261436

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の投資を通じて、最適化バランス（12%）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、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、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。
	新興国株式インデックスマザーファンド	新興国の株式等（ＤＲ（預託証書）を含みます。）を主要投資対象とします。
	日本債券インデックスマザーファンド	ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。
	外国債券インデックスマザーファンド	シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。
	新興国債券インデックスマザーファンド	新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。
	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。
	新興国株式インデックスマザーファンド	株式および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
	日本債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
	新興国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
	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（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）	

※ 当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
※ 公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
ファンドは2018年１月以降、「つみたてNISA（非課税累積投資契約に係る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
イーマクシス

ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）

第２期（決算日：2018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（マイミッドフィルダー）」は、去る１月26日に第２期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

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
ホームページ　https://www.am.mufg.jp/

当運用報告書に関するお問い合わせ先
お客さま専用フリーダイヤル　０１２０－１５１０３４
（受付時間：営業日の9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～１月３日を除く）
お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

ｅＭＡＸＩＳ専用サイト　https://emaxis.jp/

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。
・－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（１２％）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	－	－	170.40	－	－	－	－	－	－	10
1期(2017年1月26日)	10,516	0	5.2	179.20	5.2	40.7	1.5	41.0	－	15.0	239
2期(2018年1月26日)	11,791	0	12.1	201.00	12.2	41.5	1.2	40.7	0.1	15.2	1,592

(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（12%）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 新興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 新興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（１２％）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					
（期首）	円	%		%	%	%	%	%	%
2017年１月26日	10,516	－	179.20	－	40.7	1.5	41.0	－	15.0
１月末	10,481	△ 0.3	178.70	△ 0.3	41.0	1.3	40.8	－	15.1
２月末	10,592	0.7	180.60	0.8	40.9	1.4	40.6	－	15.3
３月末	10,589	0.7	180.50	0.7	40.9	1.8	40.3	－	15.3
４月末	10,649	1.3	181.50	1.3	41.5	2.0	40.5	－	15.2
５月末	10,762	2.3	183.50	2.4	41.1	1.6	40.3	0.1	15.1
６月末	10,892	3.6	185.70	3.6	41.4	1.5	40.5	0.1	15.2
７月末	10,956	4.2	186.80	4.2	41.5	1.0	40.6	0.0	15.3
８月末	10,996	4.6	187.50	4.6	41.3	1.6	40.3	0.1	15.2
９月末	11,200	6.5	191.00	6.6	41.7	1.5	40.3	0.1	15.2
10月末	11,355	8.0	193.60	8.0	41.6	1.4	40.4	0.1	15.1
11月末	11,458	9.0	195.40	9.0	41.5	1.3	40.2	0.1	15.2
12月末	11,628	10.6	198.30	10.7	41.1	1.2	40.1	0.1	15.1
（期末）									
2018年１月26日	11,791	12.1	201.00	12.2	41.5	1.2	40.7	0.1	15.2

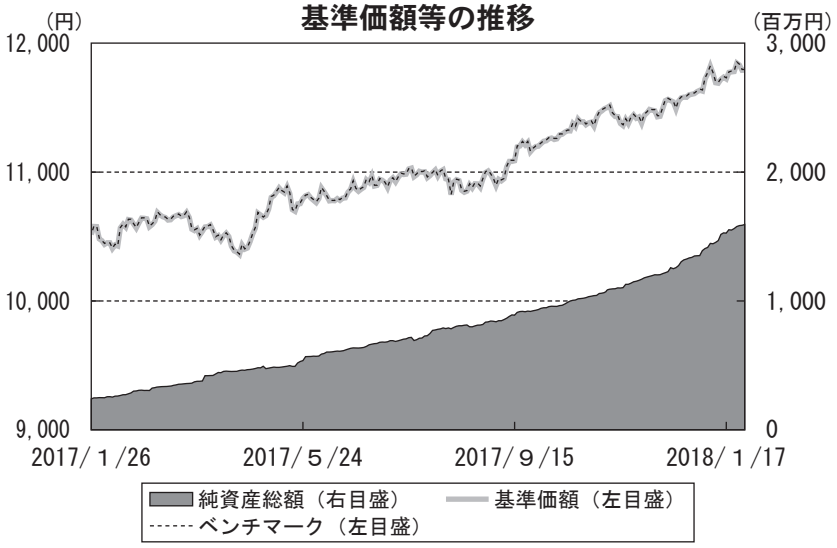
（注）騰落率は期首比。
（注）株式先物比率には不動産投信指数先物を含めて表示しております。
（注）当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
（注）「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第２期：2017/１/27～2018/１/26）

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ12.1%の上昇となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（12.2%）を0.1%下回りました。



第２期首：10,516円
第２期末：11,791円
（既払分配金　　0円）
騰落率　：　12.1%

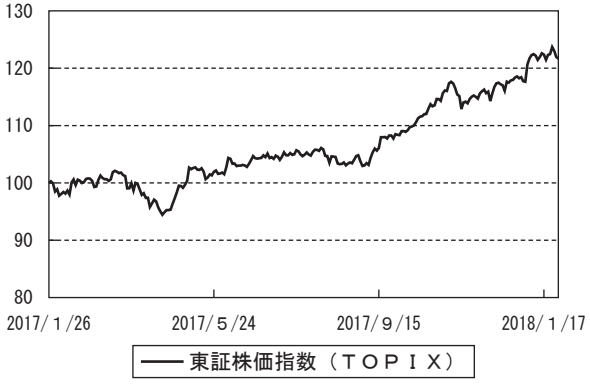
基準価額の主な変動要因

上昇要因	日米の好調な経済指標や企業決算などを受けて内外株式市況が上昇したことなどが、基準価額の上昇要因となりました。

投資環境について

（第２期：2017/１/27～2018/１/26）

市況の推移
（期首を100として指数化）

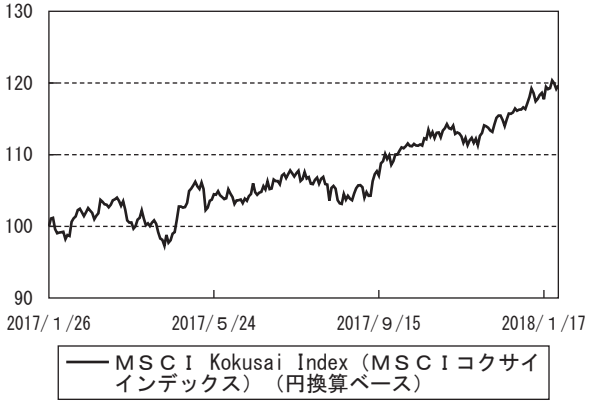


（注）東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。ＴＯＰＩＸに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの算出もしくは公表の方法の変更、ＴＯＰＩＸの算出もしくは公表の停止またはＴＯＰＩＸの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

◎国内株式市況

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

市況の推移
（期首を100として指数化）



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

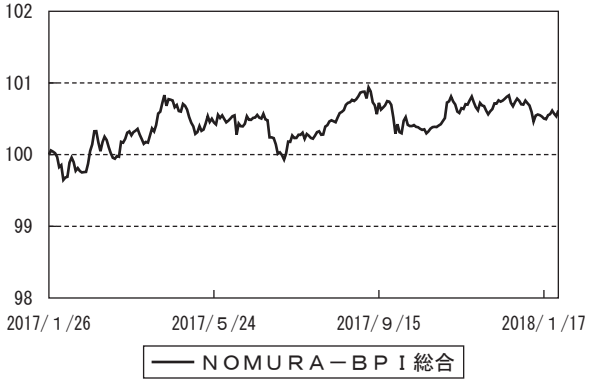
◎外国株式市況
・米国の堅調な企業決算内容や税制改革などが好感され、外国株式市況は上昇しました。

市況の推移
（期首を100として指数化）

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

◎新興国株式市況
・原油価格の上昇や世界的な株式市況の上昇などを受けて、新興国株式市況は上昇しました。

市況の推移
（期首を100として指数化）



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

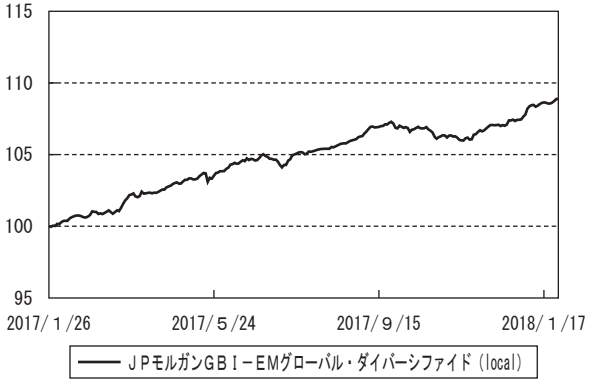
◎国内債券市況
・北朝鮮を巡る地政学リスクの高まりや日本銀行による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」の継続などを背景に、国内債券市況は上昇しました。

市況の推移
（期首を100として指数化）

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

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

市況の推移
（期首を100として指数化）



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

◎新興国債券市況
・新興国の現地通貨建て債券市況は、利金が相応に積みあがったことなどから、期首に比べて上昇しました。

市況の推移
（期首を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
・期首から2017年11月上旬にかけては、地政学リスク等によって投資家心理が悪化したことや、毎月分配型投資信託の需給悪化等を受けて、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、海外のＲＥＩＴ市場と比べた出遅れ感が意識されたことや、世界的な株高による投資家心理の改善等を受けて、国内ＲＥＩＴ市況は上昇しました。

市況の推移
（期首を100として指数化）

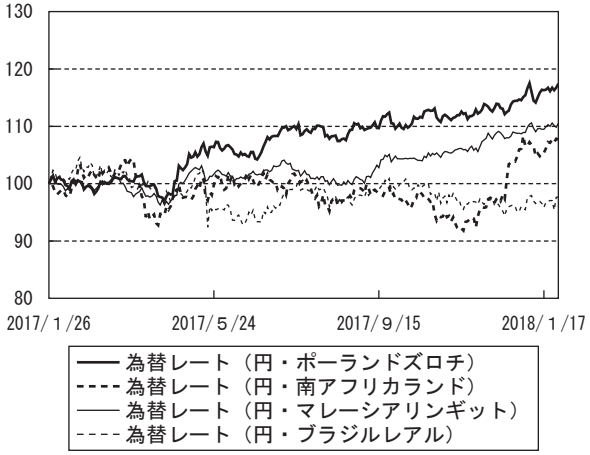
（注）Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックスとは、Ｓ＆Ｐダウ・ジョーンズ・インデックスＬＬＣが有するＳ＆Ｐグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託（ＲＥＩＴ）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。なお、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）は、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み）をもとに、委託会社が計算したものです。Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックスはS&P Dow Jones Indices LLC（「ＳＰＤＪＩ」）の商品であり、これを利用するライセンスが三菱ＵＦＪ国際投信株式会社に付与されています。
Standard & 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。

◎外国ＲＥＩＴ市況
・ＥＵと英国の離脱交渉の進展や、欧州中央銀行（ＥＣＢ）による緩和的な金融政策が継続するとの見通しなどを受けて外国ＲＥＩＴ市況は上昇しました。

為替市況の推移
（期首を100として指数化）

◎為替市況
・円・米ドル相場は、米国税制改革への期待などから米ドルが対円で上昇する局面もありましたが、米トランプ政権の政権運営の不透明感や北朝鮮を巡る地政学的リスクの高まりなどを背景に、期首との比較では、米ドルは対円で3.0％下落しました。
・円・ユーロ相場は、ＥＣＢが金融緩和政策を縮小することが意識されたことや欧州経済の回復期待などを背景にユーロが対円で買われました。期首との比較では、ユーロは対円で11.8％上昇しました。

為替市況の推移
（期首を100として指数化）



◎為替市況
・為替市況は、期首に比べて3.8％の円高・香港ドル安、2.4％の円高・ブラジルレアル安となりました。
・ブラジルレアルなど一部を除き、大半の新興国通貨が対円で買われました。
・特に、欧州経済の回復期待などを背景に中東欧通貨が対円で大きく上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

＜ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）＞
・日本を含む世界各国の株式、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。
・資産配分方針は、最適化バランス（12%）指数の資産クラス別比率を維持しました。
・資産クラス別比率は以下の通りです。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ます。

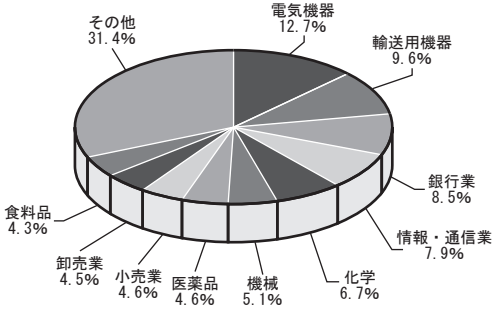
（ご参考）
ベンチマークの資産クラス別比率

マザーファンド	アセット	期首	期末
新興国株式インデックスマザーファンド	新興国株式	8%	8%
外国株式インデックスマザーファンド	先進国株式	16%	17%
ＴＯＰＩＸマザーファンド	国内株式	18%	18%
ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド	先進国ＲＥＩＴ	9%	9%
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	国内ＲＥＩＴ	6%	6%
新興国債券インデックスマザーファンド	新興国債券	8%	8%
外国債券インデックスマザーファンド	先進国債券	10%	9%
日本債券インデックスマザーファンド	国内債券	25%	25%

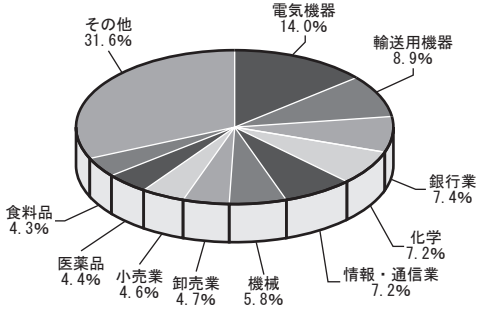
＜ＴＯＰＩＸマザーファンド＞
基準価額は期首に比べ24.2%の上昇となりました。
・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
・株式ポートフォリオはベンチマークである東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

（ご参考）
組入上位10業種

期首（2017年１月26日）



期末（2018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＞
基準価額は期首に比べ21.9%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

＜新興国株式インデックスマザーファンド＞
基準価額は期首に比べ37.0%の上昇となりました。
・ＭＳＣＩ エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に採用されている新興国の株式等（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＞
基準価額は期首に比べ0.6%の上昇となりました。
・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。
・ベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合）の構成銘柄を種別や年限等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）

期首（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

期末（2018年１月26日）

最終利回り	0.2%
直接利回り	0.9%
デュレーション	8.9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＞
基準価額は期首に比べ6.4%の上昇となりました。
・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

期首（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

期末（2018年１月26日）

最終利回り	1.6%
直接利回り	2.4%
デュレーション	7.1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。

＜新興国債券インデックスマザーファンド＞
基準価額は期首に比べ14.4%の上昇となりました。
・新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

（ご参考）
利回り・デュレーション

期首（2017年１月26日）

最終利回り	6.4%
直接利回り	6.1%
デュレーション	4.8年

期末（2018年１月26日）

最終利回り	5.8%
直接利回り	6.0%
デュレーション	4.9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。

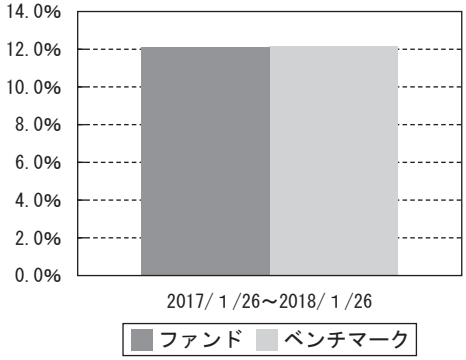
＜東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド＞
基準価額は期首に比べ1.0%の下落となりました。
・資産のほぼ全額を不動産投資信託証券（ＲＥＩＴ）（先物を含む）に投資しました。
・ポートフォリオはベンチマークである東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

＜ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド＞
基準価額は期首に比べ2.9%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（マイミッドフィルダー）＞
基準価額の騰落率は12.1%の上昇となり、ベンチマークの騰落率（12.2%）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）



＜ＴＯＰＩＸマザーファンド＞
ベンチマークは21.6%の上昇となったため、カイ離は2.6%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合　　計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	0.0%程度	2.5%程度	2.6%程度

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

◎組入比率要因
組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。
・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
・期中における先物組入比率の平均は、1.2%程度となりました。
（注）先物の使用は、「利便性に優れ、売買コストが低い」利点がある反面、必ずしも指数の値動きと一致しないことから、ベンチマークからのカイ離を生む可能性があります。

◎銘柄選択要因
銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

◎その他の要因
その他の要因による影響は2.5%程度でした。
・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

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

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

＜外国株式インデックスマザーファンド＞
ベンチマークは19.7%の上昇となったため、カイ離は2.2%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	2.3%程度	2.2%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
組入比率による影響は0.0%程度でした。
・期中、ファンドの資産をほぼ全額株式（先物・ＲＥＩＴを含む）に投資しました。
・効率的に運用を行うため、円貨、外貨現金などを若干保有しました。

◎銘柄選択要因
銘柄選択による影響は△0.1%程度でした。
ファンドとベンチマークの値動きや、推定トラッキングエラー、株式の国別比率、業種別比率などについてモニターし、必要に応じて定量モデルを用いた調整を図ることでベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。その際に、ファンドがベンチマークと連動する可能性をより高めるため、
・売買に係るコストを考慮しつつ、できる限り多くの銘柄に分散投資を行いました。
・ファンドの特性をよりベンチマークに近づけるべく、マルチファクターモデルを用いて組入銘柄とその組入比率を決定しています。

◎その他の要因
その他の要因による影響は2.3%程度でした。
その他の要因としては、配当・利子収入、為替効果、売買コスト、保管料等による影響などが含まれます。
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。

＜新興国株式インデックスマザーファンド＞
ベンチマークは34.4%の上昇となったため、カイ離は2.6%程度となりました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	コスト要因	その他の要因	合　　計
ベンチマークとのカイ離	△0.2%程度	0.1%程度	△0.1%程度	2.8%程度	2.6%程度

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

◎組入比率要因
組入比率による影響は△0.2%程度でした。
・期中、ファンドの資産をほぼ全額株式（先物・ＲＥＩＴを含む）に投資しました。
・効率的に運用を行うため、円貨、外貨現金などを若干保有しました。

◎銘柄選択要因
銘柄選択による影響は0.1%程度でした。
ファンドとベンチマークの値動きや、推定トラッキングエラー、株式の国別比率、業種別比率などについてモニターし、必要に応じて定量モデルを用いた調整を図ることでベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。その際に、ファンドがベンチマークと連動する可能性をより高めるため、
・売買に係るコストを考慮しつつ、できる限り多くの銘柄に分散投資を行いました。
・ファンドの特性をよりベンチマークに近づけるべく、マルチファクターモデルを用いて組入銘柄とその組入比率を決定しています。

◎コスト要因
売買にかかるコストおよび保管料等による影響は△0.1%程度でした。

◎その他の要因
その他配当・利子収入等による影響は2.8%程度でした。

＜日本債券インデックスマザーファンド＞
ベンチマークは0.6%の上昇となったため、カイ離は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	△0.0%程度	△0.0%程度	0.0%程度	0.0%程度

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

◎組入比率要因
組入比率による影響は△0.0%程度でした。
・公社債の実質の組入比率については、期を通じて概ね100%の水準で推移させ、ベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。そのため、期を通じて現金の保有による影響は軽微でした。
・ポートフォリオについては、主に層化抽出法に基づき運用を行い、ファンドとベンチマークの値動きや推定トラッキングエラーなどについてモニターし必要に応じて調整を図ることでベンチマークとの連動性を維持するよう努めました。結果、種別および年限構成比については、概ねベンチマーク並みとなっており、影響は軽微でした。

◎銘柄選択要因
銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。
・年限構成、種別構成、デュレーション、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7.1%の上昇となったため、カイ離は△0.7%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	△0.6%程度	△0.7%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。

◎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△0.6%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。

＜新興国債券インデックスマザーファンド＞
ベンチマークは15.6%の上昇となったため、カイ離は△1.2%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	△0.4%程度	△0.2%程度	△0.6%程度	△1.2%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△0.4%程度でした。
・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

◎管理コスト等要因
管理コスト等による影響は△0.2%程度でした。
・カストディーフィー、取引コスト、税金等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因
評価時価差異による影響は△0.6%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1.1%の下落となったため、カイ離は0.1%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	0.1%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、2.1%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3.7%の上昇となったため、カイ離は△0.8%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	△0.1%程度	△0.4%程度	△0.3%程度	0.0%程度	△0.8%程度

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

◎売買コスト要因
売買コストによる影響は△0.1%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△0.3%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0.0%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した。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

【分配原資の内訳】　（単位：円、１万口当たり、税込み）

項目		第２期 2017年１月27日～2018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		1,791

（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（マイミッドフィルダー）＞
・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（12%）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＞
・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＞
・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。

＜新興国株式インデックスマザーファンド＞
・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＞
・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＞
・今後の運用についても、運用方針を堅持します。
・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

＜新興国債券インデックスマザーファンド＞
・今後の運用についても、運用方針を堅持します。
・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
・新興国の現地通貨建て国際機関債、および新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価額などが連動する債券に投資することがあります。

＜東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド＞
・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＞
・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

（2017年１月27日～2018年１月26日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	63	0.574	(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）	(28)	(0.253)	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）	(28)	(0.253)	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）	(8)	(0.069)	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	1	0.008	(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)	(0.004)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
（先物・オプション）	(0)	(0.002)	
(c) 有価証券取引税	1	0.007	(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）	(1)	(0.006)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
(d) その他費用	4	0.035	(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）	(3)	(0.029)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（監査費用）	(0)	(0.004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（その他）	(0)	(0.002)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	69	0.624	
期中の平均基準価額は、10,963円です。			

（注）期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注）各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注）売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2017年１月27日～2018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－ＲＥＩＴマザーファンド	80,099	127,654	4,044	6,379
新興国株式インデックスマザーファンド	39,821	96,727	4,113	9,916
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	32,995	84,868	2,787	7,165
新興国債券インデックスマザーファンド	78,844	107,820	4,889	6,586
ＴＯＰＩＸマザーファンド	127,509	221,554	11,174	18,796
外国株式インデックスマザーファンド	86,889	217,641	6,801	16,721
日本債券インデックスマザーファンド	262,358	346,369	15,477	20,433
外国債券インデックスマザーファンド	61,973	125,932	4,866	9,723

○株式売買比率

（2017年１月27日～2018年１月26日）

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期		
	新興国株式インデックスマザーファンド	ＴＯＰＩＸマザーファンド	外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	15,736,603千円	354,350,702千円	301,471,596千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	50,529,858千円	297,623,737千円	338,046,761千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.31	1.19	0.89

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2017年１月27日～2018年１月26日）

利害関係人との取引状況

＜ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）＞

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	161,186	61,772	38.3	193,163	67,392	34.9
貸付有価証券(株式)	357,603	357,603	100.0	380,138	380,138	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 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	%
為替直物取引	228,254	31,726	13.9	238,231	122,704	51.5

平均保有割合　0.0%

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

＜新興国株式インデックスマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	%
為替直物取引	18,937	1,647	8.7	6,184	583	9.4

平均保有割合　0.1%

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

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	%
公社債	364,818	66,751	18.3	339,573	67,898	20.0

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。
（注）公社債には現先などによるものを含みません。

＜外国債券インデックスマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	%
為替直物取引	28,296	9,609	34.0	41,122	6,253	15.2

平均保有割合　0.1%

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

＜新興国債券インデックスマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	%
為替直物取引	5,152	1,435	27.9	2,832	524	18.5

平均保有割合　0.4%

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

＜東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド＞

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	%
投資信託証券	7,128	1,303	18.3	1,845	176	9.5
不動産投信指数先物取引	4,061	4,061	100.0	4,023	4,023	100.0

平均保有割合　0.3%

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

＜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	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	%
為替直物取引	3,191	998	31.3	3,308	827	25.0

平均保有割合　0.4%

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

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
	百万円	百万円	百万円
株式	3,827	4,955	7,987

＜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
	百万円	百万円	百万円
公社債	100	715	1,528

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
	百万円
株式	575

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

種　　類	買　付　額
	百万円
公社債	1,900

＜東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド＞

種　　類	買　付　額
	百万円
投資信託証券	353

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）	54千円
うち利害関係人への支払額（B）	1千円
（B）／（A）	2.8%

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

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2017年１月27日～2018年１月26日）

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

○組入資産の明細

（2018年１月26日現在）

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド	13,827	89,883	142,806
新興国株式インデックスマザーファンド	9,269	44,977	128,344
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	5,255	35,463	95,628
新興国債券インデックスマザーファンド	15,091	89,046	128,797
ＴＯＰＩＸマザーファンド	27,623	143,958	284,001
外国株式インデックスマザーファンド	16,949	97,037	270,025
日本債券インデックスマザーファンド	43,251	290,132	383,526
外国債券インデックスマザーファンド	12,184	69,290	143,591

○有価証券の貸付及び借入の状況

ＴＯＰＩＸマザーファンドにおいて、2018年１月26日現在における貸付株数の総株数は12,698,500株です。
うち利害関係人であるモルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券に対する貸付は、12,698,500株です。

○投資信託財産の構成

（2018年１月26日現在）

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド	142,806	8.9
新興国株式インデックスマザーファンド	128,344	8.0
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	95,628	5.9
新興国債券インデックスマザーファンド	128,797	8.0
ＴＯＰＩＸマザーファンド	284,001	17.6
外国株式インデックスマザーファンド	270,025	16.7
日本債券インデックスマザーファンド	383,526	23.8
外国債券インデックスマザーファンド	143,591	8.9
コール・ローン等、その他	35,939	2.2
投資信託財産総額	1,612,657	100.0

（注）ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（18,390,740千円）の投資信託財産総額（18,563,827千円）に対する比率は99.1%です。

（注）新興国株式インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（73,109,057千円）の投資信託財産総額（74,042,994千円）に対する比率は98.7%です。

（注）新興国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（16,632,531千円）の投資信託財産総額（16,732,605千円）に対する比率は99.4%です。

（注）外国株式インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（415,258,123千円）の投資信託財産総額（431,766,187千円）に対する比率は96.2%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（123,465,071千円）の投資信託財産総額（124,195,948千円）に対する比率は99.4%です。

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

１アメリカドル＝109.78円	１カナダドル＝88.70円	１アルゼンチンペソ＝5.60円	１メキシコペソ＝5.90円
１ブラジルレアル＝34.85円	100チリペソ＝18.33円	100コロンビアペソ＝3.93円	１ペルーヌエボソル＝34.19円
１ウルグアイペソ＝3.87円	１ユーロ＝136.17円	１イギリスポンド＝155.44円	１スイスフラン＝116.59円
１スウェーデンクローネ＝13.86円	１ノルウェークローネ＝14.18円	１デンマーククローネ＝18.29円	１トルコリラ＝29.21円
１チェココルナ＝5.37円	100ハンガリーフォリント＝44.04円	１ポーランドズロチ＝32.86円	１ロシアルーブル＝1.97円
１ルーマニアレイ＝29.12円	１オーストラリアドル＝88.18円	１ニュージーランドドル＝80.36円	１香港ドル＝14.04円
１シンガポールドル＝83.83円	１マレーシアリンギット＝28.24円	１タイバーツ＝3.50円	１フィリピンペソ＝2.16円
100インドネシアルピア＝0.83円	100韓国ウォン＝10.33円	１ニュー台湾ドル＝3.78円	１インドルピー＝1.74円
１アラブディルハム＝29.95円	１イスラエルシェケル＝32.35円	１カタールリアル＝30.21円	１南アフリカランド＝9.21円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年１月26日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,612,657,098
コール・ローン等	35,936,810
MUAM G-REITマザーファンド(評価額)	142,806,185
新興国株式インデックスマザーファンド(評価額)	128,344,243
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド(評価額)	95,628,414
新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)	128,797,557
ＴＯＰＩＸマザーファンド(評価額)	284,001,111
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	270,025,101
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	383,526,268
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	143,591,409
(B) 負債	19,981,238
未払解約金	17,060,038
未払信託報酬	2,900,327
未払利息	53
その他未払費用	20,820
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	1,592,675,860
元本	1,350,710,899
次期繰越損益金	241,964,961
(D) 受益権総口数	1,350,710,899口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	11,791円

＜注記事項＞

①期首元本額　227,836,215円
　期中追加設定元本額　1,456,517,138円
　期中一部解約元本額　333,642,454円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.1791円です。

②分配金の計算過程

項　　目	2017年１月27日～2018年１月26日
費用控除後の配当等収益額	18,116,176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	71,238,220円
収益調整金額	147,306,086円
分配準備積立金額	5,304,479円
当ファンドの分配対象収益額	241,964,961円
１万口当たり収益分配対象額	1,791円
１万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況 (2017年１月27日～2018年１月26日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	△ 5,695
受取利息	75
支払利息	△ 5,770
(B) 有価証券売買損益	93,561,254
売買益	107,243,384
売買損	△ 13,682,130
(C) 信託報酬等	△ 4,201,163
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	89,354,396
(E) 前期繰越損益金	5,304,479
(F) 追加信託差損益金	147,306,086
(配当等相当額)	(48,187,892)
(売買損益相当額)	(99,118,194)
(G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	241,964,961
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ)	241,964,961
追加信託差損益金	147,306,086
(配当等相当額)	(50,464,855)
(売買損益相当額)	(96,841,231)
分配準備積立金	94,658,875

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

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

［お知らせ］

①よりわかりやすい記載を目的として目論見書の特色の分配方針に「分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）」を掲載しました。

②純資産残高増大に応じた信託報酬率の引き下げを行うため、信託約款に所要の変更を行いました。
（2017年４月26日）

③投資対象、運用目的、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的ならびに有価証券の貸付の指図および範囲について、該当する記載の整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
（2017年10月２日）

④当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
（変更前（旧）http://www.am.mufg.jp/　→　変更後（新）https://www.am.mufg.jp/）
（2018年１月１日）

⑤2014年１月１日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15％に2.1％の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315％（所得税15％、復興特別所得税0.315％、地方税５％（法人受益者は15.315％の源泉徴収が行われます。））の税率が適用されます。

ＴＯＰＩＸマザーファンド

《第16期》決算日2017年３月27日

［計算期間：2016年３月26日～2017年３月27日］

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

運用方針	東証株価指数（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	期中騰落率	東証株価指数（TOPIX）	期中騰落率	株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	円	%		%	%	%	百万円
12期(2013年３月25日)	9,935	26.0	1,047.29	22.9	98.8	1.2	221,229
13期(2014年３月25日)	11,255	13.3	1,163.70	11.1	98.7	1.2	221,564
14期(2015年３月25日)	15,711	39.6	1,592.01	36.8	98.4	1.3	245,366
15期(2016年３月25日)	13,743	△12.5	1,366.05	△14.2	98.2	1.9	220,801
16期(2017年３月27日)	15,678	14.1	1,524.39	11.6	98.8	1.0	296,391

(注) 東証株価指数（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	騰落率	東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）	騰落率	株式組入比率	株式先物比率
	円	%		%	%	%
（期　首） 2016年３月25日	13,743	－	1,366.05	－	98.2	1.9
３月末	13,682	△ 0.4	1,347.20	△ 1.4	97.1	2.4
４月末	13,610	△ 1.0	1,340.55	△ 1.9	97.9	1.8
５月末	14,015	2.0	1,379.80	1.0	98.5	1.5
６月末	12,674	△ 7.8	1,245.82	△ 8.8	99.1	1.0
７月末	13,458	△ 2.1	1,322.74	△ 3.2	99.2	0.5
８月末	13,532	△ 1.5	1,329.54	△ 2.7	99.6	0.7
９月末	13,574	△ 1.2	1,322.78	△ 3.2	98.6	1.5
10月末	14,295	4.0	1,393.02	2.0	98.0	1.7
11月末	15,083	9.8	1,469.43	7.6	98.8	1.4
12月末	15,607	13.6	1,518.61	11.2	99.3	0.7
2017年１月末	15,641	13.8	1,521.67	11.4	99.6	0.4
２月末	15,790	14.9	1,535.32	12.4	97.6	1.0
（期　末） 2017年３月27日	15,678	14.1	1,524.39	11.6	98.8	1.0

（注）騰落率は期首比。
（注）「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

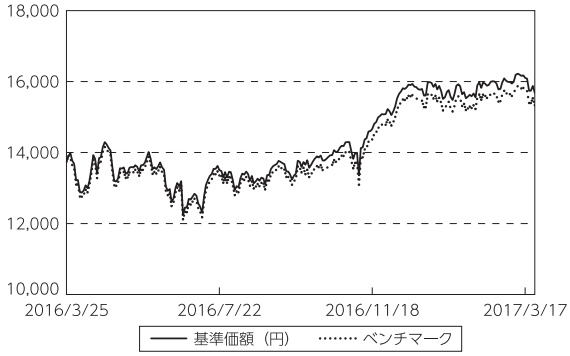
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.1%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（11.6%）を2.5%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内株式市況

・期首から2016年６月下旬にかけては、日本銀行による追加的な金融緩和策がたびたび見送られたことや英国の国民投票で欧州連合（ＥＵ）離脱派が勝利したことなどを受け、国内株式市況は下落しました。

・７月上旬から期末にかけては、国内の参議院選挙で与党が勝利し大規模な経済政策への期待が膨らんだことや、米国次期大統領政権下の経済政策への期待などから米国長期金利が上昇し、円安・米ドル高が進行したことなどにより、国内株式市況は上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

・株式ポートフォリオはベンチマークである東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは11.6%の上昇となったため、カイ離は2.5%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合計
ベンチマークとのカイ離	0.1%程度	△0.0%程度	2.4%程度	2.5%程度

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.1%程度でした。

・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

・期中における先物組入比率の平均は、1.2%程度となりました。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.4%程度でした。

・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

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

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

○今後の運用方針

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2016年３月26日～2017年３月27日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	0	0.002	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(0)	(0.001)	
（先物・オプション）	(0)	(0.002)	
(b) その他費用	0	0.000	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	0	0.002	
期中の平均基準価額は、14,246円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2016年３月26日～2017年３月27日）

株式

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
		千株	千円	千株	千円
国内	上場	142,313 (△ 14,122)	181,579,329 (－)	106,766	136,202,866

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建 新規買付額	買建 決済額	売建 新規売付額	売建 決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	株式先物取引	48,441	50,244	－	－

○株式売買比率

（2016年３月26日～2017年３月27日）

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項　　目	当　　期
(a) 期中の株式売買金額	317,782,195千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	253,968,319千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	1.25

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2016年３月26日～2017年３月27日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	181,579	44,658	24.6	136,202	18,503	13.6
貸付有価証券(株式)	359,800	359,800	100.0	353,818	353,818	100.0

利害関係人の発行する有価証券等

種　　類	買　付　額	売　付　額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	4,110	3,249	7,418

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種　　類	買　付　額
	百万円
株式	112

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項　　目	当　　期
売買委託手数料総額 (A)	6,356千円
うち利害関係人への支払額 (B)	127千円
(B) ／ (A)	2.0%

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

○組入資産の明細

（2017年３月27日現在）

国内株式

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業（0.1%）			
極洋	51	5.8	18,096
日本水産	138.6	191.9	108,999
マルハニチロ	24.6	28	97,300
カネコ種苗	－	5.1	7,354
サカタのタネ	17.8	21.8	76,409
ホクト	12.2	15	31,545
ホクリヨウ	－	1.6	1,308
鉱業（0.3%）			
住石ホールディングス	35.6	41	3,977
日鉄鉱業	33	4.1	23,657
三井松島産業	79	9.1	13,431
国際石油開発帝石	633.7	778.3	837,450
日本海洋掘削	3.6	5.2	12,131
石油資源開発	19.1	23.4	59,085
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	8.1	9.9	17,691
建設業（3.0%）			
ショーボンドホールディングス	12.6	14.3	70,785
ミライト・ホールディングス	37	45.4	51,165
タマホーム	9.1	11.1	6,748
サンヨーホームズ	2.5	3.1	2,142
ファーストコーポレーション	－	2.4	2,469
インベスターズクラウド	－	1.4	6,433
ダイセキ環境ソリューション	2.8	4.1	5,084
安藤・間	80.3	106.2	82,198
東急建設	39.1	52.4	45,640
コムシスホールディングス	51.7	57.7	116,957
ミサワホーム	14.2	17.4	19,227
ビーアールホールディングス	－	14.6	6,000
高松コンストラクショングループ	9.1	11.1	30,047
東建コーポレーション	4.9	5.5	48,455
ソネック	－	1.8	1,269
ヤマウラ	5.7	6.9	4,284
大成建設	625	751	626,334
大林組	360.8	443.1	471,901
清水建設	368	452	457,424
飛島建設	96.6	142.3	24,617
長谷工コーポレーション	140.4	172.4	217,741
松井建設	13.3	16.3	16,463
錢高組	17	21	8,442
鹿島建設	564	649	482,207
不動テトラ	84.9	119.2	24,555
大末建設	4.6	5.2	5,298
鉄建建設	73	90	29,340
西松建設	139	171	97,983
三井住友建設	460.9	566.1	70,196
大豊建設	46	54	29,700
前田建設工業	74	97	98,552
佐田建設	8.4	10.2	4,416
ナカノフドー建設	9.2	11.3	7,458
奥村組	114	122	87,718
東鉄工業	14.4	17.7	57,171
イチケン	13	13	5,902
淺沼組	39	52	17,576
戸田建設	140	172	117,820
熊谷組	176	232	69,368
青木あすなろ建設	7.9	9.7	7,895
北野建設	25	31	9,827
植木組	15	18	4,698
三井ホーム	15	19	11,951
矢作建設工業	16.4	20.1	20,703
ピーエス三菱	14.2	15.6	6,786
日本ハウスホールディングス	24.5	30.1	14,688
大東建託	45	54.4	878,016
新日本建設	14.3	17.6	16,878
ＮＩＰＰＯ	28	34	72,624
東亜道路工業	23	28	9,548
前田道路	38	46	92,736

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本道路	36	44	22,792
東亜建設工業	105	12	24,588
若築建設	69	85	12,750
東洋建設	37.7	42.5	17,722
五洋建設	133.5	163.9	90,472
大林道路	14	15.3	10,373
世紀東急工業	19	21.5	11,889
福田組	19	24	24,264
住友林業	82.8	101.7	178,178
日本基礎技術	13.5	16.4	5,854
日成ビルド工業	33	44	25,432
ヤマダ・エスバイエルホーム	61	75	5,850
巴コーポレーション	14.9	18.4	6,716
パナホーム	45	55	54,065
大和ハウス工業	355.3	436.4	1,396,043
ライト工業	23.1	28.4	32,603
積水ハウス	402.2	464.9	864,946
日特建設	13.3	12.6	5,695
北陸電気工事	4.4	7.2	6,566
ユアテック	19	23	17,940
西部電気工業	10	2.5	5,700
四電工	9	11	4,862
中電工	17.4	18.7	45,609
関電工	48	59	60,298
きんでん	72.7	98.2	153,388
東京エネシス	14	15	14,475
トーエネック	17	21	11,508
住友電設	9.5	10.2	13,464
日本電設工業	19.6	24.1	47,862
協和エクシオ	47.1	57.9	94,434
新日本空調	10.1	11.4	15,743
ＮＤＳ	19	2.3	6,881
九電工	22	28.7	88,970
三機工業	26.7	32.7	32,667
日揮	121	137.9	269,180
中外炉工業	36	45	10,125
ヤマト	10.9	13.2	7,431
太平電業	18	20	22,180
高砂熱学工業	35.9	40.7	65,852

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三晃金属工業	12	1.3	4,348
朝日工業社	14	3.3	11,170
明星工業	21.8	26.7	17,515
大氣社	14.7	19.6	54,840
ダイダン	16	20	21,320
日比谷総合設備	14.5	16.5	27,373
東芝プラントシステム	19.5	24	37,536
ＯＳＪＢホールディングス	24.5	45.1	12,582
東洋エンジニアリング	64	87	24,099
千代田化工建設	87	107	78,431
新興プランテック	24.7	30.3	26,421
食料品（4.6%）			
日本製粉	79	43.9	73,532
日清製粉グループ本社	131.9	162	279,450
日東富士製粉	9	1	4,020
昭和産業	49	61	38,003
鳥越製粉	9.5	11.7	9,441
中部飼料	11.1	16.2	18,597
フィード・ワン	72.4	88.9	17,780
東洋精糖	18	22	2,662
日本甜菜製糖	61	7.5	18,322
三井製糖	47	10.4	28,932
塩水港精糖	12.9	15.8	4,155
日新製糖	5.1	6.3	12,675
森永製菓	108	28.8	151,200
中村屋	28	3.4	17,782
江崎グリコ	27.8	37	205,350
名糖産業	5.3	6.4	9,568
不二家	69	84	21,504
山崎製パン	88	108.2	256,866
第一屋製パン	18	23	2,852
モロゾフ	18	23	13,064
亀田製菓	6.7	8.2	40,754
寿スピリッツ	2.9	10.5	29,631
カルビー	44.6	60.3	235,170
森永乳業	108	133	129,409
六甲バター	5.4	6.6	16,486
ヤクルト本社	64.5	79.2	479,160
明治ホールディングス	71.3	87.5	835,625

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
雪印メグミルク	28.3	31.9	100,485
プリマハム	76	93	46,128
日本ハム	88	100	317,000
伊藤ハム	58	－	－
林兼産業	39	4.7	4,103
丸大食品	62	71	36,068
米久	3.8	－	－
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	7.5	7.9	25,438
伊藤ハム米久ホールディングス	－	85.2	92,697
サッポロホールディングス	184	48.4	145,442
アサヒグループホールディングス	225.7	277.2	1,175,050
キリンホールディングス	487.5	636.1	1,320,225
宝ホールディングス	87.1	106.9	130,524
オエノンホールディングス	33	38	9,462
養命酒製造	3.7	4.6	9,618
コカ・コーラウエスト	40.7	50	175,000
コカ・コーライーストジャパン	42.6	57.5	150,420
サントリー食品インターナショナル	82.4	101.2	474,628
ダイドーグループホールディングス	6.1	6.8	36,380
伊藤園	35.7	43.8	181,113
キーコーヒー	10.6	13	30,446
ユニカフェ	3.2	4	3,872
ジャパンフーズ	1.5	1.9	2,772
日清オイリオグループ	64	85	54,655
不二製油グループ本社	32.1	39.4	104,804
かどや製油	1.2	1.4	8,960
Ｊ－オイルミルズ	50	6.9	29,221
キッコーマン	91	103	352,775
味の素	258	304.3	685,892
キユーピー	61.2	75.2	241,016
ハウス食品グループ本社	41.1	54.7	137,844
カゴメ	43.2	53	156,668
焼津水産化学工業	5.7	6.9	9,156
アリアケジャパン	9.8	12.1	83,611
ピエトロ	1.1	1.7	2,886
エバラ食品工業	2.9	3.5	7,542
ニチレイ	128	72.7	202,905
東洋水産	59.1	72.6	313,269
イートアンド	1.3	1.6	3,713

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大冷	－	1.1	2,035
日清食品ホールディングス	50.9	57.7	374,473
永谷園ホールディングス	11	14	20,692
一正蒲鉾	4.2	5.1	6,456
フジッコ	11.7	14.3	37,208
ロック・フィールド	6.3	14.3	26,569
日本たばこ産業	711.1	818.8	3,050,030
ケンコーマヨネーズ	3.9	6	17,130
わらべや日洋ホールディングス	6.5	8.7	23,307
なとり	6	7.4	14,126
北の達人コーポレーション	1.7	3.2	3,788
ユーグレナ	40.7	47.6	58,881
ミヨシ油脂	41	51	7,191
理研ビタミン	3.5	4.4	18,260
繊維製品（0.7%）			
片倉工業	14.1	17.3	24,773
グンゼ	91	103	45,320
東洋紡	445	547	108,853
ユニチカ	327	378	37,044
富士紡ホールディングス	55	6.7	20,904
倉敷紡績	115	139	34,611
シキボウ	69	74	11,026
日本毛織	34.6	38.9	34,348
ダイトウボウ	16	18	1,386
トーア紡コーポレーション	4.8	5.9	3,203
ダイドーリミテッド	12.7	15.4	6,868
帝国繊維	11.8	14.4	23,673
帝人	460	112.9	241,154
東レ	816	1,002	995,787
サカイオーベックス	30	3.4	6,259
住江織物	28	38	10,792
日本フエルト	6	7.9	4,163
イチカワ	7	9	2,853
日東製網	12	1.5	2,932
芦森工業	24	－	－
アツギ	87	113	15,481
ダイニック	21	26	4,992
セーレン	28	34.4	53,044
ソトー	－	5.1	5,936

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東海染工	16	19	2,755
小松精練	17.3	19.4	13,832
ワコールホールディングス	67	82	114,062
ホギメディカル	7.1	8.7	58,290
レナウン	30.7	37.3	4,177
クラウディア	2.9	3.2	1,721
ＴＳＩホールディングス	50.2	56.9	43,585
三陽商会	63	72	11,952
ナイガイ	41	50	2,900
オンワードホールディングス	75	89	68,886
ルック	20	25	5,450
キムラタン	478	583	4,081
ゴールドウイン	4.8	5.9	35,577
デサント	25.6	31.5	42,493
キング	5.6	6.8	2,815
ヤマトインターナショナル	7	8.5	3,519
パルプ・紙（0.3%）			
特種東海製紙	65	8	36,160
王子ホールディングス	461	540	287,820
日本製紙	58.1	61.9	131,351
三菱製紙	171	19.6	14,445
北越紀州製紙	69.8	77.1	60,369
中越パルプ工業	45	55	13,035
巴川製紙所	17	21	4,977
大王製紙	49.8	55	78,980
阿波製紙	－	2.5	1,535
レンゴー	99	133.2	87,246
トーモク	35	44	15,092
ザ・パック	8	9.8	31,507
化学（6.8%）			
クラレ	177.4	232.4	390,432
旭化成	701	861	920,409
共和レザー	7.4	8	7,168
昭和電工	749	91.9	175,712
住友化学	828	1,017	631,557
日本化成	21	－	－
住友精化	23	5.7	26,305
日産化学工業	67.6	75.7	249,053
ラサ工業	42	52	7,436

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
クレハ	85	10.4	51,324
多木化学	7	9	8,073
テイカ	19	21	15,960
石原産業	202	24.8	27,404
片倉コープアグリ	14	19	4,864
日東エフシー	6.6	8.1	8,432
日本曹達	73	83	51,211
東ソー	303	399	381,843
トクヤマ	186	215	113,305
セントラル硝子	122	141	68,385
東亜合成	70.4	86.5	108,903
大阪ソーダ	48	59	29,500
関東電化工業	27	28	27,244
デンカ	233	286	167,882
信越化学工業	201.7	247.7	2,367,764
日本カーバイド工業	38	47	7,144
堺化学工業	45	52	20,436
エア・ウォーター	93	113.9	232,242
大陽日酸	86.6	106.4	139,171
日本化学工業	42	51	12,393
日本パーカライジング	57.5	70.6	96,933
高圧ガス工業	17	20.5	15,088
チタン工業	13	16	3,136
四国化成工業	16	20	25,080
戸田工業	22	27	7,344
ステラ　ケミファ	5.7	6.6	20,691
保土谷化学工業	34	4.8	17,256
日本触媒	16.3	21.7	164,920
大日精化工業	43	57	42,978
カネカ	152	186	157,356
三菱瓦斯化学	193	128.7	293,049
三井化学	477	628	346,028
ＪＳＲ	105.5	138.8	269,133
東京応化工業	22.6	25.8	92,364
大阪有機化学工業	8	8.9	7,992
三菱ケミカルホールディングス	753.2	930.4	789,444
ＫＨネオケム	－	16.9	22,882
日本合成化学工業	26	－	－
ダイセル	158.1	186.2	246,715

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
住友ベークライト	105	122	81,618
積水化学工業	255.3	313.5	589,693
日本ゼオン	97	116	142,216
アイカ工業	33.8	44.3	131,881
宇部興産	602	696	185,832
積水樹脂	17.3	21.3	39,383
タキロン	26	29	17,139
旭有機材	36	45	10,890
日立化成	55.6	76.8	238,080
ニチバン	11	14	12,922
リケンテクノス	18.3	29.8	16,300
大倉工業	27	33	18,480
積水化成品工業	29	19.6	15,640
群栄化学工業	30	3.3	11,814
タイガースポリマー	5.5	6.8	4,916
ミライアル	4	5	5,120
ダイキアクシス	2.1	2.3	3,898
ダイキョーニシカワ	14.5	24.2	34,025
日本化薬	73	90	137,250
カーリットホールディングス	10.4	12.8	7,692
日本精化	9.3	11.4	11,400
扶桑化学工業	7.1	9.8	31,556
ＡＤＥＫＡ	55.3	59.4	95,574
日油	86	107	125,618
新日本理化	17.9	21.8	3,204
ハリマ化成グループ	9.6	11.7	9,289
花王	302.4	350.8	2,148,299
第一工業製薬	25	31	13,392
日華化学	－	4.4	4,589
ニイタカ	1.6	2	3,616
三洋化成工業	35	8.7	40,368
有機合成薬品工業	－	9	2,709
大日本塗料	64	79	18,723
日本ペイントホールディングス	86.8	106.6	412,009
関西ペイント	127.2	145.1	334,165
神東塗料	8	10	2,160
中国塗料	32	39.6	32,036
日本特殊塗料	7.9	9.7	16,548
藤倉化成	15.3	18.8	12,238

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
太陽ホールディングス	8.2	11.2	55,328
ＤＩＣ	444	54.5	223,450
サカタインクス	23	28.2	43,033
東洋インキＳＣホールディングス	111	136	74,800
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	8.1	10	10,760
富士フイルムホールディングス	257.3	273.9	1,208,172
資生堂	213.3	262	772,114
ライオン	130	171	348,840
高砂香料工業	7.4	9.1	32,623
マンダム	10.5	13.8	72,864
ミルボン	6.6	7.5	42,750
ファンケル	26.1	29.4	49,009
コーセー	18.2	22.3	226,345
コタ	3.5	5.2	7,670
シーズ・ホールディングス	14.2	17.9	61,039
シーボン	1.3	1.6	4,166
ポーラ・オルビスホールディングス	11.5	14.1	149,601
ノエビアホールディングス	7.1	8.7	39,498
アジュバンコスメジャパン	2.1	2.6	2,407
エステー	7.7	9.4	17,690
アグロ　カネショウ	4.4	5.4	7,268
コニシ	8.8	21.7	29,598
長谷川香料	14.2	17.5	38,482
星光ＰＭＣ	6.1	7.6	10,351
小林製薬	17	38.3	207,203
荒川化学工業	9.6	11.8	23,788
メック	8.7	10.7	13,171
日本高純度化学	3.2	3.9	9,878
タカラバイオ	－	29.6	45,021
ＪＣＵ	3.3	4.3	33,110
新田ゼラチン	7.3	8.3	6,498
ＯＡＴアグリオ	1	1.6	2,246
デクセリアルズ	25.2	36.2	42,390
アース製薬	8.1	9.9	58,311
イハラケミカル工業	17.3	19.1	19,233
北興化学工業	12	14	6,440
大成ラミック	3.2	4.3	12,289
クミアイ化学工業	23.2	28.5	18,325
日本農薬	25.7	31.5	21,892

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アキレス	92	11.3	19,978
有沢製作所	16.6	23.3	18,057
日東電工	86.9	99.6	852,974
レック	3.5	4.3	20,532
きもと	18.4	24.7	5,681
藤森工業	9.6	10.3	32,290
前澤化成工業	7.9	9	10,665
ＪＳＰ	7.3	6.4	16,876
エフピコ	10	12.2	61,488
天馬	8.6	9.1	19,009
信越ポリマー	22	27.1	21,381
東リ	29	32.8	12,923
ニフコ	21.5	24.2	136,246
日本バルカー工業	44	10.7	20,554
ユニ・チャーム	227.6	279.6	734,229
医薬品（4.8%）			
協和発酵キリン	134.5	165.2	288,769
武田薬品工業	447.8	517.7	2,689,451
アステラス製薬	1,259	1,410.8	2,116,200
大日本住友製薬	79.6	97.7	184,555
塩野義製薬	163.9	175.2	1,014,408
田辺三菱製薬	131	160.9	371,679
わかもと製薬	13	16	4,176
あすか製薬	14.3	15	25,050
日本新薬	25.8	31.6	182,964
ビオフェルミン製薬	1.8	2.2	6,831
中外製薬	111.9	137.5	529,375
科研製薬	19.4	25.8	167,958
エーザイ	138.4	170	1,007,760
ロート製薬	55	67.6	145,880
小野薬品工業	51.1	313.6	739,155
久光製薬	34.9	39	246,090
有機合成薬品工業	7	－	－
持田製薬	7.7	9.4	80,464
参天製薬	207	249.4	418,493
扶桑薬品工業	38	4.6	13,261
日本ケミファ	16	1.9	10,051
ツムラ	35.4	46.4	162,632
日医工	26.3	32.3	55,265
キッセイ薬品工業	19.9	24.5	75,215
生化学工業	21.5	25.6	48,358
栄研化学	9.4	11.6	35,844
日水製薬	4.5	5.5	8,200
鳥居薬品	7.7	9.4	26,790
ＪＣＲファーマ	8.6	10.6	25,800
東和薬品	5.2	6.3	35,217
富士製薬工業	3.1	4.5	14,535
沢井製薬	19.1	23.4	143,208
ゼリア新薬工業	23	28.3	50,006
第一三共	378.1	406.4	1,037,336
キョーリン製薬ホールディングス	30	33.8	80,883
大幸薬品	5.5	6.9	13,110
ダイト	4.7	8.2	18,753
大塚ホールディングス	241.7	296.9	1,516,862
大正製薬ホールディングス	27	29.5	268,745
ペプチドリーム	13.8	25.8	136,224
石油・石炭製品（0.5%）			
日本コークス工業	90.7	111.4	11,028
昭和シェル石油	113.1	123.4	133,518
ニチレキ	13.7	16.9	15,717
東燃ゼネラル石油	170	225	297,000
ユシロ化学工業	6	7.4	10,197
ビーピー・カストロール	4.6	5.6	9,240
富士石油	26.1	32	11,552
ＭＯＲＥＳＣＯ	3.5	4.7	7,896
出光興産	58.7	65.5	247,917
ＪＸホールディングス	1,330.9	1,532.4	807,574
コスモエネルギーホールディングス	33.9	41.6	78,624
ゴム製品（1.0%）			
横浜ゴム	67.8	83.3	182,427
東洋ゴム工業	50.9	72.9	139,457
ブリヂストン	379.5	466	2,085,816
住友ゴム工業	105.2	129.2	238,890
藤倉ゴム工業	9.5	11.5	7,900
オカモト	35	42	45,654
フコク	4.1	5.8	5,533
ニッタ	12.1	12.4	39,246
住友理工	24.3	25.6	29,542

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三ツ星ベルト	27	34	35,020
バンドー化学	41	25.1	25,175
ガラス・土石製品（1.0%）			
日東紡績	74	112	60,368
旭硝子	593	680	614,720
日本板硝子	542	62.9	50,131
石塚硝子	16	19	4,408
日本山村硝子	45	55	11,110
日本電気硝子	232	285	194,655
オハラ	4.2	5.2	6,692
住友大阪セメント	223	256	124,416
太平洋セメント	701	833	317,373
デイ・シイ	10.5	－	－
日本ヒューム	10.8	13.2	9,160
日本コンクリート工業	23.1	30.7	11,236
三谷セキサン	5.6	6.9	18,498
アジアパイルホールディングス	13.9	17	10,676
東海カーボン	97	128.9	62,645
日本カーボン	55	68	21,624
東洋炭素	6.2	7.6	14,120
ノリタケカンパニーリミテド	63	7.8	22,776
ＴＯＴＯ	82.6	101.4	431,964
日本碍子	142	174.3	429,300
日本特殊陶業	96.9	119	295,358
ダントーホールディングス	13	11	2,013
ＭＡＲＵＷＡ	4.1	5.1	20,247
品川リフラクトリーズ	28	35	10,500
黒崎播磨	24	30	13,560
ヨータイ	6	8	3,096
イソライト工業	5.6	6.8	3,060
東京窯業	13.8	16.8	3,561
ニッカトー	4	4.5	2,002
フジミインコーポレーテッド	9.9	11.7	26,172
エーアンドエーマテリアル	23	29	3,799
ニチアス	57	72	81,360
ニチハ	14.9	18.3	59,475
鉄鋼（1.3%）			
新日鐵住金	506.8	622.5	1,589,553
神戸製鋼所	2,065	238.7	238,700
中山製鋼所	126	15.5	11,315
合同製鐵	63	7.7	13,598
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	307.2	377.3	722,152
日新製鋼	51.3	63	89,019
東京製鐵	62	69.8	64,216
共英製鋼	12	14.7	29,355
大和工業	24.8	27.7	81,576
東京鐵鋼	23	29	12,818
大阪製鐵	7	8.7	17,904
淀川製鋼所	16.7	19.1	58,637
東洋鋼鈑	26.9	33	12,903
丸一鋼管	37.6	46.2	151,998
モリ工業	18	4.4	9,737
大同特殊鋼	188	231	121,044
日本高周波鋼業	44	48	4,080
日本冶金工業	82.7	114.2	23,982
山陽特殊製鋼	67	82	49,692
愛知製鋼	66	8.1	36,814
日立金属	128.7	140.5	215,386
日本金属	29	3.3	4,851
大平洋金属	78	88	34,232
新日本電工	63.6	78.1	26,710
栗本鐵工所	54	6.6	14,394
虹技	16	19	4,427
日本鋳鉄管	12	13	2,600
三菱製鋼	78	96	23,136
日亜鋼業	15.5	19.1	5,309
日本精線	8	9	6,048
シンニッタン	10.1	11.3	7,910
新家工業	22	30	6,630
非鉄金属（1.0%）			
大紀アルミニウム工業所	17	23	11,569
日本軽金属ホールディングス	254.4	355.3	88,825
三井金属鉱業	286	375	137,625
東邦亜鉛	59	78	42,276
三菱マテリアル	701	86.1	291,018
住友金属鉱山	310	357	562,810
ＤＯＷＡホールディングス	145	152	121,904
古河機械金属	175	215	46,010

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エス・サイエンス	51.5	62.7	2,508
大阪チタニウムテクノロジーズ	11	15.1	25,473
東邦チタニウム	19	23.3	19,735
ＵＡＣＪ	157	178	49,484
古河電気工業	353	46.3	180,801
住友電気工業	449.9	520	948,480
フジクラ	156	181.7	141,362
昭和電線ホールディングス	134	164	14,104
東京特殊電線	1.6	2	3,386
タツタ電線	23.4	25.8	13,003
沖電線	13	14	3,262
カナレ電気	1.8	1.9	4,204
平河ヒューテック	5.3	6.5	7,436
リョービ	68	84	40,908
アーレスティ	13	16	18,464
アサヒホールディングス	16.9	20.8	42,140
金属製品（0.7%）			
稲葉製作所	6	7.3	9,723
宮地エンジニアリンググループ	35	40	9,000
トーカロ	7.9	9.1	27,272
アルファＣｏ	3.7	4.6	8,008
ＳＵＭＣＯ	88	144.1	247,275
川田テクノロジーズ	2.1	2.6	19,188
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	－	0.5	3,040
東洋製罐グループホールディングス	79.9	98.1	184,231
ホッカンホールディングス	29	36	18,648
コロナ	5.9	7.2	8,395
横河ブリッジホールディングス	21.3	24.2	32,331
駒井ハルテック	20	2.6	5,881
高田機工	10	12	3,396
三和ホールディングス	113.8	137	141,795
文化シヤッター	31.3	38.4	31,910
三協立山	14.7	18.1	30,335
アルインコ	6.3	9.5	9,509
東洋シヤッター	2.8	3.4	2,155
ＬＩＸＩＬグループ	156.5	192.2	566,605
日本フイルコン	8.2	10	5,570
ノーリツ	22	27	57,240
長府製作所	12	14.7	39,513

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
リンナイ	20.9	23.5	218,080
ダイニチ工業	5.7	7	5,152
日東精工	16	19.6	9,290
三洋工業	14	17	3,604
岡部	23.3	28.6	28,857
ジーテクト	11.7	14.4	28,612
中国工業	1.7	2	1,392
東プレ	21.6	26.5	75,286
高周波熱錬	20.9	25.6	23,628
東京製綱	76	9.3	16,079
サンコール	6	7.3	4,109
モリテック　スチール	5.7	6.9	2,118
パイオラックス	5.7	7	53,690
日本発條	105.8	129.9	161,076
中央発條	14	16	5,504
アドバネクス	2.1	2.4	3,700
立川ブラインド工業	4.7	5.7	5,221
三益半導体工業	8.3	11.6	19,522
機械（5.2%）			
日本ドライケミカル	1.4	1.8	4,375
日本製鋼所	186	45.6	83,037
三浦工業	50.1	56.4	101,181
タクマ	42	44.2	45,128
ツガミ	32	37	26,307
オークマ	73	90	112,320
東芝機械	61	82	37,556
アマダホールディングス	163.9	185.8	234,108
アイダエンジニアリング	29.5	39.2	41,395
滝澤鉄工所	35	40	7,160
富士機械製造	36.7	42.1	60,792
牧野フライス製作所	56	69	68,724
オーエスジー	51.2	62.9	145,047
ダイジェット工業	13	16	2,896
旭ダイヤモンド工業	30.8	39.5	32,982
ＤＭＧ森精機	62	81.6	141,494
ソディック	21.4	35	38,745
ディスコ	14.3	16.1	269,675
日東工器	6.5	8	20,608
パンチ工業	4.4	5	5,920

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
豊和工業	6.3	7.7	5,428
ＯＫＫ	43	50	6,100
石川製作所	28	3.4	2,879
東洋機械金属	8.4	9.3	5,142
津田駒工業	27	31	5,270
エンシュウ	28	34	3,094
島精機製作所	15.9	18	76,050
ＮＣホールディングス	－	4.5	4,054
フリュー	1.7	8.1	12,198
ヤマシンフィルタ	－	2.7	6,739
日阪製作所	14.2	18.8	17,972
やまびこ	20.6	25.3	34,306
ペガサスミシン製造	11.6	13.2	12,051
ナブテスコ	58.4	71.7	215,817
三井海洋開発	13.2	13.9	31,344
レオン自動機	9.5	11.6	12,052
ＳＭＣ	33.7	41.4	1,355,022
新川	10	11.5	9,407
ホソカワミクロン	19	23	19,918
ユニオンツール	4.9	6	21,270
オイレス工業	14.5	17.8	37,931
日精エー・エス・ビー機械	4.1	4.4	11,470
サトーホールディングス	15.1	17.2	41,864
日本エアーテック	3.9	4.5	4,045
日精樹脂工業	8.2	10.9	12,240
オカダアイヨン	－	2.9	3,419
ワイエイシイ	4.5	5.1	6,497
小松製作所	550.8	636.7	1,873,489
住友重機械工業	328	403	315,952
日立建機	50.2	61.6	173,157
日工	17	4.1	8,441
巴工業	4.6	5.6	10,091
井関農機	115	141	32,571
ＴＯＷＡ	10.8	11.3	22,328
丸山製作所	23	29	5,394
北川鉄工所	51	6.3	13,960
ローツェ	－	4.9	15,631
タカキタ	2.8	4.6	2,562
クボタ	539.5	660.5	1,107,988

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
荏原実業	3.4	3.8	5,392
三菱化工機	37	45	9,765
月島機械	21.3	26.2	30,942
帝国電機製作所	8.2	10	10,730
東京機械製作所	43	52	3,432
新東工業	25.5	31.3	30,141
澁谷工業	9.4	11.5	35,765
アイチ　コーポレーション	15.9	19.5	16,672
小森コーポレーション	27.3	33.2	48,737
鶴見製作所	8.3	10.3	16,356
住友精密工業	18	22	7,788
酒井重工業	21	26	8,970
荏原製作所	248	62.5	212,187
石井鐵工所	16	2	3,512
酉島製作所	12	13.5	14,607
北越工業	12.1	14.8	15,362
ダイキン工業	156.3	180	1,999,800
オルガノ	19	26	13,156
トーヨーカネツ	60	63	19,530
栗田工業	67.5	78.1	214,462
椿本チエイン	64	78	73,788
大同工業	22	27	8,181
日本コンベヤ	37	－	－
木村化工機	9.7	11.8	3,917
アネスト岩田	18.1	23.9	24,210
ダイフク	57.7	65.8	181,410
サムコ	1.8	3.3	3,204
加藤製作所	25	7.2	20,174
油研工業	21	26	6,292
タダノ	52	68.9	94,461
フジテック	31.3	38.4	48,844
ＣＫＤ	29.9	39.5	55,142
キトー	13.5	16.6	19,090
平和	33.3	40.9	121,227
理想科学工業	11.9	13.1	26,828
ＳＡＮＫＹＯ	29.9	36.7	142,763
日本金銭機械	9.9	12.1	17,702
マースエンジニアリング	6.1	7.4	17,626
福島工業	6.6	8.1	31,914

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
オーイズミ	4.5	5.5	3,404
ダイコク電機	4.4	5.4	9,363
竹内製作所	15.9	24.1	50,176
アマノ	33.2	40.8	90,004
ＪＵＫＩ	15.9	20.8	26,291
サンデンホールディングス	65	80	28,320
蛇の目ミシン工業	10.4	12.8	10,252
マックス	17	20	30,920
グローリー	36.6	42.1	158,717
新晃工業	7.5	9.2	15,124
大和冷機工業	17.2	21.2	24,846
セガサミーホールディングス	115.4	130.8	206,664
日本ピストンリング	4.5	5.1	13,127
リケン	50	6.1	30,378
ＴＰＲ	13.2	14.8	53,798
ツバキ・ナカシマ	9.9	14.8	27,616
ホシザキ	23.5	28.9	251,719
大豊工業	8.7	10.7	17,087
日本精工	220.5	270.8	434,092
ＮＴＮ	266	305	171,410
ジェイテクト	114.4	140.5	247,280
不二越	100	133	75,943
日本トムソン	37	42.1	25,765
ＴＨＫ	71.4	93.2	264,222
ユーシン精機	4.2	5.8	17,075
前澤給装工業	4.4	5	7,940
イーグル工業	13.3	14.3	21,492
前澤工業	7.9	8.8	2,904
日本ピラー工業	10.9	13.3	20,322
キッツ	52.2	63.3	47,538
日立工機	28.7	34.9	30,223
マキタ	70	86	661,340
日立造船	85.1	104.5	66,357
三菱重工業	1,912	2,210	1,018,810
ＩＨＩ	825	1,013	346,446
スター精密	－	23.1	38,877
電気機器（12.7%）			
日清紡ホールディングス	59.6	73.2	83,082
イビデン	65.7	92.3	157,648
コニカミノルタ	268.1	308.7	312,713
ブラザー工業	138.8	170.4	393,794
ミネベアミツミ	173	239.9	362,968
日立製作所	2,739	3,166	1,920,812
東芝	2,260	2,949	644,061
三菱電機	1,145	1,406.5	2,268,684
富士電機	323	397	256,859
東洋電機製造	21	5.6	9,632
安川電機	133.3	152.9	343,260
シンフォニアテクノロジー	70	85	26,945
明電舎	99	121	48,158
オリジン電気	16	19	5,814
山洋電気	28	35	28,805
デンヨー	9.9	12.2	21,118
東芝テック	77	83	51,875
芝浦メカトロニクス	17	21	5,964
マブチモーター	30.7	37.2	231,756
日本電産	129.2	170.9	1,745,743
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	－	1.5	4,695
東光高岳	6	6.7	13,748
ダブル・スコープ	3.2	12.7	20,662
宮越ホールディングス	3.7	4.5	2,200
ダイヘン	63	72	52,560
田淵電機	12.2	19.9	6,726
ヤーマン	1.4	1.7	8,959
ＪＶＣケンウッド	78.8	96.7	27,946
ミマキエンジニアリング	7.2	11.8	7,776
第一精工	4.5	6.2	10,912
日新電機	25.2	26.5	33,549
大崎電気工業	20	26	25,766
オムロン	121.2	140.1	691,393
日東工業	17.2	19.4	29,682
ＩＤＥＣ	14	17.2	21,104
不二電機工業	1	1.4	1,789
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	207	254	131,826
サクサホールディングス	27	33	7,194
メルコホールディングス	5.9	7.3	24,455
テクノメディカ	2.4	3	6,510
日本電気	1,476	1,813	502,201

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
富士通	1,035	1,271	844,452
沖電気工業	465	57.1	94,728
岩崎通信機	50	58	5,046
電気興業	28	37	21,201
サンケン電気	59	77	36,498
ナカヨ	10	14	5,180
アイホン	6.1	7.5	13,575
ルネサスエレクトロニクス	55.6	68.3	81,481
セイコーエプソン	159.9	196.3	463,268
ワコム	84.5	102.3	41,738
アルバック	19.7	22.2	116,328
アクセル	4.8	5.5	4,460
ＥＩＺＯ	10.6	13	42,510
ジャパンディスプレイ	200.5	246.2	60,811
日本信号	29.6	36.4	36,472
京三製作所	25	31	13,299
能美防災	12.2	14.9	23,035
ホーチキ	7.8	9.6	14,304
エレコム	9.3	11.4	24,692
日本無線	28	8.1	10,740
パナソニック	1,226.5	1,514.256	1,810,293
シャープ	907	－	－
アンリツ	64.5	96.1	83,799
富士通ゼネラル	33	45	100,665
日立国際電気	24.6	34.5	85,974
ソニー	757.5	931	3,330,187
ＴＤＫ	64.8	74.3	519,357
帝国通信工業	25	29	5,684
ミツミ電機	40.8	－	－
タムラ製作所	41	51	23,460
アルプス電気	91.1	121.7	391,265
池上通信機	34	42	6,174
パイオニア	173.7	198.1	44,176
日本電波工業	9.7	12.7	10,337
鈴木	3.1	5.1	3,299
日本トリム	2.9	3.2	12,304
ローランド　ディー．ジー．	5.3	6.7	22,478
フォスター電機	13.5	15.4	28,490
クラリオン	57	69	31,188

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＳＭＫ	32	34	13,702
ヨコオ	7.6	9.4	13,724
東光	22	－	－
ティアック	78	95	3,800
ホシデン	32.5	40	43,120
ヒロセ電機	17.3	21.3	332,067
日本航空電子工業	31	38	55,442
ＴＯＡ	12.7	15.6	14,679
日立マクセル	17.8	19.7	40,266
古野電気	12.8	17	12,308
ユニデンホールディングス	34	39	6,864
アルパイン	25.6	31.4	50,145
スミダコーポレーション	8.8	10.8	18,284
アイコム	5.9	7.3	18,673
リオン	4.1	5	7,935
本多通信工業	－	4.2	5,854
船井電機	10.8	14.8	14,415
横河電機	107.5	143	254,683
新電元工業	38	51	24,225
アズビル	35.1	40	150,600
東亜ディーケーケー	4.5	6.5	3,718
日本光電工業	44.9	55.1	139,182
チノー	3.8	4.7	5,889
共和電業	13.2	14.9	7,077
日本電子材料	4.3	5.2	3,281
堀場製作所	19.8	26.1	159,732
アドバンテスト	73.2	89.9	175,844
小野測器	5.2	6.4	5,100
エスペック	11.1	11.7	16,520
パナソニック　デバイスＳＵＮＸ	9.4	－	－
キーエンス	24.3	59.7	2,623,815
日置電機	5.6	6.9	15,973
シスメックス	83.3	102.5	691,875
日本マイクロニクス	14	24.6	22,361
メガチップス	11.2	12.3	38,130
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	7	7.7	36,806
澤藤電機	6	8	4,616
コーセル	14.9	18.3	26,974
イリソ電子工業	－	4.2	29,526

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
新日本無線	7.9	11.2	5,286
オプテックスグループ	7.9	10	30,550
千代田インテグレ	5.7	6.9	16,380
アイ・オー・データ機器	－	4.1	4,428
レーザーテック	12.6	14.5	42,543
スタンレー電気	77	94	297,980
岩崎電気	37	48	8,448
ウシオ電機	65.2	80	113,600
岡谷電機産業	5.8	7	2,912
ヘリオス　テクノ　ホールディング	9.2	12.1	7,598
日本セラミック	6.1	10.8	26,276
遠藤照明	5.4	6.7	6,157
日本デジタル研究所	9.1	－	－
古河電池	8	9	6,840
双信電機	5.2	6.4	1,952
山一電機	9.3	12.4	19,269
図研	7.8	8.6	11,438
日本電子	42	48	26,112
カシオ計算機	107.6	106	165,466
ファナック	109.8	133.7	3,040,338
日本シイエムケイ	23.1	28.4	19,936
エンプラス	5.5	6	18,570
大真空	20	4.8	6,811
ローム	52.9	63.7	469,469
浜松ホトニクス	83.8	102.9	333,910
三井ハイテック	15.6	17.4	19,818
新光電気工業	40.6	49.8	37,748
京セラ	176.2	216.4	1,334,322
太陽誘電	52.2	64.1	89,419
村田製作所	112.6	138.3	2,156,097
ユーシン	14.2	17.7	13,044
双葉電子工業	18.4	21.6	44,668
北陸電気工業	43	53	7,314
ニチコン	33.8	41.5	44,031
日本ケミコン	87	114	41,610
ＫＯＡ	14.8	18.2	26,717
市光工業	26	28	15,988
小糸製作所	64.3	79	457,410
ミツバ	18.2	24.3	50,033

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
スター精密	20.4	－	－
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	110	27	212,490
キヤノン電子	9.8	12.1	21,586
キヤノン	578	709.8	2,456,617
リコー	347.6	396.4	369,048
ＭＵＴＯＨホールディングス	13	18	4,770
東京エレクトロン	88.1	87.9	1,024,035
輸送用機器（9.2%）			
トヨタ紡織	37.5	46.1	117,370
芦森工業	－	30	4,800
鬼怒川ゴム工業	25	－	－
ユニプレス	22.3	25.4	57,607
豊田自動織機	97.8	120.1	656,947
モリタホールディングス	18.8	23	38,939
三櫻工業	13.6	16.7	13,927
デンソー	265.2	325.1	1,634,602
東海理化電機製作所	31.4	34.7	78,630
三井造船	415	476	86,156
川崎重工業	835	1,026	346,788
名村造船所	32.2	39.6	26,967
サノヤスホールディングス	13.2	16	4,704
日本車輌製造	44	48	14,592
ニチユ三菱フォークリフト	12.5	15.7	11,162
近畿車輛	16	2	5,002
日産自動車	1,506.9	1,555.1	1,747,932
いすゞ自動車	311.1	382.1	571,812
トヨタ自動車	1,335.2	1,603	9,871,274
日野自動車	153.2	188.2	260,657
三菱自動車工業	426.3	483.2	324,710
エフテック	5.6	7	9,989
レシップホールディングス	3.5	4.3	3,698
ＧＭＢ	1.7	2.1	3,244
ファルテック	1.9	2.3	3,314
武蔵精密工業	11.4	15.3	43,803
日産車体	52.4	57.9	60,158
新明和工業	47	53	58,671
極東開発工業	21.4	26.2	48,496
日信工業	24	29.5	58,233
トピー工業	88	10.8	31,968

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ティラド	42	51	17,340
曙ブレーキ工業	54.4	61.2	21,542
タチエス	17	22.4	49,011
ＮＯＫ	51.9	63.8	164,093
フタバ産業	32.7	40.2	31,918
ＫＹＢ	120	148	86,432
シロキ工業	27	－	－
大同メタル工業	15	16.6	16,865
プレス工業	57	70	38,500
ミクニ	10.3	16.7	7,865
カルソニックカンセイ	82	40	51,200
太平洋工業	23.8	27.1	40,189
ケーヒン	24.7	30.3	55,236
河西工業	13.2	17.8	25,258
アイシン精機	108	120.6	654,858
富士機工	12.5	13.1	7,322
マツダ	339.9	417.5	650,673
ダイハツ工業	128.1	－	－
今仙電機製作所	9.8	12.1	12,136
本田技研工業	966.1	1,186.5	4,022,235
スズキ	224.4	261.3	1,212,170
富士重工業	339.2	409.4	1,684,271
安永	3.6	4.8	8,136
ヤマハ発動機	151.6	186.2	489,147
ショーワ	27.9	34.2	32,045
ＴＢＫ	12.9	16.9	8,669
エクセディ	14.6	17.9	57,996
豊田合成	39	42.6	122,347
愛三工業	18.8	23.1	21,945
盟和産業	1.3	2	2,558
ヨロズ	10	12.3	21,586
エフ・シー・シー	17.5	21.6	48,470
シマノ	43.3	53.1	900,045
タカタ	19.4	23.8	10,971
テイ・エス　テック	24.9	30.6	91,953
ジャムコ	4.7	7.7	18,872
精密機器（1.6%）			
テルモ	164.6	202.1	784,148
クリエートメディック	3.5	4.4	4,228

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日機装	38.6	45.6	54,811
島津製作所	138	169.7	304,272
ＪＭＳ	20	24	8,184
クボテック	2.3	2.8	1,534
モリテックス	2.3	－	－
長野計器	6.5	10.3	7,591
ブイ・テクノロジー	2.6	2.7	45,306
東京計器	34	45	10,440
愛知時計電機	14	1.7	6,358
オーバル	10.6	12.9	3,483
東京精密	20.7	25.5	90,652
マニー	9.8	17.5	45,255
ニコン	200.4	229.8	375,493
トプコン	36	66.4	138,444
オリンパス	159.9	210.4	894,200
理研計器	8.7	11.6	19,430
タムロン	8.7	11.7	23,470
ＨＯＹＡ	249.8	271.3	1,465,291
ノーリツ鋼機	9.7	13.3	11,743
エー・アンド・デイ	9.8	12	5,664
シチズン時計	132.1	144.3	105,194
リズム時計工業	47	53	9,964
大研医器	8.5	11.7	9,594
メニコン	5.4	9	31,590
松風	5.2	6.9	9,356
セイコーホールディングス	69	93	43,989
ニプロ	80	91.3	144,345
その他製品（1.9%）			
スノーピーク	0.9	2	6,210
パラマウントベッドホールディングス	11.3	12.6	57,645
トランザクション	1.6	5.8	6,090
ＳＨＯ－ＢＩ	3.6	4.4	2,019
ニホンフラッシュ	3.1	6.2	8,568
前田工繊	11.8	13.2	18,585
永大産業	15	17	8,976
アートネイチャー	8.6	14.1	10,998
ダンロップスポーツ	6.8	8.3	8,698
バンダイナムコホールディングス	111	145.4	501,630
アイフィスジャパン	1.8	2.9	1,252

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
共立印刷	17.8	21.9	7,818
ＳＨＯＥＩ	5.2	5.9	17,481
フランスベッドホールディングス	15	16.5	15,856
パイロットコーポレーション	18.7	23	103,845
萩原工業	2.2	3.7	9,812
トッパン・フォームズ	19.2	23.5	25,474
フジシールインターナショナル	13	29.6	71,602
タカラトミー	35.3	51.2	59,443
廣済堂	10.1	13.3	5,147
Ａｓ－ｍｅエステール	2.9	3.5	2,516
アーク	45.6	55.5	5,605
タカノ	4.7	5.8	5,834
プロネクサス	10	12.3	15,633
ホクシン	8.6	9.3	1,860
ウッドワン	20	22	6,600
大建工業	42	9.3	19,641
凸版印刷	303	372	425,568
大日本印刷	318	380	458,280
図書印刷	20	18	9,126
共同印刷	36	41	15,170
日本写真印刷	18	22.1	61,504
光村印刷	11	12	3,216
宝印刷	5.2	6.9	11,488
アシックス	100	131	234,883
ツツミ	5.4	4.9	10,206
小松ウオール工業	3.6	4.5	8,563
ヤマハ	78.9	88.8	276,168
河合楽器製作所	4	5.2	12,376
クリナップ	12.6	15.5	12,958
ピジョン	60.8	79.7	284,529
兼松サステック	11	14	3,388
キングジム	8.9	11	9,570
リンテック	25.5	31.3	75,213
ＴＡＳＡＫＩ	2	3.6	7,833
イトーキ	22.6	27.8	19,682
任天堂	66.1	81.2	2,183,062
三菱鉛筆	8	10.9	59,841
タカラスタンダード	44	27.2	49,449
コクヨ	55.8	68.5	98,914

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ナカバヤシ	22	24	6,792
グローブライド	5.2	6.4	12,345
岡村製作所	37.5	46	45,862
美津濃	58	71	42,245
アデランス	18.6	－	－
電気・ガス業（1.8%）			
東京電力ホールディングス	910.7	1,118.4	466,372
中部電力	328.5	434.4	641,608
関西電力	438.1	538	688,371
中国電力	148.4	182.3	232,614
北陸電力	105.2	129.2	140,957
東北電力	268.2	329.4	491,794
四国電力	96.7	118.7	140,778
九州電力	237.1	291.2	346,528
北海道電力	100.5	123.4	101,188
沖縄電力	11.4	19.4	51,235
電源開発	91.5	104.9	270,642
エフオン	－	4.9	4,385
イーレックス	2.1	16.6	19,936
東京瓦斯	1,198	1,414	720,998
大阪瓦斯	1,111	1,279	560,202
東邦瓦斯	271	330	263,010
北海道瓦斯	26	32	8,992
広島ガス	18.7	27.1	10,216
西部瓦斯	121	148	38,480
静岡ガス	30.5	40.6	31,302
メタウォーター	6.9	7.4	21,356
陸運業（4.2%）			
ＳＢＳホールディングス	10.6	13	10,608
東武鉄道	574	705	415,245
相鉄ホールディングス	184	211	111,619
東京急行電鉄	625	716	582,824
京浜急行電鉄	294	361	463,163
小田急電鉄	344	211.2	472,243
京王電鉄	300	368	337,456
京成電鉄	161	98.8	259,745
富士急行	29	36	36,180
新京成電鉄	14	17	7,089
東日本旅客鉄道	196.3	255.1	2,490,796

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
西日本旅客鉄道	103.3	126.9	945,405
東海旅客鉄道	96.1	109.6	2,031,436
西武ホールディングス	85.5	182.1	343,804
鴻池運輸	15.2	18.6	25,500
西日本鉄道	139	158	76,156
ハマキョウレックス	8.2	8.6	19,685
サカイ引越センター	4.2	4.5	14,377
近鉄グループホールディングス	1,080	1,327	554,686
阪急阪神ホールディングス	720	166.6	623,917
南海電気鉄道	241	279	158,472
京阪ホールディングス	241	295	207,680
神戸電鉄	26	32	12,544
名古屋鉄道	391	480	247,680
山陽電気鉄道	39	48	28,800
日本通運	415	510	297,330
ヤマトホールディングス	198.4	235.8	565,684
山九	141	174	120,756
丸運	5.8	7.1	1,838
丸全昭和運輸	36	44	19,492
センコー	48	62.6	46,073
トナミホールディングス	22	27	10,773
ニッコンホールディングス	35.1	44.7	107,369
日本石油輸送	12	1.5	3,903
福山通運	65	80	54,720
セイノーホールディングス	76.1	93.5	118,090
神奈川中央交通	13	15	11,040
日立物流	22.4	27.5	65,340
丸和運輸機関	2.4	3.3	8,490
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	10.3	13.7	21,098
九州旅客鉄道	－	98.3	354,863
海運業（0.2%）			
日本郵船	964	1,114	261,790
商船三井	523	691	241,850
川崎汽船	470	500	151,000
ＮＳユナイテッド海運	48	59	14,691
明治海運	9.7	11.8	5,664
飯野海運	55.5	68.2	32,804
共栄タンカー	9	11	2,662
乾汽船	8.5	9.6	8,928

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
空運業（0.6%）			
日本航空	205.5	237.6	862,250
ＡＮＡホールディングス	1,993	2,447	853,758
パスコ	10	12	4,332
倉庫・運輸関連業（0.2%）			
トランコム	3.1	3.8	20,938
日新	44	54	20,304
三菱倉庫	76	86	135,450
三井倉庫ホールディングス	62	76	25,156
住友倉庫	78	96	60,960
澁澤倉庫	28	34	12,444
東陽倉庫	18	22.5	6,840
日本トランスシティ	25	30	14,580
ケイヒン	20	24	3,960
中央倉庫	6.2	7.6	8,580
安田倉庫	8.3	10.3	7,992
東洋埠頭	31	38	6,992
宇徳	8.8	10.7	4,665
上組	128	157	157,314
サンリツ	2.6	3.2	1,680
キムラユニティー	2.7	3.3	3,940
キユーソー流通システム	3	4.2	11,709
郵船ロジスティクス	9.9	12.1	13,552
近鉄エクスプレス	19.2	23.6	40,143
東海運	5.8	7.1	3,294
エーアイテイー	4.9	8.1	8,059
内外トランスライン	2.7	3.9	4,325
情報・通信業（7.8%）			
ＮＥＣネッツエスアイ	13.3	14.3	31,188
システナ	10.3	10.4	17,825
デジタルアーツ	5.2	5.8	17,661
新日鉄住金ソリューションズ	17.7	21.7	51,168
キューブシステム	4.6	5.6	3,847
コア	4.5	5.5	7,513
ソフトクリエイトホールディングス	3.8	6.2	8,066
ＴＩＳ	35.1	43.1	124,128
ネオス	3.1	3.9	1,762
電算システム	3.7	4.5	7,222
グリー	64.3	79.2	58,924

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コーエーテクモホールディングス	25.1	30.9	67,300
三菱総合研究所	4.1	5	16,325
ボルテージ	2.1	2.3	2,789
電算	1.2	1.4	3,438
ＡＧＳ	1.8	3.3	5,854
ファインデックス	7	9.6	9,580
ヒト・コミュニケーションズ	2.4	2.9	5,295
ブレインパッド	1.6	2.8	3,105
ＫＬａｂ	16.4	24.9	20,841
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ	7	9.4	11,110
イーブックイニシアティブジャパン	2.3	2	2,206
ネクソン	101.3	142.4	243,504
アイスタイル	16.1	27.4	24,851
エムアップ	2.7	3.7	3,285
エイチーム	3.9	7.2	19,087
テクノスジャパン	1.1	10	10,620
ｅｎｉｓｈ	3.1	3.8	2,124
コロプラ	29.4	36.5	37,668
モバイルクリエイト	7	9.5	3,486
オルトプラス	3.9	5.4	4,833
ブロードリーフ	10.9	32.1	22,951
ハーツユナイテッドグループ	3.2	6.8	10,540
メディアドゥ	－	2.8	6,731
ブイキューブ	5.2	7.1	4,338
サイバーリンクス	1.2	2	2,028
ディー・エル・イー	－	4.3	2,592
フィックスターズ	－	1.9	6,232
ＶＯＹＡＧＥ　ＧＲＯＵＰ	2.4	4.4	7,686
オプティム	0.7	1.4	7,896
セレス	－	2.3	3,417
ベリサーブ	1.2	1.5	4,234
ティーガイア	10.5	12.9	25,503
日本アジアグループ	9	14.7	5,821
豆蔵ホールディングス	8.3	9.5	8,170
テクマトリックス	4.5	8.1	10,570
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	185.1	272.8	67,381
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	9.2	10.6	59,890
ザッパラス	6	6.7	3,329
システムリサーチ	－	1.3	2,719

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
インターネットイニシアティブ	17.1	19.1	38,257
さくらインターネット	5.2	10.6	9,752
ＧＭＯクラウド	2.3	2.9	6,452
ＳＲＡホールディングス	6.1	6.9	20,417
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	1.5	2.9	3,906
システムインテグレータ	1.5	1.8	1,236
朝日ネット	9.6	11.8	6,029
アドソル日進	－	2.6	3,200
フリービット	－	7.2	6,357
コムチュア	1.8	2.2	8,602
サイバーコム	－	1.7	1,667
メディカル・データ・ビジョン	－	2.2	8,239
ｇｕｍｉ	10.9	14.7	17,007
ショーケース・ティービー	－	1.5	1,842
ＰＣＩホールディングス	－	1.5	3,972
パイプドHD	1.3	2.3	2,589
アイビーシー	－	1	993
オープンドア	－	1.3	4,082
ＬＩＮＥ	－	21.8	89,162
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	－	10.6	8,829
ソルクシーズ	－	3.7	2,094
フェイス	2.8	3.4	4,294
ハイマックス	1.4	1.7	2,590
野村総合研究所	74.3	97.3	401,362
サイバネットシステム	8.6	10.6	7,441
ＣＥホールディングス	1.6	2	2,180
インテージホールディングス	5.5	7.4	15,303
東邦システムサイエンス	3.1	4.3	2,975
ソースネクスト	5.3	7.8	4,547
ティー・ワイ・オー	14.7	－	－
フォーカスシステムズ	－	5	3,000
クレスコ	2.4	2.9	8,024
フジ・メディア・ホールディングス	110.3	135.5	207,721
オービック	36.5	44.9	238,868
ジャストシステム	19.3	21	27,447
ＴＤＣソフトウェアエンジニアリング	2.3	5.7	7,866
ヤフー	759.4	932.7	478,475
トレンドマイクロ	51.4	68.9	332,098
インフォメーション・ディベロプメント	2	3.7	4,551

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本オラクル	17	20.9	131,461
アルファシステムズ	3.5	4.3	8,539
フューチャー	12.7	17.6	15,188
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	7.9	9.7	10,223
ソフトバンク・テクノロジー	2.9	3.1	11,795
トーセ	2.8	3.5	2,828
オービックビジネスコンサルタント	5.4	6.6	36,498
伊藤忠テクノソリューションズ	24	29.5	95,875
アイティフォー	13.7	16.9	10,832
東計電算	1.9	2.3	5,191
エックスネット	1	1.2	2,432
大塚商会	28.5	35	204,050
サイボウズ	14.2	17.3	7,629
ソフトブレーン	15.6	17.7	9,150
電通国際情報サービス	6.5	8	19,792
デジタルガレージ	－	18.9	43,110
ＥＭシステムズ	1.8	4.4	7,739
ウェザーニューズ	3.6	4.4	15,818
ＣＩＪ	9.7	10.9	6,027
東洋ビジネスエンジニアリング	1.1	1.3	2,173
日本エンタープライズ	10.9	13.3	3,737
WOWOW	5	6.2	24,614
スカラ	6	9	7,920
日本コロムビア	3.6	3.9	2,609
イマジカ・ロボット　ホールディングス	9	10.9	7,619
ネットワンシステムズ	45.9	56.3	52,302
システムソフト	－	23	3,450
アルゴグラフィックス	4.8	5.9	14,502
マーベラス	17.9	21.9	20,060
エイベックス・グループ・ホールディングス	19.5	23.9	38,502
日本ユニシス	29.2	35.9	54,065
兼松エレクトロニクス	6.7	8.2	23,058
東京放送ホールディングス	63.5	85.8	167,224
日本テレビホールディングス	96.7	118.8	233,085
朝日放送	10.5	12.8	10,355
テレビ朝日ホールディングス	28.9	35.5	76,076
スカパーＪＳＡＴホールディングス	80.4	84.6	40,692
テレビ東京ホールディングス	9.6	10.6	27,019
日本ＢＳ放送	1.8	2.9	3,079

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ビジョン	－	1.5	6,052
Ｕ－ＮＥＸＴ	2.5	3.4	3,168
ワイヤレスゲート	－	4.5	6,669
コネクシオ	9.3	11.4	19,357
日本通信	56.2	108.8	20,672
クロップス	1.9	2.8	1,820
日本電信電話	819	1,044.6	5,149,878
ＫＤＤＩ	1,076.4	1,287.4	3,826,152
光通信	12.7	15.6	170,664
ＮＴＴドコモ	817.2	972.4	2,601,656
エムティーアイ	13.6	19.9	13,551
ＧＭＯインターネット	39.3	47.5	62,367
カドカワ	33.1	37.7	60,433
学研ホールディングス	35	43	13,416
ゼンリン	14	17.2	38,270
昭文社	5.8	7.1	5,062
インプレスホールディングス	8.8	10.7	1,476
アイネット	5.9	7.3	9,198
松竹	70	86	111,800
東宝	75.6	85.1	253,427
東映	39	48	46,176
ＡＯＩ　Ｐｒｏ．	5.3	－	－
エヌ・ティ・ティ・データ	65.5	80.4	422,100
ピー・シー・エー	1.3	1.9	3,171
ビジネスブレイン太田昭和	1.6	2.2	2,314
ＤＴＳ	11.8	13.4	37,077
スクウェア・エニックス・ホールディングス	44.8	50.1	164,578
シーイーシー	6.9	7.7	15,869
カプコン	27.1	30.5	68,045
アイ・エス・ビー	1.3	2.5	2,252
ジャステック	6.7	8.2	8,519
ＳＣＳＫ	25.2	35.4	156,114
日本システムウエア	4	4.3	6,071
アイネス	15	16.4	18,154
ＴＫＣ	9.8	12	38,280
富士ソフト	15.7	19.3	54,792
ＮＳＤ	22.5	27.6	45,760
コナミホールディングス	47.8	58.7	284,108
福井コンピュータホールディングス	2.3	3.8	10,377

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＪＢＣＣホールディングス	8.9	10.9	8,665
ミロク情報サービス	7.8	9.6	17,520
ソフトバンクグループ	600.3	585.8	4,605,559
卸売業（4.5%）			
ホウスイ	8	10	1,280
高千穂交易	4.1	5	5,175
伊藤忠食品	2.6	3.2	15,264
エレマテック	4.9	5.2	10,280
ＪＡＬＵＸ	3.4	4.2	11,277
あらた	4.8	5.8	17,806
トーメンデバイス	1.6	1.9	4,246
東京エレクトロン　デバイス	3.8	4.7	7,750
フィールズ	6.9	9.9	12,345
双日	667.5	768.5	217,485
アルフレッサ　ホールディングス	133.2	153.9	300,105
横浜冷凍	26.2	32.2	35,613
神栄	15	18	3,528
山下医科器械	0.9	1	1,829
ラサ商事	5	5.6	4,345
ラクーン	－	6.2	3,019
アルコニックス	6	7.4	13,083
神戸物産	6.8	7	30,450
あい　ホールディングス	18.9	18.5	47,841
ディーブイエックス	2.8	4.6	6,118
ダイワボウホールディングス	96	110	37,180
マクニカ・富士エレホールディングス	19.1	24.1	38,945
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18.4	24.4	25,132
八洲電機	8.2	10	6,710
ＵＫＣホールディングス	6.8	8.4	17,102
ＯＣＨＩホールディングス	3.1	3.8	5,445
ＴＯＫＡＩホールディングス	46.6	57.2	49,535
大阪工機	－	1.5	1,170
三洋貿易	5.8	7.1	12,559
ビューティガレージ	－	1.3	2,389
ウイン・パートナーズ	3.8	9.4	9,353
ミタチ産業	2.7	3	1,935
シップヘルスケアホールディングス	21.5	25	77,125
明治電機工業	3.3	4.4	5,825
デリカフーズ	2.2	2.7	2,975

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
スターティア	2	2.9	1,481
コメダホールディングス	－	17.6	31,451
富士興産	4.1	4.7	2,382
協栄産業	14	16	2,656
小野建	9.2	11.3	16,339
佐鳥電機	8.4	9.6	7,833
エコートレーディング	2.4	3	1,995
伯東	8	8.9	9,620
コンドーテック	8.4	10.3	9,579
中山福	6.6	7.4	6,386
ナガイレーベン	15.3	18.8	42,995
三菱食品	11.6	14.3	50,765
松田産業	7.7	9.5	15,029
第一興商	18.7	21.2	96,566
メディパルホールディングス	106	130.1	227,024
アドヴァン	10.8	－	－
ＳＰＫ	2.4	2.8	7,176
萩原電気	2.7	4.4	9,477
アズワン	8.3	10.2	50,133
スズデン	3.4	4.7	5,395
尾家産業	3.4	4.2	5,082
シモジマ	7.3	7.9	9,519
ドウシシャ	12.5	15.3	32,130
小津産業	2.3	2.8	6,280
高速	6.3	7.7	8,647
たけびし	3.7	4.5	6,817
黒田電気	19.7	17.8	44,802
リックス	－	2.9	4,895
丸文	9.4	11.5	8,349
ハピネット	9.6	10.8	18,856
橋本総業ホールディングス	2.2	2.7	4,028
日本ライフライン	－	11.1	23,598
エクセル	5.1	5.6	8,422
マルカキカイ	3.4	4.2	7,539
ＩＤＯＭ	28.5	35	24,185
日本エム・ディ・エム	8.8	9.8	7,448
進和	6.2	7.7	14,529
エスケイジャパン	2.6	2.4	744
ダイトロン	4.8	5.9	6,584

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
シークス	6.7	9.3	40,734
田中商事	3.2	4	2,784
オーハシテクニカ	6	7.3	10,373
白銅	3	3.3	5,850
伊藤忠商事	831.5	953.1	1,526,389
丸紅	1,042.8	1,280.7	887,012
高島	20	22	4,576
長瀬産業	63.7	78.2	122,383
蝶理	6.7	8.3	16,292
豊田通商	118	144.9	483,241
三共生興	16.1	19.7	8,254
兼松	225	277	54,569
ツカモトコーポレーション	19	23	2,921
三井物産	958.1	1,176.8	1,914,653
日本紙パルプ商事	55	68	26,656
日立ハイテクノロジーズ	36.7	45.1	203,852
カメイ	13.8	16.9	21,412
東都水産	17	2	3,984
ＯＵＧホールディングス	15	20	5,300
スターゼン	3.8	5.4	25,542
山善	40.7	49.9	50,997
椿本興業	12	15	6,240
住友商事	667	819.2	1,223,475
内田洋行	26	6.4	16,518
三菱商事	795	976.4	2,365,329
第一実業	24	30	21,450
キヤノンマーケティングジャパン	30.2	37.1	81,137
西華産業	35	42	15,498
佐藤商事	9.4	11.6	10,695
菱洋エレクトロ	12.2	12.4	20,571
東京産業	10.6	12.9	6,166
ユアサ商事	10	12.3	38,068
神鋼商事	24	3.3	8,170
小林産業	7.1	9.5	2,631
阪和興業	106	130	104,520
カナデン	10.1	12.4	13,776
菱電商事	17	21	15,687
フルサト工業	5.8	7.2	12,924
岩谷産業	126	144	94,608

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
すてきナイスグループ	45	55	8,580
昭光通商	38	46	3,910
ニチモウ	16	19	3,515
極東貿易	15	20	4,840
イワキ	16	20	6,040
三愛石油	27	34.9	32,875
稲畑産業	25.4	31.2	44,023
ＧＳＩクレオス	28	32	4,288
明和産業	9.8	12	4,944
ワキタ	22.5	27.7	29,417
東邦ホールディングス	33.9	41.7	98,120
サンゲツ	36.9	44.6	84,517
ミツウロコグループホールディングス	17	20.9	14,985
シナネンホールディングス	23	5.6	12,644
伊藤忠エネクス	27.3	28.7	26,432
サンリオ	32.7	40.1	85,493
サンワテクノス	6.7	7.7	8,855
リョーサン	16.8	19.3	67,260
新光商事	12.4	14.2	17,835
トーホー	4.8	5.9	15,511
三信電気	14.6	14.4	19,339
東陽テクニカ	15	16	16,176
モスフードサービス	13.9	17	56,780
加賀電子	9.6	11.8	23,529
ソーダニッカ	11	13.4	7,048
立花エレテック	7.8	8.8	12,267
フォーバル	4.2	5.7	3,853
ＰＡＬＴＡＣ	16.9	20.8	65,416
三谷産業	11.3	13.8	5,285
太平洋興発	44	54	5,562
ヤマタネ	49	6.5	10,159
丸紅建材リース	9	13	3,107
日鉄住金物産	70	11.4	52,326
トラスコ中山	12.1	29.7	75,913
オートバックスセブン	40.6	48.2	81,554
モリト	—	10.4	9,599
加藤産業	16.5	20.3	59,763
イノテック	9.8	11.2	7,492
イエローハット	10	12.3	31,770

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＪＫホールディングス	10.6	13	8,723
日伝	4.4	5.4	18,738
北沢産業	8.8	10.7	2,332
杉本商事	6.1	7.5	11,662
因幡電機産業	14.8	18.3	74,481
バイテックホールディングス	3.2	5.3	7,340
ミスミグループ本社	119	146.3	290,551
アルテック	9.1	11.1	2,331
タキヒヨー	18	20	9,040
蔵王産業	1.7	2.1	3,192
スズケン	48.2	59.2	220,224
ジェコス	7.3	8.9	9,790
ルネサスイーストン	6.7	11.9	7,259
小売業（4.6%）			
ローソン	40.1	41.1	313,182
サンエー	7.2	9.8	49,686
ダイユーエイト	2.8	－	－
カワチ薬品	8.2	10.1	30,956
エービーシー・マート	13.7	23.7	155,946
ハードオフコーポレーション	5.1	5.7	6,703
アスクル	12.9	13.6	42,976
ゲオホールディングス	20.1	21.7	27,559
アダストリア	19.5	20	56,220
ジーフット	6.4	7.8	5,959
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	15	1.7	1,200
くらコーポレーション	6.2	8.5	38,845
キャンドゥ	5.6	6.9	12,213
パルグループホールディングス	6.2	6.6	17,298
エディオン	44.8	50.4	54,180
サーラコーポレーション	9.1	16.2	10,108
ワッツ	4.2	5.6	7,274
ハローズ	3.2	4.3	9,636
あみやき亭	2.1	2.5	11,162
ひらまつ	14.6	17.9	12,207
ゲンキー	2.1	2.6	18,200
サッポロドラッグストアー	1	－	－
大黒天物産	2.5	3.1	15,484
ハニーズホールディングス	9.3	12.6	14,086
ファーマライズホールディングス	2.4	3	1,581

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アルペン	9.4	9.9	19,364
クオール	10.8	14.7	23,446
ジェイアイエヌ	7.2	8.8	51,392
ビックカメラ	54.7	74.7	78,061
ＤＣＭホールディングス	52.1	79	80,185
ＭｏｎｏｔａＲＯ	37.4	46.1	153,513
東京一番フーズ	1.8	3.2	1,875
ダイヤモンドダイニング	1.7	2.9	4,756
きちり	2.8	3.5	2,303
アークランドサービスホールディングス	3.3	4.1	12,320
Ｊ．フロント　リテイリング	134.1	164.6	274,882
ドトール・日レスホールディングス	18.6	22.8	50,638
マツモトキヨシホールディングス	21.9	24.6	132,594
ブロンコビリー	4.1	6.8	19,876
スタートトゥデイ	32.2	118.8	275,734
トレジャー・ファクトリー	3	3.7	2,937
物語コーポレーション	2.8	3.7	18,352
ココカラファイン	11	13.6	63,172
三越伊勢丹ホールディングス	210.7	258.9	329,579
Ｈａｍｅｅ	－	2.9	2,897
ウエルシアホールディングス	9.2	25.7	82,625
クリエイトＳＤホールディングス	15.6	19.1	51,856
丸善ＣＨＩホールディングス	12.4	15.2	5,411
ミサワ	1.2	2.3	1,021
ティーライフ	－	1.2	2,076
エー・ピーカンパニー	1.7	2.1	1,902
チムニー	2.6	4	11,204
シュッピン	3	4.9	8,138
ネクステージ	1.7	2.5	6,590
ジョイフル本田	17.2	21.1	78,175
鳥貴族	－	3.2	7,404
キリン堂ホールディングス	3.4	4.2	3,452
ホットランド	2.8	6	7,158
すかいらーく	32.4	55.8	95,920
綿半ホールディングス	3	5.2	8,860
ヨシックス	－	1.3	1,753
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	35.1	43.1	44,091
ブックオフコーポレーション	6	7.4	5,979
ゴルフダイジェスト・オンライン	2.2	5.2	4,076

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
マルシェ	2.6	2.9	2,453
ドンキホーテホールディングス	68.5	84.2	325,433
西松屋チェーン	20.9	22.8	28,682
ゼンショーホールディングス	54.5	67.4	127,992
幸楽苑ホールディングス	6.7	8.2	14,661
ハークスレイ	2.9	3.2	3,756
サイゼリヤ	17.4	21.4	60,283
ＶＴホールディングス	35.8	44	26,444
魚力	3.3	4	5,304
ポプラ	2.7	3.2	1,699
フジ・コーポレーション	－	1.9	4,377
ユナイテッドアローズ	15.1	17.3	55,619
ハイデイ日高	9.6	14.2	33,767
京都きもの友禅	7.2	8.2	8,241
コロワイド	35.1	43.1	80,467
ピーシーデポコーポレーション	8.8	17.2	9,081
壱番屋	4.8	9.1	34,398
トップカルチャー	3.8	4.7	2,270
ＰＬＡＮＴ	2.4	2.9	3,419
スギホールディングス	19	28.5	149,625
ヴィア・ホールディングス	－	9.9	11,741
スクロール	16	19.7	7,052
ヨンドシーホールディングス	8.1	9.9	24,561
ユニー・ファミリーマートホールディングス	32.6	57.1	387,709
木曽路	13	15.9	40,910
サトレストランシステムズ	12.5	15.3	13,571
千趣会	20.9	23.5	19,058
タカキュー	8.2	10	1,970
ケーヨー	17.8	21.9	12,373
上新電機	25	31	35,464
日本瓦斯	12.1	23.9	76,599
ベスト電器	34.4	41.9	6,075
ロイヤルホールディングス	17.6	21.4	47,957
東天紅	8	11	1,804
いなげや	11.8	14.5	23,214
島忠	27.4	33.7	93,247
チヨダ	12.5	15.3	40,193
ライフコーポレーション	6.7	9.8	30,870
リンガーハット	9.6	14.6	33,288

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東洋証券	41	46	12,098
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	121.6	149.3	91,222
光世証券	25	31	5,890
水戸証券	32.8	40.3	12,412
いちよし証券	23.7	29.1	25,317
松井証券	53.9	74.3	67,167
だいこう証券ビジネス	5.1	6.3	4,044
マネックスグループ	124.7	139.6	38,390
カブドットコム証券	93.9	97.9	36,614
極東証券	14.2	17.4	29,562
岩井コスモホールディングス	10	12.3	14,538
藍澤證券	14.9	24.3	16,110
マネースクウェアＨＤ	3.6	－	－
マネーパートナーズグループ	9.8	16.6	7,851
小林洋行	3.1	3.7	1,102
保険業（2.7%）			
かんぽ生命保険	32.3	49.1	130,606
ＳＯＭＰＯホールディングス	235.4	272.1	1,129,759
アニコム　ホールディングス	7.2	8.8	19,967
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホール	316.6	388.9	1,420,262
ソニーフィナンシャルホールディングス	101.5	124.7	232,066
第一生命ホールディングス	678.9	784.7	1,587,840
東京海上ホールディングス	429.3	527.2	2,521,070
Ｔ＆Ｄホールディングス	386.2	474.3	782,120
アドバンスクリエイト	－	3	5,817
その他金融業（1.2%）			
全国保証	27.5	36.6	143,472
クレディセゾン	80.4	98.7	199,768
アクリーティブ	8.8	10.7	3,873
芙蓉総合リース	12.1	14.9	76,586
興銀リース	19.9	24.4	59,755
東京センチュリー	24.9	26.2	102,049
日本証券金融	46.7	57.3	34,781
アイフル	177.4	218.2	70,478
ポケットカード	10.6	9.7	5,936
リコーリース	8.3	10.2	37,689
イオンフィナンシャルサービス	69.5	83.1	181,158
アコム	212.8	264.4	117,922
ジャックス	58	72	34,560

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
オリエントコーポレーション	458.1	281.4	56,842
日立キャピタル	25	30.7	84,946
アプラスフィナンシャル	50.8	62.4	6,739
オリックス	750.3	921.5	1,549,041
三菱ＵＦＪリース	268.8	330.1	184,195
日本取引所グループ	311.1	404.6	653,833
イー・ギャランティ	3.4	3.8	9,446
アサックス	1.8	2.3	3,744
ＮＥＣキャピタルソリューション	4.3	5.3	9,237
不動産業（2.4%）			
いちご	87.9	123.7	41,563
日本駐車場開発	115.8	156.9	23,221
ヒューリック	220.9	271.4	290,669
三栄建築設計	4.2	5.2	7,893
野村不動産ホールディングス	70.3	86.4	158,976
三重交通グループホールディングス	18.8	23.1	9,101
サムティ	5.7	10.4	11,492
ディア・ライフ	5.4	8.9	3,542
エー・ディー・ワークス	73.4	119.3	4,772
日本商業開発	3.5	7.2	13,795
プレサンスコーポレーション	3.6	20.2	28,320
ユニゾホールディングス	6.6	10.7	30,805
ＴＨＥグローバル社	－	4.5	2,137
日本管理センター	6.9	9.3	12,824
サンセイランディック	2.4	2.7	2,114
エストラスト	1.9	2.3	1,508
フージャースホールディングス	14.7	16.8	10,466
オープンハウス	15.3	18.8	51,474
東急不動産ホールディングス	256.3	314.8	193,602
飯田グループホールディングス	98.1	108.5	195,083
ムゲンエステート	－	4.5	3,627
ファーストブラザーズ	－	1.3	2,285
ハウスドゥ	－	1.6	2,585
シーアールイー	－	1.8	2,818
ケイアイスター不動産	－	2.6	4,206
エコナックホールディングス	34	49	3,038
パーク２４	53.5	66	193,314
パラカ	3.7	3.7	8,125
三井不動産	562	690	1,651,170

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三菱地所	788	968	2,001,824
平和不動産	20	24.6	38,031
東京建物	115.7	151	222,272
ダイビル	27.3	33.5	33,768
京阪神ビルディング	17.5	21.6	13,478
住友不動産	254	312	911,040
大京	197	242	56,144
テーオーシー	41.1	50.4	47,577
東京楽天地	17	21	11,193
レオパレス２１	124.8	164.2	96,057
スターツコーポレーション	12.1	13.3	31,547
フジ住宅	13.5	16.6	12,632
空港施設	12.8	15.7	9,184
明和地所	5.8	7.1	5,545
住友不動産販売	7.6	11.7	41,944
ゴールドクレスト	8.3	11.7	23,388
日本エスリード	4.1	5.1	8,058
日神不動産	14.2	15.4	9,009
日本エスコン	－	17.3	7,041
タカラレーベン	46.2	56.7	29,030
サンヨーハウジング名古屋	6	6.7	6,525
イオンモール	68.4	83.8	144,555
ファースト住建	3.9	4.8	7,238
ランド	49.9	123.4	2,221
トーセイ	16.1	17.8	13,296
穴吹興産	12	1.4	3,847
エヌ・ティ・ティ都市開発	65.8	80.8	80,153
サンフロンティア不動産	12.8	14	14,028
エフ・ジェー・ネクスト	9.2	11.3	11,831
インテリックス	－	3	2,439
ランドビジネス	7.2	7.7	2,233
グランディハウス	9.3	11.4	4,959
日本空港ビルデング	33.8	41.5	169,320
サービス業（3.7%）			
日本工営	38	9.2	27,563
ネクスト	31.7	34	25,738
ジェイエイシーリクルートメント	5.2	8.5	15,062
日本M＆Aセンター	17.3	39.7	145,699
ノバレーゼ	2.9	－	－

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アコーディア・ゴルフ	31.1	－	－
中広	1.1	1.3	904
タケエイ	9.8	12.1	12,584
トラスト・テック	2.3	5.6	9,979
コシダカホールディングス	－	4.7	11,284
パソナグループ	9.7	10.2	8,109
ＣＤＳ	2.5	3.1	3,196
リンクアンドモチベーション	22.8	32.4	19,796
ＧＣＡ	9.9	12.2	11,394
エス・エム・エス	14	19.5	53,196
テンプホールディングス	78.6	106.6	216,824
リニカル	6.6	8.1	12,117
クックパッド	25	30.7	29,072
エスクリ	4.7	4.9	3,885
アイ・ケイ・ケイ	6	6.1	4,867
学情	4.1	5.7	6,817
スタジオアリス	5.2	5.6	12,992
シミックホールディングス	5	7	9,828
ＮＪＳ	2.3	3.1	4,185
綜合警備保障	37.4	50.1	211,672
カカクコム	81.3	98.2	150,933
アイロムグループ	3.2	4.2	5,493
セントケア・ホールディング	－	1.8	3,036
サイネックス	－	1	1,132
ルネサンス	5.7	7	13,181
ディップ	12.4	17.8	42,186
オプトホールディング	7	9.9	10,404
新日本科学	10.7	15.3	8,812
ツクイ	13.3	32.6	21,483
キャリアデザインセンター	3.1	2.9	3,297
エムスリー	97.1	119.3	321,513
ツカダ・グローバルホールディング	8.2	10	6,130
アウトソーシング	5.2	8.1	33,048
ウェルネット	4.2	10.3	13,884
ワールドホールディングス	－	3.1	6,646
ディー・エヌ・エー	50.3	61.7	143,761
博報堂ＤＹホールディングス	155.4	190.9	254,660
ぐるなび	13	19.9	45,491
エスアールジータカミヤ	9.1	14.8	8,376

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ジャパンベストレスキューシステム	12.8	17	4,386
ファンコミュニケーションズ	25.9	35	28,770
ライク	2.3	2.5	6,475
ビジネス・ブレークスルー	－	4.4	1,878
ＷＤＢホールディングス	4	4.9	6,698
ティア	4.7	6.6	5,141
バリューコマース	10.4	12.7	5,384
インフォマート	16.2	58.4	37,376
ＪＰホールディングス	27.8	39.6	11,761
ＥＰＳホールディングス	12.5	17.1	26,727
レッグス	1.6	3.1	2,325
プレステージ・インターナショナル	9.4	19.5	19,071
アミューズ	3.1	7.6	17,632
ドリームインキュベータ	3.7	4.2	8,950
クイック	5.7	7	8,302
ＴＡＣ	6.2	7.6	1,748
ケネディクス	150.5	174.6	78,046
電通	125	153.5	924,070
テイクアンドギヴ・ニーズ	5.3	6.4	6,073
ぴあ	3.3	4.2	12,936
イオンファンタジー	3.9	4	10,864
シーティーエス	2.5	7.3	5,058
ネクシィーズグループ	4	4.9	8,173
みらかホールディングス	28.6	35.2	183,392
アルプス技研	4.1	5.5	20,900
サニックス	18.1	22	4,136
ダイオーズ	2	2.5	2,670
日本空調サービス	5.5	13.2	8,844
オリエンタルランド	121.2	148.9	942,388
ダスキン	31.7	35.3	87,791
明光ネットワークジャパン	13	17.1	21,272
ファルコホールディングス	4.9	6.5	10,348
秀英予備校	2	2.7	1,382
田谷	1.9	2.3	1,564
ラウンドワン	35	43	38,012
リゾートトラスト	47	53.3	107,292
ビー・エム・エル	6.6	18	45,216
ワタベウェディング	3.3	2	1,180
りらいあコミュニケーションズ	18.5	22.8	25,102

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
リソー教育	20.8	23.4	15,093
早稲田アカデミー	1.5	1.8	2,332
ユー・エス・エス	135.7	166.7	317,063
東京個別指導学院	5.4	4.4	7,229
サイバーエージェント	27.4	72.5	238,887
楽天	524.6	703.7	755,070
クリーク・アンド・リバー社	－	4.9	4,723
テー・オー・ダブリュー	6.7	11	7,843
セントラルスポーツ	3.8	4.7	17,037
フルキャストホールディングス	10.3	14.2	15,151
リソルホールディングス	11	14	5,166
テクノプロ・ホールディングス	18.2	22.4	93,184
アトラ	－	1.6	1,081
インターワークス	1.5	2.8	3,049
ＫｅｅＰｅｒ技研	－	1.5	2,863
ファーストロジック	－	0.7	1,856
デザインワン・ジャパン	－	1.8	2,703
イー・ガーディアン	－	4.5	7,537
リブセンス	7.6	9.2	4,692
ジャパンマテリアル	4.7	10	17,030
ベクトル	3.5	11.2	14,884
ウチヤマホールディングス	5.8	6.2	2,839
サクセスホールディングス	1	1.3	1,791
キャリアリンク	1.5	3.1	2,083
ＩＢＪ	6.6	10.7	6,206
アサンテ	4.1	5.1	8,496
Ｎ・フィールド	4	6.5	9,243
バリューＨＲ	－	1	2,617
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	0.9	1.8	9,198
ライドオン・エクスプレス	1.8	3.4	3,114
ＥＲＩホールディングス	2.9	3.5	2,933
アビスト	1.2	2.1	8,095
ウィルグループ	2.5	5.5	4,554
エスクロー・エージェント・ジャパン	－	2.3	3,385
日本ビューホテル	1.2	2.8	3,827
リクルートホールディングス	226.1	300.9	1,700,085
エラン	0.9	1.8	3,493
土木管理総合試験所	－	1.4	949
日本郵政	247.3	359.4	514,301

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ベルシステム２４ホールディングス	16.4	21	20,601
一蔵	－	1	1,143
ソラスト	－	6.3	10,243
リログループ	4.2	5.2	91,468
東祥	3.4	2.9	14,050
エイチ・アイ・エス	18.3	22.4	59,046
ラックランド	1.6	2.4	4,826
共立メンテナンス	8.4	11.2	74,032
イチネンホールディングス	11.7	14.4	17,092
建設技術研究所	6.6	8.7	9,726
スペース	6	7.4	10,101
燦ホールディングス	2.2	2.7	4,541
スバル興業	8	10	4,760
東京テアトル	43	52	8,164
タナベ経営	－	2.7	3,825
ナガワ	2	2.5	9,962
よみうりランド	22	27	11,961
東京都競馬	77	94	23,782
常磐興産	41	5	8,375
カナモト	15.6	19.2	56,774
東京ドーム	89	54.9	57,919
西尾レントオール	9	11.1	35,131
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	56	68	2,516
トランス・コスモス	13	16	42,096
乃村工藝社	24	29.5	57,466

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
藤田観光	41	45	15,660
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	54	78	10,686
日本管財	9.6	11.8	21,629
トーカイ	5	6.1	24,888
白洋舎	12	1.3	3,637
セコム	116.6	143.3	1,145,970
セントラル警備保障	4.9	6.1	10,412
丹青社	21	23.8	22,895
メイテック	14	16.7	77,404
アサツー　ディ・ケイ	19.7	22.4	64,467
応用地質	11.8	13	18,356
船井総研ホールディングス	15.6	17.7	36,090
進学会	5.3	5.7	3,391
オオバ	6.1	10.7	5,424
学究社	1.6	3.6	5,860
ベネッセホールディングス	37.6	46.1	163,655
イオンディライト	10.8	15.5	53,397
ナック	6.9	8.4	8,324
ニチイ学館	19.5	23.9	20,315
ダイセキ	21.1	24	54,264
ステップ	3.8	4.6	6,854
合計　株数・金額	178,041	199,465	292,922,922
合計　銘柄数＜比率＞	1,933	1,997	＜98.8％＞

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
国内	株式先物取引	ＴＯＰＩＸ	2,820	－

○有価証券の貸付及び借入の状況

2017年３月27日現在における貸付株数の総株数は32,091,900株です。
うち利害関係人であるモルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券株式会社に対する貸付は、32,091,900株です。

○投資信託財産の構成

（2017年３月27日現在）

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
株式	292,922,922	87.5
コール・ローン等、その他	41,743,013	12.5
投資信託財産総額	334,665,935	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 （2017年３月27日現在）

項目	当期末
	円
(A) 資産	334,665,935,303
コール・ローン等	37,346,027,243
株式(評価額)	292,922,922,728
未収入金	3,830,495,960
未収配当金	366,060,940
その他未収収益	72,744,432
差入委託証拠金	127,684,000
(B) 負債	38,274,908,532
未払金	74,784,980
未払解約金	3,555,901,019
未払利息	46,022
受入担保金	34,644,176,511
(C) 純資産総額（Ａ－Ｂ）	296,391,026,771
元本	189,052,090,341
次期繰越損益金	107,338,936,430
(D) 受益権総口数	189,052,090,341口
１万口当たり基準価額（Ｃ／Ｄ）	15,678円

○損益の状況 （2016年３月26日～2017年３月27日）

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

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

＜注記事項＞

①期首元本額　160,669,331,010円
　期中追加設定元本額　173,392,386,291円
　期中一部解約元本額　145,009,626,960円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.5678円です。

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

ファンド・マネジャー（国内株式）	18,684,449,723円
ｅＭＡＸＩＳ ＴＯＰＩＸインデックス	17,077,512,030円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,656,580,816円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	99,802,897円
コアバランス	617,490円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	3,273,572円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	1,601,194円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	4,933,249円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 国内株式インデックス	49,732,237円
国内株式セレクション（ラップ向け）	2,584,584円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	5,620,761,162円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	10,565,357,162円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	144,688,323円
三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）	170,036,213円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	1,162,170,087円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	68,179,843円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	396,443,708円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	43,112,557円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	6,842,156円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	11,948,701円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	43,199,038円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	50,861,860円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	61,420,211円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,934,898,552円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,002,930,294円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	391,641,922円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	3,451,440,494円
ＭＵＡＭ 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	36,368,609,266円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	4,862,627,479円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ７５型（適格機関投資家限定）	1,846,915,127円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	415,165,896円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４５型（適格機関投資家限定）	274,097,035円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	131,867,682円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	507,547,681円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,114,728,295円
三菱ＵＦＪ グローバル型バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,408,598円
ＭＵＡＭトピックスリスクコントロール（５％）インデックスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	4,598,717円
ＭＵＡＭトピックスリスクコントロール（10％）インデックスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	232,389,465円
ＭＵＡＭ インデックスファンドＴＯＰＩＸｉ（適格機関投資家限定）	8,726,654円
ＭＵＫＡＭ バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	1,605,211,676円
ＭＵＫＡＭ バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	341,328,542円
ＭＵＫＡＭ スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	82,293,572円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	12,529,486円
ＭＵＫＡＭ 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	3,492,669,678円
三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ファンド	6,517,768,863円
三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ライト	299,146,590円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	7,572,986円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	37,469,537円

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

外国株式インデックスマザーファンド

《第16期》決算日2017年５月12日

［計算期間：2016年５月13日～2017年５月12日］

「外国株式インデックスマザーファンド」は、５月12日に第16期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＭＳＣＩ Kokusai Index（ＭＳＣＩコクサイ インデックス）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	（円換算ベース）	期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
12期(2013年５月13日)	15,535	56.6	114.32	52.4	96.3	1.0	2.3	199,188
13期(2014年５月12日)	18,176	17.0	130.71	14.3	96.7	1.1	2.1	197,280
14期(2015年５月12日)	23,063	26.9	162.29	24.2	96.5	1.2	2.2	227,514
15期(2016年５月12日)	19,726	△14.5	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7	270,065
16期(2017年５月12日)	24,302	23.2	163.31	20.4	92.9	1.9	2.4	332,985

（注）ＭＳＣＩ Kokusai Index（ＭＳＣＩコクサイ インデックス）とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。ＭＳＣＩ Kokusai Index（円換算ベース）は、ＭＳＣＩ Kokusai Index（米ドルベース）をもとに委託会社が計算したものです。また、ＭＳＣＩ Kokusai Indexに対する著作権及びその他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)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	(円換算ベース)	騰落率			
(期首)	円	%		%	%	%	%
2016年5月12日	19,726	－	135.59	－	94.4	2.8	2.7
5月末	20,571	4.3	140.96	4.0	95.5	1.8	2.7
6月末	18,592	△ 5.7	127.30	△ 6.1	93.7	4.9	2.8
7月末	19,767	0.2	135.16	△ 0.3	94.0	2.6	2.8
8月末	19,706	△ 0.1	134.53	△ 0.8	94.8	3.1	2.7
9月末	19,237	△ 2.5	131.19	△ 3.2	94.0	3.2	2.7
10月末	19,636	△ 0.5	133.57	△ 1.5	95.9	2.0	2.6
11月末	21,454	8.8	145.64	7.4	96.0	1.1	2.5
12月末	22,809	15.6	154.51	14.0	93.2	1.1	2.5
2017年1月末	22,737	15.3	154.07	13.6	93.3	4.2	2.4
2月末	23,181	17.5	156.94	15.7	94.9	2.6	2.5
3月末	23,408	18.7	158.11	16.6	93.7	3.8	2.4
4月末	23,574	19.5	158.70	17.0	94.2	6.0	2.5
(期末) 2017年5月12日	24,302	23.2	163.31	20.4	92.9	1.9	2.4

(注) 騰落率は期首比。
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

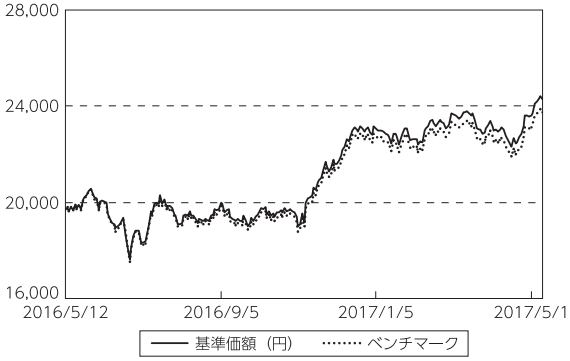
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ23.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国株式市況

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

◎為替市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

・ＭＳＣＩ Kokusai Index（ＭＳＣＩコクサイインデックス）（円換算ベース）に採用されている株式（先物・不動産投資信託証券（ＲＥＩＴ）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。

・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは20.4%の上昇となったため、カイ離は2.8%程度となりました。

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

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

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

・効率的に運用を行うため、円貨、外貨現金などを若干保有しました。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.1%程度でした。

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

・売買に係るコストを考慮しつつ、できる限り多くの銘柄に分散投資を行いました。

・ファンドの特性をよりベンチマークに近づけるべく、マルチファクターモデルを用いて組入銘柄とその組入比率を決定しています。

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.9%程度でした。

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

為替効果：現地通貨建て株価を円建てに換算する方法が、ファンドとベンチマークで異なるため生じる差異。
ファンド：株価（現地通貨建て前日終値）を翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。
ベンチマーク：株価（現地通貨建て前日終値）を同日ロンドン時間の16時時点の為替レートを用い一旦ドル換算で評価。その後翌日の対顧客電信売買相場の仲値を使い円に換算し評価。

○今後の運用方針

・ベンチマークに連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を株式（先物・ＲＥＩＴを含む）に投資し、高い株式組入比率を維持します。

・売買に係るコストを考慮しつつ、多くの銘柄に分散投資を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2016年５月13日～2017年５月12日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	4	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
（株式）	(2)	(0.011)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(1)	(0.006)	
(b) 有価証券取引税	6	0.028	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(6)	(0.027)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
(c) その他費用	8	0.039	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(8)	(0.038)	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	18	0.084	
期中の平均基準価額は、21,222円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2016年５月13日～2017年５月12日）

株式

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
外国	アメリカ	百株 155,965 (1,811)	千アメリカドル 968,705 (1,758)	百株 154,658 (1,810)	千アメリカドル 961,284 (10,652)
	カナダ	19,522 (488)	千カナダドル 80,341 (－)	17,792	千カナダドル 72,743
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	11,999 (1,507)	52,930 (△ 443)	12,065	50,338
	イタリア	31,152 (△ 3,662)	11,637 (△ 343)	29,393	10,272
	フランス	12,675 (574)	51,391 (△ 642)	12,341	48,099
	オランダ	10,312 (474)	20,624 (958)	10,191	20,302
	スペイン	29,650 (45,894)	17,901 (455)	71,415	17,428
	ベルギー	876 (△ 89)	6,551 (△ 823)	899	6,812
	オーストリア	323 (－)	979 (△ 11)	294	919
	ルクセンブルク	1,507	2,068	1,316	1,502
	フィンランド	4,303	5,398	4,120	5,272
	アイルランド	16,514	2,793	15,794	2,654
	ポルトガル	1,502	838	37,180	863
	イギリス	292 (208)	1,012 (522)	317	1,051
	イギリス	149,068 (187,486)	千イギリスポンド 86,590 (206)	138,662 (186,613)	千イギリスポンド 84,724 (1,797)
	スイス	7,784 (－)	千スイスフラン 51,855 (△ 1,119)	7,748	千スイスフラン 51,965
	スウェーデン	11,140 (527)	千スウェーデンクローネ 149,067 (－)	11,146 (200)	千スウェーデンクローネ 144,430 (360)
	ノルウェー	3,265 (－)	千ノルウェークローネ 36,901 (△ 274)	2,858	千ノルウェークローネ 31,680

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

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

投資信託証券

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

銘柄			買付		売付	
			口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ		千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6	1,104	5	1,070
	小計		680 (19)	33,618 (277)	583	29,628
	カナダ			千カナダドル		千カナダドル
		SMART REAL ESTATE INVESTMENT	4	139	3	127
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	4	102	3	79
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4	129	4	120
	小計		13	371	11	327
	ユーロ			千ユーロ		千ユーロ
		フランス				
		GECINA SA	2	314	1	228
		KLEPIERRE	10	388	10	395
		UNIBAIL-RODAMCO SE	4	1,030	4	981
		FONCIERE DES REGIONS	1 (—)	122 (△ 2)	1	114
		ICADE	1	97	1	69
	小計		20 (—)	1,953 (△ 2)	19	1,789
	ユーロ計		20 (—)	1,953 (△ 2)	19	1,789
	イギリス			千イギリスポンド		千イギリスポンド
		BRITISH LAND CO PLC	54	353	52	327
		HAMMERSON PLC	39	226	37	211
		LAND SECURITIES GROUP PLC	40	436	41	432
		INTU PROPERTIES PLC	46	133	42	118
		SEGRO PLC	52	240	30	138
		SEGRO PLC -RTS	— (15)	— (—)	15	14
	小計		234 (15)	1,390 (—)	220	1,244
	オーストラリア			千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
		VICINITY CENTRES	162	493	156	466
		SCENTRE GROUP	243	1,098	236	1,059
		GPT GROUP	82	424	88	458
		MIRVAC GROUP	200	429	214	467
		STOCKLAND	139	640	131	608
		WESTFIELD CORP	92	872	91	858
		DEXUS	46	435	45	432
		GOODMAN GROUP	91	665	90	679
	小計		1,059	5,060	1,056	5,031
	香港			千香港ドル		千香港ドル
		LINK REIT	108	5,716	105	5,647
	小計		108	5,716	105	5,647

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	SUNTEC REIT	94 (　－)	163 (△　1)	88	155
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	118	178	106	160
	CAPITALAND MALL TRUST	116	232	113	227
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	105 (　－)	257 (△　1)	94	237
	小計	435 (　－)	832 (△　3)	403	781

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 247,123	百万円 250,771	百万円 －	百万円 －

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

○株式売買比率

(2016年５月13日～2017年５月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	322,887,241千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	286,537,329千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	1.12

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年５月13日～2017年５月12日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	%
為替直物取引	261,252	90,463	34.6	268,893	180,086	67.0

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

○組入資産の明細

(2017年５月12日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ALCOA INC	1,083	—	—	—	素材
AMERICAN EXPRESS CO	692	653	5,088	579,835	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	1,233	1,444	6,335	721,910	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	274	274	1,544	176,015	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	44	46	713	81,276	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	381	379	3,659	416,930	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	58	61	246	28,125	小売
AES CORP	566	549	630	71,830	公益事業
AFLAC INC	352	342	2,532	288,523	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,022	861	5,325	606,800	保険
APACHE CORP	313	319	1,629	185,687	エネルギー
ADVANCED MICRO DEVICES	—	671	742	84,634	半導体・半導体製造装置
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	50	44	1,104	125,885	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	516	520	6,287	716,441	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	169	173	2,489	283,702	素材
ANTHEM INC	215	221	4,041	460,539	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	421	469	2,421	275,906	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,112	1,144	3,018	343,939	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	472	411	2,318	264,191	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	526	492	9,057	1,031,957	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	174	178	3,300	376,078	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	256	238	1,238	141,114	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,380	1,403	7,736	881,550	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	101	101	3,902	444,705	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,367	3,420	15,741	1,793,634	電気通信サービス
CR BARD INC	61	61	1,905	217,087	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	108	142	1,140	129,918	素材
BAKER HUGHES INC	361	337	2,001	228,077	エネルギー
ALLSTATE CORP	319	309	2,594	295,617	保険
AVERY DENNISON CORP	75	75	632	72,012	素材
CHUBB LTD	380	389	5,349	609,573	保険
ANALOG DEVICES INC	258	306	2,402	273,691	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	25	24	1,692	192,899	小売
CVS HEALTH CORP	916	894	7,360	838,620	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ENTERPRISES	178	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	978	801	2,307	262,947	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	3,045	3,001	26,163	2,981,090	銀行
CIGNA CORP	212	215	3,531	402,338	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	481	491	4,966	565,915	資本財
COCA-COLA CO/THE	3,417	3,436	15,009	1,710,128	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	440	405	3,251	370,488	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	153	165	952	108,534	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	807	787	4,103	467,567	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	166	—	—	—	メディア
CHEVRON CORP	1,557	1,584	16,826	1,917,190	エネルギー
COACH INC	229	237	1,085	123,634	耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ROCKWELL COLLINS INC	108	135	1,411	160,834	資本財
CONOCOPHILLIPS	1,022	1,039	4,930	561,796	エネルギー
CME GROUP INC	265	284	3,326	378,984	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	271	269	1,960	223,326	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	705	709	5,083	579,248	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC	495	528	4,101	467,337	公益事業
DOW CHEMICAL CO/THE	930	941	5,821	663,268	素材
DEVON ENERGY CORP	381	396	1,504	171,473	エネルギー
DEERE & CO	258	225	2,555	291,181	資本財
DANAHER CORP	509	522	4,326	492,932	ヘルスケア機器・サービス
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	724	729	5,761	656,435	素材
WALT DISNEY CO/THE	1,299	1,268	13,898	1,583,591	メディア
DARDEN RESTAURANTS INC	94	95	844	96,265	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	571	579	4,813	548,403	公益事業
DR HORTON INC	280	293	975	111,166	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC	74	69	350	39,956	小売
TARGET CORP	483	448	2,513	286,439	小売
DUN & BRADSTREET CORP	29	29	326	37,194	商業・専門サービス
DAVITA INC	140	132	889	101,304	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	128	129	1,030	117,424	資本財
DTE ENERGY COMPANY	150	153	1,603	182,685	公益事業
EXXON MOBIL CORP	3,444	3,479	28,745	3,275,230	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	178	179	1,982	225,850	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	455	483	4,557	519,248	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	541	540	3,144	358,268	資本財
EXELON CORP	763	778	2,609	297,339	公益事業
ECOLAB INC	219	220	2,797	318,696	素材
EQUIFAX INC	98	100	1,361	155,146	商業・専門サービス
EMC CORP/MA	1,603	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	183	187	1,738	198,119	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	382	379	2,926	333,492	資本財
EDISON INTERNATIONAL	271	276	2,168	247,091	公益事業
ENTERGY CORP	149	152	1,146	130,644	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	35	34	848	96,692	保険
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	49	46	337	38,467	家庭用品・パーソナル用品
NEXTERA ENERGY INC	382	393	5,292	603,050	公益事業
MACY'S INC	260	250	608	69,366	小売
FEDEX CORP	222	212	4,048	461,262	運輸
FMC TECHNOLOGIES INC	189	—	—	—	エネルギー
FORD MOTOR CO	3,065	3,120	3,435	391,495	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	322	309	1,338	152,543	各種金融
FOOT LOCKER INC	114	109	830	94,618	小売
FIRSTENERGY CORP	353	357	1,029	117,307	公益事業
FLUOR CORP	117	118	565	64,390	資本財
FREEPORT-MCMORAN INC	957	1,083	1,265	144,226	素材
GENERAL MILLS INC	494	497	2,800	319,083	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	222	217	4,237	482,865	資本財
WW GRAINGER INC	46	46	877	99,933	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	7,808	7,422	21,428	2,441,516	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	111	128	1,132	128,998	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	124	123	1,134	129,310	小売
TEGNA INC	174	173	401	45,693	メディア

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	222	214	757	86,273	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	200	201	520	59,280	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	317	300	6,759	770,144	各種金融
HALLIBURTON CO	708	725	3,310	377,235	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	605	607	8,012	912,992	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	159	146	812	92,600	自動車・自動車部品
HP INC	1,487	1,439	2,773	316,003	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	338	317	1,574	179,441	保険
HERSHEY CO/THE	122	120	1,285	146,424	食品・飲料・タバコ
HARMAN INTERNATIONAL	58	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HOME DEPOT INC	1,048	1,022	15,971	1,819,787	小売
HASBRO INC	92	93	945	107,784	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	215	217	1,926	219,559	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	762	757	11,417	1,300,957	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	325	329	1,733	197,481	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	270	265	3,669	418,109	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	336	326	800	91,157	メディア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	66	65	854	97,370	素材
JOHNSON & JOHNSON	2,288	2,282	28,126	3,204,726	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC	535	—	—	—	自動車・自動車部品
KANSAS CITY SOUTHERN	90	88	805	91,735	運輸
KELLOGG CO	219	222	1,571	179,098	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	300	301	3,860	439,919	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,314	1,296	5,790	659,792	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	765	753	2,293	261,343	食品・生活必需品小売り
KOHLS CORP	160	153	569	64,848	小売
ELI LILLY & CO	825	834	6,693	762,609	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	83	85	1,212	138,194	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	137	128	747	85,223	運輸
LENNAR CORP-A	148	167	856	97,546	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	758	730	6,188	705,081	小売
LEGGETT & PLATT INC	112	113	604	68,826	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	204	201	1,026	116,908	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	329	367	2,110	240,503	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	228	221	6,027	686,816	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	204	193	1,309	149,226	保険
L3 TECHNOLOGIES INC	64	64	1,078	122,923	資本財
LEGG MASON INC	82	—	—	—	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	170	279	2,870	327,056	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	759	697	10,053	1,145,457	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	223	218	2,996	341,450	各種金融
MEDTRONIC PLC	1,169	1,168	9,702	1,105,526	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	2,310	2,314	14,909	1,698,823	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	899	875	2,540	289,441	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	280	278	625	71,232	耐久消費財・アパレル
3M CO	509	504	9,928	1,131,196	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	132	124	1,064	121,253	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	373	382	1,183	134,868	消費者サービス
MASCO CORP	279	274	1,004	114,478	資本財
MONSANTO CO	363	367	4,263	485,793	素材
M & T BANK CORP	118	117	1,858	211,798	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	431	433	3,190	363,541	保険

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
MOHAWK INDUSTRIES INC	52	52	1,233	140,566	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	1,201	1,180	5,061	576,740	各種金融
MCKESSON CORP	190	189	2,767	315,287	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	781	784	4,046	461,062	保険
MANPOWERGROUP INC	60	57	591	67,404	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	147	145	1,680	191,502	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	247	245	2,865	326,440	運輸
BANK OF AMERICA CORP	8,614	8,478	20,408	2,325,324	銀行
NISOURCE INC	—	280	677	77,204	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	143	140	3,484	397,005	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	402	415	542	61,763	銀行
NEWMONT MINING CORP	437	447	1,498	170,719	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	966	889	2,535	288,906	メディア
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	96	94	946	107,841	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	11	11	1,119	127,561	保険
NUCOR CORP	264	267	1,540	175,515	素材
NEWELL BRANDS INC	367	366	1,958	223,134	耐久消費財・アパレル
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	366	368	1,044	119,003	メディア
NOBLE ENERGY INC	355	390	1,222	139,335	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	632	642	3,925	447,224	エネルギー
OMNICOM GROUP	200	199	1,672	190,547	メディア
PEPSICO INC	1,205	1,203	13,602	1,549,888	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	80	79	818	93,281	素材
ALTRIA GROUP INC	1,622	1,635	11,530	1,313,732	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	94	93	791	90,143	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	2,249	2,144	18,479	2,105,524	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	419	408	4,968	566,133	銀行
PFIZER INC	5,106	5,092	16,824	1,916,949	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	371	361	3,892	443,476	保険
PULTEGROUP INC	260	253	582	66,388	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP	112	112	1,790	204,011	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	133	142	2,439	277,967	エネルギー
CITIGROUP INC	2,465	2,390	14,513	1,653,618	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	242	241	1,533	174,760	保険
PPG INDUSTRIES INC	222	222	2,387	272,061	素材
PENTAIR PLC	149	146	953	108,621	資本財
PRAXAIR INC	235	240	3,100	353,254	素材
P G & E CORP	408	427	2,814	320,731	公益事業
PPL CORP	560	576	2,221	253,129	公益事業
PROGRESSIVE CORP	482	488	1,965	223,896	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	421	429	1,835	209,124	公益事業
STARWOOD HOTELS & RESORTS	145	—	—	—	消費者サービス
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	145	144	1,563	178,144	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	248	246	3,920	446,645	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	200	201	1,277	145,508	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	1,078	1,037	1,470	167,596	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	36	34	470	53,582	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	83	85	1,910	217,699	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	345	345	948	108,073	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	109	109	518	59,125	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	109	108	1,694	193,072	資本財
SCHLUMBERGER LTD	1,152	1,166	8,369	953,650	エネルギー

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
STRYKER CORP	279	282	3,815	434,730	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	980	1,002	4,011	457,064	各種金融
SEMPRA ENERGY	196	201	2,239	255,122	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	65	66	2,222	253,252	素材
ST JUDE MEDICAL INC	234	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	123	127	1,759	200,433	資本財
SUNTRUST BANKS INC	420	412	2,348	267,633	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	251	238	2,871	327,137	保険
SOUTHERN CO/THE	755	826	4,114	468,770	公益事業
AT&T INC	5,089	5,150	19,798	2,255,817	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	189	240	2,153	245,409	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	333	324	2,686	306,129	各種金融
SYSCO CORP	466	436	2,403	273,804	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	163	158	684	77,988	素材
SCANA CORP	114	113	746	85,028	公益事業
TEXAS INSTRUMENTS INC	839	838	6,743	768,323	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	106	103	948	108,108	小売
TORCHMARK CORP	101	96	728	83,015	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	349	787	3,299	375,986	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	330	332	5,678	647,014	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	226	224	1,089	124,106	資本財
UNION PACIFIC CORP	706	691	7,614	867,597	運輸
UNUM GROUP	201	192	889	101,369	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	696	656	7,961	907,124	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	788	807	13,997	1,594,914	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,446	1,424	7,356	838,232	銀行
MARATHON OIL CORP	682	701	1,015	115,679	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	576	579	6,030	687,126	運輸
VALERO ENERGY CORP	398	380	2,527	287,964	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	80	79	769	87,659	ヘルスケア機器・サービス
VALSPAR CORP/THE	—	62	696	79,331	素材
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	359	330	2,074	236,413	メディア
VF CORP	282	279	1,531	174,521	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	110	111	1,433	163,289	素材
WILLIAMS COS INC	590	686	2,079	236,940	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	720	772	6,602	752,257	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	264	268	1,625	185,208	公益事業
WAL-MART STORES INC	1,325	1,296	9,868	1,124,399	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO	4,013	4,002	21,509	2,450,778	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	369	372	2,699	307,574	商業・専門サービス
WATERS CORP	67	68	1,177	134,180	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	731	796	407	46,476	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	64	62	1,160	132,227	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	754	733	519	59,146	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XL GROUP PLC	244	—	—	—	保険
XCEL ENERGY INC	424	431	1,947	221,949	公益事業
KEYCORP	684	910	1,660	189,232	銀行
CARMAX INC	168	158	938	106,948	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	156	168	2,039	232,413	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	139	132	495	56,413	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	356	294	2,034	231,771	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	553	547	4,350	495,696	小売

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
CA INC	271	258	828	94,387	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	106	108	1,435	163,528	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	121	118	1,020	116,322	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	—	238	785	89,461	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	341	293	1,821	207,486	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	233	263	2,199	250,584	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	358	347	1,302	148,417	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	244	258	2,053	233,928	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	656	635	1,553	176,956	銀行
STERICYCLE INC	70	72	616	70,228	商業・専門サービス
INTEL CORP	3,903	3,974	14,184	1,616,237	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	4,199	4,212	14,167	1,614,292	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	75	69	850	96,939	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	105	103	1,327	151,243	不動産
COSTCO WHOLESALE CORP	361	366	6,279	715,477	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	993	908	3,948	449,922	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	257	253	2,755	313,954	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	244	244	1,419	161,730	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	558	525	1,653	188,429	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	337	333	2,177	248,112	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	177	182	1,445	164,707	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	1,121	1,122	6,085	693,414	耐久消費財・アパレル
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	6	12	140	15,976	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	624	624	9,990	1,138,364	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	145	147	1,044	118,984	銀行
NORTHERN TRUST CORP	181	180	1,634	186,237	各種金融
MICROSOFT CORP	6,278	6,198	42,433	4,834,911	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	73	73	884	100,799	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	140	142	1,083	123,482	ヘルスケア機器・サービス
STAPLES INC	538	549	518	59,088	小売
STARBUCKS CORP	1,227	1,221	7,359	838,494	消費者サービス
ORACLE CORP	2,646	2,583	11,665	1,329,193	ソフトウェア・サービス
WHOLE FOODS MARKET INC	282	263	975	111,121	食品・生活必需品小売り
NETFLIX INC	336	360	5,712	650,883	小売
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	81	79	2,038	232,290	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	423	499	2,787	317,588	ソフトウェア・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	158	156	1,604	182,771	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	68	67	1,183	134,904	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	111	111	672	76,590	小売
LAM RESEARCH CORP	130	137	2,055	234,226	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	67	67	823	93,853	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	2,054	3,999	15,702	1,789,112	メディア
XILINX INC	212	211	1,366	155,729	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	292	295	1,903	216,897	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	199	192	1,209	137,808	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	—	60	824	93,973	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	1,192	1,105	7,372	840,048	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	127	129	1,131	128,890	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	30	32	2,751	313,459	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	207	205	2,604	296,810	ソフトウェア・サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	205	234	448	51,107	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	268	273	1,565	178,316	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
YAHOO! INC	741	762	3,788	431,702	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	72	73	317	36,211	ヘルスケア機器・サービス
SIGNATURE BANK	42	45	634	72,323	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	57	109	1,152	131,298	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	187	167	1,602	182,600	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	208	208	630	71,885	メディア
SALESFORCE.COM INC	522	541	4,753	541,557	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	114	110	512	58,380	小売
ALPHABET INC-CL A	240	248	23,752	2,706,406	ソフトウェア・サービス
UNITED THERAPEUTICS CORP	37	35	439	50,067	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B/E AEROSPACE INC	87	—	—	—	資本財
GARMIN LTD	94	100	526	59,969	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	207	205	733	83,623	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	1,243	1,239	6,775	771,988	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	199	208	908	103,461	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	129	125	936	106,686	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP	197	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	235	235	1,074	122,429	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	329	338	32,120	3,659,812	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	206	204	1,456	165,904	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	118	115	1,241	141,462	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	128	131	1,313	149,660	半導体・半導体製造装置
E*TRADE FINANCIAL CORP	242	225	788	89,801	各種金融
CERNER CORP	254	257	1,664	189,619	ヘルスケア機器・サービス
BROADCOM LTD	321	337	7,803	889,124	半導体・半導体製造装置
ALKERMES PLC	124	124	715	81,468	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	83	77	694	79,185	ソフトウェア・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	250	257	1,517	172,884	電気通信サービス
WASTE CONNECTIONS INC	101	147	1,347	153,573	商業・専門サービス
EBAY INC	893	893	3,047	347,216	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	445	452	5,725	652,394	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	184	198	1,618	184,436	小売
PRICELINE GROUP INC/THE	41	41	7,511	855,890	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	980	1,026	16,766	1,910,321	各種金融
BB&T CORP	670	681	2,932	334,157	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	903	888	4,167	474,837	各種金融
BORGWARNER INC	185	174	730	83,182	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	194	177	469	53,504	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	97	97	1,214	138,367	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC	661	647	6,397	728,978	メディア
AMERISOURCEBERGEN CORP	161	137	1,224	139,518	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	54	47	489	55,742	保険
AETNA INC	288	294	4,254	484,801	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	204	205	1,119	127,517	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	408	415	2,805	319,649	公益事業
AON PLC	226	221	2,748	313,209	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	493	483	2,033	231,753	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	78	76	485	55,277	保険
HESS CORP	232	237	1,178	134,321	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	288	283	867	98,840	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	221	217	822	93,711	各種金融
RED HAT INC	151	151	1,345	153,288	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
F5 NETWORKS INC	58	55	726	82,732	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	186	188	1,164	132,661	メディア
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	147	148	738	84,153	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	242	230	924	105,374	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	138	142	1,659	189,067	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	342	369	581	66,212	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	184	182	4,639	528,654	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	121	123	2,244	255,757	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE SYSTEMS INC	412	417	5,692	648,656	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	203	208	2,403	273,897	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	—	768	2,457	280,018	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BED BATH & BEYOND INC	137	127	468	53,349	小売
CELGENE CORP	650	650	7,774	885,857	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	503	509	3,275	373,184	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	559	517	3,141	357,917	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	154	154	820	93,466	運輸
FASTENAL CO	227	239	1,078	122,933	資本財
FISERV INC	189	183	2,199	250,630	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	462	442	719	81,926	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,745	1,401	676	77,104	メディア
SANDISK CORP	166	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLE INC	4,612	4,475	68,893	7,849,678	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	128	128	893	101,818	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	659	915	1,171	133,477	銀行
COSTAR GROUP INC	—	27	682	77,795	ソフトウェア・サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	186	188	2,241	255,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHLAND INC	52	—	—	—	素材
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	118	121	846	96,394	運輸
CENTURYLINK INC	454	454	1,111	126,656	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	114	118	442	50,441	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	345	383	1,510	172,109	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	173	174	895	102,013	エネルギー
REYNOLDS AMERICAN INC	709	717	4,679	533,223	食品・飲料・タバコ
SEAGATE TECHNOLOGY	247	244	1,037	118,172	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	117	114	802	91,462	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	60	60	886	101,007	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC	311	313	1,059	120,753	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	143	149	2,666	303,801	食品・飲料・タバコ
NEWFIELD EXPLORATION CO	—	170	589	67,179	エネルギー
COOPER COS INC/THE	40	40	834	95,044	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	132	147	834	95,086	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	255	261	1,896	216,034	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	81	83	549	62,652	保険
AGCO CORP	55	51	328	37,408	資本財
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	122	123	325	37,071	メディア
MONSTER BEVERAGE CORP	117	336	1,610	183,493	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA INC	102	103	1,450	165,316	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	193	200	546	62,246	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	495	508	1,503	171,337	メディア
AMERIPRISE FINANCIAL INC	144	133	1,698	193,524	各種金融
TESORO CORP	99	96	791	90,216	エネルギー
FNF GROUP	207	209	846	96,474	保険

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	98	500	2,954	336,669	各種金融
NASDAQ INC	94	96	645	73,504	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	149	145	304	34,730	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	288	288	994	113,303	メディア
AUTOLIV INC	72	72	739	84,248	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	249	251	877	99,931	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	25	24	1,179	134,367	消費者サービス
IHS INC-CLASS A	56	—	—	—	商業・専門サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	95	173	863	98,343	食品・飲料・タバコ
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	367	341	809	92,232	小売
ARROW ELECTRONICS INC	77	76	587	66,933	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	139	134	2,138	243,689	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	101	101	552	62,917	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP	271	266	675	76,991	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	46	50	1,173	133,652	素材
RANGE RESOURCES CORP	140	161	409	46,688	エネルギー
SOUTHWESTERN ENERGY CO	315	432	323	36,831	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	78	78	924	105,294	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	48	48	387	44,180	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	96	191	755	86,081	公益事業
OCEANEERING INTL INC	80	—	—	—	エネルギー
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	96	89	861	98,132	消費者サービス
HANESBRANDS INC	324	322	719	81,935	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A	819	807	9,413	1,072,537	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	418	400	779	88,779	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	76	133	597	68,132	資本財
AVNET INC	109	104	391	44,571	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	263	284	673	76,744	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	80	150	323	36,865	消費者サービス
SPECTRA ENERGY CORP	556	—	—	—	エネルギー
TRANSDIGM GROUP INC	44	44	1,081	123,201	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	—	98	693	79,056	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	108	109	1,559	177,641	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	253	291	500	56,970	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	319	299	2,291	261,145	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	353	332	2,005	228,452	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	93	92	506	57,709	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	45	44	522	59,571	資本財
MERCADOLIBRE INC	—	33	926	105,607	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A	65	57	538	61,356	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	234	242	1,114	126,971	保険
TIME WARNER CABLE	234	—	—	—	メディア
SEATTLE GENETICS INC	—	85	527	60,133	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ULTA BEAUTY INC	50	49	1,492	170,004	小売
LKQ CORP	252	253	785	89,467	小売
HORMEL FOODS CORP	240	238	820	93,465	食品・飲料・タバコ
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	—	66	519	59,212	運輸
EASTMAN CHEMICAL CO	123	121	946	107,817	素材
GAMESTOP CORP-CLASS A	85	—	—	—	小売
HARRIS CORP	103	105	1,149	130,976	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	122	125	2,889	329,248	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP	135	130	350	39,910	エネルギー

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NRG ENERGY INC	262	—	—	—	公益事業
INVESCO LTD	350	339	1,090	124,243	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	133	144	1,288	146,768	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	115	115	593	67,616	各種金融
TERADATA CORP	113	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	137	140	816	93,079	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	107	122	1,627	185,392	エネルギー
MSCI INC	81	75	737	83,985	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	76	82	344	39,293	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	153	158	1,483	169,051	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,281	1,302	14,479	1,649,743	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,610	1,566	14,429	1,644,138	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	156	154	1,401	159,676	食品・飲料・タバコ
CORE LABORATORIES N.V.	34	37	404	46,080	エネルギー
CABOT OIL & GAS CORP	380	383	950	108,324	エネルギー
FLOWSERVE CORP	108	111	546	62,310	資本財
HELMERICH & PAYNE	89	92	538	61,409	エネルギー
T-MOBILE US INC	237	243	1,599	182,255	電気通信サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	62	69	475	54,199	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	228	185	476	54,237	メディア
RESMED INC	115	115	787	89,698	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	69	76	860	98,006	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	197	193	1,155	131,680	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	101	101	968	110,377	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	108	214	1,085	123,711	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	76	77	663	75,600	運輸
PERRIGO CO PLC	121	118	894	101,961	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUANTA SERVICES INC	129	—	—	—	資本財
FMC CORP	110	110	812	92,631	素材
WABTEC CORP	79	73	592	67,505	資本財
EVERSOURCE ENERGY	265	270	1,607	183,105	公益事業
NETSUITE INC	32	—	—	—	ソフトウェア・サービス
INGREDION INC	—	59	701	79,930	食品・飲料・タバコ
ALLERGAN PLC	326	314	7,274	828,883	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRGAS INC	53	—	—	—	素材
CROWN HOLDINGS INC	116	114	649	73,987	素材
CALPINE CORP	285	272	339	38,682	公益事業
EATON VANCE CORP	95	96	431	49,190	各種金融
DELTA AIR LINES INC	165	156	778	88,752	運輸
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	163	155	1,379	157,230	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC	151	150	1,142	130,129	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	133	131	1,032	117,653	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	243	237	1,708	194,671	小売
FORTINET INC	121	125	491	55,957	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	79	69	538	61,357	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	22	22	1,231	140,317	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	141	167	780	88,960	銀行
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	970	1,035	124	14,158	電気通信サービス
GENERAL MOTORS CO	1,169	1,155	3,940	449,010	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	112	247	2,639	300,738	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	315	291	2,386	271,942	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	—	38	743	84,680	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
HCA HEALTHCARE INC	270	252	2,155	245,601	ヘルスケア機器・サービス
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	321	—	—	—	運輸
HOLLYFRONTIER CORP	144	134	374	42,640	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	441	444	2,333	265,884	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	87	91	735	83,767	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	132	126	798	90,984	資本財
DEXCOM INC	—	73	503	57,341	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP	—	49	658	75,030	資本財
XYLEM INC	148	147	748	85,266	資本財
TRIPADVISOR INC	97	96	441	50,347	小売
MEDIVATION INC	140	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	50	49	765	87,256	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	120	130	1,186	135,236	銀行
ALLEGHANY CORP	12	13	757	86,296	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	63	65	2,872	327,240	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	441	394	3,137	357,536	エネルギー
FACEBOOK INC-A	1,878	1,964	29,475	3,358,439	ソフトウェア・サービス
CMS ENERGY CORP	235	237	1,072	122,196	公益事業
ALBEMARLE CORP	92	93	1,036	118,063	素材
PVH CORP	68	68	693	79,039	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A	95	—	—	—	ソフトウェア・サービス
KINDER MORGAN INC	1,570	1,595	3,208	365,584	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	286	298	1,214	138,391	商業・専門サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	231	228	1,983	226,010	自動車・自動車部品
CHARTER COMMUNICATION-A	69	—	—	—	メディア
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	141	145	580	66,184	資本財
SPLUNK INC	106	110	745	84,989	ソフトウェア・サービス
OGE ENERGY CORP	169	165	558	63,690	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	51	49	454	51,798	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	1,352	1,363	8,904	1,014,601	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC	81	108	3,494	398,180	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	186	166	782	89,193	エネルギー
REALOGY HOLDINGS CORP	122	—	—	—	不動産
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	106	105	790	90,120	各種金融
ZOETIS INC	392	396	2,364	269,464	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC	96	92	425	48,492	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	314	305	387	44,102	メディア
SPRINT CORP	644	681	536	61,113	電気通信サービス
TECO ENERGY INC	197	—	—	—	公益事業
SNAP-ON INC	48	47	814	92,799	資本財
AGL RESOURCES INC	102	—	—	—	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	152	139	518	59,075	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	481	474	872	99,433	ソフトウェア・サービス
VANTIV INC - CL A	130	133	834	95,113	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	93	101	903	102,927	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	125	140	1,355	154,424	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	75	74	912	103,970	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	76	—	—	—	資本財
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	65	78	1,069	121,913	ソフトウェア・サービス
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	158	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL C	257	260	24,256	2,763,738	ソフトウェア・サービス
IMS HEALTH HOLDINGS INC	137	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NAVIENT CORP	300	257	368	42,020	各種金融
ENDO INTERNATIONAL PLC	178	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED RENTALS INC	77	69	798	90,967	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	133	112	525	59,836	運輸
VOYA FINANCIAL INC	177	166	607	69,224	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	36	—	—	—	素材
ANTERO RESOURCES CORP	67	136	286	32,627	エネルギー
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	77	125	1,046	119,219	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	360	347	654	74,581	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	408	164	1,022	116,551	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	112	105	657	74,948	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	73	740	84,324	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C	—	88	751	85,638	メディア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	133	130	689	78,611	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	67	76	877	100,015	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIGNET JEWELERS LTD	62	51	316	36,115	小売
SYNCHRONY FINANCIAL	689	694	1,869	213,054	各種金融
QORVO INC	116	109	731	83,349	半導体・半導体製造装置
IONIS PHARMACEUTICALS INC	99	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	146	151	833	94,976	保険
ACUITY BRANDS INC	36	37	709	80,876	資本財
JONES LANG LASALLE INC	37	36	424	48,387	不動産
ARAMARK	188	190	705	80,410	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	435	430	1,591	181,324	銀行
LEAR CORP	62	57	836	95,361	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	63	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHITEWAVE FOODS CO	146	—	—	—	食品・飲料・タバコ
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	119	186	584	66,602	素材
RITE AID CORP	857	910	365	41,607	食品・生活必需品小売り
TARGA RESOURCES CORP	—	155	788	89,875	エネルギー
BAXALTA INC	588	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLUMBIA PIPELINE GROUP	322	—	—	—	エネルギー
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	—	95	196	22,381	メディア
WESTROCK CO	223	208	1,131	128,944	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	502	510	4,560	519,624	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	909	911	4,532	516,403	ソフトウェア・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	42	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	83	93	402	45,842	ソフトウェア・サービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,492	1,401	2,643	301,214	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOBILEYE NV	65	147	906	103,275	ソフトウェア・サービス
AMERCO	6	6	222	25,321	運輸
CDW CORP/DE	119	119	713	81,244	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDNAX INC	77	79	440	50,210	ヘルスケア機器・サービス
SABRE CORP	172	181	445	50,755	ソフトウェア・サービス
FIRST DATA CORP- CLASS A	—	277	455	51,856	ソフトウェア・サービス
WR GRACE & CO	59	60	419	47,827	素材
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	143	162	315	35,901	耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	167	169	621	70,839	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	74	79	292	33,356	メディア
DOMINO'S PIZZA INC	—	41	801	91,272	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	—	181	5,904	672,739	メディア
IDEXX LABORATORIES INC	—	76	1,240	141,296	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	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	
SMITH (A.O.) CORP	—	121	654	74,600	資本財
UGI CORP	—	146	717	81,745	公益事業
WESTAR ENERGY INC	—	119	618	70,424	公益事業
FORTIVE CORP	—	263	1,646	187,648	資本財
IHS MARKIT LTD	—	299	1,301	148,244	商業・専門サービス
XL GROUP LTD	—	222	929	105,937	保険
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	—	187	1,236	140,837	ソフトウェア・サービス
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	—	53	648	73,917	素材
COTY INC-CL A	—	397	779	88,808	家庭用品・パーソナル用品
ARCONIC INC	—	364	992	113,065	資本財
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	—	186	594	67,774	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	—	53	659	75,153	保険
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	—	23	299	34,081	家庭用品・パーソナル用品
TELEFLEX INC	—	36	697	79,526	ヘルスケア機器・サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	—	135	439	50,127	電気通信サービス
ENVISION HEALTHCARE CORP	—	100	577	65,769	ヘルスケア機器・サービス
TECHNIPFMC PLC	—	368	1,162	132,399	エネルギー
DXC TECHNOLOGY CO	—	238	1,896	216,101	ソフトウェア・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	480	970	744	84,880	不動産
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	—	190	801	91,270	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	200	210	1,375	156,676	資本財
小計 株数・金額	260,387	261,696	1,765,170	201,123,523	
小計 銘柄数<比率>	596	596	—	<60.4%>	
(カナダ)			千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA	1,228	1,246	11,556	960,704	銀行
IMPERIAL OIL LTD	247	250	988	82,153	エネルギー
THOMSON REUTERS CORP	286	273	1,645	136,825	各種金融
TRANSCANADA CORP	588	730	4,627	384,681	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	301	308	1,918	159,513	電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	506	518	2,410	200,407	保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B	470	466	1,155	96,071	素材
BARRICK GOLD CORP	965	985	2,252	187,266	素材
BCE INC	120	132	809	67,298	電気通信サービス
AGRIUM INC	109	108	1,347	112,036	素材
BOMBARDIER INC-B	1,596	1,707	377	31,360	資本財
BANK OF MONTREAL	530	542	5,120	425,693	銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	733	752	3,921	326,009	各種金融
BANK OF NOVA SCOTIA	995	1,013	7,677	638,232	銀行
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	268	283	533	44,346	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC	218	215	462	38,408	資本財
CAMECO CORP	330	348	468	38,967	エネルギー
CI FINANCIAL CORP	195	207	553	45,996	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	328	333	3,572	297,003	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	907	929	3,940	327,600	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	659	645	6,533	543,158	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	59	56	875	72,803	小売
ENBRIDGE INC	760	1,371	7,508	624,220	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	18	19	1,151	95,715	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	183	183	1,217	101,210	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	292	281	455	37,830	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	80	86	340	28,310	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	188	184	1,418	117,916	食品・生活必需品小売り

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,631	1,661	3,973	330,284	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	335	322	1,969	163,738	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	284	284	1,503	125,009	銀行
ONEX CORPORATION	71	68	682	56,720	各種金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	691	700	1,567	130,289	素材
POWER CORP OF CANADA	310	314	937	77,969	保険
POWER FINANCIAL CORP	208	204	674	56,030	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	337	357	1,024	85,203	メディア
SUNCOR ENERGY INC	1,310	1,402	6,059	503,721	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	43	41	502	41,813	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	120	117	2,503	208,092	運輸
ENCANA CORP	699	803	1,249	103,868	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	180	185	1,205	100,194	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	145	133	355	29,564	資本財
GOLDCORP INC	687	729	1,409	117,203	素材
KINROSS GOLD CORP	1,019	995	559	46,485	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	124	126	672	55,901	資本財
GREAT-WEST LIFECO INC	247	246	845	70,266	保険
METHANEX CORP	73	71	409	34,055	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	849	869	314	26,150	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	70	71	155	12,925	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	192	179	699	58,137	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	211	208	924	76,824	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	424	404	518	43,122	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELUS CORP	116	116	530	44,126	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	571	586	717	59,674	素材
YAMANA GOLD INC	785	824	304	25,344	素材
FORTIS INC	236	344	1,531	127,284	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	347	354	2,221	184,690	食品・生活必需品小売り
ELDORADO GOLD CORP	580	624	312	25,936	素材
TORONTO-DOMINION BANK	1,533	1,559	9,887	821,921	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	145	148	1,410	117,286	素材
SILVER WHEATON CORP	361	375	1,026	85,322	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	133	144	302	25,138	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	87	82	444	36,973	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	107	104	414	34,435	公益事業
METRO INC	199	199	917	76,262	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	101	215	963	80,070	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	109	109	1,010	84,042	保険
CRESCENT POINT ENERGY CORP	419	459	609	50,633	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	692	874	1,140	94,815	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	288	305	549	45,714	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	160	197	557	46,313	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	309	336	1,465	121,865	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	93	94	460	38,274	エネルギー
DOLLARAMA INC	99	95	1,162	96,608	小売
KEYERA CORP	143	160	640	53,243	エネルギー
ALTAGAS LTD	126	148	455	37,869	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	124	142	371	30,856	エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	66	63	313	26,065	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	97	115	229	19,052	不動産
INTER PIPELINE LTD	280	296	807	67,126	エネルギー

銘柄	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	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	151	162	479	39,862	エネルギー
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	133	211	554	46,131	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	16	16	1,094	91,002	ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN	168	185	1,502	124,914	消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	57	56	320	26,614	素材
VERESEN INC	258	255	471	39,216	エネルギー
CCL INDUSTRIES INC - CL B	23	24	727	60,450	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	323	306	365	30,347	各種金融
LINAMAR CORP	39	43	274	22,816	自動車・自動車部品
HYDRO ONE LTD	—	168	387	32,233	公益事業
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	92	—	—	—	商業・専門サービス
EMERA INC	—	50	235	19,543	公益事業
小計 株数・金額	32,985	35,203	142,733	11,865,402	
小計 銘柄数<比率>	90	91	—	<3.6%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
COMMERZBANK AG	882	881	838	103,746	銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	1,141	1,738	3,014	373,133	各種金融
METRO AG	147	152	450	55,718	食品・生活必需品小売り
SIEMENS AG-REG	655	641	8,389	1,038,604	資本財
RWE AG	407	403	628	77,852	公益事業
BASF SE	759	770	6,940	859,250	素材
VOLKSWAGEN AG	29	26	384	47,617	自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	796	808	5,558	688,196	自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	146	149	1,876	232,341	家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE	1,661	1,861	1,341	166,115	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	274	277	2,505	310,128	自動車・自動車部品
BAYER AG-REG	684	694	7,990	989,177	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINDE AG	153	155	2,608	322,965	素材
ALLIANZ SE-REG	377	382	6,635	821,515	保険
MAN SE	29	29	282	34,973	資本財
CONTINENTAL AG	90	92	1,932	239,275	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	933	953	1,818	225,141	半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	126	130	698	86,467	自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	204	210	352	43,681	運輸
HUGO BOSS AG -ORD	55	53	371	45,964	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE POST AG-REG	801	814	2,587	320,320	運輸
SAP SE	812	824	7,745	958,899	ソフトウェア・サービス
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	181	193	749	92,733	メディア
DEUTSCHE BOERSE AG	159	162	1,516	187,757	各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	180	180	1,550	191,945	ヘルスケア機器・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	34	33	239	29,628	運輸
ADIDAS AG	173	158	2,833	350,818	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,669	2,748	4,594	568,809	電気通信サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	137	134	2,360	292,237	保険
THYSSENKRUPP AG	305	302	673	83,395	素材
BEIERSDORF AG	82	82	775	96,066	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	116	123	1,066	132,008	素材
MERCK KGAA	106	109	1,221	151,195	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOLKSWAGEN AG-PREF	153	156	2,245	278,002	自動車・自動車部品
LANXESS AG	75	74	490	60,782	素材
FRESENIUS SE & CO KGAA	315	344	2,699	334,177	ヘルスケア機器・サービス
HOCHTIEF AG	—	16	271	33,550	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	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	279	294	995	123,186	不動産
GEA GROUP AG	150	156	582	72,105	資本財
SYMRISE AG	102	100	651	80,597	素材
K+S AG-REG	158	166	371	45,935	素材
HENKEL AG & CO KGAA	85	86	935	115,827	家庭用品・パーソナル用品
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	102	105	449	55,705	ソフトウェア・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	44	46	367	45,491	自動車・自動車部品
HANNOVER RUECK SE	49	50	550	68,209	保険
BRENNTAG AG	127	127	682	84,434	資本財
AXEL SPRINGER SE	37	37	200	24,858	メディア
FUCHS PETROLUB SE -PREF	57	59	290	35,978	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	625	647	264	32,768	電気通信サービス
OSRAM LICHT AG	73	75	508	62,999	資本財
VONOVIA SE	386	391	1,391	172,258	不動産
EVONIK INDUSTRIES AG	114	130	404	50,103	素材
ZALANDO SE	69	75	294	36,457	小売
COVESTRO AG	—	74	491	60,885	素材
SCHAEFFLER AG	—	146	217	26,931	自動車・自動車部品
INNOGY SE	—	122	412	51,106	公益事業
小計 株数・金額	18,327	19,768	98,304	12,170,037	
小計 銘柄数<比率>	52	56	—	<3.7%>	
(ユーロ…イタリア)					
ASSICURAZIONI GENERALI	961	984	1,461	180,900	保険
INTESA SANPAOLO	10,499	10,651	3,016	373,444	銀行
TELECOM ITALIA SPA	9,508	9,443	831	102,883	電気通信サービス
ENI SPA	2,105	2,143	3,194	395,427	エネルギー
UNICREDIT SPA	3,948	1,589	2,650	328,134	銀行
ENEL SPA	6,331	6,437	2,937	363,601	公益事業
SAIPEM SPA	4,956	5,277	211	26,127	エネルギー
ATLANTIA SPA	342	342	827	102,428	運輸
INTESA SANPAOLO-RSP	762	800	213	26,414	銀行
LUXOTTICA GROUP SPA	139	138	750	92,943	耐久消費財・アパレル
MEDIOBANCA SPA	466	484	444	55,071	銀行
SNAM SPA	1,760	2,037	864	107,075	エネルギー
TELECOM ITALIA-RSP	4,971	5,183	373	46,266	電気通信サービス
BANCO POPOLARE SC	308	—	—	—	銀行
LEONARDO SPA	350	343	544	67,439	資本財
UBI BANCA SPA	734	—	—	—	銀行
TERNA SPA	1,281	1,253	616	76,363	公益事業
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	908	975	213	26,448	保険
PRYSMIAN SPA	160	158	408	50,564	資本財
EXOR SPA	93	—	—	—	各種金融
POSTE ITALIANE SPA	—	442	282	34,957	保険
小計 株数・金額	50,592	48,688	19,842	2,456,493	
小計 銘柄数<比率>	20	18	—	<0.7%>	
(ユーロ…フランス)					
MICHELIN (CGDE)	154	153	1,870	231,536	自動車・自動車部品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	231	234	5,460	675,966	耐久消費財・アパレル
PEUGEOT SA	366	400	774	95,864	自動車・自動車部品
AXA SA	1,627	1,624	3,943	488,250	保険
DANONE	487	495	3,309	409,671	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	458	476	1,048	129,852	食品・生活必需品小売り

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
VIVENDI	960	865	1,591	196,976	メディア
INGENICO GROUP	45	44	378	46,835	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA	600	643	3,173	392,896	銀行
AIR LIQUIDE SA	284	326	3,698	457,887	素材
TOTAL SA	1,816	1,909	9,142	1,131,822	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	394	420	2,117	262,111	資本財
ZODIAC AEROSPACE	168	172	380	47,137	資本財
VINCI SA	396	426	3,314	410,308	資本財
SANOFI	971	973	8,900	1,101,908	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	380	399	753	93,317	公益事業
L'OREAL	207	210	3,987	493,695	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA	175	145	611	75,748	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	461	471	3,329	412,202	資本財
BNP PARIBAS	876	942	6,256	774,528	銀行
ESSILOR INTERNATIONAL	169	173	2,074	256,883	ヘルスケア機器・サービス
CAPGEMINI	135	137	1,310	162,218	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	48	43	232	28,804	食品・生活必需品小売り
VALEO SA	65	201	1,312	162,505	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	21	21	971	120,296	耐久消費財・アパレル
SODEXO	77	77	924	114,480	消費者サービス
KERING	62	63	1,876	232,265	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	106	108	902	111,671	ソフトウェア・サービス
TECHNIP SA	87	—	—	—	エネルギー
CHRISTIAN DIOR SE	45	45	1,153	142,853	耐久消費財・アパレル
ATOS SE	72	74	936	115,894	ソフトウェア・サービス
ORANGE	1,644	1,675	2,485	307,743	電気通信サービス
CNP ASSURANCES	142	138	277	34,305	保険
IMERYS SA	29	31	238	29,516	素材
SAFRAN SA	258	262	1,991	246,565	資本財
RENAULT SA	158	161	1,422	176,099	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	156	159	1,050	130,018	メディア
LAGARDERE SCA	95	102	280	34,780	メディア
JCDECAUX SA	61	64	187	23,245	メディア
SOCIETE BIC SA	23	24	264	32,794	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	167	170	649	80,355	資本財
THALES SA	86	89	873	108,187	資本財
PERNOD RICARD SA	175	178	2,149	266,075	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	874	945	1,340	165,902	銀行
ENGIE	1,215	1,332	1,841	227,919	公益事業
ALSTOM	128	123	368	45,653	資本財
ARKEMA	55	55	543	67,304	素材
LEGRAND SA	220	224	1,384	171,413	資本財
SCOR SE	126	138	489	60,640	保険
ADP	24	26	334	41,367	運輸
EDF	201	316	274	34,014	公益事業
NATIXIS	779	808	522	64,657	銀行
WENDEL	23	23	309	38,311	各種金融
BUREAU VERITAS SA	221	228	487	60,402	商業・専門サービス
EURAZEO	32	34	221	27,408	各種金融
SUEZ	255	282	468	58,018	公益事業
EIFFAGE	—	47	370	45,856	資本財
ILIAD SA	21	22	517	64,010	電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	141	152	315	39,111	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	393	403	414	51,372	運輸
EDENRED	172	180	429	53,157	商業・専門サービス
REMY COINTREAU	19	19	187	23,186	食品・飲料・タバコ
REXEL SA	255	258	397	49,237	資本財
BOLLORE	711	764	302	37,387	運輸
SFR GROUP SA	91	78	244	30,285	電気通信サービス
DASSAULT AVIATION SA	—	2	261	32,369	資本財
SEB SA	—	18	272	33,782	耐久消費財・アパレル
小計 株数・金額	20,923	21,831	99,909	12,368,852	
小計 銘柄数<比率>	64	66	—	<3.7%>	
(ユーロ…オランダ)					
QIAGEN N.V.	183	188	554	68,615	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV	786	852	835	103,483	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	743	745	742	91,897	自動車・自動車部品
FERRARI NV	105	106	805	99,733	自動車・自動車部品
EXOR NV	—	88	470	58,243	各種金融
AIRBUS SE	489	486	3,603	446,122	資本財
STMICROELECTRONICS NV	512	530	799	98,988	半導体・半導体製造装置
GEMALTO	66	69	363	45,039	ソフトウェア・サービス
WOLTERS KLUWER	249	251	974	120,615	商業・専門サービス
KONINKLIJKE KPN NV	2,654	2,842	809	100,238	電気通信サービス
AKZO NOBEL	204	212	1,595	197,579	素材
HEINEKEN NV	190	193	1,650	204,340	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV	787	797	2,629	325,474	資本財
RELX NV	822	839	1,527	189,125	商業・専門サービス
AEGON NV	1,506	1,450	665	82,405	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	688	1,074	2,124	263,029	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD HOLDING NV	105	101	571	70,703	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV	83	85	690	85,458	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	149	150	993	122,989	素材
ING GROEP NV	3,201	3,254	4,978	616,318	銀行
ASML HOLDING NV	286	313	3,843	475,777	半導体・半導体製造装置
UNILEVER NV-CVA	1,346	1,367	6,757	836,576	家庭用品・パーソナル用品
VOPAK	58	62	263	32,565	エネルギー
BOSKALIS WESTMINSTER	72	78	254	31,455	資本財
TNT EXPRESS NV	417	—	—	—	運輸
OCI NV	73	—	—	—	素材
NN GROUP NV	261	263	841	104,132	保険
ALTICE NV - B	87	94	211	26,165	メディア
ALTICE NV - A	310	306	689	85,403	メディア
ABN AMRO GROUP NV-CVA	—	233	571	70,772	銀行
小計 株数・金額	16,445	17,040	40,817	5,053,252	
小計 銘柄数<比率>	28	28	—	<1.5%>	
(ユーロ…スペイン)					
BANCO POPULAR ESPANOL	1,432	2,911	229	28,404	銀行
ENDESA SA	265	264	551	68,314	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	158	195	676	83,734	資本財
IBERDROLA SA	4,556	4,655	3,118	386,127	公益事業
TELEFONICA SA	3,725	3,808	3,820	472,965	電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA	11,932	12,241	7,418	918,405	銀行
BANKINTER SA	553	547	462	57,206	銀行

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

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
CSL LTD	385	383	5,209	438,093	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINA LTD	2,146	2,161	382	32,178	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	618	641	2,094	176,092	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	2,412	2,467	7,229	607,951	銀行
RIO TINTO LTD	353	359	2,139	179,902	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	1,147	1,153	1,566	131,703	保険
LENDLEASE GROUP	468	479	797	67,044	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	1,416	1,450	11,903	1,000,994	銀行
WESTPAC BANKING CORP	2,757	2,818	9,193	773,108	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,180	2,240	7,236	608,519	銀行
BRAMBLES LTD	1,325	1,331	1,402	117,967	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	494	469	226	19,006	運輸
BORAL LTD	622	964	659	55,452	素材
WOOLWORTHS LTD	1,057	1,089	2,952	248,314	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	3,585	3,534	1,555	130,774	電気通信サービス
AMP LTD	2,496	2,488	1,318	110,902	各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD	692	753	357	30,049	消費者サービス
AMCOR LIMITED	970	976	1,505	126,598	素材
COMPUTERSHARE LTD	403	386	588	49,507	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	464	451	924	77,774	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	256	261	2,444	205,546	各種金融
CIMIC GROUP LTD	84	88	357	30,025	資本財
ASX LTD	165	160	833	70,094	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	501	507	492	41,445	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	48	50	739	62,174	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	377	382	840	70,672	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	467	515	211	17,780	小売
NEWCREST MINING LTD	637	636	1,284	108,050	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	2,050	2,002	1,299	109,303	保険
ORIGIN ENERGY LTD	1,462	1,465	1,160	97,583	エネルギー
ORICA LTD	312	325	619	52,101	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	332	345	810	68,162	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	1,400	1,566	573	48,201	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	1,080	1,095	1,599	134,494	保険
TRANSURBAN GROUP	1,714	1,753	2,146	180,506	運輸
WESFARMERS LTD	936	954	4,210	354,063	食品・生活必需品小売り
CHALLENGER LTD	485	473	631	53,110	各種金融
SYDNEY AIRPORT	949	921	671	56,473	運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD	227	218	714	60,071	エネルギー
OIL SEARCH LTD	1,148	1,187	865	72,792	エネルギー
AGL ENERGY LTD	582	566	1,535	129,153	公益事業
TATTS GROUP LTD	1,244	1,202	526	44,280	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,276	1,332	648	54,559	素材
ASCIANO LTD	547	—	—	—	運輸
ILUKA RESOURCES LTD	354	—	—	—	素材
AUSNET SERVICES	1,718	1,740	303	25,539	公益事業
CROWN RESORTS LTD	300	324	415	34,965	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD	1,427	1,458	541	45,494	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	400	384	474	39,897	銀行
AURIZON HOLDINGS LTD	1,764	1,713	949	79,817	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	619	608	803	67,541	食品・飲料・タバコ
RAMSAY HEALTH CARE LTD	120	117	867	72,937	ヘルスケア機器・サービス

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L		47	50	179	15,058	消費者サービス
SEEK LTD		284	272	500	42,092	商業・専門サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD		328	316	378	31,869	銀行
REA GROUP LTD		48	48	310	26,136	メディア
TPG TELECOM LTD		247	306	182	15,380	電気通信サービス
HEALTHSCOPE LTD		1,457	1,564	356	30,002	ヘルスケア機器・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD		2,309	2,282	686	57,766	保険
PLATINUM ASSET MANAGEMENT		195	—	—	—	各種金融
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		—	56	374	31,456	消費者サービス
SOUTH32 LTD		4,430	4,400	1,166	98,055	素材
VOCUS GROUP LTD		390	465	116	9,814	電気通信サービス
小計	株数・金額	63,400	63,425	99,445	8,362,334	
	銘柄数<比率>	63	61	—	<2.5%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
SPARK NEW ZEALAND LTD		1,518	1,586	591	46,059	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		803	830	568	44,282	運輸
CONTACT ENERGY LTD		630	644	338	26,366	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD		573	598	513	39,970	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD		321	323	274	21,340	ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD		1,118	1,136	318	24,815	公益事業
MERCURY NZ LTD		644	643	206	16,066	公益事業
小計	株数・金額	5,610	5,763	2,812	218,901	
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
WHARF HOLDINGS LTD		1,130	1,140	7,638	111,743	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		490	470	3,494	51,123	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		2,238	2,283	23,270	340,450	資本財
SUN HUNG KAI PROPERTIES		1,440	1,220	14,225	208,114	不動産
MTR CORP		1,225	1,215	5,655	82,744	運輸
HONG KONG & CHINA GAS		5,865	6,483	10,178	148,916	公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT		4,500	4,620	4,532	66,306	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		1,165	1,160	8,282	121,171	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		950	983	19,237	281,441	各種金融
CATHAY PACIFIC AIRWAYS		1,020	1,140	1,249	18,279	運輸
HANG LUNG GROUP LTD		—	700	2,268	33,180	不動産
HANG LUNG PROPERTIES LTD		1,870	1,940	3,802	55,629	不動産
CLP HOLDINGS LTD		1,595	1,390	11,564	169,193	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		958	943	4,684	68,536	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD		990	988	3,231	47,275	銀行
HANG SENG BANK LTD		632	642	10,451	152,909	銀行
HYSAN DEVELOPMENT CO		540	550	2,026	29,651	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD		1,080	1,160	1,296	18,973	消費者サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		209	197	2,379	34,815	半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO		2,514	2,474	3,339	48,862	不動産
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		610	650	2,145	31,381	耐久消費財・アパレル
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE		570	550	3,800	55,601	公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		3,060	3,120	10,202	149,261	銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		1,150	1,175	4,094	59,908	耐久消費財・アパレル
PCCW LTD		3,530	3,900	1,786	26,132	電気通信サービス
LI & FUNG LTD		4,900	5,220	1,691	24,743	耐久消費財・アパレル
KERRY PROPERTIES LTD		520	575	1,661	24,311	不動産
NWS HOLDINGS LTD		1,285	1,355	2,062	30,171	資本財

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

銘柄		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	
(イスラエル)		百株	百株	ｻｲｽﾗｴﾙｼｪｹﾙ	千円	
FRUTAROM		－	34	724	22,891	素材
小計	株数・金額	5,013	4,674	10,336	326,437	
	銘柄数＜比率＞	9	9	－	＜0.1%＞	
合計	株数・金額	1,109,747	1,097,576	－	309,229,876	
	銘柄数＜比率＞	1,260	1,262	－	＜92.9%＞	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 邦貨換算金額欄の＜　＞内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
HCP INC	38	38	1,206	137,434	0.0
MACERICH CO/THE	11	10	617	70,350	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	—	6	747	85,221	0.0
PROLOGIS INC	43	44	2,434	277,439	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	7	7	607	69,267	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	—	12	451	51,464	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	12	13	1,514	172,592	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5	5	1,379	157,214	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	9	10	778	88,665	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	5	5	758	86,464	0.0
WELLTOWER INC	29	30	2,185	249,028	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	12	12	1,571	179,002	0.1
MID-AMERICA APARTMENT COMM	6	9	928	105,807	0.0
REALTY INCOME CORP	20	21	1,172	133,647	0.0
REGENCY CENTERS CORP	7	12	777	88,602	0.0
SL GREEN REALTY CORP	8	8	866	98,677	0.0
UDR INC	21	21	826	94,211	0.0
VENTAS INC	27	29	1,941	221,221	0.1
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	77	86	971	110,742	0.0
WEYERHAEUSER CO	65	63	2,080	237,037	0.1
AMERICAN TOWER CORP	35	35	4,524	515,519	0.2
AGNC INVESTMENT CORP	28	28	559	63,742	0.0
VEREIT INC	75	83	627	71,500	0.0
DUKE REALTY CORP	28	29	817	93,145	0.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	15	25	485	55,336	0.0
IRON MOUNTAIN INC	17	20	717	81,695	0.0
EQUINIX INC	5	6	2,771	315,792	0.1
CROWN CASTLE INTL CORP	27	30	2,870	327,071	0.1
EQUITY RESIDENTIAL	30	30	2,001	228,061	0.1
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	—	44	584	66,617	0.0
GGP INC	47	47	1,070	121,989	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	62	61	1,083	123,405	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	12	12	508	57,904	0.0
PUBLIC STORAGE	12	12	2,586	294,751	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	25	26	4,281	487,798	0.1
VORNADO REALTY TRUST	14	14	1,336	152,312	0.0
KIMCO REALTY CORP	34	36	695	79,200	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	11	11	2,223	253,354	0.1
小計 口数・金額	892	1,008	53,565	6,103,296	
小計 銘柄数<比率>	35	38	—	<1.8%>	
(カナダ)			千カナダドル		
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	5	5	175	14,547	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	11	12	275	22,863	0.0

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		13	13	346	28,774	0.0
小計	口数・金額	29	31	796	66,185	
	銘柄数<比率>	3	3	－	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		2	3	475	58,853	0.0
KLEPIERRE		18	17	672	83,202	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		8	8	1,978	244,891	0.1
FONCIERE DES REGIONS		2	2	221	27,446	0.0
ICADE		2	3	231	28,625	0.0
ユーロ計	口数・金額	34	35	3,578	443,019	
	銘柄数<比率>	5	5	－	<0.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		80	83	553	81,270	0.0
HAMMERSON PLC		65	66	394	57,912	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		65	65	734	107,834	0.0
INTU PROPERTIES PLC		78	83	232	34,182	0.0
SEGRO PLC		62	84	417	61,310	0.0
小計	口数・金額	351	382	2,333	342,510	
	銘柄数<比率>	5	5	－	<0.1%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		285	291	827	69,608	0.0
SCENTRE GROUP		446	452	1,943	163,390	0.0
GPT GROUP		153	147	784	65,957	0.0
MIRVAC GROUP		317	303	690	58,094	0.0
STOCKLAND		202	209	1,004	84,469	0.0
WESTFIELD CORP		165	166	1,488	125,177	0.0
DEXUS		83	84	869	73,108	0.0
GOODMAN GROUP		149	150	1,242	104,518	0.0
小計	口数・金額	1,803	1,806	8,851	744,323	
	銘柄数<比率>	8	8	－	<0.2%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		186	190	10,896	159,415	0.0
小計	口数・金額	186	190	10,896	159,415	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.0%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		211	217	379	30,725	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		172	184	300	24,306	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		215	218	429	34,713	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		183	194	508	41,158	0.0
小計	口数・金額	784	815	1,617	130,903	
	銘柄数<比率>	4	4	－	<0.0%>	
合計	口数・金額	4,083	4,269	－	7,989,655	
	銘柄数<比率>	61	64	－	<2.4%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 比率および合計欄の<　>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末 買建額	当期末 売建額
			百万円	百万円
外国	株式先物取引	SP EMINI	4,072	－
		SP/TSE60	228	－
		SWISS IX	204	－
		EURO ST	940	－
		SPI 200	332	－
		FTSE100	442	－

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

○投資信託財産の構成

（2017年５月12日現在）

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
株式	309,229,876	91.9
投資証券	7,989,655	2.4
コール・ローン等、その他	19,418,607	5.7
投資信託財産総額	336,638,138	100.0

（注）期末における外貨建純資産（333,541,488千円）の投資信託財産総額（336,638,138千円）に対する比率は99.1％です。
（注）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

１アメリカドル＝113.94円	１カナダドル＝83.13円	１ユーロ＝123.80円	１イギリスポンド＝146.77円
１スイスフラン＝113.06円	１スウェーデンクローネ＝12.83円	１ノルウェークローネ＝13.25円	１デンマーククローネ＝16.64円
１オーストラリアドル＝84.09円	１ニュージーランドドル＝77.83円	１香港ドル＝14.63円	１シンガポールドル＝80.91円
１イスラエルシェケル＝31.58円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年５月12日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	346,680,248,542
コール・ローン等	6,500,298,966
株式(評価額)	309,229,876,905
投資証券(評価額)	7,989,655,718
未収入金	19,062,532,745
未収配当金	619,577,275
差入委託証拠金	3,278,306,933
(B) 負債	13,694,500,515
未払金	10,045,919,306
未払解約金	3,648,576,787
未払利息	4,422
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	332,985,748,027
元本	137,017,202,778
次期繰越損益金	195,968,545,249
(D) 受益権総口数	137,017,202,778口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	24,302円

＜注記事項＞

①期首元本額　136,910,588,935円
　期中追加設定元本額　153,902,470,267円
　期中一部解約元本額　153,795,856,424円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.4302円です。

○損益の状況 (2016年５月13日～2017年５月12日)

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

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

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

ファンド・マネジャー（海外株式）	9,941,102,010円
ｅＭＡＸＩＳ 先進国株式インデックス	14,836,732,618円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,145,144,329円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	195,449,985円
コアバランス	458,860円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	615,318円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	593,676円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	1,634,211円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 先進国株式インデックス	187,851,870円
海外株式セレクション（ラップ向け）	3,225,127円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	18,432,345円
三菱ＵＦＪ ＤＣ海外株式インデックスファンド	7,679,239,467円
ｅＭＡＸＩＳ 全世界株式インデックス	2,377,930,535円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	2,746,833,986円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	5,656,621,246円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	113,562,512円
三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）	94,246,909円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	781,285,141円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	33,664,211円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	3,677,922円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	7,740,970円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	34,005,389円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	36,408,176円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	48,596,190円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,078,970,724円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,411,940,787円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	263,175,398円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	2,317,023,051円
ＭＵＡＭ 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	49,862,986,580円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４５型（適格機関投資家限定）	230,407,728円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	89,565,460円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,710,242,579円
ＭＳＣＩコクサイインデックスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	3,112,414,073円
三菱ＵＦＪ グローバル型バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,032,731円
ＭＵＡＭ 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	6,975,931,241円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	61,841,575円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	365,112,988円
ＭＵＫＡＭ バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	1,382,413,011円
ＭＵＫＡＭ バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	259,970,356円
ＭＵＫＡＭ スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	123,882,140円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	15,245,041円
ＭＵＫＡＭ 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	949,629,866円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンド	1,940,765,146円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	2,568,128円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	12,001,808円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	18,323,254円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	19,740,928円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンドＶＡ	85,496,025円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	24,640,625円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	180,455,086円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	40,515,958円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	282,957,955円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞外国株式インデックスファンド	4,198,780,634円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	173,569,383円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	687,145,111円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	642,134,748円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	548,269,657円
合計	137,017,202,778円

新興国株式インデックスマザーファンド

《第８期》決算日2017年５月12日

［計算期間：2016年５月13日～2017年５月12日］

「新興国株式インデックスマザーファンド」は、５月12日に第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	新興国の株式等（ＤＲ（預託証書）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、ＭＳＣＩ エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	新興国の株式等を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＭＳＣＩ エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
4期(2013年5月13日)	19,772	40.8	107,091.73	37.6	98.2	1.7	－	24,079
5期(2014年5月12日)	19,482	△ 1.5	102,729.55	△ 4.1	96.6	3.0	0.4	24,665
6期(2015年5月12日)	23,973	23.1	124,478.28	21.2	94.8	5.0	0.4	39,530
7期(2016年5月12日)	17,338	△27.7	87,559.17	△29.7	92.8	6.4	0.5	35,618
8期(2017年5月12日)	23,115	33.3	113,979.54	30.2	92.6	6.5	0.4	49,734

(注) ＭＳＣＩ エマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。ＭＳＣＩ エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）は、ＭＳＣＩ エマージング・マーケット・インデックス（米ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。また、ＭＳＣＩ エマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
(注) 上記指数は、配当相当分を含まないインデックスです。このためファンドとベンチマークの騰落率との差異には、ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる「配当金要因」が含まれている点にご留意ください。
(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ＭＳＣＩ エマージング・マーケット・インデックス		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	(円換算ベース)	騰落率			
(期　首)	円	%		%	%	%	%
2016年５月12日	17,338	－	87,559.17	－	92.8	6.4	0.5
５月末	17,754	2.4	89,601.69	2.3	95.9	3.6	0.5
６月末	16,928	△ 2.4	84,573.19	△ 3.4	93.7	5.6	0.5
７月末	18,303	5.6	91,422.22	4.4	91.4	8.2	0.5
８月末	18,597	7.3	92,750.15	5.9	92.1	7.4	0.4
９月末	18,505	6.7	92,361.79	5.5	95.3	4.2	0.4
10月末	18,994	9.6	94,741.01	8.2	94.4	5.2	0.4
11月末	19,422	12.0	96,509.08	10.2	95.1	4.3	0.4
12月末	20,131	16.1	99,999.91	14.2	96.7	2.7	0.4
2017年１月末	20,882	20.4	103,918.66	18.7	94.4	5.1	0.4
２月末	21,326	23.0	105,842.08	20.9	92.3	7.4	0.4
３月末	21,883	26.2	108,764.50	24.2	90.5	9.0	0.4
４月末	22,056	27.2	109,026.70	24.5	92.1	7.4	0.4
(期　末)							
2017年５月12日	23,115	33.3	113,979.54	30.2	92.6	6.5	0.4

(注) 騰落率は期首比。
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

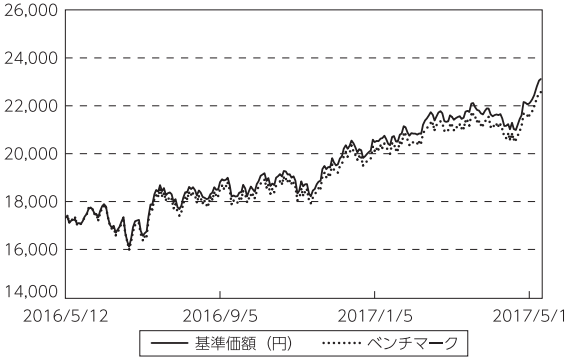
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ33.3%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(30.2%)を3.1%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

◎新興国株式市況

・米国の保護主義などへの懸念から下落する局面もありましたが、市場でリスク選好の動きが強まるなか、新興国株式市況は上昇しました。

◎為替市況

・為替市況は、期首に比べて4.7%の円安・香港ドル高、15.6%の円安・ブラジルレアル高となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

・ＭＳＣＩ エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に採用されている新興国の株式等を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは30.2%の上昇となったため、カイ離は3.1%程度となりました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	コスト要因	その他の要因	合計
ベンチマークとのカイ離	△0.1%程度	0.1%程度	△0.1%程度	3.2%程度	3.1%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△0.1%程度でした。

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

・効率的に運用を行うため、円貨、外貨現金などを若干保有しました。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.1%程度でした。

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

・売買に係るコストを考慮しつつ、できる限り多くの銘柄に分散投資を行いました。

・ファンドの特性をよりベンチマークに近づけるべく、マルチファクターモデルを用いて組入銘柄とその組入比率を決定しています。

◎コスト要因

売買にかかるコストおよび保管料等による影響は△0.1%程度でした。

◎その他の要因

その他配当・利子収入等による影響は3.2%程度でした。

○今後の運用方針

・引き続きファンドの資産のほぼ全額を株式（先物・ＲＥＩＴを含む）に投資し、高い株式組入比率を維持します。

・売買に係るコストを考慮しつつ、多くの銘柄に分散投資を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2016年５月13日～2017年５月12日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	5	0.028	(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）	(4)	(0.020)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(2)	(0.008)	
(b) 有価証券取引税	3	0.016	(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）	(3)	(0.016)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	24	0.122	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(21)	(0.107)	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）	(3)	(0.015)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	32	0.166	
期中の平均基準価額は、19,565円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2016年５月13日～2017年５月12日）

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 231,344 (350)	千アメリカドル 14,890 (－)	百株 214,938 (107)	千アメリカドル 3,281 (659)
	メキシコ	7,452 (521)	千メキシコペソ 26,351 (△98)	4,613	千メキシコペソ 15,098
	ブラジル	4,499 (1,031)	千ブラジルレアル 9,530 (－)	3,286 (－)	千ブラジルレアル 5,896 (634)
	チリ	25,679 (519)	千チリペソ 257,553 (27)	4,990 (30)	千チリペソ 197,263 (51)
	コロンビア	67 (1)	千コロンビアペソ 114,153 (－)	－	千コロンビアペソ －
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ギリシャ	－	－	182	51
	トルコ	602 (66)	千トルコリラ 511 (－)	875	千トルコリラ 565
	チェコ	440 (53)	千チェココルナ 3,616 (－)	－	千チェココルナ －
	ハンガリー	33	千ハンガリーフォリント 36,854	20	千ハンガリーフォリント 15,651
	ポーランド	167 (42)	千ポーランドズロチ 1,161 (－)	467	千ポーランドズロチ 651
	香港	83,312 (△21,920)	千香港ドル 60,957 (△153)	56,619	千香港ドル 39,321
	マレーシア	5,148 (497)	千マレーシアリンギット 2,585 (－)	7,918 (－)	千マレーシアリンギット 3,487 (8)
	タイ	10,947 (5,870)	千タイバーツ 38,992 (－)	8,335	千タイバーツ 15,433
	フィリピン	3,787 (68)	千フィリピンペソ 29,297 (－)	1,641	千フィリピンペソ 11,087

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	インドネシア	百株 34,950 (9,588)	千インドネシアルピア 11,367,388 (—)	百株 15,715	千インドネシアルピア 7,140,665
	韓国	670 (149)	千韓国ウォン 5,833,338 (—)	476	千韓国ウォン 5,551,490
	台湾	21,061 (5,868)	千ニュー台湾ドル 131,668 (△ 589)	14,776 (2,439)	千ニュー台湾ドル 83,704 (10,963)
	インド	7,858 (2,575)	千インドルピー 419,225 (—)	3,120	千インドルピー 137,877
	アラブ首長国連邦	2,600 (608)	千アラブディルハム 396 (107)	3,574 (207)	千アラブディルハム 438 (41)
	カタール	— (108)	千カタールリアル — (63)	309 (20)	千カタールリアル 261 (11)
	南アフリカ	2,689 (623)	千南アフリカランド 43,567 (—)	1,940 (1,748)	千南アフリカランド 18,248 (10,866)

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

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	メキシコ	千口	千メキシコペソ	千口	千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	20 (—)	730 (△ 293)	9	261
	小計	20 (—)	730 (△ 293)	9	261
	南アフリカ		千南アフリカランド		千南アフリカランド
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	21	573	44	1,063
	REDEFINE PROPERTIES LTD	83	929	30	328
	HYPROP INVESTMENTS LTD	1	217	—	—
	RESILIENT REIT LTD	2	245	1	178
	FORTRESS INCOME FUND LTD-A	— (79)	— (1,221)	—	—
	FORTRESS INCOME FUND LTD	— (67)	— (2,435)	—	—
	小計	108 (146)	1,966 (3,656)	75	1,571

(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 16,515	百万円 16,219	百万円 －	百万円 －

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

○株式売買比率

(2016年５月13日～2017年５月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	7,987,786千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	38,419,120千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.20

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年５月13日～2017年５月12日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	%
為替直物取引	8,742	1,647	18.8	6,843	1,225	17.9

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

○組入資産の明細

(2017年５月12日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AMBEV SA-ADR	85	—	—	—	食品・飲料・タバコ
AMERICA MOVIL-SPN ADR CL L	8	—	—	—	電気通信サービス
VALE SA-SP ADR	20	—	—	—	素材
PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	40	—	—	—	エネルギー
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	42	—	—	—	半導体・半導体製造装置
SINA CORP	—	50	418	47,626	ソフトウェア・サービス
NETEASE INC-ADR	34	70	1,953	222,630	ソフトウェア・サービス
CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	114	330	1,789	203,913	小売
INFOSYS LTD-SP ADR	36	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	168	168	210	23,984	素材
BAIDU INC - SPON ADR	117	241	4,502	513,032	ソフトウェア・サービス
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	453	436	412	47,049	電気通信サービス
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	57	119	825	94,044	消費者サービス
SOUTHERN COPPER CORP	138	75	262	29,868	素材
BANCO BRADESCO-ADR	38	—	—	—	銀行
ITAU UNIBANCO H-SPON PRF ADR	39	—	—	—	銀行
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	14	—	—	—	エネルギー
SASOL LTD-SPONSORED ADR	11	—	—	—	素材
CREDICORP LTD	59	59	973	110,958	銀行
YY INC-ADR	13	26	144	16,418	ソフトウェア・サービス
TAL EDUCATION GROUP- ADR	17	38	488	55,698	消費者サービス
FANG HOLDINGS LTD - ADR	100	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TRANSNEFT PJSC	1	1	470	53,625	エネルギー
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	1,011	1,231	247	28,207	各種金融
SBERBANK OF RUSSIA PJSC	500	500	148	16,864	銀行
GAZPROM PJSC	360	360	82	9,365	エネルギー
RUSHYDRO PJSC	104,640	104,640	167	19,136	公益事業
MMC NORILSK NICKEL PJSC	48	49	729	83,157	素材
LUKOIL PJSC	19	19	96	10,989	エネルギー
TATNEFT PJSC	1,241	1,261	818	93,234	エネルギー
ROSNEFT OIL CO PJSC	1,020	1,043	567	64,667	エネルギー
VTB BANK PJSC	4,678,200	4,667,800	535	61,029	銀行
SURGUTNEFTEGAS OJSC	5,930	6,460	322	36,791	エネルギー
SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	6,337	6,222	337	38,504	エネルギー
SEVERSTAL PJSC	184	184	246	28,102	素材
ROSTELECOM PJSC	650	790	103	11,759	電気通信サービス
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	24	—	—	—	小売
DP WORLD LTD	146	146	328	37,480	運輸
ALROSA PJSC	1,597	2,207	363	41,374	素材
JD.COM INC-ADR	151	600	2,385	271,815	小売
QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	40	—	—	—	ソフトウェア・サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	171	363	524	59,806	小売
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	431	995	11,955	1,362,257	ソフトウェア・サービス
WEIBO CORP-SPON ADR	—	29	181	20,691	ソフトウェア・サービス
58.COM INC-ADR	31	74	320	36,543	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	
YUM CHINA HOLDINGS INC	—	352	1,207	137,566	消費者サービス
INTER RAO UES PJSC	—	25,000	176	20,166	公益事業
SAMSUNG ELECTR-GDR	0.8	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HON HAI PRECISION-GDR REG S	104	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
RELIANCE INDS-SPONS GDR 144A	8	—	—	—	エネルギー
LUKOIL PJSC-SPON ADR	422	352	1,744	198,754	エネルギー
GAZPROM PAO -SPON ADR	4,945	4,550	2,062	235,054	エネルギー
SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR	143	155	79	9,059	電気通信サービス
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	79	80	956	109,017	エネルギー
GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR	620	—	—	—	電気通信サービス
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	226	272	959	109,313	食品・生活必需品小売り
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	2,126	2,213	2,709	308,742	銀行
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	1,044	814	341	38,860	銀行
MEGAFON-REG S GDR	82	—	—	—	電気通信サービス
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	—	77	111	12,715	素材
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	420	756	117	13,411	不動産
小計 株数・金額	4,814,567	4,831,218	43,385	4,943,296	
小計 銘柄数<比率>	56	43	—	<9.9%>	
(メキシコ)			千メキシコペソ		
ALFA S.A.B.-A	2,474	2,406	6,402	38,734	資本財
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	503	503	4,377	26,484	資本財
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	27,316	29,470	42,377	256,386	電気通信サービス
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	1,339	1,388	5,581	33,765	家庭用品・パーソナル用品
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	4,574	4,658	19,982	120,896	食品・生活必需品小売り
CEMEX SAB-CPO	12,234	12,939	21,234	128,465	素材
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	2,133	2,168	20,231	122,402	メディア
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,449	1,413	6,540	39,571	食品・飲料・タバコ
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	2,177	2,220	23,936	144,813	銀行
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	1,603	1,631	28,018	169,514	食品・飲料・タバコ
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	118	126	5,583	33,777	素材
MEXICHEM SAB DE CV-*	906	982	5,077	30,716	素材
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	437	449	6,305	38,149	食品・飲料・タバコ
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	3,329	3,374	18,213	110,190	素材
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	2,044	1,997	6,546	39,604	銀行
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	268	296	5,983	36,197	運輸
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	353	381	5,121	30,987	食品・飲料・タバコ
GENTERA SAB DE CV	921	901	2,903	17,568	各種金融
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	165	165	2,367	14,324	小売
GRUPO FIN SANTANDER-B	1,613	1,613	5,506	33,316	銀行
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	186	186	6,832	41,334	運輸
OHL MEXICO SAB DE CV	670	670	1,507	9,120	運輸
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	290	—	—	—	食品・生活必需品小売り
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	217	242	4,936	29,863	運輸
GRUMA S.A.B.-B	171	191	4,674	28,283	食品・飲料・タバコ
GRUPO LALA SAB DE CV	552	552	1,988	12,032	食品・飲料・タバコ
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	—	480	4,143	25,070	公益事業
小計 株数・金額	68,043	71,404	266,375	1,611,570	
小計 銘柄数<比率>	26	26	—	<3.2%>	
(ブラジル)			千ブラジルレアル		
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	663	663	587	21,310	公益事業

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジルレアル	千円	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	201	201	420	15,255	公益事業
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	3,389	3,490	5,172	187,646	エネルギー
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	292	292	874	31,728	公益事業
GERDAU SA-PREF	729	809	806	29,262	素材
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	91	91	257	9,326	公益事業
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	343	397	1,891	68,616	電気通信サービス
VALE SA-PREF	1,708	1,704	4,246	154,058	素材
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	2,609	2,865	11,391	413,295	銀行
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	101	112	415	15,062	エネルギー
BRF SA	573	541	2,396	86,949	食品・飲料・タバコ
JBS SA	615	621	701	25,458	食品・飲料・タバコ
NATURA COSMETICOS SA	147	157	546	19,821	家庭用品・パーソナル用品
VALE SA	1,082	1,142	3,005	109,048	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	316	321	2,401	87,111	エネルギー
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	144	144	490	17,804	公益事業
PORTO SEGURO SA	104	104	313	11,387	保険
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	2,547	2,645	4,052	147,011	エネルギー
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	139	139	1,017	36,899	食品・生活必需品小売り
LOJAS RENNER S.A.	563	627	1,837	66,650	小売
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	494	654	1,160	42,107	小売
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	3,409	3,526	3,621	131,379	銀行
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	202	260	352	12,800	公益事業
EDP-ENERGIAS DO BRASIL-RTS	55	—	—	—	公益事業
EMBRAER SA	586	586	925	33,569	資本財
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	—	180	314	11,395	公益事業
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	549	549	411	14,938	素材
CPFL ENERGIA SA	171	185	482	17,508	公益事業
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	170	—	—	—	公益事業
CCR SA	778	1,050	1,905	69,140	運輸
BM&FBOVESPA SA	1,511	1,838	3,679	133,486	各種金融
B2W CIA DIGITAL	112	—	—	—	小売
BRASKEM SA-PREF A	128	134	457	16,587	素材
BANCO BRADESCO SA-PREF	2,461	2,714	8,587	311,554	銀行
BANCO DO BRASIL S.A.	756	762	2,620	95,072	銀行
CIELO SA	890	1,263	3,049	110,631	ソフトウェア・サービス
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	369	369	1,020	37,015	銀行
DURATEX SA	258	258	223	8,124	素材
SUZANO PAPEL E CELULO-PREF A	310	355	444	16,112	素材
FIBRIA CELULOSE SA	222	222	625	22,704	素材
HYPERMARCAS SA	309	309	972	35,279	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANCO BRADESCO S.A.	657	816	2,480	89,987	銀行
WEG SA	488	484	953	34,579	資本財
BR MALLS PARTICIPACOES SA	508	584	789	28,650	不動産
LOCALIZA RENT A CAR	133	152	726	26,347	運輸
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	67	73	518	18,803	不動産
SUL AMERICA SA - UNITS	150	173	308	11,203	保険
TIM PARTICIPACOES SA	749	749	763	27,691	電気通信サービス
RAIA DROGASIL SA	190	200	1,383	50,197	食品・生活必需品小売り
M DIAS BRANCO SA	30	90	522	18,938	食品・飲料・タバコ
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	199	—	—	—	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	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジルレアル	千円	
ODONTOPREV S.A.	220	245	292	10,621	ヘルスケア機器・サービス
TOTVS SA	109	—	—	—	ソフトウェア・サービス
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	160	175	922	33,459	公益事業
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	91	—	—	—	公益事業
ESTACIO PARTICIPACOES SA	240	—	—	—	消費者サービス
LOJAS AMERICANAS SA	150	150	219	7,972	小売
QUALICORP SA	184	202	500	18,174	ヘルスケア機器・サービス
KROTON EDUCACIONAL SA	1,215	1,194	1,876	68,062	消費者サービス
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	614	620	1,886	68,448	保険
AMBEV SA	4,026	4,191	8,185	296,952	食品・飲料・タバコ
KLABIN SA - UNIT	477	476	750	27,233	素材
RUMO LOGISTICA OPERADORA MUL	700	—	—	—	運輸
AES TIETE ENERGIA SA-UNIT	—	141	189	6,870	公益事業
RUMO SA	—	700	693	25,167	運輸
小計 株数・金額	41,461	43,705	97,642	3,542,476	
小計 銘柄数<比率>	62	57	—	<7.1%>	
(チリ)			千チリペソ		
BANCO DE CREDITO E INVERSION	32	32	122,475	20,759	銀行
CENCOSUD SA	1,121	1,226	234,242	39,704	食品・生活必需品小売り
EMPRESAS CMPC SA	1,074	1,061	167,069	28,318	素材
COLBUN SA	7,017	7,017	108,648	18,415	公益事業
EMPRESAS COPEC SA	400	388	292,120	49,514	エネルギー
ITAU CORPBANCA	125,500	141,923	89,397	15,152	銀行
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	98	129	98,050	16,619	電気通信サービス
S.A.C.I. FALABELLA	426	524	282,725	47,921	小売
AES GENER SA	2,201	2,201	54,752	9,280	公益事業
AGUAS ANDINAS SA-A	2,210	2,393	92,417	15,664	公益事業
LATAM AIRLINES GROUP SA	255	274	226,280	38,354	運輸
ENEL GENERACION CHILE SA	2,881	2,881	153,937	26,092	公益事業
BANCO SANTANDER CHILE	58,371	58,371	234,421	39,734	銀行
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	85	85	198,377	33,624	素材
ENEL AMERICAS SA	17,259	24,759	322,019	54,582	公益事業
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	132	132	115,426	19,564	食品・飲料・タバコ
BANCO DE CHILE	20,658	20,782	172,265	29,198	銀行
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	220	220	57,728	9,784	食品・飲料・タバコ
SONDA SA	400	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ENDESA AMERICAS SA	2,881	—	—	—	公益事業
ENEL CHILE SA	17,259	17,259	128,081	21,709	公益事業
小計 株数・金額	260,486	281,663	3,150,435	533,998	
小計 銘柄数<比率>	21	19	—	<1.1%>	
(コロンビア)			千コロンビアペソ		
GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	2,954	2,954	354,504	13,790	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF	376	398	1,252,108	48,707	銀行
ECOPETROL SA	3,983	3,983	547,690	21,305	エネルギー
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	67	68	202,415	7,873	各種金融
INTERCONEXION ELECTRICA SA	333	333	408,924	15,907	公益事業
GRUPO ARGOS SA	258	258	538,512	20,948	素材
GRUPO DE INV SURAMERICANA	206	206	815,280	31,714	各種金融
CEMENTOS ARGOS SA	348	393	482,921	18,785	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	
(コロンビア)		百株	百株	千コロンビアペソ	千円	
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF		85	85	326,699	12,708	各種金融
小計	株数・金額	8,612	8,681	4,929,054	191,740	
	銘柄数<比率>	9	9	—	<0.4%>	
(ユーロ…ギリシャ)				千ユーロ		
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA		217	217	215	26,728	電気通信サービス
ALPHA BANK AE		1,224	1,142	261	32,375	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE		4,665	4,665	157	19,464	銀行
EUROBANK ERGASIAS SA		1,598	1,598	149	18,565	銀行
TITAN CEMENT CO. S.A.		38	38	99	12,297	素材
PIRAEUS BANK S.A		5,815	5,815	142	17,639	銀行
PUBLIC POWER CORP		100	—	—	—	公益事業
OPAP SA		192	192	187	23,235	消費者サービス
FF GROUP		27	27	55	6,909	小売
JUMBO SA		91	91	146	18,163	小売
ユーロ計	株数・金額	13,971	13,789	1,416	175,380	
	銘柄数<比率>	10	9	—	<0.4%>	
(トルコ)				千トルコリラ		
AKBANK T.A.S.		1,931	1,897	1,754	55,910	銀行
TURKIYE IS BANKASI-C		1,358	1,438	993	31,668	銀行
TURKIYE GARANTI BANKASI		2,026	2,069	1,934	61,642	銀行
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS		775	775	901	28,723	電気通信サービス
YAPI VE KREDI BANKASI		745	745	317	10,111	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK VE		182	182	367	11,709	食品・飲料・タバコ
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE		107	113	1,043	33,232	エネルギー
HACI OMER SABANCI HOLDING		804	804	849	27,063	各種金融
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK		1,219	1,219	800	25,492	素材
KOC HOLDING AS		559	559	940	29,977	資本財
ARCELIK AS		211	211	494	15,755	耐久消費財・アパレル
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI		558	602	280	8,951	資本財
FORD OTOMOTIV SANAYI AS		64	64	256	8,187	自動車・自動車部品
TURK HAVA YOLLARI AO		474	474	308	9,831	運輸
ULKER BISKUVI SANAYI		127	127	266	8,497	食品・飲料・タバコ
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA		110	110	317	10,106	自動車・自動車部品
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D		656	656	392	12,511	銀行
COCA-COLA ICECEK AS		64	64	230	7,340	食品・飲料・タバコ
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS		140	140	226	7,230	運輸
TURKIYE HALK BANKASI		538	538	640	20,412	銀行
ENKA INSAAT VE SANAYI AS		451	—	—	—	資本財
TURK TELEKOMUNIKASYON AS		384	384	240	7,646	電気通信サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		186	186	1,180	37,603	食品・生活必需品小売り
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS		522	627	340	10,847	素材
小計	株数・金額	14,199	13,992	15,080	480,451	
	銘柄数<比率>	24	23	—	<1.0%>	
(チェコ)				千チェココルナ		
O2 CZECH REPUBLIC AS		56	56	1,520	7,083	電気通信サービス
CEZ AS		141	141	6,132	28,578	公益事業
KOMERCNI BANKA AS		13	67	6,535	30,457	銀行
MONETA MONEY BANK AS		—	440	3,559	16,587	銀行
小計	株数・金額	211	705	17,748	82,707	
	銘柄数<比率>	3	4	—	<0.2%>	

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	
(ハンガリー)		百株	百株	千ハンガリーフォリント	千円	
RICHTER GEDEON NYRT		123	123	85,624	34,172	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OTP BANK PLC		208	213	175,725	70,131	銀行
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL		32	40	90,801	36,238	エネルギー
小計	株数・金額	363	376	352,150	140,543	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.3%>	
(ポーランド)				千ポーランドズロチ		
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN		281	282	3,201	93,813	エネルギー
ORANGE POLSKA SA		572	572	262	7,681	電気通信サービス
PKO BANK POLSKI SA		765	769	2,724	79,826	銀行
BANK PEKAO SA		115	138	1,984	58,148	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA		122	122	1,415	41,465	素材
BANK ZACHODNI WBK SA		30	30	1,084	31,784	銀行
MBANK SA		13	13	582	17,061	銀行
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I		1,563	1,563	1,022	29,950	エネルギー
GRUPA LOTOS SA		78	78	453	13,301	エネルギー
EUROCASH SA		71	71	227	6,656	食品・生活必需品小売り
BANK MILLENNIUM SA		520	520	374	10,969	銀行
CYFROWY POLSAT SA		163	163	422	12,369	メディア
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA		29	29	222	6,524	銀行
PGE SA		741	741	927	27,189	公益事業
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE		491	491	2,163	63,381	保険
TAURON POLSKA ENERGIA SA		959	959	332	9,754	公益事業
ENEA SA		190	—	—	—	公益事業
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S		—	40	306	8,983	素材
SYNTHOS SA		430	430	234	6,866	素材
GRUPA AZOTY SA		37	37	254	7,443	素材
ALIOR BANK SA		42	78	572	16,786	銀行
ENERGA SA		175	—	—	—	公益事業
LPP SA		1	1	706	20,709	耐久消費財・アパレル
CCC SA		20	23	496	14,556	耐久消費財・アパレル
小計	株数・金額	7,413	7,154	19,973	585,224	
	銘柄数<比率>	23	22	—	<1.2%>	
(香港)				千香港ドル		
PETROCHINA CO LTD-H		18,430	18,770	9,966	145,815	エネルギー
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H		22,240	22,660	14,139	206,865	エネルギー
CHINA UNICOM HONG KONG LTD		5,240	5,300	5,448	79,710	電気通信サービス
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H		820	820	1,771	25,912	ソフトウェア・サービス
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE		2,600	2,620	3,453	50,519	自動車・自動車部品
CITIC LTD		3,820	3,880	4,446	65,052	資本財
CNOOC LTD		15,580	15,870	14,298	209,192	エネルギー
YANZHOU COAL MINING CO-H		1,520	1,720	1,007	14,745	エネルギー
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H		2,970	3,010	1,306	19,111	素材
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H		1,340	1,340	1,541	22,544	運輸
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H		1,220	1,320	1,244	18,210	運輸
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN		1,080	1,420	2,627	38,433	食品・飲料・タバコ
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO		1,740	1,740	1,771	25,914	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD		440	440	1,073	15,706	資本財
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING		1,020	1,120	2,441	35,720	運輸
COSCO SHIPPING PORTS LTD		1,580	1,440	1,264	18,497	運輸
BYD CO LTD-H		565	545	2,387	34,923	自動車・自動車部品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	12,160	12,320	4,681	68,491	電気通信サービス
DATANG INTL POWER GEN CO-H	2,360	—	—	—	公益事業
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	455	455	1,694	24,796	資本財
CHINA EVERBRIGHT LTD	800	780	1,350	19,764	各種金融
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	1,080	1,080	1,188	17,380	運輸
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1,520	1,700	926	13,554	運輸
CHINA MOBILE LTD	5,350	5,445	46,418	679,104	電気通信サービス
HUANENG POWER INTL INC-H	3,720	3,720	2,157	31,565	公益事業
HUADIAN POWER INTL CORP-H	1,360	—	—	—	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	1,090	1,090	2,719	39,787	素材
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	3,640	3,760	4,218	61,719	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LENOVO GROUP LTD	6,320	6,260	3,092	45,242	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	1,422	1,422	2,841	41,566	保険
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	320	320	1,065	15,589	食品・飲料・タバコ
SINOTRANS LIMITED-H	1,590	1,870	680	9,958	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	3,420	3,420	1,217	17,812	素材
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	1,880	1,880	964	14,109	資本財
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	4,020	4,100	5,272	77,138	保険
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	6,500	6,590	16,046	234,762	保険
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	23,390	2,349	2,139	31,307	半導体・半導体製造装置
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	1,700	1,700	2,444	35,764	公益事業
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT-H	3,150	—	—	—	運輸
CHINA MENGNIU DAIRY CO	2,420	2,380	3,565	52,159	食品・飲料・タバコ
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	4,545	4,625	21,113	308,885	保険
AIR CHINA LTD-H	1,540	1,680	1,192	17,450	運輸
SINO BIOPHARMACEUTICAL	3,930	3,930	2,495	36,509	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	1,600	1,600	1,076	15,753	エネルギー
TENCENT HOLDINGS LTD	4,504	5,040	128,318	1,877,298	ソフトウェア・サービス
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	7,669	7,599	4,468	65,369	銀行
ZTE CORP-H	631	631	919	13,447	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	4,880	4,780	1,223	17,902	素材
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	73,315	74,625	47,461	694,366	銀行
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	876	876	1,054	15,430	不動産
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	490	490	2,601	38,065	耐久消費財・アパレル
CHINA POWER INTERNATIONAL	2,890	2,890	838	12,261	公益事業
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,400	2,400	2,049	29,985	自動車・自動車部品
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	2,540	2,540	904	13,229	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	2,980	3,030	5,478	80,146	エネルギー
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	1,360	1,510	1,363	19,948	素材
JIANGXI COPPER CO LTD-H	1,170	1,050	1,207	17,665	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1,720	1,720	1,032	15,098	ヘルスケア機器・サービス
BANK OF CHINA LTD-H	69,220	70,460	26,633	389,653	銀行
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	2,190	2,190	2,198	32,167	商業・専門サービス
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	1,200	1,100	1,313	19,215	不動産
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	645	655	6,510	95,251	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS BANK-H	4,020	3,465	7,104	103,935	銀行
IND & COMM BK OF CHINA-H	64,313	65,393	33,350	487,920	銀行
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	660	680	2,879	42,131	公益事業
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	2,080	2,080	988	14,454	電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	3,870	3,920	4,272	62,511	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA COAL ENERGY CO-H	2,440	1,860	647	9,469	エネルギー
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	3,440	3,400	7,480	109,432	不動産
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	7,150	7,920	3,872	56,660	銀行
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	860	950	2,052	30,020	耐久消費財・アパレル
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	3,520	3,520	2,347	34,348	資本財
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	10,080	11,280	1,161	16,997	小売
HENGAN INTL GROUP CO LTD	640	630	3,654	53,458	家庭用品・パーソナル用品
CHINA RESOURCES LAND LTD	2,420	2,460	5,079	74,318	不動産
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1,740	1,740	1,927	28,205	資本財
GUANGDONG INVESTMENT LTD	2,480	2,440	2,781	40,694	公益事業
FOSUN INTERNATIONAL LTD	1,840	2,215	2,609	38,173	資本財
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	2,880	2,480	905	13,243	不動産
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	2,480	2,480	1,145	16,762	素材
SHUI ON LAND LTD	3,276	—	—	—	不動産
WEICHAI POWER CO LTD-H	824	824	1,036	15,165	資本財
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	2,270	—	—	—	運輸
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	4,080	5,490	3,321	48,592	耐久消費財・アパレル
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	5,120	5,050	2,716	39,748	食品・飲料・タバコ
KUNLUN ENERGY CO LTD	2,860	2,860	1,990	29,121	エネルギー
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	5,032	4,732	3,591	52,548	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	780	780	2,035	29,783	公益事業
SOHO CHINA LTD	1,720	1,930	814	11,915	不動産
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	3,860	3,860	2,273	33,261	公益事業
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	4,700	4,750	5,386	78,804	自動車・自動車部品
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	2,830	2,830	1,681	24,593	公益事業
CHINA MINSHENG BANKING-H	5,151	5,111	3,894	56,977	銀行
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2,300	2,346	6,709	98,160	保険
CRRC CORP LTD - H	3,845	3,655	2,690	39,361	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	455	480	1,958	28,651	資本財
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	20,150	21,800	7,891	115,454	銀行
CHINA EVERGRANDE GROUP	3,640	3,640	3,024	44,253	不動産
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	1,906	1,846	2,363	34,582	自動車・自動車部品
SINOPHARM GROUP CO-H	1,044	1,040	3,546	51,883	ヘルスケア機器・サービス
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,540	1,540	1,931	28,252	公益事業
LONGFOR PROPERTIES	1,295	1,295	1,696	24,819	不動産
SUNNY OPTICAL TECH	—	640	4,211	61,609	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	11,100	11,950	1,135	16,608	半導体・半導体製造装置
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2,745	2,745	2,261	33,091	自動車・自動車部品
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	3,220	3,220	759	11,117	不動産
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	1,560	1,560	2,159	31,586	資本財
CITIC SECURITIES CO LTD-H	1,900	1,865	2,924	42,782	各種金融
SUN ART RETAIL GROUP LTD	2,130	2,130	1,469	21,501	食品・生活必需品小売り
FAR EAST HORIZON LTD	1,590	1,740	1,301	19,041	各種金融
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	2,270	2,270	1,166	17,069	銀行
YUEXIU PROPERTY CO LTD	5,700	—	—	—	不動産
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	1,110	1,110	2,042	29,880	耐久消費財・アパレル
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	600	600	1,284	18,784	ヘルスケア機器・サービス
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	2,836	2,644	3,368	49,280	各種金融
CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	474	—	—	—	資本財
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1,680	1,680	1,720	25,168	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	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	688	688	2,789	40,815	保険
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	5,810	6,160	1,989	29,109	保険
HUANENG RENEWABLES CORP-H	3,340	3,660	980	14,350	公益事業
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	2,925	2,605	1,779	26,029	各種金融
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	930	1,100	1,540	22,530	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	335	375	1,140	16,678	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	530	590	1,130	16,538	資本財
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	1,105	1,105	830	12,156	資本財
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS	3,440	3,720	156	2,285	食品・飲料・タバコ
HANERGY THIN FILM POWER GROU	9,600	9,600	3,753	54,915	半導体・半導体製造装置
KINGSOFT CORP LTD	730	670	1,467	21,466	ソフトウェア・サービス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	7,740	7,740	2,275	33,291	各種金融
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	1,190	1,190	1,775	25,975	資本財
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	2,040	3,000	984	14,395	ヘルスケア機器・サービス
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	2,880	2,880	1,013	14,831	銀行
CHINA VANKE CO LTD-H	1,163	1,163	2,296	33,601	不動産
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	8,900	10,000	1,260	18,433	メディア
CGN POWER CO LTD-H	7,910	9,090	2,136	31,251	公益事業
DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	517	—	—	—	不動産
LUYE PHARMA GROUP LTD	1,170	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GF SECURITIES CO LTD-H	1,164	1,154	1,841	26,945	各種金融
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	1,290	1,290	1,857	27,176	各種金融
3SBIO INC	—	940	975	14,274	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAR INC	680	—	—	—	運輸
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	—	400	1,104	16,151	自動車・自動車部品
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	—	5,600	1,870	27,363	各種金融
FULLSHARE HOLDINGS LTD	—	5,800	1,960	28,680	不動産
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	—	18,000	257	3,765	耐久消費財・アパレル
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBI-B	690	690	683	9,993	自動車・自動車部品
小計 株数・金額	665,443	670,216	646,805	9,462,760	
小計 銘柄数<比率>	140	136	—	<19.0%>	
(マレーシア)			千マレーシアリンギット		
GENTING MALAYSIA BHD	2,609	2,689	1,586	41,598	消費者サービス
GENTING BHD	1,967	2,039	1,983	52,019	消費者サービス
TELEKOM MALAYSIA BHD	969	1,028	661	17,331	電気通信サービス
TENAGA NASIONAL BHD	2,959	2,987	4,157	109,020	公益事業
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	367	390	969	25,421	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	4,257	3,093	2,879	75,502	銀行
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	552	552	154	4,044	消費者サービス
IOI CORP BHD	2,569	1,994	921	24,154	食品・飲料・タバコ
AMMB HOLDINGS BHD	1,720	1,657	921	24,156	銀行
YTL CORP BHD	3,872	3,872	580	15,231	公益事業
GAMUDA BHD	1,460	1,540	823	21,602	資本財
MISC BHD	985	985	730	19,163	運輸
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	3,600	3,600	2,127	55,785	銀行
PETRONAS GAS BHD	610	626	1,196	31,383	公益事業
SIME DARBY BERHAD	2,714	2,063	1,924	50,467	資本財
PUBLIC BANK BERHAD	2,114	2,114	4,219	110,636	銀行
UMW HOLDINGS BHD	490	490	287	7,541	自動車・自動車部品
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	111	126	579	15,197	食品・飲料・タバコ

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	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシアリンギット	千円	
RHB CAPITAL BHD	544	—	—	—	銀行
PPB GROUP BERHAD	406	435	739	19,389	食品・飲料・タバコ
IJM CORP BHD	2,688	2,529	900	23,606	資本財
DIGI.COM BHD	3,068	3,178	1,614	42,330	電気通信サービス
MAXIS BHD	1,647	1,647	1,080	28,328	電気通信サービス
AXIATA GROUP BERHAD	2,331	2,331	1,237	32,454	電気通信サービス
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	1,620	1,910	292	7,662	公益事業
HONG LEONG BANK BERHAD	580	580	813	21,321	銀行
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,459	2,169	1,587	41,629	素材
LAFARGE MALAYSIA BHD	335	335	218	5,718	素材
PETRONAS DAGANGAN BHD	214	184	446	11,713	エネルギー
AIRASIA BHD	1,000	1,400	490	12,847	運輸
BUMI ARMADA BERHAD	2,055	—	—	—	エネルギー
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	920	920	409	10,734	銀行
SAPURA ENERGY BHD	2,957	3,578	686	18,012	エネルギー
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	738	692	559	14,660	運輸
FELDA GLOBAL VENTURES	1,020	1,201	228	5,983	食品・飲料・タバコ
IHH HEALTHCARE BHD	2,160	2,912	1,802	47,262	ヘルスケア機器・サービス
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	208	208	368	9,674	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	497	497	442	11,610	資本財
GENTING PLANTATIONS BHD	195	195	226	5,941	食品・飲料・タバコ
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	1,377	1,377	375	9,856	メディア
WESTPORTS HOLDINGS BHD	932	932	363	9,530	運輸
DIALOG GROUP BHD	3,482	2,921	558	14,632	エネルギー
IOI PROPERTIES GROUP BHD	1,328	1,728	373	9,786	不動産
HARTALEGA HOLDINGS BHD	601	601	342	8,982	ヘルスケア機器・サービス
RHB BANK BHD	—	709	390	10,231	銀行
小計 株数・金額	69,289	67,016	43,255	1,134,159	
小計 銘柄数<比率>	44	43	—	<2.3%>	
(タイ)			千タイバーツ		
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	1,196	1,196	7,265	23,831	不動産
KASIKORNBANK PCL-NVDR	1,537	1,562	29,599	97,087	銀行
TMB BANK PCL-NVDR	11,100	11,100	2,464	8,082	銀行
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	830	830	1,618	5,308	メディア
CP ALL PCL-NVDR	3,858	4,248	27,399	89,870	食品・生活必需品小売り
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	222	222	4,029	13,216	銀行
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	915	927	16,732	54,882	電気通信サービス
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,364	1,565	24,414	80,077	銀行
SIAM CEMENT PCL-NVDR	358	352	18,048	59,197	素材
PTT PCL-NVDR	875	887	34,238	112,301	エネルギー
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	1,226	1,226	11,647	38,202	エネルギー
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	377	3,700	15,447	50,667	運輸
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	860	1,370	2,452	8,043	エネルギー
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	2,640	2,388	5,970	19,581	食品・飲料・タバコ
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	1,200	1,200	4,350	14,268	素材
IRPC PCL - NVDR	8,980	8,980	4,849	15,905	エネルギー
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,771	1,871	13,475	44,199	素材
THAI OIL PCL-NVDR	692	692	5,293	17,363	エネルギー
KRUNG THAI BANK - NVDR	2,940	3,180	5,946	19,504	銀行
GLOW ENERGY PCL - NVDR	435	435	3,436	11,271	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	
(タイ)		百株	百株	千タイバーツ	千円	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR		3,406	3,406	6,948	22,790	ヘルスケア機器・サービス
THAI UNION GROUP PCL-NVDR		1,652	1,652	3,419	11,216	食品・飲料・タバコ
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR		3,320	3,320	3,253	10,671	小売
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR		—	127	2,667	8,747	公益事業
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR		4,920	5,320	4,442	14,570	運輸
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR		316	316	5,782	18,967	ヘルスケア機器・サービス
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR		430	430	4,085	13,398	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRUE CORP PCL-NVDR		7,562	9,108	5,784	18,971	電気通信サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR		1,521	1,956	7,286	23,898	消費者サービス
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR		—	1,000	4,375	14,350	資本財
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR		970	970	2,643	8,669	エネルギー
KCE ELECTRONICS - NVDR		—	260	2,886	9,466	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROBINSON PCL-NVDR		—	459	2,822	9,258	小売
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO		6,040	5,740	4,161	13,649	運輸
小計	株数・金額	73,514	81,996	299,235	981,492	
	銘柄数<比率>	30	34	—	<2.0%>	
(フィリピン)				千フィリピンペソ		
PLDT INC		85	88	15,205	34,667	電気通信サービス
SM PRIME HOLDINGS INC		7,265	7,365	23,678	53,986	不動産
AYALA LAND INC		6,453	6,502	25,617	58,408	不動産
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN		660	660	6,943	15,830	銀行
INTL CONTAINER TERM SVCS INC		450	450	4,214	9,608	運輸
MEGAWORLD CORP		9,990	9,990	4,175	9,520	不動産
JOLLIBEE FOODS CORP		379	379	8,081	18,425	消費者サービス
ENERGY DEVELOPMENT CORP		8,000	8,000	4,720	10,761	公益事業
SM INVESTMENTS CORP		137	217	16,805	38,315	資本財
AYALA CORPORATION		189	218	18,991	43,301	各種金融
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC		1,677	1,771	13,513	30,810	資本財
ABOITIZ POWER CORP		1,321	1,321	5,356	12,213	公益事業
METROPOLITAN BANK & TRUST		265	541	4,571	10,422	銀行
BDO UNIBANK INC		1,436	1,741	21,197	48,330	銀行
DMCI HOLDINGS INC		3,536	3,536	4,653	10,609	資本財
UNIVERSAL ROBINA CORP		763	763	12,793	29,169	食品・飲料・タバコ
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC		1,820	1,820	2,573	5,867	資本財
JG SUMMIT HOLDINGS INC		2,197	2,538	21,197	48,329	資本財
GLOBE TELECOM INC		28	30	6,162	14,049	電気通信サービス
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO		11,200	12,027	7,901	18,015	各種金融
SECURITY BANK CORP		—	109	2,380	5,427	銀行
ROBINSONS LAND CO		1,450	1,450	3,472	7,917	不動産
GT CAPITAL HOLDINGS INC		69	69	8,702	19,842	各種金融
小計	株数・金額	59,374	61,589	242,909	553,834	
	銘柄数<比率>	22	23	—	<1.1%>	
(インドネシア)				千インドネシアルピア		
KALBE FARMA TBK PT		18,261	18,161	2,860,357	24,599	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER		44,027	44,839	19,594,643	168,513	電気通信サービス
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P		3,782	3,782	3,176,880	27,321	食品・飲料・タバコ
HM SAMPOERNA TBK PT		328	8,200	3,124,200	26,868	食品・飲料・タバコ
BANK CENTRAL ASIA TBK PT		10,750	10,946	19,620,705	168,738	銀行
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA		1,272	1,272	2,133,780	18,350	素材
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT		17,669	17,967	15,451,620	132,883	自動車・自動車部品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシアルピア	千円	
GUDANG GARAM TBK PT	415	415	2,945,462	25,330	食品・飲料・タバコ
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	9,698	9,839	13,750,002	118,250	銀行
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	340	—	—	—	食品・飲料・タバコ
BANK DANAMON INDONESIA TBK	2,810	2,810	1,382,520	11,889	銀行
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	2,554	2,554	2,209,210	18,999	素材
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	9,575	9,575	2,326,725	20,009	公益事業
UNITED TRACTORS TBK PT	1,433	1,503	3,765,015	32,379	エネルギー
LIPPO KARAWACI TBK PT	17,464	17,464	1,388,388	11,940	不動産
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	8,177	8,265	9,938,662	85,472	銀行
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,342	1,323	6,132,105	52,736	家庭用品・パーソナル用品
ADARO ENERGY TBK PT	12,400	12,400	1,853,800	15,942	エネルギー
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	1,700	1,700	795,600	6,842	運輸
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	6,606	6,606	4,343,445	37,353	銀行
AKR CORPORINDO TBK PT	1,543	1,543	979,805	8,426	資本財
CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	6,403	6,403	1,965,721	16,905	食品・飲料・タバコ
XL AXIATA TBK PT	2,450	3,200	1,008,000	8,668	電気通信サービス
PAKUWON JATI TBK PT	—	19,000	1,197,000	10,294	不動産
SUMMARECON AGUNG TBK PT	8,500	8,500	1,134,750	9,758	不動産
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	4,402	4,402	889,204	7,647	メディア
BUMI SERPONG DAMAI PT	7,017	7,017	1,234,992	10,620	不動産
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	990	1,980	1,722,600	14,814	食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,756	2,126	1,222,450	10,513	電気通信サービス
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	5,000	5,000	1,420,000	12,212	メディア
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	5,800	—	—	—	メディア
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	—	4,365	982,125	8,446	資本財
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	2,057	2,187	3,182,085	27,365	小売
小計 株数・金額	216,521	245,344	133,731,853	1,150,093	
小計 銘柄数<比率>	31	31	—	<2.3%>	
(韓国)			千韓国ウォン		
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	96	87	19,858,475	2,015,635	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KOREA ELECTRIC POWER CORP	224	229	986,706	100,150	公益事業
SHINSEGAE INC	6	6	137,592	13,965	小売
CJ CORP	12	12	260,295	26,419	資本財
SK TELECOM	17	17	416,364	42,260	電気通信サービス
HYUNDAI MOTOR CO	140	137	2,170,350	220,290	自動車・自動車部品
POSCO	60	65	1,777,185	180,384	素材
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	52	49	382,980	38,872	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KT CORP	22	22	70,537	7,159	電気通信サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	49	58	217,810	22,107	各種金融
HYUNDAI MOBIS CO LTD	59	60	1,512,500	153,518	自動車・自動車部品
CHEIL WORLDWIDE INC	72	61	117,348	11,910	メディア
KB FINANCIAL GROUP INC	337	353	1,906,982	193,558	銀行
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	31	29	822,967	83,531	保険
SAMSUNG SDI CO LTD	48	48	730,350	74,130	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	372	379	1,927,352	195,626	銀行
LG ELECTRONICS INC	93	94	750,997	76,226	耐久消費財・アパレル
AMOREPACIFIC GROUP	24	24	382,642	38,838	家庭用品・パーソナル用品
HYUNDAI DEPT STORE CO	13	13	144,160	14,632	小売
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	24	24	199,823	20,282	資本財
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	41	46	139,150	14,123	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
KT&G CORP	96	104	1,124,280	114,114	食品・飲料・タバコ
NCSOFT CORP	15	15	570,400	57,895	ソフトウェア・サービス
LG DISPLAY CO LTD	203	206	612,117	62,129	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	36	27	474,201	48,131	資本財
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	130	225	259,095	26,298	資本財
AMOREPACIFIC CORP	28	28	1,036,070	105,161	家庭用品・パーソナル用品
HANA FINANCIAL GROUP	258	264	1,135,200	115,222	銀行
HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	50	50	232,000	23,548	資本財
LG CHEM LTD	40	40	1,167,695	118,521	素材
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	41	41	98,810	10,029	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	8	8	823,680	83,603	家庭用品・パーソナル用品
SK INNOVATION CO LTD	56	57	999,940	101,493	エネルギー
KAKAO CORP	25	27	264,656	26,862	ソフトウェア・サービス
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	35	35	190,750	19,361	各種金融
HANMI SCIENCE CO LTD	9	10	72,975	7,407	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COWAY CO LTD	47	46	517,140	52,489	耐久消費財・アパレル
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	66	—	—	—	各種金融
S-1 CORPORATION	16	16	172,425	17,501	商業・専門サービス
KIA MOTORS CORP	230	234	865,606	87,859	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	508	517	2,920,956	296,477	半導体・半導体製造装置
LG CORP	83	82	584,330	59,309	資本財
HYUNDAI STEEL CO	70	70	394,856	40,077	素材
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	16	15	2,683,758	272,401	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OCI CO LTD	14	14	119,480	12,127	素材
HANWHA TECHWIN CO LTD	—	34	174,420	17,703	資本財
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	245	220	283,471	28,772	銀行
KANGWON LAND INC	103	103	400,804	40,681	消費者サービス
NAVER CORP	24	24	2,159,804	219,220	ソフトウェア・サービス
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	160	359	329,226	33,416	各種金融
CELLTRION INC	60	74	705,791	71,637	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KOREA GAS CORPORATION	22	25	119,085	12,087	公益事業
LG UPLUS CORP	188	188	254,205	25,801	電気通信サービス
LOTTE SHOPPING CO	9	9	247,040	25,074	小売
YUHAN CORP	6	7	172,885	17,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONGBU INSURANCE CO LTD	37	43	302,993	30,753	保険
S-OIL CORP	38	38	414,090	42,030	エネルギー
KCC CORP	5	5	181,537	18,426	資本財
POSCO DAEWOO CORP	41	41	100,332	10,183	資本財
SAMSUNG CARD CO	30	30	131,170	13,313	各種金融
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	27	33	339,275	34,436	自動車・自動車部品
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	68	63	310,803	31,546	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	30	39	124,662	12,653	運輸
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	69	61	716,475	72,722	保険
LOTTE CHEMICAL CORP	13	13	472,500	47,958	素材
GS HOLDINGS	45	45	269,100	27,313	エネルギー
NH INVESTMENT & SECURITIES C	121	121	168,732	17,126	各種金融
HANWHA CHEMICAL CORP	92	92	251,217	25,498	素材
HYOSUNG CORPORATION	19	18	276,575	28,072	素材
HANWHA CORPORATION	40	40	169,823	17,237	資本財
CJ CHEILJEDANG CORP	6	6	249,516	25,325	食品・飲料・タバコ

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
BNK FINANCIAL GROUP INC	230	230	228,259	23,168	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	16	16	248,745	25,247	運輸
DGB FINANCIAL GROUP INC	143	143	174,460	17,707	銀行
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	18	18	179,265	18,195	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	7	7	319,232	32,402	素材
E-MART INC	18	17	388,170	39,399	食品・生活必需品小売り
HYUNDAI WIA CORP	13	13	93,547	9,495	自動車・自動車部品
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	11	15	117,335	11,909	素材
DOOSAN CORP	6	—	—	—	資本財
SK HOLDINGS CO LTD	30	40	997,530	101,249	資本財
ORION CORP	3	3	230,640	23,409	食品・飲料・タバコ
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	55	55	212,040	21,522	保険
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	51	61	399,063	40,504	資本財
SK NETWORKS CO LTD	97	97	72,847	7,393	資本財
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	0.51	5	111,180	11,284	食品・飲料・タバコ
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	193	193	124,484	12,635	保険
LG INNOTEK CO LTD	12	12	170,730	17,329	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG CHEM LTD-PREFERENCE	6	7	133,125	13,512	素材
HANKOOK TIRE CO LTD	65	65	412,462	41,864	自動車・自動車部品
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	89	117	90,558	9,191	資本財
HANON SYSTEMS	159	171	162,450	16,488	自動車・自動車部品
CJ E&M CORP	17	17	143,620	14,577	メディア
DONGSUH COMPANIES INC	29	29	93,870	9,527	食品・生活必需品小売り
PARADISE CO LTD	37	—	—	—	消費者サービス
CJ KOREA EXPRESS CORP	5	5	106,720	10,832	運輸
HOTEL SHILLA CO LTD	29	29	172,533	17,512	小売
HANSSEM CO LTD	8	9	213,180	21,637	耐久消費財・アパレル
WOORI BANK	291	267	437,967	44,453	銀行
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	20	20	116,484	11,823	商業・専門サービス
SAMSUNG SDS CO LTD	27	30	443,975	45,063	ソフトウェア・サービス
SAMSUNG C&T CORP	66	66	844,893	85,756	資本財
AMOREPACIFIC CORP-PREF	7	8	175,365	17,799	家庭用品・パーソナル用品
HANMI PHARM CO LTD	4	4	186,445	18,924	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BGF RETAIL CO LTD	7	17	214,890	21,811	食品・生活必需品小売り
GS RETAIL CO LTD	23	23	135,486	13,751	食品・生活必需品小売り
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	0.54	0.54	94,716	9,613	食品・飲料・タバコ
OTTOGI CORPORATION	1	1	84,000	8,526	食品・飲料・タバコ
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	—	1	119,320	12,110	家庭用品・パーソナル用品
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	—	15	277,500	28,166	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HYUNDAI ELECTRIC & ENERGY SY	—	1	48,840	4,957	資本財
HYUNDAI CONSTRUCTION EQUIPME	—	1	40,885	4,149	資本財
HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	—	5	222,425	22,576	半導体・半導体製造装置
小計 株数・金額	7,213	7,556	70,597,762	7,165,672	
小計 銘柄数<比率>	107	110	—	<14.4%>	
(台湾)			千ニュー台湾ドル		
COMPAL ELECTRONICS	3,747	3,747	7,514	28,328	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA ELECTRONICS INC	1,702	1,742	29,878	112,642	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	2,831	2,831	6,851	25,831	資本財
FORMOSA PLASTICS CORP	3,616	3,686	32,768	123,537	素材
HON HAI PRECISION INDUSTRY	12,337	13,838	143,919	542,575	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千ニュー台湾ドル	千円	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	10,650	10,550	12,871	48,523	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	4,155	4,235	29,818	112,415	素材
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	500	510	14,101	53,162	食品・生活必需品小売り
SILICONWARE PRECISION INDS	1,930	1,880	9,155	34,516	半導体・半導体製造装置
TAIWAN CEMENT	2,907	2,867	9,905	37,344	素材
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	21,230	21,840	453,180	1,708,488	半導体・半導体製造装置
ASUSTEK COMPUTER INC	617	617	18,099	68,236	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	387	417	4,253	16,036	半導体・半導体製造装置
QUANTA COMPUTER INC	2,371	2,331	14,711	55,463	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	7,123	7,263	35,737	134,729	保険
ACER INC	2,591	2,591	3,783	14,265	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	8,537	8,964	8,300	31,294	銀行
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	5,545	5,815	22,100	83,318	半導体・半導体製造装置
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	2,824	2,864	26,065	98,265	素材
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	5,810	5,950	28,445	107,238	各種金融
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	419	481	3,950	14,894	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDIATEK INC	1,302	1,332	28,445	107,240	半導体・半導体製造装置
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	7,046	7,556	9,634	36,322	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	13,408	15,589	29,853	112,549	銀行
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,464	1,424	16,233	61,200	電気通信サービス
CHINA STEEL CORP	10,329	10,509	25,012	94,297	素材
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	510	510	6,069	22,880	半導体・半導体製造装置
ADVANTECH CO LTD	268	278	6,679	25,181	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	802	810	7,334	27,650	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	580	580	18,734	70,627	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AU OPTRONICS CORP	7,630	7,630	8,736	32,936	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HTC CORP	587	587	4,053	15,281	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
POWERTECH TECHNOLOGY INC	553	603	5,487	20,687	半導体・半導体製造装置
INVENTEC CORP	1,954	2,204	5,047	19,030	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	3,320	3,380	35,321	133,160	電気通信サービス
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	231	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PHISON ELECTRONICS CORP	120	140	3,948	14,883	半導体・半導体製造装置
WPG HOLDINGS LTD	1,274	1,364	5,456	20,569	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	—	550	3,575	13,477	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GIANT MANUFACTURING	240	260	4,771	17,986	耐久消費財・アパレル
RUENTEX INDUSTRIES LTD	470	470	2,206	8,319	耐久消費財・アパレル
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	1,211	1,271	4,140	15,608	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	8,433	8,273	10,755	40,547	各種金融
INNOLUX CORP	7,291	7,881	10,206	38,476	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	5,643	6,373	10,931	41,210	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	6,892	7,012	5,575	21,018	保険
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	1,400	1,370	10,412	39,253	電気通信サービス
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,434	1,674	10,111	38,121	自動車・自動車部品
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	1,011	1,011	10,469	39,468	エネルギー
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	9,517	9,647	23,732	89,473	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	8,045	8,577	16,339	61,601	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	84	88	43,747	164,926	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	4,226	4,276	24,588	92,698	食品・飲料・タバコ
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	4,109	4,355	7,622	28,738	銀行
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	12,012	12,012	9,982	37,633	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	
(台湾)	百株	百株	千ニュー台湾ドル	千円	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,852	1,861	9,149	34,494	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASIA CEMENT CORP	2,072	2,072	5,948	22,427	素材
YULON MOTOR COMPANY	790	790	2,089	7,877	自動車・自動車部品
POU CHEN	1,965	1,965	8,331	31,410	耐久消費財・アパレル
WISTRON CORP	2,049	2,090	5,769	21,752	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	650	650	2,626	9,900	素材
INOTERA MEMORIES INC	1,960	—	—	—	半導体・半導体製造装置
PEGATRON CORP	1,719	1,699	14,957	56,391	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA AIRLINES LTD	2,260	2,260	2,119	7,991	運輸
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	6,310	6,802	12,517	47,189	銀行
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	2,813	2,986	8,735	32,932	保険
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	170	193	3,951	14,895	資本財
EVA AIRWAYS CORP	1,750	1,837	2,728	10,287	運輸
EVERGREEN MARINE CORP LTD	1,533	1,533	2,016	7,600	運輸
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	6,320	6,673	10,410	39,246	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	220	220	7,711	29,070	小売
TECO ELECTRIC & MACHINERY	1,700	1,700	5,083	19,162	資本財
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	365	—	—	—	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	760	760	2,793	10,529	不動産
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	650	750	3,817	14,391	不動産
TAIWAN BUSINESS BANK	3,798	3,694	3,085	11,631	銀行
STANDARD FOODS CORP	305	339	2,545	9,598	食品・飲料・タバコ
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	340	340	2,420	9,126	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FORMOSA TAFFETA CO.	680	680	2,094	7,895	耐久消費財・アパレル
CHAILEASE HOLDING CO LTD	874	944	7,226	27,243	各種金融
TRANSCEND INFORMATION INC	180	180	1,818	6,853	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HERMES MICROVISION INC	32	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MERIDA INDUSTRY CO LTD	177	177	2,734	10,309	耐久消費財・アパレル
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	720	790	4,471	16,857	半導体・半導体製造装置
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	164	164	5,280	19,908	耐久消費財・アパレル
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	1,600	1,990	1,934	7,292	電気通信サービス
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	267	299	3,561	13,425	耐久消費財・アパレル
CASETEK HOLDINGS LTD	120	120	972	3,664	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OBI PHARMA INC	90	100	2,630	9,915	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NANYA TECHNOLOGY CORP	—	640	3,212	12,112	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	—	130	4,108	15,487	耐久消費財・アパレル
TAIMED BIOLOGICS INC	—	150	2,602	9,811	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	272,506	282,219	1,502,082	5,662,852	
小計 銘柄数<比率>	88	88	—	<11.4%>	
(インド)			千インドルピー		
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	1,307	1,335	208,983	371,990	銀行
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	412	421	99,052	176,314	ソフトウェア・サービス
ITC LTD	1,962	3,014	83,386	148,427	食品・飲料・タバコ
HINDUSTAN UNILEVER LTD	662	579	56,738	100,993	家庭用品・パーソナル用品
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	532	532	9,275	16,509	資本財
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	752	1,128	20,723	36,888	エネルギー
HINDALCO INDUSTRIES LTD	960	1,078	20,875	37,158	素材
COAL INDIA LTD	612	612	16,789	29,884	エネルギー
GAIL INDIA LTD	338	374	15,281	27,200	公益事業
AMBUJA CEMENTS LTD	606	526	13,694	24,376	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	
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円	
HERO MOTOCORP LTD	44	44	15,266	27,174	自動車・自動車部品
BAJAJ AUTO LTD	74	74	22,278	39,655	自動車・自動車部品
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	839	846	54,904	97,729	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASIAN PAINTS LTD	251	245	28,683	51,055	素材
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	131	131	13,364	23,788	各種金融
VEDANTA LTD	803	1,313	31,000	55,181	素材
TATA POWER CO LTD	930	930	7,681	13,673	公益事業
BHARTI AIRTEL LTD	1,047	861	31,516	56,098	電気通信サービス
CIPLA LTD	305	305	17,161	30,548	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NTPC LTD	1,018	1,449	23,234	41,357	公益事業
INFOSYS LTD	1,563	1,629	153,793	273,753	ソフトウェア・サービス
ULTRATECH CEMENT LTD	30	77	34,241	60,948	素材
ACC LTD	38	38	6,419	11,426	素材
DR. REDDY'S LABORATORIES	103	101	26,199	46,634	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ICICI BANK LTD	971	952	28,600	50,908	銀行
LUPIN LTD	193	190	23,934	42,603	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	92	93	63,499	113,029	自動車・自動車部品
RELIANCE INDUSTRIES LTD	1,112	1,151	156,592	278,735	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	1,363	1,443	43,021	76,578	銀行
TATA STEEL LTD	253	276	12,175	21,672	素材
LIC HOUSING FINANCE LTD	246	271	18,765	33,402	銀行
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	74	450	32,879	58,525	エネルギー
IDEA CELLULAR LTD	965	1,075	9,762	17,377	電気通信サービス
CAIRN INDIA LTD	404	—	—	—	エネルギー
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	102	107	20,549	36,577	家庭用品・パーソナル用品
RURAL ELECTRIFICATION CORP	252	—	—	—	各種金融
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	507	507	27,662	49,239	メディア
POWER FINANCE CORPORATION	215	560	9,049	16,108	各種金融
DABUR INDIA LTD	470	470	13,088	23,298	家庭用品・パーソナル用品
JSW STEEL LTD	75	750	14,587	25,965	素材
LARSEN & TOUBRO LTD	277	283	49,170	87,522	資本財
UNITED SPIRITS LTD	51	57	12,240	21,788	食品・飲料・タバコ
TITAN CO LTD	—	273	13,701	24,388	耐久消費財・アパレル
SIEMENS LTD	61	61	8,650	15,398	資本財
WIPRO LTD	540	540	27,256	48,515	ソフトウェア・サービス
AXIS BANK LTD	523	1,485	76,764	136,641	銀行
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	326	331	45,564	81,104	自動車・自動車部品
TATA MOTORS LTD	724	1,366	58,428	104,002	自動車・自動車部品
HCL TECHNOLOGIES LTD	493	499	41,884	74,554	ソフトウェア・サービス
UNITED BREWERIES LTD	56	—	—	—	食品・飲料・タバコ
DIVI'S LABORATORIES LTD	71	71	4,560	8,118	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	732	732	26,357	46,916	運輸
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	65	65	8,584	15,280	ヘルスケア機器・サービス
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	760	—	—	—	電気通信サービス
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	8	—	—	—	食品・飲料・タバコ
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	57	71	18,063	32,152	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	233	257	8,685	15,459	各種金融
YES BANK LTD	—	298	47,035	83,722	銀行
NESTLE INDIA LTD	20	20	14,055	25,019	食品・飲料・タバコ
TECH MAHINDRA LTD	194	397	17,290	30,776	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円	
AUROBINDO PHARMA LTD	232	232	14,485	25,783	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	267	372	14,985	26,674	自動車・自動車部品
BOSCH LTD	6	6	15,606	27,778	自動車・自動車部品
SHREE CEMENT LTD	7	7	14,742	26,241	素材
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	30	37	4,407	7,845	運輸
MARICO LTD	382	414	12,945	23,043	家庭用品・パーソナル用品
BHARTI INFRATEL LTD	478	513	19,425	34,577	電気通信サービス
EICHER MOTORS LTD	10	11	33,889	60,323	資本財
BHARAT FORGE LTD	93	93	10,570	18,815	自動車・自動車部品
UPL LTD	248	311	25,684	45,719	素材
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	118	118	10,693	19,034	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAVELLS INDIA LTD	—	221	11,339	20,184	資本財
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	259	259	27,693	49,294	銀行
ASHOK LEYLAND LTD	1,012	1,012	8,764	15,601	資本財
CADILA HEALTHCARE LTD	180	180	8,915	15,869	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TATA MOTORS LTD-A-DVR	310	310	8,211	14,617	自動車・自動車部品
BAJAJ FINANCE LTD	—	141	18,889	33,623	各種金融
BAJAJ FINSERV LTD	—	34	15,285	27,208	保険
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	—	360	18,970	33,766	エネルギー
IDFC BANK LTD	—	1,200	7,830	13,937	銀行
GRASIM INDUSTRIES LTD	—	180	20,831	37,079	素材
小計 株数・金額	31,466	38,779	2,287,178	4,071,177	
小計 銘柄数<比率>	73	76	—	<8.2%>	
(アラブ首長国連邦)			千アラブディルハム		
EMAAR PROPERTIES PJSC	3,066	3,066	2,296	71,136	不動産
ALDAR PROPERTIES PJSC	2,590	2,590	590	18,288	不動産
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	1,640	1,640	1,200	37,178	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	584	1,538	1,730	53,595	銀行
ARABTEC HOLDING CO PJSC	1,904	—	—	—	資本財
FIRST GULF BANK	761	—	—	—	銀行
DUBAI FINANCIAL MARKET PJSC	1,670	—	—	—	各種金融
DUBAI ISLAMIC BANK	830	1,037	603	18,700	銀行
EMAAR MALLS PJSC	1,600	1,600	422	13,081	不動産
EMIRATES TELECOM GROUP CO	1,518	1,518	2,718	84,185	電気通信サービス
DXB ENTERTAINMENTS PJSC	—	2,600	235	7,279	消費者サービス
小計 株数・金額	16,164	15,591	9,798	303,446	
小計 銘柄数<比率>	10	8	—	<0.6%>	
(カタール)			千カタールリアル		
MASRAF AL RAYAN	307	307	1,312	41,144	銀行
OOREDOO QSC	66	66	705	22,118	電気通信サービス
QATAR NATIONAL BANK	183	201	2,858	89,619	銀行
INDUSTRIES QATAR	126	126	1,325	41,561	資本財
VODAFONE QATAR	285	—	—	—	電気通信サービス
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	23	23	476	14,925	公益事業
QATAR ISLAMIC BANK	49	49	497	15,595	銀行
BARWA REAL ESTATE CO	83	83	277	8,690	不動産
COMMERCIAL BANK QSC	134	140	415	13,021	銀行
DOHA BANK QSC	103	103	329	10,318	銀行
DOHA BANK QSC - NEW	—	20	65	2,063	銀行
QATAR INSURANCE CO	105	140	1,000	31,366	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	
(カタール)	百株	百株	千カタールリアル	千円	
QATAR INSURANCE CO-NEW	16	—	—	—	保険
EZDAN HOLDING GROUP	666	666	1,058	33,176	不動産
QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	234	234	449	14,082	エネルギー
小計 株数・金額	2,384	2,163	10,771	337,686	
小計 銘柄数<比率>	14	13	—	<0.7%>	
(南アフリカ)			千南アフリカランド		
BARLOWORLD LTD	180	—	—	—	資本財
SAPPI LIMITED	480	480	4,838	41,223	素材
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	45	49	1,570	13,381	素材
NEDBANK GROUP LTD	173	173	3,821	32,562	銀行
SASOL LTD	472	492	20,106	171,306	素材
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	355	353	5,330	45,414	素材
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	534	568	2,497	21,281	素材
GOLD FIELDS LTD	664	728	3,391	28,897	素材
MONDI LTD	104	104	3,596	30,638	素材
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	865	884	6,242	53,185	小売
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	392	392	3,076	26,207	小売
TELKOM SA SOC LTD	216	244	1,919	16,354	電気通信サービス
TIGER BRANDS LTD	143	144	5,675	48,355	食品・飲料・タバコ
SANLAM LTD	1,516	1,243	8,752	74,575	保険
SHOPRITE HOLDINGS LTD	401	382	7,631	65,016	食品・生活必需品小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	1,058	1,146	16,995	144,797	銀行
RMB HOLDINGS LTD	625	625	3,866	32,945	各種金融
REMGRO LTD	420	461	10,372	88,373	各種金融
NETCARE LTD	810	819	2,217	18,888	ヘルスケア機器・サービス
NASPERS LTD-N SHS	347	388	104,118	887,085	メディア
MTN GROUP LTD	1,450	1,507	18,204	155,102	電気通信サービス
MASSMART HOLDINGS LTD	98	98	1,224	10,433	食品・生活必需品小売り
IMPERIAL HOLDINGS LTD	160	134	2,135	18,193	小売
INVESTEC LTD	214	214	2,157	18,381	各種金融
FIRSTRAND LTD	2,941	2,979	14,701	125,259	各種金融
THE FOSCHINI GROUP LTD	185	185	2,769	23,596	小売
EXXARO RESOURCES LTD	121	161	1,667	14,204	エネルギー
BIDVEST GROUP LTD	279	279	4,658	39,687	資本財
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	369	364	5,302	45,179	銀行
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	299	323	9,128	77,778	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DISCOVERY LTD	314	314	4,195	35,742	保険
VODACOM GROUP LTD	325	322	4,907	41,814	電気通信サービス
PICK N PAY STORES LTD	216	321	2,016	17,183	食品・生活必需品小売り
MMI HOLDINGS LTD	940	940	2,101	17,907	保険
SPAR GROUP LIMITED/THE	145	163	2,914	24,834	食品・生活必需品小売り
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	565	613	2,583	22,013	保険
LIBERTY HOLDINGS LTD	95	95	1,011	8,616	保険
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	821	1,178	3,451	29,409	ヘルスケア機器・サービス
MR PRICE GROUP LTD	213	213	3,165	26,966	小売
SIBANYE GOLD LTD	622	673	1,893	16,132	素材
CORONATION FUND MANAGERS LTD	204	204	1,311	11,172	各種金融
BRAIT SE	296	291	2,556	21,783	各種金融
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	295	295	754	6,426	消費者サービス
PSG GROUP LTD	74	84	2,049	17,458	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	
(南アフリカ)		百株	百株	千南アフリカランド	千円	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD		29	36	2,718	23,164	銀行
PIONEER FOODS GROUP LTD		107	117	1,928	16,430	食品・飲料・タバコ
FORTRESS INCOME FUND LTD		611	—	—	—	不動産
FORTRESS INCOME FUND LTD-A		798	—	—	—	不動産
NEW EUROPE PROPERTY INVEST		197	206	3,225	27,481	不動産
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV		2,523	2,647	18,137	154,529	耐久消費財・アパレル
BID CORP LTD		—	298	8,883	75,686	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	25,322	24,945	347,777	2,963,064	
	銘柄数<比率>	50	48	—	<6.0%>	
合計	株数・金額	6,668,533	6,770,111	—	46,073,633	
	銘柄数<比率>	846	825	—	<92.6%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国投資信託証券

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)		千口	千口	千メキシコペソ	千円	%
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		213	224	7,515	45,466	0.1
小計	口数・金額	213	224	7,515	45,466	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>	
(トルコ)				千トルコリラ		
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI		167	167	480	15,312	0.0
小計	口数・金額	167	167	480	15,312	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>	
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		203	180	4,607	39,253	0.1
REDEFINE PROPERTIES LTD		389	442	4,918	41,901	0.1
HYPROP INVESTMENTS LTD		20	22	2,710	23,090	0.0
RESILIENT REIT LTD		24	25	3,008	25,630	0.1
FORTRESS INCOME FUND LTD-A		—	79	1,403	11,959	0.0
FORTRESS INCOME FUND LTD		—	67	2,294	19,546	0.0
小計	口数・金額	638	818	18,941	161,382	
	銘柄数<比率>	4	6	—	<0.3%>	
合計	口数・金額	1,019	1,209	—	222,161	
	銘柄数<比率>	6	8	—	<0.4%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
外国	株式先物取引	MINI MS	百万円 3,255	百万円 —

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

○投資信託財産の構成

（2017年５月12日現在）

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
株式	46,073,633	91.9
投資証券	222,161	0.4
コール・ローン等、その他	3,832,559	7.7
投資信託財産総額	50,128,353	100.0

（注）期末における外貨建純資産（49,734,090千円）の投資信託財産総額（50,128,353千円）に対する比率は99.2%です。

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

１アメリカドル＝113.94円	１メキシコペソ＝6.05円	１ブラジルレアル＝36.28円	100チリペソ＝16.95円
100コロンビアペソ＝3.89円	１ユーロ＝123.80円	１トルコリラ＝31.86円	１チェココルナ＝4.66円
100ハンガリーフォリント＝39.91円	１ポーランドズロチ＝29.30円	１香港ドル＝14.63円	１マレーシアリンギット＝26.22円
１タイバーツ＝3.28円	１フィリピンペソ＝2.28円	100インドネシアルピア＝0.86円	100韓国ウォン＝10.15円
１ニュー台湾ドル＝3.77円	１インドルピー＝1.78円	１アラブディルハム＝30.97円	１カタールリアル＝31.35円
１南アフリカランド＝8.52円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年５月12日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	50,292,083,314
コール・ローン等	3,253,941,902
株式(評価額)	46,073,633,757
投資証券(評価額)	222,161,469
未収入金	329,406,576
未収配当金	48,521,124
差入委託証拠金	364,418,486
(B) 負債	557,486,697
未払金	163,955,000
未払解約金	393,531,133
未払利息	564
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	49,734,596,617
元本	21,515,916,530
次期繰越損益金	28,218,680,087
(D) 受益権総口数	21,515,916,530口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	23,115円

＜注記事項＞

①期首元本額　20,543,703,750円
　期中追加設定元本額　5,589,816,389円
　期中一部解約元本額　4,617,603,609円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.3115円です。

○損益の状況 (2016年５月13日～2017年５月12日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	930,110,109
受取配当金	920,465,062
受取利息	9,747,678
支払利息	△ 102,631
(B) 有価証券売買損益	10,704,765,762
売買益	12,017,243,005
売買損	△ 1,312,477,243
(C) 先物取引等取引損益	561,166,692
取引益	733,573,237
取引損	△ 172,406,545
(D) 保管費用等	△ 50,753,902
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	12,145,288,661
(F) 前期繰越損益金	15,074,668,766
(G) 追加信託差損益金	5,258,879,978
(H) 解約差損益金	△ 4,260,157,318
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	28,218,680,087
次期繰越損益金(Ｉ)	28,218,680,087

(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）

ｅＭＡＸＩＳ 新興国株式インデックス	13,162,396,257円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,224,580,371円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	188,733,822円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	155,361,770円
コアバランス	98,046円
海外株式セレクション（ラップ向け）	109,786円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	19,612,966円
三菱ＵＦＪ ＤＣ新興国株式インデックスファンド	4,873,662,643円
新興国株式インデックスオープン	269,021,681円
ｅＭＡＸＩＳ 全世界株式インデックス	345,562,993円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	136,460,353円
新興国株式インデックスファンド（ラップ向け）	8,253,442円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	2,749,411円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	17,108,374円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	21,274,016円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	57,525,928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）	1,434,405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）	1,012,725,407円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	2,412,914円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	13,574,454円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	3,257,491円
合計	21,515,916,530円

日本債券インデックスマザーファンド

《第16期》決算日2017年５月12日

［計算期間：2016年５月13日～2017年５月12日］

「日本債券インデックスマザーファンド」は、５月12日に第16期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合インデックス		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
12期(2013年５月13日)	12,036	1.5	345.99	1.5	98.9	0.8	269,276
13期(2014年５月12日)	12,299	2.2	353.58	2.2	99.4	0.2	283,162
14期(2015年５月12日)	12,572	2.2	361.38	2.2	99.4	0.3	343,834
15期(2016年５月12日)	13,473	7.2	387.29	7.2	99.6	－	529,456
16期(2017年５月12日)	13,180	△2.2	378.85	△2.2	99.3	0.2	457,117

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		NOMURA－BPI総合インデックス		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首) 2016年5月12日	13,473	－	387.29	－	99.6	－
5月末	13,484	0.1	387.60	0.1	100.2	0.2
6月末	13,648	1.3	392.36	1.3	99.0	0.3
7月末	13,532	0.4	389.24	0.5	99.5	0.3
8月末	13,403	△0.5	385.24	△0.5	99.5	0.3
9月末	13,411	△0.5	385.50	△0.5	99.4	0.3
10月末	13,374	△0.7	384.44	△0.7	99.5	0.2
11月末	13,288	△1.4	381.97	△1.4	99.4	0.2
12月末	13,214	△1.9	379.82	△1.9	99.4	0.2
2017年1月末	13,142	△2.5	377.74	△2.5	99.7	－
2月末	13,182	△2.2	378.90	△2.2	99.6	－
3月末	13,165	△2.3	378.49	△2.3	99.7	－
4月末	13,230	△1.8	380.33	△1.8	99.5	－
(期末) 2017年5月12日	13,180	△2.2	378.85	△2.2	99.3	0.2

(注) 騰落率は期首比。
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

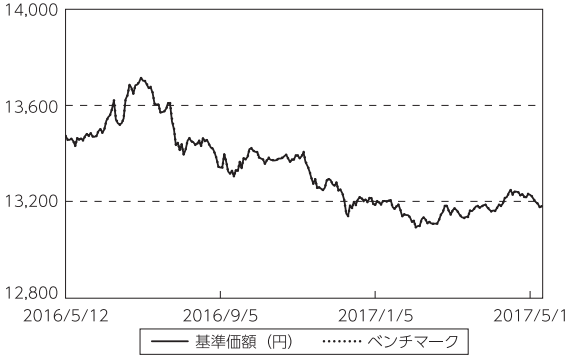
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.2%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



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

●投資環境について

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは2.2%の下落となったため、カイ離は0.0%程度となりました。

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

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は△0.0%程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

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

◎その他の要因

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

○今後の運用方針

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

○１万口当たりの費用明細

（2016年５月13日～2017年５月12日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	0	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
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
合計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,339円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2016年５月13日～2017年５月12日）

公社債

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

（注）金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）
（注）（　）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
（注）社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建 新規買付額	買建 決済額	売建 新規売付額	売建 決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	債券先物取引	13,426	12,506	－	－

○利害関係人との取引状況等

（2016年５月13日～2017年５月12日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	%
公社債	307,419	58,496	19.0	363,138	59,908	16.5

（注）公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種　　類	買　付　額	売　付　額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
公社債	501	1,447	1,730

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種　　類	買　付　額
	百万円
公社債	4,300

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

○組入資産の明細

（2017年５月12日現在）

国内公社債

（A）国内（邦貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					５年以上	２年以上	２年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	343,882,000	375,490,639	82.1	－	51.9	20.2	10.0
	(100,000)	(100,224)	(0.0)	(－)	(－)	(－)	(0.0)
地方債証券	23,959,970	25,386,389	5.6	－	3.7	1.5	0.4
	(23,959,970)	(25,386,389)	(5.6)	(－)	(3.7)	(1.5)	(0.4)
特殊債券（除く金融債）	27,041,751	28,996,132	6.3	－	4.6	1.2	0.5
	(27,041,751)	(28,996,132)	(6.3)	(－)	(4.6)	(1.2)	(0.5)
金融債券	3,140,000	3,157,567	0.7	－	0.0	0.4	0.2
	(3,140,000)	(3,157,567)	(0.7)	(－)	(0.0)	(0.4)	(0.2)
普通社債券	20,273,000	20,958,312	4.6	0.2	1.4	2.8	0.4
	(20,273,000)	(20,958,312)	(4.6)	(0.2)	(1.4)	(2.8)	(0.4)
合計	418,296,721	453,989,041	99.3	0.2	61.6	26.2	11.5
	(74,514,721)	(78,598,626)	(17.2)	(0.2)	(9.7)	(6.0)	(1.5)

（注）（　）内は非上場債で内書き。
（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。
（注）現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B)国内(邦貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第365回利付国債（２年）	0.1	1,000,000	1,003,090	2018/６/15
第366回利付国債（２年）	0.1	2,280,000	2,287,569	2018/７/15
第368回利付国債（２年）	0.1	1,400,000	1,405,236	2018/９/15
第369回利付国債（２年）	0.1	1,000,000	1,004,040	2018/10/15
第370回利付国債（２年）	0.1	1,600,000	1,606,864	2018/11/15
第371回利付国債（２年）	0.1	3,600,000	3,616,272	2018/12/15
第372回利付国債（２年）	0.1	1,300,000	1,306,188	2019/１/15
第373回利付国債（２年）	0.1	1,550,000	1,557,765	2019/２/15
第374回利付国債（２年）	0.1	2,100,000	2,110,983	2019/３/15
第112回利付国債（５年）	0.4	1,400,000	1,409,058	2018/６/20
第113回利付国債（５年）	0.3	840,000	844,519	2018/６/20
第114回利付国債（５年）	0.3	2,090,000	2,103,689	2018/９/20
第115回利付国債（５年）	0.2	3,670,000	3,689,084	2018/９/20
第116回利付国債（５年）	0.2	2,080,000	2,092,979	2018/12/20
第117回利付国債（５年）	0.2	3,570,000	3,595,418	2019/３/20
第118回利付国債（５年）	0.2	2,260,000	2,277,582	2019/６/20
第119回利付国債（５年）	0.1	450,000	452,551	2019/６/20
第120回利付国債（５年）	0.2	2,000,000	2,017,200	2019/９/20
第121回利付国債（５年）	0.1	2,380,000	2,394,851	2019/９/20
第122回利付国債（５年）	0.1	3,070,000	3,090,814	2019/12/20
第123回利付国債（５年）	0.1	3,060,000	3,082,705	2020/３/20
第124回利付国債（５年）	0.1	4,930,000	4,969,094	2020/６/20
第125回利付国債（５年）	0.1	3,000,000	3,025,230	2020/９/20
第126回利付国債（５年）	0.1	2,960,000	2,986,758	2020/12/20
第127回利付国債（５年）	0.1	4,820,000	4,865,645	2021/３/20
第128回利付国債（５年）	0.1	4,950,000	4,998,906	2021/６/20
第129回利付国債（５年）	0.1	1,600,000	1,616,432	2021/９/20
第130回利付国債（５年）	0.1	5,400,000	5,461,182	2021/12/20
第131回利付国債（５年）	0.1	1,300,000	1,314,248	2022/３/20
第１回利付国債（40年）	2.4	505,000	715,514	2048/３/20
第２回利付国債（40年）	2.2	600,000	820,464	2049/３/20
第３回利付国債（40年）	2.2	753,000	1,033,914	2050/３/20
第４回利付国債（40年）	2.2	878,000	1,210,200	2051/３/20
第５回利付国債（40年）	2.0	865,000	1,144,715	2052/３/20
第６回利付国債（40年）	1.9	910,000	1,178,977	2053/３/20
第７回利付国債（40年）	1.7	810,000	1,000,366	2054/３/20
第８回利付国債（40年）	1.4	1,060,000	1,209,608	2055/３/20
第９回利付国債（40年）	0.4	1,430,000	1,168,696	2056/３/20
第293回利付国債（10年）	1.8	1,081,000	1,104,554	2018/６/20
第294回利付国債（10年）	1.7	1,570,000	1,602,483	2018/６/20
第295回利付国債（10年）	1.5	1,240,000	1,262,940	2018/６/20
第296回利付国債（10年）	1.5	2,020,000	2,065,854	2018/９/20
第297回利付国債（10年）	1.4	1,636,000	1,677,668	2018/12/20
第298回利付国債（10年）	1.3	2,640,000	2,703,016	2018/12/20

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
国内	債券先物取引	１０年国債標準物	百万円 903	百万円 －

○投資信託財産の構成

（2017年５月12日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	453,989,041	98.7
コール・ローン等、その他	6,133,517	1.3
投資信託財産総額	460,122,558	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年５月12日現在)

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

＜注記事項＞

①期首元本額　392,963,515,092円
　期中追加設定元本額　245,553,693,560円
　期中一部解約元本額　291,679,254,167円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.3180円です。

○損益の状況 (2016年５月13日～2017年５月12日)

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

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

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

ファンド・マネジャー（国内債券）	54,615,483,471円
ｅＭＡＸＩＳ 国内債券インデックス	16,911,704,114円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,872,202,478円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	478,157,438円
コアバランス	2,044,029円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	6,231,670円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	2,420,327円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	4,262,915円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 国内債券インデックス	113,708,426円
国内債券セレクション（ラップ向け）	4,501,380円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	31,301,599円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	17,309,618,544円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	5,497,356,560円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	82,107,820円
三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）	598,261,047円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	7,881,350,735円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	442,095,198円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	504,579,550円
ｅＭＡＸＩＳ 債券バランス（２資産均等型）	59,802,401円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	59,441,649円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	46,440,556円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	42,802,857円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	88,464,709円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	18,110,184円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	1,659,004円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,299,233,788円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,282,635,043円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	1,873,954,110円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	6,219,044,942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）	159,938,336,353円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	5,661,045,142円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ７５型（適格機関投資家限定）	2,003,390,686円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,362,090,967円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４５型（適格機関投資家限定）	582,256,980円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	158,108,340円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,547,131,810円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,031,768,610円
三菱ＵＦＪ グローバル型バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,361,732円
ＭＵＫＡＭ バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	8,761,774,765円
ＭＵＫＡＭ バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	1,647,703,661円
ＭＵＫＡＭ スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	658,523,690円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	57,044,851円
ＭＵＫＡＭ 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	12,188,316,244円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	26,310,784円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	60,808,964円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	54,028,124円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	38,284,243円
三菱ＵＦＪ 日本債券インデックスファンドＶＡ	19,292,503円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	225,020,167円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	482,066,864円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	198,546,601円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	414,897,943円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞日本債券インデックスファンド	3,316,415,148円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	1,748,884,567円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	3,421,157,759円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	1,827,142,808円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	1,055,267,635円
合計	346,837,954,485円

外国債券インデックスマザーファンド

《第16期》決算日2017年５月12日

［計算期間：2016年５月13日～2017年５月12日］

「外国債券インデックスマザーファンド」は、５月12日に第16期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	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）		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
16期(2017年５月12日)	19,894	1.1	111,054.04	1.0	98.8	－	132,430

(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		
（期　首）	円	%		%	%	%
2016年５月12日	19,674	－	109,931.94	－	98.9	－
５月末	19,882	1.1	111,018.88	1.0	98.8	－
６月末	18,785	△4.5	104,838.53	△4.6	98.9	－
７月末	19,091	△3.0	106,568.13	△3.1	98.7	－
８月末	18,950	△3.7	105,873.31	△3.7	98.2	－
９月末	18,596	△5.5	103,925.95	△5.5	99.0	－
10月末	18,627	△5.3	103,797.35	△5.6	98.8	－
11月末	19,379	△1.5	108,026.33	△1.7	98.6	－
12月末	19,984	1.6	111,331.80	1.3	98.5	－
2017年１月末	19,507	△0.8	108,860.69	△1.0	98.9	－
２月末	19,406	△1.4	108,568.93	△1.2	99.0	－
３月末	19,408	△1.4	108,641.98	△1.2	98.7	－
４月末	19,527	△0.7	109,024.53	△0.8	98.7	－
（期　末）						
2017年５月12日	19,894	1.1	111,054.04	1.0	98.8	－

（注）騰落率は期首比。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

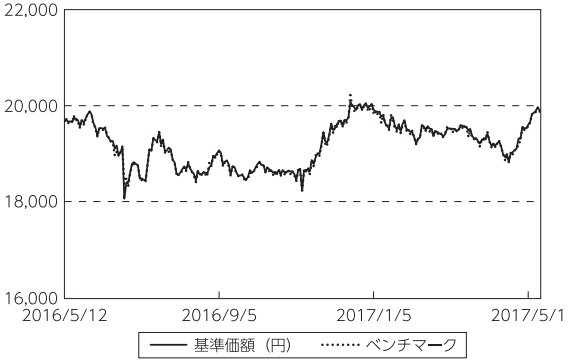
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.1%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（1.0%）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、2016年６月にかけて世界的な景気減速懸念が強まったことなどを背景に上昇しましたが、その後、米連邦準備制度理事会（ＦＲＢ）の利上げに対する期待が高まったことなどから下落しました。

◎為替市況

・円・米ドル相場は、2016年６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、米ドルが対円で下落しましたが、その後、ＦＲＢの利上げに対する期待が高まったことなどから、米ドルが対円で買われました。期首との比較では、米ドルは対円で5.1%上昇しました。

・円・ユーロ相場は、６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、ユーロが対円で下落しましたが、米国大統領選挙以降、大半の主要通貨に対して円安が進行し、ユーロは対円で上昇しました。期首との比較では、ユーロは対円でほぼ横ばいとなりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

・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1.0%の上昇となったため、カイ離は0.1%程度となりました。

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

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は0.0%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は△0.0%程度でした。

・カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.1%程度でした。

・為替の効果および債券の効果による要因です。

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

○今後の運用方針

・今後の運用についても、運用方針を堅持します。

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2016年５月13日～2017年５月12日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	3	0.015	(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)	(0.015)	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	0.015	
期中の平均基準価額は、19,261円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2016年５月13日～2017年５月12日）

公社債

			買　　付　　額	売　　付　　額
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 182,572	千アメリカドル 258,294
	カナダ	国債証券	千カナダドル 10,399	千カナダドル 14,654
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 40,606	千メキシコペソ 72,264
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	18,301	34,456
	イタリア	国債証券	25,122	43,336
	フランス	国債証券	25,800	41,960
	オランダ	国債証券	5,317	11,622
	スペイン	国債証券	14,486	23,913
	ベルギー	国債証券	6,689	12,048
	オーストリア	国債証券	3,505	6,756
	フィンランド	国債証券	1,130	2,243
	アイルランド	国債証券	1,306	2,751
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 13,951	千イギリスポンド 29,625
	スイス	国債証券	千スイスフラン 202	千スイスフラン 1,787
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 8,075	千スウェーデンクローネ 19,532
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 6,067	千ノルウェークローネ 13,264
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 10,184	千デンマーククローネ 24,457
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 9,452	千ポーランドズロチ 12,363
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 10,256	千オーストラリアドル 11,229
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 1,430	千シンガポールドル 1,981
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 4,440	千マレーシアリンギット 9,861
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 16,098	千南アフリカランド 26,504

（注）金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）

○利害関係人との取引状況等

（2016年５月13日～2017年５月12日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	%
為替直物取引	20,196	11,410	56.5	45,263	15,571	34.4

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

（2017年５月12日現在）

外国公社債

（A）外国（外貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	504,950	509,877	58,095,390	43.9	－	18.1	18.1	7.7
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	30,120	32,879	2,733,243	2.1	－	0.9	0.7	0.5
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	190,200	194,958	1,179,500	0.9	－	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	64,070	75,084	9,295,499	7.0	－	4.1	2.0	1.0
イタリア	89,500	100,673	12,463,436	9.4	－	5.4	2.8	1.2
フランス	88,660	103,434	12,805,157	9.7	－	6.0	2.9	0.8
オランダ	19,450	23,235	2,876,580	2.2	－	1.4	0.5	0.2
スペイン	50,850	58,897	7,291,500	5.5	－	3.3	1.5	0.7
ベルギー	21,700	26,317	3,258,154	2.5	－	1.8	0.5	0.2
オーストリア	13,300	15,758	1,950,868	1.5	－	0.9	0.4	0.1
フィンランド	5,850	6,491	803,591	0.6	－	0.4	0.2	0.0
アイルランド	7,550	8,584	1,062,742	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	52,055	65,437	9,604,323	7.3	－	5.3	1.6	0.4
	千スイスフラン	千スイスフラン						
スイス	1,760	2,118	239,568	0.2	－	0.1	0.1	－
	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	40,100	45,885	588,717	0.4	－	0.3	0.1	0.1
	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	26,250	27,950	370,348	0.3	－	0.2	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	38,600	47,725	794,151	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	28,550	28,991	849,437	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	30,650	32,814	2,759,409	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	5,910	6,181	500,124	0.4	－	0.2	0.2	0.0
	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	20,850	20,831	546,198	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	92,450	84,704	721,683	0.5	－	0.5	0.1	0.0
合計	－	－	130,789,630	98.8	－	51.9	33.5	13.4

（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）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	償還年月日
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	2,386	271,960	2018/4/30
		0.625 T-NOTE 180630	0.625	4,000	3,973	452,786	2018/6/30
		0.75 T-NOTE 180430	0.75	200	199	22,690	2018/4/30
		0.75 T-NOTE 180831	0.75	3,900	3,874	441,501	2018/8/31
		0.75 T-NOTE 180930	0.75	2,600	2,581	294,103	2018/9/30
		0.75 T-NOTE 181031	0.75	300	297	33,921	2018/10/31
		0.75 T-NOTE 190215	0.75	700	693	78,963	2019/2/15
		0.75 T-NOTE 190715	0.75	3,000	2,958	337,133	2019/7/15
		0.75 T-NOTE 190815	0.75	2,300	2,267	258,305	2019/8/15
		0.875 T-NOTE 180531	0.875	1,400	1,395	158,973	2018/5/31
		0.875 T-NOTE 180715	0.875	2,200	2,191	249,679	2018/7/15
		0.875 T-NOTE 181015	0.875	2,500	2,485	283,236	2018/10/15
		0.875 T-NOTE 190415	0.875	2,000	1,982	225,894	2019/4/15
		0.875 T-NOTE 190515	0.875	2,000	1,981	225,752	2019/5/15
		0.875 T-NOTE 190615	0.875	1,800	1,781	203,001	2019/6/15
		0.875 T-NOTE 190731	0.875	900	889	101,396	2019/7/31
		0.875 T-NOTE 190915	0.875	3,400	3,357	382,598	2019/9/15
		1 T-NOTE 180515	1.0	1,700	1,696	193,296	2018/5/15
		1 T-NOTE 180531	1.0	2,600	2,594	295,595	2018/5/31
		1 T-NOTE 180815	1.0	2,700	2,692	306,736	2018/8/15
		1 T-NOTE 180915	1.0	2,600	2,590	295,190	2018/9/15
		1 T-NOTE 181130	1.0	500	497	56,705	2018/11/30
		1 T-NOTE 190315	1.0	1,400	1,391	158,550	2019/3/15
		1 T-NOTE 190630	1.0	1,100	1,091	124,359	2019/6/30
		1 T-NOTE 190831	1.0	600	594	67,720	2019/8/31
		1 T-NOTE 190930	1.0	1,800	1,782	203,049	2019/9/30
		1 T-NOTE 191015	1.0	1,700	1,682	191,723	2019/10/15
		1 T-NOTE 191115	1.0	2,500	2,472	281,723	2019/11/15
		1 T-NOTE 191130	1.0	1,800	1,779	202,808	2019/11/30
		1.125 T-NOTE 180615	1.125	2,200	2,197	250,432	2018/6/15
		1.125 T-NOTE 190115	1.125	1,800	1,794	204,491	2019/1/15
		1.125 T-NOTE 190131	1.125	1,700	1,694	193,085	2019/1/31
		1.125 T-NOTE 190228	1.125	1,600	1,594	181,684	2019/2/28
		1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,300	1,294	147,450	2019/5/31
		1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,600	1,586	180,708	2019/12/31
		1.125 T-NOTE 200331	1.125	1,300	1,285	146,472	2020/3/31
		1.125 T-NOTE 200430	1.125	4,000	3,952	450,383	2020/4/30
		1.125 T-NOTE 210228	1.125	2,400	2,344	267,153	2021/2/28
		1.125 T-NOTE 210630	1.125	2,000	1,944	221,595	2021/6/30
		1.125 T-NOTE 210731	1.125	2,200	2,136	243,461	2021/7/31
		1.125 T-NOTE 210831	1.125	2,700	2,619	298,504	2021/8/31
		1.125 T-NOTE 210930	1.125	2,700	2,616	298,072	2021/9/30
		1.25 T-NOTE 181031	1.25	2,100	2,098	239,124	2018/10/31
		1.25 T-NOTE 181115	1.25	1,600	1,599	182,197	2018/11/15
		1.25 T-NOTE 181130	1.25	2,500	2,498	284,638	2018/11/30
		1.25 T-NOTE 181215	1.25	2,000	1,998	227,728	2018/12/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	1.25 T-NOTE 190131	1.25	1,850	1,847	210,517	2019/1/31
		1.25 T-NOTE 190430	1.25	600	598	68,243	2019/4/30
		1.25 T-NOTE 191031	1.25	1,400	1,393	158,799	2019/10/31
		1.25 T-NOTE 200131	1.25	2,400	2,385	271,768	2020/1/31
		1.25 T-NOTE 200229	1.25	1,350	1,340	152,743	2020/2/29
		1.25 T-NOTE 210331	1.25	1,700	1,666	189,929	2021/3/31
		1.25 T-NOTE 211031	1.25	2,000	1,946	221,791	2021/10/31
		1.25 T-NOTE 230731	1.25	1,800	1,708	194,677	2023/7/31
		1.375 T-NOTE 180630	1.375	1,800	1,803	205,460	2018/6/30
		1.375 T-NOTE 180731	1.375	2,300	2,303	262,491	2018/7/31
		1.375 T-NOTE 180930	1.375	2,800	2,804	319,505	2018/9/30
		1.375 T-NOTE 181130	1.375	1,000	1,001	114,069	2018/11/30
		1.375 T-NOTE 181231	1.375	1,500	1,501	171,090	2018/12/31
		1.375 T-NOTE 190228	1.375	1,200	1,201	136,856	2019/2/28
		1.375 T-NOTE 191215	1.375	3,400	3,392	386,593	2019/12/15
		1.375 T-NOTE 200131	1.375	1,750	1,745	198,857	2020/1/31
		1.375 T-NOTE 200215	1.375	1,700	1,694	193,054	2020/2/15
		1.375 T-NOTE 200229	1.375	2,500	2,491	283,848	2020/2/29
		1.375 T-NOTE 200331	1.375	2,100	2,091	238,283	2020/3/31
		1.375 T-NOTE 200430	1.375	2,000	1,990	226,758	2020/4/30
		1.375 T-NOTE 200531	1.375	1,700	1,690	192,593	2020/5/31
		1.375 T-NOTE 200831	1.375	2,650	2,628	299,464	2020/8/31
		1.375 T-NOTE 200930	1.375	2,600	2,576	293,536	2020/9/30
		1.375 T-NOTE 201031	1.375	2,650	2,623	298,874	2020/10/31
		1.375 T-NOTE 210131	1.375	2,300	2,269	258,642	2021/1/31
		1.375 T-NOTE 210430	1.375	2,400	2,362	269,161	2021/4/30
		1.375 T-NOTE 210531	1.375	2,700	2,655	302,518	2021/5/31
		1.375 T-NOTE 230630	1.375	2,200	2,106	239,995	2023/6/30
		1.375 T-NOTE 230831	1.375	2,700	2,579	293,890	2023/8/31
		1.375 T-NOTE 230930	1.375	2,300	2,194	250,084	2023/9/30
		1.5 T-NOTE 180831	1.5	3,400	3,410	388,636	2018/8/31
		1.5 T-NOTE 181231	1.5	2,800	2,808	320,004	2018/12/31
		1.5 T-NOTE 190131	1.5	2,600	2,607	297,123	2019/1/31
		1.5 T-NOTE 190228	1.5	2,400	2,407	274,289	2019/2/28
		1.5 T-NOTE 190331	1.5	1,000	1,003	114,300	2019/3/31
		1.5 T-NOTE 190531	1.5	2,800	2,808	319,991	2019/5/31
		1.5 T-NOTE 191031	1.5	1,600	1,602	182,617	2019/10/31
		1.5 T-NOTE 191130	1.5	2,900	2,903	330,839	2019/11/30
		1.5 T-NOTE 200415	1.5	2,100	2,097	239,040	2020/4/15
		1.5 T-NOTE 200531	1.5	2,000	1,995	227,399	2020/5/31
		1.5 T-NOTE 220131	1.5	2,300	2,257	257,209	2022/1/31
		1.5 T-NOTE 230228	1.5	1,900	1,840	209,754	2023/2/28
		1.5 T-NOTE 230331	1.5	1,800	1,741	198,442	2023/3/31
		1.5 T-NOTE 260815	1.5	5,500	5,093	580,355	2026/8/15
		1.625 T-NOTE 190331	1.625	2,700	2,714	309,320	2019/3/31
		1.625 T-NOTE 190430	1.625	1,100	1,106	126,029	2019/4/30
		1.625 T-NOTE 190630	1.625	1,700	1,708	194,711	2019/6/30

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,200	1,206	137,433	2019/7/31
		1.625 T-NOTE 190831	1.625	3,100	3,115	355,007	2019/8/31
		1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,200	1,205	137,304	2019/12/31
		1.625 T-NOTE 200315	1.625	3,000	3,009	342,848	2020/3/15
		1.625 T-NOTE 200630	1.625	2,700	2,702	307,950	2020/6/30
		1.625 T-NOTE 200731	1.625	2,200	2,201	250,805	2020/7/31
		1.625 T-NOTE 201130	1.625	2,400	2,394	272,793	2020/11/30
		1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,500	1,473	167,852	2022/8/15
		1.625 T-NOTE 221115	1.625	2,400	2,350	267,794	2022/11/15
		1.625 T-NOTE 230430	1.625	3,400	3,309	377,136	2023/4/30
		1.625 T-NOTE 230531	1.625	1,500	1,458	166,223	2023/5/31
		1.625 T-NOTE 231031	1.625	800	774	88,289	2023/10/31
		1.625 T-NOTE 260215	1.625	4,300	4,046	461,081	2026/2/15
		1.625 T-NOTE 260515	1.625	3,650	3,426	390,375	2026/5/15
		1.75 T-NOTE 181031	1.75	1,000	1,006	114,736	2018/10/31
		1.75 T-NOTE 190930	1.75	2,300	2,318	264,170	2019/9/30
		1.75 T-NOTE 201031	1.75	1,700	1,704	194,227	2020/10/31
		1.75 T-NOTE 201231	1.75	2,400	2,402	273,776	2020/12/31
		1.75 T-NOTE 211130	1.75	1,300	1,292	147,288	2021/11/30
		1.75 T-NOTE 220228	1.75	2,100	2,083	237,404	2022/2/28
		1.75 T-NOTE 220331	1.75	2,200	2,181	248,533	2022/3/31
		1.75 T-NOTE 220430	1.75	2,000	1,981	225,814	2022/4/30
		1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,400	1,387	158,095	2022/5/15
		1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,800	1,776	202,432	2022/9/30
		1.75 T-NOTE 230131	1.75	2,000	1,966	224,087	2023/1/31
		1.75 T-NOTE 230515	1.75	4,000	3,920	446,751	2023/5/15
		1.875 T-NOTE 200630	1.875	1,000	1,008	114,963	2020/6/30
		1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,300	2,299	261,990	2021/11/30
		1.875 T-NOTE 220131	1.875	2,550	2,545	290,070	2022/1/31
		1.875 T-NOTE 220228	1.875	2,600	2,595	295,757	2022/2/28
		1.875 T-NOTE 220331	1.875	1,900	1,895	215,978	2022/3/31
		1.875 T-NOTE 220531	1.875	2,000	1,993	227,185	2022/5/31
		1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,700	1,690	192,593	2022/8/31
		1.875 T-NOTE 221031	1.875	2,000	1,984	226,099	2022/10/31
		2 T-NOTE 200731	2.0	1,400	1,416	161,447	2020/7/31
		2 T-NOTE 200930	2.0	1,600	1,618	184,383	2020/9/30
		2 T-NOTE 201130	2.0	1,300	1,313	149,695	2020/11/30
		2 T-NOTE 210228	2.0	1,700	1,716	195,559	2021/2/28
		2 T-NOTE 210531	2.0	2,000	2,016	229,731	2021/5/31
		2 T-NOTE 210831	2.0	2,300	2,314	263,699	2021/8/31
		2 T-NOTE 211031	2.0	2,400	2,412	274,887	2021/10/31
		2 T-NOTE 211115	2.0	3,400	3,419	389,575	2021/11/15
		2 T-NOTE 211231	2.0	3,000	3,013	343,342	2021/12/31
		2 T-NOTE 220215	2.0	2,200	2,211	251,931	2022/2/15
		2 T-NOTE 220731	2.0	2,000	2,002	228,129	2022/7/31
		2 T-NOTE 221130	2.0	1,900	1,896	216,080	2022/11/30
		2 T-NOTE 230215	2.0	3,550	3,536	403,001	2023/2/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	2 T-NOTE 250215	2.0	4,200	4,113	468,677	2025/2/15
		2 T-NOTE 250815	2.0	4,500	4,386	499,831	2025/8/15
		2 T-NOTE 261115	2.0	4,150	4,009	456,818	2026/11/15
		2.125 T-NOTE 200831	2.125	2,200	2,234	254,604	2020/8/31
		2.125 T-NOTE 210131	2.125	2,200	2,230	254,153	2021/1/31
		2.125 T-NOTE 210630	2.125	2,350	2,379	271,126	2021/6/30
		2.125 T-NOTE 210815	2.125	3,700	3,744	426,650	2021/8/15
		2.125 T-NOTE 210930	2.125	2,500	2,527	288,010	2021/9/30
		2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,300	2,323	264,764	2021/12/31
		2.125 T-NOTE 220630	2.125	1,800	1,814	206,726	2022/6/30
		2.125 T-NOTE 221231	2.125	1,650	1,656	188,779	2022/12/31
		2.125 T-NOTE 231130	2.125	1,700	1,697	193,365	2023/11/30
		2.125 T-NOTE 240229	2.125	1,800	1,792	204,258	2024/2/29
		2.125 T-NOTE 240331	2.125	2,000	1,990	226,794	2024/3/31
		2.125 T-NOTE 250515	2.125	7,950	7,841	893,438	2025/5/15
		2.25 T-BOND 460815	2.25	3,000	2,531	288,490	2046/8/15
		2.25 T-NOTE 180731	2.25	300	303	34,599	2018/7/31
		2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,900	1,934	220,409	2021/3/31
		2.25 T-NOTE 210430	2.25	2,200	2,239	255,191	2021/4/30
		2.25 T-NOTE 210731	2.25	2,100	2,135	243,293	2021/7/31
		2.25 T-NOTE 231231	2.25	1,700	1,708	194,621	2023/12/31
		2.25 T-NOTE 240131	2.25	1,900	1,908	217,416	2024/1/31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	4,500	4,495	512,169	2024/11/15
		2.25 T-NOTE 251115	2.25	4,800	4,762	542,596	2025/11/15
		2.25 T-NOTE 270215	2.25	4,650	4,587	522,660	2027/2/15
		2.375 T-NOTE 180531	2.375	1,300	1,315	149,921	2018/5/31
		2.375 T-NOTE 180630	2.375	1,000	1,012	115,417	2018/6/30
		2.375 T-NOTE 201231	2.375	800	818	93,302	2020/12/31
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	4,000	4,037	460,032	2024/8/15
		2.5 T-BOND 450215	2.5	2,900	2,600	296,247	2045/2/15
		2.5 T-BOND 460215	2.5	2,550	2,280	259,789	2046/2/15
		2.5 T-BOND 460515	2.5	2,850	2,547	290,226	2046/5/15
		2.5 T-NOTE 230815	2.5	3,300	3,373	384,373	2023/8/15
		2.5 T-NOTE 240515	2.5	4,750	4,839	551,447	2024/5/15
		2.625 T-NOTE 180430	2.625	1,300	1,317	150,141	2018/4/30
		2.625 T-NOTE 200815	2.625	2,300	2,373	270,415	2020/8/15
		2.625 T-NOTE 201115	2.625	4,100	4,231	482,117	2020/11/15
		2.75 T-BOND 420815	2.75	1,700	1,617	184,330	2042/8/15
		2.75 T-BOND 421115	2.75	1,550	1,473	167,914	2042/11/15
		2.75 T-NOTE 190215	2.75	1,300	1,332	151,819	2019/2/15
		2.75 T-NOTE 231115	2.75	4,900	5,078	578,675	2023/11/15
		2.75 T-NOTE 240215	2.75	3,500	3,625	413,059	2024/2/15
		2.875 T-BOND 430515	2.875	2,850	2,769	315,570	2043/5/15
		2.875 T-BOND 450815	2.875	2,900	2,805	319,635	2045/8/15
		2.875 T-BOND 461115	2.875	2,700	2,610	297,471	2046/11/15
		3 T-BOND 420515	3.0	1,450	1,446	164,825	2042/5/15
		3 T-BOND 441115	3.0	2,850	2,829	322,445	2044/11/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
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 T-BOND 450515	3.0	2,950	2,926	333,392	2045/5/15
		3 T-BOND 451115	3.0	3,700	3,667	417,889	2045/11/15
		3 T-BOND 470215	3.0	4,200	4,168	474,958	2047/2/15
		3.125 T-BOND 411115	3.125	1,050	1,073	122,356	2041/11/15
		3.125 T-BOND 420215	3.125	1,400	1,430	162,980	2042/2/15
		3.125 T-BOND 430215	3.125	1,800	1,831	208,729	2043/2/15
		3.125 T-BOND 440815	3.125	3,000	3,052	347,748	2044/8/15
		3.125 T-NOTE 190515	3.125	2,700	2,795	318,489	2019/5/15
		3.125 T-NOTE 210515	3.125	2,400	2,524	287,630	2021/5/15
		3.375 T-BOND 440515	3.375	3,100	3,301	376,117	2044/5/15
		3.375 T-NOTE 191115	3.375	3,000	3,141	357,936	2019/11/15
		3.5 T-BOND 390215	3.5	1,000	1,097	125,049	2039/2/15
		3.5 T-NOTE 200515	3.5	2,300	2,432	277,130	2020/5/15
		3.625 T-BOND 430815	3.625	2,350	2,609	297,275	2043/8/15
		3.625 T-BOND 440215	3.625	3,050	3,390	386,341	2044/2/15
		3.625 T-NOTE 190815	3.625	2,200	2,307	262,956	2019/8/15
		3.625 T-NOTE 200215	3.625	2,900	3,066	349,438	2020/2/15
		3.625 T-NOTE 210215	3.625	3,300	3,529	402,175	2021/2/15
		3.75 T-BOND 410815	3.75	1,100	1,247	142,107	2041/8/15
		3.75 T-BOND 431115	3.75	3,050	3,460	394,323	2043/11/15
		3.75 T-NOTE 181115	3.75	2,700	2,798	318,898	2018/11/15
		3.875 T-BOND 400815	3.875	1,200	1,385	157,846	2040/8/15
		3.875 T-NOTE 180515	3.875	500	513	58,494	2018/5/15
		4 T-NOTE 180815	4.0	900	930	106,042	2018/8/15
		4.25 T-BOND 390515	4.25	500	609	69,396	2039/5/15
		4.25 T-BOND 401115	4.25	1,250	1,524	173,680	2040/11/15
		4.375 T-BOND 380215	4.375	400	497	56,713	2038/2/15
		4.375 T-BOND 391115	4.375	550	681	77,609	2039/11/15
		4.375 T-BOND 400515	4.375	1,500	1,859	211,834	2040/5/15
		4.375 T-BOND 410515	4.375	1,100	1,367	155,805	2041/5/15
		4.5 T-BOND 360215	4.5	1,100	1,387	158,087	2036/2/15
		4.5 T-BOND 380515	4.5	1,950	2,466	281,044	2038/5/15
		4.5 T-BOND 390815	4.5	550	692	78,931	2039/8/15
		4.625 T-BOND 400215	4.625	1,500	1,922	219,098	2040/2/15
		4.75 T-BOND 410215	4.75	1,400	1,832	208,741	2041/2/15
		5 T-BOND 370515	5.0	400	536	61,153	2037/5/15
		5.25 T-BOND 281115	5.25	650	828	94,410	2028/11/15
		5.25 T-BOND 290215	5.25	400	511	58,290	2029/2/15
		5.375 T-BOND 310215	5.375	900	1,197	136,406	2031/2/15
		5.5 T-BOND 280815	5.5	600	777	88,590	2028/8/15
		6 T-BOND 260215	6.0	500	645	73,513	2026/2/15
		6.125 T-BOND 271115	6.125	600	805	91,757	2027/11/15
		6.25 T-BOND 230815	6.25	3,500	4,355	496,213	2023/8/15
		6.25 T-BOND 300515	6.25	650	918	104,602	2030/5/15
		6.5 T-BOND 261115	6.5	500	675	76,927	2026/11/15
		8 T-BOND 211115	8.0	800	1,011	115,236	2021/11/15
		8.125 T-BOND 190815	8.125	600	689	78,541	2019/8/15

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	8.75 T-BOND 200815	8.75	700	857	97,753	2020/8/15
		8.875 T-BOND 190215	8.875	1,000	1,132	129,077	2019/2/15
小計						58,095,390	
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	900	896	74,540	2018/5/1
		0.5 CAN GOVT 180801	0.5	800	798	66,378	2018/8/1
		0.5 CAN GOVT 181101	0.5	1,200	1,197	99,511	2018/11/1
		0.5 CAN GOVT 190201	0.5	400	398	33,151	2019/2/1
		0.5 CAN GOVT 220301	0.5	1,200	1,170	97,272	2022/3/1
		0.75 CAN GOVT 190501	0.75	800	800	66,560	2019/5/1
		0.75 CAN GOVT 200901	0.75	1,600	1,594	132,557	2020/9/1
		0.75 CAN GOVT 210301	0.75	1,300	1,291	107,378	2021/3/1
		0.75 CAN GOVT 210901	0.75	1,000	990	82,333	2021/9/1
		1 CAN GOVT 220901	1.0	250	248	20,661	2022/9/1
		1 CAN GOVT 270601	1.0	500	472	39,247	2027/6/1
		1.25 CAN GOVT 180901	1.25	1,200	1,209	100,513	2018/9/1
		1.5 CAN GOVT 200301	1.5	1,000	1,019	84,778	2020/3/1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	1,000	1,017	84,614	2023/6/1
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	1,000	1,000	83,170	2026/6/1
		1.75 CAN GOVT 190301	1.75	900	917	76,243	2019/3/1
		1.75 CAN GOVT 190901	1.75	1,500	1,534	127,575	2019/9/1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,000	1,065	88,565	2025/6/1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,000	1,080	89,849	2024/6/1
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	950	1,028	85,474	2022/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	850	946	78,708	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	320	370	30,773	2064/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	800	872	72,568	2021/6/1
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	900	972	80,846	2020/6/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,200	1,508	125,361	2045/12/1
		3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,400	1,486	123,560	2019/6/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	1,100	1,455	121,034	2041/6/1
		4.25 CAN GOVT 180601	4.25	1,000	1,037	86,254	2018/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	950	1,384	115,110	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	950	1,355	112,683	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	900	1,357	112,856	2033/6/1
		8 CAN GOVT 270601	8.0	250	398	33,105	2027/6/1
小計						2,733,243	
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	19,400	22,577	136,596	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	4,700	5,888	35,623	2036/11/20
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	10,600	10,386	62,840	2018/6/14
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	20,900	19,911	120,462	2019/12/11
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	9,000	8,153	49,326	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	25,400	24,833	150,241	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	10,000	9,726	58,845	2022/6/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	7,500	7,628	46,149	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	9,800	10,078	60,976	2031/5/29

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	7,150	7,334	44,374	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	14,400	14,701	88,945	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	11,700	11,990	72,544	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	7,650	7,982	48,294	2023/12/7
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	1,300	1,364	8,252	2047/11/7
		8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	17,300	17,700	107,089	2018/12/13
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	6,600	7,218	43,672	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	6,800	7,481	45,264	2038/11/18
小計						1,179,500	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	1,900	1,839	227,785	2026/8/15
		0 OBL 200417	—	1,250	1,272	157,554	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	1,700	1,731	214,389	2021/4/9
		0 OBL 211008	—	1,000	1,017	125,991	2021/10/8
		0 OBL 220408	—	500	507	62,823	2022/4/8
		0 SCHATS 180615	—	700	705	87,326	2018/6/15
		0 SCHATS 180914	—	1,200	1,211	149,958	2018/9/14
		0 SCHATS 181214	—	600	606	75,084	2018/12/14
		0.25 BUND 270215	0.25	500	491	60,878	2027/2/15
		0.25 OBL 191011	0.25	1,700	1,736	215,016	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	1,450	1,489	184,374	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	1,800	1,854	229,557	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	2,800	2,860	354,078	2026/2/15
		0.5 OBL 190412	0.5	1,400	1,431	177,269	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	1,150	1,230	152,331	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	1,900	2,028	251,111	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	1,200	1,229	152,161	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,400	1,442	178,565	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	1,300	1,421	176,006	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,200	1,316	162,984	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,300	1,429	176,910	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,050	1,160	143,668	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,700	1,878	232,509	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,150	1,289	159,634	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,400	1,555	192,577	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	1,800	2,038	252,336	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	1,000	1,093	135,418	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,100	1,228	152,065	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,600	1,777	220,023	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,550	2,018	249,920	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,500	1,970	243,949	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,400	1,559	193,018	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	1,300	1,435	177,727	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	2,350	2,714	336,015	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	1,100	1,610	199,430	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	1,800	1,962	242,899	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	1,900	2,039	252,541	2019/1/4

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	4 BUND 370104	4.0	1,700	2,631	325,790	2037/1/4
		4.25 BUND 180704	4.25	1,800	1,902	235,583	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	1,020	1,673	207,193	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	800	1,167	144,532	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,450	2,358	291,953	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,200	2,114	261,821	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,200	1,957	242,396	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,100	1,689	209,130	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	600	851	105,354	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	750	1,267	156,900	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	800	1,283	158,944	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.05 ITALY GOVT 191015	0.05	1,300	1,295	160,396	2019/10/15
		0.1 ITALY GOVT 190415	0.1	900	902	111,676	2019/4/15
		0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	200	201	24,892	2018/5/15
		0.3 ITALY GOVT 181015	0.3	700	704	87,234	2018/10/15
		0.35 ITALY GOVT 200615	0.35	800	799	98,921	2020/6/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	400	393	48,680	2021/11/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	1,100	1,094	135,467	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	900	907	112,401	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	500	476	58,966	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	1,000	1,011	125,243	2020/5/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,300	1,279	158,396	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	900	919	113,804	2019/12/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	1,300	1,203	148,963	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,150	1,171	144,978	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	900	917	113,532	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,050	1,082	133,987	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,350	1,310	162,281	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	1,400	1,344	166,451	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,900	1,686	208,816	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	150	151	18,774	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,300	1,298	160,811	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	700	742	91,911	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	900	893	110,621	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	900	812	100,610	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	400	382	47,376	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,300	1,362	168,713	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,400	1,467	181,647	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	1,100	967	119,807	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	400	330	40,950	2067/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,000	987	122,311	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	1,300	1,351	167,350	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,400	1,477	182,930	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,300	1,430	177,084	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	2,000	2,245	277,948	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,900	2,136	264,493	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,600	2,933	363,151	2021/8/1

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,700	1,930	238,999	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,400	1,565	193,758	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,000	2,296	284,356	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	2,300	2,468	305,566	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	2,100	2,298	284,555	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,650	1,833	227,025	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	2,100	2,220	274,877	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	2,000	2,161	267,624	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	1,700	1,894	234,590	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,600	1,891	234,118	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,550	1,836	227,379	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,500	1,793	221,980	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	3,000	3,511	434,762	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	2,600	3,127	387,124	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	1,400	1,714	212,289	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,100	1,367	169,304	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,500	1,784	220,881	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,750	2,148	265,964	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,000	2,566	317,726	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,700	2,189	271,025	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,600	2,042	252,806	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	1,900	2,449	303,203	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,400	1,718	212,708	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	1,300	1,598	197,899	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,150	1,582	195,943	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,250	3,127	387,197	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,200	3,053	378,016	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	950	1,366	169,138	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,000	1,462	181,023	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O.A.T 190225	—	700	706	87,491	2019/2/25
		0 O.A.T 200225	—	1,700	1,721	213,153	2020/2/25
		0 O.A.T 200525	—	2,250	2,279	282,158	2020/5/25
		0 O.A.T 210525	—	1,600	1,615	199,994	2021/5/25
		0 O.A.T 220525	—	1,500	1,502	186,001	2022/5/25
		0.25 O.A.T 201125	0.25	1,400	1,429	176,985	2020/11/25
		0.25 O.A.T 261125	0.25	1,450	1,375	170,251	2026/11/25
		0.5 O.A.T 191125	0.5	2,100	2,152	266,532	2019/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	2,800	2,792	345,706	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	2,100	2,059	254,905	2026/5/25
		1 O.A.T 180525	1.0	1,700	1,727	213,871	2018/5/25
		1 O.A.T 181125	1.0	1,700	1,740	215,421	2018/11/25
		1 O.A.T 190525	1.0	1,700	1,752	216,998	2019/5/25
		1 O.A.T 251125	1.0	1,900	1,959	242,584	2025/11/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	1,350	1,278	158,335	2036/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	2,050	2,115	261,946	2031/5/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	2,600	2,852	353,178	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	2,650	2,912	360,550	2024/11/25

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	1.75 O.A.T 390625	1.75	900	911	112,861	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	550	490	60,717	2066/5/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	2,050	2,299	284,623	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	1,800	2,042	252,916	2024/5/25
		2.5 O.A.T 201025	2.5	2,500	2,749	340,331	2020/10/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	3,000	3,487	431,711	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	2,400	2,839	351,515	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	3,100	3,574	442,522	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	2,800	3,229	399,800	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	1,650	2,143	265,363	2045/5/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	2,700	3,015	373,365	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	2,850	3,552	439,856	2026/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	2,600	2,873	355,730	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	3,100	3,596	445,246	2021/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	1,950	2,797	346,362	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,040	1,585	196,309	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	920	1,426	176,634	2060/4/25
		4.25 O.A.T 181025	4.25	1,900	2,032	251,657	2018/10/25
		4.25 O.A.T 190425	4.25	2,250	2,461	304,716	2019/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	3,250	4,098	507,362	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	2,150	3,327	411,882	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	2,050	3,125	386,953	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	2,250	3,390	419,693	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	2,150	3,498	433,133	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	1,900	2,759	341,656	2025/10/25
		8.5 O.A.T 191025	8.5	900	1,099	136,168	2019/10/25
		8.5 O.A.T 230425	8.5	700	1,050	129,998	2023/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	300	303	37,567	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	900	919	113,865	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	900	894	110,760	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,300	1,302	161,298	2026/7/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	250	252	31,290	2027/7/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	1,200	1,238	153,297	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,100	1,220	151,074	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,100	1,245	154,178	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,000	1,127	139,585	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,000	1,236	153,034	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	850	1,159	143,506	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	2,300	2,650	328,116	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	700	789	97,749	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	400	488	60,440	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,150	1,789	221,581	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	1,000	1,054	130,579	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	1,100	1,210	149,853	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,100	1,689	209,171	2037/1/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,100	1,658	205,333	2028/1/15
		7.5 NETH GOVT 230115	7.5	700	1,004	124,296	2023/1/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	1,000	1,005	124,498	2018/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25	500	504	62,440	2019/1/31
		0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	150	149	18,554	2022/4/30
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	1,900	1,946	241,027	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	1,000	1,040	128,758	2020/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	1,300	1,274	157,813	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	1,600	1,669	206,641	2020/1/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	1,050	1,036	128,320	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,600	1,641	203,264	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,450	1,509	186,828	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	1,500	1,477	182,888	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	1,600	1,696	210,064	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	100	99	12,337	2033/7/30
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,600	1,695	209,872	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,250	2,507	310,416	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	800	787	97,512	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	300	308	38,137	2066/7/30
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	2,200	2,333	288,899	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,200	1,427	176,682	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	1,600	1,794	222,197	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	1,600	1,685	208,635	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,550	1,934	239,520	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	1,700	1,887	233,728	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,500	1,839	227,740	2023/10/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,500	1,660	205,543	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,650	2,075	256,941	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,100	1,471	182,117	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,200	1,505	186,340	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,550	1,812	224,354	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,150	1,568	194,233	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	950	1,275	157,877	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	850	1,202	148,929	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	2,200	2,793	345,808	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	1,700	2,065	255,761	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,450	2,112	261,544	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,700	2,140	264,979	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,000	1,378	170,617	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,800	2,582	319,670	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.2 BEL GOVT 231022	0.2	200	200	24,820	2023/10/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,900	1,944	240,725	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	600	597	73,950	2027/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	900	926	114,642	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	800	777	96,261	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	700	714	88,419	2018/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	450	420	52,087	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	100	105	13,119	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	200	197	24,451	2066/6/22

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,150	1,304	161,494	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	200	207	25,655	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,100	1,278	158,291	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	1,000	1,084	134,246	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	450	564	69,858	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,450	1,654	204,886	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	700	1,002	124,052	2045/6/22
		4 BEL GOVT 190328	4.0	900	977	121,001	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,100	1,325	164,137	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	550	759	94,064	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,150	1,378	170,597	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,100	1,356	167,930	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,550	2,350	290,970	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	600	806	99,805	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,450	2,297	284,454	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,400	2,085	258,227	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	—	100	99	12,329	2023/7/15
		0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	500	509	63,071	2019/10/18
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	1,200	1,220	151,037	2026/10/20
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	500	512	63,439	2018/10/19
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	1,000	1,066	132,038	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	250	246	30,558	2047/2/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	500	551	68,293	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	850	942	116,694	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	500	526	65,147	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	600	722	89,492	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	450	620	76,783	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	750	894	110,753	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,350	1,572	194,700	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	600	713	88,318	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	250	415	51,447	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	1,000	1,138	140,910	2020/7/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	850	1,288	159,545	2037/3/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	800	872	108,002	2019/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	650	902	111,725	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	600	941	116,577	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 220415	—	150	151	18,706	2022/4/15
		0 FINNISH GOVT 230915	—	500	496	61,503	2023/9/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	400	410	50,802	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	400	400	49,566	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	300	293	36,305	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	100	103	12,868	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	200	204	25,352	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	400	435	53,900	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	400	436	54,045	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	300	337	41,809	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	350	454	56,294	2042/7/4

銘柄				当期末				
				利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	フィンランド	国債証券	2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	350	427	52,926	2028/7/4
			3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	500	556	68,890	2020/4/15
			3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	400	460	56,990	2021/4/15
			4 FINNISH GOVT 250704	4.0	550	713	88,312	2025/7/4
			4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	550	608	75,317	2019/7/4
	アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	400	416	51,544	2022/3/15
			1 IRISH GOVT 260515	1.0	650	656	81,233	2026/5/15
			1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	300	294	36,492	2037/5/15
			2 IRISH GOVT 450218	2.0	500	496	61,465	2045/2/18
			2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	650	729	90,348	2030/5/15
			3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	500	600	74,320	2024/3/18
			3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	400	486	60,269	2023/3/20
			4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	500	551	68,293	2019/6/18
			4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	650	696	86,207	2018/10/18
			4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	1,000	1,142	141,463	2020/4/18
			5 IRISH GOVT 201018	5.0	600	709	87,881	2020/10/18
			5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	900	1,225	151,726	2025/3/13
			5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	500	577	71,496	2019/10/18
小計							51,807,531	
イギリス					千イギリスポンド	千イギリスポンド		
		国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	900	897	131,678	2022/7/22
			1.25 GILT 180722	1.25	2,100	2,128	312,441	2018/7/22
			1.25 GILT 270722	1.25	450	450	66,109	2027/7/22
			1.5 GILT 210122	1.5	1,850	1,931	283,504	2021/1/22
			1.5 GILT 260722	1.5	1,700	1,758	258,154	2026/7/22
			1.5 GILT 470722	1.5	400	372	54,702	2047/7/22
			1.75 GILT 190722	1.75	2,100	2,175	319,232	2019/7/22
			1.75 GILT 220907	1.75	2,000	2,128	312,337	2022/9/7
			1.75 GILT 370907	1.75	300	296	43,560	2037/9/7
			1.75 GILT 570722	1.75	1,100	1,125	165,131	2057/7/22
			2 GILT 200722	2.0	1,800	1,902	279,179	2020/7/22
			2 GILT 250907	2.0	1,600	1,734	254,528	2025/9/7
			2.25 GILT 230907	2.25	1,800	1,975	289,957	2023/9/7
			2.5 GILT 650722	2.5	810	1,038	152,462	2065/7/22
			2.75 GILT 240907	2.75	1,500	1,706	250,434	2024/9/7
			3.25 GILT 440122	3.25	1,950	2,520	370,002	2044/1/22
			3.5 GILT 450122	3.5	1,600	2,172	318,891	2045/1/22
			3.5 GILT 680722	3.5	1,370	2,247	329,848	2068/7/22
			3.75 GILT 190907	3.75	1,300	1,409	206,931	2019/9/7
			3.75 GILT 200907	3.75	1,200	1,342	196,966	2020/9/7
			3.75 GILT 210907	3.75	1,600	1,835	269,382	2021/9/7
			3.75 GILT 520722	3.75	1,370	2,100	308,241	2052/7/22
			4 GILT 220307	4.0	1,050	1,230	180,632	2022/3/7
			4 GILT 600122	4.0	800	1,374	201,686	2060/1/22
			4.25 GILT 271207	4.25	850	1,110	162,934	2027/12/7
			4.25 GILT 320607	4.25	1,200	1,633	239,759	2032/6/7
			4.25 GILT 360307	4.25	1,635	2,297	337,254	2036/3/7

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
イギリス			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券	4.25 GILT 390907	4.25	1,120	1,620	237,805	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	1,250	1,831	268,735	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	1,250	1,942	285,045	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	1,030	1,659	243,632	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	1,250	2,158	316,752	2055/12/7
		4.5 GILT 190307	4.5	1,300	1,404	206,097	2019/3/7
		4.5 GILT 340907	4.5	1,500	2,138	313,833	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	1,150	1,778	260,984	2042/12/7
		4.75 GILT 200307	4.75	1,200	1,355	199,017	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75	1,050	1,481	217,390	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	1,220	1,868	274,304	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	850	1,116	163,889	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	750	1,135	166,687	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	800	1,050	154,200	2021/6/7
小計						9,604,323	
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	340	376	42,541	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	310	339	38,385	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	400	431	48,731	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	280	352	39,904	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	430	619	70,004	2028/4/8
小計						239,568	
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	1 SWD GOVT 261112	1.0	4,700	4,865	62,419	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	6,600	7,146	91,685	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	4,700	5,467	70,148	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	6,850	8,077	103,628	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,250	4,388	56,310	2039/3/30
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	7,200	7,848	100,702	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	6,800	8,092	103,822	2020/12/1
小計						588,717	
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	2,600	2,592	34,349	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	3,050	3,116	41,289	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	1,550	1,565	20,748	2027/2/17
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	4,200	4,385	58,101	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	3,250	3,598	47,681	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	5,900	6,550	86,791	2021/5/25
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	5,700	6,142	81,386	2019/5/22
小計						370,348	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	0.25 DMK GOVT 181115	0.25	3,200	3,239	53,901	2018/11/15
		0.5 DMK GOVT 271115	0.5	1,550	1,520	25,308	2027/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	3,600	3,927	65,359	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	7,100	7,917	131,754	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	6,800	7,788	129,607	2021/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	6,950	7,716	128,409	2019/11/15

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
デンマーク			%	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	千円	
	国債証券	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	9,400	15,613	259,809	2039/11/15
小計						794,151	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	1,900	1,860	54,517	2020/4/25
		1.75 POLAND 210725	1.75	2,700	2,609	76,443	2021/7/25
		2 POLAND 210425	2.0	2,000	1,958	57,381	2021/4/25
		2.25 POLAND 220425	2.25	850	829	24,302	2022/4/25
		2.5 POLAND 180725	2.5	1,600	1,617	47,386	2018/7/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	2,900	2,731	80,037	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	2.5	1,400	1,298	38,031	2027/7/25
		3.25 POLAND 190725	3.25	2,000	2,052	60,147	2019/7/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	1,900	1,912	56,035	2025/7/25
		4 POLAND 231025	4.0	2,250	2,384	69,870	2023/10/25
		5.25 POLAND 201025	5.25	1,300	1,422	41,678	2020/10/25
		5.5 POLAND 191025	5.5	1,300	1,404	41,157	2019/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	1,300	1,467	43,007	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	1,650	1,885	55,258	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	5.75	600	741	21,718	2029/4/25
		POLAND 181025	—	2,000	1,948	57,096	2018/10/25
		POLAND 190425	—	900	865	25,367	2019/4/25
小計						849,437	
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	1,450	1,440	121,146	2020/11/21
		2 AUST GOVT 211221	2.0	1,050	1,046	87,963	2021/12/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	950	904	76,039	2028/5/21
		2.75 AUST GOVT 191021	2.75	1,800	1,842	154,949	2019/10/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,950	1,991	167,447	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	1,450	1,454	122,295	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 281121	2.75	900	896	75,391	2028/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	550	514	43,251	2035/6/21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	600	533	44,858	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 181021	3.25	900	920	77,403	2018/10/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	2,100	2,209	185,807	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	1,450	1,512	127,216	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	300	292	24,619	2039/6/21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	700	746	62,738	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,300	2,602	218,815	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 200415	4.5	2,000	2,151	180,892	2020/4/15
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	800	944	79,464	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	2,000	2,364	198,813	2027/4/21
		5.25 AUST GOVT 190315	5.25	1,700	1,809	152,131	2019/3/15
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,750	2,062	173,461	2023/4/21
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	2,150	2,459	206,830	2021/5/15
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,800	2,115	177,870	2022/7/15
小計						2,759,409	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 211001	1.25	200	197	15,971	2021/10/1

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
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	1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	550	553	44,816	2019/10/1
		1.75 SINGAPORGOVT 220401	1.75	50	50	4,061	2022/4/1
		2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	150	152	12,340	2020/7/1
		2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	100	100	8,103	2026/6/1
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	600	614	49,711	2021/6/1
		2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	300	306	24,807	2025/6/1
		2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	500	512	41,481	2019/6/1
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	400	419	33,949	2023/7/1
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	340	354	28,706	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	190	198	16,053	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	100	105	8,568	2029/7/1
		2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	300	317	25,685	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	350	373	30,215	2024/9/1
		3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	350	374	30,266	2022/9/1
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	400	422	34,208	2020/9/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	230	258	20,944	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	500	556	45,050	2027/3/1
		4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	300	311	25,180	2018/9/1
小計						500,124	
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	3.418MALAYSIAGOVT 220815	3.418	900	884	23,192	2022/8/15
		3.48 MALAYSIAGOVT 230315	3.48	1,200	1,179	30,913	2023/3/15
		3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	700	698	18,327	2020/3/31
		3.502MALAYSIAGOVT 270531	3.502	300	281	7,369	2027/5/31
		3.58 MALAYSIAGOVT 180928	3.58	200	200	5,265	2018/9/28
		3.654 MALAYSIAGOV 191031	3.654	1,100	1,104	28,964	2019/10/31
		3.659 MALAYSIAGOV 201015	3.659	1,000	1,002	26,285	2020/10/15
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	600	569	14,939	2028/6/15
		3.759 MALAYSIAGOV 190315	3.759	600	605	15,863	2019/3/15
		3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	900	900	23,612	2022/9/30
		3.8 MALAYSIAGOVT 230817	3.8	200	199	5,224	2023/8/17
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	600	562	14,754	2033/4/15
		3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	700	706	18,517	2020/7/31
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	500	487	12,794	2027/3/15
		3.9 MALAYSIAGOVT 261130	3.9	500	497	13,047	2026/11/30
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	1,150	1,145	30,045	2025/9/15
		4.048 MALAYSIA 210930	4.048	900	913	23,951	2021/9/30
		4.127 MALAYSIA 320415	4.127	600	582	15,285	2032/4/15
		4.16 MALAYSIAGOVT 210715	4.16	1,050	1,070	28,067	2021/7/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,000	1,014	26,587	2024/7/15
		4.232MALAYSIAGOVT 310630	4.232	800	785	20,587	2031/6/30
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	350	338	8,863	2035/5/31
		4.378MALAYSIAGOVT 191129	4.378	1,750	1,787	46,874	2019/11/29
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	1,000	1,021	26,795	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	900	906	23,779	2030/4/15
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	500	497	13,049	2046/3/15
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	350	353	9,281	2043/9/30

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
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	5.248 MALAYSIA 280915	5.248	200	217	5,707	2028/9/15
		5.734MALAYSIAGOVT 190730	5.734	300	314	8,247	2019/7/30
小計						546,198	
南アフリカ				千南アフリカランド	千南アフリカランド		
	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	12,900	14,373	122,459	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	8,050	5,793	49,361	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	6,400	4,548	38,753	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	3,700	3,581	30,516	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	8,300	6,884	58,654	2031/2/28
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	4,600	4,565	38,896	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	5,000	4,908	41,822	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	3,000	3,023	25,758	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	6,500	5,938	50,594	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	5,300	4,850	41,325	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	6,900	6,251	53,264	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	5,900	5,359	45,659	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	10,000	9,064	77,226	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	2,700	2,555	21,776	2035/2/28
		9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	3,200	3,006	25,612	2040/1/31
小計						721,683	
合計						130,789,630	

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

○投資信託財産の構成

(2017年５月12日現在)

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
公社債	130,789,630	96.8
コール・ローン等、その他	4,269,249	3.2
投資信託財産総額	135,058,879	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（131,760,236千円）の投資信託財産総額（135,058,879千円）に対する比率は97.6%です。
(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

１アメリカドル＝113.94円	１カナダドル＝83.13円	１メキシコペソ＝6.05円	１ユーロ＝123.80円
１イギリスポンド＝146.77円	１スイスフラン＝113.06円	１スウェーデンクローネ＝12.83円	１ノルウェークローネ＝13.25円
１デンマーククローネ＝16.64円	１ポーランドズロチ＝29.30円	１オーストラリアドル＝84.09円	１シンガポールドル＝80.91円
１マレーシアリンギット＝26.22円	１南アフリカランド＝8.52円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年５月12日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	135,979,672,180
コール・ローン等	1,288,484,942
公社債(評価額)	130,789,630,361
未収入金	2,785,838,363
未収利息	1,028,010,670
前払費用	87,707,844
(B) 負債	3,549,613,893
未払金	1,441,196,550
未払解約金	2,108,413,364
未払利息	3,979
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	132,430,058,287
元本	66,568,708,547
次期繰越損益金	65,861,349,740
(D) 受益権総口数	66,568,708,547口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	19,894円

＜注記事項＞

①期首元本額　79,369,567,734円
　期中追加設定元本額　13,460,264,160円
　期中一部解約元本額　26,261,123,347円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.9894円です。

○損益の状況 (2016年５月13日～2017年５月12日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	3,481,304,903
受取利息	3,481,412,296
その他収益金	116,880
支払利息	△ 224,273
(B) 有価証券売買損益	△ 2,469,113,070
売買益	4,743,560,191
売買損	△ 7,212,673,261
(C) 保管費用等	△ 21,156,552
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	991,035,281
(E) 前期繰越損益金	76,786,082,214
(F) 追加信託差損益金	12,413,548,035
(G) 解約差損益金	△24,329,315,790
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	65,861,349,740
次期繰越損益金(Ｈ)	65,861,349,740

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

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

ファンド・マネジャー（海外債券）	821,265,780円
ｅＭＡＸＩＳ 先進国債券インデックス	11,507,288,833円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,382,417,182円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	235,783,018円
コアバランス	1,384,859円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	340,241円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	201,099円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	470,926円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 先進国債券インデックス	72,793,229円
海外債券セレクション（ラップ向け）	3,753,251円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	22,528,484円
三菱ＵＦＪ ＤＣ海外債券インデックスファンド	7,007,945,425円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	41,113,041円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	18,601,350円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	14,975,628円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	21,995,342円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	6,029,049円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	1,099,638円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,302,553,961円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,286,110,907円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	2,107,382,988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）	19,104,565,071円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	7,767,247,723円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ７５型（適格機関投資家限定）	2,012,259,532円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	462,962,970円

三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４５型（適格機関投資家限定）	223,771,422円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	72,586,651円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,746,567,790円
三菱ＵＦＪ グローバル型バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,048,392円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	160,215,991円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	204,350,336円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	4,601,010円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	3,103,338円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	9,684,414円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	11,193,604円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	4,769,489円
三菱ＵＦＪ 外国債券インデックスファンドＶＡ	87,143,429円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	59,945,011円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	108,282,119円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	98,999,047円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	171,593,156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）	2,114,453,069円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞外国債券インデックスファンド	2,002,966,302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）	208,380,073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）	550,346,235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）	386,384,049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）	132,254,093円
合計	66,568,708,547円

新興国債券インデックスマザーファンド

《第８期》決算日2018年１月26日

［計算期間：2017年１月27日～2018年１月26日］

「新興国債券インデックスマザーファンド」は、１月26日に第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	主として対象インデックス（ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース））に採用されている新興国の現地通貨建の公社債に投資を行い、信託財産の１口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
4期(2014年1月27日)	12,503	△ 2.1	28,701.99	△ 1.7	95.2	－	3,441
5期(2015年1月26日)	14,203	13.6	32,849.46	14.5	95.0	－	7,742
6期(2016年1月26日)	11,515	△18.9	26,826.64	△18.3	95.9	－	9,861
7期(2017年1月26日)	12,647	9.8	29,442.31	9.8	96.1	－	12,443
8期(2018年1月26日)	14,464	14.4	34,033.56	15.6	96.7	－	16,676

(注) ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイドとは、Ｊ.Ｐ.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はＪ.Ｐ.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）とは、Ｊ.Ｐ.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。
(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭ グローバル・ダイバーシファイド (円換算ベース)		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
(期　首)	円	%		%	%	%
2017年１月26日	12,647	－	29,442.31	－	96.1	－
１月末	12,720	0.6	29,693.26	0.9	94.9	－
２月末	12,907	2.1	30,171.93	2.5	95.3	－
３月末	13,142	3.9	30,919.90	5.0	95.1	－
４月末	13,126	3.8	30,676.64	4.2	95.8	－
５月末	13,303	5.2	31,119.95	5.7	94.9	－
６月末	13,540	7.1	31,744.16	7.8	96.4	－
７月末	13,619	7.7	31,848.89	8.2	95.7	－
８月末	13,835	9.4	32,368.41	9.9	96.7	－
９月末	14,037	11.0	32,822.58	11.5	96.6	－
10月末	13,746	8.7	32,215.86	9.4	95.9	－
11月末	13,806	9.2	32,395.22	10.0	96.9	－
12月末	14,163	12.0	33,242.23	12.9	94.8	－
(期　末)						
2018年１月26日	14,464	14.4	34,033.56	15.6	96.7	－

(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

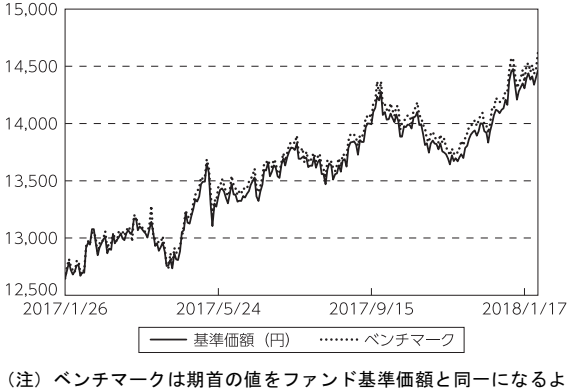
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.4%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(15.6%)を1.2%下回りました。

基準価額等の推移



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

●投資環境について

◎債券市況

・新興国の現地通貨建て債券市況は、利金が相応に積みあがったことなどから、期首に比べて上昇しました。

◎為替市況

・ブラジルレアルなど一部を除き、大半の新興国通貨が対円で買われました。
・特に、欧州経済の回復期待などを背景に中東欧通貨が対円で大きく上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

・新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは15.6%の上昇となったため、ベンチマークとのカイ離は△1.2%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	△0.4%程度	△0.2%程度	△0.6%程度	△1.2%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△0.4%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は△0.2%程度でした。

・カストディーフィー、取引コスト、税金等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は△0.6%程度でした。

・為替の効果および債券の効果による要因です。

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

○今後の運用方針

・今後の運用についても、運用方針を堅持します。
・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
・新興国の現地通貨建て国際機関債、および新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価額などが連動する債券に投資することがあります。

○１万口当たりの費用明細

（2017年１月27日～2018年１月26日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	15	0.115	(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）	(14)	(0.105)	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）	(1)	(0.010)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	15	0.115	
期中の平均基準価額は、13,495円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2017年１月27日～2018年１月26日）

公社債

			買付額	売付額
外国	アルゼンチン	国債証券	千アルゼンチンペソ 25,117	千アルゼンチンペソ －
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 105,299	千メキシコペソ 54,317
	ブラジル	国債証券	千ブラジルレアル 26,278	千ブラジルレアル 17,390
	チリ	国債証券	千チリペソ 2,073,536	千チリペソ －
	コロンビア	国債証券	千コロンビアペソ 6,992,910	千コロンビアペソ 3,093,697
	ペルー	国債証券	千ペルーヌエボソル 4,282	千ペルーヌエボソル －
	ウルグアイ	国債証券	千ウルグアイペソ 10,602	千ウルグアイペソ －
	トルコ	国債証券	千トルコリラ 15,957	千トルコリラ 10,162
	チェコ	国債証券	千チェココルナ 124,075	千チェココルナ 4,082
	ハンガリー	国債証券	千ハンガリーフォリント 393,714	千ハンガリーフォリント 353,976
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 11,370	千ポーランドズロチ 11,383
	ロシア	国債証券	千ロシアルーブル 267,920	千ロシアルーブル 52,230
	ルーマニア	国債証券	千ルーマニアレイ 6,338	千ルーマニアレイ 3,006
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 12,217	千マレーシアリンギット 22,158
	タイ	国債証券	千タイバーツ 123,306	千タイバーツ 39,671
	インドネシア	国債証券	千インドネシアルピア 41,182,480	千インドネシアルピア 8,640,515
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 43,585	千南アフリカランド 37,699

（注）金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）

○利害関係人との取引状況等

（2017年１月27日～2018年１月26日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 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	%
為替直物取引	5,152	1,435	27.9	2,832	524	18.5

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

○組入資産の明細

(2018年１月26日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債　種類別開示

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千アルゼンチンペソ	千アルゼンチンペソ	千円	%	%	%	%	%
アルゼンチン	22,500	24,348	136,353	0.8	0.8	0.4	0.4	－
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	262,900	268,302	1,582,982	9.5	－	5.9	2.7	0.8
	千ブラジルレアル	千ブラジルレアル						
ブラジル	51,170	47,821	1,666,588	10.0	10.0	1.8	6.6	1.6
	千チリペソ	千チリペソ						
チリ	2,000,000	2,096,040	384,204	2.3	－	－	2.3	－
	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ						
コロンビア	25,970,000	28,425,172	1,117,109	6.7	－	4.4	2.1	0.1
	千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル						
ペルー	10,850	12,559	429,424	2.6	－	2.4	0.2	－
	千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ						
ウルグアイ	10,000	10,070	38,974	0.2	－	0.1	0.1	－
	千トルコリラ	千トルコリラ						
トルコ	41,300	38,172	1,115,019	6.7	6.7	2.9	3.0	0.8
	千チェココルナ	千チェココルナ						
チェコ	102,000	112,470	603,966	3.6	－	2.0	1.5	0.2
	千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント						
ハンガリー	1,409,300	1,647,129	725,395	4.3	－	2.0	2.0	0.3
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	43,500	44,273	1,454,840	8.7	－	3.0	4.4	1.3
	千ロシアルーブル	千ロシアルーブル						
ロシア	619,800	634,092	1,249,162	7.5	－	4.6	2.0	1.0
	千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ						
ルーマニア	14,300	15,044	438,086	2.6	－	1.1	1.4	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	31,900	32,001	903,722	5.4	－	3.0	1.4	1.1
	千タイバーツ	千タイバーツ						
タイ	347,500	375,875	1,315,562	7.9	－	4.4	2.6	0.9
	千フィリピンペソ	千フィリピンペソ						
フィリピン	20,000	21,690	46,850	0.3	－	0.1	0.1	－
	千インドネシアルピア	千インドネシアルピア						
インドネシア	167,470,000	187,898,290	1,559,555	9.4	－	7.4	1.5	0.4
	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
南アフリカ	159,200	148,132	1,364,299	8.2	－	7.5	0.4	0.3
合計	－	－	16,132,097	96.7	17.5	53.1	34.7	8.9

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
アルゼンチン			%	千アルゼンチンペソ	千アルゼンチンペソ	千円	
	国債証券	15.5 REPUBLIC OF 261017	15.5	10,500	11,103	62,181	2026/10/17
		18.2 REPUBLIC OF 211003	18.2	12,000	13,245	74,172	2021/10/3
小計						136,353	
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	35,400	40,302	237,785	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	9,000	11,081	65,383	2036/11/20
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	23,700	22,715	134,022	2019/12/11
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	17,700	15,853	93,537	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	29,000	28,241	166,624	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	21,200	20,492	120,904	2022/6/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	16,800	16,776	98,980	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	16,200	16,381	96,652	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	10,800	10,907	64,356	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	21,100	21,200	125,081	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	28,500	28,883	170,411	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	8,500	8,739	51,562	2023/12/7
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	4,700	4,849	28,613	2047/11/7
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	9,300	9,961	58,770	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	11,000	11,914	70,296	2038/11/18
小計						1,582,982	
ブラジル				千ブラジルレアル	千ブラジルレアル		
	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	10.0	4,770	4,887	170,339	2027/1/1
		10 (IN)BRAZIL NTN 250101	10.0	3,550	3,658	127,515	2025/1/1
		10(IN)BRAZIL NTN-F210101	10.0	9,400	9,810	341,896	2021/1/1
		10(IN)BRAZIL NTN-F230101	10.0	6,850	7,104	247,580	2023/1/1
		BRAZIL-LTN 190701	—	3,700	3,351	116,783	2019/7/1
		BRAZIL-LTN 200101	—	5,100	4,401	153,388	2020/1/1
		BRAZIL-LTN 200701	—	17,500	14,384	501,300	2020/7/1
		BRAZIL-LTN 210701	—	300	223	7,782	2021/7/1
小計						1,666,588	
チリ				千チリペソ	千チリペソ		
	国債証券	5.5 CHILE (GL) 200805	5.5	2,000,000	2,096,040	384,204	2020/8/5
小計						384,204	
コロンビア				千コロンビアペソ	千コロンビアペソ		
	国債証券	10 TITULOS DE TES 240724	10.0	4,350,000	5,262,199	206,804	2024/7/24
		11 TITULOS DE TES 200724	11.0	3,620,000	4,120,446	161,933	2020/7/24
		4.375 COLOMBI(GL) 230321	4.375	1,680,000	1,598,184	62,808	2023/3/21
		6 TITULOS DE TESO 280428	6.0	1,850,000	1,775,561	69,779	2028/4/28
		7 TITULOS DE TESO 190911	7.0	550,000	569,302	22,373	2019/9/11
		7 TITULOS DE TESO 220504	7.0	3,610,000	3,815,892	149,964	2022/5/4
		7 TITULOS DE TESO 320630	7.0	1,600,000	1,630,089	64,062	2032/6/30
		7.5 TITULOS DE TE 260826	7.5	3,700,000	3,988,163	156,734	2026/8/26
		7.75 COLOMBI (GL) 210414	7.75	1,000,000	1,067,304	41,945	2021/4/14
		7.75 TITULOS DE T 300918	7.75	2,720,000	2,971,918	116,796	2030/9/18

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
コロンビア			%	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ	千円	
	国債証券	9.85 COLOMBI (GL) 270628	9.85	1,290,000	1,626,109	63,906	2027/6/28
小計						1,117,109	
ペルー				千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル		
	国債証券	5.7 PERU 240812	5.7	1,600	1,767	60,444	2024/8/12
		6.15 PERU 320812	6.15	1,900	2,118	72,431	2032/8/12
		6.35 PERU 280812	6.35	1,600	1,807	61,795	2028/8/12
		6.9 PERU 370812	6.9	1,400	1,630	55,763	2037/8/12
		6.95 PERU 310812	6.95	2,000	2,378	81,305	2031/8/12
		7.84 PERU 200812	7.84	750	842	28,818	2020/8/12
		8.2 PERU 260812	8.2	1,600	2,014	68,866	2026/8/12
小計						429,424	
ウルグアイ				千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ		
	国債証券	8.5 URUGUAY(GL) 280315	8.5	5,000	4,880	18,886	2028/3/15
		9.875 URUGUAY(GL) 220620	9.875	5,000	5,190	20,087	2022/6/20
小計						38,974	
トルコ				千トルコリラ	千トルコリラ		
	国債証券	10.4 TURKEY GOVT 190327	10.4	1,100	1,073	31,343	2019/3/27
		10.4 TURKEY GOVT 240320	10.4	1,000	952	27,807	2024/3/20
		10.5 TURKEY GOVT 200115	10.5	1,600	1,546	45,182	2020/1/15
		10.5 TURKEY GOVT 270811	10.5	2,000	1,882	54,998	2027/8/11
		10.6 TURKEY GOVT 260211	10.6	3,800	3,621	105,781	2026/2/11
		10.7 TURKEY GOVT 210217	10.7	3,200	3,078	89,920	2021/2/17
		10.7 TURKEY GOVT 220817	10.7	1,800	1,724	50,369	2022/8/17
		11 TURKEY GOVT 220302	11.0	2,400	2,320	67,790	2022/3/2
		11 TURKEY GOVT 270224	11.0	2,300	2,228	65,083	2027/2/24
		7.1 TURKEY GOVT 230308	7.1	3,100	2,563	74,885	2023/3/8
		7.4 TURKEY GOVT 200205	7.4	2,000	1,817	53,074	2020/2/5
		8 TURKEY GOVT 250312	8.0	2,300	1,915	55,963	2025/3/12
		8.5 TURKEY GOVT 190710	8.5	1,900	1,797	52,502	2019/7/10
		8.5 TURKEY GOVT 220914	8.5	1,600	1,423	41,571	2022/9/14
		8.8 TURKEY GOVT 230927	8.8	1,900	1,679	49,061	2023/9/27
		9 TURKEY GOVT 240724	9.0	2,000	1,784	52,110	2024/7/24
		9.2 TURKEY GOVT 210922	9.2	2,200	2,015	58,863	2021/9/22
		9.4 TURKEY GOVT 200708	9.4	2,800	2,616	76,430	2020/7/8
		9.5 TURKEY GOVT 220112	9.5	2,300	2,132	62,278	2022/1/12
小計						1,115,019	
チェコ				千チェココルナ	千チェココルナ		
	国債証券	0 CZECH REPUBLIC 200210	—	5,000	4,968	26,680	2020/2/10
		0.95 CZECH REPUBL 300515	0.95	3,200	2,791	14,992	2030/5/15
		1.5 CZECH REPUBLI 191029	1.5	5,000	5,119	27,489	2019/10/29
		2.4 CZECH REPUBLI 250917	2.4	17,300	18,296	98,250	2025/9/17
		2.5 CZECH REPUBLI 280825	2.5	17,700	18,669	100,252	2028/8/25
		3.75 CZECH REPUBL 200912	3.75	15,600	16,905	90,782	2020/9/12
		3.85 CZECH REPUBL 210929	3.85	11,800	13,093	70,310	2021/9/29
		4.7 CZECH REPUBLI 220912	4.7	9,400	10,969	58,906	2022/9/12

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	
チェコ			%	千チェココルナ	千チェココルナ	千円	
	国債証券	5.7 CZECH REPUBLI 240525	5.7	17,000	21,657	116,301	2024/5/25
小計						603,966	
ハンガリー				千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント		
	国債証券	1.75 HUNGARY 221026	1.75	35,000	36,070	15,885	2022/10/26
		2 HUNGARY 191030	2.0	50,000	51,739	22,786	2019/10/30
		2.5 HUNGARY 211027	2.5	40,000	42,350	18,651	2021/10/27
		3 HUNGARY 240626	3.0	134,000	146,290	64,426	2024/6/26
		3 HUNGARY 271027	3.0	99,000	106,501	46,903	2027/10/27
		3.5 HUNGARY 200624	3.5	194,000	208,779	91,946	2020/6/24
		5.5 HUNGARY 250624	5.5	190,000	238,438	105,008	2025/6/24
		6 HUNGARY 231124	6.0	216,000	272,721	120,106	2023/11/24
		6.5 HUNGARY 190624	6.5	71,800	78,286	34,477	2019/6/24
		7 HUNGARY 220624	7.0	211,500	265,597	116,969	2022/6/24
		7.5 HUNGARY 201112	7.5	168,000	200,353	88,235	2020/11/12
小計						725,395	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	3,500	3,483	114,467	2020/4/25
		1.75 POLAND 210725	1.75	4,900	4,826	158,582	2021/7/25
		2 POLAND 210425	2.0	2,700	2,689	88,367	2021/4/25
		2.25 POLAND 220425	2.25	3,000	2,974	97,751	2022/4/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	4,500	4,244	139,478	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	2.5	3,600	3,347	110,013	2027/7/25
		3.25 POLAND 190725	3.25	3,700	3,795	124,704	2019/7/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	3,400	3,428	112,668	2025/7/25
		4 POLAND 231025	4.0	4,200	4,457	146,465	2023/10/25
		5.25 POLAND 201025	5.25	2,800	3,047	100,147	2020/10/25
		5.5 POLAND 191025	5.5	2,700	2,882	94,724	2019/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	2,000	2,250	73,935	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	2,500	2,846	93,535	2022/9/23
小計						1,454,840	
ロシア				千ロシアルーブル	千ロシアルーブル		
	国債証券	6.4 RUSSIA OFZ 200527	6.4	35,600	35,343	69,627	2020/5/27
		6.7 RUSSIA GOVT B 190515	6.7	53,800	53,834	106,054	2019/5/15
		6.8 RUSSIA GOVT 191211	6.8	27,300	27,352	53,884	2019/12/11
		7 RUSSIA GOVT 230125	7.0	36,500	36,801	72,498	2023/1/25
		7 RUSSIA GOVT BON 230816	7.0	62,000	62,454	123,035	2023/8/16
		7.05 RUSSIA GOVT 280119	7.05	40,800	40,200	79,194	2028/1/19
		7.1 RUSSIA OFZ 241016	7.1	17,200	17,221	33,926	2024/10/16
		7.4 RUSSIA OFZ 221207	7.4	30,100	30,888	60,851	2022/12/7
		7.5 RUSSIA OFZ 210818	7.5	43,900	44,883	88,420	2021/8/18
		7.6 RUSSIA GOVT 210414	7.6	23,000	23,629	46,550	2021/4/14
		7.6 RUSSIA GOVT 220720	7.6	31,000	31,943	62,929	2022/7/20
		7.7 RUSSIA OFZ 330323	7.7	49,700	50,526	99,537	2033/3/23
		7.75 RUSSIA OFZ 260916	7.75	75,400	78,379	154,406	2026/9/16
		8.15 RUSSIA GOVT 270203	8.15	55,500	59,151	116,529	2027/2/3

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	
ロシア			%	千ロシアルーブル	千ロシアルーブル	千円	
	国債証券	8.5 RUSSIA OFZ 310917	8.5	38,000	41,480	81,717	2031/9/17
小計						1,249,162	
ルーマニア				千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ		
	国債証券	2.5 ROMANIA GOVER 190429	2.5	400	400	11,648	2019/4/29
		3.4 ROMANIA GOVER 220308	3.4	1,200	1,178	34,326	2022/3/8
		3.5 ROMANIA GOVER 221219	3.5	400	391	11,398	2022/12/19
		4.75 ROMANIA GOVE 250224	4.75	2,600	2,669	77,747	2025/2/24
		5.75 ROMANIA GOVE 200429	5.75	4,000	4,235	123,332	2020/4/29
		5.8 ROMANIA GOV 270726	5.8	600	663	19,331	2027/7/26
		5.85 ROMANIA GOVE 230426	5.85	2,900	3,141	91,477	2023/4/26
		5.95 ROMANIA 210611	5.95	2,200	2,363	68,823	2021/6/11
小計						438,086	
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	3.48 MALAYSIAGOVT 230315	3.48	2,200	2,166	61,176	2023/3/15
		3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	1,700	1,706	48,184	2020/3/31
		3.62 MALAYSIAGOVT 211130	3.62	2,400	2,412	68,129	2021/11/30
		3.654 MALAYSIAGOV 191031	3.654	1,800	1,812	51,186	2019/10/31
		3.659 MALAYSIAGOV 201015	3.659	2,000	2,016	56,938	2020/10/15
		3.759 MALAYSIAGOV 190315	3.759	800	804	22,730	2019/3/15
		3.8 MALAYSIAGOVT 230817	3.8	1,900	1,898	53,614	2023/8/17
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	600	599	16,921	2027/11/16
		3.9 MALAYSIAGOVT 261130	3.9	1,200	1,188	33,559	2026/11/30
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	3,500	3,499	98,812	2025/9/15
		4.059 MALAYSIAGOV 240930	4.059	1,800	1,814	51,241	2024/9/30
		4.16 MALAYSIAGOVT 210715	4.16	1,900	1,941	54,814	2021/7/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,600	1,622	45,825	2024/7/15
		4.232MALAYSIAGOVT 310630	4.232	3,200	3,122	88,167	2031/6/30
		4.378MALAYSIAGOVT 191129	4.378	3,600	3,665	103,522	2019/11/29
		4.39 MALAYSIA INV 230707	4.39	1,400	1,426	40,294	2023/7/7
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	300	304	8,601	2037/4/7
小計						903,722	
タイ				千タイバーツ	千タイバーツ		
	国債証券	1.875 THAILAND 220617	1.875	32,800	33,026	115,593	2022/6/17
		2 THAILAND 221217	2.0	7,500	7,580	26,532	2022/12/17
		2.125 THAILAND 261217	2.125	16,800	16,544	57,904	2026/12/17
		2.55 THAILAND 200626	2.55	29,900	30,670	107,345	2020/6/26
		3.4 THAILAND 360617	3.4	20,000	21,522	75,327	2036/6/17
		3.625 THAILAND 230616	3.625	42,400	46,238	161,834	2023/6/16
		3.65 THAILAND 211217	3.65	50,200	53,985	188,948	2021/12/17
		3.65 THAILAND 310620	3.65	24,600	27,331	95,661	2031/6/20
		3.85 THAILAND 251212	3.85	43,300	48,500	169,750	2025/12/12
		3.875 THAILAND 190613	3.875	41,800	43,248	151,369	2019/6/13
		4.875 THAILAND 290622	4.875	38,200	47,227	165,295	2029/6/22
小計						1,315,562	

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	
フィリピン			%	千フィリピンペソ	千フィリピンペソ	千円	
	国債証券	4.95 PHILIPPI(GL) 210115	4.95	10,000	10,337	22,329	2021/1/15
		6.25 PHILIPPI(GL) 360114	6.25	10,000	11,352	24,521	2036/1/14
小計						46,850	
インドネシア				千インドネシアルピア	千インドネシアルピア		
	国債証券	10.5 INDONESIA 300815	10.5	4,550,000	5,968,053	49,534	2030/8/15
		11 INDONESIA 201115	11.0	2,550,000	2,900,938	24,077	2020/11/15
		11 INDONESIA 250915	11.0	3,450,000	4,455,809	36,983	2025/9/15
		12.8 INDONESIA 210615	12.8	2,590,000	3,184,257	26,429	2021/6/15
		5.625 INDONESIA 230515	5.625	4,800,000	4,837,420	40,150	2023/5/15
		6.125 INDONESIA 280515	6.125	5,050,000	5,044,177	41,866	2028/5/15
		6.625 INDONESIA 330515	6.625	6,400,000	6,376,396	52,924	2033/5/15
		7 INDONESIA 220515	7.0	7,450,000	7,829,950	64,988	2022/5/15
		7 INDONESIA 270515	7.0	11,850,000	12,454,350	103,371	2027/5/15
		7.5 INDONESIA 320815	7.5	1,500,000	1,594,828	13,237	2032/8/15
		7.5 INDONESIA 380515	7.5	2,500,000	2,646,250	21,963	2038/5/15
		7.875 INDONESIA 190415	7.875	7,700,000	7,967,513	66,130	2019/4/15
		8.25 INDONESIA 210715	8.25	15,700,000	17,087,785	141,828	2021/7/15
		8.25 INDONESIA 320615	8.25	7,000,000	7,961,828	66,083	2032/6/15
		8.25 INDONESIA 360515	8.25	11,000,000	12,397,000	102,895	2036/5/15
		8.375 INDONESIA 240315	8.375	18,000,000	20,439,846	169,650	2024/3/15
		8.375 INDONESIA 260915	8.375	16,930,000	19,349,500	160,600	2026/9/15
		8.375 INDONESIA 340315	8.375	12,100,000	13,733,500	113,988	2034/3/15
		8.75 INDONESIA 310515	8.75	9,300,000	10,932,150	90,736	2031/5/15
		9 INDONESIA 290315	9.0	12,900,000	15,581,148	129,323	2029/3/15
		9.5 INDONESIA 310715	9.5	4,150,000	5,155,586	42,791	2031/7/15
小計						1,559,555	
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	23,800	26,867	247,452	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	11,300	8,296	76,408	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	14,300	10,342	95,254	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	6,500	6,395	58,904	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	12,600	10,737	98,889	2031/2/28
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	5,400	5,427	49,982	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	8,100	8,126	74,846	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	12,700	11,879	109,410	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	10,100	9,442	86,968	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	11,500	10,587	97,512	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	14,000	12,955	119,316	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	19,200	17,777	163,728	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	7,600	7,293	67,176	2035/2/28
		9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	2,100	2,003	18,448	2040/1/31
小計						1,364,299	
合計						16,132,097	

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

○投資信託財産の構成

（2018年１月26日現在）

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
公社債	16,132,097	96.4
コール・ローン等、その他	600,508	3.6
投資信託財産総額	16,732,605	100.0

（注）期末における外貨建純資産（16,632,531千円）の投資信託財産総額（16,732,605千円）に対する比率は99.4％です。

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

１アメリカドル＝109.78円	１アルゼンチンペソ＝5.60円	１メキシコペソ＝5.90円	１ブラジルレアル＝34.85円
100チリペソ＝18.33円	100コロンビアペソ＝3.93円	１ペルーヌエボソル＝34.19円	１ウルグアイペソ＝3.87円
１トルコリラ＝29.21円	１チェココルナ＝5.37円	100ハンガリーフォリント＝44.04円	１ポーランドズロチ＝32.86円
１ロシアルーブル＝1.97円	１ルーマニアレイ＝29.12円	１マレーシアリンギット＝28.24円	１タイバーツ＝3.50円
１フィリピンペソ＝2.16円	100インドネシアルピア＝0.83円	１南アフリカランド＝9.21円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年１月26日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	16,782,655,722
コール・ローン等	323,613,336
公社債(評価額)	16,132,097,835
未収入金	50,302,600
未収利息	252,361,008
前払費用	24,280,943
(B) 負債	105,706,347
前受収益	7,065
未払金	100,019,993
未払解約金	5,679,216
未払利息	73
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	16,676,949,375
元本	11,529,608,091
次期繰越損益金	5,147,341,284
(D) 受益権総口数	11,529,608,091口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	14,464円

＜注記事項＞

①期首元本額　9,838,910,954円
　期中追加設定元本額　2,812,429,380円
　期中一部解約元本額　1,121,732,243円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.4464円です。

○損益の状況 (2017年１月27日～2018年１月26日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	918,162,721
受取利息	918,321,798
その他収益金	107,997
支払利息	△ 267,074
(B) 有価証券売買損益	1,015,010,359
売買益	1,283,664,637
売買損	△ 268,654,278
(C) 保管費用等	△ 16,292,333
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	1,916,880,747
(E) 前期繰越損益金	2,604,625,102
(F) 追加信託差損益金	1,024,722,454
(G) 解約差損益金	△ 398,887,019
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	5,147,341,284
次期繰越損益金(Ｈ)	5,147,341,284

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

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

ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	2,260,258,462円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	343,440,703円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	315,746,527円
コアバランス	1,577,020円
海外債券セレクション（ラップ向け）	103,007,468円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	735,722,020円
つみたて８資産均等バランス	11,345,160円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	741,663円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	907,875円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	87,021円
ｅＭＡＸＩＳ 新興国債券インデックス	4,400,564,847円
三菱ＵＦＪ ＤＣ新興国債券インデックスファンド	3,108,565,930円
新興国債券インデックスファンド（ラップ向け）	10,285,636円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	15,280,816円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	89,046,984円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	81,765,595円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	15,032,159円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	12,059,784円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	16,055,007円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	8,117,414円
合計	11,529,608,091円

［お知らせ］

①当マザーファンドに投資する新設ベビーファンドの約款記載に合わせて、投資対象、運用目的、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的について該当する記載の整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
（2017年８月16日）

②当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
（変更前（旧）http://www.am.mufg.jp/　→　変更後（新）https://www.am.mufg.jp/）
（2018年１月１日）

東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド

《第９期》決算日2018年１月26日

［計算期間：2017年１月27日～2018年１月26日］

「東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド」は、１月26日に第９期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第９期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	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	不動産投信指数先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
9期(2018年1月26日)	26,965	△ 1.0	3,362.92	△ 1.1	98.4	1.9	21,644

(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	騰落率	東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）	騰落率	投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率
（期　首）	円	%		%	%	%
2017年１月26日	27,236	－	3,399.04	－	97.9	2.3
１月末	27,305	0.3	3,407.69	0.3	98.0	2.0
２月末	27,060	△0.6	3,376.46	△0.7	97.3	2.7
３月末	26,506	△2.7	3,307.66	△2.7	98.1	2.0
４月末	25,924	△4.8	3,234.60	△4.8	98.3	1.7
５月末	26,221	△3.7	3,271.22	△3.8	97.6	2.3
６月末	25,494	△6.4	3,180.48	△6.4	98.4	1.7
７月末	25,812	△5.2	3,220.02	△5.3	97.9	2.1
８月末	25,561	△6.1	3,188.63	△6.2	98.0	2.0
９月末	25,170	△7.6	3,139.87	△7.6	98.3	1.9
10月末	24,850	△8.8	3,099.44	△8.8	97.7	2.4
11月末	25,574	△6.1	3,189.89	△6.2	98.5	1.5
12月末	25,572	△6.1	3,189.59	△6.2	98.4	1.6
（期　末） 2018年１月26日	26,965	△1.0	3,362.92	△1.1	98.4	1.9

（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

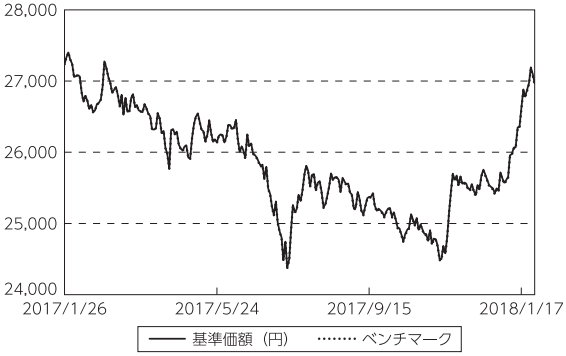
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.0%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（－1.1%）を0.1%上回りました。

基準価額等の推移



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

●投資環境について

◎国内ＲＥＩＴ市況

・期首から2017年11月上旬にかけては、地政学リスク等によって投資家心理が悪化したことや、毎月分配型投資信託の需給悪化等を受けて、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、海外のＲＥＩＴ市場と比べた出遅れ感が意識されたことや、世界的な株高による投資家心理の改善等を受けて、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1.1%の下落となったため、カイ離は0.1%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	0.1%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、2.1%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

○今後の運用方針

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2017年１月27日～2018年１月26日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	1	0.003	(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）	(0)	(0.001)	
（先物・オプション）	(1)	(0.002)	
合計	1	0.003	
期中の平均基準価額は、25,920円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2017年１月27日～2018年１月26日）

投資信託証券

銘柄		買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
		千口	千円	千口	千円
国内	日本アコモデーションファンド投資法人	0.273	128,303	0.057	27,613
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	0.485 (1)	74,817 (－)	0.066	12,386
	森ヒルズリート投資法人	0.803	111,039	0.358	52,230
	産業ファンド投資法人	0.28	140,015	0.043	21,558
	アドバンス・レジデンス投資法人	0.762	213,707	0.159	46,247
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	0.173	53,488	0.051	15,320
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.379	181,670	0.093	48,586
	ＧＬＰ投資法人	1	161,333	0.583	74,179
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.324 (0.009)	78,796 (2,272)	0.066	16,484
	日本プロロジスリート投資法人	1	266,333	0.395	94,889
	星野リゾート・リート投資法人	0.18 (0.02)	101,506 (10,712)	0.021	12,093
	Ｏｎｅリート投資法人	0.081 (0.126)	19,330 (－)	0.046	10,106
	イオンリート投資法人	1	153,020	0.54	66,633
	ヒューリックリート投資法人	0.582	97,069	0.216	39,529
	日本リート投資法人	0.22	70,267	0.045	13,550
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	0.456	50,000	0.105	10,953
	日本ヘルスケア投資法人	0.036	5,989	0.01	1,672
	積水ハウス・リート投資法人	0.57	77,696	0.133	18,937
	トーセイ・リート投資法人	0.15 (0.049)	16,232 (5,118)	0.023	2,450
	ケネディクス商業リート投資法人	0.439	105,774	0.053	13,250
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	0.101 (0.085)	10,634 (8,868)	0.024	2,418
	サムティ・レジデンシャル投資法人	0.129	11,587	0.057	4,796
	ジャパン・シニアリビング投資法人	0.041	6,320	0.011	1,538
	野村不動産マスターファンド投資法人	2	353,113	0.491	78,369
	いちごホテルリート投資法人	0.119	14,467	0.053	6,234
	ラサールロジポート投資法人	0.62	70,648	0.129	14,247
	スターアジア不動産投資法人	0.213	22,556	0.134	13,230
	マリモ地方創生リート投資法人	0.107	11,735	0.019	1,767
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.147	51,333	0.024	8,162
	大江戸温泉リート投資法人	0.163 (0.063)	14,330 (5,414)	0.022	1,953
	さくら総合リート投資法人	0.218	19,528	0.037	3,116
	投資法人みらい	0.361	63,459	0.022	3,636
	森トラスト・ホテルリート投資法人	0.608	90,828	0.03	4,480
	三菱地所物流リート投資法人	0.252	69,603	0.005	1,376
	日本ビルファンド投資法人	0.795	457,700	0.165	99,887
	ジャパンリアルエステイト投資法人	0.858	483,884	0.147	86,930
	日本リテールファンド投資法人	1	404,498	0.297	65,505
	オリックス不動産投資法人	1 (0.056)	315,703 (9,455)	0.297	51,730
	日本プライムリアルティ投資法人	0.519	200,355	0.108	45,133

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千円	千口	千円
国内	プレミア投資法人	0.742	82,958	0.154	18,623
	東急リアル・エステート投資法人	0.552	77,224	0.115	16,221
	グローバル・ワン不動産投資法人	0.183	72,745	0.023	9,172
	ユナイテッド・アーバン投資法人	1	331,681	0.34	58,012
	森トラスト総合リート投資法人	0.534	89,022	0.453	80,307
	インヴィンシブル投資法人	3	157,251	1	52,176
	フロンティア不動産投資法人	0.279	128,576	0.058	28,183
	平和不動産リート投資法人	0.466	43,742	0.208	18,155
	日本ロジスティクスファンド投資法人	0.658	144,055	0.098	22,628
	福岡リート投資法人	0.368	63,316	0.107	18,977
	ケネディクス・オフィス投資法人	0.265	170,930	0.046	30,222
	積水ハウス・レジデンシャル投資法人	0.624	72,015	0.13	15,402
	いちごオフィスリート投資法人	0.58	44,876	0.633	44,201
	大和証券オフィス投資法人	0.162	94,430	0.275	157,039
	阪急リート投資法人	0.337	45,951	0.07	10,232
	スターツプロシード投資法人	0.117	18,854	0.052	7,833
	大和ハウスリート投資法人	0.979	266,139	0.336	95,050
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	2	229,536	0.428	33,428
	日本賃貸住宅投資法人	0.925	76,031	0.192	15,775
	ジャパンエクセレント投資法人	0.737	98,632	0.154	21,015
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人（新）	0.004 (△0.009)	932 (△ 2,272)	—	—
	星野リゾート・リート投資法人（新）	0.02 (△ 0.02)	10,712 (△ 10,712)	—	—
	トーセイ・リート投資法人（新）	0.049 (△0.049)	5,118 (△ 5,118)	—	—
	ヘルスケア＆メディカル投資法人（新）	— (△0.085)	— (△ 8,868)	—	—
	スターアジア不動産投資法人（新）	0.015	1,600	—	—
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人（新）	0.023	8,454	—	—
	大江戸温泉リート投資法人（新）	0.063 (△0.063)	5,414 (△ 5,414)	—	—
	オリックス不動産投資法人（新）	0.056 (△0.056)	9,455 (△ 9,455)	—	—
合計		38 (2)	7,128,350 (—)	10	1,845,850

（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
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	不動産投信指数先物取引	4,061	4,023	—	—

○利害関係人との取引状況等

（2017年１月27日～2018年１月26日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	%
投資信託証券	7,128	1,303	18.3	1,845	176	9.5
不動産投信指数先物取引	4,061	4,061	100.0	4,023	4,023	100.0

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
	百万円
投資信託証券	353

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）	481千円
うち利害関係人への支払額（B）	400千円
（B）／（A）	83.1%

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ＭＵＦＧ証券です。

○組入資産の明細

（2018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	0.67	0.886	442,114	2.0
ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	0.368	2	215,380	1.0
森ヒルズリート投資法人	2	2	407,689	1.9
産業ファンド投資法人	0.487	0.724	367,068	1.7
アドバンス・レジデンス投資法人	1	2	705,640	3.3
ケネディクス・レジデンシャル投資法人	0.483	0.605	196,927	0.9
アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.92	1	584,307	2.7
ＧＬＰ投資法人	3	4	597,165	2.8
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.71	0.977	243,663	1.1
日本プロロジスリート投資法人	2	3	845,208	3.9
星野リゾート・リート投資法人	0.226	0.405	236,115	1.1
Ｏｎｅリート投資法人	0.131	0.292	75,102	0.3
イオンリート投資法人	1	2	313,714	1.4
ヒューリックリート投資法人	1	1	309,681	1.4
日本リート投資法人	0.542	0.717	241,987	1.1
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1	1	177,803	0.8
日本ヘルスケア投資法人	0.103	0.129	22,175	0.1
積水ハウス・リート投資法人	1	1	244,592	1.1
トーセイ・リート投資法人	0.253	0.429	48,005	0.2
ケネディクス商業リート投資法人	0.584	0.97	235,516	1.1
ヘルスケア＆メディカル投資法人	0.167	0.329	36,157	0.2
サムティ・レジデンシャル投資法人	0.391	0.463	43,846	0.2
ジャパン・シニアリビング投資法人	0.117	0.147	23,622	0.1
野村不動産マスターファンド投資法人	5	7	1,156,066	5.3
いちごホテルリート投資法人	0.356	0.422	54,817	0.3
ラサールロジポート投資法人	1	2	239,830	1.1
スターアジア不動産投資法人	0.477	0.556	63,828	0.3
マリモ地方創生リート投資法人	0.126	0.214	24,010	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.31	0.433	164,107	0.8
大江戸温泉リート投資法人	0.244	0.448	39,244	0.2
さくら総合リート投資法人	0.46	0.641	64,164	0.3
投資法人みらい	－	0.339	64,172	0.3
森トラスト・ホテルリート投資法人	－	0.578	86,700	0.4
三菱地所物流リート投資法人	－	0.247	68,666	0.3
日本ビルファンド投資法人	1	2	1,502,724	6.9
ジャパンリアルエステイト投資法人	1	2	1,416,802	6.5
日本リテールファンド投資法人	3	5	1,105,002	5.1
オリックス不動産投資法人	3	5	881,853	4.1
日本プライムリアルティ投資法人	1	1	647,498	3.0
プレミア投資法人	1	2	279,684	1.3
東急リアル・エステート投資法人	1	1	259,081	1.2
グローバル・ワン不動産投資法人	0.268	0.428	179,760	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人	4	5	1,001,704	4.6
森トラスト総合リート投資法人	1	1	313,537	1.4
インヴィンシブル投資法人	5	7	369,357	1.7
フロンティア不動産投資法人	0.686	0.907	417,220	1.9

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	%
平和不動産リート投資法人		1	1	168,093	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人		1	1	378,501	1.7
福岡リート投資法人		1	1	234,861	1.1
ケネディクス・オフィス投資法人		0.56	0.779	539,068	2.5
積水ハウス・レジデンシャル投資法人		1	2	246,481	1.1
いちごオフィスリート投資法人		2	2	170,775	0.8
大和証券オフィス投資法人		0.688	0.575	354,200	1.6
阪急リート投資法人		0.826	1	148,648	0.7
スターツプロシード投資法人		0.355	0.42	69,972	0.3
大和ハウスリート投資法人		2	2	740,610	3.4
ジャパン・ホテル・リート投資法人		5	7	629,614	2.9
日本賃貸住宅投資法人		2	3	258,600	1.2
ジャパンエクセレント投資法人		1	2	331,693	1.5
コンフォリア・レジデンシャル投資法人（新）		0.009	0.004	978	0.0
ヘルスケア＆メディカル投資法人（新）		0.085	－	－	－
スターアジア不動産投資法人（新）		－	0.015	1,661	0.0
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人（新）		－	0.023	8,590	0.0
合計	口数・金額	80	110	21,295,663	
	銘柄数＜比率＞	58	62	＜98.4%＞	

(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、Ｏｎｅリート投資法人、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、日本ヘルスケア投資法人、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、投資法人みらい、森トラスト・ホテルリート投資法人、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・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ＭＵＦＧ証券が当該ファンドの一般事務受託会社等となっています。(各ファンドで開示されている2017年７月31日時点の有価証券報告書または有価証券届出書等より記載)

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
			百万円	百万円
国内	不動産投信指数先物取引	東証ＲＥＩＴ指数	421	－

○投資信託財産の構成

（2018年１月26日現在）

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
投資証券	21,295,663	98.1
コール・ローン等、その他	412,196	1.9
投資信託財産総額	21,707,859	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年１月26日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	21,699,053,107
コール・ローン等	154,093,972
投資証券(評価額)	21,295,663,716
未収入金	107,463,434
未収配当金	144,460,985
差入委託証拠金	△ 2,629,000
(B) 負債	54,542,407
未払解約金	54,542,179
未払利息	228
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	21,644,510,700
元本	8,027,016,238
次期繰越損益金	13,617,494,462
(D) 受益権総口数	8,027,016,238口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	26,965円

＜注記事項＞

①期首元本額　6,235,686,088円
　期中追加設定元本額　3,062,294,486円
　期中一部解約元本額　1,270,964,336円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.6965円です。

○損益の状況 (2017年１月27日～2018年１月26日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	648,195,114
受取配当金	648,363,636
受取利息	2,967
その他収益金	6
支払利息	△ 171,495
(B) 有価証券売買損益	△ 610,435,154
売買益	381,492,384
売買損	△ 991,927,538
(C) 先物取引等取引損益	△ 7,840,244
取引益	35,597,180
取引損	△ 43,437,424
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	29,919,716
(E) 前期繰越損益金	10,747,519,236
(F) 追加信託差損益金	4,876,131,351
(G) 解約差損益金	△ 2,036,075,841
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	13,617,494,462
次期繰越損益金(Ｈ)	13,617,494,462

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

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

ｅＭＡＸＩＳ 国内リートインデックス	4,348,688,209円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,245,414,597円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	187,472,232円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド	931,021円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	131,191,192円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（ラップ向け）	1,403,584,585円
オルタナティブ資産セレクション（ラップ向け）	150,287,135円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	388,288,607円
つみたて８資産均等バランス	5,997,580円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	300,947円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	402,132円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	231,850円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	6,977,069円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	33,915,347円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	4,277,625円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	8,117,032円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	35,463,903円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	32,466,785円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	39,635,669円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	3,372,721円
合計	8,027,016,238円

［お知らせ］

①当マザーファンドに投資する新設ベビーファンドの約款記載に合わせて、投資対象、運用目的、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的について記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
（2017年８月16日）

②当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
（変更前（旧）http://www.am.mufg.jp/　→　変更後（新）https://www.am.mufg.jp/）
（2018年１月１日）

ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド

《第12期》決算日2018年１月５日

［計算期間：2017年１月６日～2018年１月５日］

「ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド」は、１月５日に第12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12期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として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に投資を行い、信託財産の１口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。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（除く日本、配当込み、円換算ベース）		投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
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
12期(2018年１月５日)	16,420	2.4	17,477.34	2.9	98.0	18,551

（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		ＳＡＰ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）		投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率	
（期　首） 2017年１月５日	円 16,039	% －	16,982.66	% －	% 98.8
１月末	15,292	△4.7	16,197.60	△4.6	98.3
２月末	15,848	△1.2	16,809.34	△1.0	99.2
３月末	15,389	△4.1	16,322.53	△3.9	98.5
４月末	15,629	△2.6	16,568.56	△2.4	99.2
５月末	15,400	△4.0	16,333.87	△3.8	98.2
６月末	15,865	△1.1	16,842.43	△0.8	99.0
７月末	15,839	△1.2	16,829.63	△0.9	98.8
８月末	15,734	△1.9	16,718.51	△1.6	99.0
９月末	16,120	0.5	17,124.06	0.8	98.9
10月末	16,064	0.2	17,066.57	0.5	98.6
11月末	16,351	1.9	17,386.28	2.4	98.5
12月末	16,704	4.1	17,781.94	4.7	97.9
（期　末） 2018年１月５日	16,420	2.4	17,477.34	2.9	98.0

（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2.4%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（2.9%）を0.5%下回りました。

基準価額等の推移

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

●投資環境について

◎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良好な経済指標などを受けて、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3.2%の円高・米ドル安、11.1%の円安・ユーロ高となりました。

●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2.9%の上昇となったため、カイ離は△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	△0.1%程度	△0.4%程度	△0.1%程度	0.1%程度	△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△0.1%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△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

（2017年１月６日～2018年１月５日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	2	0.013	(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）	(2)	(0.013)	
(b) 有価証券取引税	1	0.007	(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
（投資信託証券）	(1)	(0.007)	
(c) その他費用	7	0.043	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(6)	(0.038)	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）	(1)	(0.005)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	10	0.063	
期中の平均基準価額は、15,852円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2017年１月６日～2018年１月５日）

投資信託証券

銘柄		買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 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	0.893	8	4	40
	HCP INC	6	187	9	283
	MACERICH CO/THE	1	95	4	255
	ACADIA REALTY TRUST	1	32	1	39
	AGREE REALTY CORP	0.35	16	－	－
	ALEXANDER'S INC	0.069	29	0.05	20
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3	381	1	194
	PROLOGIS INC	7	426	11	652
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	1	67	2	97
	BRANDYWINE REALTY TRUST	2	33	4	72
	CAMDEN PROPERTY TRUST	1	156	1	146
	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	－	－	0.95	7
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	2	105	2	113
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	1	50	1	46
	COUSINS PROPERTIES INC	15	133	10	87
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	0.732	8	2	26
	DIGITAL REALTY TRUST INC	2 (6)	235 (518)	2	335
	EASTGROUP PROPERTIES INC	0.501	36	0.49	37
	EDUCATION REALTY TRUST INC	0.892	35	1	72
	EPR PROPERTIES	0.824	58	1	106
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1	121	1	106
	EQUITY ONE INC	－ (△ 13)	－ (△ 417)	0.68	21
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.796	194	1	317
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1	135	2	210
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	148	1	223
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	2	62	2	61
	FIRST POTOMAC REALTY TRUST	0.747	7	－ (8)	－ (96)
	GETTY REALTY CORP	0.8	21	－	－
	WELLTOWER INC	5	423	7	542
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	1	65	1	76
	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	1	57	4	119
	EQUITY COMMONWEALTH	0.26	8	1	47
	KILROY REALTY CORP	1	136	1	102
	KITE REALTY GROUP TRUST	－	－	0.67	12
	LEXINGTON REALTY TRUST	0.852	8	2	24
	LTC PROPERTIES INC	－	－	0.28	12
	MACK-CALI REALTY CORP	0.299	8	1	29
	BOSTON PROPERTIES INC	2	314	3	469

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
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	7	98	4	58
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1	122	2	211
	NATL HEALTH INVESTORS INC	0.106	8	0.15	10
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2	74	4	141
	PENN REAL ESTATE INVEST TST	－	－	0.76	9
	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	1	19	2	36
	REALTY INCOME CORP	6	356	4	278
	REGENCY CENTERS CORP	1 (6)	116 (417)	2	157
	SENIOR HOUSING PROP TRUST	3	60	4	81
	SL GREEN REALTY CORP	1	197	3	319
	LIFE STORAGE INC	0.449	36	0.83	61
	SUN COMMUNITIES INC	2	204	1	99
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	4	71	3	62
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1	32	1	50
	TAUBMAN CENTERS INC	0.136	8	0.77	46
	CUBESMART	2	56	3	74
	UDR INC	3	113	5	193
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.112	8	0.26	16
	VENTAS INC	5	369	8	533
	WASHINGTON REIT	0.252	8	0.44	13
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	0.914	28	1	47
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	－	－	0.41	7
	PS BUSINESS PARKS INC/CA	0.066	8	0.3	37
	UMH PROPERTIES INC	1	27	0.76	12
	MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	1	22	1	16
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	2	85	2	68
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	1	60	1	81
	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	－	－	1	10
	DOUGLAS EMMETT INC	3	151	2	113
	DUPONT FABROS TECHNOLOGY	1 (△ 11)	56 (△ 518)	0.98	55
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1	35	2	69
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	1	33	2	54
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	6	228	3	108
	CORESITE REALTY CORP	0.53	52	0.7	66
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	3	58	1	31
	GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	3	56	－	－
	RLJ LODGING TRUST	1 (6)	34 (150)	3	72
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	0.412	8	1	34
	STAG INDUSTRIAL INC	2	67	1	35
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	2 (12)	51 (290)	0.28	6
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	0.641	8	2	37
	HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	10	319	3	96

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
	WP CAREY INC	1	83	2	161
	WHITESTONE REIT	1	18	－	－
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	0.128	7	0.58	35
	CHATHAM LODGING TRUST	－	－	0.52	9
	TERRENO REALTY CORP	0.729	23	0.52	17
	SILVER BAY REALTY TRUST CORP	－	－	－ (5)	－ (96)
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	1	8	8	71
	CORECIVIC INC	1	41	2	83
	GEO GROUP INC/THE	1 (6)	55 (－)	1	44
	VEREIT INC	11	96	18	149
	DUKE REALTY CORP	3	94	6	181
	ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	2	26	1	18
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	0.75	22	0.34	8
	PHYSICIANS REALTY TRUST	6	134	2	42
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	6	143	3	71
	GRAMERCY PROPERTY TRUST	3	110	2	58
	CYRUSONE INC	3	180	1	65
	ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	2	22	0.88	9
	EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	1	36	2	46
	QTS REALTY TRUST INC-CL A	0.162	8	0.57	28
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	8	163	4	93
	STARWOOD WAYPOINT HOMES	11 (△ 17)	386 (△ 575)	0.64	21
	COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	1	32	3	72
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	－	－	1	12
	CARETRUST REIT INC	1	19	－	－
	NEW YORK REIT INC	－	－	24	243
	PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	1	19	1	17
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	1	65	3	113
	INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	5	49	3	31
	IRON MOUNTAIN INC	7	284	4	157
	STORE CAPITAL CORP	3	84	3	75
	URBAN EDGE PROPERTIES	2	58	1	45
	PARAMOUNT GROUP INC	28	452	－	－
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	1	36	－	－
	MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	－	－	24	295
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	－	－	0.58	10
	NORTHSTAR REALTY FINANCE	－ (△ 27)	－ (△ 443)	－	－
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	0.859	19	－	－
	CARE CAPITAL PROPERTIES INC	0.297 (△ 11)	8 (△ 290)	1	33
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	8	151	1	34
	BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	0.612	7	－	－

銘柄		買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 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
	GLOBAL NET LEASE INC	1 (△ 16)	32 (－)	－	－
	CITY OFFICE REIT INC	1	21	0.96	11
	NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	0.674	7	1	15
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	0.46	19	0.48	19
	FOREST CITY REALTY TRUST- A	7	188	2	54
	COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1	25	－	－
	FARMLAND PARTNERS INC	2	28	－	－
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	35 (－)	32 (△ 2)	－	－
	MANULIFE US REAL ESTATE INV-RTS	－ (36)	－ (－)	36	7
	TIER REIT INC	0.482	7	1	20
	WHEELER REAL ESTATE INVESTME	－ (△ 9)	－ (－)	－	－
	PARKWAY INC	－	－	0.53 (6)	10 (134)
	MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	2	32	－	－
	PARK HOTELS & RESORTS INC	25	692	3	84
	EQUITY RESIDENTIAL	4	306	7	500
	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	57 (29)	830 (443)	9	129
	INVITATION HOMES INC	11 (28)	257 (575)	0.68	14
	JBG SMITH PROPERTIES	0.961 (12)	31 (－)	－	－
	ALEXANDER & BALDWIN INC	6	281	－	－
	CLIPPER REALTY INC	2	32	－	－
	GLADSTONE LAND CORP	2	33	－	－
	GLOBAL MEDICAL REIT INC	3	32	－	－
	INFRAREIT INC	5	122	－	－
	FELCOR LODGING TRUST INC	－ (△ 18)	－ (△ 150)	－	－
	GGP INC	12	291	11	266
	HOST HOTELS & RESORTS INC	9	168	14	260
	LIBERTY PROPERTY TRUST	1	73	2	118
	LASALLE HOTEL PROPERTIES	0.981	27	1	38
	PUBLIC STORAGE	2	470	3	721
	SIMON PROPERTY GROUP INC	4	740	7	1,229
	VORNADO REALTY TRUST	2	201	3	314
	KIMCO REALTY CORP	5	110	8	181
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2	389	3	594
	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	1	76	2	105
	小計	519 (20)	15,696 (△ 2)	452 (20)	15,601 (327)

銘柄			買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
外国	カナダ		千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	－	－	0.3	13
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	0.5	15	1	35
		COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	－	－	0.9	12
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	－	－	3	61
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	1	25	3	66
		NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	－	－	0.5	11
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2	70	4	104
		ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	1	52	0.5	19
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	1	20	1	20
		BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO	－	－	－ (2)	－ (52)
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	1	21	1	16
		DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	4	45	－	－
		ONEREIT	6	24	9	36
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	0.6	27	1	47
		MILESTONE APARTMENTS REAL ES	－	－	－ (5)	－ (106)
		PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	2	16	－	－
		CHOICE PROPERTIES REIT	1	24	1	16
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1	23	2	42
		PLAZA RETAIL REIT	2	10	7	31
		SLATE OFFICE REIT	2	16	2	19
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	5	38	－	－
	小計		36	434	40 (7)	554 (159)
	ユーロ			千ユーロ		千ユーロ
		ドイツ				
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4 (－)	55 (△ 7)	2	34
		HAMBORNER REIT AG	1	17	1	14
	小計		6 (－)	73 (△ 7)	4	48
		イタリア				
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	－ (－)	－ (△0.86567)	8	6
		BENI STABILI SPA	11	6	－	－
	小計		11 (－)	6 (△0.86567)	8	6
		フランス				
		GECINA SA	1	205	0.872	116
		GECINA SA-RTS	－ (5)	－ (－)	5	14
		KLEPIERRE	2	90	4	151
		UNIBAIL-RODAMCO SE	1	344	2	536
		FONCIERE DES REGIONS	1 (－)	95 (△ 7)	1	103

銘柄				買付		売付	
				口数	金額	口数	金額
外国	ユーロ			千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	フランス						
		MERCIALYS		0.4	7	－	－
		ICADE		0.449	31	0.79	57
		ALTAREA		0.12 (－)	23 (△3)	－	－
	小計			7 (5)	798 (△11)	15	979
	オランダ						
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV		0.192	7	0.72	25
		NSI NV		4 (△17)	17 (－)	7	27
		VASTNED RETAIL NV		－	－	0.914	34
		WERELDHAVE NV		0.166	7	0.49	20
	小計			5 (△17)	31 (－)	9	108
	スペイン						
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		－ (－)	－ (△3)	1	9
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		8 (－)	98 (△7)	31	364
		AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA		1	21	0.8	12
		HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI		1	19	1	19
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		44	371	－	－
	小計			56 (－)	511 (△10)	35	406
	ベルギー						
		BEFIMMO		0.35	18	0.3	15
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES		－	－	0.35	8
		RETAIL ESTATES		0.25	19	0.37	28
		WAREHOUSES DE PAUW SCA		－	－	0.15	14
		WERELDHAVE BELGIUM NV		－	－	0.32	30
		AEDIFICA		0.7	48	0.18	13
		AEDIFICA-RTS		－ (2)	－ (－)	2	2
		XIOR STUDENT HOUSING NV		0.25	9	0.75	29
		XIOR STUDENT HOUSING NV-RTS		－ (0.5)	－ (－)	0.5	1
		MONTEA		－	－	0.98	43
		MONTEA-RTS		－ (0.98)	－ (－)	0.98	0.44135
		COFINIMMO		0.23	24	0.39	43
	小計			1 (3)	119 (－)	7	231
	アイルランド						
		GREEN REIT PLC		5	7	－	－

銘柄		買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
外国	ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	アイルランド				
	HIBERNIA REIT PLC	－	－	5	6
	小計	5	7	5	6
	ユーロ計	94 (△ 8)	1,548 (△ 31)	84	1,787
	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC	11	72	18	120
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	3 (△ 2)	19 (－)	3	24
	HAMMERSON PLC	13	77	15	92
	LAND SECURITIES GROUP PLC	9 (△ 6)	101 (△ 66)	16	175
	INTU PROPERTIES PLC	2	6	10	29
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	－	－	6	7
	SEGRO PLC	35	165	16	81
	SEGRO PLC -RTS	－ (23)	－ (－)	23	21
	WORKSPACE GROUP PLC	－	－	0.92	8
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	6	14	21	47
	SHAFTESBURY PLC	4	45	11	110
	DERWENT LONDON PLC	1	43	2	78
	MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	－	－	9	46
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	15	25	8	14
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	11	14	62	87
	RDI REIT PLC	－	－	16	6
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	－	－	2	8
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	40	59	17	25
	ASSURA PLC	121	75	24	15
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	25	15	40	23
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	18	20	－	－
	REGIONAL REIT LTD	11	12	－	－
	NEWRIVER REIT PLC	9	31	－	－
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	28	30	－	－
	UNITE GROUP PLC	35	226	2	13
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	21	21	21	20
	LXI REIT PLC	19	20	－	－
	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	10	10	－	－
	小計	452 (14)	1,109 (△ 66)	352	1,058
	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	43	121	79	221
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	1 (－)	10 (△ 2)	－ (8)	－ (51)
	ASPEN GROUP	－	－	11	11
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	3	10	－	－
	360 CAPITAL GROUP LTD	－	－	34	33

銘柄		買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
外国	オーストラリア	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
	ALE PROPERTY GROUP	－	－	25	117
	CHARTER HALL GROUP	10	60	2	15
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	－	－	4	13
	CROMWELL PROPERTY GROUP	－	－	12	12
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	4	10	－	－
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	14	45	3	12
	NATIONAL STORAGE REIT	8	11	－	－
	GDI PROPERTY GROUP	10	10	－	－
	INDUSTRIA REIT	－	－	11	24
	CENTURIA URBAN REIT	－	－	－ (7)	－ (16)
	SCENTRE GROUP	82	351	125	532
	ARENA REIT	5	10	8	16
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	8	24	14	43
	GENERATION HEALTHCARE REIT	－	－	23	52
	VIVA ENERGY REIT	－	－	6	15
	PROPERTYLINK GROUP	87	67	－	－
	CENTURIA METROPOLITAN REIT	－ (6)	－ (15)	6	16
	RURAL FUNDS GROUP	35	78	－	－
	GPT GROUP	24	127	42	215
	MIRVAC GROUP	43	98	77	174
	STOCKLAND	30	141	45	210
	WESTFIELD CORP	21	179	36	313
	DEXUS	18	175	21	204
	INVESTA OFFICE FUND	－	－	21	96
	CHARTER HALL RETAIL REIT	－	－	2	11
	GOODMAN GROUP	28	223	41	333
	小計	482 (6)	1,760 (12)	660 (16)	2,700 (68)
	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	5	11	－	－
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	34	48	35	50
	GOODMAN PROPERTY TRUST	－	－	15	18
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	－	－	62	100
	ARGOSY PROPERTY LTD	23	24	25	25
	STRIDE PROPERTY GROUP	－	－	7	12
	INVESTORE PROPERTY LTD	8	11	－	－
	小計	72	96	144	207
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	34	1,910	52	2,939
	CHAMPION REIT	－	－	42	232
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	12	56	－	－
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	－	－	115	264
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	－	－	24	122
	FORTUNE REIT	－	－	9	81

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
	SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	－	－	23	74
	小計	46	1,966	265	3,714
	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	15 (－)	26 (△ 3)	80	146
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	78	128	47	77
	CAPITACOMMERCIAL TRUST-RTS	－ (48)	－ (－)	48	13
	KEPPEL REIT	－ (－)	－ (△0.86352)	16	19
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	－ (－)	－ (△ 0.9667)	－	－
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	50 (－)	54 (△ 4)	18	22
	ASCOTT RESIDENCE TRUST-RTS	－ (36)	－ (－)	36	5
	ESR-REIT	－	－	22	12
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	41 (－)	63 (△0.50498)	42	61
	CDL HOSPITALITY TRUSTS-RTS	－ (19)	－ (－)	19	5
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	14	29	21	42
	STARHILL GLOBAL REIT	－ (－)	－ (△ 0.513)	－	－
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	106 (－)	128 (△ 1)	35	40
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	－ (－)	－ (△ 8)	26	41
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	－ (－)	－ (△ 2)	8	10
	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	－ (－)	－ (△0.35862)	－	－
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	26 (－)	10 (△ 3)	－	－
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	－ (－)	－ (△ 1)	4	11
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	－ (－)	－ (△0.19385)	7	12
	CACHE LOGISTICS TRUST	－ (－)	－ (△0.32131)	－	－
	CACHE LOGISTICS TRUST-RTS	－ (22)	－ (－)	22	4
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	28	42	18	29
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	－	－	32	20
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	54	25	31	14
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT-RTS	－	－	46	4

銘柄		買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 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
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	－ （　－）	－ （△　1）	－	－
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	46 （　－）	48 （△　3）	80	88
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	22	15	60	43
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	24 （　－）	17 （△ 0.5405）	100	69
	OUE HOSPITALITY TRUST	15	10	－	－
	KEPPEL DC REIT	－ （　－）	－ （△　0.27）	－	－
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	－ （　－）	－ （△　3）	13	13
	CAPITALAND MALL TRUST	29	59	41	82
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	32 （　－）	82 （△　3）	48	128
	小計	582 （　128）	743 （△　41）	927	1,024
	イスラエル		千イスラエルシェケル		千イスラエルシェケル
	REIT 1 LTD	－	－	3	43
	小計	－	－	3	43

（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。

○利害関係人との取引状況等

（2017年１月６日～2018年１月５日）

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	2,762	1,049	38.0	3,478	936	26.9

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

○組入資産の明細

（2018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	45	42	376	42,501	0.2
HCP INC	68	65	1,664	187,825	1.0
MACERICH CO/THE	17	15	971	109,619	0.6
ACADIA REALTY TRUST	11	11	315	35,558	0.2
AGREE REALTY CORP	3	4	207	23,425	0.1
ALEXANDER'S INC	0.5	0.519	203	23,008	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11	13	1,695	191,366	1.0
PROLOGIS INC	78	74	4,661	526,018	2.8
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	19	18	749	84,602	0.5
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12	12	78	8,844	0.0
BRANDYWINE REALTY TRUST	26	24	429	48,432	0.3
CAMDEN PROPERTY TRUST	12	12	1,146	129,370	0.7
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	25	24	137	15,553	0.1
CEDAR REALTY TRUST INC	10	10	64	7,266	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	21	21	885	99,892	0.5
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	14	14	399	45,085	0.2
COUSINS PROPERTIES INC	52	57	521	58,899	0.3
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	29	28	313	35,358	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	23	28	3,218	363,176	2.0
EASTGROUP PROPERTIES INC	4	4	418	47,278	0.3
EDUCATION REALTY TRUST INC	11	10	339	38,334	0.2
EPR PROPERTIES	9	8	545	61,580	0.3
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12	12	1,061	119,774	0.6
EQUITY ONE INC	14	－	－	－	－
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9	9	2,198	248,064	1.3
EXTRA SPACE STORAGE INC	18	17	1,493	168,569	0.9
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10	10	1,285	145,102	0.8
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	17	17	522	58,908	0.3
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	7	－	－	－	－
GETTY REALTY CORP	4	4	127	14,364	0.1
WELLTOWER INC	53	51	3,251	366,924	2.0
HIGHWOODS PROPERTIES INC	14	14	716	80,860	0.4
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	24	22	652	73,652	0.4
EQUITY COMMONWEALTH	18	17	512	57,781	0.3
KILROY REALTY CORP	13	13	1,008	113,849	0.6
KITE REALTY GROUP TRUST	12	11	226	25,586	0.1
LEXINGTON REALTY TRUST	31	30	288	32,575	0.2
LTC PROPERTIES INC	5	5	242	27,345	0.1
MACK-CALI REALTY CORP	13	12	267	30,196	0.2
BOSTON PROPERTIES INC	22	21	2,720	306,976	1.7

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	%
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	47	50	678	76,612	0.4
MID-AMERICA APARTMENT COMM	16	15	1,543	174,205	0.9
NATL HEALTH INVESTORS INC	5	5	433	48,945	0.3
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	29	27	733	82,784	0.4
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2	2	59	6,701	0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST	10	9	115	13,070	0.1
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	12	11	163	18,420	0.1
REALTY INCOME CORP	38	39	2,174	245,386	1.3
REGENCY CENTERS CORP	15	20	1,386	156,451	0.8
SAUL CENTERS INC	1	1	97	11,042	0.1
SENIOR HOUSING PROP TRUST	34	33	636	71,872	0.4
SL GREEN REALTY CORP	15	13	1,366	154,207	0.8
LIFE STORAGE INC	6	6	559	63,151	0.3
SUN COMMUNITIES INC	9	11	998	112,651	0.6
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	31	32	527	59,513	0.3
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	14	13	339	38,340	0.2
TAUBMAN CENTERS INC	8	8	531	59,933	0.3
CUBESMART	26	25	722	81,568	0.4
UDR INC	39	37	1,413	159,545	0.9
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1	1	129	14,569	0.1
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4	4	96	10,865	0.1
VENTAS INC	52	49	2,916	329,149	1.8
WASHINGTON REIT	11	10	322	36,401	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	17	16	539	60,885	0.3
HERSHA HOSPITALITY TRUST	6	5	104	11,754	0.1
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2	2	323	36,512	0.2
UMH PROPERTIES INC	3	4	59	6,763	0.0
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3	3	73	8,292	0.0
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	9	10	179	20,266	0.1
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	16	17	542	61,229	0.3
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15	15	165	18,624	0.1
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	13	12	743	83,872	0.5
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	19	17	96	10,869	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	21	22	893	100,790	0.5
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	11	—	—	—	—
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	10	9	365	41,221	0.2
CHESAPEAKE LODGING TRUST	8	8	237	26,771	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	21	20	383	43,228	0.2
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17	21	708	79,901	0.4
CORESITE REALTY CORP	5	4	546	61,625	0.3
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5	5	219	24,754	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13	14	219	24,780	0.1
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	10	13	238	26,904	0.1
RLJ LODGING TRUST	18	23	531	59,932	0.3
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	16	15	293	33,083	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	%
STAG INDUSTRIAL INC	11	12	332	37,530	0.2
SABRA HEALTH CARE REIT INC	9	24	461	52,090	0.3
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	34	32	423	47,786	0.3
SELECT INCOME REIT	9	9	221	25,013	0.1
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	21	28	820	92,612	0.5
WP CAREY INC	15	14	991	111,899	0.6
WHITESTONE REIT	4	5	76	8,648	0.0
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7	7	488	55,092	0.3
CHATHAM LODGING TRUST	6	5	123	13,895	0.1
TERRENO REALTY CORP	6	6	239	27,012	0.1
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	5	—	—	—	—
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	71	63	521	58,900	0.3
CORECIVIC INC	17	16	367	41,460	0.2
GEO GROUP INC/THE	11	17	398	44,916	0.2
VEREIT INC	144	137	1,051	118,666	0.6
DUKE REALTY CORP	53	50	1,316	148,562	0.8
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	5	5	87	9,902	0.1
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	9	10	293	33,145	0.2
PHYSICIANS REALTY TRUST	20	25	439	49,550	0.3
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	32	35	743	83,927	0.5
GRAMERCY PROPERTY TRUST	20	22	591	66,746	0.4
CYRUSONE INC	10	12	745	84,124	0.5
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	3	4	44	5,000	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	18	18	355	40,095	0.2
QTS REALTY TRUST INC-CL A	7	6	355	40,117	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	38	42	766	86,469	0.5
STARWOOD WAYPOINT HOMES	7	—	—	—	—
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	18	16	377	42,649	0.2
WASHINGTON PRIME GROUP INC	28	26	187	21,133	0.1
CARETRUST REIT INC	9	10	169	19,117	0.1
NEW YORK REIT INC	24	—	—	—	—
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	3	3	73	8,308	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	28	27	1,008	113,783	0.6
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	9	11	113	12,812	0.1
IRON MOUNTAIN INC	36	39	1,449	163,605	0.9
STORE CAPITAL CORP	23	23	601	67,884	0.4
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	11	11	90	10,191	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES	13	14	359	40,543	0.2
PARAMOUNT GROUP INC	—	28	436	49,231	0.3
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	3	5	106	12,032	0.1
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	24	—	—	—	—
XENIA HOTELS & RESORTS INC	15	15	327	36,907	0.2
NORTHSTAR REALTY FINANCE	27	—	—	—	—
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	5	6	164	18,527	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	2	2	66	7,472	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	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	12	－	－	－	－
APPLE HOSPITALITY REIT INC	22	29	561	63,354	0.3
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	2	3	35	3,966	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	24	9	197	22,308	0.1
CITY OFFICE REIT INC	2	3	45	5,109	0.0
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	7	7	94	10,653	0.1
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3	3	143	16,186	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8	8	217	24,521	0.1
FOREST CITY REALTY TRUST- A	32	37	884	99,852	0.5
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1	2	76	8,685	0.0
FARMLAND PARTNERS INC	1	4	37	4,240	0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INV	90	125	116	13,188	0.1
TIER REIT INC	7	6	136	15,451	0.1
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	10	1	11	1,319	0.0
PARKWAY INC	6	－	－	－	－
QUALITY CARE PROPERTIES	13	13	189	21,353	0.1
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3	5	64	7,293	0.0
PARK HOTELS & RESORTS INC	－	22	646	72,926	0.4
EQUITY RESIDENTIAL	54	51	3,224	363,833	2.0
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	－	77	852	96,188	0.5
INVITATION HOMES INC	－	39	919	103,765	0.6
JBG SMITH PROPERTIES	－	13	447	50,542	0.3
ALEXANDER & BALDWIN INC	－	6	179	20,305	0.1
CLIPPER REALTY INC	－	2	29	3,294	0.0
GLADSTONE LAND CORP	－	2	34	3,927	0.0
GLOBAL MEDICAL REIT INC	－	3	29	3,280	0.0
INFRAREIT INC	－	5	97	10,981	0.1
FELCOR LODGING TRUST INC	18	－	－	－	－
GGP INC	86	87	2,036	229,778	1.2
HOST HOTELS & RESORTS INC	109	104	2,062	232,697	1.3
ISTAR INC	10	10	113	12,840	0.1
LIBERTY PROPERTY TRUST	22	20	873	98,582	0.5
LASALLE HOTEL PROPERTIES	16	16	457	51,579	0.3
PUBLIC STORAGE	22	20	4,252	479,830	2.6
SIMON PROPERTY GROUP INC	46	43	7,245	817,612	4.4
VORNADO REALTY TRUST	25	24	1,812	204,469	1.1
KIMCO REALTY CORP	62	58	1,040	117,456	0.6
AVALONBAY COMMUNITIES INC	20	19	3,372	380,583	2.1
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23	22	956	107,913	0.6
小計 口数・金額	3,186	3,253	112,621	12,708,236	
小計 銘柄数＜比率＞	159	158	－	＜68.5%＞	
(カナダ)			千カナダドル		
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3	3	138	12,533	0.1
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	9	8	269	24,380	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9	9	353	31,994	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	
(カナダ)	千口	千口	千カナダドル	千円	%
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	5	5	234	21,213	0.1
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13	12	182	16,469	0.1
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	8	5	115	10,443	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	21	19	405	36,683	0.2
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	3	3	48	4,355	0.0
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	4	3	86	7,799	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	24	22	556	50,337	0.3
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	5	6	275	24,918	0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	10	10	147	13,292	0.1
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6	6	92	8,333	0.0
BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO	2	—	—	—	—
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	4	5	57	5,236	0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	8	12	149	13,534	0.1
ONEREIT	2	—	—	—	—
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3	3	161	14,584	0.1
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5	5	53	4,806	0.0
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	4	4	41	3,763	0.0
MILESTONE APARTMENTS REAL ES	5	—	—	—	—
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2	2	39	3,541	0.0
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	16	19	129	11,661	0.1
CHOICE PROPERTIES REIT	5	6	86	7,801	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	5	3	52	4,782	0.0
PLAZA RETAIL REIT	5	—	—	—	—
SLATE RETAIL REIT - U	2	2	32	2,905	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	5	5	70	6,331	0.0
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	2	2	25	2,268	0.0
SLATE OFFICE REIT	3	2	22	2,010	0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	—	5	38	3,491	0.0
小計 口数・金額	210	198	3,866	349,475	
小計 銘柄数＜比率＞	30	27	—	＜1.9%＞	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	15	17	229	31,207	0.2
HAMBORNER REIT AG	10	11	113	15,528	0.1
小計 口数・金額	26	29	342	46,736	
小計 銘柄数＜比率＞	2	2	—	＜0.3%＞	
(ユーロ…イタリア)					
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	55	47	47	6,413	0.0
BENI STABILI SPA	135	147	112	15,371	0.1
小計 口数・金額	191	195	159	21,784	
小計 銘柄数＜比率＞	2	2	—	＜0.1%＞	
(ユーロ…フランス)					
GECINA SA	6	6	1,027	140,061	0.8
KLEPIERRE	30	29	1,057	144,114	0.8
UNIBAIL-RODAMCO SE	14	13	2,918	397,728	2.1
FONCIERE DES REGIONS	7	7	677	92,341	0.5

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	%
MERCIALYS		7	8	151	20,606	0.1
ICADE		6	6	509	69,417	0.4
ALTAREA		0.36	0.48	102	13,899	0.1
小計	口数・金額	73	72	6,444	878,169	
	銘柄数＜比率＞	7	7	－	＜4.7%＞	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV		7	6	250	34,171	0.2
NSI NV		22	2	91	12,440	0.1
VASTNED RETAIL NV		2	2	82	11,264	0.1
WERELDHAVE NV		5	5	229	31,339	0.2
小計	口数・金額	39	16	654	89,215	
	銘柄数＜比率＞	4	4	－	＜0.5%＞	
(ユーロ…スペイン)						
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		14	12	115	15,742	0.1
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		69	47	534	72,902	0.4
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA		8	8	165	22,616	0.1
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI		15	15	249	34,051	0.2
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		－	44	379	51,769	0.3
小計	口数・金額	107	129	1,446	197,082	
	銘柄数＜比率＞	4	5	－	＜1.1%＞	
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO		3	3	179	24,508	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES		2	1	41	5,641	0.0
RETAIL ESTATES		1	0.88	65	8,861	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA		2	2	206	28,132	0.2
WERELDHAVE BELGIUM NV		0.32	－	－	－	－
AEDIFICA		2	2	200	27,274	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV		0.5	－	－	－	－
MONTEA		0.98	－	－	－	－
COFINIMMO		3	2	319	43,500	0.2
小計	口数・金額	15	13	1,012	137,919	
	銘柄数＜比率＞	9	6	－	＜0.7%＞	
(ユーロ…アイルランド)						
GREEN REIT PLC		96	101	159	21,793	0.1
HIBERNIA REIT PLC		103	98	151	20,618	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		53	53	79	10,833	0.1
小計	口数・金額	252	252	390	53,245	
	銘柄数＜比率＞	3	3	－	＜0.3%＞	
ユーロ計	口数・金額	706	708	10,450	1,424,154	
	銘柄数＜比率＞	31	29	－	＜7.7%＞	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		152	145	968	148,163	0.8
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		49	46	317	48,602	0.3
HAMMERSON PLC		115	113	602	92,288	0.5
LAND SECURITIES GROUP PLC		118	104	1,012	155,034	0.8

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	132	123	308	47,155	0.3
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	91	85	99	15,184	0.1
SEGRO PLC	122	141	820	125,529	0.7
WORKSPACE GROUP PLC	18	17	168	25,791	0.1
MCKAY SECURITIES PLC-ORD	15	—	—	—	—
SHAFTESBURY PLC	41	34	355	54,358	0.3
BIG YELLOW GROUP PLC	21	21	182	27,923	0.2
DERWENT LONDON PLC	16	15	453	69,437	0.4
MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	9	—	—	—	—
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	88	96	180	27,683	0.1
HANSTEEN HOLDINGS PLC	108	58	82	12,650	0.1
RDI REIT PLC	197	181	67	10,266	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	31	29	142	21,865	0.1
TRITAX BIG BOX REIT PLC	164	187	278	42,599	0.2
ASSURA PLC	235	331	208	31,938	0.2
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	89	74	45	6,939	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	68	86	77	11,901	0.1
REGIONAL REIT LTD	24	35	36	5,590	0.0
CAPITAL & REGIONAL PLC	75	75	45	6,892	0.0
NEWRIVER REIT PLC	33	42	137	21,052	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	—	28	31	4,842	0.0
UNITE GROUP PLC	—	33	263	40,370	0.2
LXI REIT PLC	—	19	19	3,009	0.0
AEW UK LONG LEASE REIT PLC	—	10	10	1,557	0.0
小計 口数・金額	2,022	2,137	6,916	1,058,631	
小計 銘柄数＜比率＞	24	26	—	＜5.7%＞	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES	485	449	1,213	107,542	0.6
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	6	—	—	—	—
ABACUS PROPERTY GROUP	43	43	176	15,622	0.1
ASPEN GROUP	11	—	—	—	—
INGENIA COMMUNITIES GROUP	22	26	74	6,597	0.0
360 CAPITAL GROUP LTD	34	—	—	—	—
ALE PROPERTY GROUP	25	—	—	—	—
CHARTER HALL GROUP	59	67	406	36,033	0.2
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	35	30	86	7,664	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP	198	185	188	16,731	0.1
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	101	106	246	21,890	0.1
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	26	36	124	11,018	0.1
NATIONAL STORAGE REIT	64	72	110	9,801	0.1
GDI PROPERTY GROUP	65	75	94	8,335	0.0
INDUSTRIA REIT	23	11	30	2,679	0.0
CENTURIA URBAN REIT	7	—	—	—	—
SCENTRE GROUP	790	747	3,108	275,533	1.5
ARENA REIT	37	34	76	6,784	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	
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリアドル	千円	%
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS		23	17	57	5,122	0.0
GENERATION HEALTHCARE REIT		23	—	—	—	—
VIVA ENERGY REIT		66	60	135	12,014	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT		23	23	94	8,419	0.0
PROPERTYLINK GROUP		—	87	88	7,851	0.0
RURAL FUNDS GROUP		—	35	83	7,372	0.0
GPT GROUP		265	247	1,291	114,508	0.6
MIRVAC GROUP		543	509	1,191	105,647	0.6
STOCKLAND		353	338	1,493	132,416	0.7
WESTFIELD CORP		284	269	2,507	222,299	1.2
DEXUS		142	139	1,388	123,099	0.7
BWP TRUST		70	70	218	19,407	0.1
INVESTA OFFICE FUND		92	71	324	28,736	0.2
CHARTER HALL RETAIL REIT		49	47	195	17,334	0.1
GOODMAN GROUP		234	221	1,871	165,926	0.9
小計	口数・金額	4,211	4,023	16,881	1,496,392	
	銘柄数＜比率＞	31	27	—	＜8.1%＞	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR		43	49	108	8,751	0.0
KIWI PROPERTY GROUP LTD		199	198	276	22,334	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST		147	132	184	14,875	0.1
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD		62	—	—	—	—
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL		141	141	193	15,595	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD		127	126	137	11,069	0.1
STRIDE PROPERTY GROUP		59	52	93	7,551	0.0
INVESTORE PROPERTY LTD		21	30	45	3,669	0.0
小計	口数・金額	803	731	1,038	83,847	
	銘柄数＜比率＞	8	7	—	＜0.5%＞	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		329	311	22,858	329,848	1.8
CHAMPION REIT		310	268	1,546	22,313	0.1
PROSPERITY REIT		178	178	599	8,655	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN		148	160	817	11,797	0.1
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT		115	—	—	—	—
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		153	129	701	10,126	0.1
FORTUNE REIT		205	196	1,911	27,575	0.1
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN		137	114	378	5,461	0.0
小計	口数・金額	1,575	1,356	28,813	415,779	
	銘柄数＜比率＞	8	7	—	＜2.2%＞	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		379	315	683	58,147	0.3
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		324	355	720	61,284	0.3
KEPPEL REIT		263	246	312	26,611	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST		84	84	128	10,942	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST		126	158	198	16,837	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	%
ESR-REIT		180	158	90	7,682	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS		111	111	191	16,279	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		90	82	188	16,066	0.1
STARHILL GLOBAL REIT		190	190	147	12,522	0.1
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		215	286	386	32,902	0.2
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS		99	73	120	10,229	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		82	74	104	8,897	0.0
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL		83	83	113	9,645	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL		255	281	113	9,684	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		59	55	165	14,064	0.1
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		177	170	352	30,013	0.2
CACHE LOGISTICS TRUST		127	127	111	9,450	0.1
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		264	273	456	38,784	0.2
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		135	103	74	6,350	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		110	133	53	4,580	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT-RTS		46	－	－	－	－
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST		121	121	106	9,055	0.0
MAPLETREE GREATER CHINA COMM		264	230	287	24,449	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI		97	59	41	3,512	0.0
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		76	－	－	－	－
OUE HOSPITALITY TRUST		160	175	153	13,058	0.1
SPH REIT		105	105	113	9,617	0.1
KEPPEL DC REIT		112	112	163	13,872	0.1
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI		165	152	174	14,864	0.1
CAPITALAND MALL TRUST		397	384	812	69,064	0.4
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		346	330	921	78,367	0.4
小計	口数・金額	5,250	5,033	7,488	636,840	
	銘柄数＜比率＞	31	29	－	＜3.4%＞	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
REIT 1 LTD		26	23	361	11,822	0.1
小計	口数・金額	26	23	361	11,822	
	銘柄数＜比率＞	1	1	－	＜0.1%＞	
合計	口数・金額	17,993	17,466	－	18,185,179	
	銘柄数＜比率＞	323	311	－	＜98.0%＞	

(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

（2018年１月５日現在）

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
投資証券	18,185,179	97.7
コール・ローン等、その他	428,832	2.3
投資信託財産総額	18,614,011	100.0

（注）期末における外貨建純資産（18,556,473千円）の投資信託財産総額（18,614,011千円）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＝112.84円	１カナダドル＝90.38円	１ユーロ＝136.27円	１イギリスポンド＝153.06円
１オーストラリアドル＝88.64円	１ニュージーランドドル＝80.76円	１香港ドル＝14.43円	１シンガポールドル＝85.04円
１イスラエルシェケル＝32.73円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年１月５日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	18,693,014,095
コール・ローン等	338,399,411
投資証券(評価額)	18,185,179,928
未収入金	79,012,798
未収配当金	90,421,958
(B) 負債	141,209,956
未払金	92,884,115
未払解約金	48,325,803
未払利息	38
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	18,551,804,139
元本	11,298,361,109
次期繰越損益金	7,253,443,030
(D) 受益権総口数	11,298,361,109口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	16,420円

＜注記事項＞

①期首元本額　11,814,318,288円
　期中追加設定元本額　2,560,769,660円
　期中一部解約元本額　3,076,726,839円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.6420円です。

○損益の状況 (2017年１月６日～2018年１月５日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	742,436,393
受取配当金	738,373,453
受取利息	563,138
その他収益金	3,529,909
支払利息	△　30,107
(B) 有価証券売買損益	△ 291,220,165
売買益	1,298,862,686
売買損	△1,590,082,851
(C) 保管費用等	△ 7,955,902
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	443,260,326
(E) 前期繰越損益金	7,135,086,125
(F) 追加信託差損益金	1,461,803,778
(G) 解約差損益金	△1,786,707,199
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	7,253,443,030
次期繰越損益金(Ｈ)	7,253,443,030

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

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

三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	183,341,917円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	120,881,529円
三菱ＵＦＪ 資産設計ファンド（分配型）	36,203,621円
三菱ＵＦＪ 資産設計ファンド（バランス型）	65,936,887円
三菱ＵＦＪ 資産設計ファンド（株式重視型）	28,301,506円
ファンド・マネジャー（海外リート）	61,783,419円
ｅＭＡＸＩＳ 先進国リートインデックス	5,817,071,504円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,905,797,800円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	290,307,203円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞先進国ＲＥＩＴインデックスファンド	1,504,555,198円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	198,565,655円
オルタナティブ資産セレクション（ラップ向け）	237,578,385円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	530,377,881円
つみたて８資産均等バランス	1,282,473円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	684,103円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	840,838円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	565,529円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	9,650,723円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	49,447,531円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	10,100,534円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	17,948,007円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	75,362,713円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	62,210,376円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	85,392,303円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	4,173,474円
合計	11,298,361,109円

［お知らせ］

①投資対象、運用目的、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的について記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
（2017年８月16日）

②当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
（変更前（旧）http://www.am.mufg.jp/　→　変更後（新）https://www.am.mufg.jp/）
（2018年１月１日）