

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	2023年3月24日まで（2014年12月25日設定）	
運用方針	各マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に投資を行います。株式の実質組入比率は、株式組入れを抑えつつ、相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。債券の実質組入比率は、原則として、先進国債券を一定の比率とし、残りの部分は国内債券等を組入れます。国内外の債券市場が下落した場合等に債券の実質組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等の組入れを行う場合があります。マザーファンド受益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のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。三菱UFJ信託銀行株式会社の投資助言・情報提供に基づき、ファンドの運用を行います。	
主要運用対象	ベビーファンド	TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券およびマネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	TOPIXマザーファンド	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
	外国株式インデックスマザーファンド	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円換算ベース) に採用されている株式を主要投資対象とします。
	日本債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI 総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。
	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
	マネー・マーケット・マザーファンド	わが国の公社債等を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	TOPIXマザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	外国株式インデックスマザーファンド	株式および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
	日本債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
	マネー・マーケット・マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)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。  
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。  
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## 運用報告書（全体版）

# 三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)

愛称：ファーストラップ（ささえ）

第4期（決算日：2018年3月26日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。  
 さて、お手持ちの「三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）」は、去る3月26日に第4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 (分配落)	標準価額			株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		税分配分	込み金	期中騰落率						
(設定日)	円	円	%	%	%	%	%	%	百万円	
2014年12月25日	10,000	—	—	—	—	—	—	—	10	
1期(2015年3月25日)	10,134	0	1.3	21.4	0.3	74.9	—	0.3	742	
2期(2016年3月25日)	10,173	0	0.4	3.8	0.1	74.9	0.1	0.1	11,025	
3期(2017年3月27日)	10,023	0	△1.5	21.2	0.6	73.8	—	0.3	16,616	
4期(2018年3月26日)	10,176	0	1.5	19.5	0.3	75.9	0.2	0.2	21,932	

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

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

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

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

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
	円	騰 落 率					
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%
2017年3月27日	10,023	—	21.2	0.6	73.8	—	0.3
3月末	10,044	0.2	21.0	0.6	73.5	—	0.3
4月末	10,097	0.7	21.7	0.8	73.4	—	0.3
5月末	10,128	1.0	21.2	0.5	73.4	0.1	0.3
6月末	10,145	1.2	20.8	0.5	70.1	0.1	0.3
7月末	10,147	1.2	21.5	0.4	76.0	0.1	0.3
8月末	10,183	1.6	21.2	0.8	75.4	0.2	0.3
9月末	10,232	2.1	21.5	0.7	75.6	0.1	0.3
10月末	10,319	3.0	21.0	0.6	75.3	0.1	0.3
11月末	10,351	3.3	21.3	0.5	75.0	0.2	0.3
12月末	10,393	3.7	21.0	0.5	75.9	0.1	0.3
2018年1月末	10,372	3.5	21.1	0.2	75.0	0.1	0.2
2月末	10,283	2.6	21.1	0.6	73.7	0.2	0.2
(期 末)							
2018年3月26日	10,176	1.5	19.5	0.3	75.9	0.2	0.2

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

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

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## 運用経過

## 当期中の基準価額等の推移について

（第4期：2017/3/28～2018/3/26）

## 基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.5%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

組み入れを行った各マザーファンド受益証券のうち、主に国内株式、先進国株式の資産クラスが上昇したことがプラスに寄与しました。

## 投資環境について

（第4期：2017/3/28～2018/3/26）

## 【概況】

当期の株式市況は、先進国株式は米国では上昇した一方、欧州では下落しました。国内株式は上昇しました。債券市場では、米国やドイツなど先進国の債券利回りは概ね上昇しました。国内の債券利回りは日銀の金融政策などを背景にほぼ変わらずとなりました。

## 【株式】

先進国株式市況は、米国では上昇した一方、欧州では下落しました。米国では、期首より2018年1月末にかけて、良好な米経済指標や、米税制改革による企業業績改善期待の高まりなどを受け上昇しました。その後、米雇用統計における賃金上昇を受けた利上げペース加速懸念から、米国債利回りが上昇したことなどが嫌気され下落したものの、通期では上昇しました。欧州では2017年8月末にかけて、欧州中央銀行（ECB）による金融緩和縮小観測の高まりや、ユーロ高進行による企業業績悪化懸念などが下落要因となりました。その後1月末にかけては堅調な米国株式市況などを背景に上昇基調で推移したものの、2月初旬の世界的な株式市況急落を受けて下落し、通期では下落しました。国内株式市況は上昇しました。期首より1月末にかけては、堅調な米国株式市況に加え、10月の衆議院選挙結果を受けた安定的な政権運営への期待などを背景に上昇しました。その後は、世界的な株式市況の下落を受けて下落したものの、通期では上昇しました。

## 【債券】

先進国債券利回りは上昇しました。期前半は主要国中央銀行の金融政策に対する思惑などから上下に振れる展開となりました。期後半は良好な経済環境を背景に、各国中央銀行が早期に金融引き締め姿勢へ転じるとの見方が高まったことなどから上昇しました。国内の債券利回りは、日銀のイールドカーブコントロール政策が意識されたことなどから、通期ではほぼ変わらずとなりました。

## 【為替】

円は米ドルに対して上昇しました。期末にかけての株式市況急落などを背景に投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから上昇しました。一方、円はユーロに対して下落しました。期前半のECBによる金融緩和縮小観測の高まりなどを背景に下落しました。

## 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。

三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき、各マザーファンドを組み入れた運用を行いました。株式の組入比率については、「投資環境」や「株式部分の収益寄与」に基づいて組入比率を決定する『株式ウエイトマトリクス』（※「目論見書」運用方法・運用プロセスをご参照ください）を活用しています。

### ◎組入比率

期を通して、堅調な株式市況を背景に、「投資環境」、「株式部分の収益寄与」ともに良好な水準であったことから株式の組入比率は高い水準を維持しました。2018年2月初めの世界的な株式市況下落を受けて、主に「投資環境」が悪化したものの、「株式部分の収益寄与」は良好な水準を維持したため、株式の組入比率は引き下げませんでした。なお、期末の「投資環境」、および「株式部分の収益寄与」の状況は以下のようになっています。

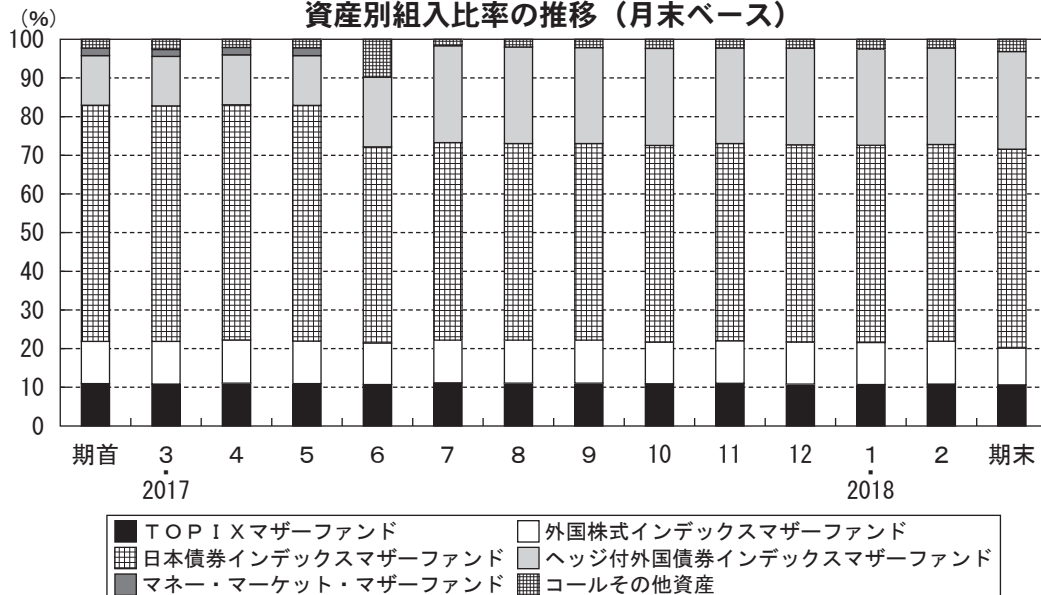
- ・国内株式の「投資環境」は中立、「株式部分の収益寄与」は高い局面
  - ・先進国株式の「投資環境」は中立、「株式部分の収益寄与」は高い局面
- また、2017年6月に中期的な投資環境見通しに基づき、債券部分の組入比率の見直しを行いました。見直しにより、国内債券の組入比率上限を51%に引き下げ、先進国債券の組入比率上限を25%（原則25%に固定）に引き上げました。

### ◎パフォーマンス要因

当期は、期首より2018年1月末にかけて株式市況が堅調に推移する中、株式組入比率の高い水準を維持していたことなどが基準価額の上昇にプラスに寄与しました。

（ご参考）

資産別組入比率の推移（月末ベース）



（ご参考）

資産別組入比率および基準価額騰落率

（2018年3月26日）

		組入可能範囲	組入比率	期中の基準価額騰落率
国内株式	TOPIXマザーファンド	0.0%~11.0%	10.6%	11.9%
先進国株式	外国株式インデックスマザーファンド	0.0%~11.0%	9.6%	6.8%
国内債券	日本債券インデックスマザーファンド	0.0%~51.0%	51.4%	0.9%
先進国債券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	0.0%~25.0% (原則、25.0%固定とします。)	25.3%	0.6%
短期公社債	マネー・マーケット・マザーファンド	—	—	0.0%

（注）組入比率は純資産総額に対する割合です。

## 当該投資信託のベンチマークとの差異について

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

## 分配金について

**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、分配対象額的水準等を勘案し、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4期
	2017年3月28日～2018年3月26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	325

(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。）

- ・三菱UFJ信託銀行の投資助言・情報提供に基づいた運用を行う方針です。
- ・三菱UFJ信託銀行は『株式ウエイトマトリクス』に基づく株式組入比率、および債券組入比率について日次で情報を提供しています。加えて、ファンド全体の収益率や、国内外の債券市況が下落した場合などに、引き下げる債券の比率についての情報を適時、提供しています。



## ○ 1万口当たりの費用明細

(2017年3月28日～2018年3月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	115	1.128	(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 ）	( 67)	(0.655)	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 ）	( 44)	(0.430)	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)	(0.043)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（ 株 式 ）	( 0)	(0.001)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0)	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.002	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	( 0)	(0.002)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0)	(0.000)	
(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)	(0.004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（ そ の 他 ）	( 0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	116	1.141	
期中の平均基準価額は、10,224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28日～2018年3月26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
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	4,601,417	5,842,350	1,917,540	2,435,000
TOPIXマザーファンド	1,078,175	1,908,000	915,180	1,551,820
外国株式インデックスマザーファンド	887,275	2,224,000	819,963	2,006,220
日本債券インデックスマザーファンド	7,671,588	10,132,240	6,897,482	9,104,760
マネー・マーケット・マザーファンド	—	—	315,194	320,994

## ○株式売買比率

(2017年3月28日～2018年3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	
	TOPIXマザーファンド	外国株式インデックス マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	382,799,467千円	301,980,140千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	300,118,677千円	345,310,087千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.27	0.87

(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28日～2018年3月26日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）&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	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 166,458	百万円 65,596	% 39.4	百万円 216,340	百万円 71,354	% 33.0
貸付有価証券(株式)	375,394	375,394	100.0	389,765	389,765	100.0

平均保有割合 0.6%

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

## &lt;外国株式インデックスマザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 217,957	百万円 24,542	% 11.3	百万円 249,815	百万円 85,836	% 34.4

平均保有割合 0.5%

※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;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

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	$\frac{D}{C}$	
公社債	百万円 354,461	百万円 73,481	% 20.7	百万円 299,351	百万円 71,624	% 23.9

平均保有割合 2.1%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

## &lt;ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド&gt;

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 2,034,946	百万円 221,179	% 10.9	百万円 2,147,357	百万円 299,579	% 14.0
為替直物取引	147,043	68,532	46.6	33,502	3,560	10.6

平均保有割合 2.3%

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

## &lt;マネー・マーケット・マザーファンド&gt;

該当事項はございません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

## ＜TOPIXマザーファンド＞

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 3,855	百万円 5,447	百万円 5,810

## ＜日本債券インデックスマザーファンド＞

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 100	百万円 300	百万円 1,530

## 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 559

## ＜日本債券インデックスマザーファンド＞

種 類	買 付 額
公社債	百万円 1,400

## 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)	245千円
うち利害関係人への支払額 (B)	4千円
(B) / (A)	1.8%

(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。

## ○組入資産の明細

(2018年3月26日現在)

## 親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	1,696,021	4,379,899	5,541,448
TOPIXマザーファンド	1,162,170	1,325,165	2,325,798
外国株式インデックスマザーファンド	792,583	859,895	2,100,295
日本債券インデックスマザーファンド	7,699,809	8,473,915	11,271,154
マネー・マーケット・マザーファンド	315,194	—	—

## ○投資信託財産の構成

(2018年3月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	5,541,448	25.0
TOPIXマザーファンド	2,325,798	10.5
外国株式インデックスマザーファンド	2,100,295	9.5
日本債券インデックスマザーファンド	11,271,154	50.9
コール・ローン等、その他	885,977	4.1
投資信託財産総額	22,124,672	100.0

(注) ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（193,373,304千円）の投資信託財産総額（215,953,519千円）に対する比率は89.5%です。

(注) 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（339,815,533千円）の投資信託財産総額（351,363,334千円）に対する比率は96.7%です。

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

1 アメリカドル=105.00円	1 カナダドル=81.62円	1 メキシコペソ=5.68円	1 ユーロ=129.93円
1 イギリスポンド=148.63円	1 スイスフラン=110.91円	1 スウェーデンクローネ=12.76円	1 ノルウェークローネ=13.55円
1 デンマーククローネ=17.44円	1 ポーランドズロチ=30.68円	1 オーストラリアドル=81.11円	1 ニューージーランドドル=76.21円
1 香港ドル=13.38円	1 シンガポールドル=79.99円	1 イスラエルシェケル=30.10円	1 南アフリカランド=8.98円

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年3月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	22,124,672,583
コール・ローン等	717,975,702
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	5,541,448,729
TOPIXマザーファンド(評価額)	2,325,798,209
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	2,100,295,230
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	11,271,154,713
未収入金	168,000,000
(B) 負債	192,448,315
未払解約金	86,284,502
未払信託報酬	105,799,883
未払利息	1,255
その他未払費用	362,675
(C) 純資産総額(A-B)	21,932,224,268
元本	21,553,334,995
次期繰越損益金	378,889,273
(D) 受益権総口数	21,553,334,995口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,176円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 16,577,562,068円  
 期中追加設定元本額 32,380,246,241円  
 期中一部解約元本額 27,404,473,314円  
 また、1口当たり純資産額は、期末10,176円です。

## ②分配金の計算過程

項 目	2017年3月28日～ 2018年3月26日
費用控除後の配当等収益額	60,578,474円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	631,392,233円
分配準備積立金額	8,912,610円
当ファンドの分配対象収益額	700,883,317円
1万口当たり収益分配対象額	325円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

## ○損益の状況 (2017年3月28日～2018年3月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 199,017
受取利息	1,859
支払利息	△ 200,876
(B) 有価証券売買損益	35,265,706
売買益	330,237,708
売買損	△294,972,002
(C) 信託報酬等	△194,210,796
(D) 当期損益金(A+B+C)	△159,144,107
(E) 前期繰越損益金	△ 11,312,139
(F) 追加信託差損益金	549,345,519
(配当等相当額)	( 605,332,731)
(売買損益相当額)	(△ 55,987,212)
(G) 計(D+E+F)	378,889,273
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	378,889,273
追加信託差損益金	549,345,519
(配当等相当額)	( 631,392,233)
(売買損益相当額)	(△ 82,046,714)
分配準備積立金	69,491,084
繰越損益金	△239,947,330

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

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

【お知らせ】

- ①投資環境等の変化に応じた資産配分比率の変更に伴う対応を行うため、国内の債券市場が下落した場合等に国内債券の実質組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等の組入れを行うルールについて、先進国債券にも同様のルールを適用するべく、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2017年6月27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)
- ③よりわかりやすい記載を目的として目論見書の特色の分配方針に「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。)」を掲載しました。
- ④2014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17期》決算日2018年3月26日

〔計算期間：2017年3月28日～2018年3月26日〕

「T O P I X マザーファンド」は、3月26日に第17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17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
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
17期(2018年3月26日)	17,551	11.9	1,671.32	9.6	98.1	1.1	275,958

(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。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) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。



## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 株 価 指 数 (TOPIX)	騰 落 率	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	円	騰 落 率				
(期 首) 2017年3月27日	15,678	—	1,524.39	—	98.8	1.0
3月末	15,696	0.1	1,512.60	△ 0.8	98.4	1.8
4月末	15,899	1.4	1,531.80	0.5	100.6	1.5
5月末	16,291	3.9	1,568.37	2.9	98.5	1.7
6月末	16,761	6.9	1,611.90	5.7	99.7	1.1
7月末	16,831	7.4	1,618.61	6.2	99.2	0.7
8月末	16,824	7.3	1,617.41	6.1	99.0	1.0
9月末	17,554	12.0	1,674.75	9.9	100.1	1.6
10月末	18,512	18.1	1,765.96	15.8	98.7	1.3
11月末	18,790	19.8	1,792.08	17.6	99.0	1.1
12月末	19,079	21.7	1,817.56	19.2	99.6	0.5
2018年1月末	19,282	23.0	1,836.71	20.5	99.4	0.7
2月末	18,569	18.4	1,768.24	16.0	99.8	0.6
(期 末) 2018年3月26日	17,551	11.9	1,671.32	9.6	98.1	1.1

(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

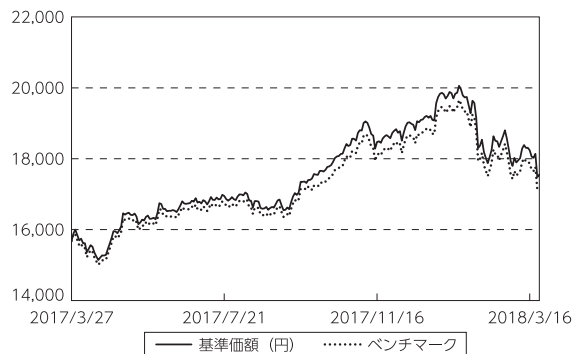
#### ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ11.9%の上昇となりました。

#### ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(9.6%)を2.3%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

- ・期首から2018年1月中旬までは、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や、国内企業の業績改善が進んだこと等を受けて、国内株式市況は上昇しました。
- ・1月下旬から期末までは、米国長期金利上昇による世界的な株安や、円高・米ドル安が進んだこと等を受け、国内株式市況は下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

●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9.6%の上昇となったため、カイ離は2.3%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率 要因	銘柄選択 要因	その他の 要因	合計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	0.0%程度	2.3%程度	2.3%程度

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

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

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.3%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 2.3%程度
マイナス要因	売買コスト等	計 Δ0.0%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5割程度となり、信託財産に若干の収益寄与となりました。

◎今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ○1万口当たりの費用明細

(2017年3月28日～2018年3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 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、17,507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3月28日～2018年3月26日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 96,823 (△31,750)	千円 166,458,794 ( )	千株 127,179	千円 216,340,673

(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 — (127,000)	千円 — (—)	証券 127,000	千円 4,261

(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。

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 75,389	百万円 75,760	百万円 —	百万円 —

○株式売買比率

(2017年3月28日～2018年3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	382,799,467千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	300,118,677千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.27

(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28日～2018年3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 166,458	百万円 65,596	39.4	百万円 216,340	百万円 71,354	33.0
貸付有価証券(株式)	375,394	375,394	100.0	389,765	389,765	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 3,855	百万円 5,447	百万円 5,810

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 559

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	7,072千円
うち利害関係人への支払額 (B)	779千円
(B) / (A)	11.0%

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MUF G証券、日立キャピタルです。

## ○組入資産の明細

(2018年3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 (0.1%)</b>				
極洋	5.8	5	19,300	
日本水産	191.9	143	75,647	
マルハニチロ	28	24.1	78,927	
カネコ種苗	5.1	4.4	6,820	
サカタのタネ	21.8	18.7	65,824	
ホクト	15	12.9	26,070	
ホクリヨウ	1.6	1.8	2,318	
<b>鉱業 (0.3%)</b>				
住石ホールディングス	41	33.2	5,079	
日鉄鉱業	4.1	3.5	21,035	
三井松島産業	9.1	6.4	9,580	
国際石油開発帝石	778.3	617.7	803,010	
日本海洋掘削	5.2	4.4	8,738	
石油資源開発	23.4	20.1	49,405	
K&Oエナジーグループ	9.9	7.5	12,352	
<b>建設業 (3.1%)</b>				
ショーボンドホールディングス	14.3	12	88,920	
ミライト・ホールディングス	45.4	39.1	63,772	
タマホーム	11.1	9.5	11,894	
サンヨーホームズ	3.1	2.2	2,101	
ファーストコーポレーション	2.4	4.2	5,111	
ベステラ	—	1.8	2,975	
インベスターズクラウド	1.4	11.1	23,620	
ダイセキ環境ソリューション	4.1	3	3,141	
第一カッター興業	—	1.3	2,774	
安藤・間	106.2	98.8	77,558	
東急建設	52.4	48.9	55,208	
コムシスホールディングス	57.7	44.7	122,165	
ミサワホーム	17.4	10.6	9,296	
ピーアールホールディングス	14.6	12.6	4,926	
高松コンストラクショングループ	11.1	8.2	24,518	
東建コーポレーション	5.5	4.7	47,705	
ソネック	1.8	1.6	1,211	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ヤマウラ	6.9	5.9	5,622	
大成建設	751	126.5	652,740	
大林組	443.1	380.9	430,417	
清水建設	452	388.6	352,071	
飛鳥建設	142.3	115.5	19,866	
長谷工コーポレーション	172.4	148.2	230,895	
松井建設	16.3	14	10,808	
銭高組	21	1.8	8,469	
鹿島建設	649	558	527,310	
不動テトラ	119.2	96.1	17,778	
大末建設	5.2	4.1	4,182	
鉄建建設	90	7.7	22,407	
西松建設	171	29.4	77,939	
三井住友建設	566.1	91.6	57,158	
大豊建設	54	46	26,910	
前田建設工業	97	90.6	107,814	
佐田建設	10.2	8.2	3,747	
ナカノフドー建設	11.3	9.7	5,839	
奥村組	122	20.9	92,796	
東鉄工業	17.7	15.2	48,868	
イチケン	13	2.3	5,835	
浅沼組	52	45	18,720	
戸田建設	172	148	110,556	
熊谷組	232	19.9	65,471	
青木あすなろ建設	9.7	8.3	8,175	
北野建設	31	26	10,504	
植木組	18	1.6	4,163	
三井ホーム	19	16	10,560	
矢作建設工業	20.1	17.3	13,338	
ピーエス三菱	15.6	15	10,380	
日本ハウスホールディングス	30.1	24.3	13,219	
大東建託	54.4	46	815,350	
新日本建設	17.6	15.1	16,383	
NIPPO	34	29.4	67,884	

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
東亜道路工業	28	2.6	10,361	
前田道路	46	40	84,720	
日本道路	44	3.4	17,578	
東亜建設工業	12	10.3	22,618	
若築建設	85	6.8	11,016	
東洋建設	42.5	39.9	19,191	
五洋建設	163.9	151	111,589	
大林道路	15.3	—	—	
世紀東急工業	21.5	17.1	11,645	
福田組	24	4.1	26,076	
住友林業	101.7	81.2	135,685	
日本基礎技術	16.4	14.1	5,611	
日成ビルド工業	44	18.8	23,274	
ヤマダ・エスバイエルホーム	75	57	5,130	
バコーボレーション	18.4	15.8	8,437	
バナホーム	55	—	—	
大和ハウス工業	436.4	375.2	1,455,025	
ライト工業	28.4	24.4	26,669	
積水ハウス	464.9	413.3	764,398	
日特建設	12.6	10.8	6,696	
北陸電気工事	7.2	7	7,868	
エアテック	23	20	16,260	
西部電気工業	2.5	2.1	5,932	
四電工	11	1.9	4,941	
中電工	18.7	16.4	46,428	
関電工	59	50.6	59,657	
きんでん	98.2	84.5	144,410	
東京エネシス	15	14.4	16,732	
トーエネック	21	3.6	11,052	
住友電設	10.2	10	20,340	
日本電設工業	24.1	19.5	39,390	
協和エクシオ	57.9	45.6	120,840	
新日本空調	11.4	9.8	15,601	
NDS	2.3	2	8,640	
九電工	28.7	25	118,125	
三機工業	32.7	26.9	30,746	
日揮	137.9	109.4	244,399	
中外炉工業	45	3.8	11,042	
ヤマト	13.2	10.4	7,560	

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
太平電業	20	8.6	22,385	
高砂熟学工業	40.7	35	65,135	
三晃金属工業	1.3	1.4	5,509	
朝日工業社	3.3	2.6	8,827	
明星工業	26.7	23	16,790	
大気社	19.6	16.8	56,532	
ダイダシ	20	8.5	18,470	
日比谷総合設備	16.5	14.2	27,150	
東芝プラントシステム	24	27.5	63,470	
OSJBホールディングス	45.1	56.1	15,651	
東洋エンジニアリング	87	14.9	14,825	
千代田化工建設	107	82.5	80,685	
新興プランテック	30.3	24.5	23,887	
<b>食料品 (4.4%)</b>				
日本製粉	43.9	37.8	61,009	
日清製粉グループ本社	162	139.3	282,082	
日東富士製粉	1	0.8	3,824	
昭和産業	61	10.4	28,880	
鳥越製粉	11.7	10.1	9,574	
中部飼料	16.2	13.9	28,731	
フィード・ワン	88.9	76.4	16,196	
東洋精糖	22	1.9	2,304	
日本甜菜製糖	7.5	6.5	15,086	
三井製糖	10.4	9	37,215	
塩水港精糖	15.8	13.6	3,644	
日新製糖	6.3	5.4	11,280	
森永製菓	28.8	26.7	122,419	
中村屋	3.4	2.9	13,731	
江崎グリコ	37	31.8	176,172	
名糖産業	6.4	5.5	8,761	
井村屋グループ	—	4.5	16,875	
不二家	84	7.3	18,155	
山崎製パン	108.2	93	204,600	
第一屋製パン	23	2	2,270	
モロゾフ	23	1.9	11,932	
亀田製菓	8.2	7.1	35,855	
寿スピリッツ	10.5	11	59,180	
カルビー	60.3	51.8	190,106	
森永乳業	133	22.8	96,672	

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
六甲バター	6.6	5.7	12,272	
ヤクルト本社	79.2	68.1	531,180	
明治ホールディングス	87.5	75.2	597,840	
雪印メグミルク	31.9	27.4	76,829	
ブリマハム	93	80	47,520	
日本ハム	100	98	213,934	
林兼産業	4.7	4.1	3,263	
丸大食品	71	61	30,805	
S Foods	7.9	8	33,720	
伊藤ハム米久ホールディングス	85.2	73.3	68,169	
サッポロホールディングス	48.4	41.6	123,884	
アサヒグループホールディングス	277.2	238.3	1,298,735	
キリンホールディングス	636.1	546.9	1,526,944	
宝ホールディングス	106.9	85.2	99,854	
オエノンホールディングス	38	32.3	14,567	
養命酒製造	4.6	3.5	8,242	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	50	79.9	332,384	
コカ・コーライーストジャパン	57.5	—	—	
サントリー食品インターナショナル	101.2	87	439,350	
ダイドールグループホールディングス	6.8	5.8	38,164	
伊藤園	43.8	37.7	153,439	
キーコーヒー	13	11.2	23,956	
ユニカフェ	4	3.4	3,529	
ジャパンフーズ	1.9	1.6	2,457	
日清オイリオグループ	85	13.4	39,128	
不二製油グループ本社	39.4	30.8	98,406	
かどや製油	1.4	1.2	7,752	
J-オイルミルズ	6.9	5.9	21,358	
キッコーマン	103	88.9	365,823	
味の素	304.3	261.7	497,360	
キュービー	75.2	63.4	178,217	
ハウス食品グループ本社	54.7	43.4	148,428	
カゴメ	53	45.6	163,476	
焼津水産化学工業	6.9	5.5	6,875	
アリアケジャパン	12.1	10.4	85,384	
ピエトロ	1.7	1.5	2,512	
エバラ食品工業	3.5	2.5	5,447	
ニチレイ	72.7	54.2	147,532	
東洋水産	72.6	62.4	255,528	

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
イトアアンド	1.6	3.1	6,475	
大冷	1.1	1.3	2,718	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	—	1.7	2,271	
日清食品ホールディングス	57.7	49.6	357,616	
永谷園ホールディングス	14	12	17,532	
一正蒲鉾	5.1	4.4	5,227	
フジッコ	14.3	12.3	29,114	
ロック・フィールド	14.3	12.3	25,817	
日本たばこ産業	818.8	704	2,048,288	
ケンコーマヨネーズ	6	7.5	24,862	
わらべや日洋ホールディングス	8.7	7.4	18,278	
なとり	7.4	6.3	12,291	
イフジ産業	—	2	1,560	
ピックスコーポレーション	—	1.7	2,992	
北の達人コーポレーション	3.2	32.8	23,550	
ユウグレナ	47.6	43.9	42,890	
ミヨシ油脂	51	4.4	5,904	
理研ビタミン	4.4	4.3	17,565	
<b>繊維製品 (0.7%)</b>				
片倉工業	17.3	13.6	18,468	
グンゼ	103	8.9	52,243	
東洋紡	547	43.9	91,751	
ユニチカ	378	34.6	21,901	
富士紡ホールディングス	6.7	6.6	24,915	
倉敷紡績	139	120	39,240	
シキボウ	74	6	7,740	
日本毛織	38.9	33.5	34,572	
ダイトボウ	18	18	1,944	
トーア紡コーポレーション	5.9	5	2,810	
ダイドーリミテッド	15.4	13.3	6,211	
帝国繊維	14.4	12.4	25,370	
帝人	112.9	97.5	193,732	
東レ	1,002	861.4	853,561	
サカイオーベックス	3.4	3	7,146	
住江織物	38	3	8,142	
日本フェルト	7.9	6.3	3,301	
イチカワ	9	8	2,784	
日東製網	1.5	1.3	2,281	
アツギ	113	7.9	9,503	



銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ダイニック	26	4.5	4,666	
セーレン	34.4	27.3	49,604	
ソトー	5.1	4.4	4,677	
東海染工	19	1.7	2,454	
小松精練	19.4	18.2	20,147	
ワコールホールディングス	82	32.8	101,352	
ホギメディカル	8.7	7.5	62,250	
レナウン	37.3	32.1	5,168	
クラウディアホールディングス	3.2	2.7	1,471	
T S I ホールディングス	56.9	41	30,135	
マツオカコーポレーション	—	2.1	6,285	
三陽商会	72	6.2	14,253	
ナイガイ	50	4.3	2,425	
オンワードホールディングス	89	70.9	63,597	
ルックホールディングス	25	20	6,020	
キムラタン	583	54.2	2,384	
ゴールドウイン	5.9	3.4	38,692	
デサント	31.5	27.1	43,576	
キング	6.8	5.9	3,616	
ヤマトインターナショナル	8.5	7.9	5,119	
<b>パルプ・紙 (0.3%)</b>				
特種東海製紙	8	6.5	26,552	
王子ホールディングス	540	500	337,000	
日本製紙	61.9	53.2	105,336	
三菱製紙	19.6	16.9	10,849	
北越紀州製紙	77.1	66.3	44,288	
中越パルプ工業	55	4.7	8,535	
巴川製紙所	21	18	4,914	
大王製紙	55	47.3	69,531	
阿波製紙	2.5	2.9	1,696	
レンゴー	133.2	114.5	105,111	
トーモク	44	6.8	14,164	
ザ・バック	9.8	8.4	31,962	
<b>化学 (7.2%)</b>				
クラレ	232.4	199.8	342,057	
旭化成	861	740.5	1,023,741	
共和レザー	8	6.9	6,506	
昭和電工	91.9	79	334,170	
住友化学	1,017	874	514,786	

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
住友精化	5.7	4.9	24,010	
日産化学工業	75.7	69.1	288,147	
ラサ工業	52	4.2	8,568	
クレハ	10.4	10.2	68,748	
多木化学	9	1.6	6,488	
テイカ	21	9.1	24,679	
石原産業	24.8	21.3	27,264	
片倉コープアグリ	19	2.9	3,630	
日東エフシー	8.1	6.9	4,954	
日本曹達	83	82	48,134	
東ソー	399	171.6	350,578	
トクヤマ	215	34.5	107,640	
セントラル硝子	141	24.2	56,797	
東亜合成	86.5	69.7	84,824	
大阪ソーダ	59	10.8	29,160	
関東電化工業	28	28.4	30,530	
デンカ	286	43.6	153,908	
信越化学工業	247.7	197.7	2,117,367	
日本カーバイド工業	47	3.7	7,448	
堺化学工業	52	8.1	21,740	
エア・ウォーター	113.9	97.9	191,198	
大陽日酸	106.4	91.5	140,178	
日本化学工業	51	4.4	14,234	
東邦アセチレン	—	1.7	2,373	
日本パーカライジング	70.6	60.7	105,375	
高圧ガス工業	20.5	17.6	14,960	
チタン工業	16	1.3	3,213	
四国化成工業	20	17.1	25,051	
戸田工業	27	2.4	9,084	
ステラ ケミファ	6.6	6	19,260	
保土谷化学工業	4.8	3.8	17,309	
日本触媒	21.7	18.7	132,770	
大日精化工業	57	9.2	38,548	
カネカ	186	160	158,720	
三菱瓦斯化学	128.7	97.9	241,617	
三井化学	628	107.9	352,293	
J S R	138.8	119.4	277,246	
東京応化工業	25.8	20.6	75,293	
大阪有機化学工業	8.9	7.7	10,402	

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三菱ケミカルホールディングス	930.4	795.3	781,541
KHネオケム	16.9	18.2	52,652
ダイセル	186.2	160.1	181,713
住友ベークライト	122	96	86,112
積水化学工業	313.5	246.6	454,730
日本ゼオン	116	100.1	148,848
アイカ工業	44.3	33.3	126,540
宇部興産	696	59.8	182,390
積水樹脂	21.3	18.3	40,827
タキロンシーアイ	29	24	16,440
旭有機材	45	7	12,040
日立化成	76.8	58.7	137,886
ニチバン	14	5.8	18,763
リケンテクノス	29.8	25.6	12,672
大倉工業	33	28	15,288
積水化成成品工業	19.6	14.9	16,896
群栄化学工業	3.3	2.9	9,947
タイガースポリマー	6.8	5.8	4,848
ミライアル	5	3.9	5,935
ダイキアクシス	2.3	3.9	6,146
ダイキョーニシカワ	24.2	23.4	38,563
竹本容器	—	1.3	3,126
森六ホールディングス	—	4.5	13,360
日本化薬	90	77.1	99,073
カーリットホールディングス	12.8	11	11,605
日本精化	11.4	9.8	11,593
扶桑化学工業	9.8	8.4	22,344
トリケミカル研究所	—	2.1	9,639
ADEKA	59.4	51.1	92,082
日油	107	45.9	138,847
新日本理化	21.8	18.7	4,450
ハリマ化成グループ	11.7	9.2	7,378
花王	350.8	278.8	2,079,290
第一工業製薬	31	23	16,928
日華化学	4.4	3.7	4,414
ニイタカ	2	1.7	2,981
三洋化成工業	8.7	7.5	36,337
有機合成薬品工業	9	7.7	2,279
大日本塗料	79	13.6	20,141

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本ペイントホールディングス	106.6	91.6	342,126
関西ペイント	145.1	124.7	306,512
神東塗料	10	8.7	2,122
中国塗料	39.6	34	35,734
日本特殊塗料	9.7	7.5	14,700
藤倉化成	18.8	15	9,750
太陽ホールディングス	11.2	9.1	40,586
D I C	54.5	46.9	162,274
サカタインクス	28.2	24.2	35,719
東洋インキＳＣホールディングス	136	117	73,593
T&K TOKA	10	7.9	10,025
富士フイルムホールディングス	273.9	235.5	970,731
資生堂	262	211.2	1,335,206
ライオン	171	157.9	328,274
高砂香料工業	9.1	7.1	21,868
マンダム	13.8	22.1	77,681
ミルボン	7.5	15.2	67,716
ファンケル	29.4	27.5	98,037
コーセー	22.3	19.2	385,728
コタ	5.2	4.9	9,280
シーズ・ホールディングス	17.9	15.4	76,923
シーボン	1.6	1.4	4,585
ポーラ・オルビスホールディングス	14.1	48.4	206,668
ノエビアホールディングス	8.7	7.2	52,632
アジupanコスメジャパン	2.6	2.5	2,547
エステー	9.4	8.1	17,406
アグロ カネショウ	5.4	4.6	10,304
コニシ	21.7	18.6	30,931
長谷川香料	17.5	15	29,580
星光PMC	7.6	6.5	6,727
小林製薬	38.3	31.8	223,554
荒川化学工業	11.8	10.2	18,543
メック	10.7	7.8	13,306
日本高純度化学	3.9	3.1	7,883
タカラバイオ	29.6	29.7	60,439
J C U	4.3	7	32,760
新田ゼラチン	8.3	7.8	6,084
O A Tアグリオ	1.6	1.8	6,030
デクセラアルズ	36.2	29.1	30,846

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
アース製薬	9.9	8.5	46,070	
イハラケミカル工業	19.1	—	—	
北興化学工業	14	11.6	7,957	
大成ラミック	4.3	3.5	11,095	
クミアイ化学工業	28.5	51.6	30,547	
日本農薬	31.5	29.6	17,700	
アキレス	11.3	8.6	18,266	
有沢製作所	23.3	19	17,423	
日東電工	99.6	85.6	664,512	
レック	4.3	6.7	23,718	
きもと	24.7	19.3	5,809	
藤森工業	10.3	9.5	34,057	
前澤化成工業	9	7.8	8,892	
J S P	6.4	6.6	20,988	
エフピコ	12.2	9.4	61,758	
天馬	9.1	8.8	18,224	
信越ポリマー	27.1	23.3	25,373	
東リ	32.8	28.2	10,405	
ニフコ	24.2	20.8	148,928	
日本バルカー工業	10.7	9.2	26,634	
ユニ・チャーム	279.6	240.4	718,796	
<b>医薬品 (4.8%)</b>				
協和発酵キリン	165.2	142	308,282	
武田薬品工業	517.7	417.6	2,317,680	
アステラス製薬	1,410.8	1,165.1	1,852,509	
大日本住友製薬	97.7	84	141,288	
塩野義製薬	175.2	162.2	868,905	
田辺三菱製薬	160.9	138.3	303,706	
わかもと製薬	16	13	3,692	
あすか製薬	15	12.9	21,607	
日本新薬	31.6	29.7	213,543	
バイオフェルミン製薬	2.2	1.9	5,314	
中外製薬	137.5	118.2	627,642	
科研製薬	25.8	20.5	124,435	
エーザイ	170	135.7	907,290	
ロート製薬	67.6	62.3	174,190	
小野薬品工業	313.6	267.7	851,553	
久光製薬	39	33.5	258,620	
持田製薬	9.4	7.9	56,169	

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
参天製薬	249.4	214.7	356,402	
扶桑薬品工業	4.6	4	11,168	
日本ケミファ	1.9	1.5	6,990	
ツムラ	46.4	40.5	144,787	
日医工	32.3	29.9	47,361	
キッセイ薬品工業	24.5	21	57,015	
生化学工業	25.6	22	41,910	
栄研化学	11.6	9.2	47,104	
日水製薬	5.5	4.8	6,628	
鳥居薬品	9.4	7.1	19,170	
J C R ファーマ	10.6	8	40,320	
東和薬品	6.3	5.4	35,640	
富士製薬工業	4.5	3.9	17,199	
沢井製薬	23.4	22.8	105,678	
ゼリア新薬工業	28.3	24.3	49,061	
第一三共	406.4	324.4	1,142,212	
キョーリン製薬ホールディングス	33.8	31.7	63,178	
大幸薬品	6.9	6	12,102	
ダイト	8.2	6.6	23,760	
大塚ホールディングス	296.9	235.6	1,208,156	
大正製薬ホールディングス	29.5	25.4	260,858	
ペプチドリーム	25.8	51.8	271,950	
<b>石油・石炭製品 (0.7%)</b>				
日本コークス工業	111.4	95.8	10,442	
昭和シェル石油	123.4	106.1	145,993	
ニチレキ	16.9	14.5	17,313	
東燃ゼネラル石油	225	—	—	
ユシロ化学工業	7.4	6.4	10,995	
ビービー・カストロール	5.6	4.9	7,663	
富士石油	32	27.5	11,082	
MORESCO	4.7	4.1	6,965	
出光興産	65.5	95.2	368,424	
J X T G ホールディングス	1,532.4	1,809.3	1,137,325	
コスモエネルギーホールディングス	41.6	32.8	110,044	
<b>ゴム製品 (0.9%)</b>				
横浜ゴム	83.3	65.6	154,488	
東洋ゴム工業	72.9	67.1	116,485	
ブリヂストン	466	375.3	1,685,097	
住友ゴム工業	129.2	116.7	218,812	

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
藤倉ゴム工業	11.5	9.9	7,128	
オカモト	42	39	40,638	
フコク	5.8	5	4,995	
ニッタ	12.4	11.7	44,226	
住友理工	25.6	22	22,396	
三ツ星ベルト	34	28	31,500	
バンドー化学	25.1	21.6	25,185	
<b>ガラス・土石製品 (0.9%)</b>				
日東紡績	112	16.9	38,041	
旭硝子	680	115.9	479,246	
日本板硝子	62.9	57.3	45,954	
石塚硝子	19	1.5	3,681	
日本山村硝子	55	47	8,742	
日本電気硝子	285	49	147,000	
オハラ	5.2	4.5	10,930	
住友大阪セメント	256	220	99,440	
太平洋セメント	833	71.6	264,204	
日本ヒューム	13.2	11.4	8,698	
日本コンクリート工業	30.7	24.4	10,321	
三谷セキサン	6.9	5.9	14,785	
アジアバイルホールディングス	17	14.6	8,833	
東海カーボン	128.9	102.9	155,276	
日本カーボン	68	5.8	29,406	
東洋炭素	7.6	7.4	23,532	
ノリタケカンパニーリミテド	7.8	6.7	30,887	
TOTO	101.4	87.2	462,160	
日本碍子	174.3	138.4	248,704	
日本特殊陶業	119	97.3	238,385	
ダントーホールディングス	11	8	1,176	
MARUWA	5.1	3.9	31,863	
品川リフラクトリーズ	35	3	8,319	
黒崎播磨	30	2.2	11,242	
ヨータイ	8	6.8	5,276	
イソライト工業	6.8	5.8	4,593	
東京窯業	16.8	14.4	5,817	
ニッカトー	4.5	3.8	3,644	
フジミインコーポレーテッド	11.7	10.1	22,624	
ユーアンドユーマテリアル	29	2.5	3,062	
ニチアス	72	62	79,236	

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
ニチハ	18.3	17.1	65,664	
<b>鉄鋼 (1.1%)</b>				
新日鐵住金	622.5	501.7	1,138,357	
神戸製鋼所	238.7	205.2	206,226	
中山製鋼所	15.5	15.5	10,757	
合同製鐵	7.7	6	12,264	
ジェイ エフ イー ホールディングス	377.3	302.8	638,302	
日新製鋼	63	30.9	38,408	
東京製鐵	69.8	60	49,200	
共英製鋼	14.7	12.6	22,705	
大和工業	27.7	23.8	67,020	
東京鐵鋼	29	4.6	7,038	
大阪製鐵	8.7	7.4	15,369	
淀川製鋼所	19.1	16.4	45,116	
東洋鋼板	33	28	19,964	
丸一鋼管	46.2	39.7	124,658	
モリ工業	4.4	3.7	11,581	
大同特殊鋼	231	19.9	105,669	
日本高周波鋼業	48	4.1	3,107	
日本冶金工業	114.2	92.7	26,512	
山陽特殊製鋼	82	12.9	34,043	
愛知製鋼	8.1	6.3	26,995	
日立金属	140.5	120.8	147,617	
日本金属	3.3	2.8	6,437	
大太平洋金属	88	6.9	20,099	
新日本電工	78.1	67.1	21,337	
栗本鐵工所	6.6	5.7	11,223	
虹技	19	1.7	3,296	
日本鑄鉄管	13	12	1,920	
三菱製鋼	96	8.3	19,505	
日亜鋼業	19.1	16.4	5,559	
日本精練	9	1.8	8,658	
シンニッタン	11.3	8.7	7,577	
新家工業	30	2.6	5,340	
<b>非鉄金属 (0.9%)</b>				
大紀アルミニウム工業所	23	18.4	13,266	
日本軽金属ホールディングス	355.3	327.3	88,043	
三井金属鉱業	375	30.3	138,016	
東邦亜鉛	78	6.2	29,946	

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
三菱マテリアル	86.1	74.1	233,044	
住友金属鉱山	357	143.3	624,358	
DOWAホールディングス	152	28.4	105,790	
古河機械金属	215	18.5	36,241	
エス・サイエンス	62.7	53.1	3,876	
大阪チタニウムテクノロジーズ	15.1	11.7	23,645	
東邦チタニウム	23.3	20.1	22,210	
UACJ	178	17	45,203	
古河電気工業	46.3	37.3	207,388	
住友電気工業	520	419.2	663,384	
フジクラ	181.7	135.4	95,050	
昭和電線ホールディングス	164	14.1	12,873	
東京特殊電線	2	1.4	4,683	
タツタ電線	25.8	22.2	14,230	
沖電線	14	—	—	
カナレ電気	1.9	1.9	4,001	
平河ヒューテック	6.5	5.6	7,229	
リョービ	84	13.8	36,818	
アーレスティ	16	13.7	12,467	
アサヒホールディングス	20.8	19.2	37,017	
<b>金属製品 (0.7%)</b>				
稲葉製作所	7.3	6.3	8,070	
宮地エンジニアリンググループ	40	3.2	6,336	
トーカロ	9.1	31.1	39,621	
アルファCo	4.6	3.9	6,684	
SUMCO	144.1	103.2	299,486	
川田テクノロジーズ	2.6	2.3	11,914	
RS Technologies	0.5	1.6	10,768	
東洋製罐グループホールディングス	98.1	76.7	117,811	
ホッカンホールディングス	36	28	10,416	
コロナ	7.2	6.2	7,874	
横河ブリッジホールディングス	24.2	20.8	45,864	
駒井ハルテック	2.6	2.5	6,220	
高田機工	12	1	3,460	
三和ホールディングス	137	107.5	142,222	
文化シャッター	38.4	33	33,363	
三協立山	18.1	15.5	22,940	
アルインコ	9.5	8.1	8,650	
東洋シャッター	3.4	2.9	1,792	

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
LIXILグループ	192.2	165.3	384,983	
日本フィルコン	10	8.6	5,478	
ノーリツ	27	25	45,450	
長府製作所	14.7	12.7	31,572	
リンナイ	23.5	20	197,200	
ダイニチ工業	7	6	5,196	
日東精工	19.6	15.5	10,881	
三洋工業	17	1.4	2,877	
岡部	28.6	22.7	21,020	
ジーテクト	14.4	12.4	25,407	
中国工業	2	1.7	1,188	
東ブレ	26.5	20.9	62,428	
高周波熱錬	25.6	21.6	23,220	
東京製綱	9.3	8	17,280	
サンコール	7.3	6.3	4,460	
モリテック スチール	6.9	6.6	5,075	
パイオラックス	7	16.6	44,869	
エイチワン	—	8.2	11,398	
日本発條	129.9	111.7	121,976	
中央発條	16	1.3	4,426	
アドパネクス	2.4	1.8	7,857	
立川ブラインド工業	5.7	4.9	7,168	
三益半導体工業	11.6	8.7	15,964	
<b>機械 (5.4%)</b>				
日本ドライケミカル	1.8	1.5	3,571	
日本製鋼所	45.6	36.6	119,865	
三浦工業	56.4	48.5	154,715	
タクマ	44.2	38	43,320	
ツガミ	37	30	39,270	
オークマ	90	13.1	77,945	
東芝機械	82	63	45,234	
アマダホールディングス	185.8	173	216,769	
アイダエンジニアリング	39.2	28.5	36,166	
滝澤鉄工所	40	3.5	6,727	
富士機械製造	42.1	33.6	66,931	
牧野フライス製作所	69	57	55,347	
オーエスジー	62.9	51.7	120,667	
ダイジェット工業	16	1.4	2,793	
旭ダイヤモンド工業	39.5	33.3	36,097	

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
DMG森精機	81.6	62.1	117,306	
ソディック	35	24.5	33,050	
ディスコ	16.1	15.2	343,824	
日東工器	8	6.9	20,631	
日進工具	—	3	8,967	
パンチ工業	5	9.3	10,350	
富士ダイス	—	4.2	4,246	
豊和工業	7.7	6.2	7,539	
OKK	50	4.3	4,618	
石川製作所	3.4	2.9	6,235	
東洋機械金属	9.3	8.7	7,160	
津田駒工業	31	26	5,824	
エンシュウ	34	29	4,408	
島精機製作所	18	14.2	100,252	
オプトラン	—	8.2	24,600	
NCホールディングス	4.5	3.6	2,692	
ブリュー	8.1	8	8,120	
ヤマシンフィルタ	2.7	16.7	21,125	
日阪製作所	18.8	16.1	16,261	
やまびこ	25.3	21.7	29,468	
平田機工	—	3.1	29,202	
ベガサスミシン製造	13.2	10.5	7,255	
ナプテスコ	71.7	61.7	246,183	
三井海洋開発	13.9	11.9	31,308	
レオン自動車	11.6	10	20,310	
SMC	41.4	35.6	1,515,136	
新川	11.5	9.2	10,432	
ホソカワミクロン	23	4.2	30,072	
ユニオンツール	6	5.1	18,564	
オイレス工業	17.8	14.5	32,030	
日精エー・エス・ビー機械	4.4	3.8	27,208	
サトーホールディングス	17.2	14.8	48,544	
技研製作所	—	5.7	16,564	
日本エアージェット	4.5	3.8	3,226	
日精樹脂工業	10.9	9.4	13,526	
オカダアイヨン	2.9	3.3	4,428	
ワイエイシイホールディングス	5.1	3.8	3,651	
小松製作所	636.7	547.4	1,858,423	
住友重機械工業	403	64.9	250,514	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日立建機	61.6	53	211,470	
日工	4.1	3.1	7,167	
巴工業	5.6	4.8	9,628	
井関農機	141	11.3	23,018	
TOWA	11.3	8.8	12,135	
丸山製作所	29	2.5	4,530	
北川鉄工所	6.3	5.4	14,520	
ローツェ	4.9	5.6	12,863	
タカキタ	4.6	3.9	2,784	
クボタ	660.5	608.1	1,077,857	
荏原実業	3.8	3.3	6,999	
三菱化工機	45	3.9	8,408	
月島機械	26.2	22.5	32,917	
帝国電機製作所	10	7.9	12,324	
東京機械製作所	52	4.4	2,332	
新東工業	31.3	26.9	29,132	
澁谷工業	11.5	9.9	35,046	
アイチ コーポレーション	19.5	19.6	13,857	
小森コーポレーション	33.2	28.5	37,762	
鶴見製作所	10.3	9.6	18,969	
住友精密工業	22	19	7,144	
酒井重工業	26	2.1	10,300	
荏原製作所	62.5	46.6	167,527	
石井鐵工所	2	1.7	3,218	
西島製作所	13.5	11.6	11,112	
北越工業	14.8	12.7	14,630	
ダイキン工業	180	154.8	1,780,200	
オルガノ	26	4.1	12,894	
トーヨーカネツ	63	4.8	14,640	
栗田工業	78.1	61.4	203,234	
椿本チエイン	78	67	55,744	
大同工業	27	4.3	5,908	
木村化工機	11.8	9.4	4,549	
アネスト岩田	23.9	19.1	21,201	
ダイフク	65.8	57.7	345,623	
サムコ	3.3	3.1	3,909	
加藤製作所	7.2	5.4	12,830	
油研工業	26	2.2	6,140	
タダノ	68.9	54.7	83,964	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
フジテック	38.4	36.3	50,638	
CKD	39.5	31.5	70,938	
キトー	16.6	8.6	16,013	
平和	40.9	35.1	76,096	
理想科学工業	13.1	11.3	22,148	
SANKYO	36.7	28.4	108,346	
日本金銭機械	12.1	10.4	11,117	
マースエンジニアリング	7.4	7.2	17,546	
福島工業	8.1	7	30,870	
オーイズミ	5.5	4.8	2,428	
ダイコク電機	5.4	5.2	8,746	
竹内製作所	24.1	19	40,869	
アマノ	40.8	35.1	94,383	
JUKI	20.8	16.8	23,133	
サンデンホールディングス	80	13.8	20,217	
蛇の目ミシン工業	12.8	10.3	7,127	
マックス	20	17.4	23,524	
グローリー	42.1	33.8	122,863	
新晃工業	9.2	11.5	19,630	
大和冷機工業	21.2	18.2	22,604	
セガサミーホールディングス	130.8	112.4	187,370	
日本ビストンリング	5.1	4.1	9,204	
リケン	6.1	5.2	30,108	
TPR	14.8	12.7	36,068	
ツバキ・ナカシマ	14.8	11.4	30,130	
ホシザキ	28.9	35.7	334,509	
大豊工業	10.7	9.2	13,984	
日本精工	270.8	232.8	319,867	
NTN	305	262.4	114,668	
ジェイテクト	140.5	120.8	182,528	
不二越	133	105	63,525	
日本トムソン	42.1	36.2	29,611	
THK	93.2	70.7	308,605	
ユーシン精機	5.8	5	16,775	
前澤給装工業	5	4.4	8,461	
イーグル工業	14.3	14	25,004	
前澤工業	8.8	8.3	3,212	
日本ピラー工業	13.3	11.5	18,308	
キッツ	63.3	50.5	44,137	

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
日立工機	34.9	—	—	
マキタ	86	147.8	735,305	
日立造船	104.5	89.9	47,736	
三菱重工業	2,210	190	753,350	
I H I	1,013	87.1	279,155	
スター精密	23.1	18.2	35,162	
<b>電気機器 (13.9%)</b>				
日清紡ホールディングス	73.2	69.2	96,672	
イビデン	92.3	69.4	109,929	
コニカミノルタ	308.7	265.4	240,717	
ブラザー工業	170.4	138.4	330,637	
ミネベアミツミ	239.9	210.5	468,573	
日立製作所	3,166	2,722	2,058,104	
東芝	2,949	—	—	
三菱電機	1,406.5	1,133.7	1,883,075	
富士電機	397	342	239,742	
東洋電機製造	5.6	4.5	7,542	
安川電機	152.9	131.4	612,324	
シンフォニアテクノロジー	85	73	25,623	
明電舎	121	96	37,440	
オリジン電気	19	3.3	5,530	
山洋電気	35	5.5	43,065	
デンヨー	12.2	10.5	19,908	
東芝テック	83	81	50,301	
芝浦メカトロニクス	21	16	7,168	
マブチモーター	37.2	31.6	160,528	
日本電産	170.9	136.4	2,163,304	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1.5	4.1	9,979	
東光高岳	6.7	5.7	9,359	
ダブル・スコープ	12.7	16.5	22,968	
宮越ホールディングス	4.5	4.2	3,465	
ダイヘン	72	62	48,236	
田淵電機	19.9	15.7	4,176	
ヤーマン	1.7	16.4	35,424	
JVCケンウッド	96.7	83.2	28,870	
ミマキエンジニアリング	11.8	10.1	7,696	
第一精工	6.2	5.3	11,416	
日新電機	26.5	26.6	26,919	
大崎電気工業	26	24.3	18,176	

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
オムロン	140.1	120.5	738,665	
日東工業	19.4	18.2	28,883	
I D E C	17.2	14	35,266	
不二電機工業	1.4	1.2	1,611	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	254	204	113,832	
サクサホールディングス	33	2.9	6,011	
メルコホールディングス	7.3	5.5	19,167	
テクノメディカ	3	2.8	5,560	
日本電気	1,813	146.7	446,701	
富士通	1,271	1,166	727,001	
沖電気工業	57.1	46	63,664	
岩崎通信機	58	5	3,665	
電気興業	37	6.4	19,296	
サンケン電気	77	66	50,556	
ナカヨ	14	2.2	4,197	
アイホン	7.5	6.4	11,225	
ルネサスエレクトロニクス	68.3	58.7	62,574	
セイコーエプソン	196.3	168.8	313,461	
ワコム	102.3	87.9	43,686	
アルバック	22.2	26.1	147,726	
アクセル	5.5	4.7	4,399	
E I Z O	13	10.4	50,856	
ジャパンディスプレイ	246.2	232.9	45,648	
日本信号	36.4	31.3	29,922	
京三製作所	31	27	17,361	
能美防災	14.9	15	32,925	
ホーチキ	9.6	8.2	15,284	
エレコム	11.4	9.9	23,443	
日本無線	8.1	—	—	
パナソニック	1,514.256	1,295.1	2,033,954	
シャープ	—	78.9	254,847	
アンリツ	96.1	82.6	104,241	
富士通ゼネラル	45	34.6	64,702	
日立国際電気	34.5	—	—	
ソニー	931	757.4	3,846,834	
T D K	74.3	59.3	550,304	
帝国通信工業	29	5	6,415	
タムラ製作所	51	43.7	32,425	
アルプス電気	121.7	97.7	250,600	

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
池上通信機	42	36	5,724	
バイオニア	198.1	188.9	32,301	
日本電波工業	12.7	10.2	6,364	
鈴木	5.1	4.8	5,112	
日本トリム	3.2	2.4	12,648	
ローランド ディー. ジー.	6.7	5.8	13,566	
フォスター電機	15.4	13.3	34,367	
クラリオン	69	60	18,360	
SMK	34	29	12,122	
ヨコオ	9.4	7.3	14,454	
ティアック	95	81	3,564	
ホシデン	40	28.6	37,408	
ヒロセ電機	21.3	18.3	272,487	
日本航空電子工業	38	29	43,616	
T O A	15.6	12.2	16,177	
マクセルホールディングス	19.7	22.5	45,202	
古野電気	17	13.5	9,355	
ユニデンホールディングス	39	31	8,122	
アルパイン	31.4	27	54,108	
スミダコーポレーション	10.8	11.6	15,694	
アイコム	7.3	6.3	16,915	
リオン	5	4.8	13,041	
本多通信工業	4.2	8.8	8,659	
船井電機	14.8	11.4	8,721	
横河電機	143	113.5	231,653	
新元元工業	51	4	27,520	
アズビル	40	34	164,900	
東亜ディーケーケー	6.5	5.6	7,100	
日本光電工業	55.1	47.4	136,701	
チノー	4.7	3.9	5,635	
共和電業	14.9	12.8	5,196	
日本電子材料	5.2	4.5	3,550	
堀場製作所	26.1	22.5	175,725	
アドバンテスト	89.9	63.2	141,252	
小野測器	6.4	4.8	3,945	
エスベック	11.7	10	24,020	
キーエンス	59.7	55.6	3,531,712	
日置電機	6.9	5.9	19,027	
シスメックス	102.5	88.2	799,092	



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
日本マイクロニクス	24.6	19.7	19,640	
メガチップス	12.3	8.9	31,506	
OBARA GROUP	7.7	6.6	40,788	
澤藤電機	8	1.2	2,377	
コーセル	18.3	15.7	22,199	
イリゾ電子工業	4.2	9.5	57,855	
新日本無線	11.2	6.9	5,595	
オブテックスグループ	10	9.2	46,460	
千代田インテグレ	6.9	5.5	12,886	
アイ・オー・データ機器	4.1	4.7	5,193	
レーザーテック	14.5	23.2	86,652	
スタンレー電気	94	86.7	335,095	
岩崎電気	48	4.4	7,370	
ウシオ電機	80	68.8	98,108	
岡谷電機産業	7	6.1	3,580	
ヘリオス テクノ ホールディング	12.1	9.6	8,774	
日本セラミック	10.8	11.5	31,291	
遠藤照明	6.7	5.7	6,013	
古河電池	9	8.1	7,557	
双信電機	6.4	4.9	2,895	
山一電機	12.4	8.2	14,374	
図研	8.6	7.4	11,026	
日本電子	48	41	37,597	
カシオ計算機	106	91.2	142,819	
ファナック	133.7	107.7	2,828,740	
日本シイエムケイ	28.4	20	16,260	
エンプラス	6	5.1	17,416	
大真空	4.8	4.1	5,371	
ローム	63.7	50.9	508,491	
浜松ホトニクス	102.9	82.6	329,987	
三井ハイテック	17.4	14.9	22,230	
新光電気工業	49.8	42.8	32,870	
京セラ	216.4	186.1	1,076,030	
太陽誘電	64.1	50.9	87,548	
村田製作所	138.3	118.9	1,664,005	
ユーシン	17.7	17.1	12,671	
双葉電子工業	21.6	18.5	40,996	
北陸電気工業	53	4.6	6,683	
ニチコン	41.5	35.7	41,804	

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
日本ケミコン	114	9.2	22,218	
KOA	18.2	15.7	33,079	
市光工業	28	16.9	18,066	
小糸製作所	79	67.9	473,942	
ミツバ	24.3	20.9	27,483	
SCREENホールディングス	27	21.5	205,970	
キヤノン電子	12.1	10.4	23,639	
キヤノン	709.8	610.3	2,322,801	
リコー	396.4	340.9	355,558	
MUTOHホールディングス	18	1.5	3,681	
東京エレクトロン	87.9	75.6	1,506,330	
<b>輸送用機器 (8.7%)</b>				
トヨタ紡織	46.1	33	69,663	
芦森工業	30	2.3	4,836	
ユニプレス	25.4	21.9	50,873	
豊田自動織機	120.1	91.8	559,980	
モリタホールディングス	23	18.2	35,690	
三櫻工業	16.7	14.4	10,440	
デンソー	325.1	251.5	1,432,292	
東海理化電機製作所	34.7	29.9	63,388	
三井造船	476	40.9	69,570	
川崎重工業	1,026	88.2	290,178	
名村造船所	39.6	34	19,346	
サノヤスホールディングス	16	13.8	3,394	
日本車輛製造	48	41	12,054	
三菱ロジスネクスト	15.7	13.5	11,691	
近畿車輛	2	1.7	4,052	
日産自動車	1,555.1	1,337.1	1,477,495	
いすゞ自動車	382.1	328.5	515,416	
トヨタ自動車	1,603	1,378.2	9,154,004	
日野自動車	188.2	161.8	217,297	
三菱自動車工業	483.2	419.6	316,798	
エフテック	7	7.2	9,252	
レシップホールディングス	4.3	4.1	3,247	
GMB	2.1	1.8	3,040	
ファルテック	2.3	2	2,746	
武蔵精密工業	15.3	12.1	42,471	
日産車体	57.9	44.3	47,356	
新明和工業	53	49.3	41,757	

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
極東開発工業	26.2	21.1	32,283	
日信工業	29.5	23	40,411	
トビー工業	10.8	9.3	28,272	
ティラド	51	4.1	16,072	
曙ブレーキ工業	61.2	52.7	13,543	
タチエス	22.4	19.2	34,848	
NOK	63.8	60.9	123,444	
フタバ産業	40.2	34.7	29,460	
KYB	148	11.8	56,876	
大同メタル工業	16.6	14.2	16,912	
プレス工業	70	60.2	37,143	
ミクニ	16.7	14.4	9,100	
カルソニックカンセイ	40	—	—	
太平洋工業	27.1	23.7	31,402	
ケーヒン	30.3	26	52,884	
河西工業	17.8	13.9	18,334	
アイシン精機	120.6	93.3	520,614	
富士機工	13.1	—	—	
マツダ	417.5	355.8	493,138	
今仙電機製作所	12.1	10.5	12,306	
本田技研工業	1,186.5	1,020.1	3,557,088	
スズキ	261.3	224.7	1,250,904	
SUBARU	409.4	352	1,225,664	
安永	4.8	5.5	11,874	
ヤマハ発動機	186.2	160.1	478,699	
ショーワ	34.2	29.4	51,067	
TBK	16.9	13.5	6,885	
エクセディ	17.9	13.7	44,319	
豊田合成	42.6	41.2	96,572	
愛三工業	23.1	19.9	21,929	
盟和産業	2	1.7	2,210	
日本プラスト	—	4.6	4,117	
ヨロズ	12.3	11.5	19,607	
エフ・シー・シー	21.6	18.5	51,800	
シマノ	53.1	45.7	674,532	
タカタ	23.8	—	—	
テイ・エス テック	30.6	26.3	105,726	
ジャムコ	7.7	5.7	11,970	

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>精密機器 (1.6%)</b>				
テルモ	202.1	173.8	921,140	
クリエートメディック	4.4	3.7	4,044	
日機装	45.6	39.2	41,983	
島津製作所	169.7	135.5	378,451	
JMS	24	10.4	6,489	
クボテック	2.8	2.4	1,245	
長野計器	10.3	8.9	10,332	
ブイ・テクノロジー	2.7	2.7	81,810	
東京計器	45	7.2	7,992	
愛知時計電機	1.7	1.5	6,322	
インターアクション	—	4.5	4,414	
オーバル	12.9	11.1	3,374	
東京精密	25.5	20.5	85,382	
マニー	17.5	13.8	54,096	
ニコン	229.8	197.5	372,090	
トプコン	66.4	60.9	121,191	
オリンパス	210.4	168.9	676,444	
理研計器	11.6	10.8	23,274	
タムロン	11.7	9.1	19,710	
HOYA	271.3	230.8	1,228,548	
シード	—	1.2	8,064	
ノーリツ鋼機	13.3	11.5	25,978	
エー・アンド・デイ	12	10.3	6,386	
シチズン時計	144.3	135.3	98,633	
リズム時計工業	53	4.3	9,945	
大研医器	11.7	10.1	7,878	
メニコン	9	15.5	40,052	
シンシア	—	0.9	621	
松風	6.9	5.5	7,887	
セイコーホールディングス	93	17.5	43,137	
ニプロ	91.3	78.5	120,419	
<b>その他製品 (2.3%)</b>				
中本パックス	—	2.2	4,556	
スノーピーク	2	3.5	4,462	
パラマウントベッドホールディングス	12.6	12	65,880	
トランザクション	5.8	5.1	5,671	
SHO-BI	4.4	3.8	1,535	
ニホンフラッシュ	6.2	5.3	12,179	

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
前田工織	13.2	11.3	18,577	
永大産業	17	15	8,010	
アートネイチャー	14.1	12.1	8,687	
ダンロップスポーツ	8.3	—	—	
バンダイナムコホールディングス	145.4	117.2	401,410	
アイフィスジャパン	2.9	2.5	1,615	
共立印刷	21.9	18.8	6,617	
SHOEI	5.9	5.1	19,915	
フランスベッドホールディングス	16.5	13.4	12,475	
パイロットコーポレーション	23	19.8	112,266	
萩原工業	3.7	6.3	10,634	
トッパン・フォームズ	23.5	24.3	27,677	
フジシールインターナショナル	29.6	25.4	93,980	
タカラトミー	51.2	47.4	49,817	
廣済堂	13.3	10.5	5,890	
Asmeエステール	3.5	3.3	3,372	
アーク	55.5	47.7	5,724	
タカノ	5.8	5	4,465	
プロネクサス	12.3	10.6	13,356	
ホクシン	9.3	8	1,464	
ウッドワン	22	3.8	5,415	
大建工業	9.3	8.9	21,796	
凸版印刷	372	320	274,560	
大日本印刷	380	148.4	323,066	
図書印刷	18	7.6	7,577	
共同印刷	41	3.5	10,972	
NISSHA	22.1	23.3	61,465	
光村印刷	12	1	2,425	
宝印刷	6.9	5.9	10,779	
アシックス	131	112.6	210,336	
ツツミ	4.9	3.5	7,245	
小松ウオール工業	4.5	3.8	10,267	
ヤマハ	88.8	76.4	343,418	
河合楽器製作所	5.2	3.8	13,148	
クリナップ	15.5	10.5	8,274	
ビジョン	79.7	68.5	303,112	
兼松サステック	14	0.9	1,677	
キングジム	11	9.4	9,400	
リンテック	31.3	26.9	79,435	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
TASAKI	3.6	—	—	
イトーキ	27.8	23.9	15,535	
任天堂	81.2	69.8	3,307,822	
三菱鉛筆	10.9	18.7	42,430	
タカラスタンダード	27.2	23.4	40,926	
コクヨ	68.5	54.4	105,372	
ナカバヤシ	24	11.1	6,759	
グローブライド	6.4	5.1	12,382	
岡村製作所	46	39.6	54,925	
美津濃	71	11.2	35,224	
<b>電気・ガス業 (1.6%)</b>				
東京電力ホールディングス	1,118.4	905	346,615	
中部電力	434.4	346.8	495,403	
関西電力	538	462.6	586,576	
中国電力	182.3	156.7	198,538	
北陸電力	129.2	111.1	97,101	
東北電力	329.4	265.5	363,469	
四国電力	118.7	102.1	125,174	
九州電力	291.2	250.4	309,494	
北海道電力	123.4	113.7	75,383	
沖縄電力	19.4	18.3	52,575	
電源開発	104.9	90.2	242,277	
エフオン	4.9	5.7	6,902	
イーレックス	16.6	17.9	13,102	
東京瓦斯	1,414	241.9	646,840	
大阪瓦斯	1,279	220	447,480	
東邦瓦斯	330	56.2	177,030	
北海道瓦斯	32	30	8,970	
広島ガス	27.1	23.3	8,854	
西部瓦斯	148	13.7	36,428	
静岡ガス	40.6	32.2	29,237	
メタウォーター	7.4	6.4	20,192	
<b>陸運業 (4.0%)</b>				
SBSホールディングス	13	11.2	14,828	
東武鉄道	705	121.1	382,070	
相鉄ホールディングス	211	36.3	101,131	
東京急行電鉄	716	307.9	513,577	
京浜急行電鉄	361	155.3	282,490	
小田急電鉄	211.2	168.6	354,903	

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
京王電鉄	368	63.3	281,368	
京成電鉄	98.8	78.9	247,746	
富士急行	36	15.5	41,090	
新京成電鉄	17	2.9	6,388	
東日本旅客鉄道	255.1	203.6	1,961,278	
西日本旅客鉄道	126.9	102.3	740,856	
東海旅客鉄道	109.6	101.5	1,970,115	
西武ホールディングス	182.1	144.5	267,180	
鴻池運輸	18.6	16	28,592	
西日本鉄道	158	31.4	85,156	
ハマキョウレックス	8.6	8	27,360	
サカイ引越センター	4.5	6	31,680	
近鉄グループホールディングス	1,327	107.4	440,877	
阪急阪神ホールディングス	166.6	143.2	553,468	
南海電気鉄道	279	50.9	132,899	
京阪ホールディングス	295	47.8	154,155	
神戸電鉄	32	2.6	10,205	
名古屋鉄道	480	84.5	223,925	
山陽電気鉄道	48	8.3	21,521	
日本通運	510	42.2	295,400	
ヤマトホールディングス	235.8	188.2	484,803	
山九	174	27.5	140,800	
丸運	7.1	6.1	2,031	
丸全昭和運輸	44	38	19,000	
センコーグループホールディングス	62.6	64.6	52,713	
トナミホールディングス	27	2.6	15,262	
ニッコンホールディングス	44.7	40.8	110,078	
日本石油輸送	1.5	1.3	3,997	
福山通運	80	15.7	69,865	
セイノーホールディングス	93.5	80.4	152,840	
神奈川中央交通	15	2.7	10,125	
日立物流	27.5	23.6	68,794	
丸和運輸機関	3.3	5.6	17,472	
C&Fロジホールディングス	13.7	11.8	17,015	
九州旅客鉄道	98.3	90.1	294,627	
S Gホールディングス	—	76.1	173,051	
<b>海運業 (0.2%)</b>				
日本郵船	1,114	89.8	184,000	
商船三井	691	67.9	200,848	

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
川崎汽船	500	49.6	120,280	
N Sユナイテッド海運	59	5.1	10,761	
明治海運	11.8	11.4	4,753	
飯野海運	68.2	54.7	26,529	
共栄タンカー	11	0.8	1,517	
乾汽船	9.6	8.3	7,129	
<b>空運業 (0.6%)</b>				
日本航空	237.6	199.2	837,436	
A N Aホールディングス	2,447	210.4	851,909	
パスカ	12	10	3,040	
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>				
トランコム	3.8	3	21,690	
日新	54	9.3	24,914	
三菱倉庫	86	37.2	81,058	
三井倉庫ホールディングス	76	61	20,008	
住友倉庫	96	74	52,244	
澁澤倉庫	34	5.9	10,584	
東陽倉庫	22.5	19.4	6,887	
日本トランスシティ	30	26	11,830	
ケイヒン	24	2.1	3,530	
中央倉庫	7.6	6.5	7,130	
川西倉庫	—	2.2	3,896	
安田倉庫	10.3	9.6	9,830	
東洋埠頭	38	3.3	5,504	
宇徳	10.7	9.2	4,149	
上組	157	67.6	154,736	
サンリツ	3.2	2.7	2,019	
キムラユニティ	3.3	2.9	3,256	
キューソー流通システム	4.2	3.1	7,991	
郵船ロジスティクス	12.1	—	—	
近鉄エクスプレス	23.6	20.3	38,773	
東海運	7.1	6.1	2,482	
エーアイテイ	8.1	7.6	8,512	
内外トランスライン	3.9	3.8	6,798	
日本コンセプト	—	2.1	3,076	
<b>情報・通信業 (7.5%)</b>				
N E C ネットエスアイ	14.3	12.3	33,308	
システナ	10.4	8.9	36,757	
デジタルアーツ	5.8	5.5	21,917	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
新日鉄住金ソリューションズ	21.7	17.5	50,155
キューブシステム	5.6	6.5	5,148
エイジア	—	1.7	2,563
コア	5.5	4.7	6,072
ソリトンシステムズ	—	3.6	4,593
ソフトクリエイトホールディングス	6.2	5.3	7,499
T I S	43.1	37.1	148,956
ネオス	3.9	3.3	1,267
電算システム	4.5	3.9	7,347
グリー	79.2	59.6	36,356
コーエーテクモホールディングス	30.9	19	38,893
三菱総合研究所	5	4.8	15,696
ボルテージ	2.3	2.2	2,026
電算	1.4	1.2	3,016
AGS	3.3	6.3	6,079
ファインデックス	9.6	9.2	6,154
ヒト・コミュニケーションズ	2.9	2.5	4,337
ブレインバッド	2.8	2.4	6,528
KL a b	24.9	21.6	34,689
ポルトウウィン・ビットクルーホールディ	9.4	8	15,184
イーブックイニシアティブジャパン	2	1.8	1,972
ネクソン	142.4	124	441,440
アイスタイル	27.4	27.9	37,776
エムアップ	3.7	3.7	3,818
エイチーム	7.2	7.6	18,597
テクノスジャパン	10	10.1	8,968
e n i s h	3.8	3.6	3,211
コプロラ	36.5	36.2	33,883
モバイルクリエイト	9.5	9	3,024
オルトプラス	5.4	5.4	5,232
ブロードリーフ	32.1	27.6	28,510
ハーツユナイテッドグループ	6.8	5.9	9,611
メディアドゥホールディングス	2.8	3.6	6,087
ブイキューブ	7.1	6.8	3,753
サイバーリンクス	2	1.7	2,031
ディー・エル・イー	4.3	7.2	3,009
フィックスターズ	1.9	1.9	17,005
VOYAGE GROUP	4.4	5.6	6,994
オブティム	1.4	1.9	4,558

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
セレス	2.3	3.4	5,307
ベリサーブ	1.5	1.5	4,620
ティーガイア	12.9	11.1	31,879
セック	—	1.1	3,080
日本アジアグループ	14.7	11.7	6,060
豆蔵ホールディングス	9.5	8.3	9,569
テクマトリックス	8.1	6.1	10,174
プロシップ	—	1.6	4,118
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	272.8	301.6	107,369
GMOペイメントゲートウェイ	10.6	7.8	77,298
ザッパラス	6.7	5.3	2,045
システムリサーチ	1.3	1.1	2,468
インターネットイニシアティブ	19.1	18.1	40,254
さくらインターネット	10.6	13.2	9,649
ヴィンクス	—	2.3	3,130
GMOクラウド	2.9	2.5	5,462
SRAホールディングス	6.9	5.9	17,534
M i n o r i ソリューションズ	2.9	2.2	3,132
システムインテグレータ	1.8	1.6	1,568
朝日ネット	11.8	10.1	5,050
e B A S E	—	2.2	2,976
アドソル日進	2.6	4.3	5,379
フリービット	7.2	7.4	9,257
コムチュア	2.2	5.7	19,636
サイバーコム	1.7	2	4,226
メディカル・データ・ビジョン	2.2	4.2	16,569
g u m i	14.7	12.8	13,350
ショーケース・ティービー	1.5	2.1	3,381
モバイルファクトリー	—	2	2,682
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	—	1.8	4,973
P C I ホールディングス	1.5	1.9	5,534
パイブドHD	2.3	1.7	2,402
アイビーシー	1	1.2	1,743
ネオジャパン	—	2	2,992
オーブントア	1.3	4.4	10,137
マイネット	—	2.2	2,838
アカツキ	—	2.2	10,835
U b i c o m ホールディングス	—	1.2	1,114
L I N E	21.8	33.6	134,736

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
シクロ・フード	—	0.9	3,928	
オークネット	—	3.5	5,183	
AOI TYO Holdings	10.6	9.1	12,676	
マクロミル	—	10.4	33,176	
ソルクシーズ	3.7	4.2	4,107	
フェイス	3.4	3.9	4,477	
ハイマックス	1.7	1.5	2,563	
野村総合研究所	97.3	70.7	335,471	
サイバネットシステム	10.6	9.1	7,325	
CEホールディングス	2	3.1	2,501	
日本システム技術	—	1.3	1,657	
インテージホールディングス	7.4	12.9	14,822	
東邦システムサイエンス	4.3	3.7	3,056	
ソースネクスト	7.8	15.6	11,278	
フォーカスシステムズ	5	6.3	5,827	
クレスコ	2.9	2.5	8,500	
フジ・メディア・ホールディングス	135.5	116.5	210,282	
オービック	44.9	35.1	305,370	
ジャストシステム	21	18.1	42,770	
TDCソフト	5.7	4.9	6,639	
ヤフー	932.7	802.1	405,060	
トレンドマイクロ	68.9	54.3	321,456	
インフォメーション・ディベロプメント	3.7	3.5	5,267	
日本オラクル	20.9	18	155,520	
アルファシステムズ	4.3	3.7	7,881	
フューチャー	17.6	15.1	19,856	
CAC Holdings	9.7	8.3	8,640	
ソフトバンク・テクノロジー	3.1	4.6	8,303	
トーセ	3.5	3	4,632	
オービックビジネスコンサルタント	6.6	5.7	38,532	
伊藤忠テクノソリューションズ	29.5	25.3	108,031	
アイティフォー	16.9	13.5	12,069	
東計電算	2.3	2	6,160	
エクスネット	1.2	1.7	1,492	
大塚商会	35	33.4	346,358	
サイボウズ	17.3	14.9	8,165	
ソフトブレイン	17.7	8.7	3,810	
電通国際情報サービス	8	6.9	19,037	
デジタルガレージ	18.9	20	68,100	

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
EMシステムズ	4.4	7.7	10,202	
ウェザーニューズ	4.4	3.8	12,388	
C I J	10.9	8.7	5,898	
東洋ビジネスエンジニアリング	1.3	1.1	1,974	
日本エンタープライズ	13.3	11.4	2,485	
WOWOW	6.2	5.3	17,675	
スカラ	9	8.9	6,995	
日本コロムビア	3.9	—	—	
イマジカ・ロボット ホールディングス	10.9	9.4	10,161	
ネットワンシステムズ	56.3	45.4	69,870	
システムソフト	23	26.3	3,708	
アルゴグラフィックス	5.9	5.1	16,218	
マーベラス	21.9	18.9	17,463	
エイベックス	23.9	20.6	31,476	
日本ユニシス	35.9	30.9	68,258	
兼松エレクトロニクス	8.2	7.1	21,229	
東京放送ホールディングス	85.8	67	146,060	
日本テレビホールディングス	118.8	102.1	188,476	
朝日放送	12.8	11	9,856	
テレビ朝日ホールディングス	35.5	30.6	67,442	
スカパーJ SATホールディングス	84.6	84.9	40,072	
テレビ東京ホールディングス	10.6	9.1	25,234	
日本BS放送	2.9	3.8	4,746	
ビジョン	1.5	2.9	9,512	
USEN-NEXT HOLDINGS	3.4	2.9	2,351	
ワイヤレスゲート	4.5	5.2	7,196	
コネクション	11.4	7.9	17,277	
日本通信	108.8	100.3	11,233	
クロップス	2.8	2.4	2,205	
日本電信電話	1,044.6	798.4	3,898,587	
KDDI	1,287.4	1,001.7	2,680,048	
光通信	15.6	13.4	218,554	
NTTドコモ	972.4	823.5	2,210,274	
エムティーアイ	19.9	15	9,285	
GMOインターネット	47.5	40.5	90,679	
アドママーケティングコミュニケーション	—	1.8	1,269	
カドカワ	37.7	32.4	34,894	
学研ホールディングス	43	3.7	17,001	
ゼンリン	17.2	13.4	43,550	

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
昭文社	7.1	5.1	4,141	
インプレスホールディングス	10.7	9.2	2,106	
アイネット	7.3	6.3	9,557	
松竹	86	7.4	104,932	
東宝	85.1	73.2	247,416	
東映	48	4.2	45,738	
エヌ・ティ・ティ・データ	80.4	345.6	370,483	
ピー・シー・エー	1.9	1.6	2,812	
ビジネスブレイン太田昭和	2.2	1.9	3,858	
D T S	13.4	11.5	41,630	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	50.1	51.7	245,316	
シーイーシー	7.7	6.6	22,077	
カブコン	30.5	23.8	117,810	
アイ・エス・ピー	2.5	2.2	3,751	
ジャステック	8.2	6.4	8,179	
S C S K	35.4	25.7	112,052	
日本システムウェア	4.3	3.7	10,345	
アイネス	16.4	14.1	15,369	
TKC	12	10.3	43,157	
富士ソフト	19.3	15.4	61,138	
NSD	27.6	18.3	38,521	
コナミホールディングス	58.7	45.5	237,965	
福井コンピュータホールディングス	3.8	3.2	7,328	
J B C Cホールディングス	10.9	8.8	9,160	
ミロク情報サービス	9.6	9.8	28,390	
ソフトバンクグループ	585.8	503.6	4,069,088	
<b>卸売業 (4.7%)</b>				
ハウスイ	10	0.9	1,064	
高千穂交易	5	4.3	5,138	
伊藤忠食品	3.2	2.8	16,380	
エレマテック	5.2	5.2	13,156	
J A L U X	4.2	3.1	9,734	
あらた	5.8	5.5	30,910	
トーマンデバイス	1.9	1.7	4,785	
東京エレクトロン デバイス	4.7	4	7,744	
フィールズ	9.9	8.5	9,919	
双日	768.5	660.8	216,742	
アルフレッサ ホールディングス	153.9	124.1	276,991	
横浜冷凍	32.2	27.8	27,772	

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
神栄	18	1.5	2,143	
山下医科器械	1	—	—	
ラサ商事	5.6	4.9	4,473	
ラクーン	6.2	6.5	3,809	
アルコニックス	7.4	11.8	24,178	
神戸物産	7	7.2	33,480	
ベッパーフードサービス	—	6	27,990	
あい ホールディングス	18.5	17.9	50,137	
ディーブイエックス	4.6	4	4,908	
ダイワボウホールディングス	110	9.5	40,897	
マクニカ・富士エレホールディングス	24.1	20.9	38,435	
ラクト・ジャパン	—	1.5	5,475	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24.4	21	21,609	
八洲電機	10	8.6	7,198	
メディアスホールディングス	—	2.1	6,018	
UKCホールディングス	8.4	7.2	15,400	
ジュレットクホールディングス	—	2.5	3,090	
大光	—	2.8	2,366	
O C H I ホールディングス	3.8	3.2	4,633	
T O K A I ホールディングス	57.2	59	60,947	
大阪工場	1.5	1.7	1,703	
三洋貿易	7.1	6.1	11,956	
ビューティガレージ	1.3	1.5	4,194	
ウイン・パートナーズ	9.4	8.1	12,417	
ミタチ産業	3	2.6	3,367	
シップヘルスケアホールディングス	25	23.3	86,210	
明治電機工業	4.4	3.8	6,684	
デリカフーズホールディングス	2.7	2.2	3,403	
スターティア	2.9	2.5	2,362	
コマダホールディングス	17.6	20.6	39,902	
富士興産	4.7	4.3	2,644	
協栄産業	16	1.3	2,606	
小野建	11.3	9.7	17,857	
佐島電機	9.6	8.2	8,733	
エコートレーディング	3	2.5	1,765	
伯東	8.9	6.8	10,329	
コンドーテック	10.3	8.9	8,339	
中山福	7.4	6.4	4,921	
ナガイレーベン	18.8	14.8	42,609	

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
三菱食品	14.3	12.3	36,125	
松田産業	9.5	8.1	14,887	
第一興商	21.2	16.6	91,134	
メディバルホールディングス	130.1	111.9	233,759	
S P K	2.8	2.4	6,852	
萩原電気	4.4	3.9	12,168	
アズワン	10.2	8.7	58,116	
スズデン	4.7	3.9	6,622	
尾家産業	4.2	3.3	4,346	
シモジマ	7.9	6.8	7,697	
ドウシシャ	15.3	11.8	27,482	
小津産業	2.8	2.4	5,340	
高速	7.7	6.6	8,144	
たけびし	4.5	3.9	6,793	
黒田電気	17.8	—	—	
リックス	2.9	2.5	4,897	
丸文	11.5	9.9	9,454	
ハビネット	10.8	7.6	11,628	
橋本総業ホールディングス	2.7	2.3	3,903	
日本ライフライン	11.1	31.8	94,732	
エクセル	5.6	4.5	12,132	
マルカキカイ	4.2	3.6	6,721	
I D O M	35	33.9	23,391	
日本エム・ディ・エム	9.8	7.5	6,975	
進和	7.7	6.6	13,741	
エスケイジャパン	2.4	2.7	1,949	
ダイトロン	5.9	5.1	9,975	
シークス	9.3	7.1	31,950	
田中商事	4	3.4	2,298	
オーハジテクニカ	7.3	6.3	10,773	
白銅	3.3	4	8,848	
伊藤忠商事	953.1	819.4	1,629,376	
丸紅	1,280.7	917.6	688,200	
高島	22	1.9	4,195	
長瀬産業	78.2	67.3	118,313	
蝶理	8.3	7.1	13,660	
豊田通商	144.9	124.6	432,362	
三共生興	19.7	19	9,557	
兼松	277	47.6	63,688	

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
ツカモトコーポレーション	23	2	2,588	
三井物産	1,176.8	948.5	1,697,815	
日本紙パルプ商事	68	5.8	24,969	
日立ハイテクノロジーズ	45.1	38.8	187,986	
カメイ	16.9	14.6	20,805	
東都水産	2	1.7	3,321	
O U Gホールディングス	20	1.8	4,678	
スターゼン	5.4	4.4	23,144	
山善	49.9	43.6	45,823	
椿本興業	15	2.5	8,737	
住友商事	819.2	704.3	1,219,143	
内田洋行	6.4	5.1	14,106	
三菱商事	976.4	783.6	2,201,132	
第一実業	30	5.1	15,402	
キヤノンマーケティングジャパン	37.1	31.9	88,394	
西華産業	42	6.9	17,450	
佐藤商事	11.6	10	11,380	
菱洋エレクトロ	12.4	10.4	17,638	
東京産業	12.9	11.1	6,382	
ユアサ商事	12.3	10.6	36,252	
神鋼商事	3.3	2.5	8,987	
小林産業	9.5	7.4	2,604	
阪和興業	130	20.9	89,870	
正栄食品工業	—	6.1	22,875	
カナデン	12.4	10.7	15,525	
菱電商事	21	8	14,128	
フルサト工業	7.2	6.2	10,992	
岩谷産業	144	24.8	96,348	
すてきなイスグループ	55	4.8	6,648	
昭光通商	46	40	4,280	
ニチモウ	19	1.7	3,005	
極東貿易	20	16	7,264	
イワキ	20	15.7	6,264	
三愛石油	34.9	30	45,570	
稲畑産業	31.2	26.8	40,736	
G S Iクレオス	32	3	4,641	
明和産業	12	10.3	4,964	
ワキタ	27.7	23.8	28,417	
東邦ホールディングス	41.7	33.1	80,333	



銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サンゲツ	44.6	37.2	78,789
ミツウロコグループホールディングス	20.9	16.2	12,652
シナネンホールディングス	5.6	4.6	12,015
伊藤忠エネクス	28.7	24.7	24,033
サンリオ	40.1	31.3	58,781
サンワテクノス	7.7	6.6	12,058
リョーサン	19.3	14	52,500
新光商事	14.2	12.2	21,594
トーヨー	5.9	5	10,945
三信電気	14.4	10.3	21,094
東陽テクニカ	16	12.9	12,190
モスフードサービス	17	14.6	45,990
加賀電子	11.8	10.1	25,977
ソーダニッカ	13.4	11.5	8,590
立花エレテック	8.8	7.6	15,868
フォーバル	5.7	4.9	4,297
PAL TAC	20.8	15.7	81,640
三谷産業	13.8	12.1	5,287
太平洋興発	54	4.7	4,789
西本Wisemettacホールディングス	—	2.3	10,522
ヤマシタヘルスケアホールディングス	—	0.9	1,313
ヤマタネ	6.5	5.6	10,421
丸紅建材リース	13	11	2,541
日鉄住金物産	11.4	8.7	48,633
泉州電業	—	3.7	11,285
トラスコ中山	29.7	23.2	57,837
オートバックスセブン	48.2	44.4	86,668
モリト	10.4	8.9	8,722
加藤産業	20.3	17.5	62,387
イノテック	11.2	9.6	12,096
イエローハット	12.3	10.5	31,972
JKホールディングス	13	11.2	9,923
日伝	5.4	9.3	19,371
北沢産業	10.7	9.2	2,888
杉本商事	7.5	6	10,890
因幡電機産業	18.3	14.7	68,722
バイテックホールディングス	5.3	5.1	10,266
東テック	—	3.7	8,965
ミスミグループ本社	146.3	129.7	357,323

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アルテック	11.1	9.5	3,657
タキヒヨー	20	3.7	8,417
蔵王産業	2.1	1.8	3,124
スズケン	59.2	50.9	215,561
ジェコス	8.9	7.7	8,354
ルネサスイーストン	11.9	10.2	6,976
<b>小売業 (4.9%)</b>			
ローソン	41.1	28.2	197,682
サンエー	9.8	8.4	49,896
カワチ薬品	10.1	8.7	21,915
エービーシー・マート	23.7	20.3	137,837
ハードオフコーポレーション	5.7	4.9	5,429
アスクル	13.6	9.7	33,513
ゲオホールディングス	21.7	20.4	34,761
アダストリア	20	17.2	36,876
ジーフット	7.8	6.7	4,964
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1.7	1.4	994
くらコーポレーション	8.5	6.6	46,530
キャンドウ	6.9	5.3	9,121
バルグループホールディングス	6.6	5.7	16,125
エディオン	50.4	43.4	52,123
サーラコーポレーション	16.2	19.2	11,980
ワッツ	5.6	4.4	4,589
ハローズ	4.3	4.2	10,193
あみやき亭	2.5	2.4	14,016
ひらまつ	17.9	15.4	7,561
ゲンキー	2.6	—	—
大黒天物産	3.1	2.7	14,256
ハニーズホールディングス	12.6	10.8	10,789
ファーマライズホールディングス	3	2.5	1,550
アルペン	9.9	8.6	19,590
ハブ	—	2.1	2,133
クオール	14.7	12.3	24,575
ジンズ	8.8	7.6	42,484
ビックカメラ	74.7	65.8	105,016
DCMホールディングス	79	60.2	62,728
Monotaro	46.1	39.7	145,897
東京一番フーズ	3.2	2.8	1,960
DDホールディングス	2.9	2.5	8,300

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
きちり	3.5	3		2,100
アークランドサービスホールディングス	4.1	9.3		21,185
J. フロント リテイリング	164.6	133.3		230,742
ドトール・日レスホールディングス	22.8	19.6		48,608
マツモトキヨシホールディングス	24.6	46.2		194,964
ブロンコビリー	6.8	5.8		19,459
スタートトゥデイ	118.8	109.7		291,363
トレジャー・ファクトリー	3.7	3.2		2,416
物語コーポレーション	3.7	3.2		32,320
ココカラファイン	13.6	11.7		81,315
三越伊勢丹ホールディングス	258.9	208.8		236,779
H a m e e	2.9	2.8		4,841
ウエルシアホールディングス	25.7	29.5		131,275
クリエイトSDホールディングス	19.1	16.5		42,355
丸善CH I ホールディングス	15.2	13		4,472
ミサワ	2.3	2		848
ティーライフ	1.2	1.5		1,737
エー・ピーカンパニー	2.1	2.1		1,734
チムニー	4	3.4		10,111
シュッピン	4.9	6.7		7,919
ネクステージ	2.5	11.8		13,794
ジョイフル本田	21.1	16.4		60,270
鳥貴族	3.2	4.1		11,976
キリン堂ホールディングス	4.2	4		6,460
ホットランド	6	6.5		7,962
すかいらく	55.8	69.3		103,395
綿半ホールディングス	5.2	4.2		16,359
ヨシックス	1.3	1.8		6,282
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	43.1	37.1		40,439
ブックオフコーポレーション	7.4	6.4		5,484
ゴルフダイジェスト・オンライン	5.2	4.5		4,167
BEENOS	1.5	1.7		2,703
あさひ	9.7	8.3		10,482
日本調剤	4.6	3.9		12,928
コスモス薬品	6.6	5.6		116,984
トーエル	6.3	5.4		5,421
一六堂	2.7	2.4		1,003
オンリー	1.5	1.7		1,562
セブン&アイ・ホールディングス	544.6	468		2,046,564

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
薬王堂	6.5	4.9		18,865
クリエイト・レストランツ・ホールディング	34.9	30		35,910
ツルハホールディングス	26	24.2		355,014
サンマルクホールディングス	8.4	8		24,920
フェリシモ	3.7	2.8		3,768
トリドールホールディングス	16	13.8		53,199
TOKYO BASE	—	7.4		10,034
サツドラホールディングス	1.7	1.8		3,625
ダイユー・リックホールディングス	4.2	5.2		5,538
パロックジャパンリミテッド	7.6	8.9		9,300
クスリのアオキホールディングス	10.3	8.9		65,237
スシローグローバルホールディングス	—	10.7		55,426
L I X I L ビバ	—	10.6		21,889
メディカルシステムネットワーク	14.7	12.7		6,832
総合メディカル	6.3	4.9		28,077
はるやまホールディングス	6.1	5.2		5,636
ノジマ	15.1	19.6		48,020
カッパ・クリエイト	18.2	13.9		18,181
ライトオン	9.7	9.4		8,572
ジーンズメイト	4.1	3.4		2,658
良品計画	17.2	14.8		530,580
三城ホールディングス	16.1	13.8		6,913
アドヴァン	13.2	11.4		11,263
アルビス	3.4	2.7		8,626
コナカ	16.6	14.3		8,365
ハウス オブ ローゼ	1.6	1.4		2,571
G-7ホールディングス	3.8	3.3		7,751
イオン北海道	13	11.2		8,489
コジマ	19.1	19.2		6,259
ヒマラヤ	4	3		3,597
コーナン商事	18.5	15.9		39,002
エコス	5	4.5		5,386
ワタミ	15.4	13.2		18,387
マルシエ	2.9	2.9		2,360
ドンキホーテホールディングス	84.2	72.4		419,920
西松屋チェーン	22.8	24.5		28,371
ゼンショーホールディングス	67.4	57.9		140,060
幸楽苑ホールディングス	8.2	7.1		13,731
ハークスレイ	3.2	2.7		2,897

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
サイゼリヤ	21.4	16.6	49,484	
V Tホールディングス	44	37.8	20,601	
魚力	4	3.1	4,315	
ポブラ	3.2	2.9	2,517	
フジ・コーポレーション	1.9	1.9	5,021	
ユナイテッドアローズ	17.3	13.8	54,717	
ハイデイ日高	14.2	14.6	37,945	
京都きもの友禅	8.2	7.1	5,396	
コロワイド	43.1	37.1	91,117	
ピーシーデポコーポレーション	17.2	16.7	11,573	
老番屋	9.1	7.9	32,706	
トップカルチャー	4.7	4	1,916	
PLANT	2.9	2.6	3,400	
スギホールディングス	28.5	24.5	141,610	
ヴィア・ホールディングス	9.9	9.9	7,405	
スクロール	19.7	17.2	6,983	
ヨンドシーホールディングス	9.9	11.4	30,141	
ユニ・ファミリーマートホールディングス	57.1	35.7	297,381	
木曽路	15.9	13.7	37,442	
SRSホールディングス	15.3	13.2	12,922	
千趣会	23.5	20.2	10,706	
タカキュー	10	8.6	1,754	
ケーヨー	21.9	20.6	10,938	
上新電機	31	13.2	49,368	
日本瓦斯	23.9	20.5	93,172	
ベスト電器	41.9	—	—	
ロイヤルホールディングス	21.4	19.8	54,054	
東天紅	11	0.8	1,418	
いなげや	14.5	12.4	22,121	
島忠	33.7	27	89,505	
チヨダ	15.3	13.2	33,910	
ライフコーポレーション	9.8	8.5	24,157	
リンガーハット	14.6	13.8	32,788	
さが美グループホールディングス	12	10	1,170	
M r M a x HD	16.2	13.9	9,035	
テナアライド	12	10.3	4,954	
AOKIホールディングス	26	22.3	35,613	
オークワ	19	16	17,024	
コメリ	20	17.2	48,332	

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
青山商事	27.2	21.4	89,559	
しまむら	15.1	13	171,340	
はせがわ	6.9	5.9	2,790	
高島屋	218	175	170,450	
松屋	28.4	22.5	30,757	
エイチ・ツー・オー リテイリング	66.6	52.9	98,817	
近鉄百貨店	50	4.3	15,501	
丸栄	27	—	—	
パルコ	12.5	10.7	14,241	
丸井グループ	136.9	106.9	211,448	
アクシアル リテイリング	10.1	9.3	37,060	
井筒屋	7	6.1	2,287	
イオン	535.4	429.7	778,401	
イズミ	25.8	20.2	134,936	
東武ストア	1.6	1.3	3,858	
平和堂	26.4	22.7	55,615	
フジ	14.5	13.3	28,462	
ヤオコー	14.7	12.7	71,755	
ゼビオホールディングス	17.7	15.2	31,205	
ケーズホールディングス	60	47.3	138,683	
O l y m p i cグループ	7.6	6.6	3,597	
日産東京販売ホールディングス	19.1	16.4	7,134	
Genky DrugStores	—	4.4	15,840	
アインホールディングス	17	15	116,700	
元気寿司	3.3	2.8	7,742	
ヤマダ電機	435.2	374.2	243,604	
アークランドサカモト	22	18.9	32,262	
ニトリホールディングス	56.2	44.3	797,178	
グルメ杵屋	9	8	9,232	
愛眼	9.5	8.9	4,067	
ケーユーホールディングス	6.8	5.8	6,008	
吉野家ホールディングス	45.3	36.7	75,602	
松屋フーズ	6.2	5.4	21,006	
サガミチェーン	16.3	14.9	20,368	
関西スーパーマーケット	10.6	8.4	9,198	
王将フードサービス	9.5	8.2	42,476	
ブレナス	14.5	12.5	25,087	
ミニストップ	9.6	8.3	17,446	
アークス	24.4	20.9	51,790	

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
パローホールディングス	28	26	72,540	
藤久	1	0.9	1,307	
ベルク	5.8	5	29,400	
大庄	6.9	6	9,720	
ファーストリテイリング	21.7	18.7	751,179	
サンドラッグ	24.7	47.3	225,384	
サックスパー ホールディングス	12.2	10.5	11,539	
ヤマザワ	2.7	2.3	4,025	
やまや	2.7	2.3	7,072	
ペルーナ	32.4	27.4	33,154	
<b>銀行業 (7.2%)</b>				
島根銀行	2.7	2.4	3,300	
じもとホールディングス	93.4	75.5	14,118	
めぶきフィナンシャルグループ	627.5	581	234,724	
東京TYフィナンシャルグループ	18.8	15.1	36,889	
九州フィナンシャルグループ	213.4	183.5	95,787	
ゆうちょ銀行	368.5	316.8	454,608	
富山第一銀行	33.1	28.4	13,944	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	851.9	679.8	388,845	
西日本フィナンシャルホールディングス	88.2	75.9	93,584	
新生銀行	1,239	96.8	153,815	
あおぞら銀行	823	66.6	281,385	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,861	7,828.1	5,384,949	
りそなホールディングス	1,522.4	1,227.1	692,697	
三井住友トラスト・ホールディングス	271.7	219.8	932,391	
三井住友フィナンシャルグループ	1,042	846.4	3,759,708	
第四銀行	159	13.7	62,746	
北越銀行	14.1	11.2	25,603	
千葉銀行	502	401	334,434	
群馬銀行	289.2	227.1	136,487	
武蔵野銀行	20.8	17.8	58,651	
千葉興業銀行	35.7	30.7	13,784	
筑波銀行	54.1	46.5	15,856	
七十七銀行	204	35.1	86,626	
青森銀行	101	8.7	28,623	
秋田銀行	83	7.2	19,972	
山形銀行	73	12.6	29,043	
岩手銀行	8.5	7.8	32,136	
東邦銀行	116	100	39,600	

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
東北銀行	66	5.7	8,116	
みちのく銀行	78	7.2	12,585	
ふくおかフィナンシャルグループ	528	454	246,976	
静岡銀行	354	295	289,100	
十六銀行	175	15	41,160	
スルガ銀行	133	114.4	174,002	
八十二銀行	251.1	202.4	114,760	
山梨中央銀行	81	69	28,980	
大垣共立銀行	201	17.7	47,170	
福井銀行	111	9.6	21,792	
北國銀行	138	12.7	50,990	
清水銀行	4.4	3.8	10,662	
富山銀行	2.5	2.2	8,283	
滋賀銀行	122	105	56,280	
南都銀行	12.6	13.1	37,177	
百五銀行	117	107.3	52,469	
京都銀行	233	42.7	240,828	
紀陽銀行	48.9	42.1	69,591	
三重銀行	5.8	5	11,640	
ほくほくフィナンシャルグループ	86.6	74.4	107,880	
広島銀行	384	165.1	128,943	
山陰合同銀行	78.2	66.3	61,393	
中国銀行	92.2	77.3	94,228	
鳥取銀行	4.1	3.6	6,195	
伊予銀行	139.2	159.5	124,888	
百十四銀行	143	119	41,769	
四国銀行	100	17.1	25,188	
阿波銀行	111	90	59,580	
大分銀行	75	6.4	25,088	
宮崎銀行	87	7.4	24,050	
佐賀銀行	79	6.8	15,803	
十八銀行	80	69	17,940	
沖縄銀行	12.7	10.9	48,505	
琉球銀行	26.8	21.7	34,524	
セブン銀行	487.8	419.4	140,499	
みずほフィナンシャルグループ	17,667.9	15,192.4	2,901,748	
高知銀行	47	4.1	5,243	
山口フィナンシャルグループ	122	105	134,190	
長野銀行	4.3	3.7	6,771	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
名古屋銀行	10.9	9		35,010
北洋銀行	212.4	168.6		57,661
愛知銀行	4.4	3.8		19,836
第三銀行	7.4	6.3		10,395
中京銀行	5.3	4.6		10,718
大光銀行	45	3.8		8,565
愛媛銀行	15.5	15.6		19,281
トマト銀行	5	4.3		6,548
みなと銀行	11.8	10.1		21,149
京葉銀行	106	99		45,738
関西アーバン銀行	18.1	15.6		22,464
栃木銀行	71.8	57.9		22,696
北日本銀行	4.1	3.5		10,416
東和銀行	244	19.6		27,518
福島銀行	141	10.5		7,812
大東銀行	68	5.4		6,631
トモニホールディングス	107.2	92.2		41,951
フィデアホールディングス	126.3	108.6		20,634
池田泉州ホールディングス	138.1	118.7		47,836
<b>証券、商品先物取引業 (1.0%)</b>				
F P G	46.4	39		50,934
マーキュリアインベストメント	—	2.3		2,465
S B I ホールディングス	147.1	126.5		325,105
日本アジア投資	12.4	10.1		3,434
ジャフコ	21.7	16		76,800
大和証券グループ本社	1,218	957		643,295
野村ホールディングス	2,660.4	1,923.7		1,160,952
岡三証券グループ	111	95		61,560
丸三証券	41.4	35.6		37,914
東洋証券	46	40		11,640
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	149.3	123.8		90,745
光世証券	31	2.7		3,537
水戸証券	40.3	34.6		14,462
いちよし証券	29.1	23.5		29,328
松井証券	74.3	54.8		52,060
だいこう証券ビジネス	6.3	5.4		3,537
マネックスグループ	139.6	118.5		38,986
カブドットコム証券	97.9	70.5		26,155
極東証券	17.4	15		23,400

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
岩井コスモホールディングス	12.3	11.4		16,222
藍澤證券	24.3	20.9		15,152
マネーパートナーズグループ	16.6	14.3		5,634
小林洋行	3.7	3.2		956
<b>保険業 (2.2%)</b>				
かんぽ生命保険	49.1	42.2		105,753
S O M P O ホールディングス	272.1	219.3		900,445
アニコム ホールディングス	8.8	7.6		28,766
MS&ADインシュアランスグループホール	388.9	292.4		941,820
ソニーフィナンシャルホールディングス	124.7	91.9		172,863
第一生命ホールディングス	784.7	632.5		1,215,348
東京海上ホールディングス	527.2	421.3		2,013,814
アドバンテッジリスクマネジメント	—	2.7		3,491
T & D ホールディングス	474.3	345.8		571,261
アドバンスクリエイト	3	2.6		5,106
<b>その他金融業 (1.2%)</b>				
全国保証	36.6	31.5		143,640
イントラスト	—	1.8		1,359
アルヒ	—	9.5		13,794
クレディセゾン	98.7	84.9		145,518
アクリーティブ	10.7	6.1		1,970
芙蓉総合リース	14.9	12.8		88,448
興銀リース	24.4	21		62,748
東京センチュリー	26.2	22.5		142,650
日本証券金融	57.3	45.8		29,586
アイフル	218.2	187.6		63,596
ポケットカード	9.7	—		—
リコーリース	10.2	8.8		31,372
イオンフィナンシャルサービス	83.1	79.4		183,652
アコム	264.4	224.7		105,159
ジャックス	72	13.6		31,307
オリエントコーポレーション	281.4	241.9		40,881
日立キャピタル	30.7	30.8		80,203
アプラスフィナンシャル	62.4	53.6		5,788
オリックス	921.5	745.9		1,367,980
三菱UFJリース	330.1	283.8		172,266
九州リースサービス	—	4.8		3,945
日本取引所グループ	404.6	328.5		623,493
イー・ギャランティ	3.8	5.9		11,617

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
アサクス	2.3	1.5	2,755	
NECキャピタルソリューション	5.3	4.5	9,481	
<b>不動産業 (2.3%)</b>				
いちご	123.7	159.8	70,951	
日本駐車場開発	156.9	134.9	22,528	
ヒューリック	271.4	233.4	255,806	
三栄建築設計	5.2	4.5	9,958	
スター・マイカ	—	4.1	8,331	
野村不動産ホールディングス	86.4	74.4	184,140	
三重交通グループホールディングス	23.1	22.7	11,622	
サムティ	10.4	9.5	16,558	
ディア・ライフ	8.9	11.2	5,600	
コーセーアールイー	—	1.9	1,666	
エー・ディー・ワークス	119.3	148.2	5,928	
日本商業開発	7.2	6.3	10,999	
ブレサンスコーポレーション	20.2	15.3	23,347	
ユニゾホールディングス	10.7	13.1	32,881	
THEグローバル社	4.5	5.2	4,232	
日本管理センター	9.3	7.4	10,989	
サンセイランディック	2.7	3.2	3,840	
エストラスト	2.3	1.5	1,345	
フージャースホールディングス	16.8	27.2	19,937	
オープンハウス	18.8	18.2	116,662	
東急不動産ホールディングス	314.8	270.7	201,130	
飯田グループホールディングス	108.5	93.3	183,801	
イギリスランド	—	1.3	1,517	
ムゲンエステート	4.5	6.9	8,928	
ファーストブラザーズ	1.3	3.1	4,476	
ハウスドゥ	1.6	1.8	5,526	
シーアールイー	1.8	1.8	3,211	
ケイアイスター不動産	2.6	4	10,260	
エコナックホールディングス	49	—	—	
パーク24	66	62	176,204	
バラカ	3.7	3.6	8,060	
三井不動産	690	558.3	1,363,368	
三菱地所	968	832.3	1,431,556	
平和不動産	24.6	19.7	39,124	
東京建物	151	122.2	188,065	
ダイビル	33.5	28.8	35,136	

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
京阪神ビルディング	21.6	18.5	16,372	
住友不動産	312	268	1,015,988	
大京	242	17.8	37,718	
テーオーシー	50.4	38.5	32,532	
東京楽天地	21	1.8	8,685	
レオパレス21	164.2	133.4	109,121	
スターツコーポレーション	13.3	15.2	41,389	
フジ住宅	16.6	14.3	12,555	
空港施設	15.7	11.6	7,029	
明和地所	7.1	6.1	4,880	
住友不動産販売	11.7	—	—	
ゴールドクレスト	11.7	8.8	19,201	
日本エスリード	5.1	4.4	9,653	
日神不動産	15.4	14.9	11,279	
日本エスコン	17.3	20	18,560	
タカラレーベン	56.7	52.4	23,632	
サンヨーハウジング名古屋	6.7	5.8	7,035	
イオンモール	83.8	72	153,792	
ファースト住建	4.8	4.2	6,615	
ランド	123.4	245.8	3,687	
カチタス	—	11.4	34,428	
トーセイ	17.8	13.6	16,904	
穴吹興産	1.4	1.2	3,490	
エス・ティ・ティ都市開発	80.8	69.5	86,805	
サンフロンティア不動産	14	13.5	15,552	
エフ・ジェー・ネクスト	11.3	8.5	6,919	
インテリックス	3	3.1	3,186	
ランドビジネス	7.7	6.6	2,105	
グランディハウス	11.4	9.8	4,478	
日本空港ビルデング	41.5	32.7	125,895	
<b>サービス業 (4.4%)</b>				
日本工営	9.2	7.3	22,009	
LIFULL	34	37.6	33,539	
ジェイエシーリクルートメント	8.5	8.7	19,087	
日本M&Aセンター	39.7	37.5	264,000	
メンバーズ	—	2.7	2,821	
中広	1.3	1.1	795	
タケエイ	12.1	11.2	13,350	
トラスト・テック	5.6	4.9	15,459	

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円			
コシダカホールディングス	4.7	5.7	40,128			
パソナグループ	10.2	10.3	22,938			
CDS	3.1	2.9	3,781			
リンクアンドモチベーション	32.4	19.9	23,084			
GCA	12.2	12.3	10,811			
エス・エム・エス	19.5	21.4	90,094			
パーソルホールディングス	106.6	100	298,900			
リニカル	8.1	7	11,823			
クックパッド	30.7	34	19,176			
エスクリ	4.9	3.8	3,275			
アイ・ケイ・ケイ	6.1	6.3	4,863			
学情	5.7	4.9	7,232			
スタジオアリス	5.6	5.4	13,591			
シミックホールディングス	7	6	16,248			
NJS	3.1	2.7	4,220			
総合警備保障	50.1	43.1	209,466			
カカコム	98.2	81.5	148,167			
アイロムグループ	4.2	3.7	11,229			
セントケア・ホールディング	1.8	4.6	3,376			
サイネックス	1	1.6	1,368			
ルネサンス	7	5.3	9,518			
ディップ	17.8	15.3	47,277			
オプトホールディング	9.9	7.5	11,617			
新日本科学	15.3	13.2	7,484			
ツクイ	32.6	25.5	20,145			
キャリアデザインセンター	2.9	2.5	5,012			
エムスリー	119.3	114	512,430			
ツカダ・グローバルホールディング	10	8.6	5,254			
プラス	—	0.6	562			
アウトソーシング	8.1	32.3	56,589			
ウェルネット	10.3	10.9	11,837			
ワールドホールディングス	3.1	3.6	15,588			
ディー・エヌ・エー	61.7	58.4	111,485			
博報堂DYホールディングス	190.9	150.5	212,205			
ぐるなび	19.9	17.1	23,820			
エスアールジータカミヤ	14.8	12.8	7,654			
ジャパンベストレスキューシステム	17	13.4	13,413			
ファンコミュニケーションズ	35	30.1	20,377			
ライク	2.5	4.2	8,761			

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円			
ビジネス・ブレイクスルー	4.4	5	2,320			
WDBホールディングス	4.9	4.9	18,301			
ティア	6.6	5.7	5,580			
CDG	—	1	1,853			
バリューコマース	12.7	9.7	12,939			
インフォマート	58.4	54.8	56,279			
J Pホールディングス	39.6	34	10,098			
エコナックホールディングス	—	21.1	2,637			
E P Sホールディングス	17.1	16.3	33,741			
レグス	3.1	2.7	2,851			
プレステージ・インターナショナル	19.5	22.5	27,315			
アミューズ	7.6	7.2	21,405			
ドリームインキュベータ	4.2	3.6	9,633			
クイック	7	6.7	12,140			
TAC	7.6	6.5	2,112			
ケネディクス	174.6	143.5	94,423			
電通	153.5	132	582,120			
テイクアンドギヴ・ニーズ	6.4	5.1	5,263			
びあ	4.2	3.6	18,288			
イオンファンタジー	4	3.5	17,920			
シーティーエス	7.3	10.7	8,067			
ネクシィーズグループ	4.9	4.2	6,438			
みらかホールディングス	35.2	32.3	134,045			
アルプス技研	5.5	9.5	22,382			
サニックス	22	17.2	4,282			
ダイオーズ	2.5	2.1	2,562			
日本空調サービス	13.2	11.3	8,294			
オリエンタルランド	148.9	128	1,322,240			
ダスキン	35.3	29.1	75,427			
明光ネットワークジャパン	17.1	13.7	17,179			
ファルコホールディングス	6.5	5.6	10,040			
秀英予備校	2.7	2.4	1,192			
田谷	2.3	2	1,408			
ラウンドワン	43	33.6	55,708			
リゾートトラスト	53.3	45.8	101,676			
ビー・エム・エル	18	13.9	36,098			
ワタベウエディング	2	1.7	940			
りらいあコミュニケーションズ	22.8	17.1	21,135			
リソー教育	23.4	18.3	13,523			

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
早稲田アカデミー	1.8	1.5	2,400
ユー・エス・エス	166.7	132.3	276,507
東京個別指導学院	4.4	3.8	4,191
サイバーエージェント	72.5	71.2	378,784
楽天	703.7	555.4	488,918
クリーク・アンド・リバー社	4.9	5.6	5,247
テー・オー・ダブリュー	11	10.3	8,991
セントラルスポーツ	4.7	4	14,620
フルキャストホールディングス	14.2	9.5	23,104
リソルホールディングス	14	1.2	5,340
テクノプロ・ホールディングス	22.4	19.3	120,046
アトラ	1.6	1.8	1,560
インターワークス	2.8	2.4	2,474
Keeper 技研	1.5	3.5	4,497
ファーストロジック	0.7	1.7	1,497
三機サービス	—	1.2	2,186
Gunosy	—	4.9	13,230
デザインワン・ジャパン	1.8	2.1	2,139
イー・ガーディアン	4.5	5.5	21,532
リブセンス	9.2	6.9	3,581
ジャパンマテリアル	10	29.6	38,628
ベクトル	11.2	13	29,042
ウチヤマホールディングス	6.2	5.3	3,174
ライクキッズネクスト	1.3	1.1	2,521
キャリアリンク	3.1	3.5	1,928
IBJ	10.7	8.6	8,600
アサンテ	5.1	3.9	7,823
N・フィールド	6.5	6	11,130
バリューHR	1	2.4	4,204
M&Aキャピタルパートナーズ	1.8	2.2	17,996
ライドオンエクスプレスホールディングス	3.4	4.4	4,628
ERIホールディングス	3.5	3	2,907
アピスト	2.1	1.5	7,425
シグマクシス	—	4.3	7,903
ウィルグループ	5.5	4.7	6,768
エスクロー・エージェント・ジャパン	2.3	14.8	6,334
日本ビューホテル	2.8	3.4	5,028
リクルートホールディングス	300.9	835.7	2,125,602
エラン	1.8	2.6	5,493

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
土木管理総合試験所	1.4	3.3	1,848
日本郵政	359.4	614.7	796,651
ベルシステム24ホールディングス	21	18.1	26,190
鎌倉新書	—	1.5	5,070
一蔵	1	1.4	1,387
LITALICO	—	1.8	2,903
グローバルグループ	—	1.2	1,591
エボラブルアジア	—	2.2	4,721
ストライク	—	1	6,130
ソラスト	6.3	6.5	17,433
セラク	—	1.8	1,263
インソース	—	1.3	5,869
キャリアインデックス	—	1.1	3,105
MS-Japan	—	0.8	5,336
船場	—	1.6	2,019
リログループ	5.2	59.2	168,956
東祥	2.9	6.7	25,795
エイチ・アイ・エス	22.4	16.9	61,262
ラックランド	2.4	2.1	4,767
共立メンテナンス	11.2	19.3	90,613
イテネンホールディングス	14.4	12.1	17,424
建設技術研究所	8.7	7.5	10,440
スペース	7.4	7	9,590
長大	—	3.2	2,566
燦ホールディングス	2.7	2.6	6,585
スバル興業	10	0.7	4,459
東京テアトル	52	4.5	6,336
タナベ経営	2.7	2.1	3,901
ナガワ	2.5	2.2	9,625
よみうりランド	27	2.4	10,656
東京都競馬	94	8.1	29,038
常磐興産	5	4.3	8,277
カナモト	19.2	16.5	56,925
東京ドーム	54.9	43.9	42,451
西尾レントオール	11.1	9.9	31,482
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	68	59	2,065
トランス・コスモス	16	12	32,436
乃村工藝社	29.5	25.3	54,243
藤田観光	45	4.3	12,964



銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
KNT-CTホールディングス	78	6.7	11,242	
日本管財	11.8	11.6	23,780	
トーカイ	6.1	10.5	24,412	
白洋舎	1.3	1.2	3,433	
セコム	143.3	115	866,410	
セントラル警備保障	6.1	5.2	14,409	
丹青社	23.8	22.2	26,595	
メイテック	16.7	12.7	73,660	
アサツー ディ・ケイ	22.4	—	—	
応用地質	13	12.2	17,860	
船井総研ホールディングス	17.7	22.5	47,610	
進学会ホールディングス	5.7	4.9	2,881	

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
オオバ	10.7	8.5	5,244	
いであ	—	2.2	2,252	
学究社	3.6	2.9	4,959	
ベネッセホールディングス	46.1	39.7	148,478	
イオンディライト	15.5	13.3	49,210	
ナック	8.4	7.2	6,825	
ニチイ学館	23.9	20.6	22,763	
ダイセキ	24	18.2	51,815	
ステップ	4.6	4	6,388	
合 計	株 数・金 額	199,465	137,359	270,790,807
	銘柄数<比率>	1,997	2,057	<98.1%>

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

### 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	
		百万円	百万円
		2,941	—

### ○有価証券の貸付及び借入の状況

(2018年3月26日現在)

区 分	当 期 末	
	数	量
貸付有価証券<株式>総株数 (モルガン・スタンレーMUF G証券)		株
		10,155,800
		(10,155,800)

(注) ( )内は利害関係人との貸付状況です。

## ○投資信託財産の構成

(2018年3月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	270,790,807	90.7
コール・ローン等、その他	27,910,416	9.3
投資信託財産総額	298,701,223	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年3月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	298,701,223,842
コール・ローン等	24,444,733,475
株式(評価額)	270,790,807,310
未収入金	2,883,876,020
未収配当金	345,621,575
その他未収収益	35,160,462
差入委託証拠金	201,025,000
(B) 負債	22,743,140,899
未払金	87,201,120
未払解約金	1,174,721,308
未払利息	42,741
受入担保金	21,481,175,730
(C) 純資産総額(A-B)	275,958,082,943
元本	157,232,250,877
次期繰越損益金	118,725,832,066
(D) 受益権総口数	157,232,250,877口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,551円

## ○損益の状況 (2017年3月28日～2018年3月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	6,246,400,125
受取配当金	5,800,274,188
受取利息	269,728
その他収益金	467,057,204
支払利息	△ 21,200,995
(B) 有価証券売買損益	27,754,025,602
売買益	39,662,112,920
売買損	△ 11,908,087,318
(C) 先物取引等取引損益	491,337,220
取引益	1,108,899,340
取引損	△ 617,562,120
(D) 保管費用等	△ 1,257,410
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	34,490,505,537
(F) 前期繰越損益金	107,338,936,430
(G) 追加信託差損益金	99,236,602,513
(H) 解約差損益金	△122,340,212,414
(I) 計(E+F+G+H)	118,725,832,066
次期繰越損益金(I)	118,725,832,066

(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	189,052,090,341円	
期中追加設定元本額	137,884,382,881円	
期中一部解約元本額	169,704,222,345円	
また、1口当たり純資産額は、期末1.7551円です。		
②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）		
ファンド・マネジャー（国内株式）		2,434,058,224円
eMAXIS TOPIXインデックス		12,050,045,926円
eMAXIS バランス（8資産均等型）		1,749,911,004円
eMAXIS バランス（波乗り型）		89,639,930円
コアバランス		758,949円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）		20,347,142円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）		29,938,694円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）		26,640,240円
eMAXIS Slim 国内株式（TOPIX）		1,070,491,276円
国内株式セレクション（ラップ向け）		852,624,468円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）		678,597,316円
つみたて日本株式（TOPIX）		1,295,447,695円
つみたて8資産均等バランス		40,056,671円
つみたて4資産均等バランス		9,535,634円
eMAXIS マイマネージャー 1970s		1,223,458円
eMAXIS マイマネージャー 1980s		1,558,881円
eMAXIS マイマネージャー 1990s		1,982,488円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）		1,567,913円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）		2,098,835円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）		2,406,280円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）		2,496,867,539円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）		4,976,044,809円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）		13,595,824円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）		236,558,098円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）		1,325,165,637円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）		36,975,422円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）		214,885,560円
eMAXIS バランス（4資産均等型）		108,722,958円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）		35,317,536円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）		46,603,032円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）		176,279,827円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）		129,092,138円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）		391,341,406円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）		55,680,200円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）		9,942,321,641円
三菱UFJ バランスファンドVA20型（適格機関投資家限定）		284,087,763円
三菱UFJ バランスファンドVA40型（適格機関投資家限定）		2,875,846,855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）		35,151,381,334円
三菱UFJ バランスファンドVA50型（適格機関投資家限定）		700,592,997円
三菱UFJ バランスファンドVA75型（適格機関投資家限定）		95,175,190円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）		9,099,046円
三菱UFJ バランスファンドVA45型（適格機関投資家限定）		172,922,881円
三菱UFJ バランスファンドVA30型（適格機関投資家限定）		101,489,004円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）		424,893,899円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）		903,702,266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）		2,558,990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）		256,811,961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)	2,477,948,179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)	897,270,772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)	170,647,002円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	28,398,733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)	4,712,373,955円
MUKAM バランス・イノベーション (債券重視型) (適格機関投資家転売制限付)	594,224円
MUKAM 日本株式インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	546,110円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	9,076,178,848円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	6,901,057円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	21,384,401円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	27,778,910円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	24,332,650円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	1,966,786,300円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	388,022,564円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	53,376,909円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	356,572,506円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	31,737,453円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	265,413,272円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,894,823,016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)	480,511,315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)	1,895,252,575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)	1,590,437,180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)	1,292,930,763円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	48,040,360,792円
合計	157,232,250,877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について、該当する記載の整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。

(2017年8月16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)

## 外国株式インデックスマザーファンド

### 《第16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]

「外国株式インデックスマザーファンド」は、5月12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	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円換算ベース) と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をMSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円換算ベース) の動きにできるだけ連動させるため、株式の実質投資比率 (組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。) は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
主 要 運 用 対 象	MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) (円換算ベース) に採用されている株式を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

### ○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイインデックス)		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	(円換算ベース)	(米ドルベース)				
	円	%			%	%	%	百万円
12期(2013年5月13日)	15,535	56.6	114.32	52.4	96.3	1.0	2.3	199,188
13期(2014年5月12日)	18,176	17.0	130.71	14.3	96.7	1.1	2.1	197,280
14期(2015年5月12日)	23,063	26.9	162.29	24.2	96.5	1.2	2.2	227,514
15期(2016年5月12日)	19,726	△14.5	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7	270,065
16期(2017年5月12日)	24,302	23.2	163.31	20.4	92.9	1.9	2.4	332,985

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

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

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイインデックス)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	円	騰 落 率	(円換算ベース)	騰 落 率			
(期 首) 2016年5月12日	19,726	—	135.59	—	94.4	2.8	2.7
5月末	20,571	4.3	140.96	4.0	95.5	1.8	2.7
6月末	18,592	△ 5.7	127.30	△ 6.1	93.7	4.9	2.8
7月末	19,767	0.2	135.16	△ 0.3	94.0	2.6	2.8
8月末	19,706	△ 0.1	134.53	△ 0.8	94.8	3.1	2.7
9月末	19,237	△ 2.5	131.19	△ 3.2	94.0	3.2	2.7
10月末	19,636	△ 0.5	133.57	△ 1.5	95.9	2.0	2.6
11月末	21,454	8.8	145.64	7.4	96.0	1.1	2.5
12月末	22,809	15.6	154.51	14.0	93.2	1.1	2.5
2017年1月末	22,737	15.3	154.07	13.6	93.3	4.2	2.4
2月末	23,181	17.5	156.94	15.7	94.9	2.6	2.5
3月末	23,408	18.7	158.11	16.6	93.7	3.8	2.4
4月末	23,574	19.5	158.70	17.0	94.2	6.0	2.5
(期 末) 2017年5月12日	24,302	23.2	163.31	20.4	92.9	1.9	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

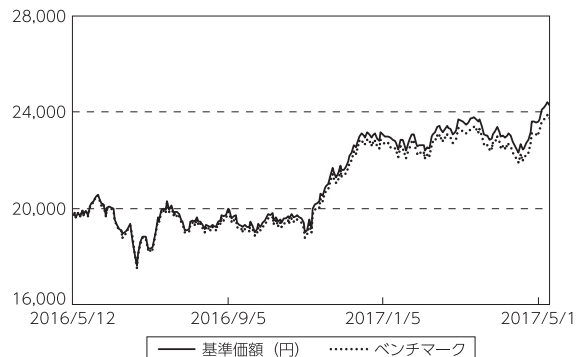
#### ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ23.2%の上昇となりました。

#### ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(20.4%)を2.8%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎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。

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて5.1%の円安・米ドル高、ユーロは円に対してほぼ横ばいとなりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイインデックス) (円換算ベース) に採用されている株式 (先物・不動産投資信託証券 (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

- 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20.4%の上昇となったため、カイ離は2.8%程度となりました。

	組入比率 要因	銘柄選択 要因	その他の 要因	合計
ベンチマーク とのカイ離	0.0%程度	△0.1%程度	2.9%程度	2.8%程度

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.1%程度でした。

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

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

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.9%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入・為替効果等	計 3.0%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料等	計 △0.1%程度

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

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

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

◎今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(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)	( 2 )	(0.011)	
(投資信託証券)	( 0 )	(0.000)	
(先物・オプション)	( 1 )	(0.006)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	6	0.028	(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)	( 6 )	(0.027)	
(投資信託証券)	( 0 )	(0.001)	
(c) そ の 他 費 用	8	0.039	(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)	( 8 )	(0.038)	
(そ の 他)	( 0 )	(0.000)	
合 計	18	0.084	
期中の平均基準価額は、21,222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 155,965 ( 1,811)	千アメリカドル 968,705 ( 1,758)	百株 154,658 ( 1,810)	千アメリカドル 961,284 ( 10,652)
	カナダ	19,522 ( 488)	千カナダドル 80,341 ( —)	17,792	千カナダドル 72,743
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	11,999 ( 1,507)	52,930 (△ 443)	12,065	50,338
	イタリア	31,152 (△ 3,662)	11,637 (△ 343)	29,393	10,272
	フランス	12,675 ( 574)	51,391 (△ 642)	12,341	48,099
	オランダ	10,312 ( 474)	20,624 ( 958)	10,191	20,302
	スペイン	29,650 ( 45,894)	17,901 ( 455)	71,415	17,428
	ベルギー	876 (△ 89)	6,551 (△ 823)	899	6,812
	オーストリア	323 ( —)	979 (△ 11)	294	919
	ルクセンブルク	1,507	2,068	1,316	1,502
	フィンランド	4,303	5,398	4,120	5,272
	アイルランド	16,514	2,793	15,794	2,654
	ポルトガル	1,502	838	37,180	863
	イギリス	292 ( 208)	1,012 ( 522)	317	1,051
	イギリス	149,068 ( 187,486)	千イギリスポンド 86,590 ( 206)	138,662 (186,613)	千イギリスポンド 84,724 ( 1,797)
	スイス	7,784 ( —)	千スイスフラン 51,855 (△ 1,119)	7,748	千スイスフラン 51,965
	スウェーデン	11,140 ( 527)	千スウェーデンクローネ 149,067 ( —)	11,146 ( 200)	千スウェーデンクローネ 144,430 ( 360)
	ノルウェー	3,265 ( —)	千ノルウェークローネ 36,901 (△ 274)	2,858	千ノルウェークローネ 31,680

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	デンマーク	百株 2,544 ( 84)	千デンマーククローネ 75,217 ( -)	百株 2,430	千デンマーククローネ 72,714
	オーストラリア	36,284 ( 334)	千オーストラリアドル 53,043 ( -)	36,080 ( 513)	千オーストラリアドル 51,712 ( 456)
	ニュージーランド	2,010	千ニュージーランドドル 1,023	1,858	千ニュージーランドドル 927
国	香港	46,613 ( 712)	千香港ドル 140,613 ( -)	42,212	千香港ドル 139,624
	シンガポール	24,661 ( 4,185)	千シンガポールドル 10,211 ( -)	28,234 ( 4,185)	千シンガポールドル 9,967 ( 33)
	イスラエル	2,463	千イスラエルシケル 9,045	2,802	千イスラエルシケル 19,434

(注) 金額は受渡代金。

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

## 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
HCP INC	21	684	20	670
MACERICH CO/THE	6	467	7	520
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10	1,082	4	447
PROLOGIS INC	23	1,202	22	1,145
CAMDEN PROPERTY TRUST	3	329	3	308
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	16	710	4	197
DIGITAL REALTY TRUST INC	8	811	6	724
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3	710	3	714
EXTRA SPACE STORAGE INC	7	605	6	515
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3	571	3	552
WELLTOWER INC	16	1,182	15	1,115
BOSTON PROPERTIES INC	7	931	6	902
MID-AMERICA APARTMENT COMM	7	725	4	455
REALTY INCOME CORP	12	779	11	735
REGENCY CENTERS CORP	11	783	6	452
SL GREEN REALTY CORP	5	541	4	520
UDR INC	15	549	15	546
VENTAS INC	17	1,130	15	994
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	65	711	57	624
WEYERHAEUSER CO	33	1,093	36	1,151
AMERICAN TOWER CORP	19	2,172	18	2,167
AGNC INVESTMENT CORP	16	319	16	325
VEREIT INC	60	557	52	473
DUKE REALTY CORP	19	495	18	491
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	24	615	14	331
IRON MOUNTAIN INC	16	602	13	485
EQUINIX INC	3	1,386	2	1,093
CROWN CASTLE INTL CORP	17	1,639	15	1,412
QUALITY CARE PROPERTIES	—	—	7	98
	( 7)	( —)		
PARK HOTELS & RESORTS INC	—	—	11	331
	( 11)	( 277)		
EQUITY RESIDENTIAL	16	1,087	16	1,031
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	61	886	16	220
GGP INC	25	663	25	645
HOST HOTELS & RESORTS INC	34	620	35	622
LIBERTY PROPERTY TRUST	7	295	7	286
PUBLIC STORAGE	6	1,530	6	1,470
SIMON PROPERTY GROUP INC	14	2,679	13	2,500
VORNADO REALTY TRUST	7	798	7	778
KIMCO REALTY CORP	21	561	19	494

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
AVALONBAY COMMUNITIES INC	6	1,104	5	1,070
小 計	680 ( 19)	33,618 ( 277)	583	29,628
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	4	139	3	127
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	4	102	3	79
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4	129	4	120
小 計	13	371	11	327
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
GECINA SA	2	314	1	228
KLEPIERRE	10	388	10	395
UNIBAIL-RODAMCO SE	4	1,030	4	981
FONCIERE DES REGIONS	1 ( -)	122 (△ 2)	1	114
ICADE	1	97	1	69
小 計	20 ( -)	1,953 (△ 2)	19	1,789
ユ ー ロ 計	20 ( -)	1,953 (△ 2)	19	1,789
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	54	353	52	327
HAMMERSON PLC	39	226	37	211
LAND SECURITIES GROUP PLC	40	436	41	432
INTU PROPERTIES PLC	46	133	42	118
SEGRO PLC	52	240	30	138
SEGRO PLC -RTS	- ( 15)	- ( -)	15	14
小 計	234 ( 15)	1,390 ( -)	220	1,244
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	162	493	156	466
SCENTRE GROUP	243	1,098	236	1,059
GPT GROUP	82	424	88	458
MIRVAC GROUP	200	429	214	467
STOCKLAND	139	640	131	608
WESTFIELD CORP	92	872	91	858
DEXUS	46	435	45	432
GOODMAN GROUP	91	665	90	679
小 計	1,059	5,060	1,056	5,031
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	108	5,716	105	5,647
小 計	108	5,716	105	5,647

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	94 ( - )	163 (△ 1)	88	155
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	118	178	106	160
	CAPITALAND MALL TRUST	116	232	113	227
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	105 ( - )	257 (△ 1)	94	237
小計		435 ( - )	832 (△ 3)	403	781

(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 247,123	百万円 250,771	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	322,887,241千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	286,537,329千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.12

(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	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 261,252	百万円 90,463	% 34.6	百万円 268,893	百万円 180,086	% 67.0

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

## ○組入資産の明細

(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	1,083	—	—	—	素材
AMERICAN EXPRESS CO	692	653	5,088	579,835	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	1,233	1,444	6,335	721,910	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	274	274	1,544	176,015	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	44	46	713	81,276	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	381	379	3,659	416,930	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	58	61	246	28,125	小売
AES CORP	566	549	630	71,830	公益事業
AFLAC INC	352	342	2,532	288,523	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,022	861	5,325	606,800	保険
APACHE CORP	313	319	1,629	185,687	エネルギー
ADVANCED MICRO DEVICES	—	671	742	84,634	半導体・半導体製造装置
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	50	44	1,104	125,885	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	516	520	6,287	716,441	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	169	173	2,489	283,702	素材
ANTHEM INC	215	221	4,041	460,539	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	421	469	2,421	275,906	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,112	1,144	3,018	343,939	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	472	411	2,318	264,191	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	526	492	9,057	1,031,957	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	174	178	3,300	376,078	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	256	238	1,238	141,114	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,380	1,403	7,736	881,550	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	101	101	3,902	444,705	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,367	3,420	15,741	1,793,634	電気通信サービス
CR BARD INC	61	61	1,905	217,087	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	108	142	1,140	129,918	素材
BAKER HUGHES INC	361	337	2,001	228,077	エネルギー
ALLSTATE CORP	319	309	2,594	295,617	保険
AVERY DENNISON CORP	75	75	632	72,012	素材
CHUBB LTD	380	389	5,349	609,573	保険
ANALOG DEVICES INC	258	306	2,402	273,691	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	25	24	1,692	192,899	小売
CVS HEALTH CORP	916	894	7,360	838,620	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ENTERPRISES	178	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	978	801	2,307	262,947	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	3,045	3,001	26,163	2,981,090	銀行
CIGNA CORP	212	215	3,531	402,338	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	481	491	4,966	565,915	資本財
COCA-COLA CO/THE	3,417	3,436	15,009	1,710,128	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	440	405	3,251	370,488	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	153	165	952	108,534	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	807	787	4,103	467,567	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	166	—	—	—	メディア
CHEVRON CORP	1,557	1,584	16,826	1,917,190	エネルギー
COACH INC	229	237	1,085	123,634	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	108	135	1,411	160,834	資本財
CONOCOPHILLIPS	1,022	1,039	4,930	561,796	エネルギー
CME GROUP INC	265	284	3,326	378,984	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	271	269	1,960	223,326	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	705	709	5,083	579,248	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC	495	528	4,101	467,337	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE	930	941	5,821	663,268	素材
DEVON ENERGY CORP	381	396	1,504	171,473	エネルギー
DEERE & CO	258	225	2,555	291,181	資本財
DANAHER CORP	509	522	4,326	492,932	ヘルスケア機器・サービス
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	724	729	5,761	656,435	素材
WALT DISNEY CO/THE	1,299	1,268	13,898	1,583,591	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC	94	95	844	96,265	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	571	579	4,813	548,403	公益事業
DR HORTON INC	280	293	975	111,166	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC	74	69	350	39,956	小売
TARGET CORP	483	448	2,513	286,439	小売
DUN & BRADSTREET CORP	29	29	326	37,194	商業・専門サービス
DAVITA INC	140	132	889	101,304	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	128	129	1,030	117,424	資本財
DTE ENERGY COMPANY	150	153	1,603	182,685	公益事業
EXXON MOBIL CORP	3,444	3,479	28,745	3,275,230	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	178	179	1,982	225,850	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	455	483	4,557	519,248	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	541	540	3,144	358,268	資本財
EXELON CORP	763	778	2,609	297,339	公益事業
ECOLAB INC	219	220	2,797	318,696	素材
EQUIFAX INC	98	100	1,361	155,146	商業・専門サービス
EMC CORP/MA	1,603	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	183	187	1,738	198,119	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	382	379	2,926	333,492	資本財
EDISON INTERNATIONAL	271	276	2,168	247,091	公益事業
ENTERGY CORP	149	152	1,146	130,644	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	35	34	848	96,692	保険
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	49	46	337	38,467	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC	382	393	5,292	603,050	公益事業
MACY'S INC	260	250	608	69,366	小売
FEDEX CORP	222	212	4,048	461,262	運輸
FMC TECHNOLOGIES INC	189	—	—	—	エネルギー
FORD MOTOR CO	3,065	3,120	3,435	391,495	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	322	309	1,338	152,543	各種金融
FOOT LOCKER INC	114	109	830	94,618	小売
FIRSTENERGY CORP	353	357	1,029	117,307	公益事業
FLUOR CORP	117	118	565	64,390	資本財
FREEMPORT-MCMORAN INC	957	1,083	1,265	144,226	素材
GENERAL MILLS INC	494	497	2,800	319,083	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	222	217	4,237	482,865	資本財
WW GRAINGER INC	46	46	877	99,933	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	7,808	7,422	21,428	2,441,516	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	111	128	1,132	128,998	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	124	123	1,134	129,310	小売
TEGNA INC	174	173	401	45,693	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	222	214	757	86,273	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	200	201	520	59,280	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	317	300	6,759	770,144	各種金融
HALLIBURTON CO	708	725	3,310	377,235	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	605	607	8,012	912,992	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	159	146	812	92,600	自動車・自動車部品
HP INC	1,487	1,439	2,773	316,003	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	338	317	1,574	179,441	保険
HERSHEY CO/THE	122	120	1,285	146,424	食品・飲料・タバコ
HARMAN INTERNATIONAL	58	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HOME DEPOT INC	1,048	1,022	15,971	1,819,787	小売
HASBRO INC	92	93	945	107,784	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	215	217	1,926	219,559	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	762	757	11,417	1,300,957	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	325	329	1,733	197,481	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	270	265	3,669	418,109	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	336	326	800	91,157	メディア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	66	65	854	97,370	素材
JOHNSON & JOHNSON	2,288	2,282	28,126	3,204,726	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC	535	—	—	—	自動車・自動車部品
KANSAS CITY SOUTHERN	90	88	805	91,735	運輸
KELLOGG CO	219	222	1,571	179,098	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	300	301	3,860	439,919	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,314	1,296	5,790	659,792	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	765	753	2,293	261,343	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	160	153	569	64,848	小売
ELI LILLY & CO	825	834	6,693	762,609	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	83	85	1,212	138,194	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	137	128	747	85,223	運輸
LENNAR CORP-A	148	167	856	97,546	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	758	730	6,188	705,081	小売
LEGGETT & PLATT INC	112	113	604	68,826	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	204	201	1,026	116,908	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	329	367	2,110	240,503	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	228	221	6,027	686,816	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	204	193	1,309	149,226	保険
L3 TECHNOLOGIES INC	64	64	1,078	122,923	資本財
LEGG MASON INC	82	—	—	—	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	170	279	2,870	327,056	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	759	697	10,053	1,145,457	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	223	218	2,996	341,450	各種金融
MEDTRONIC PLC	1,169	1,168	9,702	1,105,526	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	2,310	2,314	14,909	1,698,823	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	899	875	2,540	289,441	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	280	278	625	71,232	耐久消費財・アパレル
3M CO	509	504	9,928	1,131,196	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	132	124	1,064	121,253	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	373	382	1,183	134,868	消費者サービス
MASCO CORP	279	274	1,004	114,478	資本財
MONSANTO CO	363	367	4,263	485,793	素材
M & T BANK CORP	118	117	1,858	211,798	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	431	433	3,190	363,541	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	52	52	1,233	140,566	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	1,201	1,180	5,061	576,740	各種金融
MCKESSON CORP	190	189	2,767	315,287	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	781	784	4,046	461,062	保険
MANPOWERGROUP INC	60	57	591	67,404	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	147	145	1,680	191,502	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	247	245	2,865	326,440	運輸
BANK OF AMERICA CORP	8,614	8,478	20,408	2,325,324	銀行
NISOURCE INC	—	280	677	77,204	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	143	140	3,484	397,005	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	402	415	542	61,763	銀行
NEWMONT MINING CORP	437	447	1,498	170,719	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	966	889	2,535	288,906	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	96	94	946	107,841	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	11	11	1,119	127,561	保険
NUCOR CORP	264	267	1,540	175,515	素材
NEWELL BRANDS INC	367	366	1,958	223,134	耐久消費財・アパレル
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	366	368	1,044	119,003	メディア
NOBLE ENERGY INC	355	390	1,222	139,335	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	632	642	3,925	447,224	エネルギー
OMNICOM GROUP	200	199	1,672	190,547	メディア
PEPSICO INC	1,205	1,203	13,602	1,549,888	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	80	79	818	93,281	素材
ALTRIA GROUP INC	1,622	1,635	11,530	1,313,732	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	94	93	791	90,143	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	2,249	2,144	18,479	2,105,524	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	419	408	4,968	566,133	銀行
PFIZER INC	5,106	5,092	16,824	1,916,949	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	371	361	3,892	443,476	保険
PULTEGROUP INC	260	253	582	66,388	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP	112	112	1,790	204,011	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	133	142	2,439	277,967	エネルギー
CITIGROUP INC	2,465	2,390	14,513	1,653,618	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	242	241	1,533	174,760	保険
PPG INDUSTRIES INC	222	222	2,387	272,061	素材
PENTAIR PLC	149	146	953	108,621	資本財
PRAXAIR INC	235	240	3,100	353,254	素材
P G & E CORP	408	427	2,814	320,731	公益事業
PPL CORP	560	576	2,221	253,129	公益事業
PROGRESSIVE CORP	482	488	1,965	223,896	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	421	429	1,835	209,124	公益事業
STARWOOD HOTELS & RESORTS	145	—	—	—	消費者サービス
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	145	144	1,563	178,144	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	248	246	3,920	446,645	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	200	201	1,277	145,508	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	1,078	1,037	1,470	167,596	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	36	34	470	53,582	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	83	85	1,910	217,699	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	345	345	948	108,073	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	109	109	518	59,125	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	109	108	1,694	193,072	資本財
SCHLUMBERGER LTD	1,152	1,166	8,369	953,650	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	
STRYKER CORP	279	282	3,815	434,730	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	980	1,002	4,011	457,064	各種金融
SEMPRA ENERGY	196	201	2,239	255,122	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	65	66	2,222	253,252	素材
ST JUDE MEDICAL INC	234	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	123	127	1,759	200,433	資本財
SUNTRUST BANKS INC	420	412	2,348	267,633	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	251	238	2,871	327,137	保険
SOUTHERN CO/THE	755	826	4,114	468,770	公益事業
AT&T INC	5,089	5,150	19,798	2,255,817	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	189	240	2,153	245,409	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	333	324	2,686	306,129	各種金融
SYSCO CORP	466	436	2,403	273,804	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	163	158	684	77,988	素材
SCANA CORP	114	113	746	85,028	公益事業
TEXAS INSTRUMENTS INC	839	838	6,743	768,323	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	106	103	948	108,108	小売
TORCHMARK CORP	101	96	728	83,015	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	349	787	3,299	375,986	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	330	332	5,678	647,014	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	226	224	1,089	124,106	資本財
UNION PACIFIC CORP	706	691	7,614	867,597	運輸
UNUM GROUP	201	192	889	101,369	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	696	656	7,961	907,124	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	788	807	13,997	1,594,914	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,446	1,424	7,356	838,232	銀行
MARATHON OIL CORP	682	701	1,015	115,679	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	576	579	6,030	687,126	運輸
VALERO ENERGY CORP	398	380	2,527	287,964	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	80	79	769	87,659	ヘルスケア機器・サービス
VALSPAR CORP/THE	—	62	696	79,331	素材
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	359	330	2,074	236,413	メディア
VF CORP	282	279	1,531	174,521	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	110	111	1,433	163,289	素材
WILLIAMS COS INC	590	686	2,079	236,940	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	720	772	6,602	752,257	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	264	268	1,625	185,208	公益事業
WAL-MART STORES INC	1,325	1,296	9,868	1,124,399	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO	4,013	4,002	21,509	2,450,778	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	369	372	2,699	307,574	商業・専門サービス
WATERS CORP	67	68	1,177	134,180	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	731	796	407	46,476	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	64	62	1,160	132,227	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	754	733	519	59,146	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XL GROUP PLC	244	—	—	—	保険
XCEL ENERGY INC	424	431	1,947	221,949	公益事業
KEYCORP	684	910	1,660	189,232	銀行
CARMAX INC	168	158	938	106,948	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	156	168	2,039	232,413	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	139	132	495	56,413	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	356	294	2,034	231,771	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	553	547	4,350	495,696	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	271	258	828	94,387	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	106	108	1,435	163,528	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	121	118	1,020	116,322	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	—	238	785	89,461	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	341	293	1,821	207,486	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	233	263	2,199	250,584	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	358	347	1,302	148,417	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	244	258	2,053	233,928	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	656	635	1,553	176,956	銀行
STERICYCLE INC	70	72	616	70,228	商業・専門サービス
INTEL CORP	3,903	3,974	14,184	1,616,237	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	4,199	4,212	14,167	1,614,292	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	75	69	850	96,939	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	105	103	1,327	151,243	不動産
COSTCO WHOLESALE CORP	361	366	6,279	715,477	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	993	908	3,948	449,922	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	257	253	2,755	313,954	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	244	244	1,419	161,730	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	558	525	1,653	188,429	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	337	333	2,177	248,112	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	177	182	1,445	164,707	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	1,121	1,122	6,085	693,414	耐久消費財・アパレル
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	6	12	140	15,976	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	624	624	9,990	1,138,364	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	145	147	1,044	118,984	銀行
NORTHERN TRUST CORP	181	180	1,634	186,237	各種金融
MICROSOFT CORP	6,278	6,198	42,433	4,834,911	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	73	73	884	100,799	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	140	142	1,083	123,482	ヘルスケア機器・サービス
STAPLES INC	538	549	518	59,088	小売
STARBUCKS CORP	1,227	1,221	7,359	838,494	消費者サービス
ORACLE CORP	2,646	2,583	11,665	1,329,193	ソフトウェア・サービス
WHOLE FOODS MARKET INC	282	263	975	111,121	食品・生活必需品小売り
NETFLIX INC	336	360	5,712	650,883	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	81	79	2,038	232,290	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	423	499	2,787	317,588	ソフトウェア・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	158	156	1,604	182,771	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	68	67	1,183	134,904	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	111	111	672	76,590	小売
LAM RESEARCH CORP	130	137	2,055	234,226	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	67	67	823	93,853	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	2,054	3,999	15,702	1,789,112	メディア
XILINX INC	212	211	1,366	155,729	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	292	295	1,903	216,897	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	199	192	1,209	137,808	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	—	60	824	93,973	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	1,192	1,105	7,372	840,048	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	127	129	1,131	128,890	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	30	32	2,751	313,459	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	207	205	2,604	296,810	ソフトウェア・サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	205	234	448	51,107	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	268	273	1,565	178,316	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	741	762	3,788	431,702	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	72	73	317	36,211	ヘルスケア機器・サービス
SIGNATURE BANK	42	45	634	72,323	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	57	109	1,152	131,298	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	187	167	1,602	182,600	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	208	208	630	71,885	メディア
SALESFORCE.COM INC	522	541	4,753	541,557	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	114	110	512	58,380	小売
ALPHABET INC-CL A	240	248	23,752	2,706,406	ソフトウェア・サービス
UNITED THERAPEUTICS CORP	37	35	439	50,067	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B/E AEROSPACE INC	87	—	—	—	資本財
GARMIN LTD	94	100	526	59,969	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	207	205	733	83,623	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	1,243	1,239	6,775	771,988	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	199	208	908	103,461	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	129	125	936	106,686	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP	197	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	235	235	1,074	122,429	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	329	338	32,120	3,659,812	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	206	204	1,456	165,904	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	118	115	1,241	141,462	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	128	131	1,313	149,660	半導体・半導体製造装置
E*TRADE FINANCIAL CORP	242	225	788	89,801	各種金融
CERNER CORP	254	257	1,664	189,619	ヘルスケア機器・サービス
BROADCOM LTD	321	337	7,803	889,124	半導体・半導体製造装置
ALKERMES PLC	124	124	715	81,468	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	83	77	694	79,185	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	250	257	1,517	172,884	電気通信サービス
WASTE CONNECTIONS INC	101	147	1,347	153,573	商業・専門サービス
EBAY INC	893	893	3,047	347,216	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	445	452	5,725	652,394	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	184	198	1,618	184,436	小売
PRICELINE GROUP INC/THE	41	41	7,511	855,890	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	980	1,026	16,766	1,910,321	各種金融
BB&T CORP	670	681	2,932	334,157	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	903	888	4,167	474,837	各種金融
BORGWARNER INC	185	174	730	83,182	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	194	177	469	53,504	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	97	97	1,214	138,367	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC	661	647	6,397	728,978	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP	161	137	1,224	139,518	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	54	47	489	55,742	保険
AETNA INC	288	294	4,254	484,801	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	204	205	1,119	127,517	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	408	415	2,805	319,649	公益事業
AON PLC	226	221	2,748	313,209	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	493	483	2,033	231,753	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	78	76	485	55,277	保険
HESS CORP	232	237	1,178	134,321	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	288	283	867	98,840	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	221	217	822	93,711	各種金融
RED HAT INC	151	151	1,345	153,288	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	58	55	726	82,732	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	186	188	1,164	132,661	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	147	148	738	84,153	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	242	230	924	105,374	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	138	142	1,659	189,067	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	342	369	581	66,212	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	184	182	4,639	528,654	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	121	123	2,244	255,757	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC	412	417	5,692	648,656	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	203	208	2,403	273,897	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	—	768	2,457	280,018	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC	137	127	468	53,349	小売
CELGENE CORP	650	650	7,774	885,857	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	503	509	3,275	373,184	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	559	517	3,141	357,917	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	154	154	820	93,466	運輸
FASTENAL CO	227	239	1,078	122,933	資本財
FISERV INC	189	183	2,199	250,630	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	462	442	719	81,926	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,745	1,401	676	77,104	メディア
SANDISK CORP	166	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	4,612	4,475	68,893	7,849,678	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	128	128	893	101,818	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	659	915	1,171	133,477	銀行
COSTAR GROUP INC	—	27	682	77,795	ソフトウェア・サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	186	188	2,241	255,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHLAND INC	52	—	—	—	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	118	121	846	96,394	運輸
CENTURYLINK INC	454	454	1,111	126,656	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	114	118	442	50,441	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	345	383	1,510	172,109	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	173	174	895	102,013	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC	709	717	4,679	533,223	食品・飲料・タバコ
SEAGATE TECHNOLOGY	247	244	1,037	118,172	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	117	114	802	91,462	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	60	60	886	101,007	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC	311	313	1,059	120,753	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	143	149	2,666	303,801	食品・飲料・タバコ
NEWFIELD EXPLORATION CO	—	170	589	67,179	エネルギー
COOPER COS INC/THE	40	40	834	95,044	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	132	147	834	95,086	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	255	261	1,896	216,034	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	81	83	549	62,652	保険
AGCO CORP	55	51	328	37,408	資本財
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	122	123	325	37,071	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP	117	336	1,610	183,493	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA INC	102	103	1,450	165,316	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	193	200	546	62,246	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	495	508	1,503	171,337	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC	144	133	1,698	193,524	各種金融
TESORO CORP	99	96	791	90,216	エネルギー
FNF GROUP	207	209	846	96,474	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	98	500	2,954	336,669	各種金融
NASDAQ INC	94	96	645	73,504	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	149	145	304	34,730	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	288	288	994	113,303	メディア
AUTOLIV INC	72	72	739	84,248	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	249	251	877	99,931	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	25	24	1,179	134,367	消費者サービス
IHS INC-CLASS A	56	—	—	—	商業・専門サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	95	173	863	98,343	食品・飲料・タバコ
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	367	341	809	92,232	小売
ARROW ELECTRONICS INC	77	76	587	66,933	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	139	134	2,138	243,689	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	101	101	552	62,917	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP	271	266	675	76,991	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	46	50	1,173	133,652	素材
RANGE RESOURCES CORP	140	161	409	46,688	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO	315	432	323	36,831	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	78	78	924	105,294	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	48	48	387	44,180	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	96	191	755	86,081	公益事業
OCEANEERING INTL INC	80	—	—	—	エネルギー
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	96	89	861	98,132	消費者サービス
HANESBRANDS INC	324	322	719	81,935	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A	819	807	9,413	1,072,537	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	418	400	779	88,779	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	76	133	597	68,132	資本財
AVNET INC	109	104	391	44,571	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	263	284	673	76,744	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	80	150	323	36,865	消費者サービス
SPECTRA ENERGY CORP	556	—	—	—	エネルギー
TRANSDIGM GROUP INC	44	44	1,081	123,201	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	—	98	693	79,056	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	108	109	1,559	177,641	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	253	291	500	56,970	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	319	299	2,291	261,145	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	353	332	2,005	228,452	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	93	92	506	57,709	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	45	44	522	59,571	資本財
MERCADOLIBRE INC	—	33	926	105,607	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A	65	57	538	61,356	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	234	242	1,114	126,971	保険
TIME WARNER CABLE	234	—	—	—	メディア
SEATTLE GENETICS INC	—	85	527	60,133	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ULTA BEAUTY INC	50	49	1,492	170,004	小売
LQK CORP	252	253	785	89,467	小売
HORMEL FOODS CORP	240	238	820	93,465	食品・飲料・タバコ
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	—	66	519	59,212	運輸
EASTMAN CHEMICAL CO	123	121	946	107,817	素材
GAMESTOP CORP-CLASS A	85	—	—	—	小売
HARRIS CORP	103	105	1,149	130,976	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	122	125	2,889	329,248	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP	135	130	350	39,910	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	262	—	—	—	公益事業
INVESCO LTD	350	339	1,090	124,243	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	133	144	1,288	146,768	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	115	115	593	67,616	各種金融
TERADATA CORP	113	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	137	140	816	93,079	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	107	122	1,627	185,392	エネルギー
MSCI INC	81	75	737	83,985	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	76	82	344	39,293	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	153	158	1,483	169,051	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,281	1,302	14,479	1,649,743	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,610	1,566	14,429	1,644,138	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	156	154	1,401	159,676	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N.V.	34	37	404	46,080	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP	380	383	950	108,324	エネルギー
FLOWSERVE CORP	108	111	546	62,310	資本財
HELMERICH & PAYNE	89	92	538	61,409	エネルギー
T-MOBILE US INC	237	243	1,599	182,255	電気通信サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	62	69	475	54,199	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	228	185	476	54,237	メディア
RESMED INC	115	115	787	89,698	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	69	76	860	98,006	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	197	193	1,155	131,680	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	101	101	968	110,377	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	108	214	1,085	123,711	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	76	77	663	75,600	運輸
PERRIGO CO PLC	121	118	894	101,961	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUANTA SERVICES INC	129	—	—	—	資本財
FMC CORP	110	110	812	92,631	素材
WABTEC CORP	79	73	592	67,505	資本財
EVERSOURCE ENERGY	265	270	1,607	183,105	公益事業
NETSUITE INC	32	—	—	—	ソフトウェア・サービス
INGREDION INC	—	59	701	79,930	食品・飲料・タバコ
ALLERGAN PLC	326	314	7,274	828,883	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRGAS INC	53	—	—	—	素材
CROWN HOLDINGS INC	116	114	649	73,987	素材
CALPINE CORP	285	272	339	38,682	公益事業
EATON VANCE CORP	95	96	431	49,190	各種金融
DELTA AIR LINES INC	165	156	778	88,752	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	163	155	1,379	157,230	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC	151	150	1,142	130,129	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	133	131	1,032	117,653	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	243	237	1,708	194,671	小売
FORTINET INC	121	125	491	55,957	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	79	69	538	61,357	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	22	22	1,231	140,317	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	141	167	780	88,960	銀行
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	970	1,035	124	14,158	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO	1,169	1,155	3,940	449,010	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	112	247	2,639	300,738	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	315	291	2,386	271,942	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	—	38	743	84,680	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	270	252	2,155	245,601	ヘルスケア機器・サービス
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	321	—	—	—	運輸
HOLLYFRONTIER CORP	144	134	374	42,640	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	441	444	2,333	265,884	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	87	91	735	83,767	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	132	126	798	90,984	資本財
DEXCOM INC	—	73	503	57,341	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP	—	49	658	75,030	資本財
XYLEM INC	148	147	748	85,266	資本財
TRIPADVISOR INC	97	96	441	50,347	小売
MEDIVATION INC	140	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	50	49	765	87,256	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	120	130	1,186	135,236	銀行
ALLEGHANY CORP	12	13	757	86,296	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	63	65	2,872	327,240	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	441	394	3,137	357,536	エネルギー
FACEBOOK INC-A	1,878	1,964	29,475	3,358,439	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP	235	237	1,072	122,196	公益事業
ALBEMARLE CORP	92	93	1,036	118,063	素材
PVH CORP	68	68	693	79,039	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A	95	—	—	—	ソフトウェア・サービス
KINDER MORGAN INC	1,570	1,595	3,208	365,584	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	286	298	1,214	138,391	商業・専門サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	231	228	1,983	226,010	自動車・自動車部品
CHARTER COMMUNICATION-A	69	—	—	—	メディア
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	141	145	580	66,184	資本財
SPLUNK INC	106	110	745	84,989	ソフトウェア・サービス
OGE ENERGY CORP	169	165	558	63,690	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	51	49	454	51,798	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	1,352	1,363	8,904	1,014,601	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC	81	108	3,494	398,180	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	186	166	782	89,193	エネルギー
REALOGY HOLDINGS CORP	122	—	—	—	不動産
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	106	105	790	90,120	各種金融
ZOETIS INC	392	396	2,364	269,464	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC	96	92	425	48,492	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	314	305	387	44,102	メディア
SPRINT CORP	644	681	536	61,113	電気通信サービス
TECO ENERGY INC	197	—	—	—	公益事業
SNAP-ON INC	48	47	814	92,799	資本財
AGL RESOURCES INC	102	—	—	—	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	152	139	518	59,075	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	481	474	872	99,433	ソフトウェア・サービス
VANTIV INC - CL A	130	133	834	95,113	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	93	101	903	102,927	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	125	140	1,355	154,424	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	75	74	912	103,970	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	76	—	—	—	資本財
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	65	78	1,069	121,913	ソフトウェア・サービス
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	158	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL C	257	260	24,256	2,763,738	ソフトウェア・サービス
IMS HEALTH HOLDINGS INC	137	—	—	—	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	300	257	368	42,020	各種金融
ENDO INTERNATIONAL PLC	178	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED RENTALS INC	77	69	798	90,967	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	133	112	525	59,836	運輸
VOYA FINANCIAL INC	177	166	607	69,224	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	36	—	—	—	素材
ANTERO RESOURCES CORP	67	136	286	32,627	エネルギー
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	77	125	1,046	119,219	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	360	347	654	74,581	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	408	164	1,022	116,551	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	112	105	657	74,948	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	73	740	84,324	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C	—	88	751	85,638	メディア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	133	130	689	78,611	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	67	76	877	100,015	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIGNET JEWELERS LTD	62	51	316	36,115	小売
SYNCHRONY FINANCIAL	689	694	1,869	213,054	各種金融
QORVO INC	116	109	731	83,349	半導体・半導体製造装置
IONIS PHARMACEUTICALS INC	99	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	146	151	833	94,976	保険
ACUITY BRANDS INC	36	37	709	80,876	資本財
JONES LANG LASALLE INC	37	36	424	48,387	不動産
ARAMARK	188	190	705	80,410	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	435	430	1,591	181,324	銀行
LEAR CORP	62	57	836	95,361	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	63	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHITEWAVE FOODS CO	146	—	—	—	食品・飲料・タバコ
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	119	186	584	66,602	素材
RITE AID CORP	857	910	365	41,607	食品・生活必需品小売り
TARGA RESOURCES CORP	—	155	788	89,875	エネルギー
BAXALTA INC	588	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLUMBIA PIPELINE GROUP	322	—	—	—	エネルギー
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	—	95	196	22,381	メディア
WESTROCK CO	223	208	1,131	128,944	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	502	510	4,560	519,624	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	909	911	4,532	516,403	ソフトウェア・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	42	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	83	93	402	45,842	ソフトウェア・サービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,492	1,401	2,643	301,214	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOBILEYE NV	65	147	906	103,275	ソフトウェア・サービス
AMERCO	6	6	222	25,321	運輸
CDW CORP/DE	119	119	713	81,244	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDNAX INC	77	79	440	50,210	ヘルスケア機器・サービス
SABRE CORP	172	181	445	50,755	ソフトウェア・サービス
FIRST DATA CORP- CLASS A	—	277	455	51,856	ソフトウェア・サービス
WR GRACE & CO	59	60	419	47,827	素材
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	143	162	315	35,901	耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	167	169	621	70,839	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	74	79	292	33,356	メディア
DOMINO'S PIZZA INC	—	41	801	91,272	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	—	181	5,904	672,739	メディア
IDEXX LABORATORIES INC	—	76	1,240	141,296	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等		
		株 数	株 数		評 価 額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
SMITH (A. O.) CORP	—	121	654	74,600	資本財	
UGI CORP	—	146	717	81,745	公益事業	
WESTAR ENERGY INC	—	119	618	70,424	公益事業	
FORTIVE CORP	—	263	1,646	187,648	資本財	
IHS MARKIT LTD	—	299	1,301	148,244	商業・専門サービス	
XL GROUP LTD	—	222	929	105,937	保険	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	—	187	1,236	140,837	ソフトウェア・サービス	
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	—	53	648	73,917	素材	
COTY INC-CL A	—	397	779	88,808	家庭用品・パーソナル用品	
ARCONIC INC	—	364	992	113,065	資本財	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	—	186	594	67,774	エネルギー	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	—	53	659	75,153	保険	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	—	23	299	34,081	家庭用品・パーソナル用品	
TELEFLEX INC	—	36	697	79,526	ヘルスケア機器・サービス	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	—	135	439	50,127	電気通信サービス	
ENVISION HEALTHCARE CORP	—	100	577	65,769	ヘルスケア機器・サービス	
TECHNIPPMC PLC	—	368	1,162	132,399	エネルギー	
DXC TECHNOLOGY CO	—	238	1,896	216,101	ソフトウェア・サービス	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	480	970	744	84,880	不動産	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	—	190	801	91,270	資本財	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	200	210	1,375	156,676	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	260,387	261,696	1,765,170	201,123,523	
	銘柄 数 < 比 率 >	596	596	—	< 60.4% >	
(カナダ)				千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA	1,228	1,246	11,556	960,704	銀行	
IMPERIAL OIL LTD	247	250	988	82,153	エネルギー	
THOMSON REUTERS CORP	286	273	1,645	136,825	各種金融	
TRANSCANADA CORP	588	730	4,627	384,681	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	301	308	1,918	159,513	電気通信サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	506	518	2,410	200,407	保険	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	470	466	1,155	96,071	素材	
BARRICK GOLD CORP	965	985	2,252	187,266	素材	
BCE INC	120	132	809	67,298	電気通信サービス	
AGRIUM INC	109	108	1,347	112,036	素材	
BOMBARDIER INC-B	1,596	1,707	377	31,360	資本財	
BANK OF MONTREAL	530	542	5,120	425,693	銀行	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	733	752	3,921	326,009	各種金融	
BANK OF NOVA SCOTIA	995	1,013	7,677	638,232	銀行	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	268	283	533	44,346	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAE INC	218	215	462	38,408	資本財	
CAMECO CORP	330	348	468	38,967	エネルギー	
CI FINANCIAL CORP	195	207	553	45,996	各種金融	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	328	333	3,572	297,003	銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	907	929	3,940	327,600	エネルギー	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	659	645	6,533	543,158	運輸	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	59	56	875	72,803	小売	
ENBRIDGE INC	760	1,371	7,508	624,220	エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	18	19	1,151	95,715	保険	
CGI GROUP INC - CLASS A	183	183	1,217	101,210	ソフトウェア・サービス	
HUSKY ENERGY INC	292	281	455	37,830	エネルギー	
IGM FINANCIAL INC	80	86	340	28,310	各種金融	
LOBLAW COMPANIES LTD	188	184	1,418	117,916	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	1,631	1,661	3,973	330,284	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	335	322	1,969	163,738	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	284	284	1,503	125,009	銀行
ONEX CORPORATION	71	68	682	56,720	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	691	700	1,567	130,289	素材
POWER CORP OF CANADA	310	314	937	77,969	保険
POWER FINANCIAL CORP	208	204	674	56,030	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	337	357	1,024	85,203	メディア
SUNCOR ENERGY INC	1,310	1,402	6,059	503,721	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	43	41	502	41,813	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	120	117	2,503	208,092	運輸
ENCANA CORP	699	803	1,249	103,868	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	180	185	1,205	100,194	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	145	133	355	29,564	資本財
GOLDCORP INC	687	729	1,409	117,203	素材
KINROSS GOLD CORP	1,019	995	559	46,485	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	124	126	672	55,901	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC	247	246	845	70,266	保険
METHANEX CORP	73	71	409	34,055	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	849	869	314	26,150	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	70	71	155	12,925	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	192	179	699	58,137	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	211	208	924	76,824	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	424	404	518	43,122	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELUS CORP	116	116	530	44,126	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	571	586	717	59,674	素材
YAMANA GOLD INC	785	824	304	25,344	素材
FORTIS INC	236	344	1,531	127,284	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	347	354	2,221	184,690	食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP	580	624	312	25,936	素材
TORONTO-DOMINION BANK	1,533	1,559	9,887	821,921	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	145	148	1,410	117,286	素材
SILVER WHEATON CORP	361	375	1,026	85,322	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	133	144	302	25,138	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	87	82	444	36,973	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	107	104	414	34,435	公益事業
METRO INC	199	199	917	76,262	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	101	215	963	80,070	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	109	109	1,010	84,042	保険
CRESCENT POINT ENERGY CORP	419	459	609	50,633	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	692	874	1,140	94,815	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	288	305	549	45,714	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	160	197	557	46,313	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	309	336	1,465	121,865	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	93	94	460	38,274	エネルギー
DOLLARAMA INC	99	95	1,162	96,608	小売
KEYERA CORP	143	160	640	53,243	エネルギー
ALTAGAS LTD	126	148	455	37,869	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	124	142	371	30,856	エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	66	63	313	26,065	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	97	115	229	19,052	不動産
INTER PIPELINE LTD	280	296	807	67,126	エネルギー

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	151	162	479	39,862	エネルギー	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	133	211	554	46,131	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	16	16	1,094	91,002	ソフトウェア・サービス	
RESTAURANT BRANDS INTERN	168	185	1,502	124,914	消費者サービス	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	57	56	320	26,614	素材	
VERESEN INC	258	255	471	39,216	エネルギー	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	23	24	727	60,450	素材	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	323	306	365	30,347	各種金融	
LINAMAR CORP	39	43	274	22,816	自動車・自動車部品	
HYDRO ONE LTD	—	168	387	32,233	公益事業	
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	92	—	—	—	商業・専門サービス	
EMERA INC	—	50	235	19,543	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	32,985	35,203	142,733	11,865,402	
	銘柄数 < 比率 >	90	91	—	< 3.6% >	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
COMMERZBANK AG	882	881	838	103,746	銀行	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	1,141	1,738	3,014	373,133	各種金融	
METRO AG	147	152	450	55,718	食品・生活必需品小売り	
SIEMENS AG-REG	655	641	8,389	1,038,604	資本財	
RWE AG	407	403	628	77,852	公益事業	
BASF SE	759	770	6,940	859,250	素材	
VOLKSWAGEN AG	29	26	384	47,617	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	796	808	5,558	688,196	自動車・自動車部品	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	146	149	1,876	232,341	家庭用品・パーソナル用品	
E.ON SE	1,661	1,861	1,341	166,115	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	274	277	2,505	310,128	自動車・自動車部品	
BAYER AG-REG	684	694	7,990	989,177	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LINDE AG	153	155	2,608	322,965	素材	
ALLIANZ SE-REG	377	382	6,635	821,515	保険	
MAN SE	29	29	282	34,973	資本財	
CONTINENTAL AG	90	92	1,932	239,275	自動車・自動車部品	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	933	953	1,818	225,141	半導体・半導体製造装置	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	126	130	698	86,467	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	204	210	352	43,681	運輸	
HUGO BOSS AG -ORD	55	53	371	45,964	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE POST AG-REG	801	814	2,587	320,320	運輸	
SAP SE	812	824	7,745	958,899	ソフトウェア・サービス	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	181	193	749	92,733	メディア	
DEUTSCHE BOERSE AG	159	162	1,516	187,757	各種金融	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	180	180	1,550	191,945	ヘルスケア機器・サービス	
ADIDAS AG	34	33	239	29,628	運輸	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	173	158	2,833	350,818	耐久消費財・アパレル	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2,669	2,748	4,594	568,809	電気通信サービス	
THYSSENKRUPP AG	137	134	2,360	292,237	保険	
BEIERSDORF AG	305	302	673	83,395	素材	
HEIDELBERGCEMENT AG	82	82	775	96,066	家庭用品・パーソナル用品	
MERCK KGAA	116	123	1,066	132,008	素材	
VOLKSWAGEN AG-PREF	106	109	1,221	151,195	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LANXESS AG	153	156	2,245	278,002	自動車・自動車部品	
FRESENIUS SE & CO KGAA	75	74	490	60,782	素材	
HOCHTIEF AG	315	344	2,699	334,177	ヘルスケア機器・サービス	
	—	16	271	33,550	資本財	

銘柄	株数	当 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…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	279	294	995	123,186	不動産	
GEA GROUP AG	150	156	582	72,105	資本財	
SYMRISE AG	102	100	651	80,597	素材	
K+S AG-REG	158	166	371	45,935	素材	
HENKEL AG & CO KGAA	85	86	935	115,827	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	102	105	449	55,705	ソフトウェア・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	44	46	367	45,491	自動車・自動車部品	
HANNOVER RUECK SE	49	50	550	68,209	保険	
BRENTAG AG	127	127	682	84,434	資本財	
AXEL SPRINGER SE	37	37	200	24,858	メディア	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	57	59	290	35,978	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	625	647	264	32,768	電気通信サービス	
OSRAM LICHT AG	73	75	508	62,999	資本財	
VONOVIA SE	386	391	1,391	172,258	不動産	
EVONIK INDUSTRIES AG	114	130	404	50,103	素材	
ZALANDO SE	69	75	294	36,457	小売	
COVESTRO AG	—	74	491	60,885	素材	
SCHAEFFLER AG	—	146	217	26,931	自動車・自動車部品	
INNOGY SE	—	122	412	51,106	公益事業	
小 計	株 数	金 額	18,327	19,768	98,304	12,170,037
	銘柄 数 < 比 率 >		52	56	—	< 3.7% >
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	961	984	1,461	180,900	保険	
INTESA SANPAOLO	10,499	10,651	3,016	373,444	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	9,508	9,443	831	102,883	電気通信サービス	
ENI SPA	2,105	2,143	3,194	395,427	エネルギー	
UNICREDIT SPA	3,948	1,589	2,650	328,134	銀行	
ENEL SPA	6,331	6,437	2,937	363,601	公益事業	
SAIPEM SPA	4,956	5,277	211	26,127	エネルギー	
ATLANTIA SPA	342	342	827	102,428	運輸	
INTESA SANPAOLO-RSP	762	800	213	26,414	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	139	138	750	92,943	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	466	484	444	55,071	銀行	
SNAM SPA	1,760	2,037	864	107,075	エネルギー	
TELECOM ITALIA-RSP	4,971	5,183	373	46,266	電気通信サービス	
BANCO POPOLARE SC	308	—	—	—	銀行	
LEONARDO SPA	350	343	544	67,439	資本財	
UBI BANCA SPA	734	—	—	—	銀行	
TERNA SPA	1,281	1,253	616	76,363	公益事業	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	908	975	213	26,448	保険	
PRYSMIAN SPA	160	158	408	50,564	資本財	
EXOR SPA	93	—	—	—	各種金融	
POSTE ITALIANE SPA	—	442	282	34,957	保険	
小 計	株 数	金 額	50,592	48,688	19,842	2,456,493
	銘柄 数 < 比 率 >		20	18	—	< 0.7% >
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)	154	153	1,870	231,536	自動車・自動車部品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	231	234	5,460	675,966	耐久消費財・アパレル	
PEUGEOT SA	366	400	774	95,864	自動車・自動車部品	
AXA SA	1,627	1,624	3,943	488,250	保険	
DANONE	487	495	3,309	409,671	食品・飲料・タバコ	
CARREFOUR SA	458	476	1,048	129,852	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	960	865	1,591	196,976	メディア
INGENICO GROUP	45	44	378	46,835	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA	600	643	3,173	392,896	銀行
AIR LIQUIDE SA	284	326	3,698	457,887	素材
TOTAL SA	1,816	1,909	9,142	1,131,822	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	394	420	2,117	262,111	資本財
ZODIAC AEROSPACE	168	172	380	47,137	資本財
VINCI SA	396	426	3,314	410,308	資本財
SANOFI	971	973	8,900	1,101,908	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	380	399	753	93,317	公益事業
L'OREAL	207	210	3,987	493,695	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA	175	145	611	75,748	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	461	471	3,329	412,202	資本財
BNP PARIBAS	876	942	6,256	774,528	銀行
ESSILOR INTERNATIONAL	169	173	2,074	256,883	ヘルスケア機器・サービス
CAPGEMINI	135	137	1,310	162,218	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	48	43	232	28,804	食品・生活必需品小売り
VALEO SA	65	201	1,312	162,505	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	21	21	971	120,296	耐久消費財・アパレル
SODEXO	77	77	924	114,480	消費者サービス
KERING	62	63	1,876	232,265	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	106	108	902	111,671	ソフトウェア・サービス
TECHNIP SA	87	—	—	—	エネルギー
CHRISTIAN DIOR SE	45	45	1,153	142,853	耐久消費財・アパレル
ATOS SE	72	74	936	115,894	ソフトウェア・サービス
ORANGE	1,644	1,675	2,485	307,743	電気通信サービス
CNP ASSURANCES	142	138	277	34,305	保険
IMERYS SA	29	31	238	29,516	素材
SAFRAN SA	258	262	1,991	246,565	資本財
RENAULT SA	158	161	1,422	176,099	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	156	159	1,050	130,018	メディア
LAGARDERE SCA	95	102	280	34,780	メディア
JCDECAUX SA	61	64	187	23,245	メディア
SOCIETE BIC SA	23	24	264	32,794	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	167	170	649	80,355	資本財
THALES SA	86	89	873	108,187	資本財
PERNOD RICARD SA	175	178	2,149	266,075	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	874	945	1,340	165,902	銀行
ENGIE	1,215	1,332	1,841	227,919	公益事業
ALSTOM	128	123	368	45,653	資本財
ARKEMA	55	55	543	67,304	素材
LEGRAND SA	220	224	1,384	171,413	資本財
SCOR SE	126	138	489	60,640	保険
ADP	24	26	334	41,367	運輸
EDF	201	316	274	34,014	公益事業
NATIXIS	779	808	522	64,657	銀行
WENDEL	23	23	309	38,311	各種金融
BUREAU VERITAS SA	221	228	487	60,402	商業・専門サービス
EURAZEO	32	34	221	27,408	各種金融
SUEZ	255	282	468	58,018	公益事業
EIFFAGE	—	47	370	45,856	資本財
ILIAD SA	21	22	517	64,010	電気通信サービス

銘柄	株数	当 期		末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ユーロ…フランス)</b>						
EUTELSAT COMMUNICATIONS	141	152	315	39,111		メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	393	403	414	51,372		運輸
EDENRED	172	180	429	53,157		商業・専門サービス
REMY COINTREAU	19	19	187	23,186		食品・飲料・タバコ
REXEL SA	255	258	397	49,237		資本財
BOLLORE	711	764	302	37,387		運輸
SPR GROUP SA	91	78	244	30,285		電気通信サービス
DASSAULT AVIATION SA	—	2	261	32,369		資本財
SEB SA	—	18	272	33,782		耐久消費財・アパレル
小 計	株 数 ・ 金 額	20,923	21,831	99,909	12,368,852	
	銘柄 数 < 比 率 >	64	66	—	< 3.7% >	
<b>(ユーロ…オランダ)</b>						
QIAGEN N.V.	183	188	554	68,615		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV	786	852	835	103,483		資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	743	745	742	91,897		自動車・自動車部品
FERRARI NV	105	106	805	99,733		自動車・自動車部品
EXOR NV	—	88	470	58,243		各種金融
AIRBUS SE	489	486	3,603	446,122		資本財
STMICROELECTRONICS NV	512	530	799	98,988		半導体・半導体製造装置
GEMALTO	66	69	363	45,039		ソフトウェア・サービス
WOLTERS KLUWER	249	251	974	120,615		商業・専門サービス
KONINKLIJKE KPN NV	2,654	2,842	809	100,238		電気通信サービス
AKZO NOBEL	204	212	1,595	197,579		素材
HEINEKEN NV	190	193	1,650	204,340		食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV	787	797	2,629	325,474		資本財
RELX NV	822	839	1,527	189,125		商業・専門サービス
AEGON NV	1,506	1,450	665	82,405		保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	688	1,074	2,124	263,029		食品・生活必需品小売り
RANDSTAD HOLDING NV	105	101	571	70,703		商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV	83	85	690	85,458		食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	149	150	993	122,989		素材
ING GROEP NV	3,201	3,254	4,978	616,318		銀行
ASML HOLDING NV	286	313	3,843	475,777		半導体・半導体製造装置
UNILEVER NV-CVA	1,346	1,367	6,757	836,576		家庭用品・パーソナル用品
VOPAK	58	62	263	32,565		エネルギー
BOSKALIS WESTMINSTER	72	78	254	31,455		資本財
TNT EXPRESS NV	417	—	—	—		運輸
OCI NV	73	—	—	—		素材
NN GROUP NV	261	263	841	104,132		保険
ALTICE NV - B	87	94	211	26,165		メディア
ALTICE NV - A	310	306	689	85,403		メディア
ABN AMRO GROUP NV-CVA	—	233	571	70,772		銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	16,445	17,040	40,817	5,053,252	
	銘柄 数 < 比 率 >	28	28	—	< 1.5% >	
<b>(ユーロ…スペイン)</b>						
BANCO POPULAR ESPANOL	1,432	2,911	229	28,404		銀行
ENDESA SA	265	264	551	68,314		公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	158	195	676	83,734		資本財
IBERDROLA SA	4,556	4,655	3,118	386,127		公益事業
TELEFONICA SA	3,725	3,808	3,820	472,965		電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA	11,932	12,241	7,418	918,405		銀行
BANKINTER SA	553	547	462	57,206		銀行

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
REPSOL SA	908	952	1,397	173,005	エネルギー	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	5,369	5,614	4,146	513,344	銀行	
GAS NATURAL SDG SA	293	288	590	73,118	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	898	914	3,277	405,747	小売	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	429	542	876	108,537	運輸	
MAPPFRE SA	892	927	304	37,739	保険	
FERROVIAL SA	390	414	808	100,093	資本財	
FERROVIAL SA-RTS	—	414	13	1,635	資本財	
ZARDOYA OTIS SA	153	156	133	16,553	資本財	
ENAGAS SA	182	185	465	57,622	エネルギー	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	90	371	691	85,548	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	4,311	4,410	808	100,139	銀行	
CAIXABANK S. A	2,194	3,009	1,278	158,311	銀行	
GRIFOLS SA	245	254	641	79,366	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMADEUS IT GROUP SA	361	369	1,919	237,623	ソフトウェア・サービス	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	681	705	500	62,018	運輸	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	486	543	292	36,245	食品・生活必需品小売り	
BANKIA SA	3,782	3,727	410	50,806	銀行	
AENA SA	55	56	930	115,196	運輸	
小 計	株 数	金 額	44,354	48,483	35,765	4,427,813
	銘柄 数 < 比 率 >		25	26	—	< 1.3% >
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS	166	158	591	73,232	保険	
UCB SA	104	104	798	98,870	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	665	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	66	67	591	73,241	各種金融	
DELHAIZE GROUP	85	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
UMICORE	78	77	457	56,576	素材	
COLRUYT SA	58	57	273	33,884	食品・生活必需品小売り	
KBC GROEP NV	207	211	1,404	173,859	銀行	
SOLVAY SA	61	61	746	92,378	素材	
PROXIMUS	126	131	396	49,070	電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	46	42	242	30,025	メディア	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	—	640	6,986	864,956	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数	金 額	1,667	1,554	12,488	1,546,097
	銘柄 数 < 比 率 >		11	10	—	< 0.5% >
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG	232	250	819	101,458	銀行	
OMV AG	123	127	540	66,938	エネルギー	
VOESTALPINE AG	93	97	379	46,960	素材	
ANDRITZ AG	64	62	338	41,908	資本財	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	103	105	226	28,023	銀行	
小 計	株 数	金 額	616	645	2,304	285,290
	銘柄 数 < 比 率 >		5	5	—	< 0.1% >
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP	31	32	220	27,357	メディア	
TENARIS SA	386	402	579	71,761	エネルギー	
SES	270	310	635	78,617	メディア	
EUROFINS SCIENTIFIC	—	9	441	54,692	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARCELORMITTAL	1,408	1,532	1,107	137,087	素材	
小 計	株 数	金 額	2,096	2,287	2,984	369,516
	銘柄 数 < 比 率 >		4	5	—	< 0.1% >



銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
NOKIA OYJ	4,772	4,900	2,744	339,744		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS	452	472	538	66,678		素材
NOKIAN RENKAAT OYJ	94	92	350	43,413		自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ	439	445	1,098	136,028		素材
FORTUM OYJ	371	385	533	65,998		公益事業
KONE OYJ-B	277	281	1,202	148,893		資本財
METSO OYJ	93	90	284	35,169		資本財
SAMPO OYJ-A SHS	368	373	1,697	210,167		保険
WARTSILA OYJ ABP	121	121	659	81,671		資本財
ELISA OYJ	118	122	410	50,758		電気通信サービス
NESTE OYJ	106	110	414	51,349		エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	84	88	506	62,686		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	7,301	7,483	10,440	1,292,561	
	銘柄 数 < 比 率 >	12	12	-	< 0.4% >	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A	135	135	1,098	135,976		食品・飲料・タバコ
PADDY POWER BETFAIR PLC	70	70	686	85,022		消費者サービス
IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD	472	472	-	-		銀行
BANK OF IRELAND	23,370	24,069	594	73,600		銀行
CRH PLC	691	711	2,438	301,941		素材
小 計	株 数 ・ 金 額	24,739	25,459	4,818	596,540	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	-	< 0.2% >	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,934	2,063	674	83,451		公益事業
JERONIMO MARTINS	207	200	337	41,723		食品・生活必需品小売り
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	35,849	-	-	-		銀行
GALP ENERGIA SGPS SA	383	432	617	76,417		エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	38,374	2,696	1,628	201,592	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	3	-	< 0.1% >	
(ユーロ…イギリス)						
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	-	183	672	83,224		食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	-	183	672	83,224	
	銘柄 数 < 比 率 >	-	1	-	< 0.0% >	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	225,438	196,121	329,977	40,851,273	
	銘柄 数 < 比 率 >	230	235	-	< 12.3% >	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC	13,882	14,226	2,938	431,276		銀行
BP PLC	15,163	15,886	7,243	1,063,133		エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	47,240	53,905	3,755	551,130		銀行
ASTRAZENECA PLC	1,045	1,062	5,043	740,228		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC	326	324	536	78,770		資本財
NEXT PLC	120	118	510	74,897		小売
DIAGEO PLC	2,080	2,111	4,851	712,013		食品・飲料・タバコ
SKY PLC	856	857	854	125,464		メディア
BAE SYSTEMS PLC	2,614	2,673	1,714	251,565		資本財
UNILEVER PLC	1,060	1,077	4,402	646,166		家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC	6,742	6,877	1,240	182,049		食品・生活必需品小売り
RELX PLC	920	916	1,469	215,745		商業・専門サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,348	1,377	519	76,226		小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	526	528	3,859	566,462		家庭用品・パーソナル用品
PRUDENTIAL PLC	2,127	2,164	3,811	559,400		保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	4,916	5,006	1,275	187,157		保険

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
SAGE GROUP PLC/THE	893	895	615	90,399	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	16,192	16,605	11,258	1,652,437	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,542	1,564	8,354	1,226,138	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	581	578	591	86,819	公益事業
SCHRODERS PLC	102	108	353	51,817	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,873	2,948	768	112,846	銀行
BHP BILLITON PLC	1,747	1,772	2,080	305,363	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	793	805	2,971	436,143	食品・飲料・タバコ
WPP PLC	1,070	1,076	1,835	269,326	メディア
CENTRICA PLC	4,221	4,608	885	130,007	公益事業
BT GROUP PLC	7,008	7,104	2,116	310,577	電気通信サービス
SSE PLC	839	861	1,248	183,287	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	2,708	2,758	2,076	304,711	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,520	1,546	1,348	197,864	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	112,647	114,200	11	1,676	資本財
COMPASS GROUP PLC	1,358	1,380	2,200	322,962	消費者サービス
KINGFISHER PLC	1,891	1,896	654	96,033	小売
PEARSON PLC	678	702	497	73,066	メディア
SEVERN TRENT PLC	203	207	504	73,991	公益事業
RIO TINTO PLC	1,025	1,037	3,100	455,088	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	4,027	4,096	6,666	978,435	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SABMILLER PLC	803	—	—	—	食品・飲料・タバコ
PROVIDENT FINANCIAL PLC	121	125	410	60,293	各種金融
3I GROUP PLC	793	795	661	97,118	各種金融
GKN PLC	1,415	1,460	513	75,359	自動車・自動車部品
VODAFONE GROUP PLC	21,964	22,328	4,605	675,918	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	1,835	1,902	460	67,613	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	1,109	1,385	367	53,904	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	3,343	3,411	1,833	269,103	保険
CAPITA PLC	552	536	300	44,092	商業・専門サービス
DIXONS CARPHONE PLC	806	843	275	40,370	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	159	165	517	75,895	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	841	833	512	75,199	保険
WHITBREAD PLC	150	155	636	93,420	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	3,112	3,171	3,274	480,639	公益事業
ARM HOLDINGS PLC	1,162	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WOLSELEY PLC	210	211	1,054	154,706	資本財
BUNZL PLC	277	276	675	99,092	資本財
COBHAM PLC	976	2,080	278	40,922	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	1,160	1,177	1,238	181,738	素材
INTERTEK GROUP PLC	134	133	555	81,539	商業・専門サービス
WILLIAM HILL PLC	725	740	217	31,989	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	367	362	598	87,791	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	171	159	678	99,531	消費者サービス
CARNIVAL PLC	156	157	752	110,471	消費者サービス
PERSIMMON PLC	252	252	606	89,029	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	641	620	298	43,821	資本財
ICAP PLC	455	—	—	—	各種金融
ITV PLC	3,161	3,089	583	85,703	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	258	261	898	131,823	各種金融
G4S PLC	1,293	1,335	421	61,900	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	107	107	360	52,860	耐久消費財・アパレル

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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	826	854	515	75,587	耐久消費財・アパレル	
IMI PLC	225	217	280	41,181	資本財	
REXAM PLC	590	—	—	—	素材	
SMITH & NEPHEW PLC	740	733	960	141,009	ヘルスケア機器・サービス	
TATE & LYLE PLC	394	373	285	41,943	食品・飲料・タバコ	
TAYLOR WIMPEY PLC	2,685	2,778	551	80,979	耐久消費財・アパレル	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	3,260	3,664	7,815	1,147,028	エネルギー	
PETROFAC LTD	209	227	185	27,192	エネルギー	
TRAVIS PERKINS PLC	205	214	347	51,006	資本財	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	3,280	3,146	6,906	1,013,680	エネルギー	
OLD MUTUAL PLC	4,078	4,088	799	117,380	保険	
INVESTEC PLC	470	558	327	48,100	各種金融	
STANDARD LIFE PLC	1,628	1,799	692	101,695	保険	
EXPERIAN PLC	799	801	1,338	196,520	商業・専門サービス	
MONDI PLC	302	301	603	88,607	素材	
WEIR GROUP PLC/THE	181	186	348	51,112	資本財	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	294	295	848	124,574	食品・飲料・タバコ	
ANTOFAGASTA PLC	317	342	266	39,062	素材	
SHIRE PLC	490	757	3,549	520,922	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INMARSAT PLC	374	394	297	43,691	電気通信サービス	
ADMIRAL GROUP PLC	174	183	374	54,971	保険	
FRESNILLO PLC	178	175	263	38,676	素材	
RANDGOLD RESOURCES LTD	76	78	563	82,714	素材	
AGGREKO PLC	207	—	—	—	商業・専門サービス	
BABCOCK INTL GROUP PLC	208	218	195	28,648	商業・専門サービス	
ST JAMES'S PLACE PLC	434	451	526	77,319	保険	
GLENCORE PLC	10,122	10,267	2,978	437,081	素材	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	759	827	241	35,464	各種金融	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	215	207	298	43,822	各種金融	
CRODA INTERNATIONAL PLC	113	111	435	63,879	素材	
COCA-COLA HBC AG-DI	165	154	338	49,670	食品・飲料・タバコ	
EASYJET PLC	141	141	183	26,958	運輸	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,127	1,112	393	57,799	保険	
ROYAL MAIL PLC	743	770	325	47,816	運輸	
ASHTREAD GROUP PLC	416	414	671	98,553	資本財	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	236	—	—	—	小売	
MERLIN ENTERTAINMENT	587	566	283	41,580	消費者サービス	
TUI AG-DI	410	422	498	73,111	消費者サービス	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	125	224	32,984	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	304	322	270	39,674	ヘルスケア機器・サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC	792	841	343	50,381	ソフトウェア・サービス	
WORLDPAY GROUP PLC	1,170	1,488	467	68,619	ソフトウェア・サービス	
DCC PLC	—	73	540	79,338	資本財	
小 計	株数・金額	353,365	364,644	155,092	22,762,882	
	銘柄数<比率>	109	105	—	<6.8%>	
(スイス)			千スイスフラン			
NESTLE SA-REG	2,637	2,611	21,084	2,383,764	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	431	439	3,771	426,418	耐久消費財・アパレル	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,487	1,723	2,575	291,141	各種金融	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	376	383	2,157	243,967	素材	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	581	589	15,774	1,783,430	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GIVAUDAN-REG	7	7	1,523	172,228	素材	

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円			
SONOVA HOLDING AG-REG	44	43	657	74,345		ヘルスケア機器・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	124	126	3,540	400,331		保険	
SYNGENTA AG-REG	76	77	3,653	413,045		素材	
LONZA GROUP AG-REG	43	50	1,011	114,376		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	40	43	344	38,919		耐久消費財・アパレル	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	36	34	708	80,053		資本財	
GEBERIT AG-REG	31	31	1,439	162,795		資本財	
SWISS RE AG	290	272	2,421	273,756		保険	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	25	25	1,048	118,569		耐久消費財・アパレル	
PARGESA HOLDING SA-BR	27	31	232	26,340		各種金融	
NOVARTIS AG-REG	1,882	1,874	14,799	1,673,230		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	137	137	1,062	120,128		商業・専門サービス	
SWISSCOM AG-REG	21	21	990	111,945		電気通信サービス	
ABB LTD-REG	1,819	1,584	3,916	442,764		資本財	
SGS SA-REG	4	4	1,066	120,549		商業・専門サービス	
SULZER AG-REG	11	—	—	—		資本財	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	16	17	353	39,974		資本財	
ACTELION LTD-REG	84	81	2,293	259,289		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	44	45	686	77,605		運輸	
BALOISE HOLDING AG - REG	40	41	618	69,871		保険	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	26	27	884	100,055		保険	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.09	0.08	558	63,119		食品・飲料・タバコ	
ARYZTA AG	74	76	266	30,162		食品・飲料・タバコ	
JULIUS BAER GROUP LTD	185	191	1,011	114,305		各種金融	
SIKA AG-BR	1	1	1,146	129,634		素材	
SWISS PRIME SITE-REG	55	60	535	60,535		不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.81	0.9	522	59,068		食品・飲料・タバコ	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	13	15	941	106,413		各種金融	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	277	31,404		食品・飲料・タバコ	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	6	7	460	52,103		素材	
UBS GROUP AG-REG	3,026	3,075	5,172	584,826		各種金融	
DUFREY AG-REG	33	30	492	55,711		小売	
GALENICA AG-REG	3	3	378	42,776		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	13,757	13,793	100,379	11,348,960	
銘 柄 数 < 比 率 >	39	38	—	< 3.4% >			
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ				
ELECTROLUX AB-SER B	199	204	5,600	71,853		耐久消費財・アパレル	
ERICSSON LM-B SHS	2,516	2,581	14,854	190,577		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ATLAS COPCO AB-B SHS	321	323	9,602	123,195		資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,254	1,276	13,547	173,811		銀行	
INVESTOR AB-B SHS	375	380	15,628	200,518		各種金融	
NORDEA BANK AB	2,509	2,546	28,617	367,168		銀行	
GETINGE AB-B SHS	166	173	3,073	39,432		ヘルスケア機器・サービス	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,239	1,283	16,221	208,117		銀行	
ATLAS COPCO AB-A SHS	556	567	18,881	242,244		資本財	
SKF AB-B SHARES	329	325	6,035	77,434		資本財	
ASSA ABLOY AB-B	829	842	16,293	209,041		資本財	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	784	795	16,970	217,730		小売	
SANDVIK AB	882	892	12,509	160,499		資本財	
SWEDBANK AB - A SHARES	749	760	16,394	210,340		銀行	
SECURITAS AB-B SHS	259	266	3,684	47,277		商業・専門サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	500	511	15,136	194,198		家庭用品・パーソナル用品	

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円		
SKANSKA AB-B SHS	313	287	6,242	80,095	資本財	
SWEDISH MATCH AB	163	161	4,771	61,216	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	255	285	2,500	32,085	電気通信サービス	
TELIA CO AB	2,147	2,145	8,123	104,223	電気通信サービス	
VOLVO AB-B SHS	1,274	1,302	18,943	243,038	資本財	
ALFA LAVAL AB	242	249	4,476	57,434	資本財	
LUNDIN PETROLEUM AB	179	148	2,541	32,613	エネルギー	
BOLIDEN AB	225	232	5,657	72,590	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	355	362	3,269	41,947	耐久消費財・アパレル	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	55	52	2,482	31,846	電気通信サービス	
HEXAGON AB-B SHS	214	216	8,402	107,800	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KINNEVIK AB - B	194	197	4,792	61,486	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	129	140	2,978	38,211	各種金融	
ICA GRUPPEN AB	68	69	2,125	27,266	食品・生活必需品小売り	
LUNDBERGS AB-B SHS	—	31	2,101	26,966	各種金融	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	19,293	19,614	292,460	3,752,262	
		30	31	—	< 1.1% >	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	809	822	12,077	160,021	銀行	
NORSK HYDRO ASA	1,105	1,132	5,330	70,633	素材	
ORKLA ASA	669	693	5,616	74,422	食品・飲料・タバコ	
STATOIL ASA	924	952	14,576	193,138	エネルギー	
TELENOR ASA	621	621	8,314	110,165	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	147	150	4,829	63,995	素材	
MARINE HARVEST	—	308	4,527	59,990	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	170	171	2,331	30,892	保険	
SCHIBSTED ASA-CL A	64	66	1,495	19,814	メディア	
SCHIBSTED ASA-B SHS	76	75	1,530	20,275	メディア	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	4,588	4,995	60,630	803,348	
		9	10	—	< 0.2% >	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
NOVO NORDISK A/S-B	1,621	1,605	44,143	734,546	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	193	188	5,582	92,891	素材	
DANSKE BANK A/S	585	581	14,835	246,869	銀行	
WILLIAM DEMANT HOLDING	21	104	1,745	29,051	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	185	186	11,523	191,742	資本財	
TDC A/S	675	653	2,424	40,351	電気通信サービス	
CARLSBERG AS-B	88	88	6,256	104,106	食品・飲料・タバコ	
COLOPLAST-B	92	101	5,523	91,910	ヘルスケア機器・サービス	
DSV A/S	160	157	6,104	101,579	運輸	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	5	5	6,565	109,241	運輸	
TRYG A/S	93	97	1,298	21,610	保険	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	3	3	3,842	63,942	運輸	
PANDORA A/S	91	92	6,305	104,925	耐久消費財・アパレル	
ISS A/S	123	143	4,055	67,486	商業・専門サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	82	84	3,914	65,136	素材	
GENMAB A/S	44	48	6,513	108,386	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DONG ENERGY A/S	—	122	3,430	57,085	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	4,067	4,265	134,066	2,230,864	
		16	17	—	< 0.7% >	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
BHP BILLITON LIMITED	2,662	2,700	6,373	535,922	素材	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
CSL LTD	385	383	5,209	438,093	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINA LTD	2,146	2,161	382	32,178	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	618	641	2,094	176,092	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	2,412	2,467	7,229	607,951	銀行
RIO TINTO LTD	353	359	2,139	179,902	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	1,147	1,153	1,566	131,703	保険
LENLEASE GROUP	468	479	797	67,044	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	1,416	1,450	11,903	1,000,994	銀行
WESTPAC BANKING CORP	2,757	2,818	9,193	773,108	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,180	2,240	7,236	608,519	銀行
BRAMBLES LTD	1,325	1,331	1,402	117,967	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	494	469	226	19,006	運輸
BORAL LTD	622	964	659	55,452	素材
WOOLWORTHS LTD	1,057	1,089	2,952	248,314	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	3,585	3,534	1,555	130,774	電気通信サービス
AMP LTD	2,496	2,488	1,318	110,902	各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD	692	753	357	30,049	消費者サービス
AMCOR LIMITED	970	976	1,505	126,598	素材
COMPUTERSHARE LTD	403	386	588	49,507	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	464	451	924	77,774	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	256	261	2,444	205,546	各種金融
CIMIC GROUP LTD	84	88	357	30,025	資本財
ASX LTD	165	160	833	70,094	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	501	507	492	41,445	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	48	50	739	62,174	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	377	382	840	70,672	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	467	515	211	17,780	小売
NEWCREST MINING LTD	637	636	1,284	108,050	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	2,050	2,002	1,299	109,303	保険
ORIGIN ENERGY LTD	1,462	1,465	1,160	97,583	エネルギー
ORICA LTD	312	325	619	52,101	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	332	345	810	68,162	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	1,400	1,566	573	48,201	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	1,080	1,095	1,599	134,494	保険
TRANSURBAN GROUP	1,714	1,753	2,146	180,506	運輸
WESFARMERS LTD	936	954	4,210	354,063	食品・生活必需品小売り
CHALLENGER LTD	485	473	631	53,110	各種金融
SYDNEY AIRPORT	949	921	671	56,473	運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD	227	218	714	60,071	エネルギー
OIL SEARCH LTD	1,148	1,187	865	72,792	エネルギー
AGL ENERGY LTD	582	566	1,535	129,153	公益事業
TATTS GROUP LTD	1,244	1,202	526	44,280	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,276	1,332	648	54,559	素材
ASCIANO LTD	547	—	—	—	運輸
ILUKA RESOURCES LTD	354	—	—	—	素材
AUSNET SERVICES	1,718	1,740	303	25,539	公益事業
CROWN RESORTS LTD	300	324	415	34,965	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD	1,427	1,458	541	45,494	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	400	384	474	39,897	銀行
AURIZON HOLDINGS LTD	1,764	1,713	949	79,817	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	619	608	803	67,541	食品・飲料・タバコ
RAMSAY HEALTH CARE LTD	120	117	867	72,937	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			
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	47	50	179	15,058	消費者サービス	
SEEK LTD	284	272	500	42,092	商業・専門サービス	
BANK OF QUEENSLAND LTD	328	316	378	31,869	銀行	
REA GROUP LTD	48	48	310	26,136	メディア	
TPG TELECOM LTD	247	306	182	15,380	電気通信サービス	
HEALTHSCOPE LTD	1,457	1,564	356	30,002	ヘルスケア機器・サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,309	2,282	686	57,766	保険	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	195	—	—	—	各種金融	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	56	374	31,456	消費者サービス	
SOUTH32 LTD	4,430	4,400	1,166	98,055	素材	
VOCUS GROUP LTD	390	465	116	9,814	電気通信サービス	
小 計	株数・金額	63,400	63,425	99,445	8,362,334	
	銘柄数<比率>	63	61	—	<2.5%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,518	1,586	591	46,059	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	803	830	568	44,282	運輸	
CONTACT ENERGY LTD	630	644	338	26,366	公益事業	
FLETCHER BUILDING LTD	573	598	513	39,970	素材	
RYMAN HEALTHCARE LTD	321	323	274	21,340	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	1,118	1,136	318	24,815	公益事業	
MERCURY NZ LTD	644	643	206	16,066	公益事業	
小 計	株数・金額	5,610	5,763	2,812	218,901	
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>	
(香港)			千香港ドル			
WHARF HOLDINGS LTD	1,130	1,140	7,638	111,743	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	490	470	3,494	51,123	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,238	2,283	23,270	340,450	資本財	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,440	1,220	14,225	208,114	不動産	
MTR CORP	1,225	1,215	5,655	82,744	運輸	
HONG KONG & CHINA GAS	5,865	6,483	10,178	148,916	公益事業	
NEW WORLD DEVELOPMENT	4,500	4,620	4,532	66,306	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,165	1,160	8,282	121,171	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	950	983	19,237	281,441	各種金融	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	1,020	1,140	1,249	18,279	運輸	
HANG LUNG GROUP LTD	—	700	2,268	33,180	不動産	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,870	1,940	3,802	55,629	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	1,595	1,390	11,564	169,193	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	958	943	4,684	68,536	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	990	988	3,231	47,275	銀行	
HANG SENG BANK LTD	632	642	10,451	152,909	銀行	
HYSAN DEVELOPMENT CO	540	550	2,026	29,651	不動産	
SHANGRI-LA ASIA LTD	1,080	1,160	1,296	18,973	消費者サービス	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	209	197	2,379	34,815	半導体・半導体製造装置	
SINO LAND CO	2,514	2,474	3,339	48,862	不動産	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	610	650	2,145	31,381	耐久消費財・アパレル	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	570	550	3,800	55,601	公益事業	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,060	3,120	10,202	149,261	銀行	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	1,150	1,175	4,094	59,908	耐久消費財・アパレル	
PCCW LTD	3,530	3,900	1,786	26,132	電気通信サービス	
LI & FUNG LTD	4,900	5,220	1,691	24,743	耐久消費財・アパレル	
KERRY PROPERTIES LTD	520	575	1,661	24,311	不動産	
NWS HOLDINGS LTD	1,285	1,355	2,062	30,171	資本財	

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		
SANDS CHINA LTD	2,008	2,008	6,947	101,644	消費者サービス	
WHEELLOCK & CO LTD	750	670	4,090	59,841	不動産	
WYNN MACAU LTD	1,272	1,388	2,212	32,368	消費者サービス	
SJM HOLDINGS LTD	1,660	1,720	1,229	17,991	消費者サービス	
FIRST PACIFIC CO	2,080	1,980	1,158	16,945	各種金融	
AIA GROUP LTD	9,976	10,142	56,643	828,688	保険	
SWIRE PROPERTIES LTD	1,004	1,014	2,605	38,125	不動産	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,940	1,990	8,059	117,910	消費者サービス	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	852	852	1,421	20,791	消費者サービス	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	2,280	3,240	3,246	47,496	電気通信サービス	
WH GROUP LTD	4,875	6,570	4,461	65,264	食品・飲料・タバコ	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	2,238	2,268	12,976	189,851	不動産	
小計	株数・金額	76,974	82,087	275,307	4,027,751	
	銘柄数<比率>	39	40	—	<1.2%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,561	2,640	2,787	225,564	銀行	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	1,344	1,419	479	38,819	メディア	
SEBPCORP INDUSTRIES LTD	801	903	285	23,087	資本財	
CAPITALAND LTD	2,156	2,094	764	61,840	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	360	319	346	28,004	不動産	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	97	78	365	29,598	小売	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,461	1,496	3,131	253,339	銀行	
KEPPEL CORP LTD	1,208	1,186	785	63,525	資本財	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,071	1,109	2,658	215,080	銀行	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,357	1,266	481	38,924	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	6,613	6,864	2,546	206,058	電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	479	496	535	43,336	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	671	702	518	41,917	各種金融	
SEBPCORP MARINE LTD	660	—	—	—	資本財	
UOL GROUP LTD	391	428	303	24,586	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,810	1,894	515	41,682	運輸	
NOBLE GROUP LTD	4,185	—	—	—	資本財	
STARHUB LTD	565	570	155	12,590	電気通信サービス	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	6,110	6,368	235	19,065	食品・飲料・タバコ	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,606	1,666	571	46,235	食品・飲料・タバコ	
GENTING SINGAPORE PLC	4,988	5,212	562	45,543	消費者サービス	
SATS LTD	—	610	323	26,158	運輸	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	2,640	2,302	669	54,200	不動産	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,726	1,665	207	16,772	資本財	
小計	株数・金額	44,863	41,289	19,230	1,555,931	
	銘柄数<比率>	23	22	—	<0.5%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
ISRAEL CHEMICALS LTD	406	447	675	21,347	素材	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	755	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BANK HAPOALIM BM	877	913	2,084	65,841	銀行	
NICE LTD	48	48	1,305	41,238	ソフトウェア・サービス	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,161	1,238	2,087	65,929	銀行	
ELBIT SYSTEMS LTD	—	20	861	27,209	資本財	
DELEK GROUP LTD	3	—	—	—	エネルギー	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	1,607	1,815	1,128	35,642	電気通信サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	120	121	730	23,082	銀行	
AZRIELI GROUP LTD	31	35	736	23,254	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 34	千イスラエルシェケル 724	千円 22,891	素材	
小計	株数・金額 5,013	4,674	10,336	326,437		
	銘柄数<比率> 9	9	—	<0.1%>		
合計	株数・金額 1,109,747	1,097,576	—	309,229,876		
	銘柄数<比率> 1,260	1,262	—	<92.9%>		

(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	38	38	1,206	137,434	0.0	
MACERICH CO/THE	11	10	617	70,350	0.0	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	—	6	747	85,221	0.0	
PROLOGIS INC	43	44	2,434	277,439	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST	7	7	607	69,267	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	—	12	451	51,464	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	12	13	1,514	172,592	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5	5	1,379	157,214	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	9	10	778	88,665	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	5	5	758	86,464	0.0	
WELLTOWER INC	29	30	2,185	249,028	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	12	12	1,571	179,002	0.1	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	6	9	928	105,807	0.0	
REALTY INCOME CORP	20	21	1,172	133,647	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	7	12	777	88,602	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	8	8	866	98,677	0.0	
UDR INC	21	21	826	94,211	0.0	
VENTAS INC	27	29	1,941	221,221	0.1	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	77	86	971	110,742	0.0	
WEYERHAEUSER CO	65	63	2,080	237,037	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	35	35	4,524	515,519	0.2	
AGNC INVESTMENT CORP	28	28	559	63,742	0.0	
VEREIT INC	75	83	627	71,500	0.0	
DUKE REALTY CORP	28	29	817	93,145	0.0	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	15	25	485	55,336	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	17	20	717	81,695	0.0	
EQUINIX INC	5	6	2,771	315,792	0.1	
CROWN CASTLE INTL CORP	27	30	2,870	327,071	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	30	30	2,001	228,061	0.1	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	—	44	584	66,617	0.0	
GGP INC	47	47	1,070	121,989	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	62	61	1,083	123,405	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	12	12	508	57,904	0.0	
PUBLIC STORAGE	12	12	2,586	294,751	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	25	26	4,281	487,798	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	14	14	1,336	152,312	0.0	
KIMCO REALTY CORP	34	36	695	79,200	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	11	11	2,223	253,354	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	892	1,008	53,565	6,103,296	
	銘柄 数 < 比 率 >	35	38	—	<1.8% >	
(カナダ)				千カナダドル		
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	5	5	175	14,547	0.0	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	11	12	275	22,863	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		13	13	346	28,774	0.0
小 計		29	31	796	66,185	
		銘柄数<比率>	3	3	—	<0.0%>
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		2	3	475	58,853	0.0
KLEPIERRE		18	17	672	83,202	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		8	8	1,978	244,891	0.1
FONCIERE DES REGIONS		2	2	221	27,446	0.0
ICADE		2	3	231	28,625	0.0
ユ ー ロ 計		34	35	3,578	443,019	
		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		80	83	553	81,270	0.0
HAMMERSON PLC		65	66	394	57,912	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		65	65	734	107,834	0.0
INTU PROPERTIES PLC		78	83	232	34,182	0.0
SEGRO PLC		62	84	417	61,310	0.0
小 計		351	382	2,333	342,510	
		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		285	291	827	69,608	0.0
SCENTRE GROUP		446	452	1,943	163,390	0.0
GPT GROUP		153	147	784	65,957	0.0
MIRVAC GROUP		317	303	690	58,094	0.0
STOCKLAND		202	209	1,004	84,469	0.0
WESTFIELD CORP		165	166	1,488	125,177	0.0
DEXUS		83	84	869	73,108	0.0
GOODMAN GROUP		149	150	1,242	104,518	0.0
小 計		1,803	1,806	8,851	744,323	
		銘柄数<比率>	8	8	—	<0.2%>
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		186	190	10,896	159,415	0.0
小 計		186	190	10,896	159,415	
		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		211	217	379	30,725	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		172	184	300	24,306	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		215	218	429	34,713	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		183	194	508	41,158	0.0
小 計		784	815	1,617	130,903	
		銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>
合 計		4,083	4,269	—	7,989,655	
		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	4,072	—
		SP/TSE60	228	—
		SWISS IX	204	—
		EURO ST	940	—
		SPI 200	332	—
		FTSE100	442	—

(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 309,229,876	% 91.9
投資証券	7,989,655	2.4
コール・ローン等、その他	19,418,607	5.7
投資信託財産総額	336,638,138	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（333,541,488千円）の投資信託財産総額（336,638,138千円）に対する比率は99.1%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	346,680,248,542
コール・ローン等	6,500,298,966
株式(評価額)	309,229,876,905
投資証券(評価額)	7,989,655,718
未収入金	19,062,532,745
未収配当金	619,577,275
差入委託証拠金	3,278,306,933
(B) 負債	13,694,500,515
未払金	10,045,919,306
未払解約金	3,648,576,787
未払利息	4,422
(C) 純資産総額(A-B)	332,985,748,027
元本	137,017,202,778
次期繰越損益金	195,968,545,249
(D) 受益権総口数	137,017,202,778口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,302円

<注記事項>

- ①期首元本額 136,910,588,935円  
 期中追加設定元本額 153,902,470,267円  
 期中一部解約元本額 153,795,856,424円  
 また、1口当たり純資産額は、期末2,4302円です。

○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	6,829,457,485
受取配当金	6,817,641,983
受取利息	1,180,645
その他収益金	18,477,805
支払利息	△ 7,842,948
(B) 有価証券売買損益	52,532,465,657
売買益	66,177,694,715
売買損	△ 13,645,229,058
(C) 先物取引等取引損益	1,852,951,795
取引益	2,841,720,945
取引損	△ 988,769,150
(D) 保管費用等	△ 116,996,463
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	61,097,878,474
(F) 前期繰越損益金	133,155,172,459
(G) 追加信託差損益金	178,187,605,623
(H) 解約差損益金	△176,472,111,307
(I) 計(E+F+G+H)	195,968,545,249
次期繰越損益金(I)	195,968,545,249

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

②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）	
ファンド・マネジャー（海外株式）	9,941,102,010円
eMAXIS 先進国株式インデックス	14,836,732,618円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,145,144,329円
eMAXIS バランス（波乗り型）	195,449,985円
コアバランス	458,860円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	615,318円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	593,676円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	1,634,211円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	187,851,870円
海外株式セレクション（ラップ向け）	3,225,127円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	18,432,345円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	7,679,239,467円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,377,930,535円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	2,746,833,986円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	5,656,621,246円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	113,562,512円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	94,246,909円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	781,285,141円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	33,664,211円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴルーキーバー）	3,677,922円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	7,740,970円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	34,005,389円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	36,408,176円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	48,596,190円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	1,078,970,724円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	13,411,940,787円
三菱UFJ バランスファンドVA20型（適格機関投資家限定）	263,175,398円
三菱UFJ バランスファンドVA40型（適格機関投資家限定）	2,317,023,051円
MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	49,862,986,580円
三菱UFJ バランスファンドVA45型（適格機関投資家限定）	230,407,728円
三菱UFJ バランスファンドVA30型（適格機関投資家限定）	89,565,460円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,710,242,579円
MSCI コクサイインデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	3,112,414,073円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	4,032,731円
MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	6,975,931,241円
アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）	61,841,575円
アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）	365,112,988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）	1,382,413,011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）	259,970,356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）	123,882,140円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	15,245,041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）	949,629,866円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	1,940,765,146円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	2,568,128円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	12,001,808円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	18,323,254円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	19,740,928円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	85,496,025円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	24,640,625円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	180,455,086円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	40,515,958円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	282,957,955円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	4,198,780,634円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	173,569,383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）	687,145,111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）	642,134,748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）	548,269,657円
合計	137,017,202,778円

## 日本債券インデックスマザーファンド

### 《第16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]

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月12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	NOMURA-BPI総合インデックスと連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をNOMURA-BPI総合インデックスの動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。
主要運用対象	NOMURA-BPI総合インデックスに採用されている公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

### ○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		NOMURA-BPI 総 合 イ ン デ ッ ク ス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	円	騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率			
12期(2013年5月13日)	12,036	1.5%	345.99	1.5%	98.9%	0.8%	269,276
13期(2014年5月12日)	12,299	2.2%	353.58	2.2%	99.4%	0.2%	283,162
14期(2015年5月12日)	12,572	2.2%	361.38	2.2%	99.4%	0.3%	343,834
15期(2016年5月12日)	13,473	7.2%	387.29	7.2%	99.6%	—	529,456
16期(2017年5月12日)	13,180	△2.2%	378.85	△2.2%	99.3%	0.2%	457,117

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I 総 合 イ ン デ ッ ク ス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2016年 5月12日	円	%		%	%	%
	13,473	—	387.29	—	99.6	—
5月末	13,484	0.1	387.60	0.1	100.2	0.2
6月末	13,648	1.3	392.36	1.3	99.0	0.3
7月末	13,532	0.4	389.24	0.5	99.5	0.3
8月末	13,403	△0.5	385.24	△0.5	99.5	0.3
9月末	13,411	△0.5	385.50	△0.5	99.4	0.3
10月末	13,374	△0.7	384.44	△0.7	99.5	0.2
11月末	13,288	△1.4	381.97	△1.4	99.4	0.2
12月末	13,214	△1.9	379.82	△1.9	99.4	0.2
2017年 1月末	13,142	△2.5	377.74	△2.5	99.7	—
2月末	13,182	△2.2	378.90	△2.2	99.6	—
3月末	13,165	△2.3	378.49	△2.3	99.7	—
4月末	13,230	△1.8	380.33	△1.8	99.5	—
(期 末) 2017年 5月12日						
	13,180	△2.2	378.85	△2.2	99.3	0.2

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

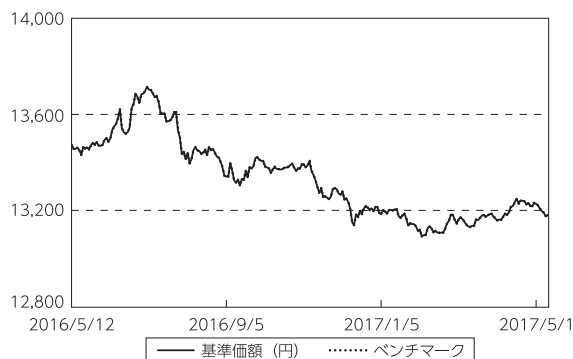
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.2%の下落となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

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

## 基準価額の推移



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



## ●投資環境について

・期の前半は、イギリスの欧州連合（EU）離脱をめぐる国民投票で離脱派が過半数を占めたことにより、世界的な景気の先行きに対する不透明感が高まったことから、一時、国内債券市況は上昇しました。その後、日本銀行が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を導入したことや、次期米国大統領にトランプ氏が選出され米国の金利が上昇したことなどから、国内債券市況は下落しました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

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

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

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

## ◎組入比率要因

組入比率による影響は△0.0%程度でした。

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

## ◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

- ・年限構成、種別構成、デュレーション（平均回収期間や金利感応度）、流動性などを考慮して選択した銘柄に分散投資しました。
- ・流動性の問題を勘案し、相対的に格付の低い社債への投資は見送りましたが、影響は軽微でした。

## ◎その他の要因

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

## ◎今後の運用方針

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

## ○1万口当たりの費用明細

(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 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,339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)

## 公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	274,647,589	315,517,134
	地方債証券	11,667,953	15,877,486
	特殊債券	12,075,501	21,575,855
	社債券	9,028,312	( 1,132,380)
			10,167,681
			( 600,000)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

## 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債券先物取引	百万円 13,426	百万円 12,506	百万円 -	百万円 -

## ○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	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %
公社債	百万円 307,419	百万円 58,496	19.0	百万円 363,138	百万円 59,908	16.5

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 501	百万円 1,447	百万円 1,730

## 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公社債	百万円 4,300

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

## ○組入資産の明細

(2017年5月12日現在)

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	343,882,000 ( 100,000)	375,490,639 ( 100,224)	82.1 ( 0.0)	— ( —)	51.9 ( —)	20.2 ( —)	10.0 ( 0.0)
地方債証券	23,959,970 ( 23,959,970)	25,386,389 ( 25,386,389)	5.6 ( 5.6)	— ( —)	3.7 ( 3.7)	1.5 ( 1.5)	0.4 ( 0.4)
特殊債券 (除く金融債)	27,041,751 ( 27,041,751)	28,996,132 ( 28,996,132)	6.3 ( 6.3)	— ( —)	4.6 ( 4.6)	1.2 ( 1.2)	0.5 ( 0.5)
金融債券	3,140,000 ( 3,140,000)	3,157,567 ( 3,157,567)	0.7 ( 0.7)	— ( —)	0.0 ( 0.0)	0.4 ( 0.4)	0.2 ( 0.2)
普通社債券	20,273,000 ( 20,273,000)	20,958,312 ( 20,958,312)	4.6 ( 4.6)	0.2 ( 0.2)	1.4 ( 1.4)	2.8 ( 2.8)	0.4 ( 0.4)
合 計	418,296,721 ( 74,514,721)	453,989,041 ( 78,598,626)	99.3 ( 17.2)	0.2 ( 0.2)	61.6 ( 9.7)	26.2 ( 6.0)	11.5 ( 1.5)

(注) ( )内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

## (B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
	%	千円	千円
国債証券			
第365回利付国債(2年)	0.1	1,000,000	1,003,090
第366回利付国債(2年)	0.1	2,280,000	2,287,569
第368回利付国債(2年)	0.1	1,400,000	1,405,236
第369回利付国債(2年)	0.1	1,000,000	1,004,040
第370回利付国債(2年)	0.1	1,600,000	1,606,864
第371回利付国債(2年)	0.1	3,600,000	3,616,272
第372回利付国債(2年)	0.1	1,300,000	1,306,188
第373回利付国債(2年)	0.1	1,550,000	1,557,765
第374回利付国債(2年)	0.1	2,100,000	2,110,983
第112回利付国債(5年)	0.4	1,400,000	1,409,058
第113回利付国債(5年)	0.3	840,000	844,519
第114回利付国債(5年)	0.3	2,090,000	2,103,689
第115回利付国債(5年)	0.2	3,670,000	3,689,084
第116回利付国債(5年)	0.2	2,080,000	2,092,979
第117回利付国債(5年)	0.2	3,570,000	3,595,418
第118回利付国債(5年)	0.2	2,260,000	2,277,582
第119回利付国債(5年)	0.1	450,000	452,551
第120回利付国債(5年)	0.2	2,000,000	2,017,200
第121回利付国債(5年)	0.1	2,380,000	2,394,851
第122回利付国債(5年)	0.1	3,070,000	3,090,814
第123回利付国債(5年)	0.1	3,060,000	3,082,705
第124回利付国債(5年)	0.1	4,930,000	4,969,094
第125回利付国債(5年)	0.1	3,000,000	3,025,230
第126回利付国債(5年)	0.1	2,960,000	2,986,758
第127回利付国債(5年)	0.1	4,820,000	4,865,645
第128回利付国債(5年)	0.1	4,950,000	4,998,906
第129回利付国債(5年)	0.1	1,600,000	1,616,432
第130回利付国債(5年)	0.1	5,400,000	5,461,182
第131回利付国債(5年)	0.1	1,300,000	1,314,248
第1回利付国債(40年)	2.4	505,000	715,514
第2回利付国債(40年)	2.2	600,000	820,464
第3回利付国債(40年)	2.2	753,000	1,033,914
第4回利付国債(40年)	2.2	878,000	1,210,200
第5回利付国債(40年)	2.0	865,000	1,144,715
第6回利付国債(40年)	1.9	910,000	1,178,977
第7回利付国債(40年)	1.7	810,000	1,000,366
第8回利付国債(40年)	1.4	1,060,000	1,209,608
第9回利付国債(40年)	0.4	1,430,000	1,168,696
第293回利付国債(10年)	1.8	1,081,000	1,104,554
第294回利付国債(10年)	1.7	1,570,000	1,602,483
第295回利付国債(10年)	1.5	1,240,000	1,262,940
第296回利付国債(10年)	1.5	2,020,000	2,065,854
第297回利付国債(10年)	1.4	1,636,000	1,677,668
第298回利付国債(10年)	1.3	2,640,000	2,703,016

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第299回利付国債 (10年)	1.3	2,760,000	2,835,541	2019/3/20
第300回利付国債 (10年)	1.5	957,000	986,733	2019/3/20
第301回利付国債 (10年)	1.5	2,072,000	2,144,540	2019/6/20
第302回利付国債 (10年)	1.4	2,250,000	2,324,047	2019/6/20
第303回利付国債 (10年)	1.4	2,325,000	2,410,746	2019/9/20
第304回利付国債 (10年)	1.3	1,170,000	1,210,400	2019/9/20
第305回利付国債 (10年)	1.3	3,458,000	3,589,646	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)	1.4	2,488,000	2,598,492	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)	1.3	1,610,000	1,676,911	2020/3/20
第308回利付国債 (10年)	1.3	1,374,000	1,435,953	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	2,300,000	2,389,401	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	2,886,000	2,997,168	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	1,600,000	1,650,864	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	4,030,000	4,225,978	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	2,969,000	3,134,224	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	1,590,000	1,666,192	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	1,853,000	1,954,470	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	780,000	819,499	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	1,557,000	1,640,377	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	1,730,000	1,815,081	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	1,519,000	1,605,036	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	1,980,000	2,082,979	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	2,515,000	2,652,218	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	1,170,000	1,228,137	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	1,675,000	1,762,133	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	2,650,000	2,774,285	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	4,135,000	4,337,408	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	1,360,000	1,421,635	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	2,140,000	2,249,033	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	3,100,000	3,227,534	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	4,620,000	4,873,499	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	1,630,000	1,722,616	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	1,360,000	1,419,908	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	3,610,000	3,774,038	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	3,730,000	3,904,526	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	4,350,000	4,559,452	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	3,450,000	3,591,243	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	1,530,000	1,593,556	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	1,840,000	1,888,392	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	3,580,000	3,701,004	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	4,290,000	4,436,074	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	2,770,000	2,866,063	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	2,770,000	2,842,657	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	4,030,000	4,063,811	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	2,910,000	2,932,465	2026/6/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第344回利付国債 (10年)	0.1	3,610,000	3,635,233	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	3,770,000	3,793,411	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	2,650,000	2,665,582	2027/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	76,000	100,294	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	98,000	125,230	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	117,000	148,344	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	127,000	171,784	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	108,000	136,693	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	169,000	219,431	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	164,000	211,264	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	142,000	172,690	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	116,000	134,212	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	185,000	205,364	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	137,000	164,804	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	220,000	278,456	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	205,000	256,647	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	493,000	649,621	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	346,000	461,896	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	302,000	403,897	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	327,000	432,382	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	427,000	557,939	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	303,000	396,133	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	495,000	665,289	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	379,000	496,766	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	570,000	767,641	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	554,000	747,141	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	411,000	554,541	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	742,000	975,158	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	884,000	1,179,751	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	860,000	1,166,882	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	1,031,000	1,403,015	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	1,030,000	1,386,091	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	1,246,000	1,656,669	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	1,138,000	1,493,852	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	1,319,000	1,764,162	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	1,564,000	1,998,088	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	1,576,000	2,086,750	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	1,759,000	2,255,794	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	1,219,000	1,567,646	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	1,797,000	2,273,456	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	1,105,000	1,374,012	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	1,360,000	1,723,895	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	660,000	821,495	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	1,060,000	1,294,768	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	980,000	1,197,393	2044/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第43回利付国債 (30年)	1.7	1,010,000	1,234,411	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	1,080,000	1,321,822	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	1,200,000	1,410,612	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	1,030,000	1,210,723	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	1,300,000	1,560,039	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	1,250,000	1,438,250	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	1,290,000	1,483,938	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	1,130,000	1,126,033	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)	0.3	1,370,000	1,187,296	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)	0.5	1,170,000	1,072,550	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)	0.6	1,180,000	1,110,238	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)	0.8	550,000	545,396	2047/3/20
第40回利付国債 (20年)	2.3	601,000	621,097	2018/9/20
第42回利付国債 (20年)	2.6	869,000	913,683	2019/3/20
第43回利付国債 (20年)	2.9	74,000	79,336	2019/9/20
第44回利付国債 (20年)	2.5	480,000	516,398	2020/3/20
第47回利付国債 (20年)	2.2	114,000	122,979	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	209,000	228,963	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)	2.1	515,000	559,645	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	200,000	217,552	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	214,000	234,777	2021/9/21
第54回利付国債 (20年)	2.2	480,000	531,600	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	241,000	265,839	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	449,000	497,420	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	147,000	162,851	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	589,000	648,671	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	289,000	307,686	2023/3/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	442,000	493,351	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	441,000	496,870	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	318,000	359,638	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	500,000	562,155	2023/12/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	846,000	978,399	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	422,000	496,153	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	160,000	185,833	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	534,000	618,671	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	620,000	716,106	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	318,000	369,716	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	575,000	671,025	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	200,000	230,258	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	210,000	243,419	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)	1.9	410,000	473,640	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	50,000	58,166	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	315,000	369,000	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	350,000	408,604	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	662,000	778,372	2025/9/20



銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第83回利付国債 (20年)	2.1	413,000	487,563	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	670,000	785,199	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	490,000	580,488	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	515,000	619,205	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	450,000	537,075	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	804,000	970,428	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	410,000	491,151	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	1,100,000	1,322,508	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	468,000	567,028	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	1,432,000	1,714,834	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	390,000	464,950	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	615,000	739,217	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	1,017,000	1,246,852	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	320,000	385,894	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	743,000	906,512	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	470,000	568,601	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	1,345,000	1,632,211	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	910,000	1,117,398	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	573,000	715,911	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	530,000	664,137	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	550,000	683,160	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	600,000	732,090	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	1,110,000	1,358,329	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	431,000	532,259	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	687,000	842,584	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	900,000	1,083,231	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	700,000	844,025	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	776,000	953,750	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	711,000	884,683	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	1,140,000	1,404,924	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	1,332,000	1,644,886	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	1,160,000	1,435,221	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	454,000	567,313	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	226,000	283,130	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	1,760,000	2,182,840	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	776,000	954,247	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	660,000	794,758	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	530,000	624,292	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	1,019,000	1,241,783	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	760,000	916,301	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	898,000	1,120,147	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	700,000	863,926	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	634,000	801,033	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	520,000	643,052	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	1,140,000	1,393,547	2031/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第128回利付国債 (20年)	1.9	1,064,000	1,303,038	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	650,000	787,176	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	1,112,000	1,347,933	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	580,000	695,043	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	977,000	1,171,559	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	1,190,000	1,443,660	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	135,000	164,010	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	600,000	719,880	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	550,000	652,069	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	472,000	567,018	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	450,000	527,224	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	80,000	94,882	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	1,947,000	2,340,060	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	1,450,000	1,743,378	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	840,000	1,022,406	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	910,000	1,080,752	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	1,130,000	1,324,077	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	2,060,000	2,478,077	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	1,780,000	2,141,642	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	2,330,000	2,767,317	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	2,010,000	2,355,177	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	2,500,000	2,928,325	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	1,740,000	2,009,212	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	1,850,000	2,072,851	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	2,180,000	2,439,965	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	2,160,000	2,452,852	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	2,020,000	2,257,632	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	2,330,000	2,519,638	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	1,730,000	1,682,805	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	2,080,000	1,942,428	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	1,940,000	1,911,326	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	1,530,000	1,531,331	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	1,200,000	1,221,276	2037/3/20
第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013)	0.67	100,000	100,224	2018/11/15
小 計		343,882,000	375,490,639	
<b>地方債証券</b>				
第1回東京都公募公債 (20年)	1.54	20,000	21,847	2023/6/20
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	10,000	13,240	2038/9/17
第8回東京都公募公債 (30年)	2.23	80,000	101,524	2038/9/17
第16回東京都公募公債 (20年)	2.01	100,000	119,452	2028/12/20
第20回東京都公募公債 (20年)	2.09	80,000	96,830	2029/9/20
第21回東京都公募公債 (20年)	2.19	80,000	97,953	2029/12/20
第22回東京都公募公債 (20年)	1.92	120,000	143,352	2030/6/20
第24回東京都公募公債 (20年)	1.98	70,000	84,657	2031/6/20
第28回東京都公募公債 (20年)	1.59	100,000	115,757	2033/3/18

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
第666回東京都公募公債	1.46	150,000	154,020	2019/3/20
第669回東京都公募公債	1.63	50,000	51,706	2019/6/20
第678回東京都公募公債	1.38	100,000	103,572	2019/12/20
第680回東京都公募公債	1.39	100,000	103,935	2020/3/19
第681回東京都公募公債	1.4	100,000	103,964	2020/3/19
第686回東京都公募公債	1.08	100,000	103,320	2020/6/19
第692回東京都公募公債	1.35	100,000	104,826	2020/12/18
第693回東京都公募公債	1.38	100,000	105,275	2021/3/19
第705回東京都公募公債	1.06	170,000	178,651	2022/3/18
第709回東京都公募公債	0.78	100,000	103,929	2022/6/20
第716回東京都公募公債	0.77	100,000	104,204	2022/12/20
第718回東京都公募公債	0.6	100,000	103,391	2023/3/20
第721回東京都公募公債	0.84	100,000	104,968	2023/6/20
第722回東京都公募公債	0.8	100,000	104,725	2023/6/20
第728回東京都公募公債	0.65	300,000	312,057	2023/12/20
第729回東京都公募公債	0.69	100,000	104,405	2024/3/19
第750回東京都公募公債	0.444	300,000	308,277	2025/12/19
第751回東京都公募公債	0.37	300,000	306,387	2025/12/19
第758回東京都公募公債	0.03	300,000	296,901	2026/6/19
第764回東京都公募公債	0.215	300,000	301,560	2026/12/18
第765回東京都公募公債	0.21	300,000	301,308	2027/3/19
平成20年度第6回北海道公募公債	1.72	53,990	55,185	2018/8/29
平成21年度第2回北海道公募公債	1.66	100,000	103,374	2019/5/29
平成21年度第12回北海道公募公債	1.42	100,000	103,696	2019/12/25
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	100,000	103,291	2020/10/29
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	100,000	104,095	2022/10/31
平成25年度第9回北海道公募公債	0.7	300,000	312,375	2023/10/31
平成26年度第13回北海道公募公債	0.461	200,000	205,378	2024/12/26
第1回神奈川県公募公債(20年)	2.55	100,000	117,657	2024/6/20
第2回神奈川県公募公債(20年)	2.23	80,000	92,646	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債(30年)	2.87	80,000	109,804	2036/6/20
第3回神奈川県公募公債(20年)	2.11	100,000	116,067	2025/6/20
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	112,368	2034/9/20
第162回神奈川県公募公債	1.62	140,450	145,212	2019/6/20
第163回神奈川県公募公債	1.4	114,000	117,337	2019/6/20
第165回神奈川県公募公債	1.4	54,660	56,451	2019/9/20
第171回神奈川県公募公債	1.41	100,000	103,995	2020/3/20
第191回神奈川県公募公債	0.83	100,000	104,132	2022/6/20
第5回大阪府公募公債(20年)	2.16	100,000	121,903	2030/5/28
第11回大阪府公募公債(20年)	1.693	200,000	234,164	2033/9/27
第316回大阪府公募公債	1.85	100,000	102,232	2018/7/30
第325回大阪府公募公債	1.66	153,000	157,928	2019/4/26
第326回大阪府公募公債	1.66	10,000	10,336	2019/5/28
第331回大阪府公募公債	1.41	100,000	103,452	2019/10/29
第332回大阪府公募公債	1.58	71,600	74,461	2019/11/27

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
第343回大阪府公募公債	0.98	70,000	72,350	2020/10/28
第348回大阪府公募公債	1.32	10,000	10,508	2021/3/30
第351回大阪府公募公債	1.19	100,000	104,922	2021/7/28
第358回大阪府公募公債	0.97	56,000	58,537	2022/2/28
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000	58,620	2022/3/29
第389回大阪府公募公債	0.53	100,000	103,225	2024/10/30
第404回大阪府公募公債	0.4	113,000	115,429	2026/1/28
平成21年度第5回京都市公募公債	1.35	20,000	20,701	2019/12/24
平成22年度第5回京都市公募公債	1.26	110,000	114,963	2020/12/21
平成23年度第9回京都市公募公債	1.01	140,000	146,742	2022/3/16
平成24年度第3回京都市公募公債 (20年)	1.63	200,000	232,360	2032/8/13
平成24年度第10回京都市公募公債	0.67	100,000	103,743	2023/3/22
平成25年度第1回京都市公募公債	0.58	100,000	103,272	2023/4/28
平成25年度第2回京都市公募公債 (15年)	1.05	100,000	108,345	2028/4/28
第1回兵庫県公募公債 (18年)	1.26	200,000	220,584	2032/8/6
第2回兵庫県公募公債 (30年)	2.36	40,000	51,962	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債 (12年)	0.73	300,000	315,273	2026/8/6
第4回兵庫県公募公債 (15年)	1.31	100,000	110,680	2027/12/24
第8回兵庫県公募公債 (15年)	1.09	100,000	108,472	2029/4/16
第15回兵庫県公募公債 (20年)	1.64	300,000	347,568	2032/7/23
第16回兵庫県公募公債 (20年)	1.7	100,000	116,695	2032/11/19
平成20年度第5回兵庫県公募公債	1.93	50,000	51,060	2018/6/20
平成21年度第1回兵庫県公募公債	1.62	120,000	123,754	2019/4/23
平成21年度第25回兵庫県公募公債	1.54	100,000	103,864	2019/11/20
平成27年度第18回兵庫県公募公債	0.125	300,000	299,214	2026/3/19
平成20年度第2回静岡県公募公債	1.91	100,000	102,128	2018/6/26
平成20年度第4回静岡県公募公債	1.65	100,000	102,120	2018/8/28
平成20年度第5回静岡県公募公債	1.59	11,000	11,254	2018/10/30
平成21年度第4回静岡県公募公債	1.56	52,920	54,784	2019/8/20
平成22年度第1回静岡県公募公債	1.455	101,700	106,019	2020/4/20
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	103,730	2020/7/22
平成22年度第8回静岡県公募公債	1.059	100,000	103,448	2020/8/25
平成25年度第1回静岡県公募公債	0.581	100,000	103,265	2023/4/19
平成25年度第5回静岡県公募公債	0.926	100,000	105,481	2023/7/25
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	130,000	135,467	2023/10/24
平成25年度第11回静岡県公募公債 (5年)	0.204	100,000	100,354	2019/3/26
平成26年度第5回静岡県公募公債	0.61	100,000	103,906	2024/7/25
平成27年度第3回静岡県公募公債	0.544	121,000	125,175	2025/5/21
平成23年度第7回愛知県公募公債	1.11	100,000	104,633	2021/7/29
平成23年度第9回愛知県公募公債	1.019	100,000	104,424	2021/9/30
平成23年度第14回愛知県公募公債	1.006	100,000	104,535	2021/11/30
平成23年度第17回愛知県公募公債	0.996	100,000	104,656	2022/1/31
平成24年度第13回愛知県公募公債	0.772	100,000	104,115	2022/11/30
平成26年度第9回愛知県公募公債	0.576	100,000	103,669	2024/8/26
平成28年度第16回愛知県公募公債	0.259	100,000	100,757	2027/2/12

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
平成20年度第4回広島県公募公債	1.73	60,000	61,587	2018/11/26
平成22年度第8回広島県公募公債	1.33	26,650	28,010	2021/3/25
平成23年度第1回広島県公募公債	1.19	100,000	104,767	2021/5/27
平成27年度第4回広島県公募公債	0.476	100,000	102,933	2025/11/25
平成21年度第8回埼玉県公募公債	1.3	100,000	103,382	2019/12/25
平成23年度第1回埼玉県公募公債	1.37	100,000	105,382	2021/4/27
平成23年度第4回埼玉県公募公債	1.2	100,000	105,006	2021/7/27
平成24年度第6回埼玉県公募公債	0.801	100,000	104,229	2022/10/26
平成26年度第6回埼玉県公募公債	0.554	150,000	155,268	2024/9/26
平成26年度第8回埼玉県公募公債	0.335	100,000	101,820	2025/1/28
平成27年度第7回埼玉県公募公債	0.469	400,000	411,560	2025/12/25
平成19年度第1回福岡県公募公債 (30年)	2.62	70,000	93,620	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債 (30年)	2.28	80,000	102,352	2038/9/17
平成21年度第11回福岡県公募公債	1.44	100,000	103,991	2020/2/25
平成22年度第3回福岡県公募公債	1.11	100,000	103,612	2020/8/24
平成22年度第5回福岡県公募公債	0.94	20,000	20,644	2020/10/28
第9回千葉県公募公債 (20年)	1.84	80,000	94,787	2030/10/11
平成20年度第3回千葉県公募公債	1.78	80,000	81,698	2018/7/25
平成20年度第5回千葉県公募公債	1.6	80,000	81,741	2018/9/25
平成22年度第11回千葉県公募公債	1.26	80,000	83,705	2021/1/25
平成23年度第9回千葉県公募公債	1.0	20,000	20,958	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債	1.05	20,000	21,021	2022/4/25
平成24年度第6回千葉県公募公債	0.81	100,000	104,315	2022/11/25
平成25年度第1回千葉県公募公債	0.58	82,500	85,196	2023/4/25
平成26年度第9回千葉県公募公債	0.465	188,000	193,280	2025/3/25
平成21年度第1回新潟県公募公債	1.42	23,000	23,717	2019/7/29
平成24年度第1回大分県公募公債	0.8	100,260	104,506	2022/10/31
第64回共同発行市場公募地方債	1.78	100,000	102,123	2018/7/25
第65回共同発行市場公募地方債	1.62	90,000	91,856	2018/8/24
第74回共同発行市場公募地方債	1.57	100,000	103,167	2019/5/24
第75回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	103,455	2019/6/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	10,000	10,349	2019/8/23
第78回共同発行市場公募地方債	1.39	30,000	30,981	2019/9/25
第79回共同発行市場公募地方債	1.34	200,000	206,530	2019/10/25
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	109,500	113,260	2019/12/25
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	30,000	31,122	2020/9/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	104,814	2021/2/25
第100回共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	105,035	2021/7/23
第101回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	104,457	2021/8/25
第103回共同発行市場公募地方債	1.0	100,000	104,410	2021/10/25
第107回共同発行市場公募地方債	1.01	200,000	209,580	2022/2/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	170,000	178,681	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	104,395	2022/5/25
第113回共同発行市場公募地方債	0.77	100,000	103,933	2022/8/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	104,258	2022/9/22

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	103,869	2022/12/22
第120回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	103,805	2023/3/24
第126回共同発行市場公募地方債	0.81	210,000	220,206	2023/9/25
第129回共同発行市場公募地方債	0.71	200,000	208,710	2023/12/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	200,000	208,282	2024/3/25
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	200,000	208,490	2024/6/25
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	103,913	2024/7/25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	200,000	207,184	2024/8/23
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	203,792	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	100,000	102,848	2025/3/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	102,333	2025/4/25
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	207,050	2025/5/23
第148回共同発行市場公募地方債	0.553	300,000	310,596	2025/7/25
第150回共同発行市場公募地方債	0.51	300,000	309,687	2025/9/25
第153回共同発行市場公募地方債	0.469	100,000	102,890	2025/12/25
第163回共同発行市場公募地方債	0.06	500,000	494,885	2026/10/23
第166回共同発行市場公募地方債	0.18	300,000	300,000	2027/1/25
平成24年度第2回熊本県公募公債	0.8	50,000	52,112	2022/10/26
平成22年度第1回新潟市公募公債	1.21	54,980	57,367	2020/12/24
平成23年度第1回浜松市公募公債	1.045	38,200	39,994	2021/11/25
平成25年度第1回浜松市公募公債	0.761	61,000	63,897	2024/1/24
第1回大阪市公募公債(15年)	1.753	200,000	229,028	2026/7/17
第5回大阪市公募公債(20年)	2.47	100,000	124,246	2028/9/21
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	125,000	129,951	2019/11/25
平成23年度第10回大阪市公募公債	0.956	10,000	10,445	2022/1/27
平成26年度第5回大阪市公募公債	0.593	100,000	103,799	2024/9/27
第1回名古屋市公募公債(12年)	1.033	100,000	107,372	2025/6/20
第2回名古屋市公募公債(20年)	2.56	100,000	117,727	2024/6/20
第10回名古屋市公募公債(20年)	2.26	80,000	98,312	2029/8/17
第477回名古屋市公募公債	1.034	100,000	104,719	2021/12/20
第484回名古屋市公募公債	0.801	100,000	104,793	2023/9/20
第5回京都市公募公債(20年)	2.36	50,000	60,173	2026/12/18
平成23年度第2回京都市公募公債	1.049	100,000	104,456	2021/8/26
平成24年度第4回京都市公募公債	0.801	100,000	104,219	2022/10/21
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	2.54	120,000	145,819	2026/6/19
平成22年度第9回神戸市公募公債(20年)	2.09	80,000	97,568	2031/1/24
第7回横浜市公募公債(20年)	2.06	200,000	232,942	2025/12/19
第17回横浜市公募公債(20年)	2.07	80,000	95,992	2028/12/20
平成20年度第4回横浜市公募公債	1.71	100,000	102,568	2018/11/16
第20回横浜市公募公債(20年)	2.1	80,000	96,858	2029/10/19
平成24年度第4回横浜市公募公債	0.81	100,000	104,499	2023/2/20
平成24年度第3回横浜市公募公債	0.729	100,000	103,919	2022/12/22
第25回横浜市公募公債(20年)	1.72	100,000	117,460	2032/7/16
第27回横浜市公募公債(20年)	1.599	60,000	69,420	2033/5/20
平成21年度第5回札幌市公募公債	1.36	112,000	115,566	2019/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	2.277	80,000	103,048	2040/9/20
第3回川崎市公募公債(15年)	1.82	100,000	106,534	2020/12/21
第44回川崎市公募公債(5年)	0.162	130,400	131,014	2020/6/19
第82回川崎市公募公債	1.52	100,000	103,562	2019/9/20
第17回北九州市公募公債(20年)	1.529	100,000	114,589	2034/6/20
平成20年度第3回福岡市公募公債	1.52	100,000	101,666	2018/6/20
平成20年度第5回福岡市公募公債	1.57	91,000	93,054	2018/10/24
平成22年度第9回福岡市公募公債	1.32	106,500	111,895	2021/3/25
平成23年度第6回福岡市公募公債	1.0	100,000	104,417	2021/10/28
平成25年度第3回福岡市公募公債(5年)	0.31	31,500	31,628	2018/9/26
平成25年度第4回福岡市公募公債	0.68	50,000	52,042	2023/10/24
平成26年度第6回福岡市公募公債(20年)	1.371	100,000	111,944	2034/9/20
平成25年度第2回広島市公募公債	0.72	100,000	104,425	2023/12/27
平成24年度第2回千葉市公募公債	0.81	100,000	104,309	2022/11/22
平成26年度第2回千葉市公募公債	0.505	100,000	103,147	2024/11/27
平成22年度第1回三重県公募公債	1.056	87,050	90,283	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債	1.021	98,410	102,939	2021/11/30
平成24年度第4回福井県公募公債	0.46	100,000	102,556	2023/4/26
平成20年度第1回徳島県公募公債	1.73	36,000	36,955	2018/11/28
平成24年度第1回徳島県公募公債	0.68	100,000	103,805	2023/3/24
平成26年度第1回徳島県公募公債	0.495	100,000	103,074	2024/11/28
平成20年度第1回岡山県公募公債	1.56	48,700	49,919	2018/12/25
小 計		23,959,970	25,386,389	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>				
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	34,000	34,717	2018/7/31
第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	50,000	51,199	2018/10/31
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	115,000	117,902	2018/11/28
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	159,000	162,801	2019/2/27
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	141,000	144,474	2019/3/19
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	242,852	2029/5/31
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	210,000	216,864	2019/6/28
第85回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	103,186	2019/7/31
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	79,000	81,518	2019/9/30
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	121,700	2029/9/28
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	121,783	2029/10/31
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	139,000	143,513	2019/12/27
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	210,000	217,639	2020/1/31
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	130,325	2040/2/29
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	50,000	51,905	2020/3/19
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	122,095	2030/4/30
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	103,508	2020/9/30
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	312,000	322,377	2020/11/30
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	71,000	74,186	2020/12/28
第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	100,000	121,371	2031/1/31
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	91,000	95,190	2021/5/31

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>		%	千円	千円	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.1	60,000	62,875	2021/7/30
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	122,000	127,442	2021/8/31
第145回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	342,000	357,547	2021/9/30
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	100,000	104,630	2021/10/29
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	200,000	238,146	2031/10/31
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	136,000	142,420	2021/11/30
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	112,000	117,035	2022/2/28
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	109,000	113,949	2022/3/18
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.977	100,000	105,040	2022/4/28
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.737	100,000	118,383	2032/4/30
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.83	200,000	242,666	2042/5/30
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.895	12,000	12,573	2022/6/30
第173回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.819	301,000	314,782	2022/9/30
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.668	100,000	104,057	2023/3/17
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	100,000	113,306	2033/4/28
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.541	153,000	158,120	2023/4/28
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.882	100,000	105,538	2023/6/30
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.911	223,000	235,851	2023/7/31
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.669	228,000	238,045	2023/11/30
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.693	188,000	196,676	2023/12/28
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.645	622,000	649,399	2024/3/29
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.644	318,000	332,357	2024/6/28
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.601	100,000	104,224	2024/7/31
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.39	100,000	113,181	2034/8/31
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.539	100,000	103,754	2024/10/31
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.32	100,000	102,097	2025/1/31
第243回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.391	100,000	102,624	2025/4/30
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.32	130,000	132,642	2026/1/30
第344回政府保証道路債券		1.6	100,000	105,197	2020/7/15
第13回政府保証東日本高速道路債券		1.6	28,000	28,656	2018/10/19
第23回政府保証中日本高速道路債券		1.5	90,000	91,850	2018/9/14
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.4	25,000	25,777	2019/7/12
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.5	200,000	206,952	2019/8/16
第4回政府保証公営企業債券(15年)		2.0	100,000	110,089	2022/4/22
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.3	200,000	204,518	2019/1/22
第5回政府保証公営企業債券(15年)		2.2	100,000	111,557	2022/7/15
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.4	100,000	102,758	2019/4/15
第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券		1.5	148,000	152,616	2019/5/24
第9回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)		0.32	100,000	100,687	2019/4/25
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.3	100,000	103,789	2020/3/13
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.1	100,000	103,613	2020/7/17
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.0	100,000	103,463	2020/9/14
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.9	101,000	104,325	2020/11/17
第21回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.2	339,000	354,777	2021/2/15
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.3	30,000	31,536	2021/3/12



銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第25回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	105,058	2021/6/14
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	21,000	21,965	2021/10/18
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	50,000	52,611	2021/12/14
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	100,000	104,748	2022/6/17
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	104,377	2022/8/15
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	17,000	17,689	2023/3/17
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	37,353	2023/5/16
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	150,000	157,983	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	160,000	167,384	2023/12/18
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.601	100,000	104,200	2024/7/16
第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.466	200,000	206,444	2024/12/13
第75回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.44	400,000	412,084	2025/8/15
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.379	400,000	410,212	2025/12/12
第84回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	398,000	395,150	2026/5/22
第89回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.005	203,000	200,917	2026/10/16
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	108,399	2021/4/16
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	1.3	123,000	126,862	2019/9/17
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	104,869	2023/2/24
第37回政府保証日本政策金融公庫債券	0.425	100,000	102,943	2025/9/16
第194回政府保証中小企業債券	1.5	120,000	122,486	2018/9/18
第201回政府保証預金保険機構債券	0.1	200,000	200,456	2019/2/13
第5回政府保証日本政策投資銀行	1.4	50,000	51,379	2019/4/15
第7回政府保証日本政策投資銀行	1.4	100,000	103,978	2020/2/17
第17回政府保証日本政策投資銀行	0.257	200,000	200,860	2018/11/9
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	200,000	20,923	2023/12/18
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.45	20,000	24,007	2026/3/19
第9回道路債券(財投機関債)	2.9	100,000	134,189	2032/5/20
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.87	30,000	43,612	2046/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.75	100,000	142,362	2047/3/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.67	130,000	182,430	2047/3/20
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.39	60,000	72,867	2027/7/20
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.34	100,000	121,266	2027/10/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.42	300,000	369,165	2028/6/20
第42回道路債券(財投機関債)	2.22	130,000	151,187	2025/3/21
第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.63	100,000	102,606	2018/12/20
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.41	150,000	186,045	2029/4/20
第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.14	50,000	60,864	2030/5/10
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.9	50,000	59,846	2032/3/19
第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.711	100,000	117,006	2032/6/18
第100回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.784	100,000	104,078	2022/12/20
第101回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.781	100,000	104,061	2022/12/20
第107回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.935	400,000	421,292	2023/6/20
第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.77	100,000	104,569	2023/12/20
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.476	600,000	616,332	2024/12/20
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.974	100,000	121,731	2055/3/19

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第1回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.648	100,000	103,500	2019/6/28
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.266	50,000	61,286	2029/6/28
第2回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.406	80,000	82,471	2019/7/26
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	20,000	21,138	2023/3/22
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債)	1.176	100,000	109,601	2029/1/26
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	112,890	2023/12/20
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	58,175	2024/9/24
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.092	100,000	121,632	2030/12/27
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.187	80,000	98,516	2031/4/28
第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.164	100,000	103,901	2020/9/28
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.846	80,000	95,003	2031/8/28
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.87	100,000	119,096	2031/9/26
第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.274	50,000	52,293	2020/12/28
第20回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.28	100,000	104,717	2021/1/28
第22回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.687	200,000	233,394	2032/6/28
第23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.418	100,000	105,576	2021/4/28
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	300,000	349,794	2032/7/28
F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.681	70,000	76,632	2023/3/17
第27回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.034	100,000	104,349	2021/8/27
第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.785	50,000	59,103	2033/1/28
第30回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.035	300,000	313,824	2021/11/26
第42回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.801	100,000	104,127	2022/11/28
第46回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.678	100,000	103,649	2023/3/28
F89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.602	300,000	340,806	2027/8/20
F110回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.562	100,000	101,082	2019/4/25
F123回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.6	100,000	114,889	2030/3/19
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	100,000	114,572	2031/7/30
F147回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.291	150,000	165,888	2027/3/19
F226回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.096	100,000	108,638	2029/2/28
第7回阪神高速道路債券(財投機関債)	2.18	100,000	115,987	2025/3/21
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167	80,000	97,584	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911	80,000	95,322	2030/10/29
第21回都市再生債券(財投機関債)	1.72	100,000	102,325	2018/9/20
第68回都市再生債券(財投機関債)	0.854	100,000	104,268	2022/9/20
第100回都市再生債券(財投機関債)	0.569	100,000	103,425	2024/11/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	20,226	21,394	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	19,392	20,654	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	21,336	22,685	2042/6/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	19,812	21,270	2037/11/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	21,556	23,014	2042/8/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	16,948	17,714	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	17,820	18,967	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	20,994	22,287	2042/10/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.94	20,712	21,955	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	17,862	19,002	2037/5/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	13,212	13,545	2037/10/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.99	22,358	23,689	2042/12/10
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.52	12,752	13,008	2037/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.19	18,699	19,925	2037/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		2.24	22,103	23,610	2039/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.43	27,282	27,898	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.15	19,170	20,426	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.16	23,595	25,111	2043/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	14,678	15,136	2039/1/10
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.7	25,116	26,014	2032/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.64	27,586	28,643	2032/11/10
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.71	28,119	29,267	2032/11/10
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.57	84,708	87,780	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	15,861	16,461	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.12	17,055	17,924	2039/7/10
第21回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.92	100,000	102,597	2018/9/20
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	18,214	18,897	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	39,828	41,507	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	21,524	22,462	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.88	40,255	43,054	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.87	42,909	45,753	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	44,187	46,997	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.88	20,848	21,908	2040/12/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.61	46,702	49,330	2045/7/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	19,927	20,884	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	49,712	52,014	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.09	21,674	22,993	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	19,582	20,872	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.6	56,592	60,019	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	55,917	59,785	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	48,632	51,887	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.92	44,439	47,594	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	139,401	149,412	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	45,666	48,653	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	45,836	48,646	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.21	19,038	20,240	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	50,078	53,174	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	52,750	55,740	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	54,520	57,556	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.42	59,490	62,696	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	178,116	187,889	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	60,874	64,229	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	62,987	66,136	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	64,029	66,873	2047/7/10
第62回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.13	50,000	61,070	2030/12/13

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円	
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.11	64,424	66,942	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	67,521	70,207	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	62,661	65,680	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.32	68,662	72,330	2048/7/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.066	80,000	97,322	2031/6/13
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	422,835	442,424	2048/9/10
第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.751	30,000	34,266	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	63,638	66,170	2048/11/10
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	135,766	141,147	2049/1/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	67,671	70,364	2049/2/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	70,720	73,415	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	141,648	146,825	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	145,302	150,702	2049/6/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.863	100,000	119,019	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	75,447	77,948	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	229,101	235,591	2049/11/10
第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	156,422	160,506	2049/12/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	78,936	80,705	2050/1/10
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	162,618	164,728	2050/2/10
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.81	261,822	268,972	2050/4/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	263,850	272,559	2050/7/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	176,934	182,502	2050/8/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.892	100,000	119,591	2032/4/16
第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.441	200,000	224,192	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.86	458,750	472,443	2050/12/10
第105回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.472	100,000	112,208	2027/6/18
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	298,344	299,579	2052/3/10
第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.227	130,000	165,616	2042/9/19
第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.801	100,000	118,375	2032/9/17
第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)	2.04	50,000	57,636	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)	1.991	70,000	84,460	2031/6/13
第11回国際協力機構債券(財投機関債)	1.14	30,000	31,533	2021/12/20
第21回東日本高速道路	0.58	100,000	100,630	2018/6/20
第22回東日本高速道路	0.401	100,000	100,432	2018/6/20
第28回東日本高速道路	0.248	100,000	100,607	2019/12/20
第33回中日本高速道路	1.084	50,000	52,267	2021/9/17
第18回西日本高速道路	0.893	100,000	104,584	2023/3/20
第20回西日本高速道路	0.759	100,000	104,032	2023/9/20
第29回西日本高速道路	0.31	400,000	403,264	2026/2/12
第132回福岡北九州高速道路債券	0.704	100,000	102,919	2024/3/19
第64回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)	0.193	100,000	100,202	2018/6/20
小 計		27,041,751	28,996,132	
<b>金融債券</b>				
い第773号商工債券	0.2	100,000	100,441	2019/10/25
い第775号商工債券	0.2	400,000	401,888	2019/12/27

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>金融債券</b>	%	千円	千円	
い第776号商工債券	0.17	100,000	100,406	2020/1/27
い第763号農林債券	0.3	340,000	341,547	2018/12/27
い第765号農林債券	0.3	100,000	100,503	2019/2/27
い第769号農林債券	0.3	100,000	100,595	2019/6/27
い第774号農林債券	0.24	100,000	100,559	2019/11/27
い第780号農林債券	0.28	300,000	302,370	2020/5/27
第286回信金中金債	0.35	100,000	100,455	2018/9/27
第288回信金中金債	0.3	200,000	200,864	2018/11/27
第291回信金中金債	0.25	100,000	100,413	2019/2/27
第293回信金中金債	0.25	100,000	100,453	2019/4/26
第304回信金中金債	0.225	200,000	201,176	2020/3/27
第316回信金中金債	0.07	200,000	200,230	2021/3/26
第318回信金中金債	0.04	100,000	99,919	2021/5/27
第322回信金中金債	0.03	400,000	399,476	2021/9/27
第8号商工債券(10年)	1.66	100,000	102,637	2018/12/20
第11号商工債券(10年)	0.66	100,000	103,635	2024/9/20
小 計		3,140,000	3,157,567	
<b>普通社債券</b>				
第459回東京電力	2.7	80,000	83,309	2019/1/29
第534回東京電力	2.055	100,000	104,219	2019/10/29
第544回東京電力	1.976	100,000	101,968	2018/6/25
第549回東京電力	1.699	150,000	153,072	2018/10/17
第559回東京電力	1.377	60,000	61,528	2019/10/29
第563回東京電力	1.39	100,000	103,116	2020/5/28
第567回東京電力	1.958	100,000	110,161	2030/7/29
第568回東京電力	1.155	100,000	102,612	2020/9/8
第490回中部電力	1.444	70,000	72,075	2019/7/25
第499回中部電力	1.194	50,000	52,922	2023/6/23
第500回中部電力	0.875	100,000	104,236	2024/5/24
第518回中部電力	0.19	200,000	199,834	2023/1/25
第478回関西電力	1.448	200,000	206,852	2020/1/24
第485回関西電力	1.285	100,000	103,825	2020/12/18
第379回中国電力	0.619	100,000	101,653	2021/1/25
第381回中国電力	0.953	100,000	104,746	2024/4/25
第382回中国電力	0.517	100,000	101,390	2021/5/25
第304回北陸電力	0.989	100,000	104,793	2023/10/25
第456回東北電力	1.176	100,000	103,667	2020/11/25
第473回東北電力	0.597	100,000	101,674	2021/4/23
第490回東北電力	0.22	300,000	299,745	2023/2/24
第245回四国電力	2.0	100,000	107,532	2021/6/25
第371回九州電力	1.43	100,000	106,358	2022/12/22
第400回九州電力	1.777	100,000	104,733	2020/4/24
第422回九州電力	1.164	100,000	102,989	2020/6/25
第429回九州電力	0.909	100,000	103,979	2024/9/25
第430回九州電力	0.54	100,000	101,323	2021/10/25

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券	%	千円	千円	
第310回北海道電力	1.286	50,000	51,961	2020/12/25
第316回北海道電力	1.164	400,000	412,084	2020/6/25
第319回北海道電力	0.514	200,000	201,696	2019/9/25
第19回沖縄電力	1.452	80,000	83,108	2020/4/24
第344回東京交通債券	1.67	100,000	108,881	2023/2/17
第347回東京交通債券	2.05	100,000	112,904	2024/3/8
第38回関西国際空港	1.112	50,000	52,442	2021/12/20
第10回成田国際空港	1.094	160,000	167,323	2021/9/17
第12回成田国際空港	0.879	100,000	104,235	2022/9/20
第13回成田国際空港	0.802	100,000	103,981	2023/2/8
第17回成田国際空港	0.489	100,000	102,421	2025/2/20
第7回大和ハウス工業	0.06	200,000	199,032	2021/6/18
第10回大和ハウス工業	0.001	100,000	99,988	2020/2/28
第3回セブン&アイ・ホールディングス	1.94	100,000	102,049	2018/6/20
第8回セブン&アイ・ホールディングス	0.383	100,000	100,487	2019/6/20
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	300,000	303,504	2022/6/20
第21回三菱ケミカルホールディングス	0.12	100,000	99,842	2021/6/9
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	103,825	2022/12/2
第4回富士フイルムホールディングス	0.005	500,000	498,175	2020/3/3
第9回資生堂	0.001	100,000	99,806	2019/12/17
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	104,122	2021/9/17
第30回豊田自動織機	0.001	300,000	299,325	2020/3/19
第5回日本電産	0.001	300,000	299,355	2019/11/25
第15回パナソニック	0.19	300,000	299,892	2021/9/17
第12回デンソー	0.01	100,000	99,545	2021/9/17
第1回日本生命2012基金	0.87	100,000	100,849	2018/8/3
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,722	2019/8/7
第1回日本生命2015基金	0.406	100,000	100,512	2019/8/5
第53回日産自動車	1.744	100,000	104,730	2020/4/28
第5回凸版印刷	1.397	100,000	104,517	2020/12/16
第3回大日本印刷	1.358	100,000	104,256	2020/12/18
第78回三菱商事	1.155	100,000	104,476	2022/3/9
第8回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	1.62	100,000	105,989	2021/10/29
第9回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	2.2	100,000	114,940	2026/10/30
第28回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	1.56	100,000	105,024	2021/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	2.46	100,000	121,693	2031/1/20
第6回住友信託銀行(劣後特約付)	2.78	100,000	119,587	2026/4/27
第8回三井住友信託銀行(社債間限定同順位特約付)	0.234	1,000,000	1,004,780	2019/7/22
第13回住友信託銀行(劣後特約付)	2.341	100,000	115,848	2026/6/15
第22回三井住友銀行(劣後特約付)	1.43	100,000	104,184	2020/9/28
第23回三井住友銀行(劣後特約付)	1.61	100,000	105,098	2020/12/17
第25回三井住友銀行(劣後特約付)	2.21	200,000	230,198	2026/6/1
第5回みずほ銀行(劣後特約付)	2.49	100,000	116,518	2026/1/30
第9回みずほ銀行(劣後特約付)	2.52	100,000	118,641	2027/4/27
第18回みずほ銀行(劣後特約付)	2.14	100,000	114,205	2026/9/11

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第11回芙蓉総合リース	0.21	100,000	99,747	2021/5/7
第12回芙蓉総合リース	0.12	300,000	299,202	2020/9/18
第38回日産フィナンシャルサービス	0.001	200,000	199,328	2019/6/20
第40回日産フィナンシャルサービス	0.001	500,000	498,375	2020/3/19
第41回日産フィナンシャルサービス	0.03	200,000	198,548	2021/9/17
第29回ホンダファイナンス	0.428	200,000	202,020	2021/3/19
第35回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,676	2019/12/20
第37回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,703	2020/3/19
第38回ホンダファイナンス	0.01	300,000	298,572	2021/3/19
第39回ホンダファイナンス	0.001	100,000	99,832	2019/12/20
第47回日立キャピタル	0.874	100,000	103,204	2023/3/20
第52回日立キャピタル	0.508	200,000	201,940	2021/6/18
第56回日立キャピタル	0.197	100,000	100,030	2019/12/20
第62回日立キャピタル	0.001	300,000	299,364	2019/9/20
第9回三井住友ファイナンス&リース	0.518	200,000	202,016	2021/1/29
第14回三井住友ファイナンス&リース	0.321	200,000	200,906	2020/10/30
第34回三菱UFJリース	0.301	100,000	100,432	2020/9/3
第36回三菱UFJリース	0.355	100,000	100,709	2022/1/21
第38回三菱UFJリース	0.16	200,000	199,812	2021/4/21
第39回三菱UFJリース	0.12	100,000	99,721	2021/6/9
第41回三菱UFJリース	0.06	200,000	198,888	2021/7/23
第47回三菱UFJリース	0.001	100,000	99,732	2020/1/24
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	113,674	2025/9/24
第43回野村ホールディングス	0.454	300,000	301,866	2019/2/25
第48回野村ホールディングス	0.245	100,000	100,110	2018/6/8
第2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回	1.98	100,000	101,901	2018/6/20
第51回三井不動産	0.001	100,000	99,860	2019/12/6
第98回三菱地所	1.165	100,000	103,152	2020/6/19
第105回三菱地所	1.178	100,000	104,622	2022/3/23
第112回三菱地所	0.577	200,000	203,044	2020/12/25
第116回三菱地所	0.643	100,000	102,535	2024/9/19
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	103,818	2021/9/17
第17回エヌ・ティ・ティ都市開発	0.61	100,000	101,640	2024/9/20
第15回東日本旅客鉄道	2.65	100,000	108,462	2020/8/25
第26回東日本旅客鉄道	1.19	100,000	105,992	2022/12/20
第29回東日本旅客鉄道	2.01	200,000	223,922	2023/9/20
第39回東日本旅客鉄道	2.05	400,000	459,756	2025/6/20
第79回東日本旅客鉄道	1.131	100,000	104,545	2021/9/29
第83回東日本旅客鉄道	1.633	100,000	113,140	2026/12/22
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	122,100	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道	2.28	123,000	136,025	2022/3/25
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	117,835	2030/10/25
第56回東海旅客鉄道	2.083	100,000	121,968	2031/5/26
第74回東海旅客鉄道	1.685	100,000	115,158	2045/3/6
第11回東京地下鉄	1.16	100,000	104,832	2021/12/9

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券		%	千円	千円	
第5回関西高速鉄道		1.238	100,000	103,539	2020/9/10
第60回日本電信電話		1.31	200,000	208,462	2020/12/18
第63回日本電信電話		0.69	100,000	102,984	2023/3/20
第19回KDDI		1.151	100,000	102,950	2020/6/19
第21回KDDI		0.669	100,000	102,282	2024/9/20
第20回エス・ティ・ティ・ドコモ		0.73	100,000	102,739	2023/9/20
第38回電源開発		0.978	100,000	104,758	2023/12/20
第40回電源開発		0.889	200,000	208,762	2024/6/20
第23回東京ガス		1.01	200,000	210,672	2023/6/9
第2回ファーストリテイリング		0.291	300,000	300,714	2020/12/18
第3回ファーストリテイリング		0.491	100,000	101,098	2022/12/16
第4回ファーストリテイリング		0.749	100,000	102,766	2025/12/18
第19回フランス相互信用連合銀行		0.999	200,000	208,478	2025/10/15
第5回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー		0.793	100,000	100,804	2018/12/13
第7回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー		0.55	100,000	100,496	2019/7/10
第15回GEキャピタルコーポレーション		2.215	100,000	106,078	2020/11/20
第9回ナショナル・オーストラリア銀行		0.457	100,000	100,474	2019/1/17
第11回ナショナル・オーストラリア銀行		0.284	100,000	100,238	2020/1/16
第8回オーストラリア・コモンウェルス銀行		0.407	300,000	301,296	2019/5/2
第9回ラボバンク・ネダーランド		1.81	100,000	105,257	2021/1/28
第18回ラボバンク・ネダーランド		0.778	100,000	100,260	2017/11/2
第23回ラボバンク・ネダーランド		0.557	100,000	100,368	2018/12/19
第27回ラボバンク・ネダーランド		0.38	100,000	100,059	2020/5/22
小	計		20,273,000	20,958,312	
合	計		418,296,721	453,989,041	

## 先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	債券先物取引	10年国債標準物	百万円 903	百万円 -

## ○投資信託財産の構成

(2017年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 453,989,041	% 98.7
コール・ローン等、その他	6,133,517	1.3
投資信託財産総額	460,122,558	100.0



## ○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	460,122,558,611
コール・ローン等	4,914,804,368
公社債(評価額)	453,989,041,759
未収入金	120,332,000
未収利息	975,110,866
前払費用	118,159,618
差入委託証拠金	5,110,000
(B) 負債	3,004,837,747
未払金	2,492,498,882
未払解約金	512,331,831
未払利息	7,034
(C) 純資産総額(A-B)	457,117,720,864
元本	346,837,954,485
次期繰越損益金	110,279,766,379
(D) 受益権総口数	346,837,954,485口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,180円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 392,963,515,092円  
 期中追加設定元本額 245,553,693,560円  
 期中一部解約元本額 291,679,254,167円  
 また、1口当たり純資産額は、期末13,180円です。

## ○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	4,764,229,288
受取利息	4,766,448,490
支払利息	△ 2,219,202
(B) 有価証券売買損益	△ 15,862,403,131
売買益	334,478,828
売買損	△ 16,196,881,959
(C) 先物取引等取引損益	△ 15,895,760
取引益	5,049,520
取引損	△ 20,945,280
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 11,114,069,603
(E) 前期繰越損益金	136,493,106,961
(F) 追加信託差損益金	79,979,939,453
(G) 解約差損益金	△ 95,079,210,432
(H) 計(D+E+F+G)	110,279,766,379
次期繰越損益金(H)	110,279,766,379

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

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

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

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

ファンド・マネジャー（国内債券）	54,615,483,471円
eMAXIS 国内債券インデックス	16,911,704,114円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,872,202,478円
eMAXIS バランス（波乗り型）	478,157,438円
コアバランス	2,044,029円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	6,231,670円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	2,420,327円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	4,262,915円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	113,708,426円
国内債券セレクション（ラップ向け）	4,501,380円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	31,301,599円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	17,309,618,544円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	5,497,356,560円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	82,107,820円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	598,261,047円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	7,881,350,735円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	442,095,198円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	504,579,550円
eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）	59,802,401円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	59,441,649円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	46,440,556円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	42,802,857円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	88,464,709円
eMAXIS 最適化バランス（マイフoward）	18,110,184円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	1,659,004円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	2,299,233,788円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	14,282,635,043円
三菱UFJ バランスファンドVA20型（適格機関投資家限定）	1,873,954,110円
三菱UFJ バランスファンドVA40型（適格機関投資家限定）	6,219,044,942円
MUKAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	159,938,336,353円
三菱UFJ バランスファンドVA50型（適格機関投資家限定）	5,661,045,142円
三菱UFJ バランスファンドVA75型（適格機関投資家限定）	2,003,390,686円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	1,362,090,967円
三菱UFJ バランスファンドVA45型（適格機関投資家限定）	582,256,980円
三菱UFJ バランスファンドVA30型（適格機関投資家限定）	158,108,340円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	5,547,131,810円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	4,031,768,610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）	3,361,732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）	8,761,774,765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）	1,647,703,661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）	658,523,690円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	57,044,851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）	12,188,316,244円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	26,310,784円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	60,808,964円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	54,028,124円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	38,284,243円
三菱UFJ 日本債券インデックスファンドVA	19,292,503円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	225,020,167円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	482,066,864円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	198,546,601円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	414,897,943円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	3,316,415,148円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	1,748,884,567円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	3,421,157,759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）	1,827,142,808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）	1,055,267,635円
合計	346,837,954,485円

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

### 《第9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]

「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第9期の決算を行いました。  
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第9期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。 組入外貨建資産については、原則として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。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。
主 要 運 用 対 象	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

### ○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	除く日本、円ヘッジ・円ベース)	期 騰 落			
	円	%			%	%	百万円
5期(2014年1月27日)	11,480	0.9	346.93	1.0	94.3	—	21,815
6期(2015年1月26日)	12,640	10.1	382.26	10.2	91.3	—	33,121
7期(2016年1月26日)	12,613	△ 0.2	381.71	△ 0.1	95.6	—	57,354
8期(2017年1月26日)	12,509	△ 0.8	378.81	△ 0.8	96.9	—	92,179
9期(2018年1月26日)	12,633	1.0	382.76	1.0	98.5	—	183,523

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス ( <small>債(日本、円ヘッジ・円ベース)</small> )		債 組 入 比 率 %	債 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 12,509	% —	378.81	% —	96.9	—
1月末	12,501	△0.1	378.53	△0.1	97.2	—
2月末	12,628	1.0	382.40	0.9	97.3	—
3月末	12,599	0.7	381.61	0.7	98.8	—
4月末	12,666	1.3	383.65	1.3	99.3	—
5月末	12,733	1.8	385.66	1.8	99.7	—
6月末	12,684	1.4	384.17	1.4	109.1	—
7月末	12,673	1.3	383.87	1.3	99.2	—
8月末	12,788	2.2	387.34	2.3	99.1	—
9月末	12,677	1.3	383.97	1.4	100.9	—
10月末	12,726	1.7	385.49	1.8	98.4	—
11月末	12,740	1.8	385.93	1.9	99.0	—
12月末	12,720	1.7	385.27	1.7	100.0	—
(期 末) 2018年1月26日	12,633	1.0	382.76	1.0	98.5	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

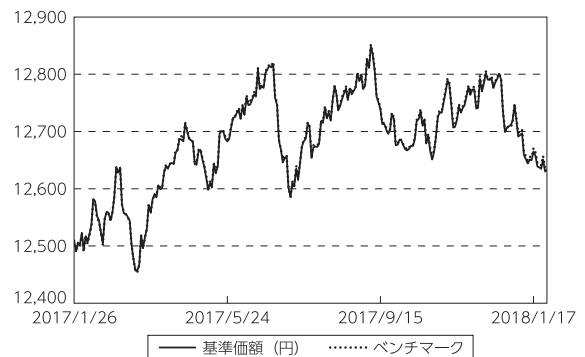
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.0%の上昇となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(1.0%)と同程度となりました。

## 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

## ◎外国債券市況

- ・先進国の債券市況は、米国のインフレが抑制されるとの観測などを背景に上昇しました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。
- ・組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動を維持するため、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1.0%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

	ポートフォリオ 要 因	管理コスト 等 要 因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	0.0%程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.1\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度

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

## ◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は $0.0\%$ 程度でした。

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

## ◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

- ・為替ヘッジ効果、カストディーフィー、取引コスト等による要因です。  
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。

## ◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

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

## ◎今後の運用方針

- ・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。
- ・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

(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) そ の 他 費 用	円	%	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
( 保 管 費 用 )	(2)	(0.013)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
( そ の 他 )	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	2	0.013	
期中の平均基準価額は、12,677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)

## 公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカドル 635,251	千アメリカドル 283,993
	カナダ	千カナダドル 37,284	千カナダドル 14,355
	メキシコ	千メキシコペソ 192,853	千メキシコペソ 78,654
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 80,767	34,272
	イタリア	国債証券 102,108	38,711
	フランス	国債証券 111,795	44,756
	オランダ	国債証券 21,630	8,182
	スペイン	国債証券 58,157	18,958
	ベルギー	国債証券 25,639	8,842
	オーストリア	国債証券 15,663	5,099
	フィンランド	国債証券 6,199	2,067
	アイルランド	国債証券 7,627	2,306
	イギリス	国債証券 千イギリスポンド 63,668	千イギリスポンド 22,690
	スイス	国債証券 千スイスフラン 1,730	千スイスフラン 746
	国	スウェーデン	国債証券 千スウェーデンクローネ 42,589
ノルウェー		国債証券 千ノルウェークローネ 25,435	千ノルウェークローネ 4,346
デンマーク		国債証券 千デンマーククローネ 43,289	千デンマーククローネ 18,868
ポーランド		国債証券 千ポーランドズロチ 31,403	千ポーランドズロチ 14,545
オーストラリア		国債証券 千オーストラリアドル 33,256	千オーストラリアドル 9,493
シンガポール		国債証券 千シンガポールドル 10,311	千シンガポールドル 3,678
南アフリカ		国債証券 千南アフリカランド 81,534	千南アフリカランド 20,809

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

## ○利害関係人との取引状況等

(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			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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	1,852,172	204,754	11.1	1,935,108	272,537	14.1
為替直物取引	117,899	63,018	53.5	35,683	6,170	17.3

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

## 外国公社債

## (A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 690,580	千アメリカドル 694,870	千円 76,282,930	% 41.6	% —	% 17.6	% 15.8	% 8.2
カナダ	千カナダドル 41,520	千カナダドル 44,241	3,924,214	2.1	—	0.9	0.8	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 235,450	千メキシコペソ 238,284	1,405,877	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	85,520	98,232	13,376,314	7.3	—	4.2	2.0	1.1
イタリア	118,330	133,733	18,210,484	9.9	—	5.8	2.9	1.2
フランス	118,110	138,644	18,879,241	10.3	—	6.6	2.5	1.2
オランダ	25,750	29,969	4,081,006	2.2	—	1.3	0.6	0.3
スペイン	68,530	79,833	10,870,866	5.9	—	3.9	1.5	0.5
ベルギー	28,930	34,837	4,743,830	2.6	—	1.9	0.6	0.2
オーストリア	17,930	21,321	2,903,302	1.6	—	1.0	0.4	0.2
フィンランド	7,840	8,476	1,154,213	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	9,680	10,896	1,483,727	0.8	—	0.5	0.2	0.1
イギリス	千イギリスポンド 69,500	千イギリスポンド 85,024	13,216,273	7.2	—	5.2	1.5	0.5
スイス	千スイスフラン 2,330	千スイスフラン 2,741	319,649	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 56,500	千スウェーデンクローネ 62,942	872,381	0.5	—	0.2	0.2	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 36,950	千ノルウェークローネ 38,603	547,394	0.3	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 47,550	千デンマーククローネ 58,752	1,074,589	0.6	—	0.4	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 36,000	千ポーランドズロチ 36,934	1,213,676	0.7	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 43,250	千オーストラリアドル 45,317	3,996,084	2.2	—	1.4	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 12,800	千シンガポールドル 13,265	1,112,084	0.6	—	0.3	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 130,350	千南アフリカランド 120,605	1,110,773	0.6	—	0.6	0.0	0.0
合 計	—	—	180,778,919	98.5	—	53.1	30.6	14.8

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

## (B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ	国債証券	0.75 T-NOTE 190215	1,800	1,777	195,180	2019/2/15
		0.75 T-NOTE 190715	1,100	1,080	118,592	2019/7/15
		0.75 T-NOTE 190815	2,200	2,157	236,902	2019/8/15
		0.875 T-NOTE 190415	2,700	2,665	292,573	2019/4/15
		0.875 T-NOTE 190515	1,100	1,084	119,073	2019/5/15
		0.875 T-NOTE 190615	500	492	54,064	2019/6/15
		0.875 T-NOTE 190731	500	491	53,983	2019/7/31
		0.875 T-NOTE 190915	1,700	1,668	183,192	2019/9/15
		1 T-NOTE 190315	1,900	1,880	206,414	2019/3/15
		1 T-NOTE 190630	400	394	43,304	2019/6/30
		1 T-NOTE 190831	2,700	2,657	291,716	2019/8/31
		1 T-NOTE 190930	1,500	1,474	161,904	2019/9/30
		1 T-NOTE 191015	2,500	2,456	269,700	2019/10/15
		1 T-NOTE 191115	5,700	5,595	614,282	2019/11/15
		1 T-NOTE 191130	1,300	1,275	140,015	2019/11/30
		1.125 T-NOTE 190115	2,800	2,780	305,198	2019/1/15
		1.125 T-NOTE 190131	1,900	1,885	206,952	2019/1/31
		1.125 T-NOTE 190228	7,200	7,138	783,654	2019/2/28
		1.125 T-NOTE 190531	1,300	1,285	141,125	2019/5/31
		1.125 T-NOTE 191231	1,800	1,768	194,122	2019/12/31
		1.125 T-NOTE 200430	1,000	978	107,369	2020/4/30
		1.125 T-NOTE 210228	3,100	2,997	329,071	2021/2/28
		1.125 T-NOTE 210630	16,000	15,398	1,690,474	2021/6/30
		1.125 T-NOTE 210731	2,600	2,499	274,412	2021/7/31
		1.125 T-NOTE 210831	2,800	2,688	295,112	2021/8/31
		1.125 T-NOTE 210930	700	671	73,688	2021/9/30
		1.25 T-NOTE 181231	400	397	43,663	2018/12/31
		1.25 T-NOTE 190131	1,800	1,788	196,307	2019/1/31
		1.25 T-NOTE 190331	3,400	3,372	370,263	2019/3/31
		1.25 T-NOTE 190430	2,000	1,982	217,613	2019/4/30
		1.25 T-NOTE 190531	3,100	3,070	337,087	2019/5/31
		1.25 T-NOTE 191031	300	295	32,486	2019/10/31
		1.25 T-NOTE 200131	900	885	97,204	2020/1/31
		1.25 T-NOTE 200229	2,400	2,358	258,933	2020/2/29
		1.25 T-NOTE 210331	12,100	11,734	1,288,176	2021/3/31
		1.25 T-NOTE 211031	3,100	2,983	327,476	2021/10/31
		1.375 T-NOTE 181231	1,600	1,592	174,845	2018/12/31
		1.375 T-NOTE 190228	500	497	54,566	2019/2/28
		1.375 T-NOTE 191215	6,600	6,516	715,406	2019/12/15
		1.375 T-NOTE 200115	10,200	10,064	1,104,840	2020/1/15
		1.375 T-NOTE 200131	3,600	3,550	389,804	2020/1/31
		1.375 T-NOTE 200215	2,700	2,661	292,179	2020/2/15
		1.375 T-NOTE 200229	1,600	1,576	173,054	2020/2/29
		1.375 T-NOTE 200331	9,100	8,958	983,466	2020/3/31
		1.375 T-NOTE 200430	1,100	1,081	118,757	2020/4/30
		1.375 T-NOTE 200531	1,600	1,572	172,587	2020/5/31

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利 率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.375 T-NOTE 200831	1.375	1,300	1,274	139,915	2020/8/31
	1.375 T-NOTE 200930	1.375	14,000	13,713	1,505,461	2020/9/30
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	4,200	4,109	451,170	2020/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	1,600	1,560	171,339	2021/1/31
	1.375 T-NOTE 210430	1.375	2,600	2,528	277,578	2021/4/30
	1.375 T-NOTE 210531	1.375	2,500	2,428	266,645	2021/5/31
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	2,400	2,268	249,042	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	2,000	1,886	207,055	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	1,700	1,601	175,792	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 190131	1.5	1,300	1,294	142,134	2019/1/31
	1.5 T-NOTE 190228	1.5	500	497	54,639	2019/2/28
	1.5 T-NOTE 190331	1.5	400	397	43,685	2019/3/31
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	4,900	4,869	534,559	2019/5/31
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	4,150	4,111	451,333	2019/10/31
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	2,000	1,979	217,347	2019/11/30
	1.5 T-NOTE 200515	1.5	4,000	3,944	432,996	2020/5/15
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	4,700	4,632	508,508	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 200715	1.5	2,900	2,855	313,449	2020/7/15
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	800	774	85,017	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	1,900	1,815	199,293	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	7,700	7,349	806,870	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	5,750	5,260	577,530	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 190331	1.625	1,400	1,394	153,115	2019/3/31
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	2,000	1,991	218,616	2019/4/30
	1.625 T-NOTE 190630	1.625	2,650	2,636	289,439	2019/6/30
	1.625 T-NOTE 190731	1.625	17,100	17,005	1,866,825	2019/7/31
	1.625 T-NOTE 190831	1.625	2,500	2,484	272,756	2019/8/31
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,600	1,586	174,165	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 200315	1.625	1,500	1,485	163,042	2020/3/15
	1.625 T-NOTE 200630	1.625	1,500	1,481	162,650	2020/6/30
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	1,300	1,283	140,896	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,500	1,476	162,122	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	8,400	8,127	892,290	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	11,050	10,664	1,170,706	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	7,850	7,534	827,100	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	2,500	2,397	263,193	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	2,200	2,099	230,534	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	4,500	4,183	459,236	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	9,200	8,527	936,121	2026/5/15
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	2,000	1,990	218,530	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 191130	1.75	4,000	3,977	436,701	2019/11/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	1,500	1,482	162,766	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	1,700	1,678	184,249	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 211130	1.75	10,000	9,794	1,075,243	2021/11/30
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	12,750	12,463	1,368,201	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	1,400	1,367	150,089	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	1,500	1,463	160,681	2022/4/30

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,200	1,170	128,524	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220531	1.75	3,800	3,703	406,571	2022/5/31
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	3,600	3,497	383,907	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,500	1,448	158,983	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	3,250	3,229	354,485	2020/6/30
	1.875 T-NOTE 201215	1.875	6,000	5,947	652,942	2020/12/15
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	700	689	75,699	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220131	1.875	2,000	1,965	215,717	2022/1/31
	1.875 T-NOTE 220228	1.875	2,500	2,454	269,432	2022/2/28
	1.875 T-NOTE 220430	1.875	4,000	3,921	430,474	2022/4/30
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	3,700	3,627	398,189	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,700	1,662	182,456	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	6,300	6,152	675,404	2022/10/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	7,500	7,467	819,747	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	350	348	38,218	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	1,800	1,787	196,276	2021/2/28
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,000	990	108,699	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	2,300	2,275	249,752	2021/10/31
	2 T-NOTE 211231	2.0	1,300	1,284	140,996	2021/12/31
	2 T-NOTE 220215	2.0	2,900	2,864	314,481	2022/2/15
	2 T-NOTE 221130	2.0	200	196	21,547	2022/11/30
	2 T-NOTE 230215	2.0	2,300	2,253	247,404	2023/2/15
	2 T-NOTE 240430	2.0	2,500	2,425	266,237	2024/4/30
	2 T-NOTE 240531	2.0	1,900	1,841	202,161	2024/5/31
	2 T-NOTE 250215	2.0	4,250	4,097	449,797	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	3,650	3,506	384,950	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	5,600	5,330	585,134	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 200831	2.125	1,000	999	109,677	2020/8/31
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	700	698	76,653	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	18,400	18,302	2,009,221	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,000	993	109,111	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	3,700	3,673	403,298	2021/12/31
	2.125 T-NOTE 220630	2.125	5,550	5,492	602,995	2022/6/30
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	2,000	1,960	215,254	2023/11/30
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	1,600	1,565	171,874	2024/2/29
	2.125 T-NOTE 240331	2.125	3,400	3,324	364,970	2024/3/31
	2.125 T-NOTE 241130	2.125	3,500	3,407	374,083	2024/11/30
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	3,700	3,591	394,317	2025/5/15
	2.25 T-BOND 460815	2.25	1,250	1,097	120,436	2046/8/15
	2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,800	1,800	197,650	2021/3/31
	2.25 T-NOTE 210430	2.25	1,600	1,600	175,689	2021/4/30
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	700	699	76,779	2021/7/31
	2.25 T-NOTE 231231	2.25	300	295	32,483	2023/12/31
	2.25 T-NOTE 240131	2.25	4,150	4,091	449,180	2024/1/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	12,000	11,778	1,293,071	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	4,200	4,075	447,387	2027/2/15
	2.375 T-NOTE 201231	2.375	700	703	77,236	2020/12/31

銘柄		利 率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	2.375 T-NOTE 240815	2.375	11,500	11,389	1,250,338	2024/8/15
	2.375 T-NOTE 270515	2.375	9,000	8,818	968,105	2027/5/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	4,850	4,505	494,621	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	2,500	2,316	254,359	2046/2/15
	2.5 T-BOND 460515	2.5	5,250	4,862	533,839	2046/5/15
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	12,350	12,376	1,358,642	2023/8/15
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	10,600	10,587	1,162,304	2024/5/15
	2.625 T-NOTE 200815	2.625	1,400	1,416	155,451	2020/8/15
	2.625 T-NOTE 201115	2.625	3,800	3,844	422,085	2020/11/15
	2.75 T-BOND 420815	2.75	10,550	10,358	1,137,187	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	2,000	1,961	215,357	2042/11/15
	2.75 T-BOND 471115	2.75	2,900	2,823	310,004	2047/11/15
	2.75 T-NOTE 190215	2.75	2,100	2,118	232,546	2019/2/15
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	4,100	4,160	456,743	2023/11/15
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	3,000	3,041	333,894	2024/2/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	2,700	2,705	297,031	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	2,500	2,499	274,342	2045/8/15
	2.875 T-BOND 461115	2.875	8,100	8,093	888,453	2046/11/15
	3 T-BOND 420515	3.0	5,150	5,289	580,649	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	5,400	5,531	607,215	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	3,600	3,686	404,655	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	3,050	3,122	342,807	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	5,050	5,171	567,728	2047/2/15
	3.125 T-BOND 411115	3.125	1,400	1,468	161,256	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	5,650	5,930	651,027	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	3,450	3,612	396,612	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	2,850	2,984	327,612	2044/8/15
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	12,400	12,585	1,381,637	2019/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	1,300	1,335	146,644	2021/5/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	3,100	3,390	372,222	2044/5/15
	3.375 T-NOTE 191115	3.375	1,860	1,903	208,920	2019/11/15
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	2,500	2,577	282,962	2020/5/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	1,450	1,650	181,192	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	2,100	2,391	262,561	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	2,520	2,581	283,432	2019/8/15
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	1,630	1,680	184,463	2020/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,000	1,157	127,121	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	4,700	5,458	599,246	2043/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	800	941	103,337	2040/8/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	800	992	108,915	2040/11/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	500	628	68,994	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	2,050	2,581	283,438	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	800	1,011	111,073	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	1,460	1,833	201,262	2036/2/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	2,600	3,379	371,034	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	5,200	6,902	757,722	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	700	936	102,835	2037/5/15

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	5.25 T-BOND 290215	5.25	2,250	2,813	308,910	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	1,200	1,562	171,524	2031/2/15
	6 T-BOND 260215	6.0	2,000	2,498	274,312	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	16,440	21,420	2,351,576	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	2,710	3,243	356,098	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	800	1,103	121,121	2030/5/15
	8 T-BOND 211115	8.0	1,300	1,568	172,215	2021/11/15
	8.125 T-BOND 190815	8.125	160	174	19,201	2019/8/15
	8.75 T-BOND 200815	8.75	6,600	7,679	843,051	2020/8/15
小計					76,282,930	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.5 CAN GOVT 190201	0.5	1,400	1,384	122,801	2019/2/1
	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	1,200	1,129	100,212	2022/3/1
	0.75 CAN GOVT 190501	0.75	1,300	1,285	113,980	2019/5/1
	0.75 CAN GOVT 190801	0.75	400	394	34,954	2019/8/1
	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	1,150	1,117	99,156	2020/9/1
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	2,000	1,930	171,191	2021/3/1
	0.75 CAN GOVT 210901	0.75	150	143	12,753	2021/9/1
	1 CAN GOVT 220901	1.0	1,300	1,240	110,074	2022/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	950	851	75,522	2027/6/1
	1.5 CAN GOVT 200301	1.5	5,300	5,266	467,167	2020/3/1
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	2,250	2,183	193,687	2023/6/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	700	661	58,694	2026/6/1
	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	900	901	79,939	2019/3/1
	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	3,500	3,499	310,437	2019/9/1
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,750	1,757	155,895	2025/6/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,100	1,123	99,613	2024/6/1
	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	1,230	1,267	112,468	2022/6/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	1,350	1,470	130,474	2048/12/1
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	500	562	49,875	2064/12/1
	3.25 CAN GOVT 210601	3.25	3,150	3,282	291,181	2021/6/1
	3.5 CAN GOVT 200601	3.5	1,150	1,193	105,862	2020/6/1
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,380	1,701	150,878	2045/12/1
	3.75 CAN GOVT 190601	3.75	960	985	87,445	2019/6/1
	4 CAN GOVT 410601	4.0	1,650	2,136	189,506	2041/6/1
	5 CAN GOVT 370601	5.0	1,300	1,839	163,148	2037/6/1
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	1,600	2,153	191,020	2029/6/1
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,100	1,589	140,975	2033/6/1
	8 CAN GOVT 270601	8.0	800	1,187	105,293	2027/6/1
小計					3,924,214	
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	23,250	26,469	156,172	2024/12/5
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	7,000	8,619	50,853	2036/11/20
	5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	20,500	19,648	115,926	2019/12/11
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	20,850	18,675	110,184	2026/3/5
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	33,400	32,526	191,904	2021/6/10
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	19,500	18,849	111,209	2022/6/9

銘柄	当期末					償還年月日	
	利率	額面金額	評価額		千円		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
国債証券	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	10,500	10,485	61,862	2027/6/3	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	11,300	11,426	67,418	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	10,800	10,907	64,356	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	19,100	19,190	113,225	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	27,300	27,667	163,236	2020/6/11	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	8,000	8,225	48,529	2023/12/7	
	8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	4,350	4,488	26,482	2047/11/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	10,400	11,139	65,721	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	9,200	9,964	58,793	2038/11/18	
小計					1,405,877		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	3,350	3,231	440,062	2026/8/15
		0 OBL 200417	—	1,700	1,720	234,250	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	5,800	5,868	799,164	2021/4/9
		0 OBL 211008	—	500	504	68,748	2021/10/8
		0 OBL 220408	—	800	805	109,729	2022/4/8
		0 SCHATZ 190315	—	700	705	96,027	2019/3/15
		0.25 BUND 270215	0.25	1,500	1,469	200,107	2027/2/15
		0.25 OBL 191011	0.25	6,750	6,849	932,713	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	2,250	2,293	312,321	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	2,950	3,002	408,794	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	2,950	2,983	406,218	2026/2/15
		0.5 OBL 190412	0.5	1,200	1,216	165,681	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	1,600	1,684	229,439	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	2,750	2,894	394,141	2025/8/15
		1 OBL 190222	1.0	1,300	1,323	180,195	2019/2/22
		1.25 BUND 480815	1.25	450	443	60,334	2048/8/15
		1.5 BUND 220904	1.5	1,900	2,041	278,030	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	4,100	4,417	601,541	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	800	863	117,520	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,800	1,951	265,800	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	2,550	2,765	376,622	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,950	2,141	291,659	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	2,800	3,046	414,793	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	900	997	135,772	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	700	750	102,156	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	250	273	37,178	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	2,800	3,042	414,247	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	2,750	3,536	481,500	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,120	1,452	197,787	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	2,050	2,226	303,124	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	2,000	2,150	292,772	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,450	1,629	221,886	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	2,500	3,607	491,251	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	1,900	2,013	274,222	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	440	458	62,424	2019/1/4
		4 BUND 370104	4.0	1,900	2,874	391,399	2037/1/4

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	4.25 BUND 390704	4.25	600	963	131,214	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	3,100	4,391	597,958	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,900	3,006	409,338	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,710	2,951	401,897	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,150	1,819	247,763	2031/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	1,000	1,363	185,683	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	950	1,554	211,633	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	1,900	2,946	401,202	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.05 ITALY GOVT 191015	0.05	800	803	109,428	2019/10/15
		0.1 ITALY GOVT 190415	0.1	1,000	1,005	136,864	2019/4/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	400	399	54,441	2021/11/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	8,450	8,512	1,159,120	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	3,700	3,758	511,840	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	300	294	40,054	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	1,100	1,118	152,363	2020/5/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,000	1,005	136,955	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	500	511	69,628	2019/12/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	1,300	1,243	169,340	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,550	1,600	217,951	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	4,250	4,399	599,028	2022/9/15
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	1,100	1,107	150,777	2024/11/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,000	1,026	139,812	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,000	1,000	136,295	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	1,000	990	134,923	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,500	1,373	187,057	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	2,100	2,182	297,144	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	2,700	2,775	377,944	2025/12/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	600	605	82,403	2027/8/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,300	1,386	188,744	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	1,500	1,537	209,338	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	1,200	1,130	153,997	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	3,500	3,471	472,669	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	3,400	3,520	479,403	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,000	1,074	146,280	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	1,100	1,030	140,323	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	550	493	67,209	2067/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,200	1,257	171,246	2046/9/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	800	852	116,139	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	2,500	2,816	383,545	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	2,300	2,563	349,003	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	1,430	1,602	218,196	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	2,100	2,425	330,340	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,750	1,929	262,797	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,550	1,850	251,924	2037/2/1
4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	400	418	57,014	2019/2/1		
4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	8,200	8,787	1,196,621	2019/9/1		
4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,130	1,234	168,038	2020/3/1		



## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	600	631	86,007	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	1,600	1,749	238,270	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	2,600	3,085	420,184	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,700	2,034	277,095	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	6,300	7,659	1,043,036	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	1,200	1,389	189,147	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,730	2,086	284,065	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	2,800	3,680	501,155	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	3,650	4,315	587,672	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,450	1,800	245,175	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,900	3,850	524,379	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	850	1,143	155,683	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	2,600	3,473	472,931	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	6,400	8,405	1,144,522	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	2,150	2,630	358,256	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	890	1,254	170,817	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	1,450	2,051	279,372	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,900	4,069	554,139	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	450	649	88,502	2026/11/1
9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,850	2,672	363,855	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O. A. T 190225	—	300	301	41,112	2019/2/25
		0 O. A. T 200225	—	1,500	1,513	206,135	2020/2/25
		0 O. A. T 200525	—	2,950	2,978	405,538	2020/5/25
		0 O. A. T 210525	—	3,400	3,422	466,034	2021/5/25
		0 O. A. T 220525	—	1,200	1,200	163,474	2022/5/25
		0.25 O. A. T 201125	0.25	3,700	3,758	511,738	2020/11/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	2,750	2,654	361,446	2026/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	1,700	1,731	235,781	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	1,500	1,506	205,169	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	1,300	1,290	175,795	2026/5/25
		1 O. A. T 190525	1.0	3,400	3,470	472,559	2019/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	2,000	2,074	282,487	2025/11/25
		1 O. A. T 270525	1.0	3,700	3,785	515,456	2027/5/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	1,950	1,901	258,866	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	1,850	1,936	263,692	2031/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	3,600	3,909	532,336	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	300	327	44,650	2024/11/25
		1.75 O. A. T 390625	1.75	750	785	106,902	2039/6/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	600	568	77,475	2066/5/25
		2 O. A. T 480525	2.0	2,050	2,162	294,434	2048/5/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	5,000	5,522	752,016	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	8,800	9,883	1,345,902	2024/5/25
		2.5 O. A. T 201025	2.5	2,100	2,264	308,305	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	5,100	5,966	812,448	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	2,400	2,846	387,572	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	3,000	3,389	461,541	2022/4/25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	6,350	7,161	975,124	2021/10/25

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	3.25 O.A.T 450525	3.25	2,400	3,232	440,107	2045/5/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	2,100	2,285	311,256	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	5,100	6,327	861,609	2026/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	6,010	6,461	879,849	2019/10/25
		4 O.A.T 381025	4.0	1,350	1,975	269,005	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	900	1,425	194,062	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	1,400	2,273	309,569	2060/4/25
		4.25 O.A.T 190425	4.25	3,100	3,285	447,442	2019/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	3,100	3,821	520,405	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	4,350	6,906	940,457	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	2,700	4,159	566,389	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	3,200	4,772	649,922	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	3,000	4,878	664,289	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	4,750	6,763	920,953	2025/10/25
		8.5 O.A.T 191025	8.5	900	1,042	141,953	2019/10/25
8.5 O.A.T 230425	8.5	500	719	97,966	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	500	502	68,484	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	1,300	1,320	179,856	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,950	1,928	262,647	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	900	898	122,381	2026/7/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	1,350	1,361	185,440	2027/7/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	1,750	1,781	242,573	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,950	2,126	289,541	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,800	2,001	272,608	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,550	1,712	233,147	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,450	1,759	239,577	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	1,200	1,616	220,106	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	2,250	2,526	344,079	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	1,400	1,537	209,386	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	850	1,008	137,310	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,500	2,305	313,973	2042/1/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	950	1,014	138,127	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,400	2,109	287,304	2037/1/15
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,300	1,907	259,730	2028/1/15		
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	400	548	74,729	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25	2,550	2,566	349,501	2019/1/31
		0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	3,200	3,224	439,094	2022/4/30
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	1,000	1,024	139,516	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	2,100	2,168	295,233	2020/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	700	705	96,023	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	2,200	2,273	309,564	2020/1/31
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	1,650	1,656	225,587	2027/10/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	1,600	1,626	221,545	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,500	1,574	214,448	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	3,200	3,406	463,802	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	1,750	1,786	243,218	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	4,400	4,761	648,347	2025/10/31

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	750	779	106,146	2033/7/30
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,500	1,559	212,338	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,100	2,371	322,922	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	1,300	1,378	187,759	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	750	850	115,781	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,850	2,200	299,701	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	2,530	2,769	377,087	2020/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,900	2,497	340,064	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	1,160	1,254	170,788	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	3,550	4,318	588,058	2023/10/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,800	1,934	263,452	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,640	2,079	283,148	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	2,050	2,903	395,392	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,200	1,494	203,554	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,800	2,046	278,616	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,250	1,803	245,618	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	700	948	129,151	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	1,200	1,811	246,612	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	1,850	2,307	314,245	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	3,100	3,651	497,159	2021/4/30
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	2,200	3,284	447,220	2032/7/30		
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	2,450	3,008	409,642	2022/1/31		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	900	1,245	169,570	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	3,150	4,560	620,946	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.2 BEL GOVT 231022	0.2	400	399	54,424	2023/10/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	2,600	2,665	362,972	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,350	1,357	184,785	2027/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,150	1,187	161,767	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	1,100	1,086	147,895	2031/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	200	201	27,414	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	750	730	99,476	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	250	270	36,829	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	180	189	25,786	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,500	1,672	227,685	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	400	438	59,712	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,900	2,177	296,504	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	1,600	1,693	230,663	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	400	504	68,665	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,750	1,942	264,554	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	1,250	1,845	251,308	2045/6/22
		4 BEL GOVT 190328	4.0	550	579	78,869	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,300	1,523	207,518	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	650	900	122,653	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,650	1,919	261,433	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,800	2,157	293,844	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,700	2,629	358,024	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	600	793	107,995	2026/3/28

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	5 BEL GOVT 350328	5.0	2,050	3,255	443,308	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,850	2,715	369,734	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	—	600	594	80,895	2023/7/15
		0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	600	608	82,796	2019/10/18
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	750	735	100,170	2027/4/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	650	656	89,444	2026/10/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	600	632	86,184	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	150	148	20,258	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	250	212	29,000	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	400	434	59,226	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	1,700	1,851	252,107	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	450	465	63,391	2019/6/18
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	60	62	8,502	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	750	886	120,671	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	900	1,243	169,305	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	1,550	1,802	245,380	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,600	1,815	247,241	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	750	867	118,165	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	650	1,078	146,845	2062/1/26
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	1,170	1,293	176,193	2020/7/15		
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,150	1,722	234,519	2037/3/15		
4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	900	949	129,318	2019/3/15		
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	1,400	1,892	257,712	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	900	1,365	185,968	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 220415	—	200	200	27,286	2022/4/15
		0 FINNISH GOVT 230915	—	450	444	60,581	2023/9/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	1,300	1,325	180,432	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	350	349	47,546	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	450	436	59,450	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	800	825	112,360	2025/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	550	589	80,260	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	550	591	80,514	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	550	608	82,852	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	450	583	79,498	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	640	768	104,607	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	600	650	88,580	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	200	224	30,508	2021/4/15
4 FINNISH GOVT 250704	4.0	400	504	68,694	2025/7/4		
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	350	374	51,039	2019/7/4		
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	800	827	112,685	2022/3/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	1,000	1,021	139,062	2026/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	500	511	69,589	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	750	787	107,251	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	890	1,015	138,321	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	750	889	121,080	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	800	953	129,818	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	1,000	1,068	145,470	2019/6/18

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
アイルランド	国債証券	4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	590	655	89,219	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	750	860	117,175	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,100	1,473	200,675	2025/3/13
		5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	750	832	113,375	2019/10/18
小 計						75,702,988	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
	国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	2,950	2,894	449,985	2022/7/22
		1.5 GILT 210122	1.5	4,500	4,598	714,847	2021/1/22
		1.5 GILT 260722	1.5	3,750	3,805	591,473	2026/7/22
		1.5 GILT 470722	1.5	1,650	1,507	234,317	2047/7/22
		1.75 GILT 190722	1.75	2,800	2,847	442,673	2019/7/22
		1.75 GILT 220907	1.75	2,100	2,177	338,518	2022/9/7
		1.75 GILT 370907	1.75	800	784	121,927	2037/9/7
		1.75 GILT 570722	1.75	2,450	2,464	383,139	2057/7/22
		2 GILT 200722	2.0	2,850	2,942	457,357	2020/7/22
		2 GILT 250907	2.0	2,650	2,800	435,345	2025/9/7
		2.25 GILT 230907	2.25	3,150	3,358	522,077	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	800	1,016	157,967	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	1,350	1,489	231,496	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	2,850	3,626	563,750	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	1,150	1,533	238,300	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	1,000	1,624	252,470	2068/7/22
		3.75 GILT 190907	3.75	2,400	2,521	391,951	2019/9/7
		3.75 GILT 200907	3.75	600	647	100,658	2020/9/7
		3.75 GILT 210907	3.75	960	1,060	164,920	2021/9/7
		3.75 GILT 520722	3.75	600	899	139,873	2052/7/22
		4 GILT 220307	4.0	850	958	149,005	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	1,140	1,922	298,756	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	200	252	39,179	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	1,300	1,724	268,101	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	2,100	2,892	449,538	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	1,100	1,563	243,009	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	800	1,150	178,789	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	950	1,444	224,533	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	350	552	85,810	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	4,200	7,105	1,104,481	2055/12/7
		4.5 GILT 190307	4.5	850	886	137,872	2019/3/7
		4.5 GILT 340907	4.5	2,150	2,995	465,692	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	4,750	7,195	1,118,393	2042/12/7
		4.75 GILT 200307	4.75	1,000	1,086	168,835	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75	1,350	1,842	286,332	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	650	975	151,616	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	1,800	2,268	352,679	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	1,800	2,614	406,459	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	800	991	154,131	2021/6/7
小 計						13,216,273	

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
スイス		%	千スイスフラン	千スイスフラン	千円	
国債証券	2 SWISS GOVT 210428	2.0	420	456	53,274	2021/4/28
	2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	350	376	43,902	2020/7/6
	3 SWISS GOVT 190512	3.0	570	599	69,891	2019/5/12
	4 SWISS GOVT 230211	4.0	450	551	64,306	2023/2/11
	4 SWISS GOVT 280408	4.0	540	757	88,274	2028/4/8
小 計					319,649	
スウェーデン			千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
国債証券	0.75 SWD GOVT 280512	0.75	3,850	3,800	52,669	2028/5/12
	1 SWD GOVT 261112	1.0	6,150	6,316	87,540	2026/11/12
	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	8,000	8,557	118,608	2023/11/13
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	5,850	6,692	92,753	2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 220601	3.5	9,750	11,228	155,633	2022/6/1
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	4,400	5,928	82,164	2039/3/30
	4.25 SWD GOVT 190312	4.25	9,350	9,878	136,920	2019/3/12
	5 SWD GOVT 201201	5.0	9,150	10,540	146,089	2020/12/1
小 計					872,381	
ノルウェー			千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	4,400	4,347	61,649	2026/2/19
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	3,500	3,538	50,172	2025/3/13
	1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	3,050	3,045	43,180	2027/2/17
	2 NORWE GOVT 230524	2.0	6,100	6,297	89,296	2023/5/24
	3 NORWE GOVT 240314	3.0	4,500	4,904	69,538	2024/3/14
	3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	7,700	8,373	118,737	2021/5/25
	4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	7,700	8,097	114,819	2019/5/22
小 計					547,394	
デンマーク			千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
国債証券	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	4,900	4,839	88,508	2027/11/15
	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	4,800	5,179	94,727	2023/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	7,400	8,183	149,673	2025/11/15
	3 DMK GOVT 211115	3.0	9,650	10,825	198,000	2021/11/15
	4 DMK GOVT 191115	4.0	8,450	9,145	167,268	2019/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	12,350	20,580	376,409	2039/11/15
小 計					1,074,589	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	2,250	2,239	73,586	2020/4/25
	1.75 POLAND 210725	1.75	4,950	4,875	160,200	2021/7/25
	2 POLAND 210425	2.0	750	747	24,546	2021/4/25
	2.25 POLAND 220425	2.25	1,900	1,884	61,909	2022/4/25
	2.5 POLAND 230125	2.5	800	792	26,056	2023/1/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	3,500	3,301	108,483	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	2,800	2,603	85,565	2027/7/25
	3.25 POLAND 190725	3.25	3,100	3,179	104,481	2019/7/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	2,650	2,672	87,814	2025/7/25
	4 POLAND 231025	4.0	2,800	2,971	97,643	2023/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	1,850	2,013	66,168	2020/10/25
	5.5 POLAND 191025	5.5	3,150	3,363	110,512	2019/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	1,900	2,137	70,238	2021/10/25

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	当期末					償還年月日
		利率	額面金額	評価額		千円	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
ポーランド		%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			
	国債証券	5.75 POLAND 220923	2,500	2,846	93,535	2022/9/23	
		5.75 POLAND 290425	900	1,109	36,470	2029/4/25	
		POLAND 190425	200	196	6,462	2019/4/25	
小計					1,213,676		
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル			
	国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	2,500	2,469	217,774	2020/11/21	
		2 AUST GOVT 211221	2,950	2,911	256,752	2021/12/21	
		2.25 AUST GOVT 280521	2,700	2,556	225,395	2028/5/21	
		2.75 AUST GOVT 191021	2,950	2,991	263,758	2019/10/21	
		2.75 AUST GOVT 240421	2,400	2,419	213,312	2024/4/21	
		2.75 AUST GOVT 271121	2,650	2,632	232,139	2027/11/21	
		2.75 AUST GOVT 281121	1,200	1,186	104,638	2028/11/21	
		2.75 AUST GOVT 350621	500	471	41,571	2035/6/21	
		3 AUST GOVT 470321	950	869	76,686	2047/3/21	
		3.25 AUST GOVT 250421	3,200	3,314	292,264	2025/4/21	
		3.25 AUST GOVT 290421	2,250	2,328	205,285	2029/4/21	
		3.25 AUST GOVT 390621	650	644	56,867	2039/6/21	
		3.75 AUST GOVT 370421	1,150	1,236	108,996	2037/4/21	
		4.25 AUST GOVT 260421	2,150	2,384	210,222	2026/4/21	
		4.5 AUST GOVT 200415	1,850	1,946	171,624	2020/4/15	
		4.5 AUST GOVT 330421	1,350	1,586	139,909	2033/4/21	
		4.75 AUST GOVT 270421	3,200	3,702	326,462	2027/4/21	
		5.25 AUST GOVT 190315	1,400	1,453	128,182	2019/3/15	
		5.5 AUST GOVT 230421	2,600	2,982	262,989	2023/4/21	
	5.75 AUST GOVT 210515	2,500	2,775	244,763	2021/5/15		
	5.75 AUST GOVT 220715	2,150	2,455	216,486	2022/7/15		
小計					3,996,084		
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル			
	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 211001	150	147	12,374	2021/10/1	
		1.625 SINGAPORGOV 191001	1,100	1,103	92,508	2019/10/1	
		1.75 SINGAPORGOVT 220401	580	580	48,635	2022/4/1	
		2 SINGAPORGOVT 200701	400	404	33,900	2020/7/1	
		2.125 SINGAPORGOV 260601	550	552	46,313	2026/6/1	
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	1,150	1,171	98,236	2021/6/1	
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	350	340	28,567	2036/8/1	
		2.375 SINGAPORGOV 250601	1,000	1,023	85,800	2025/6/1	
		2.5 SINGAPORGOVT 190601	1,050	1,065	89,351	2019/6/1	
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	1,250	1,304	109,345	2023/7/1	
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	650	677	56,778	2042/4/1	
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	400	414	34,751	2046/3/1	
		2.875 SINGAPORGOV 290701	450	479	40,213	2029/7/1	
		2.875SINGAPORGOVT 300901	650	691	57,976	2030/9/1	
		3 SINGAPORGOVT 240901	500	531	44,513	2024/9/1	
		3.125SINGAPORGOVT 220901	650	688	57,720	2022/9/1	
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	800	834	69,934	2020/9/1	
		3.375 SINGAPORGOV 330901	550	619	51,972	2033/9/1	

銘柄	当 期 末						償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額		債 権		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
シンガポール	%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円			
国債証券	3.5	SINGAPORGOVT 270301	570	634	53,189	2027/3/1	
小 計					1,112,084		
南アフリカ		千南アフリカランド	千南アフリカランド				
国債証券	10.5	SOUTH AFRICA 261221	18,800	21,223	195,466	2026/12/21	
	6.25	SOUTH AFRICA 360331	4,700	3,450	31,780	2036/3/31	
	6.5	SOUTH AFRICA 410228	15,500	11,210	103,247	2041/2/28	
	6.75	SOUTH AFRICA 210331	4,500	4,427	40,779	2021/3/31	
	7.0	SOUTH AFRICA 310228	18,000	15,338	141,270	2031/2/28	
	7.25	SOUTH AFRICA 200115	3,600	3,618	33,321	2020/1/15	
	7.75	SOUTH AFRICA 230228	8,200	8,226	75,770	2023/2/28	
	8.0	SOUTH AFRICA 300131	7,500	7,015	64,612	2030/1/31	
	8.25	SOUTH AFRICA 320331	3,800	3,552	32,720	2032/3/31	
	8.5	SOUTH AFRICA 370131	14,750	13,579	125,070	2037/1/31	
	8.75	SOUTH AFRICA 440131	6,100	5,644	51,987	2044/1/31	
	8.75	SOUTH AFRICA 480228	16,700	15,462	142,409	2048/2/28	
	8.875	SOUTH AFRIC 350228	5,500	5,278	48,614	2035/2/28	
	9.0	SOUTH AFRICA 400131	2,700	2,575	23,719	2040/1/31	
小 計					1,110,773		
合 計					180,778,919		

(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

(2018年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 180,778,919	% 97.6
コール・ローン等、その他	4,434,409	2.4
投資信託財産総額	185,213,328	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (182,378,259千円) の投資信託財産総額 (185,213,328千円) に対する比率は98.5%です。

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

1 アメリカドル=109.78円	1 カナダドル=88.70円	1 メキシコペソ=5.90円	1 ユーロ=136.17円
1 イギリスポンド=155.44円	1 スイスフラン=116.59円	1 スウェーデンクローネ=13.86円	1 ノルウェークローネ=14.18円
1 デンマーククローネ=18.29円	1 ポーランドズロチ=32.86円	1 オーストラリアドル=88.18円	1 シンガポールドル=83.83円
1 南アフリカランド=9.21円			



## ○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	368,105,844,960
コール・ローン等	823,576,609
公社債(評価額)	180,778,919,604
未収入金	184,892,559,340
未収利息	1,455,651,132
前払費用	155,138,275
(B) 負債	184,582,002,926
未払金	184,487,595,027
未払解約金	94,407,109
未払利息	790
(C) 純資産総額(A-B)	183,523,842,034
元本	145,275,272,507
次期繰越損益金	38,248,569,527
(D) 受益権総口数	145,275,272,507口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,633円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 73,688,743,763円  
 期中追加設定元本額 97,465,330,579円  
 期中一部解約元本額 25,878,801,835円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.2633円です。

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

eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	46,341,881円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	5,610,745,039円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	3,597,265,004円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	119,081,792円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	496,057,048円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	4,118,676,123円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	60,833,226円
MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド(適格機関投資家転売制限付)	103,635,957,023円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	13,834,981,578円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	230,951,434円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	237,914,737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)	5,705,741,471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)	2,120,300,689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)	188,835,718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)	5,269,608,944円
MUKAM バランス・イノベーション(債券重視型)(適格機関投資家転売制限付)	1,980,800円
合計	145,275,272,507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	3,747,103,547
受取利息	3,747,601,568
支払利息	△ 498,021
(B) 有価証券売買損益	△ 3,051,588,332
売買益	20,140,607,446
売買損	△23,192,195,778
(C) 保管費用等	△ 19,564,370
(D) 当期損益金(A+B+C)	675,950,845
(E) 前期繰越損益金	18,490,874,676
(F) 追加信託差損益金	26,029,163,427
(G) 解約差損益金	△ 6,947,419,421
(H) 計(D+E+F+G)	38,248,569,527
次期繰越損益金(H)	38,248,569,527

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

## マネー・マーケット・マザーファンド

### 《第26期》決算日2017年11月20日

[計算期間：2017年5月23日～2017年11月20日]

「マネー・マーケット・マザーファンド」は、11月20日に第26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26期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主要運用対象	わが国の公社債等を主要投資対象とします。
主な組入制限	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	騰落率	債組入比率	債券先物比率	純資産額
22期(2015年11月20日)	10,185	0.0	91.2	—	27,834
23期(2016年5月20日)	10,183	△0.0	39.0	—	5,562
24期(2016年11月21日)	10,184	0.0	24.4	—	4,420
25期(2017年5月22日)	10,184	0.0	—	—	1,681
26期(2017年11月20日)	10,184	0.0	—	—	1,266

(注) 当ファンドは主として短期債券、コール・ローンなどによる運用を行い、安定的な収益の確保をめざすファンドであり、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

### ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	債組入比率	債券先物比率
(期首) 2017年5月22日	10,184	—	—	—
5月末	10,184	0.0	—	—
6月末	10,184	0.0	—	—
7月末	10,184	0.0	—	—
8月末	10,184	0.0	—	—
9月末	10,184	0.0	—	—
10月末	10,184	0.0	—	—
(期末) 2017年11月20日	10,184	0.0	—	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

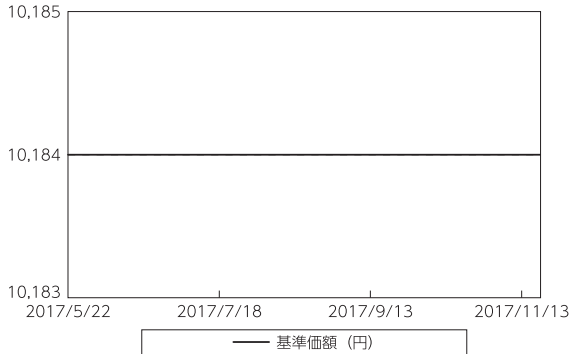
## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ横ばいとなりました。

基準価額等の推移



## ●投資環境について

## ◎国内短期金融市場

- ・当期の短期金融市場を見ると、日銀は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）は、マイナス金利の適用以降であることから、マイナス圏で推移しました。2017年11月20日のコール・レートは-0.047%となりました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。その結果、利子等収益は積み上がったものの、運用資金に対するマイナス金利適用などの影響を受けて、基準価額は横ばいとなりました。

## ○今後の運用方針

## ◎運用環境の見通し

- ・物価は緩やかに上昇していくと予想していますが、日銀の物価目標である2%には届かないと思われれます。したがって、今後も金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は低位で推移すると予想しています。

## ◎今後の運用方針

- ・コール・ローンおよびCP現先取引等への投資を通じて、安定した収益の確保をめざした運用を行う方針です。

## ○1万口当たりの費用明細

(2017年5月23日～2017年11月20日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2017年5月23日～2017年11月20日)

## その他有価証券

		買付額	売付額
国内	コマーシャル・ペーパー	千円 162,499,934	千円 162,899,937

(注) 金額は受渡代金。

## ○利害関係人との取引状況等

(2017年5月23日～2017年11月20日)

該当事項はございません。

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す。

## ○組入資産の明細

(2017年11月20日現在)

## 国内その他有価証券

区 分	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 1,199,999	% 94.7

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

## ○投資信託財産の構成

(2017年11月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
その他有価証券	千円 1,199,999	% 94.4
コール・ローン等、その他	71,624	5.6
投資信託財産総額	1,271,623	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年11月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,271,623,466
コール・ローン等	71,623,500
其他有価証券(評価額)	1,199,999,966
(B) 負債	5,066,562
未払解約金	5,066,444
未払利息	118
(C) 純資産総額(A-B)	1,266,556,904
元本	1,243,696,990
次期繰越損益金	22,859,914
(D) 受益権総口数	1,243,696,990口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,184円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,651,473,732円  
 期中追加設定元本額 203,575,952円  
 期中一部解約元本額 611,352,694円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0184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 D C金利連動アロケーション型バランスファンド	313,747,092円
三菱UFJ 新興国通貨建て債券ファンド(毎月決算型)	5,226,135円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	8,898,354円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	1,048,688円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース>(毎月分配型)	62,265円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	31,213,655円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	94,134,350円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>(毎月分配型)	635,856円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(毎月分配型)	3,078,471円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネー・プールファンド>	143,999,990円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<中国元コース>(毎月分配型)	89,620円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<インドネシアルピアコース>(毎月分配型)	1,033,322円
ブラデスコ ブラジル成長株オープン・マネー・プール・ファンド	2,383,743円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	212,322円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(毎月分配型)	26,506,400円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド(毎月分配型)	2,272,200円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース>(毎月分配型)	15,211,722円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	457,302円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	358,088円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	2,100,667円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	3,386,590円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	344,406円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<マネー・プールファンド>	6,013,964円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	9,071,898円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	2,016,707円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	1,970,066円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	43,682,881円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	1,513,806円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<アジアバスケット通貨コース>(毎月分配型)	407,171円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<マネー・プールファンド>	75,631,547円

○損益の状況 (2017年5月23日~2017年11月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 11,420
受取利息	3,609
支払利息	△ 15,029
(B) 当期損益金(A)	△ 11,420
(C) 前期繰越損益金	30,374,272
(D) 追加信託差損益金	3,745,720
(E) 解約差損益金	△11,248,658
(F) 計(B+C+D+E)	22,859,914
次期繰越損益金(F)	22,859,914

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

三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)	1,364,852円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース> (毎月分配型)	600,566円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	1,647,957円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	1,979,971円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース> (毎月分配型)	140,355円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド>	1,008,013円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド ユーロ円プレミアム (毎月分配型)	31,208,972円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり)	6,336,371円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし)	5,622,977円
三菱UFJ 米国リートファンドA<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	491,836円
三菱UFJ 米国リートファンドB<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	98,368円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース> (毎月分配型)	12,561,714円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド (年2回分配型)	69,931円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド (年2回分配型)	158,381円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース> (年2回分配型)	20,660円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース> (年2回分配型)	40,278円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース> (年2回分配型)	955,887円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	1,559,264円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	4,881,309円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	19,658円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	19,658円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	19,658円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	491,449円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9,828,976円
PIMCO ニューワールドインカム分散コース<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	12,234,366円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	348,598円
バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	1,936,118円
バリュー・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9,829円
バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	9,829円
バリュー・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	9,829円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)	9,834,580円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	13,128,307円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	3,730,759円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	14,819,878円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	3,123,514円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	6,722,976円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルールコース> (毎月分配型)	24,184,985円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (年2回分配型)	3,737,703円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (年2回分配型)	4,117,720円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (年2回分配型)	686,803円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (年2回分配型)	961,645円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (年2回分配型)	608,110円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (年2回分配型)	243,113円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルールコース> (年2回分配型)	1,809,102円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドA>	38,413,663円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドB>	979,536円
三菱UFJ/ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (毎月決算型)	8,473,583円
三菱UFJ/ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	8,859,081円
三菱UFJ/ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (年1回決算型)	2,464,335円
三菱UFJ/ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	2,065,331円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Cコース (為替ヘッジなし) (年1回決算型)	983円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Dコース (為替ヘッジあり) (年1回決算型)	983円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり> (毎月分配型)	5,920,244円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし> (毎月分配型)	9,387,547円

三菱UFJ/ビムコ トータル・リターン・ファンド2014	256,356円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	3,545,187円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	8,124,755円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり> (年1回決算型)	2,990,177円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	3,377,211円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム> (毎月分配型)	8,478,079円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム> (年2回分配型)	4,145,749円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム> (毎月分配型)	8,067,104円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム> (年2回分配型)	1,551,577円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	20,075,917円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	1,616,484円
三菱UFJ/AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド 豪ドル円プレミアム (毎月決算型)	25,537,767円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム (毎月分配型)	16,492,587円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム (年2回分配型)	3,165,280円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (毎月分配型)	128,636円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (年2回分配型)	79,540円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム> (毎月分配型)	1,375,931円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム> (年2回分配型)	1,071,396円
マルチストラテジー・ファンド (ラップ向け)	491,015円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	564,702円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	89,371円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	983円
三菱UFJ Jリート不動産株ファンド<米ドル投資型> (3ヵ月決算型)	3,063,931円
三菱UFJ Jリート不動産株ファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	6,324,266円
マクロ・トータル・リターン・ファンド	9,820円
スマート・プロテクター90 (限定追加型) 2016-12	6,313,826円
米国政策テーマ株式オープン (為替ヘッジあり)	412,412円
米国政策テーマ株式オープン (為替ヘッジなし)	1,188,139円
スマート・プロテクター90オープン	981,933円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり> (資産成長型)	256,285円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし> (資産成長型)	305,382円
テンブルトン新興国小型株ファンド	49,097円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり> (毎月決算型)	982円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり> (年2回決算型)	982円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	982円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし> (年2回決算型)	982円
Navio インド債券ファンド	885,566円
Navio マネーボールファンド	1,853,235円
三菱UFJ インド債券オープン (毎月決算型)	39,351円
三菱UFJ/AMP オーストラリアREITファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	11,293,333円
マネーボールファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定)	9,991,647円
ビムコ・エマーシング・ボンド・オープン Aコース (為替ヘッジなし)	10,766,608円
ビムコ・エマーシング・ボンド・オープン Bコース (為替ヘッジあり)	21,620,196円
合計	1,243,696,990円