

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| 商品分類 | 追加型投信／内外／資産複合／インデックス型 | |
|--------|--|--|
| 信託期間 | 無期限（2016年3月30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、最適化バランス（6%）指数に連動する成果をめざして運用を行います。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。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 | |
| 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、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。 |
| | 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。 |
| | 外国債券インデックスマザーファンド | シティ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース) に採用されている国債を主要投資対象とします。 |
| | 東証REIT指数マザーファンド | 東証REIT指数 (配当込み) に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 |
| | MUAM G-REITマザーファンド | S&P先進国REITインデックス (除く日本、配当込み、円換算ベース) に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | ベビーファンド | 株式への実質投資割合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。 |
| | 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。 |
| | 東証REIT指数マザーファンド | 株式および外貨建資産への投資は行いません。投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 |
| | MUAM G-REITマザーファンド | 株式への直接投資は行いません。投資信託証券および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 |
| 分配方針 | 経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みません）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 | |

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

運用報告書（全体版）

eMAXIS
 イーマックス

eMAXIS 最適化バランス
（マイゴールキーパー）

第1期（決算日：2017年1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「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」は、去る1月26日に第1期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG

三菱UFJ国際投信

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

eMAXIS専用サイト URL:<http://emaxis.muam.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

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

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 | | | 最適化バランス (6%) 指数 | | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 | 債券 組入比率 | 債券 先物比率 | 投資信託 証券 組入比率 | 純資産 総額 |
|----------------|--------|------------|-----------|--------------------|-----|------------|------------|------------|------------|--------------------|-----------|
| | (分配落) | 税込み 分配金 | 期中 騰落率 | 期中 騰落率 | | | | | | | |
| (設定日) | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 2016年3月30日 | 10,000 | — | — | 144.00 | — | — | — | — | — | — | 10 |
| 1期(2017年1月26日) | 9,992 | 0 | △0.1 | 144.00 | 0.0 | 15.8 | 0.4 | 77.1 | — | 5.1 | 79 |

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 最適化バランス指数は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンがeMAXISシリーズのファンド*を参照して算出する指数であり、5つの目標リスク水準別指数の総称です。目標リスク水準別の指数は、eMAXISシリーズにおける各ファンドのベンチマークの長期間にわたるデータを用いて期待収益率、リスク（標準偏差）等をそれぞれ推計した上で最適化（目標リスク水準に対してリターンが最大化される）を行い決定される資産クラス別比率に応じて、eMAXISシリーズのファンドの基準価額（分配金再投資）の騰落率を乗じることで算出されます。指数の資産クラス別比率の決定は、原則として年1回行います。

*最適化バランス（6%）指数を算出するために参照したファンド

eMAXIS TOPIXインデックス、eMAXIS 先進国株式インデックス、eMAXIS 国内債券インデックス、
eMAXIS 先進国債券インデックス、eMAXIS 国内リートインデックスおよびeMAXIS 先進国リートインデックス

(注) 株式先物比率には不動産投信指数先物を含めて表示しております。

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

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 最 適 化 バ ラ ン ス (6 %) 指 数 | | 株 式 組 入 比 率 | 株 式 先 物 比 率 | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|------------|---------|-------|------------------------------|-------|-------------|-------------|-------------|-------------|---------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | | | |
| (設定日) | 円 | % | | % | % | % | % | % | % |
| 2016年3月30日 | 10,000 | — | 144.00 | — | — | — | — | — | — |
| 3月末 | 9,989 | △0.1 | 143.90 | △0.1 | 15.6 | 0.4 | 79.4 | 0.1 | 5.1 |
| 4月末 | 9,922 | △0.8 | 142.90 | △0.8 | 15.3 | 0.4 | 77.7 | — | 5.1 |
| 5月末 | 10,003 | 0.0 | 144.10 | 0.1 | 15.9 | 0.3 | 77.3 | 0.1 | 5.1 |
| 6月末 | 9,719 | △2.8 | 140.00 | △2.8 | 15.7 | 0.5 | 76.9 | 0.1 | 5.3 |
| 7月末 | 9,840 | △1.6 | 141.80 | △1.5 | 15.6 | 0.3 | 77.3 | 0.1 | 5.1 |
| 8月末 | 9,760 | △2.4 | 140.60 | △2.4 | 15.9 | 0.3 | 76.9 | 0.1 | 5.1 |
| 9月末 | 9,684 | △3.2 | 139.60 | △3.1 | 15.5 | 0.4 | 77.4 | 0.1 | 5.1 |
| 10月末 | 9,718 | △2.8 | 140.00 | △2.8 | 15.6 | 0.3 | 77.4 | 0.1 | 5.0 |
| 11月末 | 9,931 | △0.7 | 143.10 | △0.6 | 15.6 | 0.3 | 77.3 | 0.1 | 5.1 |
| 12月末 | 10,089 | 0.9 | 145.40 | 1.0 | 15.4 | 0.2 | 77.4 | 0.1 | 5.1 |
| (期 末) | | | | | | | | | |
| 2017年1月26日 | 9,992 | △0.1 | 144.00 | 0.0 | 15.8 | 0.4 | 77.1 | — | 5.1 |

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

(注) 株式先物比率には不動産投信指数先物を含めて表示しております。

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

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第1期：2016/3/30～2017/1/26）

| | |
|------------|--|
| 基準価額の動き | 基準価額は設定時に比べ0.1%の下落となりました。 |
| ベンチマークとの差異 | ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（0.0%）を0.1%下回りました。 |



基準価額の主な変動要因

| | |
|------|--|
| 上昇要因 | 原油価格の安定などから企業業績に回復の兆しがみられたことや、トランプ新米大統領の政策への期待感などから内外株式が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。 |
| 下落要因 | 世界的にインフレ圧力が上昇し、内外債券が下落したことや信託報酬等コストなどが基準価額の下落要因となりました。 |

投資環境について

市況の推移
(設定時を100として指数化)

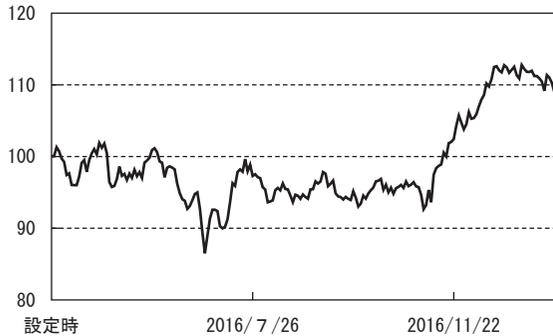
(注) 東証株価指数 (TOPIX) とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

(第1期：2016/3/30～2017/1/26)

◎国内株式市況

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

市況の推移
（設定時を100として指数化）



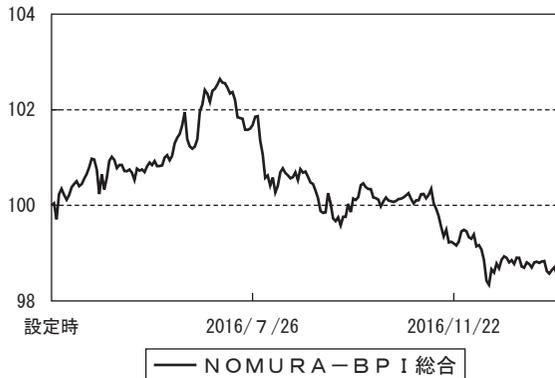
— M S C I Kokusai Index (M S C I コクサイ
インデックス) (円換算ベース)

(注) M S C I Kokusai Index (M S C I コクサイ インデックス) とは、M S C I 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。M S C I Kokusai Index (M S C I コクサイ インデックス) (円換算ベース) は、M S C I 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、M S C I Kokusai Index (M S C I コクサイ インデックス) に対する著作権及びその他の知的財産権はすべて M S C I Inc. に帰属します。

◎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。

市況の推移
(設定時を100として指数化)



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

市況の推移
(設定時を100として指数化)



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

◎国内債券市況

- ・設定時から2016年7月上旬にかけては、日本銀行が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」を継続したことや、イギリスの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、国内債券市況は上昇しました。
- ・その後、期末にかけては、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。

◎外国債券市況

- ・世界的な景気減速懸念などを背景に、金利は総じて低下傾向にありましたが、その後の米大統領選の結果を受けて、米国を中心に金利が上昇しました。

市況の推移
 （設定時を100として指数化）



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

◎国内REIT市況

- ・ 設定時から2016年11月上旬にかけては、日本銀行による追加的な金融緩和策がたびたび見送られたことや、英国の国民投票でEU離脱派が勝利したことなどを受け、国内REIT市況は下落しました。
- ・ 11月中旬から期末にかけては、米大統領選後の円安・株高により日本の景況感にも前向きな見方が台頭したことなどを背景に、国内REIT市況は上昇しました。

市況の推移
(設定時を100として指数化)

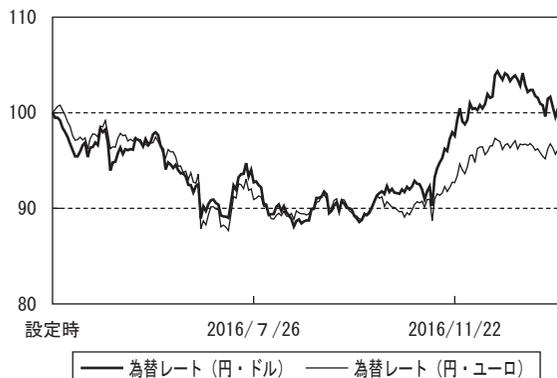


◎外国REIT市況

- ・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REIT市況は上昇しました。

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

為替市況の推移
(設定時を100として指数化)



◎為替市況

- ・2016年10月にかけて世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に、米ドルとユーロは対円で売られました。
- ・その後、米大統領選の結果を受けて対円で上昇したものの、期を通じて見るとユーロなどの主要通貨は対円で下落しました。
- ・設定時との比較では、米ドルは対円でほぼ横ばいとなり、ユーロは対円で4.0%下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

< eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー） >

- ・日本を含む先進国の株式、公社債および不動産投資信託証券の値動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・当期末の資産クラス別比率は以下の通りです。

(ご参考)

ベンチマークの資産クラス別比率（当期末）

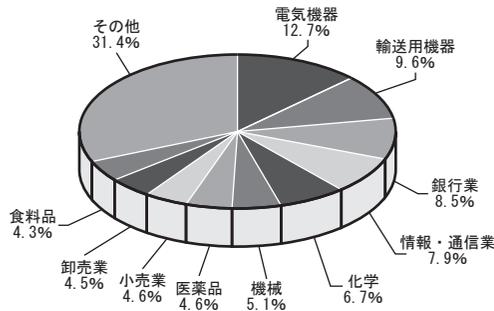
| マザーファンド | アセット | |
|--------------------|---------|-----|
| 外国株式インデックスマザーファンド | 先進国株式 | 6% |
| TOPIXマザーファンド | 国内株式 | 10% |
| MUAM G-REITマザーファンド | 先進国REIT | 3% |
| 東証REIT指数マザーファンド | 国内REIT | 2% |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 先進国債券 | 30% |
| 日本債券インデックスマザーファンド | 国内債券 | 49% |

< TOPIXマザーファンド >

基準価額は設定時に比べ13.5%の上昇となりました。

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

（ご参考）
組入上位10業種
 期末（2017年1月26日）



（注）比率は現物株式評価額に対する割合です。

＜外国株式インデックスマザーファンド＞

基準価額は設定時に比べ13.1%の上昇となりました。

- ・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

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

基準価額は設定時に比べ1.7%の下落となりました。

- ・資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
 - ・なお、期末時点では、資金フロー対応のため、債券先物のポジションは保有していません。
 - ・ベンチマーク（NOMURA-BPI総合）の構成銘柄を種別や年限などの属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました※。
- ※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

（ご参考）

利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

期末（2017年1月26日）

| | |
|---------|------|
| 最終利回り | 0.2% |
| 直接利回り | 1.0% |
| デュレーション | 8.6年 |

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

<外国債券インデックスマザーファンド>

基準価額は設定時に比べ3.9%の下落となりました。

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

（ご参考）

利回り・デュレーション

期末（2017年1月26日）

| | |
|---------|------|
| 最終利回り | 1.4% |
| 直接利回り | 2.4% |
| デュレーション | 6.8年 |

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

<東証REIT指数マザーファンド>

基準価額は設定時に比べほぼ横ばいとなりました。

- ・資産のほぼ全額を不動産投資信託証券（REIT）（先物を含む）に投資しました。
- ・ポートフォリオはベンチマークである東証REIT指数（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

<MUAM G-REITマザーファンド>

基準価額は設定時に比べ2.8%の上昇となりました。

- ・S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券（REIT）を主要投資対象とし、同インデックスに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。
- ・REITの組入比率は高位を保ち、国別比率や用途別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

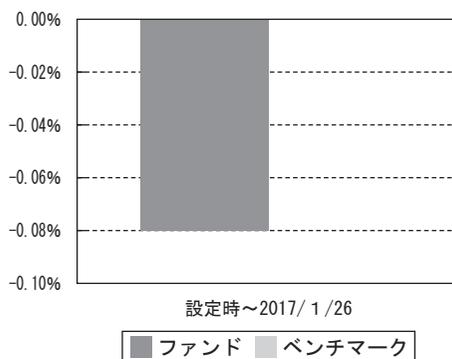
<eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）>

基準価額の騰落率は0.1%の下落となり、ベンチマークの騰落率（0.0%）を0.1%下回りました。差異の内訳は以下の通りです。

（内訳）

| | |
|------------|---------|
| 資産配分要因 | 0.0%程度 |
| その他（信託報酬等） | △0.1%程度 |

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



< T O P I X マザーファンド >

ベンチマークは12.2%の上昇となったため、カイ離は1.3%程度となりました。
 配当要因を除くと低水準に抑制し、高い流動性を維持しました。

| | 組入比率要因 | 銘柄選択要因 | その他の要因 | 合 計 |
|-------------|--------|---------|--------|--------|
| ベンチマークとのカイ離 | 0.0%程度 | △0.0%程度 | 1.3%程度 | 1.3%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、1.3%程度となりました。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.3%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・利子収入等 | 計 | 1.3%程度 |
| マイナス要因 | 売買コスト等 | 計 | △0.0%程度 |

信託財産の収益向上を目的に、保有株式の貸し付けを行っています。貸付契約額は、期末時点で概ね純資産総額の4割程度となり、信託財産に若干の収益寄与となりました。

< 外国株式インデックスマザーファンド >

ベンチマークは11.0%の上昇となったため、カイ離は2.1%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 | 2.2%程度 | 2.1%程度 |

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は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 $\Delta 0.1\%$ 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 2.2% 程度でした。

| | | | |
|--------|---------------|---|-------------------|
| プラス要因 | 配当・利子収入・為替効果等 | 計 | 2.3%程度 |
| マイナス要因 | 売買コスト・保管料等 | 計 | $\Delta 0.1\%$ 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。

<日本債券インデックスマザーファンド>

ベンチマークは 1.7% の下落となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度と低水準に抑制し、高い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 | $\Delta 0.0\%$ 程度 | 0.0% 程度 | $\Delta 0.0\%$ 程度 | $\Delta 0.0\%$ 程度 |

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

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

◎その他の要因

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

<外国債券インデックスマザーファンド>

ベンチマークは4.1%の下落となったため、カイ離は0.2%程度となりました。

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

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は0.0%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は△0.0%程度でした。

- ・カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.2%程度でした。

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

<東証REIT指数マザーファンド>

ベンチマークは0.2%の下落となったため、カイ離は0.2%程度となりました。カイ離幅を低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

| | 組入比率要因 | 銘柄選択要因 | その他の要因 | 合計 |
|-------------|--------|--------|--------|--------|
| ベンチマークとのカイ離 | 0.1%程度 | 0.0%程度 | 0.0%程度 | 0.2%程度 |

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.1%程度でした。

- ・期を通じて、運用資産のほぼ全額をREIT（先物を含む）に投資しました。
- ・期中における先物組入比率の平均は、2.2%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0.0%程度でした。

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

<MUAM G-REITマザーファンド>

ベンチマークは3.2%の上昇となったため、カイ離は△0.4%程度となりました。

| | 売買コスト 要因 | 配当課税 要因 | 為替評価 要因 | その他の 要因 | 合計 |
|-------------|-------------|------------|------------|------------|---------|
| ベンチマークとのカイ離 | △0.0%程度 | △0.4%程度 | △0.0%程度 | 0.1%程度 | △0.4%程度 |

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

◎売買コスト要因

売買コストによる影響は△0.0%程度でした。

◎配当課税要因

配当課税による影響は△0.4%程度でした。

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

◎ 為替評価要因

為替評価による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

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

◎ その他の要因

その他の要因による影響は 0.1% 程度でした。

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

分配金について

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

【分配原資の内訳】

（単位：円、1万口当たり、税込み）

| 項目 | 第1期 |
|-----------|-----------------------|
| | 2016年3月30日～2017年1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 | 84 |

（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

< eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー） >

◎今後の運用方針

- ・資産配分方針は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンが算出する最適化バランス（6%）指数の資産クラス別比率を維持します。また、目標リスク水準に沿うように原則、年1回資産クラス別比率の変更を行い、各資産の組入比率は、期を通じて同比率に準ずるよう調整を行います。

< TOPIXマザーファンド >

◎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。

< 外国株式インデックスマザーファンド >

◎今後の運用方針

- ・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。

< 日本債券インデックスマザーファンド >

◎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。

< 外国債券インデックスマザーファンド >

◎今後の運用方針

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

< 東証REIT指数マザーファンド >

◎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。

< MUAM G-REITマザーファンド >

◎今後の運用方針

- ・S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されているREITを主要投資対象とし、同インデックスに連動する投資成果をめざして、運用を行います。

○ 1万口当たりの費用明細

(2016年3月30日～2017年1月26日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|----------------------|------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 49 | 0.494 | (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 ） | (21) | (0.218) | 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 ） | (21) | (0.217) | 交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価 |
| （ 受 託 会 社 ） | (6) | (0.059) | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 0 | 0.002 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.001) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.001) | |
| （ 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) | (0.001) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 1 | 0.012 | (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) | (0.008) | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.003) | ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.001) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 50 | 0.510 | |
| 期中の平均基準価額は、9,865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

(2016年3月30日～2017年1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 |
| MUAM G-R E I Tマザーファンド | 1,876 | 2,798 | 335 | 502 |
| 東証REIT指数マザーファンド | 707 | 1,892 | 121 | 323 |
| TOPIXマザーファンド | 6,323 | 9,079 | 1,193 | 1,751 |
| 外国株式インデックスマザーファンド | 2,645 | 5,467 | 521 | 1,100 |
| 日本債券インデックスマザーファンド | 33,753 | 44,997 | 4,844 | 6,453 |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 14,278 | 27,708 | 2,060 | 3,997 |

○株式売買比率

(2016年3月30日～2017年1月26日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目 | 当期 | |
|---------------------|---------------|-------------------|
| | 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 | 265,238,388千円 | 196,336,354千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 245,412,649千円 | 265,134,971千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.08 | 0.74 |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年3月30日～2017年1月26日)

利害関係人との取引状況

< eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー） >

該当事項はございません。

< TOPIXマザーファンド >

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D C |
|------------|-----------|--------------------|--------|-----------|--------------------|--------|
| | | | | | | |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 株式 | 162,733 | 42,051 | 25.8 | 102,504 | 12,894 | 12.6 |
| 貸付有価証券(株式) | 303,377 | 303,377 | 100.0 | 280,368 | 280,368 | 100.0 |

平均保有割合 0.0%

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

<外国株式インデックスマザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 204,302 | 百万円 63,296 | % 31.0 | 百万円 129,964 | 百万円 65,596 | % 50.5 |

平均保有割合 0.0%

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-----|----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円 213,361 | 百万円 49,680 | % 23.3 | 百万円 257,228 | 百万円 40,640 | % 15.8 |

平均保有割合 0.0%

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

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

<外国債券インデックスマザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 16,166 | 百万円 3,298 | % 20.4 | 百万円 33,265 | 百万円 12,173 | % 36.6 |

平均保有割合 0.0%

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

<東証REIT指数マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-------------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 投資信託証券 | 百万円 3,205 | 百万円 1,274 | % 39.8 | 百万円 3,163 | 百万円 1,631 | % 51.6 |
| 不動産投信指数先物取引 | 4,140 | 4,140 | 100.0 | 4,258 | 4,258 | 100.0 |

平均保有割合 0.0%

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

<MUAM G-REITマザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-----|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |

平均保有割合 0.0%

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

利害関係人の発行する有価証券等

<TOPIXマザーファンド>

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|--------------|--------------|--------------|
| 株式 | 百万円 3,616 | 百万円 2,376 | 百万円 8,222 |

<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 801 | 百万円 1,032 | 百万円 2,143 |

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 97 |

<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 4,100 |

<東証REIT指数マザーファンド>

| 種 類 | 買 付 額 |
|--------|------------|
| 投資信託証券 | 百万円 134 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 0.508千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0.017千円 |
| (B) / (A) | 3.5% |

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

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

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

○組入資産の明細

(2017年1月26日現在)

親投資信託残高

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | |
|-----------------------|---|--------|--------|
| | | 口 数 | 評 価 額 |
| MUAM G-R E I Tマザーファンド | | 千口 | 千円 |
| | | 1,540 | 2,377 |
| 東証REIT指数マザーファンド | | 585 | 1,594 |
| TOPIXマザーファンド | | 5,129 | 8,145 |
| 外国株式インデックスマザーファンド | | 2,124 | 4,851 |
| 日本債券インデックスマザーファンド | | 28,909 | 37,978 |
| 外国債券インデックスマザーファンド | | 12,217 | 23,787 |

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

○投資信託財産の構成

(2017年1月26日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-----------------------|--------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| MUAM G-R E I Tマザーファンド | 2,377 | 2.9 |
| 東証REIT指数マザーファンド | 1,594 | 1.9 |
| TOPIXマザーファンド | 8,145 | 10.0 |
| 外国株式インデックスマザーファンド | 4,851 | 5.9 |
| 日本債券インデックスマザーファンド | 37,978 | 46.4 |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 23,787 | 29.1 |
| コール・ローン等、その他 | 3,132 | 3.8 |
| 投資信託財産総額 | 81,864 | 100.0 |

(注) MUAM G-R E I Tマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（18,041,793千円）の投資信託財産総額（18,064,831千円）に対する比率は99.9%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（361,760,229千円）の投資信託財産総額（362,581,312千円）に対する比率は99.8%です。

(注) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（128,890,434千円）の投資信託財産総額（128,982,879千円）に対する比率は99.9%です。

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

| | | | |
|--------------------|-------------------|---------------------|---------------------|
| 1 アメリカドル=113.15円 | 1 カナダドル=86.66円 | 1 メキシコペソ=5.37円 | 1 ユーロ=121.76円 |
| 1 イギリスポンド=142.99円 | 1 スイスフラン=113.39円 | 1 スウェーデンクローネ=12.85円 | 1 ノルウェークローネ=13.64円 |
| 1 デンマーククローネ=16.37円 | 1 ポーランドズロチ=27.98円 | 1 オーストラリアドル=85.77円 | 1 ニュージーランドドル=82.57円 |
| 1 香港ドル=14.59円 | 1 シンガポールドル=80.16円 | 1 マレーシアリングット=25.55円 | 1 イスラエルシェケル=29.91円 |
| 1 南アフリカランド=8.55円 | | | |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年1月26日現在）

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------|-------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 81,864,618 |
| コール・ローン等 | 1,411,588 |
| MUAMG-REITマザーファンド(評価額) | 2,377,856 |
| 東証REIT指数マザーファンド(評価額) | 1,594,656 |
| TOPIXマザーファンド(評価額) | 8,145,922 |
| 外国株式インデックスマザーファンド(評価額) | 4,851,651 |
| 日本債券インデックスマザーファンド(評価額) | 37,978,754 |
| 外国債券インデックスマザーファンド(評価額) | 23,787,698 |
| 未収入金 | 1,716,493 |
| (B) 負債 | 2,336,296 |
| 未払解約金 | 2,243,656 |
| 未払信託報酬 | 92,008 |
| 未払利息 | 2 |
| その他未払費用 | 630 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 79,528,322 |
| 元本 | 79,590,589 |
| 次期繰越損益金 | △ 62,267 |
| (D) 受益権総口数 | 79,590,589口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,992円 |

<注記事項>

- ①設定元本額 10,000,000円
 期中追加設定元本額 92,471,260円
 期中一部解約元本額 22,880,671円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9992円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は62,267円です。

③分配金の計算過程

| 項 目 | 2016年3月30日～ 2017年1月26日 |
|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 399,233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 | 168,703円 |
| 収益調整金額 | 102,045円 |
| 分配準備積立金額 | －円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 669,981円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 84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（2016年3月30日～2017年1月26日）

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 54 |
| 受取利息 | 4 |
| 支払利息 | △ 58 |
| (B) 有価証券売買損益 | 721,549 |
| 売買益 | 1,670,684 |
| 売買損 | △ 949,135 |
| (C) 信託報酬等 | △ 153,559 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 567,936 |
| (E) 追加信託差損益金 | △ 630,203 |
| (配当等相当額) | (△ 22) |
| (売買損益相当額) | (△ 630,181) |
| (F) 計(D+E) | △ 62,267 |
| (G) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(F+G) | △ 62,267 |
| 追加信託差損益金 | △ 630,203 |
| (配当等相当額) | (102,045) |
| (売買損益相当額) | (△ 732,248) |
| 分配準備積立金 | 567,936 |

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

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

[お 知 ら せ]

2014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。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2017年1月26日現在）

< T O P I X マザーファンド >

下記は、T O P I X マザーファンド全体(197,761,894千口)の内容です。

国内株式

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|----------------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 水産・農林業 (0.1%) | | |
| 極洋 | 6.1 | 16,671 |
| 日本水産 | 201.6 | 111,686 |
| マルハニチロ | 29.5 | 93,367 |
| カネコ種苗 | 5.3 | 8,018 |
| サカタのタネ | 22.9 | 74,654 |
| ホクト | 15.8 | 32,137 |
| ホクリヨウ | 1.6 | 1,177 |
| 鉱業 (0.3%) | | |
| 住石ホールディングス | 43.1 | 4,310 |
| 日鉄鉱業 | 4.3 | 24,854 |
| 三井松島産業 | 9.5 | 13,176 |
| 国際石油開発帝石 | 817.9 | 889,057 |
| 日本海洋掘削 | 5.4 | 12,781 |
| 石油資源開発 | 24.6 | 62,238 |
| K&Oエナジーグループ | 10.4 | 18,574 |
| 建設業 (3.0%) | | |
| ショーボンドホールディングス | 16.3 | 79,462 |
| ミライト・ホールディングス | 47.8 | 50,190 |
| タマホーム | 11.6 | 6,345 |
| サンヨーホームズ | 3.3 | 2,154 |
| ダイセキ環境ソリューション | 3.6 | 5,824 |
| 安藤・間 | 111.6 | 90,061 |
| 東急建設 | 55.1 | 49,920 |
| コムシスホールディングス | 60.7 | 128,866 |
| ミサワホーム | 18.3 | 20,221 |
| ピーアールホールディングス | 15.4 | 4,481 |
| 高松コンストラクショングループ | 11.7 | 29,203 |
| 東建コーポレーション | 6.4 | 51,200 |
| ソネック | 1.9 | 1,193 |
| ヤマウラ | 7.3 | 4,234 |
| 大成建設 | 789 | 644,613 |
| 大林組 | 465.6 | 502,848 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|---------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 清水建設 | 475 | 503,975 |
| 飛島建設 | 149.6 | 27,376 |
| 長谷工コーポレーション | 181.2 | 234,472 |
| 松井建設 | 17.1 | 19,254 |
| 銭高組 | 22 | 10,846 |
| 鹿島建設 | 682 | 539,462 |
| 不動テトラ | 125.3 | 26,688 |
| 大末建設 | 5.5 | 5,412 |
| 鉄建建設 | 94 | 31,584 |
| 西松建設 | 179 | 102,388 |
| 三井住友建設 | 594.9 | 73,172 |
| 大豊建設 | 56 | 29,736 |
| 前田建設工業 | 96 | 96,672 |
| 佐田建設 | 10.7 | 4,718 |
| ナカノフドー建設 | 11.9 | 7,021 |
| 奥村組 | 128 | 86,656 |
| 東鉄工業 | 18.6 | 60,636 |
| イチケン | 14 | 6,258 |
| 浅沼組 | 50 | 18,300 |
| 戸田建設 | 180 | 112,140 |
| 熊谷組 | 244 | 78,812 |
| 青木あすなろ建設 | 10.2 | 8,119 |
| 北野建設 | 32 | 10,208 |
| 植木組 | 19 | 4,883 |
| 三井ホーム | 20 | 11,220 |
| 矢作建設工業 | 21.1 | 23,083 |
| ピーエス三菱 | 16.3 | 6,291 |
| 日本ハウスホールディングス | 31.6 | 16,590 |
| 大東建託 | 57.1 | 914,171 |
| 新日本建設 | 18.5 | 16,576 |
| N I P P O | 36 | 77,508 |
| 東亜道路工業 | 29 | 10,092 |
| 前田道路 | 49 | 95,648 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|---------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 日本道路 | 46 | 21,022 |
| 東亜建設工業 | 12.6 | 22,843 |
| 若築建設 | 89 | 13,706 |
| 東洋建設 | 44.7 | 18,371 |
| 五洋建設 | 172.3 | 97,004 |
| 大林道路 | 16.1 | 11,205 |
| 世紀東急工業 | 22.6 | 11,277 |
| 福田組 | 25 | 27,450 |
| 住友林業 | 106.9 | 165,053 |
| 日本基礎技術 | 17.3 | 6,106 |
| 日成ビルド工業 | 46 | 25,760 |
| ヤマダ・エスバイエルホーム | 79 | 6,320 |
| 巴コーポレーション | 19.3 | 7,005 |
| パナホーム | 58 | 56,608 |
| 大和ハウス工業 | 458.6 | 1,424,411 |
| ライト工業 | 29.8 | 35,462 |
| 積水ハウス | 488.6 | 919,300 |
| 日特建設 | 13.2 | 6,322 |
| 北陸電気工事 | 7.5 | 6,930 |
| ユアテック | 24 | 19,200 |
| 西部電気工業 | 2.6 | 5,954 |
| 四電工 | 12 | 5,400 |
| 中電工 | 19.6 | 49,372 |
| 関電工 | 62 | 65,596 |
| きんでん | 103.2 | 151,807 |
| 東京エネシス | 16 | 16,400 |
| トーエネック | 22 | 12,386 |
| 住友電設 | 10.7 | 14,059 |
| 日本電設工業 | 25.3 | 47,943 |
| 協和エクシオ | 60.8 | 102,508 |
| 新日本空調 | 12 | 15,408 |
| NDS | 2.4 | 7,024 |
| 九電工 | 30.1 | 92,557 |
| 三機工業 | 34.4 | 33,505 |
| 日揮 | 144.9 | 293,132 |
| 中外炉工業 | 47 | 10,481 |
| ヤマト | 13.9 | 7,978 |
| 太平電業 | 21 | 23,709 |
| 高砂熱学工業 | 42.7 | 66,953 |
| 三晃金属工業 | 1.4 | 4,550 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|-------------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 朝日工業社 | 3.5 | 10,430 |
| 明星工業 | 28.1 | 16,803 |
| 大気社 | 20.6 | 58,854 |
| ダイダン | 21 | 20,160 |
| 日比谷総合設備 | 17.3 | 29,410 |
| 東芝プラントシステム | 25.2 | 42,739 |
| OSJBホールディングス | 47.4 | 11,897 |
| 東洋エンジニアリング | 91 | 27,755 |
| 千代田化工建設 | 112 | 93,632 |
| 新興プランテック | 31.9 | 26,285 |
| 食料品 (4.3%) | | |
| 日本製粉 | 46.2 | 73,319 |
| 日清製粉グループ本社 | 170.2 | 292,063 |
| 日東富士製粉 | 1 | 3,910 |
| 昭和産業 | 64 | 38,848 |
| 鳥越製粉 | 12.3 | 9,753 |
| 中部飼料 | 17 | 17,629 |
| フィード・ワン | 93.4 | 16,251 |
| 東洋精糖 | 23 | 2,668 |
| 日本甜菜製糖 | 7.9 | 18,738 |
| 三井製糖 | 11 | 27,456 |
| 塩水港精糖 | 16.6 | 4,133 |
| 日新製糖 | 6.6 | 11,101 |
| 森永製菓 | 30.3 | 146,046 |
| 中村屋 | 3.6 | 18,072 |
| 江崎グリコ | 38.8 | 199,432 |
| 名糖産業 | 6.7 | 9,433 |
| 不二家 | 89 | 19,847 |
| 山崎製パン | 113.7 | 256,279 |
| 第一屋製パン | 24 | 3,168 |
| モロゾフ | 24 | 12,000 |
| 亀田製菓 | 8.6 | 44,892 |
| 寿スピリッツ | 11 | 29,458 |
| カルビー | 63.3 | 229,462 |
| 森永乳業 | 139 | 106,613 |
| 六甲バター | 6.9 | 16,297 |
| ヤクルト本社 | 83.3 | 443,989 |
| 明治ホールディングス | 92 | 810,520 |
| 雪印メグミルク | 33.5 | 95,843 |
| プリマハム | 98 | 39,984 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|------------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 日本ハム | 105 | 322,875 |
| 林兼産業 | 5 | 4,295 |
| 丸大食品 | 74 | 36,186 |
| S F o o d s | 8.3 | 25,149 |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 89.6 | 88,166 |
| サッポロホールディングス | 50.9 | 150,969 |
| アサヒグループホールディングス | 291.3 | 1,138,691 |
| キリンホールディングス | 668.5 | 1,247,086 |
| 宝ホールディングス | 112.4 | 115,884 |
| オエノンホールディングス | 40 | 10,760 |
| 養命酒製造 | 4.8 | 9,100 |
| コカ・コーラウエスト | 52.6 | 172,528 |
| コカ・コーライーストジャパン | 60.4 | 147,798 |
| サントリー食品インターナショナル | 106.4 | 512,848 |
| ダイドーグループホールディングス | 7.1 | 42,032 |
| 伊藤園 | 46.1 | 174,949 |
| キーコーヒー | 13.7 | 29,824 |
| ユニカフェ | 4.2 | 4,116 |
| ジャパンフーズ | 2 | 2,632 |
| 日清オイリオグループ | 89 | 47,348 |
| 不二製油グループ本社 | 41.4 | 94,267 |
| かどや製油 | 1.5 | 6,322 |
| J-オイルミルズ | 7.2 | 28,188 |
| キッコーマン | 109 | 382,045 |
| 味の素 | 319.9 | 711,457 |
| キューピー | 79 | 229,021 |
| ハウス食品グループ本社 | 57.5 | 137,942 |
| カゴメ | 55.7 | 158,020 |
| 焼津水産化学工業 | 7.3 | 8,708 |
| アリアケジャパン | 12.7 | 74,549 |
| ビエトロ | 1.8 | 2,986 |
| エバラ食品工業 | 3.7 | 7,696 |
| ニチレイ | 76.4 | 175,949 |
| 東洋水産 | 76.3 | 306,726 |
| イートアンド | 1.7 | 3,733 |
| 大冷 | 1.2 | 2,113 |
| 日清食品ホールディングス | 60.6 | 361,782 |
| 永谷園ホールディングス | 15 | 21,495 |
| 一正蒲鉾 | 5.4 | 6,150 |
| フジッコ | 15.1 | 35,001 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|--------------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| ロック・フィールド | 16.1 | 26,484 |
| 日本たばこ産業 | 860.5 | 3,167,500 |
| ケンコーマヨネーズ | 5.5 | 16,296 |
| わらべや日洋ホールディングス | 9.1 | 22,012 |
| なとり | 7.8 | 14,063 |
| 北の達人コーポレーション | 3.3 | 1,917 |
| ユーグレナ | 50 | 59,050 |
| ミヨシ油脂 | 53 | 7,526 |
| 理研ビタミン | 4.6 | 20,516 |
| 繊維製品 (0.7%) | | |
| 片倉工業 | 18.2 | 24,406 |
| グンゼ | 108 | 41,472 |
| 東洋紡 | 575 | 108,675 |
| ユニチカ | 398 | 32,636 |
| 富士紡ホールディングス | 7.1 | 25,276 |
| 倉敷紡績 | 146 | 35,040 |
| シキボウ | 78 | 12,324 |
| 日本毛織 | 40.9 | 36,973 |
| ダイトウボウ | 19 | 1,349 |
| トーア紡コーポレーション | 6.2 | 3,428 |
| ダイドーリミテッド | 16.2 | 7,079 |
| 帝国繊維 | 15.2 | 23,864 |
| 帝人 | 118.6 | 291,281 |
| 東レ | 1,053 | 1,036,152 |
| サカイオーベックス | 3.5 | 6,331 |
| 住江織物 | 36 | 9,972 |
| 日本フェルト | 8.3 | 4,274 |
| イチカワ | 10 | 3,000 |
| 日東製網 | 1.6 | 3,451 |
| アツギ | 119 | 14,875 |
| ダイニック | 27 | 5,238 |
| セーレン | 36.2 | 51,548 |
| ソトー | 5.4 | 6,301 |
| 東海染工 | 20 | 2,860 |
| 小松精練 | 20.4 | 14,871 |
| ワコールホールディングス | 86 | 116,272 |
| ホギメディカル | 9.1 | 62,517 |
| レナウン | 39.2 | 4,625 |
| クラウディア | 3.3 | 1,778 |
| T S I ホールディングス | 59.8 | 49,215 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|---------------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 三陽商会 | 76 | 13,072 |
| ナイガイ | 53 | 3,180 |
| オンワードホールディングス | 94 | 79,242 |
| ルック | 26 | 4,628 |
| キムラタン | 611 | 4,277 |
| ゴールドウイン | 6.2 | 32,674 |
| デサント | 33.1 | 44,122 |
| キング | 7.2 | 2,952 |
| ヤマトインターナショナル | 8.9 | 3,649 |
| パルプ・紙 (0.2%) | | |
| 特種東海製紙 | 8.4 | 33,768 |
| 王子ホールディングス | 567 | 289,737 |
| 日本製紙 | 65 | 134,940 |
| 三菱製紙 | 20.6 | 16,583 |
| 北越紀州製紙 | 81 | 55,728 |
| 中越パルプ工業 | 57 | 14,136 |
| 巴川製紙所 | 22 | 5,126 |
| 大王製紙 | 57.8 | 75,255 |
| 阿波製紙 | 2.6 | 1,588 |
| レンゴー | 139.9 | 97,370 |
| トーモク | 46 | 15,410 |
| ザ・バック | 10.3 | 30,848 |
| 化学 (6.7%) | | |
| クラレ | 244.3 | 444,381 |
| 旭化成 | 905 | 983,282 |
| 共和レザー | 8.4 | 7,425 |
| 昭和電工 | 96.6 | 182,863 |
| 住友化学 | 1,068 | 621,576 |
| 住友精化 | 6 | 27,480 |
| 日産化学工業 | 79.5 | 325,155 |
| ラサ工業 | 55 | 7,920 |
| クレハ | 10.9 | 52,538 |
| 多木化学 | 10 | 8,270 |
| テイカ | 22 | 16,082 |
| 石原産業 | 26.1 | 24,455 |
| 片倉コープアグリ | 20 | 4,740 |
| 日東エフシー | 8.5 | 7,939 |
| 日本曹達 | 87 | 47,850 |
| 東ソー | 420 | 369,180 |
| トクヤマ | 226 | 117,068 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|----------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| セントラル硝子 | 148 | 82,288 |
| 東亜合成 | 90.9 | 110,988 |
| 大阪ソーダ | 63 | 31,185 |
| 関東電化工業 | 30 | 33,030 |
| デンカ | 301 | 170,366 |
| 信越化学工業 | 260.3 | 2,629,030 |
| 日本カーバイド工業 | 49 | 7,644 |
| 堺化学工業 | 54 | 21,384 |
| エア・ウォーター | 119.7 | 257,953 |
| 大陽日酸 | 111.8 | 156,855 |
| 日本化学工業 | 54 | 13,014 |
| 日本バーカライジング | 74.2 | 104,622 |
| 高圧ガス工業 | 21.5 | 15,931 |
| チタン工業 | 17 | 3,332 |
| 四国化成工業 | 21 | 23,100 |
| 戸田工業 | 29 | 8,410 |
| ステラ ケミファ | 6.9 | 24,667 |
| 保土谷化学工業 | 5.1 | 14,514 |
| 日本触媒 | 22.8 | 182,856 |
| 大日精化工業 | 60 | 41,520 |
| カネカ | 196 | 196,000 |
| 三菱瓦斯化学 | 135.2 | 302,172 |
| 三井化学 | 660 | 354,420 |
| J S R | 145.9 | 302,304 |
| 東京応化工業 | 27.2 | 112,608 |
| 大阪有機化学工業 | 9.4 | 8,836 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 977.8 | 785,564 |
| KHネオケム | 17.8 | 24,439 |
| ダイセル | 195.7 | 247,364 |
| 住友ベークライト | 128 | 88,320 |
| 積水化学工業 | 329.5 | 651,421 |
| 日本ゼオン | 122 | 154,208 |
| アイカ工業 | 46.5 | 144,150 |
| 宇部興産 | 731 | 203,218 |
| 積水樹脂 | 22.4 | 40,611 |
| タキロン | 30 | 16,440 |
| 旭有機材 | 47 | 10,763 |
| 日立化成 | 80.7 | 265,906 |
| ニチバン | 14 | 12,040 |
| リケンテクノス | 31.3 | 17,590 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|------------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 大倉工業 | 35 | 18,410 |
| 積水化成工業 | 20.6 | 17,159 |
| 群栄化学工業 | 3.5 | 11,812 |
| タイガースポリマー | 7.1 | 5,793 |
| ミライアル | 5.2 | 5,148 |
| ダイキアクシス | 2.4 | 2,757 |
| ダイキョーニシカワ | 25.4 | 39,039 |
| 日本化薬 | 94 | 140,154 |
| カーリットホールディングス | 13.5 | 7,560 |
| 日本精化 | 12 | 10,704 |
| 扶桑化学工業 | 10.3 | 26,007 |
| A D E K A | 62.4 | 104,083 |
| 日油 | 117 | 142,155 |
| 新日本理化 | 22.9 | 3,686 |
| ハリマ化成グループ | 12.3 | 9,778 |
| 花王 | 368.6 | 2,049,416 |
| 第一工業製薬 | 32 | 12,672 |
| ニイタカ | 2.1 | 3,045 |
| 三洋化成工業 | 9.1 | 46,592 |
| 有機合成薬品工業 | 9.5 | 2,536 |
| 大日本塗料 | 83 | 20,418 |
| 日本ペイントホールディングス | 112 | 374,640 |
| 関西ペイント | 152.5 | 340,990 |
| 神東塗料 | 11 | 2,398 |
| 中国塗料 | 41.6 | 36,857 |
| 日本特殊塗料 | 10.2 | 18,360 |
| 藤倉化成 | 19.7 | 13,356 |
| 太陽ホールディングス | 11.8 | 54,988 |
| D I C | 57.3 | 206,566 |
| サカタインクス | 29.6 | 45,376 |
| 東洋インキS Cホールディングス | 143 | 79,222 |
| T & K T O K A | 10.5 | 11,119 |
| 富士フイルムホールディングス | 287.8 | 1,262,003 |
| 資生堂 | 275.4 | 860,900 |
| ライオン | 180 | 353,340 |
| 高砂香料工業 | 9.5 | 29,592 |
| マンダム | 14.5 | 75,835 |
| ミルボン | 7.8 | 36,270 |
| ファンケル | 30.8 | 53,222 |
| コーセー | 23.5 | 230,065 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|------------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| コタ | 5.5 | 7,298 |
| シーズ・ホールディングス | 18.8 | 60,630 |
| シーボン | 1.7 | 4,231 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 14.8 | 156,584 |
| ノエビアホールディングス | 9.2 | 35,558 |
| アジュバンコスメジャパン | 2.7 | 2,554 |
| エステー | 9.9 | 16,958 |
| アグロ カネショウ | 5.6 | 6,921 |
| コニシ | 22.8 | 30,278 |
| 長谷川香料 | 18.4 | 35,972 |
| 星光PMC | 7.9 | 9,788 |
| 小林製薬 | 40.3 | 203,112 |
| 荒川化学工業 | 12.4 | 23,212 |
| メック | 11.2 | 11,502 |
| 日本高純度化学 | 4.1 | 10,209 |
| タカラバイオ | 31.1 | 50,195 |
| J C U | 4.6 | 27,784 |
| 新田ゼラチン | 8.7 | 6,559 |
| O A Tアグリオ | 1.7 | 2,313 |
| デクセリアルズ | 38 | 44,498 |
| アース製薬 | 10.4 | 50,076 |
| イハラケミカル工業 | 20.1 | 21,728 |
| 北興化学工業 | 14 | 6,832 |
| 大成ラミック | 4.1 | 12,710 |
| クミアイ化学工業 | 29.9 | 20,391 |
| 日本農薬 | 33.1 | 20,654 |
| アキレス | 11.9 | 20,456 |
| 有沢製作所 | 24.5 | 16,562 |
| 日東電工 | 104.7 | 972,663 |
| レック | 4.5 | 15,525 |
| きもと | 25.9 | 6,449 |
| 藤森工業 | 10.8 | 33,156 |
| 前澤化成工業 | 9.5 | 11,523 |
| J S P | 6.8 | 17,979 |
| エフビコ | 12.9 | 70,047 |
| 天馬 | 9.6 | 19,872 |
| 信越ポリマー | 28.4 | 26,014 |
| 東リ | 34.5 | 13,834 |
| ニフコ | 25.4 | 147,320 |
| 日本バルカー工業 | 11.3 | 19,040 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| ユニ・チャーム | 293.8 | 759,326 |
| 医薬品 (4.6%) | | |
| 協和発酵キリン | 173.6 | 268,038 |
| 武田薬品工業 | 544.1 | 2,599,709 |
| アステラス製薬 | 1,482.7 | 2,280,392 |
| 大日本住友製薬 | 102.7 | 206,529 |
| 塩野義製薬 | 196.4 | 1,086,288 |
| 田辺三菱製薬 | 169.1 | 382,335 |
| わかもと製薬 | 16 | 4,048 |
| あすか製薬 | 15.8 | 27,365 |
| 日本新薬 | 33.2 | 198,536 |
| ビオフェルミン製薬 | 2.4 | 6,842 |
| 中外製薬 | 144.5 | 487,687 |
| 科研製薬 | 27.1 | 157,451 |
| エーザイ | 178.6 | 1,144,826 |
| ロート製薬 | 71 | 138,805 |
| 小野薬品工業 | 329.6 | 766,155 |
| 久光製薬 | 40.9 | 244,173 |
| 持田製薬 | 9.9 | 80,289 |
| 参天製薬 | 267.4 | 371,953 |
| 扶桑薬品工業 | 4.9 | 13,969 |
| 日本ケミファ | 2 | 11,200 |
| ツムラ | 48.7 | 158,762 |
| 日医工 | 33.9 | 55,257 |
| キッセイ薬品工業 | 25.7 | 72,242 |
| 生化学工業 | 26.9 | 45,407 |
| 栄研化学 | 12.2 | 38,125 |
| 日水製薬 | 5.8 | 7,528 |
| 鳥居薬品 | 9.9 | 24,928 |
| JCRファーマ | 11.2 | 31,214 |
| 東和薬品 | 6.6 | 29,700 |
| 富士製薬工業 | 4.7 | 13,014 |
| 沢井製薬 | 24.6 | 146,862 |
| ゼリア新薬工業 | 29.7 | 53,608 |
| 第一三共 | 427.1 | 1,069,458 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 35.5 | 89,424 |
| 大幸薬品 | 7.2 | 13,060 |
| ダイト | 8.1 | 18,459 |
| 大塚ホールディングス | 312 | 1,655,472 |
| 大正製薬ホールディングス | 31 | 296,980 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| ベプチドリーム | 24.6 | 143,418 |
| 石油・石炭製品 (0.5%) | | |
| 日本コークス工業 | 117.1 | 13,349 |
| 昭和シェル石油 | 129.7 | 145,523 |
| ニチレキ | 17.7 | 16,514 |
| 東燃ゼネラル石油 | 236 | 310,340 |
| ユシロ化学工業 | 7.8 | 11,395 |
| ビービー・カストロール | 5.9 | 9,091 |
| 富士石油 | 33.6 | 13,876 |
| MORESCO | 5 | 8,790 |
| 出光興産 | 68.8 | 237,360 |
| JXホールディングス | 1,610.5 | 851,793 |
| コスモエネルギーホールディングス | 43.8 | 84,183 |
| ゴム製品 (0.9%) | | |
| 横浜ゴム | 87.5 | 177,450 |
| 東洋ゴム工業 | 76.6 | 105,708 |
| ブリヂストン | 489.8 | 2,003,771 |
| 住友ゴム工業 | 135.8 | 242,674 |
| 藤倉ゴム工業 | 12.1 | 8,010 |
| オカモト | 44 | 47,080 |
| フコク | 6.1 | 5,691 |
| ニッタ | 13 | 40,690 |
| 住友理工 | 26.9 | 29,428 |
| 三ツ星ベルト | 35 | 35,420 |
| バンドー化学 | 26.4 | 27,112 |
| ガラス・土石製品 (1.0%) | | |
| 日東紡績 | 117 | 53,820 |
| 旭硝子 | 715 | 609,895 |
| 日本板硝子 | 66.1 | 62,332 |
| 石塚硝子 | 20 | 4,140 |
| 日本山村硝子 | 58 | 11,774 |
| 日本電気硝子 | 300 | 199,200 |
| オハラ | 5.5 | 4,713 |
| 住友大阪セメント | 269 | 124,278 |
| 太平洋セメント | 875 | 355,250 |
| 日本ヒューム | 13.9 | 9,757 |
| 日本コンクリート工業 | 32.3 | 11,111 |
| 三谷セキサン | 7.3 | 21,345 |
| アジアパイルホールディングス | 17.8 | 10,217 |
| 東海カーボン | 135.5 | 55,826 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|--------------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 日本カーボン | 71 | 20,022 |
| 東洋炭素 | 8 | 15,480 |
| ノリタケカンパニーリミテド | 8.2 | 23,862 |
| TOTO | 106.6 | 492,492 |
| 日本碍子 | 183.2 | 418,978 |
| 日本特殊陶業 | 125 | 315,875 |
| ダントーホールディングス | 12 | 2,292 |
| MARUWA | 5.3 | 19,663 |
| 品川リフラクトリーズ | 37 | 10,027 |
| 黒崎播磨 | 31 | 10,261 |
| ヨータイ | 8 | 2,872 |
| イソライト工業 | 7.1 | 2,293 |
| 東京窯業 | 17.6 | 3,396 |
| ニッカトー | 4.7 | 1,964 |
| フジミインコーポレーテッド | 12.3 | 30,171 |
| エーアンドエーマテリアル | 30 | 4,020 |
| ニチアス | 76 | 90,896 |
| ニチハ | 19.3 | 56,452 |
| 鉄鋼 (1.4%) | | |
| 新日鐵住金 | 654.2 | 1,834,049 |
| 神戸製鋼所 | 250.8 | 285,661 |
| 中山製鋼所 | 16.3 | 12,534 |
| 合同製鐵 | 8.1 | 17,220 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 396.5 | 803,110 |
| 日新製鋼 | 66.2 | 100,955 |
| 東京製鐵 | 73.4 | 75,969 |
| 共英製鋼 | 15.5 | 35,975 |
| 大和工業 | 29.1 | 100,249 |
| 東京鐵鋼 | 30 | 14,400 |
| 大阪製鐵 | 9.1 | 20,238 |
| 淀川製鋼所 | 20 | 65,700 |
| 東洋鋼板 | 34.7 | 14,296 |
| 丸一鋼管 | 48.5 | 185,027 |
| モリ工業 | 4.6 | 9,480 |
| 大同特殊鋼 | 243 | 127,089 |
| 日本高周波鋼業 | 51 | 4,539 |
| 日本冶金工業 | 120 | 23,280 |
| 山陽特殊製鋼 | 86 | 51,772 |
| 愛知製鋼 | 8.6 | 43,774 |
| 日立金属 | 147.6 | 241,621 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|--------------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 日本金属 | 3.5 | 4,504 |
| 大平洋金属 | 93 | 33,945 |
| 新日本電工 | 82.1 | 24,383 |
| 栗本鐵工所 | 6.9 | 16,194 |
| 虹技 | 20 | 5,300 |
| 日本鑄鉄管 | 14 | 2,814 |
| 三菱製鋼 | 101 | 25,957 |
| 日亜鋼業 | 20 | 5,480 |
| 日本精線 | 10 | 6,130 |
| シンニッタン | 11.8 | 8,248 |
| 新家工業 | 31 | 5,053 |
| 非鉄金属 (0.9%) | | |
| 大紀アルミニウム工業所 | 24 | 12,816 |
| 日本軽金属ホールディングス | 328.4 | 92,280 |
| 三井金属鋁業 | 394 | 126,868 |
| 東邦亜鉛 | 82 | 42,230 |
| 三菱マテリアル | 90.5 | 363,810 |
| 住友金属鋁山 | 375 | 583,687 |
| DOWAホールディングス | 160 | 157,440 |
| 古河機械金属 | 226 | 52,432 |
| エス・サイエンス | 65.9 | 2,504 |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 15.8 | 27,555 |
| 東邦チタニウム | 24.5 | 19,796 |
| UACJ | 184 | 65,320 |
| 古河電気工業 | 48.6 | 191,241 |
| 住友電気工業 | 546.6 | 911,182 |
| フジクラ | 190.9 | 138,402 |
| 昭和電線ホールディングス | 172 | 15,824 |
| 東京特殊電線 | 2.1 | 3,080 |
| タツタ電線 | 27.2 | 12,892 |
| 沖電線 | 15 | 3,630 |
| カナレ電気 | 2 | 4,502 |
| 平河ヒューテック | 6.8 | 8,738 |
| リョービ | 88 | 43,912 |
| アーレスティ | 16.8 | 20,630 |
| アサヒホールディングス | 21.8 | 48,526 |
| 金属製品 (0.7%) | | |
| 稲葉製作所 | 7.7 | 10,472 |
| 宮地エンジニアリンググループ | 42 | 8,400 |
| トーカロ | 9.5 | 24,519 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|------------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| アルファCo | 4.8 | 5,467 |
| SUMCO | 151.4 | 269,340 |
| 川田テクノロジーズ | 2.7 | 22,194 |
| RS Technologies | 0.5 | 2,085 |
| 東洋製罐グループホールディングス | 103.1 | 221,046 |
| ホッカンホールディングス | 38 | 17,936 |
| コロナ | 7.6 | 8,770 |
| 横河ブリッジホールディングス | 25.5 | 35,980 |
| 駒井ハルテック | 2.8 | 6,025 |
| 高田機工 | 13 | 3,107 |
| 三和ホールディングス | 144 | 161,568 |
| 文化シャッター | 40.4 | 37,168 |
| 三協立山 | 19 | 33,041 |
| アルインコ | 10 | 10,570 |
| 東洋シャッター | 3.6 | 2,311 |
| LIXILグループ | 202 | 552,874 |
| 日本フィルコン | 10.5 | 6,079 |
| ノーリツ | 28.4 | 56,232 |
| 長府製作所 | 15.5 | 40,362 |
| リンナイ | 24.7 | 236,379 |
| ダイニチ工業 | 7.4 | 5,409 |
| 日東精工 | 20.6 | 8,590 |
| 三洋工業 | 18 | 3,600 |
| 岡部 | 30.1 | 28,896 |
| ジーテクト | 15.1 | 32,434 |
| 中国工業 | 2.1 | 1,474 |
| 東プレ | 27.9 | 80,045 |
| 高周波熱錬 | 26.9 | 24,398 |
| 東京製網 | 9.8 | 19,168 |
| サンコール | 7.7 | 4,150 |
| モリテック スチール | 7.3 | 2,124 |
| バイオラックス | 7.3 | 53,947 |
| 日本発條 | 136.5 | 153,835 |
| 中央発條 | 16 | 5,248 |
| アドバネクス | 2.5 | 4,817 |
| 立川ブラインド工業 | 6 | 5,496 |
| 三益半導体工業 | 10.7 | 19,998 |
| 機械 (5.1%) | | |
| 日本ドライケミカル | 1.9 | 4,497 |
| 日本製鋼所 | 47.9 | 104,517 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|--------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 三浦工業 | 59.3 | 107,273 |
| タクマ | 46.4 | 46,539 |
| ツガミ | 39 | 27,924 |
| オークマ | 94 | 115,244 |
| 東芝機械 | 86 | 43,086 |
| アマダホールディングス | 195.2 | 265,081 |
| アイダエンジニアリング | 41.2 | 46,391 |
| 滝澤鉄工所 | 42 | 7,098 |
| 富士機械製造 | 44.2 | 62,498 |
| 牧野フライス製作所 | 72 | 73,296 |
| オーエスジー | 66.1 | 158,309 |
| ダイジェット工業 | 17 | 3,060 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 41.5 | 35,939 |
| DMG森精機 | 85.8 | 134,362 |
| ソディック | 36.8 | 36,432 |
| ディスコ | 17 | 247,520 |
| 日東工器 | 8.4 | 21,252 |
| パンチ工業 | 5.2 | 4,825 |
| 豊和工業 | 8.1 | 5,435 |
| OKK | 53 | 6,784 |
| 石川製作所 | 3.6 | 2,656 |
| 東洋機械金属 | 9.8 | 4,635 |
| 津田駒工業 | 32 | 5,664 |
| エンシュウ | 36 | 3,636 |
| 島精機製作所 | 18.9 | 76,261 |
| NCホールディングス | 4.7 | 4,375 |
| フリュー | 2.8 | 13,202 |
| ヤマシンフィルタ | 2.8 | 4,972 |
| 日阪製作所 | 19.7 | 18,419 |
| やまびこ | 26.6 | 43,491 |
| ベガサスミシン製造 | 13.9 | 9,813 |
| ナブテスコ | 75.4 | 224,842 |
| 三井海洋開発 | 14.6 | 28,849 |
| レオン自動機 | 12.2 | 12,907 |
| SMC | 43.5 | 1,316,310 |
| 新川 | 12.1 | 10,406 |
| ホソカワミクロン | 24 | 18,936 |
| ユニオンツール | 6.3 | 20,002 |
| オイレス工業 | 18.7 | 38,110 |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 4.6 | 10,202 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|--------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| サトーホールディングス | 18 | 42,678 |
| 日本エアータック | 4.7 | 3,031 |
| 日精樹脂工業 | 11.5 | 11,983 |
| オカダアイヨン | 3 | 3,360 |
| ワイエイシイ | 5.4 | 8,391 |
| 小松製作所 | 669.1 | 1,898,905 |
| 住友重機械工業 | 423 | 341,784 |
| 日立建機 | 64.8 | 177,746 |
| 日工 | 4.4 | 9,640 |
| 巴工業 | 5.9 | 11,298 |
| 井関農機 | 148 | 33,448 |
| TOWA | 11.8 | 20,921 |
| 丸山製作所 | 30 | 5,820 |
| 北川鉄工所 | 6.6 | 16,328 |
| ローツェ | 5.1 | 11,883 |
| タカキタ | 4.8 | 2,644 |
| クボタ | 696.3 | 1,266,221 |
| 荏原実業 | 4 | 5,400 |
| 三菱化工機 | 48 | 10,560 |
| 月島機械 | 27.5 | 33,467 |
| 帝国電機製作所 | 10.5 | 10,930 |
| 東京機械製作所 | 54 | 4,212 |
| 新東工業 | 32.9 | 34,150 |
| 澁谷工業 | 12.1 | 28,822 |
| アイチ コーポレーション | 20.5 | 17,404 |
| 小森コーポレーション | 34.8 | 53,383 |
| 鶴見製作所 | 10.8 | 17,874 |
| 住友精密工業 | 23 | 8,096 |
| 酒井重工業 | 28 | 9,688 |
| 荏原製作所 | 63.8 | 227,766 |
| 石井鐵工所 | 2.1 | 3,824 |
| 西島製作所 | 14.1 | 16,200 |
| 北越工業 | 15.6 | 12,651 |
| ダイキン工業 | 189.2 | 2,166,340 |
| オルガノ | 27 | 13,176 |
| トーヨーカネツ | 66 | 22,242 |
| 栗田工業 | 82 | 221,810 |
| 椿本チエイン | 82 | 76,670 |
| 大同工業 | 28 | 7,392 |
| 木村化工機 | 12.4 | 4,216 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|---------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| アネスト岩田 | 25.1 | 28,337 |
| ダイフク | 69.1 | 174,339 |
| サムコ | 3.5 | 4,102 |
| 加藤製作所 | 7.6 | 22,800 |
| 油研工業 | 27 | 6,129 |
| タダノ | 72.4 | 108,165 |
| フジテック | 40.3 | 55,049 |
| CKD | 41.5 | 65,072 |
| キトー | 17.5 | 22,942 |
| 平和 | 42.9 | 118,575 |
| 理想科学工業 | 13.8 | 28,207 |
| SANKYO | 38.5 | 145,530 |
| 日本金銭機械 | 12.8 | 19,776 |
| マースエンジニアリング | 7.8 | 17,082 |
| 福島工業 | 8.5 | 30,515 |
| オーイズミ | 5.8 | 4,100 |
| ダイコク電機 | 5.7 | 9,769 |
| 竹内製作所 | 25.3 | 62,668 |
| アマノ | 42.9 | 94,079 |
| JUKI | 21.9 | 26,915 |
| サンデンホールディングス | 85 | 31,025 |
| 蛇の目マシン工業 | 13.4 | 11,443 |
| マックス | 21 | 30,849 |
| グローリー | 44.3 | 159,037 |
| 新晃工業 | 9.7 | 13,793 |
| 大和冷機工業 | 22.3 | 22,188 |
| セガサミーホールディングス | 137.5 | 249,150 |
| 日本ビストンリング | 5.4 | 11,345 |
| リケン | 6.4 | 26,944 |
| T P R | 15.5 | 52,080 |
| ツバキ・ナカシマ | 15.5 | 27,946 |
| ホシザキ | 30.4 | 292,752 |
| 大豊工業 | 11.2 | 18,659 |
| 日本精工 | 284.6 | 401,001 |
| NTN | 321 | 159,537 |
| ジェイテクト | 147.7 | 283,288 |
| 不二越 | 139 | 77,284 |
| 日本トムソン | 44.3 | 23,168 |
| THK | 97.9 | 277,938 |
| ユーション精機 | 6.1 | 18,031 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 前澤給装工業 | 5.2 | 7,945 |
| イーグル工業 | 15 | 23,580 |
| 前澤工業 | 10.1 | 3,747 |
| 日本ビラー工業 | 14 | 18,858 |
| キッツ | 66.5 | 44,422 |
| 日立工機 | 37.1 | 32,165 |
| マキタ | 90.4 | 717,776 |
| 日立造船 | 109.9 | 67,808 |
| 三菱重工業 | 2,322 | 1,231,821 |
| I H I | 1,065 | 333,345 |
| スター精密 | 24.3 | 42,014 |
| 電気機器 (12.7%) | | |
| 日清紡ホールディングス | 76.9 | 84,743 |
| イビデン | 97 | 161,602 |
| コニカミノルタ | 324.4 | 390,902 |
| ブラザー工業 | 179.1 | 382,736 |
| ミネベア | 223.4 | 256,463 |
| 日立製作所 | 3,327 | 2,245,059 |
| 東芝 | 3,100 | 801,350 |
| 三菱電機 | 1,478.1 | 2,597,760 |
| 富士電機 | 418 | 279,642 |
| 東洋電機製造 | 5.4 | 8,883 |
| 安川電機 | 160.6 | 331,960 |
| シンフォニアテクノロジー | 90 | 26,550 |
| 明電舎 | 127 | 50,292 |
| オリジン電気 | 20 | 6,320 |
| 山洋電気 | 36 | 32,508 |
| デンヨー | 12.8 | 21,286 |
| 東芝テック | 87 | 55,506 |
| 芝浦メカトロニクス | 22 | 6,512 |
| マブチモーター | 39.1 | 237,337 |
| 日本電産 | 179.6 | 1,910,944 |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 1.6 | 5,056 |
| 東光高岳 | 7 | 15,036 |
| ダブル・スコープ | 13.3 | 22,583 |
| 宮越ホールディングス | 4.7 | 2,354 |
| ダイヘン | 76 | 57,456 |
| 田淵電機 | 20.9 | 8,380 |
| ヤーマン | 1.8 | 10,044 |
| J V Cケンウッド | 101.7 | 32,035 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| ミマキエンジニアリング | 12.4 | 9,052 |
| 第一精工 | 6.5 | 8,970 |
| 日新電機 | 27.8 | 38,725 |
| 大崎電気工業 | 28 | 33,208 |
| オムロン | 147.3 | 718,087 |
| 日東工業 | 20.4 | 31,926 |
| I D E C | 18.1 | 20,615 |
| 不二電機工業 | 1.5 | 2,127 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 267 | 126,291 |
| サクサホールディングス | 35 | 8,435 |
| メルコホールディングス | 7.7 | 24,717 |
| テクノメディカ | 3.1 | 6,324 |
| 日本電気 | 1,905 | 603,885 |
| 富士通 | 1,336 | 932,260 |
| 沖電気工業 | 60 | 98,520 |
| 岩崎通信機 | 61 | 5,368 |
| 電気興業 | 39 | 22,893 |
| サンケン電気 | 81 | 45,036 |
| ナカヨ | 14 | 5,656 |
| アイホン | 7.8 | 15,100 |
| ルネサスエレクトロニクス | 71.7 | 73,635 |
| セイコーエプソン | 206.3 | 494,707 |
| ワコム | 107.5 | 37,410 |
| アルバック | 25.5 | 104,932 |
| アクセル | 5.8 | 5,684 |
| E I Z O | 13.7 | 47,128 |
| ジャパンディスプレイ | 258.8 | 85,662 |
| 日本信号 | 38.2 | 41,217 |
| 京三製作所 | 32 | 12,960 |
| 能美防災 | 15.7 | 27,475 |
| ホーチキ | 10 | 14,340 |
| エレコム | 12 | 23,376 |
| 日本無線 | 8.5 | 11,262 |
| パナソニック | 1,583.2 | 1,910,922 |
| アンリツ | 101 | 70,397 |
| 富士通ゼネラル | 47 | 108,335 |
| 日立国際電気 | 36.2 | 94,988 |
| ソニー | 978.4 | 3,443,968 |
| T D K | 78.1 | 640,420 |
| 帝国通信工業 | 31 | 5,549 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|-----------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| ミツミ電機 | 48.8 | 31,036 |
| タムラ製作所 | 53 | 23,426 |
| アルプス電気 | 127.9 | 385,618 |
| 池上通信機 | 44 | 7,172 |
| バイオニア | 208.2 | 52,882 |
| 日本電波工業 | 13.4 | 12,261 |
| 鈴木 | 5.3 | 2,745 |
| 日本トリム | 3.4 | 14,348 |
| ローランド ディー. ジー. | 7.1 | 24,069 |
| フォスター電機 | 16.2 | 31,168 |
| クラリオン | 73 | 32,339 |
| SMK | 35 | 15,085 |
| ヨコオ | 9.9 | 11,325 |
| ティアック | 100 | 4,800 |
| ホシデン | 42 | 38,304 |
| ヒロセ電機 | 22.4 | 336,896 |
| 日本航空電子工業 | 44 | 64,988 |
| TOA | 16.3 | 16,935 |
| 日立マクセル | 20.7 | 44,153 |
| 古野電気 | 17.8 | 13,652 |
| ユニデンホールディングス | 41 | 6,806 |
| アルパイン | 33 | 50,787 |
| スミダコーポレーション | 11.3 | 12,938 |
| アイコム | 7.7 | 17,070 |
| リオン | 5.3 | 8,469 |
| 本多通信工業 | 4.4 | 5,596 |
| 船井電機 | 15.5 | 14,058 |
| 横河電機 | 150.2 | 282,826 |
| 新電元工業 | 53 | 22,684 |
| アズビル | 42 | 143,640 |
| 東亜ディーケーケー | 6.8 | 3,746 |
| 日本光電工業 | 57.9 | 151,234 |
| チノー | 4.9 | 5,556 |
| 共和電業 | 15.7 | 6,531 |
| 日本電子材料 | 5.5 | 3,393 |
| 堀場製作所 | 27.4 | 163,304 |
| アドバンテスト | 94.5 | 205,065 |
| 小野測器 | 6.7 | 5,855 |
| エスベック | 12.3 | 15,928 |
| パナソニック デバイスSUNX | 12.1 | 9,909 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|------------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| キーエンス | 62.8 | 2,750,640 |
| 日置電機 | 7.2 | 15,573 |
| シスメックス | 107.7 | 706,512 |
| 日本マイクロニクス | 25.8 | 28,767 |
| メガチップス | 12.9 | 34,236 |
| OBARA GROUP | 8.1 | 44,469 |
| 澤藤電機 | 8 | 1,760 |
| コーセル | 19.2 | 25,228 |
| イリソ電子工業 | 4.4 | 29,392 |
| 新日本無線 | 11.8 | 4,885 |
| オブテックスグループ | 10.5 | 27,541 |
| 千代田インテグレ | 7.3 | 17,928 |
| アイ・オー・データ機器 | 4.3 | 5,534 |
| レーザーテック | 16.2 | 38,377 |
| スタンレー電気 | 98.8 | 301,834 |
| 岩崎電気 | 50 | 9,450 |
| ウシオ電機 | 84.1 | 120,935 |
| 岡谷電機産業 | 7.4 | 3,085 |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 12.8 | 6,976 |
| 日本セラミック | 11.3 | 23,956 |
| 遠藤照明 | 7 | 6,363 |
| 古河電池 | 10 | 7,610 |
| 双信電機 | 6.7 | 1,963 |
| 山一電機 | 13 | 17,329 |
| 図研 | 9 | 11,835 |
| 日本電子 | 50 | 28,950 |
| カシオ計算機 | 111.4 | 176,346 |
| ファナック | 140.5 | 3,182,325 |
| 日本シイエムケイ | 29.8 | 20,651 |
| エンプラス | 6.3 | 21,703 |
| 大真空 | 5.1 | 7,481 |
| ローム | 67 | 492,450 |
| 浜松ホトニクス | 108.1 | 352,406 |
| 三井ハイテック | 18.3 | 15,902 |
| 新光電気工業 | 52.3 | 45,657 |
| 京セラ | 227.5 | 1,351,577 |
| 太陽誘電 | 67.4 | 94,899 |
| 村田製作所 | 145.4 | 2,250,065 |
| ユーシン | 18.4 | 15,842 |
| 双葉電子工業 | 22.7 | 44,832 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|------------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 北陸電気工業 | 56 | 7,728 |
| ニチコン | 43.6 | 47,524 |
| 日本ケミコン | 119 | 31,416 |
| K O A | 19.2 | 25,017 |
| 市光工業 | 29 | 12,209 |
| 小糸製作所 | 83 | 511,280 |
| ミツバ | 25.5 | 51,357 |
| S C R E E Nホールディングス | 28.4 | 206,184 |
| キャノン電子 | 12.7 | 22,352 |
| キャノン | 746 | 2,524,464 |
| リコー | 416.7 | 430,451 |
| M U T O Hホールディングス | 19 | 4,902 |
| 東京エレクトロン | 92.4 | 1,107,414 |
| 輸送用機器 (9.6%) | | |
| トヨタ紡織 | 48.4 | 125,259 |
| 芦森工業 | 31 | 5,022 |
| ユニプレス | 26.7 | 65,628 |
| 豊田自動織機 | 126.2 | 702,934 |
| モリタホールディングス | 24.2 | 39,470 |
| 三櫻工業 | 17.6 | 14,344 |
| デンソー | 341.7 | 1,706,108 |
| 東海理化電機製作所 | 36.5 | 82,417 |
| 三井造船 | 501 | 94,188 |
| 川崎重工業 | 1,078 | 398,860 |
| 名村造船所 | 41.6 | 31,657 |
| サノヤスホールディングス | 16.8 | 4,653 |
| 日本車輛製造 | 51 | 13,719 |
| ニチユ三菱フォークリフト | 16 | 13,184 |
| 近畿車輛 | 2.1 | 5,611 |
| 日産自動車 | 1,658.4 | 1,900,526 |
| いすゞ自動車 | 401.5 | 628,347 |
| トヨタ自動車 | 1,684.7 | 11,395,310 |
| 日野自動車 | 197.8 | 234,393 |
| 三菱自動車工業 | 507.8 | 322,453 |
| エプテック | 7.3 | 9,541 |
| レシップホールディングス | 4.5 | 4,005 |
| G M B | 2.2 | 2,571 |
| ファルテック | 2.4 | 3,264 |
| 武蔵精密工業 | 16.1 | 50,393 |
| 日産車体 | 60.9 | 66,563 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|--------------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 新明和工業 | 56 | 60,816 |
| 極東開発工業 | 27.6 | 43,939 |
| 日信工業 | 31 | 58,156 |
| トビー工業 | 11.4 | 36,594 |
| ティラド | 54 | 15,822 |
| 曙ブレーキ工業 | 64.4 | 20,350 |
| タチエス | 23.5 | 44,720 |
| N O K | 67 | 158,388 |
| フタバ産業 | 42.2 | 29,413 |
| K Y B | 155 | 88,195 |
| 大同メタル工業 | 17.4 | 18,913 |
| プレス工業 | 73.6 | 37,462 |
| ミクニ | 17.6 | 6,987 |
| カルソニックカンセイ | 94 | 168,918 |
| 太平洋工業 | 28.4 | 40,526 |
| ケーヒン | 31.8 | 65,317 |
| 河西工業 | 18.7 | 25,170 |
| アイシン精機 | 126.8 | 672,040 |
| 富士機工 | 13.7 | 6,274 |
| マツダ | 438.8 | 758,685 |
| 今仙電機製作所 | 12.7 | 12,687 |
| 本田技研工業 | 1,247 | 4,366,994 |
| スズキ | 274.6 | 1,220,597 |
| 富士重工業 | 430.2 | 2,046,461 |
| 安永 | 5 | 8,580 |
| ヤマハ発動機 | 195.7 | 473,594 |
| ショーワ | 36 | 28,692 |
| T B K | 17.7 | 8,832 |
| エクセディ | 18.8 | 60,254 |
| 豊田合成 | 44.7 | 124,355 |
| 愛三工業 | 24.3 | 23,133 |
| 盟和産業 | 2.1 | 2,490 |
| ヨロズ | 12.9 | 20,149 |
| エフ・シー・シー | 22.7 | 46,217 |
| シマノ | 55.9 | 1,006,759 |
| タカタ | 25 | 15,475 |
| テイ・エス テック | 32.2 | 94,732 |
| ジャムコ | 8.1 | 21,432 |
| 精密機器 (1.5%) | | |
| テルモ | 212.4 | 893,142 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|---------------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| クリエートメディック | 4.6 | 4,420 |
| 日機装 | 47.9 | 51,779 |
| 島津製作所 | 178.3 | 343,584 |
| JMS | 26 | 8,086 |
| クボテック | 3 | 1,812 |
| 長野計器 | 10.9 | 7,673 |
| ブイ・テクノロジー | 2.8 | 48,076 |
| 東京計器 | 48 | 12,096 |
| 愛知時計電機 | 1.8 | 6,984 |
| オーバル | 13.5 | 3,901 |
| 東京精密 | 26.7 | 101,460 |
| マニー | 18.4 | 51,980 |
| ニコン | 241.5 | 451,122 |
| トプコン | 69.8 | 121,382 |
| オリンパス | 221.2 | 878,164 |
| 理研計器 | 12.2 | 20,813 |
| タムロン | 12.3 | 25,079 |
| HOYA | 285.1 | 1,373,896 |
| ノーリツ鋼機 | 14 | 12,404 |
| ユー・アンド・デイ | 12.6 | 6,161 |
| シチズン時計 | 151.6 | 106,574 |
| リズム時計工業 | 55 | 10,065 |
| 大研医器 | 12.3 | 9,901 |
| メニコン | 9.5 | 32,062 |
| 松風 | 7.3 | 10,059 |
| セイコーホールディングス | 98 | 40,964 |
| ニプロ | 95.9 | 122,368 |
| その他製品 (1.7%) | | |
| スノーピーク | 2.1 | 6,285 |
| パラマウントベッドホールディングス | 13.3 | 59,185 |
| トランザクション | 3 | 6,168 |
| SHO-BI | 4.6 | 1,955 |
| ニホンフラッシュ | 6.5 | 8,515 |
| 前田工織 | 13.9 | 18,070 |
| 永大産業 | 18 | 9,108 |
| アートネイチャー | 14.8 | 10,493 |
| ダンロップスポーツ | 8.7 | 9,178 |
| バンダイナムコホールディングス | 152.8 | 487,432 |
| アイフィスジャパン | 3.1 | 1,329 |
| 共立印刷 | 23 | 7,590 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|-----------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| SHOEI | 6.2 | 13,565 |
| フランスベッドホールディングス | 17.4 | 16,216 |
| パイロットコーポレーション | 24.2 | 113,498 |
| 萩原工業 | 3.8 | 10,153 |
| トッパン・フォームズ | 24.7 | 29,096 |
| フジシールインターナショナル | 31.1 | 75,355 |
| タカラトミー | 53.9 | 66,836 |
| 廣済堂 | 13.9 | 5,712 |
| Asmeエステール | 3.7 | 2,556 |
| アーク | 58.3 | 7,287 |
| タカノ | 6.1 | 5,380 |
| プロネクス | 13 | 14,105 |
| ホクシン | 9.8 | 2,234 |
| ウッドワン | 23 | 6,417 |
| 大建工業 | 9.7 | 21,126 |
| 凸版印刷 | 391 | 439,484 |
| 大日本印刷 | 400 | 465,200 |
| 図書印刷 | 19 | 8,892 |
| 共同印刷 | 43 | 17,286 |
| 日本写真印刷 | 23.2 | 74,472 |
| 光村印刷 | 12 | 3,096 |
| 宝印刷 | 6.7 | 10,184 |
| アシックス | 137.7 | 307,484 |
| ツツミ | 5.2 | 10,145 |
| 小松ウオール工業 | 4.7 | 9,193 |
| ヤマハ | 93.4 | 332,504 |
| 河合楽器製作所 | 5.4 | 12,268 |
| クリナップ | 16.2 | 14,596 |
| ビジョン | 83.7 | 257,377 |
| 兼松サステック | 14 | 2,800 |
| キングジム | 11.5 | 9,821 |
| リンテック | 32.9 | 84,585 |
| TASAKI | 3.8 | 5,935 |
| イトーキ | 29.2 | 21,170 |
| 任天堂 | 85.3 | 2,010,521 |
| 三菱鉛筆 | 11.4 | 69,312 |
| タカラスタンダード | 28.6 | 55,369 |
| コクヨ | 72 | 98,064 |
| ナカバヤシ | 25 | 6,800 |
| グローブライド | 6.7 | 12,321 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 岡村製作所 | 48.4 | 49,706 |
| 美津濃 | 74 | 43,882 |
| 電気・ガス業 (1.8%) | | |
| 東京電力ホールディングス | 1,175.4 | 524,228 |
| 中部電力 | 456.6 | 708,643 |
| 関西電力 | 565.5 | 705,178 |
| 中国電力 | 191.6 | 251,570 |
| 北陸電力 | 135.7 | 172,474 |
| 東北電力 | 346.2 | 486,064 |
| 四国電力 | 124.8 | 139,276 |
| 九州電力 | 306 | 395,352 |
| 北海道電力 | 129.7 | 111,542 |
| 沖縄電力 | 20.4 | 54,549 |
| 電源開発 | 110.3 | 297,810 |
| エフオン | 5.7 | 5,802 |
| イーレックス | 5.8 | 19,633 |
| 東京瓦斯 | 1,486 | 781,933 |
| 大阪瓦斯 | 1,345 | 585,478 |
| 東邦瓦斯 | 349 | 313,751 |
| 北海道瓦斯 | 34 | 9,384 |
| 広島ガス | 28.5 | 10,545 |
| 西部瓦斯 | 156 | 40,560 |
| 静岡ガス | 42.6 | 32,248 |
| メタウォーター | 7.8 | 20,982 |
| 陸運業 (4.3%) | | |
| SBSホールディングス | 13.7 | 11,083 |
| 東武鉄道 | 740 | 428,460 |
| 相鉄ホールディングス | 222 | 127,428 |
| 東京急行電鉄 | 753 | 641,556 |
| 京浜急行電鉄 | 380 | 513,760 |
| 小田急電鉄 | 222 | 506,604 |
| 京王電鉄 | 387 | 366,102 |
| 京成電鉄 | 103.9 | 283,647 |
| 富士急行 | 38 | 41,914 |
| 新京成電鉄 | 18 | 7,560 |
| 東日本旅客鉄道 | 268.1 | 2,796,283 |
| 西日本旅客鉄道 | 133.4 | 969,017 |
| 東海旅客鉄道 | 115.2 | 2,174,400 |
| 西武ホールディングス | 191.4 | 366,339 |
| 鴻池運輸 | 19.6 | 29,439 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|-------------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 西日本鉄道 | 166 | 85,822 |
| ハマキョウレックス | 9 | 19,017 |
| サカイ引越センター | 4.8 | 14,736 |
| 近鉄グループホールディングス | 1,395 | 613,800 |
| 阪急阪神ホールディングス | 175 | 681,625 |
| 南海電気鉄道 | 293 | 167,303 |
| 京阪ホールディングス | 310 | 233,430 |
| 神戸電鉄 | 34 | 13,192 |
| 名古屋鉄道 | 505 | 284,315 |
| 山陽電気鉄道 | 50 | 30,850 |
| 日本通運 | 536 | 336,072 |
| ヤマトホールディングス | 247.8 | 590,879 |
| 山九 | 182 | 127,582 |
| 丸運 | 7.5 | 1,905 |
| 丸全昭和運輸 | 46 | 21,114 |
| センコー | 62.3 | 47,908 |
| トナミホールディングス | 28 | 10,276 |
| ニッコンホールディングス | 47 | 110,826 |
| 日本石油輸送 | 1.6 | 3,968 |
| 福山通運 | 84 | 53,256 |
| セイノーホールディングス | 98.3 | 127,986 |
| 神奈川中央交通 | 16 | 11,712 |
| 日立物流 | 28.9 | 69,244 |
| 丸和運輸機関 | 3.5 | 9,772 |
| C&Fロジホールディングス | 14.4 | 18,979 |
| 九州旅客鉄道 | 103.3 | 315,065 |
| 海運業 (0.3%) | | |
| 日本郵船 | 1,171 | 285,724 |
| 商船三井 | 727 | 273,352 |
| 川崎汽船 | 525 | 149,100 |
| NSユナイテッド海運 | 62 | 13,392 |
| 明治海運 | 12.4 | 5,369 |
| 飯野海運 | 71.7 | 34,129 |
| 共栄タンカー | 12 | 2,724 |
| 乾汽船 | 10.1 | 9,736 |
| 空運業 (0.6%) | | |
| 日本航空 | 249.7 | 912,403 |
| ANAホールディングス | 2,572 | 846,445 |
| バスコ | 13 | 5,330 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|------------------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 倉庫・運輸関連業 (0.2%) | | |
| トランコム | 4 | 22,520 |
| 日新 | 57 | 21,261 |
| 三菱倉庫 | 91 | 149,240 |
| 三井倉庫ホールディングス | 80 | 27,200 |
| 住友倉庫 | 101 | 61,408 |
| 滋澤倉庫 | 36 | 12,636 |
| 東陽倉庫 | 23.7 | 6,967 |
| 日本トランスシティ | 32 | 13,984 |
| ケイヒン | 25 | 3,850 |
| 中央倉庫 | 8 | 8,632 |
| 安田倉庫 | 10.8 | 8,164 |
| 東洋埠頭 | 40 | 7,480 |
| 宇徳 | 11.2 | 4,603 |
| 上組 | 165 | 182,820 |
| サンリツ | 3.4 | 1,795 |
| キムラユニティー | 3.5 | 4,263 |
| キューソー流通システム | 4.4 | 10,916 |
| 郵船ロジスティクス | 12.7 | 15,011 |
| 近鉄エクスプレス | 24.8 | 38,861 |
| 東海運 | 7.5 | 3,435 |
| エアアイティ | 8.5 | 9,052 |
| 内外トランスライン | 4.1 | 4,411 |
| 情報・通信業 (7.9%) | | |
| NECネットエスアイ | 15 | 32,760 |
| システナ | 10.9 | 19,881 |
| デジタルアーツ | 6.1 | 17,378 |
| 新日鉄住金ソリューションズ | 22.8 | 47,925 |
| キューブシステム | 5.9 | 4,130 |
| コア | 5.7 | 6,959 |
| ソフトクリエイトホールディングス | 6.5 | 9,002 |
| T I S | 45.3 | 113,431 |
| ネオス | 4 | 1,776 |
| 電算システム | 4.8 | 8,097 |
| グリー | 83.1 | 51,189 |
| コーエーテクモホールディングス | 32.4 | 64,605 |
| 三菱総合研究所 | 5.3 | 17,251 |
| ボルテージ | 2.7 | 3,161 |
| 電算 | 1.5 | 3,594 |
| AGS | 3.4 | 5,674 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|----------------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| ファインデックス | 10.1 | 9,372 |
| ヒト・コミュニケーションズ | 3.1 | 4,863 |
| ブレインパッド | 2 | 3,332 |
| K L a b | 26.1 | 16,782 |
| ポールトゥウィン・ビットクルーホールディ | 9.8 | 10,378 |
| イーブックイニシアティブジャパン | 2.1 | 1,908 |
| ネクソン | 149.7 | 262,274 |
| アイスタイル | 20.8 | 16,036 |
| エムアップ | 3.8 | 2,496 |
| エイチーム | 7.5 | 16,312 |
| テクノスジャパン | 10.5 | 13,965 |
| e n i s h | 4 | 2,280 |
| コロブラ | 38 | 37,468 |
| モバイルクリエイト | 9 | 3,969 |
| オルトプラス | 5.6 | 3,427 |
| ブロードリーフ | 33.7 | 23,151 |
| ハーツユナイテッドグループ | 7.2 | 12,420 |
| メディアドゥ | 2.9 | 4,286 |
| ブイキューブ | 7.5 | 5,040 |
| サイバーリンクス | 2.1 | 2,207 |
| ディー・エル・イー | 4.2 | 2,986 |
| フィックスターズ | 1.9 | 7,467 |
| VOYAGE GROUP | 4.6 | 6,642 |
| オブティム | 1.4 | 8,176 |
| ベリサーブ | 1.6 | 4,708 |
| ティーガリア | 13.6 | 25,092 |
| 日本アジアグループ | 15.5 | 6,804 |
| 豆蔵ホールディングス | 10 | 10,370 |
| テクマトリックス | 4.3 | 9,060 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 286.8 | 72,847 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 11.2 | 60,368 |
| ザッパラス | 7.6 | 3,389 |
| インターネットイニシアティブ | 20.1 | 36,823 |
| さくらインターネット | 10.5 | 12,159 |
| GMOクラウド | 3 | 4,962 |
| S R Aホールディングス | 7.2 | 18,403 |
| M i n o r iソリューションズ | 3 | 3,336 |
| システムインテグレーション | 1.9 | 1,257 |
| 朝日ネット | 12.4 | 6,299 |
| アドソル日進 | 2.7 | 3,763 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|-----------------------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| フリービット | 7.6 | 7,524 |
| コムチュア | 2.3 | 8,015 |
| サイバーコム | 1.8 | 1,783 |
| メディカル・データ・ビジョン | 2.3 | 6,308 |
| g u m i | 14.1 | 15,566 |
| P C I ホールディングス | 1.6 | 4,257 |
| バイブドHD | 2.4 | 2,712 |
| アイビーシー | 1.1 | 1,133 |
| L I N E | 22.8 | 85,614 |
| A O I T Y O H o l d i n g s | 11.1 | 9,423 |
| ソルクシーズ | 3.9 | 2,145 |
| フェイス | 3.6 | 4,622 |
| ハイマックス | 1.8 | 2,678 |
| 野村総合研究所 | 102.2 | 370,475 |
| サイバネットシステム | 11.2 | 7,560 |
| C E ホールディングス | 2.1 | 2,322 |
| インテージホールディングス | 7.8 | 16,754 |
| 東邦システムサイエンス | 4.5 | 3,028 |
| ソースネクスト | 8.2 | 5,731 |
| フォーカスシステムズ | 5.3 | 3,052 |
| クレスコ | 3.1 | 7,895 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 142.4 | 234,532 |
| オービック | 47.1 | 246,333 |
| ジャストシステム | 22.1 | 27,337 |
| T D C ソフトウェアエンジニアリング | 5.9 | 7,510 |
| ヤフー | 980.2 | 455,793 |
| トレンドマイクロ | 72.4 | 317,836 |
| インフォメーション・ディベロプメント | 3.9 | 4,750 |
| 日本オラクル | 22 | 135,080 |
| アルファシステムズ | 4.5 | 8,977 |
| フューチャー | 18.5 | 14,356 |
| C A C H o l d i n g s | 10.2 | 9,567 |
| ソフトバンク・テクノロジー | 3.3 | 13,777 |
| トーセ | 3.7 | 3,041 |
| オービックビジネスコンサルタント | 6.9 | 37,329 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 31 | 93,930 |
| アイティフォー | 17.7 | 10,903 |
| 東計電算 | 2.4 | 5,239 |
| エックスネット | 1.2 | 2,230 |
| 大塚商会 | 36.8 | 207,184 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| サイボウズ | 18.2 | 8,244 |
| ソフトブレーン | 18.6 | 8,016 |
| 電通国際情報サービス | 8.4 | 16,220 |
| デジタルガレージ | 21.4 | 44,833 |
| EMシステムズ | 4.6 | 7,557 |
| ウェザーニューズ | 4.6 | 16,146 |
| C I J | 12.4 | 6,472 |
| 東洋ビジネスエンジニアリング | 1.4 | 2,160 |
| 日本エンタープライズ | 14 | 3,864 |
| WOWOW | 6.5 | 22,555 |
| スカラ | 8.5 | 6,808 |
| 日本コロムビア | 4.1 | 2,648 |
| イマジカ・ロボット ホールディングス | 11.5 | 8,452 |
| ネットワンシステムズ | 59.2 | 44,992 |
| システムソフト | 24.1 | 3,904 |
| アルゴグラフィックス | 6.3 | 14,483 |
| マーベラス | 23.1 | 18,249 |
| エイベックス・グループ・ホールディングス | 25.2 | 43,268 |
| 日本ユニシス | 37.7 | 54,702 |
| 兼松エレクトロニクス | 8.6 | 22,308 |
| 東京放送ホールディングス | 90.1 | 174,794 |
| 日本テレビホールディングス | 124.9 | 260,916 |
| 朝日放送 | 13.5 | 10,192 |
| テレビ朝日ホールディングス | 37.4 | 84,935 |
| スカパー J S A T ホールディングス | 89 | 45,568 |
| テレビ東京ホールディングス | 11.1 | 25,863 |
| 日本BS放送 | 3.1 | 3,267 |
| U-NEXT | 3.5 | 2,320 |
| ワイヤレスゲート | 4.7 | 8,276 |
| コネクシオ | 12 | 17,880 |
| 日本通信 | 114.4 | 19,104 |
| クロップス | 2.9 | 1,676 |
| 日本電信電話 | 1,097.9 | 5,463,150 |
| K D D I | 1,353 | 4,061,706 |
| 光通信 | 16.4 | 170,396 |
| N T T ドコモ | 1,021.9 | 2,800,006 |
| エムティーアイ | 20.9 | 14,692 |
| GMOインターネット | 49.9 | 81,885 |
| カドカワ | 39.7 | 68,879 |
| 学研ホールディングス | 46 | 14,490 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|----------------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| ゼンリン | 18.1 | 41,014 |
| 昭文社 | 7.4 | 5,165 |
| インプレスホールディングス | 11.3 | 1,661 |
| アイネット | 7.7 | 9,216 |
| 松竹 | 90 | 122,220 |
| 東宝 | 89.4 | 290,550 |
| 東映 | 51 | 50,949 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 84.5 | 482,495 |
| ビー・シー・エー | 2 | 2,920 |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 2.3 | 2,456 |
| D T S | 14.1 | 35,870 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 52.6 | 172,791 |
| シーイーシー | 8.1 | 15,130 |
| カプコン | 32.1 | 83,010 |
| アイ・エス・ピー | 2.6 | 2,420 |
| ジャステック | 8.7 | 9,509 |
| S C S K | 37.2 | 156,054 |
| 日本システムウエア | 4.5 | 7,150 |
| アイネス | 17.2 | 20,984 |
| T K C | 12.7 | 42,989 |
| 富士ソフト | 20.3 | 57,205 |
| N S D | 29 | 52,954 |
| コナミホールディングス | 61.7 | 297,085 |
| 福井コンピュータホールディングス | 4 | 12,160 |
| J B C Cホールディングス | 11.4 | 9,405 |
| ミロク情報サービス | 10.1 | 17,149 |
| ソフトバンクグループ | 615.6 | 5,513,313 |
| 卸売業 (4.5%) | | |
| ハウスイ | 11 | 1,430 |
| 高千穂交易 | 5.3 | 5,416 |
| 伊藤忠食品 | 3.4 | 14,739 |
| エレマテック | 5.5 | 10,868 |
| J A L U X | 4.4 | 9,042 |
| あらた | 6.1 | 16,415 |
| トーマンデバイス | 2 | 4,206 |
| 東京エレクトロン デバイス | 4.9 | 7,825 |
| フィールズ | 10.5 | 13,135 |
| 双日 | 807.7 | 241,502 |
| アルフレッサ ホールディングス | 161.8 | 308,876 |
| 横浜冷凍 | 33.9 | 35,222 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|---------------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 神栄 | 19 | 3,420 |
| 山下医科器械 | 1.1 | 1,985 |
| ラサ商事 | 5.9 | 3,728 |
| ラクーン | 5.9 | 2,920 |
| アルコニックス | 7.8 | 14,071 |
| 神戸物産 | 7.4 | 27,454 |
| あい ホールディングス | 24.3 | 53,119 |
| ディーブイエックス | 4.9 | 6,345 |
| ダイワボウホールディングス | 116 | 33,176 |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 25.3 | 41,061 |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 25.7 | 25,982 |
| 八洲電機 | 10.5 | 6,741 |
| U K Cホールディングス | 8.8 | 20,644 |
| O C H Iホールディングス | 4 | 5,272 |
| T O K A Iホールディングス | 60.1 | 48,440 |
| 大阪工機 | 1.6 | 1,169 |
| 三洋貿易 | 7.5 | 12,150 |
| ビューティガレージ | 1.2 | 1,350 |
| ウイン・パートナーズ | 9.8 | 9,731 |
| ミタチ産業 | 3.5 | 2,180 |
| シップヘルスケアホールディングス | 26.2 | 77,290 |
| 明治電機工業 | 4.7 | 5,781 |
| デリカフーズ | 2.9 | 3,050 |
| スターティア | 3.1 | 1,667 |
| コマダホールディングス | 18.5 | 34,502 |
| 富士興産 | 4.9 | 2,249 |
| 協栄産業 | 16 | 2,800 |
| 小野建 | 11.9 | 16,148 |
| 佐島電機 | 10.8 | 8,013 |
| エコートレーディング | 3.1 | 2,173 |
| 伯東 | 9.3 | 9,551 |
| コンドテック | 10.8 | 9,244 |
| 中山福 | 7.8 | 6,411 |
| ナガイレーベン | 19.7 | 50,471 |
| 三菱食品 | 15 | 49,875 |
| 松田産業 | 10 | 15,500 |
| 第一興商 | 22.2 | 100,788 |
| メディopalホールディングス | 136.8 | 252,806 |
| S P K | 2.9 | 7,232 |
| 萩原電気 | 4.7 | 10,325 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|--------------|---------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| アズワン | 10.7 | 54,998 |
| スズデン | 4.9 | 5,071 |
| 尾家産業 | 4.4 | 5,011 |
| シモジマ | 8.3 | 9,702 |
| ドウシシャ | 16.1 | 34,953 |
| 小津産業 | 3 | 6,513 |
| 高速 | 8.1 | 8,893 |
| たけびし | 4.8 | 6,177 |
| 黒田電気 | 18.7 | 44,244 |
| リックス | 3.1 | 4,941 |
| 丸文 | 12.1 | 8,385 |
| ハビネット | 11.4 | 14,614 |
| 橋本総業ホールディングス | 2.8 | 4,272 |
| 日本ライフライン | 11.7 | 24,183 |
| エクセル | 5.9 | 9,115 |
| マルカキカイ | 4.4 | 7,488 |
| I D O M | 36.8 | 26,569 |
| 日本エム・ディ・エム | 10.3 | 9,167 |
| 進和 | 8.1 | 14,596 |
| エスケイジャパン | 2.6 | 793 |
| ダイトロン | 6.2 | 6,007 |
| シークス | 9.8 | 40,915 |
| 田中商事 | 4.2 | 2,986 |
| オーハシテニカ | 7.7 | 11,149 |
| 白銅 | 3.4 | 5,103 |
| 伊藤忠商事 | 1,001.7 | 1,587,193 |
| 丸紅 | 1,346 | 940,854 |
| 高島 | 24 | 4,800 |
| 長瀬産業 | 82.2 | 129,876 |
| 蝶理 | 8.7 | 16,173 |
| 豊田通商 | 152.3 | 482,029 |
| 三共生興 | 20.7 | 8,652 |
| 兼松 | 291 | 57,909 |
| ツカモトコーポレーション | 25 | 3,150 |
| 三井物産 | 1,236.7 | 2,101,771 |
| 日本紙パルプ商事 | 71 | 25,844 |
| 日立ハイテクノロジーズ | 47.4 | 225,624 |
| カメイ | 17.8 | 22,143 |
| 東都水産 | 2.1 | 4,046 |
| OUGホールディングス | 22 | 5,742 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| スターゼン | 5.7 | 26,932 |
| 山善 | 52.5 | 51,187 |
| 椿本興業 | 15 | 5,715 |
| 住友商事 | 860.9 | 1,257,774 |
| 内田洋行 | 6.8 | 16,653 |
| 三菱商事 | 1,026.2 | 2,687,617 |
| 第一実業 | 31 | 20,956 |
| キャノンマーケティングジャパン | 39 | 76,284 |
| 西華産業 | 44 | 15,312 |
| 佐藤商事 | 12.2 | 10,565 |
| 菱洋エレクトロ | 13.1 | 19,204 |
| 東京産業 | 13.6 | 6,528 |
| ユアサ商事 | 13 | 39,195 |
| 神鋼商事 | 3.4 | 8,401 |
| 小林産業 | 9.9 | 2,583 |
| 阪和興業 | 137 | 107,819 |
| カナデン | 13 | 13,104 |
| 菱電商事 | 22 | 16,434 |
| フルサト工業 | 7.5 | 12,885 |
| 岩谷産業 | 151 | 96,036 |
| すてきなイスグループ | 58 | 8,816 |
| 昭光通商 | 48 | 4,992 |
| ニチモウ | 20 | 3,580 |
| 極東貿易 | 21 | 5,124 |
| イワキ | 21 | 5,901 |
| 三愛石油 | 36.7 | 32,259 |
| 稲畑産業 | 32.8 | 43,328 |
| G S I クレオス | 33 | 4,455 |
| 明和産業 | 12.6 | 5,014 |
| ワキタ | 29.1 | 30,380 |
| 東邦ホールディングス | 43.8 | 106,696 |
| サンゲツ | 46.9 | 95,160 |
| ミツウロコグループホールディングス | 22 | 15,884 |
| シナネンホールディングス | 5.9 | 12,950 |
| 伊藤忠エネクス | 30.2 | 28,176 |
| サンリオ | 42.2 | 95,667 |
| サンワテクノス | 8.1 | 7,824 |
| リョーサン | 20.3 | 72,572 |
| 新光商事 | 15 | 18,525 |
| トーホー | 6.2 | 15,388 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|-------------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 三信電気 | 15.1 | 18,467 |
| 東陽テクニカ | 18.1 | 18,190 |
| モスフードサービス | 17.9 | 59,428 |
| 加賀電子 | 12.3 | 24,009 |
| ソーダニッカ | 14.1 | 7,233 |
| 立花エレテック | 9.2 | 12,788 |
| フォーバル | 6 | 4,416 |
| PAL TAC | 21.9 | 63,794 |
| 三谷産業 | 14.5 | 5,553 |
| 太平洋興発 | 57 | 6,042 |
| ヤマタネ | 6.8 | 11,172 |
| 丸紅建材リース | 13 | 2,925 |
| 日鉄住金物産 | 12 | 56,100 |
| トラスコ中山 | 31.2 | 81,213 |
| オートボックスセブン | 50.6 | 89,410 |
| 加藤産業 | 21.3 | 57,701 |
| イノテック | 11.8 | 7,375 |
| イエローハット | 12.9 | 33,372 |
| J Kホールディングス | 13.7 | 8,151 |
| 日伝 | 5.7 | 18,411 |
| 北沢産業 | 11.3 | 2,271 |
| 杉本商事 | 7.8 | 12,058 |
| 因幡電機産業 | 19.2 | 76,032 |
| バイテックホールディングス | 5.6 | 7,067 |
| ミスミグループ本社 | 153.7 | 313,701 |
| アルテック | 11.7 | 2,492 |
| タキヒヨー | 21 | 9,954 |
| 蔵王産業 | 2.2 | 3,280 |
| スズケン | 62.2 | 233,561 |
| ジェコス | 9.4 | 10,123 |
| ルネサスイーストン | 12.5 | 7,475 |
| 小売業 (4.6%) | | |
| ローソン | 47.5 | 384,275 |
| サンエー | 10.3 | 53,663 |
| カワチ薬品 | 10.6 | 31,789 |
| エービーシー・マート | 24.9 | 164,091 |
| ハードオフコーポレーション | 6 | 7,134 |
| アスクル | 16.6 | 59,179 |
| ゲオホールディングス | 22.9 | 29,632 |
| アダストリア | 21 | 62,874 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|--------------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| ジーフット | 8.2 | 6,633 |
| シー・ヴィ・エス・バイエリア | 1.7 | 1,203 |
| くらコーポレーション | 8.9 | 42,141 |
| キャンドウ | 7.2 | 13,132 |
| パルグループホールディングス | 7 | 19,957 |
| エディオン | 53 | 57,876 |
| サーラコーポレーション | 17 | 10,693 |
| ワッツ | 5.9 | 6,678 |
| ハローズ | 4.5 | 10,480 |
| あみやき亭 | 2.7 | 10,611 |
| ひらまつ | 18.8 | 12,370 |
| ゲンキー | 2.7 | 16,497 |
| 大黒天物産 | 3.3 | 16,698 |
| ハニーズ | 12 | 12,828 |
| ファーマライズホールディングス | 3.1 | 1,571 |
| アルペン | 12.2 | 24,912 |
| クオール | 15.4 | 22,638 |
| ジェイアイエヌ | 9.3 | 52,731 |
| ビックカメラ | 78.5 | 87,920 |
| DCMホールディングス | 83 | 84,577 |
| MonotaRO | 48.4 | 121,677 |
| 東京一番フーズ | 3.4 | 1,931 |
| ダイヤモンドダイニング | 3 | 4,317 |
| きちり | 3.6 | 2,314 |
| アークランドサービスホールディングス | 4.3 | 13,179 |
| J. フロント リテイリング | 173 | 291,332 |
| ドトール・日レスホールディングス | 24 | 50,736 |
| マツモトキヨシホールディングス | 25.9 | 145,558 |
| ブロンコビリー | 7.1 | 19,730 |
| スタートトゥデイ | 124.8 | 266,572 |
| トレジャー・ファクトリー | 3.9 | 3,233 |
| 物語コーポレーション | 3.6 | 14,508 |
| ココカラファイン | 14.2 | 61,628 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 272 | 353,056 |
| H a m e e | 2 | 1,768 |
| ウエルシアホールディングス | 13.5 | 83,295 |
| クリエイトSDホールディングス | 20.1 | 49,827 |
| 丸善CHIホールディングス | 15.9 | 5,755 |
| ミサワ | 2.4 | 1,231 |
| ティールライフ | 1.2 | 1,762 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|----------------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| エー・ピーカンパニー | 2.2 | 1,707 |
| チムニー | 4.2 | 11,915 |
| シュッピン | 5.2 | 7,321 |
| ネクステージ | 2.7 | 6,709 |
| ジョイフル本田 | 22.2 | 70,263 |
| 鳥貴族 | 3.4 | 7,993 |
| キリン堂ホールディングス | 4.4 | 3,713 |
| ホットランド | 6.3 | 6,766 |
| すかいらく | 58.7 | 89,282 |
| 綿半ホールディングス | 5.5 | 8,954 |
| ヨシックス | 1.3 | 1,727 |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 45.3 | 44,620 |
| ブックオフコーポレーション | 7.8 | 6,427 |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 5.4 | 4,930 |
| BEENOS | 1.6 | 2,308 |
| あさひ | 10.2 | 13,545 |
| 日本調剤 | 4.8 | 20,856 |
| コスモス薬品 | 6.9 | 144,417 |
| トーエル | 6.6 | 6,276 |
| 一六堂 | 2.9 | 1,148 |
| オンリー | 1.5 | 1,212 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 572.4 | 2,594,689 |
| 薬王堂 | 6.8 | 14,062 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディング | 36.7 | 35,635 |
| ツルハホールディングス | 31.5 | 340,515 |
| サンマルクホールディングス | 8.8 | 29,788 |
| フェリシモ | 3.9 | 3,962 |
| トリドールホールディングス | 16.8 | 41,899 |
| サツドラホールディングス | 1.8 | 3,580 |
| ダイユー・リックホールディングス | 4.4 | 3,489 |
| パロックジャパンリミテッド | 8 | 11,832 |
| クスリのアオキホールディングス | 12.2 | 57,340 |
| メディカルシステムネットワーク | 15.4 | 6,622 |
| 総合メディカル | 6.6 | 27,753 |
| はるやまホールディングス | 6.4 | 5,715 |
| ノジマ | 15.8 | 19,671 |
| カップ・クリエイト | 19.1 | 25,231 |
| ライトオン | 10.2 | 9,588 |
| ジーンズメイト | 4.4 | 1,170 |
| 良品計画 | 18.1 | 389,874 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|----------------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 三城ホールディングス | 16.9 | 7,723 |
| アドヴァン | 13.9 | 15,609 |
| アルビス | 3.6 | 11,394 |
| コナカ | 17.4 | 9,987 |
| ハウス オブ ローゼ | 1.7 | 2,672 |
| G-7ホールディングス | 4 | 7,624 |
| イオン北海道 | 13.7 | 8,384 |
| コジマ | 20.1 | 5,587 |
| ヒマラヤ | 4.2 | 3,633 |
| コーナン商事 | 19.4 | 40,352 |
| エコス | 5.3 | 6,487 |
| ワタミ | 16.1 | 17,967 |
| マルシェ | 3 | 2,478 |
| ドンキホーテホールディングス | 88.5 | 371,257 |
| 西松屋チェーン | 24 | 33,360 |
| ゼンショーホールディングス | 70.8 | 135,511 |
| 幸楽苑ホールディングス | 8.7 | 14,389 |
| ハークスレイ | 3.3 | 3,610 |
| サイゼリヤ | 22.5 | 58,657 |
| V Tホールディングス | 46.2 | 25,964 |
| 魚力 | 4.2 | 5,443 |
| ポブラ | 3.4 | 1,757 |
| フジ・コーポレーション | 2 | 4,018 |
| ユナイテッドアローズ | 18.2 | 58,240 |
| ハイデイ日高 | 12.4 | 33,393 |
| 京都きもの友禅 | 8.7 | 8,700 |
| コロワイド | 45.3 | 86,341 |
| ピーシーデポコーポレーション | 18.1 | 11,167 |
| 壺番屋 | 12.4 | 46,438 |
| トップカルチャー | 4.9 | 2,371 |
| P L A N T | 3.1 | 3,723 |
| スギホールディングス | 30 | 158,100 |
| スクロール | 20.7 | 7,162 |
| ヨンドシーホールディングス | 10.4 | 25,105 |
| ユニー・ファミリーマートホールディングス | 60 | 432,000 |
| 木曽路 | 16.7 | 39,495 |
| サトレストランシステムズ | 16.1 | 13,298 |
| 千趣会 | 24.7 | 17,981 |
| タカキュー | 10.5 | 2,215 |
| ケーヨー | 23 | 13,202 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|------------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 上新電機 | 32 | 34,176 |
| 日本瓦斯 | 25.1 | 83,332 |
| ベスト電器 | 44 | 6,248 |
| ロイヤルホールディングス | 22.7 | 43,584 |
| 東天紅 | 11 | 1,837 |
| いなげや | 15.2 | 23,499 |
| 島忠 | 35.4 | 98,659 |
| チョダ | 16.1 | 43,148 |
| ライフコーポレーション | 10.3 | 33,475 |
| リンガーハット | 15.4 | 36,005 |
| さが美 | 12 | 1,476 |
| MrMax | 17 | 6,936 |
| テンアライド | 12.6 | 4,926 |
| AOKIホールディングス | 27.3 | 39,148 |
| オークワ | 19 | 22,116 |
| コメリ | 21.1 | 56,970 |
| 青山商事 | 28.6 | 113,113 |
| しまむら | 15.9 | 237,546 |
| はせがわ | 7.2 | 3,196 |
| 高島屋 | 229 | 226,023 |
| 松屋 | 29.8 | 29,114 |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 70 | 124,950 |
| 近鉄百貨店 | 52 | 18,564 |
| 丸栄 | 28 | 2,492 |
| パルコ | 13.1 | 14,331 |
| 丸井グループ | 143.9 | 238,874 |
| アクシアル リテイリング | 10.6 | 44,838 |
| 井筒屋 | 7.4 | 2,945 |
| イオン | 562.7 | 927,610 |
| イズミ | 27.1 | 129,538 |
| 東武ストア | 1.6 | 4,640 |
| 平和堂 | 27.7 | 72,823 |
| フジ | 15.2 | 36,069 |
| ヤオコー | 15.5 | 70,602 |
| ゼビオホールディングス | 18.6 | 33,182 |
| ケーズホールディングス | 63 | 129,843 |
| Olympicグループ | 8 | 4,960 |
| 日産東京販売ホールディングス | 20.1 | 6,834 |
| アインホールディングス | 16.5 | 135,630 |
| 元氣寿司 | 3.4 | 7,330 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|---------------------|----------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| ヤマダ電機 | 457.4 | 293,193 |
| アークランドサカモト | 23.1 | 31,623 |
| ニトリホールディングス | 59.1 | 751,161 |
| グルメ杵屋 | 10 | 10,120 |
| 愛眼 | 10 | 1,980 |
| ケーユーホールディングス | 7.1 | 6,106 |
| 吉野家ホールディングス | 47.6 | 76,350 |
| 松屋フーズ | 6.6 | 25,509 |
| サガミチェーン | 17.1 | 22,452 |
| 関西スーパーマーケット | 11.1 | 16,916 |
| 王将フードサービス | 10 | 43,900 |
| ブレナス | 15.3 | 36,918 |
| ミニストップ | 10.1 | 20,412 |
| アークス | 25.6 | 65,536 |
| パローホールディングス | 29.5 | 86,789 |
| 藤久 | 1.1 | 1,886 |
| ベルク | 6.1 | 25,620 |
| 大庄 | 7.3 | 11,519 |
| ファーストリテイリング | 22.8 | 832,656 |
| サンドラッグ | 26 | 202,540 |
| サックスバー ホールディングス | 12.8 | 14,208 |
| ヤマザワ | 2.8 | 5,157 |
| やまや | 2.8 | 4,832 |
| ペルーナ | 34.1 | 25,336 |
| 銀行業 (8.5%) | | |
| 島根銀行 | 2.9 | 4,033 |
| じもとホールディングス | 98.1 | 19,227 |
| めぶきフィナンシャルグループ | 659.5 | 290,839 |
| 東京T Yフィナンシャルグループ | 19.8 | 80,190 |
| 九州フィナンシャルグループ | 224.3 | 179,215 |
| ゆうちょ銀行 | 387.2 | 538,982 |
| 富山第一銀行 | 34.8 | 18,304 |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 895.4 | 543,776 |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 92.7 | 112,815 |
| 新生銀行 | 1,302 | 263,004 |
| あおぞら銀行 | 865 | 362,435 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 10,363.5 | 7,689,717 |
| りそなホールディングス | 1,599.9 | 984,098 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 285.5 | 1,205,952 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 1,095.1 | 4,948,756 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|-----------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 第四銀行 | 168 | 87,696 |
| 北越銀行 | 14.8 | 39,782 |
| 千葉銀行 | 527 | 395,250 |
| 群馬銀行 | 303.9 | 191,457 |
| 武蔵野銀行 | 21.8 | 74,447 |
| 千葉興業銀行 | 37.5 | 21,900 |
| 筑波銀行 | 56.8 | 20,050 |
| 七十七銀行 | 214 | 118,770 |
| 青森銀行 | 106 | 40,492 |
| 秋田銀行 | 89 | 32,663 |
| 山形銀行 | 77 | 37,884 |
| 岩手銀行 | 9 | 41,625 |
| 東邦銀行 | 122 | 53,314 |
| 東北銀行 | 70 | 11,130 |
| みちのく銀行 | 68 | 13,056 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 555 | 283,605 |
| 静岡銀行 | 372 | 373,116 |
| 十六銀行 | 184 | 73,600 |
| スルガ銀行 | 139.8 | 362,082 |
| 八十二銀行 | 263.9 | 179,188 |
| 山梨中央銀行 | 85 | 46,495 |
| 大垣共立銀行 | 182 | 81,354 |
| 福井銀行 | 117 | 34,866 |
| 北國銀行 | 145 | 65,540 |
| 清水銀行 | 4.6 | 17,204 |
| 富山銀行 | 2.6 | 10,881 |
| 滋賀銀行 | 128 | 81,664 |
| 南都銀行 | 13.2 | 61,578 |
| 百五銀行 | 123 | 57,933 |
| 京都銀行 | 245 | 219,520 |
| 紀陽銀行 | 51.4 | 94,730 |
| 三重銀行 | 6.1 | 14,548 |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 91 | 180,908 |
| 広島銀行 | 404 | 214,928 |
| 山陰合同銀行 | 82.2 | 78,912 |
| 中国銀行 | 96.9 | 164,342 |
| 鳥取銀行 | 4.3 | 8,225 |
| 伊予銀行 | 146.3 | 111,626 |
| 百十四銀行 | 150 | 57,600 |
| 四国銀行 | 106 | 30,634 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|--------------------------|----------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 阿波銀行 | 117 | 81,432 |
| 大分銀行 | 79 | 34,286 |
| 宮崎銀行 | 91 | 35,035 |
| 佐賀銀行 | 83 | 24,983 |
| 十八銀行 | 84 | 29,904 |
| 神縄銀行 | 13.3 | 54,663 |
| 琉球銀行 | 28.2 | 42,976 |
| セブン銀行 | 512.7 | 164,576 |
| みずほフィナンシャルグループ | 18,568.3 | 3,953,191 |
| 高知銀行 | 50 | 6,800 |
| 山口フィナンシャルグループ | 128 | 159,872 |
| 長野銀行 | 4.5 | 8,991 |
| 名古屋銀行 | 11.5 | 48,012 |
| 北洋銀行 | 223.2 | 103,564 |
| 愛知銀行 | 4.6 | 30,360 |
| 第三銀行 | 7.7 | 13,813 |
| 中京銀行 | 5.6 | 13,092 |
| 大光銀行 | 48 | 12,240 |
| 愛媛銀行 | 16.2 | 22,145 |
| トマト銀行 | 5.3 | 8,501 |
| みなと銀行 | 12.4 | 26,945 |
| 京葉銀行 | 111 | 58,941 |
| 関西アーバン銀行 | 19 | 27,398 |
| 栃木銀行 | 75.5 | 44,092 |
| 北日本銀行 | 4.3 | 13,437 |
| 東和銀行 | 256 | 29,696 |
| 福島銀行 | 148 | 14,652 |
| 大東銀行 | 71 | 11,999 |
| トモニホールディングス | 112.7 | 69,761 |
| フィデアホールディングス | 132.7 | 27,734 |
| 池田泉州ホールディングス | 145.1 | 78,644 |
| 証券、商品先物取引業 (1.3%) | | |
| F P G | 48.8 | 51,191 |
| S B I ホールディングス | 154.6 | 241,794 |
| 日本アジア投資 | 13.1 | 6,261 |
| ジャフコ | 22.9 | 89,310 |
| 大和証券グループ本社 | 1,280 | 947,840 |
| 野村ホールディングス | 2,795.9 | 2,041,845 |
| 岡三証券グループ | 116 | 87,116 |
| 丸三証券 | 43.5 | 42,543 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|----------------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 東洋証券 | 49 | 13,573 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 156.9 | 101,200 |
| 光世証券 | 33 | 6,699 |
| 水戸証券 | 42.3 | 13,324 |
| いちよし証券 | 30.6 | 27,815 |
| 松井証券 | 78.1 | 78,568 |
| だいち証券ビジネス | 6.6 | 4,118 |
| マネックスグループ | 146.7 | 46,503 |
| カブドットコム証券 | 101.7 | 40,578 |
| 極東証券 | 18.3 | 31,677 |
| 岩井コスモホールディングス | 12.9 | 13,777 |
| 藍澤証券 | 25.6 | 17,024 |
| マネーパートナーズグループ | 17.4 | 9,657 |
| 小林洋行 | 3.9 | 1,131 |
| 保険業 (2.7%) | | |
| かんぽ生命保険 | 51.6 | 131,992 |
| SOMPOホールディングス | 285.9 | 1,194,204 |
| アニコム ホールディングス | 9.3 | 21,669 |
| MS&ADインシュアランスグループホール | 408.7 | 1,573,903 |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 131 | 255,057 |
| 第一生命ホールディングス | 824.7 | 1,724,035 |
| 東京海上ホールディングス | 554.1 | 2,661,896 |
| T&Dホールディングス | 498.5 | 849,942 |
| アドバンスクリエイト | 3.2 | 6,320 |
| その他金融業 (1.3%) | | |
| 全国保証 | 38.5 | 150,342 |
| クレディセゾン | 103.7 | 217,666 |
| アクリーティブ | 11.2 | 4,838 |
| 芙蓉総合リース | 15.6 | 86,736 |
| 興銀リース | 25.7 | 64,995 |
| 東京センチュリー | 27.5 | 106,700 |
| 日本証券金融 | 60.2 | 36,782 |
| アイフル | 229.4 | 79,143 |
| ポケットカード | 10.2 | 6,140 |
| リコーリース | 10.8 | 38,502 |
| イオンフィナンシャルサービス | 87.3 | 177,480 |
| アコム | 273.8 | 133,066 |
| ジャックス | 75 | 39,375 |
| オリエントコーポレーション | 295.7 | 60,914 |
| 日立キャピタル | 32.2 | 94,603 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|--------------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| アプラスフィナンシャル | 65.6 | 7,937 |
| オリックス | 968.5 | 1,694,875 |
| 三菱UFJリース | 346.9 | 211,609 |
| 日本取引所グループ | 425.2 | 671,816 |
| イー・ギャランティ | 4 | 10,972 |
| アサックス | 2.4 | 3,849 |
| NECキャピタルソリューション | 5.6 | 9,895 |
| 不動産業 (2.5%) | | |
| いちご | 129.9 | 49,881 |
| 日本駐車場開発 | 164.8 | 25,544 |
| ヒューリック | 285.2 | 289,192 |
| 三栄建築設計 | 5.5 | 8,717 |
| 野村不動産ホールディングス | 90.8 | 178,966 |
| 三重交通グループホールディングス | 24.2 | 9,559 |
| サムティ | 11 | 12,694 |
| ディア・ライフ | 9.2 | 3,542 |
| エー・ディー・ワークス | 125.2 | 5,634 |
| 日本商業開発 | 7.6 | 15,032 |
| プレサンスコーポレーション | 21.2 | 28,874 |
| ユニゾホールディングス | 11.3 | 34,408 |
| THEグローバル社 | 4.8 | 2,174 |
| 日本管理センター | 9.8 | 12,593 |
| サンセイランディック | 2.8 | 2,044 |
| エストラスト | 2.4 | 1,816 |
| フージャースホールディングス | 17.6 | 10,665 |
| オープンハウス | 19.8 | 52,331 |
| 東急不動産ホールディングス | 330.9 | 223,688 |
| 飯田グループホールディングス | 114 | 247,152 |
| ムゲンエステート | 4.7 | 3,487 |
| ファーストブラザーズ | 1.4 | 2,504 |
| シーアールイー | 1.9 | 2,861 |
| エコナックホールディングス | 51 | 2,601 |
| パーク24 | 69.3 | 213,444 |
| バラカ | 3.9 | 7,764 |
| 三井不動産 | 725 | 1,928,500 |
| 三菱地所 | 1,017 | 2,228,755 |
| 平和不動産 | 25.9 | 41,077 |
| 東京建物 | 158.7 | 240,113 |
| ダイビル | 35.2 | 35,094 |
| 京阪神ビルディング | 22.7 | 13,756 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|---------------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| 住友不動産 | 328 | 1,033,528 |
| 大京 | 254 | 58,928 |
| テーオーシー | 53 | 49,290 |
| 東京楽天地 | 22 | 11,770 |
| レオパレス21 | 172.6 | 112,880 |
| スターツコーポレーション | 13.9 | 27,674 |
| フジ住宅 | 17.4 | 13,137 |
| 空港施設 | 16.5 | 9,718 |
| 明和地所 | 7.5 | 5,430 |
| 住友不動産販売 | 12.3 | 32,139 |
| ゴールドクレスト | 12.3 | 26,260 |
| 日本エスリード | 5.3 | 7,139 |
| 日神不動産 | 16.2 | 8,699 |
| 日本エスコン | 18.2 | 6,970 |
| タカラレーベン | 59.6 | 38,918 |
| サンヨーハウジング名古屋 | 7 | 7,168 |
| イオンモール | 88.1 | 146,069 |
| ファースト住建 | 5.1 | 7,242 |
| ランド | 117.6 | 1,764 |
| トーセイ | 18.7 | 14,305 |
| 穴吹興産 | 1.5 | 3,915 |
| エス・ティ・ティ都市開発 | 85 | 85,170 |
| サンフロンティア不動産 | 14.7 | 14,744 |
| エフ・ジェー・ネクスト | 11.9 | 8,865 |
| インテリックス | 2.8 | 2,212 |
| ランドビジネス | 8.1 | 2,332 |
| グランディハウス | 11.9 | 4,974 |
| 日本空港ビルデング | 43.6 | 179,414 |
| サービス業 (3.6%) | | |
| 日本工営 | 9.7 | 24,773 |
| ネクスト | 35.8 | 29,356 |
| ジェイエイシーリクルートメント | 8.9 | 12,023 |
| 日本M&Aセンター | 41.8 | 146,091 |
| 中広 | 1.4 | 975 |
| タケエイ | 12.7 | 12,763 |
| トラスト・テック | 5.9 | 10,655 |
| コシダカホールディングス | 5 | 11,400 |
| パソナグループ | 12.6 | 9,865 |
| CDS | 3.3 | 3,435 |
| リンクアンドモチベーション | 34.1 | 15,549 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|------------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| GCA | 12.8 | 10,547 |
| エス・エム・エス | 20.5 | 57,420 |
| テンブホールディングス | 111.9 | 219,100 |
| リニカル | 8.5 | 10,990 |
| クックパッド | 32.3 | 32,623 |
| エスクリ | 5.1 | 3,141 |
| アイ・ケイ・ケイ | 6.4 | 4,480 |
| 学情 | 6 | 7,302 |
| スタジオアリス | 5.9 | 12,584 |
| シミックホールディングス | 7.3 | 11,037 |
| NJS | 3.2 | 4,352 |
| 総合警備保障 | 52.7 | 234,515 |
| カカコム | 103.3 | 210,835 |
| アイロムグループ | 4.4 | 5,913 |
| ルネサンス | 7.4 | 11,077 |
| ディップ | 18.7 | 42,991 |
| オプトホールディング | 10.3 | 7,508 |
| 新日本科学 | 16.1 | 9,144 |
| ツクイ | 34.3 | 27,817 |
| キャリアデザインセンター | 3 | 3,726 |
| エムスリー | 125.4 | 371,058 |
| ツカダ・グローバルホールディング | 10.5 | 6,898 |
| アウトソーシング | 8.3 | 32,038 |
| ウエルネット | 10.9 | 13,930 |
| ワールドホールディングス | 3.3 | 6,755 |
| ディー・エヌ・エー | 64.9 | 171,595 |
| 博報堂DYホールディングス | 200.6 | 284,049 |
| ぐるなび | 20.9 | 51,999 |
| エスアールジータカミヤ | 15.6 | 9,516 |
| ジャパンベストレスキューシステム | 17.9 | 4,349 |
| ファンコムコミュニケーションズ | 36.8 | 27,305 |
| ライク | 3 | 7,452 |
| WDBホールディングス | 5.2 | 6,624 |
| ティア | 6.9 | 4,395 |
| バリューコマース | 13.3 | 4,468 |
| インフォマート | 61.4 | 38,559 |
| J Pホールディングス | 41.6 | 10,982 |
| E P Sホールディングス | 17.9 | 25,793 |
| レッグス | 3.3 | 2,824 |
| プレステージ・インターナショナル | 20.5 | 16,994 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|----------------|-------|---------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| アミューズ | 8 | 14,264 |
| ドリームインキュベータ | 4.4 | 9,028 |
| クイック | 7.4 | 8,199 |
| TAC | 8 | 1,840 |
| ケネディクス | 194.3 | 83,354 |
| 電通 | 161.3 | 869,407 |
| テイクアンドギヴ・ニーズ | 6.7 | 5,085 |
| びあ | 4.4 | 12,474 |
| イオンファンタジー | 4.2 | 12,831 |
| シーティーエス | 3.9 | 5,151 |
| ネクシィーズグループ | 5.2 | 7,732 |
| みらかホールディングス | 37 | 194,620 |
| アルプス技研 | 5.8 | 15,027 |
| サニックス | 23.2 | 4,268 |
| ダイオーズ | 2.6 | 2,776 |
| 日本空調サービス | 13.9 | 8,631 |
| オリエンタルランド | 156.5 | 993,618 |
| ダスキン | 37.1 | 87,964 |
| 明光ネットワークジャパン | 17.9 | 22,052 |
| ファルコホールディングス | 6.8 | 10,070 |
| 秀英予備校 | 2.9 | 1,374 |
| 田谷 | 2.4 | 1,574 |
| ラウンドワン | 45.2 | 35,979 |
| リゾートトラスト | 56 | 115,864 |
| ビー・エム・エル | 18.9 | 51,483 |
| ワタベウェディング | 2.1 | 926 |
| りらいあコミュニケーションズ | 23.9 | 28,154 |
| リソー教育 | 24.6 | 14,809 |
| 早稲田アカデミー | 1.9 | 2,147 |
| ユー・エス・エス | 175.2 | 350,750 |
| 東京個別指導学院 | 4.7 | 4,620 |
| サイバーエージェント | 76.2 | 232,410 |
| 楽天 | 739.5 | 854,862 |
| クリーク・アンド・リバー社 | 5.1 | 5,385 |
| テー・オー・ダブリュー | 11.6 | 7,493 |
| セントラルスポーツ | 4.9 | 14,489 |
| フルキャストホールディングス | 14.9 | 14,378 |
| リゾルホールディングス | 14 | 4,886 |
| テクノプロ・ホールディングス | 23.5 | 91,180 |
| アトラ | 1.6 | 1,222 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|-------------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| インターワークス | 2.9 | 3,497 |
| Ke e P e r 技研 | 1.6 | 3,184 |
| ファーストロジック | 0.8 | 1,676 |
| デザインワン・ジャパン | 1 | 2,798 |
| イー・ガーディアン | 4.7 | 9,371 |
| リブセンス | 9.7 | 4,374 |
| ジャパンマテリアル | 10.6 | 18,051 |
| ベクトル | 11.7 | 12,975 |
| ウチヤマホールディングス | 6.5 | 2,808 |
| サクセスホールディングス | 1.1 | 1,510 |
| キャリアリンク | 3.2 | 2,432 |
| I B J | 11.2 | 6,888 |
| アサンテ | 5.3 | 9,094 |
| N・フィールド | 6.8 | 9,894 |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 1.9 | 6,165 |
| ライドオン・エクスプレス | 3.6 | 3,049 |
| E R I ホールディングス | 3.7 | 2,963 |
| アビスト | 2.2 | 8,437 |
| ウィルグループ | 5.7 | 4,166 |
| エスクロー・エージェント・ジャパン | 2.4 | 4,264 |
| 日本ビューホテル | 2.1 | 2,916 |
| リクルートホールディングス | 316.2 | 1,571,514 |
| エラン | 1.9 | 2,426 |
| 土木管理総合試験所 | 1.4 | 1,023 |
| 日本郵政 | 377.7 | 543,888 |
| ベルシステム24ホールディングス | 22 | 21,912 |
| ソラスト | 6.6 | 8,824 |
| リログループ | 5.4 | 86,292 |
| 東祥 | 3.1 | 16,089 |
| エイチ・アイ・エス | 23.6 | 74,458 |
| ラックランド | 2.5 | 4,770 |
| 共立メンテナンス | 11.7 | 87,165 |
| イチネンホールディングス | 15.2 | 17,282 |
| 建設技術研究所 | 9.1 | 9,500 |
| スペース | 7.8 | 9,594 |
| 燎ホールディングス | 2.9 | 4,570 |
| スパル興業 | 10 | 5,400 |
| 東京テアトル | 55 | 9,405 |
| タナベ経営 | 2.8 | 3,626 |
| ナガワ | 2.6 | 11,531 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|------------------|-------|-----------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| よみうりランド | 29 | 13,630 |
| 東京都競馬 | 99 | 26,433 |
| 常磐興産 | 5.3 | 8,485 |
| カナモト | 20.2 | 61,004 |
| 東京ドーム | 57.7 | 63,123 |
| 西尾レントオール | 11.7 | 39,019 |
| アゴラ・ホスピタリティ・グループ | 71 | 2,698 |
| トランス・コスモス | 16.8 | 48,804 |
| 乃村工藝社 | 31 | 60,419 |
| 藤田観光 | 47 | 16,356 |
| KNT-CTホールディングス | 82 | 11,972 |
| 日本管財 | 12.4 | 21,700 |
| トーカイ | 6.4 | 25,952 |
| 白洋舎 | 1.4 | 3,746 |
| セコム | 150.6 | 1,242,299 |
| セントラル警備保障 | 6.4 | 12,742 |
| 丹青社 | 25 | 22,125 |

| 銘柄 | 当 期 末 | |
|--------------|------------------|-------------|
| | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千円 |
| メイテック | 17.5 | 75,775 |
| アサツー ディ・ケイ | 23.6 | 71,036 |
| 応用地質 | 13.7 | 19,495 |
| 船井総研ホールディングス | 18.6 | 33,201 |
| 進学会 | 6 | 3,402 |
| オオバ | 10.5 | 4,872 |
| 学究社 | 3.8 | 5,677 |
| ベネッセホールディングス | 48.5 | 158,352 |
| イオンディライト | 16.3 | 53,056 |
| ナック | 8.9 | 8,606 |
| ニチイ学館 | 25.1 | 20,707 |
| ダイセキ | 25.2 | 57,657 |
| ステップ | 4.8 | 6,652 |
| 合 計 | 株数・金額 209,541 | 312,182,586 |
| | 銘柄数<比率> 1,982 | <99.4%> |

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

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄 | 柄 | 別 | 当 期 末 | |
|----|--------|-------|--------------|----------|
| | | | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 国内 | 株式先物取引 | TOPIX | 百万円 2,080 | 百万円 - |

<有価証券の貸付及び借入の状況>

2017年1月26日現在における貸付株数の総株数は38,627,000株です。

うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUF G証券株式会社に対する貸付は、38,627,000株です。

<外国株式インデックスマザーファンド>

下記は、外国株式インデックスマザーファンド全体(157,553,049千口)の内容です。

外国株式

| 銘柄 | 株数 | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------|-------|---------|-----------|------------------------|
| | | 評価額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| AMERICAN EXPRESS CO | 744 | 5,722 | 647,453 | 各種金融 |
| ABBOTT LABORATORIES | 1,627 | 6,559 | 742,228 | ヘルスケア機器・サービス |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 308 | 1,493 | 169,043 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP | 51 | 743 | 84,078 | 各種金融 |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 432 | 4,437 | 502,063 | ソフトウェア・サービス |
| AUTONATION INC | 67 | 356 | 40,376 | 小売 |
| AES CORP | 636 | 723 | 81,917 | 公益事業 |
| AFLAC INC | 387 | 2,727 | 308,577 | 保険 |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 1,013 | 6,662 | 753,898 | 保険 |
| APACHE CORP | 359 | 2,209 | 250,034 | エネルギー |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 55 | 1,266 | 143,358 | ソフトウェア・サービス |
| ACCENTURE PLC-CL A | 589 | 6,931 | 784,267 | ソフトウェア・サービス |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 194 | 2,893 | 327,384 | 素材 |
| ANTHEM INC | 249 | 3,832 | 433,624 | ヘルスケア機器・サービス |
| ANADARKO PETROLEUM CORP | 524 | 3,708 | 419,590 | エネルギー |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 1,289 | 3,040 | 343,984 | ヘルスケア機器・サービス |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 462 | 2,135 | 241,600 | ヘルスケア機器・サービス |
| BOEING CO/THE | 561 | 9,398 | 1,063,414 | 資本財 |
| BECTON DICKINSON AND CO | 201 | 3,463 | 391,951 | ヘルスケア機器・サービス |
| BEST BUY CO INC | 274 | 1,228 | 138,960 | 小売 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 1,583 | 7,846 | 887,880 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BLACKROCK INC | 115 | 4,478 | 506,798 | 各種金融 |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 3,864 | 19,235 | 2,176,463 | 電気通信サービス |
| CR BARD INC | 69 | 1,603 | 181,409 | ヘルスケア機器・サービス |
| BALL CORP | 157 | 1,207 | 136,681 | 素材 |
| BAKER HUGHES INC | 385 | 2,450 | 277,246 | エネルギー |
| ALLSTATE CORP | 351 | 2,648 | 299,706 | 保険 |
| AVERY DENNISON CORP | 84 | 625 | 70,808 | 素材 |
| CHUBB LTD | 440 | 5,857 | 662,818 | 保険 |
| ANALOG DEVICES INC | 291 | 2,171 | 245,654 | 半導体・半導体製造装置 |
| AUTOZONE INC | 27 | 2,041 | 231,033 | 小売 |
| CVS HEALTH CORP | 1,010 | 8,031 | 908,810 | 食品・生活必需品小売り |
| CORNING INC | 982 | 2,620 | 296,471 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 3,423 | 29,451 | 3,332,418 | 銀行 |
| CIGNA CORP | 243 | 3,610 | 408,567 | ヘルスケア機器・サービス |
| CATERPILLAR INC | 554 | 5,437 | 615,265 | 資本財 |
| COCA-COLA CO/THE | 3,885 | 16,367 | 1,851,972 | 食品・飲料・タバコ |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 479 | 4,239 | 479,729 | 各種金融 |
| CAMPBELL SOUP CO | 190 | 1,199 | 135,762 | 食品・飲料・タバコ |
| CSX CORP | 897 | 4,287 | 485,177 | 運輸 |
| CHEVRON CORP | 1,788 | 20,968 | 2,372,544 | エネルギー |
| COACH INC | 263 | 955 | 108,125 | 耐久消費財・アパレル |
| ROCKWELL COLLINS INC | 123 | 1,118 | 126,528 | 資本財 |
| COMPUTER SCIENCES CORP | 133 | 813 | 92,045 | ソフトウェア・サービス |
| CONOCOPHILLIPS | 1,173 | 5,948 | 673,075 | エネルギー |
| CME GROUP INC | 320 | 3,847 | 435,378 | 各種金融 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|-----------------------------|-------|---------|-----------|--------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| CARDINAL HEALTH INC | 301 | 2,288 | 259,000 | ヘルスケア機器・サービス |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 803 | 5,498 | 622,177 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| DOMINION RESOURCES INC/VA | 598 | 4,536 | 513,250 | 公益事業 |
| DOW CHEMICAL CO/THE | 1,067 | 6,427 | 727,289 | 素材 |
| DEVON ENERGY CORP | 446 | 2,075 | 234,854 | エネルギー |
| DEERE & CO | 253 | 2,741 | 310,186 | 資本財 |
| DANAHER CORP | 588 | 4,768 | 539,523 | ヘルスケア機器・サービス |
| DU PONT (E. I.) DE NEMOURS | 828 | 6,352 | 718,784 | 素材 |
| WALT DISNEY CO/THE | 1,446 | 15,626 | 1,768,111 | メディア |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 112 | 828 | 93,791 | 消費者サービス |
| DUKE ENERGY CORP | 655 | 5,052 | 571,709 | 公益事業 |
| DR HORTON INC | 334 | 1,048 | 118,646 | 耐久消費財・アパレル |
| DICK'S SPORTING GOODS INC | 84 | 450 | 50,937 | 小売 |
| TARGET CORP | 517 | 3,361 | 380,314 | 小売 |
| DUN & BRADSTREET CORP | 34 | 424 | 48,063 | 商業・専門サービス |
| DAVITA INC | 157 | 1,008 | 114,139 | ヘルスケア機器・サービス |
| DOVER CORP | 147 | 1,199 | 135,677 | 資本財 |
| DTE ENERGY COMPANY | 172 | 1,687 | 190,930 | 公益事業 |
| EXXON MOBIL CORP | 3,930 | 33,546 | 3,795,792 | エネルギー |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 201 | 1,937 | 219,252 | ヘルスケア機器・サービス |
| EOG RESOURCES INC | 545 | 5,672 | 641,787 | エネルギー |
| EMERSON ELECTRIC CO | 609 | 3,673 | 415,684 | 資本財 |
| EXELON CORP | 878 | 3,104 | 351,231 | 公益事業 |
| ECOLAB INC | 248 | 3,048 | 344,927 | 素材 |
| EQUIFAX INC | 113 | 1,341 | 151,760 | 商業・専門サービス |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 208 | 1,713 | 193,930 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| EATON CORP PLC | 430 | 3,065 | 346,902 | 資本財 |
| EDISON INTERNATIONAL | 311 | 2,236 | 253,113 | 公益事業 |
| ENTERGY CORP | 172 | 1,216 | 137,640 | 公益事業 |
| EVEREST RE GROUP LTD | 39 | 861 | 97,511 | 保険 |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO | 55 | 439 | 49,744 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| NEXTERA ENERGY INC | 439 | 5,231 | 591,946 | 公益事業 |
| MACY'S INC | 292 | 881 | 99,730 | 小売 |
| FEDEX CORP | 239 | 4,616 | 522,315 | 運輸 |
| FORD MOTOR CO | 3,516 | 4,497 | 508,918 | 自動車・自動車部品 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 353 | 1,480 | 167,538 | 各種金融 |
| FOOT LOCKER INC | 127 | 883 | 99,949 | 小売 |
| FIRSTENERGY CORP | 407 | 1,215 | 137,538 | 公益事業 |
| FLUOR CORP | 131 | 749 | 84,760 | 資本財 |
| FREPORT-MCMORAN INC | 1,196 | 1,974 | 223,463 | 素材 |
| GENERAL MILLS INC | 568 | 3,579 | 404,988 | 食品・飲料・タバコ |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 245 | 4,305 | 487,148 | 資本財 |
| WW GRAINGER INC | 54 | 1,376 | 155,769 | 資本財 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 8,495 | 25,800 | 2,919,371 | 資本財 |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 146 | 1,144 | 129,548 | ソフトウェア・サービス |
| GENUINE PARTS CO | 140 | 1,377 | 155,914 | 小売 |
| TEGNA INC | 191 | 429 | 48,644 | メディア |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO | 248 | 786 | 88,948 | 自動車・自動車部品 |
| GAP INC/THE | 227 | 553 | 62,578 | 小売 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 346 | 8,212 | 929,287 | 各種金融 |
| HALLIBURTON CO | 816 | 4,688 | 530,478 | エネルギー |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 684 | 8,068 | 912,994 | 資本財 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|-------|---------|-----------|------------------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 169 | 1,019 | 115,329 | 自動車・自動車部品 |
| HP INC | 1,621 | 2,463 | 278,774 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 365 | 1,764 | 199,700 | 保険 |
| HERSHEY CO/THE | 137 | 1,459 | 165,130 | 食品・飲料・タバコ |
| HARMAN INTERNATIONAL | 66 | 733 | 83,009 | 耐久消費財・アパレル |
| HOME DEPOT INC | 1,171 | 16,103 | 1,822,151 | 小売 |
| HASBRO INC | 106 | 926 | 104,824 | 耐久消費財・アパレル |
| INGERSOLL-RAND PLC | 244 | 1,964 | 222,282 | 資本財 |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 860 | 15,344 | 1,736,253 | ソフトウェア・サービス |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 370 | 2,147 | 243,007 | 素材 |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 302 | 3,893 | 440,562 | 資本財 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 378 | 899 | 101,763 | メディア |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 75 | 903 | 102,238 | 素材 |
| JOHNSON & JOHNSON | 2,592 | 29,246 | 3,309,209 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 102 | 910 | 103,040 | 運輸 |
| KELLOGG CO | 249 | 1,802 | 204,006 | 食品・飲料・タバコ |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 341 | 4,165 | 471,292 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 1,473 | 6,645 | 751,943 | 食品・飲料・タバコ |
| KROGER CO | 854 | 2,860 | 323,651 | 食品・生活必需品小売り |
| KOHL'S CORP | 173 | 699 | 79,191 | 小売 |
| ELI LILLY & CO | 941 | 7,046 | 797,323 | 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 | 97 | 1,311 | 148,375 | ヘルスケア機器・サービス |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 149 | 739 | 83,705 | 運輸 |
| LENNAR CORP-A | 173 | 815 | 92,268 | 耐久消費財・アパレル |
| LOWE'S COS INC | 834 | 6,099 | 690,132 | 小売 |
| LEGGETT & PLATT INC | 126 | 614 | 69,519 | 耐久消費財・アパレル |
| L BRANDS INC | 232 | 1,435 | 162,410 | 小売 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 414 | 2,345 | 265,410 | 消費者サービス |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 250 | 6,287 | 711,436 | 資本財 |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 220 | 1,521 | 172,161 | 保険 |
| L3 TECHNOLOGIES INC | 73 | 1,104 | 124,942 | 資本財 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 313 | 2,685 | 303,815 | 消費者サービス |
| MCDONALD'S CORP | 808 | 9,848 | 1,114,308 | 消費者サービス |
| S&P GLOBAL INC | 250 | 3,020 | 341,742 | 各種金融 |
| MEDTRONIC PLC | 1,320 | 9,833 | 1,112,702 | ヘルスケア機器・サービス |
| MERCK & CO. INC. | 2,620 | 16,005 | 1,811,045 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 984 | 2,319 | 262,502 | 半導体・半導体製造装置 |
| MATTEL INC | 322 | 1,017 | 115,083 | 耐久消費財・アパレル |
| 3M CO | 572 | 10,119 | 1,145,048 | 資本財 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 143 | 1,221 | 138,263 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 429 | 1,272 | 143,957 | 消費者サービス |
| MASCO CORP | 314 | 1,057 | 119,658 | 資本財 |
| MONSANTO CO | 414 | 4,597 | 520,223 | 素材 |
| M & T BANK CORP | 133 | 2,165 | 244,993 | 銀行 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 491 | 3,377 | 382,182 | 保険 |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 59 | 1,283 | 145,246 | 耐久消費財・アパレル |
| MORGAN STANLEY | 1,359 | 5,964 | 674,900 | 各種金融 |
| MCKESSON CORP | 213 | 3,231 | 365,686 | ヘルスケア機器・サービス |
| METLIFE INC | 884 | 4,965 | 561,898 | 保険 |
| MANPOWERGROUP INC | 64 | 619 | 70,111 | 商業・専門サービス |
| MOODY'S CORP | 164 | 1,709 | 193,438 | 各種金融 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 278 | 3,356 | 379,803 | 運輸 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|-------|---------|-----------|------------------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| BANK OF AMERICA CORP | 9,672 | 22,603 | 2,557,592 | 銀行 |
| NISOURCE INC | 314 | 697 | 78,965 | 公益事業 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 160 | 3,710 | 419,793 | 資本財 |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP | 464 | 699 | 79,096 | 銀行 |
| NEWMONT MINING CORP | 502 | 1,755 | 198,643 | 素材 |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A | 1,004 | 3,045 | 344,548 | メディア |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 108 | 1,043 | 118,032 | 食品・飲料・タバコ |
| MARKEL CORP | 13 | 1,236 | 139,917 | 保険 |
| NUCOR CORP | 301 | 1,798 | 203,516 | 素材 |
| NEWELL BRANDS INC | 410 | 1,928 | 218,173 | 耐久消費財・アパレル |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B | 419 | 1,251 | 141,588 | メディア |
| NOBLE ENERGY INC | 407 | 1,620 | 183,367 | エネルギー |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 724 | 4,936 | 558,533 | エネルギー |
| OMNICOM GROUP | 224 | 1,935 | 219,013 | メディア |
| PEPSICO INC | 1,364 | 14,270 | 1,614,716 | 食品・飲料・タバコ |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 89 | 845 | 95,634 | 素材 |
| ALTRIA GROUP INC | 1,852 | 13,146 | 1,487,483 | 食品・飲料・タバコ |
| PINNACLE WEST CAPITAL | 107 | 830 | 93,978 | 公益事業 |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 2,422 | 21,113 | 2,389,037 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 465 | 5,631 | 637,225 | 銀行 |
| PFIZER INC | 5,747 | 17,985 | 2,035,054 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 413 | 4,441 | 502,541 | 保険 |
| PULTEGROUP INC | 293 | 599 | 67,829 | 耐久消費財・アパレル |
| PARKER HANNIFIN CORP | 126 | 1,897 | 214,674 | 資本財 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 160 | 2,893 | 327,401 | エネルギー |
| CITIGROUP INC | 2,753 | 15,884 | 1,797,296 | 銀行 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 272 | 1,623 | 183,691 | 保険 |
| PPG INDUSTRIES INC | 252 | 2,551 | 288,674 | 素材 |
| PENTAIR PLC | 163 | 1,005 | 113,747 | 資本財 |
| PRAXAIR INC | 270 | 3,237 | 366,293 | 素材 |
| P G & E CORP | 480 | 2,925 | 331,053 | 公益事業 |
| PPL CORP | 649 | 2,242 | 253,682 | 公益事業 |
| PROGRESSIVE CORP | 551 | 2,081 | 235,560 | 保険 |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 482 | 2,095 | 237,098 | 公益事業 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 163 | 1,429 | 161,802 | 消費者サービス |
| RAYTHEON COMPANY | 279 | 4,103 | 464,316 | 資本財 |
| REPUBLIC SERVICES INC | 227 | 1,316 | 148,923 | 商業・専門サービス |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 1,187 | 1,735 | 196,402 | 銀行 |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 39 | 540 | 61,198 | 保険 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 96 | 1,832 | 207,317 | 資本財 |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 396 | 1,029 | 116,433 | 公益事業 |
| ROBERT HALF INTL INC | 123 | 613 | 69,379 | 商業・専門サービス |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 122 | 1,876 | 212,362 | 資本財 |
| SCHLUMBERGER LTD | 1,317 | 11,269 | 1,275,089 | エネルギー |
| STRYKER CORP | 318 | 3,862 | 437,089 | ヘルスケア機器・サービス |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 1,127 | 4,769 | 539,689 | 各種金融 |
| SEMPRA ENERGY | 226 | 2,325 | 263,103 | 公益事業 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 74 | 2,107 | 238,496 | 素材 |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 142 | 1,770 | 200,277 | 資本財 |
| SUNTRUST BANKS INC | 468 | 2,724 | 308,330 | 銀行 |
| TRAVELERS COS INC/THE | 272 | 3,207 | 362,909 | 保険 |
| SOUTHERN CO/THE | 931 | 4,515 | 510,976 | 公益事業 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|-------|---------|-----------|------------------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| AT&T INC | 5,829 | 24,128 | 2,730,089 | 電気通信サービス |
| WESTERN DIGITAL CORP | 269 | 2,156 | 244,057 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| STATE STREET CORP | 369 | 2,872 | 325,079 | 各種金融 |
| SYSCO CORP | 500 | 2,653 | 300,286 | 食品・生活必需品小売り |
| SEALED AIR CORP | 187 | 922 | 104,382 | 素材 |
| SCANA CORP | 131 | 912 | 103,297 | 公益事業 |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 950 | 7,468 | 845,067 | 半導体・半導体製造装置 |
| TIFFANY & CO | 118 | 949 | 107,440 | 小売 |
| TORCHMARK CORP | 107 | 802 | 90,748 | 保険 |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 884 | 3,907 | 442,133 | 資本財 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 373 | 5,321 | 602,140 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEXTRON INC | 255 | 1,194 | 135,116 | 資本財 |
| UNION PACIFIC CORP | 789 | 8,718 | 986,465 | 運輸 |
| UNUM GROUP | 221 | 1,020 | 115,459 | 保険 |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 753 | 8,357 | 945,601 | 資本財 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 902 | 14,551 | 1,646,548 | ヘルスケア機器・サービス |
| US BANCORP | 1,620 | 8,500 | 961,845 | 銀行 |
| MARATHON OIL CORP | 802 | 1,424 | 161,233 | エネルギー |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 656 | 7,675 | 868,440 | 運輸 |
| VALERO ENERGY CORP | 437 | 2,987 | 338,084 | エネルギー |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 88 | 814 | 92,160 | ヘルスケア機器・サービス |
| VALSPAR CORP/THE | 72 | 779 | 88,237 | 素材 |
| CBS CORP-CLASS B NON VOTING | 385 | 2,428 | 274,837 | メディア |
| VF CORP | 313 | 1,651 | 186,912 | 耐久消費財・アパレル |
| VULCAN MATERIALS CO | 126 | 1,705 | 192,974 | 素材 |
| WILLIAMS COS INC | 773 | 2,228 | 252,185 | エネルギー |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 871 | 7,150 | 809,094 | 食品・生活必需品小売り |
| WEC ENERGY GROUP INC | 302 | 1,761 | 199,290 | 公益事業 |
| WAL-MART STORES INC | 1,465 | 9,802 | 1,109,140 | 食品・生活必需品小売り |
| WELLS FARGO & CO | 4,542 | 25,722 | 2,910,490 | 銀行 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 419 | 2,921 | 330,588 | 商業・専門サービス |
| WATERS CORP | 76 | 1,101 | 124,660 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL PL | 875 | 474 | 53,696 | エネルギー |
| WHIRLPOOL CORP | 71 | 1,358 | 153,725 | 耐久消費財・アパレル |
| XEROX CORP | 816 | 571 | 64,646 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| XCEL ENERGY INC | 487 | 1,985 | 224,682 | 公益事業 |
| KEYCORP | 1,024 | 1,884 | 213,205 | 銀行 |
| CARMAX INC | 182 | 1,243 | 140,677 | 小売 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 189 | 2,199 | 248,820 | ヘルスケア機器・サービス |
| TOLL BROTHERS INC | 151 | 498 | 56,460 | 耐久消費財・アパレル |
| YUM! BRANDS INC | 351 | 2,302 | 260,549 | 消費者サービス |
| TJX COMPANIES INC | 621 | 4,688 | 530,495 | 小売 |
| CA INC | 296 | 929 | 105,158 | ソフトウェア・サービス |
| CLOROX COMPANY | 123 | 1,496 | 169,385 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| CELANESE CORP-SERIES A | 137 | 1,188 | 134,426 | 素材 |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 277 | 727 | 82,305 | ソフトウェア・サービス |
| CARNIVAL CORP | 338 | 1,888 | 213,633 | 消費者サービス |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV | 295 | 2,362 | 267,293 | ソフトウェア・サービス |
| CONAGRA BRANDS INC | 395 | 1,553 | 175,725 | 食品・飲料・タバコ |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 291 | 2,118 | 239,697 | 公益事業 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 725 | 1,952 | 220,874 | 銀行 |
| STERICYCLE INC | 80 | 655 | 74,225 | 商業・専門サービス |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|---------------------------|-------|---------|-----------|------------------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| INTEL CORP | 4,474 | 16,914 | 1,913,886 | 半導体・半導体製造装置 |
| CISCO SYSTEMS INC | 4,765 | 14,631 | 1,655,540 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CINTAS CORP | 78 | 920 | 104,136 | 商業・専門サービス |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 118 | 1,229 | 139,162 | 電気通信サービス |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 414 | 6,810 | 770,663 | 食品・生活必需品小売り |
| APPLIED MATERIALS INC | 1,024 | 3,525 | 398,891 | 半導体・半導体製造装置 |
| ELECTRONIC ARTS INC | 284 | 2,320 | 262,588 | ソフトウェア・サービス |
| TYSON FOODS INC-CL A | 281 | 1,763 | 199,565 | 食品・飲料・タバコ |
| SYMANTEC CORP | 583 | 1,590 | 179,923 | ソフトウェア・サービス |
| ROSS STORES INC | 377 | 2,492 | 282,033 | 小売 |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 204 | 1,406 | 159,197 | 半導体・半導体製造装置 |
| NIKE INC -CL B | 1,277 | 6,879 | 778,425 | 耐久消費財・アパレル |
| TARO PHARMACEUTICAL INDUS | 14 | 142 | 16,178 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMGEN INC | 709 | 10,929 | 1,236,660 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COMERICA INC | 164 | 1,139 | 128,960 | 銀行 |
| NORTHERN TRUST CORP | 203 | 1,710 | 193,560 | 各種金融 |
| MICROSOFT CORP | 7,016 | 44,682 | 5,055,865 | ソフトウェア・サービス |
| ANSYS INC | 82 | 783 | 88,613 | ソフトウェア・サービス |
| CENTENE CORP | 161 | 1,042 | 117,967 | ヘルスケア機器・サービス |
| STAPLES INC | 615 | 578 | 65,483 | 小売 |
| STARBUCKS CORP | 1,388 | 8,151 | 922,314 | 消費者サービス |
| ORACLE CORP | 2,930 | 11,766 | 1,331,381 | ソフトウェア・サービス |
| WHOLE FOODS MARKET INC | 301 | 931 | 105,438 | 食品・生活必需品小売り |
| NETFLIX INC | 406 | 5,669 | 641,539 | 小売 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 89 | 2,391 | 270,591 | 小売 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 561 | 2,222 | 251,491 | ソフトウェア・サービス |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 177 | 1,631 | 184,564 | 半導体・半導体製造装置 |
| HENRY SCHEIN INC | 77 | 1,239 | 140,251 | ヘルスケア機器・サービス |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 126 | 951 | 107,714 | 小売 |
| LAM RESEARCH CORP | 151 | 1,775 | 200,850 | 半導体・半導体製造装置 |
| WYNN RESORTS LTD | 77 | 746 | 84,464 | 消費者サービス |
| COMCAST CORP-CLASS A | 2,276 | 16,718 | 1,891,728 | メディア |
| XILINX INC | 240 | 1,430 | 161,882 | 半導体・半導体製造装置 |
| PACCAR INC | 332 | 2,274 | 257,344 | 資本財 |
| DENTSPLY SIRONA INC | 220 | 1,254 | 141,949 | ヘルスケア機器・サービス |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 68 | 635 | 71,871 | ヘルスケア機器・サービス |
| GILEAD SCIENCES INC | 1,250 | 8,991 | 1,017,369 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CITRIX SYSTEMS INC | 147 | 1,412 | 159,808 | ソフトウェア・サービス |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 36 | 2,548 | 288,306 | ヘルスケア機器・サービス |
| INTUIT INC | 230 | 2,763 | 312,727 | ソフトウェア・サービス |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC | 253 | 405 | 45,884 | ソフトウェア・サービス |
| PAYCHEX INC | 306 | 1,891 | 213,973 | ソフトウェア・サービス |
| YAHOO! INC | 855 | 3,846 | 435,206 | ソフトウェア・サービス |
| PATTERSON COS INC | 79 | 331 | 37,479 | ヘルスケア機器・サービス |
| SIGNATURE BANK | 50 | 817 | 92,539 | 銀行 |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH | 122 | 1,178 | 133,390 | ソフトウェア・サービス |
| AUTODESK INC | 189 | 1,567 | 177,320 | ソフトウェア・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 235 | 831 | 94,040 | メディア |
| SALESFORCE.COM INC | 610 | 4,787 | 541,727 | ソフトウェア・サービス |
| NORDSTROM INC | 123 | 555 | 62,902 | 小売 |
| ALPHABET INC-CL A | 279 | 23,979 | 2,713,330 | ソフトウェア・サービス |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | 41 | 648 | 73,414 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|-------|---------|-----------|------------------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| B/E AEROSPACE INC | 97 | 598 | 67,672 | 資本財 |
| GARMIN LTD | 107 | 536 | 60,711 | 耐久消費財・アパレル |
| TRIMBLE INC | 236 | 710 | 80,449 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| QUALCOMM INC | 1,396 | 7,945 | 898,990 | 半導体・半導体製造装置 |
| HOLOGIC INC | 236 | 953 | 107,899 | ヘルスケア機器・サービス |
| SYNOPSYS INC | 142 | 894 | 101,263 | ソフトウェア・サービス |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP | 227 | 1,428 | 161,657 | 半導体・半導体製造装置 |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 268 | 1,134 | 128,398 | 半導体・半導体製造装置 |
| AMAZON.COM INC | 381 | 31,951 | 3,615,336 | 小売 |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 234 | 1,738 | 196,709 | 各種金融 |
| QUEST DIAGNOSTICS INC | 131 | 1,208 | 136,772 | ヘルスケア機器・サービス |
| KLA-TENCOR CORP | 148 | 1,256 | 142,144 | 半導体・半導体製造装置 |
| E*TRADE FINANCIAL CORP | 258 | 956 | 108,243 | 各種金融 |
| CERNER CORP | 287 | 1,504 | 170,179 | ヘルスケア機器・サービス |
| BROADCOM LTD | 374 | 7,589 | 858,758 | 半導体・半導体製造装置 |
| ALKERMES PLC | 143 | 799 | 90,501 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VERISIGN INC | 91 | 745 | 84,338 | ソフトウェア・サービス |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC | 289 | 1,716 | 194,209 | 電気通信サービス |
| WASTE CONNECTIONS INC | 166 | 1,309 | 148,197 | 商業・専門サービス |
| EBAY INC | 1,016 | 3,072 | 347,600 | ソフトウェア・サービス |
| NVIDIA CORP | 507 | 5,465 | 618,457 | 半導体・半導体製造装置 |
| DOLLAR TREE INC | 223 | 1,718 | 194,438 | 小売 |
| PRICELINE GROUP INC/THE | 46 | 7,395 | 836,766 | 小売 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 1,154 | 18,958 | 2,145,123 | 各種金融 |
| BB&T CORP | 771 | 3,623 | 409,953 | 銀行 |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 1,010 | 4,539 | 513,634 | 各種金融 |
| BORGWARNER INC | 202 | 838 | 94,835 | 自動車・自動車部品 |
| H&R BLOCK INC | 212 | 491 | 55,602 | 消費者サービス |
| JM SMUCKER CO/THE | 110 | 1,488 | 168,437 | 食品・飲料・タバコ |
| TIME WARNER INC | 737 | 7,054 | 798,234 | メディア |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 180 | 1,550 | 175,460 | ヘルスケア機器・サービス |
| ASSURANT INC | 57 | 562 | 63,646 | 保険 |
| AETNA INC | 332 | 3,958 | 447,868 | ヘルスケア機器・サービス |
| AMEREN CORPORATION | 233 | 1,213 | 137,333 | 公益事業 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 469 | 2,933 | 331,978 | 公益事業 |
| AON PLC | 251 | 2,842 | 321,634 | 保険 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 551 | 2,490 | 281,853 | 食品・飲料・タバコ |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD | 85 | 555 | 62,846 | 保険 |
| HESS CORP | 270 | 1,524 | 172,494 | エネルギー |
| JUNIPER NETWORKS INC | 326 | 918 | 103,968 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP | 249 | 1,166 | 131,951 | 各種金融 |
| RED HAT INC | 171 | 1,313 | 148,651 | ソフトウェア・サービス |
| F5 NETWORKS INC | 62 | 912 | 103,286 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| DISH NETWORK CORP-A | 215 | 1,339 | 151,557 | メディア |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC | 165 | 1,137 | 128,682 | ソフトウェア・サービス |
| NETAPP INC | 263 | 1,000 | 113,208 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| INCYTE CORP | 160 | 1,941 | 219,716 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 412 | 630 | 71,297 | 半導体・半導体製造装置 |
| BIOGEN INC | 207 | 5,673 | 641,993 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ILLUMINA INC | 139 | 2,238 | 253,328 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADOBE SYSTEMS INC | 472 | 5,393 | 610,327 | ソフトウェア・サービス |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 234 | 2,001 | 226,464 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|-------|---------|-----------|------------------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR | 865 | 2,913 | 329,642 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BED BATH & BEYOND INC | 145 | 590 | 66,780 | 小売 |
| CELGENE CORP | 734 | 8,375 | 947,659 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 575 | 3,309 | 374,434 | ソフトウェア・サービス |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO | 596 | 4,156 | 470,279 | ヘルスケア機器・サービス |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 171 | 903 | 102,278 | 運輸 |
| FASTENAL CO | 273 | 1,388 | 157,148 | 資本財 |
| FISERV INC | 208 | 2,265 | 256,372 | ソフトウェア・サービス |
| FLEX LTD | 518 | 785 | 88,831 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 1,646 | 769 | 87,080 | メディア |
| APPLE INC | 5,107 | 62,250 | 7,043,680 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 147 | 1,050 | 118,832 | 保険 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 1,026 | 1,439 | 162,906 | 銀行 |
| COSTAR GROUP INC | 31 | 633 | 71,685 | ソフトウェア・サービス |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 212 | 2,751 | 311,381 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 135 | 1,009 | 114,168 | 運輸 |
| CENTURYLINK INC | 517 | 1,329 | 150,462 | 電気通信サービス |
| FLIR SYSTEMS INC | 131 | 464 | 52,530 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MYLAN NV | 430 | 1,571 | 177,813 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ONEOK INC | 200 | 1,113 | 125,954 | エネルギー |
| REYNOLDS AMERICAN INC | 811 | 4,872 | 551,318 | 食品・飲料・タバコ |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 284 | 1,213 | 137,268 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| BUNGE LTD | 132 | 919 | 103,985 | 食品・飲料・タバコ |
| ADVANCE AUTO PARTS INC | 69 | 1,168 | 132,213 | 小売 |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC | 358 | 1,422 | 160,963 | エネルギー |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 167 | 2,587 | 292,738 | 食品・飲料・タバコ |
| NEWFIELD EXPLORATION CO | 188 | 799 | 90,517 | エネルギー |
| COOPER COS INC/THE | 45 | 826 | 93,539 | ヘルスケア機器・サービス |
| EQT CORP | 163 | 1,047 | 118,520 | エネルギー |
| AMPHENOL CORP-CL A | 293 | 1,964 | 222,277 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| WR BERKLEY CORP | 93 | 632 | 71,511 | 保険 |
| AGCO CORP | 60 | 388 | 43,905 | 資本財 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A | 141 | 391 | 44,282 | メディア |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 378 | 1,633 | 184,782 | 食品・飲料・タバコ |
| EXPEDIA INC | 116 | 1,412 | 159,809 | 小売 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 221 | 809 | 91,554 | 素材 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C | 585 | 1,998 | 226,109 | メディア |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 153 | 1,789 | 202,529 | 各種金融 |
| TESORO CORP | 112 | 924 | 104,651 | エネルギー |
| FNF GROUP | 232 | 799 | 90,444 | 保険 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 563 | 3,265 | 369,526 | 各種金融 |
| NASDAQ INC | 108 | 743 | 84,123 | 各種金融 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 173 | 509 | 57,652 | 耐久消費財・アパレル |
| VIACOM INC-CLASS B | 329 | 1,350 | 152,818 | メディア |
| AUTOLIV INC | 83 | 971 | 109,877 | 自動車・自動車部品 |
| CBRE GROUP INC - A | 285 | 881 | 99,797 | 不動産 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 27 | 1,155 | 130,782 | 消費者サービス |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 200 | 922 | 104,381 | 食品・飲料・タバコ |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A | 402 | 779 | 88,149 | 小売 |
| ARROW ELECTRONICS INC | 86 | 638 | 72,300 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CUMMINS INC | 151 | 2,241 | 253,582 | 資本財 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 114 | 710 | 80,352 | 資本財 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|-------|---------|-----------|------------------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| LEUCADIA NATIONAL CORP | 308 | 739 | 83,710 | 各種金融 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 57 | 1,381 | 156,298 | 素材 |
| RANGE RESOURCES CORP | 175 | 594 | 67,267 | エネルギー |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO | 472 | 454 | 51,400 | エネルギー |
| CIMAREX ENERGY CO | 89 | 1,256 | 142,155 | エネルギー |
| RALPH LAUREN CORP | 53 | 490 | 55,456 | 耐久消費財・アパレル |
| ALLIANT ENERGY CORP | 220 | 812 | 91,880 | 公益事業 |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP | 104 | 835 | 94,491 | 消費者サービス |
| HANESBRANDS INC | 358 | 853 | 96,548 | 耐久消費財・アパレル |
| MASTERCARD INC - A | 918 | 10,125 | 1,145,659 | ソフトウェア・サービス |
| WESTERN UNION CO | 462 | 928 | 105,098 | ソフトウェア・サービス |
| AERCAP HOLDINGS NV | 152 | 665 | 75,347 | 資本財 |
| AVNET INC | 120 | 575 | 65,097 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MOSAIC CO/THE | 315 | 1,048 | 118,595 | 素材 |
| MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR | 180 | 318 | 36,049 | 消費者サービス |
| SPECTRA ENERGY CORP | 665 | 2,884 | 326,340 | エネルギー |
| TRANSDIGM GROUP INC | 50 | 1,127 | 127,566 | 資本財 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 112 | 756 | 85,642 | ソフトウェア・サービス |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 124 | 1,585 | 179,406 | 保険 |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL | 291 | 556 | 62,919 | 銀行 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 336 | 2,532 | 286,566 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 383 | 2,650 | 299,955 | 各種金融 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 103 | 712 | 80,673 | 耐久消費財・アパレル |
| WABCO HOLDINGS INC | 50 | 551 | 62,369 | 資本財 |
| MERCADOLIBRE INC | 38 | 696 | 78,847 | ソフトウェア・サービス |
| VMWARE INC-CLASS A | 70 | 601 | 68,042 | ソフトウェア・サービス |
| LOEWS CORP | 272 | 1,282 | 145,130 | 保険 |
| SEATTLE GENETICS INC | 94 | 549 | 62,157 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ULTA SALON COSMETICS & FRAGR | 56 | 1,525 | 172,571 | 小売 |
| LQY CORP | 290 | 919 | 104,052 | 小売 |
| HORMEL FOODS CORP | 275 | 1,005 | 113,748 | 食品・飲料・タバコ |
| MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR | 75 | 620 | 70,223 | 運輸 |
| EASTMAN CHEMICAL CO | 140 | 1,113 | 125,959 | 素材 |
| HARRIS CORP | 118 | 1,195 | 135,229 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| HUMANA INC | 141 | 2,849 | 322,406 | ヘルスケア機器・サービス |
| MURPHY OIL CORP | 156 | 504 | 57,035 | エネルギー |
| INVESCO LTD | 388 | 1,207 | 136,636 | 各種金融 |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 161 | 1,358 | 153,680 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 129 | 660 | 74,772 | 各種金融 |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC | 156 | 811 | 91,807 | ソフトウェア・サービス |
| CONCHO RESOURCES INC | 133 | 1,907 | 215,801 | エネルギー |
| MSCI INC | 86 | 711 | 80,494 | 各種金融 |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 90 | 470 | 53,226 | エネルギー |
| MOLSON COORS BREWING CO -B | 178 | 1,729 | 195,706 | 食品・飲料・タバコ |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 1,471 | 14,179 | 1,604,404 | 食品・飲料・タバコ |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 1,787 | 14,994 | 1,696,649 | ソフトウェア・サービス |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC | 175 | 1,601 | 181,161 | 食品・飲料・タバコ |
| CORE LABORATORIES N. V. | 42 | 530 | 59,983 | エネルギー |
| CABOT OIL & GAS CORP | 440 | 1,009 | 114,281 | エネルギー |
| FLOWSERVE CORP | 123 | 641 | 72,637 | 資本財 |
| HELMERICH & PAYNE | 102 | 830 | 93,987 | エネルギー |
| T-MOBILE US INC | 273 | 1,660 | 187,831 | 電気通信サービス |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|-------|---------|-----------|------------------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A | 77 | 579 | 65,624 | メディア |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C | 216 | 585 | 66,221 | メディア |
| RESMED INC | 133 | 930 | 105,267 | ヘルスケア機器・サービス |
| GARTNER INC | 79 | 800 | 90,534 | ソフトウェア・サービス |
| AMETEK INC | 220 | 1,154 | 130,593 | 資本財 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 116 | 1,028 | 116,396 | 保険 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 242 | 1,120 | 126,828 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 85 | 844 | 95,531 | 運輸 |
| PERRIGO CO PLC | 135 | 988 | 111,879 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| FMC CORP | 127 | 792 | 89,640 | 素材 |
| WABTEC CORP | 85 | 753 | 85,246 | 資本財 |
| EVERSOURCE ENERGY | 304 | 1,653 | 187,141 | 公益事業 |
| INGREDION INC | 68 | 872 | 98,770 | 食品・飲料・タバコ |
| ALLERGAN PLC | 375 | 8,015 | 906,977 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CROWN HOLDINGS INC | 134 | 723 | 81,814 | 素材 |
| CALPINE CORP | 327 | 387 | 43,814 | 公益事業 |
| EATON VANCE CORP | 104 | 460 | 52,119 | 各種金融 |
| DELTA AIR LINES INC | 180 | 907 | 102,653 | 運輸 |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO | 175 | 1,316 | 148,935 | 食品・飲料・タバコ |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 171 | 1,232 | 139,482 | 公益事業 |
| VERISK ANALYTICS INC | 152 | 1,260 | 142,665 | 商業・専門サービス |
| DOLLAR GENERAL CORP | 266 | 1,919 | 217,227 | 小売 |
| FORTINET INC | 137 | 450 | 50,960 | ソフトウェア・サービス |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS | 78 | 576 | 65,206 | 運輸 |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 25 | 1,053 | 119,237 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CIT GROUP INC | 191 | 829 | 93,817 | 銀行 |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORP | 1,106 | 380 | 43,059 | 電気通信サービス |
| GENERAL MOTORS CO | 1,323 | 5,065 | 573,180 | 自動車・自動車部品 |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 279 | 2,720 | 307,796 | 半導体・半導体製造装置 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 334 | 3,225 | 364,992 | 素材 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 44 | 847 | 95,947 | 資本財 |
| HCA HOLDINGS INC | 288 | 2,320 | 262,582 | ヘルスケア機器・サービス |
| HOLLYFRONTIER CORP | 160 | 495 | 56,099 | エネルギー |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 501 | 2,491 | 281,907 | エネルギー |
| ATMOS ENERGY CORP | 101 | 757 | 85,688 | 公益事業 |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI | 145 | 830 | 94,015 | 資本財 |
| DEXCOM INC | 80 | 647 | 73,230 | ヘルスケア機器・サービス |
| MIDDLEBY CORP | 55 | 754 | 85,401 | 資本財 |
| XYLEM INC | 169 | 850 | 96,256 | 資本財 |
| TRIPADVISOR INC | 114 | 600 | 67,979 | 小売 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 57 | 695 | 78,670 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 142 | 1,352 | 152,987 | 銀行 |
| ALLEGHANY CORP | 14 | 894 | 101,200 | 保険 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 73 | 2,563 | 290,109 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PHILLIPS 66 | 446 | 3,794 | 429,355 | エネルギー |
| FACEBOOK INC-A | 2,201 | 28,944 | 3,275,059 | ソフトウェア・サービス |
| CMS ENERGY CORP | 271 | 1,135 | 128,526 | 公益事業 |
| ALBEMARLE CORP | 106 | 1,002 | 113,465 | 素材 |
| PVH CORP | 76 | 725 | 82,078 | 耐久消費財・アパレル |
| KINDER MORGAN INC | 1,800 | 4,069 | 460,434 | エネルギー |
| NIELSEN HOLDINGS PLC | 339 | 1,391 | 157,392 | 商業・専門サービス |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC | 258 | 1,898 | 214,817 | 自動車・自動車部品 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|-------|---------|-----------|------------------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 162 | 695 | 78,665 | 資本財 |
| SPLUNK INC | 126 | 738 | 83,604 | ソフトウェア・サービス |
| OGI ENERGY CORP | 192 | 652 | 73,777 | 公益事業 |
| POLARIS INDUSTRIES INC | 58 | 522 | 59,078 | 耐久消費財・アパレル |
| ABBVIE INC | 1,544 | 9,477 | 1,072,344 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TESLA MOTORS INC | 122 | 3,106 | 351,450 | 自動車・自動車部品 |
| CHENIERE ENERGY INC | 191 | 925 | 104,713 | エネルギー |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 120 | 912 | 103,193 | 各種金融 |
| ZOETIS INC | 446 | 2,413 | 273,066 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MALLINCKRODT PLC | 103 | 485 | 54,891 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NEWS CORP - CLASS A | 358 | 441 | 49,909 | メディア |
| SPRINT CORP | 756 | 695 | 78,666 | 電気通信サービス |
| SNAP-ON INC | 54 | 983 | 111,321 | 資本財 |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD | 159 | 683 | 77,334 | 耐久消費財・アパレル |
| TWITTER INC | 536 | 898 | 101,614 | ソフトウェア・サービス |
| VANTIV INC - CL A | 149 | 938 | 106,217 | ソフトウェア・サービス |
| WORKDAY INC-CLASS A | 113 | 958 | 108,459 | ソフトウェア・サービス |
| SERVICENOW INC | 156 | 1,349 | 152,652 | ソフトウェア・サービス |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 85 | 973 | 110,106 | ヘルスケア機器・サービス |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 87 | 1,324 | 149,890 | ソフトウェア・サービス |
| ALPHABET INC-CL C | 293 | 24,501 | 2,772,289 | ソフトウェア・サービス |
| NAVIENT CORP | 305 | 480 | 54,391 | 各種金融 |
| ENDO INTERNATIONAL PLC | 200 | 238 | 26,997 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| UNITED RENTALS INC | 81 | 936 | 105,987 | 資本財 |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 128 | 615 | 69,698 | 運輸 |
| VOYA FINANCIAL INC | 189 | 771 | 87,349 | 各種金融 |
| ANTERO RESOURCES CORP | 144 | 371 | 42,091 | エネルギー |
| QUINTILES IMS HOLDINGS INC | 140 | 1,060 | 120,006 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALLY FINANCIAL INC | 413 | 811 | 91,796 | 各種金融 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 187 | 1,103 | 124,845 | 消費者サービス |
| CDK GLOBAL INC | 121 | 760 | 86,007 | ソフトウェア・サービス |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 84 | 883 | 99,912 | エネルギー |
| LIBERTY BROADBAND-C | 101 | 809 | 91,642 | メディア |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | 150 | 725 | 82,056 | 消費者サービス |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 85 | 1,242 | 140,633 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SIGNET JEWELERS LTD | 67 | 563 | 63,799 | 小売 |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 790 | 2,839 | 321,282 | 各種金融 |
| QORVO INC | 121 | 775 | 87,757 | 半導体・半導体製造装置 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 167 | 902 | 102,171 | 保険 |
| ACUTY BRANDS INC | 41 | 876 | 99,186 | 資本財 |
| JONES LANG LASALLE INC | 42 | 436 | 49,381 | 不動産 |
| ARAMARK | 220 | 740 | 83,794 | 消費者サービス |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 491 | 1,843 | 208,622 | 銀行 |
| LEAR CORP | 67 | 993 | 112,439 | 自動車・自動車部品 |
| WHITEWAVE FOODS CO | 168 | 930 | 105,321 | 食品・飲料・タバコ |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 207 | 607 | 68,733 | 素材 |
| RITE AID CORP | 999 | 689 | 78,053 | 食品・生活必需品小売り |
| TARGA RESOURCES CORP | 158 | 939 | 106,300 | エネルギー |
| LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C | 106 | 237 | 26,919 | メディア |
| WESTROCK CO | 238 | 1,324 | 149,845 | 素材 |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 577 | 5,126 | 580,024 | 食品・飲料・タバコ |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 1,029 | 4,292 | 485,724 | ソフトウェア・サービス |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|--------------|---------|-----------|------------------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| ZILLOW GROUP INC - C | 108 | 397 | 44,932 | ソフトウェア・サービス |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRIS | 1,574 | 3,618 | 409,386 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MOBILEYE NV | 167 | 735 | 83,274 | ソフトウェア・サービス |
| AMERCO | 6 | 255 | 28,939 | 運輸 |
| CDW CORP/DE | 140 | 725 | 82,035 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MEDNAX INC | 88 | 618 | 69,929 | ヘルスケア機器・サービス |
| SABRE CORP | 202 | 497 | 56,278 | ソフトウェア・サービス |
| FIRST DATA CORP- CLASS A | 290 | 462 | 52,347 | ソフトウェア・サービス |
| WR GRACE & CO | 67 | 476 | 53,916 | 素材 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C | 179 | 459 | 52,032 | 耐久消費財・アパレル |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | 189 | 661 | 74,898 | メディア |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A | 88 | 312 | 35,312 | メディア |
| DOMINO'S PIZZA INC | 46 | 784 | 88,779 | 消費者サービス |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 205 | 6,374 | 721,297 | メディア |
| IDEXX LABORATORIES INC | 85 | 1,031 | 116,759 | ヘルスケア機器・サービス |
| SMITH (A.O.) CORP | 140 | 691 | 78,270 | 資本財 |
| UGI CORP | 168 | 777 | 88,012 | 公益事業 |
| WESTAR ENERGY INC | 138 | 754 | 85,318 | 公益事業 |
| FORTIVE CORP | 294 | 1,625 | 183,953 | 資本財 |
| IHS MARKIT LTD | 341 | 1,357 | 153,548 | 商業・専門サービス |
| XL GROUP LTD | 259 | 984 | 111,385 | 保険 |
| DELL TECHNOLOGIES INC-CL V | 211 | 1,267 | 143,391 | ソフトウェア・サービス |
| ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC | 59 | 687 | 77,773 | 素材 |
| COTY INC-CL A | 460 | 898 | 101,700 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| ARCONIC INC | 416 | 945 | 106,964 | 資本財 |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A | 171 | 623 | 70,546 | エネルギー |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 61 | 764 | 86,532 | 保険 |
| SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC | 26 | 319 | 36,167 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| TELEFLEX INC | 42 | 699 | 79,130 | ヘルスケア機器・サービス |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC | 152 | 484 | 54,794 | 電気通信サービス |
| ENVISION HEALTHCARE CORP | 111 | 767 | 86,848 | ヘルスケア機器・サービス |
| TECHNIPFMC PLC | 423 | 1,494 | 169,142 | エネルギー |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 1,110 | 757 | 85,656 | 不動産 |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 240 | 1,466 | 165,896 | 資本財 |
| 小 計 | 株 数 | 金 額 | | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | | | |
| | 600 | 294,690 | 1,924,206 | 217,724,018 |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | |
| ROYAL BANK OF CANADA | 1,406 | 13,214 | 1,145,211 | 銀行 |
| IMPERIAL OIL LTD | 283 | 1,251 | 108,424 | エネルギー |
| THOMSON REUTERS CORP | 316 | 1,872 | 162,253 | 各種金融 |
| TRANSCANADA CORP | 813 | 5,241 | 454,220 | エネルギー |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B | 344 | 1,808 | 156,746 | 電気通信サービス |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 580 | 3,022 | 261,919 | 保険 |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B | 537 | 1,845 | 159,899 | 素材 |
| BARRICK GOLD CORP | 1,104 | 2,605 | 225,787 | 素材 |
| BCE INC | 139 | 810 | 70,274 | 電気通信サービス |
| AGRIUM INC | 124 | 1,774 | 153,805 | 素材 |
| BOMBARDIER INC-B | 1,857 | 482 | 41,841 | 資本財 |
| BANK OF MONTREAL | 609 | 6,105 | 529,131 | 銀行 |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 821 | 3,747 | 324,789 | 各種金融 |
| BANK OF NOVA SCOTIA | 1,137 | 8,897 | 771,016 | 銀行 |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTE | 308 | 564 | 48,898 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

| 銘柄 | 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 | 千カナダドル | 千円 | |
| CAE INC | 253 | 477 | 41,350 | 資本財 |
| CAMECO CORP | 374 | 628 | 54,450 | エネルギー |
| CI FINANCIAL CORP | 233 | 653 | 56,658 | 各種金融 |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 372 | 4,181 | 362,381 | 銀行 |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES | 1,043 | 4,172 | 361,545 | エネルギー |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 734 | 6,707 | 581,253 | 運輸 |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A | 65 | 925 | 80,195 | 小売 |
| ENBRIDGE INC | 888 | 5,132 | 444,794 | エネルギー |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 22 | 1,353 | 117,329 | 保険 |
| CGI GROUP INC - CLASS A | 205 | 1,298 | 112,543 | ソフトウェア・サービス |
| HUSKY ENERGY INC | 332 | 576 | 49,919 | エネルギー |
| IGM FINANCIAL INC | 91 | 371 | 32,222 | 各種金融 |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 211 | 1,474 | 127,740 | 食品・生活必需品小売り |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 1,868 | 4,740 | 410,853 | 保険 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 368 | 2,119 | 183,659 | 自動車・自動車部品 |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 318 | 1,794 | 155,536 | 銀行 |
| ONEX CORPORATION | 81 | 721 | 62,508 | 各種金融 |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN | 795 | 2,064 | 178,919 | 素材 |
| POWER CORP OF CANADA | 356 | 1,120 | 97,118 | 保険 |
| POWER FINANCIAL CORP | 238 | 828 | 71,754 | 保険 |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 393 | 1,100 | 95,326 | メディア |
| SUNCOR ENERGY INC | 1,579 | 6,661 | 577,311 | エネルギー |
| WESTON (GEORGE) LTD | 49 | 554 | 48,030 | 食品・生活必需品小売り |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 133 | 2,680 | 232,255 | 運輸 |
| ENCANA CORP | 907 | 1,628 | 141,166 | エネルギー |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 211 | 1,264 | 109,546 | 素材 |
| FINNING INTERNATIONAL INC | 159 | 432 | 37,506 | 資本財 |
| GOLDCORP INC | 806 | 1,689 | 146,401 | 素材 |
| KINROSS GOLD CORP | 1,167 | 567 | 49,150 | 素材 |
| SNC-LAVALIN GROUP INC | 142 | 816 | 70,720 | 資本財 |
| GREAT-WEST LIFE CO INC | 282 | 1,028 | 89,125 | 保険 |
| METHANEX CORP | 86 | 527 | 45,730 | 素材 |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 948 | 452 | 39,187 | 素材 |
| JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A | 80 | 168 | 14,621 | 食品・生活必需品小売り |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 209 | 706 | 61,200 | 耐久消費財・アパレル |
| SAPUTO INC | 242 | 1,168 | 101,293 | 食品・飲料・タバコ |
| BLACKBERRY LTD | 469 | 448 | 38,895 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TELUS CORP | 116 | 509 | 44,170 | 電気通信サービス |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 653 | 1,119 | 97,050 | 素材 |
| YAMANA GOLD INC | 910 | 387 | 33,594 | 素材 |
| FORTIS INC | 383 | 1,592 | 137,974 | 公益事業 |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B | 398 | 2,424 | 210,082 | 食品・生活必需品小売り |
| ELDORADO GOLD CORP | 698 | 321 | 27,824 | 素材 |
| TORONTO-DOMINION BANK | 1,756 | 11,940 | 1,034,789 | 銀行 |
| FRANCO-NEVADA CORP | 168 | 1,415 | 122,629 | 素材 |
| SILVER WHEATON CORP | 416 | 1,179 | 102,239 | 素材 |
| EMPIRE CO LTD 'A' | 153 | 250 | 21,718 | 食品・生活必需品小売り |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC | 96 | 540 | 46,829 | 保険 |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A | 124 | 462 | 40,060 | 公益事業 |
| METRO INC | 223 | 897 | 77,745 | 食品・生活必需品小売り |
| OPEN TEXT CORP | 248 | 1,111 | 96,304 | ソフトウェア・サービス |
| INTACT FINANCIAL CORP | 124 | 1,167 | 101,215 | 保険 |

| 銘柄 | 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 | 千カナダドル | 千円 | |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP | 512 | 819 | 70,991 | エネルギー |
| CENOVUS ENERGY INC | 793 | 1,487 | 128,921 | エネルギー |
| ARC RESOURCES LTD | 334 | 716 | 62,085 | エネルギー |
| TOURMALINE OIL CORP | 202 | 627 | 54,354 | エネルギー |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 374 | 1,566 | 135,736 | エネルギー |
| VERMILION ENERGY INC | 111 | 611 | 52,954 | エネルギー |
| DOLLARAMA INC | 107 | 1,075 | 93,208 | 小売 |
| KEYERA CORP | 178 | 703 | 60,976 | エネルギー |
| ALTAGAS LTD | 157 | 523 | 45,333 | エネルギー |
| PEYTO EXPLORATION & DEV CORP | 155 | 451 | 39,087 | エネルギー |
| ATCO LTD -CLASS I | 78 | 359 | 31,174 | 公益事業 |
| FIRST CAPITAL REALTY INC | 123 | 258 | 22,384 | 不動産 |
| INTER PIPELINE LTD | 343 | 989 | 85,725 | エネルギー |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD | 191 | 600 | 52,013 | エネルギー |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A | 230 | 629 | 54,553 | エネルギー |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 18 | 1,079 | 93,555 | ソフトウェア・サービス |
| RESTAURANT BRANDS INTERN | 211 | 1,364 | 118,251 | 消費者サービス |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 61 | 277 | 24,020 | 素材 |
| VERESEN INC | 301 | 415 | 35,970 | エネルギー |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B | 26 | 696 | 60,384 | 素材 |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR | 371 | 483 | 41,860 | 各種金融 |
| LINAMAR CORP | 45 | 266 | 23,066 | 自動車・自動車部品 |
| HYDRO ONE LTD | 182 | 443 | 38,420 | 公益事業 |
| EMERA INC | 52 | 239 | 20,778 | 公益事業 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 38,709 91 | 158,486 — < 3.8% > | |
| (ユーロ…ドイツ) | | | 千ユーロ | |
| COMMERZBANK AG | 1,008 | 830 | 101,086 | 銀行 |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED | 1,308 | 2,538 | 309,067 | 各種金融 |
| METRO AG | 170 | 541 | 65,924 | 食品・生活必需品小売り |
| SIEMENS AG-REG | 724 | 8,675 | 1,056,328 | 資本財 |
| RWE AG | 471 | 597 | 72,707 | 公益事業 |
| BASF SE | 869 | 7,855 | 956,437 | 素材 |
| VOLKSWAGEN AG | 30 | 483 | 58,862 | 自動車・自動車部品 |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 912 | 6,601 | 803,772 | 自動車・自動車部品 |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 167 | 1,924 | 234,312 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| E.ON SE | 1,911 | 1,405 | 171,161 | 公益事業 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 314 | 2,791 | 339,873 | 自動車・自動車部品 |
| BAYER AG-REG | 783 | 8,169 | 994,749 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LINDE AG | 176 | 2,691 | 327,665 | 素材 |
| ALLIANZ SE-REG | 432 | 7,027 | 855,645 | 保険 |
| MAN SE | 33 | 318 | 38,743 | 資本財 |
| CONTINENTAL AG | 104 | 1,953 | 237,875 | 自動車・自動車部品 |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 1,073 | 1,810 | 220,386 | 半導体・半導体製造装置 |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF | 144 | 840 | 102,309 | 自動車・自動車部品 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 229 | 288 | 35,172 | 運輸 |
| HUGO BOSS AG -ORD | 62 | 379 | 46,188 | 耐久消費財・アパレル |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 919 | 2,937 | 357,716 | 運輸 |
| SAP SE | 931 | 7,882 | 959,734 | ソフトウェア・サービス |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE | 221 | 878 | 106,961 | メディア |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & | 203 | 1,524 | 185,630 | ヘルスケア機器・サービス |
| FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT | 41 | 232 | 28,331 | 運輸 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|---------------------------|--------------|--------------|------------------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…ドイツ) | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| ADIDAS AG | 178 | 2,742 | 333,930 | 耐久消費財・アパレル |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 3,103 | 5,066 | 616,908 | 電気通信サービス |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 151 | 2,689 | 327,481 | 保険 |
| THYSSENKRUPP AG | 349 | 848 | 103,304 | 素材 |
| BEIERSDORF AG | 94 | 779 | 94,852 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 140 | 1,285 | 156,576 | 素材 |
| MERCK KGAA | 122 | 1,240 | 150,996 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VOLKSWAGEN AG-PREF | 175 | 2,704 | 329,316 | 自動車・自動車部品 |
| LANXESS AG | 87 | 592 | 72,085 | 素材 |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 388 | 2,865 | 348,938 | ヘルスケア機器・サービス |
| HOCHTIEF AG | 20 | 272 | 33,138 | 資本財 |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR | 319 | 937 | 114,092 | 不動産 |
| GEA GROUP AG | 173 | 672 | 81,838 | 資本財 |
| SYMRISE AG | 117 | 673 | 81,967 | 素材 |
| K+S AG-REG | 178 | 443 | 54,020 | 素材 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 99 | 983 | 119,747 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 115 | 446 | 54,326 | ソフトウェア・サービス |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 51 | 373 | 45,504 | 自動車・自動車部品 |
| HANNOVER RUECK SE | 56 | 587 | 71,529 | 保険 |
| BRENTAG AG | 146 | 791 | 96,364 | 資本財 |
| AXEL SPRINGER SE | 39 | 193 | 23,525 | メディア |
| FUCHS PETROLUB SE -PREF | 65 | 286 | 34,836 | 素材 |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 704 | 290 | 35,361 | 電気通信サービス |
| OSRAM LICHT AG | 82 | 436 | 53,145 | 資本財 |
| VONOVIA SE | 442 | 1,326 | 161,572 | 不動産 |
| EVONIK INDUSTRIES AG | 151 | 454 | 55,329 | 素材 |
| ZALANDO SE | 82 | 296 | 36,076 | 小売 |
| COVESTRO AG | 66 | 465 | 56,703 | 素材 |
| SCHAEFFLER AG | 163 | 255 | 31,090 | 自動車・自動車部品 |
| DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER | 182 | 1,502 | 182,959 | 各種金融 |
| INNOGY SE | 137 | 438 | 53,412 | 公益事業 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 21,438 56 | 104,119 — | 12,677,578 < 3.5% > |
| (ユーロ…イタリア) | | | | |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 1,105 | 1,720 | 209,499 | 保険 |
| INTESA SANPAOLO | 12,012 | 2,762 | 336,419 | 銀行 |
| TELECOM ITALIA SPA | 9,645 | 793 | 96,658 | 電気通信サービス |
| ENI SPA | 2,412 | 3,654 | 445,032 | エネルギー |
| UNICREDIT SPA | 497 | 1,461 | 177,953 | 銀行 |
| ENEL SPA | 7,255 | 2,910 | 354,433 | 公益事業 |
| SAIPEM SPA | 5,772 | 305 | 37,249 | エネルギー |
| ATLANTIA SPA | 392 | 863 | 105,193 | 運輸 |
| INTESA SANPAOLO-RSP | 899 | 193 | 23,601 | 銀行 |
| LUXOTTICA GROUP SPA | 159 | 803 | 97,869 | 耐久消費財・アパレル |
| MEDIOBANCA SPA | 532 | 467 | 56,971 | 銀行 |
| SNAM SPA | 2,332 | 855 | 104,182 | エネルギー |
| TELECOM ITALIA-RSP | 5,629 | 384 | 46,849 | 電気通信サービス |
| LEONARDO SPA | 385 | 495 | 60,367 | 資本財 |
| TERNA SPA | 1,468 | 620 | 75,512 | 公益事業 |
| UNIPOLSAI SPA | 1,080 | 225 | 27,410 | 保険 |
| PRYSMIAN SPA | 182 | 454 | 55,324 | 資本財 |

| 銘柄 | 株数 | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|------------|--------|-----------|------------------------|
| | | 評価額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…イタリア) | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| POSTE ITALIANE SPA | 490 | 302 | 36,811 | 保険 |
| 小計 | 株数・金額 | | | |
| | 銘柄数 < 比率 > | | | |
| (ユーロ…フランス) | 18 | — | < 0.7% > | |
| MICHELIN (CGDE) | 172 | 1,761 | 214,528 | 自動車・自動車部品 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 264 | 5,060 | 616,133 | 耐久消費財・アパレル |
| PEUGEOT SA | 457 | 813 | 99,074 | 自動車・自動車部品 |
| AXA SA | 1,834 | 4,281 | 521,338 | 保険 |
| DANONE | 559 | 3,295 | 401,236 | 食品・飲料・タバコ |
| CARREFOUR SA | 538 | 1,264 | 153,961 | 食品・生活必需品小売り |
| VIVENDI | 973 | 1,704 | 207,536 | メディア |
| INGENICO GROUP | 52 | 413 | 50,295 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SOCIETE GENERALE SA | 726 | 3,470 | 422,585 | 銀行 |
| AIR LIQUIDE SA | 368 | 3,817 | 464,772 | 素材 |
| TOTAL SA | 2,135 | 10,254 | 1,248,548 | エネルギー |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN | 472 | 2,257 | 274,825 | 資本財 |
| ZODIAC AEROSPACE | 190 | 539 | 65,721 | 資本財 |
| VINCI SA | 479 | 3,196 | 389,169 | 資本財 |
| SANOFI | 1,099 | 8,159 | 993,482 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 464 | 737 | 89,758 | 公益事業 |
| L'OREAL | 238 | 4,086 | 497,550 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| ACCOR SA | 162 | 626 | 76,296 | 消費者サービス |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 532 | 3,657 | 445,318 | 資本財 |
| BNP PARIBAS | 1,004 | 6,264 | 762,805 | 銀行 |
| ESSILOR INTERNATIONAL | 196 | 2,113 | 257,340 | ヘルスケア機器・サービス |
| CAPGEMINI | 154 | 1,186 | 144,415 | ソフトウェア・サービス |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 54 | 279 | 34,005 | 食品・生活必需品小売り |
| VALEO SA | 225 | 1,308 | 159,355 | 自動車・自動車部品 |
| HERMES INTERNATIONAL | 24 | 1,022 | 124,504 | 耐久消費財・アパレル |
| SODEXO | 87 | 903 | 109,974 | 消費者サービス |
| KERING | 71 | 1,651 | 201,140 | 耐久消費財・アパレル |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 122 | 873 | 106,340 | ソフトウェア・サービス |
| CHRISTIAN DIOR SE | 51 | 1,054 | 128,439 | 耐久消費財・アパレル |
| ATOS SE | 84 | 848 | 103,307 | ソフトウェア・サービス |
| ORANGE | 1,889 | 2,745 | 334,253 | 電気通信サービス |
| CNP ASSURANCES | 165 | 293 | 35,696 | 保険 |
| IMERYS SA | 34 | 263 | 32,024 | 素材 |
| SAFRAN SA | 296 | 1,922 | 234,033 | 資本財 |
| RENAULT SA | 181 | 1,595 | 194,285 | 自動車・自動車部品 |
| PUBLICIS GROUPE | 181 | 1,181 | 143,878 | メディア |
| LAGARDERE SCA | 111 | 269 | 32,786 | メディア |
| JCDECAUX SA | 72 | 221 | 26,926 | メディア |
| SOCIETE BIC SA | 26 | 328 | 39,960 | 商業・専門サービス |
| BOUYGUES SA | 196 | 689 | 83,918 | 資本財 |
| THALES SA | 99 | 871 | 106,094 | 資本財 |
| PERNOD RICARD SA | 201 | 2,191 | 266,867 | 食品・飲料・タバコ |
| CREDIT AGRICOLE SA | 1,067 | 1,335 | 162,550 | 銀行 |
| ENGIE | 1,500 | 1,723 | 209,892 | 公益事業 |
| ALSTOM | 144 | 381 | 46,433 | 資本財 |
| ARKEMA | 64 | 611 | 74,479 | 素材 |
| LEGRAND SA | 253 | 1,376 | 167,658 | 資本財 |
| SCOR SE | 156 | 507 | 61,740 | 保険 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|---------------------------|--------------|--------------|------------------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…フランス) | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| ADP | 29 | 307 | 37,440 | 運輸 |
| EDF | 250 | 242 | 29,565 | 公益事業 |
| NATIXIS | 909 | 517 | 62,974 | 銀行 |
| WENDEL | 28 | 320 | 39,044 | 各種金融 |
| BUREAU VERITAS SA | 259 | 477 | 58,115 | 商業・専門サービス |
| EURAZEO | 37 | 214 | 26,091 | 各種金融 |
| SUEZ | 319 | 452 | 55,102 | 公益事業 |
| EIFFAGE | 57 | 390 | 47,520 | 資本財 |
| ILIAD SA | 24 | 481 | 58,683 | 電気通信サービス |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 166 | 288 | 35,066 | メディア |
| GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR | 448 | 394 | 48,059 | 運輸 |
| EDENRED | 199 | 414 | 50,466 | 商業・専門サービス |
| REMY COINTREAU | 20 | 172 | 21,039 | 食品・飲料・タバコ |
| REXEL SA | 291 | 480 | 58,498 | 資本財 |
| BOLLORE | 841 | 321 | 39,107 | 運輸 |
| SFR GROUP SA | 86 | 237 | 28,894 | 電気通信サービス |
| DASSAULT AVIATION SA | 2 | 221 | 26,986 | 資本財 |
| SEB SA | 21 | 255 | 31,126 | 耐久消費財・アパレル |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 24,434 66 | 101,601 — | 12,371,027 < 3.4% > |
| (ユーロ…オランダ) | | | | |
| QIAGEN N.V. | 204 | 527 | 64,178 | ヘルスケア機器・サービス |
| CNH INDUSTRIAL NV | 970 | 842 | 102,585 | 資本財 |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 853 | 871 | 106,128 | 自動車・自動車部品 |
| FERRARI NV | 118 | 686 | 83,548 | 自動車・自動車部品 |
| EXOR NV | 104 | 449 | 54,757 | 各種金融 |
| AIRBUS SE | 549 | 3,594 | 437,712 | 資本財 |
| STMICROELECTRONICS NV | 605 | 678 | 82,587 | 半導体・半導体製造装置 |
| GEMALTO | 76 | 408 | 49,795 | ソフトウェア・サービス |
| WOLTERS KLUWER | 286 | 997 | 121,431 | 商業・専門サービス |
| KONINKLIJKE KPN NV | 3,246 | 871 | 106,073 | 電気通信サービス |
| AKZO NOBEL | 234 | 1,507 | 183,594 | 素材 |
| HEINEKEN NV | 218 | 1,540 | 187,612 | 食品・飲料・タバコ |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 897 | 2,488 | 302,977 | 資本財 |
| RELX NV | 944 | 1,461 | 177,989 | 商業・専門サービス |
| AEGON NV | 1,736 | 904 | 110,185 | 保険 |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 1,212 | 2,415 | 294,120 | 食品・生活必需品小売り |
| RANDSTAD HOLDING NV | 112 | 622 | 75,797 | 商業・専門サービス |
| HEINEKEN HOLDING NV | 96 | 636 | 77,479 | 食品・飲料・タバコ |
| KONINKLIJKE DSM NV | 171 | 1,027 | 125,124 | 素材 |
| ING GROEP NV | 3,675 | 5,018 | 611,022 | 銀行 |
| ASML HOLDING NV | 349 | 3,981 | 484,841 | 半導体・半導体製造装置 |
| UNILEVER NV-CVA | 1,542 | 6,072 | 739,332 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| VOPAK | 68 | 292 | 35,602 | エネルギー |
| BOSKALIS WESTMINSTER | 85 | 301 | 36,655 | 資本財 |
| NN GROUP NV | 296 | 987 | 120,216 | 保険 |
| ALTICE NV - B | 96 | 190 | 23,162 | メディア |
| ALTICE NV - A | 359 | 705 | 85,933 | メディア |
| ABN AMRO GROUP NV-CVA | 272 | 597 | 72,778 | 銀行 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 19,384 28 | 40,680 — | 4,953,227 < 1.4% > |

| 銘柄 | 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 | 千ユーロ | 千円 | | |
| BANCO POPULAR ESPANOL | 3,179 | 320 | 38,986 | 銀行 | |
| ENDESA SA | 303 | 583 | 71,049 | 公益事業 | |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 179 | 528 | 64,297 | 資本財 | |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y-RTS | 179 | 7 | 958 | 資本財 | |
| IBERDROLA SA | 5,131 | 3,048 | 371,135 | 公益事業 | |
| TELEFONICA SA | 4,407 | 4,038 | 491,743 | 電気通信サービス | |
| BANCO SANTANDER SA | 13,831 | 7,428 | 904,532 | 銀行 | |
| BANKINTER SA | 643 | 493 | 60,147 | 銀行 | |
| REPSOL SA | 1,040 | 1,482 | 180,538 | エネルギー | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 6,223 | 4,023 | 489,905 | 銀行 | |
| GAS NATURAL SDG SA | 336 | 589 | 71,735 | 公益事業 | |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL | 1,030 | 3,206 | 390,364 | 小売 | |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA | 613 | 827 | 100,781 | 運輸 | |
| MAPPRE SA | 996 | 286 | 34,846 | 保険 | |
| FERROVIAL SA | 463 | 798 | 97,187 | 資本財 | |
| ZARDOYA OTIS SA | 171 | 135 | 16,549 | 資本財 | |
| ENAGAS SA | 221 | 503 | 61,269 | 公益事業 | |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 418 | 703 | 85,698 | 公益事業 | |
| BANCO DE SABADELL SA | 5,008 | 692 | 84,279 | 銀行 | |
| CAIXABANK S.A | 3,110 | 1,106 | 134,710 | 銀行 | |
| GRIFOLS SA | 285 | 557 | 67,942 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| AMADEUS IT GROUP SA | 414 | 1,792 | 218,286 | ソフトウェア・サービス | |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI | 803 | 468 | 57,060 | 運輸 | |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL | 591 | 285 | 34,780 | 食品・生活必需品小売り | |
| BANKIA SA | 4,283 | 427 | 52,108 | 銀行 | |
| AENA SA | 64 | 857 | 104,418 | 運輸 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 53,933 | 35,194 | 4,285,315 | |
| (ユーロ…ベルギー) | | | | | |
| AGEAS | 184 | 736 | 89,615 | 保険 | |
| UCB SA | 119 | 754 | 91,868 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 76 | 614 | 74,839 | 各種金融 | |
| UMICORE | 90 | 472 | 57,540 | 素材 | |
| COLRUYT SA | 62 | 283 | 34,485 | 食品・生活必需品小売り | |
| KBC GROEP NV | 237 | 1,444 | 175,904 | 銀行 | |
| SOLVAY SA | 70 | 778 | 94,770 | 素材 | |
| PROXIMUS | 141 | 382 | 46,534 | 電気通信サービス | |
| TELENET GROUP HOLDING NV | 52 | 260 | 31,669 | メディア | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 722 | 7,156 | 871,369 | 食品・飲料・タバコ | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 1,757 | 12,882 | 1,568,599 | |
| (ユーロ…オーストリア) | | | | | |
| ERSTE GROUP BANK AG | 287 | 827 | 100,806 | 銀行 | |
| OMV AG | 141 | 482 | 58,734 | エネルギー | |
| VOESTALPINE AG | 105 | 425 | 51,829 | 素材 | |
| ANDRITZ AG | 68 | 346 | 42,130 | 資本財 | |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA | 111 | 238 | 29,052 | 銀行 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 715 | 2,320 | 282,553 | |
| (ユーロ…ルクセンブルク) | | | | | |
| RTL GROUP | 36 | 258 | 31,485 | メディア | |
| TENARIS SA | 446 | 767 | 93,450 | エネルギー | |

| 銘柄 | 株数 | 期末 | | 業種等 | |
|-------------------------------|------------------|----------|-----------|------------------------|----|
| | | 評価額 | | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ユーロ…ルクセンブルク) | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| SES | 346 | 687 | 83,682 | メディア | |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 10 | 436 | 53,184 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| ARCELORMITTAL | 1,743 | 1,313 | 159,916 | 素材 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 2,582 | 3,463 | 421,720 | |
| | | 5 | — | <0.1%> | |
| (ユーロ…フィンランド) | | | | | |
| NOKIA OYJ | 5,530 | 2,354 | 286,722 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| STORA ENSO OYJ-R SHS | 526 | 582 | 70,959 | 素材 | |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | 109 | 387 | 47,175 | 自動車・自動車部品 | |
| UPM-KYMMENE OYJ | 504 | 1,235 | 150,466 | 素材 | |
| FORTUM OYJ | 427 | 643 | 78,375 | 公益事業 | |
| KONE OYJ-B | 318 | 1,437 | 175,005 | 資本財 | |
| METSO OYJ | 107 | 311 | 37,877 | 資本財 | |
| SAMPO OYJ-A SHS | 422 | 1,809 | 220,289 | 保険 | |
| WARTSILA OYJ ABP | 140 | 620 | 75,498 | 資本財 | |
| ELISA OYJ | 134 | 428 | 52,140 | 電気通信サービス | |
| NESTE OYJ | 124 | 404 | 49,294 | エネルギー | |
| ORION OYJ-CLASS B | 96 | 414 | 50,450 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 8,444 | 10,629 | 1,294,255 | |
| | | 12 | — | <0.4%> | |
| (ユーロ…アイルランド) | | | | | |
| KERRY GROUP PLC-A | 154 | 1,009 | 122,859 | 食品・飲料・タバコ | |
| PADDY POWER BETFAIR PLC | 80 | 743 | 90,579 | 消費者サービス | |
| IRISH BANK RESOLUTION CORPORA | 472 | — | — | 銀行 | |
| BANK OF IRELAND | 26,598 | 694 | 84,527 | 銀行 | |
| CRH PLC | 794 | 2,704 | 329,292 | 素材 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 28,099 | 5,151 | 627,259 | |
| | | 5 | — | <0.2%> | |
| (ユーロ…ポルトガル) | | | | | |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 2,239 | 605 | 73,676 | 公益事業 | |
| JERONIMO MARTINS | 235 | 368 | 44,842 | 食品・生活必需品小売り | |
| GALP ENERGIA SGPS SA | 476 | 667 | 81,229 | エネルギー | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 2,951 | 1,640 | 199,748 | |
| | | 3 | — | <0.1%> | |
| (ユーロ…イギリス) | | | | | |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS | 208 | 675 | 82,284 | 食品・飲料・タバコ | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 208 | 675 | 82,284 | |
| | | 1 | — | <0.0%> | |
| ユーロ計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 216,204 | 337,638 | 41,110,912 | |
| | | 235 | — | <11.4%> | |
| (イギリス) | | | | | |
| BARCLAYS PLC | 16,038 | 千イギリスポンド | 3,702 | 529,416 | 銀行 |
| BP PLC | 17,812 | 8,693 | 1,243,076 | エネルギー | |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 60,897 | 3,991 | 570,704 | 銀行 | |
| ASTRAZENECA PLC | 1,198 | 5,107 | 730,302 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| SMITHS GROUP PLC | 374 | 559 | 79,949 | 資本財 | |
| NEXT PLC | 132 | 511 | 73,161 | 小売 | |
| DIAGEO PLC | 2,386 | 5,109 | 730,597 | 食品・飲料・タバコ | |
| SKY PLC | 982 | 985 | 140,881 | メディア | |
| BAE SYSTEMS PLC | 3,008 | 1,806 | 258,308 | 資本財 | |
| UNILEVER PLC | 1,215 | 4,070 | 582,003 | 家庭用品・パーソナル用品 | |
| TESCO PLC | 7,760 | 1,462 | 209,127 | 食品・生活必需品小売り | |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|--------|----------|-----------|------------------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (イギリス) | 百株 | 千イギリスポンド | 千円 | |
| RELX PLC | 1,035 | 1,459 | 208,674 | 商業・専門サービス |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC | 1,536 | 525 | 75,210 | 小売 |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 598 | 4,075 | 582,802 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| PRUDENTIAL PLC | 2,444 | 3,858 | 551,733 | 保険 |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 5,639 | 1,361 | 194,678 | 保険 |
| SAGE GROUP PLC/THE | 1,026 | 650 | 92,971 | ソフトウェア・サービス |
| HSBC HOLDINGS PLC | 18,847 | 12,774 | 1,826,662 | 銀行 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 1,768 | 8,654 | 1,237,507 | 食品・飲料・タバコ |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 670 | 600 | 85,907 | 公益事業 |
| SCHRODERS PLC | 125 | 376 | 53,883 | 各種金融 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 3,348 | 761 | 108,938 | 銀行 |
| BHP BILLITON PLC | 2,001 | 2,917 | 417,213 | 素材 |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 909 | 3,328 | 475,928 | 食品・飲料・タバコ |
| WPP PLC | 1,214 | 2,250 | 321,773 | メディア |
| CENTRICA PLC | 5,223 | 1,180 | 168,785 | 公益事業 |
| BT GROUP PLC | 7,992 | 2,416 | 345,530 | 電気通信サービス |
| SSE PLC | 965 | 1,449 | 207,277 | 公益事業 |
| STANDARD CHARTERED PLC | 3,114 | 2,456 | 351,298 | 銀行 |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 1,743 | 1,195 | 170,985 | 資本財 |
| COMPASS GROUP PLC | 1,556 | 2,182 | 312,006 | 消費者サービス |
| KINGFISHER PLC | 2,120 | 700 | 100,169 | 小売 |
| PEARSON PLC | 777 | 475 | 67,968 | メディア |
| SEVERN TRENT PLC | 234 | 519 | 74,244 | 公益事業 |
| RIO TINTO PLC | 1,171 | 4,187 | 598,699 | 素材 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 4,623 | 7,036 | 1,006,178 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PROVIDENT FINANCIAL PLC | 142 | 391 | 55,930 | 各種金融 |
| 3I GROUP PLC | 911 | 632 | 90,467 | 各種金融 |
| GKN PLC | 1,619 | 569 | 81,363 | 自動車・自動車部品 |
| VODAFONE GROUP PLC | 25,209 | 4,862 | 695,338 | 電気通信サービス |
| WM MORRISON SUPERMARKETS | 2,110 | 499 | 71,465 | 食品・生活必需品小売り |
| SAINSBURY (J) PLC | 1,526 | 391 | 55,997 | 食品・生活必需品小売り |
| AVIVA PLC | 3,844 | 1,838 | 262,820 | 保険 |
| CAPITA PLC | 628 | 316 | 45,304 | 商業・専門サービス |
| DIXONS CARPHONE PLC | 912 | 289 | 41,442 | 小売 |
| JOHNSON MATTHEY PLC | 183 | 594 | 85,045 | 素材 |
| RSA INSURANCE GROUP PLC | 966 | 557 | 79,646 | 保険 |
| WHITBREAD PLC | 172 | 702 | 100,391 | 消費者サービス |
| NATIONAL GRID PLC | 3,592 | 3,312 | 473,660 | 公益事業 |
| WOLSELEY PLC | 239 | 1,179 | 168,679 | 資本財 |
| BUNZL PLC | 319 | 665 | 95,208 | 資本財 |
| COBHAM PLC | 1,613 | 223 | 31,923 | 資本財 |
| ANGLO AMERICAN PLC | 1,328 | 1,809 | 258,678 | 素材 |
| INTERTEK GROUP PLC | 154 | 534 | 76,439 | 商業・専門サービス |
| WILLIAM HILL PLC | 818 | 216 | 30,902 | 消費者サービス |
| BURBERRY GROUP PLC | 419 | 698 | 99,833 | 耐久消費財・アパレル |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 178 | 663 | 94,853 | 消費者サービス |
| CARNIVAL PLC | 179 | 761 | 108,937 | 消費者サービス |
| PERSIMMON PLC | 290 | 551 | 78,863 | 耐久消費財・アパレル |
| MEGGITT PLC | 724 | 315 | 45,095 | 資本財 |
| ITV PLC | 3,423 | 700 | 100,150 | メディア |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 298 | 919 | 131,418 | 各種金融 |
| G4S PLC | 1,465 | 370 | 53,003 | 商業・専門サービス |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 | | |
|-------------------------------|--------------|----------|-----------|------------------------|------------|--|
| | 株 数 | 評 価 額 | | | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| (イギリス) | 百株 | 千イギリスポンド | 千円 | | | |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE | 121 | 338 | 48,427 | 耐久消費財・アパレル | | |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 952 | 452 | 64,694 | 耐久消費財・アパレル | | |
| IMI PLC | 256 | 288 | 41,272 | 資本財 | | |
| SMITH & NEPHEW PLC | 843 | 995 | 142,330 | ヘルスケア機器・サービス | | |
| TATE & LYLE PLC | 437 | 292 | 41,838 | 食品・飲料・タバコ | | |
| TAYLOR WIMPEY PLC | 3,088 | 510 | 72,950 | 耐久消費財・アパレル | | |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 4,101 | 9,034 | 1,291,783 | エネルギー | | |
| PETROFAC LTD | 248 | 234 | 33,536 | エネルギー | | |
| TRAVIS PERKINS PLC | 235 | 348 | 49,791 | 資本財 | | |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 3,550 | 8,165 | 1,167,638 | エネルギー | | |
| OLD MUTUAL PLC | 4,672 | 992 | 141,848 | 保険 | | |
| INVESTEC PLC | 617 | 356 | 51,017 | 各種金融 | | |
| STANDARD LIFE PLC | 1,872 | 654 | 93,583 | 保険 | | |
| EXPERIAN PLC | 908 | 1,404 | 200,793 | 商業・専門サービス | | |
| MONDI PLC | 346 | 623 | 89,135 | 素材 | | |
| WEIR GROUP PLC/THE | 208 | 419 | 60,018 | 資本財 | | |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 337 | 831 | 118,908 | 食品・飲料・タバコ | | |
| ANTOFAGASTA PLC | 869 | 317 | 45,329 | 素材 | | |
| SHIRE PLC | 352 | 3,755 | 537,002 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | | |
| INMARSAT PLC | 423 | 268 | 38,379 | 電気通信サービス | | |
| ADMIRAL GROUP PLC | 197 | 353 | 50,548 | 保険 | | |
| FRESNILLO PLC | 212 | 301 | 43,086 | 素材 | | |
| RANDGOLD RESOURCES LTD | 88 | 587 | 84,061 | 素材 | | |
| BABCOCK INTL GROUP PLC | 240 | 219 | 31,371 | 商業・専門サービス | | |
| ST JAMES'S PLACE PLC | 500 | 547 | 78,253 | 保険 | | |
| GLENCORE PLC | 11,595 | 3,791 | 542,161 | 素材 | | |
| ABERDEEN ASSET MGMT PLC | 872 | 233 | 33,444 | 各種金融 | | |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 250 | 332 | 47,614 | 各種金融 | | |
| CRODA INTERNATIONAL PLC | 125 | 426 | 60,992 | 素材 | | |
| COCA-COLA HBC AG-DI | 170 | 309 | 44,194 | 食品・飲料・タバコ | | |
| EASYJET PLC | 152 | 153 | 21,924 | 運輸 | | |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 1,301 | 458 | 65,594 | 保険 | | |
| ROYAL MAIL PLC | 835 | 344 | 49,214 | 運輸 | | |
| ASHTREAD GROUP PLC | 475 | 758 | 108,458 | 資本財 | | |
| MERLIN ENTERTAINMENT | 670 | 325 | 46,562 | 消費者サービス | | |
| TUI AG-DI | 471 | 542 | 77,563 | 消費者サービス | | |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 137 | 255 | 36,495 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | | |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC | 352 | 282 | 40,366 | ヘルスケア機器・サービス | | |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 931 | 362 | 51,832 | ソフトウェア・サービス | | |
| WORLDPAY GROUP PLC | 1,736 | 491 | 70,323 | ソフトウェア・サービス | | |
| DCC PLC | 85 | 517 | 74,018 | 資本財 | | |
| 小 計 | 株 数 | 金 額 | 281,616 | 169,842 | 24,285,786 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | | 104 | — | < 6.8% > | |
| (スイス) | | | 千スイスフラン | | | |
| NESTLE SA-REG | 2,949 | 21,764 | 2,467,868 | 食品・飲料・タバコ | | |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 494 | 3,868 | 438,696 | 耐久消費財・アパレル | | |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 1,884 | 2,997 | 339,921 | 各種金融 | | |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG | 432 | 2,372 | 269,024 | 素材 | | |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN | 665 | 15,635 | 1,772,943 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | | |
| GIVAUDAN-REG | 8 | 1,611 | 182,766 | 素材 | | |
| SONOVA HOLDING AG-REG | 50 | 650 | 73,755 | ヘルスケア機器・サービス | | |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 142 | 4,101 | 465,060 | 保険 | | |

| 銘柄 | 株数 | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------|------------------|--------------|--------------|------------------------|
| | | 評価額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (スイス) | 百株 | 千スイスフラン | 千円 | |
| SYNGENTA AG-REG | 87 | 3,764 | 426,805 | 素材 |
| LONZA GROUP AG-REG | 50 | 936 | 106,139 | 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 | 48 | 334 | 37,905 | 耐久消費財・アパレル |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 37 | 711 | 80,707 | 資本財 |
| GEBERIT AG-REG | 35 | 1,505 | 170,671 | 資本財 |
| SWISS RE AG | 306 | 2,884 | 327,105 | 保険 |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR | 28 | 1,031 | 116,942 | 耐久消費財・アパレル |
| PARGESA HOLDING SA-BR | 35 | 235 | 26,741 | 各種金融 |
| NOVARTIS AG-REG | 2,115 | 15,075 | 1,709,451 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADECCO GROUP AG-REG | 154 | 1,118 | 126,782 | 商業・専門サービス |
| SWISSCOM AG-REG | 24 | 1,078 | 122,274 | 電気通信サービス |
| ABB LTD-REG | 1,783 | 4,188 | 474,921 | 資本財 |
| SGS SA-REG | 5 | 1,096 | 124,358 | 商業・専門サービス |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG | 20 | 377 | 42,835 | 資本財 |
| ACTELION LTD-REG | 91 | 2,090 | 237,040 | 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 | 51 | 696 | 79,006 | 運輸 |
| BALOISE HOLDING AG - REG | 47 | 612 | 69,484 | 保険 |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 30 | 915 | 103,792 | 保険 |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | 0.1 | 660 | 74,888 | 食品・飲料・タバコ |
| ARYZTA AG | 82 | 238 | 27,067 | 食品・飲料・タバコ |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 212 | 1,001 | 113,609 | 各種金融 |
| SIKA AG-BR | 2 | 1,026 | 116,351 | 素材 |
| SWISS PRIME SITE-REG | 68 | 567 | 64,325 | 不動産 |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC | 0.93 | 524 | 59,528 | 食品・飲料・タバコ |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | 16 | 816 | 92,624 | 各種金融 |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG | 2 | 264 | 30,040 | 食品・飲料・タバコ |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 7 | 394 | 44,745 | 素材 |
| UBS GROUP AG-REG | 3,470 | 5,979 | 677,999 | 各種金融 |
| DUFREY AG-REG | 44 | 639 | 72,538 | 小売 |
| GALENICA AG-REG | 3 | 396 | 44,984 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 15,493 38 | 104,168 - | 11,811,709 <3.3%> |
| (スウェーデン) | | 千スウェーデンクローネ | | |
| ELECTROLUX AB-SER B | 229 | 5,432 | 69,803 | 耐久消費財・アパレル |
| ERICSSON LM-B SHS | 2,905 | 15,091 | 193,925 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ATLAS COPCO AB-B SHS | 369 | 9,613 | 123,534 | 資本財 |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 1,444 | 14,195 | 182,411 | 銀行 |
| INVESTOR AB-B SHS | 428 | 15,278 | 196,324 | 各種金融 |
| NORDEA BANK AB | 2,884 | 30,570 | 392,829 | 銀行 |
| GETINGE AB-B SHS | 191 | 2,963 | 38,080 | ヘルスケア機器・サービス |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 1,450 | 19,012 | 244,307 | 銀行 |
| ATLAS COPCO AB-A SHS | 635 | 18,395 | 236,381 | 資本財 |
| SKF AB-B SHARES | 376 | 6,766 | 86,953 | 資本財 |
| ASSA ABLOY AB-B | 948 | 15,980 | 205,349 | 資本財 |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS | 898 | 21,572 | 277,201 | 小売 |
| SANDVIK AB | 1,009 | 12,225 | 157,102 | 資本財 |
| SWEDBANK AB - A SHARES | 861 | 19,128 | 245,797 | 銀行 |
| SECURITAS AB-B SHS | 293 | 4,149 | 53,314 | 商業・専門サービス |
| SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B | 573 | 14,516 | 186,532 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| SKANSKA AB-B SHS | 319 | 7,038 | 90,450 | 資本財 |
| SWEDISH MATCH AB | 181 | 5,195 | 66,767 | 食品・飲料・タバコ |
| TELE2 AB-B SHS | 330 | 2,401 | 30,854 | 電気通信サービス |

| 銘柄 | 株数 | 期末 | | 業種等 |
|----------------------------|------------------|--------------|--------------|------------------------|
| | | 評価額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (スウェーデン) | 百株 | 千スウェーデンクローネ | 千円 | |
| TELIA CO AB | 2,445 | 8,909 | 114,486 | 電気通信サービス |
| VOLVO AB-B SHS | 1,458 | 16,680 | 214,345 | 資本財 |
| ALFA LAVAL AB | 273 | 4,282 | 55,025 | 資本財 |
| LUNDIN PETROLEUM AB | 179 | 3,471 | 44,612 | エネルギー |
| BOLIDEN AB | 257 | 6,706 | 86,179 | 素材 |
| HUSQVARNA AB-B SHS | 395 | 2,817 | 36,211 | 耐久消費財・アパレル |
| MILLICOM INTL CELLULAR-SDR | 63 | 2,712 | 34,850 | 電気通信サービス |
| HEXAGON AB-B SHS | 246 | 8,628 | 110,882 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| KINNEVIK AB - B | 223 | 5,040 | 64,770 | 各種金融 |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 154 | 2,612 | 33,570 | 各種金融 |
| ICA GRUPPEN AB | 77 | 2,157 | 27,723 | 食品・生活必需品小売り |
| LUNDBERGS AB-B SHS | 36 | 2,026 | 26,044 | 各種金融 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 22,142 31 | 305,573 - | 3,926,622 <1.1%> |
| (ノルウェー) | | 千ノルウェークローネ | | |
| DNB ASA | 927 | 12,885 | 175,755 | 銀行 |
| NORSK HYDRO ASA | 1,264 | 6,107 | 83,299 | 素材 |
| ORKLA ASA | 768 | 5,958 | 81,274 | 食品・飲料・タバコ |
| STATOIL ASA | 1,068 | 17,050 | 232,562 | エネルギー |
| TELENOR ASA | 709 | 9,366 | 127,765 | 電気通信サービス |
| YARA INTERNATIONAL ASA | 167 | 6,031 | 82,268 | 素材 |
| MARINE HARVEST | 360 | 5,482 | 74,785 | 食品・飲料・タバコ |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 189 | 2,655 | 36,220 | 保険 |
| SCHIBSTED ASA-CL A | 71 | 1,517 | 20,701 | メディア |
| SCHIBSTED ASA-B SHS | 84 | 1,698 | 23,168 | メディア |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 5,611 10 | 68,753 - | 937,803 <0.3%> |
| (デンマーク) | | 千デンマーククローネ | | |
| NOVO NORDISK A/S-B | 1,811 | 43,912 | 718,850 | 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 | 218 | 5,529 | 90,523 | 素材 |
| DANSKE BANK A/S | 652 | 14,928 | 244,377 | 銀行 |
| WILLIAM DEMANT HOLDING | 116 | 1,440 | 23,577 | ヘルスケア機器・サービス |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 209 | 9,844 | 161,158 | 資本財 |
| TDC A/S | 765 | 2,930 | 47,973 | 電気通信サービス |
| CARLSBERG AS-B | 101 | 6,282 | 102,842 | 食品・飲料・タバコ |
| COLOPLAST-B | 111 | 5,509 | 90,188 | ヘルスケア機器・サービス |
| DSV A/S | 179 | 5,936 | 97,172 | 運輸 |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B | 6 | 7,175 | 117,459 | 運輸 |
| TRYG A/S | 107 | 1,401 | 22,942 | 保険 |
| AP MOELLER-MAERSK A/S-A | 3 | 4,248 | 69,552 | 運輸 |
| PANDORA A/S | 105 | 9,304 | 152,320 | 耐久消費財・アパレル |
| ISS A/S | 160 | 3,848 | 63,003 | 商業・専門サービス |
| CHR HANSEN HOLDING A/S | 95 | 3,839 | 62,854 | 素材 |
| GENMAB A/S | 53 | 6,974 | 114,166 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DONG ENERGY A/S | 85 | 2,176 | 35,635 | 公益事業 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 4,784 17 | 135,283 - | 2,214,599 <0.6%> |
| (オーストラリア) | | 千オーストラリアドル | | |
| BHP BILLITON LIMITED | 3,050 | 8,508 | 729,770 | 素材 |
| CSL LTD | 434 | 4,881 | 418,682 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALUMINA LTD | 2,350 | 479 | 41,127 | 素材 |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD | 722 | 2,316 | 198,661 | エネルギー |

| 銘柄 | 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 | 千オーストラリアドル | 千円 | |
| AUST AND NZ BANKING GROUP | 2,787 | 8,213 | 704,474 | 銀行 |
| RIO TINTO LTD | 405 | 2,726 | 233,887 | 素材 |
| QBE INSURANCE GROUP LTD | 1,312 | 1,587 | 136,162 | 保険 |
| LENLEASE GROUP | 535 | 733 | 62,887 | 不動産 |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 1,632 | 13,422 | 1,151,267 | 銀行 |
| WESTPAC BANKING CORP | 3,185 | 10,120 | 868,012 | 銀行 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 2,531 | 7,660 | 657,061 | 銀行 |
| BRAMBLES LTD | 1,529 | 1,624 | 139,346 | 商業・専門サービス |
| QANTAS AIRWAYS LTD | 551 | 192 | 16,543 | 運輸 |
| BORAL LTD | 1,126 | 655 | 56,210 | 素材 |
| WOOLWORTHS LTD | 1,220 | 3,008 | 257,999 | 食品・生活必需品小売り |
| TELSTRA CORP LTD | 4,109 | 2,083 | 178,723 | 電気通信サービス |
| AMP LTD | 2,843 | 1,424 | 122,167 | 各種金融 |
| TABCORP HOLDINGS LTD | 817 | 388 | 33,293 | 消費者サービス |
| AMCOR LIMITED | 1,112 | 1,603 | 137,538 | 素材 |
| COMPUTERSHARE LTD | 450 | 578 | 49,589 | ソフトウェア・サービス |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD | 527 | 806 | 69,157 | 消費者サービス |
| MACQUARIE GROUP LTD | 293 | 2,472 | 212,044 | 各種金融 |
| CIMIC GROUP LTD | 92 | 324 | 27,798 | 資本財 |
| ASX LTD | 188 | 925 | 79,364 | 各種金融 |
| COCA-COLA AMATIL LTD | 556 | 551 | 47,280 | 食品・飲料・タバコ |
| COCHLEAR LTD | 56 | 722 | 61,995 | ヘルスケア機器・サービス |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI | 431 | 892 | 76,564 | 素材 |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 539 | 263 | 22,629 | 小売 |
| NEWCREST MINING LTD | 729 | 1,588 | 136,236 | 素材 |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP | 2,352 | 1,371 | 117,620 | 保険 |
| ORIGIN ENERGY LTD | 1,681 | 1,218 | 104,546 | エネルギー |
| ORICA LTD | 368 | 708 | 60,770 | 素材 |
| SONIC HEALTHCARE LTD | 384 | 810 | 69,554 | ヘルスケア機器・サービス |
| SANTOS LTD | 1,551 | 622 | 53,365 | エネルギー |
| SUNCORP GROUP LTD | 1,245 | 1,622 | 139,197 | 保険 |
| TRANSURBAN GROUP | 1,983 | 2,027 | 173,910 | 運輸 |
| WESFARMERS LTD | 1,072 | 4,366 | 374,521 | 食品・生活必需品小売り |
| CHALLENGER LTD | 566 | 631 | 54,122 | 各種金融 |
| SYDNEY AIRPORT | 1,118 | 679 | 58,320 | 運輸 |
| CALTEX AUSTRALIA LTD | 254 | 749 | 64,254 | エネルギー |
| OIL SEARCH LTD | 1,314 | 918 | 78,806 | エネルギー |
| AGL ENERGY LTD | 658 | 1,463 | 125,530 | 公益事業 |
| TATTS GROUP LTD | 1,395 | 595 | 51,115 | 消費者サービス |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD | 1,484 | 978 | 83,904 | 素材 |
| AUSNET SERVICES | 2,078 | 325 | 27,898 | 公益事業 |
| CROWN RESORTS LTD | 352 | 405 | 34,793 | 消費者サービス |
| INCITEC PIVOT LTD | 1,608 | 608 | 52,153 | 素材 |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK | 441 | 563 | 48,296 | 銀行 |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 1,987 | 987 | 84,739 | 運輸 |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 715 | 797 | 68,375 | 食品・飲料・タバコ |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD | 138 | 939 | 80,572 | ヘルスケア機器・サービス |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L | 54 | 165 | 14,227 | 消費者サービス |
| SEEK LTD | 321 | 466 | 40,031 | 商業・専門サービス |
| BANK OF QUEENSLAND LTD | 375 | 452 | 38,791 | 銀行 |
| REA GROUP LTD | 54 | 292 | 25,110 | メディア |
| TPG TELECOM LTD | 322 | 217 | 18,619 | 電気通信サービス |

| 銘柄 | 株数 | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|---------|-------------|---------|--------------|
| | | 評価額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (オーストラリア) | 百株 | 千オーストラリアドル | 千円 | |
| HEALTHSCOPE LTD | 1,702 | 384 | 33,006 | ヘルスケア機器・サービス |
| MEDIBANK PRIVATE LTD | 2,670 | 720 | 61,832 | 保険 |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | 60 | 363 | 31,191 | 消費者サービス |
| SOUTH32 LTD | 5,065 | 1,443 | 123,831 | 素材 |
| VOCUS COMMUNICATIONS LTD | 486 | 206 | 17,674 | 電気通信サービス |
| 小計 | 株数・金額 | 71,992 | 108,862 | 9,337,166 |
| | 銘柄数<比率> | 61 | — | <2.6%> |
| (ニュージーランド) | | 千ニュージーランドドル | | |
| SPARK NEW ZEALAND LTD | 1,699 | 592 | 48,897 | 電気通信サービス |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 899 | 612 | 50,572 | 運輸 |
| CONTACT ENERGY LTD | 718 | 358 | 29,597 | 公益事業 |
| FLETCHER BUILDING LTD | 661 | 686 | 56,719 | 素材 |
| RYMAN HEALTHCARE LTD | 367 | 315 | 26,018 | ヘルスケア機器・サービス |
| MERIDIAN ENERGY LTD | 1,274 | 349 | 28,844 | 公益事業 |
| MERCURY NZ LTD | 710 | 218 | 18,075 | 公益事業 |
| 小計 | 株数・金額 | 6,331 | 3,133 | 258,726 |
| | 銘柄数<比率> | 7 | — | <0.1%> |
| (香港) | | 千香港ドル | | |
| WHARF HOLDINGS LTD | 1,290 | 7,559 | 110,291 | 不動産 |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A | 520 | 4,043 | 58,987 | 不動産 |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 2,568 | 23,541 | 343,477 | 資本財 |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES | 1,370 | 14,563 | 212,475 | 不動産 |
| MTR CORP | 1,415 | 5,532 | 80,721 | 運輸 |
| HONG KONG & CHINA GAS | 7,403 | 10,749 | 156,837 | 公益事業 |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | 5,430 | 4,821 | 70,350 | 不動産 |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 1,335 | 9,638 | 140,628 | 公益事業 |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 1,096 | 20,363 | 297,106 | 各種金融 |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS | 1,230 | 1,289 | 18,807 | 運輸 |
| HANG LUNG GROUP LTD | 850 | 2,465 | 35,964 | 不動産 |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD | 2,170 | 4,083 | 59,584 | 不動産 |
| CLP HOLDINGS LTD | 1,585 | 11,990 | 174,941 | 公益事業 |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 1,043 | 4,440 | 64,783 | 不動産 |
| BANK OF EAST ASIA LTD | 1,174 | 3,763 | 54,906 | 銀行 |
| HANG SENG BANK LTD | 723 | 11,264 | 164,346 | 銀行 |
| HYSAN DEVELOPMENT CO | 600 | 2,130 | 31,076 | 不動産 |
| SHANGRI-LA ASIA LTD | 1,220 | 1,029 | 15,023 | 消費者サービス |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 239 | 2,203 | 32,150 | 半導体・半導体製造装置 |
| SINO LAND CO | 2,874 | 3,678 | 53,672 | 不動産 |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | 715 | 2,027 | 29,574 | 耐久消費財・アパレル |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE | 650 | 3,968 | 57,896 | 公益事業 |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 3,495 | 10,694 | 156,035 | 銀行 |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 1,330 | 3,557 | 51,907 | 耐久消費財・アパレル |
| PCCW LTD | 4,250 | 2,001 | 29,205 | 電気通信サービス |
| LI & FUNG LTD | 5,780 | 1,947 | 28,419 | 耐久消費財・アパレル |
| KERRY PROPERTIES LTD | 615 | 1,322 | 19,291 | 不動産 |
| NWS HOLDINGS LTD | 1,505 | 2,031 | 29,643 | 資本財 |
| SANDS CHINA LTD | 2,300 | 8,130 | 118,623 | 消費者サービス |
| WHEELOCK & CO LTD | 790 | 3,716 | 54,230 | 不動産 |
| WYNN MACAU LTD | 1,524 | 2,084 | 30,417 | 消費者サービス |
| SJM HOLDINGS LTD | 1,830 | 1,129 | 16,473 | 消費者サービス |
| FIRST PACIFIC CO | 2,060 | 1,194 | 17,432 | 各種金融 |
| AIA GROUP LTD | 11,432 | 54,644 | 797,269 | 保険 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|---------------------------|------------|---------|-------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (香港) | 百株 | 千香港ドル | 千円 | |
| SWIRE PROPERTIES LTD | 1,110 | 2,419 | 35,304 | 不動産 |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 2,230 | 8,128 | 118,592 | 消費者サービス |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD | 952 | 1,431 | 20,890 | 消費者サービス |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS | 2,540 | 2,743 | 40,023 | 電気通信サービス |
| WH GROUP LTD | 7,700 | 4,543 | 66,282 | 食品・飲料・タバコ |
| CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING | 2,548 | 12,832 | 187,227 | 不動産 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 91,493 | 279,703 | 4,080,876 |
| | | 40 | — | <1.1%> |
| (シンガポール) | | 千シンガポールドル | | |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 2,995 | 2,797 | 224,233 | 銀行 |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 1,526 | 531 | 42,582 | メディア |
| SEMCORP INDUSTRIES LTD | 1,002 | 323 | 25,943 | 資本財 |
| CAPITALAND LTD | 2,492 | 799 | 64,122 | 不動産 |
| CITY DEVELOPMENTS LTD | 383 | 343 | 27,508 | 不動産 |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 96 | 399 | 32,058 | 小売 |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD | 1,681 | 3,168 | 254,001 | 銀行 |
| KEPPEL CORP LTD | 1,394 | 874 | 70,062 | 資本財 |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD | 1,233 | 2,588 | 207,459 | 銀行 |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING | 1,507 | 497 | 39,864 | 資本財 |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 7,589 | 2,929 | 234,835 | 電気通信サービス |
| SINGAPORE AIRLINES LTD | 546 | 548 | 43,974 | 運輸 |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD | 761 | 563 | 45,141 | 各種金融 |
| UOL GROUP LTD | 481 | 310 | 24,869 | 不動産 |
| COMFORTDELGRO CORP LTD | 2,063 | 499 | 40,019 | 運輸 |
| STARHUB LTD | 627 | 185 | 14,877 | 電気通信サービス |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 6,602 | 277 | 22,229 | 食品・飲料・タバコ |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD | 1,878 | 745 | 59,764 | 食品・飲料・タバコ |
| GENTING SINGAPORE PLC | 5,757 | 552 | 44,302 | 消費者サービス |
| SATS LTD | 670 | 351 | 28,196 | 運輸 |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L | 2,536 | 661 | 53,057 | 不動産 |
| YANGZIJIANG SHIPBUILDING | 1,945 | 158 | 12,706 | 資本財 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 45,766 | 20,107 | 1,611,812 |
| | | 22 | — | <0.4%> |
| (イスラエル) | | 千イスラエルシェケル | | |
| ISRAEL CHEMICALS LTD | 473 | 858 | 25,664 | 素材 |
| BANK HAPOALIM BM | 1,005 | 2,322 | 69,472 | 銀行 |
| NICE LTD | 56 | 1,482 | 44,339 | ソフトウェア・サービス |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL | 1,369 | 2,191 | 65,552 | 銀行 |
| ELBIT SYSTEMS LTD | 22 | 894 | 26,748 | 資本財 |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO | 1,959 | 1,304 | 39,027 | 電気通信サービス |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 138 | 814 | 24,373 | 銀行 |
| AZRIELI GROUP LTD | 39 | 680 | 20,349 | 不動産 |
| FRUTAROM | 36 | 734 | 21,976 | 素材 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 5,101 | 11,284 | 337,504 |
| | | 9 | — | <0.1%> |
| 合 計 | 株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 1,099,937 | — | 331,372,006 |
| | | 1,265 | — | <92.1%> |

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

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

外国投資信託証券

| 銘柄 | 口数 | 当 期 末 | | 比 率 |
|------------------------------|------------|---------|-----------|-----|
| | | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 千口 | 千アメリカドル | 千円 | % |
| HCP INC | 44 | 1,323 | 149,734 | 0.0 |
| MACERICH CO/THE | 11 | 803 | 90,925 | 0.0 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 7 | 839 | 94,950 | 0.0 |
| PROLOGIS INC | 49 | 2,582 | 292,216 | 0.1 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 8 | 682 | 77,236 | 0.0 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 13 | 615 | 69,641 | 0.0 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 15 | 1,621 | 183,422 | 0.1 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 6 | 1,399 | 158,312 | 0.0 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 11 | 877 | 99,305 | 0.0 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 6 | 948 | 107,339 | 0.0 |
| WELLTOWER INC | 33 | 2,248 | 254,467 | 0.1 |
| BOSTON PROPERTIES INC | 14 | 1,897 | 214,668 | 0.1 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 10 | 1,034 | 117,050 | 0.0 |
| REALTY INCOME CORP | 24 | 1,455 | 164,710 | 0.0 |
| REGENCY CENTERS CORP | 9 | 690 | 78,080 | 0.0 |
| SL GREEN REALTY CORP | 9 | 1,033 | 116,962 | 0.0 |
| UDR INC | 25 | 890 | 100,723 | 0.0 |
| VENTAS INC | 33 | 2,038 | 230,602 | 0.1 |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 93 | 955 | 108,164 | 0.0 |
| WEYERHAEUSER CO | 70 | 2,281 | 258,162 | 0.1 |
| AMERICAN TOWER CORP | 40 | 4,192 | 474,351 | 0.1 |
| AGNC INVESTMENT CORP | 30 | 591 | 66,918 | 0.0 |
| VEREIT INC | 91 | 786 | 89,023 | 0.0 |
| DUKE REALTY CORP | 33 | 862 | 97,615 | 0.0 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 28 | 712 | 80,601 | 0.0 |
| IRON MOUNTAIN INC | 23 | 840 | 95,100 | 0.0 |
| EQUINIX INC | 6 | 2,586 | 292,699 | 0.1 |
| CROWN CASTLE INTL CORP | 31 | 2,784 | 315,089 | 0.1 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 34 | 2,132 | 241,296 | 0.1 |
| COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A | 49 | 709 | 80,224 | 0.0 |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES | 54 | 1,352 | 153,009 | 0.0 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 70 | 1,296 | 146,732 | 0.0 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 13 | 563 | 63,733 | 0.0 |
| PUBLIC STORAGE | 13 | 3,050 | 345,115 | 0.1 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 29 | 5,437 | 615,235 | 0.2 |
| VORNADO REALTY TRUST | 16 | 1,737 | 196,619 | 0.1 |
| KIMCO REALTY CORP | 39 | 996 | 112,752 | 0.0 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 12 | 2,250 | 254,635 | 0.1 |
| 小 計 | 口数 | 金額 | | |
| | 銘柄数 < 比率 > | | | |
| | 38 | 59,102 | 6,687,432 | |
| | | — | <1.9%> | |
| (カナダ) | | 千カナダドル | | |
| SMART REAL ESTATE INVESTMENT | 6 | 192 | 16,701 | 0.0 |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 13 | 300 | 26,071 | 0.0 |

| 銘柄 | 口数 | 当 期 末 | | 比 率 |
|------------------------------|------------|------------|---------|-----------|
| | | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (カナダ) | 千口 | 千カナダドル | 千円 | % |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 15 | 391 | 33,940 | 0.0 |
| 小 計 | 口数・金額 | 34 | 885 | 76,712 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 3 | — | < 0.0% > |
| (ユーロ…フランス) | | 千ユーロ | | |
| GECINA SA | 3 | 469 | 57,120 | 0.0 |
| KLEPIERRE | 20 | 727 | 88,634 | 0.0 |
| UNIBAIL-RODAMCO SE | 9 | 1,988 | 242,095 | 0.1 |
| FONCIERE DES REGIONS | 3 | 261 | 31,834 | 0.0 |
| ICADE | 3 | 237 | 28,969 | 0.0 |
| ユ ー ロ 計 | 口数・金額 | 41 | 3,684 | 448,654 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 5 | — | < 0.1% > |
| (イギリス) | | 千イギリスポンド | | |
| BRITISH LAND CO PLC | 92 | 538 | 77,063 | 0.0 |
| HAMMERSON PLC | 75 | 411 | 58,829 | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 74 | 739 | 105,732 | 0.0 |
| INTU PROPERTIES PLC | 90 | 243 | 34,800 | 0.0 |
| SEGRO PLC | 77 | 351 | 50,318 | 0.0 |
| 小 計 | 口数・金額 | 409 | 2,285 | 326,744 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 5 | — | < 0.1% > |
| (オーストラリア) | | 千オーストラリアドル | | |
| VICINITY CENTRES | 325 | 926 | 79,460 | 0.0 |
| SCENTRE GROUP | 509 | 2,242 | 192,357 | 0.1 |
| GPT GROUP | 174 | 810 | 69,538 | 0.0 |
| MIRVAC GROUP | 361 | 725 | 62,263 | 0.0 |
| STOCKLAND | 233 | 1,011 | 86,774 | 0.0 |
| WESTFIELD CORP | 189 | 1,688 | 144,798 | 0.0 |
| DEXUS PROPERTY GROUP | 93 | 839 | 71,971 | 0.0 |
| GOODMAN GROUP | 172 | 1,181 | 101,355 | 0.0 |
| 小 計 | 口数・金額 | 2,059 | 9,426 | 808,519 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 8 | — | < 0.2% > |
| (香港) | | 千香港ドル | | |
| LINK REIT | 212 | 11,034 | 160,994 | 0.0 |
| 小 計 | 口数・金額 | 212 | 11,034 | 160,994 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 1 | — | < 0.0% > |
| (シンガポール) | | 千シンガポールドル | | |
| SUNTEC REIT | 235 | 399 | 32,038 | 0.0 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 203 | 305 | 24,456 | 0.0 |
| CAPITALAND MALL TRUST | 238 | 461 | 36,978 | 0.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 228 | 548 | 43,959 | 0.0 |
| 小 計 | 口数・金額 | 906 | 1,714 | 137,433 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 4 | — | < 0.0% > |
| 合 計 | 口数・金額 | 4,785 | — | 8,646,491 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 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、親投資信託の純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | | | 当期 | |
|-----|--------|----------|--------|-----|
| | | | 買建額 | 売建額 |
| 外国 | 株式先物取引 | SP EMINI | 12,991 | — |
| | | SP/TSE60 | 799 | — |
| | | SWISS IX | 657 | — |
| | | EURO ST | 2,857 | — |
| | | SPI 200 | 1,010 | — |
| | | FTSE100 | 1,402 | — |

(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。

<日本債券インデックスマザーファンド>

下記は、日本債券インデックスマザーファンド全体(325,711,127千円)の内容です。

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 | | 末 | | | | |
|-----------------|------------------------------|------------------------------|-----------------|--------------------|----------------|----------------|----------------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 国債証券 | 319,586,000 (100,000) | 349,528,665 (100,252) | 81.7 (0.0) | — (—) | 51.7 (—) | 20.3 (—) | 9.8 (0.0) |
| 地方債証券 | 23,613,370 (23,613,370) | 25,080,161 (25,080,161) | 5.9 (5.9) | — (—) | 3.6 (3.6) | 1.7 (1.7) | 0.5 (0.5) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 26,494,197 (26,494,197) | 28,415,579 (28,415,579) | 6.6 (6.6) | — (—) | 4.5 (4.5) | 1.4 (1.4) | 0.7 (0.7) |
| 金融債券 | 2,690,000 (2,690,000) | 2,709,848 (2,709,848) | 0.6 (0.6) | — (—) | 0.0 (0.0) | 0.4 (0.4) | 0.2 (0.2) |
| 普通社債券 | 19,373,000 (19,373,000) | 20,009,260 (20,009,260) | 4.7 (4.7) | 0.2 (0.2) | 1.3 (1.3) | 3.0 (3.0) | 0.4 (0.4) |
| 合 計 | 391,756,567 (72,270,567) | 425,743,514 (76,315,101) | 99.5 (17.8) | 0.2 (0.2) | 61.1 (9.4) | 26.8 (6.5) | 11.6 (1.9) |

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-----------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第361回利付国債 (2年) | 0.1 | 600,000 | 602,448 | 2018/2/15 |
| 第362回利付国債 (2年) | 0.1 | 700,000 | 702,947 | 2018/3/15 |
| 第363回利付国債 (2年) | 0.1 | 1,630,000 | 1,637,188 | 2018/4/15 |
| 第364回利付国債 (2年) | 0.1 | 2,000,000 | 2,009,160 | 2018/5/15 |
| 第365回利付国債 (2年) | 0.1 | 400,000 | 401,872 | 2018/6/15 |
| 第366回利付国債 (2年) | 0.1 | 680,000 | 683,270 | 2018/7/15 |
| 第368回利付国債 (2年) | 0.1 | 1,400,000 | 1,407,294 | 2018/9/15 |
| 第369回利付国債 (2年) | 0.1 | 1,000,000 | 1,005,390 | 2018/10/15 |
| 第370回利付国債 (2年) | 0.1 | 1,600,000 | 1,609,056 | 2018/11/15 |
| 第109回利付国債 (5年) | 0.1 | 2,350,000 | 2,360,011 | 2018/3/20 |
| 第110回利付国債 (5年) | 0.3 | 1,080,000 | 1,087,063 | 2018/3/20 |
| 第111回利付国債 (5年) | 0.4 | 1,410,000 | 1,420,828 | 2018/3/20 |
| 第112回利付国債 (5年) | 0.4 | 1,400,000 | 1,412,558 | 2018/6/20 |
| 第113回利付国債 (5年) | 0.3 | 2,440,000 | 2,458,495 | 2018/6/20 |
| 第114回利付国債 (5年) | 0.3 | 2,090,000 | 2,107,681 | 2018/9/20 |
| 第115回利付国債 (5年) | 0.2 | 3,670,000 | 3,694,735 | 2018/9/20 |
| 第116回利付国債 (5年) | 0.2 | 2,080,000 | 2,095,953 | 2018/12/20 |
| 第117回利付国債 (5年) | 0.2 | 3,320,000 | 3,347,356 | 2019/3/20 |
| 第118回利付国債 (5年) | 0.2 | 2,260,000 | 2,280,294 | 2019/6/20 |
| 第119回利付国債 (5年) | 0.1 | 850,000 | 855,593 | 2019/6/20 |
| 第120回利付国債 (5年) | 0.2 | 2,390,000 | 2,413,111 | 2019/9/20 |
| 第121回利付国債 (5年) | 0.1 | 1,580,000 | 1,591,091 | 2019/9/20 |
| 第122回利付国債 (5年) | 0.1 | 3,970,000 | 3,999,338 | 2019/12/20 |
| 第123回利付国債 (5年) | 0.1 | 2,360,000 | 2,378,195 | 2020/3/20 |
| 第124回利付国債 (5年) | 0.1 | 4,230,000 | 4,263,797 | 2020/6/20 |
| 第125回利付国債 (5年) | 0.1 | 3,560,000 | 3,589,263 | 2020/9/20 |
| 第126回利付国債 (5年) | 0.1 | 2,960,000 | 2,985,426 | 2020/12/20 |
| 第127回利付国債 (5年) | 0.1 | 2,950,000 | 2,976,343 | 2021/3/20 |
| 第128回利付国債 (5年) | 0.1 | 4,700,000 | 4,743,475 | 2021/6/20 |
| 第129回利付国債 (5年) | 0.1 | 2,000,000 | 2,018,620 | 2021/9/20 |
| 第130回利付国債 (5年) | 0.1 | 1,800,000 | 1,817,226 | 2021/12/20 |
| 第1回利付国債 (40年) | 2.4 | 405,000 | 577,311 | 2048/3/20 |
| 第2回利付国債 (40年) | 2.2 | 600,000 | 826,344 | 2049/3/20 |
| 第3回利付国債 (40年) | 2.2 | 593,000 | 821,192 | 2050/3/20 |
| 第4回利付国債 (40年) | 2.2 | 878,000 | 1,222,325 | 2051/3/20 |
| 第5回利付国債 (40年) | 2.0 | 835,000 | 1,115,919 | 2052/3/20 |
| 第6回利付国債 (40年) | 1.9 | 770,000 | 1,010,255 | 2053/3/20 |
| 第7回利付国債 (40年) | 1.7 | 950,000 | 1,191,366 | 2054/3/20 |
| 第8回利付国債 (40年) | 1.4 | 940,000 | 1,090,456 | 2055/3/20 |
| 第9回利付国債 (40年) | 0.4 | 870,000 | 724,188 | 2056/3/20 |
| 第290回利付国債 (10年) | 1.4 | 1,640,000 | 1,671,242 | 2018/3/20 |
| 第291回利付国債 (10年) | 1.3 | 940,000 | 956,844 | 2018/3/20 |
| 第292回利付国債 (10年) | 1.7 | 794,000 | 811,841 | 2018/3/20 |
| 第293回利付国債 (10年) | 1.8 | 1,081,000 | 1,111,743 | 2018/6/20 |
| 第294回利付国債 (10年) | 1.7 | 1,570,000 | 1,612,468 | 2018/6/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-----------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第295回利付国債 (10年) | 1.5 | 1,240,000 | 1,270,094 | 2018/6/20 |
| 第296回利付国債 (10年) | 1.5 | 2,020,000 | 2,076,782 | 2018/9/20 |
| 第297回利付国債 (10年) | 1.4 | 1,636,000 | 1,685,587 | 2018/12/20 |
| 第298回利付国債 (10年) | 1.3 | 2,640,000 | 2,715,028 | 2018/12/20 |
| 第299回利付国債 (10年) | 1.3 | 2,760,000 | 2,847,795 | 2019/3/20 |
| 第300回利付国債 (10年) | 1.5 | 957,000 | 991,547 | 2019/3/20 |
| 第301回利付国債 (10年) | 1.5 | 2,072,000 | 2,154,900 | 2019/6/20 |
| 第302回利付国債 (10年) | 1.4 | 2,250,000 | 2,334,622 | 2019/6/20 |
| 第303回利付国債 (10年) | 1.4 | 2,325,000 | 2,421,417 | 2019/9/20 |
| 第304回利付国債 (10年) | 1.3 | 1,170,000 | 1,215,419 | 2019/9/20 |
| 第305回利付国債 (10年) | 1.3 | 308,000 | 320,997 | 2019/12/20 |
| 第306回利付国債 (10年) | 1.4 | 2,488,000 | 2,609,016 | 2020/3/20 |
| 第307回利付国債 (10年) | 1.3 | 1,610,000 | 1,683,238 | 2020/3/20 |
| 第308回利付国債 (10年) | 1.3 | 1,374,000 | 1,440,817 | 2020/6/20 |
| 第309回利付国債 (10年) | 1.1 | 2,300,000 | 2,396,209 | 2020/6/20 |
| 第310回利付国債 (10年) | 1.0 | 2,886,000 | 3,004,095 | 2020/9/20 |
| 第311回利付国債 (10年) | 0.8 | 1,600,000 | 1,653,776 | 2020/9/20 |
| 第312回利付国債 (10年) | 1.2 | 4,030,000 | 4,236,094 | 2020/12/20 |
| 第313回利付国債 (10年) | 1.3 | 2,969,000 | 3,142,181 | 2021/3/20 |
| 第314回利付国債 (10年) | 1.1 | 1,590,000 | 1,669,547 | 2021/3/20 |
| 第315回利付国債 (10年) | 1.2 | 1,853,000 | 1,959,121 | 2021/6/20 |
| 第316回利付国債 (10年) | 1.1 | 780,000 | 821,230 | 2021/6/20 |
| 第317回利付国債 (10年) | 1.1 | 1,557,000 | 1,643,288 | 2021/9/20 |
| 第318回利付国債 (10年) | 1.0 | 1,730,000 | 1,817,832 | 2021/9/20 |
| 第319回利付国債 (10年) | 1.1 | 1,519,000 | 1,607,345 | 2021/12/20 |
| 第320回利付国債 (10年) | 1.0 | 1,980,000 | 2,085,435 | 2021/12/20 |
| 第321回利付国債 (10年) | 1.0 | 2,515,000 | 2,655,010 | 2022/3/20 |
| 第322回利付国債 (10年) | 0.9 | 1,170,000 | 1,229,108 | 2022/3/20 |
| 第323回利付国債 (10年) | 0.9 | 1,675,000 | 1,763,306 | 2022/6/20 |
| 第324回利付国債 (10年) | 0.8 | 2,650,000 | 2,775,398 | 2022/6/20 |
| 第325回利付国債 (10年) | 0.8 | 2,935,000 | 3,078,668 | 2022/9/20 |
| 第326回利付国債 (10年) | 0.7 | 1,360,000 | 1,420,642 | 2022/12/20 |
| 第327回利付国債 (10年) | 0.8 | 2,440,000 | 2,563,220 | 2022/12/20 |
| 第328回利付国債 (10年) | 0.6 | 2,150,000 | 2,235,978 | 2023/3/20 |
| 第329回利付国債 (10年) | 0.8 | 3,410,000 | 3,594,515 | 2023/6/20 |
| 第330回利付国債 (10年) | 0.8 | 2,930,000 | 3,092,761 | 2023/9/20 |
| 第331回利付国債 (10年) | 0.6 | 1,360,000 | 1,417,460 | 2023/9/20 |
| 第332回利付国債 (10年) | 0.6 | 3,410,000 | 3,555,811 | 2023/12/20 |
| 第333回利付国債 (10年) | 0.6 | 2,620,000 | 2,732,136 | 2024/3/20 |
| 第334回利付国債 (10年) | 0.6 | 3,950,000 | 4,120,482 | 2024/6/20 |
| 第335回利付国債 (10年) | 0.5 | 3,450,000 | 3,574,924 | 2024/9/20 |
| 第336回利付国債 (10年) | 0.5 | 1,530,000 | 1,586,579 | 2024/12/20 |
| 第337回利付国債 (10年) | 0.3 | 2,190,000 | 2,236,515 | 2024/12/20 |
| 第338回利付国債 (10年) | 0.4 | 3,910,000 | 4,025,736 | 2025/3/20 |
| 第339回利付国債 (10年) | 0.4 | 4,100,000 | 4,223,328 | 2025/6/20 |
| 第340回利付国債 (10年) | 0.4 | 3,280,000 | 3,380,171 | 2025/9/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-----------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第341回利付国債 (10年) | 0.3 | 2,770,000 | 2,831,272 | 2025/12/20 |
| 第342回利付国債 (10年) | 0.1 | 3,770,000 | 3,783,685 | 2026/3/20 |
| 第343回利付国債 (10年) | 0.1 | 3,710,000 | 3,722,094 | 2026/6/20 |
| 第344回利付国債 (10年) | 0.1 | 3,690,000 | 3,698,819 | 2026/9/20 |
| 第345回利付国債 (10年) | 0.1 | 1,100,000 | 1,101,617 | 2026/12/20 |
| 第1回利付国債 (30年) | 2.8 | 76,000 | 100,419 | 2029/9/20 |
| 第2回利付国債 (30年) | 2.4 | 98,000 | 125,275 | 2030/2/20 |
| 第3回利付国債 (30年) | 2.3 | 117,000 | 148,449 | 2030/5/20 |
| 第4回利付国債 (30年) | 2.9 | 127,000 | 172,140 | 2030/11/20 |
| 第5回利付国債 (30年) | 2.2 | 108,000 | 136,513 | 2031/5/20 |
| 第6回利付国債 (30年) | 2.4 | 169,000 | 219,309 | 2031/11/20 |
| 第7回利付国債 (30年) | 2.3 | 164,000 | 210,905 | 2032/5/20 |
| 第8回利付国債 (30年) | 1.8 | 142,000 | 172,459 | 2032/11/22 |
| 第9回利付国債 (30年) | 1.4 | 116,000 | 133,727 | 2032/12/20 |
| 第10回利付国債 (30年) | 1.1 | 185,000 | 204,626 | 2033/3/20 |
| 第11回利付国債 (30年) | 1.7 | 137,000 | 164,261 | 2033/6/20 |
| 第12回利付国債 (30年) | 2.1 | 220,000 | 277,910 | 2033/9/20 |
| 第13回利付国債 (30年) | 2.0 | 205,000 | 255,872 | 2033/12/20 |
| 第14回利付国債 (30年) | 2.4 | 493,000 | 647,471 | 2034/3/20 |
| 第15回利付国債 (30年) | 2.5 | 346,000 | 460,743 | 2034/6/20 |
| 第16回利付国債 (30年) | 2.5 | 302,000 | 402,837 | 2034/9/20 |
| 第17回利付国債 (30年) | 2.4 | 327,000 | 431,133 | 2034/12/20 |
| 第18回利付国債 (30年) | 2.3 | 427,000 | 556,176 | 2035/3/20 |
| 第19回利付国債 (30年) | 2.3 | 303,000 | 394,833 | 2035/6/20 |
| 第20回利付国債 (30年) | 2.5 | 495,000 | 662,656 | 2035/9/20 |
| 第21回利付国債 (30年) | 2.3 | 379,000 | 494,174 | 2035/12/20 |
| 第22回利付国債 (30年) | 2.5 | 570,000 | 763,748 | 2036/3/20 |
| 第23回利付国債 (30年) | 2.5 | 554,000 | 743,246 | 2036/6/20 |
| 第24回利付国債 (30年) | 2.5 | 411,000 | 551,578 | 2036/9/20 |
| 第25回利付国債 (30年) | 2.3 | 742,000 | 968,695 | 2036/12/20 |
| 第26回利付国債 (30年) | 2.4 | 884,000 | 1,171,945 | 2037/3/20 |
| 第27回利付国債 (30年) | 2.5 | 860,000 | 1,160,071 | 2037/9/20 |
| 第28回利付国債 (30年) | 2.5 | 1,031,000 | 1,395,788 | 2038/3/20 |
| 第29回利付国債 (30年) | 2.4 | 1,030,000 | 1,379,788 | 2038/9/20 |
| 第30回利付国債 (30年) | 2.3 | 1,246,000 | 1,650,202 | 2039/3/20 |
| 第31回利付国債 (30年) | 2.2 | 788,000 | 1,031,066 | 2039/9/20 |
| 第32回利付国債 (30年) | 2.3 | 1,319,000 | 1,758,424 | 2040/3/20 |
| 第33回利付国債 (30年) | 2.0 | 1,424,000 | 1,814,176 | 2040/9/20 |
| 第34回利付国債 (30年) | 2.2 | 1,376,000 | 1,819,030 | 2041/3/20 |
| 第35回利付国債 (30年) | 2.0 | 1,599,000 | 2,048,734 | 2041/9/20 |
| 第36回利付国債 (30年) | 2.0 | 1,419,000 | 1,823,017 | 2042/3/20 |
| 第37回利付国債 (30年) | 1.9 | 1,547,000 | 1,956,908 | 2042/9/20 |
| 第38回利付国債 (30年) | 1.8 | 865,000 | 1,076,397 | 2043/3/20 |
| 第39回利付国債 (30年) | 1.9 | 1,160,000 | 1,471,668 | 2043/6/20 |
| 第40回利付国債 (30年) | 1.8 | 1,000,000 | 1,245,570 | 2043/9/20 |
| 第41回利付国債 (30年) | 1.7 | 760,000 | 929,867 | 2043/12/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第42回利付国債 (30年) | 1.7 | 800,000 | 979,072 | 2044/3/20 |
| 第43回利付国債 (30年) | 1.7 | 1,010,000 | 1,236,421 | 2044/6/20 |
| 第44回利付国債 (30年) | 1.7 | 1,080,000 | 1,322,449 | 2044/9/20 |
| 第45回利付国債 (30年) | 1.5 | 870,000 | 1,022,841 | 2044/12/20 |
| 第46回利付国債 (30年) | 1.5 | 1,260,000 | 1,481,256 | 2045/3/20 |
| 第47回利付国債 (30年) | 1.6 | 1,050,000 | 1,261,827 | 2045/6/20 |
| 第48回利付国債 (30年) | 1.4 | 1,250,000 | 1,439,837 | 2045/9/20 |
| 第49回利付国債 (30年) | 1.4 | 1,290,000 | 1,487,318 | 2045/12/20 |
| 第50回利付国債 (30年) | 0.8 | 1,080,000 | 1,077,451 | 2046/3/20 |
| 第51回利付国債 (30年) | 0.3 | 1,270,000 | 1,101,864 | 2046/6/20 |
| 第52回利付国債 (30年) | 0.5 | 1,170,000 | 1,074,317 | 2046/9/20 |
| 第53回利付国債 (30年) | 0.6 | 300,000 | 282,798 | 2046/12/20 |
| 第38回利付国債 (20年) | 2.7 | 400,000 | 413,536 | 2018/3/20 |
| 第40回利付国債 (20年) | 2.3 | 601,000 | 625,743 | 2018/9/20 |
| 第42回利付国債 (20年) | 2.6 | 869,000 | 920,757 | 2019/3/20 |
| 第43回利付国債 (20年) | 2.9 | 74,000 | 79,999 | 2019/9/20 |
| 第44回利付国債 (20年) | 2.5 | 480,000 | 519,806 | 2020/3/20 |
| 第47回利付国債 (20年) | 2.2 | 114,000 | 123,671 | 2020/9/21 |
| 第48回利付国債 (20年) | 2.5 | 209,000 | 230,267 | 2020/12/21 |
| 第49回利付国債 (20年) | 2.1 | 515,000 | 562,210 | 2021/3/22 |
| 第51回利付国債 (20年) | 2.0 | 200,000 | 218,466 | 2021/6/21 |
| 第52回利付国債 (20年) | 2.1 | 214,000 | 235,840 | 2021/9/21 |
| 第54回利付国債 (20年) | 2.2 | 480,000 | 533,827 | 2021/12/20 |
| 第55回利付国債 (20年) | 2.0 | 241,000 | 266,856 | 2022/3/21 |
| 第56回利付国債 (20年) | 2.0 | 449,000 | 499,516 | 2022/6/20 |
| 第58回利付国債 (20年) | 1.9 | 147,000 | 163,439 | 2022/9/20 |
| 第59回利付国債 (20年) | 1.7 | 589,000 | 650,438 | 2022/12/20 |
| 第61回利付国債 (20年) | 1.0 | 289,000 | 307,860 | 2023/3/20 |
| 第63回利付国債 (20年) | 1.8 | 442,000 | 494,067 | 2023/6/20 |
| 第64回利付国債 (20年) | 1.9 | 441,000 | 497,611 | 2023/9/20 |
| 第65回利付国債 (20年) | 1.9 | 318,000 | 360,233 | 2023/12/20 |
| 第66回利付国債 (20年) | 1.8 | 500,000 | 562,955 | 2023/12/20 |
| 第68回利付国債 (20年) | 2.2 | 846,000 | 979,126 | 2024/3/20 |
| 第70回利付国債 (20年) | 2.4 | 422,000 | 496,255 | 2024/6/20 |
| 第71回利付国債 (20年) | 2.2 | 160,000 | 185,793 | 2024/6/20 |
| 第72回利付国債 (20年) | 2.1 | 534,000 | 618,473 | 2024/9/20 |
| 第73回利付国債 (20年) | 2.0 | 620,000 | 716,112 | 2024/12/20 |
| 第74回利付国債 (20年) | 2.1 | 318,000 | 369,795 | 2024/12/20 |
| 第75回利付国債 (20年) | 2.1 | 575,000 | 671,306 | 2025/3/20 |
| 第76回利付国債 (20年) | 1.9 | 200,000 | 230,254 | 2025/3/20 |
| 第77回利付国債 (20年) | 2.0 | 210,000 | 243,469 | 2025/3/20 |
| 第78回利付国債 (20年) | 1.9 | 410,000 | 473,738 | 2025/6/20 |
| 第79回利付国債 (20年) | 2.0 | 50,000 | 58,191 | 2025/6/20 |
| 第80回利付国債 (20年) | 2.1 | 315,000 | 369,236 | 2025/6/20 |
| 第81回利付国債 (20年) | 2.0 | 350,000 | 408,702 | 2025/9/20 |
| 第82回利付国債 (20年) | 2.1 | 662,000 | 778,723 | 2025/9/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-----------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第83回利付国債 (20年) | 2.1 | 413,000 | 487,914 | 2025/12/20 |
| 第84回利付国債 (20年) | 2.0 | 670,000 | 785,601 | 2025/12/20 |
| 第85回利付国債 (20年) | 2.1 | 490,000 | 581,071 | 2026/3/20 |
| 第86回利付国債 (20年) | 2.3 | 515,000 | 620,075 | 2026/3/20 |
| 第87回利付国債 (20年) | 2.2 | 450,000 | 537,727 | 2026/3/20 |
| 第88回利付国債 (20年) | 2.3 | 804,000 | 971,642 | 2026/6/20 |
| 第89回利付国債 (20年) | 2.2 | 410,000 | 491,663 | 2026/6/20 |
| 第90回利付国債 (20年) | 2.2 | 1,100,000 | 1,324,312 | 2026/9/20 |
| 第91回利付国債 (20年) | 2.3 | 468,000 | 567,913 | 2026/9/20 |
| 第92回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,432,000 | 1,715,765 | 2026/12/20 |
| 第93回利付国債 (20年) | 2.0 | 510,000 | 607,517 | 2027/3/20 |
| 第94回利付国債 (20年) | 2.1 | 715,000 | 858,893 | 2027/3/20 |
| 第95回利付国債 (20年) | 2.3 | 917,000 | 1,123,792 | 2027/6/20 |
| 第96回利付国債 (20年) | 2.1 | 520,000 | 626,584 | 2027/6/20 |
| 第97回利付国債 (20年) | 2.2 | 743,000 | 905,330 | 2027/9/20 |
| 第98回利付国債 (20年) | 2.1 | 70,000 | 84,558 | 2027/9/20 |
| 第99回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,345,000 | 1,629,454 | 2027/12/20 |
| 第100回利付国債 (20年) | 2.2 | 910,000 | 1,115,514 | 2028/3/20 |
| 第101回利付国債 (20年) | 2.4 | 573,000 | 714,972 | 2028/3/20 |
| 第102回利付国債 (20年) | 2.4 | 530,000 | 663,872 | 2028/6/20 |
| 第103回利付国債 (20年) | 2.3 | 550,000 | 682,759 | 2028/6/20 |
| 第104回利付国債 (20年) | 2.1 | 520,000 | 633,869 | 2028/6/20 |
| 第105回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,110,000 | 1,356,031 | 2028/9/20 |
| 第106回利付国債 (20年) | 2.2 | 431,000 | 531,457 | 2028/9/20 |
| 第107回利付国債 (20年) | 2.1 | 687,000 | 841,492 | 2028/12/20 |
| 第108回利付国債 (20年) | 1.9 | 580,000 | 696,916 | 2028/12/20 |
| 第109回利付国債 (20年) | 1.9 | 700,000 | 842,968 | 2029/3/20 |
| 第110回利付国債 (20年) | 2.1 | 976,000 | 1,198,518 | 2029/3/20 |
| 第111回利付国債 (20年) | 2.2 | 711,000 | 883,943 | 2029/6/20 |
| 第112回利付国債 (20年) | 2.1 | 740,000 | 911,036 | 2029/6/20 |
| 第113回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,432,000 | 1,767,374 | 2029/9/20 |
| 第114回利付国債 (20年) | 2.1 | 880,000 | 1,088,692 | 2029/12/20 |
| 第115回利付国債 (20年) | 2.2 | 654,000 | 817,303 | 2029/12/20 |
| 第116回利付国債 (20年) | 2.2 | 606,000 | 758,681 | 2030/3/20 |
| 第117回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,160,000 | 1,437,460 | 2030/3/20 |
| 第118回利付国債 (20年) | 2.0 | 666,000 | 818,021 | 2030/6/20 |
| 第119回利付国債 (20年) | 1.8 | 660,000 | 793,531 | 2030/6/20 |
| 第120回利付国債 (20年) | 1.6 | 530,000 | 623,481 | 2030/6/20 |
| 第121回利付国債 (20年) | 1.9 | 819,000 | 997,222 | 2030/9/20 |
| 第122回利付国債 (20年) | 1.8 | 760,000 | 915,359 | 2030/9/20 |
| 第123回利付国債 (20年) | 2.1 | 1,048,000 | 1,306,457 | 2030/12/20 |
| 第124回利付国債 (20年) | 2.0 | 700,000 | 863,254 | 2030/12/20 |
| 第125回利付国債 (20年) | 2.2 | 734,000 | 926,865 | 2031/3/20 |
| 第126回利付国債 (20年) | 2.0 | 810,000 | 1,000,098 | 2031/3/20 |
| 第127回利付国債 (20年) | 1.9 | 590,000 | 720,437 | 2031/3/20 |
| 第128回利付国債 (20年) | 1.9 | 1,064,000 | 1,300,569 | 2031/6/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-------------------------|-------|-------------|-------------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第129回利付国債 (20年) | 1.8 | 100,000 | 120,853 | 2031/6/20 |
| 第130回利付国債 (20年) | 1.8 | 1,112,000 | 1,344,952 | 2031/9/20 |
| 第131回利付国債 (20年) | 1.7 | 580,000 | 693,372 | 2031/9/20 |
| 第132回利付国債 (20年) | 1.7 | 477,000 | 570,539 | 2031/12/20 |
| 第133回利付国債 (20年) | 1.8 | 1,190,000 | 1,440,268 | 2031/12/20 |
| 第134回利付国債 (20年) | 1.8 | 85,000 | 102,935 | 2032/3/20 |
| 第135回利付国債 (20年) | 1.7 | 600,000 | 717,966 | 2032/3/20 |
| 第136回利付国債 (20年) | 1.6 | 550,000 | 650,215 | 2032/3/20 |
| 第137回利付国債 (20年) | 1.7 | 472,000 | 565,031 | 2032/6/20 |
| 第138回利付国債 (20年) | 1.5 | 450,000 | 525,555 | 2032/6/20 |
| 第139回利付国債 (20年) | 1.6 | 480,000 | 567,600 | 2032/6/20 |
| 第140回利付国債 (20年) | 1.7 | 1,297,000 | 1,553,144 | 2032/9/20 |
| 第141回利付国債 (20年) | 1.7 | 1,550,000 | 1,857,938 | 2032/12/20 |
| 第142回利付国債 (20年) | 1.8 | 840,000 | 1,019,474 | 2032/12/20 |
| 第143回利付国債 (20年) | 1.6 | 880,000 | 1,041,620 | 2033/3/20 |
| 第144回利付国債 (20年) | 1.5 | 830,000 | 969,108 | 2033/3/20 |
| 第145回利付国債 (20年) | 1.7 | 2,160,000 | 2,589,818 | 2033/6/20 |
| 第146回利付国債 (20年) | 1.7 | 1,780,000 | 2,134,326 | 2033/9/20 |
| 第147回利付国債 (20年) | 1.6 | 2,030,000 | 2,400,150 | 2033/12/20 |
| 第148回利付国債 (20年) | 1.5 | 1,520,000 | 1,772,472 | 2034/3/20 |
| 第149回利付国債 (20年) | 1.5 | 2,060,000 | 2,401,033 | 2034/6/20 |
| 第150回利付国債 (20年) | 1.4 | 1,990,000 | 2,285,853 | 2034/9/20 |
| 第151回利付国債 (20年) | 1.2 | 2,100,000 | 2,339,421 | 2034/12/20 |
| 第152回利付国債 (20年) | 1.2 | 1,930,000 | 2,147,472 | 2035/3/20 |
| 第153回利付国債 (20年) | 1.3 | 1,900,000 | 2,145,100 | 2035/6/20 |
| 第154回利付国債 (20年) | 1.2 | 2,220,000 | 2,461,846 | 2035/9/20 |
| 第155回利付国債 (20年) | 1.0 | 1,810,000 | 1,941,044 | 2035/12/20 |
| 第156回利付国債 (20年) | 0.4 | 1,530,000 | 1,472,410 | 2036/3/20 |
| 第157回利付国債 (20年) | 0.2 | 2,230,000 | 2,057,219 | 2036/6/20 |
| 第158回利付国債 (20年) | 0.5 | 1,690,000 | 1,645,840 | 2036/9/20 |
| 第159回利付国債 (20年) | 0.6 | 100,000 | 99,032 | 2036/12/20 |
| 第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013) | 0.67 | 100,000 | 100,252 | 2018/11/15 |
| 小 計 | | 319,586,000 | 349,528,665 | |
| 地方債証券 | | | | |
| 第1回東京都公募公債 (20年) | 1.54 | 20,000 | 21,872 | 2023/6/20 |
| 第7回東京都公募公債 (30年) | 2.51 | 10,000 | 13,163 | 2038/9/17 |
| 第8回東京都公募公債 (30年) | 2.23 | 80,000 | 100,884 | 2038/9/17 |
| 第16回東京都公募公債 (20年) | 2.01 | 100,000 | 119,300 | 2028/12/20 |
| 第20回東京都公募公債 (20年) | 2.09 | 80,000 | 96,796 | 2029/9/20 |
| 第21回東京都公募公債 (20年) | 2.19 | 80,000 | 97,979 | 2029/12/20 |
| 第22回東京都公募公債 (20年) | 1.92 | 120,000 | 143,367 | 2030/6/20 |
| 第24回東京都公募公債 (20年) | 1.98 | 70,000 | 84,535 | 2031/6/20 |
| 第28回東京都公募公債 (20年) | 1.59 | 100,000 | 115,326 | 2033/3/18 |
| 第666回東京都公募公債 | 1.46 | 150,000 | 154,612 | 2019/3/20 |
| 第669回東京都公募公債 | 1.63 | 50,000 | 51,929 | 2019/6/20 |
| 第678回東京都公募公債 | 1.38 | 100,000 | 103,925 | 2019/12/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|--------------------|-------|---------|---------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 |
| | % | 千円 | 千円 |
| 地方債証券 | | | |
| 第680回東京都公募公債 | 1.39 | 100,000 | 104,303 |
| 第681回東京都公募公債 | 1.4 | 100,000 | 104,334 |
| 第686回東京都公募公債 | 1.08 | 100,000 | 103,579 |
| 第692回東京都公募公債 | 1.35 | 100,000 | 105,155 |
| 第693回東京都公募公債 | 1.38 | 100,000 | 105,609 |
| 第705回東京都公募公債 | 1.06 | 170,000 | 178,938 |
| 第709回東京都公募公債 | 0.78 | 100,000 | 103,956 |
| 第716回東京都公募公債 | 0.77 | 100,000 | 104,172 |
| 第718回東京都公募公債 | 0.6 | 100,000 | 103,270 |
| 第721回東京都公募公債 | 0.84 | 100,000 | 104,900 |
| 第722回東京都公募公債 | 0.8 | 100,000 | 104,645 |
| 第728回東京都公募公債 | 0.65 | 100,000 | 103,841 |
| 第729回東京都公募公債 | 0.69 | 100,000 | 104,076 |
| 第750回東京都公募公債 | 0.444 | 300,000 | 307,341 |
| 第751回東京都公募公債 | 0.37 | 300,000 | 305,391 |
| 平成19年度第16回北海道公募公債 | 1.58 | 100,000 | 101,799 |
| 平成20年度第6回北海道公募公債 | 1.72 | 53,990 | 55,444 |
| 平成21年度第2回北海道公募公債 | 1.66 | 100,000 | 103,828 |
| 平成21年度第12回北海道公募公債 | 1.42 | 100,000 | 104,061 |
| 平成22年度第8回北海道公募公債 | 0.96 | 100,000 | 103,508 |
| 平成24年度第9回北海道公募公債 | 0.79 | 100,000 | 104,102 |
| 平成26年度第13回北海道公募公債 | 0.461 | 200,000 | 204,626 |
| 第1回神奈川県公募公債 (20年) | 2.55 | 100,000 | 117,702 |
| 第2回神奈川県公募公債 (20年) | 2.23 | 80,000 | 92,629 |
| 第2回神奈川県公募公債 (30年) | 2.87 | 80,000 | 109,184 |
| 第3回神奈川県公募公債 (20年) | 2.11 | 100,000 | 116,172 |
| 第27回神奈川県公募公債 (20年) | 1.398 | 100,000 | 111,739 |
| 第152回神奈川県公募公債 | 1.53 | 110,000 | 111,901 |
| 第162回神奈川県公募公債 | 1.62 | 140,450 | 145,834 |
| 第163回神奈川県公募公債 | 1.4 | 114,000 | 117,769 |
| 第165回神奈川県公募公債 | 1.4 | 54,660 | 56,650 |
| 第170回神奈川県公募公債 | 1.38 | 240,000 | 250,260 |
| 第171回神奈川県公募公債 | 1.41 | 100,000 | 104,369 |
| 第176回神奈川県公募公債 | 1.16 | 128,900 | 134,224 |
| 第191回神奈川県公募公債 | 0.83 | 100,000 | 104,169 |
| 第5回大阪府公募公債 (20年) | 2.16 | 100,000 | 121,969 |
| 第11回大阪府公募公債 (20年) | 1.693 | 200,000 | 233,258 |
| 第92回大阪府公募公債 (5年) | 0.14 | 100,000 | 100,139 |
| 第313回大阪府公募公債 | 1.66 | 100,000 | 102,048 |
| 第314回大阪府公募公債 | 1.8 | 30,000 | 30,713 |
| 第316回大阪府公募公債 | 1.85 | 100,000 | 102,753 |
| 第325回大阪府公募公債 | 1.66 | 153,000 | 158,622 |
| 第326回大阪府公募公債 | 1.66 | 10,000 | 10,382 |
| 第331回大阪府公募公債 | 1.41 | 100,000 | 103,815 |
| 第332回大阪府公募公債 | 1.58 | 71,600 | 74,755 |
| 第337回大阪府公募公債 | 1.44 | 110,000 | 115,068 |

| 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343回大阪府公募公債 | 0.98 | 70,000 | 72,506 | 2020/10/28 |
| 第348回大阪府公募公債 | 1.32 | 10,000 | 10,539 | 2021/3/30 |
| 第351回大阪府公募公債 | 1.19 | 100,000 | 105,238 | 2021/7/28 |
| 第358回大阪府公募公債 | 0.97 | 56,000 | 58,615 | 2022/2/28 |
| 第359回大阪府公募公債 | 0.99 | 56,000 | 58,696 | 2022/3/29 |
| 第389回大阪府公募公債 | 0.53 | 100,000 | 102,797 | 2024/10/30 |
| 第404回大阪府公募公債 | 0.4 | 113,000 | 115,079 | 2026/1/28 |
| 平成21年度第5回京都府公募公債 | 1.35 | 20,000 | 20,770 | 2019/12/24 |
| 平成22年度第5回京都府公募公債 | 1.26 | 110,000 | 115,295 | 2020/12/21 |
| 平成23年度第9回京都府公募公債 | 1.01 | 140,000 | 146,918 | 2022/3/16 |
| 平成24年度第3回京都府公募公債 (20年) | 1.63 | 200,000 | 231,406 | 2027/8/13 |
| 平成24年度第10回京都府公募公債 | 0.67 | 100,000 | 103,638 | 2023/3/22 |
| 平成25年度第1回京都府公募公債 | 0.58 | 100,000 | 103,137 | 2023/4/28 |
| 平成25年度第2回京都府公募公債 (15年) | 1.05 | 100,000 | 107,851 | 2028/4/28 |
| 第1回兵庫県公募公債 (18年) | 1.26 | 200,000 | 219,484 | 2032/8/6 |
| 第2回兵庫県公募公債 (30年) | 2.36 | 40,000 | 51,723 | 2040/3/19 |
| 第4回兵庫県公募公債 (15年) | 1.31 | 100,000 | 110,257 | 2027/12/24 |
| 第8回兵庫県公募公債 (15年) | 1.09 | 100,000 | 108,149 | 2029/4/16 |
| 第15回兵庫県公募公債 (20年) | 1.64 | 300,000 | 346,146 | 2032/7/23 |
| 第16回兵庫県公募公債 (20年) | 1.7 | 100,000 | 116,288 | 2032/11/19 |
| 平成20年度第5回兵庫県公募公債 | 1.93 | 50,000 | 51,334 | 2018/6/20 |
| 平成21年度第1回兵庫県公募公債 | 1.62 | 120,000 | 124,286 | 2019/4/23 |
| 平成21年度第3回兵庫県公募公債 | 1.62 | 190,000 | 197,035 | 2019/5/22 |
| 平成21年度第25回兵庫県公募公債 | 1.54 | 100,000 | 104,264 | 2019/11/20 |
| 平成20年度第1回静岡県公募公債 | 1.73 | 14,500 | 14,830 | 2018/5/28 |
| 平成20年度第2回静岡県公募公債 | 1.91 | 100,000 | 102,671 | 2018/6/26 |
| 平成20年度第4回静岡県公募公債 | 1.65 | 100,000 | 102,578 | 2018/8/28 |
| 平成20年度第5回静岡県公募公債 | 1.59 | 11,000 | 11,302 | 2018/10/30 |
| 平成21年度第4回静岡県公募公債 | 1.56 | 52,920 | 55,004 | 2019/8/20 |
| 平成22年度第1回静岡県公募公債 | 1.455 | 101,700 | 106,405 | 2020/4/20 |
| 平成22年度第6回静岡県公募公債 | 1.178 | 100,000 | 104,015 | 2020/7/22 |
| 平成22年度第8回静岡県公募公債 | 1.059 | 100,000 | 103,695 | 2020/8/25 |
| 平成25年度第1回静岡県公募公債 | 0.581 | 100,000 | 103,131 | 2023/4/19 |
| 平成25年度第5回静岡県公募公債 | 0.926 | 100,000 | 105,441 | 2023/7/25 |
| 平成25年度第8回静岡県公募公債 | 0.699 | 130,000 | 135,288 | 2023/10/24 |
| 平成25年度第11回静岡県公募公債 (5年) | 0.204 | 100,000 | 100,386 | 2019/3/26 |
| 平成26年度第5回静岡県公募公債 | 0.61 | 100,000 | 103,449 | 2024/7/25 |
| 平成27年度第3回静岡県公募公債 | 0.544 | 121,000 | 124,763 | 2025/5/21 |
| 平成23年度第7回愛知県公募公債 | 1.11 | 100,000 | 104,881 | 2021/7/29 |
| 平成23年度第9回愛知県公募公債 | 1.019 | 100,000 | 104,640 | 2021/9/30 |
| 平成23年度第14回愛知県公募公債 | 1.006 | 100,000 | 104,744 | 2021/11/30 |
| 平成23年度第17回愛知県公募公債 | 0.996 | 100,000 | 104,861 | 2022/1/31 |
| 平成24年度第13回愛知県公募公債 | 0.772 | 100,000 | 104,085 | 2022/11/30 |
| 平成26年度第9回愛知県公募公債 | 0.576 | 100,000 | 103,195 | 2024/8/26 |
| 平成20年度第4回広島県公募公債 | 1.73 | 60,000 | 61,873 | 2018/11/26 |
| 平成22年度第8回広島県公募公債 | 1.33 | 26,650 | 28,095 | 2021/3/25 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|-------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 平成23年度第1回広島県公募公債 | 1.19 | 100,000 | 105,042 | 2021/5/27 |
| 平成27年度第4回広島県公募公債 | 0.476 | 100,000 | 102,618 | 2025/11/25 |
| 平成21年度第1回埼玉県公募公債 | 1.53 | 200,000 | 206,740 | 2019/4/23 |
| 平成21年度第8回埼玉県公募公債 | 1.3 | 100,000 | 103,711 | 2019/12/25 |
| 平成23年度第1回埼玉県公募公債 | 1.37 | 100,000 | 105,711 | 2021/4/27 |
| 平成23年度第4回埼玉県公募公債 | 1.2 | 100,000 | 105,279 | 2021/7/27 |
| 平成24年度第6回埼玉県公募公債 | 0.801 | 100,000 | 104,215 | 2022/10/26 |
| 平成26年度第6回埼玉県公募公債 | 0.554 | 150,000 | 154,594 | 2024/9/26 |
| 平成26年度第8回埼玉県公募公債 | 0.335 | 100,000 | 101,383 | 2025/1/28 |
| 平成19年度第1回福岡県公募公債 | 2.62 | 70,000 | 92,970 | 2037/9/18 |
| 平成20年度第1回福岡県公募公債 | 2.28 | 80,000 | 101,716 | 2038/9/17 |
| 平成21年度第11回福岡県公募公債 | 1.44 | 100,000 | 104,371 | 2020/2/25 |
| 平成22年度第3回福岡県公募公債 | 1.11 | 100,000 | 103,875 | 2020/8/24 |
| 平成22年度第5回福岡県公募公債 | 0.94 | 20,000 | 20,686 | 2020/10/28 |
| 平成25年度第11回福岡県公募公債 | 0.694 | 300,000 | 312,132 | 2024/2/26 |
| 第9回千葉県公募公債 (20年) | 1.84 | 80,000 | 94,714 | 2030/10/11 |
| 平成20年度第2回千葉県公募公債 | 1.8 | 90,000 | 92,124 | 2018/5/25 |
| 平成20年度第3回千葉県公募公債 | 1.78 | 80,000 | 82,099 | 2018/7/25 |
| 平成20年度第5回千葉県公募公債 | 1.6 | 80,000 | 82,094 | 2018/9/25 |
| 平成22年度第7回千葉県公募公債 | 0.92 | 120,000 | 124,011 | 2020/10/23 |
| 平成22年度第11回千葉県公募公債 | 1.26 | 80,000 | 83,945 | 2021/1/25 |
| 平成23年度第9回千葉県公募公債 | 1.0 | 20,000 | 20,982 | 2022/3/25 |
| 平成24年度第1回千葉県公募公債 | 1.05 | 20,000 | 21,049 | 2022/4/25 |
| 平成24年度第6回千葉県公募公債 | 0.81 | 100,000 | 104,296 | 2022/11/25 |
| 平成25年度第1回千葉県公募公債 | 0.58 | 82,500 | 85,084 | 2023/4/25 |
| 平成26年度第9回千葉県公募公債 | 0.465 | 188,000 | 192,619 | 2025/3/25 |
| 平成21年度第1回新潟県公募公債 | 1.42 | 23,000 | 23,804 | 2019/7/29 |
| 平成24年度第1回大分県公募公債 | 0.8 | 100,260 | 104,489 | 2022/10/31 |
| 第62回共同発行市場公募地方債 | 1.74 | 100,000 | 102,280 | 2018/5/25 |
| 第63回共同発行市場公募地方債 | 1.88 | 200,000 | 205,246 | 2018/6/25 |
| 第64回共同発行市場公募地方債 | 1.78 | 100,000 | 102,624 | 2018/7/25 |
| 第65回共同発行市場公募地方債 | 1.62 | 90,000 | 92,262 | 2018/8/24 |
| 第74回共同発行市場公募地方債 | 1.57 | 100,000 | 103,595 | 2019/5/24 |
| 第75回共同発行市場公募地方債 | 1.64 | 100,000 | 103,903 | 2019/6/25 |
| 第77回共同発行市場公募地方債 | 1.54 | 10,000 | 10,389 | 2019/8/23 |
| 第78回共同発行市場公募地方債 | 1.39 | 30,000 | 31,089 | 2019/9/25 |
| 第79回共同発行市場公募地方債 | 1.34 | 200,000 | 207,216 | 2019/10/25 |
| 第81回共同発行市場公募地方債 | 1.32 | 109,500 | 113,628 | 2019/12/25 |
| 第90回共同発行市場公募地方債 | 1.12 | 30,000 | 31,201 | 2020/9/25 |
| 第95回共同発行市場公募地方債 | 1.28 | 100,000 | 105,119 | 2021/2/25 |
| 第100回共同発行市場公募地方債 | 1.21 | 100,000 | 105,311 | 2021/7/23 |
| 第101回共同発行市場公募地方債 | 1.05 | 100,000 | 104,685 | 2021/8/25 |
| 第103回共同発行市場公募地方債 | 1.0 | 100,000 | 104,618 | 2021/10/25 |
| 第107回共同発行市場公募地方債 | 1.01 | 200,000 | 209,836 | 2022/2/25 |
| 第109回共同発行市場公募地方債 | 1.05 | 170,000 | 178,918 | 2022/4/25 |
| 第110回共同発行市場公募地方債 | 0.89 | 100,000 | 104,441 | 2022/5/25 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第113回共同発行市場公募地方債 | 0.77 | 100,000 | 103,948 | 2022/8/25 |
| 第114回共同発行市場公募地方債 | 0.82 | 100,000 | 104,255 | 2022/9/22 |
| 第117回共同発行市場公募地方債 | 0.72 | 100,000 | 103,820 | 2022/12/22 |
| 第120回共同発行市場公募地方債 | 0.68 | 100,000 | 103,703 | 2023/3/24 |
| 第130回共同発行市場公募地方債 | 0.76 | 230,000 | 240,352 | 2024/1/25 |
| 第132回共同発行市場公募地方債 | 0.66 | 200,000 | 207,596 | 2024/3/25 |
| 第135回共同発行市場公募地方債 | 0.659 | 200,000 | 207,618 | 2024/6/25 |
| 第136回共同発行市場公募地方債 | 0.611 | 100,000 | 103,456 | 2024/7/25 |
| 第137回共同発行市場公募地方債 | 0.566 | 200,000 | 206,310 | 2024/8/23 |
| 第140回共同発行市場公募地方債 | 0.505 | 300,000 | 308,127 | 2024/11/25 |
| 第142回共同発行市場公募地方債 | 0.345 | 200,000 | 202,920 | 2025/1/24 |
| 第144回共同発行市場公募地方債 | 0.47 | 100,000 | 102,497 | 2025/3/25 |
| 第145回共同発行市場公募地方債 | 0.406 | 100,000 | 101,960 | 2025/4/25 |
| 第146回共同発行市場公募地方債 | 0.553 | 200,000 | 206,372 | 2025/5/23 |
| 第148回共同発行市場公募地方債 | 0.553 | 300,000 | 309,672 | 2025/7/25 |
| 第150回共同発行市場公募地方債 | 0.51 | 300,000 | 308,709 | 2025/9/25 |
| 第152回共同発行市場公募地方債 | 0.496 | 500,000 | 513,960 | 2025/11/25 |
| 第153回共同発行市場公募地方債 | 0.469 | 100,000 | 102,578 | 2025/12/25 |
| 平成24年度第2回熊本県公募公債 | 0.8 | 50,000 | 52,104 | 2022/10/26 |
| 平成22年度第1回新潟市公募公債 | 1.21 | 54,980 | 57,525 | 2020/12/24 |
| 平成23年度第1回浜松市公募公債 | 1.045 | 38,200 | 40,079 | 2021/11/25 |
| 平成25年度第1回浜松市公募公債 | 0.761 | 61,000 | 63,749 | 2024/1/24 |
| 第1回大阪市公募公債 (15年) | 1.753 | 200,000 | 229,212 | 2026/7/17 |
| 第5回大阪市公募公債 (20年) | 2.47 | 100,000 | 124,154 | 2028/9/21 |
| 平成21年度第6回大阪市公募公債 | 1.57 | 125,000 | 130,462 | 2019/11/25 |
| 平成23年度第10回大阪市公募公債 | 0.956 | 10,000 | 10,465 | 2022/1/27 |
| 平成26年度第5回大阪市公募公債 | 0.593 | 100,000 | 103,360 | 2024/9/27 |
| 第1回名古屋市公募公債 (12年) | 1.033 | 100,000 | 107,195 | 2025/6/20 |
| 第2回名古屋市公募公債 (20年) | 2.56 | 100,000 | 117,775 | 2024/6/20 |
| 第10回名古屋市公募公債 (20年) | 2.26 | 80,000 | 98,256 | 2029/8/17 |
| 第477回名古屋市公募公債 | 1.034 | 100,000 | 104,935 | 2021/12/20 |
| 第484回名古屋市公募公債 | 0.801 | 100,000 | 104,732 | 2023/9/20 |
| 第5回京都市公募公債 (20年) | 2.36 | 50,000 | 60,193 | 2026/12/18 |
| 平成23年度第2回京都市公募公債 | 1.049 | 100,000 | 104,683 | 2021/8/26 |
| 平成24年度第4回京都市公募公債 | 0.801 | 100,000 | 104,205 | 2022/10/21 |
| 平成18年度第3回神戸市公募公債 (20年) | 2.54 | 120,000 | 146,182 | 2026/6/19 |
| 平成22年度第9回神戸市公募公債 (20年) | 2.09 | 80,000 | 97,527 | 2031/1/24 |
| 第7回横浜市公募公債 (20年) | 2.06 | 200,000 | 233,150 | 2025/12/19 |
| 第17回横浜市公募公債 (20年) | 2.07 | 80,000 | 95,880 | 2028/12/20 |
| 平成20年度第3回横浜市公募公債 | 1.56 | 200,000 | 204,954 | 2018/9/7 |
| 平成20年度第4回横浜市公募公債 | 1.71 | 100,000 | 103,040 | 2018/11/16 |
| 第20回横浜市公募公債 (20年) | 2.1 | 80,000 | 96,817 | 2029/10/19 |
| 平成24年度第4回横浜市公募公債 | 0.81 | 100,000 | 104,437 | 2023/2/20 |
| 平成24年度第3回横浜市公募公債 | 0.729 | 100,000 | 103,873 | 2022/12/22 |
| 第25回横浜市公募公債 (20年) | 1.72 | 100,000 | 117,092 | 2032/7/16 |
| 第27回横浜市公募公債 (20年) | 1.599 | 60,000 | 69,159 | 2033/5/20 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------------------|---|-------|------------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 平成21年度第5回札幌市公募公債 | | 1.36 | 112,000 | 115,959 | 2019/9/20 |
| 平成22年度第8回札幌市公募公債 (30年) | | 2.277 | 80,000 | 102,664 | 2040/9/20 |
| 第3回川崎市公募公債 (15年) | | 1.82 | 100,000 | 106,998 | 2020/12/21 |
| 第44回川崎市公募公債 (5年) | | 0.162 | 130,400 | 131,005 | 2020/6/19 |
| 第82回川崎市公募公債 | | 1.52 | 100,000 | 103,958 | 2019/9/20 |
| 第17回北九州市公募公債 (20年) | | 1.529 | 100,000 | 114,085 | 2034/6/20 |
| 平成20年度第3回福岡市公募公債 | | 1.52 | 100,000 | 102,095 | 2018/6/20 |
| 平成20年度第5回福岡市公募公債 | | 1.57 | 91,000 | 93,447 | 2018/10/24 |
| 平成22年度第9回福岡市公募公債 | | 1.32 | 106,500 | 112,230 | 2021/3/25 |
| 平成23年度第6回福岡市公募公債 | | 1.0 | 100,000 | 104,626 | 2021/10/28 |
| 平成25年度第3回福岡市公募公債 (5年) | | 0.31 | 31,500 | 31,649 | 2018/9/26 |
| 平成25年度第4回福岡市公募公債 | | 0.68 | 50,000 | 51,970 | 2023/10/24 |
| 平成26年度第6回福岡市公募公債 (20年) | | 1.371 | 100,000 | 111,311 | 2034/9/20 |
| 平成25年度第2回広島市公募公債 | | 0.72 | 100,000 | 104,259 | 2023/12/27 |
| 平成24年度第2回千葉市公募公債 | | 0.81 | 100,000 | 104,290 | 2022/11/22 |
| 平成26年度第2回千葉市公募公債 | | 0.505 | 100,000 | 102,711 | 2024/11/27 |
| 平成22年度第1回三重県公募公債 | | 1.056 | 87,050 | 90,497 | 2020/11/30 |
| 平成23年度第1回三重県公募公債 | | 1.021 | 98,410 | 103,150 | 2021/11/30 |
| 平成24年度第4回福井県公募公債 | | 0.46 | 100,000 | 102,388 | 2023/4/26 |
| 平成20年度第1回徳島県公募公債 | | 1.73 | 36,000 | 37,127 | 2018/11/28 |
| 平成24年度第1回徳島県公募公債 | | 0.68 | 100,000 | 103,703 | 2023/3/24 |
| 平成26年度第1回徳島県公募公債 | | 0.495 | 100,000 | 102,634 | 2024/11/28 |
| 平成20年度第1回岡山県公募公債 | | 1.56 | 48,700 | 50,127 | 2018/12/25 |
| 小 | 計 | | 23,613,370 | 25,080,161 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | | |
| 第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.5 | 100,000 | 101,515 | 2018/1/31 |
| 第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.4 | 100,000 | 101,609 | 2018/3/23 |
| 第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.7 | 100,000 | 102,272 | 2018/5/30 |
| 第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.7 | 34,000 | 34,869 | 2018/7/31 |
| 第64回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.6 | 206,000 | 211,207 | 2018/8/29 |
| 第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.5 | 224,000 | 229,577 | 2018/9/28 |
| 第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.6 | 50,000 | 51,400 | 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 | 118,359 | 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 | 163,280 | 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 | 144,895 | 2019/3/19 |
| 第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.5 | 200,000 | 206,998 | 2019/5/31 |
| 第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 2.1 | 200,000 | 242,702 | 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 | 217,595 | 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 | 103,495 | 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 | 81,727 | 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 | 121,669 | 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 | 121,743 | 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 | 143,827 | 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 | 218,179 | 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 | 129,732 | 2040/2/29 |
| 第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.3 | 50,000 | 52,035 | 2020/3/19 |

| 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 | 122,097 | 2030/4/30 |
| 第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.3 | 200,000 | 208,834 | 2020/6/30 |
| 第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.0 | 100,000 | 103,638 | 2020/9/30 |
| 第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.9 | 112,000 | 115,830 | 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 | 74,311 | 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 | 121,309 | 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 | 95,306 | 2021/5/31 |
| 第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.1 | 60,000 | 62,946 | 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 | 127,543 | 2021/8/31 |
| 第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.0 | 100,000 | 104,704 | 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 | 237,662 | 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 | 142,515 | 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 | 117,070 | 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 | 113,981 | 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 | 105,064 | 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 | 117,953 | 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 | 242,058 | 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 | 12,572 | 2022/6/30 |
| 第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.805 | 100,000 | 104,612 | 2022/11/30 |
| 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 | 103,961 | 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 | 112,841 | 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 | 157,960 | 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 | 105,524 | 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 | 235,869 | 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 | 237,808 | 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 | 196,403 | 2023/12/28 |
| 第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.645 | 322,000 | 335,218 | 2024/3/29 |
| 第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.644 | 100,000 | 104,162 | 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 | 103,853 | 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 | 112,560 | 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 | 103,423 | 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 | 101,750 | 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 | 102,342 | 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 | 132,291 | 2026/1/30 |
| 第344回政府保証道路債券 | 1.6 | 100,000 | 105,510 | 2020/7/15 |
| 第13回政府保証東日本高速道路債券 | 1.6 | 28,000 | 28,769 | 2018/10/19 |
| 第20回政府保証中日本高速道路債券 | 1.4 | 10,000 | 10,158 | 2018/3/16 |
| 第23回政府保証中日本高速道路債券 | 1.5 | 90,000 | 92,189 | 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 | 25,856 | 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 | 207,618 | 2019/8/16 |
| 第4回政府保証公営企業債券(15年) | 2.0 | 100,000 | 110,406 | 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 | 205,128 | 2019/1/22 |
| 第5回政府保証公営企業債券(15年) | 2.2 | 100,000 | 111,938 | 2022/7/15 |
| 第7回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年) | 0.25 | 300,000 | 301,260 | 2018/10/29 |
| 第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券 | 1.4 | 100,000 | 103,083 | 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 | 153,135 | 2019/5/24 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------------|---|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 第9回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年) | | 0.32 | 100,000 | 100,699 | 2019/4/25 |
| 第10回政府保証地方公共団体金融機構債券 | | 1.3 | 100,000 | 104,046 | 2020/3/13 |
| 第12回政府保証地方公共団体金融機構債券 | | 1.3 | 200,000 | 208,570 | 2020/5/22 |
| 第14回政府保証地方公共団体金融機構債券 | | 1.1 | 100,000 | 103,782 | 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 | 103,594 | 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 | 104,421 | 2020/11/17 |
| 第21回政府保証地方公共団体金融機構債券 | | 1.2 | 100,000 | 104,825 | 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 | 31,595 | 2021/3/12 |
| 第25回政府保証地方公共団体金融機構債券 | | 1.2 | 100,000 | 105,212 | 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 | 21,981 | 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 | 52,659 | 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 | 104,739 | 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 | 104,360 | 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 | 17,673 | 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 | 37,321 | 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 | 157,969 | 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 | 167,187 | 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 | 103,832 | 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 | 205,806 | 2024/12/13 |
| 第79回政府保証地方公共団体金融機構債券 | | 0.379 | 400,000 | 409,280 | 2025/12/12 |
| 第84回政府保証地方公共団体金融機構債券 | | 0.02 | 138,000 | 136,578 | 2026/5/22 |
| 第883回政府保証公営企業債券 | | 1.4 | 100,000 | 101,595 | 2018/3/19 |
| 第884回政府保証公営企業債券 | | 1.4 | 114,000 | 115,944 | 2018/4/17 |
| 第2回政府保証公営企業債券(15年) | | 2.1 | 100,000 | 108,816 | 2021/4/16 |
| 第5回政府保証日本政策金融公庫債券 | | 1.3 | 123,000 | 127,190 | 2019/9/17 |
| 第25回政府保証日本政策金融公庫債券 | | 0.815 | 100,000 | 104,818 | 2023/2/24 |
| 第37回政府保証日本政策金融公庫債券 | | 0.425 | 100,000 | 102,695 | 2025/9/16 |
| 第194回政府保証中小企業債券 | | 1.5 | 120,000 | 122,940 | 2018/9/18 |
| 第201回政府保証預金保険機構債券 | | 0.1 | 200,000 | 200,364 | 2019/2/13 |
| 第5回政府保証日本政策投資銀行 | | 1.4 | 50,000 | 51,541 | 2019/4/15 |
| 第7回政府保証日本政策投資銀行 | | 1.4 | 100,000 | 104,265 | 2020/2/17 |
| 第17回政府保証日本政策投資銀行 | | 0.257 | 200,000 | 200,880 | 2018/11/9 |
| 第22回政府保証日本政策投資銀行 | | 0.693 | 20,000 | 20,898 | 2023/12/18 |
| 第46回日本政策投資銀行債券(財投機関債) | | 1.69 | 50,000 | 50,959 | 2018/3/20 |
| 第7回道路債券(財投機関債) | | 2.7 | 100,000 | 114,206 | 2022/6/20 |
| 第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 2.45 | 20,000 | 24,055 | 2026/3/19 |
| 第9回道路債券(財投機関債) | | 2.9 | 100,000 | 134,067 | 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 | 43,067 | 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 | 140,710 | 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 | 180,294 | 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 | 72,801 | 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 | 121,148 | 2027/10/20 |
| 第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 1.61 | 100,000 | 101,826 | 2018/3/20 |
| 第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 2.42 | 300,000 | 368,856 | 2028/6/20 |
| 第42回道路債券(財投機関債) | | 2.22 | 130,000 | 151,374 | 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 | 103,054 | 2018/12/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-------------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 | |
| 第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 | 186,024 | 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 | 60,898 | 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 | 59,643 | 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 | 116,639 | 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 | 104,254 | 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 | 104,237 | 2022/12/20 |
| 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 | 104,557 | 2023/12/20 |
| 第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 1.974 | 100,000 | 121,761 | 2055/3/19 |
| 第1回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.648 | 100,000 | 103,949 | 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 | 61,256 | 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 | 82,772 | 2019/7/26 |
| 第3回公営企業債券(20年)(財投機関債) | 1.03 | 20,000 | 21,162 | 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 | 109,248 | 2029/1/26 |
| 第6回公営企業債券(20年)(財投機関債) | 2.03 | 100,000 | 113,231 | 2023/12/20 |
| 第9回公営企業債券(20年)(財投機関債) | 2.33 | 50,000 | 58,173 | 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 | 121,582 | 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 | 98,476 | 2031/4/28 |
| 第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.164 | 100,000 | 104,177 | 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 | 94,830 | 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 | 118,879 | 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 | 52,446 | 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 | 104,981 | 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 | 232,480 | 2032/6/28 |
| F23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.075 | 100,000 | 101,416 | 2018/5/29 |
| 第23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.418 | 100,000 | 105,873 | 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 | 348,393 | 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 | 76,843 | 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 | 104,521 | 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 | 58,905 | 2033/1/28 |
| 第42回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 0.801 | 100,000 | 104,311 | 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 | 103,665 | 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 | 339,858 | 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 | 101,219 | 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 | 114,837 | 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 | 114,293 | 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 | 165,514 | 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 | 108,325 | 2029/2/28 |
| 第7回阪神高速道路債券(財投機関債) | 2.18 | 100,000 | 116,121 | 2025/3/21 |
| 第3回日本政策金融公庫(財投機関債) | 1.43 | 200,000 | 207,468 | 2019/9/20 |
| 第10回日本政策金融公庫(財投機関債) | 2.167 | 80,000 | 97,655 | 2030/3/19 |
| 第15回日本政策金融公庫(財投機関債) | 1.911 | 80,000 | 95,256 | 2030/10/29 |
| 第21回都市再生債券(財投機関債) | 1.72 | 100,000 | 102,803 | 2018/9/20 |
| 第68回都市再生債券(財投機関債) | 0.854 | 100,000 | 104,472 | 2022/9/20 |
| 第100回都市再生債券(財投機関債) | 0.569 | 100,000 | 103,000 | 2024/11/20 |
| 第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.13 | 22,097 | 23,426 | 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 | 20,401 | 21,745 | 2037/11/10 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|---------------------------|-------|---------|---------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 |
| 第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.19 | 23,302 | 24,820 |
| 第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.27 | 20,909 | 22,458 |
| 第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.29 | 23,108 | 24,708 |
| 第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 1.76 | 17,854 | 18,678 |
| 第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.26 | 18,695 | 19,926 |
| 第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.13 | 22,294 | 23,686 |
| 第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.94 | 21,673 | 22,972 |
| 第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.25 | 18,713 | 19,941 |
| 第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.67 | 13,854 | 14,243 |
| 第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.99 | 23,900 | 25,338 |
| 第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.52 | 13,345 | 13,644 |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.19 | 19,507 | 20,803 |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.24 | 23,254 | 24,834 |
| 第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.43 | 28,568 | 29,263 |
| 第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.15 | 20,121 | 21,456 |
| 第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.16 | 25,542 | 27,215 |
| 第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.7 | 15,468 | 15,969 |
| 第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.7 | 26,986 | 27,979 |
| 第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.64 | 29,483 | 30,632 |
| 第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.71 | 30,175 | 31,423 |
| 第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.57 | 90,729 | 94,065 |
| 第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.8 | 16,766 | 17,423 |
| 第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.12 | 17,990 | 18,943 |
| 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 | 103,133 |
| 第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.67 | 19,751 | 20,526 |
| 第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.7 | 42,988 | 44,857 |
| 第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.69 | 23,484 | 24,534 |
| 第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.88 | 42,708 | 45,605 |
| 第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.87 | 45,961 | 48,958 |
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.81 | 47,321 | 50,292 |
| 第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.88 | 22,462 | 23,617 |
| 第37回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 1.4 | 200,000 | 207,310 |
| 第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.61 | 49,850 | 52,588 |
| 第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.84 | 21,490 | 22,544 |
| 第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.36 | 53,720 | 56,112 |
| 第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.09 | 23,094 | 24,513 |
| 第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.34 | 21,255 | 22,706 |
| 第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.6 | 60,639 | 64,207 |
| 第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.77 | 60,278 | 64,362 |
| 第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.79 | 53,051 | 56,522 |
| 第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.92 | 48,497 | 51,891 |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.89 | 152,640 | 163,419 |
| 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.76 | 50,232 | 53,446 |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.67 | 49,960 | 52,948 |
| 第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.21 | 20,633 | 21,974 |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.64 | 54,719 | 58,016 |

| 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52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.51 | 57,210 | 60,364 | 2046/9/10 |
| 第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.48 | 58,877 | 62,054 | 2046/10/10 |
| 第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.42 | 64,142 | 67,476 | 2047/1/10 |
| 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.44 | 193,410 | 203,658 | 2047/2/10 |
| 第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.44 | 65,849 | 69,358 | 2047/4/10 |
| 第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.34 | 67,196 | 70,416 | 2047/5/10 |
| 第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.21 | 68,148 | 71,044 | 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 | 61,051 | 2030/12/13 |
| 第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.11 | 68,975 | 71,533 | 2047/8/10 |
| 第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.12 | 71,602 | 74,304 | 2047/11/10 |
| 第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.25 | 67,496 | 70,624 | 2048/3/10 |
| 第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.32 | 72,677 | 76,447 | 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 | 97,192 | 2031/6/13 |
| 第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.21 | 452,606 | 472,783 | 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 | 34,277 | 2026/6/19 |
| 第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.08 | 68,267 | 70,836 | 2048/11/10 |
| 第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.07 | 145,324 | 150,754 | 2049/1/10 |
| 第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.07 | 72,331 | 75,052 | 2049/2/10 |
| 第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.04 | 75,440 | 78,147 | 2049/4/10 |
| 第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.01 | 151,048 | 156,224 | 2049/5/10 |
| 第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.02 | 154,156 | 159,526 | 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 | 118,765 | 2031/11/18 |
| 第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.95 | 80,069 | 82,512 | 2049/10/10 |
| 第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.87 | 242,271 | 248,504 | 2049/11/10 |
| 第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.84 | 165,546 | 169,399 | 2049/12/10 |
| 第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.74 | 83,018 | 84,641 | 2050/1/10 |
| 第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.6 | 169,812 | 171,484 | 2050/2/10 |
| 第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.81 | 268,212 | 274,858 | 2050/4/10 |
| 第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.9 | 271,221 | 279,476 | 2050/7/10 |
| 第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.88 | 181,362 | 186,585 | 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 | 119,265 | 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 | 223,658 | 2027/3/19 |
| 第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.86 | 471,465 | 484,185 | 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 | 111,856 | 2027/6/18 |
| 第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 2.227 | 130,000 | 164,559 | 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 | 117,917 | 2032/9/17 |
| 第144回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 0.748 | 300,000 | 313,218 | 2023/12/20 |
| 第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債) | | 2.04 | 50,000 | 57,700 | 2025/6/20 |
| 第7回国際協力機構債券(財投機関債) | | 1.991 | 70,000 | 84,335 | 2031/6/13 |
| 第11回国際協力機構債券(財投機関債) | | 1.14 | 30,000 | 31,605 | 2021/12/20 |
| 第21回東日本高速道路 | | 0.58 | 100,000 | 100,788 | 2018/6/20 |
| 第22回東日本高速道路 | | 0.401 | 100,000 | 100,538 | 2018/6/20 |
| 第28回東日本高速道路 | | 0.248 | 100,000 | 100,616 | 2019/12/20 |
| 第33回中日本高速道路 | | 1.084 | 50,000 | 52,355 | 2021/9/17 |
| 第18回西日本高速道路 | | 0.893 | 100,000 | 104,647 | 2023/3/20 |
| 第20回西日本高速道路 | | 0.759 | 100,000 | 104,076 | 2023/9/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-------------------------------|-------|------------|------------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券 (除く金融債) | % | 千円 | 千円 | |
| 第29回西日本高速道路 | 0.31 | 400,000 | 401,832 | 2026/2/12 |
| 第132回福岡北九州高速道路債券 | 0.704 | 100,000 | 102,431 | 2024/3/19 |
| 第21回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 (財投機関債) | 1.86 | 200,000 | 206,068 | 2018/9/20 |
| 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 | 100,248 | 2018/6/20 |
| 小 計 | | 26,494,197 | 28,415,579 | |
| 金融債券 | | | | |
| い第773号商工債券 | 0.2 | 100,000 | 100,452 | 2019/10/25 |
| い第775号商工債券 | 0.2 | 400,000 | 401,928 | 2019/12/27 |
| い第776号商工債券 | 0.17 | 100,000 | 100,411 | 2020/1/27 |
| い第761号農林債券 | 0.3 | 250,000 | 251,177 | 2018/10/26 |
| い第763号農林債券 | 0.3 | 340,000 | 341,751 | 2018/12/27 |
| い第765号農林債券 | 0.3 | 100,000 | 100,551 | 2019/2/27 |
| い第769号農林債券 | 0.3 | 100,000 | 100,651 | 2019/6/27 |
| い第774号農林債券 | 0.24 | 100,000 | 100,566 | 2019/11/27 |
| い第780号農林債券 | 0.28 | 300,000 | 302,256 | 2020/5/27 |
| 第286回信金中金債 | 0.35 | 100,000 | 100,542 | 2018/9/27 |
| 第288回信金中金債 | 0.3 | 200,000 | 201,006 | 2018/11/27 |
| 第291回信金中金債 | 0.25 | 100,000 | 100,457 | 2019/2/27 |
| 第293回信金中金債 | 0.25 | 100,000 | 100,497 | 2019/4/26 |
| 第304回信金中金債 | 0.225 | 200,000 | 201,230 | 2020/3/27 |
| 第8号商工債券 (10年) | 1.66 | 100,000 | 103,101 | 2018/12/20 |
| 第11号商工債券 (10年) | 0.66 | 100,000 | 103,272 | 2024/9/20 |
| 小 計 | | 2,690,000 | 2,709,848 | |
| 普通社債券 | | | | |
| 第459回東京電力 | 2.7 | 80,000 | 83,856 | 2019/1/29 |
| 第534回東京電力 | 2.055 | 100,000 | 104,726 | 2019/10/29 |
| 第544回東京電力 | 1.976 | 100,000 | 102,469 | 2018/6/25 |
| 第549回東京電力 | 1.699 | 150,000 | 153,702 | 2018/10/17 |
| 第559回東京電力 | 1.377 | 60,000 | 61,724 | 2019/10/29 |
| 第563回東京電力 | 1.39 | 100,000 | 103,364 | 2020/5/28 |
| 第567回東京電力 | 1.958 | 100,000 | 109,287 | 2030/7/29 |
| 第568回東京電力 | 1.155 | 100,000 | 102,745 | 2020/9/8 |
| 第490回中部電力 | 1.444 | 70,000 | 72,309 | 2019/7/25 |
| 第499回中部電力 | 1.194 | 50,000 | 52,907 | 2023/6/23 |
| 第500回中部電力 | 0.875 | 100,000 | 103,861 | 2024/5/24 |
| 第518回中部電力 | 0.19 | 200,000 | 199,398 | 2023/1/25 |
| 第478回関西電力 | 1.448 | 200,000 | 207,442 | 2020/1/24 |
| 第485回関西電力 | 1.285 | 100,000 | 104,011 | 2020/12/18 |
| 第374回中国電力 | 0.814 | 100,000 | 102,002 | 2020/2/25 |
| 第379回中国電力 | 0.619 | 100,000 | 101,621 | 2021/1/25 |
| 第381回中国電力 | 0.953 | 100,000 | 104,335 | 2024/4/25 |
| 第382回中国電力 | 0.517 | 100,000 | 101,294 | 2021/5/25 |
| 第304回北陸電力 | 0.989 | 100,000 | 104,610 | 2023/10/25 |
| 第456回東北電力 | 1.176 | 100,000 | 103,611 | 2020/11/25 |
| 第473回東北電力 | 0.597 | 100,000 | 101,476 | 2021/4/23 |
| 第245回四国電力 | 2.0 | 100,000 | 107,895 | 2021/6/25 |

| 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371回九州電力 | 1.43 | 100,000 | 106,369 | 2022/12/22 |
| 第400回九州電力 | 1.777 | 100,000 | 105,055 | 2020/4/24 |
| 第422回九州電力 | 1.164 | 100,000 | 103,213 | 2020/6/25 |
| 第429回九州電力 | 0.909 | 100,000 | 103,477 | 2024/9/25 |
| 第430回九州電力 | 0.54 | 100,000 | 101,261 | 2021/10/25 |
| 第310回北海道電力 | 1.286 | 50,000 | 52,057 | 2020/12/25 |
| 第315回北海道電力 | 0.82 | 100,000 | 100,963 | 2018/4/25 |
| 第316回北海道電力 | 1.164 | 400,000 | 412,924 | 2020/6/25 |
| 第319回北海道電力 | 0.514 | 200,000 | 201,850 | 2019/9/25 |
| 第19回沖縄電力 | 1.452 | 80,000 | 83,395 | 2020/4/24 |
| 第344回東京交通債券 | 1.67 | 100,000 | 108,964 | 2023/2/17 |
| 第347回東京交通債券 | 2.05 | 100,000 | 112,829 | 2024/3/8 |
| 第38回関西国際空港 | 1.112 | 50,000 | 52,555 | 2021/12/20 |
| 第10回成田国際空港 | 1.094 | 160,000 | 167,612 | 2021/9/17 |
| 第12回成田国際空港 | 0.879 | 100,000 | 104,436 | 2022/9/20 |
| 第13回成田国際空港 | 0.802 | 100,000 | 104,021 | 2023/2/8 |
| 第17回成田国際空港 | 0.489 | 100,000 | 102,011 | 2025/2/20 |
| 第7回大和ハウス工業 | 0.06 | 200,000 | 198,162 | 2021/6/18 |
| 第3回セブン&アイ・ホールディングス | 1.94 | 100,000 | 102,676 | 2018/6/20 |
| 第8回セブン&アイ・ホールディングス | 0.383 | 100,000 | 100,572 | 2019/6/20 |
| 第11回セブン&アイ・ホールディングス | 0.514 | 300,000 | 302,925 | 2022/6/20 |
| 第21回三菱ケミカルホールディングス | 0.12 | 100,000 | 99,647 | 2021/6/9 |
| 第3回富士フイルムホールディングス | 0.882 | 100,000 | 103,399 | 2022/12/2 |
| 第9回資生堂 | 0.001 | 100,000 | 99,885 | 2019/12/17 |
| 第19回豊田自動織機 | 1.109 | 100,000 | 104,272 | 2021/9/17 |
| 第5回日本電産 | 0.001 | 300,000 | 299,283 | 2019/11/25 |
| 第12回パナソニック | 0.387 | 300,000 | 302,067 | 2020/3/19 |
| 第15回パナソニック | 0.19 | 300,000 | 299,688 | 2021/9/17 |
| 第30回ソニー | 0.05 | 400,000 | 399,100 | 2019/9/20 |
| 第12回デンソー | 0.01 | 100,000 | 99,395 | 2021/9/17 |
| 第1回日本生命2012基金 | 0.87 | 100,000 | 100,846 | 2018/8/3 |
| 第1回明治安田生命2014基金 | 0.51 | 100,000 | 100,415 | 2019/8/7 |
| 第1回日本生命2015基金 | 0.406 | 100,000 | 100,204 | 2019/8/5 |
| 第53回日産自動車 | 1.744 | 100,000 | 105,135 | 2020/4/28 |
| 第5回凸版印刷 | 1.397 | 100,000 | 104,760 | 2020/12/16 |
| 第3回大日本印刷 | 1.358 | 100,000 | 104,456 | 2020/12/18 |
| 第78回三菱商事 | 1.155 | 100,000 | 104,207 | 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 | 106,276 | 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 | 114,753 | 2026/10/30 |
| 第9回三菱東京UFJ銀行 | 2.69 | 100,000 | 108,202 | 2020/2/27 |
| 第28回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付) | 1.56 | 100,000 | 105,230 | 2021/1/20 |
| 第30回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付) | 2.46 | 100,000 | 121,943 | 2031/1/20 |
| 第124回三菱東京UFJ銀行 | 1.51 | 100,000 | 106,081 | 2021/4/16 |
| 第5回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位) | 0.285 | 200,000 | 200,988 | 2018/11/28 |
| 第6回住友信託銀行 (劣後特約付) | 2.78 | 100,000 | 119,586 | 2026/4/27 |
| 第13回住友信託銀行 (劣後特約付) | 2.341 | 100,000 | 115,729 | 2026/6/15 |

| 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22回三井住友銀行 (劣後特約付) | 1.43 | 100,000 | 104,393 | 2020/9/28 |
| 第23回三井住友銀行 (劣後特約付) | 1.61 | 100,000 | 105,303 | 2020/12/17 |
| 第25回三井住友銀行 (劣後特約付) | 2.21 | 200,000 | 230,032 | 2026/6/1 |
| 第5回みずほ銀行 (劣後特約付) | 2.49 | 100,000 | 116,465 | 2026/1/30 |
| 第9回みずほ銀行 (劣後特約付) | 2.52 | 100,000 | 118,369 | 2027/4/27 |
| 第18回みずほ銀行 (劣後特約付) | 2.14 | 100,000 | 114,067 | 2026/9/11 |
| 第11回芙蓉総合リース | 0.21 | 100,000 | 99,363 | 2021/5/7 |
| 第12回芙蓉総合リース | 0.12 | 300,000 | 298,821 | 2020/9/18 |
| 第38回日産フィナンシャルサービス | 0.001 | 200,000 | 199,128 | 2019/6/20 |
| 第40回日産フィナンシャルサービス | 0.001 | 500,000 | 498,030 | 2020/3/19 |
| 第41回日産フィナンシャルサービス | 0.03 | 200,000 | 198,686 | 2021/9/17 |
| 第10回東京センチュリーリース | 0.298 | 100,000 | 100,287 | 2019/11/21 |
| 第15回東京センチュリーリース | 0.11 | 100,000 | 99,949 | 2019/4/12 |
| 第29回ホンダファイナンス | 0.428 | 200,000 | 201,082 | 2021/3/19 |
| 第35回ホンダファイナンス | 0.001 | 100,000 | 99,625 | 2019/12/20 |
| 第37回ホンダファイナンス | 0.001 | 100,000 | 99,825 | 2020/3/19 |
| 第38回ホンダファイナンス | 0.01 | 300,000 | 299,187 | 2021/3/19 |
| 第39回ホンダファイナンス | 0.001 | 100,000 | 100,015 | 2019/12/20 |
| 第47回日立キャピタル | 0.874 | 100,000 | 102,986 | 2023/3/20 |
| 第52回日立キャピタル | 0.508 | 200,000 | 201,702 | 2021/6/18 |
| 第56回日立キャピタル | 0.197 | 100,000 | 100,018 | 2019/12/20 |
| 第62回日立キャピタル | 0.001 | 300,000 | 299,295 | 2019/9/20 |
| 第9回三井住友ファイナンス&リース | 0.518 | 200,000 | 201,886 | 2021/1/29 |
| 第14回三井住友ファイナンス&リース | 0.321 | 200,000 | 200,722 | 2020/10/30 |
| 第34回三菱UFJリース | 0.301 | 100,000 | 100,187 | 2020/9/3 |
| 第36回三菱UFJリース | 0.355 | 100,000 | 100,275 | 2022/1/21 |
| 第38回三菱UFJリース | 0.16 | 200,000 | 199,028 | 2021/4/21 |
| 第39回三菱UFJリース | 0.12 | 100,000 | 99,302 | 2021/6/9 |
| 第41回三菱UFJリース | 0.06 | 200,000 | 198,030 | 2021/7/23 |
| 第47回三菱UFJリース | 0.001 | 100,000 | 99,865 | 2020/1/24 |
| 第27回野村ホールディングス | 2.107 | 100,000 | 113,584 | 2025/9/24 |
| 第39回野村ホールディングス | 0.853 | 100,000 | 100,862 | 2018/2/26 |
| 第43回野村ホールディングス | 0.454 | 300,000 | 302,160 | 2019/2/25 |
| 第48回野村ホールディングス | 0.245 | 100,000 | 100,240 | 2018/6/8 |
| 第49回野村ホールディングス | 0.437 | 100,000 | 100,903 | 2020/6/10 |
| 第2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回 | 1.98 | 100,000 | 102,499 | 2018/6/20 |
| 第51回三井不動産 | 0.001 | 100,000 | 100,015 | 2019/12/6 |
| 第98回三菱地所 | 1.165 | 100,000 | 103,175 | 2020/6/19 |
| 第105回三菱地所 | 1.178 | 100,000 | 104,249 | 2022/3/23 |
| 第112回三菱地所 | 0.577 | 200,000 | 202,380 | 2020/12/25 |
| 第116回三菱地所 | 0.643 | 100,000 | 101,392 | 2024/9/19 |
| 第11回エヌ・ティ・ティ都市開発 | 1.12 | 100,000 | 103,908 | 2021/9/17 |
| 第17回エヌ・ティ・ティ都市開発 | 0.61 | 100,000 | 101,074 | 2024/9/20 |
| 第15回東日本旅客鉄道 | 2.65 | 100,000 | 109,111 | 2020/8/25 |
| 第26回東日本旅客鉄道 | 1.19 | 100,000 | 105,987 | 2022/12/20 |
| 第29回東日本旅客鉄道 | 2.01 | 200,000 | 224,272 | 2023/9/20 |

| 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79回東日本旅客鉄道 | | 1.131 | 100,000 | 104,695 | 2021/9/29 |
| 第83回東日本旅客鉄道 | | 1.633 | 100,000 | 113,211 | 2026/12/22 |
| 第100回東日本旅客鉄道 | | 1.981 | 100,000 | 122,275 | 2044/1/29 |
| 第9回西日本旅客鉄道 | | 2.28 | 123,000 | 136,515 | 2022/3/25 |
| 第53回東海旅客鉄道 | | 1.797 | 100,000 | 117,883 | 2030/10/25 |
| 第56回東海旅客鉄道 | | 2.083 | 100,000 | 121,978 | 2031/5/26 |
| 第74回東海旅客鉄道 | | 1.685 | 100,000 | 115,382 | 2045/3/6 |
| 第11回東京地下鉄 | | 1.16 | 100,000 | 104,956 | 2021/12/9 |
| 第5回関西高速鉄道 | | 1.238 | 100,000 | 103,720 | 2020/9/10 |
| 第60回日本電信電話 | | 1.31 | 200,000 | 208,860 | 2020/12/18 |
| 第63回日本電信電話 | | 0.69 | 100,000 | 102,657 | 2023/3/20 |
| 第19回KDD I | | 1.151 | 100,000 | 103,163 | 2020/6/19 |
| 第21回KDD I | | 0.669 | 100,000 | 101,736 | 2024/9/20 |
| 第20回エス・ティ・ティ・ドコモ | | 0.73 | 100,000 | 102,449 | 2023/9/20 |
| 第38回電源開発 | | 0.978 | 100,000 | 104,487 | 2023/12/20 |
| 第40回電源開発 | | 0.889 | 200,000 | 207,786 | 2024/6/20 |
| 第23回東京ガス | | 1.01 | 200,000 | 210,440 | 2023/6/9 |
| 第25回エス・ティ・ティ・データ | | 1.47 | 100,000 | 103,933 | 2020/3/19 |
| 第2回ファーストリテイリング | | 0.291 | 300,000 | 300,363 | 2020/12/18 |
| 第3回ファーストリテイリング | | 0.491 | 100,000 | 100,835 | 2022/12/16 |
| 第4回ファーストリテイリング | | 0.749 | 100,000 | 102,247 | 2025/12/18 |
| 第5回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー | | 0.793 | 100,000 | 100,854 | 2018/12/13 |
| 第7回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー | | 0.55 | 100,000 | 100,477 | 2019/7/10 |
| 第15回GEキャピタルコーポレーション | | 2.215 | 100,000 | 106,499 | 2020/11/20 |
| 第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー | | 1.32 | 100,000 | 100,037 | 2017/2/9 |
| 第9回ナショナル・オーストラリア銀行 | | 0.457 | 100,000 | 100,531 | 2019/1/17 |
| 第11回ナショナル・オーストラリア銀行 | | 0.284 | 100,000 | 100,217 | 2020/1/16 |
| 第8回オーストラリア・COMMONWEALTH銀行 | | 0.407 | 300,000 | 301,398 | 2019/5/2 |
| 第9回ラボバンク・ネダーランド | | 1.81 | 100,000 | 105,584 | 2021/1/28 |
| 第18回ラボバンク・ネダーランド | | 0.778 | 100,000 | 100,420 | 2017/11/2 |
| 第23回ラボバンク・ネダーランド | | 0.557 | 100,000 | 100,414 | 2018/12/19 |
| 第27回ラボバンク・ネダーランド | | 0.38 | 100,000 | 100,001 | 2020/5/22 |
| 小 | 計 | | 19,373,000 | 20,009,260 | |
| 合 | 計 | | 391,756,567 | 425,743,514 | |

<外国債券インデックスマザーファンド>

下記は、外国債券インデックスマザーファンド全体(65,998,579千口)の内容です。

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|---------|-------------|-------------|-------------|------|-----------------|-----------|------|------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 492,200 | 494,536 | 55,956,749 | 43.5 | — | 17.7 | 17.6 | 8.2 |
| | 千カナダドル | 千カナダドル | | | | | | |
| カナダ | 29,300 | 31,751 | 2,751,626 | 2.1 | — | 1.0 | 0.7 | 0.5 |
| | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | | | | | | |
| メキシコ | 178,100 | 179,604 | 964,478 | 0.8 | — | 0.4 | 0.2 | 0.1 |
| | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| ドイツ | 65,720 | 76,963 | 9,371,057 | 7.3 | — | 4.0 | 2.2 | 1.1 |
| イタリア | 87,350 | 99,609 | 12,128,458 | 9.4 | — | 5.6 | 2.9 | 0.9 |
| フランス | 87,290 | 102,128 | 12,435,155 | 9.7 | — | 5.9 | 2.9 | 0.9 |
| オランダ | 20,700 | 24,299 | 2,958,760 | 2.3 | — | 1.4 | 0.5 | 0.4 |
| スペイン | 49,250 | 57,676 | 7,022,733 | 5.5 | — | 3.3 | 1.5 | 0.6 |
| ベルギー | 21,300 | 25,977 | 3,163,066 | 2.5 | — | 1.8 | 0.5 | 0.2 |
| オーストリア | 13,500 | 16,051 | 1,954,486 | 1.5 | — | 1.0 | 0.4 | 0.1 |
| フィンランド | 5,550 | 6,231 | 758,703 | 0.6 | — | 0.4 | 0.2 | 0.0 |
| アイルランド | 6,950 | 7,981 | 971,800 | 0.8 | — | 0.4 | 0.3 | 0.1 |
| | 千イギリスポンド | 千イギリスポンド | | | | | | |
| イギリス | 51,765 | 64,076 | 9,162,359 | 7.1 | — | 5.1 | 1.6 | 0.4 |
| | 千スイスフラン | 千スイスフラン | | | | | | |
| スイス | 2,290 | 2,701 | 306,326 | 0.2 | — | 0.1 | 0.1 | 0.0 |
| | 千スウェーデンクローネ | 千スウェーデンクローネ | | | | | | |
| スウェーデン | 40,350 | 46,279 | 594,689 | 0.5 | — | 0.3 | 0.2 | — |
| | 千ノルウェークローネ | 千ノルウェークローネ | | | | | | |
| ノルウェー | 24,200 | 25,832 | 352,350 | 0.3 | — | 0.1 | 0.1 | — |
| | 千デンマーククローネ | 千デンマーククローネ | | | | | | |
| デンマーク | 40,050 | 50,278 | 823,054 | 0.6 | — | 0.4 | 0.2 | 0.0 |
| | 千ポーランドズロチ | 千ポーランドズロチ | | | | | | |
| ポーランド | 27,600 | 27,748 | 776,389 | 0.6 | — | 0.2 | 0.3 | 0.1 |
| | 千オーストラリアドル | 千オーストラリアドル | | | | | | |
| オーストラリア | 29,550 | 31,676 | 2,716,868 | 2.1 | — | 1.3 | 0.6 | 0.2 |
| | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | | | | | | |
| シンガポール | 5,860 | 6,049 | 484,920 | 0.4 | — | 0.2 | 0.1 | 0.1 |
| | 千マレーシアリンギット | 千マレーシアリンギット | | | | | | |
| マレーシア | 21,950 | 21,780 | 556,504 | 0.4 | — | 0.2 | 0.2 | 0.0 |
| | 千南アフリカランド | 千南アフリカランド | | | | | | |
| 南アフリカ | 88,050 | 81,640 | 698,025 | 0.5 | — | 0.5 | 0.1 | 0.0 |
| 合 計 | — | — | 126,908,564 | 98.8 | — | 51.3 | 33.4 | 14.1 |

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

(注) 組入比率は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 銘柄 | 利率 | 当 期 額面金額 | 期 末 評 価 額 | | 償還年月日 |
|------|---------------------|-------|----------------|-----------------------|---------|------------|
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | | | | | |
| アメリカ | | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | |
| | 国債証券 | | | | | |
| | 0.625 T-NOTE 180430 | 0.625 | 2,400 | 2,390 | 270,435 | 2018/4/30 |
| | 0.75 T-NOTE 171231 | 0.75 | 2,300 | 2,297 | 260,011 | 2017/12/31 |
| | 0.75 T-NOTE 180131 | 0.75 | 2,000 | 1,998 | 226,079 | 2018/1/31 |
| | 0.75 T-NOTE 180228 | 0.75 | 3,500 | 3,494 | 395,406 | 2018/2/28 |
| | 0.75 T-NOTE 180331 | 0.75 | 2,000 | 1,996 | 225,849 | 2018/3/31 |
| | 0.75 T-NOTE 180415 | 0.75 | 1,800 | 1,795 | 203,184 | 2018/4/15 |
| | 0.75 T-NOTE 180430 | 0.75 | 200 | 199 | 22,572 | 2018/4/30 |
| | 0.75 T-NOTE 180831 | 0.75 | 2,700 | 2,685 | 303,846 | 2018/8/31 |
| | 0.75 T-NOTE 180930 | 0.75 | 2,800 | 2,782 | 314,877 | 2018/9/30 |
| | 0.75 T-NOTE 181031 | 0.75 | 1,000 | 992 | 112,341 | 2018/10/31 |
| | 0.75 T-NOTE 190215 | 0.75 | 700 | 692 | 78,385 | 2019/2/15 |
| | 0.75 T-NOTE 190715 | 0.75 | 3,000 | 2,954 | 334,265 | 2019/7/15 |
| | 0.75 T-NOTE 190815 | 0.75 | 2,800 | 2,754 | 311,684 | 2019/8/15 |
| | 0.875 T-NOTE 180115 | 0.875 | 1,400 | 1,400 | 158,490 | 2018/1/15 |
| | 0.875 T-NOTE 180131 | 0.875 | 2,000 | 2,000 | 226,344 | 2018/1/31 |
| | 0.875 T-NOTE 180331 | 0.875 | 1,800 | 1,799 | 203,582 | 2018/3/31 |
| | 0.875 T-NOTE 180531 | 0.875 | 1,600 | 1,597 | 180,778 | 2018/5/31 |
| | 0.875 T-NOTE 180715 | 0.875 | 2,200 | 2,195 | 248,375 | 2018/7/15 |
| | 0.875 T-NOTE 181015 | 0.875 | 2,500 | 2,488 | 281,582 | 2018/10/15 |
| | 0.875 T-NOTE 190415 | 0.875 | 2,000 | 1,980 | 224,063 | 2019/4/15 |
| | 0.875 T-NOTE 190515 | 0.875 | 2,000 | 1,978 | 223,886 | 2019/5/15 |
| | 0.875 T-NOTE 190615 | 0.875 | 1,800 | 1,779 | 201,354 | 2019/6/15 |
| | 0.875 T-NOTE 190731 | 0.875 | 900 | 888 | 100,538 | 2019/7/31 |
| | 0.875 T-NOTE 190915 | 0.875 | 3,400 | 3,351 | 379,224 | 2019/9/15 |
| | 1 T-NOTE 171231 | 1.0 | 2,200 | 2,203 | 249,318 | 2017/12/31 |
| | 1 T-NOTE 180215 | 1.0 | 1,500 | 1,502 | 169,963 | 2018/2/15 |
| | 1 T-NOTE 180315 | 1.0 | 2,100 | 2,102 | 237,847 | 2018/3/15 |
| | 1 T-NOTE 180515 | 1.0 | 1,700 | 1,700 | 192,392 | 2018/5/15 |
| | 1 T-NOTE 180531 | 1.0 | 2,600 | 2,600 | 294,190 | 2018/5/31 |
| | 1 T-NOTE 180815 | 1.0 | 2,700 | 2,697 | 305,182 | 2018/8/15 |
| | 1 T-NOTE 180915 | 1.0 | 2,600 | 2,595 | 293,626 | 2018/9/15 |
| | 1 T-NOTE 181130 | 1.0 | 300 | 298 | 33,829 | 2018/11/30 |
| | 1 T-NOTE 190315 | 1.0 | 1,400 | 1,391 | 157,438 | 2019/3/15 |
| | 1 T-NOTE 190630 | 1.0 | 1,100 | 1,090 | 123,395 | 2019/6/30 |
| | 1 T-NOTE 190831 | 1.0 | 600 | 593 | 67,166 | 2019/8/31 |
| | 1 T-NOTE 190930 | 1.0 | 1,800 | 1,779 | 201,362 | 2019/9/30 |
| | 1 T-NOTE 191015 | 1.0 | 1,700 | 1,679 | 190,048 | 2019/10/15 |
| | 1 T-NOTE 191130 | 1.0 | 1,800 | 1,775 | 200,933 | 2019/11/30 |
| | 1.125 T-NOTE 180615 | 1.125 | 2,200 | 2,203 | 249,328 | 2018/6/15 |
| | 1.125 T-NOTE 190115 | 1.125 | 1,800 | 1,796 | 203,248 | 2019/1/15 |
| | 1.125 T-NOTE 190531 | 1.125 | 1,600 | 1,591 | 180,113 | 2019/5/31 |
| | 1.125 T-NOTE 191231 | 1.125 | 1,700 | 1,681 | 190,243 | 2019/12/31 |
| | 1.125 T-NOTE 200331 | 1.125 | 1,600 | 1,577 | 178,522 | 2020/3/31 |
| | 1.125 T-NOTE 200430 | 1.125 | 1,000 | 985 | 111,452 | 2020/4/30 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|------|---------------------|---------|---------|--------|---------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | | |
| アメリカ | | | | | | |
| 国債証券 | 1.125 T-NOTE 210228 | 1.125 | 2,700 | 2,623 | 296,817 | 2021/2/28 |
| | 1.125 T-NOTE 210630 | 1.125 | 2,200 | 2,126 | 240,645 | 2021/6/30 |
| | 1.125 T-NOTE 210731 | 1.125 | 2,200 | 2,123 | 240,275 | 2021/7/31 |
| | 1.125 T-NOTE 210831 | 1.125 | 3,000 | 2,893 | 327,383 | 2021/8/31 |
| | 1.125 T-NOTE 210930 | 1.125 | 2,700 | 2,599 | 294,167 | 2021/9/30 |
| | 1.25 T-NOTE 181031 | 1.25 | 2,400 | 2,403 | 271,963 | 2018/10/31 |
| | 1.25 T-NOTE 181115 | 1.25 | 1,900 | 1,902 | 215,262 | 2018/11/15 |
| | 1.25 T-NOTE 181130 | 1.25 | 2,500 | 2,502 | 283,173 | 2018/11/30 |
| | 1.25 T-NOTE 181215 | 1.25 | 2,400 | 2,401 | 271,761 | 2018/12/15 |
| | 1.25 T-NOTE 190131 | 1.25 | 2,400 | 2,400 | 271,570 | 2019/1/31 |
| | 1.25 T-NOTE 190430 | 1.25 | 600 | 598 | 67,775 | 2019/4/30 |
| | 1.25 T-NOTE 191031 | 1.25 | 1,400 | 1,392 | 157,587 | 2019/10/31 |
| | 1.25 T-NOTE 200131 | 1.25 | 2,700 | 2,677 | 302,903 | 2020/1/31 |
| | 1.25 T-NOTE 200229 | 1.25 | 1,600 | 1,585 | 179,399 | 2020/2/29 |
| | 1.25 T-NOTE 210331 | 1.25 | 1,900 | 1,853 | 209,694 | 2021/3/31 |
| | 1.25 T-NOTE 211031 | 1.25 | 600 | 580 | 65,678 | 2021/10/31 |
| | 1.25 T-NOTE 230731 | 1.25 | 1,500 | 1,407 | 159,223 | 2023/7/31 |
| | 1.375 T-NOTE 180630 | 1.375 | 1,800 | 1,809 | 204,696 | 2018/6/30 |
| | 1.375 T-NOTE 180731 | 1.375 | 2,300 | 2,311 | 261,525 | 2018/7/31 |
| | 1.375 T-NOTE 180930 | 1.375 | 3,200 | 3,213 | 363,607 | 2018/9/30 |
| | 1.375 T-NOTE 181130 | 1.375 | 1,100 | 1,103 | 124,858 | 2018/11/30 |
| | 1.375 T-NOTE 181231 | 1.375 | 2,000 | 2,006 | 227,033 | 2018/12/31 |
| | 1.375 T-NOTE 190228 | 1.375 | 1,200 | 1,202 | 136,061 | 2019/2/28 |
| | 1.375 T-NOTE 200131 | 1.375 | 1,900 | 1,891 | 214,044 | 2020/1/31 |
| | 1.375 T-NOTE 200229 | 1.375 | 2,500 | 2,485 | 281,217 | 2020/2/29 |
| | 1.375 T-NOTE 200331 | 1.375 | 2,100 | 2,085 | 236,018 | 2020/3/31 |
| | 1.375 T-NOTE 200430 | 1.375 | 2,000 | 1,984 | 224,549 | 2020/4/30 |
| | 1.375 T-NOTE 200531 | 1.375 | 2,000 | 1,982 | 224,337 | 2020/5/31 |
| | 1.375 T-NOTE 200831 | 1.375 | 2,700 | 2,667 | 301,853 | 2020/8/31 |
| | 1.375 T-NOTE 200930 | 1.375 | 2,600 | 2,566 | 290,351 | 2020/9/30 |
| | 1.375 T-NOTE 201031 | 1.375 | 2,600 | 2,563 | 290,029 | 2020/10/31 |
| | 1.375 T-NOTE 210131 | 1.375 | 2,300 | 2,259 | 255,670 | 2021/1/31 |
| | 1.375 T-NOTE 210430 | 1.375 | 2,600 | 2,546 | 288,099 | 2021/4/30 |
| | 1.375 T-NOTE 210531 | 1.375 | 3,200 | 3,130 | 354,244 | 2021/5/31 |
| | 1.375 T-NOTE 230630 | 1.375 | 2,500 | 2,366 | 267,803 | 2023/6/30 |
| | 1.375 T-NOTE 230831 | 1.375 | 2,800 | 2,643 | 299,147 | 2023/8/31 |
| | 1.375 T-NOTE 230930 | 1.375 | 2,300 | 2,170 | 245,545 | 2023/9/30 |
| | 1.5 T-NOTE 180831 | 1.5 | 3,400 | 3,422 | 387,234 | 2018/8/31 |
| | 1.5 T-NOTE 181231 | 1.5 | 2,900 | 2,915 | 329,903 | 2018/12/31 |
| | 1.5 T-NOTE 190131 | 1.5 | 2,600 | 2,613 | 295,660 | 2019/1/31 |
| | 1.5 T-NOTE 190228 | 1.5 | 2,400 | 2,411 | 272,854 | 2019/2/28 |
| | 1.5 T-NOTE 190331 | 1.5 | 1,000 | 1,004 | 113,605 | 2019/3/31 |
| | 1.5 T-NOTE 190531 | 1.5 | 2,800 | 2,809 | 317,896 | 2019/5/31 |
| | 1.5 T-NOTE 191031 | 1.5 | 2,000 | 2,002 | 226,529 | 2019/10/31 |
| | 1.5 T-NOTE 191130 | 1.5 | 2,900 | 2,901 | 328,250 | 2019/11/30 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|------|---------------------|---------|---------|--------|---------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| アメリカ | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | | |
| 国債証券 | | | | | | |
| | 1.5 T-NOTE 200531 | 1.5 | 2,300 | 2,289 | 259,004 | 2020/5/31 |
| | 1.5 T-NOTE 220131 | 1.5 | 2,400 | 2,341 | 264,940 | 2022/1/31 |
| | 1.5 T-NOTE 230228 | 1.5 | 2,200 | 2,109 | 238,700 | 2023/2/28 |
| | 1.5 T-NOTE 230331 | 1.5 | 1,800 | 1,723 | 194,982 | 2023/3/31 |
| | 1.5 T-NOTE 260815 | 1.5 | 5,000 | 4,566 | 516,644 | 2026/8/15 |
| | 1.625 T-NOTE 190331 | 1.625 | 2,700 | 2,718 | 307,581 | 2019/3/31 |
| | 1.625 T-NOTE 190430 | 1.625 | 1,100 | 1,107 | 125,272 | 2019/4/30 |
| | 1.625 T-NOTE 190630 | 1.625 | 1,700 | 1,710 | 193,497 | 2019/6/30 |
| | 1.625 T-NOTE 190731 | 1.625 | 1,700 | 1,709 | 193,391 | 2019/7/31 |
| | 1.625 T-NOTE 190831 | 1.625 | 3,100 | 3,116 | 352,601 | 2019/8/31 |
| | 1.625 T-NOTE 191231 | 1.625 | 1,200 | 1,203 | 136,214 | 2019/12/31 |
| | 1.625 T-NOTE 200630 | 1.625 | 2,700 | 2,695 | 305,027 | 2020/6/30 |
| | 1.625 T-NOTE 200731 | 1.625 | 3,300 | 3,292 | 372,490 | 2020/7/31 |
| | 1.625 T-NOTE 201130 | 1.625 | 2,400 | 2,385 | 269,926 | 2020/11/30 |
| | 1.625 T-NOTE 220815 | 1.625 | 1,600 | 1,558 | 176,287 | 2022/8/15 |
| | 1.625 T-NOTE 221115 | 1.625 | 2,400 | 2,328 | 263,498 | 2022/11/15 |
| | 1.625 T-NOTE 230430 | 1.625 | 2,200 | 2,120 | 239,906 | 2023/4/30 |
| | 1.625 T-NOTE 230531 | 1.625 | 1,600 | 1,540 | 174,265 | 2023/5/31 |
| | 1.625 T-NOTE 231031 | 1.625 | 1,000 | 957 | 108,394 | 2023/10/31 |
| | 1.625 T-NOTE 260215 | 1.625 | 4,700 | 4,363 | 493,747 | 2026/2/15 |
| | 1.625 T-NOTE 260515 | 1.625 | 4,800 | 4,446 | 503,107 | 2026/5/15 |
| | 1.75 T-NOTE 181031 | 1.75 | 700 | 707 | 80,018 | 2018/10/31 |
| | 1.75 T-NOTE 190930 | 1.75 | 2,300 | 2,318 | 262,359 | 2019/9/30 |
| | 1.75 T-NOTE 201031 | 1.75 | 2,300 | 2,299 | 260,184 | 2020/10/31 |
| | 1.75 T-NOTE 201231 | 1.75 | 2,500 | 2,494 | 282,278 | 2020/12/31 |
| | 1.75 T-NOTE 211130 | 1.75 | 1,300 | 1,286 | 145,612 | 2021/11/30 |
| | 1.75 T-NOTE 220228 | 1.75 | 2,100 | 2,071 | 234,366 | 2022/2/28 |
| | 1.75 T-NOTE 220331 | 1.75 | 2,200 | 2,167 | 245,234 | 2022/3/31 |
| | 1.75 T-NOTE 220430 | 1.75 | 2,000 | 1,968 | 222,693 | 2022/4/30 |
| | 1.75 T-NOTE 220515 | 1.75 | 1,800 | 1,770 | 200,320 | 2022/5/15 |
| | 1.75 T-NOTE 220930 | 1.75 | 2,000 | 1,956 | 221,367 | 2022/9/30 |
| | 1.75 T-NOTE 230131 | 1.75 | 2,100 | 2,045 | 231,451 | 2023/1/31 |
| | 1.75 T-NOTE 230515 | 1.75 | 4,000 | 3,882 | 439,269 | 2023/5/15 |
| | 1.875 T-NOTE 200630 | 1.875 | 1,300 | 1,308 | 148,083 | 2020/6/30 |
| | 1.875 T-NOTE 211130 | 1.875 | 2,300 | 2,287 | 258,821 | 2021/11/30 |
| | 1.875 T-NOTE 220531 | 1.875 | 2,200 | 2,177 | 246,343 | 2022/5/31 |
| | 1.875 T-NOTE 220831 | 1.875 | 2,000 | 1,971 | 223,099 | 2022/8/31 |
| | 1.875 T-NOTE 221031 | 1.875 | 2,000 | 1,967 | 222,657 | 2022/10/31 |
| | 2 T-NOTE 200731 | 2.0 | 1,100 | 1,111 | 125,806 | 2020/7/31 |
| | 2 T-NOTE 200930 | 2.0 | 1,600 | 1,615 | 182,737 | 2020/9/30 |
| | 2 T-NOTE 201130 | 2.0 | 1,300 | 1,310 | 148,255 | 2020/11/30 |
| | 2 T-NOTE 210228 | 2.0 | 2,000 | 2,012 | 227,661 | 2021/2/28 |
| | 2 T-NOTE 210531 | 2.0 | 2,200 | 2,209 | 249,980 | 2021/5/31 |
| | 2 T-NOTE 210831 | 2.0 | 2,300 | 2,304 | 260,753 | 2021/8/31 |
| | 2 T-NOTE 211031 | 2.0 | 2,500 | 2,501 | 283,029 | 2021/10/31 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|------|---------------------|---------|---------|--------|---------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | | |
| アメリカ | | | | | | |
| 国債証券 | | | | | | |
| | 2 T-NOTE 211115 | 2.0 | 3,400 | 3,401 | 384,830 | 2021/11/15 |
| | 2 T-NOTE 220215 | 2.0 | 2,200 | 2,197 | 248,667 | 2022/2/15 |
| | 2 T-NOTE 220731 | 2.0 | 2,000 | 1,987 | 224,938 | 2022/7/31 |
| | 2 T-NOTE 221130 | 2.0 | 2,000 | 1,979 | 224,001 | 2022/11/30 |
| | 2 T-NOTE 230215 | 2.0 | 4,000 | 3,951 | 447,154 | 2023/2/15 |
| | 2 T-NOTE 250215 | 2.0 | 4,900 | 4,739 | 536,329 | 2025/2/15 |
| | 2 T-NOTE 250815 | 2.0 | 4,700 | 4,525 | 512,111 | 2025/8/15 |
| | 2 T-NOTE 261115 | 2.0 | 2,600 | 2,482 | 280,882 | 2026/11/15 |
| | 2.125 T-NOTE 200831 | 2.125 | 2,200 | 2,229 | 252,294 | 2020/8/31 |
| | 2.125 T-NOTE 210131 | 2.125 | 1,600 | 1,617 | 183,062 | 2021/1/31 |
| | 2.125 T-NOTE 210630 | 2.125 | 2,600 | 2,623 | 296,833 | 2021/6/30 |
| | 2.125 T-NOTE 210815 | 2.125 | 3,300 | 3,325 | 376,239 | 2021/8/15 |
| | 2.125 T-NOTE 210930 | 2.125 | 2,500 | 2,517 | 284,819 | 2021/9/30 |
| | 2.125 T-NOTE 211231 | 2.125 | 2,300 | 2,314 | 261,830 | 2021/12/31 |
| | 2.125 T-NOTE 220630 | 2.125 | 2,000 | 2,002 | 226,565 | 2022/6/30 |
| | 2.125 T-NOTE 221231 | 2.125 | 2,100 | 2,091 | 236,649 | 2022/12/31 |
| | 2.125 T-NOTE 231130 | 2.125 | 1,700 | 1,680 | 190,175 | 2023/11/30 |
| | 2.125 T-NOTE 250515 | 2.125 | 4,700 | 4,580 | 518,302 | 2025/5/15 |
| | 2.25 T-BOND 460815 | 2.25 | 3,100 | 2,578 | 291,765 | 2046/8/15 |
| | 2.25 T-NOTE 180731 | 2.25 | 800 | 814 | 92,135 | 2018/7/31 |
| | 2.25 T-NOTE 210331 | 2.25 | 2,000 | 2,031 | 229,818 | 2021/3/31 |
| | 2.25 T-NOTE 210430 | 2.25 | 2,300 | 2,334 | 264,148 | 2021/4/30 |
| | 2.25 T-NOTE 210731 | 2.25 | 2,100 | 2,128 | 240,826 | 2021/7/31 |
| | 2.25 T-NOTE 241115 | 2.25 | 4,800 | 4,742 | 536,628 | 2024/11/15 |
| | 2.25 T-NOTE 251115 | 2.25 | 4,900 | 4,803 | 543,562 | 2025/11/15 |
| | 2.375 T-NOTE 180531 | 2.375 | 1,300 | 1,323 | 149,789 | 2018/5/31 |
| | 2.375 T-NOTE 180630 | 2.375 | 1,000 | 1,018 | 115,293 | 2018/6/30 |
| | 2.375 T-NOTE 201231 | 2.375 | 800 | 817 | 92,493 | 2020/12/31 |
| | 2.375 T-NOTE 240815 | 2.375 | 4,300 | 4,297 | 486,278 | 2024/8/15 |
| | 2.5 T-BOND 450215 | 2.5 | 3,100 | 2,739 | 309,961 | 2045/2/15 |
| | 2.5 T-BOND 460215 | 2.5 | 2,650 | 2,333 | 264,006 | 2046/2/15 |
| | 2.5 T-BOND 460515 | 2.5 | 2,850 | 2,508 | 283,855 | 2046/5/15 |
| | 2.5 T-NOTE 230815 | 2.5 | 3,600 | 3,647 | 412,686 | 2023/8/15 |
| | 2.5 T-NOTE 240515 | 2.5 | 5,300 | 5,354 | 605,832 | 2024/5/15 |
| | 2.625 T-NOTE 180131 | 2.625 | 1,100 | 1,119 | 126,672 | 2018/1/31 |
| | 2.625 T-NOTE 180430 | 2.625 | 1,500 | 1,531 | 173,298 | 2018/4/30 |
| | 2.625 T-NOTE 200815 | 2.625 | 2,500 | 2,579 | 291,847 | 2020/8/15 |
| | 2.625 T-NOTE 201115 | 2.625 | 4,200 | 4,331 | 490,155 | 2020/11/15 |
| | 2.75 T-BOND 420815 | 2.75 | 1,700 | 1,595 | 180,573 | 2042/8/15 |
| | 2.75 T-BOND 421115 | 2.75 | 1,800 | 1,687 | 190,924 | 2042/11/15 |
| | 2.75 T-NOTE 171231 | 2.75 | 1,300 | 1,322 | 149,686 | 2017/12/31 |
| | 2.75 T-NOTE 180228 | 2.75 | 900 | 917 | 103,867 | 2018/2/28 |
| | 2.75 T-NOTE 190215 | 2.75 | 1,300 | 1,338 | 151,433 | 2019/2/15 |
| | 2.75 T-NOTE 231115 | 2.75 | 4,900 | 5,036 | 569,855 | 2023/11/15 |
| | 2.75 T-NOTE 240215 | 2.75 | 3,500 | 3,596 | 406,977 | 2024/2/15 |

| 銘柄 | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|---------------------|-------|---------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | |
| アメリカ | | | | | | |
| | 国債証券 | | | | | |
| | 2.875 T-BOND 430515 | 2.875 | 3,200 | 3,069 | 347,257 | 2043/5/15 |
| | 2.875 T-BOND 450815 | 2.875 | 3,200 | 3,051 | 345,305 | 2045/8/15 |
| | 2.875 T-BOND 461115 | 2.875 | 1,400 | 1,337 | 151,293 | 2046/11/15 |
| | 2.875 T-NOTE 180331 | 2.875 | 1,000 | 1,022 | 115,713 | 2018/3/31 |
| | 3 T-BOND 420515 | 3.0 | 1,300 | 1,280 | 144,923 | 2042/5/15 |
| | 3 T-BOND 441115 | 3.0 | 3,200 | 3,136 | 354,923 | 2044/11/15 |
| | 3 T-BOND 450515 | 3.0 | 3,150 | 3,081 | 348,681 | 2045/5/15 |
| | 3 T-BOND 451115 | 3.0 | 3,200 | 3,127 | 353,876 | 2045/11/15 |
| | 3.125 T-BOND 411115 | 3.125 | 1,200 | 1,209 | 136,904 | 2041/11/15 |
| | 3.125 T-BOND 420215 | 3.125 | 1,400 | 1,410 | 159,635 | 2042/2/15 |
| | 3.125 T-BOND 430215 | 3.125 | 1,900 | 1,909 | 216,076 | 2043/2/15 |
| | 3.125 T-BOND 440815 | 3.125 | 3,200 | 3,215 | 363,833 | 2044/8/15 |
| | 3.125 T-NOTE 190515 | 3.125 | 2,700 | 2,809 | 317,880 | 2019/5/15 |
| | 3.125 T-NOTE 210515 | 3.125 | 2,400 | 2,521 | 285,350 | 2021/5/15 |
| | 3.375 T-BOND 440515 | 3.375 | 3,200 | 3,369 | 381,202 | 2044/5/15 |
| | 3.375 T-NOTE 191115 | 3.375 | 3,300 | 3,471 | 392,808 | 2019/11/15 |
| | 3.5 T-BOND 390215 | 3.5 | 1,000 | 1,083 | 122,617 | 2039/2/15 |
| | 3.5 T-NOTE 180215 | 3.5 | 1,600 | 1,643 | 185,990 | 2018/2/15 |
| | 3.5 T-NOTE 200515 | 3.5 | 2,300 | 2,438 | 275,869 | 2020/5/15 |
| | 3.625 T-BOND 430815 | 3.625 | 2,500 | 2,747 | 310,919 | 2043/8/15 |
| | 3.625 T-BOND 440215 | 3.625 | 3,300 | 3,626 | 410,384 | 2044/2/15 |
| | 3.625 T-NOTE 190815 | 3.625 | 2,200 | 2,321 | 262,708 | 2019/8/15 |
| | 3.625 T-NOTE 200215 | 3.625 | 2,900 | 3,078 | 348,361 | 2020/2/15 |
| | 3.625 T-NOTE 210215 | 3.625 | 3,700 | 3,961 | 448,222 | 2021/2/15 |
| | 3.75 T-BOND 410815 | 3.75 | 1,100 | 1,230 | 139,284 | 2041/8/15 |
| | 3.75 T-BOND 431115 | 3.75 | 2,950 | 3,317 | 375,386 | 2043/11/15 |
| | 3.75 T-NOTE 181115 | 3.75 | 2,700 | 2,823 | 319,479 | 2018/11/15 |
| | 3.875 T-BOND 400815 | 3.875 | 1,200 | 1,368 | 154,810 | 2040/8/15 |
| | 3.875 T-NOTE 180515 | 3.875 | 500 | 518 | 58,689 | 2018/5/15 |
| | 4 T-NOTE 180815 | 4.0 | 900 | 941 | 106,517 | 2018/8/15 |
| | 4.25 T-BOND 390515 | 4.25 | 800 | 963 | 108,963 | 2039/5/15 |
| | 4.25 T-BOND 401115 | 4.25 | 1,400 | 1,686 | 190,859 | 2040/11/15 |
| | 4.375 T-BOND 380215 | 4.375 | 500 | 616 | 69,719 | 2038/2/15 |
| | 4.375 T-BOND 391115 | 4.375 | 900 | 1,101 | 124,636 | 2039/11/15 |
| | 4.375 T-BOND 400515 | 4.375 | 1,500 | 1,837 | 207,939 | 2040/5/15 |
| | 4.375 T-BOND 410515 | 4.375 | 1,100 | 1,351 | 152,907 | 2041/5/15 |
| | 4.5 T-BOND 360215 | 4.5 | 1,100 | 1,378 | 156,018 | 2036/2/15 |
| | 4.5 T-BOND 380515 | 4.5 | 700 | 876 | 99,179 | 2038/5/15 |
| | 4.5 T-BOND 390815 | 4.5 | 650 | 809 | 91,595 | 2039/8/15 |
| | 4.625 T-BOND 400215 | 4.625 | 1,500 | 1,900 | 214,993 | 2040/2/15 |
| | 4.75 T-BOND 410215 | 4.75 | 1,500 | 1,940 | 219,568 | 2041/2/15 |
| | 5 T-BOND 370515 | 5.0 | 400 | 532 | 60,195 | 2037/5/15 |
| | 5.25 T-BOND 281115 | 5.25 | 750 | 949 | 107,397 | 2028/11/15 |
| | 5.25 T-BOND 290215 | 5.25 | 400 | 508 | 57,490 | 2029/2/15 |
| | 5.375 T-BOND 310215 | 5.375 | 1,000 | 1,322 | 149,685 | 2031/2/15 |

| 銘柄 | | 当 期 末 | | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|-------|---------|---------|------------|------------|-------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 債 権 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 | 5.5 T-BOND 280815 | 5.5 | 600 | 771 | 87,310 | 2028/8/15 | |
| | 6 T-BOND 260215 | 6.0 | 700 | 899 | 101,803 | 2026/2/15 | |
| | 6.125 T-BOND 271115 | 6.125 | 600 | 799 | 90,519 | 2027/11/15 | |
| | 6.25 T-BOND 230815 | 6.25 | 600 | 747 | 84,592 | 2023/8/15 | |
| | 6.25 T-BOND 300515 | 6.25 | 500 | 702 | 79,443 | 2030/5/15 | |
| | 6.5 T-BOND 261115 | 6.5 | 500 | 673 | 76,150 | 2026/11/15 | |
| | 8 T-BOND 211115 | 8.0 | 800 | 1,020 | 115,497 | 2021/11/15 | |
| | 8.125 T-BOND 190815 | 8.125 | 600 | 701 | 79,354 | 2019/8/15 | |
| | 8.75 T-BOND 200815 | 8.75 | 700 | 870 | 98,467 | 2020/8/15 | |
| | 8.875 T-BOND 190215 | 8.875 | 1,000 | 1,157 | 130,940 | 2019/2/15 | |
| 小 | 計 | | | | 55,956,749 | | |
| カナダ | | | 千カナダドル | 千カナダドル | | | |
| 国債証券 | 0.25 CAN GOVT 180501 | 0.25 | 1,100 | 1,093 | 94,795 | 2018/5/1 | |
| | 0.5 CAN GOVT 180801 | 0.5 | 800 | 796 | 69,063 | 2018/8/1 | |
| | 0.5 CAN GOVT 181101 | 0.5 | 1,200 | 1,194 | 103,475 | 2018/11/1 | |
| | 0.5 CAN GOVT 220301 | 0.5 | 600 | 578 | 50,112 | 2022/3/1 | |
| | 0.75 CAN GOVT 200901 | 0.75 | 1,200 | 1,187 | 102,869 | 2020/9/1 | |
| | 0.75 CAN GOVT 210301 | 0.75 | 1,300 | 1,280 | 110,974 | 2021/3/1 | |
| | 0.75 CAN GOVT 210901 | 0.75 | 1,000 | 981 | 85,048 | 2021/9/1 | |
| | 1 CAN GOVT 270601 | 1.0 | 300 | 274 | 23,746 | 2027/6/1 | |
| | 1.25 CAN GOVT 180201 | 1.25 | 1,200 | 1,207 | 104,633 | 2018/2/1 | |
| | 1.25 CAN GOVT 180301 | 1.25 | 700 | 704 | 61,054 | 2018/3/1 | |
| | 1.25 CAN GOVT 180901 | 1.25 | 1,200 | 1,208 | 104,757 | 2018/9/1 | |
| | 1.5 CAN GOVT 200301 | 1.5 | 700 | 710 | 61,590 | 2020/3/1 | |
| | 1.5 CAN GOVT 230601 | 1.5 | 1,000 | 1,003 | 86,929 | 2023/6/1 | |
| | 1.5 CAN GOVT 260601 | 1.5 | 900 | 875 | 75,853 | 2026/6/1 | |
| | 1.75 CAN GOVT 190301 | 1.75 | 900 | 917 | 79,504 | 2019/3/1 | |
| | 1.75 CAN GOVT 190901 | 1.75 | 1,100 | 1,124 | 97,440 | 2019/9/1 | |
| | 2.25 CAN GOVT 250601 | 2.25 | 1,100 | 1,144 | 99,203 | 2025/6/1 | |
| | 2.5 CAN GOVT 240601 | 2.5 | 950 | 1,008 | 87,414 | 2024/6/1 | |
| | 2.75 CAN GOVT 220601 | 2.75 | 950 | 1,020 | 88,478 | 2022/6/1 | |
| | 2.75 CAN GOVT 481201 | 2.75 | 850 | 906 | 78,529 | 2048/12/1 | |
| | 2.75 CANADA GOVER 641201 | 2.75 | 250 | 272 | 23,624 | 2064/12/1 | |
| | 3.25 CAN GOVT 210601 | 3.25 | 800 | 871 | 75,485 | 2021/6/1 | |
| | 3.5 CAN GOVT 200601 | 3.5 | 1,100 | 1,189 | 103,040 | 2020/6/1 | |
| | 3.5 CAN GOVT 451201 | 3.5 | 1,250 | 1,511 | 131,008 | 2045/12/1 | |
| | 3.75 CAN GOVT 190601 | 3.75 | 1,600 | 1,707 | 148,005 | 2019/6/1 | |
| | 4 CAN GOVT 410601 | 4.0 | 1,100 | 1,404 | 121,708 | 2041/6/1 | |
| | 4.25 CAN GOVT 180601 | 4.25 | 1,000 | 1,047 | 90,740 | 2018/6/1 | |
| | 5 CAN GOVT 370601 | 5.0 | 1,000 | 1,411 | 122,303 | 2037/6/1 | |
| | 5.75 CAN GOVT 290601 | 5.75 | 900 | 1,255 | 108,781 | 2029/6/1 | |
| | 5.75 CAN GOVT 330601 | 5.75 | 950 | 1,392 | 120,678 | 2033/6/1 | |
| | 8 CAN GOVT 270601 | 8.0 | 300 | 470 | 40,773 | 2027/6/1 | |
| 小 | 計 | | | | 2,751,626 | | |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|------------------|--------|---------|---------|------------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| メキシコ | | | % | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | 千円 | |
| 国債証券 | 10 MEXICAN BONOS 241205 | 10.0 | 19,200 | 22,029 | 118,300 | 2024/12/5 | |
| | 10 MEXICAN BONOS 361120 | 10.0 | 4,700 | 5,593 | 30,037 | 2036/11/20 | |
| | 4.75 MEXICAN BONO 180614 | 4.75 | 13,600 | 13,244 | 71,123 | 2018/6/14 | |
| | 5 MEXICAN BONOS 191211 | 5.0 | 16,900 | 16,032 | 86,095 | 2019/12/11 | |
| | 5.75 MEXICAN BONO 260305 | 5.75 | 6,900 | 6,061 | 32,548 | 2026/3/5 | |
| | 6.5 MEXICAN BONOS 210610 | 6.5 | 22,700 | 22,057 | 118,448 | 2021/6/10 | |
| | 6.5 MEXICAN BONOS 220609 | 6.5 | 8,300 | 7,988 | 42,900 | 2022/6/9 | |
| | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 7.5 | 6,600 | 6,507 | 34,943 | 2027/6/3 | |
| | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 7.75 | 10,200 | 10,006 | 53,736 | 2031/5/29 | |
| | 7.75 MEXICAN BONO 341123 | 7.75 | 7,000 | 6,797 | 36,500 | 2034/11/23 | |
| | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 7.75 | 12,300 | 11,897 | 63,888 | 2042/11/13 | |
| | 8 MEXICAN BONOS 200611 | 8.0 | 9,800 | 10,063 | 54,041 | 2020/6/11 | |
| | 8 MEXICAN BONOS 231207 | 8.0 | 7,100 | 7,298 | 39,190 | 2023/12/7 | |
| | 8.5 MEXICAN BONOS 181213 | 8.5 | 18,400 | 18,941 | 101,717 | 2018/12/13 | |
| | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 8.5 | 6,900 | 7,260 | 38,988 | 2029/5/31 | |
| | 8.5 MEXICAN BONOS 381118 | 8.5 | 7,500 | 7,824 | 42,017 | 2038/11/18 | |
| 小 計 | | | | | 964,478 | | |
| ユーロ | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | |
| ドイツ | 国債証券 | 0 BUND 260815 | — | 1,300 | 1,252 | 152,469 | 2026/8/15 |
| | | 0 OBL 200417 | — | 1,500 | 1,529 | 186,235 | 2020/4/17 |
| | | 0 OBL 210409 | — | 1,700 | 1,733 | 211,013 | 2021/4/9 |
| | | 0 OBL 211008 | — | 1,000 | 1,018 | 123,955 | 2021/10/8 |
| | | 0 SCHATS 180316 | — | 1,100 | 1,108 | 134,961 | 2018/3/16 |
| | | 0 SCHATS 180615 | — | 1,300 | 1,312 | 159,779 | 2018/6/15 |
| | | 0.25 OBL 180413 | 0.25 | 1,500 | 1,517 | 184,732 | 2018/4/13 |
| | | 0.25 OBL 191011 | 0.25 | 1,400 | 1,434 | 174,687 | 2019/10/11 |
| | | 0.25 OBL 201016 | 0.25 | 1,600 | 1,647 | 200,577 | 2020/10/16 |
| | | 0.5 BUND 250215 | 0.5 | 2,000 | 2,058 | 250,692 | 2025/2/15 |
| | | 0.5 BUND 260215 | 0.5 | 2,100 | 2,137 | 260,273 | 2026/2/15 |
| | | 0.5 OBL 180223 | 0.5 | 1,200 | 1,215 | 147,963 | 2018/2/23 |
| | | 0.5 OBL 190412 | 0.5 | 1,400 | 1,437 | 174,972 | 2019/4/12 |
| | | 1 BUND 240815 | 1.0 | 1,350 | 1,446 | 176,136 | 2024/8/15 |
| | | 1 BUND 250815 | 1.0 | 1,900 | 2,027 | 246,825 | 2025/8/15 |
| | | 1 OBL 181012 | 1.0 | 1,200 | 1,234 | 150,300 | 2018/10/12 |
| | | 1 OBL 190222 | 1.0 | 1,400 | 1,449 | 176,473 | 2019/2/22 |
| | | 1.5 BUND 220904 | 1.5 | 1,300 | 1,428 | 173,972 | 2022/9/4 |
| | | 1.5 BUND 230215 | 1.5 | 1,200 | 1,322 | 161,070 | 2023/2/15 |
| | | 1.5 BUND 230515 | 1.5 | 1,300 | 1,435 | 174,795 | 2023/5/15 |
| | | 1.5 BUND 240515 | 1.5 | 1,300 | 1,441 | 175,456 | 2024/5/15 |
| | | 1.75 BUND 220704 | 1.75 | 1,700 | 1,888 | 229,885 | 2022/7/4 |
| | | 1.75 BUND 240215 | 1.75 | 1,300 | 1,463 | 178,219 | 2024/2/15 |
| | | 2 BUND 220104 | 2.0 | 1,500 | 1,674 | 203,875 | 2022/1/4 |
| | | 2 BUND 230815 | 2.0 | 1,500 | 1,708 | 208,064 | 2023/8/15 |
| | | 2.25 BUND 200904 | 2.25 | 1,300 | 1,433 | 174,541 | 2020/9/4 |
| | | 2.25 BUND 210904 | 2.25 | 1,100 | 1,236 | 150,577 | 2021/9/4 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------------------|------|------------------------|-------|---------|----------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| ドイツ | 国債証券 | 2.5 BUND 210104 | 2.5 | 1,600 | 1,791 | 218,169 | 2021/1/4 |
| | | 2.5 BUND 440704 | 2.5 | 1,400 | 1,829 | 222,735 | 2044/7/4 |
| | | 2.5 BUND 460815 | 2.5 | 1,400 | 1,842 | 224,397 | 2046/8/15 |
| | | 3 BUND 200704 | 3.0 | 1,600 | 1,798 | 219,028 | 2020/7/4 |
| | | 3.25 BUND 200104 | 3.25 | 1,300 | 1,449 | 176,540 | 2020/1/4 |
| | | 3.25 BUND 210704 | 3.25 | 1,500 | 1,748 | 212,953 | 2021/7/4 |
| | | 3.25 BUND 420704 | 3.25 | 1,100 | 1,609 | 195,918 | 2042/7/4 |
| | | 3.5 BUND 190704 | 3.5 | 1,800 | 1,984 | 241,682 | 2019/7/4 |
| | | 3.75 BUND 190104 | 3.75 | 1,900 | 2,064 | 251,368 | 2019/1/4 |
| | | 4 BUND 180104 | 4.0 | 1,400 | 1,461 | 178,006 | 2018/1/4 |
| | | 4 BUND 370104 | 4.0 | 1,700 | 2,634 | 320,811 | 2037/1/4 |
| | | 4.25 BUND 180704 | 4.25 | 1,700 | 1,821 | 221,776 | 2018/7/4 |
| | | 4.25 BUND 390704 | 4.25 | 870 | 1,427 | 173,758 | 2039/7/4 |
| | | 4.75 BUND 280704 | 4.75 | 800 | 1,173 | 142,859 | 2028/7/4 |
| | | 4.75 BUND 340704 | 4.75 | 1,500 | 2,446 | 297,897 | 2034/7/4 |
| | | 4.75 BUND 400704 | 4.75 | 1,300 | 2,291 | 278,985 | 2040/7/4 |
| | | 5.5 BUND 310104 | 5.5 | 1,300 | 2,128 | 259,218 | 2031/1/4 |
| | | 5.625 BUND 280104 | 5.625 | 1,250 | 1,934 | 235,539 | 2028/1/4 |
| 6.25 BUND 240104 | 6.25 | 600 | 862 | 104,984 | 2024/1/4 | | |
| 6.25 BUND 300104 | 6.25 | 550 | 934 | 113,816 | 2030/1/4 | | |
| 6.5 BUND 270704 | 6.5 | 700 | 1,134 | 138,098 | 2027/7/4 | | |
| イタリア | 国債証券 | 0.05 ITALY GOVT 191015 | 0.05 | 200 | 199 | 24,306 | 2019/10/15 |
| | | 0.1 ITALY GOVT 190415 | 0.1 | 600 | 600 | 73,166 | 2019/4/15 |
| | | 0.25 ITALY GOVT 180515 | 0.25 | 1,300 | 1,307 | 159,150 | 2018/5/15 |
| | | 0.3 ITALY GOVT 181015 | 0.3 | 500 | 503 | 61,292 | 2018/10/15 |
| | | 0.45 ITALY GOVT 210601 | 0.45 | 1,100 | 1,095 | 133,427 | 2021/6/1 |
| | | 0.65 ITALY GOVT 201101 | 0.65 | 900 | 911 | 110,929 | 2020/11/1 |
| | | 0.65 ITALY GOVT 231015 | 0.65 | 400 | 382 | 46,523 | 2023/10/15 |
| | | 0.7 ITALY GOVT 200501 | 0.7 | 1,100 | 1,116 | 136,003 | 2020/5/1 |
| | | 0.75 ITALY GOVT 180115 | 0.75 | 900 | 908 | 110,648 | 2018/1/15 |
| | | 0.95 ITALY GOVT 230315 | 0.95 | 1,100 | 1,086 | 132,279 | 2023/3/15 |
| | | 1.05 ITALY GOVT 191201 | 1.05 | 900 | 923 | 112,451 | 2019/12/1 |
| | | 1.25 ITALY GOVT 261201 | 1.25 | 1,100 | 1,018 | 123,971 | 2026/12/1 |
| | | 1.35 ITALY GOVT 220415 | 1.35 | 1,300 | 1,329 | 161,869 | 2022/4/15 |
| | | 1.45 ITALY GOVT 220915 | 1.45 | 1,300 | 1,331 | 162,114 | 2022/9/15 |
| | | 1.5 ITALY GOVT 190801 | 1.5 | 1,200 | 1,242 | 151,252 | 2019/8/1 |
| | | 1.5 ITALY GOVT 250601 | 1.5 | 1,500 | 1,462 | 178,102 | 2025/6/1 |
| | | 1.6 ITALY GOVT 260601 | 1.6 | 1,400 | 1,350 | 164,393 | 2026/6/1 |
| | | 1.65 ITALY GOVT 320301 | 1.65 | 1,600 | 1,437 | 175,074 | 2032/3/1 |
| | | 2 ITALY GOVT 251201 | 2.0 | 1,300 | 1,304 | 158,872 | 2025/12/1 |
| | | 2.15 ITALY GOVT 211215 | 2.15 | 900 | 960 | 116,957 | 2021/12/15 |
| | | 2.25 ITALY GOVT 360901 | 2.25 | 700 | 648 | 78,927 | 2036/9/1 |
| | | 2.5 ITALY GOVT 190501 | 2.5 | 1,300 | 1,371 | 167,009 | 2019/5/1 |
| | | 2.5 ITALY GOVT 241201 | 2.5 | 1,400 | 1,481 | 180,417 | 2024/12/1 |
| | | 2.7 ITALY GOVT 470301 | 2.7 | 900 | 808 | 98,454 | 2047/3/1 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|------|------------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| イタリア | 国債証券 | 2.8 ITALY GOVT 670301 | 2.8 | 400 | 333 | 40,587 | 2067/3/1 |
| | | 3.25 ITALY GOVT 460901 | 3.25 | 1,050 | 1,055 | 128,497 | 2046/9/1 |
| | | 3.5 ITALY GOVT 180601 | 3.5 | 2,200 | 2,308 | 281,142 | 2018/6/1 |
| | | 3.5 ITALY GOVT 181201 | 3.5 | 1,400 | 1,492 | 181,766 | 2018/12/1 |
| | | 3.5 ITALY GOVT 300301 | 3.5 | 1,400 | 1,565 | 190,649 | 2030/3/1 |
| | | 3.75 ITALY GOVT 210301 | 3.75 | 2,100 | 2,381 | 289,933 | 2021/3/1 |
| | | 3.75 ITALY GOVT 210501 | 3.75 | 1,500 | 1,702 | 207,314 | 2021/5/1 |
| | | 3.75 ITALY GOVT 210801 | 3.75 | 2,600 | 2,964 | 360,901 | 2021/8/1 |
| | | 3.75 ITALY GOVT 240901 | 3.75 | 1,500 | 1,723 | 209,840 | 2024/9/1 |
| | | 4 ITALY GOVT 200901 | 4.0 | 1,700 | 1,924 | 234,292 | 2020/9/1 |
| | | 4 ITALY GOVT 370201 | 4.0 | 2,000 | 2,347 | 285,774 | 2037/2/1 |
| | | 4.25 ITALY GOVT 190201 | 4.25 | 2,300 | 2,498 | 304,203 | 2019/2/1 |
| | | 4.25 ITALY GOVT 190901 | 4.25 | 2,100 | 2,324 | 283,067 | 2019/9/1 |
| | | 4.25 ITALY GOVT 200301 | 4.25 | 1,900 | 2,137 | 260,222 | 2020/3/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 180201 | 4.5 | 700 | 733 | 89,333 | 2018/2/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 180801 | 4.5 | 2,200 | 2,354 | 286,676 | 2018/8/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 190301 | 4.5 | 2,000 | 2,187 | 266,379 | 2019/3/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 200201 | 4.5 | 1,700 | 1,920 | 233,788 | 2020/2/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 230501 | 4.5 | 1,600 | 1,914 | 233,165 | 2023/5/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 240301 | 4.5 | 1,750 | 2,102 | 256,024 | 2024/3/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 260301 | 4.5 | 1,300 | 1,565 | 190,658 | 2026/3/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 210901 | 4.75 | 2,000 | 2,371 | 288,724 | 2021/9/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 230801 | 4.75 | 2,100 | 2,558 | 311,482 | 2023/8/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 280901 | 4.75 | 1,500 | 1,867 | 227,405 | 2028/9/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 440901 | 4.75 | 1,100 | 1,407 | 171,382 | 2044/9/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 220301 | 5.0 | 1,400 | 1,687 | 205,499 | 2022/3/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 250301 | 5.0 | 1,900 | 2,362 | 287,692 | 2025/3/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 340801 | 5.0 | 1,750 | 2,302 | 280,329 | 2034/8/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 390801 | 5.0 | 1,400 | 1,849 | 225,171 | 2039/8/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 400901 | 5.0 | 1,650 | 2,166 | 263,823 | 2040/9/1 |
| | | 5.25 ITALY GOVT 291101 | 5.25 | 2,100 | 2,753 | 335,205 | 2029/11/1 |
| | | 5.5 ITALY GOVT 220901 | 5.5 | 1,700 | 2,116 | 257,651 | 2022/9/1 |
| | | 5.5 ITALY GOVT 221101 | 5.5 | 1,200 | 1,496 | 182,232 | 2022/11/1 |
| | | 5.75 ITALY GOVT 330201 | 5.75 | 1,200 | 1,681 | 204,725 | 2033/2/1 |
| | | 6 ITALY GOVT 310501 | 6.0 | 2,450 | 3,470 | 422,568 | 2031/5/1 |
| | | 6.5 ITALY GOVT 271101 | 6.5 | 1,900 | 2,681 | 326,473 | 2027/11/1 |
| | | 7.25 ITALY GOVT 261101 | 7.25 | 700 | 1,022 | 124,514 | 2026/11/1 |
| | | 9 ITALY GOVT 231101 | 9.0 | 1,000 | 1,492 | 181,756 | 2023/11/1 |
| フランス | 国債証券 | 0 O.A.T 180225 | — | 700 | 704 | 85,739 | 2018/2/25 |
| | | 0 O.A.T 190225 | — | 700 | 707 | 86,118 | 2019/2/25 |
| | | 0 O.A.T 200525 | — | 1,700 | 1,717 | 209,155 | 2020/5/25 |
| | | 0 O.A.T 210525 | — | 1,600 | 1,610 | 196,054 | 2021/5/25 |
| | | 0.25 O.A.T 201125 | 0.25 | 1,900 | 1,936 | 235,754 | 2020/11/25 |
| | | 0.25 O.A.T 261125 | 0.25 | 900 | 839 | 102,232 | 2026/11/25 |
| | | 0.5 O.A.T 191125 | 0.5 | 2,200 | 2,255 | 274,669 | 2019/11/25 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|-------------------|------|-----------------------|-------|---------|------------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| フランス | 国債証券 | 0.5 O.A.T 250525 | 0.5 | 2,400 | 2,367 | 288,261 | 2025/5/25 |
| | | 0.5 O.A.T 260525 | 0.5 | 2,100 | 2,026 | 246,795 | 2026/5/25 |
| | | 1 O.A.T 180525 | 1.0 | 1,700 | 1,735 | 211,263 | 2018/5/25 |
| | | 1 O.A.T 181125 | 1.0 | 1,700 | 1,747 | 212,757 | 2018/11/25 |
| | | 1 O.A.T 190525 | 1.0 | 2,200 | 2,274 | 276,991 | 2019/5/25 |
| | | 1 O.A.T 251125 | 1.0 | 1,900 | 1,934 | 235,515 | 2025/11/25 |
| | | 1.25 O.A.T 360525 | 1.25 | 950 | 879 | 107,089 | 2036/5/25 |
| | | 1.5 O.A.T 310525 | 1.5 | 1,850 | 1,874 | 228,189 | 2031/5/25 |
| | | 1.75 O.A.T 230525 | 1.75 | 2,400 | 2,627 | 319,865 | 2023/5/25 |
| | | 1.75 O.A.T 241125 | 1.75 | 2,400 | 2,621 | 319,250 | 2024/11/25 |
| | | 1.75 O.A.T 660525 | 1.75 | 350 | 293 | 35,704 | 2066/5/25 |
| | | 2.25 O.A.T 221025 | 2.25 | 2,300 | 2,580 | 314,261 | 2022/10/25 |
| | | 2.25 O.A.T 240525 | 2.25 | 2,100 | 2,375 | 289,244 | 2024/5/25 |
| | | 2.5 O.A.T 201025 | 2.5 | 2,500 | 2,761 | 336,214 | 2020/10/25 |
| | | 2.5 O.A.T 300525 | 2.5 | 2,350 | 2,695 | 328,207 | 2030/5/25 |
| | | 2.75 O.A.T 271025 | 2.75 | 2,200 | 2,575 | 313,580 | 2027/10/25 |
| | | 3 O.A.T 220425 | 3.0 | 3,200 | 3,702 | 450,823 | 2022/4/25 |
| | | 3.25 O.A.T 211025 | 3.25 | 3,000 | 3,475 | 423,176 | 2021/10/25 |
| | | 3.25 O.A.T 450525 | 3.25 | 1,700 | 2,164 | 263,536 | 2045/5/25 |
| | | 3.5 O.A.T 200425 | 3.5 | 2,800 | 3,150 | 383,575 | 2020/4/25 |
| | | 3.5 O.A.T 260425 | 3.5 | 2,800 | 3,462 | 421,586 | 2026/4/25 |
| | | 3.75 O.A.T 191025 | 3.75 | 2,600 | 2,899 | 353,081 | 2019/10/25 |
| | | 3.75 O.A.T 210425 | 3.75 | 3,000 | 3,505 | 426,863 | 2021/4/25 |
| | | 4 O.A.T 180425 | 4.0 | 2,700 | 2,853 | 347,416 | 2018/4/25 |
| | | 4 O.A.T 381025 | 4.0 | 2,000 | 2,817 | 343,116 | 2038/10/25 |
| | | 4 O.A.T 550425 | 4.0 | 1,090 | 1,623 | 197,631 | 2055/4/25 |
| | | 4 O.A.T 600425 | 4.0 | 850 | 1,279 | 155,796 | 2060/4/25 |
| | | 4.25 O.A.T 181025 | 4.25 | 2,000 | 2,168 | 263,986 | 2018/10/25 |
| | | 4.25 O.A.T 190425 | 4.25 | 2,500 | 2,766 | 336,826 | 2019/4/25 |
| | | 4.25 O.A.T 231025 | 4.25 | 3,300 | 4,174 | 508,301 | 2023/10/25 |
| 4.5 O.A.T 410425 | 4.5 | 2,200 | 3,335 | 406,147 | 2041/4/25 | | |
| 4.75 O.A.T 350425 | 4.75 | 2,100 | 3,159 | 384,730 | 2035/4/25 | | |
| 5.5 O.A.T 290425 | 5.5 | 2,400 | 3,590 | 437,118 | 2029/4/25 | | |
| 5.75 O.A.T 321025 | 5.75 | 2,150 | 3,464 | 421,877 | 2032/10/25 | | |
| 6 O.A.T 251025 | 6.0 | 2,000 | 2,907 | 353,969 | 2025/10/25 | | |
| 8.5 O.A.T 191025 | 8.5 | 900 | 1,122 | 136,627 | 2019/10/25 | | |
| 8.5 O.A.T 230425 | 8.5 | 900 | 1,363 | 166,048 | 2023/4/25 | | |
| オランダ | 国債証券 | 0 NETH GOVT 180415 | — | 900 | 906 | 110,382 | 2018/4/15 |
| | | 0 NETH GOVT 220115 | — | 300 | 303 | 36,894 | 2022/1/15 |
| | | 0.25 NETH GOVT 200115 | 0.25 | 1,400 | 1,433 | 174,493 | 2020/1/15 |
| | | 0.25 NETH GOVT 250715 | 0.25 | 1,000 | 984 | 119,916 | 2025/7/15 |
| | | 0.5 NETH GOVT 260715 | 0.5 | 1,100 | 1,091 | 132,943 | 2026/7/15 |
| | | 1.25 NETH GOVT 180115 | 1.25 | 1,100 | 1,119 | 136,352 | 2018/1/15 |
| | | 1.25 NETH GOVT 190115 | 1.25 | 1,200 | 1,243 | 151,408 | 2019/1/15 |
| | | 1.75 NETH GOVT 230715 | 1.75 | 1,000 | 1,110 | 135,156 | 2023/7/15 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------------------------|------|-----------------------|-------|------------------------|-------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| オランダ | 国債証券 | 2 NETH GOVT 240715 | 2.0 | 1,100 | 1,243 | 151,361 | 2024/7/15 |
| | | 2.25 NETH GOVT 220715 | 2.25 | 1,300 | 1,471 | 179,207 | 2022/7/15 |
| | | 2.5 NETH GOVT 330115 | 2.5 | 950 | 1,166 | 141,976 | 2033/1/15 |
| | | 2.75 NETH GOVT 470115 | 2.75 | 850 | 1,149 | 139,950 | 2047/1/15 |
| | | 3.25 NETH GOVT 210715 | 3.25 | 1,400 | 1,627 | 198,130 | 2021/7/15 |
| | | 3.5 NETH GOVT 200715 | 3.5 | 700 | 797 | 97,158 | 2020/7/15 |
| | | 3.75 NETH GOVT 230115 | 3.75 | 400 | 491 | 59,868 | 2023/1/15 |
| | | 3.75 NETH GOVT 420115 | 3.75 | 1,100 | 1,702 | 207,238 | 2042/1/15 |
| | | 4 NETH GOVT 180715 | 4.0 | 1,100 | 1,174 | 142,999 | 2018/7/15 |
| | | 4 NETH GOVT 190715 | 4.0 | 1,100 | 1,225 | 149,162 | 2019/7/15 |
| | | 4 NETH GOVT 370115 | 4.0 | 1,100 | 1,681 | 204,781 | 2037/1/15 |
| | | 5.5 NETH GOVT 280115 | 5.5 | 900 | 1,359 | 165,572 | 2028/1/15 |
| | | 7.5 NETH GOVT 230115 | 7.5 | 700 | 1,016 | 123,802 | 2023/1/15 |
| | | スペイン | 国債証券 | 0.25 SPAIN GOVT 180430 | 0.25 | 1,400 | 1,409 |
| 0.25 SPAIN GOVT 190131 | 0.25 | | | 600 | 605 | 73,711 | 2019/1/31 |
| 0.75 SPAIN GOVT 210730 | 0.75 | | | 1,300 | 1,328 | 161,719 | 2021/7/30 |
| 1.15 SPAIN GOVT 200730 | 1.15 | | | 1,400 | 1,454 | 177,070 | 2020/7/30 |
| 1.3 SPAIN GOVT 261031 | 1.3 | | | 1,000 | 979 | 119,204 | 2026/10/31 |
| 1.4 SPAIN GOVT 200131 | 1.4 | | | 1,600 | 1,668 | 203,205 | 2020/1/31 |
| 1.6 SPAIN GOVT 250430 | 1.6 | | | 1,600 | 1,642 | 199,958 | 2025/4/30 |
| 1.95 SPAIN GOVT 260430 | 1.95 | | | 1,400 | 1,458 | 177,606 | 2026/4/30 |
| 1.95 SPAIN GOVT 300730 | 1.95 | | | 1,400 | 1,394 | 169,751 | 2030/7/30 |
| 2.15 SPAIN GOVT 251031 | 2.15 | | | 1,600 | 1,700 | 207,025 | 2025/10/31 |
| 2.75 SPAIN GOVT 190430 | 2.75 | | | 1,900 | 2,026 | 246,689 | 2019/4/30 |
| 2.75 SPAIN GOVT 241031 | 2.75 | | | 1,800 | 2,012 | 245,074 | 2024/10/31 |
| 2.9 SPAIN GOVT 461031 | 2.9 | | | 600 | 604 | 73,629 | 2046/10/31 |
| 3.45 SPAIN GOVT 660730 | 3.45 | | | 300 | 312 | 38,011 | 2066/7/30 |
| 3.75 SPAIN GOVT 181031 | 3.75 | | | 1,500 | 1,607 | 195,753 | 2018/10/31 |
| 3.8 SPAIN GOVT 240430 | 3.8 | | | 1,500 | 1,788 | 217,800 | 2024/4/30 |
| 4 SPAIN GOVT 200430 | 4.0 | | | 1,600 | 1,807 | 220,029 | 2020/4/30 |
| 4.1 SPAIN GOVT 180730 | 4.1 | | | 1,600 | 1,705 | 207,658 | 2018/7/30 |
| 4.2 SPAIN GOVT 370131 | 4.2 | | | 1,200 | 1,532 | 186,628 | 2037/1/31 |
| 4.3 SPAIN GOVT 191031 | 4.3 | | | 1,600 | 1,793 | 218,334 | 2019/10/31 |
| 4.4 SPAIN GOVT 231031 | 4.4 | | | 1,500 | 1,848 | 225,130 | 2023/10/31 |
| 4.5 SPAIN GOVT 180131 | 4.5 | | | 1,400 | 1,467 | 178,733 | 2018/1/31 |
| 4.6 SPAIN GOVT 190730 | 4.6 | | | 1,500 | 1,677 | 204,261 | 2019/7/30 |
| 4.65 SPAIN GOVT 250730 | 4.65 | | | 1,800 | 2,279 | 277,595 | 2025/7/30 |
| 4.7 SPAIN GOVT 410730 | 4.7 | | | 1,100 | 1,504 | 183,210 | 2041/7/30 |
| 4.8 SPAIN GOVT 240131 | 4.8 | | | 1,200 | 1,514 | 184,440 | 2024/1/31 |
| 4.85 SPAIN GOVT 201031 | 4.85 | | | 1,450 | 1,707 | 207,961 | 2020/10/31 |
| 4.9 SPAIN GOVT 400730 | 4.9 | | | 1,300 | 1,817 | 221,320 | 2040/7/30 |
| 5.15 SPAIN GOVT 281031 | 5.15 | | | 750 | 1,018 | 123,999 | 2028/10/31 |
| 5.15 SPAIN GOVT 441031 | 5.15 | | | 850 | 1,233 | 150,212 | 2044/10/31 |
| 5.4 SPAIN GOVT 230131 | 5.4 | | | 1,600 | 2,047 | 249,250 | 2023/1/31 |
| 5.5 SPAIN GOVT 210430 | 5.5 | | | 1,800 | 2,204 | 268,446 | 2021/4/30 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|--------------------------|------|--------------------------|-------|---------|-----------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| スペイン | 国債証券 | 5.75 SPAIN GOVT 320730 | 5.75 | 1,450 | 2,150 | 261,796 | 2032/7/30 |
| | | 5.85 SPAIN GOVT 220131 | 5.85 | 1,700 | 2,158 | 262,770 | 2022/1/31 |
| | | 5.9 SPAIN GOVT 260730 | 5.9 | 1,100 | 1,526 | 185,900 | 2026/7/30 |
| | | 6 SPAIN GOVT 290131 | 6.0 | 1,850 | 2,687 | 327,196 | 2029/1/31 |
| ベルギー | 国債証券 | 0.8 BEL GOVT 250622 | 0.8 | 1,400 | 1,419 | 172,825 | 2025/6/22 |
| | | 1 BEL GOVT 260622 | 1.0 | 900 | 915 | 111,480 | 2026/6/22 |
| | | 1 BEL GOVT 310622 | 1.0 | 700 | 669 | 81,499 | 2031/6/22 |
| | | 1.25 BEL GOVT 180622 | 1.25 | 800 | 820 | 99,870 | 2018/6/22 |
| | | 1.6 BEL GOVT 470622 | 1.6 | 450 | 413 | 50,383 | 2047/6/22 |
| | | 1.9 BEL GOVT 380622 | 1.9 | 150 | 156 | 19,064 | 2038/6/22 |
| | | 2.15 BEL GOVT 660622 | 2.15 | 200 | 191 | 23,298 | 2066/6/22 |
| | | 2.25 BEL GOVT 230622 | 2.25 | 1,100 | 1,249 | 152,091 | 2023/6/22 |
| | | 2.6 BEL GOVT 240622 | 2.6 | 1,200 | 1,393 | 169,712 | 2024/6/22 |
| | | 3 BEL GOVT 190928 | 3.0 | 1,000 | 1,092 | 133,034 | 2019/9/28 |
| | | 3 BEL GOVT 340622 | 3.0 | 350 | 433 | 52,809 | 2034/6/22 |
| | | 3.75 BEL GOVT 200928 | 3.75 | 1,400 | 1,612 | 196,293 | 2020/9/28 |
| | | 3.75 BEL GOVT 450622 | 3.75 | 750 | 1,062 | 129,397 | 2045/6/22 |
| | | 4 BEL GOVT 180328 | 4.0 | 800 | 842 | 102,630 | 2018/3/28 |
| | | 4 BEL GOVT 190328 | 4.0 | 900 | 988 | 120,335 | 2019/3/28 |
| | | 4 BEL GOVT 220328 | 4.0 | 1,100 | 1,336 | 162,749 | 2022/3/28 |
| | | 4 BEL GOVT 320328 | 4.0 | 550 | 752 | 91,605 | 2032/3/28 |
| | | 4.25 BEL GOVT 210928 | 4.25 | 1,300 | 1,572 | 191,496 | 2021/9/28 |
| | | 4.25 BEL GOVT 220928 | 4.25 | 1,200 | 1,490 | 181,499 | 2022/9/28 |
| | | 4.25 BEL GOVT 410328 | 4.25 | 1,350 | 2,031 | 247,329 | 2041/3/28 |
| 4.5 BEL GOVT 260328 | 4.5 | 700 | 937 | 114,127 | 2026/3/28 | | |
| 5 BEL GOVT 350328 | 5.0 | 1,600 | 2,517 | 306,484 | 2035/3/28 | | |
| 5.5 BEL GOVT 280328 | 5.5 | 1,400 | 2,078 | 253,045 | 2028/3/28 | | |
| オーストリア | 国債証券 | 0 AUSTRIA GOVT 230715 | — | 100 | 99 | 12,074 | 2023/7/15 |
| | | 0.25 AUSTRIA GOVT 191018 | 0.25 | 500 | 510 | 62,152 | 2019/10/18 |
| | | 0.75 AUSTRIA GOVT 261020 | 0.75 | 700 | 706 | 85,998 | 2026/10/20 |
| | | 1.15 AUSTRIA GOVT 181019 | 1.15 | 500 | 515 | 62,715 | 2018/10/19 |
| | | 1.2 AUSTRIA GOVT 251020 | 1.2 | 700 | 742 | 90,434 | 2025/10/20 |
| | | 1.5 AUSTRIA GOVT 470220 | 1.5 | 200 | 195 | 23,838 | 2047/2/20 |
| | | 1.65 AUSTRIA GOVT 241021 | 1.65 | 600 | 661 | 80,569 | 2024/10/21 |
| | | 1.75 AUSTRIA GOVT 231020 | 1.75 | 900 | 999 | 121,756 | 2023/10/20 |
| | | 1.95 AUSTRIA GOVT 190618 | 1.95 | 500 | 530 | 64,539 | 2019/6/18 |
| | | 2.4 AUSTRIA GOVT 340523 | 2.4 | 450 | 538 | 65,579 | 2034/5/23 |
| | | 3.15 AUSTRIA GOVT 440620 | 3.15 | 500 | 687 | 83,746 | 2044/6/20 |
| | | 3.4 AUSTRIA GOVT 221122 | 3.4 | 700 | 840 | 102,358 | 2022/11/22 |
| | | 3.5 AUSTRIA GOVT 210915 | 3.5 | 1,150 | 1,351 | 164,585 | 2021/9/15 |
| | | 3.65 AUSTRIA GOVT 220420 | 3.65 | 700 | 838 | 102,149 | 2022/4/20 |
| | | 3.8 AUSTRIA GOVT 620126 | 3.8 | 250 | 407 | 49,633 | 2062/1/26 |
| | | 3.9 AUSTRIA GOVT 200715 | 3.9 | 1,000 | 1,150 | 140,047 | 2020/7/15 |
| | | 4.15 AUSTRIA GOVT 370315 | 4.15 | 900 | 1,361 | 165,783 | 2037/3/15 |
| 4.35 AUSTRIA GOVT 190315 | 4.35 | 900 | 994 | 121,086 | 2019/3/15 | | |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|--------------------------|------------------|--------------------------|-------|----------|------------|------------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| オーストリア | 国債証券 | 4.65 AUSTRIA GOVT 180115 | 4.65 | 900 | 945 | 115,159 | 2018/1/15 |
| | | 4.85 AUSTRIA GOVT 260315 | 4.85 | 800 | 1,110 | 135,185 | 2026/3/15 |
| | | 6.25 AUSTRIA GOVT 270715 | 6.25 | 550 | 863 | 105,094 | 2027/7/15 |
| フィンランド | 国債証券 | 0 FINNISH GOVT 230915 | — | 200 | 197 | 24,091 | 2023/9/15 |
| | | 0.375 FINNISH GOV 200915 | 0.375 | 400 | 411 | 50,047 | 2020/9/15 |
| | | 0.5 FINNISH GOVT 260415 | 0.5 | 400 | 395 | 48,198 | 2026/4/15 |
| | | 0.75 FINNISH GOVT 310415 | 0.75 | 300 | 288 | 35,093 | 2031/4/15 |
| | | 0.875 FINNISH GOV 250915 | 0.875 | 100 | 103 | 12,560 | 2025/9/15 |
| | | 1.125 FINNISH GOV 180915 | 1.125 | 200 | 205 | 25,041 | 2018/9/15 |
| | | 1.5 FINNISH GOVT 230415 | 1.5 | 400 | 435 | 53,064 | 2023/4/15 |
| | | 1.625 FINNISH GOV 220915 | 1.625 | 400 | 438 | 53,395 | 2022/9/15 |
| | | 2 FINNISH GOVT 240415 | 2.0 | 300 | 337 | 41,097 | 2024/4/15 |
| | | 2.625 FINNISH GOV 420704 | 2.625 | 350 | 447 | 54,467 | 2042/7/4 |
| | | 2.75 FINNISH GOVT 280704 | 2.75 | 400 | 487 | 59,342 | 2028/7/4 |
| | | 3.375 FINNISH GOV 200415 | 3.375 | 500 | 561 | 68,422 | 2020/4/15 |
| | | 3.5 FINNISH GOVT 210415 | 3.5 | 500 | 580 | 70,678 | 2021/4/15 |
| 4 FINNISH GOVT 250704 | 4.0 | 600 | 779 | 94,948 | 2025/7/4 | | |
| 4.375 FINNISH GOV 190704 | 4.375 | 500 | 560 | 68,253 | 2019/7/4 | | |
| アイルランド | 国債証券 | 0.8 IRISH GOVT 220315 | 0.8 | 400 | 414 | 50,449 | 2022/3/15 |
| | | 1 IRISH GOVT 260515 | 1.0 | 400 | 396 | 48,279 | 2026/5/15 |
| | | 2 IRISH GOVT 450218 | 2.0 | 450 | 432 | 52,658 | 2045/2/18 |
| | | 2.4 IRISH GOVT 300515 | 2.4 | 650 | 716 | 87,229 | 2030/5/15 |
| | | 3.4 IRISH GOVT 240318 | 3.4 | 600 | 713 | 86,915 | 2024/3/18 |
| | | 3.9 IRISH GOVT 230320 | 3.9 | 400 | 485 | 59,065 | 2023/3/20 |
| | | 4.4 IRISH GOVT 190618 | 4.4 | 500 | 557 | 67,877 | 2019/6/18 |
| | | 4.5 IRISH GOVT 181018 | 4.5 | 650 | 706 | 85,965 | 2018/10/18 |
| | | 4.5 IRISH GOVT 200418 | 4.5 | 800 | 921 | 112,253 | 2020/4/18 |
| | | 5 IRISH GOVT 201018 | 5.0 | 600 | 717 | 87,306 | 2020/10/18 |
| | | 5.4 IRISH GOVT 250313 | 5.4 | 900 | 1,218 | 148,322 | 2025/3/13 |
| 5.9 IRISH GOVT 191018 | 5.9 | 600 | 702 | 85,476 | 2019/10/18 | | |
| 小 計 | | | | | | 50,764,221 | |
| イギリス | | | | 千イギリスポンド | 千イギリスポンド | | |
| 国債証券 | 1.25 GILT 180722 | 1.25 | 2,400 | 2,439 | 348,771 | 2018/7/22 | |
| | 1.5 GILT 210122 | 1.5 | 2,150 | 2,228 | 318,652 | 2021/1/22 | |
| | 1.5 GILT 260722 | 1.5 | 1,400 | 1,404 | 200,814 | 2026/7/22 | |
| | 1.5 GILT 470722 | 1.5 | 100 | 88 | 12,593 | 2047/7/22 | |
| | 1.75 GILT 190722 | 1.75 | 2,100 | 2,176 | 311,279 | 2019/7/22 | |
| | 1.75 GILT 220907 | 1.75 | 2,200 | 2,310 | 330,401 | 2022/9/7 | |
| | 2 GILT 200722 | 2.0 | 2,100 | 2,211 | 316,181 | 2020/7/22 | |
| | 2 GILT 250907 | 2.0 | 1,600 | 1,688 | 241,424 | 2025/9/7 | |
| | 2.25 GILT 230907 | 2.25 | 1,700 | 1,837 | 262,702 | 2023/9/7 | |
| | 2.5 GILT 650722 | 2.5 | 900 | 1,073 | 153,444 | 2065/7/22 | |
| | 2.75 GILT 240907 | 2.75 | 1,500 | 1,673 | 239,300 | 2024/9/7 | |
| | 3.25 GILT 440122 | 3.25 | 1,730 | 2,140 | 306,036 | 2044/1/22 | |
| | 3.5 GILT 450122 | 3.5 | 1,800 | 2,332 | 333,459 | 2045/1/22 | |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | | | |
|--------|------|------------------------|----------|-------------|-------------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| イギリス | | % | 千イギリスポンド | 千イギリスポンド | 千円 | | |
| | 国債証券 | 3.5 GILT 680722 | 3.5 | 1,500 | 2,288 | 327,234 | 2068/7/22 |
| | | 3.75 GILT 190907 | 3.75 | 1,100 | 1,200 | 171,620 | 2019/9/7 |
| | | 3.75 GILT 200907 | 3.75 | 1,200 | 1,342 | 191,964 | 2020/9/7 |
| | | 3.75 GILT 210907 | 3.75 | 1,200 | 1,370 | 195,984 | 2021/9/7 |
| | | 3.75 GILT 520722 | 3.75 | 1,300 | 1,889 | 270,164 | 2052/7/22 |
| | | 4 GILT 220307 | 4.0 | 1,050 | 1,224 | 175,029 | 2022/3/7 |
| | | 4 GILT 600122 | 4.0 | 930 | 1,504 | 215,096 | 2060/1/22 |
| | | 4.25 GILT 271207 | 4.25 | 950 | 1,204 | 172,206 | 2027/12/7 |
| | | 4.25 GILT 320607 | 4.25 | 1,300 | 1,717 | 245,649 | 2032/6/7 |
| | | 4.25 GILT 360307 | 4.25 | 1,685 | 2,289 | 327,367 | 2036/3/7 |
| | | 4.25 GILT 390907 | 4.25 | 1,050 | 1,464 | 209,411 | 2039/9/7 |
| | | 4.25 GILT 401207 | 4.25 | 1,200 | 1,690 | 241,733 | 2040/12/7 |
| | | 4.25 GILT 461207 | 4.25 | 1,350 | 2,003 | 286,488 | 2046/12/7 |
| | | 4.25 GILT 491207 | 4.25 | 1,130 | 1,736 | 248,297 | 2049/12/7 |
| | | 4.25 GILT 551207 | 4.25 | 1,330 | 2,175 | 311,043 | 2055/12/7 |
| | | 4.5 GILT 190307 | 4.5 | 1,300 | 1,418 | 202,769 | 2019/3/7 |
| | | 4.5 GILT 340907 | 4.5 | 1,550 | 2,142 | 306,312 | 2034/9/7 |
| | | 4.5 GILT 421207 | 4.5 | 1,270 | 1,888 | 270,084 | 2042/12/7 |
| | | 4.75 GILT 200307 | 4.75 | 1,400 | 1,590 | 227,448 | 2020/3/7 |
| | | 4.75 GILT 301207 | 4.75 | 1,100 | 1,505 | 215,305 | 2030/12/7 |
| | | 4.75 GILT 381207 | 4.75 | 1,290 | 1,908 | 272,893 | 2038/12/7 |
| | | 5 GILT 180307 | 5.0 | 1,200 | 1,264 | 180,817 | 2018/3/7 |
| | | 5 GILT 250307 | 5.0 | 1,050 | 1,356 | 193,968 | 2025/3/7 |
| | | 6 GILT 281207 | 6.0 | 750 | 1,107 | 158,321 | 2028/12/7 |
| | | 8 GILT 210607 | 8.0 | 900 | 1,189 | 170,084 | 2021/6/7 |
| 小 | 計 | | | | | 9,162,359 | |
| スイス | | | | 千スイスフラン | 千スイスフラン | | |
| | 国債証券 | 2 SWISS GOVT 210428 | 2.0 | 270 | 301 | 34,215 | 2021/4/28 |
| | | 2.25 SWISS GOVT 200706 | 2.25 | 340 | 376 | 42,686 | 2020/7/6 |
| | | 3 SWISS GOVT 180108 | 3.0 | 500 | 518 | 58,837 | 2018/1/8 |
| | | 3 SWISS GOVT 190512 | 3.0 | 420 | 458 | 51,947 | 2019/5/12 |
| | | 4 SWISS GOVT 230211 | 4.0 | 330 | 421 | 47,770 | 2023/2/11 |
| | | 4 SWISS GOVT 280408 | 4.0 | 430 | 625 | 70,868 | 2028/4/8 |
| 小 | 計 | | | | | 306,326 | |
| スウェーデン | | | | 千スウェーデンクローネ | 千スウェーデンクローネ | | |
| | 国債証券 | 1 SWD GOVT 261112 | 1.0 | 5,300 | 5,430 | 69,783 | 2026/11/12 |
| | | 1.5 SWD GOVT 231113 | 1.5 | 5,750 | 6,217 | 79,898 | 2023/11/13 |
| | | 2.5 SWD GOVT 250512 | 2.5 | 4,800 | 5,572 | 71,604 | 2025/5/12 |
| | | 3.5 SWD GOVT 220601 | 3.5 | 6,950 | 8,228 | 105,733 | 2022/6/1 |
| | | 3.5 SWD GOVT 390330 | 3.5 | 3,450 | 4,587 | 58,955 | 2039/3/30 |
| | | 4.25 SWD GOVT 190312 | 4.25 | 7,200 | 7,942 | 102,056 | 2019/3/12 |
| | | 5 SWD GOVT 201201 | 5.0 | 6,900 | 8,300 | 106,657 | 2020/12/1 |
| 小 | 計 | | | | | 594,689 | |
| ノルウェー | | | | 千ノルウェークローネ | 千ノルウェークローネ | | |
| | 国債証券 | 1.5 NORWE GOVT 260219 | 1.5 | 2,700 | 2,662 | 36,322 | 2026/2/19 |

| 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 | | |
| ノルウェー | | % | 千ノルウェークロネ | 千ノルウェークロネ | 千円 | | |
| | 国債証券 | 1.75 NORWE GOVT 250313 | 1.75 | 3,000 | 3,043 | 41,512 | 2025/3/13 |
| | | 2 NORWE GOVT 230524 | 2.0 | 4,200 | 4,368 | 59,580 | 2023/5/24 |
| | | 3 NORWE GOVT 240314 | 3.0 | 3,300 | 3,647 | 49,754 | 2024/3/14 |
| | | 3.75 NORWE GOVT 210525 | 3.75 | 5,400 | 6,017 | 82,073 | 2021/5/25 |
| | | 4.5 NORWE GOVT 190522 | 4.5 | 5,600 | 6,092 | 83,107 | 2019/5/22 |
| 小 | 計 | | | | | 352,350 | |
| デンマーク | | | | 千デンマーククロネ | 千デンマーククロネ | | |
| | 国債証券 | 0.25 DMK GOVT 181115 | 0.25 | 3,700 | 3,757 | 61,513 | 2018/11/15 |
| | | 1.5 DMK GOVT 231115 | 1.5 | 4,700 | 5,141 | 84,171 | 2023/11/15 |
| | | 1.75 DMK GOVT 251115 | 1.75 | 6,300 | 6,992 | 114,470 | 2025/11/15 |
| | | 3 DMK GOVT 211115 | 3.0 | 7,000 | 8,069 | 132,097 | 2021/11/15 |
| | | 4 DMK GOVT 191115 | 4.0 | 7,400 | 8,317 | 136,159 | 2019/11/15 |
| | | 4.5 DMK GOVT 391115 | 4.5 | 9,650 | 16,013 | 262,146 | 2039/11/15 |
| | | 7 DMK GOVT 241110 | 7.0 | 1,300 | 1,985 | 32,495 | 2024/11/10 |
| 小 | 計 | | | | | 823,054 | |
| 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 | 2,200 | 2,132 | 59,678 | 2020/4/25 |
| | | 1.75 POLAND 210725 | 1.75 | 2,300 | 2,191 | 61,316 | 2021/7/25 |
| | | 2 POLAND 210425 | 2.0 | 2,000 | 1,932 | 54,057 | 2021/4/25 |
| | | 2.5 POLAND 180725 | 2.5 | 1,900 | 1,920 | 53,725 | 2018/7/25 |
| | | 2.5 POLAND 260725 | 2.5 | 2,800 | 2,522 | 70,576 | 2026/7/25 |
| | | 2.5 POLAND 270725 | 2.5 | 500 | 445 | 12,451 | 2027/7/25 |
| | | 3.25 POLAND 190725 | 3.25 | 2,000 | 2,048 | 57,314 | 2019/7/25 |
| | | 3.25 POLAND 250725 | 3.25 | 2,100 | 2,038 | 57,034 | 2025/7/25 |
| | | 3.75 POLAND 180425 | 3.75 | 1,100 | 1,128 | 31,581 | 2018/4/25 |
| | | 4 POLAND 231025 | 4.0 | 2,250 | 2,322 | 64,972 | 2023/10/25 |
| | | 5.25 POLAND 201025 | 5.25 | 1,000 | 1,090 | 30,503 | 2020/10/25 |
| | | 5.5 POLAND 191025 | 5.5 | 1,500 | 1,627 | 45,524 | 2019/10/25 |
| | | 5.75 POLAND 211025 | 5.75 | 1,300 | 1,458 | 40,804 | 2021/10/25 |
| | | 5.75 POLAND 220923 | 5.75 | 1,650 | 1,862 | 52,117 | 2022/9/23 |
| | | 5.75 POLAND 290425 | 5.75 | 600 | 709 | 19,844 | 2029/4/25 |
| | | POLAND 181025 | — | 2,400 | 2,319 | 64,885 | 2018/10/25 |
| 小 | 計 | | | | | 776,389 | |
| オーストラリア | | | | 千オーストラリアドル | 千オーストラリアドル | | |
| | 国債証券 | 1.75 AUST GOVT 201121 | 1.75 | 1,350 | 1,334 | 114,465 | 2020/11/21 |
| | | 2.25 AUST GOVT 280521 | 2.25 | 950 | 895 | 76,827 | 2028/5/21 |
| | | 2.75 AUST GOVT 191021 | 2.75 | 1,700 | 1,737 | 149,044 | 2019/10/21 |
| | | 2.75 AUST GOVT 240421 | 2.75 | 1,950 | 1,979 | 169,766 | 2024/4/21 |
| | | 2.75 AUST GOVT 271121 | 2.75 | 1,350 | 1,344 | 115,297 | 2027/11/21 |
| | | 2.75 AUST GOVT 350621 | 2.75 | 500 | 457 | 39,229 | 2035/6/21 |
| | | 3 AUST GOVT 470321 | 3.0 | 550 | 473 | 40,650 | 2047/3/21 |
| | | 3.25 AUST GOVT 181021 | 3.25 | 1,200 | 1,230 | 105,515 | 2018/10/21 |
| | | 3.25 AUST GOVT 250421 | 3.25 | 2,000 | 2,093 | 179,585 | 2025/4/21 |
| | | 3.25 AUST GOVT 290421 | 3.25 | 1,000 | 1,033 | 88,606 | 2029/4/21 |
| | | 3.25 AUST GOVT 390621 | 3.25 | 300 | 284 | 24,443 | 2039/6/21 |

| 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 | | |
| オーストラリア | | % | 千オーストラリアドル | 千オーストラリアドル | 千円 | | |
| 国債証券 | 3.75 AUST GOVT 370421 | 3.75 | 700 | 728 | 62,513 | 2037/4/21 | |
| | 4.25 AUST GOVT 260421 | 4.25 | 2,400 | 2,708 | 232,293 | 2026/4/21 | |
| | 4.5 AUST GOVT 200415 | 4.5 | 2,000 | 2,156 | 184,971 | 2020/4/15 | |
| | 4.5 AUST GOVT 330421 | 4.5 | 800 | 932 | 80,006 | 2033/4/21 | |
| | 4.75 AUST GOVT 270421 | 4.75 | 2,100 | 2,476 | 212,417 | 2027/4/21 | |
| | 5.25 AUST GOVT 190315 | 5.25 | 1,700 | 1,820 | 156,130 | 2019/3/15 | |
| | 5.5 AUST GOVT 180121 | 5.5 | 1,400 | 1,450 | 124,450 | 2018/1/21 | |
| | 5.5 AUST GOVT 230421 | 5.5 | 1,650 | 1,946 | 166,946 | 2023/4/21 | |
| | 5.75 AUST GOVT 210515 | 5.75 | 2,150 | 2,469 | 211,786 | 2021/5/15 | |
| 5.75 AUST GOVT 220715 | 5.75 | 1,800 | 2,120 | 181,918 | 2022/7/15 | | |
| 小 計 | | | | | 2,716,868 | | |
| シンガポール | | | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | | | |
| 国債証券 | 0.5 SINGAPORGOVT 180401 | 0.5 | 500 | 496 | 39,807 | 2018/4/1 | |
| | 1.625 SINGAPORGOV 191001 | 1.625 | 350 | 352 | 28,218 | 2019/10/1 | |
| | 2 SINGAPORGOVT 200701 | 2.0 | 150 | 152 | 12,189 | 2020/7/1 | |
| | 2.125 SINGAPORGOV 260601 | 2.125 | 100 | 98 | 7,881 | 2026/6/1 | |
| | 2.25 SINGAPORGOVT 210601 | 2.25 | 600 | 611 | 49,014 | 2021/6/1 | |
| | 2.375 SINGAPORGOV 250601 | 2.375 | 300 | 301 | 24,192 | 2025/6/1 | |
| | 2.5 SINGAPORGOVT 190601 | 2.5 | 450 | 462 | 37,035 | 2019/6/1 | |
| | 2.75 SINGAPORGOVT 230701 | 2.75 | 400 | 415 | 33,276 | 2023/7/1 | |
| | 2.75 SINGAPORGOVT 420401 | 2.75 | 400 | 402 | 32,256 | 2042/4/1 | |
| | 2.75 SINGAPORGOVT 460301 | 2.75 | 150 | 150 | 12,084 | 2046/3/1 | |
| | 2.875 SINGAPORGOV 290701 | 2.875 | 100 | 103 | 8,276 | 2029/7/1 | |
| | 2.875SINGAPORGOVT 300901 | 2.875 | 300 | 308 | 24,689 | 2030/9/1 | |
| | 3 SINGAPORGOVT 240901 | 3.0 | 400 | 421 | 33,795 | 2024/9/1 | |
| | 3.125SINGAPORGOVT 220901 | 3.125 | 350 | 371 | 29,739 | 2022/9/1 | |
| | 3.25 SINGAPORGOVT 200901 | 3.25 | 400 | 422 | 33,888 | 2020/9/1 | |
| | 3.375 SINGAPORGOV 330901 | 3.375 | 230 | 250 | 20,077 | 2033/9/1 | |
| | 3.5 SINGAPORGOVT 270301 | 3.5 | 380 | 416 | 33,369 | 2027/3/1 | |
| 4 SINGAPORGOVT 180901 | 4.0 | 300 | 313 | 25,127 | 2018/9/1 | | |
| 小 計 | | | | | 484,920 | | |
| マレーシア | | | 千マレーシアリンギット | 千マレーシアリンギット | | | |
| 国債証券 | 3.26 MALAYSIAGOV 180301 | 3.26 | 900 | 902 | 23,054 | 2018/3/1 | |
| | 3.418MALAYSIAGOV 220815 | 3.418 | 900 | 878 | 22,443 | 2022/8/15 | |
| | 3.48 MALAYSIAGOV 230315 | 3.48 | 1,200 | 1,165 | 29,769 | 2023/3/15 | |
| | 3.492 MALAYSIAGOV 200331 | 3.492 | 900 | 898 | 22,965 | 2020/3/31 | |
| | 3.502MALAYSIAGOV 270531 | 3.502 | 300 | 275 | 7,040 | 2027/5/31 | |
| | 3.58 MALAYSIAGOV 180928 | 3.58 | 800 | 804 | 20,562 | 2018/9/28 | |
| | 3.654 MALAYSIAGOV 191031 | 3.654 | 1,100 | 1,107 | 28,286 | 2019/10/31 | |
| | 3.659 MALAYSIAGOV 201015 | 3.659 | 1,000 | 1,002 | 25,625 | 2020/10/15 | |
| | 3.733 MALAYSIAGO 280615 | 3.733 | 600 | 559 | 14,300 | 2028/6/15 | |
| | 3.759 MALAYSIAGOV 190315 | 3.759 | 600 | 605 | 15,479 | 2019/3/15 | |
| | 3.795 MALAYSIAGOV 220930 | 3.795 | 900 | 895 | 22,880 | 2022/9/30 | |
| | 3.8 MALAYSIAGOV 230817 | 3.8 | 200 | 198 | 5,068 | 2023/8/17 | |
| | 3.844 MALAYSIAGOV 330415 | 3.844 | 600 | 539 | 13,791 | 2033/4/15 | |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|-------|--------------------------|-------|-------------|-------------|-------------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| マレーシア | | % | 千マレーシアリンギット | 千マレーシアリンギット | 千円 | |
| 国債証券 | 3.889 MALAYSIAGO 200731 | 3.889 | 700 | 707 | 18,083 | 2020/7/31 |
| | 3.892 MALAYSIAGOV 270315 | 3.892 | 500 | 481 | 12,306 | 2027/3/15 |
| | 3.9 MALAYSIAGOV 261130 | 3.9 | 100 | 98 | 2,507 | 2026/11/30 |
| | 3.955 MALAYSIAGOV 250915 | 3.955 | 1,150 | 1,133 | 28,957 | 2025/9/15 |
| | 4.048 MALAYSIA 210930 | 4.048 | 900 | 913 | 23,332 | 2021/9/30 |
| | 4.127 MALAYSIA 320415 | 4.127 | 600 | 558 | 14,266 | 2032/4/15 |
| | 4.16 MALAYSIAGOV 210715 | 4.16 | 1,050 | 1,071 | 27,383 | 2021/7/15 |
| | 4.181 MALAYSIAGOV 240715 | 4.181 | 1,000 | 1,007 | 25,744 | 2024/7/15 |
| | 4.232MALAYSIAGOV 310630 | 4.232 | 800 | 772 | 19,748 | 2031/6/30 |
| | 4.24 MALAYSIAGOV 180207 | 4.24 | 400 | 404 | 10,344 | 2018/2/7 |
| | 4.254 MALAYSIAGOV 350531 | 4.254 | 350 | 331 | 8,476 | 2035/5/31 |
| | 4.378MALAYSIAGOV 191129 | 4.378 | 1,200 | 1,231 | 31,463 | 2019/11/29 |
| | 4.392 MALAYSIAGOV 260415 | 4.392 | 1,000 | 1,009 | 25,789 | 2026/4/15 |
| | 4.498 MALAYSIAGOV 300415 | 4.498 | 900 | 891 | 22,766 | 2030/4/15 |
| | 4.736 MALAYSIAGOV 460315 | 4.736 | 200 | 198 | 5,066 | 2046/3/15 |
| | 4.935 MALAYSIAGOV 430930 | 4.935 | 600 | 605 | 15,471 | 2043/9/30 |
| | 5.248 MALAYSIA 280915 | 5.248 | 200 | 213 | 5,443 | 2028/9/15 |
| | 5.734MALAYSIAGOV 190730 | 5.734 | 300 | 316 | 8,082 | 2019/7/30 |
| 小計 | | | | | 556,504 | |
| 南アフリカ | | | 千南アフリカランド | 千南アフリカランド | | |
| 国債証券 | 10.5 SOUTH AFRICA 261221 | 10.5 | 13,100 | 14,618 | 124,988 | 2026/12/21 |
| | 6.25 SOUTH AFRICA 360331 | 6.25 | 6,550 | 4,752 | 40,632 | 2036/3/31 |
| | 6.5 SOUTH AFRICA 410228 | 6.5 | 5,800 | 4,199 | 35,903 | 2041/2/28 |
| | 6.75 SOUTH AFRICA 210331 | 6.75 | 3,900 | 3,724 | 31,844 | 2021/3/31 |
| | 7 SOUTH AFRICA 310228 | 7.0 | 7,200 | 5,980 | 51,132 | 2031/2/28 |
| | 7.25 SOUTH AFRICA 200115 | 7.25 | 4,600 | 4,523 | 38,677 | 2020/1/15 |
| | 7.75 SOUTH AFRICA 230228 | 7.75 | 4,400 | 4,275 | 36,554 | 2023/2/28 |
| | 8 SOUTH AFRICA 181221 | 8.0 | 3,000 | 3,012 | 25,758 | 2018/12/21 |
| | 8 SOUTH AFRICA 300131 | 8.0 | 6,900 | 6,306 | 53,919 | 2030/1/31 |
| | 8.25 SOUTH AFRICA 320331 | 8.25 | 5,300 | 4,854 | 41,507 | 2032/3/31 |
| | 8.5 SOUTH AFRICA 370131 | 8.5 | 6,900 | 6,316 | 54,006 | 2037/1/31 |
| | 8.75 SOUTH AFRICA 440131 | 8.75 | 5,900 | 5,485 | 46,901 | 2044/1/31 |
| | 8.75 SOUTH AFRICA 480228 | 8.75 | 9,400 | 8,716 | 74,523 | 2048/2/28 |
| | 8.875 SOUTH AFRIC 350228 | 8.875 | 2,700 | 2,579 | 22,053 | 2035/2/28 |
| | 9 SOUTH AFRICA 400131 | 9.0 | 2,400 | 2,294 | 19,621 | 2040/1/31 |
| 小計 | | | | | 698,025 | |
| 合計 | | | | | 126,908,564 | |

(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。

<MUAM G-REITマザーファンド>

下記は、MUAM G-REITマザーファンド全体(11,695,691千口)の内容です。

外国投資信託証券

| 銘柄 | 口数 | 当期末 | | 比率 |
|------------------------------|-----|---------|---------|-----|
| | | 評価額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 千口 | 千アメリカドル | 千円 | % |
| DDR CORP | 45 | 692 | 78,366 | 0.4 |
| HCP INC | 67 | 2,025 | 229,189 | 1.3 |
| MACERICH CO/THE | 17 | 1,212 | 137,190 | 0.8 |
| ACADIA REALTY TRUST | 11 | 380 | 43,058 | 0.2 |
| AGREE REALTY CORP | 3 | 175 | 19,817 | 0.1 |
| ALEXANDER'S INC | 0.5 | 220 | 24,946 | 0.1 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 11 | 1,302 | 147,430 | 0.8 |
| PROLOGIS INC | 76 | 3,976 | 449,927 | 2.5 |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 19 | 941 | 106,494 | 0.6 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 12 | 95 | 10,816 | 0.1 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 25 | 418 | 47,301 | 0.3 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 12 | 1,065 | 120,505 | 0.7 |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES | 25 | 269 | 30,446 | 0.2 |
| CEDAR REALTY TRUST INC | 10 | 67 | 7,618 | 0.0 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 21 | 963 | 109,054 | 0.6 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 14 | 456 | 51,630 | 0.3 |
| COUSINS PROPERTIES INC | 49 | 425 | 48,097 | 0.3 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 29 | 348 | 39,407 | 0.2 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 23 | 2,474 | 280,023 | 1.6 |
| EASTGROUP PROPERTIES INC | 4 | 347 | 39,297 | 0.2 |
| EDUCATION REALTY TRUST INC | 10 | 441 | 49,999 | 0.3 |
| EPR PROPERTIES | 9 | 697 | 78,911 | 0.4 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 11 | 866 | 98,074 | 0.5 |
| EQUITY ONE INC | 13 | 419 | 47,517 | 0.3 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 9 | 2,143 | 242,592 | 1.3 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 18 | 1,342 | 151,933 | 0.8 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 10 | 1,462 | 165,445 | 0.9 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 17 | 474 | 53,670 | 0.3 |
| FIRST POTOMAC REALTY TRUST | 7 | 85 | 9,664 | 0.1 |
| GETTY REALTY CORP | 4 | 105 | 11,990 | 0.1 |
| WELLTOWER INC | 52 | 3,493 | 395,254 | 2.2 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 14 | 782 | 88,530 | 0.5 |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 23 | 747 | 84,525 | 0.5 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 18 | 582 | 65,873 | 0.4 |
| KILROY REALTY CORP | 14 | 1,081 | 122,353 | 0.7 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 12 | 302 | 34,244 | 0.2 |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 31 | 340 | 38,511 | 0.2 |
| LTC PROPERTIES INC | 5 | 281 | 31,810 | 0.2 |
| MACK-CALI REALTY CORP | 13 | 389 | 44,058 | 0.2 |
| BOSTON PROPERTIES INC | 22 | 2,905 | 328,804 | 1.8 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------------|-------|---------|---------|-----|
| | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 千口 | 千アメリカドル | 千円 | % |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 47 | 620 | 70,198 | 0.4 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 16 | 1,608 | 181,975 | 1.0 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 5 | 441 | 49,922 | 0.3 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 28 | 923 | 104,538 | 0.6 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 2 | 55 | 6,314 | 0.0 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 10 | 191 | 21,675 | 0.1 |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES | 11 | 181 | 20,547 | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP | 37 | 2,234 | 252,813 | 1.4 |
| REGENCY CENTERS CORP | 15 | 1,058 | 119,776 | 0.7 |
| SAUL CENTERS INC | 1 | 107 | 12,203 | 0.1 |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST | 34 | 668 | 75,673 | 0.4 |
| SL GREEN REALTY CORP | 14 | 1,595 | 180,494 | 1.0 |
| LIFE STORAGE INC | 6 | 561 | 63,589 | 0.4 |
| SUN COMMUNITIES INC | 9 | 755 | 85,444 | 0.5 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 31 | 475 | 53,847 | 0.3 |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 14 | 481 | 54,505 | 0.3 |
| TAUBMAN CENTERS INC | 8 | 638 | 72,233 | 0.4 |
| CUBESMART | 26 | 683 | 77,326 | 0.4 |
| UDR INC | 38 | 1,362 | 154,184 | 0.9 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 1 | 112 | 12,739 | 0.1 |
| URSTADT BIDDLE - CLASS A | 4 | 105 | 11,902 | 0.1 |
| VENTAS INC | 51 | 3,147 | 356,181 | 2.0 |
| WASHINGTON REIT | 11 | 362 | 40,963 | 0.2 |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 17 | 635 | 71,893 | 0.4 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 6 | 134 | 15,207 | 0.1 |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA | 2 | 346 | 39,192 | 0.2 |
| UMH PROPERTIES INC | 3 | 47 | 5,416 | 0.0 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 3 | 70 | 8,022 | 0.0 |
| MONMOUTH REAL ESTATE INV COR | 9 | 146 | 16,550 | 0.1 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 16 | 513 | 58,097 | 0.3 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 15 | 206 | 23,343 | 0.1 |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC | 13 | 638 | 72,274 | 0.4 |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 19 | 132 | 14,946 | 0.1 |
| DOUGLAS EMMETT INC | 20 | 784 | 88,796 | 0.5 |
| DUPONT FABROS TECHNOLOGY | 11 | 524 | 59,373 | 0.3 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 10 | 314 | 35,602 | 0.2 |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST | 8 | 230 | 26,047 | 0.1 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 21 | 461 | 52,189 | 0.3 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 21 | 763 | 86,340 | 0.5 |
| CORESITE REALTY CORP | 4 | 420 | 47,551 | 0.3 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 5 | 256 | 29,022 | 0.2 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 13 | 209 | 23,711 | 0.1 |
| GOVERNMENT PROPERTIES INCOME | 10 | 202 | 22,967 | 0.1 |
| RLJ LODGING TRUST | 18 | 436 | 49,430 | 0.3 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 16 | 342 | 38,757 | 0.2 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------------|-------|---------|---------|-----|
| | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 千口 | 千アメリカドル | 千円 | % |
| STAG INDUSTRIAL INC | 11 | 274 | 31,008 | 0.2 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 9 | 252 | 28,556 | 0.2 |
| RETAIL PROPERTIES OF AME - A | 34 | 524 | 59,305 | 0.3 |
| SELECT INCOME REIT | 9 | 235 | 26,638 | 0.1 |
| HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A | 20 | 608 | 68,797 | 0.4 |
| WP CAREY INC | 15 | 961 | 108,812 | 0.6 |
| WHITESTONE REIT | 4 | 55 | 6,334 | 0.0 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 7 | 474 | 53,667 | 0.3 |
| CHATHAM LODGING TRUST | 6 | 127 | 14,420 | 0.1 |
| TERRENO REALTY CORP | 6 | 189 | 21,493 | 0.1 |
| SILVER BAY REALTY TRUST CORP | 5 | 93 | 10,616 | 0.1 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 71 | 764 | 86,536 | 0.5 |
| CORECIVIC INC | 16 | 494 | 55,979 | 0.3 |
| GEO GROUP INC/THE | 11 | 458 | 51,909 | 0.3 |
| VEREIT INC | 140 | 1,211 | 137,059 | 0.8 |
| DUKE REALTY CORP | 51 | 1,355 | 153,369 | 0.8 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN | 5 | 74 | 8,472 | 0.0 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 9 | 236 | 26,798 | 0.1 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 19 | 363 | 41,115 | 0.2 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 32 | 685 | 77,603 | 0.4 |
| GRAMERCY PROPERTY TRUST | 20 | 566 | 64,134 | 0.4 |
| CYRUSONE INC | 10 | 537 | 60,782 | 0.3 |
| ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN | 3 | 46 | 5,303 | 0.0 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 17 | 365 | 41,343 | 0.2 |
| QTS REALTY TRUST INC-CL A | 7 | 358 | 40,515 | 0.2 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 38 | 941 | 106,479 | 0.6 |
| COLONY STARWOOD HOMES | 7 | 213 | 24,100 | 0.1 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 17 | 398 | 45,079 | 0.2 |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 28 | 276 | 31,331 | 0.2 |
| CARETRUST REIT INC | 9 | 144 | 16,403 | 0.1 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUN-A | 3 | 53 | 6,015 | 0.0 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 28 | 877 | 99,289 | 0.6 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 7 | 69 | 7,896 | 0.0 |
| IRON MOUNTAIN INC | 35 | 1,251 | 141,594 | 0.8 |
| STORE CAPITAL CORP | 22 | 562 | 63,702 | 0.4 |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | 11 | 122 | 13,868 | 0.1 |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 13 | 371 | 41,994 | 0.2 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 3 | 66 | 7,508 | 0.0 |
| MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I | 24 | 252 | 28,625 | 0.2 |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 15 | 303 | 34,326 | 0.2 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 5 | 132 | 15,032 | 0.1 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL | 2 | 57 | 6,511 | 0.0 |
| CARE CAPITAL PROPERTIES INC | 12 | 311 | 35,282 | 0.2 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 22 | 467 | 52,887 | 0.3 |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | 2 | 38 | 4,314 | 0.0 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------------|-------|-----------|---------|------------|
| | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 千口 | 千アメリカドル | 千円 | % |
| GLOBAL NET LEASE INC | 24 | 194 | 22,051 | 0.1 |
| CITY OFFICE REIT INC | 2 | 34 | 3,895 | 0.0 |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 7 | 96 | 10,875 | 0.1 |
| SERITAGE GROWTH PROP- A REIT | 3 | 156 | 17,697 | 0.1 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 8 | 180 | 20,458 | 0.1 |
| FOREST CITY REALTY TRUST- A | 32 | 712 | 80,607 | 0.4 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 1 | 40 | 4,584 | 0.0 |
| FARMLAND PARTNERS INC | 1 | 19 | 2,230 | 0.0 |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV | 90 | 77 | 8,757 | 0.0 |
| TIER REIT INC | 6 | 118 | 13,438 | 0.1 |
| WHEELER REAL ESTATE INVESTME | 10 | 18 | 2,074 | 0.0 |
| PARKWAY INC | 6 | 144 | 16,383 | 0.1 |
| QUALITY CARE PROPERTIES | 13 | 221 | 25,047 | 0.1 |
| MEDEQUITIES REALTY TRUST INC | 3 | 34 | 3,886 | 0.0 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 53 | 3,275 | 370,598 | 2.1 |
| COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A | 80 | 1,139 | 128,951 | 0.7 |
| FELCOR LODGING TRUST INC | 18 | 147 | 16,743 | 0.1 |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES | 84 | 2,097 | 237,346 | 1.3 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 107 | 1,981 | 224,225 | 1.2 |
| ISTAR INC | 10 | 120 | 13,612 | 0.1 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 21 | 867 | 98,129 | 0.5 |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES | 16 | 509 | 57,609 | 0.3 |
| PUBLIC STORAGE | 21 | 4,743 | 536,684 | 3.0 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 45 | 8,332 | 942,831 | 5.2 |
| VORNADO REALTY TRUST | 24 | 2,686 | 303,998 | 1.7 |
| KIMCO REALTY CORP | 61 | 1,545 | 174,848 | 1.0 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 19 | 3,458 | 391,314 | 2.2 |
| APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 23 | 1,026 | 116,146 | 0.6 |
| 小 計 | 口 数 | 金額 | | |
| | 銘柄 | 数 < 比 率 > | | |
| | | 3,171 | 115,210 | 13,036,028 |
| | | 158 | - | <72.2%> |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 3 | 167 | 14,521 | 0.1 |
| SMART REAL ESTATE INVESTMENT | 9 | 305 | 26,443 | 0.1 |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 9 | 307 | 26,634 | 0.1 |
| CAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 5 | 241 | 20,945 | 0.1 |
| COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 13 | 202 | 17,591 | 0.1 |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 8 | 159 | 13,855 | 0.1 |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 19 | 448 | 38,830 | 0.2 |
| MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS | 3 | 53 | 4,643 | 0.0 |
| NORTHVIEW APARTMENT REAL EST | 4 | 84 | 7,282 | 0.0 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 23 | 602 | 52,200 | 0.3 |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 5 | 199 | 17,290 | 0.1 |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 10 | 130 | 11,317 | 0.1 |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 6 | 91 | 7,908 | 0.0 |
| BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO | 2 | 62 | 5,442 | 0.0 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------------|--------------|--------|---------|---------|
| | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (カナダ) | 千口 | 千カナダドル | 千円 | % |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 4 | 47 | 4,138 | 0.0 |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV | 8 | 79 | 6,919 | 0.0 |
| ONEREIT | 2 | 8 | 743 | 0.0 |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 3 | 138 | 12,035 | 0.1 |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 5 | 41 | 3,618 | 0.0 |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 4 | 40 | 3,539 | 0.0 |
| MILESTONE APARTMENTS REAL ES | 5 | 117 | 10,166 | 0.1 |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 2 | 36 | 3,134 | 0.0 |
| PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE | 16 | 94 | 8,162 | 0.0 |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 5 | 82 | 7,132 | 0.0 |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 5 | 73 | 6,356 | 0.0 |
| PLAZA RETAIL REIT | 5 | 26 | 2,284 | 0.0 |
| SLATE RETAIL REIT - U | 2 | 35 | 3,106 | 0.0 |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 5 | 60 | 5,221 | 0.0 |
| AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA | 2 | 24 | 2,083 | 0.0 |
| SLATE OFFICE REIT | 3 | 24 | 2,138 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 207 | 3,989 | 345,689 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 30 | - | <1.9%> |
| (ユーロ…ドイツ) | | | 千ユーロ | |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 14 | 165 | 20,207 | 0.1 |
| HAMBORNER REIT AG | 10 | 97 | 11,874 | 0.1 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 25 | 263 | 32,081 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 2 | - | <0.2%> |
| (ユーロ…イタリア) | | | | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 55 | 40 | 4,935 | 0.0 |
| BENI STABILI SPA | 135 | 73 | 8,908 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 191 | 113 | 13,843 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 2 | - | <0.1%> |
| (ユーロ…フランス) | | | | |
| GECINA SA | 5 | 707 | 86,120 | 0.5 |
| KLEPIERRE | 29 | 1,046 | 127,437 | 0.7 |
| UNIBAIL-RODAMCO SE | 14 | 3,054 | 371,930 | 2.1 |
| FONCIERE DES REGIONS | 7 | 564 | 68,763 | 0.4 |
| MERCIALYS | 7 | 141 | 17,221 | 0.1 |
| ICADE | 6 | 434 | 52,923 | 0.3 |
| ALTAREA | 0.36 | 62 | 7,594 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 72 | 6,011 | 731,991 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 7 | - | <4.1%> |
| (ユーロ…オランダ) | | | | |
| EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV | 7 | 246 | 30,016 | 0.2 |
| NSI NV | 18 | 70 | 8,628 | 0.0 |
| VASTNED RETAIL NV | 2 | 100 | 12,180 | 0.1 |
| WERELDHAVE NV | 5 | 239 | 29,142 | 0.2 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 34 | 656 | 79,967 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 4 | - | <0.4%> |

| 銘柄 | 口数 | 当 期 末 | | |
|------------------------------|------------|----------|---------|-----------|
| | | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…スペイン) | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 14 | 98 | 12,016 | 0.1 |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 67 | 699 | 85,124 | 0.5 |
| AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA | 8 | 110 | 13,438 | 0.1 |
| HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI | 15 | 174 | 21,282 | 0.1 |
| 小 計 | 口数・金額 | 105 | 1,082 | 131,862 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 4 | — | <0.7%> |
| (ユーロ…ベルギー) | | | | |
| BEFIMMO | 3 | 166 | 20,252 | 0.1 |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 2 | 49 | 6,057 | 0.0 |
| RETAIL ESTATES | 0.77 | 56 | 6,886 | 0.0 |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | 2 | 193 | 23,589 | 0.1 |
| WERELDHAVE BELGIUM NV | 0.32 | 33 | 4,034 | 0.0 |
| AEDIFICA | 2 | 141 | 17,253 | 0.1 |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | 0.5 | 17 | 2,188 | 0.0 |
| MONTEA | 0.98 | 43 | 5,280 | 0.0 |
| COFINIMMO | 2 | 300 | 36,639 | 0.2 |
| 小 計 | 口数・金額 | 15 | 1,003 | 122,182 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 9 | — | <0.7%> |
| (ユーロ…アイルランド) | | | | |
| GREEN REIT PLC | 96 | 126 | 15,349 | 0.1 |
| HIBERNIA REIT PLC | 103 | 124 | 15,193 | 0.1 |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 53 | 61 | 7,505 | 0.0 |
| 小 計 | 口数・金額 | 252 | 312 | 38,048 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 3 | — | <0.2%> |
| ユーロ計 | 口数・金額 | 697 | 9,444 | 1,149,976 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 31 | — | <6.4%> |
| (イギリス) | | 千イギリスポンド | | |
| BRITISH LAND CO PLC | 149 | 873 | 124,847 | 0.7 |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 49 | 307 | 43,899 | 0.2 |
| HAMMERSON PLC | 112 | 615 | 88,013 | 0.5 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 115 | 1,150 | 164,446 | 0.9 |
| INTU PROPERTIES PLC | 132 | 356 | 51,012 | 0.3 |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 91 | 98 | 14,027 | 0.1 |
| SEGREO PLC | 118 | 543 | 77,739 | 0.4 |
| WORKSPACE GROUP PLC | 18 | 136 | 19,574 | 0.1 |
| MCKAY SECURITIES PLC-ORD | 15 | 30 | 4,384 | 0.0 |
| SHAFESBURY PLC | 41 | 359 | 51,473 | 0.3 |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 21 | 148 | 21,193 | 0.1 |
| DERWENT LONDON PLC | 16 | 403 | 57,649 | 0.3 |
| MUCKLOW (A & J) GROUP PLC | 9 | 43 | 6,237 | 0.0 |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 88 | 130 | 18,593 | 0.1 |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC | 108 | 120 | 17,190 | 0.1 |
| REDEFINE INTERNATIONAL PLC | 197 | 77 | 11,034 | 0.1 |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC | 31 | 115 | 16,583 | 0.1 |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 164 | 228 | 32,660 | 0.2 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------------|--------------|-------------|---------|-----------|
| | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (イギリス) | 千口 | 千イギリスポンド | 千円 | % |
| ASSURA PLC | 235 | 128 | 18,330 | 0.1 |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 64 | 36 | 5,240 | 0.0 |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 68 | 73 | 10,514 | 0.1 |
| REGIONAL REIT LTD | 24 | 25 | 3,644 | 0.0 |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | 75 | 42 | 6,006 | 0.0 |
| NEWRIVER REIT PLC | 33 | 109 | 15,717 | 0.1 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 1,985 | 6,154 | 880,017 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 24 | — | <4.9%> |
| (オーストラリア) | | 千オーストラリアドル | | |
| VICINITY CENTRES | 472 | 1,345 | 115,380 | 0.6 |
| ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP | 6 | 42 | 3,620 | 0.0 |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 43 | 122 | 10,499 | 0.1 |
| ASPEN GROUP | 11 | 11 | 1,026 | 0.0 |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 22 | 59 | 5,074 | 0.0 |
| 360 CAPITAL GROUP LTD | 34 | 30 | 2,603 | 0.0 |
| ALE PROPERTY GROUP | 25 | 108 | 9,342 | 0.1 |
| CHARTER HALL GROUP | 59 | 273 | 23,464 | 0.1 |
| FOLKESTONE EDUCATION TRUST | 35 | 89 | 7,686 | 0.0 |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 198 | 192 | 16,483 | 0.1 |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 101 | 222 | 19,121 | 0.1 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 26 | 81 | 6,988 | 0.0 |
| NATIONAL STORAGE REIT | 64 | 92 | 7,929 | 0.0 |
| GDI PROPERTY GROUP | 65 | 63 | 5,463 | 0.0 |
| INDUSTRIA REIT | 23 | 47 | 4,063 | 0.0 |
| CENTURIA URBAN REIT | 7 | 17 | 1,458 | 0.0 |
| SCENTRE GROUP | 772 | 3,398 | 291,529 | 1.6 |
| ARENA REIT | 29 | 54 | 4,676 | 0.0 |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS | 23 | 64 | 5,542 | 0.0 |
| GENERATION HEALTHCARE REIT | 23 | 44 | 3,844 | 0.0 |
| VIVA ENERGY REIT | 66 | 151 | 13,025 | 0.1 |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 23 | 88 | 7,594 | 0.0 |
| GPT GROUP | 259 | 1,204 | 103,336 | 0.6 |
| MIRVAC GROUP | 543 | 1,092 | 93,739 | 0.5 |
| STOCKLAND | 353 | 1,535 | 131,680 | 0.7 |
| WESTFIELD CORP | 280 | 2,496 | 214,160 | 1.2 |
| DEXUS PROPERTY GROUP | 138 | 1,237 | 106,104 | 0.6 |
| BWP TRUST | 70 | 204 | 17,571 | 0.1 |
| INVESTA OFFICE FUND | 92 | 414 | 35,592 | 0.2 |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 49 | 210 | 18,067 | 0.1 |
| GOODMAN GROUP | 230 | 1,577 | 135,296 | 0.7 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 4,154 | 16,578 | 1,421,971 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 31 | — | <7.9%> |
| (ニュージーランド) | | 千ニュージーランドドル | | |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 43 | 90 | 7,467 | 0.0 |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 179 | 259 | 21,443 | 0.1 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------------|---------------|-------------|---------|---------|
| | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ニュージーランド) | 千口 | 千ニュージーランドドル | 千円 | % |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 147 | 184 | 15,274 | 0.1 |
| PROPERTY FOR INDUSTRY LTD | 62 | 99 | 8,178 | 0.0 |
| PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 141 | 175 | 14,479 | 0.1 |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 127 | 134 | 11,073 | 0.1 |
| STRIDE PROPERTY GROUP | 59 | 104 | 8,666 | 0.0 |
| INVESTORE PROPERTY LTD | 21 | 30 | 2,522 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 783 | 1,079 | 89,105 |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 8 | — | <0.5%> |
| (香港) | | 千香港ドル | | |
| LINK REIT | 323 | 16,838 | 245,668 | 1.4 |
| CHAMPION REIT | 310 | 1,305 | 19,041 | 0.1 |
| PROSPERITY REIT | 178 | 562 | 8,206 | 0.0 |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | 148 | 624 | 9,112 | 0.1 |
| REGAL REAL ESTATE INVESTMENT | 115 | 239 | 3,489 | 0.0 |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST | 153 | 719 | 10,491 | 0.1 |
| FORTUNE REIT | 205 | 1,847 | 26,948 | 0.1 |
| SPRING REAL ESTATE INVESTMEN | 137 | 431 | 6,296 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 1,569 | 22,567 | 329,255 |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 8 | — | <1.8%> |
| (シンガポール) | | 千シンガポールドル | | |
| SUNTEC REIT | 362 | 614 | 49,294 | 0.3 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 305 | 458 | 36,721 | 0.2 |
| KEPPEL REIT | 263 | 267 | 21,414 | 0.1 |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST | 84 | 108 | 8,662 | 0.0 |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST | 126 | 149 | 12,006 | 0.1 |
| CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST | 180 | 101 | 8,174 | 0.0 |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 89 | 124 | 9,983 | 0.1 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 77 | 156 | 12,549 | 0.1 |
| STARHILL GLOBAL REIT | 190 | 144 | 11,575 | 0.1 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 215 | 229 | 18,380 | 0.1 |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS | 99 | 141 | 11,359 | 0.1 |
| FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | 82 | 105 | 8,467 | 0.0 |
| AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL | 83 | 113 | 9,058 | 0.1 |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL | 255 | 98 | 7,875 | 0.0 |
| PARKWAYLIFE REAL ESTATE | 59 | 143 | 11,504 | 0.1 |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 177 | 292 | 23,476 | 0.1 |
| CACHE LOGISTICS TRUST | 127 | 103 | 8,296 | 0.0 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 264 | 390 | 31,320 | 0.2 |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 135 | 81 | 6,492 | 0.0 |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 110 | 41 | 3,306 | 0.0 |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | 121 | 85 | 6,886 | 0.0 |
| MAPLETREE GREATER CHINA COMM | 264 | 253 | 20,315 | 0.1 |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REI | 97 | 63 | 5,054 | 0.0 |
| QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | 76 | 53 | 4,264 | 0.0 |
| QUE HOSPITALITY TRUST | 160 | 109 | 8,812 | 0.0 |

| 銘柄 | 口数 | 当 期 末 | | |
|------------------------------|------------|------------|--------|------------|
| | | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (シンガポール) | 千口 | 千シンガポールドル | 千円 | % |
| SPH REIT | 105 | 102 | 8,176 | 0.0 |
| KEPPEL DC REIT | 112 | 135 | 10,821 | 0.1 |
| FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI | 165 | 154 | 12,366 | 0.1 |
| CAPITALAND MALL TRUST | 397 | 768 | 61,594 | 0.3 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 346 | 832 | 66,699 | 0.4 |
| 小 計 | 口数・金額 | 5,134 | 6,423 | 514,913 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 30 | — | <2.9%> |
| (イスラエル) | | 千イスラエルシェケル | | |
| REIT 1 LTD | 26 | 297 | 8,905 | 0.0 |
| 小 計 | 口数・金額 | 26 | 297 | 8,905 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 1 | — | <0.0%> |
| 合 計 | 口数・金額 | 17,730 | — | 17,775,865 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 321 | — | <98.5%> |

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

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

TOPIXマザーファンド

《第15期》決算日2016年3月25日

[計算期間：2015年3月26日～2016年3月25日]

「TOPIXマザーファンド」は、3月25日に第15期の決算を行いました。

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

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 東証株価指数(TOPIX) | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|-------|---------------|-------|--------|--------|---------|
| | 期騰落 | 期中率 | (TOPIX) | 期中率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 11期(2012年3月26日) | 7,888 | 1.8 | 851.82 | △0.6 | 98.4 | 1.7 | 187,797 |
| 12期(2013年3月25日) | 9,935 | 26.0 | 1,047.29 | 22.9 | 98.8 | 1.2 | 221,229 |
| 13期(2014年3月25日) | 11,255 | 13.3 | 1,163.70 | 11.1 | 98.7 | 1.2 | 221,564 |
| 14期(2015年3月25日) | 15,711 | 39.6 | 1,592.01 | 36.8 | 98.4 | 1.3 | 245,366 |
| 15期(2016年3月25日) | 13,743 | △12.5 | 1,366.05 | △14.2 | 98.2 | 1.9 | 220,801 |

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

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ12.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内株式市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは14.2%の下落となったため、カイ離は1.7%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

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

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

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

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.7%程度でした。

- ・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

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

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

◎今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2015年3月26日～2016年3月25日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-----|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 | 円 | % | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| (株 式) | 1 | 0.004 | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.000) | |
| | (1) | (0.004) | |
| 合 計 | 1 | 0.004 | |
| 期中の平均基準価額は、15,388円です。 | | | |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年3月26日～2016年3月25日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---|----|-----------|------------|--------|------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国 | 上場 | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| 内 | | 60,807 | 81,253,363 | 52,180 | 71,378,260 |
| | | (△ 2,998) | () | | |

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | | 買 建 | | 売 建 | |
|-------|--------|--------|--------|-------|-------|
| | | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国 | 株式先物取引 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 内 | | 75,143 | 73,705 | — | — |

○株式売買比率

(2015年3月26日～2016年3月25日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|---------------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 152,631,624千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 230,566,570千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.66 |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年3月26日～2016年3月25日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | |
|-----|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
| | | | $\frac{B}{A}$ | | | $\frac{D}{C}$ |
| 株式 | 百万円 81,253 | 百万円 18,121 | % 22.3 | 百万円 71,378 | 百万円 8,859 | % 12.4 |

利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|--------------|--------------|--------------|
| 株式 | 百万円 2,092 | 百万円 1,952 | 百万円 4,875 |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 買 付 額 |
|-----|------------|
| 株式 | 百万円 294 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 9,191千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 72千円 |
| (B) / (A) | 0.8% |

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

○組入資産の明細

(2016年3月25日現在)

国内株式

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

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

○有価証券の貸付及び借入の状況

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

うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUF G証券株式会社に対する貸付は、24,569,000株です。

○投資信託財産の構成

(2016年3月25日現在)

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年3月25日現在)

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

○損益の状況 (2015年3月26日～2016年3月25日)

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

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

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

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

<注記事項>

| | | | |
|--|------------------|--------------------------------------|------------------|
| ①期首元本額 | 156,174,324,083円 | | |
| 期中追加設定元本額 | 90,299,508,544円 | | |
| 期中一部解約元本額 | 85,804,501,617円 | | |
| また、1口当たり純資産額は、期末1.3743円です。 | | | |
| ②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額） | | | |
| ファンド・マネジャー（国内株式） | 2,419,679,844円 | インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA | 22,906,682円 |
| eMAXIS TOPIXインデックス | 21,330,711,385円 | インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA | 76,085,335円 |
| eMAXIS バランス（8資産均等型） | 1,592,208,146円 | インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA | 142,479,268円 |
| eMAXIS バランス（波乗り型） | 111,177,712円 | インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA | 120,583,422円 |
| コアバランス | 912,057円 | 三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1 | 3,150,098,815円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定） | 19,945,917,827円 | 三菱UFJ TOPIX・ファンドVA | 834,278,300円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定） | 14,790,783,904円 | 三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定） | 107,865,555円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA20型（適格機関投資家限定） | 527,242,271円 | 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定） | 896,042,538円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA40型（適格機関投資家限定） | 4,309,348,804円 | 三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定） | 104,323,312円 |
| MUAM 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 15,138,673,776円 | 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定） | 802,533,806円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA50型（適格機関投資家限定） | 6,747,383,047円 | 三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド | 2,128,408,178円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA75型（適格機関投資家限定） | 2,669,566,608円 | 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型） | 566,144,963円 |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定） | 636,641,903円 | 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型） | 2,248,685,858円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA45型（適格機関投資家限定） | 315,038,965円 | 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型） | 1,775,755,051円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA30型（適格機関投資家限定） | 176,444,031円 | 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型） | 1,347,664,902円 |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定） | 595,935,508円 | 三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド | 44,719,222,766円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定） | 1,406,064,878円 | 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型） | 636,768,073円 |
| 三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定） | 26,070,308円 | 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型） | 107,973,296円 |
| MJAMトピックスリソースコントロール(5%)インデックスファンド(FOF)用 適格機関投資家限定 | 1,399,846円 | 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型） | 94,918,456円 |
| MJAMトピックスリソースコントロール(10%)インデックスファンド(FOF)用 適格機関投資家限定 | 143,580,107円 | 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金） | 170,809円 |
| MUAMインデックスファンドTOPIXi（適格機関投資家限定） | 8,726,654円 | 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金） | 255,117円 |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンド | 7,499,823,663円 | 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金） | 298,365円 |
| 三菱UFJ TOPIX・ライト | 373,640,163円 | eMAXIS バランス（4資産均等型） | 18,896,736円 |
| | | 合計 | 160,669,331,010円 |

【お知らせ】

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

外国株式インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2016年5月12日

[計算期間：2015年5月13日～2016年5月12日]

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

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

○最近5期の運用実績

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

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

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

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 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 組 入 比 率 |
|---------------------|---------|-------|--|-------|-----------|-----------|-----------------|
| | 円 | 騰 落 率 | (円換算ベース) | 騰 落 率 | | | |
| (期 首) 2015年5月12日 | 23,063 | — | 162.29 | — | 96.5 | 1.2 | 2.2 |
| 5月末 | 23,848 | 3.4 | 167.17 | 3.0 | 94.8 | 1.2 | 2.2 |
| 6月末 | 22,902 | △ 0.7 | 160.34 | △ 1.2 | 96.0 | 1.8 | 2.2 |
| 7月末 | 23,546 | 2.1 | 164.73 | 1.5 | 98.2 | 1.1 | 2.3 |
| 8月末 | 21,677 | △ 6.0 | 151.30 | △ 6.8 | 94.5 | 3.0 | 2.4 |
| 9月末 | 20,196 | △12.4 | 140.71 | △13.3 | 95.4 | 2.3 | 2.5 |
| 10月末 | 22,402 | △ 2.9 | 155.86 | △ 4.0 | 95.1 | 1.4 | 2.5 |
| 11月末 | 22,647 | △ 1.8 | 157.46 | △ 3.0 | 94.8 | 5.3 | 2.4 |
| 12月末 | 22,114 | △ 4.1 | 153.40 | △ 5.5 | 94.3 | 3.8 | 2.5 |
| 2016年1月末 | 20,152 | △12.6 | 139.74 | △13.9 | 95.2 | 2.3 | 2.6 |
| 2月末 | 19,318 | △16.2 | 133.62 | △17.7 | 95.4 | 2.1 | 2.6 |
| 3月末 | 20,436 | △11.4 | 141.17 | △13.0 | 99.9 | 2.3 | 2.8 |
| 4月末 | 20,342 | △11.8 | 140.05 | △13.7 | 94.9 | 3.0 | 2.6 |
| (期 末) 2016年5月12日 | 19,726 | △14.5 | 135.59 | △16.4 | 94.4 | 2.8 | 2.7 |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

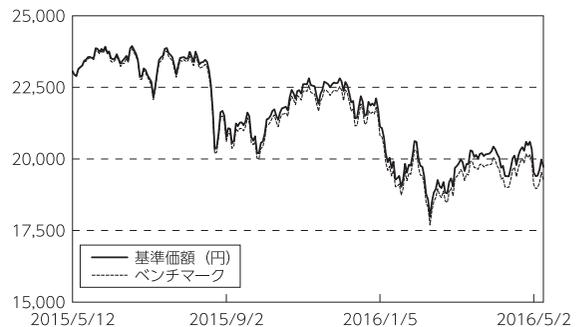
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(－16.4%)を1.9%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国株式市況

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

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて9.8%の円高・米ドル安、7.5%の円高・ユーロ安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

(注) マルチファクターモデル

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

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは16.4%の下落となったため、カイ離は1.9%程度となりました。

| | 組入比率 要因 | 銘柄選択 要因 | その他の 要因 | 合計 |
|-----------------|------------|------------|------------|--------|
| ベンチマーク とのカイ離 | △0.0%程度 | △0.0%程度 | 1.9%程度 | 1.9%程度 |

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は△0.0%程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

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

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

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.9%程度でした。

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

(2015年5月13日～2016年5月12日)

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年5月13日～2016年5月12日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------|--------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 国 | アメリカ | 百株 149,154 (4,640) | 千アメリカドル 847,454 (923) | 百株 76,288 (1,657) | 千アメリカドル 423,884 (18,362) |
| | カナダ | 19,381 (233) | 千カナダドル 66,300 (0.04604) | 9,692 (122) | 千カナダドル 31,218 (885) |
| | ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| | ドイツ | 10,429 (373) | 45,014 (△ 209) | 5,261 | 22,410 |
| | イタリア | 33,237 (△ 2,756) | 10,796 (△ 9) | 14,677 | 5,484 |
| | フランス | 12,402 (-) | 46,419 (△ 139) | 7,926 | 23,806 |
| | オランダ | 9,130 (474) | 17,240 (504) | 4,423 | 8,369 |
| | スペイン | 25,143 (43,299) | 16,712 (360) | 54,758 | 8,532 |
| | ベルギー | 908 (39) | 6,786 (-) | 474 | 3,268 |
| | オーストリア | 309 | 836 | 700 | 572 |
| | ルクセンブルク | 1,438 (684) | 1,244 (△ 376) | 1,150 | 595 |
| | フィンランド | 4,662 | 5,426 | 1,380 | 2,101 |
| | アイルランド | 13,253 | 2,821 | 6,013 | 886 |
| | ポルトガル | 22,727 | 824 | 7,210 | 345 |
| | イギリス | 139,904 (222,492) | 千イギリスポンド 76,169 (△ 180) | 65,194 (269,531) | 千イギリスポンド 35,516 (996) |
| スイス | 7,902 (1,054) | 千スイスフラン 51,689 (△ 436) | 4,980 (-) | 千スイスフラン 25,433 (0.02471) | |
| スウェーデン | 10,648 (1,614) | 千スウェーデンクローネ 134,262 (-) | 6,017 | 千スウェーデンクローネ 67,764 | |
| ノルウェー | 2,690 | 千ノルウェークローネ 30,441 | 1,697 | 千ノルウェークローネ 16,159 | |
| デンマーク | 2,403 (52) | 千デンマーククローネ 78,242 (-) | 1,128 | 千デンマーククローネ 37,515 | |

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

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

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

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|------------------------------|-----------------|--------------------|-------|------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千口 | 千アメリカドル | 千口 | 千アメリカドル |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 6 | 1,127 | 2 | 511 |
| 小 計 | 513 (31) | 27,136 (1,685) | 245 | 12,357 |
| カナダ | | 千カナダドル | | 千カナダドル |
| SMART REAL ESTATE INVESTMENT | 6 | 195 | 0.9 | 27 |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 7 | 147 | 4 | 83 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 7 | 192 | 3 | 87 |
| 小 計 | 20 | 536 | 8 | 199 |
| ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| フランス | | | | |
| GECINA SA | 1 | 217 | 0.714 | 84 |
| KLEPIERRE | 13 | 543 | 5 | 220 |
| UNIBAIL-RODAMCO SE | 4 | 1,067 | 2 | 514 |
| FONCIERE DES REGIONS | 1 | 116 | 0.709 | 56 |
| ICADE | 1 | 110 | 1 | 73 |
| 小 計 | 22 | 2,056 | 10 | 948 |
| ユ ー ロ 計 | 22 | 2,056 | 10 | 948 |
| イギリス | | 千イギリスポンド | | 千イギリスポンド |
| BRITISH LAND CO PLC | 44 | 338 | 20 | 165 |
| HAMMERSON PLC | 36 | 219 | 18 | 113 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 36 | 429 | 18 | 224 |
| INTU PROPERTIES PLC | 42 | 134 | 18 | 59 |
| SEGRO PLC | 32 | 137 | 14 | 62 |
| 小 計 | 192 | 1,259 | 90 | 625 |
| オーストラリア | | 千オーストラリアドル | | 千オーストラリアドル |
| VICINITY CENTRES | 164 | 486 | 73 | 213 |
| SCENTRE GROUP | 246 | 1,037 | 115 | 480 |
| FEDERATION CENTRES | — (103) | — (316) | — | — |
| NOVION PROPERTY GROUP | — (△ 126) | — (△ 316) | 6 | 16 |
| GPT GROUP | 92 | 440 | 41 | 196 |
| MIRVAC GROUP | 166 | 307 | 74 | 144 |
| STOCKLAND | 113 | 464 | 53 | 223 |
| WESTFIELD CORP | 90 | 897 | 43 | 420 |
| DEXUS PROPERTY GROUP | 44 | 334 | 17 | 135 |
| GOODMAN GROUP | 88 | 564 | 43 | 283 |
| 小 計 | 1,007 (△ 22) | 4,533 (—) | 470 | 2,113 |
| 香港 | | 千香港ドル | | 千香港ドル |
| LINK REIT | 106 | 4,778 | 55 | 2,497 |
| 小 計 | 106 | 4,778 | 55 | 2,497 |
| シンガポール | | 千シンガポールドル | | 千シンガポールドル |
| SUNTEC REIT | 113 (—) | 181 (△ 1) | 44 | 68 |

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

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

| 種類別 | | 買建 | | 売建 | |
|-----|--------|----------------|----------------|----------|----------|
| | | 新規買付額 | 決済額 | 新規売付額 | 決済額 |
| 外国 | 株式先物取引 | 百万円 141,684 | 百万円 135,556 | 百万円 - | 百万円 - |

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

○株式売買比率

(2015年5月13日～2016年5月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

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

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

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

外国株式

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

| 銘柄 | 株数 | 株数 | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|---------|---------|---------|-----------|------------------------|
| | | | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| SIGNET JEWELERS LTD | 45 | 62 | 649 | 70,426 | 小売 |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 99 | 689 | 2,064 | 223,770 | 各種金融 |
| QORVO INC | 86 | 116 | 538 | 58,307 | 半導体・半導体製造装置 |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC | 70 | 99 | 328 | 35,600 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | — | 146 | 690 | 74,830 | 保険 |
| ACUITY BRANDS INC | — | 36 | 913 | 98,995 | 資本財 |
| JONES LANG LASALLE INC | — | 37 | 417 | 45,228 | 不動産 |
| ARAMARK | — | 188 | 621 | 67,363 | 消費者サービス |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | — | 435 | 967 | 104,862 | 銀行 |
| LEAR CORP | — | 62 | 718 | 77,836 | 自動車・自動車部品 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | — | 63 | 340 | 36,872 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WHITEWAVE FOODS CO | — | 146 | 644 | 69,883 | 食品・飲料・タバコ |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | — | 119 | 336 | 36,459 | 素材 |
| RITE AID CORP | — | 857 | 686 | 74,344 | 食品・生活必需品小売り |
| BAXALTA INC | — | 588 | 2,503 | 271,344 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COLUMBIA PIPELINE GROUP | — | 322 | 823 | 89,256 | エネルギー |
| WESTROCK CO | — | 223 | 955 | 103,546 | 素材 |
| KRAFT HEINZ CO/THE | — | 502 | 4,277 | 463,512 | 食品・飲料・タバコ |
| PAYPAL HOLDINGS INC | — | 909 | 3,613 | 391,572 | ソフトウェア・サービス |
| TABLEAU SOFTWARE INC-CL A | — | 42 | 208 | 22,570 | ソフトウェア・サービス |
| ZILLOW GROUP INC - C | — | 83 | 226 | 24,531 | ソフトウェア・サービス |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRIS | — | 1,492 | 2,391 | 259,164 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MOBILEYE NV | — | 65 | 239 | 25,950 | ソフトウェア・サービス |
| AMERCO | — | 6 | 241 | 26,152 | 運輸 |
| CDW CORP/DE | — | 119 | 494 | 53,599 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MEDNAX INC | — | 77 | 538 | 58,397 | ヘルスケア機器・サービス |
| SABRE CORP | — | 172 | 503 | 54,556 | ソフトウェア・サービス |
| WR GRACE & CO | — | 59 | 461 | 49,986 | 素材 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C | — | 143 | 503 | 54,607 | 耐久消費財・アパレル |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C | — | 167 | 529 | 57,329 | メディア |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A | — | 74 | 240 | 26,018 | メディア |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | — | 480 | 294 | 31,938 | 不動産 |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | — | 200 | 1,066 | 115,522 | 資本財 |
| 小計 | 株数・金額 | 184,539 | 260,387 | 1,520,759 | 164,804,668 |
| | 銘柄数<比率> | 593 | 596 | — | <61.0%> |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | |
| ROYAL BANK OF CANADA | 855 | 1,228 | 9,408 | 793,455 | 銀行 |
| IMPERIAL OIL LTD | 176 | 247 | 1,000 | 84,359 | エネルギー |
| THOMSON REUTERS CORP | 213 | 286 | 1,508 | 127,176 | メディア |
| TRANSCANADA CORP | 420 | 588 | 3,044 | 256,756 | エネルギー |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B | 214 | 301 | 1,486 | 125,393 | 電気通信サービス |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 362 | 506 | 2,182 | 184,082 | 保険 |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B | 340 | 470 | 592 | 49,940 | 素材 |
| BARRICK GOLD CORP | 690 | 965 | 2,288 | 192,948 | 素材 |
| BCE INC | 85 | 120 | 715 | 60,302 | 電気通信サービス |
| AGRIUM INC | 85 | 109 | 1,213 | 102,352 | 素材 |
| BOMBARDIER INC-B | 847 | 1,596 | 323 | 27,321 | 資本財 |
| BANK OF MONTREAL | 382 | 530 | 4,319 | 364,263 | 銀行 |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 330 | 733 | 3,192 | 269,261 | 不動産 |
| BANK OF NOVA SCOTIA | 720 | 995 | 6,247 | 526,860 | 銀行 |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTE | 189 | 268 | 906 | 76,479 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CAE INC | 160 | 218 | 338 | 28,568 | 資本財 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------|---------|-------|--------|---------|--------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダドル | 千円 | |
| CAMECO CORP | 237 | 330 | 499 | 42,132 | エネルギー |
| CI FINANCIAL CORP | 132 | 195 | 527 | 44,481 | 各種金融 |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 235 | 328 | 3,297 | 278,068 | 銀行 |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES | 647 | 907 | 3,364 | 283,691 | エネルギー |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 483 | 659 | 5,040 | 425,081 | 運輸 |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A | 44 | 59 | 820 | 69,188 | 小売 |
| ENBRIDGE INC | 503 | 760 | 3,895 | 328,465 | エネルギー |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 12 | 18 | 1,160 | 97,857 | 保険 |
| CGI GROUP INC - CLASS A | 133 | 183 | 1,067 | 90,047 | ソフトウェア・サービス |
| HUSKY ENERGY INC | 206 | 292 | 442 | 37,331 | エネルギー |
| IGM FINANCIAL INC | 61 | 80 | 297 | 25,056 | 各種金融 |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 135 | 188 | 1,297 | 109,392 | 食品・生活必需品小売り |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 1,166 | 1,631 | 2,984 | 251,702 | 保険 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 246 | 335 | 1,755 | 148,061 | 自動車・自動車部品 |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 193 | 284 | 1,185 | 99,942 | 銀行 |
| ONEX CORPORATION | 53 | 71 | 563 | 47,480 | 各種金融 |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN | 491 | 691 | 1,415 | 119,399 | 素材 |
| POWER CORP OF CANADA | 220 | 310 | 894 | 75,394 | 保険 |
| POWER FINANCIAL CORP | 147 | 208 | 650 | 54,867 | 保険 |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 236 | 337 | 810 | 68,348 | メディア |
| SUNCOR ENERGY INC | 860 | 1,310 | 4,515 | 380,798 | エネルギー |
| TRANSALTA CORP | 169 | — | — | — | 公益事業 |
| WESTON (GEORGE) LTD | 30 | 43 | 473 | 39,967 | 食品・生活必需品小売り |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 101 | 120 | 2,124 | 179,116 | 運輸 |
| ENCANA CORP | 492 | 699 | 627 | 52,875 | エネルギー |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 124 | 180 | 1,078 | 90,985 | 素材 |
| FINNING INTERNATIONAL INC | 103 | 145 | 318 | 26,840 | 資本財 |
| GOLDCORP INC | 484 | 687 | 1,654 | 139,506 | 素材 |
| KINROSS GOLD CORP | 689 | 1,019 | 686 | 57,918 | 素材 |
| SNC-LAVALIN GROUP INC | 90 | 124 | 638 | 53,874 | 資本財 |
| GREAT-WEST LIFE CO INC | 179 | 247 | 845 | 71,278 | 保険 |
| METHANEX CORP | 56 | 73 | 285 | 24,088 | 素材 |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 491 | 849 | 302 | 25,488 | 素材 |
| JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A | 46 | 70 | 133 | 11,298 | 食品・生活必需品小売り |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 139 | 192 | 732 | 61,753 | 耐久消費財・アパレル |
| SAPUTO INC | 152 | 211 | 879 | 74,181 | 食品・飲料・タバコ |
| BLACKBERRY LTD | 299 | 424 | 365 | 30,785 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TELUS CORP | 116 | 116 | 471 | 39,735 | 電気通信サービス |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 359 | 571 | 527 | 44,444 | 素材 |
| YAMANA GOLD INC | 546 | 785 | 484 | 40,844 | 素材 |
| FORTIS INC | 163 | 236 | 959 | 80,881 | 公益事業 |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B | 248 | 347 | 1,872 | 157,929 | 食品・生活必需品小売り |
| ELDORADO GOLD CORP | 431 | 580 | 361 | 30,471 | 素材 |
| TORONTO-DOMINION BANK | 1,091 | 1,533 | 8,592 | 724,602 | 銀行 |
| FRANCO-NEVADA CORP | 93 | 145 | 1,301 | 109,732 | 素材 |
| SILVER WHEATON CORP | 241 | 361 | 893 | 75,377 | 素材 |
| EMPIRE CO LTD 'A' | 33 | 133 | 285 | 24,114 | 食品・生活必需品小売り |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC | 59 | 87 | 360 | 30,425 | 保険 |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A | 74 | 107 | 390 | 32,962 | 公益事業 |
| METRO INC | 148 | 199 | 851 | 71,825 | 食品・生活必需品小売り |
| OPEN TEXT CORP | 71 | 101 | 719 | 60,677 | ソフトウェア・サービス |
| INTACT FINANCIAL CORP | 78 | 109 | 964 | 81,367 | 保険 |

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

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

| 銘柄 | 株数 | 当 期 末 | | | 業 種 等 | |
|------------------------------|---------------------------|--------------|--------------|-------------|------------------------|--|
| | | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ユーロ…イタリア) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| TELECOM ITALIA-RSP | 3,577 | 4,971 | 338 | 41,914 | 電気通信サービス | |
| BANCO POPOLARE SC | 214 | 308 | 135 | 16,801 | 銀行 | |
| LEONARDO-FINMECCANICA SPA | 244 | 350 | 377 | 46,698 | 資本財 | |
| PIRELLI & C. | 139 | — | — | — | 自動車・自動車部品 | |
| UBI BANCA SPA | 509 | 734 | 232 | 28,795 | 銀行 | |
| TERNA SPA | 917 | 1,281 | 620 | 76,875 | 公益事業 | |
| UNIPOLSAI SPA | 523 | 908 | 173 | 21,433 | 保険 | |
| PRYSMIAN SPA | 123 | 160 | 345 | 42,738 | 資本財 | |
| EXOR SPA | 56 | 93 | 299 | 37,096 | 各種金融 | |
| ENEL GREEN POWER SPA | 1,081 | — | — | — | 公益事業 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 34,788 23 | 50,592 20 | 16,484 — | 2,040,977 < 0.8% > | |
| (ユーロ…フランス) | | | | | | |
| MICHELIN (CGDE) | 109 | 154 | 1,402 | 173,647 | 自動車・自動車部品 | |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 165 | 231 | 3,384 | 419,048 | 耐久消費財・アパレル | |
| PEUGEOT SA | 232 | 366 | 499 | 61,849 | 自動車・自動車部品 | |
| AXA SA | 1,077 | 1,627 | 3,391 | 419,891 | 保険 | |
| DANONE | 343 | 487 | 2,952 | 365,563 | 食品・飲料・タバコ | |
| CARREFOUR SA | 326 | 458 | 1,106 | 137,014 | 食品・生活必需品小売り | |
| VIVENDI | 719 | 960 | 1,580 | 195,653 | メディア | |
| INGENICO GROUP | — | 45 | 465 | 57,623 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| ALCATEL-LUCENT SA | 1,680 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| SOCIETE GENERALE SA | 429 | 600 | 1,981 | 245,282 | 銀行 | |
| AIR LIQUIDE SA | 204 | 284 | 2,711 | 335,660 | 素材 | |
| TOTAL SA | 1,268 | 1,816 | 7,788 | 964,328 | エネルギー | |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN | 266 | 394 | 1,517 | 187,926 | 資本財 | |
| ZODIAC AEROSPACE | 110 | 168 | 351 | 43,524 | 資本財 | |
| VINCI SA | 279 | 396 | 2,560 | 317,049 | 資本財 | |
| LAFARGE SA | 110 | — | — | — | 素材 | |
| SANOFI | 708 | 971 | 6,752 | 836,076 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 254 | 380 | 755 | 93,545 | 公益事業 | |
| L'OREAL | 149 | 207 | 3,310 | 409,841 | 家庭用品・パーソナル用品 | |
| ACCOR SA | 124 | 175 | 680 | 84,200 | 消費者サービス | |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 311 | 461 | 2,535 | 313,981 | 資本財 | |
| BNP PARIBAS | 627 | 876 | 3,866 | 478,694 | 銀行 | |
| ESSILOR INTERNATIONAL | 121 | 169 | 1,936 | 239,786 | ヘルスケア機器・サービス | |
| CAPGEMINI | 84 | 135 | 1,105 | 136,853 | ソフトウェア・サービス | |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 32 | 48 | 245 | 30,371 | 食品・生活必需品小売り | |
| VALEO SA | 45 | 65 | 912 | 112,927 | 自動車・自動車部品 | |
| HERMES INTERNATIONAL | 15 | 21 | 697 | 86,299 | 耐久消費財・アパレル | |
| VALLOUREC SA | 63 | — | — | — | エネルギー | |
| SODEXO | 56 | 77 | 691 | 85,612 | 消費者サービス | |
| KERING | 44 | 62 | 904 | 111,985 | 耐久消費財・アパレル | |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 76 | 106 | 734 | 90,985 | ソフトウェア・サービス | |
| TECHNIP SA | 59 | 87 | 411 | 50,911 | エネルギー | |
| CHRISTIAN DIOR SE | 32 | 45 | 684 | 84,698 | 耐久消費財・アパレル | |
| ATOS SE | 47 | 72 | 584 | 72,428 | ソフトウェア・サービス | |
| ORANGE | 1,098 | 1,644 | 2,416 | 299,232 | 電気通信サービス | |
| CNP ASSURANCES | 100 | 142 | 200 | 24,768 | 保険 | |
| IMERYS SA | 19 | 29 | 183 | 22,704 | 素材 | |
| SAFRAN SA | 173 | 258 | 1,548 | 191,736 | 資本財 | |
| RENAULT SA | 113 | 158 | 1,291 | 159,885 | 自動車・自動車部品 | |

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

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

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

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------|---------|--------|----------|---------|------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千イギリスポンド | 千円 | |
| CAPITA PLC | 394 | 552 | 605 | 94,698 | 商業・専門サービス |
| DIXONS CARPHONE PLC | 588 | 806 | 334 | 52,320 | 小売 |
| JOHNSON MATTHEY PLC | 122 | 159 | 460 | 72,090 | 素材 |
| RSA INSURANCE GROUP PLC | 609 | 841 | 403 | 63,187 | 保険 |
| WHITBREAD PLC | 108 | 150 | 591 | 92,514 | 消費者サービス |
| NATIONAL GRID PLC | 2,230 | 3,112 | 3,103 | 485,719 | 公益事業 |
| ARM HOLDINGS PLC | 831 | 1,162 | 1,100 | 172,192 | 半導体・半導体製造装置 |
| WOLSELEY PLC | 155 | 210 | 825 | 129,143 | 資本財 |
| BUNZL PLC | 199 | 277 | 578 | 90,475 | 資本財 |
| COBHAM PLC | 670 | 976 | 157 | 24,708 | 資本財 |
| ANGLO AMERICAN PLC | 825 | 1,160 | 716 | 112,109 | 素材 |
| INTERTEK GROUP PLC | 95 | 134 | 448 | 70,198 | 商業・専門サービス |
| WILLIAM HILL PLC | 518 | 725 | 221 | 34,740 | 消費者サービス |
| BURBERRY GROUP PLC | 265 | 367 | 429 | 67,293 | 耐久消費財・アパレル |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 140 | 171 | 463 | 72,557 | 消費者サービス |
| CARNIVAL PLC | 107 | 156 | 563 | 88,196 | 消費者サービス |
| PERSIMMON PLC | 180 | 252 | 494 | 77,330 | 耐久消費財・アパレル |
| MEGGITT PLC | 483 | 641 | 263 | 41,275 | 資本財 |
| ICAP PLC | 332 | 455 | 211 | 33,043 | 各種金融 |
| ITV PLC | 2,282 | 3,161 | 680 | 106,551 | メディア |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 185 | 258 | 667 | 104,492 | 各種金融 |
| G4S PLC | 933 | 1,293 | 249 | 39,085 | 商業・専門サービス |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS | — | 107 | 310 | 48,651 | 耐久消費財・アパレル |
| AMEC FOSTER WHEELER PLC | 228 | — | — | — | エネルギー |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | — | 826 | 432 | 67,755 | 耐久消費財・アパレル |
| IMI PLC | 160 | 225 | 222 | 34,870 | 資本財 |
| REXAM PLC | 417 | 590 | 371 | 58,090 | 素材 |
| SMITH & NEPHEW PLC | 531 | 740 | 856 | 134,045 | ヘルスケア機器・サービス |
| TATE & LYLE PLC | 276 | 394 | 240 | 37,602 | 食品・飲料・タバコ |
| TAYLOR WIMPEY PLC | — | 2,685 | 482 | 75,505 | 耐久消費財・アパレル |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 2,318 | 3,260 | 5,655 | 885,192 | エネルギー |
| PETROFAC LTD | 153 | 209 | 171 | 26,912 | エネルギー |
| TRAVIS PERKINS PLC | 145 | 205 | 373 | 58,414 | 資本財 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 1,446 | 3,280 | 5,732 | 897,187 | エネルギー |
| OLD MUTUAL PLC | 2,904 | 4,078 | 701 | 109,787 | 保険 |
| INVESTEC PLC | 327 | 470 | 226 | 35,413 | 各種金融 |
| STANDARD LIFE PLC | 1,166 | 1,628 | 520 | 81,408 | 保険 |
| EXPERIAN PLC | 587 | 799 | 1,011 | 158,360 | 商業・専門サービス |
| MONDI PLC | — | 302 | 408 | 63,970 | 素材 |
| WEIR GROUP PLC/THE | 125 | 181 | 202 | 31,759 | 資本財 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 211 | 294 | 914 | 143,084 | 食品・飲料・タバコ |
| ANTOFAGASTA PLC | 233 | 317 | 135 | 21,182 | 素材 |
| TULLOW OIL PLC | 532 | — | — | — | エネルギー |
| SHIRE PLC | 349 | 490 | 2,053 | 321,403 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INMARSAT PLC | 251 | 374 | 300 | 46,960 | 電気通信サービス |
| ADMIRAL GROUP PLC | 117 | 174 | 334 | 52,426 | 保険 |
| FRESNILLO PLC | 130 | 178 | 191 | 29,992 | 素材 |
| RANDGOLD RESOURCES LTD | 51 | 76 | 469 | 73,409 | 素材 |
| AGGREKO PLC | 151 | 207 | 218 | 34,260 | 商業・専門サービス |
| BABCOCK INTL GROUP PLC | 148 | 208 | 201 | 31,496 | 商業・専門サービス |
| ST JAMES' S PLACE PLC | — | 434 | 376 | 58,983 | 保険 |
| GLENCORE PLC | 6,585 | 10,122 | 1,385 | 216,827 | 素材 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 | |
|------------------------------|---------------------|----------------|----------------|--------------|------------------------|--|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千イギリスポンド | 千円 | | |
| ABERDEEN ASSET MGMT PLC | 551 | 759 | 202 | 31,755 | 各種金融 | |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 140 | 215 | 271 | 42,558 | 各種金融 | |
| CRODA INTERNATIONAL PLC | 79 | 113 | 341 | 53,383 | 素材 | |
| MELROSE INDUSTRIES PLC | 584 | — | — | — | 資本財 | |
| COCA-COLA HBC AG-DI | 115 | 165 | 231 | 36,253 | 食品・飲料・タバコ | |
| EASYJET PLC | 96 | 141 | 210 | 32,992 | 運輸 | |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 886 | 1,127 | 427 | 66,859 | 保険 | |
| ROYAL MAIL PLC | 382 | 743 | 370 | 57,943 | 運輸 | |
| ASHTREAD GROUP PLC | 300 | 416 | 374 | 58,567 | 資本財 | |
| SPORTS DIRECT INTERNATIONAL | 165 | 236 | 89 | 13,935 | 小売 | |
| MERLIN ENTERTAINMENT | 418 | 587 | 253 | 39,674 | 消費者サービス | |
| TUI AG-DI | 269 | 410 | 432 | 67,656 | 消費者サービス | |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC | — | 304 | 266 | 41,705 | ヘルスケア機器・サービス | |
| AUTO TRADER GROUP PLC | — | 792 | 302 | 47,320 | ソフトウェア・サービス | |
| WORLDPAY GROUP PLC | — | 1,170 | 307 | 48,199 | ソフトウェア・サービス | |
| 小 計 | 株 数 銘柄 数 < 比 率 > | 325,695 104 | 353,365 109 | 129,802 — | 20,316,680 <7.5%> | |
| (スイス) | | | 千スイスフラン | | | |
| NESTLE SA-REG | 1,912 | 2,637 | 19,187 | 2,141,894 | 食品・飲料・タバコ | |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 309 | 431 | 2,684 | 299,657 | 耐久消費財・アパレル | |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 904 | 1,487 | 2,034 | 227,107 | 各種金融 | |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG | 135 | 376 | 1,660 | 185,328 | 素材 | |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 416 | 581 | 14,184 | 1,583,383 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| GIVAUDAN-REG | 5 | 7 | 1,473 | 164,515 | 素材 | |
| SONOVA HOLDING AG-REG | 31 | 44 | 602 | 67,216 | ヘルスケア機器・サービス | |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 88 | 124 | 2,686 | 299,863 | 保険 | |
| SYNGENTA AG-REG | 55 | 76 | 3,012 | 336,333 | 素材 | |
| LONZA GROUP AG-REG | 31 | 43 | 739 | 82,558 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| SWATCH GROUP AG/THE-REG | 29 | 40 | 257 | 28,722 | 耐久消費財・アパレル | |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 26 | 36 | 643 | 71,778 | 資本財 | |
| GEBERIT AG-REG | 22 | 31 | 1,154 | 128,925 | 資本財 | |
| SWISS RE AG | 208 | 290 | 2,527 | 282,098 | 保険 | |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR | 18 | 25 | 822 | 91,852 | 耐久消費財・アパレル | |
| PARGESA HOLDING SA-BR | 19 | 27 | 173 | 19,334 | 各種金融 | |
| NOVARTIS AG-REG | 1,364 | 1,882 | 13,788 | 1,539,227 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| ADECCO GROUP AG-REG | 101 | 137 | 808 | 90,222 | 商業・専門サービス | |
| SWISSCOM AG-REG | 13 | 21 | 1,035 | 115,627 | 電気通信サービス | |
| ABB LTD-REG | 1,302 | 1,819 | 3,681 | 410,990 | 資本財 | |
| SGS SA-REG | 3 | 4 | 951 | 106,256 | 商業・専門サービス | |
| SULZER AG-REG | 13 | 11 | 100 | 11,195 | 資本財 | |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG | 12 | 16 | 295 | 32,965 | 資本財 | |
| ACTELION LTD-REG | 60 | 84 | 1,329 | 148,460 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG | 32 | 44 | 605 | 67,589 | 運輸 | |
| BALOISE HOLDING AG - REG | 28 | 40 | 476 | 53,222 | 保険 | |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 18 | 26 | 639 | 71,426 | 保険 | |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | 0.06 | 0.09 | 648 | 72,441 | 食品・飲料・タバコ | |
| ARYZTA AG | 52 | 74 | 282 | 31,577 | 食品・飲料・タバコ | |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 133 | 185 | 729 | 81,450 | 各種金融 | |
| SIKA AG-BR | 1 | 1 | 745 | 83,236 | 素材 | |
| TRANSOCEAN LTD | 211 | — | — | — | エネルギー | |
| SWISS PRIME SITE-REG | 34 | 55 | 469 | 52,402 | 不動産 | |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC | 0.55 | 0.81 | 491 | 54,885 | 食品・飲料・タバコ | |

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

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

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 | |
|------------------------------|--------------|--------|-----------|---------|-------------|--|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港ドル | 千円 | | |
| HUTCHISON WHAMPOA LTD | 1,270 | — | — | — | 資本財 | |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A | 375 | 490 | 4,044 | 56,507 | 不動産 | |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 820 | 2,238 | 20,830 | 291,007 | 資本財 | |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES | 1,000 | 1,440 | 13,140 | 183,565 | 不動産 | |
| MTR CORP | 875 | 1,225 | 4,704 | 65,714 | 運輸 | |
| HONG KONG & CHINA GAS | 3,782 | 5,865 | 8,481 | 118,492 | 公益事業 | |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | 3,050 | 4,500 | 3,244 | 45,325 | 不動産 | |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 830 | 1,165 | 8,964 | 125,236 | 公益事業 | |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 658 | 950 | 17,651 | 246,584 | 各種金融 | |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS | 720 | 1,020 | 1,240 | 17,327 | 運輸 | |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD | 1,310 | 1,870 | 2,655 | 37,095 | 不動産 | |
| CLP HOLDINGS LTD | 1,135 | 1,595 | 11,643 | 162,659 | 公益事業 | |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 618 | 958 | 4,429 | 61,874 | 不動産 | |
| BANK OF EAST ASIA LTD | 698 | 990 | 2,742 | 38,317 | 銀行 | |
| HANG SENG BANK LTD | 452 | 632 | 8,664 | 121,046 | 銀行 | |
| HYSAN DEVELOPMENT CO | 380 | 540 | 1,738 | 24,291 | 不動産 | |
| SHANGRI-LA ASIA LTD | 600 | 1,080 | 968 | 13,533 | 消費者サービス | |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 137 | 209 | 1,146 | 16,014 | 半導体・半導体製造装置 | |
| SINO LAND CO | 1,774 | 2,514 | 2,865 | 40,037 | 不動産 | |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | 435 | 610 | 1,726 | 24,116 | 耐久消費財・アパレル | |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE | 370 | 570 | 4,283 | 59,841 | 公益事業 | |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 2,200 | 3,060 | 6,854 | 95,755 | 銀行 | |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 805 | 1,150 | 3,524 | 49,240 | 耐久消費財・アパレル | |
| PCCW LTD | 2,510 | 3,530 | 1,803 | 25,199 | 電気通信サービス | |
| LI & FUNG LTD | 3,400 | 4,900 | 2,146 | 29,982 | 耐久消費財・アパレル | |
| KERRY PROPERTIES LTD | 395 | 520 | 1,011 | 14,136 | 不動産 | |
| NWS HOLDINGS LTD | 895 | 1,285 | 1,547 | 21,613 | 資本財 | |
| SANDS CHINA LTD | 1,436 | 2,008 | 5,532 | 77,282 | 消費者サービス | |
| WHELOCK & CO LTD | 550 | 750 | 2,606 | 36,409 | 不動産 | |
| WYNN MACAU LTD | 904 | 1,272 | 1,422 | 19,866 | 消費者サービス | |
| SJM HOLDINGS LTD | 1,150 | 1,660 | 790 | 11,038 | 消費者サービス | |
| FIRST PACIFIC CO | 1,420 | 2,080 | 1,002 | 14,005 | 各種金融 | |
| AIA GROUP LTD | 7,146 | 9,976 | 43,345 | 605,539 | 保険 | |
| SWIRE PROPERTIES LTD | 704 | 1,004 | 1,999 | 27,939 | 不動産 | |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 1,370 | 1,940 | 4,811 | 67,212 | 消費者サービス | |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD | 552 | 852 | 886 | 12,378 | 消費者サービス | |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS | 1,530 | 2,280 | 2,576 | 35,992 | 電気通信サービス | |
| WH GROUP LTD | 2,240 | 4,875 | 2,949 | 41,202 | 食品・飲料・タバコ | |
| CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING | — | 2,238 | 10,532 | 147,145 | 不動産 | |
| 小 計 | 株 数 | 51,397 | 76,974 | 225,171 | 3,145,651 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 39 | 39 | — | < 1.2% > | |
| (シンガポール) | | | 千シンガポールドル | | | |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 1,794 | 2,561 | 2,133 | 169,193 | 銀行 | |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 972 | 1,344 | 520 | 41,266 | メディア | |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD | 590 | 801 | 213 | 16,961 | 資本財 | |
| CAPITALAND LTD | 1,530 | 2,156 | 642 | 50,955 | 不動産 | |
| CITY DEVELOPMENTS LTD | 250 | 360 | 289 | 22,955 | 不動産 | |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 64 | 97 | 330 | 26,179 | 小売 | |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD | 1,040 | 1,461 | 2,143 | 169,984 | 銀行 | |
| KEPPEL CORP LTD | 870 | 1,208 | 618 | 49,052 | 資本財 | |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD | 773 | 1,071 | 1,880 | 149,156 | 銀行 | |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING | 950 | 1,357 | 428 | 34,009 | 資本財 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 | |
|------------------------------|--------------|---------|------------|---------|------------------------|--|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (シンガポール) | 百株 | 百株 | 千シンガポールドル | 千円 | | |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 4,762 | 6,613 | 2,539 | 201,417 | 電気通信サービス | |
| SINGAPORE AIRLINES LTD | 343 | 479 | 558 | 44,294 | 運輸 | |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD | 500 | 671 | 500 | 39,699 | 各種金融 | |
| SEMBCORP MARINE LTD | 500 | 660 | 100 | 7,956 | 資本財 | |
| UOL GROUP LTD | 290 | 391 | 219 | 17,396 | 不動産 | |
| COMFORTDELGRO CORP LTD | 1,230 | 1,810 | 503 | 39,907 | 運輸 | |
| NOBLE GROUP LTD | 2,710 | 4,185 | 146 | 11,619 | 資本財 | |
| STARHUB LTD | 400 | 565 | 187 | 14,832 | 電気通信サービス | |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 4,393 | 6,110 | 223 | 17,689 | 食品・飲料・タバコ | |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD | 1,150 | 1,606 | 528 | 41,905 | 食品・飲料・タバコ | |
| GENTING SINGAPORE PLC | 3,700 | 4,988 | 379 | 30,065 | 消費者サービス | |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L | 1,880 | 2,640 | 465 | 36,955 | 不動産 | |
| YANGZIJIANG SHIPBUILDING | 1,150 | 1,726 | 155 | 12,320 | 資本財 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 31,844 | 44,863 | 15,707 | 1,245,773 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 23 | 23 | — | <0.5%> | |
| (イスラエル) | | | 千イスラエルシェケル | | | |
| ISRAEL CHEMICALS LTD | 258 | 406 | 668 | 19,270 | 素材 | |
| TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD | 510 | 755 | 15,128 | 436,310 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| BANK HAPOLIM BM | 616 | 877 | 1,704 | 49,143 | 銀行 | |
| NICE SYSTEMS LTD | 34 | 48 | 1,179 | 34,021 | ソフトウェア・サービス | |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL | 777 | 1,161 | 1,620 | 46,732 | 銀行 | |
| ISRAEL CORP LIMITED/THE | 1 | — | — | — | 素材 | |
| DELEK GROUP LTD | 2 | 3 | 275 | 7,956 | エネルギー | |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO | 1,127 | 1,607 | 1,301 | 37,546 | 電気通信サービス | |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 80 | 120 | 517 | 14,938 | 銀行 | |
| AZRIELI GROUP | — | 31 | 481 | 13,874 | 不動産 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 3,409 | 5,013 | 22,877 | 659,793 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 9 | 9 | — | <0.2%> | |
| 合 計 | 株 数 ・ 金 額 | 846,139 | 1,109,747 | — | 255,005,772 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 1,258 | 1,260 | — | <94.4%> | |

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

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

外国投資信託証券

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | | |
|------------------------------|--------------|-------|-------|------------|-----------|-----|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (カナダ) | | 千口 | 千口 | 千カナダドル | 千円 | % |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | | 9 | 13 | 370 | 31,252 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 17 | 29 | 792 | 66,802 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 2 | 3 | — | < 0.0% > | |
| (ユーロ…フランス) | | | | 千ユーロ | | |
| GECINA SA | | 1 | 2 | 359 | 44,485 | 0.0 |
| KLEPIERRE | | 10 | 18 | 744 | 92,180 | 0.0 |
| UNIBAIL-RODAMCO SE | | 5 | 8 | 1,913 | 236,890 | 0.1 |
| FONCIERE DES REGIONS | | 1 | 2 | 202 | 25,025 | 0.0 |
| ICADE | | 2 | 2 | 186 | 23,084 | 0.0 |
| ユ ー ロ 計 | 口 数 ・ 金 額 | 21 | 34 | 3,405 | 421,666 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 5 | 5 | — | < 0.2% > | |
| (イギリス) | | | | 千イギリスポンド | | |
| BRITISH LAND CO PLC | | 57 | 80 | 583 | 91,374 | 0.0 |
| HAMMERSON PLC | | 46 | 65 | 377 | 59,117 | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | | 46 | 65 | 752 | 117,785 | 0.0 |
| INTU PROPERTIES PLC | | 54 | 78 | 229 | 35,967 | 0.0 |
| SEGRO PLC | | 44 | 62 | 262 | 41,163 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 249 | 351 | 2,206 | 345,408 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 5 | 5 | — | < 0.1% > | |
| (オーストラリア) | | | | 千オーストラリアドル | | |
| VICINITY CENTRES | | 90 | 285 | 976 | 78,011 | 0.0 |
| SCENTRE GROUP | | 316 | 446 | 2,054 | 164,143 | 0.1 |
| NOVION PROPERTY GROUP | | 132 | — | — | — | — |
| GPT GROUP | | 102 | 153 | 800 | 63,994 | 0.0 |
| MIRVAC GROUP | | 226 | 317 | 620 | 49,577 | 0.0 |
| STOCKLAND | | 141 | 202 | 929 | 74,289 | 0.0 |
| WESTFIELD CORP | | 117 | 165 | 1,779 | 142,238 | 0.1 |
| DEXUS PROPERTY GROUP | | 57 | 83 | 711 | 56,893 | 0.0 |
| GOODMAN GROUP | | 104 | 149 | 1,082 | 86,470 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 1,289 | 1,803 | 8,955 | 715,618 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 9 | 8 | — | < 0.3% > | |
| (香港) | | | | 千香港ドル | | |
| LINK REIT | | 135 | 186 | 8,653 | 120,890 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 135 | 186 | 8,653 | 120,890 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | < 0.0% > | |
| (シンガポール) | | | | 千シンガポールドル | | |
| SUNTEC REIT | | 143 | 211 | 349 | 27,703 | 0.0 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | | 131 | 172 | 240 | 19,107 | 0.0 |
| CAPITALAND MALL TRUST | | 146 | 215 | 446 | 35,411 | 0.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | | 122 | 183 | 446 | 35,441 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 542 | 784 | 1,483 | 117,664 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 4 | 4 | — | < 0.0% > | |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 2,847 | 4,083 | — | 7,251,695 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 60 | 61 | — | < 2.7% > | |

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

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

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

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

| 項 目 | 当 期 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株式 | 千円 255,005,772 | % 94.4 |
| 投資証券 | 7,251,695 | 2.7 |
| コール・ローン等、その他 | 7,907,174 | 2.9 |
| 投資信託財産総額 | 270,164,641 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産(269,579,000千円)の投資信託財産総額(270,164,641千円)に対する比率は99.8%です。

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

| | | | |
|--------------------|---------------------|--------------------|--------------------|
| 1 アメリカドル=108.37円 | 1 カナダドル=84.33円 | 1 ユーロ=123.81円 | 1 イギリスポンド=156.52円 |
| 1 スイスフラン=111.63円 | 1 スウェーデンクローネ=13.33円 | 1 ノルウェークローネ=13.28円 | 1 デンマーククローネ=16.64円 |
| 1 オーストラリアドル=79.91円 | 1 ニュージーランドドル=74.03円 | 1 香港ドル=13.97円 | 1 シンガポールドル=79.31円 |
| 1 イスラエルシェゲル=28.84円 | | | |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

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

<注記事項>

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

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

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

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

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

【お 知 ら せ】

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

日本債券インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2016年5月12日

〔計算期間：2015年5月13日～2016年5月12日〕

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

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

○最近5期の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 | | NOMURA-BPI 総 合 イン デ ッ ク ス | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 純 資 産 総 額 |
|-----------------|---------|---------|------------------------------|---------|----------------|----------------|--------------|
| | 円 | 騰 落 中 率 | | 騰 落 中 率 | | | |
| 11期(2012年5月14日) | 11,862 | 2.8 | 340.97 | 2.8 | 99.4 | 0.1 | 203,547 |
| 12期(2013年5月13日) | 12,036 | 1.5 | 345.99 | 1.5 | 98.9 | 0.8 | 269,276 |
| 13期(2014年5月12日) | 12,299 | 2.2 | 353.58 | 2.2 | 99.4 | 0.2 | 283,162 |
| 14期(2015年5月12日) | 12,572 | 2.2 | 361.38 | 2.2 | 99.4 | 0.3 | 343,834 |
| 15期(2016年5月12日) | 13,473 | 7.2 | 387.29 | 7.2 | 99.6 | — | 529,456 |

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | N O M U R A - B P I 総 合 イ ン デ ッ ク ス | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|---------------------|---------|-------|--|-------|-----------|-----------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2015年5月12日 | 円 | % | | % | % | % |
| | 12,572 | — | 361.38 | — | 99.4 | 0.3 |
| 5月末 | 12,620 | 0.4 | 362.77 | 0.4 | 99.2 | 0.4 |
| 6月末 | 12,613 | 0.3 | 362.54 | 0.3 | 99.5 | 0.3 |
| 7月末 | 12,649 | 0.6 | 363.58 | 0.6 | 99.3 | 0.4 |
| 8月末 | 12,670 | 0.8 | 364.20 | 0.8 | 99.3 | 0.4 |
| 9月末 | 12,707 | 1.1 | 365.24 | 1.1 | 99.0 | 0.1 |
| 10月末 | 12,755 | 1.5 | 366.65 | 1.5 | 98.9 | 0.1 |
| 11月末 | 12,754 | 1.4 | 366.58 | 1.4 | 99.4 | 0.1 |
| 12月末 | 12,832 | 2.1 | 368.88 | 2.1 | 99.4 | — |
| 2016年1月末 | 12,991 | 3.3 | 373.52 | 3.4 | 99.0 | 0.1 |
| 2月末 | 13,214 | 5.1 | 379.83 | 5.1 | 98.8 | 0.3 |
| 3月末 | 13,320 | 5.9 | 382.91 | 6.0 | 101.6 | 0.1 |
| 4月末 | 13,437 | 6.9 | 386.25 | 6.9 | 99.8 | — |
| (期 末) 2016年5月12日 | | | | | | |
| | 13,473 | 7.2 | 387.29 | 7.2 | 99.6 | — |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ7.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(7.2%)とほぼ同程度となりました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内債券市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
- ・なお、期末時点では、資金フロー対応のため、債券先物のポジションは保有しておりません。
- ・ベンチマーク（NOMURA-BPI総合インデックス）の構成銘柄を種別や年限などの属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました*。

*一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは7.2%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度と低水準に抑制し、高い運動性を維持しました。

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

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

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

◎その他の要因

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

◎今後の運用方針

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

○1万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016年5月12日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---------------------------------|---------------|-----------------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション) | 円 0 (0) | % 0.000 (0.000) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| (b) そ の 他 費 用 (そ の 他) | 0 (0) | 0.000 (0.000) | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 0 | 0.000 | |
| 期中の平均基準価額は、12,880円です。 | | | |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年5月13日～2016年5月12日)

公社債

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

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | | 買 建 | | 売 建 | |
|--------|--------|---------------|---------------|----------|----------|
| | | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国 内 | 債券先物取引 | 百万円 11,739 | 百万円 12,952 | 百万円 - | 百万円 - |

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

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

(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|--------------|------------|--------------|
| 公社債 | 百万円 1,136 | 百万円 302 | 百万円 1,990 |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 買 付 額 |
|-----|--------------|
| 公社債 | 百万円 1,600 |

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

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 | | | 末 | | | |
|-----------------|------------------------------|------------------------------|----------------|--------------------|----------------|----------------|----------------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | 千円 | 千円 | % | % | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| 国債証券 | 380,496,000 (100,000) | 430,939,878 (100,703) | 81.4 (0.0) | — (—) | 50.7 (—) | 21.3 (0.0) | 9.3 (—) |
| 地方債証券 | 28,006,180 (28,006,180) | 30,032,413 (30,032,413) | 5.7 (5.7) | — (—) | 4.0 (4.0) | 1.4 (1.4) | 0.2 (0.2) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 36,130,167 (36,130,167) | 39,037,654 (39,037,654) | 7.4 (7.4) | — (—) | 5.3 (5.3) | 1.4 (1.4) | 0.7 (0.7) |
| 金融債券 | 4,340,000 (4,340,000) | 4,372,982 (4,372,982) | 0.8 (0.8) | — (—) | 0.0 (0.0) | 0.6 (0.6) | 0.2 (0.2) |
| 普通社債券 | 21,917,000 (21,917,000) | 22,919,698 (22,919,698) | 4.3 (4.3) | 0.2 (0.2) | 1.3 (1.3) | 2.1 (2.1) | 0.9 (0.9) |
| 合 計 | 470,889,347 (90,493,347) | 527,302,626 (96,463,451) | 99.6 (18.2) | 0.2 (0.2) | 61.3 (10.5) | 27.0 (5.6) | 11.4 (2.0) |

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

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

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-----------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第288回利付国債 (10年) | 1.7 | 2,026,000 | 2,079,992 | 2017/9/20 |
| 第289回利付国債 (10年) | 1.5 | 2,453,000 | 2,522,444 | 2017/12/20 |
| 第290回利付国債 (10年) | 1.4 | 1,640,000 | 1,690,266 | 2018/3/20 |
| 第291回利付国債 (10年) | 1.3 | 940,000 | 967,072 | 2018/3/20 |
| 第292回利付国債 (10年) | 1.7 | 794,000 | 822,750 | 2018/3/20 |
| 第293回利付国債 (10年) | 1.8 | 1,081,000 | 1,127,807 | 2018/6/20 |
| 第294回利付国債 (10年) | 1.7 | 1,570,000 | 1,634,668 | 2018/6/20 |
| 第295回利付国債 (10年) | 1.5 | 1,240,000 | 1,285,855 | 2018/6/20 |
| 第296回利付国債 (10年) | 1.5 | 2,020,000 | 2,103,486 | 2018/9/20 |
| 第297回利付国債 (10年) | 1.4 | 836,000 | 871,830 | 2018/12/20 |
| 第298回利付国債 (10年) | 1.3 | 2,640,000 | 2,746,233 | 2018/12/20 |
| 第299回利付国債 (10年) | 1.3 | 2,760,000 | 2,881,688 | 2019/3/20 |
| 第300回利付国債 (10年) | 1.5 | 957,000 | 1,004,677 | 2019/3/20 |
| 第301回利付国債 (10年) | 1.5 | 1,872,000 | 1,973,892 | 2019/6/20 |
| 第302回利付国債 (10年) | 1.4 | 2,850,000 | 2,996,233 | 2019/6/20 |
| 第303回利付国債 (10年) | 1.4 | 2,325,000 | 2,453,688 | 2019/9/20 |
| 第304回利付国債 (10年) | 1.3 | 1,170,000 | 1,230,804 | 2019/9/20 |
| 第305回利付国債 (10年) | 1.3 | 3,808,000 | 4,020,029 | 2019/12/20 |
| 第306回利付国債 (10年) | 1.4 | 2,488,000 | 2,646,286 | 2020/3/20 |
| 第307回利付国債 (10年) | 1.3 | 1,610,000 | 1,706,181 | 2020/3/20 |
| 第308回利付国債 (10年) | 1.3 | 1,374,000 | 1,461,221 | 2020/6/20 |
| 第309回利付国債 (10年) | 1.1 | 2,300,000 | 2,426,983 | 2020/6/20 |
| 第310回利付国債 (10年) | 1.0 | 2,886,000 | 3,041,872 | 2020/9/20 |
| 第311回利付国債 (10年) | 0.8 | 2,700,000 | 2,822,121 | 2020/9/20 |
| 第312回利付国債 (10年) | 1.2 | 4,030,000 | 4,297,753 | 2020/12/20 |
| 第313回利付国債 (10年) | 1.3 | 2,969,000 | 3,191,496 | 2021/3/20 |
| 第314回利付国債 (10年) | 1.1 | 1,590,000 | 1,693,572 | 2021/3/20 |
| 第315回利付国債 (10年) | 1.2 | 2,253,000 | 2,420,352 | 2021/6/20 |
| 第316回利付国債 (10年) | 1.1 | 980,000 | 1,047,747 | 2021/6/20 |
| 第317回利付国債 (10年) | 1.1 | 1,557,000 | 1,670,022 | 2021/9/20 |
| 第318回利付国債 (10年) | 1.0 | 2,490,000 | 2,657,253 | 2021/9/20 |
| 第319回利付国債 (10年) | 1.1 | 1,519,000 | 1,634,474 | 2021/12/20 |
| 第320回利付国債 (10年) | 1.0 | 2,850,000 | 3,050,497 | 2021/12/20 |
| 第321回利付国債 (10年) | 1.0 | 2,515,000 | 2,699,827 | 2022/3/20 |
| 第322回利付国債 (10年) | 0.9 | 1,770,000 | 1,889,581 | 2022/3/20 |
| 第323回利付国債 (10年) | 0.9 | 1,675,000 | 1,793,121 | 2022/6/20 |
| 第324回利付国債 (10年) | 0.8 | 3,440,000 | 3,661,295 | 2022/6/20 |
| 第325回利付国債 (10年) | 0.8 | 3,435,000 | 3,665,248 | 2022/9/20 |
| 第326回利付国債 (10年) | 0.7 | 1,360,000 | 1,445,204 | 2022/12/20 |
| 第327回利付国債 (10年) | 0.8 | 2,240,000 | 2,395,344 | 2022/12/20 |
| 第328回利付国債 (10年) | 0.6 | 740,000 | 782,979 | 2023/3/20 |
| 第329回利付国債 (10年) | 0.8 | 3,210,000 | 3,447,251 | 2023/6/20 |
| 第330回利付国債 (10年) | 0.8 | 2,390,000 | 2,572,070 | 2023/9/20 |
| 第331回利付国債 (10年) | 0.6 | 1,480,000 | 1,570,635 | 2023/9/20 |
| 第332回利付国債 (10年) | 0.6 | 3,110,000 | 3,304,468 | 2023/12/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-----------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第333回利付国債 (10年) | 0.6 | 4,060,000 | 4,318,825 | 2024/3/20 |
| 第334回利付国債 (10年) | 0.6 | 4,200,000 | 4,472,790 | 2024/6/20 |
| 第335回利付国債 (10年) | 0.5 | 4,240,000 | 4,484,351 | 2024/9/20 |
| 第336回利付国債 (10年) | 0.5 | 1,360,000 | 1,439,492 | 2024/12/20 |
| 第337回利付国債 (10年) | 0.3 | 3,980,000 | 4,143,180 | 2024/12/20 |
| 第338回利付国債 (10年) | 0.4 | 4,440,000 | 4,663,021 | 2025/3/20 |
| 第339回利付国債 (10年) | 0.4 | 5,380,000 | 5,652,819 | 2025/6/20 |
| 第340回利付国債 (10年) | 0.4 | 5,330,000 | 5,602,576 | 2025/9/20 |
| 第341回利付国債 (10年) | 0.3 | 4,820,000 | 5,018,969 | 2025/12/20 |
| 第342回利付国債 (10年) | 0.1 | 3,680,000 | 3,758,752 | 2026/3/20 |
| 第1回利付国債 (30年) | 2.8 | 76,000 | 104,404 | 2029/9/20 |
| 第2回利付国債 (30年) | 2.4 | 98,000 | 130,290 | 2030/2/20 |
| 第3回利付国債 (30年) | 2.3 | 117,000 | 154,486 | 2030/5/20 |
| 第4回利付国債 (30年) | 2.9 | 127,000 | 179,675 | 2030/11/20 |
| 第5回利付国債 (30年) | 2.2 | 108,000 | 142,701 | 2031/5/20 |
| 第6回利付国債 (30年) | 2.4 | 169,000 | 229,611 | 2031/11/20 |
| 第7回利付国債 (30年) | 2.3 | 164,000 | 221,729 | 2032/5/20 |
| 第8回利付国債 (30年) | 1.8 | 142,000 | 181,231 | 2032/11/22 |
| 第9回利付国債 (30年) | 1.4 | 116,000 | 140,505 | 2032/12/20 |
| 第10回利付国債 (30年) | 1.1 | 185,000 | 215,108 | 2033/3/20 |
| 第11回利付国債 (30年) | 1.7 | 137,000 | 173,261 | 2033/6/20 |
| 第12回利付国債 (30年) | 2.1 | 220,000 | 293,774 | 2033/9/20 |
| 第13回利付国債 (30年) | 2.0 | 205,000 | 270,716 | 2033/12/20 |
| 第14回利付国債 (30年) | 2.4 | 493,000 | 686,965 | 2034/3/20 |
| 第15回利付国債 (30年) | 2.5 | 346,000 | 488,818 | 2034/6/20 |
| 第16回利付国債 (30年) | 2.5 | 302,000 | 427,961 | 2034/9/20 |
| 第17回利付国債 (30年) | 2.4 | 327,000 | 458,454 | 2034/12/20 |
| 第18回利付国債 (30年) | 2.3 | 427,000 | 591,984 | 2035/3/20 |
| 第19回利付国債 (30年) | 2.3 | 303,000 | 420,809 | 2035/6/20 |
| 第20回利付国債 (30年) | 2.5 | 495,000 | 707,726 | 2035/9/20 |
| 第21回利付国債 (30年) | 2.3 | 379,000 | 528,094 | 2035/12/20 |
| 第22回利付国債 (30年) | 2.5 | 570,000 | 817,875 | 2036/3/20 |
| 第23回利付国債 (30年) | 2.5 | 554,000 | 796,319 | 2036/6/20 |
| 第24回利付国債 (30年) | 2.5 | 411,000 | 592,349 | 2036/9/20 |
| 第25回利付国債 (30年) | 2.3 | 742,000 | 1,043,021 | 2036/12/20 |
| 第26回利付国債 (30年) | 2.4 | 1,064,000 | 1,520,211 | 2037/3/20 |
| 第27回利付国債 (30年) | 2.5 | 910,000 | 1,327,635 | 2037/9/20 |
| 第28回利付国債 (30年) | 2.5 | 1,191,000 | 1,747,852 | 2038/3/20 |
| 第29回利付国債 (30年) | 2.4 | 1,400,000 | 2,037,070 | 2038/9/20 |
| 第30回利付国債 (30年) | 2.3 | 1,336,000 | 1,925,763 | 2039/3/20 |
| 第31回利付国債 (30年) | 2.2 | 1,228,000 | 1,752,380 | 2039/9/20 |
| 第32回利付国債 (30年) | 2.3 | 1,509,000 | 2,197,677 | 2040/3/20 |
| 第33回利付国債 (30年) | 2.0 | 1,834,000 | 2,561,786 | 2040/9/20 |
| 第34回利付国債 (30年) | 2.2 | 1,626,000 | 2,359,374 | 2041/3/20 |
| 第35回利付国債 (30年) | 2.0 | 1,769,000 | 2,495,032 | 2041/9/20 |

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

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

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

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第28回東京都公募公債 (20年) | 1.59 | 100,000 | 122,170 | 2033/3/18 |
| 第666回東京都公募公債 | 1.46 | 150,000 | 156,177 | 2019/3/20 |
| 第669回東京都公募公債 | 1.63 | 50,000 | 52,511 | 2019/6/20 |
| 第678回東京都公募公債 | 1.38 | 100,000 | 104,916 | 2019/12/20 |
| 第680回東京都公募公債 | 1.39 | 100,000 | 105,319 | 2020/3/19 |
| 第681回東京都公募公債 | 1.4 | 100,000 | 105,349 | 2020/3/19 |
| 第686回東京都公募公債 | 1.08 | 100,000 | 104,369 | 2020/6/19 |
| 第692回東京都公募公債 | 1.35 | 100,000 | 106,165 | 2020/12/18 |
| 第693回東京都公募公債 | 1.38 | 100,000 | 106,670 | 2021/3/19 |
| 第701回東京都公募公債 | 0.99 | 120,000 | 126,288 | 2021/9/17 |
| 第705回東京都公募公債 | 1.06 | 170,000 | 180,438 | 2022/3/18 |
| 第709回東京都公募公債 | 0.78 | 100,000 | 104,731 | 2022/6/20 |
| 第716回東京都公募公債 | 0.77 | 100,000 | 105,018 | 2022/12/20 |
| 第717回東京都公募公債 | 0.63 | 100,000 | 104,217 | 2023/3/20 |
| 第718回東京都公募公債 | 0.6 | 100,000 | 104,012 | 2023/3/20 |
| 第719回東京都公募公債 | 0.86 | 250,000 | 264,480 | 2023/3/20 |
| 第723回東京都公募公債 | 0.76 | 200,000 | 210,802 | 2023/9/20 |
| 第728回東京都公募公債 | 0.65 | 300,000 | 314,115 | 2023/12/20 |
| 第730回東京都公募公債 | 0.664 | 100,000 | 105,089 | 2024/3/19 |
| 平成19年度第2回北海道公募公債 | 1.84 | 112,000 | 114,084 | 2017/5/31 |
| 平成19年度第4回北海道公募公債 | 1.98 | 20,000 | 20,435 | 2017/6/29 |
| 平成19年度第16回北海道公募公債 | 1.58 | 100,000 | 102,857 | 2018/3/23 |
| 平成20年度第6回北海道公募公債 | 1.72 | 53,990 | 56,059 | 2018/8/29 |
| 平成21年度第2回北海道公募公債 | 1.66 | 100,000 | 104,893 | 2019/5/29 |
| 平成21年度第12回北海道公募公債 | 1.42 | 100,000 | 104,897 | 2019/12/25 |
| 平成22年度第8回北海道公募公債 | 0.96 | 100,000 | 103,939 | 2020/10/29 |
| 平成24年度第9回北海道公募公債 | 0.79 | 100,000 | 104,506 | 2022/10/31 |
| 平成24年度第13回北海道公募公債 (5年) | 0.23 | 100,000 | 100,318 | 2018/1/31 |
| 平成26年度第13回北海道公募公債 | 0.461 | 200,000 | 206,354 | 2024/12/26 |
| 第1回神奈川県公募公債 (20年) | 2.55 | 100,000 | 120,230 | 2024/6/20 |
| 第2回神奈川県公募公債 (20年) | 2.23 | 80,000 | 94,514 | 2024/9/20 |
| 第2回神奈川県公募公債 (30年) | 2.87 | 80,000 | 116,556 | 2036/6/20 |
| 第3回神奈川県公募公債 (20年) | 2.11 | 100,000 | 118,721 | 2025/6/20 |
| 第27回神奈川県公募公債 (20年) | 1.398 | 100,000 | 119,313 | 2034/9/20 |
| 第152回神奈川県公募公債 | 1.53 | 110,000 | 113,100 | 2018/3/20 |
| 第162回神奈川県公募公債 | 1.62 | 140,450 | 147,450 | 2019/6/20 |
| 第163回神奈川県公募公債 | 1.4 | 114,000 | 118,902 | 2019/6/20 |
| 第165回神奈川県公募公債 | 1.4 | 54,660 | 57,210 | 2019/9/20 |
| 第170回神奈川県公募公債 | 1.38 | 240,000 | 252,619 | 2020/3/20 |
| 第171回神奈川県公募公債 | 1.41 | 100,000 | 105,374 | 2020/3/20 |
| 第176回神奈川県公募公債 | 1.16 | 128,900 | 135,261 | 2020/9/18 |
| 第191回神奈川県公募公債 | 0.83 | 100,000 | 104,876 | 2022/6/20 |
| 第192回神奈川県公募公債 | 0.805 | 200,000 | 209,782 | 2022/9/20 |
| 第5回大阪府公募公債 (20年) | 2.16 | 100,000 | 126,762 | 2030/5/28 |
| 第11回大阪府公募公債 (20年) | 1.693 | 200,000 | 246,444 | 2033/9/27 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第89回大阪府公募公債 (5年) | 0.2 | 100,000 | 100,219 | 2017/12/27 |
| 第92回大阪府公募公債 (5年) | 0.14 | 100,000 | 100,131 | 2018/3/28 |
| 第306回大阪府公募公債 | 1.83 | 30,000 | 30,727 | 2017/9/27 |
| 第313回大阪府公募公債 | 1.66 | 100,000 | 103,120 | 2018/4/27 |
| 第314回大阪府公募公債 | 1.8 | 30,000 | 31,063 | 2018/5/29 |
| 第316回大阪府公募公債 | 1.85 | 100,000 | 103,951 | 2018/7/30 |
| 第325回大阪府公募公債 | 1.66 | 153,000 | 160,184 | 2019/4/26 |
| 第326回大阪府公募公債 | 1.66 | 10,000 | 10,482 | 2019/5/28 |
| 第331回大阪府公募公債 | 1.41 | 100,000 | 104,606 | 2019/10/29 |
| 第332回大阪府公募公債 | 1.58 | 71,600 | 75,386 | 2019/11/27 |
| 第334回大阪府公募公債 | 1.47 | 264,000 | 277,561 | 2020/1/28 |
| 第337回大阪府公募公債 | 1.44 | 110,000 | 115,897 | 2020/4/28 |
| 第343回大阪府公募公債 | 0.98 | 70,000 | 72,688 | 2020/10/28 |
| 第348回大阪府公募公債 | 1.32 | 10,000 | 10,605 | 2021/3/30 |
| 第351回大阪府公募公債 | 1.19 | 100,000 | 105,761 | 2021/7/28 |
| 第358回大阪府公募公債 | 0.97 | 56,000 | 58,844 | 2022/2/28 |
| 第359回大阪府公募公債 | 0.99 | 56,000 | 58,948 | 2022/3/29 |
| 第366回大阪府公募公債 | 0.79 | 156,000 | 163,112 | 2022/11/29 |
| 第386回大阪府公募公債 | 0.585 | 100,000 | 104,249 | 2024/7/30 |
| 第389回大阪府公募公債 | 0.53 | 100,000 | 103,915 | 2024/10/30 |
| 平成21年度第5回京都府公募公債 | 1.35 | 20,000 | 20,950 | 2019/12/24 |
| 平成22年度第5回京都府公募公債 | 1.26 | 110,000 | 116,176 | 2020/12/21 |
| 平成23年度第9回京都府公募公債 | 1.01 | 140,000 | 147,919 | 2022/3/16 |
| 平成24年度第3回京都府公募公債 (20年) | 1.63 | 200,000 | 244,844 | 2032/8/13 |
| 平成24年度第10回京都府公募公債 | 0.67 | 100,000 | 104,352 | 2023/3/22 |
| 平成25年度第1回京都府公募公債 | 0.58 | 100,000 | 103,752 | 2023/4/28 |
| 平成25年度第2回京都府公募公債 (15年) | 1.05 | 100,000 | 110,713 | 2028/4/28 |
| 第2回兵庫県公募公債 (30年) | 2.36 | 40,000 | 55,785 | 2040/3/19 |
| 第4回兵庫県公募公債 (15年) | 1.31 | 100,000 | 113,124 | 2027/12/24 |
| 第8回兵庫県公募公債 (15年) | 1.09 | 100,000 | 111,085 | 2029/4/16 |
| 第16回兵庫県公募公債 (20年) | 1.7 | 100,000 | 122,916 | 2032/11/19 |
| 平成20年度第5回兵庫県公募公債 | 1.93 | 50,000 | 51,984 | 2018/6/20 |
| 平成21年度第1回兵庫県公募公債 | 1.62 | 120,000 | 125,515 | 2019/4/23 |
| 平成21年度第3回兵庫県公募公債 | 1.62 | 190,000 | 198,975 | 2019/5/22 |
| 平成21年度第25回兵庫県公募公債 | 1.54 | 100,000 | 105,176 | 2019/11/20 |
| 平成20年度第1回静岡県公募公債 | 1.73 | 14,500 | 15,009 | 2018/5/28 |
| 平成20年度第2回静岡県公募公債 | 1.91 | 100,000 | 104,035 | 2018/6/26 |
| 平成20年度第4回静岡県公募公債 | 1.65 | 100,000 | 103,788 | 2018/8/28 |
| 平成20年度第5回静岡県公募公債 | 1.59 | 11,000 | 11,427 | 2018/10/30 |
| 平成21年度第4回静岡県公募公債 | 1.56 | 52,920 | 55,604 | 2019/8/20 |
| 平成22年度第1回静岡県公募公債 | 1.455 | 101,700 | 107,458 | 2020/4/20 |
| 平成22年度第6回静岡県公募公債 | 1.178 | 100,000 | 104,831 | 2020/7/22 |
| 平成22年度第8回静岡県公募公債 | 1.059 | 100,000 | 104,429 | 2020/8/25 |
| 平成23年度第6回静岡県公募公債 | 1.201 | 170,000 | 180,285 | 2021/7/23 |
| 平成24年度第10回静岡県公募公債 | 0.678 | 100,000 | 104,442 | 2023/3/22 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------|---|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 平成25年度第1回静岡県公募公債 | | 0.581 | 100,000 | 103,782 | 2023/4/19 |
| 平成25年度第5回静岡県公募公債 | | 0.926 | 100,000 | 106,325 | 2023/7/25 |
| 平成25年度第8回静岡県公募公債 | | 0.699 | 100,000 | 104,897 | 2023/10/24 |
| 平成25年度第9回静岡県公募公債 | | 0.679 | 300,000 | 314,514 | 2023/11/22 |
| 平成25年度第11回静岡県公募公債 (5年) | | 0.204 | 100,000 | 100,557 | 2019/3/26 |
| 平成26年度第5回静岡県公募公債 | | 0.61 | 100,000 | 104,574 | 2024/7/25 |
| 平成27年度第3回静岡県公募公債 | | 0.544 | 121,000 | 126,367 | 2025/5/21 |
| 平成23年度第7回愛知県公募公債 | | 1.11 | 100,000 | 105,595 | 2021/7/29 |
| 平成23年度第9回愛知県公募公債 | | 1.019 | 100,000 | 105,289 | 2021/9/30 |
| 平成23年度第14回愛知県公募公債 | | 1.006 | 100,000 | 105,381 | 2021/11/30 |
| 平成23年度第17回愛知県公募公債 | | 0.996 | 100,000 | 105,489 | 2022/1/31 |
| 平成24年度第13回愛知県公募公債 | | 0.772 | 100,000 | 104,819 | 2022/11/30 |
| 平成25年度第2回愛知県公募公債 | | 0.576 | 200,000 | 207,514 | 2023/4/26 |
| 平成25年度第9回愛知県公募公債 | | 0.849 | 240,000 | 253,852 | 2023/7/25 |
| 平成25年度第15回愛知県公募公債 | | 0.699 | 600,000 | 629,394 | 2023/10/25 |
| 平成26年度第9回愛知県公募公債 | | 0.576 | 100,000 | 104,385 | 2024/8/26 |
| 平成19年度第2回広島県公募公債 | | 1.94 | 46,050 | 47,202 | 2017/8/24 |
| 平成20年度第4回広島県公募公債 | | 1.73 | 60,000 | 62,601 | 2018/11/26 |
| 平成22年度第8回広島県公募公債 | | 1.33 | 26,650 | 28,340 | 2021/3/25 |
| 平成23年度第1回広島県公募公債 | | 1.19 | 100,000 | 105,867 | 2021/5/27 |
| 平成25年度第3回広島県公募公債 | | 0.8 | 100,000 | 105,589 | 2023/9/25 |
| 平成19年度第3回埼玉県公募公債 | | 1.94 | 39,100 | 40,081 | 2017/8/28 |
| 平成19年度第6回埼玉県公募公債 | | 1.63 | 100,000 | 102,786 | 2018/1/30 |
| 平成21年度第8回埼玉県公募公債 | | 1.3 | 100,000 | 104,633 | 2019/12/25 |
| 平成23年度第1回埼玉県公募公債 | | 1.37 | 100,000 | 106,688 | 2021/4/27 |
| 平成23年度第4回埼玉県公募公債 | | 1.2 | 100,000 | 106,057 | 2021/7/27 |
| 平成24年度第6回埼玉県公募公債 | | 0.801 | 100,000 | 104,938 | 2022/10/26 |
| 平成26年度第6回埼玉県公募公債 | | 0.554 | 150,000 | 156,303 | 2024/9/26 |
| 平成26年度第8回埼玉県公募公債 | | 0.335 | 100,000 | 102,491 | 2025/1/28 |
| 平成19年度第1回福岡県公募公債 (30年) | | 2.62 | 70,000 | 100,073 | 2037/9/18 |
| 平成20年度第1回福岡県公募公債 (30年) | | 2.28 | 80,000 | 109,944 | 2038/9/17 |
| 平成21年度第11回福岡県公募公債 | | 1.44 | 100,000 | 105,464 | 2020/2/25 |
| 平成22年度第3回福岡県公募公債 | | 1.11 | 100,000 | 104,734 | 2020/8/24 |
| 平成22年度第5回福岡県公募公債 | | 0.94 | 20,000 | 20,825 | 2020/10/28 |
| 平成24年度第11回福岡県公募公債 | | 0.8 | 550,000 | 578,946 | 2023/2/27 |
| 平成25年度第11回福岡県公募公債 | | 0.694 | 300,000 | 315,363 | 2024/2/26 |
| 第9回千葉県公募公債 (20年) | | 1.84 | 80,000 | 98,802 | 2030/10/11 |
| 平成20年度第2回千葉県公募公債 | | 1.8 | 90,000 | 93,280 | 2018/5/25 |
| 平成20年度第3回千葉県公募公債 | | 1.78 | 80,000 | 83,119 | 2018/7/25 |
| 平成20年度第5回千葉県公募公債 | | 1.6 | 80,000 | 83,026 | 2018/9/25 |
| 平成22年度第7回千葉県公募公債 | | 0.92 | 120,000 | 124,717 | 2020/10/23 |
| 平成22年度第11回千葉県公募公債 | | 1.26 | 80,000 | 84,612 | 2021/1/25 |
| 平成23年度第6回千葉県公募公債 | | 1.11 | 200,000 | 212,056 | 2021/12/24 |
| 平成23年度第9回千葉県公募公債 | | 1.0 | 20,000 | 21,130 | 2022/3/25 |
| 平成24年度第1回千葉県公募公債 | | 1.05 | 20,000 | 21,206 | 2022/4/25 |

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

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

| 銘柄 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------------------|---|-------|------------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 平成25年度第2回広島市公募公債 | | 0.72 | 100,000 | 105,210 | 2023/12/27 |
| 平成24年度第2回千葉市公募公債 | | 0.81 | 100,000 | 105,085 | 2022/11/22 |
| 平成26年度第2回千葉市公募公債 | | 0.505 | 100,000 | 103,826 | 2024/11/27 |
| 平成22年度第1回三重県公募公債 | | 1.056 | 87,050 | 91,089 | 2020/11/30 |
| 平成23年度第1回三重県公募公債 | | 1.021 | 98,410 | 103,787 | 2021/11/30 |
| 平成24年度第1回三重県公募公債 | | 0.801 | 140,660 | 147,602 | 2022/10/25 |
| 平成24年度第4回福井県公募公債 | | 0.46 | 100,000 | 102,988 | 2023/4/26 |
| 平成20年度第1回徳島県公募公債 | | 1.73 | 36,000 | 37,586 | 2018/11/28 |
| 平成24年度第1回徳島県公募公債 | | 0.68 | 100,000 | 104,495 | 2023/3/24 |
| 平成26年度第1回徳島県公募公債 | | 0.495 | 100,000 | 103,831 | 2024/11/28 |
| 平成20年度第1回岡山県公募公債 | | 1.56 | 48,700 | 50,691 | 2018/12/25 |
| 小 計 | | | 28,006,180 | 30,032,413 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | | |
| 第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.9 | 200,000 | 204,682 | 2017/7/31 |
| 第42回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.8 | 106,000 | 108,832 | 2017/10/31 |
| 第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.5 | 100,000 | 102,590 | 2018/1/31 |
| 第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.4 | 100,000 | 102,616 | 2018/3/23 |
| 第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.7 | 100,000 | 103,476 | 2018/5/30 |
| 第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.7 | 34,000 | 35,280 | 2018/7/31 |
| 第64回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.6 | 206,000 | 213,535 | 2018/8/29 |
| 第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.5 | 224,000 | 231,945 | 2018/9/28 |
| 第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.6 | 50,000 | 51,963 | 2018/10/31 |
| 第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.6 | 115,000 | 119,656 | 2018/11/28 |
| 第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.3 | 159,000 | 164,736 | 2019/2/27 |
| 第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.3 | 141,000 | 146,187 | 2019/3/19 |
| 第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.5 | 200,000 | 209,120 | 2019/5/31 |
| 第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 2.1 | 200,000 | 250,406 | 2029/5/31 |
| 第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.5 | 210,000 | 219,819 | 2019/6/28 |
| 第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.3 | 79,000 | 82,464 | 2019/9/30 |
| 第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 2.1 | 100,000 | 125,662 | 2029/9/28 |
| 第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 2.1 | 100,000 | 125,749 | 2029/10/31 |
| 第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.2 | 139,000 | 144,989 | 2019/12/27 |
| 第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.3 | 210,000 | 220,096 | 2020/1/31 |
| 第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 2.3 | 100,000 | 142,066 | 2040/2/29 |
| 第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.3 | 50,000 | 52,494 | 2020/3/19 |
| 第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 2.1 | 100,000 | 126,997 | 2030/4/30 |
| 第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.3 | 200,000 | 210,680 | 2020/6/30 |
| 第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.0 | 100,000 | 104,342 | 2020/9/30 |
| 第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.9 | 112,000 | 116,538 | 2020/11/30 |
| 第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.2 | 71,000 | 74,912 | 2020/12/28 |
| 第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 2.0 | 100,000 | 126,565 | 2031/1/31 |
| 第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.1 | 91,000 | 96,051 | 2021/5/31 |
| 第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.1 | 60,000 | 63,432 | 2021/7/30 |
| 第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.0 | 122,000 | 128,503 | 2021/8/31 |
| 第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.0 | 100,000 | 105,464 | 2021/10/29 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------------------|---|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.8 | 200,000 | 249,240 | 2031/10/31 |
| 第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.0 | 136,000 | 143,553 | 2021/11/30 |
| 第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.9 | 112,000 | 117,816 | 2022/2/28 |
| 第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.9 | 370,000 | 389,425 | 2022/3/18 |
| 第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.977 | 100,000 | 105,770 | 2022/4/28 |
| 第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.737 | 100,000 | 124,167 | 2032/4/30 |
| 第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.83 | 200,000 | 268,736 | 2042/5/30 |
| 第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.895 | 12,000 | 12,658 | 2022/6/30 |
| 第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.839 | 300,000 | 315,585 | 2022/7/29 |
| 第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.791 | 350,000 | 367,808 | 2022/10/31 |
| 第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.805 | 100,000 | 105,275 | 2022/11/30 |
| 第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.734 | 222,000 | 232,802 | 2022/12/28 |
| 第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.834 | 200,000 | 211,194 | 2023/1/31 |
| 第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.668 | 100,000 | 104,576 | 2023/3/17 |
| 第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.4 | 100,000 | 119,209 | 2033/4/28 |
| 第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.541 | 153,000 | 158,765 | 2023/4/28 |
| 第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.605 | 474,000 | 494,026 | 2023/5/31 |
| 第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.882 | 100,000 | 106,292 | 2023/6/30 |
| 第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.911 | 121,000 | 128,913 | 2023/7/31 |
| 第197回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.835 | 398,000 | 422,126 | 2023/8/31 |
| 第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.669 | 228,000 | 239,431 | 2023/11/30 |
| 第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.693 | 188,000 | 197,864 | 2023/12/28 |
| 第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.645 | 322,000 | 338,093 | 2024/3/29 |
| 第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.644 | 100,000 | 105,148 | 2024/6/28 |
| 第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.601 | 100,000 | 104,852 | 2024/7/31 |
| 第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.39 | 100,000 | 119,327 | 2034/8/31 |
| 第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.539 | 100,000 | 104,477 | 2024/10/31 |
| 第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.466 | 241,000 | 250,478 | 2024/12/27 |
| 第344回政府保証道路債券 | | 1.6 | 100,000 | 106,646 | 2020/7/15 |
| 第4回政府保証首都高速道路債券 | | 1.7 | 179,000 | 183,226 | 2017/9/25 |
| 第7回政府保証東日本高速道路債券 | | 1.9 | 34,000 | 34,838 | 2017/8/24 |
| 第13回政府保証東日本高速道路債券 | | 1.6 | 28,000 | 29,085 | 2018/10/19 |
| 第17回政府保証中日本高速道路債券 | | 1.7 | 100,000 | 102,315 | 2017/9/15 |
| 第20回政府保証中日本高速道路債券 | | 1.4 | 10,000 | 10,257 | 2018/3/16 |
| 第23回政府保証中日本高速道路債券 | | 1.5 | 90,000 | 93,139 | 2018/9/14 |
| 第1回政府保証地方公共団体金融機構債券 | | 1.5 | 280,000 | 292,913 | 2019/6/14 |
| 第2回政府保証地方公共団体金融機構債券 | | 1.4 | 25,000 | 26,104 | 2019/7/12 |
| 第3回政府保証地方公共団体金融機構債券 | | 1.5 | 200,000 | 209,750 | 2019/8/16 |
| 第3回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年) | | 0.4 | 200,000 | 201,394 | 2018/1/30 |
| 第4回政府保証公営企業債券(15年) | | 2.0 | 100,000 | 111,858 | 2022/4/22 |
| 第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券 | | 1.3 | 200,000 | 206,932 | 2019/1/22 |
| 第5回政府保証公営企業債券(15年) | | 2.2 | 100,000 | 113,551 | 2022/7/15 |
| 第7回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年) | | 0.25 | 300,000 | 301,743 | 2018/10/29 |
| 第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券 | | 1.4 | 100,000 | 104,062 | 2019/4/15 |
| 第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券 | | 1.5 | 148,000 | 154,689 | 2019/5/24 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-----------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 | |
| 第9回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年) | 0.32 | 100,000 | 100,906 | 2019/4/25 |
| 第10回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.3 | 100,000 | 104,965 | 2020/3/13 |
| 第12回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.3 | 200,000 | 210,410 | 2020/5/22 |
| 第16回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.0 | 100,000 | 104,298 | 2020/9/14 |
| 第18回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.9 | 101,000 | 105,069 | 2020/11/17 |
| 第22回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.3 | 15,000 | 15,939 | 2021/3/12 |
| 第25回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.2 | 100,000 | 106,125 | 2021/6/14 |
| 第29回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.0 | 21,000 | 22,141 | 2021/10/18 |
| 第31回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.1 | 50,000 | 53,075 | 2021/12/14 |
| 第37回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.895 | 100,000 | 105,511 | 2022/6/17 |
| 第39回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.801 | 100,000 | 105,012 | 2022/8/15 |
| 第45回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.815 | 354,000 | 373,516 | 2023/2/17 |
| 第46回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.668 | 17,000 | 17,777 | 2023/3/17 |
| 第47回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.541 | 345,000 | 357,965 | 2023/4/21 |
| 第48回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.605 | 36,000 | 37,526 | 2023/5/16 |
| 第50回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.911 | 168,000 | 178,914 | 2023/7/14 |
| 第51回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.835 | 150,000 | 159,033 | 2023/8/14 |
| 第55回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.693 | 160,000 | 168,364 | 2023/12/18 |
| 第58回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.645 | 200,000 | 210,030 | 2024/3/15 |
| 第62回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.601 | 100,000 | 104,828 | 2024/7/16 |
| 第63回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.556 | 200,000 | 209,014 | 2024/8/16 |
| 第879回政府保証公営企業債券 | 1.7 | 102,000 | 104,380 | 2017/9/19 |
| 第883回政府保証公営企業債券 | 1.4 | 100,000 | 102,589 | 2018/3/19 |
| 第884回政府保証公営企業債券 | 1.4 | 114,000 | 117,073 | 2018/4/17 |
| 第2回政府保証公営企業債券(15年) | 2.1 | 100,000 | 110,341 | 2021/4/16 |
| 第5回政府保証日本政策金融公庫債券 | 1.3 | 123,000 | 128,334 | 2019/9/17 |
| 第23回政府保証日本政策金融公庫債券 | 0.734 | 134,000 | 140,488 | 2022/12/16 |
| 第25回政府保証日本政策金融公庫債券 | 0.815 | 100,000 | 105,526 | 2023/2/24 |
| 第26回政府保証日本政策金融公庫債券 | 0.911 | 484,000 | 515,503 | 2023/7/19 |
| 第191回政府保証中小企業債券 | 1.7 | 211,000 | 215,884 | 2017/9/15 |
| 第16回政府保証民間都市開発債券 | 0.699 | 197,000 | 207,173 | 2023/10/20 |
| 第21回政府保証国民生活債券 | 1.5 | 2,000 | 2,048 | 2017/12/18 |
| 第2回政府保証新関西国際空港債券 | 0.882 | 202,000 | 214,833 | 2023/6/27 |
| 第5回政府保証日本政策投資銀行 | 1.4 | 50,000 | 52,031 | 2019/4/15 |
| 第7回政府保証日本政策投資銀行 | 1.4 | 100,000 | 105,252 | 2020/2/17 |
| 第11回政府保証日本政策投資銀行 | 1.0 | 179,000 | 188,556 | 2021/9/14 |
| 第17回政府保証日本政策投資銀行 | 0.257 | 200,000 | 201,222 | 2018/11/9 |
| 第22回政府保証日本政策投資銀行 | 0.693 | 20,000 | 21,045 | 2023/12/18 |
| 第27回政府保証日本政策投資銀行 | 0.11 | 200,000 | 200,988 | 2021/2/12 |
| 第53回政府保証関西国際空港債券 | 1.5 | 151,000 | 154,871 | 2018/1/24 |
| 第11回政府保証西日本高速道路債券 | 1.7 | 31,000 | 31,821 | 2017/11/28 |
| 第46回日本政策投資銀行債券(財投機関債) | 1.69 | 50,000 | 51,558 | 2018/3/20 |
| 第7回道路債券(財投機関債) | 2.7 | 100,000 | 116,309 | 2022/6/20 |
| 第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.45 | 20,000 | 24,525 | 2026/3/19 |
| 第9回道路債券(財投機関債) | 2.9 | 100,000 | 140,278 | 2032/5/20 |

| 銘柄 | 利 率 | 当 期 末 | | |
|-------------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 | |
| 第13回道路債券(財投機関債) | 2.28 | 200,000 | 228,644 | 2022/9/20 |
| 第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.87 | 30,000 | 47,873 | 2046/12/20 |
| 第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.75 | 100,000 | 156,430 | 2047/3/20 |
| 第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.67 | 130,000 | 200,379 | 2047/3/20 |
| 第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.39 | 60,000 | 74,791 | 2027/7/20 |
| 第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 1.82 | 200,000 | 204,994 | 2017/9/20 |
| 第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.34 | 100,000 | 124,568 | 2027/10/20 |
| 第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 1.61 | 100,000 | 102,956 | 2018/3/20 |
| 第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.42 | 300,000 | 379,848 | 2028/6/20 |
| 第42回道路債券(財投機関債) | 2.22 | 130,000 | 154,186 | 2025/3/21 |
| 第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 1.63 | 100,000 | 104,169 | 2018/12/20 |
| 第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.41 | 150,000 | 191,812 | 2029/4/20 |
| 第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.14 | 50,000 | 62,980 | 2030/5/10 |
| 第71回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 1.17 | 100,000 | 105,862 | 2021/6/18 |
| 第73回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 1.14 | 100,000 | 105,709 | 2021/6/18 |
| 第78回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 1.08 | 100,000 | 105,907 | 2021/12/20 |
| 第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 1.9 | 50,000 | 62,296 | 2032/3/19 |
| 第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 1.711 | 100,000 | 121,765 | 2032/6/18 |
| 第92回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 0.834 | 110,000 | 115,425 | 2022/6/20 |
| 第96回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 0.796 | 300,000 | 314,700 | 2022/9/20 |
| 第100回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 0.784 | 100,000 | 104,972 | 2022/12/20 |
| 第101回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 0.781 | 100,000 | 104,952 | 2022/12/20 |
| 第110回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 0.94 | 300,000 | 319,131 | 2023/6/20 |
| 第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 0.85 | 200,000 | 211,478 | 2023/6/20 |
| 第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 0.77 | 100,000 | 105,416 | 2023/12/20 |
| 第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 1.974 | 100,000 | 140,439 | 2055/3/19 |
| 第1回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.648 | 100,000 | 105,090 | 2019/6/28 |
| 第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 2.266 | 50,000 | 63,094 | 2029/6/28 |
| 第2回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.406 | 80,000 | 83,538 | 2019/7/26 |
| 第3回公営企業債券(20年)(財投機関債) | 1.03 | 20,000 | 21,363 | 2023/3/22 |
| 第3回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債) | 1.176 | 100,000 | 111,897 | 2029/1/26 |
| 第6回公営企業債券(20年)(財投機関債) | 2.03 | 100,000 | 114,961 | 2023/12/20 |
| 第9回公営企業債券(20年)(財投機関債) | 2.33 | 50,000 | 59,351 | 2024/9/24 |
| 第12回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 2.092 | 100,000 | 125,913 | 2030/12/27 |
| 第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 2.187 | 80,000 | 102,351 | 2031/4/28 |
| 第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.164 | 100,000 | 104,938 | 2020/9/28 |
| 第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 1.846 | 80,000 | 98,595 | 2031/8/28 |
| 第17回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 1.87 | 100,000 | 123,616 | 2031/9/26 |
| 第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.274 | 50,000 | 52,852 | 2020/12/28 |
| 第20回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.28 | 100,000 | 105,846 | 2021/1/28 |
| 第22回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 1.687 | 200,000 | 243,238 | 2032/6/28 |
| F23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.075 | 100,000 | 102,159 | 2018/5/29 |
| 第23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.418 | 100,000 | 106,877 | 2021/4/28 |
| 第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 1.68 | 300,000 | 364,578 | 2032/7/28 |
| F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.681 | 70,000 | 77,872 | 2023/3/17 |

| 銘柄 | 利 率 | 当 期 末 | | |
|------------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 | |
| 第27回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.034 | 100,000 | 105,334 | 2021/8/27 |
| 第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 1.785 | 50,000 | 61,772 | 2033/1/28 |
| 第28回公営企業債券(財投機関債) | 1.89 | 100,000 | 102,734 | 2017/10/25 |
| 第35回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.006 | 200,000 | 211,680 | 2022/4/28 |
| 第42回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 0.801 | 100,000 | 105,039 | 2022/11/28 |
| 第44回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 0.791 | 200,000 | 210,198 | 2023/1/27 |
| 第46回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 0.678 | 100,000 | 104,417 | 2023/3/28 |
| 第49回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 0.887 | 200,000 | 212,040 | 2023/6/28 |
| 第50回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 0.922 | 300,000 | 319,026 | 2023/7/28 |
| F89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.602 | 300,000 | 348,126 | 2027/8/20 |
| F110回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 0.562 | 100,000 | 101,590 | 2019/4/25 |
| F123回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.6 | 100,000 | 118,194 | 2030/3/19 |
| F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.546 | 100,000 | 118,743 | 2031/7/30 |
| F147回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.291 | 150,000 | 168,373 | 2027/3/19 |
| F226回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.096 | 100,000 | 110,914 | 2029/2/28 |
| 第10回首都高速道路 | 0.336 | 400,000 | 401,884 | 2017/9/20 |
| 第13回首都高速道路(財投機関債) | 0.223 | 100,000 | 100,681 | 2019/9/20 |
| 第7回阪神高速道路債券(財投機関債) | 2.18 | 100,000 | 118,254 | 2025/3/21 |
| 第14回阪神高速道路 | 0.1 | 300,000 | 300,375 | 2019/12/20 |
| 第10回日本政策金融公庫(財投機関債) | 2.167 | 80,000 | 100,969 | 2030/3/19 |
| 第15回日本政策金融公庫(財投機関債) | 1.911 | 80,000 | 98,762 | 2030/10/29 |
| 第21回都市再生債券(財投機関債) | 1.72 | 100,000 | 103,996 | 2018/9/20 |
| 第68回都市再生債券(財投機関債) | 0.854 | 100,000 | 105,269 | 2022/9/20 |
| 第100回都市再生債券(財投機関債) | 0.569 | 100,000 | 104,184 | 2024/11/20 |
| 第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.13 | 26,476 | 28,389 | 2042/5/10 |
| 第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.08 | 22,792 | 24,547 | 2037/11/10 |
| 第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.19 | 28,211 | 30,404 | 2042/6/10 |
| 第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.27 | 23,341 | 25,355 | 2037/11/10 |
| 第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.29 | 27,832 | 30,105 | 2042/8/10 |
| 第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 1.76 | 19,935 | 21,068 | 2036/11/10 |
| 第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.26 | 20,909 | 22,542 | 2037/5/10 |
| 第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.13 | 27,579 | 29,673 | 2042/10/10 |
| 第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.94 | 24,467 | 26,167 | 2038/11/10 |
| 第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.25 | 20,973 | 22,595 | 2037/5/10 |
| 第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.67 | 15,357 | 15,883 | 2037/10/10 |
| 第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.99 | 28,382 | 30,398 | 2042/12/10 |
| 第8回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 1.73 | 70,000 | 71,650 | 2017/9/20 |
| 第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.52 | 14,945 | 15,377 | 2037/12/10 |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.19 | 21,625 | 23,302 | 2037/5/10 |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.24 | 26,057 | 28,002 | 2039/5/10 |
| 第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.43 | 31,898 | 32,856 | 2038/2/10 |
| 第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.15 | 22,330 | 24,061 | 2037/5/10 |
| 第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.16 | 31,322 | 33,746 | 2043/5/10 |
| 第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.7 | 17,578 | 18,292 | 2039/1/10 |
| 第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.7 | 31,268 | 32,657 | 2032/5/10 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|---------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 | |
| 第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.64 | 33,743 | 35,326 | 2032/11/10 |
| 第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.71 | 34,640 | 36,368 | 2032/11/10 |
| 第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.57 | 103,716 | 108,350 | 2032/11/10 |
| 第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.8 | 19,211 | 20,124 | 2039/6/10 |
| 第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.12 | 20,163 | 21,359 | 2039/7/10 |
| 第21回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 1.92 | 100,000 | 104,468 | 2018/9/20 |
| 第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.67 | 24,293 | 25,519 | 2040/5/10 |
| 第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.7 | 53,618 | 56,605 | 2040/6/10 |
| 第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.69 | 29,093 | 30,730 | 2040/7/10 |
| 第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.88 | 49,627 | 53,407 | 2045/2/10 |
| 第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.87 | 54,543 | 58,581 | 2045/4/10 |
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.81 | 56,528 | 60,561 | 2045/5/10 |
| 第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.88 | 27,506 | 29,274 | 2040/12/10 |
| 第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.61 | 59,344 | 63,107 | 2045/7/10 |
| 第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.84 | 26,062 | 27,656 | 2041/2/10 |
| 第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.36 | 65,596 | 69,098 | 2045/9/10 |
| 第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.09 | 28,071 | 30,162 | 2041/4/10 |
| 第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.34 | 26,132 | 28,331 | 2041/5/10 |
| 第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.6 | 71,444 | 76,374 | 2045/12/10 |
| 第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.77 | 71,660 | 77,275 | 2046/1/10 |
| 第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.79 | 66,485 | 71,562 | 2046/2/10 |
| 第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.92 | 63,447 | 68,618 | 2046/4/10 |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.89 | 192,858 | 208,768 | 2046/5/10 |
| 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.76 | 64,274 | 69,136 | 2046/6/10 |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.67 | 64,107 | 68,668 | 2046/7/10 |
| 第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.21 | 25,898 | 28,036 | 2042/2/10 |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.64 | 68,941 | 73,882 | 2046/8/10 |
| 第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.51 | 71,981 | 76,754 | 2046/9/10 |
| 第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.48 | 73,005 | 77,763 | 2046/10/10 |
| 第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.42 | 76,026 | 80,855 | 2047/1/10 |
| 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.44 | 229,284 | 244,065 | 2047/2/10 |
| 第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.44 | 76,918 | 81,909 | 2047/4/10 |
| 第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.34 | 77,502 | 82,101 | 2047/5/10 |
| 第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.21 | 78,949 | 83,290 | 2047/7/10 |
| 第62回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 2.13 | 50,000 | 63,146 | 2030/12/13 |
| 第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.11 | 79,408 | 83,325 | 2047/8/10 |
| 第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.12 | 81,224 | 85,318 | 2047/11/10 |
| 第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.25 | 81,265 | 85,946 | 2048/3/10 |
| 第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.32 | 84,702 | 90,108 | 2048/7/10 |
| 第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 2.066 | 80,000 | 101,050 | 2031/6/13 |
| 第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.21 | 240,858 | 254,290 | 2048/9/10 |
| 第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 1.751 | 30,000 | 34,833 | 2026/6/19 |
| 第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.08 | 83,286 | 87,347 | 2048/11/10 |
| 第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.07 | 172,376 | 180,820 | 2049/1/10 |
| 第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.07 | 85,891 | 90,232 | 2049/2/10 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------------|---|-------|------------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.04 | 87,869 | 92,178 | 2049/4/10 |
| 第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.01 | 176,722 | 185,105 | 2049/5/10 |
| 第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.02 | 179,296 | 187,957 | 2049/6/10 |
| 第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 1.863 | 100,000 | 123,667 | 2031/11/18 |
| 第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.95 | 92,290 | 96,385 | 2049/10/10 |
| 第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.87 | 277,212 | 288,250 | 2049/11/10 |
| 第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.84 | 187,136 | 194,220 | 2049/12/10 |
| 第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.74 | 93,706 | 96,615 | 2050/1/10 |
| 第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.6 | 188,382 | 192,366 | 2050/2/10 |
| 第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.9 | 289,818 | 302,445 | 2050/7/10 |
| 第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.88 | 193,764 | 201,933 | 2050/8/10 |
| 第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 1.892 | 100,000 | 124,488 | 2032/4/16 |
| 第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 1.441 | 200,000 | 226,976 | 2027/3/19 |
| 第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 0.86 | 490,020 | 510,850 | 2050/12/10 |
| 第105回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 1.472 | 100,000 | 114,067 | 2027/6/18 |
| 第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 2.227 | 130,000 | 179,354 | 2042/9/19 |
| 第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 1.801 | 100,000 | 123,405 | 2032/9/17 |
| 第144回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 0.748 | 300,000 | 315,747 | 2023/12/20 |
| 第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債) | | 2.04 | 50,000 | 58,697 | 2025/6/20 |
| 第7回国際協力機構債券(財投機関債) | | 1.991 | 70,000 | 88,039 | 2031/6/13 |
| 第11回国際協力機構債券(財投機関債) | | 1.14 | 30,000 | 31,855 | 2021/12/20 |
| 第18回東日本高速道路 | | 0.387 | 100,000 | 100,546 | 2017/9/20 |
| 第21回東日本高速道路 | | 0.58 | 100,000 | 101,180 | 2018/6/20 |
| 第22回東日本高速道路 | | 0.401 | 100,000 | 100,803 | 2018/6/20 |
| 第28回東日本高速道路 | | 0.248 | 100,000 | 100,767 | 2019/12/20 |
| 第3回中日本高速道路 | | 1.92 | 300,000 | 307,779 | 2017/9/20 |
| 第21回中日本高速道路 | | 0.592 | 100,000 | 100,818 | 2017/9/20 |
| 第33回中日本高速道路 | | 1.084 | 50,000 | 52,829 | 2021/9/17 |
| 第42回中日本高速道路 | | 0.942 | 100,000 | 105,358 | 2022/3/18 |
| 第43回中日本高速道路 | | 0.362 | 100,000 | 100,521 | 2017/9/20 |
| 第45回中日本高速道路 | | 0.904 | 300,000 | 316,758 | 2022/9/20 |
| 第46回中日本高速道路 | | 0.351 | 200,000 | 200,950 | 2017/9/20 |
| 第59回中日本高速道路 | | 0.309 | 100,000 | 101,590 | 2021/12/20 |
| 第18回西日本高速道路 | | 0.893 | 100,000 | 105,873 | 2023/3/20 |
| 第20回西日本高速道路 | | 0.759 | 100,000 | 105,239 | 2023/9/20 |
| 第21回西日本高速道路 | | 0.754 | 400,000 | 421,180 | 2023/12/20 |
| 第132回福岡北九州高速道路債券 | | 0.704 | 100,000 | 104,909 | 2024/3/19 |
| 第21回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債) | | 1.86 | 200,000 | 208,652 | 2018/9/20 |
| 第43回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債) | | 1.026 | 100,000 | 105,348 | 2021/9/17 |
| 第64回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債) | | 0.193 | 100,000 | 100,365 | 2018/6/20 |
| 第5回東京都住宅供給公社債券 | | 2.02 | 100,000 | 102,579 | 2017/9/20 |
| 小 | 計 | | 36,130,167 | 39,037,654 | |
| 金融債券 | | | | | |
| い第745号商工債券 | | 0.35 | 100,000 | 100,388 | 2017/6/27 |
| い第773号商工債券 | | 0.2 | 100,000 | 100,562 | 2019/10/25 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|---------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 金融債券 | % | 千円 | 千円 | |
| い第775号商工債券 | 0.2 | 400,000 | 402,248 | 2019/12/27 |
| い第776号商工債券 | 0.17 | 100,000 | 100,471 | 2020/1/27 |
| い第752号農林債券 | 0.3 | 150,000 | 150,742 | 2018/1/26 |
| い第760号農林債券 | 0.4 | 400,000 | 403,372 | 2018/9/27 |
| い第761号農林債券 | 0.3 | 250,000 | 251,562 | 2018/10/26 |
| い第763号農林債券 | 0.3 | 340,000 | 342,227 | 2018/12/27 |
| い第765号農林債券 | 0.3 | 100,000 | 100,698 | 2019/2/27 |
| い第769号農林債券 | 0.3 | 100,000 | 100,811 | 2019/6/27 |
| い第774号農林債券 | 0.24 | 100,000 | 100,659 | 2019/11/27 |
| い第780号農林債券 | 0.28 | 300,000 | 302,796 | 2020/5/27 |
| 第271回信金中金債 | 0.35 | 100,000 | 100,388 | 2017/6/27 |
| 第279回信金中金債 | 0.25 | 300,000 | 301,293 | 2018/2/27 |
| 第286回信金中金債 | 0.35 | 100,000 | 100,748 | 2018/9/27 |
| 第288回信金中金債 | 0.3 | 200,000 | 201,346 | 2018/11/27 |
| 第291回信金中金債 | 0.25 | 100,000 | 100,586 | 2019/2/27 |
| 第293回信金中金債 | 0.25 | 100,000 | 100,640 | 2019/4/26 |
| 第304回信金中金債 | 0.225 | 200,000 | 201,466 | 2020/3/27 |
| 第8号商工債券(10年) | 1.66 | 100,000 | 104,221 | 2018/12/20 |
| 第11号商工債券(10年) | 0.66 | 100,000 | 104,338 | 2024/9/20 |
| 第179号商工債券(3年) | 0.14 | 300,000 | 300,657 | 2017/12/27 |
| 第184号商工債券(3年) | 0.15 | 300,000 | 300,762 | 2018/5/25 |
| 小 計 | | 4,340,000 | 4,372,982 | |
| 普通社債券 | | | | |
| 第459回東京電力 | 2.7 | 80,000 | 84,946 | 2019/1/29 |
| 第532回東京電力 | 1.75 | 120,000 | 122,343 | 2017/9/28 |
| 第534回東京電力 | 2.055 | 100,000 | 105,307 | 2019/10/29 |
| 第536回東京電力 | 1.672 | 100,000 | 102,283 | 2018/1/29 |
| 第544回東京電力 | 1.976 | 100,000 | 103,434 | 2018/6/25 |
| 第549回東京電力 | 1.699 | 150,000 | 154,881 | 2018/10/17 |
| 第559回東京電力 | 1.377 | 60,000 | 61,788 | 2019/10/29 |
| 第563回東京電力 | 1.39 | 100,000 | 103,512 | 2020/5/28 |
| 第567回東京電力 | 1.958 | 100,000 | 108,825 | 2030/7/29 |
| 第568回東京電力 | 1.155 | 100,000 | 102,730 | 2020/9/8 |
| 第490回中部電力 | 1.444 | 70,000 | 73,003 | 2019/7/25 |
| 第499回中部電力 | 1.194 | 50,000 | 53,392 | 2023/6/23 |
| 第500回中部電力 | 0.875 | 100,000 | 104,921 | 2024/5/24 |
| 第448回関西電力 | 2.16 | 100,000 | 104,233 | 2018/6/20 |
| 第456回関西電力 | 2.01 | 100,000 | 102,331 | 2017/7/25 |
| 第472回関西電力 | 1.79 | 100,000 | 104,096 | 2018/11/22 |
| 第473回関西電力 | 1.665 | 100,000 | 104,322 | 2019/4/25 |
| 第478回関西電力 | 1.448 | 200,000 | 209,038 | 2020/1/24 |
| 第485回関西電力 | 1.285 | 100,000 | 104,733 | 2020/12/18 |
| 第374回中国電力 | 0.814 | 100,000 | 102,595 | 2020/2/25 |
| 第379回中国電力 | 0.619 | 100,000 | 102,153 | 2021/1/25 |
| 第382回中国電力 | 0.517 | 100,000 | 101,759 | 2021/5/25 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第288回北陸電力 | 1.89 | 100,000 | 102,720 | 2017/10/25 |
| 第303回北陸電力 | 0.756 | 100,000 | 102,040 | 2019/6/25 |
| 第448回東北電力 | 1.608 | 100,000 | 104,523 | 2019/5/24 |
| 第456回東北電力 | 1.176 | 100,000 | 104,320 | 2020/11/25 |
| 第473回東北電力 | 0.597 | 100,000 | 101,846 | 2021/4/23 |
| 第245回四国電力 | 2.0 | 100,000 | 109,374 | 2021/6/25 |
| 第400回九州電力 | 1.777 | 100,000 | 106,090 | 2020/4/24 |
| 第408回九州電力 | 1.672 | 100,000 | 104,662 | 2019/6/25 |
| 第422回九州電力 | 1.164 | 100,000 | 103,770 | 2020/6/25 |
| 第423回九州電力 | 0.959 | 100,000 | 102,644 | 2019/9/25 |
| 第429回九州電力 | 0.909 | 100,000 | 104,039 | 2024/9/25 |
| 第430回九州電力 | 0.54 | 100,000 | 101,369 | 2021/10/25 |
| 第261回北海道電力 | 2.775 | 24,000 | 24,981 | 2017/11/24 |
| 第310回北海道電力 | 1.286 | 50,000 | 52,379 | 2020/12/25 |
| 第315回北海道電力 | 0.82 | 100,000 | 101,334 | 2018/4/25 |
| 第316回北海道電力 | 1.164 | 100,000 | 103,854 | 2020/6/25 |
| 第319回北海道電力 | 0.514 | 200,000 | 202,100 | 2019/9/25 |
| 第19回沖縄電力 | 1.452 | 80,000 | 84,532 | 2020/4/24 |
| 第344回東京交通債券 | 1.67 | 100,000 | 110,709 | 2023/2/17 |
| 第347回東京交通債券 | 2.05 | 100,000 | 115,310 | 2024/3/8 |
| 第25回関西国際空港 | 1.361 | 400,000 | 421,824 | 2020/6/19 |
| 第38回関西国際空港 | 1.112 | 50,000 | 53,043 | 2021/12/20 |
| 第10回成田国際空港 | 1.094 | 160,000 | 169,137 | 2021/9/17 |
| 第11回成田国際空港 | 1.067 | 100,000 | 106,007 | 2022/2/18 |
| 第12回成田国際空港 | 0.879 | 100,000 | 105,427 | 2022/9/20 |
| 第13回成田国際空港 | 0.802 | 100,000 | 105,164 | 2023/2/8 |
| 第17回成田国際空港 | 0.489 | 100,000 | 103,325 | 2025/2/20 |
| 第3回セブン&アイ・ホールディングス | 1.94 | 100,000 | 104,029 | 2018/6/20 |
| 第8回セブン&アイ・ホールディングス | 0.383 | 100,000 | 100,973 | 2019/6/20 |
| 第11回セブン&アイ・ホールディングス | 0.514 | 300,000 | 307,149 | 2022/6/20 |
| 第3回富士フイルムホールディングス | 0.882 | 100,000 | 105,160 | 2022/12/2 |
| 第19回豊田自動織機 | 1.109 | 100,000 | 105,453 | 2021/9/17 |
| 第10回小松製作所 | 0.275 | 100,000 | 100,541 | 2019/6/20 |
| 第1回日本電産 | 0.386 | 100,000 | 100,474 | 2017/9/20 |
| 第12回パナソニック | 0.387 | 300,000 | 303,033 | 2020/3/19 |
| 第1回B号日本生命2011基金 | 1.12 | 400,000 | 404,592 | 2017/8/5 |
| 第1回日本生命2012基金 | 0.87 | 100,000 | 101,584 | 2018/8/3 |
| 第1回明治安田生命2014基金 | 0.51 | 100,000 | 101,082 | 2019/8/7 |
| 第1回日本生命2015基金 | 0.406 | 100,000 | 100,811 | 2019/8/5 |
| 第53回日産自動車 | 1.744 | 100,000 | 106,558 | 2020/4/28 |
| 第5回凸版印刷 | 1.397 | 100,000 | 105,935 | 2020/12/16 |
| 第3回大日本印刷 | 1.358 | 100,000 | 105,897 | 2020/12/18 |
| 第78回三菱商事 | 1.155 | 100,000 | 105,825 | 2022/3/9 |
| 第7回みずほコーポレート銀行(同順位特約付) | 2.08 | 100,000 | 102,493 | 2017/7/27 |
| 第7回みずほコーポレート銀行(劣後特約付) | 2.5 | 300,000 | 321,141 | 2019/6/3 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|---------------------------|---|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 第8回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付) | | 1.62 | 100,000 | 107,406 | 2021/10/29 |
| 第9回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付) | | 2.2 | 100,000 | 117,435 | 2026/10/30 |
| 第10回みずほコーポレート銀行 | | 1.945 | 400,000 | 411,264 | 2017/10/27 |
| 第30回みずほコーポレート銀行 | | 0.34 | 100,000 | 100,383 | 2017/7/25 |
| 第31回みずほコーポレート銀行 | | 0.33 | 200,000 | 200,910 | 2017/10/25 |
| 第32回みずほコーポレート銀行 | | 0.27 | 800,000 | 803,312 | 2018/1/24 |
| 第33回みずほコーポレート銀行 | | 0.41 | 600,000 | 604,272 | 2018/4/20 |
| 第7回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付) | | 2.11 | 400,000 | 428,364 | 2019/12/20 |
| 第9回三菱東京UFJ銀行 | | 2.69 | 100,000 | 110,062 | 2020/2/27 |
| 第12回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付) | | 2.16 | 100,000 | 102,523 | 2017/7/28 |
| 第28回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付) | | 1.56 | 100,000 | 106,455 | 2021/1/20 |
| 第30回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付) | | 2.46 | 100,000 | 127,012 | 2031/1/20 |
| 第93回三菱東京UFJ銀行 | | 1.985 | 200,000 | 205,632 | 2017/10/17 |
| 第124回三菱東京UFJ銀行 | | 1.51 | 100,000 | 107,020 | 2021/4/16 |
| 第6回りそな銀行 (劣後特約付) | | 2.084 | 400,000 | 428,204 | 2020/3/4 |
| 第1回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位) | | 0.345 | 100,000 | 100,352 | 2017/6/7 |
| 第2回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位) | | 0.26 | 100,000 | 100,391 | 2017/12/20 |
| 第5回三菱UFJ信託銀行 (特定社債間限定同順位) | | 0.285 | 200,000 | 201,270 | 2018/11/28 |
| 第6回住友信託銀行 (劣後特約付) | | 2.78 | 100,000 | 122,963 | 2026/4/27 |
| 第13回住友信託銀行 (劣後特約付) | | 2.341 | 100,000 | 118,768 | 2026/6/15 |
| 第6回セブン銀行 | | 0.398 | 100,000 | 100,439 | 2017/6/20 |
| 第22回三井住友銀行 (劣後特約付) | | 1.43 | 100,000 | 105,443 | 2020/9/28 |
| 第23回三井住友銀行 (劣後特約付) | | 1.61 | 100,000 | 106,536 | 2020/12/17 |
| 第25回三井住友銀行 (劣後特約付) | | 2.21 | 200,000 | 236,008 | 2026/6/1 |
| 第57回三井住友銀行 | | 0.28 | 200,000 | 200,790 | 2017/10/20 |
| 第5回みずほ銀行 (劣後特約付) | | 2.49 | 100,000 | 119,382 | 2026/1/30 |
| 第9回みずほ銀行 (劣後特約付) | | 2.52 | 100,000 | 121,555 | 2027/4/27 |
| 第18回みずほ銀行 (劣後特約付) | | 2.14 | 100,000 | 116,686 | 2026/9/11 |
| 第8回芙蓉総合リース | | 0.318 | 100,000 | 100,702 | 2019/7/30 |
| 第11回芙蓉総合リース | | 0.21 | 100,000 | 99,990 | 2021/5/7 |
| 第4回興銀リース | | 0.36 | 100,000 | 100,788 | 2019/5/23 |
| 第5回興銀リース | | 0.272 | 100,000 | 100,581 | 2019/12/5 |
| 第28回日産フィナンシャルサービス | | 0.253 | 100,000 | 100,446 | 2019/6/20 |
| 第10回東京センチュリーリース | | 0.298 | 100,000 | 100,666 | 2019/11/21 |
| 第15回東京センチュリーリース | | 0.11 | 100,000 | 100,031 | 2019/4/12 |
| 第29回ホンダファイナンス | | 0.428 | 100,000 | 101,280 | 2021/3/19 |
| 第62回トヨタファイナンス | | 0.203 | 100,000 | 100,496 | 2019/12/20 |
| 第69回トヨタファイナンス | | 0.02 | 200,000 | 199,982 | 2019/4/26 |
| 第47回日立キャピタル | | 0.874 | 100,000 | 104,591 | 2023/3/20 |
| 第52回日立キャピタル | | 0.508 | 200,000 | 203,656 | 2021/6/18 |
| 第56回日立キャピタル | | 0.197 | 100,000 | 100,390 | 2019/12/20 |
| 第9回三井住友ファイナンス&リース | | 0.518 | 200,000 | 203,426 | 2021/1/29 |
| 第14回三井住友ファイナンス&リース | | 0.321 | 200,000 | 201,674 | 2020/10/30 |
| 第36回三菱UFJリース | | 0.355 | 100,000 | 100,979 | 2022/1/21 |
| 第37回三菱UFJリース | | 0.07 | 100,000 | 99,959 | 2019/2/21 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|--------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第38回三菱UFJリース | 0.16 | 200,000 | 200,128 | 2021/4/21 |
| 第27回野村ホールディングス | 2.107 | 100,000 | 115,205 | 2025/9/24 |
| 第39回野村ホールディングス | 0.853 | 100,000 | 101,372 | 2018/2/26 |
| 第43回野村ホールディングス | 0.454 | 300,000 | 302,874 | 2019/2/25 |
| 第48回野村ホールディングス | 0.245 | 100,000 | 100,317 | 2018/6/8 |
| 第49回野村ホールディングス | 0.437 | 100,000 | 101,192 | 2020/6/10 |
| 第2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回 | 1.98 | 100,000 | 103,754 | 2018/6/20 |
| 第98回三菱地所 | 1.165 | 100,000 | 104,297 | 2020/6/19 |
| 第105回三菱地所 | 1.178 | 100,000 | 105,998 | 2022/3/23 |
| 第112回三菱地所 | 0.577 | 200,000 | 204,178 | 2020/12/25 |
| 第116回三菱地所 | 0.643 | 100,000 | 103,301 | 2024/9/19 |
| 第11回エヌ・ティ・ティ都市開発 | 1.12 | 100,000 | 105,306 | 2021/9/17 |
| 第17回エヌ・ティ・ティ都市開発 | 0.61 | 100,000 | 102,948 | 2024/9/20 |
| 第15回東日本旅客鉄道 | 2.65 | 100,000 | 111,052 | 2020/8/25 |
| 第26回東日本旅客鉄道 | 1.19 | 100,000 | 107,436 | 2022/12/20 |
| 第29回東日本旅客鉄道 | 2.01 | 200,000 | 228,408 | 2023/9/20 |
| 第60回東日本旅客鉄道 | 1.449 | 100,000 | 104,469 | 2019/7/24 |
| 第62回東日本旅客鉄道 | 1.424 | 100,000 | 104,632 | 2019/9/27 |
| 第79回東日本旅客鉄道 | 1.131 | 100,000 | 105,774 | 2021/9/29 |
| 第83回東日本旅客鉄道 | 1.633 | 100,000 | 115,017 | 2026/12/22 |
| 第100回東日本旅客鉄道 | 1.981 | 100,000 | 133,127 | 2044/1/29 |
| 第9回西日本旅客鉄道 | 2.28 | 123,000 | 139,051 | 2022/3/25 |
| 第53回東海旅客鉄道 | 1.797 | 100,000 | 121,166 | 2030/10/25 |
| 第56回東海旅客鉄道 | 2.083 | 100,000 | 125,840 | 2031/5/26 |
| 第74回東海旅客鉄道 | 1.685 | 100,000 | 126,488 | 2045/3/6 |
| 第11回東京地下鉄 | 1.16 | 100,000 | 106,203 | 2021/12/9 |
| 第5回日本通運 | 1.818 | 100,000 | 105,391 | 2019/5/31 |
| 第5回関西高速鉄道 | 1.238 | 100,000 | 105,008 | 2020/9/10 |
| 第59回日本電信電話 | 1.69 | 100,000 | 105,119 | 2019/6/20 |
| 第63回日本電信電話 | 0.69 | 100,000 | 104,271 | 2023/3/20 |
| 第19回KDDI | 1.151 | 100,000 | 104,368 | 2020/6/19 |
| 第21回KDDI | 0.669 | 100,000 | 104,026 | 2024/9/20 |
| 第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ | 0.73 | 100,000 | 104,831 | 2023/9/20 |
| 第29回電源開発 | 1.405 | 100,000 | 104,645 | 2019/11/20 |
| 第38回電源開発 | 0.978 | 100,000 | 105,160 | 2023/12/20 |
| 第40回電源開発 | 0.889 | 200,000 | 209,240 | 2024/6/20 |
| 第23回東京ガス | 1.01 | 200,000 | 213,162 | 2023/6/9 |
| 第25回エヌ・ティ・ティ・データ | 1.47 | 100,000 | 105,519 | 2020/3/19 |
| 第2回ファーストリテイリング | 0.291 | 100,000 | 101,003 | 2020/12/18 |
| 第3回ファーストリテイリング | 0.491 | 100,000 | 102,191 | 2022/12/16 |
| 第4回ファーストリテイリング | 0.749 | 100,000 | 104,191 | 2025/12/18 |
| 第5回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー | 0.793 | 100,000 | 101,548 | 2018/12/13 |
| 第15回GEキャピタルコーポレーション | 2.215 | 100,000 | 108,615 | 2020/11/20 |
| 第23回GEキャピタルコーポレーション | 0.45 | 200,000 | 200,148 | 2016/9/20 |
| 第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー | 1.32 | 100,000 | 100,894 | 2017/2/9 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|---------------------------|-------|-------------|-------------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第8回ナショナル・オーストラリア銀行 | 1.3 | 100,000 | 100,801 | 2017/1/20 |
| 第9回ナショナル・オーストラリア銀行 | 0.457 | 100,000 | 100,814 | 2019/1/17 |
| 第11回ナショナル・オーストラリア銀行 | 0.284 | 100,000 | 100,445 | 2020/1/16 |
| 第8回オーストラリア・コモンウェルス銀行 | 0.407 | 300,000 | 302,295 | 2019/5/2 |
| 第8回ウエストパック・バンキング・コーポレーション | 1.0 | 100,000 | 100,220 | 2016/8/12 |
| 第9回ラボバンク・ネダーランド | 1.81 | 100,000 | 107,163 | 2021/1/28 |
| 第18回ラボバンク・ネダーランド | 0.778 | 100,000 | 100,971 | 2017/11/2 |
| 第22回ラボバンク・ネダーランド | 0.377 | 100,000 | 100,164 | 2016/12/19 |
| 第23回ラボバンク・ネダーランド | 0.557 | 100,000 | 101,048 | 2018/12/19 |
| 第27回ラボバンク・ネダーランド | 0.38 | 100,000 | 100,559 | 2020/5/22 |
| 小 計 | | 21,917,000 | 22,919,698 | |
| 合 計 | | 470,889,347 | 527,302,626 | |

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

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

<注記事項>

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

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

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

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

| | |
|--|------------------|
| ②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額） | |
| ファンド・マネジャー（国内債券） | 24,560,538,321円 |
| eMAXIS 国内債券インデックス | 16,932,463,018円 |
| eMAXIS バランス（8資産均等型） | 1,513,899,345円 |
| eMAXIS バランス（波乗り型） | 318,764,587円 |
| コアバランス | 2,495,021円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型） | 24,663,146,879円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型） | 28,138,690,875円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型） | 227,589,648円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定） | 29,184,652,524円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定） | 14,740,056,498円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定） | 2,087,892,777円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定） | 6,373,056,468円 |
| MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 199,687,055,080円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定） | 6,632,302,396円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定） | 2,642,591,636円 |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定） | 1,901,143,295円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定） | 552,810,923円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定） | 174,759,098円 |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定） | 5,411,642,373円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定） | 4,201,886,464円 |
| 三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定） | 35,492,792円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA | 58,782,800円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA | 90,216,225円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA | 118,748,080円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA | 73,430,230円 |
| 三菱UFJ 日本債券インデックスファンドVA | 23,134,363円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定） | 267,175,876円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定） | 641,170,860円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定） | 261,546,394円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定） | 645,178,699円 |
| 三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド | 2,887,689,697円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型） | 1,614,469,539円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型） | 3,107,456,915円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型） | 1,646,858,018円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型） | 907,309,775円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型） | 6,129,391,967円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型） | 617,588,982円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型） | 713,503,002円 |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN） | 406,651,573円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金） | 420,126円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金） | 272,141円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金） | 191,413円 |
| eMAXIS 債券バランス（2資産均等型） | 49,079,772円 |
| eMAXIS バランス（4資産均等型） | 22,122,406円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールデンキーパー） | 5,351,778円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー） | 16,871,400円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー） | 3,342,258円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフワード） | 2,016,780円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー） | 54,241円 |
| MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付） | 2,670,099,620円 |
| MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付） | 466,044円 |
| 合計 | 392,963,515,092円 |

【お 知 ら せ】

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

外国債券インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2016年5月12日

[計算期間：2015年5月13日～2016年5月12日]

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

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

○最近5期の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 | | シティ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース) | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|----------|--------|--------------------------------|--------|--------------|--------------|---------|
| | 期 騰 落 | 中 率 | 期 騰 落 | 中 率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 11期(2012年5月14日) | 13,365 | 2.3 | 74,734.13 | 2.1 | 98.7 | — | 158,535 |
| 12期(2013年5月13日) | 17,815 | 33.3 | 99,491.98 | 33.1 | 98.8 | — | 195,142 |
| 13期(2014年5月12日) | 18,707 | 5.0 | 104,415.94 | 4.9 | 98.8 | — | 185,030 |
| 14期(2015年5月12日) | 20,959 | 12.0 | 117,169.90 | 12.2 | 98.8 | — | 159,683 |
| 15期(2016年5月12日) | 19,674 | △ 6.1 | 109,931.94 | △ 6.2 | 98.9 | — | 156,155 |

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

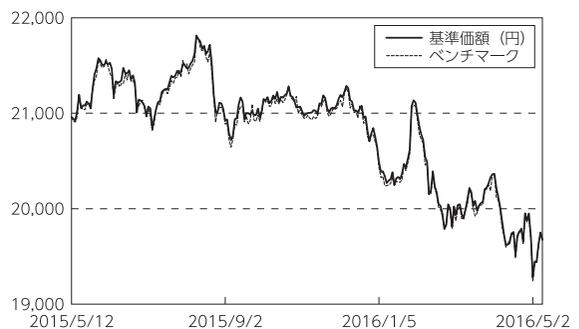
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.1%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎債券市況

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

◎為替市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは6.2%の下落となったため、乖離は0.1%程度となりました。

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

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は△0.0%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は△0.0%程度でした。

- ・コストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.1%程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。

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

○今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016年5月12日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|--------|------------|---------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 3 | % 0.016 | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (3) | (0.016) | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.000) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 3 | 0.016 | |
| 期中の平均基準価額は、20,850円です。 | | | |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

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

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

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

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

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

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

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

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

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

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

| 銘柄 | 銘柄 | 当期末 | | | | | 償還年月日 |
|------|------|--------------------------|---------|---------|--------|-----------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 千円 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| カナダ | | % | 千カナダドル | 千カナダドル | | | |
| | 国債証券 | 0.25 CAN GOVT 171101 | 0.25 | 1,100 | 1,095 | 92,378 | 2017/11/1 |
| | | 0.25 CAN GOVT 180501 | 0.25 | 800 | 795 | 67,092 | 2018/5/1 |
| | | 0.75 CAN GOVT 200901 | 0.75 | 1,300 | 1,307 | 110,228 | 2020/9/1 |
| | | 0.75 CAN GOVT 210301 | 0.75 | 1,300 | 1,304 | 110,023 | 2021/3/1 |
| | | 0.75 CAN GOVT 210901 | 0.75 | 400 | 400 | 33,735 | 2021/9/1 |
| | | 1.25 CAN GOVT 170801 | 1.25 | 1,500 | 1,513 | 127,592 | 2017/8/1 |
| | | 1.25 CAN GOVT 180201 | 1.25 | 1,600 | 1,619 | 136,580 | 2018/2/1 |
| | | 1.25 CAN GOVT 180301 | 1.25 | 900 | 911 | 76,891 | 2018/3/1 |
| | | 1.25 CAN GOVT 180901 | 1.25 | 1,100 | 1,118 | 94,311 | 2018/9/1 |
| | | 1.5 CAN GOVT 170901 | 1.5 | 1,100 | 1,113 | 93,924 | 2017/9/1 |
| | | 1.5 CAN GOVT 200301 | 1.5 | 700 | 723 | 61,043 | 2020/3/1 |
| | | 1.5 CAN GOVT 230601 | 1.5 | 1,200 | 1,243 | 104,873 | 2023/6/1 |
| | | 1.5 CAN GOVT 260601 | 1.5 | 1,100 | 1,120 | 94,530 | 2026/6/1 |
| | | 1.75 CAN GOVT 190301 | 1.75 | 900 | 930 | 78,492 | 2019/3/1 |
| | | 1.75 CAN GOVT 190901 | 1.75 | 900 | 934 | 78,833 | 2019/9/1 |
| | | 2.25 CAN GOVT 250601 | 2.25 | 1,100 | 1,199 | 101,154 | 2025/6/1 |
| | | 2.5 CAN GOVT 240601 | 2.5 | 1,350 | 1,496 | 126,196 | 2024/6/1 |
| | | 2.75 CAN GOVT 220601 | 2.75 | 1,200 | 1,334 | 112,507 | 2022/6/1 |
| | | 2.75 CAN GOVT 481201 | 2.75 | 650 | 769 | 64,888 | 2048/12/1 |
| | | 2.75 CANADA GOVER 641201 | 2.75 | 350 | 439 | 37,051 | 2064/12/1 |
| | | 3.25 CAN GOVT 210601 | 3.25 | 1,000 | 1,126 | 94,968 | 2021/6/1 |
| | | 3.5 CAN GOVT 200601 | 3.5 | 1,200 | 1,338 | 112,863 | 2020/6/1 |
| | | 3.5 CAN GOVT 451201 | 3.5 | 1,400 | 1,882 | 158,734 | 2045/12/1 |
| | | 3.75 CAN GOVT 190601 | 3.75 | 1,600 | 1,753 | 147,889 | 2019/6/1 |
| | | 4 CAN GOVT 170601 | 4.0 | 950 | 984 | 83,025 | 2017/6/1 |
| | | 4 CAN GOVT 410601 | 4.0 | 1,500 | 2,096 | 176,821 | 2041/6/1 |
| | | 4.25 CAN GOVT 180601 | 4.25 | 1,100 | 1,183 | 99,808 | 2018/6/1 |
| | | 5 CAN GOVT 370601 | 5.0 | 1,150 | 1,754 | 147,985 | 2037/6/1 |
| | | 5.75 CAN GOVT 290601 | 5.75 | 950 | 1,413 | 119,164 | 2029/6/1 |
| | | 5.75 CAN GOVT 330601 | 5.75 | 1,200 | 1,887 | 159,180 | 2033/6/1 |
| | | 8 CAN GOVT 270601 | 8.0 | 300 | 502 | 42,355 | 2027/6/1 |
| 小 | 計 | | | | | 3,212,411 | |
| メキシコ | | | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | | | |
| | 国債証券 | 10 MEXICAN BONOS 241205 | 10.0 | 22,400 | 28,726 | 173,220 | 2024/12/5 |
| | | 10 MEXICAN BONOS 361120 | 10.0 | 5,200 | 7,219 | 43,533 | 2036/11/20 |
| | | 4.75 MEXICAN BONO 180614 | 4.75 | 17,700 | 17,787 | 107,258 | 2018/6/14 |
| | | 5 MEXICAN BONOS 170615 | 5.0 | 9,700 | 9,794 | 59,061 | 2017/6/15 |
| | | 5 MEXICAN BONOS 191211 | 5.0 | 12,700 | 12,658 | 76,330 | 2019/12/11 |
| | | 5.75 MEXICAN BONO 260305 | 5.75 | 5,200 | 5,134 | 30,962 | 2026/3/5 |
| | | 6.5 MEXICAN BONOS 210610 | 6.5 | 20,900 | 21,925 | 132,209 | 2021/6/10 |
| | | 6.5 MEXICAN BONOS 220609 | 6.5 | 9,700 | 10,160 | 61,265 | 2022/6/9 |
| | | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 7.5 | 7,700 | 8,575 | 51,707 | 2027/6/3 |
| | | 7.75 MEXICAN BONO 171214 | 7.75 | 14,300 | 15,120 | 91,179 | 2017/12/14 |
| | | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 7.75 | 12,200 | 13,782 | 83,108 | 2031/5/29 |
| | | 7.75 MEXICAN BONO 341123 | 7.75 | 7,400 | 8,367 | 50,453 | 2034/11/23 |
| | | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 7.75 | 12,800 | 14,575 | 87,888 | 2042/11/13 |
| | | 8 MEXICAN BONOS 200611 | 8.0 | 10,900 | 12,025 | 72,513 | 2020/6/11 |

| 銘柄 | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 | |
|------|------|--------------------------|---------|---------|--------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| メキシコ | | % | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | 千円 | | |
| | 国債証券 | 8 MEXICAN BONOS 231207 | 8.0 | 8,200 | 9,328 | 56,252 | 2023/12/7 |
| | | 8.5 MEXICAN BONOS 181213 | 8.5 | 23,400 | 25,565 | 154,162 | 2018/12/13 |
| | | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 8.5 | 9,100 | 10,924 | 65,875 | 2029/5/31 |
| | | 8.5 MEXICAN BONOS 381118 | 8.5 | 10,100 | 12,326 | 74,331 | 2038/11/18 |
| 小 計 | | | | | | 1,471,314 | |
| ユーロ | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | |
| ドイツ | 国債証券 | 0 OBL 200417 | — | 1,700 | 1,732 | 214,455 | 2020/4/17 |
| | | 0 OBL 210409 | — | 1,200 | 1,222 | 151,409 | 2021/4/9 |
| | | 0 SCHATS 170616 | — | 1,400 | 1,407 | 174,287 | 2017/6/16 |
| | | 0 SCHATS 170915 | — | 1,300 | 1,309 | 162,071 | 2017/9/15 |
| | | 0 SCHATS 171215 | — | 1,100 | 1,108 | 137,294 | 2017/12/15 |
| | | 0 SCHATS 180316 | — | 900 | 908 | 112,482 | 2018/3/16 |
| | | 0.25 OBL 180413 | 0.25 | 1,500 | 1,522 | 188,491 | 2018/4/13 |
| | | 0.25 OBL 191011 | 0.25 | 1,800 | 1,847 | 228,696 | 2019/10/11 |
| | | 0.25 OBL 201016 | 0.25 | 1,600 | 1,649 | 204,236 | 2020/10/16 |
| | | 0.5 BUND 250215 | 0.5 | 2,200 | 2,298 | 284,543 | 2025/2/15 |
| | | 0.5 BUND 260215 | 0.5 | 1,500 | 1,554 | 192,447 | 2026/2/15 |
| | | 0.5 OBL 171013 | 0.5 | 1,300 | 1,318 | 163,262 | 2017/10/13 |
| | | 0.5 OBL 180223 | 0.5 | 1,900 | 1,934 | 239,532 | 2018/2/23 |
| | | 0.5 OBL 190412 | 0.5 | 1,400 | 1,442 | 178,560 | 2019/4/12 |
| | | 1 BUND 240815 | 1.0 | 1,700 | 1,852 | 229,314 | 2024/8/15 |
| | | 1 BUND 250815 | 1.0 | 2,000 | 2,174 | 269,212 | 2025/8/15 |
| | | 1 OBL 181012 | 1.0 | 1,300 | 1,348 | 166,940 | 2018/10/12 |
| | | 1 OBL 190222 | 1.0 | 1,400 | 1,460 | 180,778 | 2019/2/22 |
| | | 1.5 BUND 220904 | 1.5 | 1,500 | 1,671 | 206,988 | 2022/9/4 |
| | | 1.5 BUND 230215 | 1.5 | 1,600 | 1,790 | 221,709 | 2023/2/15 |
| | | 1.5 BUND 230515 | 1.5 | 1,500 | 1,683 | 208,427 | 2023/5/15 |
| | | 1.5 BUND 240515 | 1.5 | 1,700 | 1,921 | 237,902 | 2024/5/15 |
| | | 1.75 BUND 220704 | 1.75 | 2,100 | 2,367 | 293,112 | 2022/7/4 |
| | | 1.75 BUND 240215 | 1.75 | 1,600 | 1,837 | 227,453 | 2024/2/15 |
| | | 2 BUND 220104 | 2.0 | 2,100 | 2,380 | 294,698 | 2022/1/4 |
| | | 2 BUND 230815 | 2.0 | 1,600 | 1,859 | 230,187 | 2023/8/15 |
| | | 2.25 BUND 200904 | 2.25 | 1,400 | 1,566 | 193,908 | 2020/9/4 |
| | | 2.25 BUND 210904 | 2.25 | 1,300 | 1,483 | 183,647 | 2021/9/4 |
| | | 2.5 BUND 210104 | 2.5 | 1,700 | 1,933 | 239,428 | 2021/1/4 |
| | | 2.5 BUND 440704 | 2.5 | 1,550 | 2,208 | 273,436 | 2044/7/4 |
| | | 2.5 BUND 460815 | 2.5 | 1,300 | 1,876 | 232,319 | 2046/8/15 |
| | | 3 BUND 200704 | 3.0 | 1,800 | 2,061 | 255,216 | 2020/7/4 |
| | | 3.25 BUND 200104 | 3.25 | 2,100 | 2,390 | 295,920 | 2020/1/4 |
| | | 3.25 BUND 210704 | 3.25 | 1,700 | 2,021 | 250,257 | 2021/7/4 |
| | | 3.25 BUND 420704 | 3.25 | 1,300 | 2,056 | 254,635 | 2042/7/4 |
| | | 3.5 BUND 190704 | 3.5 | 2,000 | 2,254 | 279,092 | 2019/7/4 |
| | | 3.75 BUND 190104 | 3.75 | 2,300 | 2,562 | 317,254 | 2019/1/4 |
| | | 4 BUND 180104 | 4.0 | 1,700 | 1,827 | 226,273 | 2018/1/4 |
| | | 4 BUND 370104 | 4.0 | 2,200 | 3,620 | 448,272 | 2037/1/4 |
| | | 4.25 BUND 170704 | 4.25 | 1,500 | 1,581 | 195,855 | 2017/7/4 |
| | | 4.25 BUND 180704 | 4.25 | 1,900 | 2,095 | 259,445 | 2018/7/4 |

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

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

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|----------------------|------|------------------------|-------|---------|-----------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| フランス | 国債証券 | 3.5 O.A.T 200425 | 3.5 | 3,200 | 3,685 | 456,254 | 2020/4/25 |
| | | 3.5 O.A.T 260425 | 3.5 | 3,300 | 4,288 | 530,940 | 2026/4/25 |
| | | 3.75 O.A.T 191025 | 3.75 | 3,000 | 3,429 | 424,581 | 2019/10/25 |
| | | 3.75 O.A.T 210425 | 3.75 | 3,100 | 3,711 | 459,556 | 2021/4/25 |
| | | 4 O.A.T 180425 | 4.0 | 3,200 | 3,479 | 430,739 | 2018/4/25 |
| | | 4 O.A.T 381025 | 4.0 | 2,450 | 3,755 | 464,996 | 2038/10/25 |
| | | 4 O.A.T 550425 | 4.0 | 1,400 | 2,362 | 292,466 | 2055/4/25 |
| | | 4 O.A.T 600425 | 4.0 | 1,050 | 1,799 | 222,742 | 2060/4/25 |
| | | 4.25 O.A.T 171025 | 4.25 | 3,400 | 3,634 | 449,957 | 2017/10/25 |
| | | 4.25 O.A.T 181025 | 4.25 | 2,700 | 3,011 | 372,880 | 2018/10/25 |
| | | 4.25 O.A.T 190425 | 4.25 | 2,500 | 2,845 | 352,347 | 2019/4/25 |
| | | 4.25 O.A.T 231025 | 4.25 | 3,700 | 4,855 | 601,160 | 2023/10/25 |
| | | 4.5 O.A.T 410425 | 4.5 | 2,300 | 3,850 | 476,764 | 2041/4/25 |
| | | 4.75 O.A.T 350425 | 4.75 | 2,300 | 3,736 | 462,554 | 2035/4/25 |
| | | 5.5 O.A.T 290425 | 5.5 | 2,500 | 3,977 | 492,392 | 2029/4/25 |
| | | 5.75 O.A.T 321025 | 5.75 | 2,700 | 4,673 | 578,650 | 2032/10/25 |
| | | 6 O.A.T 251025 | 6.0 | 2,100 | 3,210 | 397,541 | 2025/10/25 |
| | | 8.5 O.A.T 191025 | 8.5 | 1,000 | 1,308 | 161,993 | 2019/10/25 |
| 8.5 O.A.T 230425 | 8.5 | 900 | 1,433 | 177,472 | 2023/4/25 | | |
| オランダ | 国債証券 | 0 NETH GOVT 180415 | — | 900 | 908 | 112,437 | 2018/4/15 |
| | | 0.25 NETH GOVT 200115 | 0.25 | 1,400 | 1,436 | 177,814 | 2020/1/15 |
| | | 0.25 NETH GOVT 250715 | 0.25 | 1,400 | 1,405 | 173,957 | 2025/7/15 |
| | | 0.5 NETH GOVT 260715 | 0.5 | 500 | 507 | 62,876 | 2026/7/15 |
| | | 1.25 NETH GOVT 180115 | 1.25 | 1,500 | 1,543 | 191,147 | 2018/1/15 |
| | | 1.25 NETH GOVT 190115 | 1.25 | 1,500 | 1,569 | 194,350 | 2019/1/15 |
| | | 1.75 NETH GOVT 230715 | 1.75 | 1,400 | 1,582 | 195,954 | 2023/7/15 |
| | | 2 NETH GOVT 240715 | 2.0 | 1,400 | 1,620 | 200,573 | 2024/7/15 |
| | | 2.25 NETH GOVT 220715 | 2.25 | 1,400 | 1,611 | 199,516 | 2022/7/15 |
| | | 2.5 NETH GOVT 330115 | 2.5 | 1,100 | 1,413 | 174,991 | 2033/1/15 |
| | | 2.75 NETH GOVT 470115 | 2.75 | 1,000 | 1,468 | 181,852 | 2047/1/15 |
| | | 3.25 NETH GOVT 210715 | 3.25 | 1,500 | 1,776 | 219,951 | 2021/7/15 |
| | | 3.5 NETH GOVT 200715 | 3.5 | 1,300 | 1,513 | 187,389 | 2020/7/15 |
| | | 3.75 NETH GOVT 230115 | 3.75 | 400 | 504 | 62,412 | 2023/1/15 |
| | | 3.75 NETH GOVT 420115 | 3.75 | 1,300 | 2,158 | 267,222 | 2042/1/15 |
| | | 4 NETH GOVT 180715 | 4.0 | 1,300 | 1,427 | 176,726 | 2018/7/15 |
| | | 4 NETH GOVT 190715 | 4.0 | 1,300 | 1,485 | 183,945 | 2019/7/15 |
| | | 4 NETH GOVT 370115 | 4.0 | 1,300 | 2,099 | 259,914 | 2037/1/15 |
| 4.5 NETH GOVT 170715 | 4.5 | 1,300 | 1,376 | 170,417 | 2017/7/15 | | |
| 5.5 NETH GOVT 280115 | 5.5 | 1,200 | 1,897 | 234,974 | 2028/1/15 | | |
| 7.5 NETH GOVT 230115 | 7.5 | 700 | 1,058 | 131,036 | 2023/1/15 | | |
| スペイン | 国債証券 | 0.25 SPAIN GOVT 180430 | 0.25 | 1,600 | 1,610 | 199,344 | 2018/4/30 |
| | | 0.25 SPAIN GOVT 190131 | 0.25 | 400 | 402 | 49,860 | 2019/1/31 |
| | | 0.5 SPAIN GOVT 171031 | 0.5 | 1,600 | 1,613 | 199,809 | 2017/10/31 |
| | | 0.75 SPAIN GOVT 210730 | 0.75 | 200 | 202 | 25,019 | 2021/7/30 |
| | | 1.15 SPAIN GOVT 200730 | 1.15 | 1,600 | 1,654 | 204,860 | 2020/7/30 |
| | | 1.4 SPAIN GOVT 200131 | 1.4 | 2,200 | 2,296 | 284,339 | 2020/1/31 |
| | | 1.6 SPAIN GOVT 250430 | 1.6 | 1,800 | 1,825 | 226,033 | 2025/4/30 |

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

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|--------------------------|------|--------------------------|-------|---------|-----------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| ベルギー | 国債証券 | 4.25 BEL GOVT 210928 | 4.25 | 1,500 | 1,860 | 230,388 | 2021/9/28 |
| | | 4.25 BEL GOVT 220928 | 4.25 | 1,500 | 1,915 | 237,167 | 2022/9/28 |
| | | 4.25 BEL GOVT 410328 | 4.25 | 1,450 | 2,333 | 288,908 | 2041/3/28 |
| | | 4.5 BEL GOVT 260328 | 4.5 | 900 | 1,256 | 155,532 | 2026/3/28 |
| | | 5 BEL GOVT 350328 | 5.0 | 1,800 | 2,978 | 368,718 | 2035/3/28 |
| | | 5.5 BEL GOVT 170928 | 5.5 | 600 | 649 | 80,436 | 2017/9/28 |
| | | 5.5 BEL GOVT 280328 | 5.5 | 1,700 | 2,636 | 326,439 | 2028/3/28 |
| オーストリア | 国債証券 | 0.25 AUSTRIA GOVT 191018 | 0.25 | 700 | 715 | 88,595 | 2019/10/18 |
| | | 0.75 AUSTRIA GOVT 261020 | 0.75 | 300 | 307 | 38,032 | 2026/10/20 |
| | | 1.15 AUSTRIA GOVT 181019 | 1.15 | 600 | 623 | 77,186 | 2018/10/19 |
| | | 1.2 AUSTRIA GOVT 251020 | 1.2 | 800 | 863 | 106,947 | 2025/10/20 |
| | | 1.65 AUSTRIA GOVT 241021 | 1.65 | 1,000 | 1,124 | 139,205 | 2024/10/21 |
| | | 1.75 AUSTRIA GOVT 231020 | 1.75 | 800 | 904 | 111,934 | 2023/10/20 |
| | | 1.95 AUSTRIA GOVT 190618 | 1.95 | 600 | 643 | 79,731 | 2019/6/18 |
| | | 2.4 AUSTRIA GOVT 340523 | 2.4 | 500 | 618 | 76,539 | 2034/5/23 |
| | | 3.15 AUSTRIA GOVT 440620 | 3.15 | 650 | 946 | 117,201 | 2044/6/20 |
| | | 3.4 AUSTRIA GOVT 221122 | 3.4 | 900 | 1,106 | 137,013 | 2022/11/22 |
| | | 3.5 AUSTRIA GOVT 210915 | 3.5 | 1,350 | 1,620 | 200,588 | 2021/9/15 |
| | | 3.65 AUSTRIA GOVT 220420 | 3.65 | 800 | 981 | 121,576 | 2022/4/20 |
| | | 3.8 AUSTRIA GOVT 620126 | 3.8 | 300 | 539 | 66,747 | 2062/1/26 |
| | | 3.9 AUSTRIA GOVT 200715 | 3.9 | 1,200 | 1,414 | 175,166 | 2020/7/15 |
| | | 4.15 AUSTRIA GOVT 370315 | 4.15 | 1,050 | 1,655 | 204,906 | 2037/3/15 |
| | | 4.3 AUSTRIA GOVT 170915 | 4.3 | 700 | 744 | 92,235 | 2017/9/15 |
| | | 4.35 AUSTRIA GOVT 190315 | 4.35 | 1,000 | 1,136 | 140,672 | 2019/3/15 |
| 4.65 AUSTRIA GOVT 180115 | 4.65 | 1,200 | 1,303 | 161,408 | 2018/1/15 | | |
| 4.85 AUSTRIA GOVT 260315 | 4.85 | 800 | 1,147 | 142,054 | 2026/3/15 | | |
| 6.25 AUSTRIA GOVT 270715 | 6.25 | 700 | 1,143 | 141,613 | 2027/7/15 | | |
| フィンランド | 国債証券 | 0.375 FINNISH GOV 200915 | 0.375 | 500 | 514 | 63,703 | 2020/9/15 |
| | | 0.5 FINNISH GOVT 260415 | 0.5 | 400 | 403 | 49,947 | 2026/4/15 |
| | | 0.75 FINNISH GOVT 310415 | 0.75 | 300 | 297 | 36,881 | 2031/4/15 |
| | | 0.875 FINNISH GOV 250915 | 0.875 | 300 | 314 | 38,998 | 2025/9/15 |
| | | 1.125 FINNISH GOV 180915 | 1.125 | 300 | 311 | 38,532 | 2018/9/15 |
| | | 1.5 FINNISH GOVT 230415 | 1.5 | 400 | 441 | 54,696 | 2023/4/15 |
| | | 1.625 FINNISH GOV 220915 | 1.625 | 500 | 554 | 68,615 | 2022/9/15 |
| | | 2 FINNISH GOVT 240415 | 2.0 | 400 | 458 | 56,813 | 2024/4/15 |
| | | 2.625 FINNISH GOV 420704 | 2.625 | 400 | 547 | 67,825 | 2042/7/4 |
| | | 2.75 FINNISH GOVT 280704 | 2.75 | 500 | 626 | 77,622 | 2028/7/4 |
| | | 3.375 FINNISH GOV 200415 | 3.375 | 500 | 573 | 70,967 | 2020/4/15 |
| | | 3.5 FINNISH GOVT 210415 | 3.5 | 500 | 592 | 73,363 | 2021/4/15 |
| | | 3.875 FINNISH GOVT170915 | 3.875 | 600 | 635 | 78,672 | 2017/9/15 |
| | | 4 FINNISH GOVT 250704 | 4.0 | 600 | 803 | 99,520 | 2025/7/4 |
| | | 4.375 FINNISH GOV 190704 | 4.375 | 600 | 691 | 85,596 | 2019/7/4 |
| アイルランド | 国債証券 | 0.8 IRISH GOVT 220315 | 0.8 | 500 | 517 | 64,059 | 2022/3/15 |
| | | 1 IRISH GOVT 260515 | 1.0 | 400 | 405 | 50,172 | 2026/5/15 |
| | | 2 IRISH GOVT 450218 | 2.0 | 450 | 467 | 57,884 | 2045/2/18 |
| | | 2.4 IRISH GOVT 300515 | 2.4 | 700 | 799 | 98,956 | 2030/5/15 |
| | | 3.4 IRISH GOVT 240318 | 3.4 | 700 | 849 | 105,161 | 2024/3/18 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------------------|------------------|-----------------------|-------|----------|-----------|------------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| ユーロ | | | | | | | |
| アイルランド | 国債証券 | 3.9 IRISH GOVT 230320 | 3.9 | 500 | 617 | 76,502 | 2023/3/20 |
| | | 4.4 IRISH GOVT 190618 | 4.4 | 700 | 800 | 99,138 | 2019/6/18 |
| | | 4.5 IRISH GOVT 181018 | 4.5 | 750 | 838 | 103,763 | 2018/10/18 |
| | | 4.5 IRISH GOVT 200418 | 4.5 | 1,000 | 1,180 | 146,139 | 2020/4/18 |
| | | 5 IRISH GOVT 201018 | 5.0 | 800 | 977 | 121,051 | 2020/10/18 |
| | | 5.4 IRISH GOVT 250313 | 5.4 | 1,100 | 1,533 | 189,897 | 2025/3/13 |
| | | 5.5 IRISH GOVT 171018 | 5.5 | 500 | 542 | 67,120 | 2017/10/18 |
| | | 5.9 IRISH GOVT 191018 | 5.9 | 600 | 724 | 89,737 | 2019/10/18 |
| 小 計 | | | | | | 63,440,158 | |
| イギリス | | | | 千イギリスポンド | 千イギリスポンド | | |
| 国債証券 | 1 GILT 170907 | 1.0 | 2,600 | 2,621 | 410,329 | 2017/9/7 | |
| | 1.25 GILT 180722 | 1.25 | 2,600 | 2,649 | 414,724 | 2018/7/22 | |
| | 1.5 GILT 210122 | 1.5 | 1,900 | 1,960 | 306,874 | 2021/1/22 | |
| | 1.5 GILT 260722 | 1.5 | 500 | 498 | 78,083 | 2026/7/22 | |
| | 1.75 GILT 190722 | 1.75 | 2,100 | 2,180 | 341,231 | 2019/7/22 | |
| | 1.75 GILT 220907 | 1.75 | 2,200 | 2,301 | 360,218 | 2022/9/7 | |
| | 2 GILT 200722 | 2.0 | 2,500 | 2,633 | 412,156 | 2020/7/22 | |
| | 2 GILT 250907 | 2.0 | 2,000 | 2,105 | 329,615 | 2025/9/7 | |
| | 2.25 GILT 230907 | 2.25 | 2,000 | 2,153 | 337,003 | 2023/9/7 | |
| | 2.5 GILT 650722 | 2.5 | 350 | 392 | 61,492 | 2065/7/22 | |
| | 2.75 GILT 240907 | 2.75 | 2,100 | 2,341 | 366,475 | 2024/9/7 | |
| | 3.25 GILT 440122 | 3.25 | 2,200 | 2,642 | 413,539 | 2044/1/22 | |
| | 3.5 GILT 450122 | 3.5 | 2,150 | 2,705 | 423,491 | 2045/1/22 | |
| | 3.5 GILT 680722 | 3.5 | 1,750 | 2,524 | 395,128 | 2068/7/22 | |
| | 3.75 GILT 190907 | 3.75 | 1,800 | 1,994 | 312,149 | 2019/9/7 | |
| | 3.75 GILT 200907 | 3.75 | 1,500 | 1,698 | 265,794 | 2020/9/7 | |
| | 3.75 GILT 210907 | 3.75 | 1,700 | 1,958 | 306,555 | 2021/9/7 | |
| | 3.75 GILT 520722 | 3.75 | 1,300 | 1,821 | 285,110 | 2052/7/22 | |
| | 4 GILT 220307 | 4.0 | 1,300 | 1,532 | 239,857 | 2022/3/7 | |
| | 4 GILT 600122 | 4.0 | 1,150 | 1,775 | 277,934 | 2060/1/22 | |
| | 4.25 GILT 271207 | 4.25 | 1,100 | 1,410 | 220,733 | 2027/12/7 | |
| | 4.25 GILT 320607 | 4.25 | 1,800 | 2,368 | 370,708 | 2032/6/7 | |
| | 4.25 GILT 360307 | 4.25 | 1,885 | 2,527 | 395,589 | 2036/3/7 | |
| | 4.25 GILT 390907 | 4.25 | 1,300 | 1,780 | 278,741 | 2039/9/7 | |
| | 4.25 GILT 401207 | 4.25 | 1,750 | 2,422 | 379,132 | 2040/12/7 | |
| | 4.25 GILT 461207 | 4.25 | 1,550 | 2,238 | 350,310 | 2046/12/7 | |
| | 4.25 GILT 491207 | 4.25 | 1,250 | 1,862 | 291,557 | 2049/12/7 | |
| | 4.25 GILT 551207 | 4.25 | 1,600 | 2,524 | 395,144 | 2055/12/7 | |
| | 4.5 GILT 190307 | 4.5 | 1,500 | 1,673 | 261,967 | 2019/3/7 | |
| | 4.5 GILT 340907 | 4.5 | 2,000 | 2,740 | 428,864 | 2034/9/7 | |
| | 4.5 GILT 421207 | 4.5 | 1,700 | 2,470 | 386,753 | 2042/12/7 | |
| | 4.75 GILT 200307 | 4.75 | 1,800 | 2,083 | 326,095 | 2020/3/7 | |
| | 4.75 GILT 301207 | 4.75 | 1,600 | 2,192 | 343,242 | 2030/12/7 | |
| 4.75 GILT 381207 | 4.75 | 1,350 | 1,963 | 307,307 | 2038/12/7 | | |
| 5 GILT 180307 | 5.0 | 1,900 | 2,063 | 323,052 | 2018/3/7 | | |
| 5 GILT 250307 | 5.0 | 1,550 | 2,030 | 317,777 | 2025/3/7 | | |
| 6 GILT 281207 | 6.0 | 1,100 | 1,652 | 258,662 | 2028/12/7 | | |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | | | 償還年月日 | | |
|------------------------|------|------------------------|------|-----------------------|--------|------------|------------|---------|-----------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | | |
| イギリス | 国債証券 | 8 GILT 210607 | 8.0 | 1,100 | 1,494 | 233,912 | 2021/6/7 | | |
| | | 8.75 GILT 170825 | 8.75 | 350 | 388 | 60,769 | 2017/8/25 | | |
| 小 計 | | | | | | 12,268,091 | | | |
| スイス | 国債証券 | 2 SWISS GOVT 210428 | 2.0 | 320 | 364 | 40,708 | 2021/4/28 | | |
| | | 2.25 SWISS GOVT 200706 | 2.25 | 450 | 508 | 56,751 | 2020/7/6 | | |
| | | 3 SWISS GOVT 180108 | 3.0 | 550 | 584 | 65,270 | 2018/1/8 | | |
| | | 3 SWISS GOVT 190512 | 3.0 | 490 | 548 | 61,180 | 2019/5/12 | | |
| | | 4 SWISS GOVT 230211 | 4.0 | 440 | 578 | 64,623 | 2023/2/11 | | |
| | | 4 SWISS GOVT 280408 | 4.0 | 500 | 754 | 84,194 | 2028/4/8 | | |
| | | 4.25 SWISS GOVT 170605 | 4.25 | 450 | 474 | 52,920 | 2017/6/5 | | |
| | | 小 計 | | | | | | 425,649 | |
| スウェーデン | 国債証券 | 1 SWD GOVT 261112 | 1.0 | 4,300 | 4,419 | 58,918 | 2026/11/12 | | |
| | | 1.5 SWD GOVT 231113 | 1.5 | 6,800 | 7,382 | 98,409 | 2023/11/13 | | |
| | | 2.5 SWD GOVT 250512 | 2.5 | 5,500 | 6,469 | 86,240 | 2025/5/12 | | |
| | | 3.5 SWD GOVT 220601 | 3.5 | 7,700 | 9,265 | 123,506 | 2022/6/1 | | |
| | | 3.5 SWD GOVT 390330 | 3.5 | 4,000 | 5,400 | 71,990 | 2039/3/30 | | |
| | | 3.75 SWD GOVT 170812 | 3.75 | 5,700 | 6,011 | 80,135 | 2017/8/12 | | |
| | | 4.25 SWD GOVT 190312 | 4.25 | 8,100 | 9,185 | 122,437 | 2019/3/12 | | |
| | | 5 SWD GOVT 201201 | 5.0 | 8,200 | 10,151 | 135,318 | 2020/12/1 | | |
| | | 小 計 | | | | | | 776,956 | |
| | | ノルウェー | 国債証券 | 1.5 NORWE GOVT 260219 | 1.5 | 2,000 | 2,030 | 26,959 | 2026/2/19 |
| 1.75 NORWE GOVT 250313 | 1.75 | | | 3,400 | 3,540 | 47,023 | 2025/3/13 | | |
| 2 NORWE GOVT 230524 | 2.0 | | | 4,600 | 4,887 | 64,912 | 2023/5/24 | | |
| 3 NORWE GOVT 240314 | 3.0 | | | 4,200 | 4,779 | 63,467 | 2024/3/14 | | |
| 3.75 NORWE GOVT 210525 | 3.75 | | | 6,600 | 7,532 | 100,028 | 2021/5/25 | | |
| 4.25 NORWE GOVT 170519 | 4.25 | | | 5,800 | 6,015 | 79,889 | 2017/5/19 | | |
| 4.5 NORWE GOVT 190522 | 4.5 | | | 6,400 | 7,149 | 94,940 | 2019/5/22 | | |
| 小 計 | | | | | | | | 477,220 | |
| デンマーク | 国債証券 | 0.25 DMK GOVT 181115 | 0.25 | 3,000 | 3,048 | 50,728 | 2018/11/15 | | |
| | | 1.5 DMK GOVT 231115 | 1.5 | 5,200 | 5,743 | 95,565 | 2023/11/15 | | |
| | | 1.75 DMK GOVT 251115 | 1.75 | 6,500 | 7,321 | 121,826 | 2025/11/15 | | |
| | | 3 DMK GOVT 211115 | 3.0 | 8,200 | 9,609 | 159,910 | 2021/11/15 | | |
| | | 4 DMK GOVT 171115 | 4.0 | 4,700 | 5,020 | 83,533 | 2017/11/15 | | |
| | | 4 DMK GOVT 191115 | 4.0 | 8,400 | 9,685 | 161,161 | 2019/11/15 | | |
| | | 4.5 DMK GOVT 391115 | 4.5 | 11,400 | 20,004 | 332,878 | 2039/11/15 | | |
| | | 7 DMK GOVT 241110 | 7.0 | 2,100 | 3,324 | 55,316 | 2024/11/10 | | |
| 小 計 | | | | | | 1,060,921 | | | |
| ポーランド | 国債証券 | 1.5 POLAND 200425 | 1.5 | 2,600 | 2,553 | 71,416 | 2020/4/25 | | |
| | | 1.75 POLAND 210725 | 1.75 | 1,100 | 1,069 | 29,917 | 2021/7/25 | | |
| | | 2 POLAND 210425 | 2.0 | 2,400 | 2,377 | 66,486 | 2021/4/25 | | |
| | | 2.5 POLAND 180725 | 2.5 | 2,200 | 2,241 | 62,681 | 2018/7/25 | | |
| | | 2.5 POLAND 260725 | 2.5 | 2,000 | 1,909 | 53,403 | 2026/7/25 | | |
| | | 小 計 | | | | | | | |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|---------|------|--------------------------|-------|------------|------------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ポーランド | | | % | 千ポーランドズロチ | 千ポーランドズロチ | 千円 | |
| | 国債証券 | 3.25 POLAND 190725 | 3.25 | 1,900 | 1,985 | 55,542 | 2019/7/25 |
| | | 3.25 POLAND 250725 | 3.25 | 2,600 | 2,674 | 74,812 | 2025/7/25 |
| | | 3.75 POLAND 180425 | 3.75 | 1,700 | 1,771 | 49,546 | 2018/4/25 |
| | | 4 POLAND 231025 | 4.0 | 2,400 | 2,610 | 73,015 | 2023/10/25 |
| | | 5.25 POLAND 171025 | 5.25 | 2,100 | 2,212 | 61,882 | 2017/10/25 |
| | | 5.25 POLAND 201025 | 5.25 | 1,500 | 1,706 | 47,732 | 2020/10/25 |
| | | 5.5 POLAND 191025 | 5.5 | 1,800 | 2,020 | 56,508 | 2019/10/25 |
| | | 5.75 POLAND 211025 | 5.75 | 1,400 | 1,647 | 46,081 | 2021/10/25 |
| | | 5.75 POLAND 220923 | 5.75 | 2,000 | 2,383 | 66,674 | 2022/9/23 |
| | | 5.75 POLAND 290425 | 5.75 | 800 | 1,003 | 28,076 | 2029/4/25 |
| | | POLAND 170725 | — | 1,200 | 1,179 | 32,991 | 2017/7/25 |
| | | POLAND 181025 | — | 1,200 | 1,152 | 32,241 | 2018/10/25 |
| 小 | 計 | | | | | 909,011 | |
| オーストラリア | | | | 千オーストラリアドル | 千オーストラリアドル | | |
| | 国債証券 | 1.75 AUST GOVT 201121 | 1.75 | 1,100 | 1,100 | 87,904 | 2020/11/21 |
| | | 2.75 AUST GOVT 191021 | 2.75 | 1,700 | 1,764 | 140,980 | 2019/10/21 |
| | | 2.75 AUST GOVT 240421 | 2.75 | 2,200 | 2,291 | 183,096 | 2024/4/21 |
| | | 2.75 AUST GOVT 271121 | 2.75 | 800 | 825 | 65,998 | 2027/11/21 |
| | | 2.75 AUST GOVT 350621 | 2.75 | 500 | 486 | 38,890 | 2035/6/21 |
| | | 3.25 AUST GOVT 181021 | 3.25 | 1,300 | 1,351 | 107,968 | 2018/10/21 |
| | | 3.25 AUST GOVT 250421 | 3.25 | 2,300 | 2,484 | 198,553 | 2025/4/21 |
| | | 3.25 AUST GOVT 290421 | 3.25 | 800 | 862 | 68,913 | 2029/4/21 |
| | | 3.25 AUST GOVT 390621 | 3.25 | 400 | 411 | 32,883 | 2039/6/21 |
| | | 3.75 AUST GOVT 370421 | 3.75 | 750 | 839 | 67,052 | 2037/4/21 |
| | | 4.25 AUST GOVT 170721 | 4.25 | 1,550 | 1,596 | 127,603 | 2017/7/21 |
| | | 4.25 AUST GOVT 260421 | 4.25 | 2,500 | 2,929 | 234,096 | 2026/4/21 |
| | | 4.5 AUST GOVT 200415 | 4.5 | 2,100 | 2,326 | 185,907 | 2020/4/15 |
| | | 4.5 AUST GOVT 330421 | 4.5 | 950 | 1,173 | 93,772 | 2033/4/21 |
| | | 4.75 AUST GOVT 270421 | 4.75 | 2,300 | 2,825 | 225,824 | 2027/4/21 |
| | | 5.25 AUST GOVT 190315 | 5.25 | 2,200 | 2,422 | 193,582 | 2019/3/15 |
| | | 5.5 AUST GOVT 180121 | 5.5 | 2,100 | 2,235 | 178,656 | 2018/1/21 |
| | | 5.5 AUST GOVT 230421 | 5.5 | 1,900 | 2,321 | 185,483 | 2023/4/21 |
| | | 5.75 AUST GOVT 210515 | 5.75 | 1,900 | 2,256 | 180,318 | 2021/5/15 |
| | | 5.75 AUST GOVT 220715 | 5.75 | 2,000 | 2,438 | 194,850 | 2022/7/15 |
| 小 | 計 | | | | | 2,792,339 | |
| シンガポール | | | | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | | |
| | 国債証券 | 0.5 SINGAPORGOVT 180401 | 0.5 | 600 | 594 | 47,129 | 2018/4/1 |
| | | 1.375 SINGAPORGOV 171001 | 1.375 | 100 | 100 | 7,985 | 2017/10/1 |
| | | 1.625 SINGAPORGOV 191001 | 1.625 | 150 | 152 | 12,057 | 2019/10/1 |
| | | 2 SINGAPORGOVT 200701 | 2.0 | 250 | 256 | 20,343 | 2020/7/1 |
| | | 2.25 SINGAPORGOVT 210601 | 2.25 | 600 | 618 | 49,091 | 2021/6/1 |
| | | 2.375 SINGAPORGOV 250601 | 2.375 | 150 | 154 | 12,283 | 2025/6/1 |
| | | 2.5 SINGAPORGOVT 190601 | 2.5 | 600 | 624 | 49,498 | 2019/6/1 |
| | | 2.75 SINGAPORGOVT 230701 | 2.75 | 400 | 422 | 33,516 | 2023/7/1 |
| | | 2.75 SINGAPORGOVT 420401 | 2.75 | 450 | 475 | 37,723 | 2042/4/1 |
| | | 2.75 SINGAPORGOVT 460301 | 2.75 | 150 | 157 | 12,462 | 2046/3/1 |
| | | 2.875 SINGAPORGOV 290701 | 2.875 | 150 | 160 | 12,722 | 2029/7/1 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 | |
|--------|------|---------------------------|-------------|-------------|--------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| シンガポール | | % | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | 千円 | | |
| | 国債証券 | 2.875SINGAPORGOVT 300901 | 2.875 | 400 | 425 | 33,779 | 2030/9/1 |
| | | 3.SINGAPORGOVT 240901 | 3.0 | 600 | 646 | 51,259 | 2024/9/1 |
| | | 3.125SINGAPORGOVT 220901 | 3.125 | 470 | 508 | 40,306 | 2022/9/1 |
| | | 3.25.SINGAPORGOVT 200901 | 3.25 | 400 | 430 | 34,157 | 2020/9/1 |
| | | 3.375.SINGAPORGOVT 330901 | 3.375 | 200 | 227 | 18,050 | 2033/9/1 |
| | | 3.5.SINGAPORGOVT 270301 | 3.5 | 470 | 531 | 42,177 | 2027/3/1 |
| | | 4.SINGAPORGOVT 180901 | 4.0 | 300 | 320 | 25,399 | 2018/9/1 |
| 小 | 計 | | | | | 539,944 | |
| マレーシア | | | 千マレーシアリンギット | 千マレーシアリンギット | | | |
| | 国債証券 | 3.26.MALAYSIAGOV 180301 | 3.26 | 900 | 903 | 24,360 | 2018/3/1 |
| | | 3.314.MALAYSIA 171031 | 3.314 | 1,100 | 1,105 | 29,819 | 2017/10/31 |
| | | 3.418.MALAYSIAGOV 220815 | 3.418 | 900 | 879 | 23,730 | 2022/8/15 |
| | | 3.48.MALAYSIAGOV 230315 | 3.48 | 1,200 | 1,173 | 31,654 | 2023/3/15 |
| | | 3.492.MALAYSIAGOV 200331 | 3.492 | 900 | 899 | 24,256 | 2020/3/31 |
| | | 3.502.MALAYSIAGOV 270531 | 3.502 | 800 | 750 | 20,252 | 2027/5/31 |
| | | 3.58.MALAYSIAGOV 180928 | 3.58 | 800 | 806 | 21,742 | 2018/9/28 |
| | | 3.654.MALAYSIAGOV 191031 | 3.654 | 700 | 705 | 19,027 | 2019/10/31 |
| | | 3.659.MALAYSIAGOV 201015 | 3.659 | 1,000 | 1,007 | 27,185 | 2020/10/15 |
| | | 3.733.MALAYSIAGO 280615 | 3.733 | 600 | 572 | 15,435 | 2028/6/15 |
| | | 3.759.MALAYSIAGOV 190315 | 3.759 | 450 | 456 | 12,311 | 2019/3/15 |
| | | 3.795.MALAYSIAGOV 220930 | 3.795 | 900 | 898 | 24,244 | 2022/9/30 |
| | | 3.8.MALAYSIAGOV 230817 | 3.8 | 200 | 200 | 5,400 | 2023/8/17 |
| | | 3.844.MALAYSIAGOV 330415 | 3.844 | 300 | 281 | 7,590 | 2033/4/15 |
| | | 3.889.MALAYSIAGO 200731 | 3.889 | 700 | 710 | 19,154 | 2020/7/31 |
| | | 3.892.MALAYSIAGOV 270315 | 3.892 | 500 | 488 | 13,177 | 2027/3/15 |
| | | 3.955.MALAYSIAGOV 250915 | 3.955 | 1,150 | 1,154 | 31,131 | 2025/9/15 |
| | | 4.012.MALAYSIAGOV 170915 | 4.012 | 1,500 | 1,520 | 40,997 | 2017/9/15 |
| | | 4.048.MALAYSIA 210930 | 4.048 | 900 | 915 | 24,688 | 2021/9/30 |
| | | 4.127.MALAYSIA 320415 | 4.127 | 700 | 682 | 18,399 | 2032/4/15 |
| | | 4.16.MALAYSIAGOV 210715 | 4.16 | 1,200 | 1,228 | 33,138 | 2021/7/15 |
| | | 4.181.MALAYSIAGOV 240715 | 4.181 | 1,400 | 1,423 | 38,381 | 2024/7/15 |
| | | 4.232.MALAYSIAGOV 310630 | 4.232 | 300 | 301 | 8,128 | 2031/6/30 |
| | | 4.24.MALAYSIAGOV 180207 | 4.24 | 1,200 | 1,224 | 33,022 | 2018/2/7 |
| | | 4.254.MALAYSIAGOV 350531 | 4.254 | 350 | 347 | 9,376 | 2035/5/31 |
| | | 4.378.MALAYSIAGOV 191129 | 4.378 | 1,900 | 1,960 | 52,866 | 2019/11/29 |
| | | 4.392.MALAYSIAGOV 260415 | 4.392 | 1,000 | 1,026 | 27,696 | 2026/4/15 |
| | | 4.498.MALAYSIAGOV 300415 | 4.498 | 1,200 | 1,229 | 33,155 | 2030/4/15 |
| | | 4.935.MALAYSIAGOV 430930 | 4.935 | 600 | 619 | 16,699 | 2043/9/30 |
| | | 5.248.MALAYSIA 280915 | 5.248 | 200 | 219 | 5,909 | 2028/9/15 |
| | | 5.734.MALAYSIAGOV 190730 | 5.734 | 700 | 748 | 20,186 | 2019/7/30 |
| 小 | 計 | | | | | 713,120 | |
| 南アフリカ | | | 千南アフリカランド | 千南アフリカランド | | | |
| | 国債証券 | 10.5.SOUTH AFRICA 261221 | 10.5 | 15,000 | 16,338 | 117,800 | 2026/12/21 |
| | | 6.25.SOUTH AFRICA 360331 | 6.25 | 7,350 | 5,129 | 36,980 | 2036/3/31 |
| | | 6.5.SOUTH AFRICA 410228 | 6.5 | 7,200 | 4,977 | 35,889 | 2041/2/28 |
| | | 6.75.SOUTH AFRICA 210331 | 6.75 | 5,700 | 5,267 | 37,981 | 2021/3/31 |
| | | 7.SOUTH AFRICA 310228 | 7.0 | 8,000 | 6,367 | 45,912 | 2031/2/28 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 | |
|-------|------|---------------------------|-----------|-----------|--------|-------------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| 南アフリカ | | % | 千南アフリカランド | 千南アフリカランド | 千円 | | |
| | 国債証券 | 7.25 SOUTH AFRICA 200115 | 7.25 | 5,500 | 5,280 | 38,069 | 2020/1/15 |
| | | 7.75 SOUTH AFRICA 230228 | 7.75 | 5,000 | 4,701 | 33,899 | 2023/2/28 |
| | | 8 SOUTH AFRICA 181221 | 8.0 | 4,100 | 4,074 | 29,374 | 2018/12/21 |
| | | 8 SOUTH AFRICA 300131 | 8.0 | 8,500 | 7,491 | 54,016 | 2030/1/31 |
| | | 8.25 SOUTH AFRICA 170915 | 8.25 | 5,000 | 5,021 | 36,207 | 2017/9/15 |
| | | 8.25 SOUTH AFRICA 320331 | 8.25 | 5,800 | 5,123 | 36,938 | 2032/3/31 |
| | | 8.5 SOUTH AFRICA 370131 | 8.5 | 7,000 | 6,179 | 44,556 | 2037/1/31 |
| | | 8.75 SOUTH AFRICA 440131 | 8.75 | 5,000 | 4,440 | 32,014 | 2044/1/31 |
| | | 8.75 SOUTH AFRICA 480228 | 8.75 | 9,700 | 8,597 | 61,984 | 2048/2/28 |
| | | 8.875 SOUTH AFRICA 350228 | 8.875 | 2,500 | 2,308 | 16,641 | 2035/2/28 |
| | | 9 SOUTH AFRICA 400131 | 9.0 | 1,400 | 1,285 | 9,268 | 2040/1/31 |
| 小 | 計 | | | | | 667,536 | |
| 合 | 計 | | | | | 154,462,427 | |

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

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

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

(注) 期末における外貨建純資産 (156,139,125千円) の投資信託財産総額 (156,472,309千円) に対する比率は99.8%です。

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

| | | | |
|----------------------|-------------------|---------------------|--------------------|
| 1 アメリカドル=108.37円 | 1 カナダドル=84.33円 | 1 メキシコペソ=6.03円 | 1 ユーロ=123.81円 |
| 1 イギリスポンド=156.52円 | 1 スイスフラン=111.63円 | 1 スウェーデンクローネ=13.33円 | 1 ノルウェークローネ=13.28円 |
| 1 デンマーククローネ=16.64円 | 1 ポーランドズロチ=27.97円 | 1 オーストラリアドル=79.91円 | 1 シンガポールドル=79.31円 |
| 1 マレーシアリングgit=26.97円 | 1 南アフリカランド=7.21円 | | |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

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

<注記事項>

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

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

| | |
|-------------------------------------|-----------------|
| ファンド・マネジャー(海外債券) | 1,807,611,362円 |
| eMAXIS 先進国債券インデックス | 11,534,490,043円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 1,137,218,484円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 226,352,324円 |
| コアバランス | 1,700,783円 |
| 三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド | 6,437,009,006円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定) | 16,634,896,304円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定) | 3,373,592,301円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定) | 2,212,693,687円 |
| MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定) | 13,634,758,617円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA50型(適格機関投資家限定) | 9,105,298,351円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA75型(適格機関投資家限定) | 2,745,502,453円 |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定) | 650,178,523円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA45型(適格機関投資家限定) | 218,583,584円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA30型(適格機関投資家限定) | 80,427,144円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定) | 2,835,690,297円 |
| 三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 43,989,417円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA | 7,156,437円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA | 14,999,999円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA | 25,991,372円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA | 9,528,671円 |
| 三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA | 164,114,246円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定) | 72,157,907円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定) | 148,729,507円 |

○損益の状況 (2015年5月13日~2016年5月12日)

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

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

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

【お知らせ】

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

東証REIT指数マザーファンド

《第8期》決算日2017年1月26日

[計算期間：2016年1月27日～2017年1月26日]

「東証REIT指数マザーファンド」は、1月26日に第8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8期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 東証REIT指数 (配当込み) | | 投資信託証券 組入比率 | 不動産投信 先物比率 | 純総 資産額 |
|----------------|--------|-------|--------------------|-------|----------------|---------------|-----------|
| | 期騰落 | 中率 | 期騰落 | 中率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 4期(2013年1月28日) | 15,186 | 47.0 | 1,892.12 | 47.4 | 99.0 | — | 2,449 |
| 5期(2014年1月27日) | 19,623 | 29.2 | 2,454.67 | 29.7 | 96.9 | 2.4 | 5,919 |
| 6期(2015年1月26日) | 26,667 | 35.9 | 3,336.13 | 35.9 | 96.5 | 3.5 | 12,810 |
| 7期(2016年1月26日) | 23,985 | △10.1 | 2,998.39 | △10.1 | 98.1 | 2.2 | 15,494 |
| 8期(2017年1月26日) | 27,236 | 13.6 | 3,399.04 | 13.4 | 97.9 | 2.3 | 16,983 |

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

(注) 「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 東 証 R E I T 指 数 | | 投 資 信 託 不 動 産 組 入 比 率 | 不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率 |
|---------------------|---------|-------|-----------------|-------|--------------------------|--------------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | (配 当 込 み) | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2016年1月26日 | 円 | % | | % | % | % |
| | 23,985 | — | 2,998.39 | — | 98.1 | 2.2 |
| 1月末 | 25,455 | 6.1 | 3,182.12 | 6.1 | 97.3 | 2.7 |
| 2月末 | 26,894 | 12.1 | 3,361.11 | 12.1 | 98.1 | 1.9 |
| 3月末 | 27,285 | 13.8 | 3,409.88 | 13.7 | 97.8 | 2.3 |
| 4月末 | 27,732 | 15.6 | 3,465.54 | 15.6 | 97.8 | 2.2 |
| 5月末 | 27,389 | 14.2 | 3,422.69 | 14.2 | 98.3 | 1.7 |
| 6月末 | 26,730 | 11.4 | 3,340.35 | 11.4 | 97.1 | 2.9 |
| 7月末 | 27,163 | 13.2 | 3,394.01 | 13.2 | 97.0 | 3.0 |
| 8月末 | 26,623 | 11.0 | 3,325.60 | 10.9 | 97.9 | 2.2 |
| 9月末 | 26,722 | 11.4 | 3,336.34 | 11.3 | 98.0 | 2.0 |
| 10月末 | 26,188 | 9.2 | 3,269.40 | 9.0 | 98.0 | 2.1 |
| 11月末 | 26,425 | 10.2 | 3,298.65 | 10.0 | 97.6 | 2.4 |
| 12月末 | 27,417 | 14.3 | 3,422.06 | 14.1 | 98.4 | 1.6 |
| (期 末) 2017年1月26日 | 27,236 | 13.6 | 3,399.04 | 13.4 | 97.9 | 2.3 |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ13.6%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(13.4%)を0.2%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内REIT市況

- ・期首から2016年4月中旬にかけては、日本銀行によるマイナス金利政策導入の発表などにより国内REIT市況は上昇しました。
- ・4月下旬から11月上旬にかけては、日本銀行による追加的な金融緩和策がたびたび見送られたことや、英国の国民投票で欧州連合（EU）離脱派が勝利したことなどを受け、国内REIT市況は下落しました。
- ・11月中旬から期末にかけては、米大統領選後の円安・株高により日本の景況感にも前向きな見方が台頭したことなどを背景に、国内REIT市況は上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を不動産投資信託証券（REIT）（先物を含む）に投資しました。
- ・ポートフォリオはベンチマークである東証REIT指数（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは13.4%の上昇となったため、カイ離は0.2%程度となりました。カイ離幅を低水準に抑制し、高い流動性を維持しました。

| | 組入比率 要因 | 銘柄選択 要因 | その他の 要因 | 合計 |
|-----------------|------------|------------|------------|--------|
| ベンチマーク とのカイ離 | 0.1%程度 | 0.1%程度 | 0.1%程度 | 0.2%程度 |

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.1%程度でした。

- ・期を通じて、運用資産のほぼ全額をREIT（先物を含む）に投資しました。
- ・期中における先物組入比率の平均は、2.2%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0.1%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は0.1%程度でした。

| | | |
|--------|--------|-----------|
| プラス要因 | 売買益等 | 計 0.1%程度 |
| マイナス要因 | 売買コスト等 | 計 Δ0.0%程度 |

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2016年1月27日～2017年1月26日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-----|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 | 円 | % | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| (投 資 信 託 証 券) | 1 | 0.004 | |
| (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | (0) | (0.000) | |
| (b) そ の 他 費 用 | (1) | (0.003) | (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 |
| (そ の 他) | 0 | 0.000 | |
| 合 計 | (0) | (0.000) | |
| 期中の平均基準価額は、26,835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1月27日～2017年1月26日)

投資信託証券

| 銘柄 | 買 | | 付 | | 売 | | 付 | |
|-----------------------|---|----------|---|-------------|---|-------|---|---------|
| | 口 | 数 | 金 | 額 | 口 | 数 | 金 | 額 |
| | | 千口 | | 千円 | | 千口 | | 千円 |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | | 0.11 | | 50,237 | | 0.162 | | 75,289 |
| MCUBS Mid City投資法人 | | 0.06 | | 21,168 | | 0.089 | | 30,171 |
| 森ヒルズリート投資法人 | | 0.529 | | 83,773 | | 0.575 | | 87,383 |
| | | (0.134) | | (18,817) | | | | |
| 産業ファンド投資法人 | | 0.079 | | 43,111 | | 0.118 | | 62,625 |
| 大和ハウスリート投資法人 | | 0.065 | | 35,830 | | 0.028 | | 13,796 |
| | | (△ 0.56) | | (△ 249,103) | | | | |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | | 0.379 | | 105,862 | | 0.451 | | 128,568 |
| ケネディクス・レジデンシャル投資法人 | | 0.08 | | 23,159 | | 0.117 | | 34,986 |
| アクティブア・プロパティーズ投資法人 | | 0.209 | | 111,718 | | 0.204 | | 106,681 |
| | | (0.021) | | (10,149) | | | | |
| GLP投資法人 | | 0.948 | | 120,764 | | 0.938 | | 118,466 |
| | | (0.068) | | (8,116) | | | | |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | | 0.16 | | 36,818 | | 0.171 | | 40,888 |
| | | (0.017) | | (3,524) | | | | |
| 日本プロロジスリート投資法人 | | 0.638 | | 156,925 | | 0.582 | | 136,972 |
| 星野リゾート・リート投資法人 | | 0.023 | | 29,361 | | 0.046 | | 31,408 |
| | | (0.133) | | (-) | | | | |
| SIA不動産投資法人 | | 0.049 | | 19,584 | | 0.03 | | 11,629 |
| イオンリート投資法人 | | 0.585 | | 77,096 | | 0.4 | | 50,566 |
| ヒューリックリート投資法人 | | 0.593 | | 108,700 | | 0.312 | | 56,698 |
| 日本リート投資法人 | | 0.09 | | 24,942 | | 0.132 | | 36,221 |
| インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | | 0.562 | | 53,482 | | 0.243 | | 22,023 |
| 日本ヘルスケア投資法人 | | 0.016 | | 2,903 | | 0.024 | | 4,245 |
| 積水ハウス・リート投資法人 | | 0.347 | | 47,547 | | 0.295 | | 41,171 |
| トーセイ・リート投資法人 | | 0.05 | | 5,575 | | 0.061 | | 6,626 |
| | | (0.024) | | (2,494) | | | | |
| ケネディクス商業リート投資法人 | | 0.184 | | 50,356 | | 0.13 | | 33,268 |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 | | 0.027 | | 2,863 | | 0.04 | | 4,236 |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | | 0.12 | | 10,693 | | 0.085 | | 7,171 |
| | | (0.113) | | (9,795) | | | | |
| ジャパン・シニアリビング投資法人 | | 0.019 | | 2,887 | | 0.028 | | 4,032 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | | 0.87 | | 143,198 | | 1 | | 227,824 |
| | | (0.736) | | (119,647) | | | | |
| いちごホテルリート投資法人 | | 0.229 | | 34,972 | | 0.079 | | 10,464 |
| ラサールレジポート投資法人 | | 1 | | 197,020 | | 0.304 | | 32,635 |
| スターアジア不動産投資法人 | | 0.566 | | 56,347 | | 0.089 | | 8,178 |
| マリモ地方創生リート投資法人 | | 0.149 | | 13,419 | | 0.023 | | 1,817 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | | 0.365 | | 118,587 | | 0.055 | | 17,233 |
| 大江戸温泉リート投資法人 | | 0.287 | | 25,793 | | 0.043 | | 3,399 |
| さくら総合リート投資法人 | | 0.541 | | 43,597 | | 0.081 | | 6,256 |
| 日本ビルファンド投資法人 | | 0.322 | | 206,012 | | 0.475 | | 300,452 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | | 0.297 | | 188,640 | | 0.439 | | 272,877 |
| 日本リテールファンド投資法人 | | 0.582 | | 146,257 | | 0.858 | | 204,115 |
| オリックス不動産投資法人 | | 0.821 | | 144,375 | | 0.835 | | 145,321 |
| | | (0.045) | | (7,700) | | | | |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | | 0.266 | | 120,167 | | 0.294 | | 133,520 |

○利害関係人との取引状況等

(2016年1月27日～2017年1月26日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ % | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ % |
|-------------|-----------|--------------------|--------------------|-----------|--------------------|--------------------|
| | | | | | | |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 投資信託証券 | 3,886 | 1,825 | 47.0 | 3,826 | 1,777 | 46.4 |
| 不動産投信指数先物取引 | 5,572 | 4,823 | 86.6 | 5,579 | 4,436 | 79.5 |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 買 付 額 |
|--------|------------|
| 投資信託証券 | 百万円 224 |

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) | 690千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 380千円 |
| (B) / (A) | 55.1% |

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

○組入資産の明細

(2017年1月26日現在)

国内投資信託証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------|-------|-----------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千口 | 千口 | 千円 | % |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | 0.722 | 0.67 | 334,330 | 2.0 |
| MCUBS MidCity投資法人 | 0.397 | 0.368 | 130,640 | 0.8 |
| 森ヒルズリート投資法人 | 2 | 2 | 377,036 | 2.2 |
| 産業ファンド投資法人 | 0.526 | 0.487 | 258,597 | 1.5 |
| 大和ハウスリート投資法人 | 0.523 | — | — | — |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | 1 | 1 | 554,388 | 3.3 |
| ケネディクス・レジデンシャル投資法人 | 0.52 | 0.483 | 152,869 | 0.9 |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 0.894 | 0.92 | 511,520 | 3.0 |
| GLP投資法人 | 3 | 3 | 504,437 | 3.0 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 0.704 | 0.71 | 182,470 | 1.1 |
| 日本プロロジスリート投資法人 | 2 | 2 | 629,213 | 3.7 |
| 星野リゾート・リート投資法人 | 0.116 | 0.226 | 137,182 | 0.8 |
| SI A不動産投資法人 | 0.112 | 0.131 | 51,679 | 0.3 |
| イオンリート投資法人 | 1 | 1 | 228,422 | 1.3 |
| ヒューリックリート投資法人 | 1 | 1 | 280,763 | 1.7 |
| 日本リート投資法人 | 0.584 | 0.542 | 153,657 | 0.9 |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | 0.808 | 1 | 111,685 | 0.7 |
| 日本ヘルスケア投資法人 | 0.111 | 0.103 | 18,117 | 0.1 |
| 積水ハウス・リート投資法人 | 1 | 1 | 185,152 | 1.1 |
| トーセイ・リート投資法人 | 0.24 | 0.253 | 27,703 | 0.2 |
| ケネディクス商業リート投資法人 | 0.53 | 0.584 | 160,600 | 0.9 |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 | 0.18 | 0.167 | 17,818 | 0.1 |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | 0.243 | 0.391 | 34,017 | 0.2 |
| ジャパン・シニアリビング投資法人 | 0.126 | 0.117 | 16,965 | 0.1 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | 5 | 5 | 1,013,759 | 6.0 |
| いちごホテルリート投資法人 | 0.206 | 0.356 | 46,315 | 0.3 |
| ラサールレポート投資法人 | — | 1 | 163,507 | 1.0 |
| スターアジア不動産投資法人 | — | 0.477 | 47,366 | 0.3 |
| マリモ地方創生リート投資法人 | — | 0.126 | 11,163 | 0.1 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | — | 0.31 | 102,610 | 0.6 |
| 大江戸温泉リート投資法人 | — | 0.244 | 20,471 | 0.1 |
| さくら総合リート投資法人 | — | 0.46 | 37,766 | 0.2 |
| 日本ビルファンド投資法人 | 2 | 1 | 1,268,800 | 7.5 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 1 | 1 | 1,163,830 | 6.9 |
| 日本リテールファンド投資法人 | 3 | 3 | 855,187 | 5.0 |
| オリックス不動産投資法人 | 3 | 3 | 641,462 | 3.8 |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 1 | 1 | 583,034 | 3.4 |
| プレミア投資法人 | 1 | 1 | 239,097 | 1.4 |
| 東急リアル・エステート投資法人 | 1 | 1 | 192,517 | 1.1 |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 0.289 | 0.268 | 116,580 | 0.7 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 4 | 4 | 762,854 | 4.5 |
| 森トラスト総合リート投資法人 | 1 | 1 | 329,960 | 1.9 |
| インヴェンシブル投資法人 | 4 | 5 | 268,329 | 1.6 |
| フロンティア不動産投資法人 | 0.739 | 0.686 | 348,488 | 2.1 |
| 平和不動産リート投資法人 | 1 | 1 | 121,920 | 0.7 |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 1 | 1 | 290,497 | 1.7 |

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 比 率 |
|-----------------------|---------------|-------|---------|------------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 | |
| | | 千口 | 千口 | 千円 | % |
| 福岡リート投資法人 | 1 | 1 | 185,630 | | 1.1 |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | 0.604 | 0.56 | 369,040 | | 2.2 |
| 積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人 | 1 | 1 | 191,152 | | 1.1 |
| いちごオフィスリート投資法人 | 2 | 2 | 156,520 | | 0.9 |
| 大和証券オフィス投資法人 | 0.721 | 0.688 | 399,040 | | 2.3 |
| 阪急リート投資法人 | 0.891 | 0.826 | 126,212 | | 0.7 |
| スターツプロシード投資法人 | 0.259 | 0.355 | 55,025 | | 0.3 |
| トップリート投資法人 | 0.262 | — | — | | — |
| 大和ハウスリート投資法人 | 1 | 2 | 596,190 | | 3.5 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 4 | 5 | 405,157 | | 2.4 |
| 日本賃貸住宅投資法人 | 2 | 2 | 187,934 | | 1.1 |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 1 | 1 | 255,768 | | 1.5 |
| 森ヒルズリート投資法人(新) | 0.134 | — | — | | — |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人(新) | 0.017 | 0.009 | 2,272 | | 0.0 |
| ヘルスケア&メディカル投資法人(新) | — | 0.085 | 8,868 | | 0.1 |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 76 | 80 | 16,623,598 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 54 | 58 | < 97.9% > | |

(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。

(注) 日本アコモデーションファンド投資法人、MCUBS MidCity投資法人、森ヒルズリート投資法人、産業ファンド投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、ケネディクス・レジデンシャル投資法人、アクティビア・プロパティーズ投資法人、GLP投資法人、コンフォリア・レジデンシャル投資法人、日本プロロジスリート投資法人、星野リゾート・リート投資法人、SIA不動産投資法人、イオンリート投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本リート投資法人、インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人、積水ハウス・リート投資法人、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、ジャパン・シニアリビング投資法人、野村不動産マスターファンド投資法人、いちごホテルリート投資法人、ラサールロジポート投資法人、スターアジア不動産投資法人、マリモ地方創生リート投資法人、三井不動産ロジスティクスパーク投資法人、さくら総合リート投資法人、日本ビルファンド投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、日本リテールファンド投資法人、オリックス不動産投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、プレミア投資法人、東急リアル・エステート投資法人、グローバル・ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、森トラスト総合リート投資法人、インヴィンシブル投資法人、フロンティア不動産投資法人、平和不動産リート投資法人、日本ロジスティクスファンド投資法人、福岡リート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人、いちごオフィスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、阪急リート投資法人、スターツプロシード投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、日本賃貸住宅投資法人、ジャパンエクセレント投資法人につきましては、委託会社の利害関係人である三菱UFJ信託銀行、三菱東京UFJ銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUFJ証券が当該ファンドの一般事務受託会社となっています。(各ファンドで開示されている2017年1月5日時点の有価証券報告書または有価証券届出書より記載)

純資産総額の10%を超える不動産ファンドに関する組入投資証券の内容
当期末において10%を超える銘柄の組入れはございません。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘 柄 別 | 当 期 末 | |
|-------------|-------|-------|
| | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 国内 | 百万円 | 百万円 |
| 不動産投信指数先物取引 | 391 | — |
| 東証REIT指数 | | |

○投資信託財産の構成

(2017年1月26日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資証券 | 千円 16,623,598 | % 97.6 |
| コール・ローン等、その他 | 405,950 | 2.4 |
| 投資信託財産総額 | 17,029,548 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年1月26日現在)

| 項目 | 当期末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 17,028,819,464 |
| コール・ローン等 | 260,969,022 |
| 投資証券(評価額) | 16,623,598,310 |
| 未収入金 | 907,888 |
| 未収配当金 | 126,081,744 |
| 差入委託証拠金 | 17,262,500 |
| (B) 負債 | 45,614,140 |
| 未払金 | 16,272,500 |
| 未払解約金 | 29,341,270 |
| 未払利息 | 370 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 16,983,205,324 |
| 元本 | 6,235,686,088 |
| 次期繰越損益金 | 10,747,519,236 |
| (D) 受益権総口数 | 6,235,686,088口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 27,236円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 6,460,011,075円
 期中追加設定元本額 1,908,286,071円
 期中一部解約元本額 2,132,611,058円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.7236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 国内リートインデックス | 4,507,090,853円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 948,051,651円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 168,337,454円 |
| 三菱UFJ <DC> J-REITインデックスファンド | 936,645円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 88,294,746円 |
| J-REITインデックスファンド(ラップ向け) | 350,360,035円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型) | 40,083,638円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型) | 114,980,036円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー) | 585,496円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー) | 1,526,848円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー) | 5,255,271円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード) | 6,176,899円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー) | 3,313,590円 |
| 世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定) | 692,926円 |
| 合計 | 6,235,686,088円 |

【お知らせ】

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

(2016年3月2日)

○損益の状況 (2016年1月27日~2017年1月26日)

| 項目 | 当期 |
|--------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 601,055,739 |
| 受取配当金 | 594,303,011 |
| 受取利息 | 11,017 |
| その他収益金 | 6,869,164 |
| 支払利息 | △ 127,453 |
| (B) 有価証券売買損益 | 1,366,906,328 |
| 売買益 | 1,670,388,151 |
| 売買損 | △ 303,481,823 |
| (C) 先物取引等取引損益 | 51,149,188 |
| 取引益 | 87,839,044 |
| 取引損 | △ 36,689,856 |
| (D) 保管費用等 | △ 341 |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 2,019,110,914 |
| (F) 前期繰越損益金 | 9,034,049,849 |
| (G) 追加信託差損益金 | 3,178,524,395 |
| (H) 解約差損益金 | △ 3,484,165,922 |
| (I) 計(E+F+G+H) | 10,747,519,236 |
| 次期繰越損益金(I) | 10,747,519,236 |

(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。

MUAM G-REITマザーファンド

《第11期》決算日2017年1月5日

[計算期間：2016年1月6日～2017年1月5日]

「MUAM G-REITマザーファンド」は、1月5日に第11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11期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | S & P 先進国 REITインデックス | | 投資信託 証券組 入比率 | 純資 産総 額 |
|----------------|--------|-------|-------------------------|-----------|--------------------|---------------|
| | 期騰落 | 中率 | (除く日本、配当 込み、円換算ベース) | 期騰落 中率 | | |
| | 円 | % | | % | % | 百万円 |
| 7期(2013年1月7日) | 9,018 | 42.6 | 9,337.10 | 43.7 | 98.5 | 4,623 |
| 8期(2014年1月6日) | 10,769 | 19.4 | 11,215.01 | 20.1 | 98.1 | 6,129 |
| 9期(2015年1月5日) | 15,384 | 42.9 | 16,149.24 | 44.0 | 99.1 | 11,986 |
| 10期(2016年1月5日) | 15,105 | △ 1.8 | 15,914.11 | △ 1.5 | 98.7 | 16,191 |
| 11期(2017年1月5日) | 16,039 | 6.2 | 16,982.66 | 6.7 | 98.8 | 18,949 |

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

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | S & P 先 進 国 R E I T イ ン デ ッ ク ス (除く日本、配当込 み、円換算ベース) | 騰 落 率 | 投 資 信 託 券 率 組 入 比 |
|--------------------|---------|--------|--|--------|----------------------|
| | 円 | 騰 落 率 | | | |
| (期 首) 2016年1月5日 | 15,105 | % — | 15,914.11 | % — | % 98.7 |
| 1月末 | 14,711 | △2.6 | 15,503.98 | △2.6 | 98.8 |
| 2月末 | 14,055 | △7.0 | 14,824.48 | △6.8 | 99.1 |
| 3月末 | 15,250 | 1.0 | 16,107.90 | 1.2 | 98.8 |
| 4月末 | 14,858 | △1.6 | 15,674.21 | △1.5 | 98.9 |
| 5月末 | 15,118 | 0.1 | 15,953.02 | 0.2 | 99.4 |
| 6月末 | 14,508 | △4.0 | 15,335.21 | △3.6 | 99.0 |
| 7月末 | 15,381 | 1.8 | 16,263.54 | 2.2 | 99.4 |
| 8月末 | 14,875 | △1.5 | 15,743.95 | △1.1 | 99.2 |
| 9月末 | 14,403 | △4.6 | 15,255.82 | △4.1 | 98.9 |
| 10月末 | 13,754 | △8.9 | 14,541.87 | △8.6 | 99.1 |
| 11月末 | 14,765 | △2.3 | 15,615.44 | △1.9 | 99.3 |
| 12月末 | 15,625 | 3.4 | 16,536.14 | 3.9 | 98.5 |
| (期 末) 2017年1月5日 | 16,039 | 6.2 | 16,982.66 | 6.7 | 98.8 |

(注) 騰落率は期首比。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.2%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(6.7%)を0.5%下回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国REIT市況（現地通貨ベース）

- ・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を受けて、外国REIT市況は上昇しました。

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて2.2%の円高・米ドル安、5.0%の円高・ユーロ安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは6.7%の上昇となったため、ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.5\%$ 程度となりました。

| | 売買コスト 要因 | 配当課税 要因 | 為替評価 要因 | その他の 要因 | 合計 |
|-------------|-------------------|-------------------|-------------------|------------|-------------------|
| ベンチマークとのカイ離 | $\Delta 0.1\%$ 程度 | $\Delta 0.5\%$ 程度 | $\Delta 0.1\%$ 程度 | 0.1%程度 | $\Delta 0.5\%$ 程度 |

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

◎売買コスト要因

売買コストによる影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

◎配当課税要因

配当課税による影響は $\Delta 0.5\%$ 程度でした。

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

◎為替評価要因

為替評価による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

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

◎その他の要因

その他の要因による影響は0.1%程度でした。

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

○今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年1月6日～2017年1月5日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---|--------------------------|----------------------------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) | 円 2 (0) (2) | % 0.017 (0.000) (0.017) | (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) 有 価 証 券 取 引 税 (投 資 信 託 証 券) | 2 (2) | 0.011 (0.011) | (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 |
| (c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 9 (5) (4) | 0.059 (0.033) (0.026) | (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 |
| 合 計 | 13 | 0.087 | |
| 期中の平均基準価額は、14,775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1月6日～2017年1月5日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|------|-----------|----------------|------------------|-----------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 国 | アメリカ | 百株 320 | 千アメリカドル 575 | 百株 — (320) | 千アメリカドル — (575) |

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株式分割・増資割当および合併等による増減分です。

投資信託証券

| 銘 柄 | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|------------------------------|------------|--------------|------------|-------------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外 国 | アメリカ | 千口 | 千アメリカドル | 千口 | 千アメリカドル |
| | DDR CORP | 8 | 146 | 4 | 61 |
| | HCP INC | 13 | 466 | 7 | 239 |
| | MACERICH CO/THE | 3 | 287 | 3 | 298 |
| | ACADIA REALTY TRUST | 3 | 120 | 0.7 | 23 |
| | AGREE REALTY CORP | 1 | 74 | 0.5 | 22 |
| | ALEXANDER'S INC | 0.11 | 40 | 0.12 | 49 |
| | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 2 | 249 | 0.76 | 83 |
| | PROLOGIS INC | 15 | 682 | 8 | 448 |
| | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 6 | 272 | 1 | 78 |
| | BIOMED REALTY TRUST INC | 0.8 | 18 | — (28) | — (667) |
| | BRANDYWINE REALTY TRUST | 4 | 67 | 2 | 34 |
| | CAMDEN PROPERTY TRUST | 2 | 199 | 1 | 123 |
| | CBL & ASSOCIATES PROPERTIES | 6 | 80 | 1 | 18 |
| | CEDAR REALTY TRUST INC | 2 | 17 | 2 | 18 |
| | NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 5 | 248 | 2 | 97 |
| | CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 2 | 70 | 1 | 43 |
| | COUSINS PROPERTIES INC | 6 (20) | 59 (191) | 3 | 31 |
| | DIAMONDRock HOSPITALITY CO | 9 | 80 | 5 | 60 |
| | DIGITAL REALTY TRUST INC | 5 | 509 | 2 | 218 |
| | EASTGROUP PROPERTIES INC | 0.9 | 51 | 0.35 | 24 |
| | EDUCATION REALTY TRUST INC | 4 | 175 | 0.55 | 22 |
| | EPR PROPERTIES | 2 | 136 | 0.87 | 61 |
| | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 2 | 158 | 0.95 | 66 |
| | EQUITY ONE INC | 4 | 135 | 1 | 29 |
| | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 1 | 406 | 1 | 261 |
| | EXTRA SPACE STORAGE INC | 3 | 308 | 1 | 126 |
| | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 2 | 332 | 0.95 | 135 |
| | FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 4 | 92 | 1 | 52 |

| 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 |
| FIRST POTOMAC REALTY TRUST | 1 | 15 | 1 | 19 |
| GETTY REALTY CORP | 0.8 (-) | 14 (0.31014) | - | - |
| WELLTOWER INC | 11 | 760 | 5 | 384 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 3 | 158 | 1 | 68 |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 6 | 158 | 2 | 72 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 2 | 69 | 1 | 50 |
| INLAND REAL ESTATE CORP | - | - | - | - |
| | | | (12) | (136) |
| KILROY REALTY CORP | 2 | 155 | 1 | 113 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 2 | 56 | 1 | 24 |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 6 | 48 | 2 | 23 |
| LTC PROPERTIES INC | 1 | 83 | 0.55 | 25 |
| MACK-CALI REALTY CORP | 2 | 50 | 0.8 | 23 |
| BOSTON PROPERTIES INC | 4 | 540 | 2 | 316 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 18 | 254 | 4 | 51 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 1 (6) | 185 (513) | 1 | 145 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 1 | 137 | 0.6 | 44 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 9 | 310 | 2 | 72 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 0.5 | 11 | - | - |
| PARKWAY PROPERTIES INC | 1 (△ 12) | 18 (△ 191) | - | - |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 2 | 52 | 1 | 19 |
| POST PROPERTIES INC | 1 (△ 8) | 79 (△ 513) | - | - |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES | 1 | 32 | - | - |
| REALTY INCOME CORP | 7 | 474 | 3 | 205 |
| REGENCY CENTERS CORP | 4 | 315 | 1 | 97 |
| SAUL CENTERS INC | 0.3 | 20 | 0.3 | 19 |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST | 6 | 111 | 3 | 60 |
| SL GREEN REALTY CORP | 2 | 259 | 1 | 138 |
| LIFE STORAGE INC | 2 | 273 | 0.65 | 55 |
| SUN COMMUNITIES INC | 3 | 210 | 0.82 | 61 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 6 (0.875) | 76 (9) | 3 | 54 |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 2 | 94 | 1 | 63 |
| TAUBMAN CENTERS INC | 1 | 104 | 0.75 | 55 |
| CUBESMART | 5 | 174 | 2 | 69 |
| UDR INC | 8 | 304 | 4 | 142 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 0.36 | 18 | - | - |
| URSTADT BIDDLE - CLASS A | 1 | 20 | - | - |
| VENTAS INC | 11 | 740 | 4 | 301 |
| WASHINGTON REIT | 3 | 85 | 0.8 | 25 |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 3 | 140 | 1 | 58 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 0.8 | 17 | 0.9 | 18 |

外

国

| 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 |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA | 0.566 | 51 | 0.2 | 22 |
| UMH PROPERTIES INC | 1 | 16 | 1 | 18 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 1 | 14 | — | — |
| MONMOUTH REAL ESTATE INV COR | 3 | 39 | 1 | 20 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 5 | 179 | 2 | 59 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 5 | 62 | 1 | 21 |
| WINTHROP REALTY TRUST | — | — | 5 | 46 |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC | 2 | 95 | 1 | 51 |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 2 | 16 | — | — |
| DOUGLAS EMMETT INC | 4 | 130 | 1 | 69 |
| DUPONT FABROS TECHNOLOGY | 3 | 125 | 1 | 46 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 1 | 37 | 0.8 | 25 |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST | 1 | 37 | 0.8 | 21 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 3 | 57 | 2 | 43 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 9 | 303 | 1 | 58 |
| CORESITE REALTY CORP | 1 | 109 | 0.55 | 40 |
| CAMPUS CREST COMMUNITIES INC | — | — | — | — |
| | | | (9) | (64) |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 1 | 42 | 0.5 | 21 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 3 | 38 | 1 | 24 |
| GOVERNMENT PROPERTIES INCOME | 2 | 33 | 1 | 22 |
| RLJ LODGING TRUST | 3 | 56 | 1 | 29 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 4 | 85 | 1 | 21 |
| ROUSE PROPERTIES INC | 0.933 | 16 | — | — |
| | | | (5) | (86) |
| STAG INDUSTRIAL INC | 1 | 38 | — | — |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 1 | 28 | 0.9 | 21 |
| RETAIL PROPERTIES OF AME - A | 6 | 105 | 4 | 65 |
| SELECT INCOME REIT | 1 | 33 | 0.82 | 19 |
| HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A | 5 | 150 | 1 | 31 |
| WP CAREY INC | 3 | 238 | 1 | 73 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 1 | 63 | 0.82 | 52 |
| CHATHAM LODGING TRUST | 0.9 | 18 | — | — |
| TERRENO REALTY CORP | 1 | 45 | 0.9 | 25 |
| SILVER BAY REALTY TRUST CORP | 1 | 13 | — | — |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 19 | 215 | 6 | 74 |
| CORECIVIC INC | 2 | 86 | 0.9 | 22 |
| GEO GROUP INC/THE | 2 | 74 | 1 | 41 |
| VEREIT INC | 33 | 311 | 13 | 115 |
| DUKE REALTY CORP | 10 | 238 | 4 | 121 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN | 3 | 38 | 1 | 18 |
| AMERICAN RESIDENTIAL PROPERT | — | — | — | — |
| | (△ 4) | (△ 84) | | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 3 | 65 | 1 | 24 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 10 | 188 | 1 | 22 |

| 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 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 9 (5) | 191 (84) | 3 | 72 |
| GRAMERCY PROPERTY TRUST | 11 (△ 41) | 92 (-) | 6 | 53 |
| CYRUSONE INC | 2 | 122 | 1 | 44 |
| ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN | 1 | 15 | 1 | 20 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 4 | 86 | 2 | 45 |
| QTS REALTY TRUST INC-CL A | 2 | 125 | 0.8 | 38 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 18 | 502 | 2 | 63 |
| COLONY STARWOOD HOMES | 2 | 76 | 0.76 | 21 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 3 | 79 | 1 | 27 |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 5 | 57 | 2 | 22 |
| CARETRUST REIT INC | 3 | 43 | - | - |
| NEW YORK REIT INC | 6 | 59 | 4 | 39 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUN-A | 1 | 15 | - | - |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 18 | 604 | 2 | 73 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 6 | 52 | - | - |
| IRON MOUNTAIN INC | 14 | 492 | 3 | 127 |
| STORE CAPITAL CORP | 15 | 404 | 1 | 32 |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | 1 | 17 | 2 | 21 |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 2 | 60 | 1 | 32 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 2 | 45 | 1 | 20 |
| MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I | 4 | 38 | 2 | 21 |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 2 | 33 | 1 | 24 |
| NORTHSTAR REALTY FINANCE | 6 | 71 | 4 | 67 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 1 | 41 | - | - |
| NEXPOINT RESIDENTIAL | 1 | 15 | 1 | 24 |
| CARE CAPITAL PROPERTIES INC | 2 | 56 | 0.8 | 18 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 3 | 72 | 2 | 42 |
| GLOBAL NET LEASE INC | 4 | 33 | 2 | 19 |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 1 | 14 | 1 | 23 |
| SERITAGE GROWTH PROP- A REIT | 1 | 82 | - | - |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 4 (1) | 76 (30) | 2 | 49 |
| FOREST CITY REALTY TRUST- A | 3 (32) | 66 (575) | 3 | 64 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 1 | 32 | - | - |
| FARMLAND PARTNERS INC | 1 | 20 | - | - |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV | 90 | 74 | - | - |
| TIER REIT INC | 7 | 123 | - | - |
| WHEELER REAL ESTATE INVESTME | 10 | 18 | - | - |
| PARKWAY INC | - (6) | - (-) | - | - |
| QUALITY CARE PROPERTIES | - (15) | - (-) | 1 | 22 |
| MEDEQUITIES REALTY TRUST INC | 3 | 31 | - | - |

外

国

| 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 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 10 | 774 | 6 | 384 |
| FELCOR LODGING TRUST INC | 4 | 28 | 2 | 22 |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES | 17 | 467 | 10 | 262 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 21 | 321 | 13 | 245 |
| ISTAR INC | 11 | 127 | 1 | 22 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 3 | 128 | 1 | 70 |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES | 3 | 76 | 1 | 55 |
| PUBLIC STORAGE | 4 | 1,091 | 2 | 506 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 9 | 1,826 | 4 | 891 |
| VORNADO REALTY TRUST | 4 | 450 | 3 | 355 |
| KIMCO REALTY CORP | 12 | 336 | 5 | 150 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 4 | 711 | 2 | 385 |
| APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 4 | 172 | 2 | 95 |
| 小 計 | 861 (21) | 26,194 (615) | 313 (56) | 11,605 (955) |
| カナダ | | 千カナダドル | | 千カナダドル |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 0.6 | 25 | — | — |
| SMART REAL ESTATE INVESTMENT | 1 | 51 | 0.9 | 28 |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 1 | 55 | 0.7 | 21 |
| CAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 1 | 47 | 0.6 | 27 |
| COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 3 | 48 | — | — |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 1 | 20 | — | — |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 3 | 65 | 1 | 24 |
| INNVEST REAL ESTATE INVESTME | 4 | 20 | — | — |
| | | | (11) | (57) |
| MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS | 1 | 21 | 1 | 26 |
| NORTHVIEW APARTMENT REAL EST | 1 | 21 | — | — |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 5 | 130 | 2 | 53 |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 1 | 51 | 0.8 | 28 |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 2 | 30 | 2 | 24 |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 1 | 27 | — | — |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV | 3 | 28 | 2 | 25 |
| ONEREIT | 7 | 22 | 6 | 23 |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 0.6 | 22 | — | — |
| MILESTONE APARTMENTS REAL ES | 9 | 151 | 7 | 134 |
| PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE | 6 | 35 | 4 | 24 |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 2 | 26 | 2 | 26 |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 1 | 22 | — | — |
| PLAZA RETAIL REIT | 5 | 26 | 5 | 23 |
| SLATE RETAIL REIT - U-RTS | — | — | 2 | 0.09745 |
| | (2) | (—) | | |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 5 | 51 | — | — |
| AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA | 2 | 21 | — | — |
| SLATE OFFICE REIT | 3 | 26 | — | — |
| 小 計 | 75 (2) | 1,055 (—) | 40 (11) | 491 (57) |

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|------------------------------|---------------|------------------|------|---------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| ユーロ | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| ドイツ | | | | |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 3 (-) | 43 (△ 8) | 1 | 15 |
| HAMBORNER REIT AG | 4 | 42 | 1 | 15 |
| HAMBORNER REIT AG-RTS | - (9) | - (-) | 9 | 0.12675 |
| 小 計 | 8 (9) | 85 (△ 8) | 12 | 31 |
| イタリア | | | | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 18 (-) | 13 (△0.28592) | - | - |
| BENI STABILI SPA | 20 (-) | 11 (△ 4) | 31 | 17 |
| 小 計 | 38 (-) | 25 (△ 4) | 31 | 17 |
| フランス | | | | |
| GECINA SA | 1 | 216 | 0.48 | 60 |
| KLEPIERRE | 7 | 308 | 2 | 96 |
| UNIBAIL-RODAMCO SE | 2 | 676 | 1 | 317 |
| AFFINE | - | - | 1 | 16 |
| FONCIERE DES REGIONS | 2 (-) | 177 (△ 8) | 0.79 | 60 |
| MERCIALYS | 6 | 129 | 1 | 18 |
| ANF IMMOBILIER | 0.7 | 14 | 1 | 35 |
| ICADE | 2 | 201 | 1 | 76 |
| ALTAREA | 0.18 (-) | 31 (△ 3) | 0.1 | 17 |
| ALTAREA-RTS | - (0.36) | - (-) | 0.36 | 1 |
| FONCIERE DES MURS | - (-) | - (△ 1) | 1 | 33 |
| 小 計 | 24 (0.36) | 1,755 (△ 13) | 12 | 733 |
| オランダ | | | | |
| EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV | 1 | 54 | 0.55 | 18 |
| NSI NV | 3 | 13 | - | - |
| VASTNED RETAIL NV | 0.4 | 15 | - | - |
| WERELDHAVE NV | 0.84 | 39 | 0.4 | 16 |
| 小 計 | 6 | 123 | 0.95 | 35 |
| スペイン | | | | |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 5 (-) | 41 (△ 1) | - | - |
| LAR ESPANA REAL ESTATE-RTS | - (10) | - (-) | 10 | 6 |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 35 (-) | 332 (△ 5) | 6 | 63 |

外 国

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|------------------------------|--------------|-----------------|-------------|---------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| ユーロ | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| スペイン | | | | |
| AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA | 2 | 30 | 1 | 19 |
| HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI | 17 | 204 | 1 | 20 |
| 小 計 | 60 (10) | 609 (△ 6) | 19 | 110 |
| ベルギー | | | | |
| BEFIMMO | 1 | 57 | 0.35 | 18 |
| BEFIMMO - RTS | — (3) | — (—) | 3 | 1 |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 0.75 | 18 | — | — |
| RETAIL ESTATES | 0.22 | 17 | — | — |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | 0.61 (—) | 49 (1) | — | — |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA - RTS | — (2) | — (—) | — (2) | — (1) |
| AEDIFICA | 0.3 | 18 | 0.3 | 20 |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | 0.5 | 15 | — | — |
| MONTEA | 0.98 | 46 | — | — |
| COFINIMMO | 0.497 | 51 | 0.25 | 25 |
| 小 計 | 4 (5) | 273 (1) | 4 (2) | 65 (1) |
| アイルランド | | | | |
| GREEN REIT PLC | 23 | 33 | 15 | 21 |
| HIBERNIA REIT PLC | 26 | 33 | 13 | 16 |
| 小 計 | 49 | 67 | 29 | 37 |
| ユ ー ロ 計 | 192 (25) | 2,940 (△ 30) | 111 (2) | 1,030 (1) |
| イギリス | | 千イギリスポンド | | 千イギリスポンド |
| BRITISH LAND CO PLC | 28 | 201 | 14 | 94 |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 9 | 71 | 6 | 39 |
| HAMMERSON PLC | 21 | 120 | 11 | 62 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 20 | 226 | 11 | 120 |
| INTU PROPERTIES PLC | 39 | 113 | 16 | 43 |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 31 | 33 | — | — |
| SEGRO PLC | 36 | 162 | 13 | 57 |
| WORKSPACE GROUP PLC | 2 | 23 | 1 | 11 |
| MCKAY SECURITIES PLC-ORD | 3 | 9 | — | — |
| SHAFTESBURY PLC | 7 | 67 | 4 | 37 |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 4 | 34 | 2 | 17 |
| DERWENT LONDON PLC | 3 | 96 | 1 | 46 |
| MUCKLOW (A & J) GROUP PLC | 9 | 47 | — | — |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 14 | 22 | 9 | 14 |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC | 22 | 23 | 16 | 17 |
| REDEFINE INTERNATIONAL PLC | 59 | 26 | — | — |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC | 3 | 11 | — | — |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 86 | 115 | 14 | 18 |

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|----------------------------------|------|-------------|-----|-------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| イギリス | 千口 | 千イギリスポンド | 千口 | 千イギリスポンド |
| ASSURA PLC | 44 | 24 | 27 | 15 |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 19 | 11 | — | — |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 31 | 35 | 15 | 16 |
| REGIONAL REIT LTD | 23 | 24 | 24 | 25 |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | 75 | 48 | — | — |
| NEWRIVER REIT PLC | 37 | 120 | 3 | 11 |
| 小 計 | 636 | 1,673 | 193 | 650 |
| 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 | 92 | 280 | 48 | 141 |
| ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP | 3 | 24 | 3 | 24 |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 7 | 21 | — | — |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 10 | 30 | 7 | 20 |
| ALE PROPERTY GROUP | 5 | 24 | 5 | 20 |
| CHARTER HALL GROUP | 24 | 119 | 6 | 30 |
| FOLKESTONE EDUCATION TRUST | 8 | 17 | — | — |
| GALILEO JAPAN TRUST | — | — | 15 | 40 |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 24 | 23 | — | — |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 21 | 44 | 11 | 25 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 8 | 25 | 7 | 23 |
| NATIONAL STORAGE REIT | 45 | 70 | 16 | 23 |
| GDI PROPERTY GROUP | 23 | 22 | 24 | 23 |
| INDUSTRIA REIT | 10 | 21 | — | — |
| SCENTRE GROUP | 147 | 661 | 80 | 354 |
| ARENA REIT | 10 | 19 | — | — |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS | 7 | 18 | — | — |
| GENERATION HEALTHCARE REIT | 23 | 50 | — | — |
| VIVA ENERGY REIT | 66 | 147 | — | — |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 23 | 93 | — | — |
| GPT GROUP | 46 | 229 | 26 | 131 |
| MIRVAC GROUP | 117 | 230 | 62 | 127 |
| STOCKLAND | 58 | 255 | 29 | 131 |
| WESTFIELD CORP | 53 | 530 | 28 | 262 |
| DEXUS PROPERTY GROUP | 22 | 179 | 12 | 111 |
| BWP TRUST | 13 | 44 | 8 | 23 |
| INVESTA OFFICE FUND | 16 | 68 | 5 | 22 |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 9 | 39 | 6 | 25 |
| GOODMAN GROUP | 38 | 254 | 19 | 134 |
| 小 計 | 937 | 3,550 | 424 | 1,700 |
| ニュージーランド | | 千ニュージーランドドル | | 千ニュージーランドドル |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 16 | 36 | 13 | 26 |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR-RTS | — | — | 9 | 0.29558 |
| | (9) | (—) | | |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 43 | 58 | — | — |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 22 | 28 | 17 | 21 |
| PROPERTY FOR INDUSTRY LTD | 15 | 24 | 16 | 25 |

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|------------------------------|--------------|------------------|-----|-------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| ニュージーランド | 千口 | 千ニュージーランドドル | 千口 | 千ニュージーランドドル |
| STRIDE PROPERTY LTD | 10 (△ 59) | 23 (△ 106) | — | — |
| PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 21 | 27 | 23 | 27 |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 18 | 21 | — | — |
| STRIDE PROPERTY GROUP | — (59) | — (106) | — | — |
| INVESTORE PROPERTY LTD | 26 (14) | 41 (—) | 19 | 25 |
| 小 計 | 173 (23) | 262 (—) | 97 | 126 |
| 香港 | | 千香港ドル | | 千香港ドル |
| LINK REIT | 62 | 2,909 | 39 | 2,060 |
| CHAMPION REIT | 65 | 248 | 35 | 149 |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | 33 | 146 | 35 | 148 |
| FORTUNE REIT | 48 | 411 | 20 | 180 |
| SPRING REAL ESTATE INVESTMEN | 47 | 139 | — | — |
| NEW CENTURY REIT | — | — | 63 | 139 |
| 小 計 | 255 | 3,854 | 192 | 2,679 |
| シンガポール | | 千シンガポールドル | | 千シンガポールドル |
| SUNTEC REIT | 81 (—) | 132 (△ 3) | 35 | 60 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 76 | 108 | 15 | 23 |
| KEPPEL REIT | 73 (—) | 70 (△ 2) | 33 | 34 |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST | 18 (—) | 25 (△0.64692) | 17 | 22 |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST | 28 (—) | 31 (△ 7) | 21 | 24 |
| CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST | 36 | 19 | — | — |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 16 (—) | 24 (△0.19378) | — | — |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 11 | 22 | — | — |
| STARHILL GLOBAL REIT | 33 (—) | 24 (△ 2) | 29 | 22 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 48 (—) | 47 (△ 3) | 23 | 23 |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS | 32 (—) | 51 (△ 7) | 19 | 26 |
| FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | — (—) | — (△ 2) | — | — |
| AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL | — (—) | — (△0.39614) | — | — |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL | 78 (—) | 24 (△ 3) | 57 | 20 |
| PARKWAYLIFE REAL ESTATE | 11 (—) | 24 (△ 1) | — | — |

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|----------------------------------|----------------|-------------------|-----|-----------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 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 |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 44 (-) | 70 (△0.07522) | 20 | 32 |
| CACHE LOGISTICS TRUST | 26 (-) | 22 (△0.53467) | - | - |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 105 | 157 | 19 | 28 |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 36 | 23 | - | - |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 35 | 22 | - | - |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT-RTS | - (46) | - (-) | - | - |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | - (-) | - (△ 1) | - | - |
| MAPLETREE GREATER CHINA COMM | 57 (-) | 53 (△ 4) | 30 | 28 |
| OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | - (-) | - (△ 1) | - | - |
| OUE HOSPITALITY TRUST | 84 | 57 | 39 | 24 |
| OUE HOSPITALITY TRUST-RTS | - (37) | - (-) | 37 | 4 |
| SPH REIT | 20 | 19 | 20 | 19 |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | - (-) | - (△ 2) | 92 | 64 |
| KEPPEL DC REIT | 80 | 94 | 79 | 93 |
| FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI | 165 (-) | 156 (△ 3) | - | - |
| CAPITALAND MALL TRUST | 77 | 160 | 44 | 86 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 82 (-) | 198 (△0.77017) | 27 | 64 |
| 小 計 | 1,359 (84) | 1,643 (△ 49) | 663 | 706 |
| イスラエル | | 千イスラエルシケル | | 千イスラエルシケル |
| REIT 1 LTD | 6 | 64 | - | - |
| 小 計 | 6 | 64 | - | - |

(注) 金額は受渡代金。

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

○株式売買比率

(2016年1月6日～2017年1月5日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|----------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 65,441千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | —千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | — |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年1月6日～2017年1月5日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|-----------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | |
| 為替直物取引 | 百万円 3,644 | 百万円 598 | % 16.4 | 百万円 2,239 | 百万円 1,022 | % 45.6 |

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

○組入資産の明細

(2017年1月5日現在)

外国投資信託証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|------------------------------|---------|-----|---------|---------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千アメリカドル | 千円 | % |
| DDR CORP | 41 | 45 | 704 | 82,110 | 0.4 |
| HCP INC | 63 | 68 | 2,100 | 244,778 | 1.3 |
| MACERICH CO/THE | 18 | 17 | 1,288 | 150,185 | 0.8 |
| ACADIA REALTY TRUST | 9 | 11 | 400 | 46,635 | 0.2 |
| AGREE REALTY CORP | 2 | 3 | 177 | 20,708 | 0.1 |
| ALEXANDER'S INC | 0.51 | 0.5 | 219 | 25,573 | 0.1 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 9 | 11 | 1,337 | 155,943 | 0.8 |
| PROLOGIS INC | 71 | 78 | 4,199 | 489,520 | 2.6 |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 15 | 19 | 980 | 114,292 | 0.6 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 12 | 12 | 95 | 11,128 | 0.1 |
| BIOMED REALTY TRUST INC | 27 | — | — | — | — |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 23 | 26 | 449 | 52,347 | 0.3 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 11 | 12 | 1,095 | 127,732 | 0.7 |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES | 20 | 25 | 302 | 35,217 | 0.2 |
| CEDAR REALTY TRUST INC | 10 | 10 | 73 | 8,544 | 0.0 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 18 | 21 | 980 | 114,230 | 0.6 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 12 | 14 | 447 | 52,180 | 0.3 |
| COUSINS PROPERTIES INC | 28 | 52 | 447 | 52,178 | 0.3 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 26 | 29 | 353 | 41,217 | 0.2 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 19 | 23 | 2,405 | 280,373 | 1.5 |
| EASTGROUP PROPERTIES INC | 4 | 4 | 367 | 42,868 | 0.2 |
| EDUCATION REALTY TRUST INC | 7 | 11 | 463 | 53,982 | 0.3 |
| EPR PROPERTIES | 8 | 9 | 681 | 79,410 | 0.4 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 10 | 12 | 866 | 100,976 | 0.5 |
| EQUITY ONE INC | 10 | 14 | 438 | 51,144 | 0.3 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 8 | 9 | 2,234 | 260,482 | 1.4 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 16 | 18 | 1,448 | 168,855 | 0.9 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 9 | 10 | 1,525 | 177,802 | 0.9 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 14 | 17 | 490 | 57,224 | 0.3 |
| FIRST POTOMAC REALTY TRUST | 8 | 7 | 88 | 10,326 | 0.1 |
| GETTY REALTY CORP | 3 | 4 | 105 | 12,304 | 0.1 |
| WELLTOWER INC | 48 | 53 | 3,572 | 416,357 | 2.2 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 12 | 14 | 780 | 90,992 | 0.5 |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 20 | 24 | 786 | 91,626 | 0.5 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 17 | 18 | 571 | 66,655 | 0.4 |
| INLAND REAL ESTATE CORP | 12 | — | — | — | — |
| KILROY REALTY CORP | 12 | 13 | 1,005 | 117,159 | 0.6 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 11 | 12 | 298 | 34,775 | 0.2 |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 27 | 31 | 353 | 41,197 | 0.2 |
| LTC PROPERTIES INC | 4 | 5 | 282 | 32,942 | 0.2 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|------------------------------|---------|-----|---------|---------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千アメリカドル | 千円 | % |
| MACK-CALI REALTY CORP | 11 | 13 | 391 | 45,636 | 0.2 |
| BOSTON PROPERTIES INC | 20 | 22 | 2,993 | 348,909 | 1.8 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 32 | 47 | 586 | 68,369 | 0.4 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 10 | 16 | 1,659 | 193,403 | 1.0 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 4 | 5 | 444 | 51,864 | 0.3 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 22 | 29 | 937 | 109,332 | 0.6 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 1 | 2 | 58 | 6,830 | 0.0 |
| PARKWAY PROPERTIES INC | 11 | — | — | — | — |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 9 | — | 212 | 24,815 | 0.1 |
| POST PROPERTIES INC | 7 | — | — | — | — |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES | 10 | 12 | 211 | 24,672 | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP | 33 | 38 | 2,227 | 259,645 | 1.4 |
| REGENCY CENTERS CORP | 12 | 15 | 1,080 | 125,960 | 0.7 |
| SAUL CENTERS INC | 1 | 1 | 110 | 12,925 | 0.1 |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST | 31 | 34 | 673 | 78,524 | 0.4 |
| SL GREEN REALTY CORP | 13 | 15 | 1,661 | 193,654 | 1.0 |
| LIFE STORAGE INC | 4 | 6 | 587 | 68,501 | 0.4 |
| SUN COMMUNITIES INC | 7 | 9 | 757 | 88,259 | 0.5 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 28 | 31 | 495 | 57,758 | 0.3 |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 13 | 14 | 521 | 60,828 | 0.3 |
| TAUBMAN CENTERS INC | 8 | 8 | 679 | 79,256 | 0.4 |
| CUBESMART | 23 | 26 | 717 | 83,586 | 0.4 |
| UDR INC | 35 | 39 | 1,441 | 168,005 | 0.9 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 1 | 1 | 131 | 15,379 | 0.1 |
| URSTADT BIDDLE - CLASS A | 3 | 4 | 110 | 12,853 | 0.1 |
| VENTAS INC | 45 | 52 | 3,276 | 381,873 | 2.0 |
| WASHINGTON REIT | 8 | 11 | 370 | 43,159 | 0.2 |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 15 | 17 | 636 | 74,182 | 0.4 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 6 | 6 | 137 | 16,001 | 0.1 |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA | 2 | 2 | 345 | 40,295 | 0.2 |
| UMH PROPERTIES INC | 2 | 3 | 48 | 5,606 | 0.0 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 2 | 3 | 73 | 8,603 | 0.0 |
| MONMOUTH REAL ESTATE INV COR | 8 | 9 | 147 | 17,184 | 0.1 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 13 | 16 | 521 | 60,736 | 0.3 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 12 | 15 | 210 | 24,528 | 0.1 |
| WINTHROP REALTY TRUST | 5 | — | — | — | — |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC | 12 | 13 | 648 | 75,571 | 0.4 |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 16 | 19 | 138 | 16,113 | 0.1 |
| DOUGLAS EMMETT INC | 19 | 21 | 803 | 93,614 | 0.5 |
| DUPONT FABROS TECHNOLOGY | 8 | 11 | 507 | 59,206 | 0.3 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 10 | 10 | 329 | 38,418 | 0.2 |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST | 8 | 8 | 231 | 26,997 | 0.1 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 20 | 21 | 452 | 52,704 | 0.3 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 9 | 17 | 634 | 74,002 | 0.4 |
| CORESITE REALTY CORP | 4 | 5 | 420 | 48,971 | 0.3 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|------------------------------|---------|-----|---------|---------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千アメリカドル | 千円 | % |
| CAMPUS CREST COMMUNITIES INC | 9 | — | — | — | — |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 5 | 5 | 259 | 30,227 | 0.2 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 11 | 13 | 211 | 24,683 | 0.1 |
| GOVERNMENT PROPERTIES INCOME | 9 | 10 | 203 | 23,706 | 0.1 |
| RLJ LODGING TRUST | 17 | 18 | 471 | 54,986 | 0.3 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 13 | 16 | 350 | 40,801 | 0.2 |
| ROUSE PROPERTIES INC | 5 | — | — | — | — |
| STAG INDUSTRIAL INC | 9 | 11 | 271 | 31,666 | 0.2 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 9 | 9 | 241 | 28,203 | 0.1 |
| RETAIL PROPERTIES OF AME - A | 32 | 34 | 542 | 63,282 | 0.3 |
| SELECT INCOME REIT | 8 | 9 | 238 | 27,784 | 0.1 |
| HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A | 17 | 21 | 634 | 73,948 | 0.4 |
| WP CAREY INC | 13 | 15 | 966 | 112,665 | 0.6 |
| WHITESTONE REIT | 4 | 4 | 57 | 6,711 | 0.0 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 7 | 7 | 469 | 54,709 | 0.3 |
| CHATHAM LODGING TRUST | 5 | 6 | 125 | 14,637 | 0.1 |
| TERRENO REALTY CORP | 5 | 6 | 196 | 22,881 | 0.1 |
| SILVER BAY REALTY TRUST CORP | 4 | 5 | 96 | 11,199 | 0.1 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 59 | 71 | 791 | 92,232 | 0.5 |
| CORECIVIC INC | 15 | 17 | 441 | 51,413 | 0.3 |
| GEO GROUP INC/THE | 9 | 11 | 413 | 48,174 | 0.3 |
| VEREIT INC | 123 | 144 | 1,261 | 147,018 | 0.8 |
| DUKE REALTY CORP | 47 | 53 | 1,446 | 168,578 | 0.9 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN | 3 | 5 | 77 | 9,012 | 0.0 |
| AMERICAN RESIDENTIAL PROPERT | 4 | — | — | — | — |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 7 | 9 | 236 | 27,536 | 0.1 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 11 | 20 | 390 | 45,516 | 0.2 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 20 | 32 | 672 | 78,371 | 0.4 |
| GRAMERCY PROPERTY TRUST | 56 | 20 | 583 | 67,996 | 0.4 |
| CYRUSONE INC | 9 | 10 | 516 | 60,173 | 0.3 |
| ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN | 3 | 3 | 46 | 5,395 | 0.0 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 16 | 18 | 380 | 44,346 | 0.2 |
| QTS REALTY TRUST INC-CL A | 5 | 7 | 370 | 43,174 | 0.2 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 22 | 38 | 970 | 113,079 | 0.6 |
| COLONY STARWOOD HOMES | 5 | 7 | 209 | 24,413 | 0.1 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 16 | 18 | 412 | 48,088 | 0.3 |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 24 | 28 | 306 | 35,742 | 0.2 |
| CARETRUST REIT INC | 5 | 9 | 146 | 17,105 | 0.1 |
| NEW YORK REIT INC | 22 | 24 | 244 | 28,499 | 0.2 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUN-A | 2 | 3 | 55 | 6,435 | 0.0 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 12 | 28 | 910 | 106,133 | 0.6 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 3 | 9 | 88 | 10,329 | 0.1 |
| IRON MOUNTAIN INC | 25 | 36 | 1,231 | 143,556 | 0.8 |
| STORE CAPITAL CORP | 9 | 23 | 588 | 68,598 | 0.4 |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | 12 | 11 | 121 | 14,106 | 0.1 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|------------------------------|--------------|-------|---------|---------|------------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千アメリカドル | 千円 | % | |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 12 | 13 | 389 | 45,447 | 0.2 | |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 1 | 3 | 67 | 7,881 | 0.0 | |
| MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I | 22 | 24 | 269 | 31,374 | 0.2 | |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 14 | 15 | 311 | 36,287 | 0.2 | |
| NORTHSTAR REALTY FINANCE | 25 | 27 | 443 | 51,645 | 0.3 | |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 3 | 5 | 117 | 13,736 | 0.1 | |
| NEXPOINT RESIDENTIAL | 2 | 2 | 55 | 6,519 | 0.0 | |
| CARE CAPITAL PROPERTIES INC | 11 | 12 | 315 | 36,810 | 0.2 | |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 21 | 22 | 466 | 54,347 | 0.3 | |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | 2 | 2 | 39 | 4,610 | 0.0 | |
| GLOBAL NET LEASE INC | 23 | 24 | 196 | 22,888 | 0.1 | |
| CITY OFFICE REIT INC | 2 | 2 | 36 | 4,198 | 0.0 | |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 7 | 7 | 98 | 11,539 | 0.1 | |
| SERITAGE GROWTH PROP- A REIT | 1 | 3 | 153 | 17,854 | 0.1 | |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 5 | 8 | 176 | 20,577 | 0.1 | |
| FOREST CITY REALTY TRUST- A | — | 32 | 670 | 78,137 | 0.4 | |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | — | 1 | 41 | 4,882 | 0.0 | |
| FARMLAND PARTNERS INC | — | 1 | 20 | 2,366 | 0.0 | |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV | — | 90 | 75 | 8,759 | 0.0 | |
| TIER REIT INC | — | 7 | 133 | 15,591 | 0.1 | |
| WHEELER REAL ESTATE INVESTME | — | 10 | 18 | 2,124 | 0.0 | |
| PARKWAY INC | — | 6 | 146 | 17,063 | 0.1 | |
| QUALITY CARE PROPERTIES | — | 13 | 216 | 25,196 | 0.1 | |
| MEDEQUITIES REALTY TRUST INC | — | 3 | 34 | 4,059 | 0.0 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | 49 | 54 | 3,489 | 406,721 | 2.1 | |
| FELCOR LODGING TRUST INC | 16 | 18 | 150 | 17,530 | 0.1 | |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES | 79 | 86 | 2,238 | 260,881 | 1.4 | |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 101 | 109 | 2,110 | 246,015 | 1.3 | |
| ISTAR INC | — | 10 | 128 | 14,971 | 0.1 | |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 19 | 22 | 894 | 104,283 | 0.6 | |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES | 15 | 16 | 522 | 60,913 | 0.3 | |
| PUBLIC STORAGE | 19 | 22 | 4,988 | 581,502 | 3.1 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 41 | 46 | 8,558 | 997,570 | 5.3 | |
| VORNADO REALTY TRUST | 24 | 25 | 2,745 | 320,039 | 1.7 | |
| KIMCO REALTY CORP | 56 | 62 | 1,625 | 189,469 | 1.0 | |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 18 | 20 | 3,616 | 421,521 | 2.2 | |
| APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 20 | 23 | 1,046 | 121,958 | 0.6 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 2,674 | 3,186 | 117,906 | 13,743,140 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 157 | 159 | — | <72.5%> | |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | | |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 2 | 3 | 174 | 15,313 | 0.1 | |
| SMART REAL ESTATE INVESTMENT | 8 | 9 | 306 | 26,878 | 0.1 | |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 8 | 9 | 304 | 26,708 | 0.1 | |
| CAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 4 | 5 | 238 | 20,936 | 0.1 | |
| COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 10 | 13 | 203 | 17,869 | 0.1 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|------------------------------|--------------|-----|--------|---------|---------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (カナダ) | 千口 | 千口 | 千カナダドル | 千円 | % | |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 7 | 8 | 164 | 14,427 | 0.1 | |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 19 | 21 | 476 | 41,778 | 0.2 | |
| INNVEST REAL ESTATE INVESTME | 7 | — | — | — | — | |
| MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS | 4 | 3 | 52 | 4,565 | 0.0 | |
| NORTHVIEW APARTMENT REAL EST | 3 | 4 | 82 | 7,255 | 0.0 | |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 20 | 24 | 646 | 56,676 | 0.3 | |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 5 | 5 | 206 | 18,139 | 0.1 | |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 10 | 10 | 133 | 11,733 | 0.1 | |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 4 | 6 | 89 | 7,888 | 0.0 | |
| BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO | 2 | 2 | 52 | 4,623 | 0.0 | |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 4 | 4 | 47 | 4,172 | 0.0 | |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV | 7 | 8 | 78 | 6,873 | 0.0 | |
| ONEREIT | 1 | 2 | 8 | 730 | 0.0 | |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 3 | 3 | 165 | 14,516 | 0.1 | |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 5 | 5 | 42 | 3,704 | 0.0 | |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 4 | 4 | 39 | 3,508 | 0.0 | |
| MILESTONE APARTMENTS REAL ES | 3 | 5 | 106 | 9,351 | 0.0 | |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 2 | 2 | 35 | 3,093 | 0.0 | |
| PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE | 14 | 16 | 93 | 8,189 | 0.0 | |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 5 | 5 | 78 | 6,910 | 0.0 | |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 3 | 5 | 74 | 6,540 | 0.0 | |
| PLAZA RETAIL REIT | 4 | 5 | 26 | 2,280 | 0.0 | |
| SLATE RETAIL REIT - U | 2 | 2 | 36 | 3,237 | 0.0 | |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | — | 5 | 59 | 5,237 | 0.0 | |
| AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA | — | 2 | 22 | 1,943 | 0.0 | |
| SLATE OFFICE REIT | — | 3 | 24 | 2,178 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 184 | 210 | 4,072 | 357,263 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 28 | 30 | — | <1.9%> | |
| (ユーロ…ドイツ) | | | 千ユーロ | | | |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 13 | 15 | 188 | 23,108 | 0.1 | |
| HAMBORNER REIT AG | 8 | 10 | 98 | 12,128 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 21 | 26 | 287 | 35,237 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 2 | 2 | — | <0.2%> | |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 36 | 55 | 41 | 5,086 | 0.0 | |
| BENI STABILI SPA | 147 | 135 | 74 | 9,110 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 184 | 191 | 115 | 14,196 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 2 | 2 | — | <0.1%> | |
| (ユーロ…フランス) | | | | | | |
| GECINA SA | 4 | 6 | 792 | 97,284 | 0.5 | |
| KLEPIERRE | 25 | 30 | 1,135 | 139,306 | 0.7 | |
| UNIBAIL-RODAMCO SE | 13 | 14 | 3,289 | 403,643 | 2.1 | |
| AFFINE | 1 | — | — | — | — | |
| FONCIERE DES REGIONS | 5 | 7 | 604 | 74,150 | 0.4 | |
| MERCIALYS | 2 | 7 | 150 | 18,426 | 0.1 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|------------------------------|--------------|------|-------|----------|-----------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ユーロ…フランス) | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| ANF IMMOBILIER | | 1 | — | — | — | — |
| ICADE | | 4 | 6 | 448 | 55,073 | 0.3 |
| ALTAREA | | 0.28 | 0.36 | 67 | 8,222 | 0.0 |
| FONCIERE DES MURS | | 1 | — | — | — | — |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 60 | 73 | 6,488 | 796,107 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 10 | 7 | — | <4.2%> | |
| (ユーロ…オランダ) | | | | | | |
| EUROCOMMERCIAL PROPRIETE-CV | | 6 | 7 | 264 | 32,424 | 0.2 |
| NSI NV | | 19 | 22 | 82 | 10,130 | 0.1 |
| VASTNED RETAIL NV | | 2 | 2 | 107 | 13,203 | 0.1 |
| WERELDHAVE NV | | 5 | 5 | 258 | 31,757 | 0.2 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 33 | 39 | 713 | 87,515 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 4 | 4 | — | <0.5%> | |
| (ユーロ…スペイン) | | | | | | |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | | 8 | 14 | 100 | 12,283 | 0.1 |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | | 41 | 69 | 723 | 88,830 | 0.5 |
| AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA | | 7 | 8 | 110 | 13,608 | 0.1 |
| HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI | | — | 15 | 169 | 20,785 | 0.1 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 56 | 107 | 1,104 | 135,507 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 3 | 4 | — | <0.7%> | |
| (ユーロ…ベルギー) | | | | | | |
| BEFIMMO | | 2 | 3 | 176 | 21,649 | 0.1 |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | | 1 | 2 | 52 | 6,381 | 0.0 |
| RETAIL ESTATES | | 0.78 | 1 | 76 | 9,398 | 0.0 |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | | 1 | 2 | 196 | 24,140 | 0.1 |
| WERELDHAVE BELGIUM NV | | 0.32 | 0.32 | 35 | 4,375 | 0.0 |
| AEDIFICA | | 2 | 2 | 146 | 17,947 | 0.1 |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | | — | 0.5 | 17 | 2,177 | 0.0 |
| MONTEA | | — | 0.98 | 45 | 5,579 | 0.0 |
| COFINIMMO | | 2 | 3 | 330 | 40,501 | 0.2 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 11 | 15 | 1,077 | 132,151 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 7 | 9 | — | <0.7%> | |
| (ユーロ…アイルランド) | | | | | | |
| GREEN REIT PLC | | 89 | 96 | 132 | 16,214 | 0.1 |
| HIBERNIA REIT PLC | | 90 | 103 | 127 | 15,691 | 0.1 |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | | 53 | 53 | 61 | 7,576 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 233 | 252 | 321 | 39,482 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 3 | 3 | — | <0.2%> | |
| ユ ー ロ 計 | 口 数 ・ 金 額 | 601 | 706 | 10,107 | 1,240,197 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 31 | 31 | — | <6.5%> | |
| (イギリス) | | | | 千イギリスポンド | | |
| BRITISH LAND CO PLC | | 139 | 152 | 955 | 137,515 | 0.7 |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | | 46 | 49 | 327 | 47,191 | 0.2 |
| HAMMERSON PLC | | 105 | 115 | 652 | 93,938 | 0.5 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | | 108 | 118 | 1,233 | 177,492 | 0.9 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|------------------------------|--------------|-------|----------|------------|----------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (イギリス) | 千口 | 千口 | 千イギリスポンド | 千円 | % | |
| INTU PROPERTIES PLC | 109 | 132 | 368 | 53,011 | 0.3 | |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 60 | 91 | 102 | 14,679 | 0.1 | |
| SEGRO PLC | 98 | 122 | 564 | 81,161 | 0.4 | |
| WORKSPACE GROUP PLC | 16 | 18 | 140 | 20,204 | 0.1 | |
| MCKAY SECURITIES PLC-ORD | 11 | 15 | 28 | 4,066 | 0.0 | |
| SHAFTESBURY PLC | 37 | 41 | 370 | 53,246 | 0.3 | |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 19 | 21 | 146 | 21,081 | 0.1 | |
| DERWENT LONDON PLC | 14 | 16 | 441 | 63,541 | 0.3 | |
| MUCKLOW (A & J) GROUP PLC | — | 9 | 43 | 6,250 | 0.0 | |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 83 | 88 | 136 | 19,602 | 0.1 | |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC | 102 | 108 | 121 | 17,456 | 0.1 | |
| REDEFINE INTERNATIONAL PLC | 138 | 197 | 76 | 11,005 | 0.1 | |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC | 28 | 31 | 113 | 16,281 | 0.1 | |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 92 | 164 | 229 | 33,034 | 0.2 | |
| ASSURA PLC | 218 | 235 | 133 | 19,275 | 0.1 | |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 70 | 89 | 51 | 7,388 | 0.0 | |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 51 | 68 | 71 | 10,334 | 0.1 | |
| REGIONAL REIT LTD | 25 | 24 | 26 | 3,754 | 0.0 | |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | — | 75 | 41 | 5,935 | 0.0 | |
| NEWRIVER REIT PLC | — | 33 | 115 | 16,570 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 1,578 | 2,022 | 6,490 | 934,022 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 21 | 24 | — | < 4.9% > | |
| (オーストラリア) | | | | 千オーストラリアドル | | |
| VICINITY CENTRES | 440 | 485 | 1,445 | 122,881 | 0.6 | |
| ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP | 6 | 6 | 43 | 3,702 | 0.0 | |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 36 | 43 | 130 | 11,072 | 0.1 | |
| ASPEN GROUP | 11 | 11 | 12 | 1,056 | 0.0 | |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 19 | 22 | 61 | 5,244 | 0.0 | |
| 360 CAPITAL GROUP LTD | 34 | 34 | 30 | 2,581 | 0.0 | |
| ALE PROPERTY GROUP | 25 | 25 | 110 | 9,369 | 0.0 | |
| CHARTER HALL GROUP | 41 | 59 | 280 | 23,865 | 0.1 | |
| FOLKESTONE EDUCATION TRUST | 27 | 35 | 92 | 7,859 | 0.0 | |
| GALILEO JAPAN TRUST | 15 | — | — | — | — | |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 174 | 198 | 193 | 16,423 | 0.1 | |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 92 | 101 | 222 | 18,954 | 0.1 | |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 26 | 26 | 87 | 7,417 | 0.0 | |
| NATIONAL STORAGE REIT | 35 | 64 | 95 | 8,132 | 0.0 | |
| GDI PROPERTY GROUP | 66 | 65 | 64 | 5,443 | 0.0 | |
| INDUSTRIA REIT | 13 | 23 | 47 | 4,067 | 0.0 | |
| 360 CAPITAL OFFICE FUND | 7 | 7 | 16 | 1,439 | 0.0 | |
| SCENTRE GROUP | 723 | 790 | 3,634 | 309,038 | 1.6 | |
| ARENA REIT | 27 | 37 | 70 | 6,025 | 0.0 | |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS | 16 | 23 | 65 | 5,594 | 0.0 | |
| GENERATION HEALTHCARE REIT | — | 23 | 44 | 3,791 | 0.0 | |
| VIVA ENERGY REIT | — | 66 | 161 | 13,764 | 0.1 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|------------------------------|--------------|-------|-------------|---------|-----------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (オーストラリア) | 千口 | 千口 | 千オーストラリアドル | 千円 | % | |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | — | 23 | 92 | 7,821 | 0.0 | |
| GPT GROUP | 245 | 265 | 1,320 | 112,243 | 0.6 | |
| MIRVAC GROUP | 488 | 543 | 1,158 | 98,467 | 0.5 | |
| STOCKLAND | 324 | 353 | 1,602 | 136,243 | 0.7 | |
| WESTFIELD CORP | 260 | 284 | 2,665 | 226,593 | 1.2 | |
| DEXUS PROPERTY GROUP | 131 | 142 | 1,357 | 115,401 | 0.6 | |
| BWP TRUST | 65 | 70 | 211 | 18,016 | 0.1 | |
| INVESTA OFFICE FUND | 80 | 92 | 439 | 37,324 | 0.2 | |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 46 | 49 | 210 | 17,866 | 0.1 | |
| GOODMAN GROUP | 215 | 234 | 1,665 | 141,621 | 0.7 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 3,697 | 4,211 | 17,635 | 1,499,328 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 29 | 31 | — | < 7.9% > | |
| (ニュージーランド) | | | 千ニュージーランドドル | | | |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 40 | 43 | 88 | 7,223 | 0.0 | |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 156 | 199 | 276 | 22,532 | 0.1 | |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 143 | 147 | 180 | 14,707 | 0.1 | |
| PROPERTY FOR INDUSTRY LTD | 63 | 62 | 99 | 8,068 | 0.0 | |
| STRIDE PROPERTY LTD | 48 | — | — | — | — | |
| PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 143 | 141 | 171 | 13,995 | 0.1 | |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 108 | 127 | 129 | 10,560 | 0.1 | |
| STRIDE PROPERTY GROUP | — | 59 | 102 | 8,356 | 0.0 | |
| INVESTORE PROPERTY LTD | — | 21 | 29 | 2,417 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 704 | 803 | 1,078 | 87,863 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 7 | 8 | — | < 0.5% > | |
| (香港) | | | 千香港ドル | | | |
| LINK REIT | 306 | 329 | 16,795 | 252,435 | 1.3 | |
| CHAMPION REIT | 280 | 310 | 1,302 | 19,569 | 0.1 | |
| PROSPERITY REIT | 178 | 178 | 553 | 8,320 | 0.0 | |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | 150 | 148 | 606 | 9,120 | 0.0 | |
| REGAL REAL ESTATE INVESTMENT | 115 | 115 | 239 | 3,595 | 0.0 | |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST | 153 | 153 | 693 | 10,417 | 0.1 | |
| FORTUNE REIT | 177 | 205 | 1,826 | 27,453 | 0.1 | |
| SPRING REAL ESTATE INVESTMEN | 90 | 137 | 435 | 6,547 | 0.0 | |
| NEW CENTURY REIT | 63 | — | — | — | — | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 1,512 | 1,575 | 22,452 | 337,458 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 9 | 8 | — | < 1.8% > | |
| (シンガポール) | | | 千シンガポールドル | | | |
| SUNTEC REIT | 333 | 379 | 626 | 50,797 | 0.3 | |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 263 | 324 | 488 | 39,563 | 0.2 | |
| KEPPEL REIT | 223 | 263 | 268 | 21,761 | 0.1 | |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST | 83 | 84 | 106 | 8,657 | 0.0 | |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST | 120 | 126 | 145 | 11,834 | 0.1 | |
| CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST | 144 | 180 | 97 | 7,900 | 0.0 | |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 95 | 111 | 151 | 12,302 | 0.1 | |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 78 | 90 | 173 | 14,080 | 0.1 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|----------------------------------|--------------|--------|-----------|------------|------------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (シンガポール) | 千口 | 千口 | 千シンガポールドル | 千円 | % | |
| STARHILL GLOBAL REIT | 186 | 190 | 143 | 11,628 | 0.1 | |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 191 | 215 | 219 | 17,801 | 0.1 | |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS | 86 | 99 | 138 | 11,204 | 0.1 | |
| FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | 82 | 82 | 105 | 8,562 | 0.0 | |
| AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL | 83 | 83 | 111 | 9,058 | 0.0 | |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL | 234 | 255 | 95 | 7,757 | 0.0 | |
| PARKWAYLIFE REAL ESTATE | 48 | 59 | 142 | 11,585 | 0.1 | |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 153 | 177 | 291 | 23,668 | 0.1 | |
| CACHE LOGISTICS TRUST | 101 | 127 | 103 | 8,390 | 0.0 | |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 178 | 264 | 373 | 30,280 | 0.2 | |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 99 | 135 | 80 | 6,511 | 0.0 | |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 75 | 110 | 39 | 3,165 | 0.0 | |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT-RTS | — | 46 | 4 | 340 | 0.0 | |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | 121 | 121 | 84 | 6,865 | 0.0 | |
| MAPLETREE GREATER CHINA COMM | 237 | 264 | 249 | 20,222 | 0.1 | |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REI | 97 | 97 | 63 | 5,150 | 0.0 | |
| OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | 76 | 76 | 52 | 4,281 | 0.0 | |
| OUE HOSPITALITY TRUST | 115 | 160 | 109 | 8,911 | 0.0 | |
| SPH REIT | 105 | 105 | 100 | 8,182 | 0.0 | |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | 92 | — | — | — | — | |
| KEPPEL DC REIT | 111 | 112 | 135 | 10,943 | 0.1 | |
| FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI | — | 165 | 155 | 12,572 | 0.1 | |
| CAPITALAND MALL TRUST | 364 | 397 | 766 | 62,124 | 0.3 | |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 292 | 346 | 800 | 64,919 | 0.3 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 4,471 | 5,250 | 6,427 | 521,026 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 30 | 31 | — | < 2.7% > | |
| (イスラエル) | | | | 千イスラエルシェケル | | |
| REIT 1 LTD | | 20 | 26 | 301 | 9,103 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 20 | 26 | 301 | 9,103 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | < 0.0% > | |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 15,444 | 17,993 | — | 18,729,404 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 313 | 323 | — | < 98.8% > | |

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

○投資信託財産の構成

(2017年1月5日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資証券 | 千円 18,729,404 | % 98.4 |
| コール・ローン等、その他 | 296,303 | 1.6 |
| 投資信託財産総額 | 19,025,707 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産(18,959,638千円)の投資信託財産総額(19,025,707千円)に対する比率は99.7%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=116.56円 | 1 カナダドル=87.73円 | 1 ユーロ=122.70円 | 1 イギリスポンド=143.90円 |
| 1 オーストラリアドル=85.02円 | 1 ニュージーランドドル=81.46円 | 1 香港ドル=15.03円 | 1 シンガポールドル=81.06円 |
| 1 イスラエルシェケル=30.22円 | | | |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年1月5日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 19,116,219,049 |
| コール・ローン等 | 216,744,971 |
| 投資証券(評価額) | 18,729,404,789 |
| 未収入金 | 90,699,815 |
| 未収配当金 | 79,369,353 |
| 未収利息 | 121 |
| (B) 負債 | 166,814,636 |
| 未払金 | 90,511,400 |
| 未払解約金 | 76,303,236 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 18,949,404,413 |
| 元本 | 11,814,318,288 |
| 次期繰越損益金 | 7,135,086,125 |
| (D) 受益権総口数 | 11,814,318,288口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 16.039円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 10,718,844,576円
 期中追加設定元本額 2,954,569,904円
 期中一部解約元本額 1,859,096,192円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.6039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 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型) | 207,226,514円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型) | 144,605,089円 |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド(分配型) | 23,778,003円 |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド(バランス型) | 44,763,077円 |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド(株式重視型) | 19,539,829円 |
| ファンド・マネジャー(海外リート) | 639,345,452円 |
| eMAXIS 先進国リートインデックス | 7,047,079,004円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 1,635,566,781円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 299,396,604円 |
| 三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド | 1,284,832,035円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 154,360,698円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型) | 73,157,420円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型) | 205,681,187円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー) | 1,117,108円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー) | 2,925,339円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー) | 12,051,341円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード) | 10,917,808円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー) | 7,641,517円 |
| 世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定) | 333,482円 |
| 合計 | 11,814,318,288円 |

[お知らせ]

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

(2016年3月2日)

○損益の状況 (2016年1月6日~2017年1月5日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 780,147,469 |
| 受取配当金 | 776,760,344 |
| 受取利息 | 269,095 |
| その他収益金 | 3,132,101 |
| 支払利息 | △ 14,071 |
| (B) 有価証券売買損益 | 490,982,336 |
| 売買益 | 1,549,784,268 |
| 売買損 | △1,058,801,932 |
| (C) 保管費用等 | △ 11,001,215 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 1,260,128,590 |
| (E) 前期繰越損益金 | 5,472,381,055 |
| (F) 追加信託差損益金 | 1,334,569,568 |
| (G) 解約差損益金 | △ 931,993,088 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 7,135,086,125 |
| 次期繰越損益金(H) | 7,135,086,125 |

- (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。