,345	414,151	銀行
ASML HOLDING NV	207	286	2,326	288,076	半導体・半導体製造装置

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UNILEVER NV-CVA	966	1,346	5,282	654,058	家庭用品・パーソナル用品	
VOPAK	41	58	271	33,622	エネルギー	
BOSKALIS WESTMINSTER	51	72	254	31,523	資本財	
DELTA LLOYD NV	130	—	—	—	保険	
TNT EXPRESS NV	259	417	332	41,214	運輸	
OCI NV	49	73	105	13,119	素材	
NN GROUP NV	93	261	776	96,078	保険	
ALTICE NV - B	—	87	121	15,008	メディア	
ALTICE NV - A	—	310	426	52,806	メディア	
小 計	株 数 ・ 金 額	11,264	16,445	29,906	3,702,693	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	28	—	< 1.4% >	
(ユーロ…スペイン)						
BANCO POPULAR ESPANOL	1,061	1,432	297	36,772	銀行	
ENDESA SA	191	265	481	59,643	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	102	158	435	53,896	資本財	
IBERDROLA SA	3,070	4,556	2,751	340,701	公益事業	
TELEFONICA SA	2,651	3,725	3,449	427,117	電気通信サービス	
BANCO SANTANDER SA	8,525	11,932	4,819	596,703	銀行	
BANKINTER SA	403	553	352	43,583	銀行	
REPSOL SA	615	908	1,021	126,497	エネルギー	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,743	5,369	2,960	366,536	銀行	
GAS NATURAL SDG SA	208	293	494	61,215	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	645	898	2,514	311,377	小売	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	239	429	622	77,044	運輸	
MAPPRE SA	539	892	189	23,491	保険	
FERROVIAL SA	246	390	707	87,546	資本財	
FERROVIAL SA-RTS	237	—	—	—	資本財	
ZARDOYA OTIS SA	103	153	139	17,220	資本財	
ENAGAS SA	122	182	478	59,299	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	65	90	705	87,346	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	2,560	4,311	663	82,094	銀行	
CAIXABANK S.A	1,364	2,194	525	65,022	銀行	
GRIFOLS SA	88	245	452	55,979	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	264	361	1,445	178,968	ソフトウェア・サービス	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	493	681	447	55,455	運輸	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	371	486	232	28,794	食品・生活必需品小売り	
BANKIA SA	2,716	3,782	289	35,829	銀行	
AENA SA	36	55	679	84,170	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額	30,669	44,354	27,157	3,362,311	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	25	—	< 1.2% >	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS	128	166	540	66,937	保険	
UCB SA	74	104	697	86,384	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	477	665	7,400	916,197	食品・飲料・タバコ	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	48	66	486	60,178	各種金融	
DELHAIZE GROUP	60	85	787	97,509	食品・生活必需品小売り	
UMICORE	55	78	352	43,607	素材	
COLRUYT SA	42	58	293	36,334	食品・生活必需品小売り	
KBC GROEP NV	149	207	947	117,290	銀行	
SOLVAY SA	34	61	549	67,977	素材	
PROXIMUS	90	126	354	43,869	電気通信サービス	

銘柄	株数	期首(前期末)			業種等	
		当		期末		
		株数	株数			評価額
株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額			
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円		
TELENET GROUP HOLDING NV	30	46	197	24,454	メディア	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,193	1,667	12,605	1,560,740	
		11	11	—	<0.6%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG	166	232	545	67,479	銀行	
OMV AG	85	123	310	38,419	エネルギー	
VOESTALPINE AG	65	93	269	33,338	素材	
IMMOFINANZ AG	554	—	—	—	不動産	
ANDRITZ AG	42	64	291	36,069	資本財	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	69	103	126	15,609	銀行	
VIENNA INSURANCE GROUP AG	24	—	—	—	保険	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,008	616	1,542	190,916	
		7	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP	22	31	235	29,208	メディア	
TENARIS SA	276	386	435	53,885	エネルギー	
SES	180	270	653	80,891	メディア	
ARCELORMITTAL	590	1,408	612	75,848	素材	
ALTICE SA	51	—	—	—	メディア	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,122	2,096	1,937	239,833	
		5	4	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ	2,219	4,772	2,214	274,159	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STORA ENSO OYJ-R SHS	323	452	335	41,518	素材	
NOKIAN RENKAAT OYJ	67	94	304	37,728	自動車・自動車部品	
UPM-KYMMENE OYJ	314	439	731	90,610	素材	
FORTUM OYJ	267	371	473	58,605	公益事業	
KONE OYJ-B	187	277	1,096	135,813	資本財	
METSO OYJ	67	93	189	23,406	資本財	
SAMPO OYJ-A SHS	265	368	1,443	178,680	保険	
WARTSILA OYJ ABP	86	121	446	55,280	資本財	
ELISA OYJ	84	118	384	47,544	電気通信サービス	
NESTE OYJ	73	106	307	38,073	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	60	84	257	31,857	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,019	7,301	8,184	1,013,278	
		12	12	—	<0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A	96	135	1,084	134,317	食品・飲料・タバコ	
PADDY POWER BETFAIR PLC	—	70	792	98,107	消費者サービス	
IRISH BANK RESOLUTION CORPOR	472	472	—	—	銀行	
BANK OF IRELAND	16,439	23,370	574	71,180	銀行	
CRH PLC	490	691	1,765	218,569	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,499	24,739	4,217	522,174	
		4	5	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,362	1,934	601	74,522	公益事業	
JERONIMO MARTINS	149	207	285	35,340	食品・生活必需品小売り	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	21,117	35,849	114	14,203	銀行	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円		
GALP ENERGIA SGPS SA	227	383	451	55,924	エネルギー	
小 計	株 数 ・ 金 額	22,857	38,374	1,453	179,990	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.1% >	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	153,656	225,438	258,756	32,036,661	
	銘柄 数 < 比 率 >	237	230	—	< 11.9% >	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC	9,750	13,882	2,271	355,493	銀行	
BP PLC	10,812	15,163	5,476	857,241	エネルギー	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	33,849	47,240	3,103	485,714	銀行	
ASTRAZENECA PLC	748	1,045	4,110	643,391	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SMITHS GROUP PLC	235	326	358	56,078	資本財	
NEXT PLC	90	120	640	100,321	小売	
DIAGEO PLC	1,490	2,080	3,922	613,952	食品・飲料・タバコ	
SKY PLC	611	856	796	124,729	メディア	
BAE SYSTEMS PLC	1,867	2,614	1,282	200,685	資本財	
UNILEVER PLC	760	1,060	3,341	523,004	家庭用品・パーソナル用品	
TESCO PLC	4,811	6,742	1,074	168,167	食品・生活必需品小売り	
RELX PLC	671	920	1,130	177,002	メディア	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	966	1,348	563	88,208	小売	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	383	526	3,612	565,489	家庭用品・パーソナル用品	
PRUDENTIAL PLC	1,521	2,127	2,781	435,312	保険	
BG GROUP PLC	2,023	—	—	—	エネルギー	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,519	4,916	1,066	166,975	保険	
SAGE GROUP PLC/THE	637	893	535	83,815	ソフトウェア・サービス	
HSBC HOLDINGS PLC	11,377	16,192	6,981	1,092,761	銀行	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,105	1,542	6,548	1,024,965	食品・飲料・タバコ	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	406	581	550	86,227	公益事業	
SCHRODERS PLC	74	102	252	39,525	各種金融	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,501	2,873	614	96,116	銀行	
BHP BILLITON PLC	1,250	1,747	1,461	228,824	素材	
IMPERIAL BRANDS PLC	567	793	3,015	472,056	食品・飲料・タバコ	
WPP PLC	778	1,070	1,713	268,132	メディア	
CENTRICA PLC	2,950	4,221	886	138,743	公益事業	
BT GROUP PLC	4,824	7,008	3,062	479,275	電気通信サービス	
SSE PLC	587	839	1,270	198,906	公益事業	
STANDARD CHARTERED PLC	1,464	2,708	1,346	210,814	銀行	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,117	1,520	1,001	156,737	資本財	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF C	158,293	112,647	11	1,763	資本財	
COMPASS GROUP PLC	987	1,358	1,699	266,069	消費者サービス	
KINGFISHER PLC	1,400	1,891	686	107,467	小売	
PEARSON PLC	486	678	548	85,816	メディア	
SEVERN TRENT PLC	144	203	453	70,994	公益事業	
RIO TINTO PLC	753	1,025	2,083	326,161	素材	
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,881	4,027	5,940	929,766	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SABMILLER PLC	573	803	3,398	531,888	食品・飲料・タバコ	
PROVIDENT FINANCIAL PLC	—	121	338	53,053	各種金融	
3I GROUP PLC	582	793	378	59,256	各種金融	
GKN PLC	968	1,415	396	62,118	自動車・自動車部品	
VODAFONE GROUP PLC	15,710	21,964	4,882	764,255	電気通信サービス	
WM MORRISON SUPERMARKETS	1,256	1,835	347	54,409	食品・生活必需品小売り	
SAINSBURY (J) PLC	721	1,109	291	45,685	食品・生活必需品小売り	
AVIVA PLC	2,370	3,343	1,415	221,612	保険	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
CAPITA PLC	394	552	605	94,698	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC	588	806	334	52,320	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	122	159	460	72,090	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	609	841	403	63,187	保険
WHITBREAD PLC	108	150	591	92,514	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	2,230	3,112	3,103	485,719	公益事業
ARM HOLDINGS PLC	831	1,162	1,100	172,192	半導体・半導体製造装置
WOLSELEY PLC	155	210	825	129,143	資本財
BUNZL PLC	199	277	578	90,475	資本財
COBHAM PLC	670	976	157	24,708	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	825	1,160	716	112,109	素材
INTERTEK GROUP PLC	95	134	448	70,198	商業・専門サービス
WILLIAM HILL PLC	518	725	221	34,740	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	265	367	429	67,293	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	140	171	463	72,557	消費者サービス
CARNIVAL PLC	107	156	563	88,196	消費者サービス
PERSIMMON PLC	180	252	494	77,330	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	483	641	263	41,275	資本財
ICAP PLC	332	455	211	33,043	各種金融
ITV PLC	2,282	3,161	680	106,551	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	185	258	667	104,492	各種金融
G4S PLC	933	1,293	249	39,085	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS	—	107	310	48,651	耐久消費財・アパレル
AMEC FOSTER WHEELER PLC	228	—	—	—	エネルギー
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	—	826	432	67,755	耐久消費財・アパレル
IMI PLC	160	225	222	34,870	資本財
REXAM PLC	417	590	371	58,090	素材
SMITH & NEPHEW PLC	531	740	856	134,045	ヘルスケア機器・サービス
TATE & LYLE PLC	276	394	240	37,602	食品・飲料・タバコ
TAYLOR WIMPEY PLC	—	2,685	482	75,505	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,318	3,260	5,655	885,192	エネルギー
PETROFAC LTD	153	209	171	26,912	エネルギー
TRAVIS PERKINS PLC	145	205	373	58,414	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,446	3,280	5,732	897,187	エネルギー
OLD MUTUAL PLC	2,904	4,078	701	109,787	保険
INVESTEC PLC	327	470	226	35,413	各種金融
STANDARD LIFE PLC	1,166	1,628	520	81,408	保険
EXPERIAN PLC	587	799	1,011	158,360	商業・専門サービス
MONDI PLC	—	302	408	63,970	素材
WEIR GROUP PLC/THE	125	181	202	31,759	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	211	294	914	143,084	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC	233	317	135	21,182	素材
TULLOW OIL PLC	532	—	—	—	エネルギー
SHIRE PLC	349	490	2,053	321,403	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INMARSAT PLC	251	374	300	46,960	電気通信サービス
ADMIRAL GROUP PLC	117	174	334	52,426	保険
FRESNILLO PLC	130	178	191	29,992	素材
RANDGOLD RESOURCES LTD	51	76	469	73,409	素材
AGGREKO PLC	151	207	218	34,260	商業・専門サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	148	208	201	31,496	商業・専門サービス
ST JAMES' S PLACE PLC	—	434	376	58,983	保険
GLENCORE PLC	6,585	10,122	1,385	216,827	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		
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	551	759	202	31,755	各種金融	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	140	215	271	42,558	各種金融	
CRODA INTERNATIONAL PLC	79	113	341	53,383	素材	
MELROSE INDUSTRIES PLC	584	—	—	—	資本財	
COCA-COLA HBC AG-DI	115	165	231	36,253	食品・飲料・タバコ	
EASYJET PLC	96	141	210	32,992	運輸	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	886	1,127	427	66,859	保険	
ROYAL MAIL PLC	382	743	370	57,943	運輸	
ASHTREAD GROUP PLC	300	416	374	58,567	資本財	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	165	236	89	13,935	小売	
MERLIN ENTERTAINMENT	418	587	253	39,674	消費者サービス	
TUI AG-DI	269	410	432	67,656	消費者サービス	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	—	304	266	41,705	ヘルスケア機器・サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC	—	792	302	47,320	ソフトウェア・サービス	
WORLDPAY GROUP PLC	—	1,170	307	48,199	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	325,695 104	353,365 109	129,802 —	20,316,680 <7.5%>	
(スイス)			千スイスフラン			
NESTLE SA-REG	1,912	2,637	19,187	2,141,894	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	309	431	2,684	299,657	耐久消費財・アパレル	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	904	1,487	2,034	227,107	各種金融	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	135	376	1,660	185,328	素材	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	416	581	14,184	1,583,383	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GIVAUDAN-REG	5	7	1,473	164,515	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	31	44	602	67,216	ヘルスケア機器・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	88	124	2,686	299,863	保険	
SYNGENTA AG-REG	55	76	3,012	336,333	素材	
LONZA GROUP AG-REG	31	43	739	82,558	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	29	40	257	28,722	耐久消費財・アパレル	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	26	36	643	71,778	資本財	
GEBERIT AG-REG	22	31	1,154	128,925	資本財	
SWISS RE AG	208	290	2,527	282,098	保険	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	18	25	822	91,852	耐久消費財・アパレル	
PARGESA HOLDING SA-BR	19	27	173	19,334	各種金融	
NOVARTIS AG-REG	1,364	1,882	13,788	1,539,227	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	101	137	808	90,222	商業・専門サービス	
SWISSCOM AG-REG	13	21	1,035	115,627	電気通信サービス	
ABB LTD-REG	1,302	1,819	3,681	410,990	資本財	
SGS SA-REG	3	4	951	106,256	商業・専門サービス	
SULZER AG-REG	13	11	100	11,195	資本財	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	12	16	295	32,965	資本財	
ACTELION LTD-REG	60	84	1,329	148,460	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	32	44	605	67,589	運輸	
BALOISE HOLDING AG - REG	28	40	476	53,222	保険	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	18	26	639	71,426	保険	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.06	0.09	648	72,441	食品・飲料・タバコ	
ARYZTA AG	52	74	282	31,577	食品・飲料・タバコ	
JULIUS BAER GROUP LTD	133	185	729	81,450	各種金融	
SIKA AG-BR	1	1	745	83,236	素材	
TRANSOCEAN LTD	211	—	—	—	エネルギー	
SWISS PRIME SITE-REG	34	55	469	52,402	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.55	0.81	491	54,885	食品・飲料・タバコ	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	10	13	530	59,185	各種金融	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	211	23,628	食品・飲料・タバコ	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	5	6	317	35,414	素材	
UBS GROUP AG-REG	2,164	3,026	4,688	523,404	各種金融	
DUFREY AG-REG	—	33	439	49,023	小売	
GALENICA AG-REG	—	3	435	48,573	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	9,781	13,757	87,547	9,772,976	
	銘柄数<比率>	38	39	—	<3.6%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ			
ELECTROLUX AB-SER B	140	199	4,585	61,124	耐久消費財・アパレル	
ERICSSON LM-B SHS	1,804	2,516	15,592	207,847	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ATLAS COPCO AB-B SHS	234	321	6,042	80,541	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	901	1,254	9,429	125,696	銀行	
INVESTOR AB-B SHS	271	375	10,196	135,914	各種金融	
NORDEA BANK AB	1,801	2,509	19,198	255,917	銀行	
GETINGE AB-B SHS	118	166	2,808	37,434	ヘルスケア機器・サービス	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	296	1,239	12,777	170,322	銀行	
ATLAS COPCO AB-A SHS	400	556	11,324	150,954	資本財	
SKF AB-B SHARES	233	329	4,787	63,813	資本財	
ASSA ABLOY AB-B	198	829	13,665	182,161	資本財	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	562	784	20,827	277,636	小売	
SANDVIK AB	635	882	7,035	93,789	資本財	
SWEDBANK AB - A SHARES	537	749	12,938	172,474	銀行	
SECURITAS AB-B SHS	182	259	3,252	43,349	商業・専門サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	348	500	12,647	168,584	家庭用品・パーソナル用品	
SKANSKA AB-B SHS	223	313	5,641	75,201	資本財	
SWEDISH MATCH AB	120	163	4,440	59,197	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	188	255	1,983	26,445	電気通信サービス	
TELIA CO AB	1,536	2,147	8,063	107,485	電気通信サービス	
VOLVO AB-B SHS	909	1,274	11,822	157,592	資本財	
ALFA LAVAL AB	188	242	3,040	40,529	資本財	
ELEKTA AB-B SHS	214	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
LUNDIN PETROLEUM AB	125	179	2,648	35,305	エネルギー	
BOLIDEN AB	159	225	3,064	40,855	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	240	355	2,329	31,056	耐久消費財・アパレル	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	38	55	2,484	33,124	電気通信サービス	
HEXAGON AB-B SHS	150	214	6,676	89,003	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	140	194	4,291	57,199	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	95	129	1,796	23,942	各種金融	
ICA GRUPPEN AB	46	68	1,876	25,016	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額	13,047	19,293	227,270	3,029,520	
	銘柄数<比率>	31	30	—	<1.1%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	580	809	7,980	105,982	銀行	
NORSK HYDRO ASA	805	1,105	3,523	46,797	素材	
ORKLA ASA	475	669	5,042	66,958	食品・飲料・タバコ	
STATOIL ASA	662	924	12,477	165,699	エネルギー	
TELENOR ASA	445	621	8,596	114,158	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	105	147	4,314	57,291	素材	
SUBSEA 7 SA	166	—	—	—	エネルギー	
SEADRILL LTD	233	—	—	—	エネルギー	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	119	170	2,335	31,020	保険	

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等		
		株 数	評 価 額			
		外貨建金額	邦貨換算金額			
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェークローネ	千円		
SCHIBSTED ASA-CL A	—	64	1,720	22,851	メディア	
SCHIBSTED ASA-B SHS	—	76	1,973	26,210	メディア	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,595	4,588	47,964	636,971	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	< 0.2% >	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
NOVO NORDISK A/S-B	1,189	1,621	58,108	966,924	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	142	193	6,093	101,390	素材	
DANSKE BANK A/S	388	585	10,730	178,562	銀行	
WILLIAM DEMANT HOLDING	12	21	1,401	23,322	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	131	185	8,421	140,137	資本財	
TDC A/S	478	675	2,302	38,317	電気通信サービス	
CARLSBERG AS-B	63	88	5,494	91,436	食品・飲料・タバコ	
COLOPLAST-B	66	92	4,528	75,349	ヘルスケア機器・サービス	
DSV A/S	105	160	4,525	75,300	運輸	
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	4	5	4,926	81,981	運輸	
TRYG A/S	13	93	1,160	19,303	保険	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	2	3	2,743	45,643	運輸	
PANDORA A/S	68	91	8,649	143,922	耐久消費財・アパレル	
ISS A/S	71	123	3,148	52,392	商業・専門サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	—	82	3,376	56,181	素材	
GENMAB A/S	—	44	4,400	73,216	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,739	4,067	130,011	2,163,383	
	銘柄 数 < 比 率 >	14	16	—	< 0.8% >	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
BHP BILLITON LIMITED	1,904	2,662	4,939	394,700	素材	
CSL LTD	282	385	4,245	339,254	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALUMINA LTD	1,564	2,146	284	22,729	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	441	618	1,634	130,642	エネルギー	
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,639	2,412	5,893	470,988	銀行	
RIO TINTO LTD	258	353	1,626	130,010	素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD	815	1,147	1,344	107,425	保険	
LENLEASE GROUP	329	468	633	50,638	不動産	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	963	1,416	11,049	882,944	銀行	
WESTPAC BANKING CORP	1,848	2,757	8,633	689,904	銀行	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,387	2,180	6,298	503,299	銀行	
BRAMBLES LTD	940	1,325	1,734	138,565	商業・専門サービス	
QANTAS AIRWAYS LTD	373	494	168	13,476	運輸	
BORAL LTD	466	622	428	34,251	素材	
WOOLWORTHS LTD	750	1,057	2,410	192,634	食品・生活必需品小売り	
TELSTRA CORP LTD	2,553	3,585	2,047	163,585	電気通信サービス	
AMP LTD	1,763	2,496	1,452	116,100	保険	
TABCORP HOLDINGS LTD	518	692	297	23,798	消費者サービス	
AMCOR LIMITED	722	970	1,559	124,595	素材	
COMPUTERSHARE LTD	287	403	419	33,556	ソフトウェア・サービス	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	—	464	487	38,919	消費者サービス	
MACQUARIE GROUP LTD	172	256	1,811	144,769	各種金融	
CIMIC GROUP LTD	64	84	318	25,483	資本財	
ASX LTD	117	165	742	59,312	各種金融	
COCA-COLA AMATIL LTD	351	501	460	36,780	食品・飲料・タバコ	
COCHLEAR LTD	35	48	563	45,021	ヘルスケア機器・サービス	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	276	377	743	59,438	素材	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	354	467	218	17,499	小売	

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		
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
NEWREST MINING LTD	454	637	1,309	104,632	素材	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,392	2,050	1,240	99,113	保険	
ORIGIN ENERGY LTD	664	1,462	743	59,381	エネルギー	
ORICA LTD	222	312	426	34,094	素材	
SONIC HEALTHCARE LTD	229	332	678	54,231	ヘルスケア機器・サービス	
SANTOS LTD	590	1,400	568	45,443	エネルギー	
SUNCORP GROUP LTD	776	1,080	1,390	111,130	保険	
TRANSURBAN GROUP	1,097	1,714	2,130	170,279	運輸	
WESFARMERS LTD	668	936	4,040	322,915	食品・生活必需品小売り	
TOLL HOLDINGS LTD	412	—	—	—	運輸	
CHALLENGER LTD	—	485	451	36,102	各種金融	
SYDNEY AIRPORT	667	949	693	55,389	運輸	
CALTEX AUSTRALIA LTD	163	227	766	61,229	エネルギー	
OTL SEARCH LTD	—	1,148	774	61,871	エネルギー	
WORLEYPARSONS LTD	128	—	—	—	エネルギー	
AGL ENERGY LTD	405	582	1,101	87,983	公益事業	
TATTS GROUP LTD	891	1,244	491	39,281	消費者サービス	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	911	1,276	371	29,678	素材	
ASCIANO LTD	585	547	487	38,961	運輸	
ILUKA RESOURCES LTD	251	354	216	17,313	素材	
AUSNET SERVICES	1,155	1,718	278	22,250	公益事業	
CROWN RESORTS LTD	212	300	361	28,896	消費者サービス	
INCITEC PIVOT LTD	1,020	1,427	461	36,841	素材	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	270	400	385	30,789	銀行	
AURIZON HOLDINGS LTD	1,304	1,764	802	64,166	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	382	619	634	50,701	食品・飲料・タバコ	
ALS LTD	252	—	—	—	商業・専門サービス	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	79	120	836	66,825	ヘルスケア機器・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	34	47	185	14,860	消費者サービス	
SEEK LTD	190	284	467	37,374	商業・専門サービス	
BANK OF QUEENSLAND LTD	228	328	374	29,917	銀行	
REA GROUP LTD	33	48	259	20,774	メディア	
TPG TELECOM LTD	176	247	286	22,881	電気通信サービス	
HEALTHSCOPE LTD	705	1,457	408	32,609	ヘルスケア機器・サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,652	2,309	729	58,330	保険	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	139	195	120	9,600	各種金融	
SOUTH32 LTD	—	4,430	717	57,356	素材	
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	—	390	346	27,705	電気通信サービス	
小 計	株 数	金 額	39,535	63,400	87,989	7,031,240
銘 柄 数 < 比 率 >	61	63	—	—	—	< 2.6% >
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,069	1,518	560	41,480	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	556	803	537	39,803	運輸	
CONTACT ENERGY LTD	231	630	333	24,659	公益事業	
FLETCHER BUILDING LTD	393	573	492	36,486	素材	
RYMAN HEALTHCARE LTD	213	321	298	22,095	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	797	1,118	306	22,697	公益事業	
MIGHTY RIVER POWER	452	644	197	14,592	公益事業	
小 計	株 数	金 額	3,713	5,610	2,726	201,815
銘 柄 数 < 比 率 >	7	7	—	—	—	< 0.1% >
(香港)			千香港ドル			
WHARF HOLDINGS LTD	900	1,130	4,661	65,117	不動産	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
HUTCHISON WHAMPOA LTD	1,270	—	—	—	資本財	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	375	490	4,044	56,507	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	820	2,238	20,830	291,007	資本財	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,000	1,440	13,140	183,565	不動産	
MTR CORP	875	1,225	4,704	65,714	運輸	
HONG KONG & CHINA GAS	3,782	5,865	8,481	118,492	公益事業	
NEW WORLD DEVELOPMENT	3,050	4,500	3,244	45,325	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	830	1,165	8,964	125,236	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	658	950	17,651	246,584	各種金融	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	720	1,020	1,240	17,327	運輸	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,310	1,870	2,655	37,095	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	1,135	1,595	11,643	162,659	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	618	958	4,429	61,874	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	698	990	2,742	38,317	銀行	
HANG SENG BANK LTD	452	632	8,664	121,046	銀行	
HYSAN DEVELOPMENT CO	380	540	1,738	24,291	不動産	
SHANGRI-LA ASIA LTD	600	1,080	968	13,533	消費者サービス	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	137	209	1,146	16,014	半導体・半導体製造装置	
SINO LAND CO	1,774	2,514	2,865	40,037	不動産	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	435	610	1,726	24,116	耐久消費財・アパレル	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	370	570	4,283	59,841	公益事業	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,200	3,060	6,854	95,755	銀行	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	805	1,150	3,524	49,240	耐久消費財・アパレル	
PCCW LTD	2,510	3,530	1,803	25,199	電気通信サービス	
LI & FUNG LTD	3,400	4,900	2,146	29,982	耐久消費財・アパレル	
KERRY PROPERTIES LTD	395	520	1,011	14,136	不動産	
NWS HOLDINGS LTD	895	1,285	1,547	21,613	資本財	
SANDS CHINA LTD	1,436	2,008	5,532	77,282	消費者サービス	
WHELOCK & CO LTD	550	750	2,606	36,409	不動産	
WYNN MACAU LTD	904	1,272	1,422	19,866	消費者サービス	
SJM HOLDINGS LTD	1,150	1,660	790	11,038	消費者サービス	
FIRST PACIFIC CO	1,420	2,080	1,002	14,005	各種金融	
AIA GROUP LTD	7,146	9,976	43,345	605,539	保険	
SWIRE PROPERTIES LTD	704	1,004	1,999	27,939	不動産	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,370	1,940	4,811	67,212	消費者サービス	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	552	852	886	12,378	消費者サービス	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,530	2,280	2,576	35,992	電気通信サービス	
WH GROUP LTD	2,240	4,875	2,949	41,202	食品・飲料・タバコ	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	—	2,238	10,532	147,145	不動産	
小 計	株 数	51,397	76,974	225,171	3,145,651	
	銘柄 数 < 比率 >	39	39	—	< 1.2% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,794	2,561	2,133	169,193	銀行	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	972	1,344	520	41,266	メディア	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	590	801	213	16,961	資本財	
CAPITALAND LTD	1,530	2,156	642	50,955	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	250	360	289	22,955	不動産	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	64	97	330	26,179	小売	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,040	1,461	2,143	169,984	銀行	
KEPPEL CORP LTD	870	1,208	618	49,052	資本財	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	773	1,071	1,880	149,156	銀行	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	950	1,357	428	34,009	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		
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,762	6,613	2,539	201,417	電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	343	479	558	44,294	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	500	671	500	39,699	各種金融	
SEMBCORP MARINE LTD	500	660	100	7,956	資本財	
UOL GROUP LTD	290	391	219	17,396	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,230	1,810	503	39,907	運輸	
NOBLE GROUP LTD	2,710	4,185	146	11,619	資本財	
STARHUB LTD	400	565	187	14,832	電気通信サービス	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	4,393	6,110	223	17,689	食品・飲料・タバコ	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,150	1,606	528	41,905	食品・飲料・タバコ	
GENTING SINGAPORE PLC	3,700	4,988	379	30,065	消費者サービス	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	1,880	2,640	465	36,955	不動産	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	1,150	1,726	155	12,320	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	31,844	44,863	15,707	1,245,773	
	銘柄 数 < 比 率 >	23	23	—	<0.5%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
ISRAEL CHEMICALS LTD	258	406	668	19,270	素材	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	510	755	15,128	436,310	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BANK HAPOALIM BM	616	877	1,704	49,143	銀行	
NICE SYSTEMS LTD	34	48	1,179	34,021	ソフトウェア・サービス	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	777	1,161	1,620	46,732	銀行	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	1	—	—	—	素材	
DELEK GROUP LTD	2	3	275	7,956	エネルギー	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	1,127	1,607	1,301	37,546	電気通信サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	80	120	517	14,938	銀行	
AZRIELI GROUP	—	31	481	13,874	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,409	5,013	22,877	659,793	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.2%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	846,139	1,109,747	—	255,005,772	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,258	1,260	—	<94.4%>	

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

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

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
HCP INC	27	38	1,312	142,236	0.1	
MACERICH CO/THE	8	11	866	93,856	0.0	
PROLOGIS INC	29	43	2,034	220,503	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST	5	7	614	66,590	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	8	12	1,126	122,123	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3	5	1,263	136,895	0.1	
EXTRA SPACE STORAGE INC	—	9	892	96,716	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	4	5	894	96,956	0.0	
WELLTOWER INC	20	29	2,080	225,517	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	9	12	1,666	180,583	0.1	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	6	634	68,737	0.0	
REALTY INCOME CORP	13	20	1,304	141,409	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	5	7	609	66,059	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	5	8	866	93,880	0.0	
UDR INC	15	21	797	86,464	0.0	
VENTAS INC	19	27	1,806	195,778	0.1	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	55	77	856	92,850	0.0	
RAYONIER INC	7	—	—	—	—	
WEYERHAEUSER CO	30	65	2,022	219,215	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	24	35	3,711	402,162	0.1	
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	20	28	536	58,088	0.0	
VEREIT INC	53	75	722	78,319	0.0	
DUKE REALTY CORP	20	28	663	71,873	0.0	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	15	409	44,333	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	9	17	648	70,318	0.0	
EQUINIX INC	3	5	1,881	203,869	0.1	
COMMUNICATIONS SALES & LE	7	—	—	—	—	
CROWN CASTLE INTL CORP	—	27	2,490	269,940	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	20	30	2,103	228,007	0.1	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	31	47	1,318	142,931	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	44	62	997	108,126	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	8	12	448	48,638	0.0	
PLUM CREEK TIMBER CO	10	—	—	—	—	
PUBLIC STORAGE	8	12	3,155	341,926	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	18	25	5,208	564,481	0.2	
VORNADO REALTY TRUST	9	14	1,351	146,500	0.1	
KIMCO REALTY CORP	24	34	1,000	108,451	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	7	11	2,115	229,297	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	592	892	50,416	5,463,644	
	銘柄 数 < 比 率 >	34	35	—	<2.0%>	
(カナダ)				千カナダドル		
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	—	5	181	15,299	0.0	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	7	11	240	20,250	0.0	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		9	13	370	31,252	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	17	29	792	66,802	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	3	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		1	2	359	44,485	0.0
KLEPIERRE		10	18	744	92,180	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		5	8	1,913	236,890	0.1
FONCIERE DES REGIONS		1	2	202	25,025	0.0
ICADE		2	2	186	23,084	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	21	34	3,405	421,666	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.2% >	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		57	80	583	91,374	0.0
HAMMERSON PLC		46	65	377	59,117	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		46	65	752	117,785	0.0
INTU PROPERTIES PLC		54	78	229	35,967	0.0
SEGRO PLC		44	62	262	41,163	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	249	351	2,206	345,408	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.1% >	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		90	285	976	78,011	0.0
SCENTRE GROUP		316	446	2,054	164,143	0.1
NOVION PROPERTY GROUP		132	—	—	—	—
GPT GROUP		102	153	800	63,994	0.0
MIRVAC GROUP		226	317	620	49,577	0.0
STOCKLAND		141	202	929	74,289	0.0
WESTFIELD CORP		117	165	1,779	142,238	0.1
DEXUS PROPERTY GROUP		57	83	711	56,893	0.0
GOODMAN GROUP		104	149	1,082	86,470	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,289	1,803	8,955	715,618	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	8	—	< 0.3% >	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		135	186	8,653	120,890	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	135	186	8,653	120,890	
	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	211	349	27,703	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		131	172	240	19,107	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		146	215	446	35,411	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		122	183	446	35,441	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	542	784	1,483	117,664	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.0% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	2,847	4,083	—	7,251,695	
	銘柄 数 < 比 率 >	60	61	—	< 2.7% >	

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引	SP EMINI	4,951	—
		SP/TSE60	297	—
		SWISS IX	281	—
		EURO ST	1,165	—
		SPI 200	299	—
		FTSE100	594	—
		百万円	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

(2016年5月12日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
株式	255,005,772	94.4
投資証券	7,251,695	2.7
コール・ローン等、その他	7,907,174	2.9
投資信託財産総額	270,164,641	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(269,579,000千円)の投資信託財産総額(270,164,641千円)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=108.37円	1 カナダドル=84.33円	1 ユーロ=123.81円	1 イギリスポンド=156.52円
1 スイスフラン=111.63円	1 スウェーデンクローネ=13.33円	1 ノルウェークローネ=13.28円	1 デンマーククローネ=16.64円
1 オーストラリアドル=79.91円	1 ニュージーランドドル=74.03円	1 香港ドル=13.97円	1 シンガポールドル=79.31円
1 イスラエルシェゲル=28.84円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	270,567,377,983
コール・ローン等	5,990,555,724
株式(評価額)	255,005,772,397
投資証券(評価額)	7,251,695,005
未収入金	448,779,016
未収配当金	509,853,785
差入委託証拠金	1,360,722,056
(B) 負債	501,616,589
未払金	489,693,779
未払解約金	11,915,982
未払利息	986
その他未払費用	5,842
(C) 純資産総額(A-B)	270,065,761,394
元本	136,910,588,935
次期繰越損益金	133,155,172,459
(D) 受益権総口数	136,910,588,935口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,726円

<注記事項>

- ①期首元本額 98,648,858,071円
 期中追加設定元本額 105,675,196,642円
 期中一部解約元本額 67,413,465,778円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.9726円です。

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,144,972,744
受取配当金	5,114,973,722
受取利息	605,578
その他収益金	32,650,193
支払利息	△ 3,256,749
(B) 有価証券売買損益	△ 39,922,483,936
売買益	14,666,285,344
売買損	△ 54,588,769,280
(C) 先物取引等取引損益	△ 413,189,353
取引益	1,107,317,888
取引損	△ 1,520,507,241
(D) 保管費用等	△ 120,160,518
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 35,310,861,063
(F) 前期繰越損益金	128,865,980,554
(G) 追加信託差損益金	118,154,658,797
(H) 解約差損益金	△ 78,554,605,829
(I) 計(E+F+G+H)	133,155,172,459
次期繰越損益金(I)	133,155,172,459

- (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）	2,448,719,365円
eMAXIS 先進国株式インデックス	16,378,104,804円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,138,768,930円
eMAXIS バランス（波乗り型）	120,737,094円
コアバランス	219,720円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	5,850,610,646円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,408,019,604円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	823,810,399円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	1,882,465,423円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	85,978,515円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	16,118,943,652円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	16,679,805,595円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	347,095,316円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	2,909,896,008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）	46,542,204,119円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	271,114,613円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	119,808,786円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	2,054,265,694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）	3,180,423,248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）	52,918,604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）	6,872,839,069円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	1,903,425,272円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	7,173,466円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	22,285,032円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	51,267,580円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	47,118,237円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	166,480,868円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	36,705,073円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	291,823,087円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	65,215,077円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	523,982,813円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	4,096,664,594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）	196,823,527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）	767,070,036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）	695,163,101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）	581,896,994円
アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）	530,050,843円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	416,410,090円
アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）	92,997,552円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	13,474,781円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	59,237円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	85,793円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	102,421円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	15,891,218円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	464,062円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	3,556,879円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	1,527,502円
eMAXIS 最適化バランス（マイフワード）	4,840,689円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	2,003,954円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	89,261,136円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	18,817円
合計	136,910,588,935円

【お 知 ら せ】

- ①2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年7月1日)
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資制限について、買付基準の記載部分の「取得時において」の削除を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年12月2日)
- ③信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため(分散型に分類)、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行うための、所要の約款変更を行いました。
(2016年3月2日)

新興国株式インデックスマザーファンド

《第7期》決算日2016年5月12日

[計算期間：2015年5月13日～2016年5月12日]

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

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		MSCI エマージング・マーケット・インデックス (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
	期騰落	中率	期騰落	中率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
3期(2012年5月14日)	14,047	△15.7	77,807.35	△17.8	96.2	2.9	0.5	14,336
4期(2013年5月13日)	19,772	40.8	107,091.73	37.6	98.2	1.7	—	24,079
5期(2014年5月12日)	19,482	△1.5	102,729.55	△4.1	96.6	3.0	0.4	24,665
6期(2015年5月12日)	23,973	23.1	124,478.28	21.2	94.8	5.0	0.4	39,530
7期(2016年5月12日)	17,338	△27.7	87,559.17	△29.7	92.8	6.4	0.5	35,618

(注) MSCI エマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（米ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。また、MSCI エマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他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 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) 2015年5月12日	円	%		%	%	%	%
	23,973	—	124,478.28	—	94.8	5.0	0.4
5月末	24,168	0.8	124,908.28	0.3	94.8	4.8	0.4
6月末	22,860	△4.6	117,480.49	△5.6	94.6	4.6	0.5
7月末	21,655	△9.7	110,900.32	△10.9	93.7	7.1	0.5
8月末	19,362	△19.2	99,398.26	△20.1	94.2	5.5	0.5
9月末	18,263	△23.8	93,131.31	△25.2	94.0	6.3	0.5
10月末	20,102	△16.1	102,297.72	△17.8	94.7	4.9	0.5
11月末	19,854	△17.2	101,493.66	△18.5	94.5	5.1	0.5
12月末	18,950	△21.0	96,451.09	△22.5	96.9	3.2	0.5
2016年1月末	17,182	△28.3	87,296.42	△29.9	96.1	3.5	0.5
2月末	16,532	△31.0	84,080.85	△32.5	94.5	5.3	0.5
3月末	18,566	△22.6	93,973.20	△24.5	92.3	7.1	0.5
4月末	18,355	△23.4	92,537.69	△25.7	92.4	6.9	0.5
(期 末) 2016年5月12日	17,338	△27.7	87,559.17	△29.7	92.8	6.4	0.5

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ27.7%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎新興国株式市況

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

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて9.9%の円高・香港ドル安、20.0%の円高・ブラジルリアル安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

(注) マルチファクターモデル

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

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは29.7%の下落となったため、カイ離は2.0%程度となりました。

	組入比率 要 因	銘柄選択 要 因	コスト 要 因	その他の 要 因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	△0.0% 程度	0.3% 程度	△0.2% 程度	1.9% 程度	2.0% 程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は△0.0%程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.3%程度でした。

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

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

◎コスト要因

売買にかかるコストおよび保管料等による影響は△0.2%程度でした。

◎その他の要因

その他配当・利子収入等による影響は1.9%程度でした。

◎今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(8)	(0.040)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(2)	(0.009)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	4	0.018	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(4)	(0.018)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	29	0.148	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保 管 費 用)	(26)	(0.134)	
(そ の 他)	(3)	(0.015)	
合 計	41	0.206	
期中の平均基準価額は、19,654円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	メキシコ	千口	千メキシコペソ	千口	千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	36 (-)	1,388 (△ 254)	- (-)	- (0.00001)
	小 計	36 (-)	1,388 (△ 254)	- (-)	- (0.00001)
	トルコ		千トルコリラ		千トルコリラ
	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	29	79	6	15
	小 計	29	79	6	15
国	南アフリカ		千南アフリカランド		千南アフリカランド
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	25	642	-	-
	REDEFINE PROPERTIES LTD	120	1,364	-	-
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	20	2,366	-	-
	RESILIENT REIT LTD	5	637	-	-
	RESILIENT PROPERTY INCOME-RTS	- (2)	- (-)	2	36
小 計	172 (2)	5,011 (-)	2	36	

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	株式先物取引	百万円 15,769	百万円 14,911	百万円 -	百万円 -

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

○株式売買比率

(2015年5月13日～2016年5月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 12,177	百万円 204	% 1.7	百万円 4,416	百万円 32	% 0.7

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

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

外国株式

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円			
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,560	1,540	1,657	23,148		公益事業	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	3,160	—	—	—		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LONGFOR PROPERTIES	1,160	1,295	1,333	18,633		不動産	
CHINA RESOURCES CEMENT	1,460	—	—	—		素材	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	7,860	11,100	1,298	18,142		半導体・半導体製造装置	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	790	2,745	1,559	21,781		自動車・自動車部品	
BBMG CORP-H	760	—	—	—		素材	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	2,500	3,220	637	8,906		不動産	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	1,260	1,560	1,775	24,800		資本財	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	820	1,900	2,975	41,566		各種金融	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	1,820	2,130	1,092	15,264		食品・生活必需品小売り	
FAR EAST HORIZON LTD	1,020	1,590	941	13,149		各種金融	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	2,000	2,270	860	12,018		銀行	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	5,300	5,700	609	8,520		不動産	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	940	—	—	—		食品・飲料・タバコ	
HATER ELECTRONICS GROUP CO	830	1,110	1,363	19,042		耐久消費財・アパレル	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	520	600	1,008	14,081		ヘルスケア機器・サービス	
CHINA SOUTH CITY HOLDINGS	2,100	—	—	—		不動産	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	992	2,836	3,408	47,621		各種金融	
CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	373	474	487	6,807		資本財	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	—	1,680	787	11,007		不動産	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	530	688	1,682	23,499		保険	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	4,920	5,810	1,731	24,187		保険	
HUANENG RENEWABLES CORP-H	—	3,340	771	10,778		公益事業	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	1,220	2,925	1,845	25,784		各種金融	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	870	930	967	13,511		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	275	335	660	9,228		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	530	530	632	8,840		資本財	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	890	1,105	724	10,126		資本財	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	4,000	3,440	994	13,888		食品・飲料・タバコ	
NEW WORLD CHINA LAND LTD	1,980	—	—	—		不動産	
HANERGY THIN FILM POWER GROU	9,300	9,600	3,753	52,437		半導体・半導体製造装置	
KINGSOFT CORP LTD	510	730	1,268	17,724		ソフトウェア・サービス	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	3,720	7,740	1,888	26,383		各種金融	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	—	1,190	1,792	25,036		資本財	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	1,900	2,040	1,005	14,049		電気通信サービス	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	1,900	2,880	947	13,236		銀行	
CHINA VANKE CO LTD-H	1,029	1,163	2,078	29,030		不動産	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	4,100	8,900	1,548	21,633		メディア	
CHINA CNR CORP LTD-H	1,505	—	—	—		資本財	
CGN POWER CO LTD-H	4,160	7,910	1,945	27,183		公益事業	
DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	—	517	2,649	37,015		不動産	
LUYE PHARMA GROUP LTD	—	1,170	594	8,303		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GF SECURITIES CO LTD-H	—	1,164	1,934	27,025		各種金融	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	—	1,290	1,953	27,284		各種金融	
CAR INC	—	680	533	7,447		運輸	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILI-B	590	690	763	10,661		自動車・自動車部品	
小 計	株 数	金 額	541,815	665,443	498,120	6,958,745	
	銘柄 数 < 比 率 >		139	140	—	<19.5% >	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシアリンギット	千円		
GENTING MALAYSIA BHD	2,189	2,609	1,124	30,327	消費者サービス	
GENTING BHD	1,526	1,967	1,664	44,880	消費者サービス	
TELEKOM MALAYSIA BHD	820	969	639	17,248	電気通信サービス	
TENAGA NASIONAL BHD	2,558	2,959	4,142	111,725	公益事業	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	363	367	847	22,844	食品・飲料・タバコ	
MALAYAN BANKING BHD	3,470	4,257	3,767	101,607	銀行	
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	449	552	170	4,593	消費者サービス	
IOI CORP BHD	2,224	2,569	1,076	29,030	食品・飲料・タバコ	
AMMB HOLDINGS BHD	1,530	1,720	779	21,013	銀行	
YTL CORP BHD	3,374	3,872	631	17,024	公益事業	
GAMUDA BHD	1,390	1,460	693	18,703	資本財	
MISC BHD	820	985	751	20,269	運輸	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	3,600	3,600	1,684	45,439	銀行	
PETRONAS GAS BHD	509	610	1,299	35,042	公益事業	
SIME DARBY BERHAD	2,260	2,714	2,068	55,775	資本財	
PUBLIC BANK BERHAD	2,062	2,114	4,008	108,099	銀行	
UMW HOLDINGS BHD	440	490	301	8,140	自動車・自動車部品	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	99	111	534	14,405	食品・飲料・タバコ	
RHB CAPITAL BHD	360	544	326	8,803	銀行	
PPB GROUP BERHAD	368	406	632	17,059	食品・飲料・タバコ	
IJM CORP BHD	1,233	2,688	932	25,155	資本財	
DIGI.COM BHD	2,700	3,068	1,343	36,241	電気通信サービス	
MAXIS BHD	1,460	1,647	920	24,830	電気通信サービス	
AXIATA GROUP BERHAD	1,940	2,331	1,272	34,325	電気通信サービス	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	910	1,620	238	6,422	公益事業	
HONG LEONG BANK BERHAD	410	580	777	20,961	銀行	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,120	2,459	1,576	42,510	素材	
LAFARGE MALAYSIA BHD	335	335	278	7,508	素材	
PETRONAS DAGANGAN BHD	183	214	485	13,101	エネルギー	
ATRASIA BHD	1,000	1,000	216	5,825	運輸	
BUMI ARMADA BERHAD	1,455	2,055	157	4,239	エネルギー	
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	740	920	374	10,098	銀行	
SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	2,860	2,957	467	12,600	エネルギー	
UEM SUNRISE BHD	1,180	—	—	—	不動産	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	670	738	467	12,619	運輸	
FELDA GLOBAL VENTURES	820	1,020	144	3,906	食品・飲料・タバコ	
IHH HEALTHCARE BHD	1,810	2,160	1,404	37,865	ヘルスケア機器・サービス	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	185	208	310	8,380	銀行	
HAP SENG CONSOLIDATED	—	497	381	10,294	資本財	
GENTING PLANTATIONS BHD	150	195	207	5,585	食品・飲料・タバコ	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	1,170	1,377	371	10,027	メディア	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	—	932	391	10,557	運輸	
DIALOG GROUP BHD	2,766	3,482	546	14,747	資本財	
IOI PROPERTIES GROUP BHD	1,178	1,328	316	8,524	不動産	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	—	601	234	6,321	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株数・金額	57,687	69,289	40,959	1,104,686	
	銘柄数<比率>	42	44	—	<3.1%>	
(タイ)			千タイバーツ			
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	970	1,196	6,458	19,827	不動産	
KASIKORN BANK PCL-NVDR	1,382	1,537	24,284	74,553	銀行	

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(タイ)	百株	百株	千タイバーツ	千円		
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	10,200	11,100	2,419	7,428	銀行	
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	750	830	2,033	6,242	メディア	
CP ALL PCL-NVDR	3,302	3,858	18,229	55,963	食品・生活必需品小売り	
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	426	222	3,474	10,666	銀行	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	787	915	13,587	41,714	電気通信サービス	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,165	1,364	17,186	52,762	銀行	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	313	358	17,423	53,488	素材	
PTT PCL-NVDR	761	875	25,550	78,438	エネルギー	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	1,075	1,226	8,857	27,193	エネルギー	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	313	377	14,627	44,906	運輸	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	720	860	1,161	3,564	エネルギー	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,940	2,640	6,864	21,072	食品・飲料・タバコ	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	900	1,200	3,600	11,052	素材	
IRPC PCL - NVDR	8,300	8,980	4,310	13,232	エネルギー	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,285	1,771	10,231	31,409	素材	
THAI OIL PCL-NVDR	650	692	4,446	13,649	エネルギー	
KRUNG THAI BANK - NVDR	2,610	2,940	4,821	14,802	銀行	
GLOW ENERGY PCL - NVDR	360	435	3,708	11,384	公益事業	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	2,500	3,406	8,140	24,990	ヘルスケア機器・サービス	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	1,460	1,652	3,568	10,954	食品・飲料・タバコ	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	2,980	3,320	2,755	8,459	小売	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	4,250	4,920	4,403	13,518	運輸	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	290	316	6,272	19,256	ヘルスケア機器・サービス	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	320	430	2,816	8,646	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TRUE CORP PCL-NVDR	6,400	7,562	5,558	17,064	電気通信サービス	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,370	1,521	5,855	17,977	消費者サービス	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	970	970	2,075	6,372	エネルギー	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	—	6,040	3,865	11,867	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額	58,749	73,514	238,587	732,463	
	銘柄 数 < 比 率 >	29	30	—	< 2.1% >	
(フィリピン)				千フィリピンペソ		
PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	74	85	14,910	34,741	電気通信サービス	
SM PRIME HOLDINGS INC	6,405	7,265	18,344	42,741	不動産	
AYALA LAND INC	5,430	6,453	22,746	53,000	不動産	
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	620	660	6,250	14,562	銀行	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	400	450	2,859	6,663	運輸	
MEGAWORLD CORP	8,300	9,990	4,045	9,427	不動産	
JOLLIBEE FOODS CORP	337	379	8,870	20,667	消費者サービス	
ENERGY DEVELOPMENT CORP	6,900	8,000	4,784	11,146	公益事業	
SM INVESTMENTS CORP	117	137	13,264	30,906	資本財	
AYALA CORPORATION	160	189	14,984	34,914	各種金融	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	1,470	1,677	11,739	27,353	資本財	
ABOITIZ POWER CORP	1,100	1,321	5,997	13,973	公益事業	
METROPOLITAN BANK & TRUST	195	265	2,199	5,124	銀行	
BDO UNIBANK INC	1,250	1,436	14,799	34,481	銀行	
DMCI HOLDINGS INC	2,850	3,536	4,476	10,430	資本財	
UNIVERSAL ROBINA CORP	680	763	16,100	37,515	食品・飲料・タバコ	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	1,320	1,820	2,631	6,131	資本財	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	1,850	2,197	19,338	45,059	資本財	
GLOBE TELECOM INC	26	28	6,423	14,966	電気通信サービス	

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

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

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

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

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	株数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千ニュー台湾ドル	千円		
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	231	231	2,419	8,055	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PHISON ELECTRONICS CORP	100	120	3,000	9,990	半導体・半導体製造装置	
WPG HOLDINGS LTD	1,044	1,274	4,299	14,318	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CLEVO COMPANY	284	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
GIANT MANUFACTURING	220	240	4,284	14,265	耐久消費財・アパレル	
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	370	—	—	—	不動産	
FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS	22	—	—	—	消費者サービス	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	410	470	2,030	6,761	耐久消費財・アパレル	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	981	1,211	3,694	12,303	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	6,668	8,433	8,601	28,644	各種金融	
INNOLUX CORP	6,151	7,291	6,919	23,041	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	4,471	5,643	8,719	29,037	銀行	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	5,949	6,892	4,301	14,322	保険	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	1,240	1,400	10,486	34,918	電気通信サービス	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,264	1,434	9,121	30,373	自動車・自動車部品	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	881	1,011	8,749	29,135	エネルギー	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	7,597	9,517	21,747	72,419	銀行	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	5,760	8,045	12,751	42,463	銀行	
LARGAN PRECISION CO LTD	77	84	22,649	75,423	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	3,456	4,226	24,216	80,640	食品・飲料・タバコ	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	3,755	4,109	6,575	21,894	銀行	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	10,392	12,012	9,297	30,961	銀行	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,624	1,852	7,020	23,378	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASIA CEMENT CORP	1,662	2,072	5,306	17,670	素材	
YULON MOTOR COMPANY	600	790	2,125	7,076	自動車・自動車部品	
POU CHEN	1,585	1,965	7,830	26,075	耐久消費財・アパレル	
WISTRON CORP	1,871	2,049	3,575	11,908	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	620	650	2,710	9,025	素材	
INOTERA MEMORIES INC	1,680	1,960	5,752	19,156	半導体・半導体製造装置	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	1,010	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PEGATRON CORP	1,219	1,719	11,230	37,396	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHINA AIRLINES LTD	2,080	2,260	2,271	7,563	運輸	
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	4,821	6,310	10,570	35,199	銀行	
WALSIN LIHWA CORP	2,700	—	—	—	資本財	
FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	788	—	—	—	小売	
TPK HOLDING CO LTD	204	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	2,176	2,813	6,542	21,786	保険	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	135	170	2,324	7,739	資本財	
TAIWAN GLASS IND CORP	669	—	—	—	資本財	
EVA AIRWAYS CORP	1,290	1,750	2,607	8,682	運輸	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	1,319	1,533	1,755	5,845	運輸	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	5,057	6,320	8,659	28,835	銀行	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	180	220	6,534	21,758	小売	
TECO ELECTRIC & MACHINERY	1,380	1,700	4,190	13,954	資本財	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	335	365	1,802	6,001	半導体・半導体製造装置	
CTCI CORP	460	—	—	—	資本財	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	500	760	2,614	8,705	不動産	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	420	650	3,061	10,194	不動産	
TAIWAN BUSINESS BANK	2,803	3,798	3,050	10,157	銀行	
STANDARD FOODS CORP	278	305	2,376	7,912	食品・飲料・タバコ	

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千ニュー台湾ドル	千円		
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	210	340	2,159	7,189	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FORMOSA TAFFETA CO.	660	680	2,006	6,679	耐久消費財・アパレル	
CHALEASE HOLDING CO LTD	716	874	4,408	14,679	各種金融	
SCINOPHARM TAIWAN LTD	163	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRANSCEND INFORMATION INC	140	180	1,562	5,202	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HERMES MICROVISION INC	30	32	3,103	10,335	半導体・半導体製造装置	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	147	177	2,247	7,485	耐久消費財・アパレル	
CHINA MOTOR CORP	360	—	—	—	自動車・自動車部品	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	560	720	3,816	12,707	半導体・半導体製造装置	
YANG MING MARINE TRANSPORT	880	—	—	—	運輸	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	124	164	5,084	16,929	耐久消費財・アパレル	
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	1,400	1,600	1,600	5,328	電気通信サービス	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	—	267	3,500	11,656	耐久消費財・アパレル	
CASETEK HOLDINGS LTD	—	120	1,302	4,335	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
OBI PHARMA INC	—	90	3,262	10,864	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	234,362	272,506	1,155,316	3,847,205	
		101	88	—	<10.8%>	
(インド)				千インドルピー		
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	1,128	1,307	157,372	258,091	銀行	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	355	412	103,955	170,486	ソフトウェア・サービス	
ITC LTD	1,694	1,962	62,410	102,353	食品・飲料・タバコ	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	575	662	57,126	93,687	家庭用品・パーソナル用品	
JINDAL STEEL & POWER LTD	300	—	—	—	素材	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	450	532	6,726	11,031	資本財	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	575	752	15,445	25,329	エネルギー	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	800	960	8,793	14,421	素材	
COAL INDIA LTD	530	612	17,377	28,498	エネルギー	
GAIL INDIA LTD	230	338	13,115	21,509	公益事業	
AMBUJA CEMENTS LTD	490	606	13,367	21,922	素材	
HERO MOTOCORP LTD	39	44	13,060	21,419	自動車・自動車部品	
BAJAJ AUTO LTD	63	74	18,703	30,673	自動車・自動車部品	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	611	839	66,857	109,646	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADANI ENTERPRISES LTD	108	—	—	—	資本財	
ASIAN PAINTS LTD	212	251	22,868	37,504	素材	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	117	131	14,281	23,421	各種金融	
VEDANTA LTD	900	803	8,007	13,132	素材	
TATA POWER CO LTD	860	930	6,603	10,828	公益事業	
BHARTI AIRTEL LTD	460	1,047	37,605	61,673	電気通信サービス	
CIPLA LTD	260	305	16,387	26,875	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NTPC LTD	1,290	1,018	14,407	23,628	公益事業	
INFOSYS LTD	677	1,563	187,945	308,230	ソフトウェア・サービス	
ULTRATECH CEMENT LTD	28	30	9,629	15,792	素材	
ACC LTD	38	38	5,575	9,143	素材	
DLF LTD	370	—	—	—	不動産	
DR. REDDY'S LABORATORIES	90	103	29,662	48,646	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ICICI BANK LTD	847	971	21,761	35,688	銀行	
LUPIN LTD	—	193	30,819	50,543	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	—	92	36,060	59,139	自動車・自動車部品	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	964	1,112	108,493	177,929	エネルギー	
STATE BANK OF INDIA	1,140	1,363	25,219	41,359	銀行	

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

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アラブ首長国連邦)	百株	百株	千アラブディルハム	千円		
EMAAR PROPERTIES PJSC	2,625	3,066	1,919	56,747		不動産
ALDAR PROPERTIES PJSC	2,340	2,590	681	20,135		不動産
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	750	1,640	997	29,474		銀行
NATIONAL BANK OF ABU DHABI	484	584	482	14,259		銀行
ARABTEC HOLDING CO PJSC	1,774	1,904	293	8,669		資本財
FIRST GULF BANK	675	761	947	28,006		銀行
DUBAI FINANCIAL MARKET PJSC	1,520	1,670	222	6,565		各種金融
DUBAI ISLAMIC BANK	780	830	468	13,862		銀行
EMAAR MALLS GROUP PJSC	—	1,600	440	13,006		不動産
EMIRATES TELECOM GROUP CO	—	1,518	2,771	81,923		電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	10,948	16,164	9,223	272,651	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	10	—	< 0.8% >	
(カタール)			千カタールリアル			
MASRAF AL RAYAN	281	307	1,042	31,080		銀行
OOREDOO QSC	61	66	587	17,516		電気通信サービス
QATAR NATIONAL BANK	127	183	2,536	75,641		銀行
INDUSTRIES QATAR	114	126	1,265	37,722		資本財
VODAFONE QATAR	265	285	319	9,527		電気通信サービス
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	21	23	481	14,355		公益事業
QATAR ISLAMIC BANK	43	49	479	14,288		銀行
BARWA REAL ESTATE CO	77	83	262	7,833		不動産
COMMERCIAL BANK QSC	67	134	504	15,035		銀行
DOHA BANK QSC	55	103	371	11,064		銀行
GULF INTERNATIONAL SERVICES	30	—	—	—		エネルギー
QATAR INSURANCE CO	—	105	787	23,491		保険
QATAR INSURANCE CO-NEW	—	16	126	3,768		保険
EZDAN HOLDING GROUP	—	666	1,189	35,470		不動産
QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	—	234	535	15,971		エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	1,142	2,384	10,488	312,765	
	銘柄 数 < 比 率 >	11	14	—	< 0.9% >	
(南アフリカ)			千南アフリカランド			
BARLOWORLD LTD	160	180	1,323	9,538		資本財
SAPPI LIMITED	435	480	3,338	24,069		素材
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	35	45	1,734	12,507		素材
NEDBANK GROUP LTD	146	173	3,018	21,761		銀行
SASOL LTD	409	472	21,305	153,611		エネルギー
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	300	355	8,085	58,297		素材
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	410	534	2,700	19,472		素材
GOLD FIELDS LTD	550	664	4,292	30,945		素材
MONDI LTD	—	104	3,028	21,834		素材
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	699	865	7,834	56,485		小売
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	280	392	4,106	29,604		小売
TELKOM SA SOC LTD	190	216	1,287	9,281		電気通信サービス
TIGER BRANDS LTD	125	143	4,933	35,568		食品・飲料・タバコ
SANLAM LTD	1,389	1,516	9,877	71,214		保険
SHOPRITE HOLDINGS LTD	352	401	6,785	48,922		食品・生活必需品小売り
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	1,616	—	—	—		耐久消費財・アパレル
STANDARD BANK GROUP LTD	914	1,058	12,493	90,076		銀行
RMB HOLDINGS LTD	519	625	3,344	24,116		各種金融
REMGR0 LTD	364	420	10,351	74,636		各種金融

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(南アフリカ)	百株	百株	千円	千円		
PPC LTD	410	—	—	—	—	素材
NETCARE LTD	734	810	2,837	20,461	20,461	ヘルスケア機器・サービス
NASPERS LTD-N SHS	300	347	68,785	495,941	495,941	メディア
MTN GROUP LTD	1,259	1,450	19,163	138,166	138,166	電気通信サービス
MASSMART HOLDINGS LTD	86	98	1,195	8,619	8,619	食品・生活必需品小売り
KUMBA IRON ORE LTD	41	—	—	—	—	素材
IMPERIAL HOLDINGS LTD	143	160	2,133	15,385	15,385	小売
INVESTEC LTD	186	214	2,216	15,981	15,981	各種金融
FIRSTSTRAND LTD	2,552	2,941	12,608	90,910	90,910	各種金融
THE FOSCHINI GROUP LTD	154	185	2,698	19,455	19,455	小売
EXXARO RESOURCES LTD	101	121	865	6,237	6,237	エネルギー
BIDVEST GROUP LTD	244	279	10,021	72,255	72,255	資本財
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	258	369	5,087	36,681	36,681	銀行
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	75	—	—	—	—	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	258	299	9,496	68,466	68,466	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DISCOVERY LTD	275	314	3,720	26,825	26,825	保険
VODACOM GROUP LTD	271	325	5,450	39,300	39,300	電気通信サービス
PICK N PAY STORES LTD	165	216	1,653	11,920	11,920	食品・生活必需品小売り
MMI HOLDINGS LTD	860	940	2,105	15,181	15,181	保険
SPAR GROUP LIMITED/THE	121	145	3,108	22,409	22,409	食品・生活必需品小売り
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	520	565	2,316	16,701	16,701	保険
LIBERTY HOLDINGS LTD	95	95	1,258	9,075	9,075	保険
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	680	821	3,118	22,483	22,483	ヘルスケア機器・サービス
MR PRICE GROUP LTD	177	213	3,827	27,595	27,595	小売
ASSORE LTD	23	—	—	—	—	素材
SIBANYE GOLD LTD	—	622	3,297	23,772	23,772	素材
NAMPAK LTD	430	—	—	—	—	素材
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	290	—	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CORONATION FUND MANAGERS LTD	185	204	1,436	10,358	10,358	各種金融
BRAIT SE	240	296	4,413	31,822	31,822	各種金融
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	295	295	763	5,502	5,502	消費者サービス
PSG GROUP LTD	—	74	1,352	9,749	9,749	各種金融
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	—	29	1,650	11,903	11,903	銀行
PIONEER FOODS GROUP LTD	—	107	1,795	12,943	12,943	食品・飲料・タバコ
FORTRESS INCOME FUND LTD	—	611	2,235	16,119	16,119	不動産
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	—	798	1,221	8,808	8,808	不動産
NEW EUROPE PROPERTY INVEST	—	197	3,538	25,515	25,515	不動産
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	—	2,523	22,284	160,667	160,667	耐久消費財・アパレル
小 計	株 数 ・ 金 額	20,322	25,322	317,498	2,289,165	
	銘柄 数 < 比 率 >	48	50	—	< 6.4% >	
合 計	株 数 ・ 金 額	5,383,479	6,668,533	—	33,061,297	
	銘柄 数 < 比 率 >	842	846	—	< 92.8% >	

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

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

外国投資信託証券

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

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	柄 別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外国	株式先物取引	百万円	百万円
	MINI MS	2,270	-

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

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円	%
投資証券	33,061,297	91.9
コール・ローン等、その他	176,441	0.5
投資信託財産総額	2,755,866	7.6
	35,993,604	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(35,622,785千円)の投資信託財産総額(35,993,604千円)に対する比率は99.0%です。

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

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

<注記事項>

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

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

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

○損益の状況 (2015年5月13日~2016年5月12日)

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

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

【お 知 ら せ】

- ①2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年7月1日)
- ②信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため(分散型に分類)、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行うための、所要の約款変更を行いました。
(2016年3月2日)

日本債券インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2016年5月12日

〔計算期間：2015年5月13日～2016年5月12日〕

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第15期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	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		NOMURA-BPI 総 合 イン デ ッ ク ス		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	円	騰 落 中 率		騰 落 中 率			
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
15期(2016年5月12日)	13,473	7.2	387.29	7.2	99.6	—	529,456

(注) NOMURA-BPI総合インデックスとは、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総合インデックス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。

(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		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
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年5月12日	円	%		%	%	%
	12,572	—	361.38	—	99.4	0.3
5月末	12,620	0.4	362.77	0.4	99.2	0.4
6月末	12,613	0.3	362.54	0.3	99.5	0.3
7月末	12,649	0.6	363.58	0.6	99.3	0.4
8月末	12,670	0.8	364.20	0.8	99.3	0.4
9月末	12,707	1.1	365.24	1.1	99.0	0.1
10月末	12,755	1.5	366.65	1.5	98.9	0.1
11月末	12,754	1.4	366.58	1.4	99.4	0.1
12月末	12,832	2.1	368.88	2.1	99.4	—
2016年1月末	12,991	3.3	373.52	3.4	99.0	0.1
2月末	13,214	5.1	379.83	5.1	98.8	0.3
3月末	13,320	5.9	382.91	6.0	101.6	0.1
4月末	13,437	6.9	386.25	6.9	99.8	—
(期 末) 2016年5月12日						
	13,473	7.2	387.29	7.2	99.6	—

(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7.2%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(7.2%)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

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
- ・なお、期末時点では、資金フロー対応のため、債券先物のポジションは保有しておりません。
- ・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7.2%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度と低水準に抑制し、高い運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	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は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、ベンチマークとの運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運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、 $\Delta 0.0\%$ 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

(2015年5月13日～2016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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、12,880円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年5月13日～2016年5月12日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	240,143,108	110,760,622
	地方債証券	14,052,879	4,085,436
	特殊債券	20,627,787	5,898,067 (523,705)
	社債券	11,239,981	5,506,287 (980,000)

(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	百万円	百万円	百万円
		11,739	12,952	—	—

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	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 286,063	百万円 84,760	29.6	百万円 126,250	百万円 49,856	39.5

(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

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 1,136	百万円 302	百万円 1,990

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公社債	百万円 1,600

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

○組入資産の明細

(2016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		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	380,496,000 (100,000)	430,939,878 (100,703)	81.4 (0.0)	— (—)	50.7 (—)	21.3 (0.0)	9.3 (—)
地方債証券	28,006,180 (28,006,180)	30,032,413 (30,032,413)	5.7 (5.7)	— (—)	4.0 (4.0)	1.4 (1.4)	0.2 (0.2)
特殊債券 (除く金融債)	36,130,167 (36,130,167)	39,037,654 (39,037,654)	7.4 (7.4)	— (—)	5.3 (5.3)	1.4 (1.4)	0.7 (0.7)
金融債券	4,340,000 (4,340,000)	4,372,982 (4,372,982)	0.8 (0.8)	— (—)	0.0 (0.0)	0.6 (0.6)	0.2 (0.2)
普通社債券	21,917,000 (21,917,000)	22,919,698 (22,919,698)	4.3 (4.3)	0.2 (0.2)	1.3 (1.3)	2.1 (2.1)	0.9 (0.9)
合 計	470,889,347 (90,493,347)	527,302,626 (96,463,451)	99.6 (18.2)	0.2 (0.2)	61.3 (10.5)	27.0 (5.6)	11.4 (2.0)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第353回利付国債 (2年)	0.1	1,190,000	1,194,843	2017/6/15
第354回利付国債 (2年)	0.1	680,000	682,978	2017/7/15
第355回利付国債 (2年)	0.1	4,850,000	4,872,795	2017/8/15
第356回利付国債 (2年)	0.1	2,250,000	2,261,430	2017/9/15
第357回利付国債 (2年)	0.1	2,750,000	2,764,850	2017/10/15
第358回利付国債 (2年)	0.1	3,800,000	3,821,736	2017/11/15
第359回利付国債 (2年)	0.1	2,000,000	2,012,080	2017/12/15
第360回利付国債 (2年)	0.1	1,150,000	1,157,130	2018/1/15
第361回利付国債 (2年)	0.1	600,000	603,852	2018/2/15
第362回利付国債 (2年)	0.1	2,200,000	2,214,762	2018/3/15
第363回利付国債 (2年)	0.1	2,630,000	2,648,199	2018/4/15
第105回利付国債 (5年)	0.2	240,000	241,226	2017/6/20
第106回利付国債 (5年)	0.2	3,130,000	3,149,875	2017/9/20
第107回利付国債 (5年)	0.2	3,120,000	3,143,493	2017/12/20
第108回利付国債 (5年)	0.1	1,530,000	1,539,072	2017/12/20
第109回利付国債 (5年)	0.1	2,350,000	2,365,886	2018/3/20
第110回利付国債 (5年)	0.3	1,080,000	1,091,296	2018/3/20
第111回利付国債 (5年)	0.4	1,410,000	1,427,371	2018/3/20
第112回利付国債 (5年)	0.4	1,400,000	1,419,460	2018/6/20
第113回利付国債 (5年)	0.3	6,040,000	6,111,272	2018/6/20
第114回利付国債 (5年)	0.3	1,390,000	1,408,375	2018/9/20
第115回利付国債 (5年)	0.2	3,670,000	3,709,856	2018/9/20
第116回利付国債 (5年)	0.2	4,280,000	4,330,889	2018/12/20
第117回利付国債 (5年)	0.2	4,970,000	5,034,013	2019/3/20
第118回利付国債 (5年)	0.2	2,560,000	2,595,532	2019/6/20
第119回利付国債 (5年)	0.1	520,000	525,595	2019/6/20
第120回利付国債 (5年)	0.2	2,690,000	2,730,403	2019/9/20
第121回利付国債 (5年)	0.1	2,580,000	2,610,031	2019/9/20
第122回利付国債 (5年)	0.1	4,310,000	4,363,961	2019/12/20
第123回利付国債 (5年)	0.1	6,170,000	6,251,382	2020/3/20
第124回利付国債 (5年)	0.1	5,430,000	5,506,345	2020/6/20
第125回利付国債 (5年)	0.1	4,260,000	4,322,664	2020/9/20
第126回利付国債 (5年)	0.1	4,460,000	4,529,397	2020/12/20
第127回利付国債 (5年)	0.1	4,570,000	4,644,993	2021/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	385,000	624,543	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	620,000	976,574	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	653,000	1,037,381	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	948,000	1,518,601	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	935,000	1,449,418	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	1,070,000	1,635,270	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	1,110,000	1,629,824	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	1,320,000	1,809,403	2055/3/20
第286回利付国債 (10年)	1.8	1,070,000	1,094,342	2017/6/20
第287回利付国債 (10年)	1.9	2,400,000	2,457,240	2017/6/20

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288回利付国債 (10年)	1.7	2,026,000	2,079,992	2017/9/20
第289回利付国債 (10年)	1.5	2,453,000	2,522,444	2017/12/20
第290回利付国債 (10年)	1.4	1,640,000	1,690,266	2018/3/20
第291回利付国債 (10年)	1.3	940,000	967,072	2018/3/20
第292回利付国債 (10年)	1.7	794,000	822,750	2018/3/20
第293回利付国債 (10年)	1.8	1,081,000	1,127,807	2018/6/20
第294回利付国債 (10年)	1.7	1,570,000	1,634,668	2018/6/20
第295回利付国債 (10年)	1.5	1,240,000	1,285,855	2018/6/20
第296回利付国債 (10年)	1.5	2,020,000	2,103,486	2018/9/20
第297回利付国債 (10年)	1.4	836,000	871,830	2018/12/20
第298回利付国債 (10年)	1.3	2,640,000	2,746,233	2018/12/20
第299回利付国債 (10年)	1.3	2,760,000	2,881,688	2019/3/20
第300回利付国債 (10年)	1.5	957,000	1,004,677	2019/3/20
第301回利付国債 (10年)	1.5	1,872,000	1,973,892	2019/6/20
第302回利付国債 (10年)	1.4	2,850,000	2,996,233	2019/6/20
第303回利付国債 (10年)	1.4	2,325,000	2,453,688	2019/9/20
第304回利付国債 (10年)	1.3	1,170,000	1,230,804	2019/9/20
第305回利付国債 (10年)	1.3	3,808,000	4,020,029	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)	1.4	2,488,000	2,646,286	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)	1.3	1,610,000	1,706,181	2020/3/20
第308回利付国債 (10年)	1.3	1,374,000	1,461,221	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	2,300,000	2,426,983	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	2,886,000	3,041,872	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	2,700,000	2,822,121	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	4,030,000	4,297,753	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	2,969,000	3,191,496	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	1,590,000	1,693,572	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	2,253,000	2,420,352	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	980,000	1,047,747	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	1,557,000	1,670,022	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	2,490,000	2,657,253	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	1,519,000	1,634,474	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	2,850,000	3,050,497	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	2,515,000	2,699,827	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	1,770,000	1,889,581	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	1,675,000	1,793,121	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	3,440,000	3,661,295	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	3,435,000	3,665,248	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	1,360,000	1,445,204	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	2,240,000	2,395,344	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	740,000	782,979	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	3,210,000	3,447,251	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	2,390,000	2,572,070	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	1,480,000	1,570,635	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	3,110,000	3,304,468	2023/12/20

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333回利付国債 (10年)	0.6	4,060,000	4,318,825	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	4,200,000	4,472,790	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	4,240,000	4,484,351	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	1,360,000	1,439,492	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	3,980,000	4,143,180	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	4,440,000	4,663,021	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	5,380,000	5,652,819	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	5,330,000	5,602,576	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	4,820,000	5,018,969	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	3,680,000	3,758,752	2026/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	76,000	104,404	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	98,000	130,290	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	117,000	154,486	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	127,000	179,675	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	108,000	142,701	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	169,000	229,611	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	164,000	221,729	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	142,000	181,231	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	116,000	140,505	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	185,000	215,108	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	137,000	173,261	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	220,000	293,774	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	205,000	270,716	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	493,000	686,965	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	346,000	488,818	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	302,000	427,961	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	327,000	458,454	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	427,000	591,984	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	303,000	420,809	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	495,000	707,726	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	379,000	528,094	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	570,000	817,875	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	554,000	796,319	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	411,000	592,349	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	742,000	1,043,021	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	1,064,000	1,520,211	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	910,000	1,327,635	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	1,191,000	1,747,852	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	1,400,000	2,037,070	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	1,336,000	1,925,763	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	1,228,000	1,752,380	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	1,509,000	2,197,677	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	1,834,000	2,561,786	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	1,626,000	2,359,374	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	1,769,000	2,495,032	2041/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第36回利付国債 (30年)	2.0	1,809,000	2,565,035	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	1,827,000	2,559,517	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	1,425,000	1,970,703	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	1,200,000	1,693,860	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	970,000	1,347,960	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	1,060,000	1,445,596	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	1,010,000	1,380,447	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	1,270,000	1,739,722	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	1,250,000	1,716,162	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	1,130,000	1,493,035	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	1,530,000	2,025,459	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	1,380,000	1,867,567	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	1,580,000	2,054,331	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	1,520,000	1,977,185	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	890,000	1,007,747	2046/3/20
第36回利付国債 (20年)	3.0	201,000	209,890	2017/9/20
第38回利付国債 (20年)	2.7	400,000	421,936	2018/3/20
第40回利付国債 (20年)	2.3	601,000	637,120	2018/9/20
第42回利付国債 (20年)	2.6	869,000	939,797	2019/3/20
第43回利付国債 (20年)	2.9	74,000	81,828	2019/9/20
第44回利付国債 (20年)	2.5	480,000	530,817	2020/3/20
第47回利付国債 (20年)	2.2	114,000	126,145	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	209,000	235,526	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)	2.1	515,000	573,704	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	200,000	223,124	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	214,000	241,075	2021/9/21
第54回利付国債 (20年)	2.2	480,000	546,288	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	241,000	272,930	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	449,000	511,060	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	147,000	167,224	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	589,000	665,145	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	289,000	313,715	2023/3/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	442,000	506,359	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	441,000	510,633	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	318,000	369,659	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	500,000	577,365	2023/12/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	846,000	1,007,391	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	422,000	511,447	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	160,000	191,284	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	534,000	636,645	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	620,000	736,739	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	318,000	380,646	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	575,000	690,644	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	200,000	236,640	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	210,000	250,353	2025/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第78回利付国債 (20年)	1.9	410,000	486,834	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	50,000	59,830	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	315,000	379,833	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	350,000	420,546	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	662,000	801,695	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	413,000	501,530	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	670,000	807,122	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	490,000	597,167	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	515,000	637,879	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	450,000	552,892	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	804,000	1,000,795	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	410,000	506,173	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	980,000	1,214,406	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	468,000	584,831	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	1,212,000	1,495,183	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	510,000	626,035	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	965,000	1,195,113	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	917,000	1,160,674	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	380,000	472,476	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	853,000	1,073,875	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	620,000	773,450	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	1,695,000	2,122,563	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	1,100,000	1,395,702	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	573,000	740,699	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	680,000	882,204	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	550,000	706,860	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	280,000	353,043	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	1,790,000	2,263,938	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	531,000	678,177	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	607,000	770,483	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	1,230,000	1,530,169	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	700,000	873,061	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	966,000	1,229,708	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	531,000	684,878	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	1,210,000	1,544,782	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	1,792,000	2,294,297	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	1,810,000	2,325,234	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	654,000	849,055	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	746,000	971,858	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	1,260,000	1,624,051	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	666,000	851,953	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	660,000	825,712	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	800,000	978,352	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	1,369,000	1,735,974	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	760,000	952,857	2030/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第123回利付国債 (20年)	2.1	1,748,000	2,273,868	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	700,000	900,417	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	734,000	967,947	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	810,000	1,044,268	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	560,000	713,697	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	1,214,000	1,551,649	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	600,000	757,884	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	1,182,000	1,495,903	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	890,000	1,112,820	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	827,000	1,035,776	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	1,190,000	1,508,789	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	965,000	1,225,636	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	370,000	464,139	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	770,000	953,860	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	472,000	593,039	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	890,000	1,089,965	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	480,000	595,468	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	2,427,000	3,056,515	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	1,550,000	1,954,891	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	840,000	1,073,133	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	1,380,000	1,720,032	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	1,020,000	1,254,467	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	2,790,000	3,528,457	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	2,070,000	2,621,344	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	2,360,000	2,951,746	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	2,170,000	2,679,103	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	2,500,000	3,086,425	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	2,420,000	2,946,979	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	2,620,000	3,098,097	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	2,920,000	3,453,367	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	2,400,000	2,885,568	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	2,290,000	2,708,978	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	2,530,000	2,895,306	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	1,510,000	1,552,808	2036/3/20
第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013)	0.67	100,000	100,703	2018/11/15
小 計		380,496,000	430,939,878	
地方債証券				
第1回東京都公募公債 (20年)	1.54	20,000	22,141	2023/6/20
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	10,000	14,225	2038/9/17
第8回東京都公募公債 (30年)	2.23	80,000	109,130	2038/9/17
第16回東京都公募公債 (20年)	2.01	100,000	123,399	2028/12/20
第20回東京都公募公債 (20年)	2.09	80,000	100,457	2029/9/20
第21回東京都公募公債 (20年)	2.19	80,000	101,831	2029/12/20
第22回東京都公募公債 (20年)	1.92	120,000	149,548	2030/6/20
第24回東京都公募公債 (20年)	1.98	70,000	88,857	2031/6/20

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28回東京都公募公債 (20年)	1.59	100,000	122,170	2033/3/18
第666回東京都公募公債	1.46	150,000	156,177	2019/3/20
第669回東京都公募公債	1.63	50,000	52,511	2019/6/20
第678回東京都公募公債	1.38	100,000	104,916	2019/12/20
第680回東京都公募公債	1.39	100,000	105,319	2020/3/19
第681回東京都公募公債	1.4	100,000	105,349	2020/3/19
第686回東京都公募公債	1.08	100,000	104,369	2020/6/19
第692回東京都公募公債	1.35	100,000	106,165	2020/12/18
第693回東京都公募公債	1.38	100,000	106,670	2021/3/19
第701回東京都公募公債	0.99	120,000	126,288	2021/9/17
第705回東京都公募公債	1.06	170,000	180,438	2022/3/18
第709回東京都公募公債	0.78	100,000	104,731	2022/6/20
第716回東京都公募公債	0.77	100,000	105,018	2022/12/20
第717回東京都公募公債	0.63	100,000	104,217	2023/3/20
第718回東京都公募公債	0.6	100,000	104,012	2023/3/20
第719回東京都公募公債	0.86	250,000	264,480	2023/3/20
第723回東京都公募公債	0.76	200,000	210,802	2023/9/20
第728回東京都公募公債	0.65	300,000	314,115	2023/12/20
第730回東京都公募公債	0.664	100,000	105,089	2024/3/19
平成19年度第2回北海道公募公債	1.84	112,000	114,084	2017/5/31
平成19年度第4回北海道公募公債	1.98	20,000	20,435	2017/6/29
平成19年度第16回北海道公募公債	1.58	100,000	102,857	2018/3/23
平成20年度第6回北海道公募公債	1.72	53,990	56,059	2018/8/29
平成21年度第2回北海道公募公債	1.66	100,000	104,893	2019/5/29
平成21年度第12回北海道公募公債	1.42	100,000	104,897	2019/12/25
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	100,000	103,939	2020/10/29
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	100,000	104,506	2022/10/31
平成24年度第13回北海道公募公債 (5年)	0.23	100,000	100,318	2018/1/31
平成26年度第13回北海道公募公債	0.461	200,000	206,354	2024/12/26
第1回神奈川県公募公債 (20年)	2.55	100,000	120,230	2024/6/20
第2回神奈川県公募公債 (20年)	2.23	80,000	94,514	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債 (30年)	2.87	80,000	116,556	2036/6/20
第3回神奈川県公募公債 (20年)	2.11	100,000	118,721	2025/6/20
第27回神奈川県公募公債 (20年)	1.398	100,000	119,313	2034/9/20
第152回神奈川県公募公債	1.53	110,000	113,100	2018/3/20
第162回神奈川県公募公債	1.62	140,450	147,450	2019/6/20
第163回神奈川県公募公債	1.4	114,000	118,902	2019/6/20
第165回神奈川県公募公債	1.4	54,660	57,210	2019/9/20
第170回神奈川県公募公債	1.38	240,000	252,619	2020/3/20
第171回神奈川県公募公債	1.41	100,000	105,374	2020/3/20
第176回神奈川県公募公債	1.16	128,900	135,261	2020/9/18
第191回神奈川県公募公債	0.83	100,000	104,876	2022/6/20
第192回神奈川県公募公債	0.805	200,000	209,782	2022/9/20
第5回大阪府公募公債 (20年)	2.16	100,000	126,762	2030/5/28
第11回大阪府公募公債 (20年)	1.693	200,000	246,444	2033/9/27

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89回大阪府公募公債 (5年)	0.2	100,000	100,219	2017/12/27
第92回大阪府公募公債 (5年)	0.14	100,000	100,131	2018/3/28
第306回大阪府公募公債	1.83	30,000	30,727	2017/9/27
第313回大阪府公募公債	1.66	100,000	103,120	2018/4/27
第314回大阪府公募公債	1.8	30,000	31,063	2018/5/29
第316回大阪府公募公債	1.85	100,000	103,951	2018/7/30
第325回大阪府公募公債	1.66	153,000	160,184	2019/4/26
第326回大阪府公募公債	1.66	10,000	10,482	2019/5/28
第331回大阪府公募公債	1.41	100,000	104,606	2019/10/29
第332回大阪府公募公債	1.58	71,600	75,386	2019/11/27
第334回大阪府公募公債	1.47	264,000	277,561	2020/1/28
第337回大阪府公募公債	1.44	110,000	115,897	2020/4/28
第343回大阪府公募公債	0.98	70,000	72,688	2020/10/28
第348回大阪府公募公債	1.32	10,000	10,605	2021/3/30
第351回大阪府公募公債	1.19	100,000	105,761	2021/7/28
第358回大阪府公募公債	0.97	56,000	58,844	2022/2/28
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000	58,948	2022/3/29
第366回大阪府公募公債	0.79	156,000	163,112	2022/11/29
第386回大阪府公募公債	0.585	100,000	104,249	2024/7/30
第389回大阪府公募公債	0.53	100,000	103,915	2024/10/30
平成21年度第5回京都府公募公債	1.35	20,000	20,950	2019/12/24
平成22年度第5回京都府公募公債	1.26	110,000	116,176	2020/12/21
平成23年度第9回京都府公募公債	1.01	140,000	147,919	2022/3/16
平成24年度第3回京都府公募公債 (20年)	1.63	200,000	244,844	2032/8/13
平成24年度第10回京都府公募公債	0.67	100,000	104,352	2023/3/22
平成25年度第1回京都府公募公債	0.58	100,000	103,752	2023/4/28
平成25年度第2回京都府公募公債 (15年)	1.05	100,000	110,713	2028/4/28
第2回兵庫県公募公債 (30年)	2.36	40,000	55,785	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債 (15年)	1.31	100,000	113,124	2027/12/24
第8回兵庫県公募公債 (15年)	1.09	100,000	111,085	2029/4/16
第16回兵庫県公募公債 (20年)	1.7	100,000	122,916	2032/11/19
平成20年度第5回兵庫県公募公債	1.93	50,000	51,984	2018/6/20
平成21年度第1回兵庫県公募公債	1.62	120,000	125,515	2019/4/23
平成21年度第3回兵庫県公募公債	1.62	190,000	198,975	2019/5/22
平成21年度第25回兵庫県公募公債	1.54	100,000	105,176	2019/11/20
平成20年度第1回静岡県公募公債	1.73	14,500	15,009	2018/5/28
平成20年度第2回静岡県公募公債	1.91	100,000	104,035	2018/6/26
平成20年度第4回静岡県公募公債	1.65	100,000	103,788	2018/8/28
平成20年度第5回静岡県公募公債	1.59	11,000	11,427	2018/10/30
平成21年度第4回静岡県公募公債	1.56	52,920	55,604	2019/8/20
平成22年度第1回静岡県公募公債	1.455	101,700	107,458	2020/4/20
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	104,831	2020/7/22
平成22年度第8回静岡県公募公債	1.059	100,000	104,429	2020/8/25
平成23年度第6回静岡県公募公債	1.201	170,000	180,285	2021/7/23
平成24年度第10回静岡県公募公債	0.678	100,000	104,442	2023/3/22

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1回静岡県公募公債		0.581	100,000	103,782	2023/4/19
平成25年度第5回静岡県公募公債		0.926	100,000	106,325	2023/7/25
平成25年度第8回静岡県公募公債		0.699	100,000	104,897	2023/10/24
平成25年度第9回静岡県公募公債		0.679	300,000	314,514	2023/11/22
平成25年度第11回静岡県公募公債	(5年)	0.204	100,000	100,557	2019/3/26
平成26年度第5回静岡県公募公債		0.61	100,000	104,574	2024/7/25
平成27年度第3回静岡県公募公債		0.544	121,000	126,367	2025/5/21
平成23年度第7回愛知県公募公債		1.11	100,000	105,595	2021/7/29
平成23年度第9回愛知県公募公債		1.019	100,000	105,289	2021/9/30
平成23年度第14回愛知県公募公債		1.006	100,000	105,381	2021/11/30
平成23年度第17回愛知県公募公債		0.996	100,000	105,489	2022/1/31
平成24年度第13回愛知県公募公債		0.772	100,000	104,819	2022/11/30
平成25年度第2回愛知県公募公債		0.576	200,000	207,514	2023/4/26
平成25年度第9回愛知県公募公債		0.849	240,000	253,852	2023/7/25
平成25年度第15回愛知県公募公債		0.699	600,000	629,394	2023/10/25
平成26年度第9回愛知県公募公債		0.576	100,000	104,385	2024/8/26
平成19年度第2回広島県公募公債		1.94	46,050	47,202	2017/8/24
平成20年度第4回広島県公募公債		1.73	60,000	62,601	2018/11/26
平成22年度第8回広島県公募公債		1.33	26,650	28,340	2021/3/25
平成23年度第1回広島県公募公債		1.19	100,000	105,867	2021/5/27
平成25年度第3回広島県公募公債		0.8	100,000	105,589	2023/9/25
平成19年度第3回埼玉県公募公債		1.94	39,100	40,081	2017/8/28
平成19年度第6回埼玉県公募公債		1.63	100,000	102,786	2018/1/30
平成21年度第8回埼玉県公募公債		1.3	100,000	104,633	2019/12/25
平成23年度第1回埼玉県公募公債		1.37	100,000	106,688	2021/4/27
平成23年度第4回埼玉県公募公債		1.2	100,000	106,057	2021/7/27
平成24年度第6回埼玉県公募公債		0.801	100,000	104,938	2022/10/26
平成26年度第6回埼玉県公募公債		0.554	150,000	156,303	2024/9/26
平成26年度第8回埼玉県公募公債		0.335	100,000	102,491	2025/1/28
平成19年度第1回福岡県公募公債	(30年)	2.62	70,000	100,073	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債	(30年)	2.28	80,000	109,944	2038/9/17
平成21年度第11回福岡県公募公債		1.44	100,000	105,464	2020/2/25
平成22年度第3回福岡県公募公債		1.11	100,000	104,734	2020/8/24
平成22年度第5回福岡県公募公債		0.94	20,000	20,825	2020/10/28
平成24年度第11回福岡県公募公債		0.8	550,000	578,946	2023/2/27
平成25年度第11回福岡県公募公債		0.694	300,000	315,363	2024/2/26
第9回千葉県公募公債(20年)		1.84	80,000	98,802	2030/10/11
平成20年度第2回千葉県公募公債		1.8	90,000	93,280	2018/5/25
平成20年度第3回千葉県公募公債		1.78	80,000	83,119	2018/7/25
平成20年度第5回千葉県公募公債		1.6	80,000	83,026	2018/9/25
平成22年度第7回千葉県公募公債		0.92	120,000	124,717	2020/10/23
平成22年度第11回千葉県公募公債		1.26	80,000	84,612	2021/1/25
平成23年度第6回千葉県公募公債		1.11	200,000	212,056	2021/12/24
平成23年度第9回千葉県公募公債		1.0	20,000	21,130	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債		1.05	20,000	21,206	2022/4/25

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
平成24年度第6回千葉県公募公債	0.81	100,000	105,057	2022/11/25
平成25年度第1回千葉県公募公債	0.58	82,500	85,621	2023/4/25
平成26年度第9回千葉県公募公債	0.465	188,000	195,057	2025/3/25
平成21年度第1回新潟県公募公債	1.42	23,000	24,053	2019/7/29
平成23年度第1回新潟県公募公債	1.02	119,000	125,530	2021/11/30
平成24年度第1回大分県公募公債	0.8	100,260	105,214	2022/10/31
第58回共同発行市場公募地方債	1.59	21,000	21,568	2018/1/25
第59回共同発行市場公募地方債	1.57	100,800	103,619	2018/2/23
第62回共同発行市場公募地方債	1.74	100,000	103,533	2018/5/25
第63回共同発行市場公募地方債	1.88	200,000	207,950	2018/6/25
第64回共同発行市場公募地方債	1.78	100,000	103,856	2018/7/25
第65回共同発行市場公募地方債	1.62	90,000	93,321	2018/8/24
第74回共同発行市場公募地方債	1.57	100,000	104,726	2019/5/24
第75回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	105,084	2019/6/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	10,000	10,500	2019/8/23
第78回共同発行市場公募地方債	1.39	30,000	31,401	2019/9/25
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	109,500	114,673	2019/12/25
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	30,000	31,434	2020/9/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	105,974	2021/2/25
第100回共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	106,124	2021/7/23
第101回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	105,385	2021/8/25
第103回共同発行市場公募地方債	1.0	100,000	105,281	2021/10/25
第104回共同発行市場公募地方債	1.03	200,000	211,058	2021/11/25
第107回共同発行市場公募地方債	1.01	200,000	211,334	2022/2/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	170,000	180,305	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	105,149	2022/5/25
第113回共同発行市場公募地方債	0.77	100,000	104,648	2022/8/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	105,024	2022/9/22
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	250,000	262,565	2022/11/25
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	104,554	2022/12/22
第118回共同発行市場公募地方債	0.84	200,000	210,776	2023/1/25
第119回共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	315,663	2023/2/24
第120回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	104,459	2023/3/24
第128回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	314,214	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	230,000	242,721	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	200,000	209,724	2024/3/25
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	400,000	420,408	2024/4/25
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	200,000	210,018	2024/6/25
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	104,624	2024/7/25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	400,000	417,364	2024/8/23
第138回共同発行市場公募地方債	0.554	300,000	312,732	2024/9/25
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	300,000	311,736	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	205,324	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	100,000	103,752	2025/3/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	103,218	2025/4/25

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	209,040	2025/5/23
第148回共同発行市場公募地方債	0.553	300,000	313,971	2025/7/25
第150回共同発行市場公募地方債	0.51	300,000	313,041	2025/9/25
平成19年度第1回堺市公募公債	1.73	100,000	102,753	2017/12/19
平成24年度第2回熊本県公募公債	0.8	50,000	52,483	2022/10/26
平成22年度第1回新潟市公募公債	1.21	54,980	57,959	2020/12/24
平成23年度第1回浜松市公募公債	1.045	38,200	40,343	2021/11/25
平成25年度第1回浜松市公募公債	0.761	61,000	64,376	2024/1/24
第1回大阪市公募公債(15年)	1.753	200,000	232,506	2026/7/17
第5回大阪市公募公債(20年)	2.47	100,000	127,775	2028/9/21
平成19年度第4回大阪市公募公債	1.9	30,000	30,622	2017/6/21
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	125,000	131,766	2019/11/25
平成23年度第10回大阪市公募公債	0.956	10,000	10,519	2022/1/27
平成26年度第5回大阪市公募公債	0.593	100,000	104,529	2024/9/27
第1回名古屋市公募公債(12年)	1.033	100,000	108,957	2025/6/20
第2回名古屋市公募公債(20年)	2.56	100,000	120,310	2024/6/20
第10回名古屋市公募公債(20年)	2.26	80,000	101,690	2029/8/17
第477回名古屋市公募公債	1.034	100,000	105,561	2021/12/20
第5回京都市公募公債(20年)	2.36	50,000	61,661	2026/12/18
平成23年度第2回京都市公募公債	1.049	100,000	105,299	2021/8/26
平成24年度第4回京都市公募公債	0.801	100,000	104,861	2022/10/21
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	2.54	120,000	148,916	2026/6/19
平成22年度第9回神戸市公募公債(20年)	2.09	80,000	101,530	2031/1/24
第7回横浜市公募公債(20年)	2.06	200,000	239,212	2025/12/19
第17回横浜市公募公債(20年)	2.07	80,000	99,007	2028/12/20
平成20年度第4回横浜市公募公債	1.71	100,000	104,222	2018/11/16
第20回横浜市公募公債(20年)	2.1	80,000	100,220	2029/10/19
平成24年度第4回横浜市公募公債	0.81	100,000	105,209	2023/2/20
平成24年度第3回横浜市公募公債	0.729	100,000	104,509	2022/12/22
第25回横浜市公募公債(20年)	1.72	100,000	123,821	2032/7/16
第27回横浜市公募公債(20年)	1.599	60,000	73,401	2033/5/20
平成21年度第5回札幌市公募公債	1.36	112,000	117,075	2019/9/20
平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	2.277	80,000	111,830	2040/9/20
第44回川崎市公募公債(5年)	0.162	130,400	131,131	2020/6/19
第82回川崎市公募公債	1.52	100,000	105,070	2019/9/20
第17回北九州市公募公債(20年)	1.529	100,000	121,211	2034/6/20
平成20年度第3回福岡市公募公債	1.52	100,000	103,166	2018/6/20
平成20年度第5回福岡市公募公債	1.57	91,000	94,502	2018/10/24
平成22年度第9回福岡市公募公債	1.32	106,500	113,040	2021/3/25
平成23年度第6回福岡市公募公債	1.0	100,000	105,261	2021/10/28
平成24年度第1回福岡市公募公債(5年)	0.25	34,700	34,796	2017/6/26
平成24年度第3回福岡市公募公債(5年)	0.25	42,500	42,645	2017/9/28
平成25年度第3回福岡市公募公債(5年)	0.31	31,500	31,731	2018/9/26
平成25年度第4回福岡市公募公債	0.68	50,000	52,378	2023/10/24
平成26年度第6回福岡市公募公債(20年)	1.371	100,000	118,430	2034/9/20

銘柄	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2回広島市公募公債		0.72	100,000	105,210	2023/12/27
平成24年度第2回千葉市公募公債		0.81	100,000	105,085	2022/11/22
平成26年度第2回千葉市公募公債		0.505	100,000	103,826	2024/11/27
平成22年度第1回三重県公募公債		1.056	87,050	91,089	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債		1.021	98,410	103,787	2021/11/30
平成24年度第1回三重県公募公債		0.801	140,660	147,602	2022/10/25
平成24年度第4回福井県公募公債		0.46	100,000	102,988	2023/4/26
平成20年度第1回徳島県公募公債		1.73	36,000	37,586	2018/11/28
平成24年度第1回徳島県公募公債		0.68	100,000	104,495	2023/3/24
平成26年度第1回徳島県公募公債		0.495	100,000	103,831	2024/11/28
平成20年度第1回岡山県公募公債		1.56	48,700	50,691	2018/12/25
小 計			28,006,180	30,032,413	
特殊債券(除く金融債)					
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	204,682	2017/7/31
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	108,832	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	102,590	2018/1/31
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	100,000	102,616	2018/3/23
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	103,476	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	35,280	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	206,000	213,535	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	224,000	231,945	2018/9/28
第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.6	50,000	51,963	2018/10/31
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	119,656	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	164,736	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	141,000	146,187	2019/3/19
第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	200,000	209,120	2019/5/31
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	250,406	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	210,000	219,819	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	82,464	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	125,662	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	125,749	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	144,989	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	220,096	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	142,066	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	52,494	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	126,997	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	200,000	210,680	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	104,342	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	116,538	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	74,912	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	126,565	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	96,051	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	63,432	2021/7/30
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	128,503	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	105,464	2021/10/29

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148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	200,000	249,240	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	143,553	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	117,816	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	370,000	389,425	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	105,770	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	124,167	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	268,736	2042/5/30
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.895	12,000	12,658	2022/6/30
第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.839	300,000	315,585	2022/7/29
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	350,000	367,808	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	105,275	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	222,000	232,802	2022/12/28
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.834	200,000	211,194	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	104,576	2023/3/17
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	100,000	119,209	2033/4/28
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.541	153,000	158,765	2023/4/28
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.605	474,000	494,026	2023/5/31
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.882	100,000	106,292	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	128,913	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	398,000	422,126	2023/8/31
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.669	228,000	239,431	2023/11/30
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.693	188,000	197,864	2023/12/28
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.645	322,000	338,093	2024/3/29
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	105,148	2024/6/28
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.601	100,000	104,852	2024/7/31
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	119,327	2034/8/31
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.539	100,000	104,477	2024/10/31
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.466	241,000	250,478	2024/12/27
第344回政府保証道路債券		1.6	100,000	106,646	2020/7/15
第4回政府保証首都高速道路債券		1.7	179,000	183,226	2017/9/25
第7回政府保証東日本高速道路債券		1.9	34,000	34,838	2017/8/24
第13回政府保証東日本高速道路債券		1.6	28,000	29,085	2018/10/19
第17回政府保証中日本高速道路債券		1.7	100,000	102,315	2017/9/15
第20回政府保証中日本高速道路債券		1.4	10,000	10,257	2018/3/16
第23回政府保証中日本高速道路債券		1.5	90,000	93,139	2018/9/14
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.5	280,000	292,913	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	26,104	2019/7/12
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.5	200,000	209,750	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	201,394	2018/1/30
第4回政府保証公営企業債券(15年)		2.0	100,000	111,858	2022/4/22
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.3	200,000	206,932	2019/1/22
第5回政府保証公営企業債券(15年)		2.2	100,000	113,551	2022/7/15
第7回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)		0.25	300,000	301,743	2018/10/29
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.4	100,000	104,062	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	148,000	154,689	2019/5/24

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9回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	0.32	100,000	100,906	2019/4/25
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	104,965	2020/3/13
第12回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	200,000	210,410	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	104,298	2020/9/14
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	101,000	105,069	2020/11/17
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	15,000	15,939	2021/3/12
第25回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	106,125	2021/6/14
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	21,000	22,141	2021/10/18
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	50,000	53,075	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	105,511	2022/6/17
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	105,012	2022/8/15
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	354,000	373,516	2023/2/17
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	17,000	17,777	2023/3/17
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.541	345,000	357,965	2023/4/21
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	37,526	2023/5/16
第50回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.911	168,000	178,914	2023/7/14
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	150,000	159,033	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	160,000	168,364	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	210,030	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	104,828	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	209,014	2024/8/16
第879回政府保証公営企業債券	1.7	102,000	104,380	2017/9/19
第883回政府保証公営企業債券	1.4	100,000	102,589	2018/3/19
第884回政府保証公営企業債券	1.4	114,000	117,073	2018/4/17
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	110,341	2021/4/16
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	1.3	123,000	128,334	2019/9/17
第23回政府保証日本政策金融公庫債券	0.734	134,000	140,488	2022/12/16
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	105,526	2023/2/24
第26回政府保証日本政策金融公庫債券	0.911	484,000	515,503	2023/7/19
第191回政府保証中小企業債券	1.7	211,000	215,884	2017/9/15
第16回政府保証民間都市開発債券	0.699	197,000	207,173	2023/10/20
第21回政府保証国民生活債券	1.5	2,000	2,048	2017/12/18
第2回政府保証新関西国際空港債券	0.882	202,000	214,833	2023/6/27
第5回政府保証日本政策投資銀行	1.4	50,000	52,031	2019/4/15
第7回政府保証日本政策投資銀行	1.4	100,000	105,252	2020/2/17
第11回政府保証日本政策投資銀行	1.0	179,000	188,556	2021/9/14
第17回政府保証日本政策投資銀行	0.257	200,000	201,222	2018/11/9
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	21,045	2023/12/18
第27回政府保証日本政策投資銀行	0.11	200,000	200,988	2021/2/12
第53回政府保証関西国際空港債券	1.5	151,000	154,871	2018/1/24
第11回政府保証西日本高速道路債券	1.7	31,000	31,821	2017/11/28
第46回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.69	50,000	51,558	2018/3/20
第7回道路債券(財投機関債)	2.7	100,000	116,309	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	24,525	2026/3/19
第9回道路債券(財投機関債)	2.9	100,000	140,278	2032/5/20

銘柄	利 率	当 期 末		
		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13回道路債券(財投機関債)	2.28	200,000	228,644	2022/9/20
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	47,873	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	156,430	2047/3/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.67	130,000	200,379	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	74,791	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	204,994	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	124,568	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	102,956	2018/3/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.42	300,000	379,848	2028/6/20
第42回道路債券(財投機関債)	2.22	130,000	154,186	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	104,169	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	150,000	191,812	2029/4/20
第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.14	50,000	62,980	2030/5/10
第71回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.17	100,000	105,862	2021/6/18
第73回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.14	100,000	105,709	2021/6/18
第78回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.08	100,000	105,907	2021/12/20
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	62,296	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	121,765	2032/6/18
第92回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.834	110,000	115,425	2022/6/20
第96回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.796	300,000	314,700	2022/9/20
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	104,972	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	104,952	2022/12/20
第110回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.94	300,000	319,131	2023/6/20
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	211,478	2023/6/20
第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.77	100,000	105,416	2023/12/20
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.974	100,000	140,439	2055/3/19
第1回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.648	100,000	105,090	2019/6/28
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.266	50,000	63,094	2029/6/28
第2回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.406	80,000	83,538	2019/7/26
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	20,000	21,363	2023/3/22
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債)	1.176	100,000	111,897	2029/1/26
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	114,961	2023/12/20
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	59,351	2024/9/24
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.092	100,000	125,913	2030/12/27
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.187	80,000	102,351	2031/4/28
第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.164	100,000	104,938	2020/9/28
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.846	80,000	98,595	2031/8/28
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.87	100,000	123,616	2031/9/26
第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.274	50,000	52,852	2020/12/28
第20回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.28	100,000	105,846	2021/1/28
第22回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.687	200,000	243,238	2032/6/28
F23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.075	100,000	102,159	2018/5/29
第23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.418	100,000	106,877	2021/4/28
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	300,000	364,578	2032/7/28
F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.681	70,000	77,872	2023/3/17

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27回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.034	100,000	105,334	2021/8/27
第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.785	50,000	61,772	2033/1/28
第28回公営企業債券(財投機関債)		1.89	100,000	102,734	2017/10/25
第35回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.006	200,000	211,680	2022/4/28
第42回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.801	100,000	105,039	2022/11/28
第44回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.791	200,000	210,198	2023/1/27
第46回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.678	100,000	104,417	2023/3/28
第49回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.887	200,000	212,040	2023/6/28
第50回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.922	300,000	319,026	2023/7/28
F89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.602	300,000	348,126	2027/8/20
F110回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.562	100,000	101,590	2019/4/25
F123回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.6	100,000	118,194	2030/3/19
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.546	100,000	118,743	2031/7/30
F147回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.291	150,000	168,373	2027/3/19
F226回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.096	100,000	110,914	2029/2/28
第10回首都高速道路		0.336	400,000	401,884	2017/9/20
第13回首都高速道路(財投機関債)		0.223	100,000	100,681	2019/9/20
第7回阪神高速道路債券(財投機関債)		2.18	100,000	118,254	2025/3/21
第14回阪神高速道路		0.1	300,000	300,375	2019/12/20
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)		2.167	80,000	100,969	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)		1.911	80,000	98,762	2030/10/29
第21回都市再生債券(財投機関債)		1.72	100,000	103,996	2018/9/20
第68回都市再生債券(財投機関債)		0.854	100,000	105,269	2022/9/20
第100回都市再生債券(財投機関債)		0.569	100,000	104,184	2024/11/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	26,476	28,389	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	22,792	24,547	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.19	28,211	30,404	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	23,341	25,355	2037/11/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.29	27,832	30,105	2042/8/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.76	19,935	21,068	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.26	20,909	22,542	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	27,579	29,673	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	24,467	26,167	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.25	20,973	22,595	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	15,357	15,883	2037/10/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.99	28,382	30,398	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	71,650	2017/9/20
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.52	14,945	15,377	2037/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.19	21,625	23,302	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	26,057	28,002	2039/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.43	31,898	32,856	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.15	22,330	24,061	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.16	31,322	33,746	2043/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	17,578	18,292	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	31,268	32,657	2032/5/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.64	33,743	35,326	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	34,640	36,368	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	103,716	108,350	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	19,211	20,124	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.12	20,163	21,359	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	104,468	2018/9/20
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	24,293	25,519	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	53,618	56,605	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	29,093	30,730	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.88	49,627	53,407	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.87	54,543	58,581	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	56,528	60,561	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.88	27,506	29,274	2040/12/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.61	59,344	63,107	2045/7/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	26,062	27,656	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	65,596	69,098	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.09	28,071	30,162	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	26,132	28,331	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.6	71,444	76,374	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	71,660	77,275	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	66,485	71,562	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.92	63,447	68,618	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	192,858	208,768	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	64,274	69,136	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	64,107	68,668	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.21	25,898	28,036	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	68,941	73,882	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	71,981	76,754	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	73,005	77,763	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.42	76,026	80,855	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	229,284	244,065	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	76,918	81,909	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	77,502	82,101	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	78,949	83,290	2047/7/10
第62回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.13	50,000	63,146	2030/12/13
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.11	79,408	83,325	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	81,224	85,318	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.25	81,265	85,946	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.32	84,702	90,108	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	101,050	2031/6/13
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	240,858	254,290	2048/9/10
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	34,833	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.08	83,286	87,347	2048/11/10
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	172,376	180,820	2049/1/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	85,891	90,232	2049/2/10

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83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	87,869	92,178	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	176,722	185,105	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.02	179,296	187,957	2049/6/10
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	123,667	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.95	92,290	96,385	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	277,212	288,250	2049/11/10
第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.84	187,136	194,220	2049/12/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	93,706	96,615	2050/1/10
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.6	188,382	192,366	2050/2/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.9	289,818	302,445	2050/7/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.88	193,764	201,933	2050/8/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.892	100,000	124,488	2032/4/16
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	226,976	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.86	490,020	510,850	2050/12/10
第105回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.472	100,000	114,067	2027/6/18
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	179,354	2042/9/19
第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.801	100,000	123,405	2032/9/17
第144回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.748	300,000	315,747	2023/12/20
第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)		2.04	50,000	58,697	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)		1.991	70,000	88,039	2031/6/13
第11回国際協力機構債券(財投機関債)		1.14	30,000	31,855	2021/12/20
第18回東日本高速道路		0.387	100,000	100,546	2017/9/20
第21回東日本高速道路		0.58	100,000	101,180	2018/6/20
第22回東日本高速道路		0.401	100,000	100,803	2018/6/20
第28回東日本高速道路		0.248	100,000	100,767	2019/12/20
第3回中日本高速道路		1.92	300,000	307,779	2017/9/20
第21回中日本高速道路		0.592	100,000	100,818	2017/9/20
第33回中日本高速道路		1.084	50,000	52,829	2021/9/17
第42回中日本高速道路		0.942	100,000	105,358	2022/3/18
第43回中日本高速道路		0.362	100,000	100,521	2017/9/20
第45回中日本高速道路		0.904	300,000	316,758	2022/9/20
第46回中日本高速道路		0.351	200,000	200,950	2017/9/20
第59回中日本高速道路		0.309	100,000	101,590	2021/12/20
第18回西日本高速道路		0.893	100,000	105,873	2023/3/20
第20回西日本高速道路		0.759	100,000	105,239	2023/9/20
第21回西日本高速道路		0.754	400,000	421,180	2023/12/20
第132回福岡北九州高速道路債券		0.704	100,000	104,909	2024/3/19
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	208,652	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	105,348	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	100,365	2018/6/20
第5回東京都住宅供給公社債券		2.02	100,000	102,579	2017/9/20
小	計		36,130,167	39,037,654	
金融債券					
い第745号商工債券		0.35	100,000	100,388	2017/6/27
い第773号商工債券		0.2	100,000	100,562	2019/10/25

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775号商工債券	0.2	400,000	402,248	2019/12/27
い第776号商工債券	0.17	100,000	100,471	2020/1/27
い第752号農林債券	0.3	150,000	150,742	2018/1/26
い第760号農林債券	0.4	400,000	403,372	2018/9/27
い第761号農林債券	0.3	250,000	251,562	2018/10/26
い第763号農林債券	0.3	340,000	342,227	2018/12/27
い第765号農林債券	0.3	100,000	100,698	2019/2/27
い第769号農林債券	0.3	100,000	100,811	2019/6/27
い第774号農林債券	0.24	100,000	100,659	2019/11/27
い第780号農林債券	0.28	300,000	302,796	2020/5/27
第271回信金中金債	0.35	100,000	100,388	2017/6/27
第279回信金中金債	0.25	300,000	301,293	2018/2/27
第286回信金中金債	0.35	100,000	100,748	2018/9/27
第288回信金中金債	0.3	200,000	201,346	2018/11/27
第291回信金中金債	0.25	100,000	100,586	2019/2/27
第293回信金中金債	0.25	100,000	100,640	2019/4/26
第304回信金中金債	0.225	200,000	201,466	2020/3/27
第8号商工債券(10年)	1.66	100,000	104,221	2018/12/20
第11号商工債券(10年)	0.66	100,000	104,338	2024/9/20
第179号商工債券(3年)	0.14	300,000	300,657	2017/12/27
第184号商工債券(3年)	0.15	300,000	300,762	2018/5/25
小 計		4,340,000	4,372,982	
普通社債券				
第459回東京電力	2.7	80,000	84,946	2019/1/29
第532回東京電力	1.75	120,000	122,343	2017/9/28
第534回東京電力	2.055	100,000	105,307	2019/10/29
第536回東京電力	1.672	100,000	102,283	2018/1/29
第544回東京電力	1.976	100,000	103,434	2018/6/25
第549回東京電力	1.699	150,000	154,881	2018/10/17
第559回東京電力	1.377	60,000	61,788	2019/10/29
第563回東京電力	1.39	100,000	103,512	2020/5/28
第567回東京電力	1.958	100,000	108,825	2030/7/29
第568回東京電力	1.155	100,000	102,730	2020/9/8
第490回中部電力	1.444	70,000	73,003	2019/7/25
第499回中部電力	1.194	50,000	53,392	2023/6/23
第500回中部電力	0.875	100,000	104,921	2024/5/24
第448回関西電力	2.16	100,000	104,233	2018/6/20
第456回関西電力	2.01	100,000	102,331	2017/7/25
第472回関西電力	1.79	100,000	104,096	2018/11/22
第473回関西電力	1.665	100,000	104,322	2019/4/25
第478回関西電力	1.448	200,000	209,038	2020/1/24
第485回関西電力	1.285	100,000	104,733	2020/12/18
第374回中国電力	0.814	100,000	102,595	2020/2/25
第379回中国電力	0.619	100,000	102,153	2021/1/25
第382回中国電力	0.517	100,000	101,759	2021/5/25

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288回北陸電力	1.89	100,000	102,720	2017/10/25
第303回北陸電力	0.756	100,000	102,040	2019/6/25
第448回東北電力	1.608	100,000	104,523	2019/5/24
第456回東北電力	1.176	100,000	104,320	2020/11/25
第473回東北電力	0.597	100,000	101,846	2021/4/23
第245回四国電力	2.0	100,000	109,374	2021/6/25
第400回九州電力	1.777	100,000	106,090	2020/4/24
第408回九州電力	1.672	100,000	104,662	2019/6/25
第422回九州電力	1.164	100,000	103,770	2020/6/25
第423回九州電力	0.959	100,000	102,644	2019/9/25
第429回九州電力	0.909	100,000	104,039	2024/9/25
第430回九州電力	0.54	100,000	101,369	2021/10/25
第261回北海道電力	2.775	24,000	24,981	2017/11/24
第310回北海道電力	1.286	50,000	52,379	2020/12/25
第315回北海道電力	0.82	100,000	101,334	2018/4/25
第316回北海道電力	1.164	100,000	103,854	2020/6/25
第319回北海道電力	0.514	200,000	202,100	2019/9/25
第19回沖縄電力	1.452	80,000	84,532	2020/4/24
第344回東京交通債券	1.67	100,000	110,709	2023/2/17
第347回東京交通債券	2.05	100,000	115,310	2024/3/8
第25回関西国際空港	1.361	400,000	421,824	2020/6/19
第38回関西国際空港	1.112	50,000	53,043	2021/12/20
第10回成田国際空港	1.094	160,000	169,137	2021/9/17
第11回成田国際空港	1.067	100,000	106,007	2022/2/18
第12回成田国際空港	0.879	100,000	105,427	2022/9/20
第13回成田国際空港	0.802	100,000	105,164	2023/2/8
第17回成田国際空港	0.489	100,000	103,325	2025/2/20
第3回セブン&アイ・ホールディングス	1.94	100,000	104,029	2018/6/20
第8回セブン&アイ・ホールディングス	0.383	100,000	100,973	2019/6/20
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	300,000	307,149	2022/6/20
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	105,160	2022/12/2
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	105,453	2021/9/17
第10回小松製作所	0.275	100,000	100,541	2019/6/20
第1回日本電産	0.386	100,000	100,474	2017/9/20
第12回パナソニック	0.387	300,000	303,033	2020/3/19
第1回B号日本生命2011基金	1.12	400,000	404,592	2017/8/5
第1回日本生命2012基金	0.87	100,000	101,584	2018/8/3
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	101,082	2019/8/7
第1回日本生命2015基金	0.406	100,000	100,811	2019/8/5
第53回日産自動車	1.744	100,000	106,558	2020/4/28
第5回凸版印刷	1.397	100,000	105,935	2020/12/16
第3回大日本印刷	1.358	100,000	105,897	2020/12/18
第78回三菱商事	1.155	100,000	105,825	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	102,493	2017/7/27
第7回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	2.5	300,000	321,141	2019/6/3

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8回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)		1.62	100,000	107,406	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	117,435	2026/10/30
第10回みずほコーポレート銀行		1.945	400,000	411,264	2017/10/27
第30回みずほコーポレート銀行		0.34	100,000	100,383	2017/7/25
第31回みずほコーポレート銀行		0.33	200,000	200,910	2017/10/25
第32回みずほコーポレート銀行		0.27	800,000	803,312	2018/1/24
第33回みずほコーポレート銀行		0.41	600,000	604,272	2018/4/20
第7回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)		2.11	400,000	428,364	2019/12/20
第9回三菱東京UFJ銀行		2.69	100,000	110,062	2020/2/27
第12回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)		2.16	100,000	102,523	2017/7/28
第28回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)		1.56	100,000	106,455	2021/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)		2.46	100,000	127,012	2031/1/20
第93回三菱東京UFJ銀行		1.985	200,000	205,632	2017/10/17
第124回三菱東京UFJ銀行		1.51	100,000	107,020	2021/4/16
第6回りそな銀行 (劣後特約付)		2.084	400,000	428,204	2020/3/4
第1回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位)		0.345	100,000	100,352	2017/6/7
第2回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位)		0.26	100,000	100,391	2017/12/20
第5回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位)		0.285	200,000	201,270	2018/11/28
第6回住友信託銀行 (劣後特約付)		2.78	100,000	122,963	2026/4/27
第13回住友信託銀行 (劣後特約付)		2.341	100,000	118,768	2026/6/15
第6回セブン銀行		0.398	100,000	100,439	2017/6/20
第22回三井住友銀行 (劣後特約付)		1.43	100,000	105,443	2020/9/28
第23回三井住友銀行 (劣後特約付)		1.61	100,000	106,536	2020/12/17
第25回三井住友銀行 (劣後特約付)		2.21	200,000	236,008	2026/6/1
第57回三井住友銀行		0.28	200,000	200,790	2017/10/20
第5回みずほ銀行 (劣後特約付)		2.49	100,000	119,382	2026/1/30
第9回みずほ銀行 (劣後特約付)		2.52	100,000	121,555	2027/4/27
第18回みずほ銀行 (劣後特約付)		2.14	100,000	116,686	2026/9/11
第8回芙蓉総合リース		0.318	100,000	100,702	2019/7/30
第11回芙蓉総合リース		0.21	100,000	99,990	2021/5/7
第4回興銀リース		0.36	100,000	100,788	2019/5/23
第5回興銀リース		0.272	100,000	100,581	2019/12/5
第28回日産フィナンシャルサービス		0.253	100,000	100,446	2019/6/20
第10回東京センチュリーリース		0.298	100,000	100,666	2019/11/21
第15回東京センチュリーリース		0.11	100,000	100,031	2019/4/12
第29回ホンダファイナンス		0.428	100,000	101,280	2021/3/19
第62回トヨタファイナンス		0.203	100,000	100,496	2019/12/20
第69回トヨタファイナンス		0.02	200,000	199,982	2019/4/26
第47回日立キャピタル		0.874	100,000	104,591	2023/3/20
第52回日立キャピタル		0.508	200,000	203,656	2021/6/18
第56回日立キャピタル		0.197	100,000	100,390	2019/12/20
第9回三井住友ファイナンス&リース		0.518	200,000	203,426	2021/1/29
第14回三井住友ファイナンス&リース		0.321	200,000	201,674	2020/10/30
第36回三菱UFJリース		0.355	100,000	100,979	2022/1/21
第37回三菱UFJリース		0.07	100,000	99,959	2019/2/21

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38回三菱UFJリース	0.16	200,000	200,128	2021/4/21
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	115,205	2025/9/24
第39回野村ホールディングス	0.853	100,000	101,372	2018/2/26
第43回野村ホールディングス	0.454	300,000	302,874	2019/2/25
第48回野村ホールディングス	0.245	100,000	100,317	2018/6/8
第49回野村ホールディングス	0.437	100,000	101,192	2020/6/10
第2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回	1.98	100,000	103,754	2018/6/20
第98回三菱地所	1.165	100,000	104,297	2020/6/19
第105回三菱地所	1.178	100,000	105,998	2022/3/23
第112回三菱地所	0.577	200,000	204,178	2020/12/25
第116回三菱地所	0.643	100,000	103,301	2024/9/19
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	105,306	2021/9/17
第17回エヌ・ティ・ティ都市開発	0.61	100,000	102,948	2024/9/20
第15回東日本旅客鉄道	2.65	100,000	111,052	2020/8/25
第26回東日本旅客鉄道	1.19	100,000	107,436	2022/12/20
第29回東日本旅客鉄道	2.01	200,000	228,408	2023/9/20
第60回東日本旅客鉄道	1.449	100,000	104,469	2019/7/24
第62回東日本旅客鉄道	1.424	100,000	104,632	2019/9/27
第79回東日本旅客鉄道	1.131	100,000	105,774	2021/9/29
第83回東日本旅客鉄道	1.633	100,000	115,017	2026/12/22
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	133,127	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道	2.28	123,000	139,051	2022/3/25
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	121,166	2030/10/25
第56回東海旅客鉄道	2.083	100,000	125,840	2031/5/26
第74回東海旅客鉄道	1.685	100,000	126,488	2045/3/6
第11回東京地下鉄	1.16	100,000	106,203	2021/12/9
第5回日本通運	1.818	100,000	105,391	2019/5/31
第5回関西高速鉄道	1.238	100,000	105,008	2020/9/10
第59回日本電信電話	1.69	100,000	105,119	2019/6/20
第63回日本電信電話	0.69	100,000	104,271	2023/3/20
第19回KDDI	1.151	100,000	104,368	2020/6/19
第21回KDDI	0.669	100,000	104,026	2024/9/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	104,831	2023/9/20
第29回電源開発	1.405	100,000	104,645	2019/11/20
第38回電源開発	0.978	100,000	105,160	2023/12/20
第40回電源開発	0.889	200,000	209,240	2024/6/20
第23回東京ガス	1.01	200,000	213,162	2023/6/9
第25回エヌ・ティ・ティ・データ	1.47	100,000	105,519	2020/3/19
第2回ファーストリテイリング	0.291	100,000	101,003	2020/12/18
第3回ファーストリテイリング	0.491	100,000	102,191	2022/12/16
第4回ファーストリテイリング	0.749	100,000	104,191	2025/12/18
第5回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.793	100,000	101,548	2018/12/13
第15回GEキャピタルコーポレーション	2.215	100,000	108,615	2020/11/20
第23回GEキャピタルコーポレーション	0.45	200,000	200,148	2016/9/20
第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.32	100,000	100,894	2017/2/9

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8回ナショナル・オーストラリア銀行	1.3	100,000	100,801	2017/1/20
第9回ナショナル・オーストラリア銀行	0.457	100,000	100,814	2019/1/17
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	100,445	2020/1/16
第8回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.407	300,000	302,295	2019/5/2
第8回ウエストパック・バンキング・コーポレーション	1.0	100,000	100,220	2016/8/12
第9回ラボバンク・ネダーランド	1.81	100,000	107,163	2021/1/28
第18回ラボバンク・ネダーランド	0.778	100,000	100,971	2017/11/2
第22回ラボバンク・ネダーランド	0.377	100,000	100,164	2016/12/19
第23回ラボバンク・ネダーランド	0.557	100,000	101,048	2018/12/19
第27回ラボバンク・ネダーランド	0.38	100,000	100,559	2020/5/22
小 計		21,917,000	22,919,698	
合 計		470,889,347	527,302,626	

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 527,302,626	% 99.2
コール・ローン等、その他	4,274,375	0.8
投資信託財産総額	531,577,001	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	531,577,001,301	
コール・ローン等	2,989,676,014	
公社債(評価額)	527,302,626,956	
未収利息	1,167,439,286	
前払費用	117,259,045	
(B) 負債	2,120,379,248	
未払金	1,319,510,540	
未払解約金	800,861,372	
未払利息	6,070	
その他未払費用	1,266	
(C) 純資産総額(A-B)	529,456,622,053	
元本	392,963,515,092	
次期繰越損益金	136,493,106,961	
(D) 受益権総口数	392,963,515.092口	
1万口当たり基準価額(C/D)	13,473円	

<注記事項>

- ①期首元本額 273,489,284,775円
 期中追加設定元本額 230,928,667,279円
 期中一部解約元本額 111,454,436,962円
 また、1口当たり純資産額は、期末13,473円です。

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	4,626,521,224	
受取利息	4,626,717,898	
その他収益金	11,000	
支払利息	△ 207,674	
(B) 有価証券売買損益	27,196,907,264	
売買益	27,869,990,260	
売買損	△ 673,082,996	
(C) 先物取引等取引損益	40,030,720	
取引益	42,200,160	
取引損	△ 2,169,440	
(D) 保管費用等	△ 1,266	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	31,863,457,942	
(F) 前期繰越損益金	70,345,224,180	
(G) 追加信託差損益金	66,710,614,776	
(H) 解約差損益金	△ 32,426,189,937	
(I) 計(E+F+G+H)	136,493,106,961	
次期繰越損益金(I)	136,493,106,961	

- (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（国内債券）	24,560,538,321円
eMAXIS 国内債券インデックス	16,932,463,018円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,513,899,345円
eMAXIS バランス（波乗り型）	318,764,587円
コアバランス	2,495,021円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	24,663,146,879円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	28,138,690,875円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	227,589,648円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	29,184,652,524円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	14,740,056,498円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	2,087,892,777円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	6,373,050,568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）	199,687,055,080円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	6,632,302,396円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）	2,642,591,636円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	1,901,143,295円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	552,810,923円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	174,759,098円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	5,411,642,373円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	4,201,886,464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）	35,492,792円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	58,782,800円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	90,216,225円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	118,748,080円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	73,430,230円
三菱UFJ 日本債券インデックスファンドVA	23,134,363円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	267,175,876円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	641,170,860円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	261,546,394円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	645,178,699円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	2,887,689,697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）	1,614,469,539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）	3,107,456,915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）	1,646,858,018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）	907,309,775円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	6,129,391,967円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	617,588,982円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	713,503,002円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	406,651,573円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	420,126円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	272,141円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	191,413円
eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）	49,079,772円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	22,122,406円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールデンキーパー）	5,351,778円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	16,871,400円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	3,342,258円
eMAXIS 最適化バランス（マイフワード）	2,016,780円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	54,241円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	2,670,099,620円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	466,044円
合計	392,963,515,092円

【お 知 ら せ】

- ①2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年7月1日)
- ②信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため(分散型に分類)、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行うための、所要の約款変更を行いました。
(2016年3月2日)

外国債券インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2016年5月12日

[計算期間：2015年5月13日～2016年5月12日]

「外国債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第15期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	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 (除く日本、円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
15期(2016年5月12日)	19,674	△ 6.1	109,931.94	△ 6.2	98.9	—	156,155

(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 (除く日本、 円換算ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年5月12日	円	%	117,169.90	%	%	%
5月末	20,959	—	119,576.28	—	98.8	—
6月末	21,469	2.4	117,821.48	2.1	97.3	—
7月末	21,143	0.9	119,513.99	0.6	98.7	—
8月末	21,435	2.3	119,513.99	2.0	98.8	—
9月末	21,102	0.7	117,759.56	0.5	98.1	—
10月末	21,048	0.4	117,295.48	0.1	98.8	—
11月末	21,064	0.5	117,390.65	0.2	98.7	—
12月末	21,049	0.4	117,622.76	0.4	98.9	—
2016年1月末	20,757	△1.0	115,735.90	△1.2	98.5	—
2月末	21,077	0.6	117,720.03	0.5	97.9	—
3月末	20,000	△4.6	111,665.52	△4.7	98.9	—
4月末	20,359	△2.9	113,814.57	△2.9	101.9	—
5月末	19,703	△6.0	109,994.30	△6.1	98.9	—
(期 末) 2016年5月12日	19,674	△6.1	109,931.94	△6.2	98.9	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

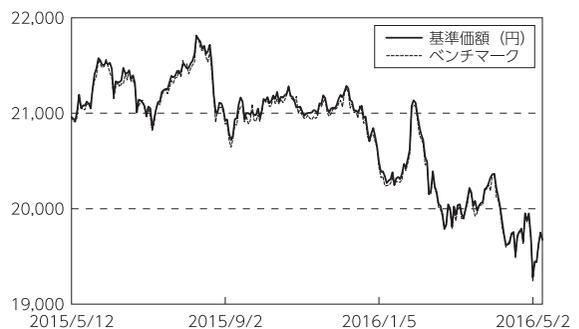
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.1%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−6.2%)を0.1%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎債券市況

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

◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、FRB（米連邦準備制度理事会）による政策金利の引き上げが意識されて米ドルが対円で上昇する局面もありましたが、世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に米ドルが対円で売られました。期首との比較では、米ドルは対円で9.8%下落しました。
- ・円・ユーロ相場は、ユーロ圏の景況感の改善などを背景に上昇する局面もありましたが、ECB（欧州中央銀行）が緩和的な金融政策を維持したことなどを背景に、ユーロが対円で売られました。期首との比較では、ユーロは対円で7.5%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6.2%の下落となったため、カイ離は0.1%程度となりました。

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

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は△0.0%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は△0.0%程度でした。

- ・カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.1%程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。

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

○今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016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	% 0.016	(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)	(0.016)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	3	0.016	
期中の平均基準価額は、20,850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。

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 34,058	百万円 1,659	% 4.9	百万円 27,994	百万円 1,524	% 5.4

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

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

外国公社債

(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	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額		うちBB格以下 組入比率	5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 577,850	千アメリカドル 606,327	千円 65,707,749	% 42.1	% —	% 17.5	% 16.2	% 8.4
カナダ	千カナダドル 33,700	千カナダドル 38,093	3,212,411	2.1	—	1.0	0.6	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 219,600	千メキシコペソ 243,999	1,471,314	0.9	—	0.6	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	77,700	93,979	11,635,561	7.5	—	4.4	2.0	1.0
イタリア	104,600	124,581	15,424,452	9.9	—	6.2	2.8	0.9
フランス	101,500	123,991	15,351,399	9.8	—	6.1	2.8	0.9
オランダ	25,100	30,364	3,759,462	2.4	—	1.5	0.6	0.3
スペイン	58,700	69,178	8,564,969	5.5	—	3.1	1.7	0.7
ベルギー	25,900	32,740	4,053,611	2.6	—	1.9	0.5	0.2
オーストリア	15,950	19,540	2,419,359	1.5	—	1.0	0.4	0.2
フィンランド	6,800	7,768	961,757	0.6	—	0.4	0.2	0.1
アイルランド	8,700	10,254	1,269,585	0.8	—	0.4	0.4	0.0
イギリス	千イギリスポンド 63,885	千イギリスポンド 78,380	12,268,091	7.9	—	5.7	1.7	0.5
スイス	千スイスフラン 3,200	千スイスフラン 3,813	425,649	0.3	—	0.1	0.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 50,300	千スウェーデンクローネ 58,286	776,956	0.5	—	0.3	0.2	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 33,000	千ノルウェークローネ 35,935	477,220	0.3	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 49,500	千デンマーククローネ 63,757	1,060,921	0.7	—	0.5	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 30,900	千ポーランドズロチ 32,499	909,011	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 31,350	千オーストラリアドル 34,943	2,792,339	1.8	—	1.1	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 6,440	千シンガポールドル 6,808	539,944	0.3	—	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 26,250	千マレーシアリンギット 26,441	713,120	0.5	—	0.2	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 102,750	千南アフリカランド 92,584	667,536	0.4	—	0.3	0.1	0.0
合 計	—	—	154,462,427	98.9	—	52.9	31.5	14.5

(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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ	国債証券	0.5	2,800	2,795	302,985	2017/7/31
	0.625 T-NOTE 170531	0.625	3,800	3,801	411,982	2017/5/31
	0.625 T-NOTE 170630	0.625	2,100	2,100	227,639	2017/6/30
	0.625 T-NOTE 170731	0.625	3,500	3,500	379,295	2017/7/31
	0.625 T-NOTE 170831	0.625	6,400	6,398	693,378	2017/8/31
	0.625 T-NOTE 170930	0.625	5,400	5,397	584,900	2017/9/30
	0.625 T-NOTE 171130	0.625	2,800	2,797	303,151	2017/11/30
	0.625 T-NOTE 180430	0.625	2,400	2,395	259,580	2018/4/30
	0.75 T-NOTE 170630	0.75	2,700	2,704	293,079	2017/6/30
	0.75 T-NOTE 171031	0.75	5,500	5,505	596,663	2017/10/31
	0.75 T-NOTE 171231	0.75	3,100	3,101	336,156	2017/12/31
	0.75 T-NOTE 180131	0.75	2,000	2,001	216,900	2018/1/31
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	4,000	4,002	433,767	2018/2/28
	0.75 T-NOTE 180331	0.75	2,900	2,901	314,481	2018/3/31
	0.75 T-NOTE 180415	0.75	1,800	1,800	195,165	2018/4/15
	0.75 T-NOTE 190215	0.75	3,000	2,992	324,309	2019/2/15
	0.875 T-NOTE 170430	0.875	3,800	3,812	413,141	2017/4/30
	0.875 T-NOTE 170515	0.875	2,800	2,809	304,419	2017/5/15
	0.875 T-NOTE 170615	0.875	2,700	2,708	293,501	2017/6/15
	0.875 T-NOTE 170715	0.875	1,800	1,805	195,660	2017/7/15
	0.875 T-NOTE 170815	0.875	1,600	1,604	173,913	2017/8/15
	0.875 T-NOTE 171015	0.875	1,800	1,805	195,637	2017/10/15
	0.875 T-NOTE 171115	0.875	2,300	2,306	249,961	2017/11/15
	0.875 T-NOTE 171130	0.875	2,100	2,105	228,190	2017/11/30
	0.875 T-NOTE 180115	0.875	1,400	1,403	152,138	2018/1/15
	0.875 T-NOTE 180131	0.875	2,300	2,306	249,981	2018/1/31
	0.875 T-NOTE 180331	0.875	400	401	43,474	2018/3/31
	0.875 T-NOTE 180715	0.875	2,200	2,205	239,000	2018/7/15
	0.875 T-NOTE 181015	0.875	3,600	3,606	390,878	2018/10/15
	0.875 T-NOTE 190415	0.875	2,800	2,800	303,518	2019/4/15
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	900	899	97,456	2019/7/31
	1 T-NOTE 170915	1.0	3,600	3,616	391,945	2017/9/15
	1 T-NOTE 171215	1.0	3,600	3,617	391,975	2017/12/15
	1 T-NOTE 171231	1.0	2,200	2,210	239,559	2017/12/31
	1 T-NOTE 180215	1.0	1,600	1,608	174,265	2018/2/15
	1 T-NOTE 180315	1.0	2,100	2,111	228,777	2018/3/15
	1 T-NOTE 180515	1.0	2,200	2,211	239,652	2018/5/15
	1 T-NOTE 180531	1.0	2,700	2,714	294,153	2018/5/31
	1 T-NOTE 180815	1.0	3,000	3,015	326,773	2018/8/15
	1 T-NOTE 180915	1.0	2,600	2,613	283,225	2018/9/15
	1 T-NOTE 190315	1.0	1,500	1,506	163,221	2019/3/15
	1 T-NOTE 190630	1.0	2,000	2,007	217,527	2019/6/30
	1 T-NOTE 190831	1.0	1,000	1,002	108,628	2019/8/31
	1 T-NOTE 190930	1.0	1,800	1,803	195,492	2019/9/30
	1 T-NOTE 191130	1.0	1,800	1,801	195,233	2019/11/30
	1.125 T-NOTE 180615	1.125	2,200	2,217	240,304	2018/6/15

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 190115	1.125	1,800	1,814	196,597	2019/1/15
		1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,600	1,612	174,733	2019/5/31
		1.125 T-NOTE 191231	1.125	2,600	2,612	283,104	2019/12/31
		1.125 T-NOTE 200331	1.125	2,000	2,007	217,501	2020/3/31
		1.125 T-NOTE 200430	1.125	2,700	2,708	293,490	2020/4/30
		1.125 T-NOTE 210228	1.125	3,300	3,292	356,754	2021/2/28
		1.25 T-NOTE 181031	1.25	2,400	2,426	262,953	2018/10/31
		1.25 T-NOTE 181115	1.25	3,100	3,134	339,634	2018/11/15
		1.25 T-NOTE 181130	1.25	2,500	2,527	273,909	2018/11/30
		1.25 T-NOTE 181215	1.25	2,000	2,022	219,169	2018/12/15
		1.25 T-NOTE 190131	1.25	2,400	2,426	262,993	2019/1/31
		1.25 T-NOTE 190430	1.25	1,500	1,517	164,421	2019/4/30
		1.25 T-NOTE 191031	1.25	2,800	2,828	306,529	2019/10/31
		1.25 T-NOTE 200131	1.25	3,500	3,530	382,554	2020/1/31
		1.25 T-NOTE 200229	1.25	1,800	1,814	196,673	2020/2/29
		1.25 T-NOTE 210331	1.25	2,300	2,305	249,854	2021/3/31
		1.375 T-NOTE 180630	1.375	1,600	1,621	175,728	2018/6/30
		1.375 T-NOTE 180731	1.375	2,000	2,027	219,669	2018/7/31
		1.375 T-NOTE 180930	1.375	2,500	2,535	274,777	2018/9/30
		1.375 T-NOTE 181130	1.375	1,200	1,217	131,898	2018/11/30
		1.375 T-NOTE 181231	1.375	2,000	2,029	219,931	2018/12/31
		1.375 T-NOTE 190228	1.375	2,100	2,131	230,963	2019/2/28
		1.375 T-NOTE 200131	1.375	2,300	2,330	252,600	2020/1/31
		1.375 T-NOTE 200229	1.375	2,800	2,835	307,252	2020/2/29
		1.375 T-NOTE 200331	1.375	2,800	2,834	307,205	2020/3/31
		1.375 T-NOTE 200430	1.375	3,700	3,744	405,793	2020/4/30
		1.375 T-NOTE 200531	1.375	2,400	2,428	263,196	2020/5/31
		1.375 T-NOTE 200831	1.375	3,100	3,132	339,463	2020/8/31
		1.375 T-NOTE 200930	1.375	3,500	3,534	383,058	2020/9/30
		1.375 T-NOTE 201031	1.375	2,500	2,524	273,528	2020/10/31
		1.375 T-NOTE 210131	1.375	3,500	3,530	382,584	2021/1/31
		1.5 T-NOTE 180831	1.5	3,600	3,660	396,715	2018/8/31
		1.5 T-NOTE 181231	1.5	2,900	2,951	319,846	2018/12/31
		1.5 T-NOTE 190131	1.5	2,900	2,952	319,920	2019/1/31
		1.5 T-NOTE 190228	1.5	2,600	2,647	286,890	2019/2/28
		1.5 T-NOTE 190331	1.5	1,000	1,018	110,389	2019/3/31
		1.5 T-NOTE 190531	1.5	2,800	2,852	309,137	2019/5/31
		1.5 T-NOTE 191031	1.5	3,100	3,156	342,062	2019/10/31
		1.5 T-NOTE 191130	1.5	3,100	3,155	342,009	2019/11/30
		1.5 T-NOTE 200531	1.5	3,200	3,252	352,473	2020/5/31
1.5 T-NOTE 220131	1.5	3,500	3,530	382,643	2022/1/31		
1.5 T-NOTE 230228	1.5	2,400	2,400	260,169	2023/2/28		
1.5 T-NOTE 230331	1.5	2,200	2,199	238,376	2023/3/31		
1.625 T-NOTE 190331	1.625	3,000	3,065	332,247	2019/3/31		
1.625 T-NOTE 190430	1.625	2,100	2,146	232,626	2019/4/30		
1.625 T-NOTE 190630	1.625	2,600	2,659	288,189	2019/6/30		
1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,700	1,738	188,431	2019/7/31		

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 190831	1.625	3,100	3,170	343,584	2019/8/31
		1.625 T-NOTE 191231	1.625	2,700	2,759	299,091	2019/12/31
		1.625 T-NOTE 200630	1.625	3,000	3,063	331,967	2020/6/30
		1.625 T-NOTE 200731	1.625	3,800	3,879	420,460	2020/7/31
		1.625 T-NOTE 201130	1.625	3,700	3,777	409,395	2020/11/30
		1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,700	1,721	186,546	2022/8/15
		1.625 T-NOTE 221115	1.625	2,900	2,931	317,661	2022/11/15
		1.625 T-NOTE 260215	1.625	5,500	5,445	590,074	2026/2/15
		1.75 T-NOTE 181031	1.75	500	511	55,465	2018/10/31
		1.75 T-NOTE 190930	1.75	2,800	2,875	311,590	2019/9/30
		1.75 T-NOTE 201031	1.75	3,500	3,590	389,103	2020/10/31
		1.75 T-NOTE 201231	1.75	2,700	2,769	300,165	2020/12/31
		1.75 T-NOTE 220228	1.75	2,700	2,758	298,976	2022/2/28
		1.75 T-NOTE 220331	1.75	2,600	2,655	287,793	2022/3/31
		1.75 T-NOTE 220430	1.75	2,800	2,858	309,765	2022/4/30
		1.75 T-NOTE 220515	1.75	2,500	2,551	276,555	2022/5/15
		1.75 T-NOTE 220930	1.75	2,300	2,342	253,827	2022/9/30
		1.75 T-NOTE 230131	1.75	2,500	2,541	275,475	2023/1/31
		1.75 T-NOTE 230515	1.75	4,300	4,372	473,891	2023/5/15
		1.875 T-NOTE 170831	1.875	1,900	1,930	209,176	2017/8/31
		1.875 T-NOTE 170930	1.875	1,700	1,728	187,294	2017/9/30
		1.875 T-NOTE 171031	1.875	2,500	2,543	275,655	2017/10/31
		1.875 T-NOTE 200630	1.875	1,800	1,857	201,245	2020/6/30
		1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,800	2,885	312,657	2021/11/30
		1.875 T-NOTE 220531	1.875	2,900	2,980	323,013	2022/5/31
		1.875 T-NOTE 220831	1.875	2,200	2,257	244,690	2022/8/31
		1.875 T-NOTE 221031	1.875	3,700	3,795	411,337	2022/10/31
		2 T-NOTE 200731	2.0	1,400	1,450	157,229	2020/7/31
		2 T-NOTE 200930	2.0	1,600	1,659	179,840	2020/9/30
		2 T-NOTE 201130	2.0	1,300	1,348	146,097	2020/11/30
		2 T-NOTE 210228	2.0	2,400	2,489	269,800	2021/2/28
		2 T-NOTE 210531	2.0	2,200	2,282	247,391	2021/5/31
		2 T-NOTE 210831	2.0	2,400	2,489	269,800	2021/8/31
		2 T-NOTE 211031	2.0	2,500	2,592	280,915	2021/10/31
		2 T-NOTE 211115	2.0	3,900	4,044	438,327	2021/11/15
		2 T-NOTE 220215	2.0	2,900	3,006	325,812	2022/2/15
		2 T-NOTE 220731	2.0	2,100	2,172	235,399	2022/7/31
		2 T-NOTE 221130	2.0	2,500	2,583	279,920	2022/11/30
		2 T-NOTE 230215	2.0	4,400	4,548	492,958	2023/2/15
		2 T-NOTE 250215	2.0	5,700	5,849	633,923	2025/2/15
		2 T-NOTE 250815	2.0	5,900	6,045	655,167	2025/8/15
		2.125 T-NOTE 200831	2.125	3,000	3,124	338,647	2020/8/31
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	2,300	2,398	259,961	2021/1/31	
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	2,300	2,401	260,233	2021/6/30	
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	3,300	3,444	373,322	2021/8/15	
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	2,500	2,608	282,735	2021/9/30	
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,800	2,921	316,640	2021/12/31	

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	2.125 T-NOTE 220630	2.125	2,600	2,708	293,538	2022/6/30
	2.125 T-NOTE 221231	2.125	2,700	2,811	304,668	2022/12/31
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	5,800	6,008	651,134	2025/5/15
	2.25 T-NOTE 171130	2.25	2,600	2,663	288,596	2017/11/30
	2.25 T-NOTE 180731	2.25	800	826	89,547	2018/7/31
	2.25 T-NOTE 210331	2.25	2,000	2,099	227,509	2021/3/31
	2.25 T-NOTE 210430	2.25	2,800	2,939	318,536	2021/4/30
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	2,300	2,415	261,733	2021/7/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	5,900	6,179	669,703	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	6,300	6,588	714,040	2025/11/15
	2.375 T-NOTE 170731	2.375	2,900	2,961	320,914	2017/7/31
	2.375 T-NOTE 180531	2.375	1,300	1,343	145,553	2018/5/31
	2.375 T-NOTE 180630	2.375	1,000	1,034	112,120	2018/6/30
	2.375 T-NOTE 201231	2.375	1,500	1,580	171,305	2020/12/31
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	5,900	6,239	676,197	2024/8/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	3,400	3,343	362,297	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	3,400	3,343	362,355	2046/2/15
	2.5 T-NOTE 170630	2.5	2,400	2,451	265,645	2017/6/30
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	3,700	3,952	428,347	2023/8/15
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	5,800	6,195	671,365	2024/5/15
	2.625 T-NOTE 180131	2.625	1,500	1,549	167,882	2018/1/31
	2.625 T-NOTE 180430	2.625	1,500	1,556	168,638	2018/4/30
	2.625 T-NOTE 200815	2.625	2,500	2,655	287,815	2020/8/15
	2.625 T-NOTE 201115	2.625	4,200	4,469	484,330	2020/11/15
	2.75 T-BOND 420815	2.75	2,100	2,192	237,604	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	3,400	3,543	384,031	2042/11/15
	2.75 T-NOTE 170531	2.75	1,100	1,124	121,898	2017/5/31
	2.75 T-NOTE 171231	2.75	1,700	1,756	190,374	2017/12/31
	2.75 T-NOTE 180228	2.75	1,500	1,554	168,441	2018/2/28
	2.75 T-NOTE 190215	2.75	1,300	1,368	148,337	2019/2/15
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	5,800	6,302	683,052	2023/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	4,400	4,781	518,215	2024/2/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	4,200	4,472	484,667	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	3,400	3,609	391,141	2045/8/15
	2.875 T-NOTE 180331	2.875	1,400	1,456	157,863	2018/3/31
	3 T-BOND 420515	3.0	1,500	1,642	178,010	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	3,300	3,592	389,359	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	3,900	4,244	459,987	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	3,200	3,481	377,317	2045/11/15
	3.125 T-BOND 411115	3.125	1,100	1,234	133,828	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	1,500	1,683	182,391	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	3,500	3,914	424,188	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	3,200	3,571	386,989	2044/8/15
	3.125 T-NOTE 170430	3.125	2,100	2,151	233,204	2017/4/30
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	2,700	2,882	312,406	2019/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	2,200	2,402	260,392	2021/5/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	3,900	4,559	494,063	2044/5/15

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
国債証券	3.375 T-NOTE 191115	3.375	3,300	3,575	387,460	2019/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	1,000	1,201	130,255	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 180215	3.5	1,600	1,678	181,865	2018/2/15
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	2,400	2,629	284,918	2020/5/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	4,500	5,512	597,427	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	3,600	4,404	477,363	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	1,700	1,848	200,363	2019/8/15
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	4,700	5,158	558,999	2020/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	3,700	4,115	445,984	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,300	1,615	175,066	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	3,600	4,510	488,823	2043/11/15
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	2,800	3,006	325,790	2018/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	1,400	1,771	191,958	2040/8/15
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	1,400	1,489	161,419	2018/5/15
	4 T-NOTE 180815	4.0	900	967	104,855	2018/8/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	800	1,068	115,820	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	1,400	1,870	202,745	2040/11/15
	4.25 T-NOTE 171115	4.25	1,500	1,580	171,273	2017/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	500	681	73,860	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	1,300	1,765	191,323	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	1,300	1,765	191,367	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,700	2,316	251,055	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	1,300	1,797	194,845	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	800	1,108	120,134	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	1,100	1,520	164,775	2039/8/15
	4.5 T-NOTE 170515	4.5	1,100	1,143	123,900	2017/5/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	1,800	2,529	274,159	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	1,600	2,292	248,478	2041/2/15
	4.75 T-NOTE 170815	4.75	2,400	2,524	273,569	2017/8/15
	5 T-BOND 370515	5.0	600	884	95,856	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	900	1,235	133,925	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	700	964	104,560	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	1,100	1,582	171,443	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815	5.5	600	837	90,751	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	700	971	105,319	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	650	939	101,800	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	600	797	86,403	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	700	1,070	116,040	2030/5/15
	6.5 T-BOND 261115	6.5	500	728	78,902	2026/11/15
	8 T-BOND 211115	8.0	1,200	1,629	176,616	2021/11/15
	8.125 T-BOND 190815	8.125	600	738	80,053	2019/8/15
	8.75 T-BOND 170515	8.75	1,500	1,624	176,041	2017/5/15
	8.75 T-BOND 200815	8.75	700	922	99,997	2020/8/15
	8.875 T-BOND 190215	8.875	1,000	1,221	132,325	2019/2/15
小 計					65,707,749	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.25 CAN GOVT 170501	0.25	800	797	67,281	2017/5/1

銘柄	銘柄	当期末					償還年月日
		利率	額面金額	評価額		千円	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
	国債証券	0.25 CAN GOVT 171101	0.25	1,100	1,095	92,378	2017/11/1
		0.25 CAN GOVT 180501	0.25	800	795	67,092	2018/5/1
		0.75 CAN GOVT 200901	0.75	1,300	1,307	110,228	2020/9/1
		0.75 CAN GOVT 210301	0.75	1,300	1,304	110,023	2021/3/1
		0.75 CAN GOVT 210901	0.75	400	400	33,735	2021/9/1
		1.25 CAN GOVT 170801	1.25	1,500	1,513	127,592	2017/8/1
		1.25 CAN GOVT 180201	1.25	1,600	1,619	136,580	2018/2/1
		1.25 CAN GOVT 180301	1.25	900	911	76,891	2018/3/1
		1.25 CAN GOVT 180901	1.25	1,100	1,118	94,311	2018/9/1
		1.5 CAN GOVT 170901	1.5	1,100	1,113	93,924	2017/9/1
		1.5 CAN GOVT 200301	1.5	700	723	61,043	2020/3/1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	1,200	1,243	104,873	2023/6/1
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	1,100	1,120	94,530	2026/6/1
		1.75 CAN GOVT 190301	1.75	900	930	78,492	2019/3/1
		1.75 CAN GOVT 190901	1.75	900	934	78,833	2019/9/1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,100	1,199	101,154	2025/6/1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,350	1,496	126,196	2024/6/1
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	1,200	1,334	112,507	2022/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	650	769	64,888	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	350	439	37,051	2064/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	1,000	1,126	94,968	2021/6/1
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	1,200	1,338	112,863	2020/6/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,400	1,882	158,734	2045/12/1
		3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,600	1,753	147,889	2019/6/1
		4 CAN GOVT 170601	4.0	950	984	83,025	2017/6/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	1,500	2,096	176,821	2041/6/1
		4.25 CAN GOVT 180601	4.25	1,100	1,183	99,808	2018/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	1,150	1,754	147,985	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	950	1,413	119,164	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,200	1,887	159,180	2033/6/1
		8 CAN GOVT 270601	8.0	300	502	42,355	2027/6/1
小	計					3,212,411	
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	22,400	28,726	173,220	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	5,200	7,219	43,533	2036/11/20
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	17,700	17,787	107,258	2018/6/14
		5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	9,700	9,794	59,061	2017/6/15
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	12,700	12,658	76,330	2019/12/11
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	5,200	5,134	30,962	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	20,900	21,925	132,209	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	9,700	10,160	61,265	2022/6/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	7,700	8,575	51,707	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	14,300	15,120	91,179	2017/12/14
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	12,200	13,782	83,108	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	7,400	8,367	50,453	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	12,800	14,575	87,888	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	10,900	12,025	72,513	2020/6/11

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	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	8,200	9,328	56,252	2023/12/7
		8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	23,400	25,565	154,162	2018/12/13
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	9,100	10,924	65,875	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	10,100	12,326	74,331	2038/11/18
小 計						1,471,314	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 OBL 200417	—	1,700	1,732	214,455	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	1,200	1,222	151,409	2021/4/9
		0 SCHATS 170616	—	1,400	1,407	174,287	2017/6/16
		0 SCHATS 170915	—	1,300	1,309	162,071	2017/9/15
		0 SCHATS 171215	—	1,100	1,108	137,294	2017/12/15
		0 SCHATS 180316	—	900	908	112,482	2018/3/16
		0.25 OBL 180413	0.25	1,500	1,522	188,491	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	1,800	1,847	228,696	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	1,600	1,649	204,236	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	2,200	2,298	284,543	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	1,500	1,554	192,447	2026/2/15
		0.5 OBL 171013	0.5	1,300	1,318	163,262	2017/10/13
		0.5 OBL 180223	0.5	1,900	1,934	239,532	2018/2/23
		0.5 OBL 190412	0.5	1,400	1,442	178,560	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	1,700	1,852	229,314	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	2,000	2,174	269,212	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	1,300	1,348	166,940	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,400	1,460	180,778	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	1,500	1,671	206,988	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,600	1,790	221,709	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,500	1,683	208,427	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,700	1,921	237,902	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	2,100	2,367	293,112	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,600	1,837	227,453	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	2,100	2,380	294,698	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	1,600	1,859	230,187	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	1,400	1,566	193,908	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,300	1,483	183,647	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,700	1,933	239,428	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,550	2,208	273,436	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,300	1,876	232,319	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,800	2,061	255,216	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	2,100	2,390	295,920	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,700	2,021	250,257	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	1,300	2,056	254,635	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	2,000	2,254	279,092	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	2,300	2,562	317,254	2019/1/4
		4 BUND 180104	4.0	1,700	1,827	226,273	2018/1/4
		4 BUND 370104	4.0	2,200	3,620	448,272	2037/1/4
		4.25 BUND 170704	4.25	1,500	1,581	195,855	2017/7/4
		4.25 BUND 180704	4.25	1,900	2,095	259,445	2018/7/4

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	4.25 BUND 390704	4.25	1,000	1,752	216,933	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	1,150	1,773	219,538	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,850	3,190	394,971	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,600	3,016	373,430	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,400	2,414	298,914	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,350	2,194	271,708	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	900	1,345	166,608	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	900	1,617	200,237	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	900	1,532	189,758	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	1,900	1,911	236,638	2018/5/15
		0.3 ITALY GOVT 181015	0.3	700	705	87,299	2018/10/15
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	900	912	112,961	2020/11/1
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	1,200	1,222	151,313	2020/5/1
		0.75 ITALY GOVT 180115	0.75	1,500	1,520	188,259	2018/1/15
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	600	601	74,468	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	1,900	1,961	242,848	2019/12/1
		1.15 ITALY GOVT 170515	1.15	1,200	1,215	150,436	2017/5/15
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,800	1,869	231,404	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	1,500	1,561	193,329	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,300	1,358	168,220	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,900	1,920	237,732	2025/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,300	1,238	153,339	2032/3/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,300	1,361	168,558	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,500	1,627	201,491	2021/12/15
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	550	541	67,016	2036/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,200	1,286	159,254	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	2,200	2,411	298,557	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	900	897	111,089	2047/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,200	1,340	165,954	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 171101	3.5	1,500	1,578	195,465	2017/11/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	2,300	2,466	305,365	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,600	1,742	215,776	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	2,000	2,381	294,865	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	2,000	2,317	286,892	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,400	1,625	201,258	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,600	3,034	375,648	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,800	2,149	266,148	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	2,000	2,316	286,843	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,300	2,894	358,359	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	2,300	2,565	317,596	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	2,600	2,953	365,685	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	2,400	2,770	342,978	2020/3/1
4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	2,200	2,372	293,736	2018/2/1		
4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	2,200	2,420	299,661	2018/8/1		
4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	2,000	2,250	278,646	2019/3/1		
4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	2,400	2,785	344,835	2020/2/1		
4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,400	1,737	215,081	2023/5/1		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,200	2,746	340,055	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,600	2,036	252,186	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 170501	4.75	1,300	1,361	168,558	2017/5/1
		4.75 ITALY GOVT 170601	4.75	1,200	1,261	156,134	2017/6/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	2,300	2,807	347,624	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	2,100	2,652	328,368	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	2,000	2,642	327,192	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,400	1,977	244,868	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,800	2,242	277,681	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	2,400	3,122	386,614	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,100	2,956	366,055	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,700	2,437	301,845	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	2,000	2,862	354,418	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 170801	5.25	1,800	1,917	237,366	2017/8/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,500	3,486	431,632	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	2,100	2,709	335,466	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	2,000	2,587	320,321	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,350	2,027	250,991	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,650	3,997	494,949	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,450	3,653	452,347	2027/11/1
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	1,000	1,544	191,162	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,100	1,725	213,595	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O. A. T 180225	—	2,300	2,318	287,055	2018/2/25
		0 O. A. T 190225	—	500	505	62,597	2019/2/25
		0 O. A. T 200525	—	2,100	2,125	263,147	2020/5/25
		0.25 O. A. T 201125	0.25	2,000	2,044	253,129	2020/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	2,900	2,987	369,892	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	3,000	3,044	376,964	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	400	400	49,628	2026/5/25
		1 BTAN 170725	1.0	1,600	1,628	201,612	2017/7/25
		1 O. A. T 180525	1.0	2,000	2,058	254,875	2018/5/25
		1 O. A. T 181125	1.0	1,900	1,968	243,766	2018/11/25
		1 O. A. T 190525	1.0	2,000	2,085	258,143	2019/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	2,100	2,217	274,535	2025/11/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	600	601	74,494	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	900	970	120,103	2031/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	2,700	3,028	375,003	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	2,500	2,818	348,927	2024/11/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	250	244	30,282	2066/5/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	2,600	2,985	369,676	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	3,300	3,850	476,784	2024/5/25
		2.5 O. A. T 201025	2.5	3,300	3,708	459,154	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	2,500	3,045	377,063	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	3,900	4,818	596,596	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	3,700	4,386	543,119	2022/4/25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	4,000	4,745	587,527	2021/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	1,650	2,352	291,322	2045/5/25

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	3.5 O.A.T 200425	3.5	3,200	3,685	456,254	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	3,300	4,288	530,940	2026/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	3,000	3,429	424,581	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	3,100	3,711	459,556	2021/4/25
		4 O.A.T 180425	4.0	3,200	3,479	430,739	2018/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	2,450	3,755	464,996	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,400	2,362	292,466	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	1,050	1,799	222,742	2060/4/25
		4.25 O.A.T 171025	4.25	3,400	3,634	449,957	2017/10/25
		4.25 O.A.T 181025	4.25	2,700	3,011	372,880	2018/10/25
		4.25 O.A.T 190425	4.25	2,500	2,845	352,347	2019/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	3,700	4,855	601,160	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	2,300	3,850	476,764	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	2,300	3,736	462,554	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	2,500	3,977	492,392	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	2,700	4,673	578,650	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	2,100	3,210	397,541	2025/10/25
		8.5 O.A.T 191025	8.5	1,000	1,308	161,993	2019/10/25
8.5 O.A.T 230425	8.5	900	1,433	177,472	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	900	908	112,437	2018/4/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	1,400	1,436	177,814	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,400	1,405	173,957	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	500	507	62,876	2026/7/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	1,500	1,543	191,147	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	1,500	1,569	194,350	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,400	1,582	195,954	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,400	1,620	200,573	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,400	1,611	199,516	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,100	1,413	174,991	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	1,000	1,468	181,852	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,500	1,776	219,951	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	1,300	1,513	187,389	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	400	504	62,412	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,300	2,158	267,222	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	1,300	1,427	176,726	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	1,300	1,485	183,945	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,300	2,099	259,914	2037/1/15
4.5 NETH GOVT 170715	4.5	1,300	1,376	170,417	2017/7/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,200	1,897	234,974	2028/1/15		
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	700	1,058	131,036	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	1,600	1,610	199,344	2018/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25	400	402	49,860	2019/1/31
		0.5 SPAIN GOVT 171031	0.5	1,600	1,613	199,809	2017/10/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	200	202	25,019	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	1,600	1,654	204,860	2020/7/30
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	2,200	2,296	284,339	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,800	1,825	226,033	2025/4/30

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,100	1,135	140,535	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	750	740	91,682	2030/7/30
		2.1 SPAIN GOVT 170430	2.1	1,400	1,430	177,104	2017/4/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	1,900	2,004	248,141	2025/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,900	2,051	253,975	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,500	2,774	343,448	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	500	503	62,285	2046/10/31
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	1,700	1,859	230,177	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,900	2,261	279,969	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	2,000	2,292	283,834	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	1,800	1,966	243,416	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,500	1,901	235,412	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	2,000	2,286	283,042	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,600	1,978	244,985	2023/10/31
		4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	2,200	2,372	293,777	2018/1/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,700	1,944	240,733	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,700	2,161	267,642	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,250	1,702	210,794	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,500	1,901	235,440	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,600	1,914	237,091	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,200	1,672	207,079	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	1,500	2,034	251,922	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	1,150	1,680	208,104	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	2,000	2,587	320,407	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 170730	5.5	1,900	2,029	251,329	2017/7/30
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	2,100	2,617	324,078	2021/4/30
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,650	2,454	303,865	2032/7/30		
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	2,100	2,716	336,363	2022/1/31		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,200	1,678	207,829	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	2,000	2,917	361,228	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,500	1,556	192,688	2025/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	600	627	77,740	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	100	99	12,365	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	1,100	1,140	141,202	2018/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	350	349	43,294	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	250	276	34,208	2038/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,200	1,388	171,957	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,400	1,668	206,588	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	1,300	1,450	179,551	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	750	978	121,151	2034/6/22
		3.5 BEL GOVT 170628	3.5	1,300	1,358	168,203	2017/6/28
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,600	1,887	233,634	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	800	1,229	152,212	2045/6/22
		4 BEL GOVT 180328	4.0	1,000	1,084	134,271	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	1,100	1,242	153,780	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,300	1,619	200,450	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	800	1,152	142,718	2032/3/28

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	
ベルギー	国債証券	4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,500	1,860	230,388	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,500	1,915	237,167	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,450	2,333	288,908	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	900	1,256	155,532	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,800	2,978	368,718	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 170928	5.5	600	649	80,436	2017/9/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,700	2,636	326,439	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	700	715	88,595	2019/10/18
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	300	307	38,032	2026/10/20
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	600	623	77,186	2018/10/19
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	800	863	106,947	2025/10/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	1,000	1,124	139,205	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	800	904	111,934	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	600	643	79,731	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	500	618	76,539	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	650	946	117,201	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	900	1,106	137,013	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,350	1,620	200,588	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	800	981	121,576	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	300	539	66,747	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	1,200	1,414	175,166	2020/7/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,050	1,655	204,906	2037/3/15
		4.3 AUSTRIA GOVT 170915	4.3	700	744	92,235	2017/9/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	1,000	1,136	140,672	2019/3/15
4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	1,200	1,303	161,408	2018/1/15		
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	800	1,147	142,054	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	700	1,143	141,613	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	500	514	63,703	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	400	403	49,947	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	300	297	36,881	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	300	314	38,998	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	300	311	38,532	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	400	441	54,696	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	500	554	68,615	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	400	458	56,813	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	400	547	67,825	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	500	626	77,622	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	500	573	70,967	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	500	592	73,363	2021/4/15
		3.875 FINNISH GOVT170915	3.875	600	635	78,672	2017/9/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	600	803	99,520	2025/7/4
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	600	691	85,596	2019/7/4		
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	500	517	64,059	2022/3/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	400	405	50,172	2026/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	450	467	57,884	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	700	799	98,956	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	700	849	105,161	2024/3/18

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
アイルランド	国債証券	3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	500	617	76,502	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	700	800	99,138	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	750	838	103,763	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	1,000	1,180	146,139	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	800	977	121,051	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,100	1,533	189,897	2025/3/13
		5.5 IRISH GOVT 171018	5.5	500	542	67,120	2017/10/18
		5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	600	724	89,737	2019/10/18
小 計						63,440,158	
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	2,600	2,621	410,329	2017/9/7	
	1.25 GILT 180722	1.25	2,600	2,649	414,724	2018/7/22	
	1.5 GILT 210122	1.5	1,900	1,960	306,874	2021/1/22	
	1.5 GILT 260722	1.5	500	498	78,083	2026/7/22	
	1.75 GILT 190722	1.75	2,100	2,180	341,231	2019/7/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	2,200	2,301	360,218	2022/9/7	
	2 GILT 200722	2.0	2,500	2,633	412,156	2020/7/22	
	2 GILT 250907	2.0	2,000	2,105	329,615	2025/9/7	
	2.25 GILT 230907	2.25	2,000	2,153	337,003	2023/9/7	
	2.5 GILT 650722	2.5	350	392	61,492	2065/7/22	
	2.75 GILT 240907	2.75	2,100	2,341	366,475	2024/9/7	
	3.25 GILT 440122	3.25	2,200	2,642	413,539	2044/1/22	
	3.5 GILT 450122	3.5	2,150	2,705	423,491	2045/1/22	
	3.5 GILT 680722	3.5	1,750	2,524	395,128	2068/7/22	
	3.75 GILT 190907	3.75	1,800	1,994	312,149	2019/9/7	
	3.75 GILT 200907	3.75	1,500	1,698	265,794	2020/9/7	
	3.75 GILT 210907	3.75	1,700	1,958	306,555	2021/9/7	
	3.75 GILT 520722	3.75	1,300	1,821	285,110	2052/7/22	
	4 GILT 220307	4.0	1,300	1,532	239,857	2022/3/7	
	4 GILT 600122	4.0	1,150	1,775	277,934	2060/1/22	
	4.25 GILT 271207	4.25	1,100	1,410	220,733	2027/12/7	
	4.25 GILT 320607	4.25	1,800	2,368	370,708	2032/6/7	
	4.25 GILT 360307	4.25	1,885	2,527	395,589	2036/3/7	
	4.25 GILT 390907	4.25	1,300	1,780	278,741	2039/9/7	
	4.25 GILT 401207	4.25	1,750	2,422	379,132	2040/12/7	
	4.25 GILT 461207	4.25	1,550	2,238	350,310	2046/12/7	
	4.25 GILT 491207	4.25	1,250	1,862	291,557	2049/12/7	
	4.25 GILT 551207	4.25	1,600	2,524	395,144	2055/12/7	
	4.5 GILT 190307	4.5	1,500	1,673	261,967	2019/3/7	
	4.5 GILT 340907	4.5	2,000	2,740	428,864	2034/9/7	
	4.5 GILT 421207	4.5	1,700	2,470	386,753	2042/12/7	
	4.75 GILT 200307	4.75	1,800	2,083	326,095	2020/3/7	
	4.75 GILT 301207	4.75	1,600	2,192	343,242	2030/12/7	
4.75 GILT 381207	4.75	1,350	1,963	307,307	2038/12/7		
5 GILT 180307	5.0	1,900	2,063	323,052	2018/3/7		
5 GILT 250307	5.0	1,550	2,030	317,777	2025/3/7		
6 GILT 281207	6.0	1,100	1,652	258,662	2028/12/7		

銘	柄	当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円		
	国債証券	8 GILT 210607	8.0	1,100	1,494	233,912	2021/6/7
		8.75 GILT 170825	8.75	350	388	60,769	2017/8/25
小 計						12,268,091	
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	320	364	40,708	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	450	508	56,751	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 180108	3.0	550	584	65,270	2018/1/8
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	490	548	61,180	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	440	578	64,623	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	500	754	84,194	2028/4/8
		4.25 SWISS GOVT 170605	4.25	450	474	52,920	2017/6/5
小 計						425,649	
スウェーデン			千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ			
	国債証券	1 SWD GOVT 261112	1.0	4,300	4,419	58,918	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	6,800	7,382	98,409	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	5,500	6,469	86,240	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	7,700	9,265	123,506	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	4,000	5,400	71,990	2039/3/30
		3.75 SWD GOVT 170812	3.75	5,700	6,011	80,135	2017/8/12
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	8,100	9,185	122,437	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	8,200	10,151	135,318	2020/12/1
	小 計						776,956
ノルウェー			千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ			
	国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	2,000	2,030	26,959	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	3,400	3,540	47,023	2025/3/13
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	4,600	4,887	64,912	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	4,200	4,779	63,467	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	6,600	7,532	100,028	2021/5/25
		4.25 NORWE GOVT 170519	4.25	5,800	6,015	79,889	2017/5/19
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	6,400	7,149	94,940	2019/5/22
小 計						477,220	
デンマーク			千デンマーククローネ	千デンマーククローネ			
	国債証券	0.25 DMK GOVT 181115	0.25	3,000	3,048	50,728	2018/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	5,200	5,743	95,565	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	6,500	7,321	121,826	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	8,200	9,609	159,910	2021/11/15
		4 DMK GOVT 171115	4.0	4,700	5,020	83,533	2017/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	8,400	9,685	161,161	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	11,400	20,004	332,878	2039/11/15
	7 DMK GOVT 241110	7.0	2,100	3,324	55,316	2024/11/10	
小 計						1,060,921	
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	2,600	2,553	71,416	2020/4/25
		1.75 POLAND 210725	1.75	1,100	1,069	29,917	2021/7/25
		2 POLAND 210425	2.0	2,400	2,377	66,486	2021/4/25
		2.5 POLAND 180725	2.5	2,200	2,241	62,681	2018/7/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	2,000	1,909	53,403	2026/7/25

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
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	3.25 POLAND 190725	3.25	1,900	1,985	55,542	2019/7/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	2,600	2,674	74,812	2025/7/25
	3.75 POLAND 180425	3.75	1,700	1,771	49,546	2018/4/25
	4 POLAND 231025	4.0	2,400	2,610	73,015	2023/10/25
	5.25 POLAND 171025	5.25	2,100	2,212	61,882	2017/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	1,500	1,706	47,732	2020/10/25
	5.5 POLAND 191025	5.5	1,800	2,020	56,508	2019/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	1,400	1,647	46,081	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	2,000	2,383	66,674	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	800	1,003	28,076	2029/4/25
	POLAND 170725	—	1,200	1,179	32,991	2017/7/25
	POLAND 181025	—	1,200	1,152	32,241	2018/10/25
小 計					909,011	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	1.75	1,100	1,100	87,904	2020/11/21
	2.75 AUST GOVT 191021	2.75	1,700	1,764	140,980	2019/10/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	2,200	2,291	183,096	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	800	825	65,998	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	500	486	38,890	2035/6/21
	3.25 AUST GOVT 181021	3.25	1,300	1,351	107,968	2018/10/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	2,300	2,484	198,553	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	800	862	68,913	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	400	411	32,883	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	750	839	67,052	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 170721	4.25	1,550	1,596	127,603	2017/7/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,500	2,929	234,096	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	2,100	2,326	185,907	2020/4/15
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	950	1,173	93,772	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	2,300	2,825	225,824	2027/4/21
	5.25 AUST GOVT 190315	5.25	2,200	2,422	193,582	2019/3/15
	5.5 AUST GOVT 180121	5.5	2,100	2,235	178,656	2018/1/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,900	2,321	185,483	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,900	2,256	180,318	2021/5/15
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	2,000	2,438	194,850	2022/7/15
小 計					2,792,339	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
国債証券	0.5 SINGAPORGOVT 180401	0.5	600	594	47,129	2018/4/1
	1.375 SINGAPORGOV 171001	1.375	100	100	7,985	2017/10/1
	1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	150	152	12,057	2019/10/1
	2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	250	256	20,343	2020/7/1
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	600	618	49,091	2021/6/1
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	150	154	12,283	2025/6/1
	2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	600	624	49,498	2019/6/1
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	400	422	33,516	2023/7/1
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	450	475	37,723	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	150	157	12,462	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	150	160	12,722	2029/7/1

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
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	2.875SINGAPORGOVT 300901	400	425	33,779	2030/9/1
		3.SINGAPORGOVT 240901	600	646	51,259	2024/9/1
		3.125SINGAPORGOVT 220901	470	508	40,306	2022/9/1
		3.25.SINGAPORGOVT 200901	400	430	34,157	2020/9/1
		3.375.SINGAPORGOVT 330901	200	227	18,050	2033/9/1
		3.5.SINGAPORGOVT 270301	470	531	42,177	2027/3/1
		4.SINGAPORGOVT 180901	300	320	25,399	2018/9/1
小 計					539,944	
マレーシア			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	3.26.MALAYSIAGOV 180301	900	903	24,360	2018/3/1
		3.314.MALAYSIA 171031	1,100	1,105	29,819	2017/10/31
		3.418.MALAYSIAGOV 220815	900	879	23,730	2022/8/15
		3.48.MALAYSIAGOV 230315	1,200	1,173	31,654	2023/3/15
		3.492.MALAYSIAGOV 200331	900	899	24,256	2020/3/31
		3.502.MALAYSIAGOV 270531	800	750	20,252	2027/5/31
		3.58.MALAYSIAGOV 180928	800	806	21,742	2018/9/28
		3.654.MALAYSIAGOV 191031	700	705	19,027	2019/10/31
		3.659.MALAYSIAGOV 201015	1,000	1,007	27,185	2020/10/15
		3.733.MALAYSIAGO 280615	600	572	15,435	2028/6/15
		3.759.MALAYSIAGOV 190315	450	456	12,311	2019/3/15
		3.795.MALAYSIAGOV 220930	900	898	24,244	2022/9/30
		3.8.MALAYSIAGOV 230817	200	200	5,400	2023/8/17
		3.844.MALAYSIAGOV 330415	300	281	7,590	2033/4/15
		3.889.MALAYSIAGO 200731	700	710	19,154	2020/7/31
		3.892.MALAYSIAGOV 270315	500	488	13,177	2027/3/15
		3.955.MALAYSIAGOV 250915	1,150	1,154	31,131	2025/9/15
		4.012.MALAYSIAGOV 170915	1,500	1,520	40,997	2017/9/15
		4.048.MALAYSIA 210930	900	915	24,688	2021/9/30
		4.127.MALAYSIA 320415	700	682	18,399	2032/4/15
		4.16.MALAYSIAGOV 210715	1,200	1,228	33,138	2021/7/15
		4.181.MALAYSIAGOV 240715	1,400	1,423	38,381	2024/7/15
		4.232.MALAYSIAGOV 310630	300	301	8,128	2031/6/30
		4.24.MALAYSIAGOV 180207	1,200	1,224	33,022	2018/2/7
		4.254.MALAYSIAGOV 350531	350	347	9,376	2035/5/31
		4.378.MALAYSIAGOV 191129	1,900	1,960	52,866	2019/11/29
		4.392.MALAYSIAGOV 260415	1,000	1,026	27,696	2026/4/15
		4.498.MALAYSIAGOV 300415	1,200	1,229	33,155	2030/4/15
		4.935.MALAYSIAGOV 430930	600	619	16,699	2043/9/30
		5.248.MALAYSIA 280915	200	219	5,909	2028/9/15
		5.734.MALAYSIAGOV 190730	700	748	20,186	2019/7/30
小 計					713,120	
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	15,000	16,338	117,800	2026/12/21
		6.25.SOUTH AFRICA 360331	7,350	5,129	36,980	2036/3/31
		6.5.SOUTH AFRICA 410228	7,200	4,977	35,889	2041/2/28
		6.75.SOUTH AFRICA 210331	5,700	5,267	37,981	2021/3/31
		7.SOUTH AFRICA 310228	8,000	6,367	45,912	2031/2/28

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		
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	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	5,500	5,280	38,069	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	5,000	4,701	33,899	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	4,100	4,074	29,374	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	8,500	7,491	54,016	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	5,000	5,021	36,207	2017/9/15
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	5,800	5,123	36,938	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	7,000	6,179	44,556	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	5,000	4,440	32,014	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	9,700	8,597	61,984	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	2,500	2,308	16,641	2035/2/28
		9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	1,400	1,285	9,268	2040/1/31
小	計					667,536	
合	計					154,462,427	

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

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	154,462,427	98.7
コール・ローン等、その他	2,009,882	1.3
投資信託財産総額	156,472,309	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (156,139,125千円) の投資信託財産総額 (156,472,309千円) 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=108.37円	1 カナダドル=84.33円	1 メキシコペソ=6.03円	1 ユーロ=123.81円
1 イギリスポンド=156.52円	1 スイスフラン=111.63円	1 スウェーデンクローネ=13.33円	1 ノルウェークローネ=13.28円
1 デンマーククローネ=16.64円	1 ポーランドズロチ=27.97円	1 オーストラリアドル=79.91円	1 シンガポールドル=79.31円
1 マレーシアリングgit=26.97円	1 南アフリカランド=7.21円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	156,494,614,094
コール・ローン等	682,983,499
公社債(評価額)	154,462,427,243
未収入金	22,304,800
未収利息	1,211,101,821
前払費用	115,796,731
(B) 負債	338,964,146
未払金	312,238,067
未払解約金	26,725,867
未払利息	87
その他未払費用	125
(C) 純資産総額(A-B)	156,155,649,948
元本	79,369,567,734
次期繰越損益金	76,786,082,214
(D) 受益権総口数	79,369,567,734口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,674円

<注記事項>

- ①期首元本額 76,187,578,939円
 期中追加設定元本額 20,858,565,795円
 期中一部解約元本額 17,676,577,000円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.9674円です。

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

ファンド・マネジャー(海外債券)	1,807,611,362円
eMAXIS 先進国債券インデックス	11,534,490,043円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,137,218,484円
eMAXIS バランス(波乗り型)	226,352,324円
コアバランス	1,700,783円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	6,437,009,006円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	16,634,896,304円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,373,592,301円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	2,212,693,687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)	13,634,758,617円
三菱UFJ バランスファンドVA50型(適格機関投資家限定)	9,105,298,351円
三菱UFJ バランスファンドVA75型(適格機関投資家限定)	2,745,502,453円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	650,178,523円
三菱UFJ バランスファンドVA45型(適格機関投資家限定)	218,583,584円
三菱UFJ バランスファンドVA30型(適格機関投資家限定)	80,427,144円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	2,835,690,297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)	43,989,417円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	7,156,437円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	14,999,999円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	25,991,372円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	9,528,671円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	164,114,246円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	72,157,907円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	148,729,507円

○損益の状況 (2015年5月13日~2016年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,659,008,119
受取利息	3,659,020,893
支払利息	△ 12,774
(B) 有価証券売買損益	△13,252,708,283
売買益	3,569,021,473
売買損	△16,821,729,756
(C) 保管費用等	△ 24,140,834
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 9,617,840,998
(E) 前期繰越損益金	83,496,410,946
(F) 追加信託差損益金	22,468,546,126
(G) 解約差損益金	△19,561,033,860
(H) 計(D+E+F+G)	76,786,082,214
次期繰越損益金(H)	76,786,082,214

- (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。

三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	134,129,874円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	267,768,500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)	2,079,264,410円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	2,023,133,189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)	197,198,794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)	514,854,998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)	351,395,677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)	116,981,812円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	240,934,647円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	294,341,698円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	24,926円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	24,156円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	23,736円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	15,888,517円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	2,317,658円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	6,470,155円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	954,709円
eMAXIS 最適化バランス (マイフoward)	1,152,296円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	37,163円
合計	79,369,567,734円

【お知らせ】

- ①2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年7月1日)
- ②信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため(分散型に分類)、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行うための、所要の約款変更を行いました。
(2016年3月2日)

新興国債券インデックスマザーファンド

《第6期》決算日2016年1月26日

[計算期間：2015年1月27日～2016年1月26日]

「新興国債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第6期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第6期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

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

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		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)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年 1 月 26 日	円 14,203	% —	32,849.46	% —	% 95.0	% —
1 月 末	14,191	△ 0.1	32,771.81	△ 0.2	94.3	—
2 月 末	14,020	△ 1.3	32,442.87	△ 1.2	95.2	—
3 月 末	13,688	△ 3.6	31,531.29	△ 4.0	94.5	—
4 月 末	14,016	△ 1.3	32,461.89	△ 1.2	95.0	—
5 月 末	14,132	△ 0.5	32,557.20	△ 0.9	95.2	—
6 月 末	13,755	△ 3.2	31,765.24	△ 3.3	93.9	—
7 月 末	13,571	△ 4.4	31,302.36	△ 4.7	94.9	—
8 月 末	12,618	△ 11.2	29,219.41	△ 11.1	95.1	—
9 月 末	11,947	△ 15.9	27,639.62	△ 15.9	93.5	—
10 月 末	12,612	△ 11.2	29,247.64	△ 11.0	95.0	—
11 月 末	12,615	△ 11.2	29,451.50	△ 10.3	96.0	—
12 月 末	12,193	△ 14.2	28,342.51	△ 13.7	95.1	—
(期 末) 2016年 1 月 26 日	11,515	△ 18.9	26,826.64	△ 18.3	95.9	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ18.9%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎債券市況

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

◎為替市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは18.3%の下落となったため、ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.6\%$ 程度となりました。

	ポートフォリオ 要因	管理コスト 等 要因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	$\Delta 0.4\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度	0.0%程度	$\Delta 0.6\%$ 程度

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は $\Delta 0.4\%$ 程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。

・カストディーフィー、取引コスト、税金等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.0%程度でした。

・為替の効果および債券の効果による要因です。

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

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

◎今後の運用方針

・今後の運用についても、運用方針を堅持します。

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年1月27日～2016年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 17	% 0.128	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(16)	(0.122)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.000)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（ そ の 他 ）	(1)	(0.006)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	17	0.128	
期中の平均基準価額は、13,279円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年1月27日～2016年1月26日)

公社債

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

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2015年1月27日～2016年1月26日)

利害関係人との取引状況

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

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

○組入資産の明細

(2016年1月26日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

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

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

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

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
コロンビア		%	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ	千円	
国債証券	7.75 COLOMBI (GL) 210414	7.75	1,310,000	1,323,100	46,043	2021/4/14
	7.75 TITULOS DE T 300918	7.75	1,750,000	1,504,422	52,353	2030/9/18
	9.85 COLOMBI (GL) 270628	9.85	1,290,000	1,448,670	50,413	2027/6/28
小 計					536,486	
ペルー			千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル		
国債証券	5.2 PERU 230912	5.2	300	267	9,106	2023/9/12
	5.7 PERU 240812	5.7	1,000	903	30,792	2024/8/12
	6.9 PERU 370812	6.9	600	534	18,226	2037/8/12
	6.95 PERU 310812	6.95	1,400	1,290	44,017	2031/8/12
	7.84 PERU 200812	7.84	750	788	26,901	2020/8/12
	8.2 PERU 260812	8.2	900	949	32,367	2026/8/12
小 計					161,413	
トルコ			千トルコリラ	千トルコリラ		
国債証券	10.4 TURKEY GOVT 190327	10.4	1,100	1,086	42,479	2019/3/27
	10.4 TURKEY GOVT 240320	10.4	1,000	974	38,118	2024/3/20
	10.5 TURKEY GOVT 200115	10.5	1,400	1,390	54,352	2020/1/15
	6.3 TURKEY GOVT 180214	6.3	1,400	1,284	50,217	2018/2/14
	7.1 TURKEY GOVT 230308	7.1	2,000	1,635	63,939	2023/3/8
	7.4 TURKEY GOVT 200205	7.4	1,600	1,425	55,718	2020/2/5
	8 TURKEY GOVT 250312	8.0	2,200	1,848	72,267	2025/3/12
	8.3 TURKEY GOVT 180620	8.3	1,600	1,514	59,214	2018/6/20
	8.5 TURKEY GOVT 190710	8.5	2,000	1,865	72,944	2019/7/10
	8.5 TURKEY GOVT 220914	8.5	1,400	1,249	48,868	2022/9/14
	8.8 TURKEY GOVT 181114	8.8	1,600	1,520	59,462	2018/11/14
	8.8 TURKEY GOVT 230927	8.8	1,800	1,611	62,999	2023/9/27
	9 TURKEY GOVT 170308	9.0	1,700	1,665	65,122	2017/3/8
	9 TURKEY GOVT 240724	9.0	1,700	1,538	60,141	2024/7/24
	9.4 TURKEY GOVT 200708	9.4	1,400	1,331	52,069	2020/7/8
	9.5 TURKEY GOVT 220112	9.5	1,500	1,414	55,295	2022/1/12
小 計					913,211	
ハンガリー			千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント		
国債証券	2.5 HUNGARY 180622	2.5	109,000	110,679	45,445	2018/6/22
	3.5 HUNGARY 200624	3.5	163,000	170,467	69,993	2020/6/24
	4 HUNGARY 180425	4.0	149,000	156,403	64,219	2018/4/25
	5.5 HUNGARY 181220	5.5	103,000	113,332	46,534	2018/12/20
	5.5 HUNGARY 250624	5.5	157,000	183,313	75,268	2025/6/24
	6 HUNGARY 231124	6.0	173,000	205,321	84,305	2023/11/24
	6.5 HUNGARY 190624	6.5	184,800	210,705	86,515	2019/6/24
	6.75 HUNGARY 170224	6.75	60,000	63,624	26,124	2017/2/24
	6.75 HUNGARY 171124	6.75	110,000	120,167	49,340	2017/11/24
	7 HUNGARY 220624	7.0	182,500	224,066	92,001	2022/6/24
	7.5 HUNGARY 201112	7.5	151,000	184,458	75,738	2020/11/12
小 計					715,486	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	3,300	3,196	91,416	2020/4/25

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

銘	柄	当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
マレーシア		%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円		
	国債証券	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	600	581	16,030	2027/3/15
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	2,000	1,992	54,924	2025/9/15
		4.012 MALAYSIAGOV 170915	4.012	1,600	1,632	45,002	2017/9/15
		4.048 MALAYSIA 210930	4.048	2,420	2,461	67,854	2021/9/30
		4.127 MALAYSIA 320415	4.127	800	758	20,925	2032/4/15
		4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	1,400	1,432	39,493	2021/7/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,300	1,318	36,340	2024/7/15
		4.24 MALAYSIAGOV 180207	4.24	1,500	1,532	42,238	2018/2/7
		4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	2,500	2,585	71,270	2019/11/29
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	1,300	1,314	36,242	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	1,800	1,835	50,617	2030/4/15
		5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	800	861	23,758	2019/7/30
小	計					974,001	
タイ				千タイバーツ	千タイバーツ		
	国債証券	2.55 THAILAND 200626	2.55	17,400	17,964	58,922	2020/6/26
		2.8 THAILAND 171010	2.8	10,000	10,219	33,518	2017/10/10
		3.25 THAILAND 170616	3.25	28,900	29,640	97,221	2017/6/16
		3.45 THAILAND 190308	3.45	11,700	12,355	40,525	2019/3/8
		3.58 THAILAND 271217	3.58	9,500	10,415	34,161	2027/12/17
		3.625 THAILAND 230616	3.625	28,200	30,769	100,925	2023/6/16
		3.65 THAILAND 211217	3.65	45,900	49,935	163,787	2021/12/17
		3.85 THAILAND 251212	3.85	19,500	21,867	71,724	2025/12/12
		3.875 THAILAND 190613	3.875	40,900	43,985	144,271	2019/6/13
		4.75 THAILAND 241220	4.75	8,300	9,791	32,116	2024/12/20
		4.875 THAILAND 290622	4.875	27,100	33,780	110,801	2029/6/22
		5.125 THAILAND 180313	5.125	12,400	13,335	43,740	2018/3/13
小	計					931,715	
フィリピン				千フィリピンペソ	千フィリピンペソ		
	国債証券	4.95 PHILIPPI(GL) 210115	4.95	5,000	5,133	12,629	2021/1/15
		6.25 PHILIPPI(GL) 360114	6.25	10,000	11,092	27,286	2036/1/14
小	計					39,915	
インドネシア				千インドネシアルピア	千インドネシアルピア		
	国債証券	10 INDONESIA 170715	10.0	1,000,000	1,025,030	8,712	2017/7/15
		10.5 INDONESIA 300815	10.5	3,550,000	4,022,043	34,187	2030/8/15
		11 INDONESIA 201115	11.0	2,200,000	2,416,304	20,538	2020/11/15
		11 INDONESIA 250915	11.0	3,450,000	3,960,220	33,661	2025/9/15
		12.8 INDONESIA 210615	12.8	2,590,000	3,062,234	26,028	2021/6/15
		5.25 INDONESIA 180515	5.25	1,550,000	1,450,986	12,333	2018/5/15
		5.625 INDONESIA 230515	5.625	4,800,000	4,026,864	34,228	2023/5/15
		6.125 INDONESIA 280515	6.125	5,050,000	4,041,515	34,352	2028/5/15
		6.25 INDONESIA 170415	6.25	1,200,000	1,174,068	9,979	2017/4/15
		6.625 INDONESIA 330515	6.625	7,300,000	5,868,616	49,883	2033/5/15
		7 INDONESIA 220515	7.0	5,650,000	5,226,984	44,429	2022/5/15
		7 INDONESIA 270515	7.0	4,050,000	3,558,694	30,248	2027/5/15
		7.875 INDONESIA 190415	7.875	7,000,000	6,906,340	58,703	2019/4/15

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
インドネシア		%	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	8.25	5,600,000	5,572,952	47,370	2021/7/15
		8.25	7,000,000	6,633,760	56,386	2032/6/15
		8.375	17,200,000	17,084,244	145,216	2024/3/15
		8.375	6,330,000	6,317,909	53,702	2026/9/15
		8.375	12,100,000	11,628,463	98,841	2034/3/15
		9.0	11,600,000	11,763,212	99,987	2029/3/15
		9.5	3,150,000	3,319,060	28,212	2031/7/15
小	計				927,005	
南アフリカ			千南アフリカランド	千南アフリカランド		
	国債証券	10.5	19,400	20,525	146,555	2026/12/21
		6.25	11,700	7,836	55,954	2036/3/31
		6.5	10,500	6,987	49,890	2041/2/28
		6.75	9,000	8,072	57,638	2021/3/31
		7.0	12,000	9,220	65,834	2031/2/28
		7.25	9,300	8,729	62,327	2020/1/15
		7.75	6,500	5,927	42,324	2023/2/28
		8.0	7,500	7,335	52,375	2018/12/21
		8.0	12,100	10,309	73,607	2030/1/31
		8.25	7,500	7,481	53,420	2017/9/15
		8.25	7,600	6,491	46,346	2032/3/31
		8.5	8,900	7,579	54,117	2037/1/31
		8.75	12,700	10,883	77,706	2048/2/28
小	計				838,099	
合	計				9,460,517	

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

○投資信託財産の構成

(2016年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	9,460,517	95.6
コール・ローン等、その他	435,917	4.4
投資信託財産総額	9,896,434	100.0

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

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年1月26日現在)

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

<注記事項>

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

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

eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,730,806,829円
eMAXIS バランス(波乗り型)	365,846,277円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	198,944,668円
コアバランス	681,024円
eMAXIS 新興国債券インデックス	4,426,397,507円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	1,434,216,167円
新興国債券インデックスオープン	934,480円
新興国債券インデックスファンド(ラップ向け)	168,879,662円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	30,527,848円
三菱UFJ 新興国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	46,123,613円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	69,400,009円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	91,266,261円
合計	8,564,024,345円

[お知らせ]

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

○損益の状況 (2015年1月27日~2016年1月26日)

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

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