

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／株式
信託期間	2027年2月5日まで（2017年3月13日設定）
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界の株式に実質的な投資を行います。投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。
主要運用対象	別に示した投資対象ファンドの投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への直接投資は行いません。 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。  分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

## 運用報告書（全体版）

# 国内株式セクション （ラップ向け）

第1期（決算日：2018年2月5日）

## 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、お手持ちの「国内株式セクション（ラップ向け）」は、去る2月5日に第1期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



## 三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号  
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

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

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

## 本資料の表記にあたって

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

## ○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			(参考指数)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配	み金騰落	東証株価指数 (TOPIX)	騰落率				
(設定日)	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2017年3月13日	10,000	—	—	1,577.40	—	—	—	—	10
1期(2018年2月5日)	11,677	0	16.8	1,823.74	15.6	93.2	1.5	1.1	3,798

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

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

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み合わせるので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「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」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		(参考指数)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
	騰落率	騰落率	東証株価指数 (TOPIX)	騰落率			
(設定日)	円	%		%	%	%	%
2017年3月13日	10,000	—	1,577.40	—	—	—	—
3月末	9,714	△ 2.9	1,512.60	△ 4.1	94.5	2.2	1.0
4月末	9,836	△ 1.6	1,531.80	△ 2.9	95.8	1.9	1.0
5月末	10,017	0.2	1,568.37	△ 0.6	91.1	1.6	0.9
6月末	10,247	2.5	1,611.90	2.2	93.5	1.5	0.9
7月末	10,316	3.2	1,618.61	2.6	95.3	1.0	1.0
8月末	10,333	3.3	1,617.41	2.5	95.2	1.0	1.0
9月末	10,748	7.5	1,674.75	6.2	95.7	1.7	0.9
10月末	11,257	12.6	1,765.96	12.0	95.4	1.1	0.8
11月末	11,421	14.2	1,792.08	13.6	95.7	1.0	0.8
12月末	11,635	16.4	1,817.56	15.2	95.9	0.6	0.7
2018年1月末	11,766	17.7	1,836.71	16.4	94.6	1.1	1.1
(期末)							
2018年2月5日	11,677	16.8	1,823.74	15.6	93.2	1.5	1.1

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み合わせるので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「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」は買建比率－売建比率。

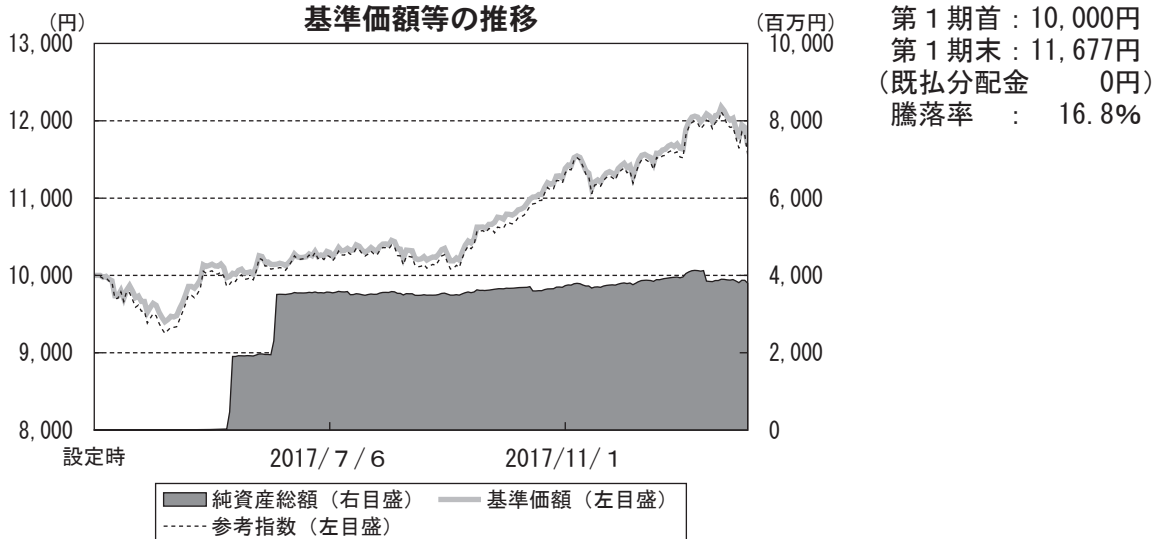
## 運用経過

## 当期中の基準価額等の推移について

（第1期：2017/3/13～2018/2/5）

## 基準価額の動き

基準価額は設定時に比べ16.8%の上昇となりました。



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



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

## 基準価額の主な変動要因

## 上昇要因

すべての組入れファンドが上昇し、プラスに寄与しました。

## 投資環境について

（第1期：2017/3/13～2018/2/5）

### ◎国内株式市況

- ・国内株式市況は上昇しました。
- ・設定後、北朝鮮をめぐる地政学リスクが高まったことやトランプ米政権の政策運営をめぐる不透明感などから、下落する場面があったものの、底堅い国内企業業績や衆議院選挙での与党の勝利を受けて安倍政権の経済政策への期待が高まったことなどから上昇し、結果として国内株式市況は上昇しました。

### ◎海外株式市況

- ・海外株式市況は上昇しました。
- ・設定後、北朝鮮をめぐる地政学リスクが高まったことやトランプ米政権の政策運営をめぐる不透明感などから、上値が抑えられる場面があったものの、底堅い企業業績や米連邦準備制度理事会（FRB）が追加利上げに慎重な姿勢を示したこと、米税制改革法案の可決を受けて設備投資や個人投資などのさらなる拡大への期待などから上昇し、結果として海外株式市況は上昇しました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

### **i** 期間中にどのような運用をしたかを確認できます。

- ・投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界の株式に実質的な投資を行いました。
- ・投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき行い、期を通じて「TOPIXマザーファンド」、「JPX日経400インデックスマザーファンド」、「日本株インカム・マザーファンド」、「ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド」、「JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド」に投資を行いました。
- ・前記の運用の結果、すべての組入れファンドが上昇したことなどから、基準価額は設定時に比べて上昇しました。

## （ご参考）投資信託証券別組入比率表

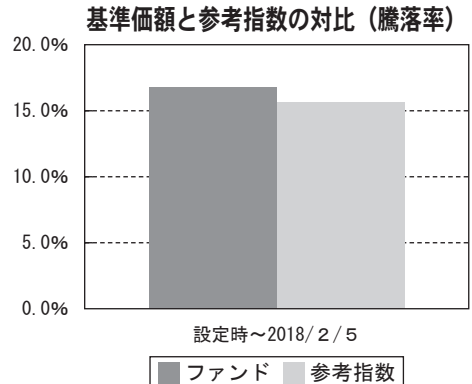
投資信託証券	設定時	2017年											2018年 1月末
		3月末	4月末	5月末	6月末	7月末	8月末	9月末	10月末	11月末	12月末		
TOPIXマザーファンド	—	41.76	41.78	40.82	40.82	41.43	41.57	41.71	41.66	41.54	41.58	41.34	
JPX日経400インデックスマザーファンド	—	9.81	9.81	9.53	9.60	9.73	9.63	9.89	9.83	9.72	9.67	9.56	
日本株インカム・マザーファンド	—	26.84	26.91	26.44	26.55	27.12	26.99	27.20	26.93	27.08	27.02	26.72	
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	—	10.17	10.15	9.64	9.51	9.74	9.63	9.53	9.66	9.88	9.71	9.99	
JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド	—	9.90	9.88	9.54	9.52	9.74	9.69	9.81	9.79	9.79	9.60	9.65	

（注）比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

## 当該投資信託のベンチマークとの差異について

**i** ベンチマークまたは参考指数と比較することで、期間中の運用内容を評価することができます。

- ・当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。右記のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率との対比です。
- ・参考指数は東証株価指数（TOPIX）です。



## 分配金について

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

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、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1期
	2017年3月13日～2018年2月5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	1,676

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## 今後の運用方針 （作成対象期間末での見解です。）

### ◎今後の運用方針

- ・日本を含む世界の株式を実質的な主要投資対象とし、主として値上がり益の獲得をめざします。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。
- ・投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年3月13日～2018年2月5日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	44	0.409	(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 ）	(35)	(0.331)	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 ）	( 4)	(0.039)	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 ）	( 4)	(0.039)	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	4	0.039	(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 ）	( 4)	(0.034)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0)	(0.001)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0)	(0.004)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	( 0)	(0.001)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	1	0.010	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	( 1)	(0.006)	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 ）	( 0)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	49	0.459	
期中の平均基準価額は、10,662円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

## ○売買及び取引の状況

(2017年3月13日～2018年2月5日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	226,990	358,035	12,771	22,000
J P X日経400インデックスマザーファンド	263,402	363,215	35,628	55,690
J A P A N クオリティ150インデックスマザーファンド	323,687	355,085	38,000	47,440
T O P I Xマザーファンド	939,198	1,550,326	121,525	227,600
日本株インカム・マザーファンド	507,381	982,628	57,290	127,530

## ○株式売買比率

(2017年3月13日～2018年2月5日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期				
	ヘッジ付外国株式 インデックス マザーファンド	J P X日経400 インデックス マザーファンド	J A P A N クオリティ150 インデックス マザーファンド	T O P I X マザーファンド	日本株インカム・ マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	45,361,589千円	11,863,417千円	7,417,495千円	321,948,671千円	15,662,921千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	64,846,996千円	8,632,624千円	1,672,210千円	301,288,299千円	9,299,426千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.69	1.37	4.43	1.06	1.68

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。



## ○利害関係人との取引状況等

(2017年3月13日～2018年2月5日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;国内株式セレクション（ラップ向け）&gt;

該当事項はございません。

## &lt;TOPIXマザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	147,196	59,165	40.2	174,752	72,814	41.7
貸付有価証券(株式)	327,401	327,401	100.0	334,212	334,212	100.0

平均保有割合 0.4%

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

## &lt;JPX日経400インデックスマザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	4,301	1,401	32.6	7,562	1,321	17.5

平均保有割合 3.1%

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

## &lt;日本株インカム・マザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	7,330	2,069	28.2	8,332	2,381	28.6
投資信託証券	263	116	44.1	182	14	7.7

平均保有割合 7.8%

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

## &lt;ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド&gt;

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	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 795,358	百万円 588,311	% 74.0	百万円 756,966	百万円 572,990	% 75.7
為替直物取引	7	—	—	48,590	20,605	42.4

平均保有割合 0.4%

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

## &lt;JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 3,826	百万円 754	% 19.7	百万円 3,590	百万円 562	% 15.7

平均保有割合 16.4%

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

## 利害関係人の発行する有価証券等

## &lt;TOPIXマザーファンド&gt;

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 3,427	百万円 4,448	百万円 7,629

## &lt;JPX日経400インデックスマザーファンド&gt;

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 65	百万円 156	百万円 124

## &lt;日本株インカム・マザーファンド&gt;

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 —	百万円 74	百万円 —

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 560

<JPX日経400インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 1

<日本株インカム・マザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 72

<JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 23

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)	1,089千円
うち利害関係人への支払額 (B)	244千円
(B) / (A)	22.5%

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

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2017年3月13日～2018年2月5日)

設定時残高(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

(2018年2月5日現在)

## 親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
		千口	千円
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド		214,219	373,256
J P X日経400インデックスマザーファンド		227,774	361,979
J A P A N クオリティ150インデックスマザーファンド		285,687	363,651
T O P I Xマザーファンド		817,672	1,565,433
日本株インカム・マザーファンド		450,091	1,028,818

## ○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、2018年2月5日現在における貸付株数の総株数は14,741,100株です。うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUF G証券に対する貸付は、14,741,100株です。

## ○投資信託財産の構成

(2018年2月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	373,256	9.8
J P X日経400インデックスマザーファンド	361,979	9.5
J A P A N クオリティ150インデックスマザーファンド	363,651	9.5
T O P I Xマザーファンド	1,565,433	41.1
日本株インカム・マザーファンド	1,028,818	27.0
コール・ローン等、その他	119,549	3.1
投資信託財産総額	3,812,686	100.0

(注) ヘッジ付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（46,883,140千円）の投資信託財産総額（49,447,276千円）に対する比率は94.8%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=109.90円	1 カナダドル=88.49円	1 ユーロ=136.78円	1 イギリスポンド=155.15円
1 スイスフラン=118.03円	1 スウェーデンクローネ=13.88円	1 ノルウェークローネ=14.17円	1 デンマーククローネ=18.38円
1 オーストラリアドル=87.04円	1 ニュージーランドドル=80.24円	1 香港ドル=14.05円	1 シンガポールドル=83.25円
1 イスラエルシェケル=31.85円			

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2018年2月5日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,812,686,688
コール・ローン等	119,547,373
ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	373,256,448
J P X 日経400インデックスマザーファンド(評価額)	361,979,222
JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド(評価額)	363,651,211
T O P I X マザーファンド(評価額)	1,565,433,828
日本株インカム・マザーファンド(評価額)	1,028,818,606
(B) 負債	14,489,554
未払解約金	7,563,969
未払信託報酬	6,874,711
未払利息	182
その他未払費用	50,692
(C) 純資産総額(A-B)	3,798,197,134
元本	3,252,761,662
次期繰越損益金	545,435,472
(D) 受益権総口数	3,252,761,662口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,677円

## &lt;注記事項&gt;

- ①設定元本額 10,000,000円  
 期中追加設定元本額 4,170,718,781円  
 期中一部解約元本額 927,957,119円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.1677円です。

## ○損益の状況（2017年3月13日～2018年2月5日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 34,666
受取利息	483
支払利息	△ 35,149
(B) 有価証券売買損益	470,144,460
売買益	563,106,344
売買損	△ 92,961,884
(C) 信託報酬等	△ 11,541,569
(D) 当期損益金(A+B+C)	458,568,225
(E) 追加信託差損益金	86,867,247
(配当等相当額)	(△ 12,040)
(売買損益相当額)	( 86,879,287)
(F) 計(D+E)	545,435,472
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	545,435,472
追加信託差損益金	86,867,247
(配当等相当額)	( 3,163,893)
(売買損益相当額)	( 83,703,354)
分配準備積立金	458,568,225

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

## ②分配金の計算過程

項 目	2017年3月13日～ 2018年2月5日
費用控除後の配当等収益額	45,074,567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	413,493,658円
収益調整金額	86,867,247円
分配準備積立金額	－円
当ファンドの分配対象収益額	545,435,472円
1万口当たり収益分配対象額	1,676円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

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

【お 知 ら せ】

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

# T O P I X マザーファンド

## 《第16期》決算日2017年3月27日

〔計算期間：2016年3月26日～2017年3月27日〕

「T O P I X マザーファンド」は、3月27日に第16期の決算を行いました。  
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

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

### ○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		東 証 株 価 指 数 (T O P I X)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
16期(2017年3月27日)	15,678	14.1	1,524.39	11.6	98.8	1.0	296,391

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

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 株 価 指 数		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	円	騰 落 率	(TOPIX)	騰 落 率		
(期 首) 2016年3月25日	13,743	—	1,366.05	—	98.2	1.9
3月末	13,682	△ 0.4	1,347.20	△ 1.4	97.1	2.4
4月末	13,610	△ 1.0	1,340.55	△ 1.9	97.9	1.8
5月末	14,015	2.0	1,379.80	1.0	98.5	1.5
6月末	12,674	△ 7.8	1,245.82	△ 8.8	99.1	1.0
7月末	13,458	△ 2.1	1,322.74	△ 3.2	99.2	0.5
8月末	13,532	△ 1.5	1,329.54	△ 2.7	99.6	0.7
9月末	13,574	△ 1.2	1,322.78	△ 3.2	98.6	1.5
10月末	14,295	4.0	1,393.02	2.0	98.0	1.7
11月末	15,083	9.8	1,469.43	7.6	98.8	1.4
12月末	15,607	13.6	1,518.61	11.2	99.3	0.7
2017年1月末	15,641	13.8	1,521.67	11.4	99.6	0.4
2月末	15,790	14.9	1,535.32	12.4	97.6	1.0
(期 末) 2017年3月27日	15,678	14.1	1,524.39	11.6	98.8	1.0

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

### ●当期中の基準価額等の推移について

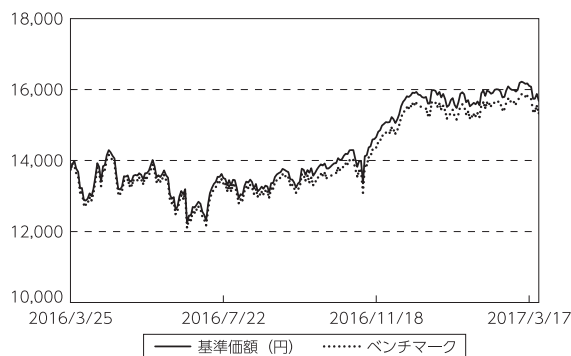
#### ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.1%の上昇となりました。

#### ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(11.6%)を2.5%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2016年6月下旬にかけては、日本銀行による追加的な金融緩和策がたびたび見送られたことや英国の国民投票で欧州連合（EU）離脱派が勝利したことなどを受け、国内株式市況は下落しました。
- ・7月上旬から期末にかけては、国内の参議院選挙で与党が勝利し大規模な経済政策への期待が膨らんだことや、米国次期大統領政権下の経済政策への期待などから米国長期金利が上昇し、円安・米ドル高が進行したことなどにより、国内株式市況は上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・株式ポートフォリオはベンチマークである東証株価指数（TOPIX）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11.6%の上昇となったため、カイ離は2.5%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	0.1%程度	△0.0%程度	2.4%程度	2.5%程度

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.1%程度でした。

- ・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・期中における先物組入比率の平均は、1.2%程度となりました。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.4%程度でした。

- ・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

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

信託財産の収益向上を目的に、保有株式の貸し付けを行っています。貸付契約額は、期末時点で概ね純資産総額の4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

(2016年3月26日～2017年3月27日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 ( 株 式 ) (先物・オプション)	円 0 (0) (0)	% 0.002 (0.001) (0.002)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(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	0.002	
期中の平均基準価額は、14,246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

(2016年3月26日～2017年3月27日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 142,313 (△ 14,122)	千円 181,579,329 ( )	千株 106,766	千円 136,202,866

(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 48,441	百万円 50,244	百万円 -	百万円 -

## ○株式売買比率

(2016年3月26日～2017年3月27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	317,782,195千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	253,968,319千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.25

(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

(2016年3月26日～2017年3月27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 181,579	百万円 44,658	% 24.6	百万円 136,202	百万円 18,503	% 13.6
貸付有価証券(株式)	359,800	359,800	100.0	353,818	353,818	100.0

## 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 4,110	百万円 3,249	百万円 7,418

## 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 112

## 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)	6,356千円
うち利害関係人への支払額 (B)	127千円
(B) / (A)	2.0%

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

## ○組入資産の明細

(2017年3月27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
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>				
極洋	51	5.8	18,096	
日本水産	138.6	191.9	108,999	
マルハニチロ	24.6	28	97,300	
カネコ種苗	—	5.1	7,354	
サカタのタネ	17.8	21.8	76,409	
ホクト	12.2	15	31,545	
ホクリヨウ	—	1.6	1,308	
<b>鉱業 (0.3%)</b>				
住石ホールディングス	35.6	41	3,977	
日鉄鉱業	33	4.1	23,657	
三井松島産業	79	9.1	13,431	
国際石油開発帝石	633.7	778.3	837,450	
日本海洋掘削	3.6	5.2	12,131	
石油資源開発	19.1	23.4	59,085	
K&Oエナジーグループ	8.1	9.9	17,691	
<b>建設業 (3.0%)</b>				
ショーボンドホールディングス	12.6	14.3	70,785	
ミライト・ホールディングス	37	45.4	51,165	
タマホーム	9.1	11.1	6,748	
サンヨーホームズ	2.5	3.1	2,142	
ファーストコーポレーション	—	2.4	2,469	
インベスターズクラウド	—	1.4	6,433	
ダイセキ環境ソリューション	2.8	4.1	5,084	
安藤・間	80.3	106.2	82,198	
東急建設	39.1	52.4	45,640	
コムシスホールディングス	51.7	57.7	116,957	
ミサワホーム	14.2	17.4	19,227	
ピーアールホールディングス	—	14.6	6,000	
高松コンストラクショングループ	9.1	11.1	30,047	
東建コーポレーション	4.9	5.5	48,455	
ソネック	—	1.8	1,269	
ヤマウラ	5.7	6.9	4,284	
大成建設	625	751	626,334	

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
大林組	360.8	443.1	471,901	
清水建設	368	452	457,424	
飛鳥建設	96.6	142.3	24,617	
長谷工コーポレーション	140.4	172.4	217,741	
松井建設	13.3	16.3	16,463	
銭高組	17	21	8,442	
鹿島建設	564	649	482,207	
不動テトラ	84.9	119.2	24,555	
大末建設	4.6	5.2	5,298	
鉄建建設	73	90	29,340	
西松建設	139	171	97,983	
三井住友建設	460.9	566.1	70,196	
大豊建設	46	54	29,700	
前田建設工業	74	97	98,552	
佐田建設	8.4	10.2	4,416	
ナカノフドー建設	9.2	11.3	7,458	
奥村組	114	122	87,718	
東鉄工業	14.4	17.7	57,171	
イチケン	13	13	5,902	
浅沼組	39	52	17,576	
戸田建設	140	172	117,820	
熊谷組	176	232	69,368	
青木あすなろ建設	7.9	9.7	7,895	
北野建設	25	31	9,827	
植木組	15	18	4,698	
三井ホーム	15	19	11,951	
矢作建設工業	16.4	20.1	20,703	
ビーエス三菱	14.2	15.6	6,786	
日本ハウスホールディングス	24.5	30.1	14,688	
大東建託	45	54.4	878,016	
新日本建設	14.3	17.6	16,878	
N I P P O	28	34	72,624	
東亜道路工業	23	28	9,548	
前田道路	38	46	92,736	

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
日本道路	36	44	22,792	
東亜建設工業	105	12	24,588	
若築建設	69	85	12,750	
東洋建設	37.7	42.5	17,722	
五洋建設	133.5	163.9	90,472	
大林道路	14	15.3	10,373	
世紀東急工業	19	21.5	11,889	
福田組	19	24	24,264	
住友林業	82.8	101.7	178,178	
日本基礎技術	13.5	16.4	5,854	
日成ビルド工業	33	44	25,432	
ヤマダ・エスバイエルホーム	61	75	5,850	
巴コーポレーション	14.9	18.4	6,716	
バナホーム	45	55	54,065	
大和ハウス工業	355.3	436.4	1,396,043	
ライト工業	23.1	28.4	32,603	
積水ハウス	402.2	464.9	864,946	
日特建設	13.3	12.6	5,695	
北陸電気工事	4.4	7.2	6,566	
ユアテック	19	23	17,940	
西部電気工業	10	2.5	5,700	
四電工	9	11	4,862	
中電工	17.4	18.7	45,609	
関電工	48	59	60,298	
きんでん	72.7	98.2	153,388	
東京エネシス	14	15	14,475	
トーエネック	17	21	11,508	
住友電設	9.5	10.2	13,464	
日本電設工業	19.6	24.1	47,862	
協和エクシオ	47.1	57.9	94,434	
新日本空調	10.1	11.4	15,743	
NDS	19	2.3	6,881	
九電工	22	28.7	88,970	
三機工業	26.7	32.7	32,667	
日揮	121	137.9	269,180	
中外炉工業	36	45	10,125	
ヤマト	10.9	13.2	7,431	
太平電業	18	20	22,180	
高砂熱学工業	35.9	40.7	65,852	

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
三晃金属工業	12	1.3	4,348	
朝日工業社	14	3.3	11,170	
明星工業	21.8	26.7	17,515	
大氣社	14.7	19.6	54,840	
ダイダン	16	20	21,320	
日比谷総合設備	14.5	16.5	27,373	
東芝プラントシステム	19.5	24	37,536	
OSJBホールディングス	24.5	45.1	12,582	
東洋エンジニアリング	64	87	24,099	
千代田化工建設	87	107	78,431	
新興ブランテック	24.7	30.3	26,421	
<b>食料品 (4.6%)</b>				
日本製粉	79	43.9	73,532	
日清製粉グループ本社	131.9	162	279,450	
日東富士製粉	9	1	4,020	
昭和産業	49	61	38,003	
鳥越製粉	9.5	11.7	9,441	
中部飼料	11.1	16.2	18,597	
フィード・ワン	72.4	88.9	17,780	
東洋精糖	18	22	2,662	
日本甜菜製糖	61	7.5	18,322	
三井製糖	47	10.4	28,932	
塩水港精糖	12.9	15.8	4,155	
日新製糖	5.1	6.3	12,675	
森永製菓	108	28.8	151,200	
中村屋	28	3.4	17,782	
江崎グリコ	27.8	37	205,350	
名糖産業	5.3	6.4	9,568	
不二家	69	84	21,504	
山崎製パン	88	108.2	256,866	
第一屋製パン	18	23	2,852	
モロゾフ	18	23	13,064	
亀田製菓	6.7	8.2	40,754	
寿スピリッツ	2.9	10.5	29,631	
カルビー	44.6	60.3	235,170	
森永乳業	108	133	129,409	
六甲バター	5.4	6.6	16,486	
ヤクルト本社	64.5	79.2	479,160	
明治ホールディングス	71.3	87.5	835,625	

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
雪印メグミルク	28.3	31.9	100,485	
ブリマハム	76	93	46,128	
日本ハム	88	100	317,000	
伊藤ハム	58	—	—	
林兼産業	39	4.7	4,103	
丸大食品	62	71	36,068	
米久	3.8	—	—	
S Foods	7.5	7.9	25,438	
伊藤ハム米久ホールディングス	—	85.2	92,697	
サッポロホールディングス	184	48.4	145,442	
アサヒグループホールディングス	225.7	277.2	1,175,050	
キリンホールディングス	487.5	636.1	1,320,225	
宝ホールディングス	87.1	106.9	130,524	
オエノンホールディングス	33	38	9,462	
養命酒製造	3.7	4.6	9,618	
コカ・コーラウエスト	40.7	50	175,000	
コカ・コーライーストジャパン	42.6	57.5	150,420	
サントリー食品インターナショナル	82.4	101.2	474,628	
ダイドールグループホールディングス	6.1	6.8	36,380	
伊藤園	35.7	43.8	181,113	
キーコーヒー	10.6	13	30,446	
ユニカフェ	3.2	4	3,872	
ジャパンフーズ	1.5	1.9	2,772	
日清オイリオグループ	64	85	54,655	
不二製油グループ本社	32.1	39.4	104,804	
かどや製油	1.2	1.4	8,960	
J-オイルミルズ	50	6.9	29,221	
キッコーマン	91	103	352,775	
味の素	258	304.3	685,892	
キュービー	61.2	75.2	241,016	
ハウス食品グループ本社	41.1	54.7	137,844	
カゴメ	43.2	53	156,668	
焼津水産化学工業	5.7	6.9	9,156	
アリアケジャパン	9.8	12.1	83,611	
ピエトロ	1.1	1.7	2,886	
エバラ食品工業	2.9	3.5	7,542	
ニチレイ	128	72.7	202,905	
東洋水産	59.1	72.6	313,269	
イートアンド	1.3	1.6	3,713	

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
大冷	—	1.1	2,035	
日清食品ホールディングス	50.9	57.7	374,473	
永谷園ホールディングス	11	14	20,692	
一正蒲鉾	4.2	5.1	6,456	
フジッコ	11.7	14.3	37,208	
ロック・フィールド	6.3	14.3	26,569	
日本たばこ産業	711.1	818.8	3,050,030	
ケンコーマヨネーズ	3.9	6	17,130	
わらべや日洋ホールディングス	6.5	8.7	23,307	
なとり	6	7.4	14,126	
北の達人コーポレーション	1.7	3.2	3,788	
ユーグレナ	40.7	47.6	58,881	
ミヨシ油脂	41	51	7,191	
理研ビタミン	3.5	4.4	18,260	
<b>繊維製品 (0.7%)</b>				
片倉工業	14.1	17.3	24,773	
グンゼ	91	103	45,320	
東洋紡	445	547	108,853	
ユニチカ	327	378	37,044	
富士紡ホールディングス	55	6.7	20,904	
倉敷紡績	115	139	34,611	
シキボウ	69	74	11,026	
日本毛織	34.6	38.9	34,348	
ダイトボウ	16	18	1,386	
トーア紡コーポレーション	4.8	5.9	3,203	
ダイドーリミテッド	12.7	15.4	6,868	
帝国繊維	11.8	14.4	23,673	
帝人	460	112.9	241,154	
東レ	816	1,002	995,787	
サカイオーボックス	30	3.4	6,259	
住江織物	28	38	10,792	
日本フェルト	6	7.9	4,163	
イチカワ	7	9	2,853	
日東製網	12	1.5	2,932	
芦森工業	24	—	—	
アツギ	87	113	15,481	
ダイニック	21	26	4,992	
セーレン	28	34.4	53,044	
ソトー	—	5.1	5,936	

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
東海染工	16	19	2,755	
小松精練	17.3	19.4	13,832	
ワコールホールディングス	67	82	114,062	
ホギメディカル	7.1	8.7	58,290	
レナウン	30.7	37.3	4,177	
クラウディア	2.9	3.2	1,721	
T S I ホールディングス	50.2	56.9	43,585	
三陽商会	63	72	11,952	
ナイガイ	41	50	2,900	
オンワードホールディングス	75	89	68,886	
ルック	20	25	5,450	
キムラタン	478	583	4,081	
ゴールドウイン	4.8	5.9	35,577	
デサント	25.6	31.5	42,493	
キング	5.6	6.8	2,815	
ヤマトインターナショナル	7	8.5	3,519	
<b>パルプ・紙 (0.3%)</b>				
特種東海製紙	65	8	36,160	
王子ホールディングス	461	540	287,820	
日本製紙	58.1	61.9	131,351	
三菱製紙	171	19.6	14,445	
北越紀州製紙	69.8	77.1	60,369	
中越パルプ工業	45	55	13,035	
巴川製紙所	17	21	4,977	
大王製紙	49.8	55	78,980	
阿波製紙	—	2.5	1,535	
レンゴー	99	133.2	87,246	
トーモク	35	44	15,092	
ザ・バック	8	9.8	31,507	
<b>化学 (6.8%)</b>				
クラレ	177.4	232.4	390,432	
旭化成	701	861	920,409	
共和レザー	7.4	8	7,168	
昭和電工	749	91.9	175,712	
住友化学	828	1,017	631,557	
日本化成	21	—	—	
住友精化	23	5.7	26,305	
日産化学工業	67.6	75.7	249,053	
ラサ工業	42	52	7,436	

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
クレハ	85	10.4	51,324	
多木化学	7	9	8,073	
テイカ	19	21	15,960	
石原産業	202	24.8	27,404	
片倉コープアグリ	14	19	4,864	
日東エフシー	6.6	8.1	8,432	
日本曹達	73	83	51,211	
東ソー	303	399	381,843	
トクヤマ	186	215	113,305	
セントラル硝子	122	141	68,385	
東亜合成	70.4	86.5	108,903	
大阪ソーダ	48	59	29,500	
関東電化工業	27	28	27,244	
デンカ	233	286	167,882	
信越化学工業	201.7	247.7	2,367,764	
日本カーバイド工業	38	47	7,144	
堺化学工業	45	52	20,436	
エア・ウォーター	93	113.9	232,242	
大陽日酸	86.6	106.4	139,171	
日本化学工業	42	51	12,393	
日本パーカライジング	57.5	70.6	96,933	
高圧ガス工業	17	20.5	15,088	
チタン工業	13	16	3,136	
四国化成工業	16	20	25,080	
戸田工業	22	27	7,344	
ステラ ケミファ	5.7	6.6	20,691	
保土谷化学工業	34	4.8	17,256	
日本触媒	16.3	21.7	164,920	
大日精化工業	43	57	42,978	
カネカ	152	186	157,356	
三菱瓦斯化学	193	128.7	293,049	
三井化学	477	628	346,028	
J S R	105.5	138.8	269,133	
東京応化工業	22.6	25.8	92,364	
大阪有機化学工業	8	8.9	7,992	
三菱ケミカルホールディングス	753.2	930.4	789,444	
KHネオケム	—	16.9	22,882	
日本合成化学工業	26	—	—	
ダイセル	158.1	186.2	246,715	

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
住友ベークライト	105	122	81,618	
積水化学工業	255.3	313.5	589,693	
日本ゼオン	97	116	142,216	
アイカ工業	33.8	44.3	131,881	
宇部興産	602	696	185,832	
積水樹脂	17.3	21.3	39,383	
タキロン	26	29	17,139	
旭有機材	36	45	10,890	
日立化成	55.6	76.8	238,080	
ニチバン	11	14	12,922	
リケンテクノス	18.3	29.8	16,300	
大倉工業	27	33	18,480	
積水化成成品工業	29	19.6	15,640	
群栄化学工業	30	3.3	11,814	
タイガースポリマー	5.5	6.8	4,916	
ミライアル	4	5	5,120	
ダイキアクシス	2.1	2.3	3,898	
ダイキョーニシカワ	14.5	24.2	34,025	
日本化薬	73	90	137,250	
カーリットホールディングス	10.4	12.8	7,692	
日本精化	9.3	11.4	11,400	
扶桑化学工業	7.1	9.8	31,556	
ADEKA	55.3	59.4	95,574	
日油	86	107	125,618	
新日本理化	17.9	21.8	3,204	
ハリマ化成グループ	9.6	11.7	9,289	
花王	302.4	350.8	2,148,299	
第一工業製薬	25	31	13,392	
日華化学	—	4.4	4,589	
ニイタカ	1.6	2	3,616	
三洋化成工業	35	8.7	40,368	
有機合成薬品工業	—	9	2,709	
大日本塗料	64	79	18,723	
日本ペイントホールディングス	86.8	106.6	412,009	
関西ペイント	127.2	145.1	334,165	
神東塗料	8	10	2,160	
中国塗料	32	39.6	32,036	
日本特殊塗料	7.9	9.7	16,548	
藤倉化成	15.3	18.8	12,238	

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
太陽ホールディングス	8.2	11.2	55,328	
D I C	444	54.5	223,450	
サカタインクス	23	28.2	43,033	
東洋インキSCホールディングス	111	136	74,800	
T&K TOKA	8.1	10	10,760	
富士フィルムホールディングス	257.3	273.9	1,208,172	
資生堂	213.3	262	772,114	
ライオン	130	171	348,840	
高砂香料工業	7.4	9.1	32,623	
マンダム	10.5	13.8	72,864	
ミルボン	6.6	7.5	42,750	
ファンケル	26.1	29.4	49,009	
コーセー	18.2	22.3	226,345	
コタ	3.5	5.2	7,670	
シーズ・ホールディングス	14.2	17.9	61,039	
シーボン	1.3	1.6	4,166	
ポーラ・オルビスホールディングス	11.5	14.1	149,601	
ノエビアホールディングス	7.1	8.7	39,498	
アジュバンコスメジャパン	2.1	2.6	2,407	
エステー	7.7	9.4	17,690	
アグロ カネショウ	4.4	5.4	7,268	
コニシ	8.8	21.7	29,598	
長谷川香料	14.2	17.5	38,482	
星光PMC	6.1	7.6	10,351	
小林製薬	17	38.3	207,203	
荒川化学工業	9.6	11.8	23,788	
メック	8.7	10.7	13,171	
日本高純度化学	3.2	3.9	9,878	
タカラバイオ	—	29.6	45,021	
J C U	3.3	4.3	33,110	
新田ゼラチン	7.3	8.3	6,498	
OATアグリオ	1	1.6	2,246	
デクセリアルズ	25.2	36.2	42,390	
アース製薬	8.1	9.9	58,311	
イハラケミカル工業	17.3	19.1	19,233	
北興化学工業	12	14	6,440	
大成ラミック	3.2	4.3	12,289	
クミアイ化学工業	23.2	28.5	18,325	
日本農薬	25.7	31.5	21,892	



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
アキレス	92	11.3	19,978	
有沢製作所	16.6	23.3	18,057	
日東電工	86.9	99.6	852,974	
レック	3.5	4.3	20,532	
きもと	18.4	24.7	5,681	
藤森工業	9.6	10.3	32,290	
前澤化成工業	7.9	9	10,665	
J S P	7.3	6.4	16,876	
エフピコ	10	12.2	61,488	
天馬	8.6	9.1	19,009	
信越ポリマー	22	27.1	21,381	
東リ	29	32.8	12,923	
ニフコ	21.5	24.2	136,246	
日本バルカー工業	44	10.7	20,554	
ユニ・チャーム	227.6	279.6	734,229	
<b>医薬品 (4.8%)</b>				
協和発酵キリン	134.5	165.2	288,769	
武田薬品工業	447.8	517.7	2,689,451	
アステラス製薬	1,259	1,410.8	2,116,200	
大日本住友製薬	79.6	97.7	184,555	
塩野義製薬	163.9	175.2	1,014,408	
田辺三菱製薬	131	160.9	371,679	
わかもと製薬	13	16	4,176	
あすか製薬	14.3	15	25,050	
日本新薬	25.8	31.6	182,964	
ビオフェルミン製薬	1.8	2.2	6,831	
中外製薬	111.9	137.5	529,375	
科研製薬	19.4	25.8	167,958	
エーザイ	138.4	170	1,007,760	
ロート製薬	55	67.6	145,880	
小野薬品工業	51.1	313.6	739,155	
久光製薬	34.9	39	246,090	
有機合成薬品工業	7	—	—	
持田製薬	7.7	9.4	80,464	
参天製薬	207	249.4	418,493	
扶桑薬品工業	38	4.6	13,261	
日本ケミファ	16	1.9	10,051	
ツムラ	35.4	46.4	162,632	
日医工	26.3	32.3	55,265	

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
キッセイ薬品工業	19.9	24.5	75,215	
生化学工業	21.5	25.6	48,358	
栄研化学	9.4	11.6	35,844	
日水製薬	4.5	5.5	8,200	
鳥居薬品	7.7	9.4	26,790	
J C R ファーマ	8.6	10.6	25,800	
東和薬品	5.2	6.3	35,217	
富士製薬工業	3.1	4.5	14,535	
沢井製薬	19.1	23.4	143,208	
ゼリア新薬工業	23	28.3	50,006	
第一三共	378.1	406.4	1,037,336	
キョーリン製薬ホールディングス	30	33.8	80,883	
大幸薬品	5.5	6.9	13,110	
ダイト	4.7	8.2	18,753	
大塚ホールディングス	241.7	296.9	1,516,862	
大正製薬ホールディングス	27	29.5	268,745	
ペプチドリーム	13.8	25.8	136,224	
<b>石油・石炭製品 (0.5%)</b>				
日本コークス工業	90.7	111.4	11,028	
昭和シェル石油	113.1	123.4	133,518	
ニチレキ	13.7	16.9	15,717	
東燃ゼネラル石油	170	225	297,000	
ユシロ化学工業	6	7.4	10,197	
ビービー・カストロール	4.6	5.6	9,240	
富士石油	26.1	32	11,552	
MORESCO	3.5	4.7	7,896	
出光興産	58.7	65.5	247,917	
J Xホールディングス	1,330.9	1,532.4	807,574	
コスモエネルギーホールディングス	33.9	41.6	78,624	
<b>ゴム製品 (1.0%)</b>				
横浜ゴム	67.8	83.3	182,427	
東洋ゴム工業	50.9	72.9	139,457	
ブリヂストン	379.5	466	2,085,816	
住友ゴム工業	105.2	129.2	238,890	
藤倉ゴム工業	9.5	11.5	7,900	
オカモト	35	42	45,654	
フコク	4.1	5.8	5,533	
ニッタ	12.1	12.4	39,246	
住友理工	24.3	25.6	29,542	

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
三ツ星ベルト	27	34		35,020
バンドー化学	41	25.1		25,175
<b>ガラス・土石製品 (1.0%)</b>				
日東紡績	74	112		60,368
旭硝子	593	680		614,720
日本板硝子	542	62.9		50,131
石塚硝子	16	19		4,408
日本山村硝子	45	55		11,110
日本電気硝子	232	285		194,655
オハラ	4.2	5.2		6,692
住友大阪セメント	223	256		124,416
太平洋セメント	701	833		317,373
デイ・シイ	10.5	—		—
日本ヒューム	10.8	13.2		9,160
日本コンクリート工業	23.1	30.7		11,236
三谷セキサン	5.6	6.9		18,498
アジアバイルホールディングス	13.9	17		10,676
東海カーボン	97	128.9		62,645
日本カーボン	55	68		21,624
東洋炭素	6.2	7.6		14,120
ノリタケカンパニーリミテド	63	7.8		22,776
TOTO	82.6	101.4		431,964
日本碍子	142	174.3		429,300
日本特殊陶業	96.9	119		295,358
ダントーホールディングス	13	11		2,013
MARUWA	4.1	5.1		20,247
品川リフラクトリーズ	28	35		10,500
黒崎播磨	24	30		13,560
ヨータイ	6	8		3,096
イソライト工業	5.6	6.8		3,060
東京窯業	13.8	16.8		3,561
ニッカトー	4	4.5		2,002
フジミインコーポレーテッド	9.9	11.7		26,172
エーアンドエーマテリアル	23	29		3,799
ニチアス	57	72		81,360
ニチハ	14.9	18.3		59,475
<b>鉄鋼 (1.3%)</b>				
新日鐵住金	506.8	622.5		1,589,553
神戸製鋼所	2,065	238.7		238,700

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
中鋼製鋼所	126	15.5		11,315
合同製鐵	63	7.7		13,598
ジェイ エフ イー ホールディングス	307.2	377.3		722,152
日新製鋼	51.3	63		89,019
東京製鐵	62	69.8		64,216
共英製鋼	12	14.7		29,355
大和工業	24.8	27.7		81,576
東京鐵鋼	23	29		12,818
大阪製鐵	7	8.7		17,904
淀川製鋼所	16.7	19.1		58,637
東洋鋼板	26.9	33		12,903
丸一鋼管	37.6	46.2		151,998
モリ工業	18	4.4		9,737
大同特殊鋼	188	231		121,044
日本高周波鋼業	44	48		4,080
日本冶金工業	82.7	114.2		23,982
山陽特殊製鋼	67	82		49,692
愛知製鋼	66	8.1		36,814
日立金属	128.7	140.5		215,386
日本金属	29	3.3		4,851
大平洋金属	78	88		34,232
新日本電工	63.6	78.1		26,710
栗本鐵工所	54	6.6		14,394
虹技	16	19		4,427
日本鑄鉄管	12	13		2,600
三菱製鋼	78	96		23,136
日亜鋼業	15.5	19.1		5,309
日本精練	8	9		6,048
シンニッタン	10.1	11.3		7,910
新家工業	22	30		6,630
<b>非鉄金属 (1.0%)</b>				
大紀アルミニウム工業所	17	23		11,569
日本軽金属ホールディングス	254.4	355.3		88,825
三井金属鉱業	286	375		137,625
東邦亜鉛	59	78		42,276
三菱マテリアル	701	86.1		291,018
住友金属鉱山	310	357		562,810
DOWAホールディングス	145	152		121,904
古河機械金属	175	215		46,010

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
エス・サイエンス	51.5	62.7	2,508	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11	15.1	25,473	
東邦チタニウム	19	23.3	19,735	
UACJ	157	178	49,484	
古河電気工業	353	46.3	180,801	
住友電気工業	449.9	520	948,480	
フジクラ	156	181.7	141,362	
昭和電線ホールディングス	134	164	14,104	
東京特殊電線	1.6	2	3,386	
タツタ電線	23.4	25.8	13,003	
沖電線	13	14	3,262	
カナレ電気	1.8	1.9	4,204	
平河ヒューテック	5.3	6.5	7,436	
リョービ	68	84	40,908	
アーレスティ	13	16	18,464	
アサヒホールディングス	16.9	20.8	42,140	
<b>金属製品 (0.7%)</b>				
稲葉製作所	6	7.3	9,723	
宮地エンジニアリンググループ	35	40	9,000	
トーカロ	7.9	9.1	27,272	
アルファC○	3.7	4.6	8,008	
SUMCO	88	144.1	247,275	
川田テクノロジーズ	2.1	2.6	19,188	
RS Technologies	—	0.5	3,040	
東洋製織グループホールディングス	79.9	98.1	184,231	
ホッカンホールディングス	29	36	18,648	
コロナ	5.9	7.2	8,395	
横河ブリッジホールディングス	21.3	24.2	32,331	
駒井ハルテック	20	2.6	5,881	
高田機工	10	12	3,396	
三和ホールディングス	113.8	137	141,795	
文化シャッター	31.3	38.4	31,910	
三協立山	14.7	18.1	30,335	
アルインコ	6.3	9.5	9,509	
東洋シャッター	2.8	3.4	2,155	
LIXILグループ	156.5	192.2	566,605	
日本フィルコン	8.2	10	5,570	
ノーリツ	22	27	57,240	
長府製作所	12	14.7	39,513	

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
リンナイ	20.9	23.5	218,080	
ダイニチ工業	5.7	7	5,152	
日東精工	16	19.6	9,290	
三洋工業	14	17	3,604	
岡部	23.3	28.6	28,857	
ジーテクト	11.7	14.4	28,612	
中国工業	1.7	2	1,392	
東プレ	21.6	26.5	75,286	
高周波熱錬	20.9	25.6	23,628	
東京製綱	76	9.3	16,079	
サンコール	6	7.3	4,109	
モリテック スチール	5.7	6.9	2,118	
パイオラックス	5.7	7	53,690	
日本発條	105.8	129.9	161,076	
中央発條	14	16	5,504	
アドパネクス	2.1	2.4	3,700	
立川ブラインド工業	4.7	5.7	5,221	
三益半導体工業	8.3	11.6	19,522	
<b>機械 (5.2%)</b>				
日本ドライケミカル	1.4	1.8	4,375	
日本製鋼所	186	45.6	83,037	
三浦工業	50.1	56.4	101,181	
タクマ	42	44.2	45,128	
ツガミ	32	37	26,307	
オークマ	73	90	112,320	
東芝機械	61	82	37,556	
アマダホールディングス	163.9	185.8	234,108	
アイダエンジニアリング	29.5	39.2	41,395	
滝澤鉄工所	35	40	7,160	
富士機械製造	36.7	42.1	60,792	
牧野フライス製作所	56	69	68,724	
オーエスジー	51.2	62.9	145,047	
ダイジェット工業	13	16	2,896	
旭ダイヤモンド工業	30.8	39.5	32,982	
DMG森精機	62	81.6	141,494	
ソディック	21.4	35	38,745	
デイスコ	14.3	16.1	269,675	
日東工器	6.5	8	20,608	
パンチ工業	4.4	5	5,920	

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
豊和工業	6.3	7.7	5,428	
OKK	43	50	6,100	
石川製作所	28	3.4	2,879	
東洋機械金属	8.4	9.3	5,142	
津田駒工業	27	31	5,270	
エンシュウ	28	34	3,094	
島精機製作所	15.9	18	76,050	
NCホールディングス	—	4.5	4,054	
フリー	1.7	8.1	12,198	
ヤマシンフィルタ	—	2.7	6,739	
日阪製作所	14.2	18.8	17,972	
やまびこ	20.6	25.3	34,306	
ベガサスミシン製造	11.6	13.2	12,051	
ナプテスコ	58.4	71.7	215,817	
三井海洋開発	13.2	13.9	31,344	
レオン自動車	9.5	11.6	12,052	
SMC	33.7	41.4	1,355,022	
新川	10	11.5	9,407	
ホソカワミクロン	19	23	19,918	
ユニオンツール	4.9	6	21,270	
オイレス工業	14.5	17.8	37,931	
日精エー・エス・ビー機械	4.1	4.4	11,470	
サトーホールディングス	15.1	17.2	41,864	
日本エアータック	3.9	4.5	4,045	
日精樹脂工業	8.2	10.9	12,240	
オカダアイオン	—	2.9	3,419	
ワイエイシイ	4.5	5.1	6,497	
小松製作所	550.8	636.7	1,873,489	
住友重機械工業	328	403	315,952	
日立建機	50.2	61.6	173,157	
日工	17	4.1	8,441	
巴工業	4.6	5.6	10,091	
井関農機	115	141	32,571	
TOWA	10.8	11.3	22,328	
丸山製作所	23	29	5,394	
北川鉄工所	51	6.3	13,960	
ローテ	—	4.9	15,631	
タカキタ	2.8	4.6	2,562	
クボタ	539.5	660.5	1,107,988	

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
荏原実業	3.4	3.8	5,392	
三菱化工機	37	45	9,765	
月島機械	21.3	26.2	30,942	
帝国電機製作所	8.2	10	10,730	
東京機械製作所	43	52	3,432	
新東工業	25.5	31.3	30,141	
澁谷工業	9.4	11.5	35,765	
アイチ コーポレーション	15.9	19.5	16,672	
小森コーポレーション	27.3	33.2	48,737	
鶴見製作所	8.3	10.3	16,356	
住友精密工業	18	22	7,788	
酒井重工業	21	26	8,970	
荏原製作所	248	62.5	212,187	
石井鐵工所	16	2	3,512	
西島製作所	12	13.5	14,607	
北越工業	12.1	14.8	15,362	
ダイキン工業	156.3	180	1,999,800	
オルガノ	19	26	13,156	
トーヨーカネツ	60	63	19,530	
栗田工業	67.5	78.1	214,462	
椿本チエイン	64	78	73,788	
大同工業	22	27	8,181	
日本コンベヤ	37	—	—	
木村化工機	9.7	11.8	3,917	
アネスト岩田	18.1	23.9	24,210	
ダイフク	57.7	65.8	181,410	
サムコ	1.8	3.3	3,204	
加藤製作所	25	7.2	20,174	
油研工業	21	26	6,292	
タダノ	52	68.9	94,461	
フジテック	31.3	38.4	48,844	
CKD	29.9	39.5	55,142	
キトー	13.5	16.6	19,090	
平和	33.3	40.9	121,227	
理想科学工業	11.9	13.1	26,828	
SANKYO	29.9	36.7	142,763	
日本金銭機械	9.9	12.1	17,702	
マースエンジニアリング	6.1	7.4	17,626	
福島工業	6.6	8.1	31,914	

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
オーイズミ	4.5	5.5	3,404	
ダイコク電機	4.4	5.4	9,363	
竹内製作所	15.9	24.1	50,176	
アマノ	33.2	40.8	90,004	
JUKI	15.9	20.8	26,291	
サンデンホールディングス	65	80	28,320	
蛇の目ミシン工業	10.4	12.8	10,252	
マックス	17	20	30,920	
グローリー	36.6	42.1	158,717	
新晃工業	7.5	9.2	15,124	
大和冷機工業	17.2	21.2	24,846	
セガサミーホールディングス	115.4	130.8	206,664	
日本ビストンリング	4.5	5.1	13,127	
リケン	50	6.1	30,378	
TPR	13.2	14.8	53,798	
ツバキ・ナカシマ	9.9	14.8	27,616	
ホシザキ	23.5	28.9	251,719	
大豊工業	8.7	10.7	17,087	
日本精工	220.5	270.8	434,092	
NTN	266	305	171,410	
ジェイテクト	114.4	140.5	247,280	
不二越	100	133	75,943	
日本トムソン	37	42.1	25,765	
THK	71.4	93.2	264,222	
ユースン精機	4.2	5.8	17,075	
前澤給装工業	4.4	5	7,940	
イーグル工業	13.3	14.3	21,492	
前澤工業	7.9	8.8	2,904	
日本ビラー工業	10.9	13.3	20,322	
キッツ	52.2	63.3	47,538	
日立工機	28.7	34.9	30,223	
マキタ	70	86	661,340	
日立造船	85.1	104.5	66,357	
三菱重工業	1,912	2,210	1,018,810	
IHI	825	1,013	346,446	
スター精密	—	23.1	38,877	
<b>電気機器 (12.7%)</b>				
日清紡ホールディングス	59.6	73.2	83,082	
イビデン	65.7	92.3	157,648	

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
コニカミノルタ	268.1	308.7	312,713	
ブラザー工業	138.8	170.4	393,794	
ミネベアミツミ	173	239.9	362,968	
日立製作所	2,739	3,166	1,920,812	
東芝	2,260	2,949	644,061	
三菱電機	1,145	1,406.5	2,268,684	
富士電機	323	397	256,859	
東洋電機製造	21	5.6	9,632	
安川電機	133.3	152.9	343,260	
シンフォニアテクノロジー	70	85	26,945	
明電舎	99	121	48,158	
オリジン電気	16	19	5,814	
山洋電気	28	35	28,805	
デンヨー	9.9	12.2	21,118	
東芝テック	77	83	51,875	
芝浦メカトロニクス	17	21	5,964	
マブチモーター	30.7	37.2	231,756	
日本電産	129.2	170.9	1,745,743	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	—	1.5	4,695	
東光高岳	6	6.7	13,748	
ダブル・スコープ	3.2	12.7	20,662	
富越ホールディングス	3.7	4.5	2,200	
ダイヘン	63	72	52,560	
田淵電機	12.2	19.9	6,726	
ヤママン	1.4	1.7	8,959	
JVCケンウッド	78.8	96.7	27,946	
ミマキエンジニアリング	7.2	11.8	7,776	
第一精工	4.5	6.2	10,912	
日新電機	25.2	26.5	33,549	
大崎電気工業	20	26	25,766	
オムロン	121.2	140.1	691,393	
日東工業	17.2	19.4	29,682	
I D E C	14	17.2	21,104	
不二電機工業	1	1.4	1,789	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	207	254	131,826	
サクサホールディングス	27	33	7,194	
メルコホールディングス	5.9	7.3	24,455	
テクノメディカ	2.4	3	6,510	
日本電気	1,476	1,813	502,201	

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
富士通	1,035	1,271	844,452	
沖電気工業	465	57.1	94,728	
岩崎通信機	50	58	5,046	
電気興業	28	37	21,201	
サンケン電気	59	77	36,498	
ナカヨ	10	14	5,180	
アイホン	6.1	7.5	13,575	
ルネサスエレクトロニクス	55.6	68.3	81,481	
セイコーエプソン	159.9	196.3	463,268	
ワコム	84.5	102.3	41,738	
アルバック	19.7	22.2	116,328	
アクセル	4.8	5.5	4,460	
E I Z O	10.6	13	42,510	
ジャパンディスプレイ	200.5	246.2	60,811	
日本信号	29.6	36.4	36,472	
京三製作所	25	31	13,299	
能美防災	12.2	14.9	23,035	
ホーチキ	7.8	9.6	14,304	
エレコム	9.3	11.4	24,692	
日本無線	28	8.1	10,740	
パナソニック	1,226.5	1,514.256	1,810,293	
シャープ	907	—	—	
アンリツ	64.5	96.1	83,799	
富士通ゼネラル	33	45	100,665	
日立国際電気	24.6	34.5	85,974	
ソニー	757.5	931	3,330,187	
TDK	64.8	74.3	519,357	
帝国通信工業	25	29	5,684	
ミツミ電機	40.8	—	—	
タムラ製作所	41	51	23,460	
アルプス電気	91.1	121.7	391,265	
池上通信機	34	42	6,174	
パイオニア	173.7	198.1	44,176	
日本電波工業	9.7	12.7	10,337	
鈴木	3.1	5.1	3,299	
日本トリム	2.9	3.2	12,304	
ローランド ディー. ジー.	5.3	6.7	22,478	
フォスター電機	13.5	15.4	28,490	
クラリオン	57	69	31,188	

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
SMK	32	34	13,702	
ヨコオ	7.6	9.4	13,724	
東光	22	—	—	
ティアック	78	95	3,800	
ホシデン	32.5	40	43,120	
ヒロセ電機	17.3	21.3	332,067	
日本航空電子工業	31	38	55,442	
TOA	12.7	15.6	14,679	
日立マクセル	17.8	19.7	40,266	
古野電気	12.8	17	12,308	
ユニデンホールディングス	34	39	6,864	
アルパイン	25.6	31.4	50,145	
スミダコーポレーション	8.8	10.8	18,284	
アイコム	5.9	7.3	18,673	
リオン	4.1	5	7,935	
本多通信工業	—	4.2	5,854	
船井電機	10.8	14.8	14,415	
横河電機	107.5	143	254,683	
新電元工業	38	51	24,225	
アズビル	35.1	40	150,600	
東亜ディーケーケー	4.5	6.5	3,718	
日本光電工業	44.9	55.1	139,182	
チノー	3.8	4.7	5,889	
共和電業	13.2	14.9	7,077	
日本電子材料	4.3	5.2	3,281	
堀場製作所	19.8	26.1	159,732	
アドバンテスト	73.2	89.9	175,844	
小野測器	5.2	6.4	5,100	
エスパック	11.1	11.7	16,520	
パナソニック デバイスSUNX	9.4	—	—	
キーエンス	24.3	59.7	2,623,815	
日置電機	5.6	6.9	15,973	
シスメックス	83.3	102.5	691,875	
日本マイクロニクス	14	24.6	22,361	
メガチップス	11.2	12.3	38,130	
OBARA GROUP	7	7.7	36,806	
澤藤電機	6	8	4,616	
コーセル	14.9	18.3	26,974	
イリソ電子工業	—	4.2	29,526	

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
新日本無線	7.9	11.2	5,286	
オブテックスグループ	7.9	10	30,550	
千代田インテグレ	5.7	6.9	16,380	
アイ・オー・データ機器	—	4.1	4,428	
レーザーテック	12.6	14.5	42,543	
スタンレー電気	77	94	297,980	
岩崎電気	37	48	8,448	
ウシオ電機	65.2	80	113,600	
岡谷電機産業	5.8	7	2,912	
ヘリオス テクノ ホールディング	9.2	12.1	7,598	
日本セラミック	6.1	10.8	26,276	
遠藤照明	5.4	6.7	6,157	
日本デジタル研究所	9.1	—	—	
古河電池	8	9	6,840	
双信電機	5.2	6.4	1,952	
山一電機	9.3	12.4	19,269	
図研	7.8	8.6	11,438	
日本電子	42	48	26,112	
カシオ計算機	107.6	106	165,466	
ファナック	109.8	133.7	3,040,338	
日本シイエムケイ	23.1	28.4	19,936	
エンプラス	5.5	6	18,570	
大真空	20	4.8	6,811	
ローム	52.9	63.7	469,469	
浜松ホトニクス	83.8	102.9	333,910	
三井ハイテック	15.6	17.4	19,818	
新光電気工業	40.6	49.8	37,748	
京セラ	176.2	216.4	1,334,322	
太陽誘電	52.2	64.1	89,419	
村田製作所	112.6	138.3	2,156,097	
ユーシン	14.2	17.7	13,044	
双葉電子工業	18.4	21.6	44,668	
北陸電気工業	43	53	7,314	
ニチコン	33.8	41.5	44,031	
日本ケミコン	87	114	41,610	
KOA	14.8	18.2	26,717	
市光工業	26	28	15,988	
小糸製作所	64.3	79	457,410	
ミツバ	18.2	24.3	50,033	

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
スター精密	20.4	—	—	
SCREENホールディングス	110	27	212,490	
キヤノン電子	9.8	12.1	21,586	
キヤノン	578	709.8	2,456,617	
リコー	347.6	396.4	369,048	
MUTOHホールディングス	13	18	4,770	
東京エレクトロン	88.1	87.9	1,024,035	
<b>輸送用機器 (9.2%)</b>				
トヨタ紡織	37.5	46.1	117,370	
芦森工業	—	30	4,800	
鬼怒川ゴム工業	25	—	—	
ユニプレス	22.3	25.4	57,607	
豊田自動織機	97.8	120.1	656,947	
モリタホールディングス	18.8	23	38,939	
三櫻工業	13.6	16.7	13,927	
デンソー	265.2	325.1	1,634,602	
東海理化電機製作所	31.4	34.7	78,630	
三井造船	415	476	86,156	
川崎重工業	835	1,026	346,788	
名村造船所	32.2	39.6	26,967	
サノヤスホールディングス	13.2	16	4,704	
日本車輛製造	44	48	14,592	
ニチユ三菱フォークリフト	12.5	15.7	11,162	
近畿車輛	16	2	5,002	
日産自動車	1,506.9	1,555.1	1,747,932	
いすゞ自動車	311.1	382.1	571,812	
トヨタ自動車	1,335.2	1,603	9,871,274	
日野自動車	153.2	188.2	260,657	
三菱自動車工業	426.3	483.2	324,710	
エフテック	5.6	7	9,989	
レシップホールディングス	3.5	4.3	3,698	
GMB	1.7	2.1	3,244	
ファルテック	1.9	2.3	3,314	
武蔵精密工業	11.4	15.3	43,803	
日産車体	52.4	57.9	60,158	
新明和工業	47	53	58,671	
極東開発工業	21.4	26.2	48,496	
日信工業	24	29.5	58,233	
トビー工業	88	10.8	31,968	

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
ティラド	42	51	17,340	
曙ブレーキ工業	54.4	61.2	21,542	
タチエス	17	22.4	49,011	
NOK	51.9	63.8	164,093	
フタバ産業	32.7	40.2	31,918	
KYB	120	148	86,432	
シロキ工業	27	—	—	
大同メタル工業	15	16.6	16,865	
プレス工業	57	70	38,500	
ミクニ	10.3	16.7	7,865	
カルソニックカンセイ	82	40	51,200	
太平洋工業	23.8	27.1	40,189	
ケーヒン	24.7	30.3	55,236	
河西工業	13.2	17.8	25,258	
アイシン精機	108	120.6	654,858	
富士機工	12.5	13.1	7,322	
マツダ	339.9	417.5	650,673	
ダイハツ工業	128.1	—	—	
今仙電機製作所	9.8	12.1	12,136	
本田技研工業	966.1	1,186.5	4,022,235	
スズキ	224.4	261.3	1,212,170	
富士重工業	339.2	409.4	1,684,271	
安永	3.6	4.8	8,136	
ヤマハ発動機	151.6	186.2	489,147	
ショーワ	27.9	34.2	32,045	
T B K	12.9	16.9	8,669	
エクセディ	14.6	17.9	57,996	
豊田合成	39	42.6	122,347	
愛三工業	18.8	23.1	21,945	
盟和産業	1.3	2	2,558	
ヨロズ	10	12.3	21,586	
エフ・シー・シー	17.5	21.6	48,470	
シマノ	43.3	53.1	900,045	
タカタ	19.4	23.8	10,971	
ティ・エス テック	24.9	30.6	91,953	
ジャムコ	4.7	7.7	18,872	
<b>精密機器 (1.6%)</b>				
テルモ	164.6	202.1	784,148	
クリエートメディック	3.5	4.4	4,228	

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
日機装	38.6	45.6	54,811	
島津製作所	138	169.7	304,272	
J M S	20	24	8,184	
クボテック	2.3	2.8	1,534	
モリテックス	2.3	—	—	
長野計器	6.5	10.3	7,591	
ブイ・テクノロジー	2.6	2.7	45,306	
東京計器	34	45	10,440	
愛知時計電機	14	1.7	6,358	
オーバル	10.6	12.9	3,483	
東京精密	20.7	25.5	90,652	
マニー	9.8	17.5	45,255	
ニコン	200.4	229.8	375,493	
トプコン	36	66.4	138,444	
オリンパス	159.9	210.4	894,200	
理研計器	8.7	11.6	19,430	
タムロン	8.7	11.7	23,470	
HOYA	249.8	271.3	1,465,291	
ノーリツ鋼機	9.7	13.3	11,743	
エー・アンド・デイ	9.8	12	5,664	
シチズン時計	132.1	144.3	105,194	
リズム時計工業	47	53	9,964	
大研医器	8.5	11.7	9,594	
メニコン	5.4	9	31,590	
松風	5.2	6.9	9,356	
セイコーホールディングス	69	93	43,989	
ニプロ	80	91.3	144,345	
<b>その他製品 (1.9%)</b>				
スノーピーク	0.9	2	6,210	
パラマウントベッドホールディングス	11.3	12.6	57,645	
トランザクション	1.6	5.8	6,090	
S H O - B I	3.6	4.4	2,019	
ニホンフラッシュ	3.1	6.2	8,568	
前田工織	11.8	13.2	18,585	
永大産業	15	17	8,976	
アートネイチャー	8.6	14.1	10,998	
ダンロップスポーツ	6.8	8.3	8,698	
パンダイナムコホールディングス	111	145.4	501,630	
アイフィスジャパン	1.8	2.9	1,252	



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
共立印刷	17.8	21.9	7,818	
SHOEI	5.2	5.9	17,481	
フランスベッドホールディングス	15	16.5	15,856	
パイロットコーポレーション	18.7	23	103,845	
萩原工業	2.2	3.7	9,812	
トッパン・フォームズ	19.2	23.5	25,474	
フジシールインターナショナル	13	29.6	71,602	
タカラトミー	35.3	51.2	59,443	
廣済堂	10.1	13.3	5,147	
Asmeエステール	2.9	3.5	2,516	
アーク	45.6	55.5	5,605	
タカノ	4.7	5.8	5,834	
プロネクス	10	12.3	15,633	
ホクシン	8.6	9.3	1,860	
ウッドワン	20	22	6,600	
大建工業	42	9.3	19,641	
凸版印刷	303	372	425,568	
大日本印刷	318	380	458,280	
図書印刷	20	18	9,126	
共同印刷	36	41	15,170	
日本写真印刷	18	22.1	61,504	
光村印刷	11	12	3,216	
宝印刷	5.2	6.9	11,488	
アシックス	100	131	234,883	
ツツミ	5.4	4.9	10,206	
小松ウオール工業	3.6	4.5	8,563	
ヤマハ	78.9	88.8	276,168	
河合楽器製作所	4	5.2	12,376	
クリナップ	12.6	15.5	12,958	
ビジョン	60.8	79.7	284,529	
兼松サステック	11	14	3,388	
キングジム	8.9	11	9,570	
リンテック	25.5	31.3	75,213	
TASAKI	2	3.6	7,833	
イトーキ	22.6	27.8	19,682	
任天堂	66.1	81.2	2,183,062	
三菱鉛筆	8	10.9	59,841	
タカラスタンダード	44	27.2	49,449	
コクヨ	55.8	68.5	98,914	

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
ナカバヤシ	22	24	6,792	
グローブライド	5.2	6.4	12,345	
岡村製作所	37.5	46	45,862	
美津濃	58	71	42,245	
アデランス	18.6	—	—	
<b>電気・ガス業 (1.8%)</b>				
東京電力ホールディングス	910.7	1,118.4	466,372	
中部電力	328.5	434.4	641,608	
関西電力	438.1	538	688,371	
中国電力	148.4	182.3	232,614	
北陸電力	105.2	129.2	140,957	
東北電力	268.2	329.4	491,794	
四国電力	96.7	118.7	140,778	
九州電力	237.1	291.2	346,528	
北海道電力	100.5	123.4	101,188	
沖縄電力	11.4	19.4	51,235	
電源開発	91.5	104.9	270,642	
エフオン	—	4.9	4,385	
イーレックス	2.1	16.6	19,936	
東京瓦斯	1,198	1,414	720,998	
大阪瓦斯	1,111	1,279	560,202	
東邦瓦斯	271	330	263,010	
北海道瓦斯	26	32	8,992	
広島ガス	18.7	27.1	10,216	
西部瓦斯	121	148	38,480	
静岡ガス	30.5	40.6	31,302	
メタウォーター	6.9	7.4	21,356	
<b>陸運業 (4.2%)</b>				
SBSホールディングス	10.6	13	10,608	
東武鉄道	574	705	415,245	
相鉄ホールディングス	184	211	111,619	
東京急行電鉄	625	716	582,824	
京浜急行電鉄	294	361	463,163	
小田急電鉄	344	211.2	472,243	
京王電鉄	300	368	337,456	
京成電鉄	161	98.8	259,745	
富士急行	29	36	36,180	
新京成電鉄	14	17	7,089	
東日本旅客鉄道	196.3	255.1	2,490,796	

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
西日本旅客鉄道	103.3	126.9	945,405	
東海旅客鉄道	96.1	109.6	2,031,436	
西武ホールディングス	85.5	182.1	343,804	
鴻池運輸	15.2	18.6	25,500	
西日本鉄道	139	158	76,156	
ハマキョウレックス	8.2	8.6	19,685	
サカイ引越センター	4.2	4.5	14,377	
近鉄グループホールディングス	1,080	1,327	554,686	
阪急阪神ホールディングス	720	166.6	623,917	
南海電気鉄道	241	279	158,472	
京阪ホールディングス	241	295	207,680	
神戸電鉄	26	32	12,544	
名古屋鉄道	391	480	247,680	
山陽電気鉄道	39	48	28,800	
日本通運	415	510	297,330	
ヤマトホールディングス	198.4	235.8	565,684	
山九	141	174	120,756	
丸運	5.8	7.1	1,838	
丸全昭和運輸	36	44	19,492	
センコー	48	62.6	46,073	
トナミホールディングス	22	27	10,773	
ニッコンホールディングス	35.1	44.7	107,369	
日本石油輸送	12	1.5	3,903	
福山通運	65	80	54,720	
セイノーホールディングス	76.1	93.5	118,090	
神奈川中央交通	13	15	11,040	
日立物流	22.4	27.5	65,340	
丸和運輸機関	2.4	3.3	8,490	
C&Fロジホールディングス	10.3	13.7	21,098	
九州旅客鉄道	—	98.3	354,863	
<b>海運業 (0.2%)</b>				
日本郵船	964	1,114	261,790	
商船三井	523	691	241,850	
川崎汽船	470	500	151,000	
NSユナイテッド海運	48	59	14,691	
明治海運	9.7	11.8	5,664	
飯野海運	55.5	68.2	32,804	
共栄タンカー	9	11	2,662	
乾汽船	8.5	9.6	8,928	

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
<b>空運業 (0.6%)</b>				
日本航空	205.5	237.6	862,250	
ANAホールディングス	1,993	2,447	853,758	
バスコ	10	12	4,332	
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>				
トランコム	3.1	3.8	20,938	
日新	44	54	20,304	
三菱倉庫	76	86	135,450	
三井倉庫ホールディングス	62	76	25,156	
住友倉庫	78	96	60,960	
澁澤倉庫	28	34	12,444	
東陽倉庫	18	22.5	6,840	
日本トランスシティ	25	30	14,580	
ケイヒン	20	24	3,960	
中央倉庫	6.2	7.6	8,580	
安田倉庫	8.3	10.3	7,992	
東洋埠頭	31	38	6,992	
宇徳	8.8	10.7	4,665	
上組	128	157	157,314	
サンリツ	2.6	3.2	1,680	
キムラユニティー	2.7	3.3	3,940	
キューソー流通システム	3	4.2	11,709	
郵船ロジスティクス	9.9	12.1	13,552	
近鉄エクスプレス	19.2	23.6	40,143	
東海運	5.8	7.1	3,294	
ユーアイティー	4.9	8.1	8,059	
内外トランスライン	2.7	3.9	4,325	
<b>情報・通信業 (7.8%)</b>				
NECネットエスアイ	13.3	14.3	31,188	
システナ	10.3	10.4	17,825	
デジタルアーツ	5.2	5.8	17,661	
新日鉄住金ソリューションズ	17.7	21.7	51,168	
キューブシステム	4.6	5.6	3,847	
コア	4.5	5.5	7,513	
ソフトクリエイトホールディングス	3.8	6.2	8,066	
T I S	35.1	43.1	124,128	
ネオス	3.1	3.9	1,762	
電算システム	3.7	4.5	7,222	
グリー	64.3	79.2	58,924	

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
コーエーテックモホールディングス	25.1	30.9	67,300	
三菱総合研究所	4.1	5	16,325	
ボルテージ	2.1	2.3	2,789	
電算	1.2	1.4	3,438	
AGS	1.8	3.3	5,854	
ファインデックス	7	9.6	9,580	
ヒト・コミュニケーションズ	2.4	2.9	5,295	
ブレインパッド	1.6	2.8	3,105	
KL a b	16.4	24.9	20,841	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	7	9.4	11,110	
イーブックイニシアティブジャパン	2.3	2	2,206	
ネクソン	101.3	142.4	243,504	
アイスタイル	16.1	27.4	24,851	
エムアップ	2.7	3.7	3,285	
エイチーム	3.9	7.2	19,087	
テクノスジャパン	1.1	10	10,620	
e n i s h	3.1	3.8	2,124	
コロブラ	29.4	36.5	37,668	
モバイルクリエイト	7	9.5	3,486	
オルトプラス	3.9	5.4	4,833	
ブロードリーフ	10.9	32.1	22,951	
ハーツユナイテッドグループ	3.2	6.8	10,540	
メディアドゥ	—	2.8	6,731	
ブイキューブ	5.2	7.1	4,338	
サイバーリンクス	1.2	2	2,028	
ディー・エル・イー	—	4.3	2,592	
フィックスターズ	—	1.9	6,232	
VOYAGE GROUP	2.4	4.4	7,686	
オブティム	0.7	1.4	7,896	
セレス	—	2.3	3,417	
ベリサーブ	1.2	1.5	4,234	
ティーガイア	10.5	12.9	25,503	
日本アジアグループ	9	14.7	5,821	
豆蔵ホールディングス	8.3	9.5	8,170	
テクマトリックス	4.5	8.1	10,570	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	185.1	272.8	67,381	
GMOペイメントゲートウェイ	9.2	10.6	59,890	
ザッパラス	6	6.7	3,329	
システムリサーチ	—	1.3	2,719	

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
インターネットイニシアティブ	17.1	19.1	38,257	
さくらインターネット	5.2	10.6	9,752	
GMOクラウド	2.3	2.9	6,452	
SRAホールディングス	6.1	6.9	20,417	
Minor iソリューションズ	1.5	2.9	3,906	
システムインテグレータ	1.5	1.8	1,236	
朝日ネット	9.6	11.8	6,029	
アドソル日進	—	2.6	3,200	
フリービット	—	7.2	6,357	
コムチュア	1.8	2.2	8,602	
サイバーコム	—	1.7	1,667	
メディカル・データ・ビジョン	—	2.2	8,239	
g u m i	10.9	14.7	17,007	
ショーケース・ティービー	—	1.5	1,842	
PC Iホールディングス	—	1.5	3,972	
パイプドHD	1.3	2.3	2,589	
アイビーシー	—	1	993	
オープンドア	—	1.3	4,082	
L I N E	—	21.8	89,162	
AOI TYO Holdings	—	10.6	8,829	
ソルクシーズ	—	3.7	2,094	
フェイス	2.8	3.4	4,294	
ハイマックス	1.4	1.7	2,590	
野村総合研究所	74.3	97.3	401,362	
サイバネットシステム	8.6	10.6	7,441	
CEホールディングス	1.6	2	2,180	
インテージホールディングス	5.5	7.4	15,303	
東邦システムサイエンス	3.1	4.3	2,975	
ソースネクスト	5.3	7.8	4,547	
ティー・ワイ・オー	14.7	—	—	
フォーカスシステムズ	—	5	3,000	
クレスコ	2.4	2.9	8,024	
フジ・メディア・ホールディングス	110.3	135.5	207,721	
オービック	36.5	44.9	238,868	
ジャストシステム	19.3	21	27,447	
TDCソフトウェアエンジニアリング	2.3	5.7	7,866	
ヤフー	759.4	932.7	478,475	
トレンドマイクロ	51.4	68.9	332,098	
インフォメーション・ディベロップメント	2	3.7	4,551	

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
日本オラクル	17	20.9	131,461	
アルファシステムズ	3.5	4.3	8,539	
フューチャー	12.7	17.6	15,188	
CAC Holdings	7.9	9.7	10,223	
ソフトバンク・テクノロジー	2.9	3.1	11,795	
トーセ	2.8	3.5	2,828	
オービックビジネスコンサルタント	5.4	6.6	36,498	
伊藤忠テクノソリューションズ	24	29.5	95,875	
アイティフォー	13.7	16.9	10,832	
東計電算	1.9	2.3	5,191	
エクスネット	1	1.2	2,432	
大塚商会	28.5	35	204,050	
サイボウズ	14.2	17.3	7,629	
ソフトブレーン	15.6	17.7	9,150	
電通国際情報サービス	6.5	8	19,792	
デジタルガレージ	—	18.9	43,110	
EMシステムズ	1.8	4.4	7,739	
ウェザーニューズ	3.6	4.4	15,818	
C I J	9.7	10.9	6,027	
東洋ビジネスエンジニアリング	1.1	1.3	2,173	
日本エンタープライズ	10.9	13.3	3,737	
WOWOW	5	6.2	24,614	
スカラ	6	9	7,920	
日本コロムビア	3.6	3.9	2,609	
イマジカ・ロボット ホールディングス	9	10.9	7,619	
ネットワンシステムズ	45.9	56.3	52,302	
システムソフト	—	23	3,450	
アルゴグラフィックス	4.8	5.9	14,502	
マーベラス	17.9	21.9	20,060	
エイバックス・グループ・ホールディングス	19.5	23.9	38,502	
日本ユニシス	29.2	35.9	54,065	
兼松エレクトロニクス	6.7	8.2	23,058	
東京放送ホールディングス	63.5	85.8	167,224	
日本テレビホールディングス	96.7	118.8	233,085	
朝日放送	10.5	12.8	10,355	
テレビ朝日ホールディングス	28.9	35.5	76,076	
スカパーJ SATホールディングス	80.4	84.6	40,692	
テレビ東京ホールディングス	9.6	10.6	27,019	
日本BS放送	1.8	2.9	3,079	

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
ビジョン	—	1.5	6,052	
U-NEXT	2.5	3.4	3,168	
ワイヤレスゲート	—	4.5	6,669	
コネクシオ	9.3	11.4	19,357	
日本通信	56.2	108.8	20,672	
クロップス	1.9	2.8	1,820	
日本電信電話	819	1,044.6	5,149,878	
KDDI	1,076.4	1,287.4	3,826,152	
光通信	12.7	15.6	170,664	
NTTドコモ	817.2	972.4	2,601,656	
エムティーアイ	13.6	19.9	13,551	
GMOインターネット	39.3	47.5	62,367	
カドカワ	33.1	37.7	60,433	
学研ホールディングス	35	43	13,416	
ゼンリン	14	17.2	38,270	
昭文社	5.8	7.1	5,062	
インプレスホールディングス	8.8	10.7	1,476	
アイネット	5.9	7.3	9,198	
松竹	70	86	111,800	
東宝	75.6	85.1	253,427	
東映	39	48	46,176	
AOI Pro.	5.3	—	—	
エス・ティ・ティ・データ	65.5	80.4	422,100	
ビー・シー・エー	1.3	1.9	3,171	
ビジネスブレイン太田昭和	1.6	2.2	2,314	
DTS	11.8	13.4	37,077	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	44.8	50.1	164,578	
シーイーシー	6.9	7.7	15,869	
カブコン	27.1	30.5	68,045	
アイ・エス・ビー	1.3	2.5	2,252	
ジャステック	6.7	8.2	8,519	
SCSK	25.2	35.4	156,114	
日本システムウエア	4	4.3	6,071	
アイネス	15	16.4	18,154	
TKC	9.8	12	38,280	
富士ソフト	15.7	19.3	54,792	
NSD	22.5	27.6	45,760	
コナミホールディングス	47.8	58.7	284,108	
福井コンピュータホールディングス	2.3	3.8	10,377	

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
J B C Cホールディングス	8.9	10.9	8,665	
ミロク情報サービス	7.8	9.6	17,520	
ソフトバンクグループ	600.3	585.8	4,605,559	
<b>卸売業 (4.5%)</b>				
ハウスイ	8	10	1,280	
高千穂交易	4.1	5	5,175	
伊藤忠食品	2.6	3.2	15,264	
エレマテック	4.9	5.2	10,280	
J A L U X	3.4	4.2	11,277	
あらた	4.8	5.8	17,806	
トーメンデバイス	1.6	1.9	4,246	
東京エレクトロン デバイス	3.8	4.7	7,750	
フィールズ	6.9	9.9	12,345	
双日	667.5	768.5	217,485	
アルフレッサ ホールディングス	133.2	153.9	300,105	
横浜冷凍	26.2	32.2	35,613	
神栄	15	18	3,528	
山下医科器械	0.9	1	1,829	
ラサ商事	5	5.6	4,345	
ラクーン	—	6.2	3,019	
アルコニックス	6	7.4	13,083	
神戸物産	6.8	7	30,450	
あい ホールディングス	18.9	18.5	47,841	
ディーブイエックス	2.8	4.6	6,118	
ダイワボウホールディングス	96	110	37,180	
マクニカ・富士エレホールディングス	19.1	24.1	38,945	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18.4	24.4	25,132	
八洲電機	8.2	10	6,710	
U K Cホールディングス	6.8	8.4	17,102	
O C H Iホールディングス	3.1	3.8	5,445	
T O K A Iホールディングス	46.6	57.2	49,535	
大阪工機	—	1.5	1,170	
三洋貿易	5.8	7.1	12,559	
ビューティガレージ	—	1.3	2,389	
ウイン・パートナーズ	3.8	9.4	9,353	
ミタチ産業	2.7	3	1,935	
シップヘルスケアホールディングス	21.5	25	77,125	
明治電機工業	3.3	4.4	5,825	
デリカフーズ	2.2	2.7	2,975	

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	2	2.9	1,481	
コメダホールディングス	—	17.6	31,451	
富士興産	4.1	4.7	2,382	
協栄産業	14	16	2,656	
小野建	9.2	11.3	16,339	
佐鳥電機	8.4	9.6	7,833	
エコートレーディング	2.4	3	1,995	
伯東	8	8.9	9,620	
コンドレーテック	8.4	10.3	9,579	
中山福	6.6	7.4	6,386	
ナガイレーバン	15.3	18.8	42,995	
三菱食品	11.6	14.3	50,765	
松田産業	7.7	9.5	15,029	
第一興商	18.7	21.2	96,566	
メディパルホールディングス	106	130.1	227,024	
アドヴァン	10.8	—	—	
S P K	2.4	2.8	7,176	
萩原電気	2.7	4.4	9,477	
アズワン	8.3	10.2	50,133	
スズデン	3.4	4.7	5,395	
尾家産業	3.4	4.2	5,082	
シモジマ	7.3	7.9	9,519	
ドウシシャ	12.5	15.3	32,130	
小津産業	2.3	2.8	6,280	
高速	6.3	7.7	8,647	
たけびし	3.7	4.5	6,817	
黒田電気	19.7	17.8	44,802	
リックス	—	2.9	4,895	
丸文	9.4	11.5	8,349	
ハビネット	9.6	10.8	18,856	
橋本総業ホールディングス	2.2	2.7	4,028	
日本ライフライン	—	11.1	23,598	
エクセル	5.1	5.6	8,422	
マルカキカイ	3.4	4.2	7,539	
I D O M	28.5	35	24,185	
日本エム・ディ・エム	8.8	9.8	7,448	
進和	6.2	7.7	14,529	
エスケイジャパン	2.6	2.4	744	
ダイترون	4.8	5.9	6,584	

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
シークス	6.7	9.3	40,734	
田中商事	3.2	4	2,784	
オーハシテクニカ	6	7.3	10,373	
白銅	3	3.3	5,850	
伊藤忠商事	831.5	953.1	1,526,389	
丸紅	1,042.8	1,280.7	887,012	
高島	20	22	4,576	
長瀬産業	63.7	78.2	122,383	
蝶理	6.7	8.3	16,292	
豊田通商	118	144.9	483,241	
三共生興	16.1	19.7	8,254	
兼松	225	277	54,569	
ツカモトコーポレーション	19	23	2,921	
三井物産	958.1	1,176.8	1,914,653	
日本紙バルブ商事	55	68	26,656	
日立ハイテクノロジーズ	36.7	45.1	203,852	
カメイ	13.8	16.9	21,412	
東都水産	17	2	3,984	
OUGホールディングス	15	20	5,300	
スターゼン	3.8	5.4	25,542	
山善	40.7	49.9	50,997	
椿本興業	12	15	6,240	
住友商事	667	819.2	1,223,475	
内田洋行	26	6.4	16,518	
三菱商事	795	976.4	2,365,329	
第一実業	24	30	21,450	
キャノンマーケティングジャパン	30.2	37.1	81,137	
西華産業	35	42	15,498	
佐藤商事	9.4	11.6	10,695	
菱洋エレクトロ	12.2	12.4	20,571	
東京産業	10.6	12.9	6,166	
ユアサ商事	10	12.3	38,068	
神鋼商事	24	3.3	8,170	
小林産業	7.1	9.5	2,631	
阪和興業	106	130	104,520	
カナデン	10.1	12.4	13,776	
菱電商事	17	21	15,687	
フルサト工業	5.8	7.2	12,924	
岩谷産業	126	144	94,608	

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
すてきなニスグループ	45	55	8,580	
昭光通商	38	46	3,910	
ニチモウ	16	19	3,515	
極東貿易	15	20	4,840	
イワキ	16	20	6,040	
三菱石油	27	34.9	32,875	
稲畑産業	25.4	31.2	44,023	
G S I クレオス	28	32	4,288	
明和産業	9.8	12	4,944	
ワキタ	22.5	27.7	29,417	
東邦ホールディングス	33.9	41.7	98,120	
サンゲツ	36.9	44.6	84,517	
ミツウロコグループホールディングス	17	20.9	14,985	
シナネンホールディングス	23	5.6	12,644	
伊藤忠エネクス	27.3	28.7	26,432	
サンリオ	32.7	40.1	85,493	
サンワテクノス	6.7	7.7	8,855	
リョーサン	16.8	19.3	67,260	
新光商事	12.4	14.2	17,835	
トーホー	4.8	5.9	15,511	
三信電気	14.6	14.4	19,339	
東陽テクニカ	15	16	16,176	
モスフードサービス	13.9	17	56,780	
加賀電子	9.6	11.8	23,529	
ソーダニッカ	11	13.4	7,048	
立花エレテック	7.8	8.8	12,267	
フォーバル	4.2	5.7	3,853	
P A L T A C	16.9	20.8	65,416	
三谷産業	11.3	13.8	5,285	
太平洋興発	44	54	5,562	
ヤマタネ	49	6.5	10,159	
丸紅建材リース	9	13	3,107	
日鉄住金物産	70	11.4	52,326	
トラスコ中山	12.1	29.7	75,913	
オートバックスセブン	40.6	48.2	81,554	
モリト	—	10.4	9,599	
加藤産業	16.5	20.3	59,763	
イノテック	9.8	11.2	7,492	
イエローハット	10	12.3	31,770	

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
J Kホールディングス	10.6	13	8,723	
日伝	4.4	5.4	18,738	
北沢産業	8.8	10.7	2,332	
杉本商事	6.1	7.5	11,662	
因幡電機産業	14.8	18.3	74,481	
バイテックホールディングス	3.2	5.3	7,340	
ミスミグループ本社	119	146.3	290,551	
アルテック	9.1	11.1	2,331	
タキヒヨー	18	20	9,040	
蔵王産業	1.7	2.1	3,192	
スズケン	48.2	59.2	220,224	
ジェコス	7.3	8.9	9,790	
ルネサスイーストン	6.7	11.9	7,259	
<b>小売業 (4.6%)</b>				
ローソン	40.1	41.1	313,182	
サンエー	7.2	9.8	49,686	
ダイユーエイト	2.8	—	—	
カワチ薬品	8.2	10.1	30,956	
ユーピーシー・マート	13.7	23.7	155,946	
ハードオフコーポレーション	5.1	5.7	6,703	
アスクル	12.9	13.6	42,976	
ゲオホールディングス	20.1	21.7	27,559	
アダストリア	19.5	20	56,220	
ジーフット	6.4	7.8	5,959	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	15	1.7	1,200	
くらコーポレーション	6.2	8.5	38,845	
キャンドウ	5.6	6.9	12,213	
パルグループホールディングス	6.2	6.6	17,298	
エディオン	44.8	50.4	54,180	
サーラコーポレーション	9.1	16.2	10,108	
ワッツ	4.2	5.6	7,274	
ハローズ	3.2	4.3	9,636	
あみやき亭	2.1	2.5	11,162	
ひらまつ	14.6	17.9	12,207	
ゲンキー	2.1	2.6	18,200	
サッポロドラッグストアー	1	—	—	
大黒天物産	2.5	3.1	15,484	
ハニーズホールディングス	9.3	12.6	14,086	
ファーマライズホールディングス	2.4	3	1,581	

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
アルペン	9.4	9.9	19,364	
クオール	10.8	14.7	23,446	
ジェイアイエス	7.2	8.8	51,392	
ビックカメラ	54.7	74.7	78,061	
DCMホールディングス	52.1	79	80,185	
MonotaRO	37.4	46.1	153,513	
東京一番フーズ	1.8	3.2	1,875	
ダイヤモンドダイニング	1.7	2.9	4,756	
きちり	2.8	3.5	2,303	
アークランドサービスホールディングス	3.3	4.1	12,320	
J. フロント リテイリング	134.1	164.6	274,882	
ドトール・日レスホールディングス	18.6	22.8	50,638	
マツモトキヨシホールディングス	21.9	24.6	132,594	
ブロンコビリー	4.1	6.8	19,876	
スタートトゥデイ	32.2	118.8	275,734	
トレジャー・ファクトリー	3	3.7	2,937	
物語コーポレーション	2.8	3.7	18,352	
ココカラファイン	11	13.6	63,172	
三越伊勢丹ホールディングス	210.7	258.9	329,579	
Hamee	—	2.9	2,897	
ウエルシアホールディングス	9.2	25.7	82,625	
クリエイトSDホールディングス	15.6	19.1	51,856	
丸善CHIホールディングス	12.4	15.2	5,411	
ミサワ	1.2	2.3	1,021	
ティーライフ	—	1.2	2,076	
エー・ピーカンパニー	1.7	2.1	1,902	
チムニー	2.6	4	11,204	
シュッピン	3	4.9	8,138	
ネクステージ	1.7	2.5	6,590	
ジョイフル本田	17.2	21.1	78,175	
鳥貴族	—	3.2	7,404	
キリン堂ホールディングス	3.4	4.2	3,452	
ホットランド	2.8	6	7,158	
すかいらく	32.4	55.8	95,920	
綿半ホールディングス	3	5.2	8,860	
ヨシックス	—	1.3	1,753	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	35.1	43.1	44,091	
ブックオフコーポレーション	6	7.4	5,979	
ゴルフダイジェスト・オンライン	2.2	5.2	4,076	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
BEENOS	—	1.5	2,182	
あさひ	7.9	9.7	12,697	
日本調剤	2.7	4.6	16,790	
コスモス薬品	5.3	6.6	144,144	
トーエル	5.1	6.3	5,966	
一六堂	2.6	2.7	1,058	
オンリー	—	1.5	1,290	
セブン&アイ・ホールディングス	443.2	544.6	2,373,911	
薬王堂	1.5	6.5	17,810	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	28.4	34.9	35,004	
ツルハホールディングス	24.3	26	279,500	
サンマルクホールディングス	8.4	8.4	28,812	
フェリシモ	3	3.7	3,770	
トリドールホールディングス	13	16	37,936	
クスリのアオキ	9.4	—	—	
サツドラホールディングス	—	1.7	3,564	
ダイユー・リックホールディングス	—	4.2	3,053	
バロックジャパンリミテッド	—	7.6	10,047	
クスリのアオキホールディングス	—	10.3	52,839	
メディカルシステムネットワーク	12.1	14.7	7,276	
総合メディカル	5.1	6.3	26,995	
はるやまホールディングス	4.4	6.1	6,411	
ノジマ	—	15.1	21,245	
カッパ・クリエイト	14.8	18.2	23,150	
ライトオン	7.9	9.7	9,719	
ジーンズメイト	3.4	4.1	1,016	
良品計画	12.2	17.2	401,104	
三城ホールディングス	13.2	16.1	7,744	
アドヴァン	—	13.2	15,919	
アルピス	2.8	3.4	11,951	
コナカ	12.5	16.6	10,009	
ハウス オブ ローゼ	1.3	1.6	2,537	
G-7ホールディングス	3.1	3.8	9,427	
イオン北海道	7.1	13	7,956	
コジマ	15.7	19.1	5,653	
ヒマラヤ	3.3	4	3,288	
コーナン商事	15	18.5	39,109	
エコス	3.9	5	5,955	
ワタミ	12.5	15.4	20,035	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
マルシェ	2.6	2.9	2,453	
ドンキホーテホールディングス	68.5	84.2	325,433	
西松屋チェーン	20.9	22.8	28,682	
ゼンショーホールディングス	54.5	67.4	127,992	
幸楽苑ホールディングス	6.7	8.2	14,661	
ハークスレイ	2.9	3.2	3,756	
サイゼリヤ	17.4	21.4	60,283	
V Tホールディングス	35.8	44	26,444	
魚力	3.3	4	5,304	
ポブラ	2.7	3.2	1,699	
フジ・コーポレーション	—	1.9	4,377	
ユナイテッドアローズ	15.1	17.3	55,619	
ハイデイ日高	9.6	14.2	33,767	
京都市もの友禅	7.2	8.2	8,241	
コロワイド	35.1	43.1	80,467	
ビーシーデポコーポレーション	8.8	17.2	9,081	
巻番屋	4.8	9.1	34,398	
トップカルチャー	3.8	4.7	2,270	
P L A N T	2.4	2.9	3,419	
スギホールディングス	19	28.5	149,625	
ヴィア・ホールディングス	—	9.9	11,741	
スクロール	16	19.7	7,052	
ヨンドシーホールディングス	8.1	9.9	24,561	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	32.6	57.1	387,709	
木曽路	13	15.9	40,910	
サトレストランシステムズ	12.5	15.3	13,571	
千趣会	20.9	23.5	19,058	
タカキュー	8.2	10	1,970	
ケーヨー	17.8	21.9	12,373	
上新電機	25	31	35,464	
日本瓦斯	12.1	23.9	76,599	
ベスト電器	34.4	41.9	6,075	
ロイヤルホールディングス	17.6	21.4	47,957	
東天紅	8	11	1,804	
いなげや	11.8	14.5	23,214	
島忠	27.4	33.7	93,247	
チヨダ	12.5	15.3	40,193	
ライフコーポレーション	6.7	9.8	30,870	
リンガーハット	9.6	14.6	33,288	



銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
さが美	8	12	1,524
MrMax	9.3	16.2	6,512
テンアライド	9.8	12	4,836
AOKIホールディングス	24.2	26	35,048
オークワ	17	19	21,147
コメリ	16.3	20	56,280
青山商事	20.3	27.2	111,248
しまむら	12.3	15.1	223,933
はせがわ	3.8	6.9	3,098
高島屋	154	218	215,602
松屋	21.3	28.4	29,166
エイチ・ツー・オー リテイリング	54.3	66.6	121,744
近鉄百貨店	40	50	16,950
丸栄	22	27	2,295
ニッセンホールディングス	15.7	—	—
バルコ	10.1	12.5	15,550
丸井グループ	130	136.9	211,784
アクシアル リテイリング	8.2	10.1	43,884
井筒屋	57	7	2,842
イオン	436	535.4	866,544
ユニグループ・ホールディングス	101.4	—	—
イズミ	21	25.8	130,290
東武ストア	13	1.6	4,824
平和堂	21.5	26.4	71,438
フジ	11.8	14.5	34,887
ヤオコー	12	14.7	63,945
ゼビオホールディングス	14.4	17.7	30,886
ケーズホールディングス	22.4	60	122,700
Olympicグループ	6.2	7.6	4,598
日産東京販売ホールディングス	17.9	19.1	7,525
アインホールディングス	12.8	17	131,240
元気寿司	3	3.3	7,474
ヤマダ電機	322.2	435.2	250,675
アークランドサカモト	17.9	22	30,800
ニトリホールディングス	45.8	56.2	749,708
グルメ杵屋	8	9	10,008
愛眼	8.5	9.5	1,909
ケーユーホールディングス	5.5	6.8	6,283
吉野家ホールディングス	39.1	45.3	73,567

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
松屋フーズ	5.1	6.2	27,900
サガミチェーン	14.1	16.3	23,798
関西スーパーマーケット	8.6	10.6	16,631
王将フードサービス	7.8	9.5	40,897
ブレナス	11.8	14.5	36,685
ミニストップ	7.8	9.6	20,659
アークス	19.8	24.4	64,489
パローホールディングス	22.8	28	74,928
藤久	0.8	1	1,736
ベルク	5.2	5.8	25,810
大庄	4.9	6.9	10,853
ファーストリテイリング	21.2	21.7	754,943
サンドラッグ	22.4	24.7	189,202
サックスパー ホールディングス	10	12.2	15,250
ヤマザワ	2.2	2.7	4,878
やまや	2.2	2.7	4,549
ペルーナ	26.4	32.4	27,540
<b>銀行業 (8.2%)</b>			
島根銀行	2.2	2.7	3,936
じもとホールディングス	76	93.4	18,213
めぶきフィナンシャルグループ	77.8	627.5	283,630
東京TYフィナンシャルグループ	14.6	18.8	64,954
九州フィナンシャルグループ	162.2	213.4	148,953
ゆうちょ銀行	203.6	368.5	518,111
富山第一銀行	—	33.1	17,609
コンコルディア・フィナンシャルグループ	—	851.9	451,336
西日本フィナンシャルホールディングス	—	88.2	100,989
新生銀行	917	1,239	249,039
あおぞら銀行	670	823	343,191
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,501.4	9,861	6,948,060
りそなホールディングス	1,239.5	1,522.4	919,681
三井住友トラスト・ホールディングス	2,212	271.7	1,054,467
三井住友フィナンシャルグループ	848.4	1,042	4,327,426
第四銀行	134	159	72,186
北越銀行	114	14.1	39,931
西日本シティ銀行	345	—	—
千葉銀行	409	502	364,954
横浜銀行	711	—	—
常陽銀行	383	—	—

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
群馬銀行	235	289.2	172,363
武蔵野銀行	16.9	20.8	70,304
千葉興業銀行	29	35.7	21,669
筑波銀行	44	54.1	17,095
七十七銀行	166	204	99,552
青森銀行	78	101	39,188
秋田銀行	69	83	28,469
山形銀行	60	73	35,040
岩手銀行	7.4	8.5	39,610
東邦銀行	95	116	48,140
東北銀行	54	66	10,362
みちのく銀行	53	78	14,976
ふくおかフィナンシャルグループ	459	528	260,832
静岡銀行	310	354	324,972
十六銀行	133	175	63,875
スルガ銀行	100.6	133	314,545
八十二銀行	192	251.1	164,219
山梨中央銀行	66	81	41,553
大垣共立銀行	141	201	67,938
福井銀行	91	111	29,304
北國銀行	118	138	58,650
清水銀行	3.6	4.4	14,718
富山銀行	2	2.5	10,187
滋賀銀行	100	122	70,638
南都銀行	102	12.6	52,920
百五銀行	95	117	53,118
京都銀行	202	233	195,487
紀陽銀行	41.6	48.9	85,086
三重銀行	47	5.8	13,786
ほくほくフィナンシャルグループ	721	86.6	154,754
広島銀行	313	384	184,320
山陰合同銀行	64.2	78.2	72,100
中国銀行	75.1	92.2	151,484
鳥取銀行	34	4.1	7,273
伊予銀行	113.3	139.2	107,323
百十四銀行	116	143	54,769
四国銀行	82	100	29,500
阿波銀行	87	111	79,698
大分銀行	61	75	32,925

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
宮崎銀行	71	87	30,102
佐賀銀行	64	79	23,463
十八銀行	65	80	29,040
沖縄銀行	8.4	12.7	53,022
琉球銀行	21.8	26.8	42,799
セブン銀行	397	487.8	179,022
みずほフィナンシャルグループ	14,934.3	17,667.9	3,676,689
高知銀行	41	47	6,204
山口フィナンシャルグループ	99	122	150,426
長野銀行	35	4.3	8,608
名古屋銀行	89	10.9	43,600
北洋銀行	159.6	212.4	91,332
愛知銀行	3.6	4.4	28,028
第三銀行	60	7.4	12,668
中京銀行	43	5.3	12,386
東日本銀行	51	—	—
大光銀行	38	45	10,035
愛媛銀行	62	15.5	21,328
トマト銀行	41	5	7,880
みなと銀行	96	11.8	25,027
京葉銀行	87	106	51,940
関西アーバン銀行	14.8	18.1	26,353
栃木銀行	57	71.8	37,407
北日本銀行	3.3	4.1	13,407
東和銀行	149	244	29,036
福島銀行	130	141	13,395
大東銀行	64	68	11,968
トモニホールディングス	81.3	107.2	63,462
フィデアホールディングス	64.8	126.3	26,396
池田泉州ホールディングス	112.4	138.1	65,597
<b>証券、商品先物取引業 (1.2%)</b>			
F P G	31.4	46.4	45,889
S B I ホールディングス	127.3	147.1	236,831
日本アジア投資	7.2	12.4	5,257
ジャフコ	17.7	21.7	83,002
大和証券グループ本社	991	1,218	847,728
野村ホールディングス	2,038.7	2,660.4	1,852,702
岡三証券グループ	90	111	79,809
丸三証券	31.5	41.4	41,607

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
東洋証券	41	46	12,098	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	121.6	149.3	91,222	
光世証券	25	31	5,890	
水戸証券	32.8	40.3	12,412	
いちよし証券	23.7	29.1	25,317	
松井証券	53.9	74.3	67,167	
だいに証券ビジネス	5.1	6.3	4,044	
マネックスグループ	124.7	139.6	38,390	
カブドットコム証券	93.9	97.9	36,614	
極東証券	14.2	17.4	29,562	
岩井コスモホールディングス	10	12.3	14,538	
藍澤証券	14.9	24.3	16,110	
マネースクウェアHD	3.6	—	—	
マネーパートナーズグループ	9.8	16.6	7,851	
小林洋行	3.1	3.7	1,102	
<b>保険業 (2.7%)</b>				
かんぽ生命保険	32.3	49.1	130,606	
SOMPOホールディングス	235.4	272.1	1,129,759	
アニコム ホールディングス	7.2	8.8	19,967	
MS&ADインシュアランスグループホール	316.6	388.9	1,420,262	
ソニーフィナンシャルホールディングス	101.5	124.7	232,066	
第一生命ホールディングス	678.9	784.7	1,587,840	
東京海上ホールディングス	429.3	527.2	2,521,070	
T&Dホールディングス	386.2	474.3	782,120	
アドバンスクリエイト	—	3	5,817	
<b>その他金融業 (1.2%)</b>				
全国保証	27.5	36.6	143,472	
クレディセゾン	80.4	98.7	199,768	
アクリーティブ	8.8	10.7	3,873	
芙蓉総合リース	12.1	14.9	76,586	
興銀リース	19.9	24.4	59,755	
東京センチュリー	24.9	26.2	102,049	
日本証券金融	46.7	57.3	34,781	
アイフル	177.4	218.2	70,478	
ポケットカード	10.6	9.7	5,936	
リコーリース	8.3	10.2	37,689	
イオンフィナンシャルサービス	69.5	83.1	181,158	
アコム	212.8	264.4	117,922	
ジャックス	58	72	34,560	

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
オリエントコーポレーション	458.1	281.4	56,842	
日立キャピタル	25	30.7	84,946	
アブラスフィナンシャル	50.8	62.4	6,739	
オリックス	750.3	921.5	1,549,041	
三菱UFJリース	268.8	330.1	184,195	
日本取引所グループ	311.1	404.6	653,833	
イー・ギャランティ	3.4	3.8	9,446	
アサックス	1.8	2.3	3,744	
NECキャピタルソリューション	4.3	5.3	9,237	
<b>不動産業 (2.4%)</b>				
いちご	87.9	123.7	41,563	
日本駐車場開発	115.8	156.9	23,221	
ヒューリック	220.9	271.4	290,669	
三栄建築設計	4.2	5.2	7,893	
野村不動産ホールディングス	70.3	86.4	158,976	
三重交通グループホールディングス	18.8	23.1	9,101	
サムティ	5.7	10.4	11,492	
ディア・ライフ	5.4	8.9	3,542	
エー・ディー・ワークス	73.4	119.3	4,772	
日本商業開発	3.5	7.2	13,795	
プレサンスコーポレーション	3.6	20.2	28,320	
ユニゾホールディングス	6.6	10.7	30,805	
THEグローバル社	—	4.5	2,137	
日本管理センター	6.9	9.3	12,824	
サンセイランディック	2.4	2.7	2,114	
エストラスト	1.9	2.3	1,508	
フージャースホールディングス	14.7	16.8	10,466	
オープンハウス	15.3	18.8	51,474	
東急不動産ホールディングス	256.3	314.8	193,602	
飯田グループホールディングス	98.1	108.5	195,083	
ムゲンエステート	—	4.5	3,627	
ファーストブラザーズ	—	1.3	2,285	
ハウスドゥ	—	1.6	2,585	
シーアールイー	—	1.8	2,818	
ケイアイスター不動産	—	2.6	4,206	
エコナックホールディングス	34	49	3,038	
パーク24	53.5	66	193,314	
バラカ	3.7	3.7	8,125	
三井不動産	562	690	1,651,170	

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
三菱地所	788	968	2,001,824	
平和不動産	20	24.6	38,031	
東京建物	115.7	151	222,272	
ダイビル	27.3	33.5	33,768	
京阪神ビルディング	17.5	21.6	13,478	
住友不動産	254	312	911,040	
大京	197	242	56,144	
テーオーシー	41.1	50.4	47,577	
東京楽天地	17	21	11,193	
レオパレス21	124.8	164.2	96,057	
スターツコーポレーション	12.1	13.3	31,547	
フジ住宅	13.5	16.6	12,632	
空港施設	12.8	15.7	9,184	
明和地所	5.8	7.1	5,545	
住友不動産販売	7.6	11.7	41,944	
ゴールドクレスト	8.3	11.7	23,388	
日本エスリード	4.1	5.1	8,058	
日神不動産	14.2	15.4	9,009	
日本エスコン	—	17.3	7,041	
タカラレーベン	46.2	56.7	29,030	
サンヨーハウジング名古屋	6	6.7	6,525	
イオンモール	68.4	83.8	144,555	
ファースト住建	3.9	4.8	7,238	
ランド	49.9	123.4	2,221	
トーセイ	16.1	17.8	13,296	
穴吹興産	12	1.4	3,847	
エヌ・ティ・ティ都市開発	65.8	80.8	80,153	
サンフロンティア不動産	12.8	14	14,028	
エフ・ジェー・ネクスト	9.2	11.3	11,831	
インテリックス	—	3	2,439	
ランドビジネス	7.2	7.7	2,233	
グランディハウス	9.3	11.4	4,959	
日本空港ビルデング	33.8	41.5	169,320	
<b>サービス業 (3.7%)</b>				
日本工営	38	9.2	27,563	
ネクスト	31.7	34	25,738	
ジェイエイシーリクルートメント	5.2	8.5	15,062	
日本M&Aセンター	17.3	39.7	145,699	
ノバレーゼ	2.9	—	—	

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
アコーディア・ゴルフ	31.1	—	—	
中広	1.1	1.3	904	
タケエイ	9.8	12.1	12,584	
トラスト・テック	2.3	5.6	9,979	
コシダカホールディングス	—	4.7	11,284	
パソナグループ	9.7	10.2	8,109	
CDS	2.5	3.1	3,196	
リンクアンドモチベーション	22.8	32.4	19,796	
GCA	9.9	12.2	11,394	
エス・エム・エス	14	19.5	53,196	
テンブホールディングス	78.6	106.6	216,824	
リニカル	6.6	8.1	12,117	
クックパッド	25	30.7	29,072	
エスクリ	4.7	4.9	3,885	
アイ・ケイ・ケイ	6	6.1	4,867	
学情	4.1	5.7	6,817	
スタジオアリス	5.2	5.6	12,992	
シミックホールディングス	5	7	9,828	
NJS	2.3	3.1	4,185	
総合警備保障	37.4	50.1	211,672	
カカコム	81.3	98.2	150,933	
アイロムグループ	3.2	4.2	5,493	
セントケア・ホールディング	—	1.8	3,036	
サイネックス	—	1	1,132	
ルネサンス	5.7	7	13,181	
ディップ	12.4	17.8	42,186	
オプトホールディング	7	9.9	10,404	
新日本科学	10.7	15.3	8,812	
ツクイ	13.3	32.6	21,483	
キャリアデザインセンター	3.1	2.9	3,297	
エムスリー	97.1	119.3	321,513	
ツカダ・グローバルホールディング	8.2	10	6,130	
アウトソーシング	5.2	8.1	33,048	
ウエルネット	4.2	10.3	13,884	
ワールドホールディングス	—	3.1	6,646	
ディー・エヌ・エー	50.3	61.7	143,761	
博報堂DYホールディングス	155.4	190.9	254,660	
ぐるなび	13	19.9	45,491	
エスアールジータカミヤ	9.1	14.8	8,376	

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
ジャパンベストレスキューシステム	12.8	17	4,386	
ファンコミュニケーションズ	25.9	35	28,770	
ライク	2.3	2.5	6,475	
ビジネス・ブレイクスルー	—	4.4	1,878	
WDBホールディングス	4	4.9	6,698	
ティア	4.7	6.6	5,141	
バリューコマース	10.4	12.7	5,384	
インフォマート	16.2	58.4	37,376	
J Pホールディングス	27.8	39.6	11,761	
E P Sホールディングス	12.5	17.1	26,727	
レッグス	1.6	3.1	2,325	
ブレステージ・インターナショナル	9.4	19.5	19,071	
アミューズ	3.1	7.6	17,632	
ドリームインキュベータ	3.7	4.2	8,950	
クイック	5.7	7	8,302	
T A C	6.2	7.6	1,748	
ケネディクス	150.5	174.6	78,046	
電通	125	153.5	924,070	
テイクアンドグヴ・ニーズ	5.3	6.4	6,073	
びあ	3.3	4.2	12,936	
イオンファンタジー	3.9	4	10,864	
シーティーエス	2.5	7.3	5,058	
ネクシィーズグループ	4	4.9	8,173	
みらかホールディングス	28.6	35.2	183,392	
アルプス技研	4.1	5.5	20,900	
サニックス	18.1	22	4,136	
ダイオーズ	2	2.5	2,670	
日本空調サービス	5.5	13.2	8,844	
オリエンタルランド	121.2	148.9	942,388	
ダスキン	31.7	35.3	87,791	
明光ネットワークジャパン	13	17.1	21,272	
ファルコホールディングス	4.9	6.5	10,348	
秀英予備校	2	2.7	1,382	
田谷	1.9	2.3	1,564	
ラウンドワン	35	43	38,012	
リゾートトラスト	47	53.3	107,292	
ビー・エム・エル	6.6	18	45,216	
ワタベウェディング	3.3	2	1,180	
りらいあコミュニケーションズ	18.5	22.8	25,102	

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
リソー教育	20.8	23.4	15,093	
早稲田アカデミー	1.5	1.8	2,332	
ユー・エス・エス	135.7	166.7	317,063	
東京個別指導学院	5.4	4.4	7,229	
サイバーエージェント	27.4	72.5	238,887	
楽天	524.6	703.7	755,070	
クリーク・アンド・リバー社	—	4.9	4,723	
テー・オー・ダブリュー	6.7	11	7,843	
セントラルスポーツ	3.8	4.7	17,037	
フルキャストホールディングス	10.3	14.2	15,151	
リソルホールディングス	11	14	5,166	
テクノプロ・ホールディングス	18.2	22.4	93,184	
アトラ	—	1.6	1,081	
インターワークス	1.5	2.8	3,049	
K e e P e r 技研	—	1.5	2,863	
ファーストロジック	—	0.7	1,856	
デザインワン・ジャパン	—	1.8	2,703	
イー・ガーディアン	—	4.5	7,537	
リブセンス	7.6	9.2	4,692	
ジャパンマテリアル	4.7	10	17,030	
バクトル	3.5	11.2	14,884	
ウチヤマホールディングス	5.8	6.2	2,839	
サクセスホールディングス	1	1.3	1,791	
キャリアリンク	1.5	3.1	2,083	
I B J	6.6	10.7	6,206	
アサンテ	4.1	5.1	8,496	
N・フィールド	4	6.5	9,243	
バリューHR	—	1	2,617	
M&Aキャピタルパートナーズ	0.9	1.8	9,198	
ライドオン・エクスプレス	1.8	3.4	3,114	
E R Iホールディングス	2.9	3.5	2,933	
アピスト	1.2	2.1	8,095	
ウィルグループ	2.5	5.5	4,554	
エスクロー・エージェント・ジャパン	—	2.3	3,385	
日本ビューホテル	1.2	2.8	3,827	
リクルートホールディングス	226.1	300.9	1,700,085	
エラン	0.9	1.8	3,493	
土木管理総合試験所	—	1.4	949	
日本郵政	247.3	359.4	514,301	

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
ベルシステム24ホールディングス	16.4	21	20,601	
一蔵	—	1	1,143	
ソラスト	—	6.3	10,243	
リログループ	4.2	5.2	91,468	
東祥	3.4	2.9	14,050	
エイチ・アイ・エス	18.3	22.4	59,046	
ラックランド	1.6	2.4	4,826	
共立メンテナンス	8.4	11.2	74,032	
イチネンホールディングス	11.7	14.4	17,092	
建設技術研究所	6.6	8.7	9,726	
スペース	6	7.4	10,101	
燦ホールディングス	2.2	2.7	4,541	
スバル興業	8	10	4,760	
東京テアトル	43	52	8,164	
タナベ経営	—	2.7	3,825	
ナガワ	2	2.5	9,962	
よみうりランド	22	27	11,961	
東京都競馬	77	94	23,782	
常磐興産	41	5	8,375	
カナモト	15.6	19.2	56,774	
東京ドーム	89	54.9	57,919	
西尾レントオール	9	11.1	35,131	
アゴラ・ホスピタリティー・グループ	56	68	2,516	
トランス・コスモス	13	16	42,096	
乃村工藝社	24	29.5	57,466	

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
藤田観光	41	45	15,660	
KNT-CTホールディングス	54	78	10,686	
日本管財	9.6	11.8	21,629	
トーカイ	5	6.1	24,888	
白洋舎	12	1.3	3,637	
セコム	116.6	143.3	1,145,970	
セントラル警備保障	4.9	6.1	10,412	
丹青社	21	23.8	22,895	
メイテック	14	16.7	77,404	
アサツー ディ・ケイ	19.7	22.4	64,467	
応用地質	11.8	13	18,356	
船井総研ホールディングス	15.6	17.7	36,090	
進学会	5.3	5.7	3,391	
オオバ	6.1	10.7	5,424	
学究社	1.6	3.6	5,860	
ベネッセホールディングス	37.6	46.1	163,655	
イオンディライト	10.8	15.5	53,397	
ナック	6.9	8.4	8,324	
ニチイ学館	19.5	23.9	20,315	
ダイセキ	21.1	24	54,264	
ステップ	3.8	4.6	6,854	
合 計	株 数・金 額	178,041	199,465	292,922,922
	銘柄数<比率>	1,933	1,997	<98.8%>

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

### 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	
		百万円	百万円
		2,820	—

## ○有価証券の貸付及び借入の状況

2017年3月27日現在における貸付株数の総株数は32,091,900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、32,091,900株です。

## ○投資信託財産の構成

(2017年3月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	292,922,922	87.5
コール・ローン等、その他	41,743,013	12.5
投資信託財産総額	334,665,935	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年3月27日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	334,665,935,303
コール・ローン等	37,346,027,243
株式(評価額)	292,922,922,728
未収入金	3,830,495,960
未収配当金	366,060,940
その他未収収益	72,744,432
差入委託証拠金	127,684,000
(B) 負債	38,274,908,532
未払金	74,784,980
未払解約金	3,555,901,019
未払利息	46,022
受入担保金	34,644,176,511
(C) 純資産総額(A-B)	296,391,026,771
元本	189,052,090,341
次期繰越損益金	107,338,936,430
(D) 受益権総口数	189,052,090,341口
1万円当たり基準価額(C/D)	15,678円

## ○損益の状況

(2016年3月26日～2017年3月27日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,193,888,085
受取配当金	4,664,860,608
受取利息	446,395
その他収益金	551,034,864
支払利息	△ 22,453,782
(B) 有価証券売買損益	30,713,194,538
売買益	41,607,023,039
売買損	△ 10,893,828,501
(C) 先物取引等取引損益	519,753,092
取引益	1,008,150,856
取引損	△ 488,397,764
(D) 保管費用等	△ 53,099
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	36,426,782,616
(F) 前期繰越損益金	60,132,306,746
(G) 追加信託差損益金	72,080,253,640
(H) 解約差損益金	△ 61,300,406,572
(I) 計(E+F+G+H)	107,338,936,430
次期繰越損益金(I)	107,338,936,430

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

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

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

<注記事項>

①期首元本額	160,669,331,010円	
期中追加設定元本額	173,392,386,291円	
期中一部解約元本額	145,009,626,960円	
また、1口当たり純資産額は、期末1.5678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）		18,684,449,723円
eMAXIS TOPIXインデックス		17,077,512,030円
eMAXIS バランス（8資産均等型）		1,656,580,816円
eMAXIS バランス（波乗り型）		99,802,897円
コアバランス		617,490円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）		3,273,572円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）		1,601,194円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）		4,933,249円
eMAXIS Slim 国内株式インデックス		49,732,237円
国内株式セレクション（ラップ向け）		2,584,584円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）		5,620,761,162円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）		10,565,357,162円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）		144,688,323円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）		170,036,213円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）		1,162,170,087円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）		68,179,843円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）		396,443,708円
eMAXIS バランス（4資産均等型）		43,112,557円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）		6,842,156円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）		11,948,701円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）		43,199,038円
eMAXIS 最適化バランス（マイフワード）		50,861,860円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）		61,420,211円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）		2,934,898,552円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）		12,002,930,294円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）		391,641,922円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）		3,451,440,494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）		36,368,609,266円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）		4,862,627,479円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）		1,846,915,127円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）		415,165,896円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）		274,097,035円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）		131,867,682円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）		507,547,681円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）		1,114,728,295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）		2,408,598円
MUAMトピックスリスクコントロール（5%）インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）		4,598,717円
MUAMトピックスリスクコントロール（10%）インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）		232,389,465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
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）		1,605,211,676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）		341,328,542円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）		82,293,572円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）		12,529,486円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）		3,492,669,678円
三菱UFJ TOPIX・ファンド		6,517,768,863円
三菱UFJ TOPIX・ライト		299,146,590円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA		7,572,986円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA		37,469,537円



インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	55,884,133円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	48,224,010円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	2,406,819,347円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	593,468,639円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	79,221,728円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	556,207,535円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	63,352,746円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	453,012,795円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	2,007,133,293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)	506,662,947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)	2,004,591,620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)	1,650,942,297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)	1,288,311,636円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	44,465,564,715円
合計	189,052,090,341円

# J P X日経400インデックスマザーファンド

## 《第4期》決算日2018年1月26日

[計算期間：2017年1月27日～2018年1月26日]

「J P X日経400インデックスマザーファンド」は、1月26日に第4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4期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定株式を含みます。）を主要投資対象とし、J P X日経インデックス400に連動する投資成果をめざして運用を行います。株式の組入比率は原則として高位を保ちます。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所上場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は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

### ○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		J P X日経インデックス400		株組入比率	株先物比率	純資産総額
	期騰落率	中率	期騰落率	中率			
(設定日)	円	%	%	%	%	%	百万円
2014年4月1日	10,000	—	10,901	—	—	—	999
1期(2015年1月26日)	11,815	18.2	12,733	16.8	96.2	3.8	4,866
2期(2016年1月26日)	11,593	△ 1.9	12,274	△ 3.6	97.6	2.4	12,535
3期(2017年1月26日)	13,375	15.4	13,860	12.9	97.2	2.8	12,083
4期(2018年1月26日)	16,392	22.6	16,637	20.0	97.3	2.7	8,332

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) J P X日経インデックス400とは、東京証券取引所の第一部、第二部、マザーズ、JASDAQを主たる市場とする普通株式等の中から時価総額、売買代金、ROE等を基に原則400銘柄を選定し算出される株価指数です。「J P X日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループおよび株式会社東京証券取引所（以下、総称して「J P Xグループ」といいます。）と株式会社日本経済新聞社（以下、「日本経済新聞社」といいます。）によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、J P Xグループと日本経済新聞社は、「J P X日経インデックス400」自体および「J P X日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。「J P X日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべてJ P Xグループと日本経済新聞社に帰属しています。ファンドは、委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、J P Xグループと日本経済新聞社は、その運用およびファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。J P Xグループと日本経済新聞社は、「J P X日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。J P Xグループと日本経済新聞社は、「J P X日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「J P X日経インデックス400」の内容を変える権利および公表を停止する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。

(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		J P X日経インデックス400		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率
	円	騰 落 率 %		騰 落 率 %	%	%
(期 首) 2017年1月26日	13,375	—	13,860	—	97.2	2.8
1月末	13,164	△ 1.6	13,642	△ 1.6	98.8	1.2
2月末	13,274	△ 0.8	13,748	△ 0.8	98.2	1.8
3月末	13,172	△ 1.5	13,522	△ 2.4	97.2	2.8
4月末	13,339	△ 0.3	13,692	△ 1.2	98.0	2.0
5月末	13,625	1.9	13,977	0.8	98.0	2.0
6月末	14,009	4.7	14,354	3.6	98.6	1.9
7月末	14,045	5.0	14,390	3.8	98.6	1.4
8月末	13,985	4.6	14,324	3.4	97.9	2.1
9月末	14,550	8.8	14,787	6.7	98.0	2.0
10月末	15,379	15.0	15,630	12.8	98.6	1.4
11月末	15,625	16.8	15,877	14.6	98.2	1.8
12月末	15,838	18.4	16,074	16.0	98.6	1.4
(期 末) 2018年1月26日	16,392	22.6	16,637	20.0	97.3	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

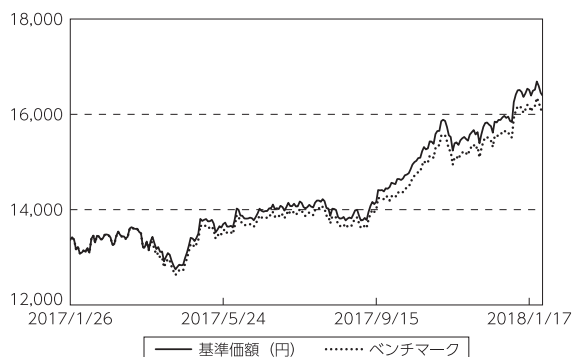
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ22.6%の上昇となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(20.0%)を2.6%上回りました。

## 基準価額等の推移



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

●投資環境について

◎国内株式市況

・フランス大統領選挙で親欧州連合（EU）派のマクロン氏が勝利したこと等を好感して世界的に株高となったこと、国内の衆議院選挙で与党が勝利したことによる経済政策継続への期待、国内企業の業績改善が進んだこと等を受け国内株式市況は上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。  
・株式ポートフォリオはベンチマークであるJ P X日経インデックス400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20.0%の上昇となったため、カイ離は2.6%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率 要 因	銘柄選択 要 因	その他の 要 因	合 計
ベンチマークとのカイ離	0.1%程度	△0.0%程度	2.4%程度	2.6%程度

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.1%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、2.7%程度となりました。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.4%程度でした。配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

プラス要因	配当収入等	計 2.5%程度
マイナス要因	売買コスト等	計 △0.1%程度

◎今後の運用方針

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ○ 1 万 口 当 た り の 費 用 明 細

(2017年1月27日～2018年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 ( 株 式 ) ( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	円 3 (0) (3)	% 0.020 (0.001) (0.019)	(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 )	1 (1)	0.006 (0.006)	(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	4	0.026	
期中の平均基準価額は、14,167円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○ 売 買 及 び 取 引 の 状 況

(2017年1月27日～2018年1月26日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 2,208 (△ 659)	千円 4,112,450 ( - )	千株 5,340	千円 9,294,365

(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 11,436	百万円 11,592	百万円 455	百万円 456

## ○株式売買比率

(2017年1月27日～2018年1月26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	13,406,815千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	9,052,271千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.48

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2017年1月27日～2018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		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 4,112	百万円 1,403	% 34.1	百万円 9,294	百万円 2,427	% 26.1

## 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 63	百万円 192	百万円 123

## 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 1

## 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)	1,864千円
うち利害関係人への支払額 (B)	7千円
(B) / (A)	0.4%

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、モルガン・スタンレーMUFJ証券、日立キャピタルです。

## ○組入資産の明細

(2018年1月26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
<b>水産・農林業 (0.0%)</b>				
日本水産	10.2	5.1		3,034
<b>鉱業 (0.4%)</b>				
国際石油開発帝石	41.5	22.1		33,006
<b>建設業 (3.3%)</b>				
安藤・間	5.7	3.5		3,269
東急建設	2.8	1.7		2,019
コムシスホールディングス	3.1	1.6		4,984
大成建設	40	4.5		26,010
大林組	23.6	13.6		19,012
清水建設	24	13.9		16,207
長谷工コーポレーション	9.2	5.3		9,550
鹿島建設	35	20		22,540
三井住友建設	30.2	3.3		2,085
前田建設工業	—	3.2		4,921
戸田建設	—	5		4,450
熊谷組	12	0.7		2,215
大東建託	2.9	1.6		32,640
N I P P O	2	1		2,548
前田道路	2	1		2,513
五洋建設	—	5.4		4,708
住友林業	5.4	2.9		5,727
大和ハウス工業	23.3	13.4		60,514
積水ハウス	24.8	14.8		31,672
協和エクシオ	3.1	1.6		4,640
九電工	1.5	0.9		5,049
日揮	7.3	—		—
<b>食料品 (4.4%)</b>				
江崎グリコ	2	1.1		6,149
カルビー	3.2	1.9		7,391
ヤクルト本社	4.2	2.4		21,192
明治ホールディングス	4.7	2.7		25,029
日本ハム	5	4		10,528
アサヒグループホールディングス	14.8	8.5		48,985

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
キリンホールディングス	33.9	19.6		55,164
サントリー食品インターナショナル	—	3.1		16,337
伊藤園	2.3	—		—
キッコーマン	6	3.2		14,592
味の素	16.2	9.4		19,631
キュービー	4	2.3		6,803
ニチレイ	3.9	1.9		5,677
東洋水産	3.9	2.2		10,461
日清食品ホールディングス	3.1	1.8		14,706
日本たばこ産業	33.2	25.2		92,181
<b>繊維製品 (0.5%)</b>				
帝人	—	3.5		8,666
東レ	53	30.8		34,619
<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>				
王子ホールディングス	29	18		13,716
大王製紙	2.9	1.7		2,585
<b>化学 (7.5%)</b>				
クラレ	12.4	7.2		15,062
旭化成	46	26.5		38,703
住友化学	54	31		25,699
日産化学工業	4	2.5		11,487
東ソー	21	6.1		15,274
デンカ	15	1.6		7,112
信越化学工業	13.2	7.1		88,821
エア・ウォーター	6.1	3.5		8,403
大陽日酸	5.7	3.3		5,702
日本パーカライズン	3.8	2.2		4,371
三菱瓦斯化学	6.9	3.5		11,042
三井化学	—	3.9		13,591
J S R	7.4	4.3		9,829
三菱ケミカルホールディングス	49.3	28.5		34,442
ダイセル	9.9	5.7		7,575
積水化学工業	16.7	8.8		19,712
日本ゼオン	6	3.6		5,821

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
アイカ工業	2.4	1.2	4,968	
宇部興産	37	2.1	6,846	
日立化成	4.1	2.1	6,165	
ダイキョーニシカワ	—	0.8	1,476	
日本化薬	5	2.8	4,578	
日油	6	1.6	4,798	
花王	18.7	10	77,000	
日本ペイントホールディングス	5.7	3.3	12,787	
関西ペイント	7.7	4.5	12,523	
D I C	2.9	1.7	7,497	
富士フィルムホールディングス	14.6	—	—	
資生堂	14	7.6	44,566	
ライオン	—	5.7	11,975	
コーセー	1.2	0.7	13,321	
シーズ・ホールディングス	1	0.6	3,516	
小林製薬	2	1.1	8,162	
日東電工	5.3	3.1	31,139	
ニフコ	1.3	0.7	5,411	
ユニ・チャーム	14.9	8.6	25,787	
<b>医薬品 (5.2%)</b>				
協和発酵キリン	8.8	5.1	11,281	
武田薬品工業	27.6	15	99,660	
アステラス製薬	75.2	41.7	59,297	
大日本住友製薬	—	3	4,800	
塩野義製薬	10	5.8	36,319	
田辺三菱製薬	8.6	5	11,535	
中外製薬	7.3	4.2	25,158	
科研製薬	1.4	0.7	4,137	
エーザイ	9.1	4.9	31,090	
小野薬品工業	16.7	9.6	26,169	
久光製薬	2.1	1.2	9,312	
参天製薬	13.6	7.7	14,306	
ツムラ	2.5	1.5	5,730	
沢井製薬	1.2	0.8	4,000	
第一三共	21.7	11.6	40,495	
キョーリン製薬ホールディングス	1.8	—	—	
大塚ホールディングス	15.8	8.4	41,655	
大正製薬ホールディングス	1.6	—	—	

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
<b>ゴム製品 (1.2%)</b>				
横浜ゴム	4.4	2.4	6,756	
東洋ゴム工業	3.9	2.4	5,620	
ブリヂストン	24.8	14.3	77,534	
住友ゴム工業	6.9	4	8,652	
<b>ガラス・土石製品 (1.0%)</b>				
旭硝子	36	4.1	19,762	
住友大阪セメント	14	8	4,160	
太平洋セメント	44	2.6	12,103	
T O T O	5.4	3.1	19,685	
日本碍子	9.3	5	11,060	
日本特殊陶業	6.3	3.5	10,314	
<b>鉄鋼 (1.1%)</b>				
新日鐵住金	33.2	18	51,453	
神戸製鋼所	12.7	—	—	
ジェイ エフ イー ホールディングス	20.1	10.8	28,533	
東京製鐵	—	2.1	1,997	
日立金属	7.5	4.3	6,966	
<b>非鉄金属 (0.9%)</b>				
日本軽金属ホールディングス	—	11.7	3,732	
三菱マテリアル	4.6	2.7	10,975	
住友金属鉱山	19	5.1	26,693	
DOWAホールディングス	8	1	4,690	
住友電気工業	27.7	15	28,350	
<b>金属製品 (0.2%)</b>				
三和ホールディングス	7.3	3.8	5,985	
三協立山	1	—	—	
リンナイ	1.3	0.7	7,252	
日本発條	6.9	4	4,904	
<b>機械 (6.0%)</b>				
アマダホールディングス	—	6.2	10,254	
オーエスジー	3.4	1.8	5,130	
DMG森精機	4.4	2.2	5,559	
ディスコ	0.9	0.5	12,990	
ニューフレアテクノロジー	0.2	0.1	686	
ナブテスコ	3.8	2.2	11,330	
SMC	2.2	1.3	71,123	
小松製作所	33.9	19.6	83,378	
住友重機械工業	21	2.3	11,431	



銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日立建機	3.3	1.9	8,331
ハーモニック・ドライブ・システムズ	—	0.6	4,500
クボタ	35.3	21.9	49,734
荏原製作所	3.2	1.7	7,811
ダイキン工業	9.6	5.5	73,425
椿本チエイン	4	2	1,846
ダイフク	3.5	2.1	15,624
タダノ	3.7	2	3,804
平和	2.2	1.3	2,753
竹内製作所	1.3	0.7	1,954
T P R	0.8	0.5	1,797
ホシザキ	2.1	1.3	13,754
日本精工	14.4	8.3	15,172
ジェイテクト	7.5	4.3	8,501
不二越	7	—	—
THK	5	2.5	11,587
イーグル工業	0.8	0.5	1,083
マキタ	4.6	5.3	27,666
三菱重工業	118	6.8	28,743
I H I	54	—	—
<b>電気機器 (16.8%)</b>			
コニカミノルタ	16.5	9.5	10,374
ブラザー工業	9.1	5	14,615
ミネベアミツミ	11.3	7.5	18,637
日立製作所	169	97	89,240
三菱電機	75	40.6	83,189
富士電機	21	12	10,740
安川電機	8.1	4.7	26,837
日本電産	9.1	4.9	89,131
オムロン	7.5	4.3	31,089
日本電気	97	5.3	16,774
富士通	68	42	34,129
沖電気工業	3	—	—
ルネサスエレクトロニクス	3.6	2.1	2,685
セイコーエプソン	10.5	6	16,140
アルバック	—	0.7	5,369
エレコム	0.6	0.4	1,082
パナソニック	80.3	46.4	76,977
富士通ゼネラル	2	1.2	2,535

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日立国際電気	1.8	0.7	2,180
ソニー	—	23.7	125,254
TDK	4	2.1	21,504
アルプス電気	6.5	3.5	10,972
クラリオン	—	2	798
ヒロセ電機	1.1	0.7	11,893
日本航空電子工業	2	1	1,828
横河電機	7.6	4.1	9,044
日本光電工業	2.9	1.7	4,448
堀場製作所	1.4	0.8	5,656
アドバンテスト	—	2.3	5,037
キーエンス	3.2	2	138,240
シスメックス	5.5	3.2	29,120
OBARA GROUP	—	0.2	1,544
スタンレー電気	5	3.1	14,105
カシオ計算機	5.7	3.3	5,610
ファナック	7.1	3.9	119,184
エンプラス	0.3	—	—
浜松ホトニクス	5.5	3	12,195
京セラ	11.5	6.7	49,754
村田製作所	7.4	4.3	68,434
小糸製作所	4.2	2.4	19,632
ミツバ	1.3	0.7	1,090
SCREENホールディングス	1.4	0.8	7,680
キヤノン	37.8	21.8	93,304
リコー	21.1	12.2	13,395
東京エレクトロン	4.7	2.7	58,927
<b>輸送用機器 (8.2%)</b>			
トヨタ紡織	—	1.2	2,883
豊田自動織機	6.4	3.3	24,090
デンソー	17.3	9	63,342
川崎重工業	55	3.2	14,528
名村造船所	2.1	—	—
日産自動車	84.1	47.9	56,617
いすゞ自動車	20.4	11.8	22,083
トヨタ自動車	28.1	18.2	138,465
日野自動車	10	5.8	8,578
日信工業	1.6	0.8	1,721
NOK	3.4	2.2	5,753

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
カルソニックカンセイ	5	—	—	—
アイシン精機	6.4	3.3	21,417	
マツダ	22.3	12.7	19,812	
本田技研工業	56.5	35	137,655	
スズキ	13.9	8	49,472	
S U B A R U	21.8	12.6	46,380	
ヤマハ発動機	9.9	5.7	21,318	
豊田合成	2.3	1.5	4,414	
シマノ	2.8	1.6	25,376	
ティ・エス テック	1.6	0.9	4,351	
<b>精密機器 (1.6%)</b>				
テルモ	10.8	6.2	34,224	
島津製作所	9	4.8	13,785	
ニコン	12.2	—	—	
トプコン	3.5	—	—	
オリンパス	11.2	6	25,680	
HOYA	14.5	8.3	47,484	
朝日インテック	1.7	2	8,490	
セイコーホールディングス	5	0.6	1,917	
<b>その他製品 (0.6%)</b>				
バンダイナムコホールディングス	7.8	4.2	15,267	
パイロットコーポレーション	1.2	0.7	3,941	
アシックス	7	4	7,360	
ヤマハ	4.7	2.7	12,879	
ビジョン	4.2	2.5	11,137	
<b>電気・ガス業 (1.4%)</b>				
中部電力	23.2	12.4	17,459	
関西電力	—	16.6	23,157	
東北電力	17.6	9.5	13,898	
電源開発	5.6	3.2	9,984	
東京瓦斯	75	8.7	23,220	
大阪瓦斯	68	7.9	17,526	
東邦瓦斯	18	2	6,300	
<b>陸運業 (4.8%)</b>				
東武鉄道	38	4.3	16,232	
相鉄ホールディングス	15	1.7	5,193	
東京急行電鉄	38	11	20,823	
小田急電鉄	11.3	6	14,844	
京王電鉄	20	2.3	12,236	

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
京成電鉄	5.3	2.8	10,738	
東日本旅客鉄道	13.6	7.3	82,745	
西日本旅客鉄道	6.8	3.7	31,261	
東海旅客鉄道	5.8	3.6	75,906	
西武ホールディングス	—	5.2	11,611	
西日本鉄道	11	1.5	4,680	
近鉄グループホールディングス	71	3.8	16,834	
阪急阪神ホールディングス	8.9	5.1	23,077	
南海電気鉄道	20	2.4	6,988	
京阪ホールディングス	21	2.3	8,211	
名古屋鉄道	34	4	11,776	
日本通運	27	1.5	11,490	
ヤマトホールディングス	12.6	6.7	17,513	
山九	9	1	4,860	
日立物流	—	0.8	2,344	
<b>海運業 (—%)</b>				
日本郵船	59	—	—	
<b>空運業 (0.8%)</b>				
日本航空	12.7	7.1	29,876	
ANAホールディングス	130	7.5	34,275	
<b>情報・通信業 (6.7%)</b>				
新日鉄住金ソリューションズ	—	0.6	1,896	
グリー	4.2	—	—	
ネクソン	7.6	4.5	16,402	
コロブラ	1.9	1.3	1,292	
ティーガイア	0.7	0.4	1,091	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	14.5	10.8	3,434	
野村総合研究所	5.1	2.7	14,499	
オービック	2.4	1.3	11,570	
ヤフー	49.7	28.7	15,268	
トレンドマイクロ	3.7	1.9	11,533	
日本オラクル	1.1	0.6	5,364	
伊藤忠テクノソリューションズ	1.6	0.9	4,500	
大塚商会	1.9	1.2	11,208	
U S E N	3.2	—	—	
日本テレビホールディングス	6.3	3.7	7,041	
日本電信電話	31.4	18	95,058	
KDD I	46.7	33.1	93,325	
光通信	0.8	0.5	8,035	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
NTTドコモ	51.8	29.5	80,726	
GMOインターネット	2.5	1.5	3,028	
東宝	4.5	2.6	9,776	
エヌ・ティ・ティ・データ	4.3	12.4	16,591	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	—	1.9	9,880	
S C S K	1.9	0.9	4,689	
コナミホールディングス	—	1.6	9,952	
ソフトバンクグループ	19.9	11.8	108,560	
<b>卸売業 (4.9%)</b>				
双日	41	23.7	8,579	
アルフレッサ ホールディングス	8.2	4.4	12,091	
神戸物産	—	0.3	1,444	
シップヘルスケアホールディングス	1.3	0.8	2,916	
第一興商	1.5	0.8	4,800	
メディバルホールディングス	6.9	4	8,836	
伊藤忠商事	50.8	29.3	64,005	
丸紅	68.3	32.8	27,614	
豊田通商	7.7	4.5	20,610	
兼松	15	1.7	2,594	
三井物産	62.7	34	66,096	
日立ハイテクノロジーズ	2.4	1.4	7,322	
住友商事	43.7	25.2	48,585	
三菱商事	52	28.1	88,093	
阪和興業	7	0.7	3,815	
岩谷産業	8	0.9	3,429	
東邦ホールディングス	2.2	1.2	3,084	
サンリオ	2.1	1.1	2,092	
日鉄住金物産	0.6	0.3	1,998	
ミスミグループ本社	7.8	4.6	16,491	
<b>小売業 (4.3%)</b>				
ローソン	2.4	1	7,360	
エービーシー・マート	1.3	0.7	5,012	
ゲオホールディングス	1.2	—	—	
アダストリア	—	0.6	1,438	
セリア	0.8	1	6,590	
ビックカメラ	—	2.3	3,882	
MonotaRO	2.5	1.4	5,033	
J. フロント リテイリング	8.8	4.8	9,638	
マツモトキヨシホールディングス	1.3	1.7	7,896	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
スタートトゥデイ	6.3	3.9	12,655	
ウエルシアホールディングス	0.9	1.1	5,258	
クリエイトSDホールディングス	1	0.6	1,623	
コスモス薬品	0.3	0.2	3,994	
セブン&アイ・ホールディングス	29	16.8	77,649	
ツルハホールディングス	1.6	0.8	12,448	
クスリのアオキホールディングス	0.6	0.3	1,731	
ノジマ	1.1	0.7	1,873	
良品計画	0.9	0.5	18,100	
ドンキホーテホールディングス	4.5	2.6	15,808	
VTホールディングス	3.1	—	—	
ユナイテッドアローズ	0.9	0.5	2,430	
スギホールディングス	1.5	0.9	5,292	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	2.1	1.3	9,789	
日本瓦斯	1.3	0.7	3,129	
しまむら	0.8	0.5	6,180	
高島屋	12	6	6,876	
イオン	28.5	15.4	29,260	
イズミ	1.4	0.7	4,921	
ヤオコー	0.8	0.5	2,715	
ケーズホールディングス	3.2	1.7	5,431	
アインホールディングス	0.8	0.6	4,092	
ニトリホールディングス	3	1.6	28,320	
パローホールディングス	1.5	0.9	2,365	
ファーストリテイリング	1.2	0.7	34,657	
サンドラッグ	1.3	1.7	8,177	
<b>銀行業 (6.5%)</b>				
めぶきフィナンシャルグループ	—	20.8	10,483	
東京TYフィナンシャルグループ	1	0.5	1,537	
九州フィナンシャルグループ	15.2	8.8	5,878	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	45.4	24.3	16,086	
新生銀行	66	3.5	6,727	
あおぞら銀行	44	2.4	10,728	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	300.9	132.4	111,335	
りそなホールディングス	81.1	43.9	29,882	
三井住友トラスト・ホールディングス	14.5	7.9	36,505	
三井住友フィナンシャルグループ	49.6	23.1	116,724	
千葉銀行	27	14	13,412	
群馬銀行	15.4	8.1	5,418	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ふくおかフィナンシャルグループ	28	—	—
静岡銀行	19	11	12,936
スルガ銀行	7.1	4.1	9,151
八十二銀行	17.8	—	—
ほくほくフィナンシャルグループ	4.6	2.7	4,482
広島銀行	20	5.9	5,457
中国銀行	6.6	3.7	5,461
セブン銀行	26	15	6,105
みずほフィナンシャルグループ	937.6	522.4	109,704
山口フィナンシャルグループ	9	5	6,490
北洋銀行	11.3	—	—
<b>証券、商品先物取引業 (1.3%)</b>			
F P G	2.5	1.4	2,391
S B I ホールディングス	7.8	4.5	11,565
ジャフコ	1.2	0.6	3,960
大和証券グループ本社	65	34	26,764
野村ホールディングス	141.8	72.3	52,525
岡三証券グループ	6	—	—
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	8	4.4	3,586
松井証券	4	2	2,024
カブドットコム証券	5.3	2.6	1,011
<b>保険業 (3.0%)</b>			
S O M P Oホールディングス	14.5	7.9	36,490
MS&ADインシュアランスグループホール	20.7	10.5	40,362
ソニーフィナンシャルホールディングス	6.6	3.3	6,662
第一生命ホールディングス	41.8	22.6	53,087
東京海上ホールディングス	28.1	15.1	79,501
T & Dホールディングス	25.3	12.4	24,359
<b>その他金融業 (1.5%)</b>			
全国保証	2	1.1	5,940
芙蓉総合リース	0.8	0.5	4,110
興銀リース	1.3	0.8	2,369
東京センチュリー	1.4	0.8	4,936
イオンフィナンシャルサービス	4.4	2.8	7,907
オリエントコーポレーション	15	8.7	1,609
日立キャピタル	1.6	1.1	3,432
オリックス	49.1	26.7	57,752
三菱UFJリース	17.6	10.2	7,609
日本取引所グループ	21.6	11.8	24,508

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>不動産業 (3.0%)</b>			
いちご	6.6	5.7	2,656
ヒューリック	14.5	8.4	11,155
野村不動産ホールディングス	4.6	2.7	7,630
プレサンスコーポレーション	1.1	0.5	806
オープンハウス	—	0.7	4,774
東急不動産ホールディングス	16.8	9.7	8,526
飯田グループホールディングス	5.8	3.3	7,392
パーク24	3.5	2.2	6,171
三井不動産	37	20	58,850
三菱地所	52	29.8	64,457
東京建物	8	4.4	8,043
住友不動産	17	10	43,260
大京	13	—	—
レオパレス21	8.8	4.8	4,248
スターツコーポレーション	0.9	0.5	1,587
住友不動産販売	0.6	—	—
タカラレーベン	3	—	—
イオンモール	4.5	2.6	6,398
エヌ・ティ・ティ都市開発	4.3	2.5	3,575
<b>サービス業 (2.7%)</b>			
ミクシィ	2	1	4,885
日本M&Aセンター	2.1	1.3	8,515
パーソルホールディングス	5.7	3.6	10,123
クックパッド	1.6	—	—
総合警備保障	2.7	1.5	9,360
カカオコム	5.2	3	5,658
ディップ	0.9	0.5	1,710
エムスリー	6.4	4.1	15,662
ディー・エヌ・エー	3.3	2.1	5,094
博報堂DYホールディングス	10.2	5.4	9,055
ぐるなび	1.1	—	—
電通	8.2	—	—
オリエンタルランド	7.9	4.6	50,715
リゾートトラスト	2.8	1.6	4,310
ユー・エス・エス	8.9	4.7	11,956
サイバーエージェント	3.9	2.5	10,512
楽天	37.5	19.9	20,307
リログループ	0.4	2.1	6,951

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エイチ・アイ・エス	1.2	—	—
カナモト	1	0.6	2,085
セコム	7.6	4.1	35,268
メイテック	—	0.5	3,010

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
イオンディライト	0.8	0.5	2,017
合 計	株数・金額	7,165	3,374
	銘柄数<比率>	400	400 <97.3%>

(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	J P X日経400	百万円 224	百万円 —

### ○投資信託財産の構成

(2018年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 8,107,423	% 97.3
コール・ローン等、その他	227,147	2.7
投資信託財産総額	8,334,570	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,334,567,919
コール・ローン等	211,302,859
株式(評価額)	8,107,423,960
未収配当金	10,745,100
差入委託証拠金	5,096,000
(B) 負債	1,574,865
未払金	1,573,580
未払解約金	973
未払利息	312
(C) 純資産総額(A-B)	8,332,993,054
元本	5,083,419,288
次期繰越損益金	3,249,573,766
(D) 受益権総口数	5,083,419,288口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,392円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 9,034,957,986円  
 期中追加設定元本額 3,428,793,481円  
 期中一部解約元本額 7,380,332,179円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.6392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)

国際 J P X 日経インデックス400オープン(適格機関投資家専用)	835,570円
e M A X I S J P X 日経400インデックス	4,727,831,670円
J P X 日経400インデックスファンド(ラップ向け)	63,590,850円
国内株式セレクション(ラップ向け)	227,774,492円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	6,363,540円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	57,023,166円
合計	5,083,419,288円

## 【お知らせ】

- ①投資対象、運用目的、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的ならびに有価証券の貸付の指図および範囲について、記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。  
 (2017年10月2日)
- ②当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。  
 (変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)  
 (2018年1月1日)

## ○損益の状況 (2017年1月27日～2018年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	188,338,824
受取配当金	188,321,320
受取利息	3,217
その他収益金	138,097
支払利息	△ 123,810
(B) 有価証券売買損益	1,542,902,407
売買益	1,810,287,190
売買損	△ 267,384,783
(C) 先物取引等取引損益	40,556,013
取引益	77,798,817
取引損	△ 37,242,804
(D) 保管費用等	△ 569,739
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	1,771,227,505
(F) 前期繰越損益金	3,049,023,026
(G) 追加信託差損益金	1,434,402,311
(H) 解約差損益金	△3,005,079,076
(I) 計(E+F+G+H)	3,249,573,766
次期繰越損益金(I)	3,249,573,766

(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。

# 日本株インカム・マザーファンド

## 《第25期》決算日2018年2月5日

〔計算期間：2017年8月4日～2018年2月5日〕

「日本株インカム・マザーファンド」は、2月5日に第25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25期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として東京証券取引所第一部上場株式の中から、予想配当利回りが市場平均と比較して高いと判断される銘柄に投資し、高水準の配当収入と中長期的な株価値上がり益の獲得をめざして運用を行います。なお、東京証券取引所第二部上場株式およびJASDAQ上場株式等に投資する場合があります。
主要運用対象	わが国の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合に制限を設けません。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		(参考指数)		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
	円	騰落率	東証株指数(TOPIX)	株価指数騰落率				
21期(2016年2月3日)	16,870	△11.5	1,406.27	△15.3	94.1	—	4.2	11,079
22期(2016年8月3日)	15,021	△11.0	1,271.98	△9.5	95.0	—	4.0	9,546
23期(2017年2月3日)	18,436	22.7	1,514.99	19.1	96.2	—	2.9	10,270
24期(2017年8月3日)	19,938	8.1	1,633.82	7.8	95.9	—	2.6	9,816
25期(2018年2月5日)	22,858	14.6	1,823.74	11.6	95.5	—	3.3	10,849

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(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) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		( 参 考 指 数 )		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	( TO P I X )	騰 落 率	騰 落 率			
(期首)	円	%			%	%	%
2017年8月3日	19,938	—	1,633.82	—	95.9	—	2.6
8月末	19,965	0.1	1,617.41	△ 1.0	96.1	—	2.7
9月末	20,818	4.4	1,674.75	2.5	95.2	—	2.5
10月末	21,717	8.9	1,765.96	8.1	95.9	—	2.0
11月末	21,982	10.3	1,792.08	9.7	96.1	—	2.0
12月末	22,733	14.0	1,817.56	11.2	96.8	—	1.9
2018年1月末	22,929	15.0	1,836.71	12.4	95.6	—	3.3
(期末)							
2018年2月5日	22,858	14.6	1,823.74	11.6	95.5	—	3.3

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

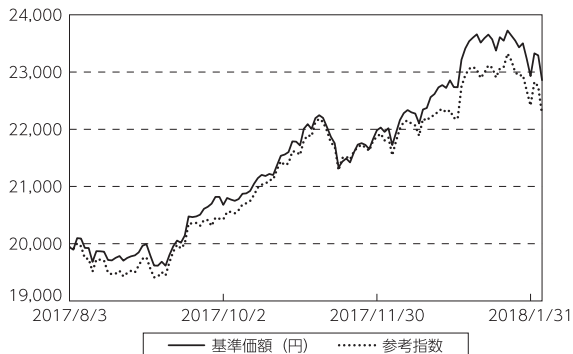
## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.6%の上昇となりました。

基準価額等の推移



(注) 参考指数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2017年9月上旬にかけては、米朝関係の緊迫化などを受けた地政学リスクに対する懸念などから、国内株式市況は下落基調となりました。
- ・9月中旬から期末にかけては、衆議院の解散報道とその後の与党勝利を受けて、安倍政権の基盤強化や経済政策への期待が広がったことや国内企業の良好な決算発表を受けて業績拡大期待が高まったことに加え、米税制改革法案への期待が高まったことなどを好感し、国内株式市況は大きく上昇しました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・株式組入比率は、運用の基本方針にしたがい、高水準を維持しました。
- ・銘柄選択にあたっては、予想配当利回りが市場平均を上回る銘柄の中から、株価の値上がり益が期待できる銘柄を厳選して投資しました。
- ・組入銘柄数は概ね80銘柄程度で推移させました。株価水準や予想配当利回り水準等を勘案し、銘柄入れ替えを機動的・継続的に行いました。当



期では、今後の業績拡大と増配余地などを考慮し住友金属鉱山など22銘柄を新規に組み入れました。また、海外での販売競争の激化が懸念されるSUBARUなど20銘柄を全株売却しました。新規組入と全株売却をした主な銘柄のポイントは以下の通りです。

#### ◎新規組入銘柄

- ・住友金属鉱山：非鉄金属市況の上昇などによる業績拡大と、業績に応じた株主還元の拡大を期待し、新規で組み入れました。

#### ◎全株売却銘柄

- ・SUBARU：海外での販売競争の激化による業績の懸念および今後の増配余地等を勘案し、全株売却しました。

以上の投資判断の結果、組入銘柄の株価上昇により、基準価額は14.6%上昇しました。パフォーマンスに寄与・影響した主な銘柄は以下の通りです。

(プラス要因)

#### ◎銘柄

- ・東京エレクトロン：予想配当利回り水準の高さなどから期首より保有していました。堅調な業績が確認されたことに加え、増配が発表されたことなどが好感され、株価は堅調に推移、プラスに寄与しました。
- ・伊藤忠商事：積極的な株主還元姿勢などを評価し、期首より保有していました。堅調な業績動向が好感され、株価は堅調に推移、プラスに寄与しました。

(マイナス要因)

#### ◎銘柄

- ・熊谷組：今後の株主還元強化を期待し、期首より保有していました。住友林業との資本業務提携に基づき第三者割当増資を発表したことで株式の希薄化が嫌気され株価は軟調に推移、マイナスに影響しました。

## ◎今後の運用方針

### ◎運用環境の見通し

- ・国内株式市況は、今後もしばらくは堅調な推移が続くと考えています。米国経済、アジア新興国経済が堅調に推移することに加えて、日本経済についても、堅調な雇用、鉱工業生産等に支えられて、拡大が持続すると期待しています。そのような状況下、2018年も日本企業の業績は堅調に推移すると考えています。こうした見通しに加え、資本生産性を改善させ市場の信任を得ることによって企業価値を向上させようとする動きの拡大が、日本企業の株主還元姿勢への注目を高めていると考えています。

### ◎今後の運用方針

- ・今後も企業調査を十分に行い、予想配当利回りの高い銘柄を中心に投資し、「高水準の配当収入」と「中長期的な株価の値上がり益」の獲得をめざす基本方針を継続します。加えて、財務の健全性や株式の流動性に留意しながら、保有銘柄の比率調整や新規銘柄の組み入れを行います。なお、国内株式市況が大幅に上昇する局面においても市況に追随するのではなく、引き続き基本方針に重きを置いた運用を行います。

## ○1万口当たりの費用明細

(2017年8月4日～2018年2月5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)	15	0.069	
(投資信託証券)	(14)	(0.066)	
	(1)	(0.003)	
合 計	15	0.069	
期中の平均基準価額は、21,690円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2017年8月4日～2018年2月5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
		2,835	4,592,715	2,884	4,699,480
		(△1,700)	( )		

(注) 金額は受渡代金。

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

## 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内		証 券	千円	証 券	千円
		—	—	47,000	11,609
		(47,000)	(—)		

(注) 金額は受渡代金。

(注) ( )内は株主割当および権利行使等による増減分です。

## 投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	アドバンス・レジデンス投資法人	0.062	17,283	0.018	4,917
	日本リート投資法人	0.081	27,115	—	—
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	0.277	33,507	—	—
	ラサールロジポート投資法人	0.234	27,763	—	—
	オリックス不動産投資法人	0.343	55,748	0.001	168
	グローバル・ワン不動産投資法人	0.039	16,150	—	—
	ユナイテッド・アーバン投資法人	0.144	24,152	0.163	26,539
	森トラス総合リート投資法人	0.018	2,891	0.303	49,362
	ケネディクス・オフィス投資法人	0.014	9,379	0.037	22,963
	大和証券オフィス投資法人	0.052	32,556	—	—
	大和ハウスリート投資法人	0.007	1,881	0.16	42,490
	合計	1	248,432	0.682	146,442

(注) 金額は受渡代金。

## ○株式売買比率

(2017年8月4日～2018年2月5日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	9,292,195千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	9,179,021千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.01

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2017年8月4日～2018年2月5日)

## 利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 4,592	百万円 1,083	% 23.6	百万円 4,699	百万円 975	% 20.7
投資信託証券	248	116	46.8	146	10	6.8

## 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 —	百万円 74	百万円 —

## 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 21

## 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)	6,600千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1,274千円
(B) / (A)	19.3%

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

(2018年2月5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
<b>建設業 (5.6%)</b>				
ミライト・ホールディングス	38.7	—	—	—
西松建設	145	17	52,700	
奥村組	166	23.4	110,682	
熊谷組	253	16.8	51,576	
大東建託	6.4	—	—	
大和ハウス工業	34.9	21.9	93,206	
積水ハウス	69.5	46.5	90,419	
中電工	31.4	27.6	87,216	
協和エクシオ	59.5	—	—	
新興ブランテック	64	87.2	95,484	
<b>食料品 (1.6%)</b>				
日本たばこ産業	25.4	47.8	171,410	
<b>化学 (4.5%)</b>				
デンカ	76	18.1	76,382	
三菱ケミカルホールディングス	—	135.7	157,886	
KHネオケム	36.3	—	—	
太陽ホールディングス	21.9	8.4	44,268	
D I C	12	—	—	
東洋インキS Cホールディングス	121	122	80,764	
ファンケル	33.2	—	—	
日本バルカー工業	39.1	31	102,300	
<b>医薬品 (3.4%)</b>				
武田薬品工業	44.1	39.4	248,889	
エーザイ	19	17	107,474	
<b>石油・石炭製品 (2.8%)</b>				
J X T Gホールディングス	504.2	402.6	285,926	
<b>鉄鋼 (1.5%)</b>				
新日鐵住金	—	56.2	155,364	
<b>非鉄金属 (3.4%)</b>				
日本軽金属ホールディングス	487.5	345	108,330	
住友金属鉱山	—	48.2	240,662	
<b>機械 (2.4%)</b>				
マックス	42	31.5	48,163	

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
ツバキ・ナカシマ	52	43.4	132,587	
日本精工	33.7	—	—	
スター精密	66.8	32.8	73,636	
<b>電気機器 (8.2%)</b>				
I D E C	27.5	48.7	148,291	
セイコーエプソン	33.9	—	—	
E I Z O	5.4	—	—	
キヤノン	110.1	104.9	445,405	
東京エレクトロン	19.1	13.2	259,974	
<b>輸送用機器 (10.6%)</b>				
日産自動車	396.9	242.8	283,954	
トヨタ自動車	28.6	79.5	596,329	
本田技研工業	—	54.7	217,213	
S U B A R U	87.1	—	—	
ヤマハ発動機	18.1	—	—	
<b>精密機器 (1.6%)</b>				
セイコーホールディングス	—	18.1	56,924	
ニプロ	69.6	66.2	107,839	
<b>その他製品 (—%)</b>				
リンテック	15.9	—	—	
<b>電気・ガス業 (1.0%)</b>				
関西電力	71.6	—	—	
東北電力	—	73.6	104,438	
<b>陸運業 (0.5%)</b>				
センコーグループホールディングス	61.9	60.2	48,641	
<b>空運業 (1.1%)</b>				
日本航空	36.8	26.7	109,656	
<b>情報・通信業 (8.4%)</b>				
コーエーテクモホールディングス	44.2	47.1	113,463	
トレンドマイクロ	15.1	8.3	47,891	
ネットワンシステムズ	82	23	41,561	
日本電信電話	—	34.5	177,399	
沖縄セルラー電話	10.8	7.8	33,384	
N T T ドコモ	150	168.8	453,818	

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
<b>卸売業 (15.4%)</b>				
TOKAIホールディングス	108.4	105.1	109,093	
コマダホールディングス	28	27.8	58,936	
伊藤忠商事	248.2	219.9	473,004	
兼松	423	53.7	81,462	
三井物産	103.6	83.3	166,891	
山善	35.3	—	—	
住友商事	79.7	166.8	317,754	
阪和興業	139	27.5	144,100	
稲畑産業	48.8	—	—	
日鉄住金物産	15.1	18	118,080	
オートバックスセブン	18.3	34.9	74,860	
因幡電機産業	3.9	10.6	54,060	
<b>小売業 (2.9%)</b>				
エディオン	—	19.1	26,415	
スシログローバルホールディングス	—	13.9	62,272	
VTホールディングス	—	66.9	39,671	
AOKIホールディングス	15	12.9	22,407	
青山商事	36.1	—	—	
ケーズホールディングス	49.3	48.3	147,798	
<b>銀行業 (12.7%)</b>				
あおぞら銀行	915	79.4	357,300	
りそなホールディングス	—	301.1	196,738	
三井住友フィナンシャルグループ	67.4	90.3	445,630	
みずほフィナンシャルグループ	1,338.2	1,536.9	314,910	

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
<b>保険業 (3.9%)</b>				
ソニーフィナンシャルホールディングス	117.1	112.7	235,092	
東京海上ホールディングス	26.8	32.7	168,960	
<b>その他金融業 (3.1%)</b>				
日本証券金融	—	67.6	44,954	
イオンフィナンシャルサービス	39.9	38.5	105,105	
ジャックス	138	—	—	
オリックス	91.9	87.6	175,725	
<b>不動産業 (2.7%)</b>				
野村不動産ホールディングス	14	40.4	102,979	
サムティ	—	32.3	63,146	
フージャースホールディングス	—	47	34,686	
パーク24	15.3	19.8	52,430	
フジ住宅	24.8	26.9	22,865	
<b>サービス業 (2.7%)</b>				
ジェイエイシーリクルートメント	27.7	27.3	58,804	
りらいあコミュニケーションズ	41.2	—	—	
リソー教育	58.9	56.8	47,768	
ベルシステム24ホールディングス	—	42.5	68,595	
ソラスト	32.8	9.7	28,595	
丹青社	—	62.7	75,240	
合 計	株 数・金 額	8,067	6,318	10,357,854
	銘柄数<比率>	75	73	<95.5%>

(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。

## 国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千口	千円	%
アドバンス・レジデンス投資法人	0.153	0.197	54,628	0.5
日本リート投資法人	—	0.081	26,406	0.2
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	—	0.277	32,963	0.3
ラサールロジポート投資法人	—	0.234	27,635	0.3
オリックス不動産投資法人	—	0.342	56,977	0.5
グローバル・ワン不動産投資法人	—	0.039	16,087	0.1
ユナイテッド・アーバン投資法人	0.346	0.327	56,145	0.5
森トラスト総合リート投資法人	0.285	—	—	—
ケネディクス・オフィス投資法人	0.105	0.082	56,580	0.5
大和証券オフィス投資法人	—	0.052	32,396	0.3
大和ハウスリート投資法人	0.153	—	—	—
合 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1 5	1 359,819	< 3.3% >

(注) 比率および合計欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率。

## ○投資信託財産の構成

(2018年2月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	10,357,854	95.4
投資証券	359,819	3.3
コール・ローン等、その他	136,219	1.3
投資信託財産総額	10,853,892	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年2月5日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	10,853,892,820
コール・ローン等	99,539,075
株式(評価額)	10,357,854,120
投資証券(評価額)	359,819,100
未収入金	11,609,000
未収配当金	25,071,525
(B) 負債	4,058,105
未払解約金	4,057,953
未払利息	152
(C) 純資産総額(A-B)	10,849,834,715
元本	4,746,620,078
次期繰越損益金	6,103,214,637
(D) 受益権総口数	4,746,620,078口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,858円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 4,923,511,318円  
 期中追加設定元本額 867,416,556円  
 期中一部解約元本額 1,044,307,796円  
 また、1口当たり純資産額は、期末2,2858円です。

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

三菱UFJ 好配当日本株ファンド(2ヵ月決算型)	3,423,570,768円
好配当日本株ファンド(ラップ向け)	872,958,048円
国内株式セレクション(ラップ向け)	450,091,262円
合計	4,746,620,078円

## 【お知らせ】

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

## ○損益の状況 (2017年8月4日~2018年2月5日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	137,854,627
受取配当金	137,750,520
受取利息	425
その他収益金	138,182
支払利息	△ 34,500
(B) 有価証券売買損益	1,061,657,241
売買益	1,228,575,605
売買損	△ 166,918,364
(C) 当期損益金(A+B)	1,199,511,868
(D) 前期繰越損益金	4,892,791,286
(E) 追加信託差損益金	1,166,524,911
(F) 解約差損益金	△1,155,613,428
(G) 計(C+D+E+F)	6,103,214,637
次期繰越損益金(G)	6,103,214,637

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



## ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

### 《第10期》決算日2017年5月12日

〔計算期間：2016年5月13日～2017年5月12日〕

「ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド」は、5月12日に第10期の決算を行いました。  
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第10期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円ヘッジ・円ベース) 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 (円ヘッジ・円ベース) 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、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。
主要運用対象	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円ヘッジ・円ベース) 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) (円ヘッジ・円ベース)		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
6期(2013年5月13日)	10,714	24.2	261.46	21.0	97.8	3.6	2.4	175,865
7期(2014年5月12日)	12,301	14.8	294.15	12.5	92.9	4.5	2.0	153,665
8期(2015年5月12日)	13,927	13.2	325.42	10.6	95.5	2.4	2.2	91,128
9期(2016年5月12日)	13,282	△ 4.6	303.60	△ 6.7	88.4	10.2	2.5	87,141
10期(2017年5月12日)	15,753	18.6	352.04	16.0	94.3	4.8	2.4	85,648

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

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

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

(注) 株式組入比率には新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCI Kokusai Index (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
	騰 落 率	(円ヘッジ・円ベース)	騰 落 率				
(期 首) 2016年5月12日	円	%		%	%	%	%
5月末	13,282	—	303.60	—	88.4	10.2	2.5
6月末	13,597	2.4	310.03	2.1	90.4	10.1	2.5
7月末	13,329	0.4	303.46	△ 0.0	83.8	6.3	2.5
8月末	13,991	5.3	318.26	4.8	85.9	12.3	2.5
9月末	14,090	6.1	319.70	5.3	85.8	12.1	2.5
10月末	14,004	5.4	317.40	4.5	87.5	7.8	2.5
11月末	13,905	4.7	314.89	3.7	89.7	10.0	2.4
12月末	14,237	7.2	321.59	5.9	96.7	7.1	2.5
2017年1月末	14,663	10.4	330.41	8.8	86.3	12.3	2.3
2月末	14,820	11.6	333.95	10.0	87.3	7.7	2.3
3月末	15,302	15.2	344.05	13.3	86.3	10.4	2.3
4月末	15,462	16.4	346.89	14.3	87.5	9.5	2.3
5月末	15,630	17.7	349.95	15.3	88.9	8.5	2.3
(期 末) 2017年5月12日	15,753	18.6	352.04	16.0	94.3	4.8	2.4

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

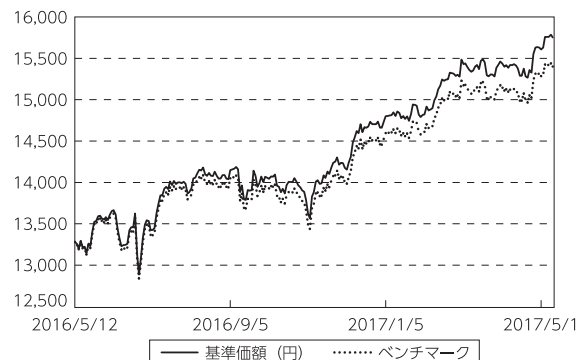
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ18.6%の上昇となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(16.0%)を2.6%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

- ・米国の堅調な企業決算発表や米国大統領選挙結果を受けた今後の政策期待などから、外国株式市況は上昇しました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

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

(注) マルチファクターモデル

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

- ・組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動性を維持するため、為替ヘッジを行いました。

●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16.0%の上昇となったため、カイ離は2.6%程度となりました。

	組入比率 要因	銘柄選択 要因	その他の 要因	合計
ベンチマーク とのカイ離	△0.1%程度	△0.1%程度	2.8%程度	2.6%程度

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

## ◎組入比率要因

組入比率による影響は△0.1%程度でした。

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

## ◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.1%程度でした。

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

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

## ◎その他の要因

その他の要因による影響は2.8%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入等	計 3.0%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料・為替ヘッジ効果等	計△0.2%程度

為替ヘッジ効果：為替変動に伴う外貨建資産の価格変動リスクの低減効果が、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

- ・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。
- ・組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動性を維持するため、為替ヘッジを行います。

## ○ 1万口当たりの費用明細

(2016年5月13日～2017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)	1	0.008	
(投資信託証券)	(1)	(0.004)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.004	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(1)	(0.004)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	5	0.033	(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)	(5)	(0.033)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	7	0.045	
期中の平均基準価額は、14,419円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2016年5月13日～2017年5月12日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 6,395 ( 419)	千アメリカドル 34,545 ( 553)	百株 16,475 ( 527)	千アメリカドル 98,941 ( 2,921)
	カナダ	917 ( 151)	千カナダドル 3,784 ( —)	1,856	千カナダドル 7,381
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	606 ( 355)	2,375 (△ 122)	1,396	5,150
	イタリア	1,590 (△ 817)	823 (△ 87)	3,485	1,159
	フランス	484 ( 167)	1,973 (△ 145)	1,306	4,666
	オランダ	433 ( 134)	757 ( 266)	1,058	1,952
	スペイン	1,496 ( 13,160)	670 ( 127)	15,381	1,682
	ベルギー	24 (△ 25)	220 (△ 240)	90	700
	オーストリア	9 ( —)	24 (△ 3)	27	81
	ルクセンブルク	81	170	119	134
	フィンランド	138	139	400	468
	アイルランド	552	66	1,491	200
	ポルトガル	63	26	10,470	90
	イギリス	58 ( 48)	205 ( 114)	58	188
	イギリス	6,645 ( 51,223)	千イギリスポンド 3,429 ( 54)	14,082 (55,555)	千イギリスポンド 9,094 ( 512)
	スイス	230 ( —)	千スイスフラン 1,485 (△ 306)	808	千スイスフラン 5,155
	スウェーデン	337 ( 151)	千スウェーデンクローネ 4,616 ( —)	1,139 ( 58)	千スウェーデンクローネ 14,142 ( 105)
	ノルウェー	186 ( —)	千ノルウェークローネ 2,278 (△ 77)	271	千ノルウェークローネ 3,053

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	デンマーク	百株 123 ( 24)	千デンマーククローネ 3,637 ( -)	百株 260	千デンマーククローネ 7,156
	オーストラリア	1,147 ( 100)	千オーストラリアドル 1,695 ( -)	3,614 ( 148)	千オーストラリアドル 5,046 ( 131)
	ニュージーランド	326	千ニュージーランドドル 169	280	千ニュージーランドドル 142
国	香港	2,422 ( 202)	千香港ドル 5,807 ( -)	4,416	千香港ドル 14,393
	シンガポール	1,891 ( 1,188)	千シンガポールドル 395 ( -)	4,742 ( 1,188)	千シンガポールドル 996 ( 9)
	イスラエル	168	千イスラエルシケル 792	513	千イスラエルシケル 4,388

(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	0.644	25	2	59
MACERICH CO/THE	0.162	13	0.843	59
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2	197	0.2	21
PROLOGIS INC	0.672	35	2	114
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.13	11	0.385	30
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	3	149	0.3	12
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.502	49	0.672	63
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.093	21	0.312	68
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.355	30	0.527	37
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.133	21	0.303	42
WELLTOWER INC	0.631	47	1	98
BOSTON PROPERTIES INC	0.205	28	0.679	83
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.7	64	0.1	9
REALTY INCOME CORP	0.495	32	1	60
REGENCY CENTERS CORP	1	91	0.279	18
SL GREEN REALTY CORP	0.211	24	0.446	46
UDR INC	0.492	17	1	40
VENTAS INC	0.651	46	1	71
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	4	46	5	56
WEYERHAEUSER CO	—	—	3	102
AMERICAN TOWER CORP	0.607	68	1	195
AGNC INVESTMENT CORP	—	—	1	26
VEREIT INC	3	40	5	46
DUKE REALTY CORP	0.675	18	1	35
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	3	98	1	32
IRON MOUNTAIN INC	1	57	1	35
EQUINIX INC	0.167	61	0.261	90
CROWN CASTLE INTL CORP	1	102	1	131
QUALITY CARE PROPERTIES	—	—	2	30
	( 2)	( —)		
PARK HOTELS & RESORTS INC	—	—	2	76
	( 2)	( 62)		
EQUITY RESIDENTIAL	0.49	31	1	97
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	11	169	—	—
GGP INC	0.744	21	2	61
HOST HOTELS & RESORTS INC	0.806	14	3	60
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.277	11	0.759	29
PUBLIC STORAGE	0.207	46	0.663	141
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.424	91	1	227
VORNADO REALTY TRUST	0.238	24	0.758	75
KIMCO REALTY CORP	0.646	19	1	44

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.187	32	0.603	101
小 計	44 ( 5)	1,866 ( 62)	55	2,640
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	—	—	0.3	9
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	—	—	0.5	11
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	—	—	0.4	10
小 計	—	—	1	31
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
GECINA SA	0.232	30	0.206	25
KLEPIERRE	0.29	12	0.968	34
UNIBAIL-RODAMCO SE	0.15	36	0.444	94
FONCIERE DES REGIONS	0.21 ( —)	17 (△0.90435)	0.159	11
ICADE	0.1	6	0.117	7
小 計	0.982 ( —)	103 (△0.90435)	1	174
ユ ー ロ 計	0.982 ( —)	103 (△0.90435)	1	174
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	5	38	4	25
HAMMERSON PLC	1	8	3	20
LAND SECURITIES GROUP PLC	0.904	9	3	33
INTU PROPERTIES PLC	—	—	2	7
SEGRO PLC	1	8	2	8
SEGRO PLC -RTS	— ( 3)	— ( —)	3	3
小 計	9 ( 3)	65 ( —)	19	99
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	4	14	15	45
SCENTRE GROUP	8	42	25	113
GPT GROUP	2	14	8	42
MIRVAC GROUP	6	14	18	38
STOCKLAND	3	14	9	44
WESTFIELD CORP	2	25	8	80
DEXUS	1	14	4	44
GOODMAN GROUP	2	17	7	52
小 計	31	160	99	461
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	3	169	11	585
小 計	3	169	11	585



銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	SUNTEC REIT	—	—	9	15
		( —)	(△0.52381)		
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	—	—	8	11
	CAPITALAND MALL TRUST	—	—	7	15
小計	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	6	16	6	15
		( —)	(△0.31161)		
小計		6	16	32	58
		( —)	(△0.83542)		

(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 64,755	百万円 71,055	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

(2016年5月13日～2017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	22,878,006千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	77,889,794千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.29

(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

(2016年5月13日～2017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	$\frac{D}{C}$	%
為替先物取引	百万円 1,016,900	百万円 666,486	65.5	百万円 1,015,289	百万円 664,989	65.5
為替直物取引	3,799	1,433	37.7	18,844	17,690	93.9

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

## ○組入資産の明細

(2017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	327	—	—	—	素材
AMERICAN EXPRESS CO	209	170	1,329	151,488	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	373	377	1,654	188,537	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	82	71	401	45,693	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	13	11	180	20,579	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	115	98	954	108,730	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	18	14	59	6,778	小売
AES CORP	170	146	168	19,207	公益事業
AFLAC INC	106	89	661	75,379	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	309	225	1,392	158,703	保険
APACHE CORP	94	83	424	48,401	エネルギー
ADVANCED MICRO DEVICES	—	173	191	21,820	半導体・半導体製造装置
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	15	11	287	32,787	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	156	135	1,638	186,652	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	51	44	646	73,679	素材
ANTHEM INC	65	57	1,054	120,105	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	127	122	631	71,967	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	336	298	787	89,678	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	136	107	604	68,898	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	159	128	2,363	269,332	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	52	46	857	97,647	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	77	61	322	36,707	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	417	365	2,017	229,901	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	30	26	1,021	116,345	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,018	893	4,113	468,639	電気通信サービス
CR BARD INC	18	16	497	56,639	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	27	36	290	33,124	素材
BAKER HUGHES INC	91	87	521	59,387	エネルギー
ALLSTATE CORP	96	80	674	76,810	保険
EVERETT DENNISON CORP	22	19	162	18,562	素材
CHUBB LTD	115	101	1,395	158,979	保険
ANALOG DEVICES INC	78	79	623	70,990	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	7	6	437	49,885	小売
CVS HEALTH CORP	277	233	1,921	218,887	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ENTERPRISES	53	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	296	208	600	68,471	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	921	784	6,836	778,958	銀行
CIGNA CORP	64	56	921	104,975	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	145	128	1,299	148,104	資本財
COCA-COLA CO/THE	1,033	897	3,919	446,584	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	133	105	849	96,777	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	46	43	253	28,831	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	244	205	1,071	122,113	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	50	—	—	—	メディア
CHEVRON CORP	471	413	4,396	500,992	エネルギー
COACH INC	69	61	278	31,789	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	32	35	369	42,057	資本財
CONOCOPHILLIPS	309	271	1,286	146,589	エネルギー
CME GROUP INC	80	74	864	98,472	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	82	69	508	57,989	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	213	185	1,328	151,391	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC	149	138	1,072	122,164	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE	281	245	1,519	173,142	素材
DEVON ENERGY CORP	115	103	392	44,701	エネルギー
DEERE & CO	78	58	664	75,672	資本財
DANAHER CORP	154	136	1,128	128,529	ヘルスケア機器・サービス
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	219	190	1,503	171,333	素材
WALT DISNEY CO/THE	393	331	3,630	413,621	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC	28	25	221	25,290	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	172	151	1,256	143,150	公益事業
DR HORTON INC	84	77	257	29,319	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC	22	19	95	10,922	小売
TARGET CORP	146	116	655	74,727	小売
DUN & BRADSTREET CORP	9	7	87	9,972	商業・専門サービス
DAVITA INC	42	35	236	26,968	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	38	34	271	30,967	資本財
DTE ENERGY COMPANY	45	39	416	47,447	公益事業
EXXON MOBIL CORP	1,042	909	7,509	855,679	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	53	46	514	58,676	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	137	126	1,190	135,664	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	163	140	819	93,324	資本財
EXELON CORP	231	202	679	77,416	公益事業
ECOLAB INC	66	57	728	82,970	素材
EQUIFAX INC	29	26	354	40,401	商業・専門サービス
EMC CORP/MA	485	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	55	48	448	51,146	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	115	98	758	86,477	資本財
EDISON INTERNATIONAL	82	71	565	64,402	公益事業
ENTERGY CORP	45	39	299	34,123	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	10	8	214	24,395	保険
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	15	12	92	10,513	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC	115	102	1,383	157,596	公益事業
MACY'S INC	78	67	164	18,755	小売
FEDEX CORP	67	55	1,054	120,180	運輸
FMC TECHNOLOGIES INC	57	—	—	—	エネルギー
FORD MOTOR CO	927	812	894	101,895	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	97	81	354	40,414	各種金融
FOOT LOCKER INC	34	29	223	25,507	小売
FIRSTENERGY CORP	106	94	270	30,869	公益事業
FLUOR CORP	35	30	145	16,608	資本財
FREEMPORT-MCMORAN INC	289	284	331	37,819	素材
GENERAL MILLS INC	149	129	728	82,980	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	67	56	1,105	126,009	資本財
WW GRAINGER INC	14	12	230	26,282	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	2,362	1,939	5,597	637,830	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	32	33	298	33,976	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	37	32	299	34,075	小売
TEGNA INC	52	44	102	11,691	メディア

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	67	57	203	23,165	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	60	52	134	15,338	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	96	78	1,766	201,236	各種金融
HALLIBURTON CO	210	190	867	98,796	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	183	158	2,093	238,520	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	48	39	217	24,825	自動車・自動車部品
HP INC	450	374	721	82,225	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	102	82	410	46,821	保険
HERSHEY CO/THE	37	31	337	38,496	食品・飲料・タバコ
HARMAN INTERNATIONAL	17	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HOME DEPOT INC	317	267	4,171	475,315	小売
HASBRO INC	28	24	250	28,531	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	65	56	499	56,867	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	230	198	2,983	339,902	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	98	85	449	51,241	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	81	69	955	108,886	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	101	87	215	24,578	メディア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	20	17	227	25,956	素材
JOHNSON & JOHNSON	692	596	7,343	836,741	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC	162	—	—	—	自動車・自動車部品
KANSAS CITY SOUTHERN	27	23	215	24,532	運輸
KELLOGG CO	66	57	406	46,337	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	90	78	1,009	115,052	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	397	338	1,511	172,227	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	231	197	600	68,466	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	48	38	143	16,339	小売
ELI LILLY & CO	249	217	1,744	198,809	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	25	22	318	36,245	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	41	34	201	22,967	運輸
LENNAR CORP-A	44	44	228	26,056	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	229	190	1,615	184,097	小売
LEGGETT & PLATT INC	34	29	155	17,728	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	61	53	272	31,060	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	99	95	549	62,608	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	69	57	1,573	179,253	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	61	50	339	38,659	保険
L3 TECHNOLOGIES INC	19	16	284	32,472	資本財
LEGG MASON INC	24	—	—	—	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	51	72	745	84,924	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	229	181	2,623	298,901	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	67	56	782	89,102	各種金融
MEDTRONIC PLC	353	305	2,534	288,729	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	699	604	3,892	443,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	271	227	660	75,256	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	84	74	166	19,025	耐久消費財・アパレル
3M CO	154	131	2,591	295,308	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	39	33	282	32,163	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	112	102	316	36,015	消費者サービス
MASCO CORP	84	72	266	30,337	資本財
MONSANTO CO	110	95	1,110	126,485	素材
M & T BANK CORP	35	30	481	54,912	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	130	112	830	94,604	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	
MOHAWK INDUSTRIES INC	15	13	323	36,894	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	363	308	1,322	150,699	各種金融
MCKESSON CORP	57	49	720	82,142	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	236	204	1,055	120,208	保険
MANPOWERGROUP INC	18	15	154	17,637	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	44	38	439	50,117	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	74	63	744	84,775	運輸
BANK OF AMERICA CORP	2,606	2,215	5,332	607,614	銀行
NISOURCE INC	—	72	175	19,982	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	43	36	907	103,446	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	121	107	139	15,937	銀行
NEWMONT MINING CORP	132	116	388	44,307	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	292	232	663	75,601	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	29	25	251	28,690	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	3	3	295	33,643	保険
NUCOR CORP	79	69	400	45,576	素材
NEWELL BRANDS INC	112	94	507	57,860	耐久消費財・アパレル
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	110	94	267	30,499	メディア
NOBLE ENERGY INC	107	94	295	33,684	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	191	167	1,022	116,489	エネルギー
OMNICOM GROUP	60	51	435	49,626	メディア
PEPSICO INC	364	314	3,551	404,682	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	24	20	211	24,126	素材
ALTRIA GROUP INC	490	427	3,015	343,568	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	28	24	209	23,913	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	680	560	4,828	550,153	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	126	106	1,298	147,976	銀行
PFIZER INC	1,545	1,329	4,393	500,643	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	112	94	1,018	116,048	保険
PULTEGROUP INC	78	64	148	16,894	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP	34	29	465	53,091	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	40	37	636	72,492	エネルギー
CITIGROUP INC	745	624	3,792	432,149	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	73	62	399	45,545	保険
PPG INDUSTRIES INC	67	57	619	70,562	素材
PENTAIR PLC	45	37	245	27,983	資本財
PRAXAIR INC	71	62	806	91,854	素材
P G & E CORP	120	112	738	84,189	公益事業
PPL CORP	169	149	577	65,807	公益事業
PROGRESSIVE CORP	146	127	512	58,374	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	127	111	477	54,370	公益事業
STARWOOD HOTELS & RESORTS	35	—	—	—	消費者サービス
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	44	37	408	46,528	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	75	64	1,025	116,817	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	60	52	332	37,881	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	325	269	382	43,584	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	10	9	124	14,174	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	25	22	494	56,354	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	104	91	250	28,549	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	33	28	135	15,463	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	33	28	444	50,618	資本財
SCHLUMBERGER LTD	345	304	2,185	249,030	エネルギー

## ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

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	
STRYKER CORP	84	73	995	113,445	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	296	262	1,050	119,669	各種金融
SEMPRA ENERGY	59	52	583	66,429	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19	17	582	66,382	素材
ST JUDE MEDICAL INC	70	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	37	32	454	51,737	資本財
SUNTRUST BANKS INC	127	107	609	69,476	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	76	62	751	85,578	保険
SOUTHERN CO/THE	228	216	1,077	122,744	公益事業
AT&T INC	1,539	1,346	5,175	589,664	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	48	62	558	63,638	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	100	84	699	79,710	各種金融
SYSCO CORP	141	114	627	71,465	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	49	41	180	20,575	素材
SCANA CORP	34	30	198	22,646	公益事業
TEXAS INSTRUMENTS INC	253	218	1,757	200,272	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	32	27	251	28,665	小売
TORCHMARK CORP	30	24	188	21,434	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	105	206	863	98,379	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	99	86	1,483	169,070	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	68	59	286	32,673	資本財
UNION PACIFIC CORP	213	180	1,988	226,609	運輸
UNUM GROUP	60	51	237	27,030	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	210	171	2,078	236,782	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	238	208	3,615	411,964	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	437	372	1,922	219,091	銀行
MARATHON OIL CORP	205	185	268	30,649	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	174	151	1,577	179,759	運輸
VALERO ENERGY CORP	120	99	659	75,138	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	24	20	198	22,607	ヘルスケア機器・サービス
VALSPAR CORP/THE	—	16	179	20,472	素材
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	108	86	539	61,502	メディア
VF CORP	85	72	398	45,415	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	33	29	376	42,873	素材
WILLIAMS COS INC	178	178	541	61,650	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	217	201	1,721	196,191	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	79	69	422	48,190	公益事業
WAL-MART STORES INC	401	338	2,576	293,562	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO	1,214	1,045	5,620	640,357	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	111	96	702	80,026	商業・専門サービス
WATERS CORP	20	17	304	34,673	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	220	203	104	11,852	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	19	16	306	34,965	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	227	189	134	15,298	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XL GROUP PLC	74	—	—	—	保険
XCEL ENERGY INC	128	112	507	57,802	公益事業
KEYCORP	174	236	431	49,188	銀行
CARMAX INC	50	42	249	28,442	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	47	43	531	60,561	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	42	34	127	14,581	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	107	76	528	60,225	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	167	142	1,134	129,239	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	
CA INC	82	68	219	25,003	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	32	28	376	42,929	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	36	31	272	31,052	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	—	62	204	23,305	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	103	76	473	54,004	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	70	68	570	64,991	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	108	91	342	39,051	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	74	67	533	60,831	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	198	164	403	45,925	銀行
STERICYCLE INC	21	18	158	18,029	商業・専門サービス
INTEL CORP	1,181	1,038	3,705	422,255	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	1,270	1,098	3,695	421,099	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	22	18	223	25,453	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	31	27	350	39,888	不動産
COSTCO WHOLESALE CORP	109	95	1,642	187,113	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	300	236	1,028	117,204	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	77	65	714	81,405	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	73	63	369	42,145	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	168	137	431	49,151	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	102	86	562	64,125	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	42	47	373	42,525	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	339	292	1,588	181,027	耐久消費財・アパレル
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	2	3	35	3,994	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	188	163	2,609	297,358	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	44	38	268	30,601	銀行
NORTHERN TRUST CORP	54	47	425	48,455	各種金融
MICROSOFT CORP	1,899	1,619	11,084	1,263,022	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	22	19	228	26,077	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	35	37	285	32,566	ヘルスケア機器・サービス
STAPLES INC	160	142	134	15,293	小売
STARBUCKS CORP	371	318	1,921	218,932	消費者サービス
ORACLE CORP	800	674	3,047	347,261	ソフトウェア・サービス
WHOLE FOODS MARKET INC	85	69	258	29,445	食品・生活必需品小売り
NETFLIX INC	101	93	1,488	169,603	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	24	20	532	60,649	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	128	129	723	82,450	ソフトウェア・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	47	41	421	48,004	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	20	17	310	35,334	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	33	29	176	20,124	小売
LAM RESEARCH CORP	40	35	536	61,084	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	20	17	218	24,915	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	621	1,044	4,101	467,283	メディア
XILINX INC	64	55	358	40,823	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	88	76	493	56,283	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	60	50	313	35,763	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	—	16	219	25,059	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	360	288	1,927	219,583	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	38	34	296	33,835	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	9	8	713	81,252	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	62	53	675	76,924	ソフトウェア・サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	62	60	116	13,255	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	81	70	405	46,187	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	
YAHOO! INC	224	199	990	112,842	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	21	18	80	9,218	ヘルスケア機器・サービス
SIGNATURE BANK	12	11	163	18,651	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	17	28	296	33,728	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	56	43	417	47,604	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	63	54	165	18,838	メディア
SALESFORCE.COM INC	157	141	1,236	140,930	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	34	28	131	15,037	小売
ALPHABET INC-CL A	72	64	6,204	706,961	ソフトウェア・サービス
UNITED THERAPEUTICS CORP	11	9	116	13,244	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B/E AEROSPACE INC	26	—	—	—	資本財
GARMIN LTD	28	26	136	15,570	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	62	54	195	22,218	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	376	323	1,770	201,741	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	60	55	239	27,340	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	38	32	245	27,974	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP	59	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	71	62	283	32,334	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	99	88	8,391	956,090	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	62	53	380	43,302	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	35	30	328	37,424	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	32	34	343	39,103	半導体・半導体製造装置
E*TRADE FINANCIAL CORP	73	59	209	23,833	各種金融
CERNER CORP	77	66	432	49,230	ヘルスケア機器・サービス
BROADCOM LTD	97	88	2,038	232,260	半導体・半導体製造装置
ALKERMES PLC	37	33	190	21,699	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	25	20	181	20,703	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	75	66	394	44,946	電気通信サービス
WASTE CONNECTIONS INC	26	39	357	40,743	商業・専門サービス
EBAY INC	270	232	793	90,457	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	134	118	1,495	170,409	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	55	51	420	47,966	小売
PRICELINE GROUP INC/THE	12	10	1,962	223,581	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	296	268	4,381	499,229	各種金融
BB&T CORP	201	178	766	87,319	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	273	231	1,088	124,017	各種金融
BORGWARNER INC	56	47	196	22,419	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	58	48	128	14,627	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	29	25	318	36,273	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC	200	169	1,670	190,324	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP	48	36	322	36,732	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	16	12	128	14,596	保険
AETNA INC	86	76	1,109	126,464	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	61	53	293	33,476	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	123	108	731	83,362	公益事業
AON PLC	68	57	715	81,520	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	149	125	528	60,239	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	23	18	119	13,577	保険
HESS CORP	70	62	310	35,375	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	87	75	230	26,317	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	67	57	217	24,809	各種金融
RED HAT INC	45	39	351	40,085	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	
F5 NETWORKS INC	17	14	188	21,452	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	56	49	306	34,935	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	44	38	190	21,731	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	73	60	244	27,838	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	41	37	432	49,230	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	103	95	149	17,026	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	55	47	1,212	138,099	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	36	32	583	66,533	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC	124	109	1,486	169,420	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	61	54	626	71,398	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	—	200	640	72,921	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC	41	33	124	14,130	小売
CELGENE CORP	196	169	2,029	231,194	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	152	132	853	97,298	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	169	135	820	93,458	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	46	39	211	24,043	運輸
FASTENAL CO	68	63	284	32,395	資本財
FISERV INC	57	47	570	64,951	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	139	120	195	22,246	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIRIUS XM HOLDINGS INC	524	380	183	20,920	メディア
SANDISK CORP	50	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	1,395	1,168	17,994	2,050,287	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	38	34	236	26,901	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	198	237	303	34,591	銀行
COSTAR GROUP INC	—	7	177	20,169	ソフトウェア・サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	56	49	584	66,623	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHLAND INC	15	—	—	—	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	36	31	218	24,853	運輸
CENTURYLINK INC	137	119	292	33,277	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	34	29	110	12,536	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	104	99	392	44,742	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	52	46	237	27,029	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC	214	187	1,221	139,232	食品・飲料・タバコ
SEAGATE TECHNOLOGY	74	64	272	31,078	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	35	30	214	24,418	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	18	16	235	26,840	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC	93	82	279	31,891	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	43	38	691	78,799	食品・飲料・タバコ
NEWFIELD EXPLORATION CO	—	43	151	17,272	エネルギー
COOPER COS INC/THE	12	10	221	25,214	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	38	37	214	24,489	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	77	67	491	55,984	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	24	21	142	16,259	保険
AGCO CORP	17	14	92	10,527	資本財
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	37	34	89	10,203	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP	35	87	419	47,762	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA INC	30	27	378	43,074	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	58	51	139	15,870	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	149	132	390	44,537	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC	43	34	443	50,503	各種金融
TESORO CORP	30	26	213	24,297	エネルギー
FNF GROUP	62	53	217	24,831	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	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	29	130	769	87,657	各種金融
NASDAQ INC	28	25	169	19,295	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	37	40	84	9,633	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	87	76	262	29,963	メディア
AUTOLIV INC	22	19	198	22,608	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	75	66	231	26,351	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	7	6	311	35,456	消費者サービス
IHS INC-CLASS A	17	—	—	—	商業・専門サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	28	46	229	26,182	食品・飲料・タバコ
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	111	93	220	25,156	小売
ARROW ELECTRONICS INC	23	20	153	17,528	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	42	35	555	63,347	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	30	26	144	16,504	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP	81	71	180	20,597	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	14	13	308	35,184	素材
RANGE RESOURCES CORP	42	39	101	11,580	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO	96	108	81	9,265	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	23	20	246	28,072	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	14	12	97	11,139	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	29	50	200	22,841	公益事業
OCEANEERING INTL INC	24	—	—	—	エネルギー
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	29	23	224	25,621	消費者サービス
HANESBRANDS INC	98	82	184	21,044	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A	247	211	2,458	280,167	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	126	106	207	23,678	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	22	33	148	16,905	資本財
AVNET INC	33	27	105	11,977	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	79	72	172	19,664	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	20	40	86	9,830	消費者サービス
SPECTRA ENERGY CORP	168	—	—	—	エネルギー
TRANSDIGM GROUP INC	13	11	284	32,441	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	—	26	184	20,974	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	32	28	402	45,855	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	76	66	114	13,078	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	96	77	595	67,839	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	107	86	522	59,577	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	28	24	131	14,936	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	13	11	136	15,595	資本財
MERCADOLIBRE INC	—	9	252	28,802	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A	19	14	137	15,658	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	70	62	288	32,866	保険
TIME WARNER CABLE	70	—	—	—	メディア
SEATTLE GENETICS INC	—	22	136	15,563	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ULTA BEAUTY INC	15	12	388	44,286	小売
LKQ CORP	76	67	209	23,833	小売
HORMEL FOODS CORP	72	63	218	24,924	食品・飲料・タバコ
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	—	17	133	15,251	運輸
EASTMAN CHEMICAL CO	37	32	252	28,721	素材
GAMESTOP CORP-CLASS A	26	—	—	—	小売
HARRIS CORP	31	27	298	33,982	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	37	32	753	85,887	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP	41	36	97	11,055	エネルギー

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NRG ENERGY INC	79	—	—	—	公益事業
INVESCO LTD	106	89	289	32,950	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	40	37	334	38,109	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	35	30	154	17,584	各種金融
TERADATA CORP	33	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	41	36	210	23,948	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	32	31	423	48,291	エネルギー
MSCI INC	24	19	186	21,276	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	23	20	86	9,853	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	46	41	385	43,887	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	387	339	3,777	430,403	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	487	409	3,770	429,608	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	47	39	362	41,273	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N.V.	10	9	104	11,863	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP	114	102	253	28,918	エネルギー
FLOWSERVE CORP	32	28	141	16,084	資本財
HELMERICH & PAYNE	26	23	138	15,798	エネルギー
T-MOBILE US INC	71	63	414	47,262	電気通信サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	18	17	122	13,968	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	69	48	125	14,327	メディア
RESMED INC	34	30	210	23,970	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	20	18	205	23,426	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	59	50	305	34,771	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	30	26	255	29,117	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	32	56	284	32,359	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	23	19	170	19,437	運輸
PERRIGO CO PLC	36	31	236	26,982	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUANTA SERVICES INC	39	—	—	—	資本財
FMC CORP	33	29	215	24,592	素材
WABTEC CORP	24	19	159	18,164	資本財
EVERSOURCE ENERGY	80	70	418	47,656	公益事業
NETSUITE INC	10	—	—	—	ソフトウェア・サービス
INGREDION INC	—	16	190	21,675	食品・飲料・タバコ
ALLERGAN PLC	98	82	1,899	216,413	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRGAS INC	13	—	—	—	素材
CROWN HOLDINGS INC	35	30	174	19,930	素材
CALPINE CORP	86	74	93	10,613	公益事業
EATON VANCE CORP	28	24	109	12,481	各種金融
DELTA AIR LINES INC	50	41	208	23,767	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	49	40	361	41,171	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC	45	39	300	34,208	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	40	34	269	30,664	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	73	61	444	50,626	小売
FORTINET INC	36	31	124	14,168	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	23	18	140	15,962	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6	5	321	36,590	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	42	44	206	23,560	銀行
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	292	253	30	3,463	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO	353	301	1,028	117,135	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	34	65	694	79,141	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	95	75	622	70,888	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	—	10	195	22,284	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	
HCA HEALTHCARE INC	81	65	561	63,953	ヘルスケア機器・サービス
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	95	—	—	—	運輸
HOLLYFRONTIER CORP	43	36	102	11,666	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	133	115	608	69,330	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	26	23	185	21,171	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	39	33	212	24,246	資本財
DEXCOM INC	—	19	130	14,924	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP	—	12	161	18,374	資本財
XYLEM INC	44	39	199	22,719	資本財
TRIPADVISOR INC	29	26	119	13,637	小売
MEDIVATION INC	41	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	15	13	206	23,533	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	36	33	308	35,170	銀行
ALLEGHANY CORP	3	3	194	22,181	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	19	16	748	85,260	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	133	103	820	93,459	エネルギー
FACEBOOK INC-A	568	513	7,700	877,361	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP	70	62	282	32,244	公益事業
ALBEMARLE CORP	28	24	272	31,052	素材
PVH CORP	20	17	178	20,354	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A	28	—	—	—	ソフトウェア・サービス
KINDER MORGAN INC	475	416	836	95,319	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	86	78	318	36,339	商業・専門サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	70	59	519	59,219	自動車・自動車部品
CHARTER COMMUNICATION-A	21	—	—	—	メディア
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	42	37	150	17,091	資本財
SPLUNK INC	32	29	196	22,375	ソフトウェア・サービス
OGE ENERGY CORP	51	44	151	17,219	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	15	13	123	14,024	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	409	356	2,329	265,379	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC	24	28	911	103,889	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	56	44	208	23,788	エネルギー
REALOGY HOLDINGS CORP	36	—	—	—	不動産
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	32	27	209	23,851	各種金融
ZOETIS INC	118	103	616	70,222	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC	29	23	108	12,403	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	95	82	104	11,940	メディア
SPRINT CORP	199	174	137	15,635	電気通信サービス
TECO ENERGY INC	59	—	—	—	公益事業
SNAP-ON INC	14	12	217	24,829	資本財
AGL RESOURCES INC	25	—	—	—	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	46	35	130	14,860	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	145	124	228	26,018	ソフトウェア・サービス
VANTIV INC - CL A	39	35	222	25,310	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	28	26	240	27,381	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	37	36	349	39,810	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	22	19	243	27,780	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	23	—	—	—	資本財
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	19	20	277	31,578	ソフトウェア・サービス
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	46	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL C	77	68	6,335	721,869	ソフトウェア・サービス
IMS HEALTH HOLDINGS INC	41	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NAVIENT CORP	90	65	93	10,680	各種金融
ENDO INTERNATIONAL PLC	53	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED RENTALS INC	23	18	210	23,951	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	40	29	138	15,738	運輸
VOYA FINANCIAL INC	53	42	154	17,586	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	11	—	—	—	素材
ANTERO RESOURCES CORP	20	34	71	8,162	エネルギー
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	23	32	270	30,810	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	108	92	174	19,856	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	123	43	269	30,748	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	34	28	175	20,021	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	19	192	21,947	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C	—	24	204	23,355	メディア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	40	34	185	21,079	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	20	20	232	26,450	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIGNET JEWELERS LTD	18	13	80	9,157	小売
SYNCHRONY FINANCIAL	208	180	486	55,464	各種金融
QORVO INC	35	28	187	21,404	半導体・半導体製造装置
IONIS PHARMACEUTICALS INC	30	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	44	38	214	24,428	保険
ACUITY BRANDS INC	10	9	181	20,670	資本財
JONES LANG LASALLE INC	11	9	114	13,070	不動産
ARAMARK	56	50	189	21,540	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	131	111	413	47,086	銀行
LEAR CORP	18	15	226	25,862	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	19	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHITEWAVE FOODS CO	44	—	—	—	食品・飲料・タバコ
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	35	47	149	17,037	素材
RITE AID CORP	219	230	92	10,550	食品・生活必需品小売り
TARGA RESOURCES CORP	—	40	203	23,193	エネルギー
BAXALTA INC	170	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLUMBIA PIPELINE GROUP	97	—	—	—	エネルギー
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	—	24	49	5,630	メディア
WESTROCK CO	64	55	298	34,028	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	151	133	1,190	135,630	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	275	237	1,181	134,667	ソフトウェア・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	13	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	25	24	107	12,299	ソフトウェア・サービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	451	366	691	78,804	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOBILEYE NV	20	39	240	27,399	ソフトウェア・サービス
AMERCO	1	1	55	6,361	運輸
CDW CORP/DE	35	32	193	22,096	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDNAX INC	23	20	114	13,052	ヘルスケア機器・サービス
SABRE CORP	51	46	112	12,863	ソフトウェア・サービス
FIRST DATA CORP- CLASS A	—	71	117	13,358	ソフトウェア・サービス
WR GRACE & CO	18	15	104	11,956	素材
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	37	41	79	9,086	耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	50	43	160	18,305	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	22	20	76	8,763	メディア
DOMINO'S PIZZA INC	—	11	214	24,487	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	—	47	1,541	175,646	メディア
IDEXX LABORATORIES INC	—	20	326	37,183	ヘルスケア機器・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		
SMITH (A.O.) CORP	—	32	173	19,728	資本財	
UGI CORP	—	39	191	21,836	公益事業	
WESTAR ENERGY INC	—	32	166	18,937	公益事業	
FORTIVE CORP	—	68	425	48,517	資本財	
IHS MARKIT LTD	—	78	342	39,066	商業・専門サービス	
XL GROUP LTD	—	58	244	27,888	保険	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	—	49	323	36,904	ソフトウェア・サービス	
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	—	13	166	18,969	素材	
COTY INC-CL A	—	106	208	23,745	家庭用品・パーソナル用品	
ARCONIC INC	—	96	262	29,874	資本財	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	—	48	153	17,490	エネルギー	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	—	14	174	19,851	保険	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	—	6	78	8,890	家庭用品・パーソナル用品	
TELEFLEX INC	—	10	193	22,090	ヘルスケア機器・サービス	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	—	34	112	12,783	電気通信サービス	
ENVISION HEALTHCARE CORP	—	25	149	17,006	ヘルスケア機器・サービス	
TECHNIPPMC PLC	—	98	309	35,242	エネルギー	
DXC TECHNOLOGY CO	—	62	494	56,321	ソフトウェア・サービス	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	120	260	199	22,751	不動産	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	—	50	210	24,018	資本財	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	60	55	360	41,034	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	78,527 596	68,340 596	460,977 —	52,523,771 <61.3%>	
(カナダ)			千カナダドル			
ROYAL BANK OF CANADA	371	325	3,014	250,584	銀行	
IMPERIAL OIL LTD	75	66	260	21,688	エネルギー	
THOMSON REUTERS CORP	86	71	428	35,584	各種金融	
TRANSCANADA CORP	178	190	1,204	100,122	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	91	79	492	40,914	電気通信サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	153	134	623	51,842	保険	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	142	124	307	25,564	素材	
BARRICK GOLD CORP	291	255	583	48,480	素材	
BCE INC	36	32	196	16,314	電気通信サービス	
AGRIUM INC	33	29	361	30,083	素材	
BOMBARDIER INC-B	487	427	94	7,844	資本財	
BANK OF MONTREAL	160	141	1,332	110,743	銀行	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	221	196	1,022	84,970	各種金融	
BANK OF NOVA SCOTIA	301	265	2,008	166,961	銀行	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	81	72	135	11,282	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAE INC	68	56	120	10,004	資本財	
CAMECO CORP	100	89	119	9,965	エネルギー	
CI FINANCIAL CORP	59	53	141	11,776	各種金融	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	99	87	933	77,595	銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	274	242	1,026	85,338	エネルギー	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	199	168	1,701	141,473	運輸	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	18	15	234	19,501	小売	
ENBRIDGE INC	230	356	1,949	162,087	エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	6	5	303	25,188	保険	
CGI GROUP INC - CLASS A	55	47	312	25,994	ソフトウェア・サービス	
HUSKY ENERGY INC	88	77	125	10,422	エネルギー	
IGM FINANCIAL INC	25	21	83	6,913	各種金融	
LOBLAW COMPANIES LTD	57	49	377	31,401	食品・生活必需品小売り	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
MANULIFE FINANCIAL CORP	493	432	1,033	85,901	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	101	83	507	42,206	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	86	74	391	32,572	銀行
ONEX CORPORATION	21	18	180	15,014	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	209	184	411	34,247	素材
POWER CORP OF CANADA	94	82	244	20,361	保険
POWER FINANCIAL CORP	63	55	181	15,106	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	102	91	261	21,718	メディア
SUNCOR ENERGY INC	396	365	1,577	131,140	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	13	11	134	11,218	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	36	31	663	55,135	運輸
ENCANA CORP	211	216	336	27,939	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	54	49	319	26,538	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	43	38	101	8,447	資本財
GOLDCORP INC	208	187	361	30,064	素材
KINROSS GOLD CORP	308	265	148	12,380	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	38	33	176	14,640	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC	75	65	223	18,566	保険
METHANEX CORP	23	20	115	9,593	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	252	222	80	6,680	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	21	16	35	2,912	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	58	48	187	15,589	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	64	56	248	20,683	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	125	111	142	11,848	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELUS CORP	41	41	187	15,596	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	173	151	184	15,376	素材
YAMANA GOLD INC	237	222	82	6,828	素材
FORTIS INC	71	89	396	32,931	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	105	92	577	47,998	食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP	179	152	76	6,317	素材
TORONTO-DOMINION BANK	464	407	2,581	214,574	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	44	39	371	30,906	素材
SILVER WHEATON CORP	101	96	262	21,842	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	41	34	71	5,935	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	26	22	119	9,919	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	32	28	111	9,270	公益事業
METRO INC	60	50	230	19,161	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	30	58	259	21,600	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	33	29	268	22,359	保険
CRESCENT POINT ENERGY CORP	126	118	156	13,016	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	209	223	291	24,192	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	86	78	140	11,690	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	47	50	141	11,754	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	93	87	379	31,554	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	28	26	127	10,586	エネルギー
DOLLARAMA INC	30	24	293	24,406	小売
KEYERA CORP	43	41	164	13,643	エネルギー
ALTAGAS LTD	37	36	110	9,211	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	38	36	94	7,822	エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	20	18	89	7,447	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	28	27	53	4,473	不動産
INTER PIPELINE LTD	85	80	218	18,142	エネルギー

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
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	46	46	136	11,375	エネルギー	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	41	52	136	11,368	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	5	4	273	22,750	ソフトウェア・サービス	
RESTAURANT BRANDS INTERN	50	48	396	32,932	消費者サービス	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	17	14	80	6,653	素材	
VERESEN INC	75	72	133	11,072	エネルギー	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	7	6	181	15,112	素材	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	97	83	99	8,231	各種金融	
LINAMAR CORP	12	10	63	5,306	自動車・自動車部品	
HYDRO ONE LTD	—	44	101	8,442	公益事業	
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	23	—	—	—	商業・専門サービス	
EMERA INC	—	13	61	5,081	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	9,959	9,170	37,267	3,098,044	
	銘柄 数 < 比 率 >	90	91	—	< 3.6% >	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
COMMERZBANK AG	266	233	221	27,462	銀行	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	345	452	784	97,075	各種金融	
METRO AG	44	39	115	14,303	食品・生活必需品小売り	
SIEMENS AG-REG	198	167	2,194	271,673	資本財	
RWE AG	123	108	168	20,877	公益事業	
BASF SE	229	201	1,816	224,941	素材	
VOLKSWAGEN AG	8	7	105	13,029	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	240	210	1,448	179,357	自動車・自動車部品	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	44	38	485	60,092	家庭用品・パーソナル用品	
E.ON SE	502	441	318	39,384	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	82	72	653	80,849	自動車・自動車部品	
BAYER AG-REG	207	181	2,084	258,013	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LINDE AG	46	40	679	84,147	素材	
ALLIANZ SE-REG	114	100	1,738	215,253	保険	
MAN SE	7	7	75	9,311	資本財	
CONTINENTAL AG	27	24	503	62,272	自動車・自動車部品	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	282	247	472	58,485	半導体・半導体製造装置	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	38	33	179	22,182	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	60	52	88	10,902	運輸	
HUGO BOSS AG -ORD	16	14	103	12,753	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE POST AG-REG	242	212	674	83,560	運輸	
SAP SE	245	214	2,020	250,076	ソフトウェア・サービス	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	54	51	198	24,633	メディア	
DEUTSCHE BOERSE AG	48	42	394	48,837	各種金融	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	54	47	404	50,085	ヘルスケア機器・サービス	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	10	9	67	8,338	運輸	
ADIDAS AG	52	41	736	91,233	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	806	716	1,197	148,218	電気通信サービス	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	41	35	615	76,174	保険	
THYSSENKRUPP AG	92	80	179	22,222	素材	
BEIERSDORF AG	25	21	206	25,537	家庭用品・パーソナル用品	
HEIDELBERGCEMENT AG	35	32	279	34,663	素材	
MERCK KGAA	32	28	316	39,131	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VOLKSWAGEN AG-PREF	46	40	581	72,033	自動車・自動車部品	
LANXESS AG	22	20	131	16,307	素材	
FRESENIUS SE & CO KGAA	95	89	704	87,217	ヘルスケア機器・サービス	
HOCHTIEF AG	—	4	77	9,552	資本財	



銘柄	株数	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	84	77	261	32,337	不動産
GEA GROUP AG	45	40	149	18,475	資本財
SYMRISE AG	30	27	174	21,632	素材
K+S AG-REG	47	42	94	11,719	素材
HENKEL AG & CO KGAA	25	22	245	30,446	家庭用品・パーソナル用品
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	30	26	114	14,127	ソフトウェア・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	13	12	94	11,732	自動車・自動車部品
HANNOVER RUECK SE	15	13	141	17,542	保険
BRENTAG AG	38	33	181	22,452	資本財
AXEL SPRINGER SE	11	10	54	6,702	メディア
FUCHS PETROLUB SE -PREF	17	15	73	9,041	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	186	160	65	8,129	電気通信サービス
OSRAM LICHT AG	22	18	126	15,714	資本財
VONOVIA SE	116	102	362	44,935	不動産
EVONIK INDUSTRIES AG	34	35	109	13,563	素材
ZALANDO SE	21	18	73	9,159	小売
COVESTRO AG	—	16	106	13,164	素材
SCHAEFFLER AG	—	36	54	6,732	自動車・自動車部品
INNOGY SE	—	31	104	12,916	公益事業
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,538 52	5,103 56	25,611 —	3,170,720 <3.7%>
(ユーロ…イタリア)					
ASSICURAZIONI GENERALI	291	256	380	47,072	保険
INTESA SANPAOLO	3,174	2,786	789	97,694	銀行
TELECOM ITALIA SPA	2,874	2,498	219	27,214	電気通信サービス
ENI SPA	636	557	830	102,868	エネルギー
UNICREDIT SPA	1,194	413	690	85,480	銀行
ENEL SPA	1,968	1,678	765	94,770	公益事業
SAIPEM SPA	1,524	1,333	53	6,600	エネルギー
ATLANTIA SPA	103	90	219	27,228	運輸
INTESA SANPAOLO-RSP	230	196	52	6,471	銀行
LUXOTTICA GROUP SPA	42	37	200	24,798	耐久消費財・アパレル
MEDIOBANCA SPA	140	123	113	14,091	銀行
SNAM SPA	533	540	229	28,407	エネルギー
TELECOM ITALIA-RSP	1,500	1,325	95	11,828	電気通信サービス
BANCO POPOLARE SC	90	—	—	—	銀行
LEONARDO SPA	101	88	140	17,430	資本財
UBI BANCA SPA	226	—	—	—	銀行
TERNA SPA	387	340	167	20,732	公益事業
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	273	236	51	6,398	保険
PRYSMIAN SPA	48	42	109	13,609	資本財
EXOR SPA	27	—	—	—	各種金融
POSTE ITALIANE SPA	—	115	73	9,076	保険
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	15,372 20	12,660 18	5,183 —	641,776 <0.7%>
(ユーロ…フランス)					
MICHELIN (CGDE)	46	39	483	59,865	自動車・自動車部品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	69	61	1,425	176,443	耐久消費財・アパレル
PEUGEOT SA	111	106	205	25,404	自動車・自動車部品
AXA SA	492	424	1,029	127,488	保険
DANONE	147	129	862	106,726	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	138	124	273	33,900	食品・生活必需品小売り

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
VIVENDI	290	225	414	51,361	メディア
INGENICO GROUP	13	12	102	12,675	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA	181	167	827	102,462	銀行
AIR LIQUIDE SA	86	85	964	119,390	素材
TOTAL SA	549	498	2,388	295,692	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	119	109	550	68,205	資本財
ZODIAC AEROSPACE	50	44	97	12,112	資本財
VINCI SA	120	110	861	106,623	資本財
SANOFI	294	254	2,328	288,291	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	114	107	202	25,070	公益事業
L'OREAL	62	55	1,041	128,885	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA	53	37	157	19,501	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	139	122	867	107,409	資本財
BNP PARIBAS	265	245	1,632	202,044	銀行
ESSILOR INTERNATIONAL	51	45	543	67,230	ヘルスケア機器・サービス
CAPGEMINI	40	35	341	42,324	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	14	12	66	8,208	食品・生活必需品小売り
VALEO SA	19	52	339	42,013	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	6	5	255	31,653	耐久消費財・アパレル
SODEXO	23	20	239	29,678	消費者サービス
KERING	18	16	487	60,397	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	32	28	234	28,991	ソフトウェア・サービス
TECHNIP SA	26	—	—	—	エネルギー
CHRISTIAN DIOR SE	13	11	301	37,373	耐久消費財・アパレル
ATOS SE	21	19	244	30,306	ソフトウェア・サービス
ORANGE	496	436	646	80,083	電気通信サービス
CNP ASSURANCES	43	38	76	9,411	保険
IMERYS SA	8	7	60	7,512	素材
SAFRAN SA	78	68	518	64,213	資本財
RENAULT SA	48	42	370	45,846	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	47	42	276	34,282	メディア
LAGARDERE SCA	29	26	71	8,822	メディア
JCDECAUX SA	18	15	46	5,718	メディア
SOCIETE BIC SA	7	6	68	8,540	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	50	45	173	21,451	資本財
THALES SA	26	22	225	27,922	資本財
PERNOD RICARD SA	53	46	559	69,323	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	264	246	349	43,251	銀行
ENGIE	367	352	487	60,342	公益事業
ALSTOM	38	34	103	12,817	資本財
ARKEMA	16	14	145	18,037	素材
LEGRAND SA	66	58	360	44,602	資本財
SCOR SE	38	35	126	15,627	保険
ADP	7	6	85	10,542	運輸
EDF	62	61	52	6,551	公益事業
NATIXIS	236	213	137	17,041	銀行
WENDEL	7	6	90	11,143	各種金融
BUREAU VERITAS SA	66	58	124	15,413	商業・専門サービス
EURAZEO	10	8	55	6,823	各種金融
SUEZ	76	78	129	16,082	公益事業
EIFFAGE	—	13	101	12,550	資本財
ILIAD SA	6	5	132	16,415	電気通信サービス

## ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
EUTELSAT COMMUNICATIONS	42	36	76	9,488	メディア	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	118	102	105	13,037	運輸	
EDENRED	52	45	108	13,426	商業・専門サービス	
REMY COINTREAU	6	5	50	6,229	食品・飲料・タバコ	
REXEL SA	75	66	102	12,641	資本財	
BOLLORE	219	194	76	9,494	運輸	
SPR GROUP SA	27	20	64	8,041	電気通信サービス	
DASSAULT AVIATION SA	—	0.5	65	8,092	資本財	
SEB SA	—	5	75	9,384	耐久消費財・アパレル	
小計	株数・金額	6,333	5,679	26,073	3,227,943	
	銘柄数<比率>	64	66	—	<3.8%>	
(ユーロ…オランダ)						
QIAGEN N.V.	55	49	145	18,025	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CNH INDUSTRIAL NV	237	224	219	27,216	資本財	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	224	197	197	24,395	自動車・自動車部品	
FERRARI NV	32	27	205	25,403	自動車・自動車部品	
EXOR NV	—	23	126	15,637	各種金融	
AIRBUS SE	147	127	939	116,347	資本財	
STMICROELECTRONICS NV	159	139	210	26,079	半導体・半導体製造装置	
GEMALTO	20	17	92	11,462	ソフトウェア・サービス	
WOLTERS KLUWER	75	66	256	31,810	商業・専門サービス	
KONINKLIJKE KPN NV	802	747	212	26,360	電気通信サービス	
AKZO NOBEL	61	55	415	51,406	素材	
HEINEKEN NV	57	50	430	53,341	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	238	207	684	84,752	資本財	
RELX NV	249	218	397	49,233	商業・専門サービス	
AEGON NV	456	388	178	22,079	保険	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	208	280	554	68,638	食品・生活必需品小売り	
RANDSTAD HOLDING NV	32	26	146	18,102	商業・専門サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	25	22	180	22,357	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	45	39	261	32,384	素材	
ING GROEP NV	968	849	1,298	160,799	銀行	
ASML HOLDING NV	86	81	1,003	124,266	半導体・半導体製造装置	
UNILEVER NV-CVA	407	356	1,762	218,135	家庭用品・パーソナル用品	
VOPAK	17	15	66	8,203	エネルギー	
BOSKALIS WESTMINSTER	21	19	63	7,847	資本財	
TNT EXPRESS NV	105	—	—	—	運輸	
OCI NV	21	—	—	—	素材	
NN GROUP NV	79	68	220	27,238	保険	
ALTICE NV - B	26	22	50	6,302	メディア	
ALTICE NV - A	93	82	185	22,905	メディア	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	—	64	157	19,439	銀行	
小計	株数・金額	4,960	4,470	10,663	1,320,176	
	銘柄数<比率>	28	28	—	<1.5%>	
(ユーロ…スペイン)						
BANCO POPULAR ESPANOL	431	708	55	6,910	銀行	
ENDESA SA	80	70	146	18,100	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	47	41	142	17,642	資本財	
IBERDROLA SA	1,380	1,211	811	100,516	公益事業	
TELEFONICA SA	1,126	992	994	123,180	電気通信サービス	
BANCO SANTANDER SA	3,609	3,195	1,936	239,723	銀行	
BANKINTER SA	167	146	123	15,311	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		
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
REPSOL SA	274	246	362	44,863	エネルギー	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,590	1,438	1,062	131,520	銀行	
GAS NATURAL SDG SA	89	77	158	19,683	公益事業	
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	272	237	852	105,563	小売	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	130	141	228	28,287	運輸	
MAPPRE SA	261	232	76	9,440	保険	
FERROVIAL SA	118	106	208	25,856	資本財	
FERROVIAL SA-RTS	—	106	3	422	資本財	
ZARDOYA OTIS SA	44	44	38	4,719	資本財	
ENAGAS SA	55	50	127	15,772	エネルギー	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	27	96	180	22,286	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	1,279	1,159	212	26,315	銀行	
CAIXABANK S. A	663	785	333	41,321	銀行	
GRIFOLS SA	74	65	163	20,293	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMADEUS IT GROUP SA	109	95	496	61,431	ソフトウェア・サービス	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	207	190	135	16,732	運輸	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	146	141	76	9,462	食品・生活必需品小売り	
BANKIA SA	1,143	1,025	112	13,977	銀行	
AENA SA	16	14	244	30,239	運輸	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	13,348 25	12,623 26	9,285 —	1,149,576 <1.3%>	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS	50	42	158	19,668	保険	
UCB SA	31	27	212	26,334	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	201	17	—	—	食品・飲料・タバコ	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	20	17	154	19,094	各種金融	
DELHAIZE GROUP	21	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
UMICORE	23	20	122	15,142	素材	
COLRUYT SA	17	14	69	8,599	食品・生活必需品小売り	
KBC GROEP NV	62	54	364	45,154	銀行	
SOLVAY SA	18	16	197	24,462	素材	
PROXIMUS	38	34	103	12,771	電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	13	12	68	8,512	メディア	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	—	166	1,820	225,335	食品・飲料・タバコ	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	499 11	408 10	3,272 —	405,075 <0.5%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG	70	66	217	26,872	銀行	
OMV AG	37	34	143	17,822	エネルギー	
VOESTALPINE AG	28	25	99	12,330	素材	
ANDRITZ AG	19	16	87	10,781	資本財	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	29	25	54	6,710	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	185 5	167 5	601 —	74,517 <0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP	9	8	57	7,062	メディア	
TENARIS SA	117	103	149	18,471	エネルギー	
SES	81	80	163	20,279	メディア	
EUROFINS SCIENTIFIC	—	2	115	14,272	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARCELORMITTAL	426	402	290	36,016	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	635 4	597 5	776 —	96,101 <0.1%>	

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
NOKIA OYJ	1,444	1,278	715	88,614	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STORA ENSO OYJ-R SHS	137	120	137	16,990	素材	
NOKIAN RENKAAT OYJ	28	25	97	12,039	自動車・自動車部品	
UPM-KYMMENE OYJ	133	116	287	35,597	素材	
FORTUM OYJ	112	98	136	16,878	公益事業	
KONE OYJ-B	84	73	314	38,893	資本財	
METSO OYJ	28	24	77	9,633	資本財	
SAMPO OYJ-A SHS	111	97	443	54,942	保険	
WARTSILA OYJ ABP	36	32	175	21,766	資本財	
ELISA OYJ	35	30	102	12,699	電気通信サービス	
NESTE OYJ	32	28	105	13,086	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	25	22	126	15,687	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>	2,210 12	1,948 12	2,720 -	336,829 <0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A	40	35	289	35,849	食品・飲料・タバコ	
PADDY POWER BETFAIR PLC	20	20	196	24,292	消費者サービス	
BANK OF IRELAND	7,084	6,176	152	18,887	銀行	
CRH PLC	209	184	631	78,192	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,355 4	6,416 4	1,269 -	157,221 <0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	586	539	176	21,809	公益事業	
JERONIMO MARTINS	62	56	94	11,668	食品・生活必需品小売り	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	10,346	-	-	-	銀行	
GALP ENERGIA SGPS SA	116	110	157	19,455	エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	11,112 4	705 3	427 -	52,932 <0.1%>	
(ユーロ…イギリス)						
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	-	48	176	21,829	食品・飲料・タバコ	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	- -	48 1	176 -	21,829 <0.0%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	67,551 229	50,827 234	86,063 -	10,654,701 <12.4%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
BARCLAYS PLC	4,201	3,705	765	112,346	銀行	
BP PLC	4,586	4,152	1,893	277,860	エネルギー	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	14,294	14,067	979	143,830	銀行	
ASTRAZENECA PLC	316	276	1,314	192,864	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SMITHS GROUP PLC	98	86	142	20,968	資本財	
NEXT PLC	36	30	131	19,371	小売	
DIAGEO PLC	629	551	1,266	185,839	食品・飲料・タバコ	
SKY PLC	259	227	226	33,259	メディア	
BAE SYSTEMS PLC	791	694	444	65,309	資本財	
UNILEVER PLC	320	280	1,147	168,381	家庭用品・パーソナル用品	
TESCO PLC	2,039	1,793	323	47,464	食品・生活必需品小売り	
RELX PLC	278	238	383	56,241	商業・専門サービス	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	408	355	134	19,675	小売	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1597	138	1,009	148,122	家庭用品・パーソナル用品	
PRUDENTIAL PLC	643	564	994	145,986	保険	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,488	1,304	332	48,758	保険	
SAGE GROUP PLC/THE	270	236	162	23,834	ソフトウェア・サービス	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
HSBC HOLDINGS PLC	4,899	4,339	2,942	431,801	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	466	408	2,180	319,985	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	175	154	157	23,134	公益事業
SCHRODERS PLC	31	29	96	14,145	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	869	773	201	29,612	銀行
BHP BILLITON PLC	528	462	542	79,618	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	240	209	774	113,644	食品・飲料・タバコ
WPP PLC	323	281	479	70,320	メディア
CENTRICA PLC	1,276	1,206	231	34,032	公益事業
BT GROUP PLC	2,118	1,862	554	81,430	電気通信サービス
SSE PLC	254	226	328	48,156	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	819	719	541	79,441	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	460	402	350	51,486	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	32,679	28,578	2	419	資本財
COMPASS GROUP PLC	411	359	573	84,100	消費者サービス
KINGFISHER PLC	572	490	169	24,843	小売
PEARSON PLC	205	180	127	18,733	メディア
SEVERN TRENT PLC	61	53	130	19,151	公益事業
RIO TINTO PLC	310	272	813	119,387	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,218	1,067	1,737	255,039	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SABMILLER PLC	244	—	—	—	食品・飲料・タバコ
PROVIDENT FINANCIAL PLC	36	32	105	15,545	各種金融
3I GROUP PLC	241	210	174	25,672	各種金融
GKN PLC	428	375	131	19,373	自動車・自動車部品
VODAFONE GROUP PLC	6,644	5,823	1,201	176,297	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	555	486	117	17,287	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	336	357	94	13,917	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	1,011	888	477	70,103	保険
CAPITA PLC	166	144	80	11,882	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC	244	210	68	10,058	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	48	42	132	19,445	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	254	223	137	20,164	保険
WHITBREAD PLC	45	40	164	24,077	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	941	829	856	125,638	公益事業
ARM HOLDINGS PLC	351	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WOLSELEY PLC	63	55	275	40,426	資本財
BUNZL PLC	84	73	179	26,382	資本財
COBHAM PLC	286	375	50	7,380	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	350	306	322	47,372	素材
INTERTEK GROUP PLC	40	35	148	21,775	商業・専門サービス
WILLIAM HILL PLC	220	191	56	8,279	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	111	97	159	23,466	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	49	39	168	24,659	消費者サービス
CARNIVAL PLC	47	41	198	29,154	消費者サービス
PERSIMMON PLC	76	67	161	23,752	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	193	168	80	11,883	資本財
ICAP PLC	138	—	—	—	各種金融
ITV PLC	957	794	150	22,034	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	78	69	236	34,761	各種金融
G4S PLC	390	337	106	15,662	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	32	28	94	13,832	耐久消費財・アパレル
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	250	218	132	19,377	耐久消費財・アパレル

銘柄	株数	当期末			業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
IMI PLC	68	59	77	11,325	資本財	
REXAM PLC	147	—	—	—	素材	
SMITH & NEPHEW PLC	224	191	250	36,727	ヘルスケア機器・サービス	
TATE & LYLE PLC	116	104	79	11,725	食品・飲料・タバコ	
TAYLOR WIMPEY PLC	813	713	141	20,787	耐久消費財・アパレル	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	986	956	2,040	299,472	エネルギー	
PETROFAC LTD	64	57	46	6,845	エネルギー	
TRAVIS PERKINS PLC	62	54	87	12,851	資本財	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	992	822	1,806	265,086	エネルギー	
OLD MUTUAL PLC	1,233	1,080	211	31,008	保険	
INVESTEC PLC	139	142	83	12,251	各種金融	
STANDARD LIFE PLC	493	433	166	24,487	保険	
EXPERIAN PLC	242	209	350	51,439	商業・専門サービス	
MONDI PLC	91	80	160	23,559	素材	
WEIR GROUP PLC/THE	53	48	91	13,423	資本財	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	89	78	224	32,936	食品・飲料・タバコ	
ANTOFAGASTA PLC	98	86	67	9,853	素材	
SHIRE PLC	148	198	927	136,199	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INMARSAT PLC	112	97	73	10,770	電気通信サービス	
ADMIRAL GROUP PLC	52	45	93	13,756	保険	
FRESNILLO PLC	55	49	74	10,976	素材	
RANDGOLD RESOURCES LTD	23	20	146	21,512	素材	
AGGREKO PLC	64	—	—	—	商業・専門サービス	
BABCOCK INTL GROUP PLC	63	55	49	7,309	商業・専門サービス	
ST JAMES' S PLACE PLC	131	115	135	19,842	保険	
GLENCORE PLC	3,062	2,676	776	113,959	素材	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	230	201	58	8,633	各種金融	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	65	56	80	11,812	各種金融	
CRODA INTERNATIONAL PLC	32	28	111	16,432	素材	
COCA-COLA HBC AG-DI	50	38	84	12,445	食品・飲料・タバコ	
EASYJET PLC	41	35	46	6,765	運輸	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	343	300	106	15,593	保険	
ROYAL MAIL PLC	225	196	83	12,190	運輸	
ASHTREAD GROUP PLC	126	109	178	26,142	資本財	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	67	—	—	—	小売	
MERLIN ENTERTAINMENT	177	151	75	11,148	消費者サービス	
TUI AG-DI	124	109	128	18,887	消費者サービス	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	32	57	8,430	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	92	78	65	9,610	ヘルスケア機器・サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC	239	216	88	12,987	ソフトウェア・サービス	
WORLDPAY GROUP PLC	349	400	125	18,446	ソフトウェア・サービス	
DCC PLC	—	20	148	21,736	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	105,469	93,700	40,455	5,937,643	
(スイス)			千スイスフラン			
NESTLE SA-REG	798	682	5,509	622,903	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	130	114	981	110,996	耐久消費財・アパレル	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	449	435	650	73,591	各種金融	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	113	100	562	63,602	素材	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	175	154	4,121	466,030	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GIVAUDAN-REG	2	2	393	44,488	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	13	11	169	19,206	ヘルスケア機器・サービス	

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		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	37	32	922	104,309	保険	
SYNGENTA AG-REG	23	20	951	107,589	素材	
LONZA GROUP AG-REG	13	12	252	28,532	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	12	11	88	10,002	耐久消費財・アパレル	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	10	8	184	20,822	資本財	
GEBERIT AG-REG	9	8	370	41,923	資本財	
SWISS RE AG	87	70	629	71,180	保険	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	7	6	275	31,112	耐久消費財・アパレル	
PARGESA HOLDING SA-BR	7	7	54	6,207	各種金融	
NOVARTIS AG-REG	569	489	3,867	437,235	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	41	35	274	31,079	商業・専門サービス	
SWISSCOM AG-REG	6	5	256	28,943	電気通信サービス	
ABB LTD-REG	550	412	1,018	115,137	資本財	
SGS SA-REG	1	1	277	31,368	商業・専門サービス	
SULZER AG-REG	3	—	—	—	資本財	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	5	4	90	10,200	資本財	
ACTELION LTD-REG	25	21	598	67,631	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	13	11	178	20,194	運輸	
BALOISE HOLDING AG - REG	12	11	162	18,373	保険	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	8	7	227	25,757	保険	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.03	0.02	139	15,779	食品・飲料・タバコ	
ARYZTA AG	21	19	67	7,615	食品・飲料・タバコ	
JULIUS BAER GROUP LTD	56	49	260	29,421	各種金融	
SIKA AG-BR	0.54	0.47	296	33,477	素材	
SWISS PRIME SITE-REG	16	15	140	15,843	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.25	0.22	127	14,438	食品・飲料・タバコ	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	4	3	234	26,481	各種金融	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.56	0.49	69	7,811	食品・飲料・タバコ	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2	1	119	13,521	素材	
UBS GROUP AG-REG	915	801	1,348	152,475	各種金融	
DUFREY AG-REG	10	10	166	18,842	小売	
GALENICA AG-REG	0.98	0.85	97	11,051	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株数・金額	4,161	3,582	26,138	2,955,182	
	銘柄数<比率>	39	38	—	<3.5%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ			
ELECTROLUX AB-SER B	60	52	1,441	18,492	耐久消費財・アパレル	
ERICSSON LM-B SHS	761	672	3,868	49,632	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ATLAS COPCO AB-B SHS	97	85	2,533	32,509	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	380	333	3,536	45,372	銀行	
INVESTOR AB-B SHS	113	99	4,083	52,391	各種金融	
NORDEA BANK AB	759	665	7,479	95,964	銀行	
GETINGE AB-B SHS	50	44	795	10,206	ヘルスケア機器・サービス	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	375	334	4,228	54,252	銀行	
ATLAS COPCO AB-A SHS	168	149	4,962	63,671	資本財	
SKF AB-B SHARES	99	87	1,615	20,731	資本財	
ASSA ABLOY AB-B	250	219	4,247	54,494	資本財	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	237	207	4,432	56,872	小売	
SANDVIK AB	267	233	3,268	41,938	資本財	
SWEDBANK AB - A SHARES	226	198	4,287	55,007	銀行	
SECURITAS AB-B SHS	78	68	944	12,115	商業・専門サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	151	132	3,933	50,463	家庭用品・パーソナル用品	
SKANSKA AB-B SHS	94	74	1,605	20,595	資本財	



銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額	金額		
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円		
SWEDISH MATCH AB	49	41	1,227	15,745	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	79	79	695	8,926	電気通信サービス	
TELIA CO AB	647	565	2,139	27,444	電気通信サービス	
VOLVO AB-B SHS	385	342	4,982	63,924	資本財	
ALFA LAVAL AB	73	63	1,145	14,698	資本財	
LUNDIN PETROLEUM AB	54	40	695	8,917	エネルギー	
BOLIDEN AB	68	59	1,449	18,596	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	104	91	824	10,583	耐久消費財・アパレル	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	16	14	692	8,885	電気通信サービス	
HEXAGON AB-B SHS	64	56	2,215	28,425	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KINNEVIK AB - B	58	51	1,252	16,070	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	40	35	755	9,691	各種金融	
ICA GRUPPEN AB	20	17	533	6,846	食品・生活必需品小売り	
LUNDBERGS AB-B SHS	—	8	542	6,958	各種金融	
小計	株数・金額	5,836	5,127	76,416	980,428	
	銘柄数<比率>	30	31	—	<1.1%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	245	214	3,149	41,733	銀行	
NORSK HYDRO ASA	335	291	1,372	18,188	素材	
ORKLA ASA	203	178	1,445	19,152	食品・飲料・タバコ	
STATOIL ASA	279	251	3,841	50,902	エネルギー	
TELENOR ASA	187	164	2,197	29,122	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	44	38	1,246	16,511	素材	
MARINE HARVEST	—	84	1,234	16,361	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	50	43	594	7,879	保険	
SCHIBSTED ASA-CL A	18	18	404	5,353	メディア	
SCHIBSTED ASA-B SHS	22	18	371	4,928	メディア	
小計	株数・金額	1,388	1,303	15,859	210,132	
	銘柄数<比率>	9	10	—	<0.2%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
NOVO NORDISK A/S-B	490	418	11,512	191,573	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	58	50	1,498	24,933	素材	
DANSKE BANK A/S	177	151	3,856	64,178	銀行	
WILLIAM DEMANT HOLDING	6	26	440	7,332	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	56	48	2,990	49,754	資本財	
TDC A/S	203	174	646	10,756	電気通信サービス	
CARLSBERG AS-B	26	23	1,662	27,658	食品・飲料・タバコ	
COLOPLAST-B	27	26	1,436	23,907	ヘルスケア機器・サービス	
DSV A/S	48	41	1,621	26,981	運輸	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1	1	1,778	29,590	運輸	
TRYG A/S	29	24	331	5,513	保険	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.96	0.79	922	15,354	運輸	
PANDORA A/S	27	24	1,668	27,769	耐久消費財・アパレル	
ISS A/S	37	36	1,042	17,341	商業・専門サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	24	21	1,010	16,816	素材	
GENMAB A/S	13	13	1,764	29,354	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DONG ENERGY A/S	—	34	956	15,909	公益事業	
小計	株数・金額	1,230	1,118	35,139	584,724	
	銘柄数<比率>	16	17	—	<0.7%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
BHP BILLITON LIMITED	805	704	1,663	139,867	素材	
CSL LTD	116	100	1,363	114,654	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	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
ALUMINA LTD	659	545	96	8,115	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	186	167	547	46,006	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	730	643	1,886	158,611	銀行
RIO TINTO LTD	106	93	557	46,864	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	347	303	412	34,697	保険
LENLEASE GROUP	141	123	206	17,322	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	428	379	3,110	261,592	銀行
WESTPAC BANKING CORP	834	735	2,399	201,781	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	660	584	1,888	158,810	銀行
BRAMBLES LTD	400	354	373	31,381	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	147	113	54	4,599	運輸
BORAL LTD	193	261	179	15,056	素材
WOOLWORTHS LTD	319	285	774	65,112	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	1,082	929	408	34,373	電気通信サービス
AMP LTD	754	658	349	29,368	各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD	217	190	90	7,601	消費者サービス
AMCOR LIMITED	293	257	396	33,374	素材
COMPUTERSHARE LTD	121	107	163	13,726	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	140	121	249	20,974	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	77	67	635	53,435	各種金融
CIMIC GROUP LTD	26	21	88	7,401	資本財
ASX LTD	50	43	227	19,150	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	149	127	123	10,415	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	14	12	190	16,007	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	114	100	219	18,466	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	146	124	50	4,277	小売
NEWCREST MINING LTD	192	169	341	28,715	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	621	530	344	28,933	保険
ORIGIN ENERGY LTD	442	389	308	25,935	エネルギー
ORICA LTD	94	83	158	13,342	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	100	89	210	17,676	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	422	405	148	12,473	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	327	288	420	35,363	保険
TRANSURBAN GROUP	518	458	561	47,216	運輸
WESFARMERS LTD	283	248	1,094	92,074	食品・生活必需品小売り
CHALLENGER LTD	147	128	170	14,370	各種金融
SYDNEY AIRPORT	286	252	184	15,477	運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD	69	58	192	16,187	エネルギー
OIL SEARCH LTD	345	305	222	18,727	エネルギー
AGL ENERGY LTD	176	152	412	34,657	公益事業
TATTS GROUP LTD	380	317	139	11,706	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	393	342	166	14,021	素材
ASCIANO LTD	129	—	—	—	運輸
ILUKA RESOURCES LTD	107	—	—	—	素材
AUSNET SERVICES	514	485	84	7,121	公益事業
CROWN RESORTS LTD	93	81	104	8,754	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD	431	386	143	12,071	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	118	106	131	11,054	銀行
AURIZON HOLDINGS LTD	535	459	254	21,401	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	187	164	217	18,294	食品・飲料・タバコ
RAMSAY HEALTH CARE LTD	36	32	236	19,922	ヘルスケア機器・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	14	11	40	3,401	消費者サービス

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	
SEEK LTD	84	72	133	11,214	商業・専門サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	97	91	109	9,203	銀行
REA GROUP LTD	14	11	76	6,426	メディア
TPG TELECOM LTD	76	76	45	3,864	電気通信サービス
HEALTHSCOPE LTD	449	397	90	7,621	ヘルスケア機器・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	701	616	185	15,594	保険
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	66	—	—	—	各種金融
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	15	100	8,425	消費者サービス
SOUTH32 LTD	1,342	1,169	309	26,056	素材
VOCUS GROUP LTD	116	114	28	2,406	電気通信サービス
小 計	株 数	株 数	26,076	2,192,760	
	銘柄 数 < 比 率 >	銘柄 数 < 比 率 >	—	< 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	380	397	148	11,529	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	202	209	143	11,157	運輸
CONTACT ENERGY LTD	155	165	86	6,758	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD	144	151	129	10,090	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD	79	82	69	5,434	ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD	283	290	81	6,350	公益事業
MERCURY NZ LTD	156	153	49	3,831	公益事業
小 計	株 数	株 数	708	55,153	
	銘柄 数 < 比 率 >	銘柄 数 < 比 率 >	—	< 0.1% >	
(香港)			千香港ドル		
WHARF HOLDINGS LTD	330	300	2,010	29,406	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	145	120	892	13,052	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	683	593	6,045	88,451	資本財
SUN HUNG KAI PROPERTIES	440	320	3,731	54,587	不動産
MTR CORP	365	320	1,489	21,792	運輸
HONG KONG & CHINA GAS	1,767	1,733	2,721	39,822	公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,370	1,250	1,226	17,940	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	340	310	2,213	32,382	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	280	255	4,990	73,008	各種金融
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	320	260	284	4,168	運輸
HANG LUNG GROUP LTD	—	190	615	9,006	不動産
HANG LUNG PROPERTIES LTD	550	490	960	14,050	不動産
CLP HOLDINGS LTD	485	360	2,995	43,819	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	276	242	1,202	17,590	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	294	262	858	12,553	銀行
HANG SENG BANK LTD	194	163	2,653	38,822	銀行
HYSAN DEVELOPMENT CO	160	140	515	7,547	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD	320	260	290	4,252	消費者サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	50	60	724	10,603	半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO	750	690	931	13,627	不動産
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	200	165	544	7,966	耐久消費財・アパレル
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	180	150	1,036	15,163	公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	940	815	2,665	38,989	銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	335	305	1,062	15,550	耐久消費財・アパレル
PCCW LTD	1,050	1,010	462	6,767	電気通信サービス
LI & FUNG LTD	1,480	1,300	421	6,162	耐久消費財・アパレル
KERRY PROPERTIES LTD	175	155	447	6,553	不動産
NWS HOLDINGS LTD	360	350	532	7,793	資本財
SANDS CHINA LTD	588	532	1,840	26,929	消費者サービス

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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
WHEELLOCK & CO LTD	230	180	1,098	16,076	不動産
WYNN MACAU LTD	396	336	535	7,835	消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD	510	470	336	4,916	消費者サービス
FIRST PACIFIC CO	620	440	257	3,765	各種金融
AIA GROUP LTD	3,002	2,642	14,755	215,873	保険
SWIRE PROPERTIES LTD	288	248	637	9,324	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	570	520	2,106	30,810	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	240	200	333	4,880	消費者サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	680	820	821	12,020	電気通信サービス
WH GROUP LTD	1,480	1,785	1,212	17,731	食品・飲料・タバコ
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	678	588	3,365	49,232	不動産
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23,122 39	21,330 40	71,827 —	1,050,834 <1.2%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	780	694	732	59,296	銀行
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	414	372	125	10,173	メディア
SEBACORP INDUSTRIES LTD	249	238	75	6,085	資本財
CAPITALAND LTD	648	577	210	17,040	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	110	89	96	7,813	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	26	21	98	7,968	小売
DBS GROUP HOLDINGS LTD	440	390	816	66,044	銀行
KEPPEL CORP LTD	363	323	213	17,300	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	329	291	697	56,436	銀行
SINGAPORE TECH ENGINEERING	398	342	129	10,515	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,998	1,791	664	53,761	電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	143	125	134	10,912	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	208	177	130	10,568	各種金融
SEBACORP MARINE LTD	214	—	—	—	資本財
UOL GROUP LTD	127	107	75	6,146	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	547	472	128	10,387	運輸
NOBLE GROUP LTD	1,188	—	—	—	資本財
STARHUB LTD	162	127	34	2,805	電気通信サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,801	1,525	56	4,567	食品・飲料・タバコ
WILMAR INTERNATIONAL LTD	492	442	151	12,266	食品・飲料・タバコ
GENTING SINGAPORE PLC	1,539	1,381	149	12,067	消費者サービス
SATS LTD	—	160	84	6,861	運輸
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	796	586	170	13,797	不動産
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	487	378	47	3,807	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	13,460 23	10,608 22	5,025 —	406,623 <0.5%>
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
ISRAEL CHEMICALS LTD	127	107	162	5,141	素材
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	228	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANK HAPALIM BM	263	234	534	16,894	銀行
NICE LTD	14	13	366	11,562	ソフトウェア・サービス
BANK LEUMI LE-ISRAEL	348	317	535	16,903	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD	—	5	215	6,802	資本財
DELEK GROUP LTD	1	—	—	—	エネルギー
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	481	438	272	8,615	電気通信サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	34	28	174	5,495	銀行
AZRIELI GROUP LTD	9	8	178	5,627	不動産

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル) FRUTAROM	百株 —	百株 9	千イスラエルシェケル 191	千円 6,059	素材	
小計	株数・金額 1,508	株数 1,163	2,631	83,102		
	銘柄数<比率> 9	9	—	<0.1%>		
合計	株数・金額 332,807	284,397	—	80,733,104		
	銘柄数<比率> 1,259	1,261	—	<94.3%>		

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

(注) 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	11	10	317	36,122	0.0	
MACERICH CO/THE	3	2	159	18,168	0.0	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	—	1	207	23,599	0.0	
PROLOGIS INC	13	11	629	71,743	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	1	156	17,779	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	—	3	120	13,723	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3	3	396	45,149	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	1	359	41,007	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	2	2	199	22,761	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	1	202	23,072	0.0	
WELLTOWER INC	8	7	567	64,684	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	3	3	408	46,525	0.1	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1	2	246	28,140	0.0	
REALTY INCOME CORP	6	5	307	34,996	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	2	3	208	23,749	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	2	2	234	26,667	0.0	
UDR INC	6	5	220	25,111	0.0	
VENTAS INC	8	7	506	57,703	0.1	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	23	22	251	28,622	0.0	
WEYERHAEUSER CO	19	16	540	61,551	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	10	9	1,177	134,200	0.2	
AGNC INVESTMENT CORP	8	7	141	16,147	0.0	
VEREIT INC	22	21	159	18,200	0.0	
DUKE REALTY CORP	8	7	221	25,273	0.0	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	4	6	126	14,364	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	5	5	191	21,845	0.0	
EQUINIX INC	1	1	675	76,945	0.1	
CROWN CASTLE INTL CORP	8	7	745	84,893	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	9	7	517	58,994	0.1	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	—	11	150	17,168	0.0	
GGP INC	14	12	283	32,275	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	18	16	287	32,738	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	3	3	130	14,851	0.0	
PUBLIC STORAGE	3	3	671	76,532	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	7	6	1,114	126,931	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	4	3	350	39,917	0.0	
KIMCO REALTY CORP	10	9	176	20,160	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3	3	575	65,611	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	269	262	13,936	1,587,934	
	銘柄 数 < 比 率 >	35	38	—	<1.9%>	
(カナダ)				千カナダドル		
SMART REAL ESTATE INVESTMENT		1	1	40	3,377	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		3	2	65	5,479	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		3	3	89	7,460	0.0
小 計		8	7	196	16,316	
		銘柄数<比率>	3	3	—	<0.0%>
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		0.862	0.888	120	14,885	0.0
KLEPIERRE		5	4	180	22,310	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		2	2	512	63,496	0.1
FONCIERE DES REGIONS		0.753	0.804	68	8,487	0.0
ICADE		0.829	0.812	58	7,238	0.0
ユ ー ロ 計		10	9	940	116,418	
		銘柄数<比率>	5	5	—	<0.1%>
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		20	21	142	20,977	0.0
HAMMERSON PLC		19	17	102	15,018	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		19	17	195	28,638	0.0
INTU PROPERTIES PLC		23	20	58	8,570	0.0
SEGRO PLC		18	18	91	13,458	0.0
小 計		102	95	590	86,662	
		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		86	75	214	18,042	0.0
SCENTRE GROUP		135	118	506	42,571	0.0
GPT GROUP		46	40	215	18,115	0.0
MIRVAC GROUP		95	83	190	16,038	0.0
STOCKLAND		61	54	259	21,819	0.0
WESTFIELD CORP		50	43	392	32,999	0.0
DEXUS		25	21	223	18,821	0.0
GOODMAN GROUP		45	40	330	27,814	0.0
小 計		545	477	2,333	196,222	
		銘柄数<比率>	8	8	—	<0.2%>
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		57	49	2,810	41,112	0.0
小 計		57	49	2,810	41,112	
		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		62	52	92	7,490	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		53	45	73	5,934	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		63	56	109	8,880	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		54	54	142	11,530	0.0
小 計		233	208	418	33,835	
		銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>
合 計		1,227	1,110	—	2,078,502	
		銘柄数<比率>	61	64	—	<2.4%>

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

## 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		百万円	百万円
		SP EMINI	2,697	—
		SP/TSE60	152	—
		SWISS IX	153	—
		EURO ST	639	—
		SPI 200	209	—
		FTSE100	302	—

(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

(2017年5月12日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
株式	千円 80,733,104	% 91.2
投資証券	2,078,502	2.3
コール・ローン等、その他	5,677,256	6.5
投資信託財産総額	88,488,862	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(87,416,700千円)の投資信託財産総額(88,488,862千円)に対する比率は98.8%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=113.94円	1 カナダドル=83.13円	1 ユーロ=123.80円	1 イギリスポンド=146.77円
1 スイスフラン=113.06円	1 スウェーデンクローネ=12.83円	1 ノルウェークローネ=13.25円	1 デンマーククローネ=16.64円
1 オーストラリアドル=84.09円	1 ニュージーランドドル=77.83円	1 香港ドル=14.63円	1 シンガポールドル=80.91円
1 イスラエルシェゲル=31.58円			



## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	173,489,779,062
コール・ローン等	2,271,589,995
株式(評価額)	80,733,104,146
投資証券(評価額)	2,078,502,529
未収入金	85,106,469,129
未収配当金	154,819,239
差入委託証拠金	3,145,294,024
(B) 負債	87,840,823,861
未払金	86,732,078,933
未払解約金	1,108,743,397
未払利息	1,531
(C) 純資産総額(A-B)	85,648,955,201
元本	54,368,337,558
次期繰越損益金	31,280,617,643
(D) 受益権総口数	54,368,337,558口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,753円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 65,607,671,368円  
 期中追加設定元本額 13,010,185,812円  
 期中一部解約元本額 24,249,519,622円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.5753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)

国内株式セレクション(ラップ向け)	790,805円
ヘッジ付先進国株式インデックスオープン	1,857,428,655円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	19,536,871,489円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投資家限定)	11,008,256,227円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,735,164,782円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,085,523,040円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	3,449,798,649円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	15,976,708円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	93,386,663円
MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	14,585,140,540円
合計	54,368,337,558円

## [お知らせ]

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める(分散型に分類)ため、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い、信託約款に所要の変更を行いました。  
 (2016年7月1日)

## ○損益の状況 (2016年5月13日~2017年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,929,991,032
受取配当金	1,913,089,374
受取利息	△ 645,935
その他収益金	25,868,291
支払利息	△ 8,320,698
(B) 有価証券売買損益	11,603,358,464
売買益	31,687,490,837
売買損	△20,084,132,373
(C) 先物取引等取引損益	1,571,451,771
取引益	1,813,024,981
取引損	△ 241,573,210
(D) 保管費用等	△ 29,706,307
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	15,075,094,960
(F) 前期繰越損益金	21,534,062,535
(G) 追加信託差損益金	6,138,729,831
(H) 解約差損益金	△11,467,269,683
(I) 計(E+F+G+H)	31,280,617,643
次期繰越損益金(I)	31,280,617,643

(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。

# JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド

## 《第3期》決算日2018年1月26日

[計算期間：2017年1月27日～2018年1月26日]

「JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド」は、1月26日に第3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3期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主としてわが国の金融商品取引所上場株式（上場予定株式を含みます。）に投資を行い、iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックスに連動する投資成果をめざして運用を行います。株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定株式を含みます。）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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

### ○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス		株組入比率	株先物比率	純資産総額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
(設定日)	円	%			%	%	百万円
2015年11月6日	10,000	—	166.32	—	—	—	299
1期(2016年1月26日)	8,905	△11.0	148.04	△11.0	96.9	3.1	444
2期(2017年1月26日)	10,267	15.3	167.04	12.8	98.2	1.2	1,322
3期(2018年1月26日)	13,199	28.6	210.69	26.1	99.0	1.0	1,840

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックスとは、東京証券取引所を主たる市場とする普通株式等の中から時価総額、流動性によりスクリーニングされる投資ユニバースのうち、高ROEかつ、①財務健全性、②キャッシュフロー収益性、③利益安定性の3点に着目し、高ROEの継続性を評価して150銘柄を選定し算出される株価指数です。iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックスは、三菱UFJ信託銀行が有するアクティブ運用機関としてのノウハウとSTOXXリミテッド（以下「STOXX社」）が有する指数提供機関としての経験を活用し、両社で共同開発したものです。2001年6月18日の時価総額を100として、STOXX社が算出・公表しています。STOXX社は、iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス及びそれに含まれるデータの発行元です。STOXX社は、報告された情報の作成に何ら関与するものではなく、かつ報告された情報、又はiSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス若しくはそのデータに関するエラー、遺漏若しくは中断について、何ら保証するものではなく、(過失の有無を問わず)いかなる責任も負うものではありません。これらについては、正確性、妥当性、正当性、完全性、適時性及び目的への適合性を含みますが、これらに限定されません。STOXX社に關係する情報の流布又は再配信は、一切禁止されています。

(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。

(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		iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2017年1月26日	円	%		%	%	%
	10,267	—	167.04	—	98.2	1.2
1月末	10,150	△ 1.1	165.15	△ 1.1	98.6	1.2
2月末	10,205	△ 0.6	165.99	△ 0.6	98.8	1.2
3月末	10,261	△ 0.1	165.62	△ 0.9	97.4	2.2
4月末	10,378	1.1	167.48	0.3	98.1	2.2
5月末	10,844	5.6	174.95	4.7	98.8	1.3
6月末	11,077	7.9	178.46	6.8	98.7	1.1
7月末	11,212	9.2	180.61	8.1	98.9	1.1
8月末	11,223	9.3	180.64	8.1	98.8	1.1
9月末	11,750	14.4	187.96	12.5	97.3	2.7
10月末	12,397	20.7	198.34	18.7	99.1	0.8
11月末	12,734	24.0	203.76	22.0	99.3	0.7
12月末	12,801	24.7	204.48	22.4	99.2	0.7
(期 末) 2018年1月26日	13,199	28.6	210.69	26.1	99.0	1.0

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

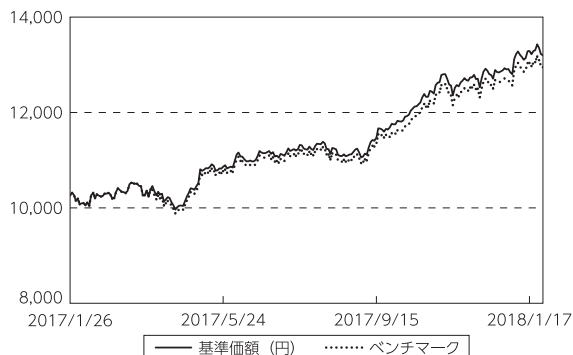
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ28.6%の上昇となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

ベンチマークは26.1%の上昇となったため、カ  
イ離は2.5%程度となりました。

## 基準価額等の推移



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

●投資環境について

◎国内株式市況

フランス大統領選挙で親欧州連合（EU）派のマクロン氏が勝利したこと等を好感して世界的に株高となったこと、衆議院選挙で与党が勝利したことによる経済政策継続への期待、国内企業の業績改善が進んだこと等を受け国内株式市況は上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・株式ポートフォリオはベンチマークである iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス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26.1%の上昇となったため、ベンチマークとの乖離は2.5%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い流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
ベンチマークとの乖離	△0.1%程度	0.0%程度	2.5%程度	2.5%程度

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は△0.1%程度でした。

- ・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式（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、1.4%程度となりました。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.5%程度でした。

- ・配当金等の受取りにより、プラス乖離となりました。

プラス要因	配当収入等	計 2.5%程度
マイナス要因	売買コスト等	計 △0.0%程度

◎今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2017年1月27日～2018年1月26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	0.007	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
	(1)	(0.007)	
合 計	1	0.007	
期中の平均基準価額は、11,252円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2017年1月27日～2018年1月26日)

株式

国	上場	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内		千株	千円	千株	千円
		1,080	3,767,494	1,010	3,611,132
		(△ 18)	( )		

(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	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	865	866	944	943

## ○株式売買比率

(2017年1月27日～2018年1月26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	7,378,626千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,597,004千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	4.62

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2017年1月27日～2018年1月26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	$\frac{D}{C}$	%
株式	百万円 3,767	百万円 726	19.3	百万円 3,611	百万円 562	15.6

## 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 23

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

## ○組入資産の明細

(2018年1月26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
<b>建設業 (6.0%)</b>				
大成建設	12	2.8	16,184	
大林組	7.7	—	—	
清水建設	8	—	—	
長谷工コーポレーション	3.2	3.7	6,667	
鹿島建設	11	13	14,651	
西松建設	3	0.7	2,226	
前田建設工業	2	2.1	3,229	
熊谷組	4	—	—	
大東建託	0.8	0.9	18,360	
前田道路	1	—	—	
五洋建設	—	3.5	3,052	
大和ハウス工業	—	8.2	37,031	
協和エクシオ	—	1.2	3,480	
九電工	0.5	0.7	3,927	
<b>食料品 (7.0%)</b>				
森永製菓	0.5	0.6	3,480	
カルビー	0.9	1	3,890	
明治ホールディングス	1.6	1.8	16,686	
アサヒグループホールディングス	—	5.7	32,849	
キリンホールディングス	—	11.3	31,803	
伊藤園	—	0.8	3,672	
キッコーマン	2	—	—	
ニチレイ	1.5	—	—	
日本たばこ産業	6.6	9.4	34,385	
<b>化学 (11.6%)</b>				
旭化成	14	17.3	25,266	
日産化学工業	1.6	1.9	8,730	
東ソー	—	4	10,016	
三菱瓦斯化学	—	2.7	8,518	
J S R	—	2.5	5,715	
三菱ケミカルホールディングス	—	18.6	22,478	
ダイセル	3.7	4.3	5,714	
積水化学工業	4.9	5.6	12,544	

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
日本ゼオン	—	2.5	4,042	
アイカ工業	0.7	0.8	3,312	
日立化成	1.1	—	—	
日本化薬	2	—	—	
日油	2	1.1	3,298	
花王	4.8	4.5	34,650	
関西ペイント	2.8	—	—	
ライオン	3	3.7	7,773	
コーセー	0.4	0.4	7,612	
ポラー・オルビスホールディングス	0.3	1.2	5,394	
小林製薬	0.6	0.8	5,936	
日東電工	1.7	2	20,090	
ニフコ	0.5	0.6	4,638	
ユニ・チャーム	5	5.3	15,892	
<b>医薬品 (5.7%)</b>				
アステラス製薬	16.4	24.7	35,123	
大日本住友製薬	—	2.1	3,360	
塩野義製薬	3.3	3.8	23,795	
日本新薬	0.7	0.8	6,240	
中外製薬	2.4	2.8	16,772	
科研製薬	0.4	0.5	2,955	
エーザイ	3.2	—	—	
小野薬品工業	—	5.8	15,810	
沢井製薬	0.4	—	—	
パプチドリーム	0.5	—	—	
<b>ゴム製品 (2.1%)</b>				
ブリヂストン	5.9	7	37,954	
住友ゴム工業	2	—	—	
<b>ガラス・土石製品 (0.7%)</b>				
TOTO	1.8	2.1	13,335	
日本碍子	3.1	—	—	
日本特殊陶業	2.1	—	—	
<b>非鉄金属 (-%)</b>				
DOWAホールディングス	3	—	—	

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
<b>金属製品 (0.2%)</b>				
三和ホールディングス	2.6	2.9	4,567	
<b>機械 (9.0%)</b>				
オーエスジー	1	—	—	
ディスコ	0.3	0.4	10,392	
島精機製作所	—	0.4	3,172	
ナブテスコ	1.3	1.5	7,725	
SMC	0.7	0.8	43,768	
クボタ	12.7	14.6	33,156	
ダイキン工業	2.4	2.7	36,045	
ダイフク	—	1.5	11,160	
CKD	—	0.8	2,372	
竹内製作所	—	0.5	1,396	
ホシザキ	0.6	0.7	7,406	
THK	—	1.6	7,416	
マキタ	1.5	—	—	
<b>電気機器 (16.4%)</b>				
ブラザー工業	2.8	3.2	9,353	
ミネベアミツミ	—	5.3	13,170	
三菱電機	15	—	—	
富士電機	—	9	8,055	
安川電機	—	3.3	18,843	
マブチモーター	—	0.8	5,264	
日本電産	2.5	—	—	
オムロン	2.3	2.6	18,798	
アルバック	0.5	0.6	4,602	
富士通ゼネラル	1	0.8	1,690	
アルプス電気	—	2.4	7,524	
横河電機	2.6	—	—	
アズビル	—	0.9	4,635	
日本光電工業	1	—	—	
堀場製作所	—	0.5	3,535	
キーエンス	—	0.6	41,472	
シスメックス	1.9	2.2	20,020	
スタンレー電気	1.7	1.9	8,645	
カシオ計算機	2.8	—	—	
ファナック	1.2	1.3	39,728	
村田製作所	1.6	2.4	38,196	
小糸製作所	1.4	1.6	13,088	

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
SCREENホールディングス	0.5	0.6	5,760	
東京エレクトロン	1.8	1.7	37,102	
<b>輸送用機器 (7.1%)</b>				
トヨタ紡織	—	1.1	2,643	
いすゞ自動車	6.6	7.7	14,410	
トヨタ自動車	3.6	—	—	
カルソニックカンセイ	2	—	—	
アイシン精機	2.2	2.3	14,927	
スズキ	4.7	5.4	33,393	
SUBARU	5.2	7.9	29,079	
ヤマハ発動機	3.3	3.8	14,212	
シマノ	0.9	1.1	17,446	
テイ・エス テック	0.6	0.6	2,901	
<b>精密機器 (4.7%)</b>				
テルモ	3.8	4.1	22,632	
島津製作所	—	3.4	9,764	
東京精密	0.4	0.5	2,377	
オリンパス	—	4	17,120	
HOYA	4.2	4.8	27,460	
朝日インテック	0.6	1.5	6,367	
<b>その他製品 (1.0%)</b>				
バンダイナムコホールディングス	2.4	2.7	9,814	
タカラトミー	—	1.1	1,837	
ヤマハ	2	—	—	
ビジョン	1.3	1.5	6,682	
<b>電気・ガス業 (—%)</b>				
東邦瓦斯	5	—	—	
<b>陸運業 (2.0%)</b>				
東海旅客鉄道	1.4	1.7	35,844	
<b>空運業 (2.1%)</b>				
日本航空	3.9	4.4	18,515	
ANAホールディングス	—	4.3	19,651	
<b>情報・通信業 (8.6%)</b>				
ネクソン	—	2.4	8,748	
野村総合研究所	1.4	1.8	9,666	
オービック	0.8	0.9	8,010	
ヤフー	13.1	15.1	8,033	
トレンドマイクロ	1.4	1.6	9,712	
日本オラクル	0.3	0.4	3,576	



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
伊藤忠テクノソリューションズ	0.6	0.7	3,500	
大塚商会	0.7	0.8	7,472	
日本ユニシス	—	1	2,366	
日本電信電話	5.5	—	—	
KDDI	8.6	10.9	30,732	
光通信	0.3	0.3	4,821	
NTTドコモ	9.6	12.2	33,385	
GMOインターネット	0.7	—	—	
東宝	1.5	1.7	6,392	
エヌ・ティ・ティ・データ	1.4	—	—	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1	1.1	5,720	
カブコン	—	0.6	2,319	
S C S K	0.6	0.7	3,647	
コナミホールディングス	—	1.3	8,086	
<b>卸売業 (0.9%)</b>				
アルフレッサ ホールディングス	2.3	—	—	
第一興商	0.5	0.6	3,600	
日立ハイテクノロジーズ	0.7	—	—	
サンリオ	0.7	—	—	
ミスミグループ本社	2.9	3.5	12,547	
<b>小売業 (6.2%)</b>				
ローソン	0.5	0.6	4,416	
エービーシー・マート	0.3	0.4	2,864	
MonotaRO	0.7	0.8	2,876	
マツモトキヨシホールディングス	0.5	1.1	5,109	
スタートトゥデイ	2.2	—	—	
ウエルシアホールディングス	0.3	0.6	2,868	
すかいらーく	—	1.5	2,382	
コスモス薬品	0.1	0.1	1,997	
ツルハホールディングス	0.5	—	—	
良品計画	0.3	0.3	10,860	
ドンキホーテホールディングス	—	1.4	8,512	
スギホールディングス	0.4	0.6	3,528	
しまむら	0.3	—	—	
アインホールディングス	0.3	0.3	2,046	
ニトリホールディングス	1	1.2	21,240	
ファーストリテイリング	—	0.8	39,608	
サンドラッグ	0.4	0.9	4,329	

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
<b>銀行業 (0.9%)</b>				
めぶきフィナンシャルグループ	—	13	6,552	
あおぞら銀行	13	—	—	
スルガ銀行	—	2.9	6,472	
セブン銀行	—	9.1	3,703	
<b>証券、商品先物取引業 (0.1%)</b>				
ジャフコ	—	0.4	2,640	
松井証券	1.5	—	—	
<b>保険業 (—%)</b>				
SOMPOホールディングス	4.4	—	—	
ソニーフィナンシャルホールディングス	1.8	—	—	
第一生命ホールディングス	12.6	—	—	
東京海上ホールディングス	4.7	—	—	
<b>その他金融業 (1.0%)</b>				
全国保証	0.6	0.6	3,240	
日本取引所グループ	5.9	6.8	14,123	
<b>不動産業 (0.4%)</b>				
ヒューリック	5.2	—	—	
パーク24	1.2	1.4	3,927	
レオパレス21	—	3.1	2,743	
<b>サービス業 (6.3%)</b>				
日本M&Aセンター	0.7	0.8	5,240	
エス・エム・エス	—	0.4	1,402	
パーソルホールディングス	1.8	2.4	6,748	
総合警備保障	1	—	—	
カカコム	1.5	1.7	3,206	
エムスリー	2.1	2.6	9,932	
アウトソーシング	—	1	2,148	
ディー・エヌ・エー	—	1.4	3,396	
博報堂DYホールディングス	3.4	—	—	
オリエンタルランド	2.4	2.8	30,870	
ユー・エス・エス	2.7	3.1	7,886	
サイバーエージェント	1.1	—	—	
リクルートホールディングス	5.6	13.4	37,613	
リログループ	0.1	1.5	4,965	
共立メンテナンス	0.2	0.4	1,898	
セコム	2.3	—	—	
合 計	株 数・金 額	416	467	1,821,359
	銘柄数<比率>	150	149	<99.0%>

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

## 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	
		百万円	百万円
		18	—

## ○投資信託財産の構成

(2018年1月26日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	1,821,359	97.1
コール・ローン等、その他	54,287	2.9
投資信託財産総額	1,875,646	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,875,646,421
コール・ローン等	49,178,721
株式(評価額)	1,821,359,950
未収配当金	4,567,750
差入委託証拠金	540,000
(B) 負債	35,257,172
未払金	35,130,100
未払解約金	127,000
未払利息	72
(C) 純資産総額(A-B)	1,840,389,249
元本	1,394,296,523
次期繰越損益金	446,092,726
(D) 受益権総口数	1,394,296,523口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,199円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,288,103,605円  
 期中追加設定元本額 2,725,102,102円  
 期中一部解約元本額 2,618,909,184円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3199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)

iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックスファンド(ラップ向け)	59,570,192円
国内株式セレクション(ラップ向け)	285,687,180円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	13,679,589円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	70,836,013円
eMAXIS JAPAN クオリティ150インデックス	964,523,549円
合計	1,394,296,523円

【お知らせ】

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

○損益の状況 (2017年1月27日～2018年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	28,487,630
受取配当金	28,491,705
受取利息	356
その他収益金	24,328
支払利息	△ 28,759
(B) 有価証券売買損益	365,835,889
売買益	414,666,915
売買損	△ 48,831,026
(C) 先物取引等取引損益	4,689,000
取引益	7,168,540
取引損	△ 2,479,540
(D) 当期損益金(A+B+C)	399,012,519
(E) 前期繰越損益金	34,428,474
(F) 追加信託差損益金	588,254,457
(G) 解約差損益金	△575,602,724
(H) 計(D+E+F+G)	446,092,726
次期繰越損益金(H)	446,092,726

- (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。