

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／国内／資産複合	
信託期間	無期限（2001年3月26日設定）	
運用方針	TOPIXマザーファンド受益証券に信託財産の純資産総額の50%程度を投資します。組入資産の価格変動に伴う配分比率の見直しは、原則として株式への実質投資比率が50±2%程度の範囲内になるよう適宜行います。残りの部分は、日本短期債券マザーファンド受益証券に投資します。	
主要運用対象	ベビーファンド	TOPIXマザーファンド受益証券および日本短期債券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。
	日本短期債券マザーファンド	わが国の公社債・金融商品を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。外貨建資産への投資は行いません。
	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。
	日本短期債券マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

※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、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。  
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## 運用報告書（全体版）

# 三菱UFJ TOPIX・ライト

第14期（決算日：2015年3月25日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。  
 さて、お手持ちの「三菱UFJ TOPIX・ライト」は、去る3月25日に第14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。



東京都千代田区丸の内一丁目4番5号  
 URL:<http://www.am.mufg.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

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

# ◆目次

## 三菱UFJ TOPIX・ライトのご報告

◇最近5期の運用実績	1
◇当期中の基準価額と市況等の推移	2
◇運用経過	3
◇今後の運用方針	9
◇1万口当たりの費用明細	10
◇売買及び取引の状況	11
◇株式売買比率	11
◇利害関係人との取引状況等	11
◇組入資産の明細	13
◇投資信託財産の構成	13
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	14
◇損益の状況	14
◇お知らせ	15

## マザーファンドのご報告

◇TOPIXマザーファンド	19
◇日本短期債券マザーファンド	52

## 本資料の表記にあたって

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額			株 組入 比率	株 先物 比率	債 組入 比率	債 先物 比率	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金					
	円		円		%	%	%	%	百万円
10期(2011年3月25日)	9,093		0	△ 3.9	49.7	0.9	48.4	—	2,066
11期(2012年3月26日)	9,180		0	1.0	48.8	0.9	48.6	—	1,895
12期(2013年3月25日)	10,322		0	12.4	49.6	0.6	48.5	—	1,853
13期(2014年3月25日)	11,009		0	6.7	48.7	0.6	48.7	—	1,423
14期(2015年3月25日)	12,987		0	18.0	49.4	0.7	48.1	—	1,264

- (注) 当ファンドは、投資対象とする各親投資信託にそれぞれベンチマークが設定されており、値動きを表す適切な指数が存在しないため、当ファンドの基準価額動向と比較するベンチマークおよび参考指数はありません。
- (注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」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。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額 円	騰 落 率		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		%	%	%	%	%	%
(期 首) 2014年3月25日	11,009	—	—	48.7	0.6	48.7	—
3月末	11,244	2.1	—	49.5	1.0	47.2	—
4月末	11,052	0.4	—	48.8	1.0	48.9	—
5月末	11,237	2.1	—	48.9	0.7	48.5	—
6月末	11,522	4.7	—	49.2	0.4	47.3	—
7月末	11,641	5.7	—	49.7	0.3	48.0	—
8月末	11,587	5.3	—	49.5	0.5	48.7	—
9月末	11,842	7.6	—	48.9	0.6	48.1	—
10月末	11,892	8.0	—	50.6	0.7	47.1	—
11月末	12,229	11.1	—	49.5	0.6	47.5	—
12月末	12,217	11.0	—	49.3	0.3	48.6	—
2015年1月末	12,247	11.2	—	49.3	0.3	47.7	—
2月末	12,710	15.5	—	49.2	0.6	48.0	—
(期 末) 2015年3月25日	12,987	18.0	—	49.4	0.7	48.1	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」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14期：2014/3/26～2015/3/25)

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ18.0%の上昇となりました。



## 基準価額の主な変動要因

上昇要因

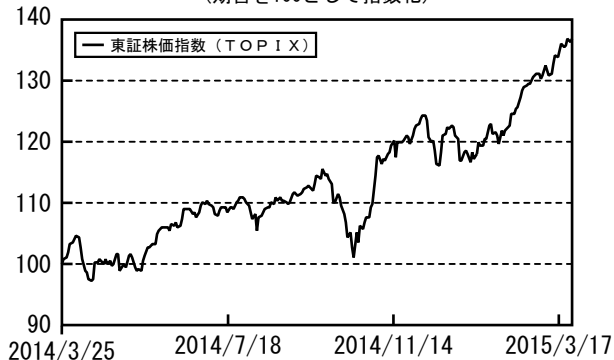
世界的な金融緩和姿勢の高まりを好感し株式市況が上昇したことがプラス要因となりました。

## 投資環境について

(第14期：2014/3/26～2015/3/25)

## 市況の推移

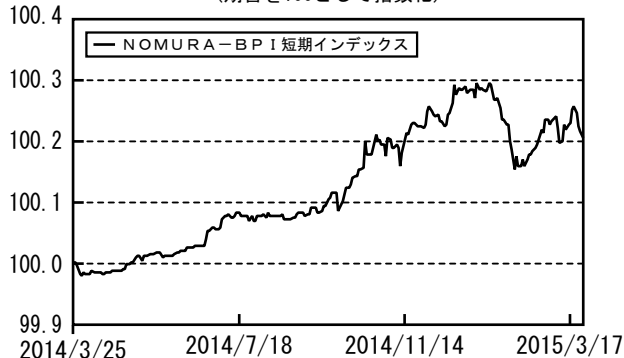
(期首を100として指数化)



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

## 市況の推移

(期首を100として指数化)



・NOMURA-BPI 短期インデックスとは、NOMURA-BPI 総合インデックスのサブインデックスで、残存期間1年から3年の債券で構成されています。NOMURA-BPI 総合インデックスは、野村証券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI 総合インデックスおよびNOMURA-BPI 短期インデックスは野村証券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し野村証券株式会社は一切関係ありません。

## ◎国内株式市況

・米国中心の海外景気の回復に加えて、政府の成長戦略に対する期待が高まったことや、日銀の追加金融緩和の発表などを受けて国内株式市況は上昇しました。

## ◎国内短期債券市況

・日銀による大規模国債買入オペの効果や世界景気に対する慎重な見方を受けて、国内金利はもみ合いながらも低下(債券価格は上昇)基調となっていましたが、日銀が2014年10月末に「量的・質的金融緩和」の拡大を決定したことから2015年1月中旬にかけて一段の低下となりました。

・その後は、日銀による追加金融緩和観測の後退や米国金利の上昇などから国内金利は上昇しました。

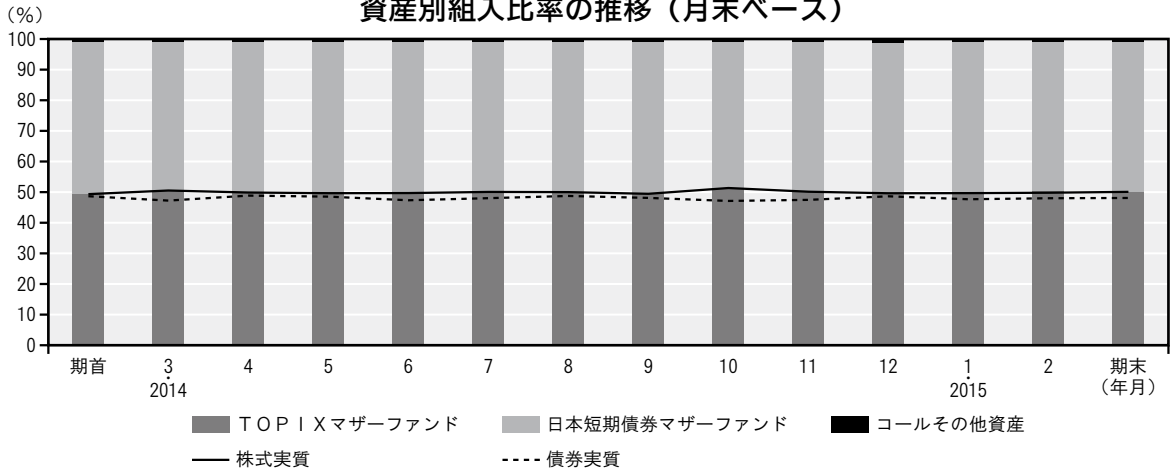
## 当該投資信託のポートフォリオについて

## &lt;三菱UFJ TOPIX・ライト&gt;

- ・国内の株式・債券に分散投資することにより、値上がり益の獲得をめざして運用を行いました。
- ・当期の資産配分の推移は以下の通りです。

(ご参考)

資産別組入比率の推移（月末ベース）



- ・資産配分は、ファンドの基本投資割合に準じて運用を行いました。
- ・上記の運用を行った結果、基準価額は18.0%上昇しました。

基準価額の変動要因の内訳は以下の通りです。

(内訳)

TOPIXマザーファンド	18.5%程度
日本短期債券マザーファンド	0.1%程度
その他（信託報酬等）	△ 0.6%程度

## <TOPIXマザーファンド>

基準価額は期首に比べ39.6%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。

### 【ベンチマークとの比較】

ベンチマークは36.8%の上昇となったため、カイ離は2.8%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	2.8%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2.8%程度でした。配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

プラス要因	配当・利子収入、再投資効果等	計 2.8%程度
マイナス要因	売買コスト等	計 △0.0%程度

再投資効果：配当金等を受け取った後、再投資することにより生じます。市場が上昇すればプラス、下落すればマイナスの要因となります。

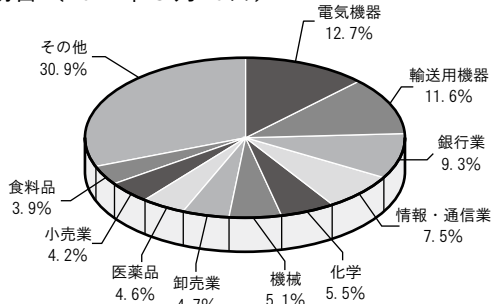
信託財産の収益向上を目的に、保有株式の貸し付けを行っています。貸付契約額は、期末時点で概ね純資産総額の5割程度となり、信託財産に若干の収益寄与となりました。



## (ご参考)

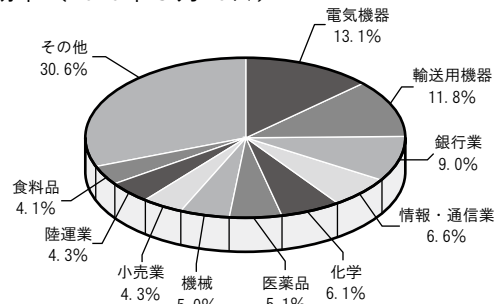
## 組入上位10業種

期首 (2014年3月25日)



(注) 比率は現物株式評価額に対する割合です。

期末 (2015年3月25日)



(注) 比率は現物株式評価額に対する割合です。

## &lt;日本短期債券マザーファンド&gt;

基準価額は期首に比べ0.3%の上昇となりました。

## ◎組入比率

- ・期を通じて高位組み入れを維持しました。

## ◎デュレーション (平均回収期間や金利感応度)

- ・既に金利水準が低く、特に短期ゾーンの金利低下余地が限定的との判断により、デュレーションをベンチマーク対比で短めの水準としました。

## ◎債券種別構成

- ・国内金利の低位安定推移を見込み、利回り向上の観点から一般債をオーバーウェイト (投資比率を基準となる配分比率より多くすること) としました。

## 【ベンチマークとの比較】

ファンドの騰落率は、ベンチマーク (NOMURA-BPI短期インデックス) の騰落率 (0.2%) を0.1%上回りました。この主な要因は、次の通りです。

(プラス要因)

## ◎デュレーション

- ・2015年1月以降の日銀による追加緩和観測の後退を受けた金利上昇局面で、デュレーションをベンチマーク対比で短めの水準としたこと。

## ◎債券種別構成

- ・2015年1月以降の一般債のスプレッド (利回り格差) 縮小局面で一般債をオーバーウェイトとしたこと。

(マイナス要因)

## ◎デュレーション

- ・2014年10月以降の日銀の金融緩和拡大を受けた金利低下局面で、デュレーションをベンチ

マーク対比で短めの水準としたこと。

### ◎債券種別構成

- ・2014年10月以降の一般債のスプレッド拡大局面で一般債のオーバーウェイトを維持したこと。

### (ご参考)

#### 利回り・デュレーション

期首 (2014年3月25日)

最終利回り	0.2%
直接利回り	0.7%
デュレーション	1.8年

- ・数値は債券現物部分で計算しております(先物は考慮していません)。
- ・最終利回りは、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。

期末 (2015年3月25日)

最終利回り	0.2%
直接利回り	0.9%
デュレーション	1.7年

- ・数値は債券現物部分で計算しております(先物は考慮していません)。
- ・最終利回りは、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。

### 当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・当ファンドは、投資対象とする各親投資信託にそれぞれベンチマークが設定されており、値動きを表す適切な指数が存在しないため、当ファンドの基準価額動向と比較するベンチマークおよび参考指数はありません。
- ・従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

### 分配金について

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

#### 【分配原資の内訳】

(単位：円、1万円当たり、税込み)

項 目	第14期	
	2014年3月26日～2015年3月25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	3,744	

- (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

### <三菱UFJ TOPIX・ライト>

#### ◎今後の運用方針

- ・資産配分方針は、従前通り基本投資割合を維持します。また各資産の組入比率は、期を通じて同割合に準ずるよう調整を行います。

### <TOPIXマザーファンド>

#### ◎今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

### <日本短期債券マザーファンド>

#### ◎運用環境の見通し

- ・先行きについては、設備投資や輸出を中心とした持ち直しや雇用環境も改善を続けるものの、個人消費の回復が遅れていることなどから、本邦景気は緩やかな改善にとどまるものと思われれます。
- ・日銀は「物価安定の目標」の実現に向けて引き続き強力な金融緩和姿勢をもって臨むものと思われれます。
- ・日銀の社債買入オペなどによる良好な需給環境を背景に一般債の国債に対する金利差は低位での安定推移を予想します。
- ・国内金利は引き続き低位での推移を想定しますが、短期ゾーンに関しては低下余地は限定的と思われれます。

#### ◎今後の運用方針

- ・安定した利子収益確保をめざし、債券組入比率は引き続き高位に維持する方針です。
- ・ファンド全体のデュレーションは、既に金利水準が低いことから当面ベンチマーク対比で短めの水準で機動的に調整する方針です。
- ・債券種別構成は、流動性や銘柄分散に留意しつつ、一般債の組入比率をベンチマーク比高めに維持します。

## ○ 1万口当たりの費用明細

(2014年3月26日～2015年3月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 71	% 0.605	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(31)	(0.273)	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 ）	(32)	(0.267)	分配金・償還金・換金代金支払等の事務手続き、交付運用報告書等の送付、購入後の説明・情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	( 8 )	(0.065)	投資信託財産の保管・管理、運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
（ 株 式 ）	( 0 )	(0.000)	有価証券等を売買する際に発生する費用
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0 )	(0.002)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.003	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	( 0 )	(0.003)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（ そ の 他 ）	( 0 )	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	71	0.610	
期中の平均基準価額は、11,785円です。			

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

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 売買委託手数料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

(2014年3月26日～2015年3月25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
日本短期債券マザーファンド	63,903	70,812	147,310	163,224
TOPIXマザーファンド	31,341	36,661	251,307	330,568

## ○株式売買比率

(2014年3月26日～2015年3月25日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	TOPIXマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	120,411,827千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	230,104,102千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.52	

(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

(2014年3月26日～2015年3月25日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;三菱UFJ TOPIX・ライト&gt;

該当事項はございません。

## &lt;日本短期債券マザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 13,200	百万円 1,605	% 12.2	百万円 8,636	百万円 2,902	% 33.6

平均保有割合 6.2%

※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まません。

## &lt;TOPIXマザーファンド&gt;

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 34,719	百万円 5,427	% 15.6	百万円 85,692	百万円 19,228	% 22.4
株式先物取引	62,695	23,952	38.2	63,330	27,143	42.9

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。

## 利害関係人の発行する有価証券等

## &lt;三菱UFJ TOPIX・ライト&gt;

該当事項はございません。

## &lt;日本短期債券マザーファンド&gt;

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 919	百万円 301	百万円 1,115

## &lt;TOPIXマザーファンド&gt;

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 987	百万円 2,234	百万円 6,749

## 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

## &lt;三菱UFJ TOPIX・ライト&gt;

該当事項はございません。

## &lt;日本短期債券マザーファンド&gt;

種 類	買 付 額
公社債	百万円 999

## &lt;TOPIXマザーファンド&gt;

種 類	買 付 額
株式	百万円 739

### 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)	25千円
うち利害関係人への支払額 (B)	10千円
(B) / (A)	41.2%

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

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

### ○組入資産の明細

(2015年3月25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
日本短期債券マザーファンド	638,806	555,399	616,326
TOPIXマザーファンド	624,251	404,286	635,173

TOPIXマザーファンドの組入資産の明細につきましては、マザーファンド頁をご参照ください。

### ○投資信託財産の構成

(2015年3月25日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本短期債券マザーファンド	616,326	48.5
TOPIXマザーファンド	635,173	50.0
コール・ローン等、その他	19,045	1.5
投資信託財産総額	1,270,544	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年3月25日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	1,270,544,741
コール・ローン等	16,480,739
日本短期債券マザーファンド(評価額)	616,326,512
TOPIXマザーファンド(評価額)	635,173,748
未収入金	2,563,720
未収利息	22
(B) 負債	6,441,470
未払解約金	2,567,078
未払信託報酬	3,856,550
その他未払費用	17,842
(C) 純資産総額(A-B)	1,264,103,271
元本	973,345,266
次期繰越損益金	290,758,005
(D) 受益権総口数	973,345,266口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,987円

## &lt;注記事項&gt;

①期首元本額	1,293,027,726円
期中追加設定元本額	19,040,422円
期中一部解約元本額	338,722,882円

## ○損益の状況 (2014年3月26日～2015年3月25日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	7,598
受取利息	7,598
(B) 有価証券売買損益	199,550,203
売買益	225,147,597
売買損	△ 25,597,394
(C) 信託報酬等	△ 8,119,677
(D) 当期損益金(A+B+C)	191,438,124
(E) 前期繰越損益金	111,866,288
(F) 追加信託差損益金	△ 12,546,407
(配当等相当額)	( 61,131,974)
(売買損益相当額)	(△ 73,678,381)
(G) 計(D+E+F)	290,758,005
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	290,758,005
追加信託差損益金	△ 12,546,407
(配当等相当額)	( 61,149,034)
(売買損益相当額)	(△ 73,695,441)
分配準備積立金	303,304,412

- (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。

## ②分配金の計算過程

		第14期
費用控除後の配当等収益額	A	15,814,055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	B	39,569,146円
収益調整金額	C	61,149,034円
分配準備積立金額	D	247,921,211円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	364,453,446円
当ファンドの期末残存口数	F	973,345,266口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,744円
1万口当たり分配金額	H	-円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	-円



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

【お知らせ】

- ①申込単位・解約単位の変更に伴い、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2014年6月25日)
- ②運用報告書の二段階化について信託約款に記載し、所要の変更を行いました。  
(2014年12月1日)
- ③新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。  
(2014年12月1日)
- ④デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。  
(2014年12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。

## ○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2015年3月25日現在)

## ＜日本短期債券マザーファンド＞

下記は、日本短期債券マザーファンド全体(8,617,268千口)の内容です。

## 国内公社債

## (A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
国債証券	800,000	838,924	8.8	—	—	8.8	—	
特殊債券 (除く金融債)	1,200,000 (1,200,000)	1,201,797 (1,201,797)	12.6 (12.6)	— (—)	— (—)	— (—)	12.6 (12.6)	
金融債券	1,100,000 (1,100,000)	1,103,931 (1,103,931)	11.5 (11.5)	— (—)	— (—)	9.4 (9.4)	2.1 (2.1)	
普通社債券	6,200,000 (6,200,000)	6,285,029 (6,285,029)	65.7 (65.7)	— (—)	— (—)	12.8 (12.8)	52.9 (52.9)	
合 計	9,300,000 (8,500,000)	9,429,681 (8,590,757)	98.6 (89.8)	— (—)	— (—)	31.1 (22.3)	67.6 (67.6)	

(注) ( )内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

## (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第298回利付国債(10年)	1.3	300,000	314,094	2018/12/20
第299回利付国債(10年)	1.3	500,000	524,830	2019/3/20
小計		800,000	838,924	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>				
第36回福祉医療機構債券(財投機関債)	0.167	100,000	100,064	2016/12/20
第33回日本学生支援債券(財投機関債)	0.187	100,000	100,102	2016/11/18
第37回日本学生支援債券(財投機関債)	0.105	100,000	99,966	2016/11/18
第50回中日本高速道路	0.232	100,000	100,173	2016/11/8
第44回韓国産業銀行(2014)	0.43	400,000	400,752	2016/1/29
第12回韓国輸出入銀行	0.4	400,000	400,740	2016/3/14
小計		1,200,000	1,201,797	
<b>金融債券</b>				
い第744号商工債券	0.35	100,000	100,424	2017/5/26
い第746号商工債券	0.3	100,000	100,326	2017/7/27
い第741号農林債券	0.5	100,000	100,615	2017/2/27
い第749号農林債券	0.3	200,000	200,566	2017/10/27
い第750号農林債券	0.3	100,000	100,292	2017/11/27
第270回信金中金債	0.35	100,000	100,446	2017/5/26
第271回信金中金債	0.35	100,000	100,449	2017/6/27
第272回信金中金債	0.3	100,000	100,349	2017/7/27
第273回信金中金債	0.3	100,000	100,373	2017/8/25
第168号商工債券(3年)	0.2	100,000	100,091	2017/1/27
小計		1,100,000	1,103,931	
<b>普通社債券</b>				
第446回関西電力	1.78	100,000	101,491	2016/3/18
第382回東北電力	3.125	300,000	317,976	2017/4/25
第387回九州電力	1.69	100,000	101,466	2016/3/25
第416回九州電力	0.661	200,000	201,358	2016/12/22
第425回九州電力	0.281	100,000	100,020	2017/2/24
第7回新関西国際空港	0.217	100,000	100,133	2016/12/20
第10回新関西国際空港	0.161	100,000	100,027	2017/9/20
第6回ブリヂストン	0.247	100,000	100,129	2016/4/22
第13回住友大阪セメント	0.6	100,000	100,590	2016/9/5
第13回トヨタ自動車	0.289	100,000	100,190	2016/6/20
第9回りそなホールディングス	0.644	100,000	100,687	2016/9/20
第11回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	2.28	200,000	206,546	2016/10/31
第12回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	2.16	100,000	104,472	2017/7/28
第132回三菱東京UFJ銀行	0.46	100,000	100,567	2017/1/24
第1回三菱UFJ信託銀行(特定社債間限定同順位)	0.345	300,000	301,275	2017/6/7
第5回住友信託銀行(劣後特約付)	2.25	100,000	102,150	2016/4/27
第10回三井住友銀行(劣後特約付)	2.11	400,000	414,168	2017/2/16
第6回みずほ銀行(劣後特約付)	2.25	400,000	412,516	2016/11/4
第27回日産フィナンシャルサービス	0.146	100,000	100,033	2017/6/20
第59回トヨタファイナンス	0.157	100,000	100,082	2017/6/20
第62回アコム	1.07	100,000	100,719	2016/3/4

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138回オリックス	1.69	100,000	103,559	2017/8/25
第13回三菱UFJリース	0.796	200,000	201,384	2016/4/22
第25回三菱UFJリース	0.313	100,000	100,376	2017/11/21
第38回野村ホールディングス	0.605	200,000	200,688	2016/2/26
第3回新韓銀行	0.83	200,000	200,274	2015/7/29
第12回ボスコ(2013)	0.93	100,000	100,285	2016/12/9
第23回GEキャピタルコーポレーション	0.45	300,000	301,233	2016/9/20
第10回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	0.462	400,000	401,176	2016/6/13
第9回ゴールドマン・サックス・グループ・インク	2.11	100,000	103,227	2016/12/28
第10回現代キャピタル・サービスズ・インク	0.75	100,000	100,238	2015/10/16
第4回ビー・エヌ・ビー・パリバ	0.53	100,000	100,449	2016/9/13
第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.89	300,000	302,649	2016/6/10
第7回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.315	100,000	100,234	2016/11/18
第8回オーストラリア・ニュージーランド銀行	1.09	200,000	201,692	2016/2/16
第17回ラボバンク・ネダーランド	0.563	100,000	100,235	2015/11/2
第22回ラボバンク・ネダーランド	0.377	300,000	300,735	2016/12/19
小計		6,200,000	6,285,029	
合計		9,300,000	9,429,681	

## TOPIXマザーファンド

## 《第14期》決算日2015年3月25日

[計算期間：2014年3月26日～2015年3月25日]

「TOPIXマザーファンド」は、3月25日に第14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14期の運用状況をご報告申し上げます。

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数 (TOPIX)		株組入比率	株先物比率	純資産額
	円	騰落率	(TOPIX)	騰落率			
10期(2011年3月25日)	7,748	△ 8.1	857.38	△10.0	98.1	1.9	179,093
11期(2012年3月26日)	7,888	1.8	851.82	△ 0.6	98.4	1.7	187,797
12期(2013年3月25日)	9,935	26.0	1,047.29	22.9	98.8	1.2	221,229
13期(2014年3月25日)	11,255	13.3	1,163.70	11.1	98.7	1.2	221,564
14期(2015年3月25日)	15,711	39.6	1,592.01	36.8	98.4	1.3	245,366

(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国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。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「配当要因」が含まれている点にご留意ください。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 株 価 指 数 (TOPIX)	騰 落 率		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	円	%		騰 落 率	%		
(期 首) 2014年3月25日	11,255	—	1,163.70	—	98.7	1.2	
3月末	11,746	4.4	1,202.89	3.4	98.0	2.1	
4月末	11,351	0.9	1,162.44	△ 0.1	98.0	2.1	
5月末	11,739	4.3	1,201.41	3.2	97.9	1.4	
6月末	12,346	9.7	1,262.56	8.5	98.4	0.9	
7月末	12,610	12.0	1,289.42	10.8	98.9	0.7	
8月末	12,502	11.1	1,277.97	9.8	99.1	1.0	
9月末	13,065	16.1	1,326.29	14.0	98.1	1.1	
10月末	13,140	16.7	1,333.64	14.6	98.3	1.4	
11月末	13,898	23.5	1,410.34	21.2	98.8	1.2	
12月末	13,885	23.4	1,407.51	21.0	99.3	0.7	
2015年1月末	13,960	24.0	1,415.07	21.6	98.3	0.7	
2月末	15,038	33.6	1,523.85	30.9	97.8	1.1	
(期 末) 2015年3月25日	15,711	39.6	1,592.01	36.8	98.4	1.3	

(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39.6%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(36.8%)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

◎国内株式市況

米国中心の海外景気の回復に加えて、政府の成長戦略に対する期待が高まったことや、日銀の追加金融緩和の発表などを受けて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36.8%の上昇となったため、カイ離は2.8%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	2.8%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2.8%程度でした。  
配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

プラス要因	配当・利子収入、再投資効果等	計 2.8%程度
マイナス要因	売買コスト等	計 Δ0.0%程度

再投資効果：配当金等を受け取った後、再投資することにより生じます。市場が上昇すればプラス、下落すればマイナスの要因となります。

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

## ○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。



○1万口当たりの費用明細

(2014年3月26日～2015年3月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 ( 株 式 ) (先物・オプション)	円 0 (0) (0)	% 0.004 (0.000) (0.004)	(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 有価証券等を売買する際に発生する費用
(b) そ の 他 費 用 ( そ の 他 )	0 (0)	0.000 (0.000)	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	0	0.004	
期中の平均基準価額は、12,940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

(2014年3月26日～2015年3月25日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 30,195 (△ 751)	千円 34,719,638 ( )	千株 70,804	千円 85,692,188

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円 62,695	百万円 63,330	百万円 -	百万円 -

## ○株式売買比率

(2014年3月26日～2015年3月25日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	120,411,827千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	230,104,102千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.52

(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

(2014年3月26日～2015年3月25日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
株式	百万円 34,719	百万円 5,427	% 15.6	百万円 85,692	百万円 19,228	% 22.4
株式先物取引	62,695	23,952	38.2	63,330	27,143	42.9

## 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 987	百万円 2,234	百万円 6,749

## 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 739

## 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	9,006千円
うち利害関係人への支払額 (B)	3,568千円
(B) / (A)	39.6%

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

○組入資産の明細

(2015年3月25日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>				
極洋	58	49	14,847	
日本水産	182.2	142.9	52,158	
マルハニチロ	—	22.3	39,738	
マルハニチロホールディングス	285	—	—	
サカタのタネ	21.9	18.7	36,820	
ホクト	16.4	12.9	30,121	
<b>鉱業 (0.4%)</b>				
住石ホールディングス	41.1	32.2	4,025	
日鉄鉱業	38	32	15,232	
三井松島産業	97	76	10,488	
国際石油開発帝石	720.9	612.4	824,902	
日本海洋掘削	3.7	3.5	14,192	
石油資源開発	21.1	16.6	65,570	
K&Oエナジーグループ	7.5	7.8	11,762	
<b>建設業 (2.5%)</b>				
ショーボンドホールディングス	13.2	11.2	58,576	
ミライト・ホールディングス	42.1	35.8	50,191	
タマホーム	7.4	8.7	4,845	
サンヨーホームズ	—	1.2	808	
ダイセキ環境ソリューション	1.3	1.4	2,674	
安藤・間	98.9	77.6	53,699	
東急建設	52.6	41.3	29,033	
コムシスホールディングス	72	51.7	74,396	
ミサワホーム	15.9	13.7	14,796	
高松コンストラクショングループ	11.2	8.8	23,012	
東建コーポレーション	5.53	4.3	25,671	
ヤマウラ	6.9	5.5	2,310	
大成建設	750	604	431,860	
大林組	445	349	283,388	
清水建設	454	356	303,312	
飛鳥建設	91.1	75.7	18,470	
長谷工コーポレーション	197.7	145.3	167,530	
松井建設	16	13	9,009	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
銭高組	16	17	6,596	
鹿島建設	652	511	293,314	
不動テトラ	104.7	88	21,296	
大末建設	57	4.4	3,718	
鉄建建設	90	71	30,104	
日鉄住金テックスエンジ	24	22	12,958	
西松建設	194	125	54,625	
三井住友建設	398.5	471.6	79,700	
大豊建設	46	32	19,904	
前田建設工業	91	78	68,094	
佐田建設	51	40	5,640	
ナカノフドー建設	11.3	8.9	3,684	
奥村組	131	110	64,900	
大和小田急建設	8	6.3	5,852	
東鉄工業	17.8	14	39,466	
イチケン	16	13	4,264	
浅沼組	45	37	5,624	
戸田建設	172	146	75,628	
熊谷組	160	146	55,626	
青木あすなろ建設	9	7	6,314	
北野建設	31	24	8,688	
植木組	18	14	3,710	
三井ホーム	19	15	8,280	
矢作建設工業	20.2	14.4	11,779	
ビーエス三菱	11.7	12.3	5,178	
東日本ハウス	—	14.4	7,790	
大東建託	56.3	44.1	608,139	
新日本建設	17.6	13.8	6,541	
N I P P O	34	27	51,732	
東亜道路工業	28	22	9,086	
前田道路	46	36	70,560	
日本道路	40	35	22,120	
東亜建設工業	129	87	18,096	
若築建設	80	67	12,730	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東洋建設	46.1	34.8	17,156
五洋建設	176	129	56,373
大林道路	17	14	9,744
世紀東急工業	77	16.9	8,973
福田組	22	17	13,532
住友林業	102	85.7	114,066
日本基礎技術	16.5	14	6,174
日成ビルド工業	38	32	10,016
ヤマダ・エスバイエルホーム	67	53	5,088
巴コーポレーション	18.4	14.4	6,782
バナホーム	55	43	36,120
大和ハウス工業	407	340.4	807,428
ライト工業	30.9	18.6	18,376
積水ハウス	395	360.7	627,257
日特建設	18	15.6	7,909
北陸電気工事	7	6	4,254
ユアテック	23	18	15,228
西部電気工業	12	10	4,870
四電工	13	10	4,850
中電工	21.4	16.8	40,706
関電工	67	53	38,372
きんでん	99	77	114,730
東京エネシス	15	13	13,260
トーエネック	21	16	9,696
住友電設	10.2	9.2	12,466
日本電設工業	24	18.9	33,604
協和エクシオ	58.1	49.3	63,350
新日本空調	12.5	9.8	9,760
NDS	22	19	5,947
九電工	27	21	27,531
三機工業	32	23.6	21,877
日揮	149	117	278,050
中外炉工業	44	35	9,870
ヤマト	13	10	4,410
太平電業	22	16	13,808
高砂熱学工業	42.3	32.4	50,414
三晃金属工業	16	11	2,970
朝日工業社	17	13	6,214
明星工業	22	20.4	13,280

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大気社	19.6	16.6	49,800
ダイダシ	20	16	13,632
日比谷総合設備	18.2	15	26,070
東芝プラントシステム	24.1	18.9	31,298
OSJBホールディングス	—	15.8	3,950
東洋エンジニアリング	79	56	18,760
千代田化工建設	118	84	86,604
新興プランテック	30.4	23.9	22,991
<b>食料品 (4.1%)</b>			
日本製粉	91	71	43,523
日清製粉グループ本社	147.8	127.5	183,855
日東富士製粉	12	9	3,267
昭和産業	61	48	24,384
鳥越製粉	11.8	9.2	6,587
協同飼料	51	—	—
中部飼料	14.2	11.1	7,636
日本配合飼料	45	—	—
フィード・ワンホールディングス	—	69.9	8,388
東洋精糖	22	18	1,872
日本甜菜製糖	76	59	12,508
三井製糖	58	46	20,608
塩水港精糖	8.6	12.4	3,496
森永製菓	145	105	45,360
中村屋	34	27	14,823
江崎グリコ	51	26.8	130,650
名糖産業	6.6	5.1	6,130
不二家	85	66	12,870
山崎製パン	109	85	182,325
第一屋製パン	20	16	2,032
モロゾフ	23	18	6,912
亀田製菓	8.3	6.5	30,777
寿スピリッツ	—	2.8	7,338
カルビー	54.4	43	223,170
森永乳業	125	104	49,296
六甲バター	6.6	5.2	6,245
ヤクルト本社	86.7	62.3	518,959
明治ホールディングス	43.9	34.4	507,056
雪印メグミルク	32	27.3	41,031
プリマハム	74	65	22,100

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本ハム	103	85	241,230	
伊藤ハム	81	64	45,760	
林兼産業	48	37	3,922	
丸大食品	71	60	25,020	
米久	4.7	3.7	6,915	
S Foods	9.5	7.3	15,293	
サッポロホールディングス	243	190	92,910	
アサヒグループホールディングス	298	233.7	906,288	
キリンホールディングス	634	497.4	824,191	
宝ホールディングス	116	91.2	84,268	
オエノンホールディングス	35	30	6,720	
養命酒製造	11	7	7,028	
コカ・コーラウエスト	45.7	39.4	78,051	
コカ・コーライーストジャパン	30.6	35.3	83,661	
サントリー食品インターナショナル	76.2	69.7	361,046	
ダイドードリンコ	6.8	5.9	28,821	
伊藤園	40.3	34.5	87,216	
キーコーヒー	14	10.2	19,043	
ユニカフェ	4	3.1	3,317	
ジャパンフーズ	1.9	1.5	1,809	
日清オイリオグループ	64	56	26,768	
不二製油	36	31	58,466	
かどや製油	1.5	1.1	3,159	
J-オイルミルズ	62	49	21,560	
キッコーマン	121	95	364,325	
味の素	353	268	731,908	
キュービー	75.4	59.1	169,971	
ハウス食品グループ本社	52.1	43	112,359	
カゴメ	57.3	44.9	85,265	
焼津水産化学工業	6.9	5.5	5,940	
アリアケジャパン	13.5	10.6	43,142	
エバラ食品工業	—	1.9	4,121	
ニチレイ	158	124	82,832	
東洋水産	73	60.7	276,488	
イートアンド	0.8	1.3	2,672	
日清食品ホールディングス	57.9	49.2	305,040	
永谷園	14	11	12,980	
一正蒲鉾	—	2	4,524	
フジッコ	15	11	21,857	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ロック・フィールド	7.7	6	14,994	
日本たばこ産業	821.6	644.2	2,459,233	
ケンコーマヨネーズ	4.8	3.8	6,327	
わらべや日洋	8.7	6.8	15,266	
なとり	6.8	5.3	8,347	
ユウグレナ	—	25.3	49,031	
ミヨシ油脂	51	40	5,600	
理研ビタミン	—	3.4	14,484	
<b>繊維製品 (0.8%)</b>				
片倉工業	15.9	13.6	17,435	
グンゼ	112	88	29,920	
東洋紡	585	430	74,820	
ユニチカ	380	316	17,696	
富士紡ホールディングス	72	53	16,430	
日清紡ホールディングス	88	69	84,042	
倉敷紡績	142	111	24,864	
シキボウ	80	62	7,688	
日本毛織	44	34	28,798	
大東紡織	21	16	1,200	
トーア紡コーポレーション	59	49	3,675	
ダイドリーミテッド	15.5	12.1	6,642	
帝国繊維	14.5	11.4	19,836	
帝人	566	444	184,260	
東レ	1,005	841	884,311	
サカイオーベックス	37	29	5,858	
住江織物	38	27	8,424	
日本フェルト	7.7	5.8	3,410	
イチカワ	9	7	2,128	
日本バイリーン	14	15	9,105	
日東製網	16	13	2,184	
芦森工業	30	23	3,680	
アツギ	116	91	11,284	
ダイニック	26	21	4,011	
セーレン	37.2	27.1	29,484	
東海染工	19	15	2,010	
小松精練	23	18.1	10,516	
ワコールホールディングス	82	65	94,770	
ホギメディカル	8.7	6.8	40,936	
レナウン	33.3	26.3	3,340	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
クラウディア	1.6	2.5	1,592	
T S Iホールディングス	66.6	48.5	40,546	
三陽商会	73	57	17,784	
ナイガイ	51	40	2,480	
オンワードホールディングス	92	78	65,988	
ルック	25	18	4,122	
キムラタン	463	484	4,840	
ゴールドウイン	32	25	19,550	
デサント	32	24.8	35,811	
キング	6.9	5.4	2,430	
ヤマトインターナショナル	8.3	7.1	2,932	
<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>				
特種東海製紙	81	63	18,522	
王子ホールディングス	612	446	230,582	
日本製紙	71.6	52.4	97,568	
三菱製紙	197	166	14,442	
北越紀州製紙	94.5	67.4	38,687	
中越パルプ工業	53	41	10,291	
巴川製紙所	21	17	4,522	
大王製紙	48	48	52,560	
レンゴー	111	96	50,784	
トーモク	44	34	9,962	
ザ・バック	9.8	7.7	19,103	
<b>化学 (6.1%)</b>				
クラレ	220.2	185	300,070	
旭化成	864	678	821,736	
共和レザー	9.1	7.1	5,893	
コープケミカル	21	16	1,552	
昭和電工	923	723	112,065	
住友化学	1,020	800	496,000	
日本化成	26	20	2,980	
住友精化	29	23	20,171	
日産化学工業	94.9	71.3	179,176	
ラサ工業	52	41	5,822	
クレハ	97	76	40,508	
多木化学	9	7	5,096	
テイカ	23	18	8,046	
石原産業	249	182	21,112	
片倉チッカリン	9	7	2,191	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本曹達	89	70	51,660	
東ソー	370	271	158,264	
トクヤマ	215	169	45,123	
セントラル硝子	132	111	62,604	
東亜合成	163	136	75,072	
ダイソー	55	43	18,490	
関東電化工業	33	26	20,072	
電気化学工業	277	225	109,800	
信越化学工業	248.5	194.9	1,591,163	
日本カーバイド工業	40	37	8,880	
堺化学工業	56	44	17,952	
エア・ウォーター	114	96	210,912	
大陽日酸	178	140	236,320	
日本化学工業	51	40	10,960	
日本パーカライジング	33	25.6	74,163	
高圧ガス工業	21	16	10,208	
チタン工業	16	13	3,120	
四国化成工業	20	16	15,936	
戸田工業	25	22	9,350	
ステラ ケミファ	7.1	5.5	7,683	
保土谷化学工業	41	33	6,831	
日本触媒	117	85	153,425	
大日精化工業	54	45	28,485	
カネカ	173	147	128,772	
三菱瓦斯化学	218	187	111,639	
三井化学	630	494	191,672	
J S R	127.1	107.3	228,441	
東京応化工業	26.8	22.5	91,012	
大阪有機化学工業	9.2	7.8	4,048	
三菱ケミカルホールディングス	866.3	679.3	505,602	
日本合成化学工業	28	25	20,300	
ダイセル	180	152.8	233,172	
住友ベークライト	108	102	56,610	
積水化学工業	284	252	398,160	
日本ゼオン	109	94	105,468	
アイカ工業	38.9	32.7	91,952	
宇部興産	698	547	108,853	
積水樹脂	19.4	16.8	28,341	
タキロン	32	23	12,673	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
旭有機材工業	49	38	10,260	
日立化成	59.9	53.7	142,143	
ニチバン	14	11	5,104	
リケンテクノス	22	17.6	7,920	
大倉工業	33	26	9,204	
積水化成成品工業	39	31	14,384	
群栄化学工業	37	29	10,121	
タイガースポリマー	6.8	5.3	4,616	
ミライアル	3.4	3.9	5,830	
ダイキアクシス	—	1.2	1,329	
ダイキョーニシカワ	—	2.6	9,126	
日本化薬	97	71	106,287	
カーリットホールディングス	11	8.6	5,908	
日本精化	11.5	9	8,640	
ADEKA	59.6	50.1	77,855	
日油	115	90	80,640	
新日本理化	16.4	17.1	3,847	
ハリマ化成グループ	11.8	9.2	4,526	
花王	360.4	292.2	1,765,764	
第一工業製薬	25	24	9,960	
三洋化成工業	44	34	33,456	
大日本塗料	79	62	9,734	
日本ペイントホールディングス	120	94	432,400	
関西ペイント	168	132	300,168	
神東塗料	8	8	1,864	
中国塗料	40	31	34,069	
日本特殊塗料	10.7	8.4	6,837	
藤倉化成	17.5	14.8	8,421	
太陽ホールディングス	11.3	8.8	38,412	
D I C	491	435	149,640	
サカタインクス	28.3	22.2	25,885	
東洋インキＳＣホールディングス	125	107	62,809	
T&K TOKA	5	3.6	8,708	
富士フイルムホールディングス	317.1	248.7	1,070,777	
資生堂	246.5	193.3	425,839	
ライオン	160	125	92,625	
高砂香料工業	50	36	19,980	
マンダム	13.9	10.9	48,941	
ミルボン	8.8	6.4	23,104	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ファンケル	32.1	25.2	39,639	
コーセー	22.4	17.6	117,568	
コタ	—	3.1	6,206	
ドクターシーラボ	9.4	7.4	32,486	
シーボン	1.2	1.2	3,672	
ポーラ・オルビスホールディングス	14.1	12.9	82,431	
ノエビアホールディングス	9.2	6.9	16,787	
アジュバンコスメジヤパン	1.6	2	1,864	
エステー	8.5	7.4	7,829	
アグロ カネショウ	—	2.9	2,610	
コニン	10	8.5	17,391	
長谷川香料	17.5	13.8	24,522	
星光PMC	5.7	5.9	5,599	
小林製薬	22.7	17.8	155,038	
荒川化学工業	11.6	9.2	11,960	
メック	10.7	8.4	7,215	
日本高純度化学	0.039	3.1	7,932	
J C U	2	3	16,230	
新田ゼラチン	8.3	6.5	5,466	
アース製薬	10	7.8	32,370	
イハラケミカル工業	21.3	16.7	29,241	
北興化学工業	14	12	4,884	
大成ラミック	3.6	3	8,919	
クミアイ化学工業	29	22.4	22,691	
日本農薬	32	24.8	30,727	
アキレス	110	92	14,536	
有沢製作所	23.1	18.2	20,111	
日東電工	114.2	84	694,932	
レック	4.3	3.7	5,746	
きもと	10.1	19.4	5,761	
藤森工業	11.9	9.3	32,782	
前澤化成工業	9.7	7.6	9,750	
J S P	9	8.1	18,403	
エフビコ	6.8	9.6	42,240	
天馬	11	8.4	16,321	
信越ポリマー	27.2	21.3	12,524	
東リ	36	28	7,896	
ニフコ	30.9	24.2	103,818	
日本バルカー工業	58	45	14,760	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ユニ・チャーム	85	220	705,760
<b>医薬品 (5.1%)</b>			
協和発酵キリン	166	130	210,730
武田薬品工業	519.1	407.1	2,592,412
アステラス製薬	319.1	1,237.5	2,475,000
大日本住友製薬	98.1	76.9	116,811
塩野義製薬	216.4	169.7	709,346
田辺三菱製薬	115.3	126.6	267,505
わかもと製薬	16	12	3,744
あすか製薬	16.3	12.8	15,974
日本新薬	32	25	106,375
ピオフェルミン製薬	2.2	1.8	5,376
中外製薬	138	108.2	421,439
科研製薬	50	37	143,745
エーザイ	170.6	143.3	1,296,865
ロート製薬	58.1	49.4	85,462
小野薬品工業	62.9	49.4	691,600
久光製薬	43	30.7	152,272
有機合成薬品工業	9	7	2,009
持田製薬	10.2	7.8	63,258
参天製薬	50.9	39.9	361,095
扶桑薬品工業	47	37	12,099
日本ケミファ	19	14	8,778
ツムラ	40.7	34.2	103,284
日医工	32.4	25.4	72,263
キッセイ薬品工業	25.7	20.2	74,134
生化学工業	28.9	20.8	45,676
栄研化学	10.7	9.1	17,836
日水製薬	5.6	4.4	6,516
鳥居薬品	9.5	7.4	24,383
JCRファーマ	8	8.4	20,874
東和薬品	7.1	5.5	38,170
富士製薬工業	3.9	3.1	7,362
沢井製薬	21.9	17.2	126,248
ゼリア新薬工業	21.8	22.2	46,464
第一三共	436.9	365.4	738,838
キョーリン製薬ホールディングス	36.9	29	86,304
大幸薬品	6.6	4.8	9,460
ダイト	4.6	4.4	11,677

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大塚ホールディングス	275	215.6	808,392
大正製薬ホールディングス	33.3	26.1	238,554
<b>石油・石炭製品 (0.4%)</b>			
日本コークス工業	111.8	97.4	11,688
昭和シェル石油	123.9	97.1	109,528
コスモ石油	383	300	50,100
ニチレキ	17	13	14,599
東燃ゼネラル石油	209	164	178,596
ユシロ化学工業	7.5	6.4	10,227
ピーピー・カストロール	5.7	4.4	5,803
富士石油	35.3	25.2	10,281
MORESCO	3.3	2.8	5,639
出光興産	65.7	51.5	111,137
JXホールディングス	1,537.8	1,205.8	581,195
<b>ゴム製品 (0.9%)</b>			
横浜ゴム	155	121	148,830
東洋ゴム工業	115	49.2	115,177
ブリヂストン	434.2	340.5	1,639,167
住友ゴム工業	108.1	84.7	185,577
藤倉ゴム工業	8.7	9.1	6,952
オカモト	48	37	17,464
フコク	5.8	4.5	5,467
ニッタ	13.7	10.7	35,738
住友理工	25.6	20.1	21,708
三ツ星ベルト	35	28	27,440
バンドー化学	50	40	19,080
<b>ガラス・土石製品 (0.9%)</b>			
日東紡績	102	80	38,240
旭硝子	683	535	425,860
日本板硝子	668	524	62,356
石塚硝子	18	14	3,262
日本山村硝子	55	43	7,697
日本電気硝子	286	208	129,168
オハラ	5.2	4.1	2,443
住友大阪セメント	263	202	74,740
太平洋セメント	814	678	252,216
デイ・シイ	14.2	11.1	5,205
日本ヒューム	13	11.3	9,718
日本コンクリート工業	25	18.6	9,132



銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
三谷セキサン	6.9	5.4	10,692	
ジャパンバイル	12.5	14.5	10,208	
東海カーボン	129	94	32,900	
日本カーボン	73	57	18,525	
東洋炭素	8.5	6	13,926	
ノリタケカンパニーリミテド	78	61	17,934	
TOTO	204	160	279,360	
日本碍子	175	137	356,748	
日本特殊陶業	119	93.6	311,220	
ダントーホールディングス	18	14	2,198	
MARUWA	3.6	3.2	9,168	
品川リフラクトリーズ	35	27	8,343	
黒崎播磨	30	23	6,049	
ヨータイ	8	6	2,400	
イソライト工業	5	5.4	1,225	
東京窯業	17	13	2,899	
ニッカトー	4.9	3.9	1,634	
フジミインコーポレーテッド	12.6	10.5	22,291	
エーアンドエーマテリアル	29	23	2,714	
ニチアス	67	48	33,360	
ニチハ	16.9	14.4	20,116	
<b>鉄鋼 (1.5%)</b>				
新日鐵住金	5,856	4,592	1,426,275	
神戸製鋼所	2,209	1,878	430,062	
中山製鋼所	78	81	7,452	
合同製鐵	70	55	9,955	
ジェイ エフ イー ホールディングス	353.4	277.1	771,169	
日新製鋼	58.7	46	68,494	
東京製鐵	76.4	54.9	46,061	
共英製鋼	12.9	11.6	23,362	
大和工業	28.7	24.7	74,223	
東京鐵鋼	29	21	10,626	
大阪製鐵	6.9	6.8	14,470	
淀川製鋼所	98	77	39,193	
東洋鋼板	33	26	14,560	
丸一鋼管	46.3	33.3	96,736	
モリ工業	21	17	7,378	
大同特殊鋼	232	182	101,920	
日本高周波鋼業	54	43	4,988	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本冶金工業	108	84.9	20,630	
山陽特殊製鋼	76	65	32,305	
愛知製鋼	74	64	37,824	
日立金属	123	111	212,121	
日本金属	36	28	4,088	
大太平洋金属	97	69	23,529	
新日本電工	59	66.2	20,058	
栗本鐵工所	72	56	13,272	
虹技	15	15	3,315	
日本鑄鉄管	15	11	2,552	
三菱製鋼	84	71	18,673	
日亜鋼業	19	15	5,175	
日本精線	11	8	5,064	
シンニッタン	13.1	11.2	6,630	
新家工業	30	21	4,200	
<b>非鉄金属 (0.9%)</b>				
大紀アルミニウム工業所	22	18	6,264	
日本軽金属ホールディングス	313.5	263.4	50,572	
三井金属鉱業	353	295	80,830	
東邦亜鉛	78	61	23,912	
三菱マテリアル	864	678	282,048	
住友金属鉱山	358	300	558,000	
DOWAホールディングス	153	130	137,930	
古河機械金属	233	169	37,518	
エス・サイエンス	47.2	52.6	2,472	
大阪チタニウムテクノロジーズ	15.1	10.7	27,830	
東邦チタニウム	23.4	18.4	15,640	
UACJ	176	124	41,912	
古河電気工業	435	319	68,904	
住友電気工業	521.9	409.2	652,469	
フジクラ	222	151	82,899	
昭和電線ホールディングス	177	119	11,424	
東京特殊電線	20	1.5	2,163	
タツタ電線	20.2	20.3	10,434	
沖電線	14	11	3,773	
カナレ電気	1.9	1.7	4,355	
平河ヒューテック	3	2.6	3,463	
リョービ	84	61	22,875	
アーレスティ	—	9.4	7,473	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
アサヒホールディングス	20.9	16.3		35,550
<b>金属製品 (0.7%)</b>				
稲葉製作所	5.9	4.6		6,177
宮地エンジニアリンググループ	45	31		6,200
トーカロ	8.4	7.1		16,535
アルファC o	4.6	3.6		5,119
SUMCO	84.7	74.7		165,385
川田テクノロジーズ	2.9	2		7,470
東洋製罐グループホールディングス	98.4	77.2		141,276
ホッカンホールディングス	33	26		7,644
コロナ	7.2	5.7		6,765
横河ブリッジホールディングス	26	20.5		26,588
O S J Bホールディングス	30.2	—		—
駒井ハルテック	27	19		5,054
高田機工	12	9		2,331
三和ホールディングス	117	104.7		94,125
文化シャッター	33	30		30,390
三協立山	16.9	14.2		32,688
アルインコ	—	4.6		5,267
東洋シャッター	3.7	2.7		2,292
L I X I Lグループ	192.9	161.3		475,835
日本ファイルコン	9.1	7.9		3,831
ノーリツ	27.1	21.3		42,259
長府製作所	14.8	11.6		34,556
リンナイ	21.5	20.2		182,002
ダイニチ工業	7	5.5		4,460
日東精工	20	15		5,595
三洋工業	17	14		3,178
岡部	27.3	21.4		24,032
ジーテクト	—	7.4		8,539
中国工業	2.1	1.7		1,489
東ブレ	26.6	20.9		39,772
高周波熱練	20.2	18.7		17,334
東京製鋼	94	73		14,016
サンコール	9	7		4,711
モリテック スチール	7	5.5		1,853
パイオラックス	6.5	5.5		28,820
日本発條	110.3	94.3		116,554
中央発條	18	14		4,942

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
アドバネクス	27	20		3,620
三益半導体工業	11.7	8		11,400
<b>機械 (5.0%)</b>				
日本ドライケミカル	1	1.5		3,576
アタカ大機	9	—		—
日本製鋼所	198	156		82,524
三浦工業	20.6	48.4		66,985
タクマ	43	37		34,299
ツガミ	43	31		24,738
オークマ	90	71		81,508
東芝機械	75	59		30,680
アマダ	212	161.9		188,775
アイダエンジニアリング	32.5	23.7		32,706
滝澤鉄工所	34	34		8,160
富士機械製造	42.2	35.5		50,694
牧野フライス製作所	69	54		56,484
オーエスジー	56.9	49.5		117,859
ダイジェット工業	16	13		2,977
旭ダイヤモンド工業	35.6	29.7		41,995
DMG森精機	81.9	68.5		122,889
ディスコ	15.4	12.6		161,154
日東工器	8.1	6.3		14,175
パンチ工業	—	2.9		3,813
豊和工業	7.7	6.1		4,745
大阪機工	54	42		6,888
石川製作所	31	27		2,727
東洋機械金属	10.2	7.4		3,529
津田駒工業	34	26		3,848
エンシュウ	34	27		3,105
島精機製作所	18	15.3		32,742
日阪製作所	17	13.7		14,672
やまびこ	5.4	4.3		23,994
ベガサスミシン製造	12.7	9.5		5,785
ナブテスコ	63.2	66.1		239,943
三井海洋開発	11.4	10.9		20,481
レオン自動機	13	8.3		4,141
SMC	39.6	32.6		1,190,552
新川	11.5	9		7,452
ホソカワミクロン	23	18		11,538

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ユニオンツール	6	5.4	18,738	
オイレス工業	13.1	13.6	33,116	
日精エー・エス・ビー機械	3.8	3.5	8,904	
サトーホールディングス	14.5	13.5	39,285	
日本エアータック	4.1	3.2	2,121	
日精樹脂工業	10.1	7.9	10,720	
ワイエイシイ	5.6	4.4	3,022	
小松製作所	646.2	538.4	1,318,541	
住友重機械工業	379	297	244,728	
日立建機	70.7	48.5	105,293	
日工	21	15	6,900	
巴工業	4.8	4.1	7,298	
井関農機	142	111	27,417	
TOWA	11.3	8.9	6,408	
丸山製作所	29	24	5,592	
北川鉄工所	63	50	13,000	
クボタ	723	524	1,052,454	
荏原実業	3.6	3.2	4,604	
三菱化工機	46	36	15,660	
月島機械	22	19.1	24,944	
帝国電機製作所	4.7	7.2	8,611	
東京機械製作所	48	41	3,198	
新東工業	32.5	25.5	24,327	
澁谷工業	8.7	9.1	21,931	
アイチ コーポレーション	19.6	15.4	9,532	
小森コーポレーション	33.7	26.4	42,530	
鶴見製作所	10	8.1	14,094	
住友精密工業	22	17	8,228	
酒井重工業	26	21	5,985	
荏原製作所	306	225	120,825	
石井鐵工所	20	16	3,648	
西島製作所	14.7	10.6	9,614	
北越工業	—	8	7,920	
ダイキン工業	180.6	151.1	1,217,714	
オルガノ	21	21	10,479	
トーヨーカネツ	74	63	14,742	
栗田工業	83.2	61.4	184,814	
椿本チエイン	71	55	54,945	
大同工業	27	21	5,754	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本コンベヤ	43	34	7,174	
木村化工機	12.7	10	5,740	
アネスト岩田	22	16.2	12,636	
ダイフク	56	51.3	82,439	
サムコ	1.7	1.4	1,745	
加藤製作所	31	23	18,745	
油研工業	26	20	5,400	
タダノ	59	50	82,500	
フジテック	39	30.2	39,380	
CKD	37.1	29.1	34,134	
キトー	7.8	11.3	14,125	
平和	28.7	22.5	55,395	
理想科学工業	10.2	12.6	26,334	
SANKYO	40.1	31.4	141,300	
日本金銭機械	12.2	9.6	17,376	
マースエンジニアリング	7.5	5.9	13,251	
福島工業	7.3	5.7	9,370	
オーイズミ	4.6	3.6	3,384	
ダイコク電機	5.5	4.3	8,096	
アマノ	37.8	34.6	50,619	
JUKI	85	77	32,417	
サンデン	75	63	37,674	
蛇の目マシン工業	128	101	13,938	
マックス	21	16	23,168	
グローリー	39.5	33.2	112,382	
新晃工業	9.2	7.2	9,655	
大和冷機工業	21	15	11,430	
セガサミーホールディングス	142.2	111.5	208,393	
日本ピストンリング	52	40	10,400	
リケン	52	45	22,230	
T P R	14.7	11.6	37,932	
ホンザキ電機	28.9	22.7	178,649	
大豊工業	9.4	8.4	12,415	
日本精工	294	213	381,057	
N T N	306	240	150,240	
ジェイテクト	140.6	110.6	212,462	
不二越	123	96	62,976	
日本トムソン	42	36	21,852	
T H K	82.5	69	217,695	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ユーシン精機	5.9	4.6	11,049
前澤給装工業	5	3.9	6,017
イーグル工業	16.4	14.4	35,438
前澤工業	9.7	7.6	2,644
日本ビラー工業	14.4	11.3	11,367
キッツ	59.4	46.5	28,179
日立工機	35.4	27.8	28,495
マキタ	86.3	67.7	439,373
日立造船	98.1	81.1	51,579
三菱重工業	2,356	1,739	1,183,389
I H I	913	747	426,537
<b>電気機器 (13.1%)</b>			
イビデン	80.6	68	143,412
コニカミノルタ	349.5	247.2	315,180
ブラザー工業	171	134.1	266,054
ミネベア	180	154	304,766
日立製作所	3,183	2,491	2,091,692
東芝	2,611	2,184	1,160,796
三菱電機	1,323	1,037	1,516,094
富士電機	368	289	162,418
東洋電機製造	28	20	8,600
安川電機	145	122.1	217,704
シンフォニアテクノロジー	80	72	14,976
明電舎	122	95	38,285
オリジン電気	19	15	7,845
山洋電気	20	23	19,757
デンヨー	13	9.4	17,371
東芝テック	83	74	58,460
芝浦メカトロニクス	23	17	5,168
マブチモーター	18.7	31.7	202,880
日本電産	71.5	112.2	906,351
東光高岳	7.4	5.2	9,183
宮越ホールディングス	4.5	3.5	1,809
ダイヘン	78	57	34,542
田淵電機	—	8.8	12,038
ヤーマン	1.7	1.3	2,262
JVCケンウッド	91.4	76.1	27,776
第一精工	5.5	3.8	10,993
日新電機	27	24	17,328

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大崎電気工業	21	17	13,906
オムロン	149.3	112	621,600
日東工業	19.4	16.6	38,196
I D E C	17.3	12.3	13,517
不二電機工業	—	1	1,386
ジーエス・ユアサ コーポレーション	255	200	113,800
サクサホールディングス	33	26	5,694
メルコホールディングス	6.4	5.7	12,870
テクノメディカ	3	2.3	5,745
日本電気	1,819	1,342	477,752
富士通	1,276	1,000	867,000
沖電気工業	511	359	93,340
岩崎通信機	62	45	4,140
電気興業	38	29	17,023
サンケン電気	72	53	44,202
ナカヨ	13	10	4,000
アイホン	7.6	6	11,106
ルネサスエレクトロニクス	68.5	53.7	46,826
セイコーエプソン	90.3	70.8	334,176
ワコム	104.2	81.7	52,369
アルバック	24.3	17.7	33,895
アクセル	6.6	4.8	8,059
ビクセラ	5.5	—	—
E I Z O	12.1	9.5	25,802
ジャパンディスプレイ	—	159.8	69,672
日本信号	36.5	28.6	34,691
京三製作所	31	24	9,456
能美防災	17	13.7	20,659
ホーチキ	10	7.5	6,337
エレコム	4.8	3.2	8,115
日本無線	34	22	9,372
パナソニック	1,511.6	1,264.3	1,955,239
シャープ	954	877	218,373
アンリツ	76.9	64.9	56,657
富士通ゼネラル	31	32	46,176
日立国際電気	26	27	45,792
ソニー	725.4	678	2,219,094
T D K	79.9	62.6	574,042
帝国通信工業	31	25	6,400

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ミツミ電機	50.3	36.6	33,562
タムラ製作所	51	40	18,520
アルプス電気	97	81.9	247,338
池上通信機	42	35	6,580
パイオニア	183.5	155.9	34,765
日本電波工業	11.9	9.4	10,114
鈴木	—	1.3	1,561
日本トリム	2.8	2.5	7,650
ローランド ディー. ジー.	5.9	4.2	14,196
フォスター電機	13.5	10.6	33,496
クラリオン	81	55	19,305
SMK	39	31	16,151
ヨコオ	11.1	8.1	5,613
東光	62	24	8,280
ティアック	71	56	3,360
ホシデン	38.8	31.4	22,294
ヒロセ電機	23	16.8	284,424
日本航空電子工業	34	30	92,850
TOA	14.2	11.1	13,486
日立マクセル	—	15.5	34,363
古野電気	12.8	12.3	14,341
ユニデン	42	28	6,468
アルパイン	28.7	24.7	48,239
スミダコーポレーション	10.8	9.3	6,175
アイコム	7.3	5.7	17,271
リオン	3.7	2.9	4,509
船井電機	13.4	10.5	15,760
横河電機	143.5	103.8	138,054
新電元工業	42	40	24,840
アズビル	40.1	33.9	113,734
東亜ディーケーケー	4.9	4.3	2,928
日本光電工業	28.2	22.1	140,998
チノー	24	3.7	4,554
共和電業	16	12.7	5,930
日本電子材料	5.7	4.4	3,599
堀場製作所	24.5	19.2	91,968
アドバンテスト	90.2	70.7	117,715
小野測器	14	5.2	5,200
エスベック	13.7	11.5	14,513

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
パナソニック デバイスSUNX	11.6	9.1	8,044
キーエンス	30	23.5	1,590,010
日置電機	6.9	5.4	10,843
シスメックス	55.4	80.3	519,541
メガチップス	11.9	10.8	15,400
OBARA GROUP	8.6	6.7	46,498
日本電産コバル電子	13.6	—	—
澤藤電機	8	6	1,542
コーセル	19.2	15.1	20,173
新日本無線	10	8	4,008
オプテックス	8.4	7.1	17,870
千代田インテグレ	5.8	4.6	12,870
レーザーテック	10.2	10.6	17,606
スタンレー電気	95.3	74.5	207,855
岩崎電気	48	35	8,225
ウシオ電機	80.3	63	100,737
岡谷電機産業	7.1	5.6	2,766
ヘリオス テクノ ホールディング	11.2	9.6	5,097
日本セラミック	7.6	5.9	9,876
遠藤照明	5.5	4.8	7,041
日本デジタル研究所	9.8	8.7	14,007
古河電池	9	7	6,251
双信電機	6.4	5.1	2,147
山一電機	14.4	12	11,772
図研	8.6	7.5	8,280
日本電子	51	44	26,752
カシオ計算機	137.6	104	234,312
ファナック	147.6	108	2,911,680
日本シイエムケイ	31.1	26.4	8,316
エンプラス	5	4.7	23,053
大真空	18	19	6,517
ローム	69.9	51.1	449,680
浜松ホトニクス	51.6	43.2	318,816
三井ハイテック	17.4	13.7	12,905
新光電気工業	44.4	39.2	36,024
京セラ	235.8	170.3	1,174,048
太陽誘電	64.3	54.3	97,631
村田製作所	138.8	108.8	1,929,024
ユーション	18.4	14.4	11,260

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
双葉電子工業	24.5	17.7	35,400	
北陸電気工業	53	45	9,135	
ニチコン	41.7	32.7	38,324	
日本ケミコン	92	84	31,416	
KOA	16.6	14.3	17,617	
市光工業	32	25	6,025	
小糸製作所	73	62.2	235,427	
ミツバ	24.3	19.1	51,073	
スター精密	25.1	19.7	33,824	
SCREENホールディングス	125	98	94,962	
キャノン電子	12.1	9.5	23,455	
キャノン	767.1	601.5	2,528,706	
リコー	397.8	311.9	422,000	
MUTOHホールディングス	18	14	6,384	
東京エレクトロン	118.7	87.3	768,676	
<b>輸送用機器 (11.8%)</b>				
トヨタ紡織	46.3	36.3	56,446	
鬼怒川ゴム工業	25	24	13,224	
ユニプレス	21.4	19.9	48,635	
豊田自動織機	120.5	94.5	668,115	
モリタホールディングス	23	18.1	21,177	
三櫻工業	16.8	13.2	11,880	
デンソー	326.9	256.3	1,453,221	
東海理化電機製作所	34.8	27.3	78,787	
三井造船	512	402	84,420	
佐世保重工業	93	—	—	
川崎重工業	1,030	754	473,512	
名村造船所	19.4	28.9	33,813	
サノヤスホールディングス	12.1	12.6	3,628	
日本車輛製造	48	38	13,376	
ニチユ三菱フォークリフト	15	11.9	8,460	
近畿車輛	23	16	6,288	
日産自動車	1,857.2	1,456.2	1,866,120	
いすゞ自動車	767	328	551,696	
トヨタ自動車	1,841.4	1,431.3	12,445,153	
日野自動車	165.2	148.1	263,618	
三菱自動車工業	414.4	380.2	421,641	
エフテック	5.5	5.9	6,926	
レシップホールディングス	—	3.4	2,961	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
GMB	1.3	1.5	2,050	
ファルテック	—	1.1	1,879	
武蔵精密工業	14.1	11.1	28,515	
日産車体	65	45.6	72,960	
新明和工業	53	42	54,138	
極東開発工業	22.8	19.3	27,116	
日信工業	26.9	19	37,620	
トビー工業	109	85	24,990	
ティラド	51	40	10,600	
曙ブレーキ工業	61.5	43.8	19,578	
タチエス	19.5	16.4	28,962	
NOK	64	50.2	187,246	
フタバ産業	40.3	31.6	18,359	
カヤバ工業	125	116	53,708	
シロキ工業	29	23	7,314	
大同メタル工業	18	14.5	18,154	
プレス工業	52	51	25,551	
カルソニックカンセイ	90	79	62,173	
太平洋工業	26.9	21.1	21,395	
ケーヒン	30.4	23.8	48,575	
河西工業	18	12.7	12,839	
アイシン精機	121.1	94.9	420,881	
富士機工	15	12	7,080	
マツダ	1,972	309.2	774,700	
ダイハツ工業	140.4	123.8	228,534	
今仙電機製作所	9.8	8.8	14,247	
本田技研工業	1,190.7	933.6	3,837,096	
スズキ	276.6	216.9	801,228	
富士重工業	450.3	353.1	1,449,828	
安永	—	3.4	2,261	
ヤマハ発動機	201.2	157.8	449,572	
ショーワ	31.2	24.5	30,747	
TBK	15	13.3	8,645	
エクセディ	16	14.1	40,368	
豊田合成	42.7	33.5	95,307	
愛三工業	16.1	16.1	17,806	
盟和産業	—	8	1,264	
ヨロズ	9.7	9.7	24,424	
エフ・シー・シー	21.6	15.3	30,600	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
シマノ	57.1	44.8	842,240	
タカタ	23.9	18.8	25,060	
テイ・エス テック	27.9	21.9	72,817	
<b>精密機器 (1.5%)</b>				
テルモ	101.4	159	531,855	
クリエートメディック	4.4	3.4	3,488	
日機装	42.9	33.6	36,220	
島津製作所	170	124	173,724	
JMS	24	19	5,738	
クボテック	3.4	2.2	715	
ショットモリテックス	2.9	2.4	588	
長野計器	8.5	6.6	4,917	
ブイ・テクノロジー	0.027	2	4,988	
東京計器	46	36	9,756	
愛知時計電機	17	14	4,718	
オーバル	—	7.6	2,538	
東京精密	23.7	18.6	53,995	
マニー	4	2.9	24,041	
ニコン	247	193.7	324,060	
トプコン	35.5	31.3	92,898	
オリンパス	197.1	154.5	699,112	
理研計器	11.7	9.1	11,966	
タムロン	10.2	8	20,832	
HOYA	321.7	246.9	1,294,002	
ノーリツ鋼機	11.9	9.3	6,528	
ユー・アンド・デイ	12	9.4	4,718	
シチズンホールディングス	162.9	127.7	121,059	
リズム時計工業	60	45	7,560	
大研医器	4.6	7.2	9,187	
松風	6.5	5.1	7,083	
セイコーホールディングス	85	73	46,063	
ニプロ	70.4	66.3	80,156	
<b>その他製品 (1.5%)</b>				
パラマウントベッドホールディングス	12.7	10.9	35,425	
SHO-BI	3.9	3.5	1,410	
前田工織	9.6	10.3	11,247	
永大産業	17	15	6,945	
アートネイチャー	4.2	7.5	8,775	
ダンロップスポーツ	7.1	6.5	8,053	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
バンダイナムコホールディングス	145.9	114.4	266,437	
共立印刷	24	18.8	5,715	
フランスベッドホールディングス	83	72	13,176	
パイロットコーポレーション	11.5	9	61,560	
萩原工業	—	2.2	4,573	
トッパン・フォームズ	23.6	18.5	25,641	
フジシールインターナショナル	16.1	12.6	42,273	
タカラトミー	43.5	37.2	27,081	
廣済堂	12.3	9.6	5,875	
Asmeエステール	—	2.8	2,346	
アーク	39.2	32.7	4,447	
タカノ	5.8	4.6	2,875	
プロネクサス	13.4	10.5	8,683	
ホクシン	9.2	8.4	1,142	
ウッドワン	22	17	4,692	
大建工業	54	42	11,886	
凸版印刷	374	293	280,108	
大日本印刷	403	316	385,994	
図書印刷	21	17	6,069	
共同印刷	41	32	11,968	
日本写真印刷	22.2	17.4	38,836	
光村印刷	12	9	2,565	
宝印刷	7.4	5.4	5,891	
アシックス	131.4	103.1	353,117	
ツツミ	6.6	5.2	14,398	
ローランド	12.7	—	—	
小松ウオール工業	4.5	3.2	8,371	
ヤマハ	97.2	76.2	168,783	
河合楽器製作所	46	3.6	8,733	
クリナップ	13.5	9.5	8,768	
ビジョン	21.7	19.6	190,708	
兼松日産農林	20	13	1,937	
キングジム	11	8.6	6,837	
リンテック	31.5	24.7	72,766	
TASAKI	2.6	1.9	4,069	
イトーキ	27.8	21.8	16,633	
任天堂	81.5	63.9	1,185,664	
三菱鉛筆	10.9	8.5	37,697	
タカラスタンダード	55	43	44,333	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コクヨ	68.8	53.9	62,470
ナカバヤシ	28	22	5,060
グローブライド	69	50	10,150
岡村製作所	51	39.8	37,173
美津濃	66	56	37,072
アデランス	16.5	12	14,724
<b>電気・ガス業 (1.9%)</b>			
東京電力	1,122.3	880	403,040
中部電力	436	317.4	461,817
関西電力	539.9	423.3	477,694
中国電力	182.9	143.4	231,877
北陸電力	129.6	101.6	166,319
東北電力	330.5	259.2	357,696
四国電力	119.1	93.4	140,847
九州電力	292.2	229.1	258,195
北海道電力	123.8	97.1	92,439
沖縄電力	8.6	6.8	28,186
電源開発	82.1	75.2	296,288
東京瓦斯	1,551	1,261	967,691
大阪瓦斯	1,369	1,074	546,773
東邦瓦斯	336	264	180,048
北海道瓦斯	26	20	5,820
西部瓦斯	149	117	31,239
静岡瓦斯	34.4	29.5	23,511
メタウォーター	—	4.8	11,851
<b>陸運業 (4.3%)</b>			
SBSホールディングス	2.8	7.7	6,622
東武鉄道	751	554	329,630
相鉄ホールディングス	227	178	106,800
東京急行電鉄	779	564	454,020
京浜急行電鉄	340	284	290,248
小田急電鉄	424	332	445,212
京王電鉄	370	290	299,570
京成電鉄	198	156	252,408
富士急行	36	28	31,780
新京成電鉄	17	13	5,629
東日本旅客鉄道	243.4	190.1	2,002,703
西日本旅客鉄道	119.4	99.9	705,294
東海旅客鉄道	118.5	92.9	2,217,987

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
西武ホールディングス	—	82.7	264,640
鴻池運輸	7	6.4	16,422
西日本鉄道	171	134	80,266
ハマキョウレックス	3.8	3.2	13,632
サカイ引越センター	2.1	1.8	7,290
近畿日本鉄道	1,332	1,044	503,208
阪急阪神ホールディングス	888	696	547,056
南海電気鉄道	276	232	122,264
京阪電気鉄道	279	232	175,160
神戸電鉄	32	25	9,325
名糖運輸	5.4	4.3	3,612
名古屋鉄道	462	378	198,450
山陽電気鉄道	48	38	18,126
日本通運	524	411	278,658
ヤマトホールディングス	246.4	182.4	534,158
山九	161	126	68,670
丸運	8.3	5.6	1,489
丸全昭和運輸	44	35	14,875
センコー	53	43	34,701
トナミホールディングス	27	21	9,492
日本梱包運輸倉庫	40.4	33.9	75,156
日本石油輸送	15	12	3,132
福山通運	80	63	41,454
セイノーホールディングス	94	80.3	108,405
神奈川中央交通	16	12	7,488
日立物流	27.6	21.6	40,953
<b>海運業 (0.3%)</b>			
日本郵船	1,118	876	332,004
商船三井	743	544	230,112
川崎汽船	579	454	158,900
N Sユナイテッド海運	57	45	14,175
乾汽船	15.7	—	—
明治海運	11.8	9.3	3,747
飯野海運	54.8	53.7	35,442
共栄タンカー	11	9	2,151
第一中央汽船	97	102	4,284
<b>空運業 (0.6%)</b>			
日本航空	111.8	198.6	774,540
ANAホールディングス	2,600	2,039	694,075



銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
スカイマーク	28.1	—	—	—
パスコ	12	10	3,610	—
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>				
トランコム	3.8	3	16,320	—
日新	50	39	12,519	—
三菱倉庫	87	68	135,728	—
三井倉庫ホールディングス	66	60	25,740	—
住友倉庫	89	76	54,568	—
滋澤倉庫	31	27	9,909	—
東陽倉庫	23	18	5,544	—
乾汽船	—	6.9	6,969	—
日本トランスシティ	28	24	9,552	—
ケイヒン	24	19	3,876	—
中央倉庫	7.6	6	5,988	—
安田倉庫	10.3	8.1	8,642	—
東洋埠頭	38	32	6,688	—
宇徳	10.7	8.4	5,208	—
上組	158	124	153,388	—
サンリツ	3.2	2.5	1,437	—
キムラユニティー	3	2.6	2,841	—
キューソー流通システム	4.2	2.9	4,115	—
郵船ロジスティクス	12.1	9.5	14,953	—
近鉄エクスプレス	11.8	9.3	51,057	—
東海運	7.1	5.6	1,747	—
エアアイティー	4.9	4.8	5,664	—
<b>情報・通信業 (6.6%)</b>				
NECネットエスアイ	14.3	12.8	32,089	—
システナ	12.7	10	9,500	—
デジタルアーツ	3.5	5.5	6,831	—
新日鉄住金ソリューションズ	10.9	8.5	30,770	—
キューブシステム	—	4.4	3,053	—
コア	4.9	4.3	3,951	—
ソフトクリエイトホールディングス	4.2	3.3	3,267	—
ITホールディングス	46.9	33.9	73,325	—
ネオス	2.6	2.7	1,809	—
電算システム	3.1	3.5	5,495	—
グリー	78	62	50,096	—
コーエーテックモホールディングス	25.8	23.1	43,682	—
三菱総合研究所	5.1	4	11,088	—

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ボルテージ	2.3	1.8	1,801	—
電算	0.9	1.1	2,735	—
AGS	—	1.7	1,734	—
ファインデックス	—	1.5	7,950	—
ヒト・コミュニケーションズ	1.4	1.4	2,500	—
ブレインパッド	1	1.5	1,807	—
KL a b	8.8	10.8	14,472	—
ポルトウウィン・ビットクルーホールディ	7.8	6.7	6,834	—
イーブックイニシアティブジャパン	1.9	2.3	2,295	—
ネクソン	108.3	97.3	122,598	—
アイスタイル	4.3	4.3	3,182	—
エムアップ	2.3	2.7	2,162	—
エイチーム	1.2	1.2	6,144	—
e n i s h	1.9	2.7	3,909	—
コロブラ	—	18	48,816	—
モバイルクリエイト	1	6	4,464	—
オルトプラス	—	1.9	1,717	—
ブロードリーフ	12.9	8.4	19,378	—
ハーツユナイテッドグループ	2.9	3.1	5,697	—
ドワンゴ	11.7	—	—	—
ベリサーブ	0.8	1.2	1,327	—
ティーガイア	13	10.2	16,269	—
豆蔵ホールディングス	7.6	8	5,016	—
テクマトリックス	4.2	4.4	3,102	—
GMOペイメントゲートウェイ	5	8.9	24,946	—
ザッパラス	7.3	5.7	3,659	—
インターネットイニシアティブ	19.2	16.7	35,036	—
GMOクラウド	—	1.7	1,553	—
ビットアイル	9.9	11.6	6,403	—
SRAホールディングス	6.3	5.4	9,325	—
システムインテグレータ	1	1.5	688	—
パイブドピッツ	—	1	1,893	—
朝日ネット	12	10.5	5,722	—
コムチュア	1.1	1.7	3,442	—
g u m i	—	7.7	11,727	—
パナソニック インフォメーションシステム	2.6	2.4	9,204	—
フェイス	3.9	3.1	4,051	—
野村総合研究所	73.9	58	266,800	—
サイバネットシステム	10.6	8.4	4,065	—

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
CEホールディングス	—	1.2	1,552	
インテージホールディングス	7.1	5.8	12,609	
東邦システムサイエンス	—	3	1,899	
ソースネクスト	6.5	5.1	3,911	
ティー・ワイ・オー	9.3	10	2,040	
クレスコ	3	2.3	4,397	
フジ・メディア・ホールディングス	126.3	106.6	185,697	
オービック	45	35.3	177,206	
ジャストシステム	—	14	10,346	
TDCソフトウェアエンジニアリング	2.8	2.2	2,536	
ヤフー	945.2	733.8	380,108	
トレンドマイクロ	57.6	54.2	226,285	
インフォメーション・ディベロプメント	—	1.9	1,943	
日本オラクル	20.9	16.4	86,264	
アルファシステムズ	4.3	3.3	5,893	
フューチャーアーキテクト	15.7	10.7	7,950	
CAC Holdings	8	6.9	7,990	
ソフトバンク・テクノロジー	3.1	2.7	3,218	
トーセ	3.2	2.5	2,040	
オービックビジネスコンサルタント	6.6	6.5	27,170	
伊藤忠テクノソリューションズ	14.8	11.6	59,972	
アイティフォー	14.5	12.4	6,150	
東計電算	2.3	1.8	3,304	
エクスネット	1.2	0.9	1,399	
大塚商会	11.7	27.5	147,400	
サイボウズ	19.5	13.7	4,575	
ソフトブレイン	17.8	14	2,674	
アグレックス	3	—	—	
電通国際情報サービス	8	6.3	7,257	
EMシステムズ	1.8	1.2	2,223	
ウェザーニューズ	3.9	3.1	10,943	
C I J	12	9.3	4,557	
東洋ビジネスエンジニアリング	—	1	1,402	
日本エンタープライズ	—	6.9	2,539	
WOWOW	4	2.4	18,528	
フュージョンパートナー	—	4.3	3,878	
日本コロムビア	6.5	3.6	1,432	
イマジカ・ロボット ホールディングス	—	5.4	4,050	
ネットワンシステムズ	51.2	41.6	34,361	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
アルゴグラフィックス	4.9	4.2	7,845	
マーベラス	19.8	17.3	28,147	
エイベックス・グループ・ホールディングス	24	20.3	40,457	
日本ユニシス	31.5	28.3	33,903	
兼松エレクトロニクス	8.2	6.5	12,226	
東京放送ホールディングス	70.4	61.3	96,976	
日本テレビホールディングス	130.1	93.5	191,301	
朝日放送	—	10.1	10,069	
テレビ朝日ホールディングス	33.1	28	55,804	
スカパー J S A Tホールディングス	99.1	77.7	59,440	
テレビ東京ホールディングス	10.6	8.3	18,467	
コネクシオ	11.5	7.2	8,460	
クロップス	—	0.9	493	
日本電信電話	513.1	400.7	3,069,362	
KDD I	405.3	346.7	2,823,524	
光通信	11.8	9.2	73,416	
NTTドコモ	1,075.9	843.6	1,844,109	
GMOインターネット	43.6	34.2	51,129	
KADOKAWA・DWANGO	—	25.1	47,564	
学研ホールディングス	44	34	8,738	
ゼンリン	17.3	13.5	20,398	
昭文社	7.8	6.1	5,618	
KADOKAWA	13	—	—	
インプレスホールディングス	9.1	7.3	1,299	
アイネット	5.5	5.2	5,148	
松竹	86	67	74,705	
東宝	93.2	73.1	221,127	
東映	55	38	34,048	
AOI Pro.	6	4.7	4,258	
エヌ・ティ・ティ・データ	92.2	63.2	331,168	
ビー・シー・エー	—	1.3	2,470	
DTS	12.4	10.6	25,122	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	47.5	39.4	98,894	
シーイーシー	7.7	6.7	5,842	
カブコン	33.4	26.2	61,150	
ジャックステック	8.3	5.9	5,374	
S C S K	31.1	24.3	79,461	
日本システムウエア	4.9	3.8	3,366	
アイネス	17.7	13.9	13,177	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
TKC	11	8.6	21,749
富士ソフト	16.6	14.1	35,066
NSD	27.7	23.9	44,406
コナミ	59	41.6	92,726
福井コンピュータホールディングス	1.8	2.8	2,116
JBCホールディングス	10.9	8.6	6,983
ミロク情報サービス	8.5	6.7	4,669
ソフトバンク	641.2	541.5	3,796,998
<b>卸売業 (4.0%)</b>			
ハウスイ	10	8	1,080
高千穂交易	5.4	3.9	4,149
伊藤忠食品	3.2	2.5	11,200
エレマテック	6.1	4.8	14,832
JALUX	3.7	2.9	6,092
あらた	29	23	7,751
トーマンデバイス	2	1.5	2,977
東京エレクトロン デバイス	2.6	2	3,350
双日	874	685.3	143,913
アルフレッサ ホールディングス	38.6	121.1	210,592
横浜冷凍	32.3	25.3	21,454
神栄	18	15	3,030
山下医科器械	1	0.8	1,407
ラサ商事	5.6	4.8	3,048
アルコニックス	3.9	5.8	10,608
神戸物産	1.4	3.4	14,569
あい ホールディングス	20.9	16.4	36,293
ディーブイエックス	—	3	3,576
ダイワボウホールディングス	119	93	19,158
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24.5	19.2	17,990
八洲電機	10.1	7.9	4,850
UKCホールディングス	8.4	6.6	14,064
OCHIホールディングス	—	2.6	3,684
TOKAIホールディングス	63.8	50	27,550
三洋貿易	4.5	6.1	8,802
ウイン・パートナーズ	—	3.3	4,785
ミタチ産業	3	2.4	1,891
シップヘルスケアホールディングス	18.7	18.7	51,986
明治電機工業	—	2.9	3,256
デリカフーズ	—	1.8	1,949

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	—	0.9	1,451
富士興産	4.7	3.9	2,379
協栄産業	16	12	2,496
小野建	11.3	8.9	9,870
佐島電機	10.3	8.1	6,690
エコートレーディング	3.2	2.3	1,527
伯東	7.9	7	10,171
コンドーテック	10.6	7.4	6,082
中山福	7.5	5.9	5,510
ナガイレーベン	17.3	14.8	31,435
三菱食品	14.3	11.2	28,918
松田産業	9.5	7.4	11,840
メディカルホールディングス	130.6	102.4	165,580
アドヴァン	6.6	5.2	8,158
SPK	3	2.2	5,326
萩原電気	—	2.8	5,336
アズワン	8.5	7.3	26,462
スズデン	4.7	3.3	2,366
尾家産業	4.2	3.3	3,095
シモジマ	9	6.3	7,037
ドウシシャ	13.8	13.2	25,344
小津産業	—	2	4,648
高速	7.8	6.1	5,453
たげびし	—	3.6	4,114
黒田電気	18.8	17.2	33,677
丸文	11.5	9	7,173
ハビネット	7.9	6.2	9,163
トーマンエレクトロニクス	6.6	—	—
橋本総業	—	1.9	2,785
エクセル	6	4.7	6,415
マルカキカイ	4.2	3.3	5,814
ガリバーインターナショナル	43.9	31	31,031
日本エム・ディ・エム	10.9	8.5	5,278
進和	7.7	6	8,574
エスケイジャパン	3.1	2.6	605
ダイトエレクトロン	6	4.7	3,351
シークス	8.3	6.5	18,817
田中商事	4	3.1	2,154
オーハシテクニカ	6.7	6.3	9,878

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
マクニカ	6.7	5.3	20,034	
白銅	4.2	3.3	4,986	
伊藤忠商事	1,041.8	857.1	1,163,513	
丸紅	1,142	895.7	658,608	
高島	24	19	5,396	
長瀬産業	73.9	62.4	101,212	
蝶理	8.3	6.5	12,265	
豊田通商	145.5	114.1	376,530	
三共生興	22.2	17.4	9,117	
兼松	278	204	37,536	
ツカモトコーポレーション	23	18	2,538	
三井物産	1,202.3	868.1	1,478,808	
日本紙パルプ商事	68	53	18,126	
日立ハイテクノロジーズ	39.6	35.5	140,047	
カメイ	17	13.3	12,049	
東都水産	23	17	3,808	
OUGホールディングス	19	16	3,888	
スターゼン	47	40	16,040	
山善	50.1	39.3	39,064	
椿本興業	15	12	3,912	
住友商事	770.6	604.3	833,631	
内田洋行	30	25	9,150	
三菱商事	1,018.9	784.7	1,957,826	
第一実業	30	25	15,925	
キャノンマーケティングジャパン	37.2	29.2	72,737	
西華産業	45	34	11,662	
佐藤商事	11.6	9.1	7,771	
菱洋エレクトロ	15.4	11.8	18,006	
東京産業	13	10.2	5,140	
ユアサ商事	133	9	23,715	
神鋼商事	33	26	7,098	
小林産業	8.6	7.4	1,953	
阪和興業	130	102	52,020	
カナデン	13	10	8,970	
菱電商事	19	16	13,760	
フルサト工業	7.2	5.6	9,676	
岩谷産業	145	113	93,338	
すてきなニスグループ	56	44	8,668	
昭光通商	42	36	5,472	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ニチモウ	20	16	3,392	
極東貿易	15	12	2,772	
イワキ	20	15	3,600	
三菱石油	30	26	21,424	
稲畑産業	32.1	24.5	31,017	
G S I クレオス	35	27	3,510	
明和産業	12	8.2	3,673	
ワキタ	19	21.8	26,160	
東邦ホールディングス	41.8	35.3	75,259	
サンゲツ	23.1	18.4	67,988	
ミツウロコグループホールディングス	21	16.5	9,718	
シナネン	28	22	10,934	
伊藤忠エネクス	28.8	22.6	22,780	
サンリオ	32.9	28.7	97,580	
サンワテクノス	7	6.5	7,787	
リョーサン	19.4	17.2	53,148	
新光商事	14.3	12	14,712	
トーヨー	27	23	10,212	
三信電気	15.6	14.1	14,283	
東陽テクニカ	17.9	15	17,775	
モスフードサービス	17.1	13.4	35,000	
加賀電子	11.8	9.2	13,735	
ソーダニッカ	13	11	6,479	
立花エレテック	7.9	6.3	11,421	
フォーバル	—	2	3,312	
P a l t a c	18.3	16.4	28,782	
太平洋興発	47	40	4,000	
ヤマタネ	65	51	9,282	
丸紅建材リース	11	9	2,493	
日鉄住金物産	86	67	28,475	
トラスコ中山	14.9	12.8	47,296	
オートバックスセブン	45.8	37.7	75,550	
加藤産業	18.8	14.7	36,823	
イノテック	12	9.4	4,577	
イエローハット	11.3	9.6	25,536	
富士エレクトロニクス	6.7	5.3	7,944	
J Kホールディングス	11.8	10.3	6,561	
日伝	5.9	4.2	11,340	
北沢産業	11	8.6	1,625	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
杉本商事	7	5.5	6,957
因幡電機産業	17.9	15.2	67,564
バイテック	4.4	3.5	3,752
ミスミグループ本社	52.3	38.2	183,742
江守グループホールディングス	4.2	4.4	2,640
アルテック	6.4	7.7	1,670
タキヒヨー	22	17	7,225
スズケン	54	42.4	173,840
ジェコス	9	7	9,527
ルネサスイーストン	—	4.8	3,144
<b>小売業 (4.3%)</b>			
ローソン	53.6	38.8	327,860
サンエー	9.9	7.7	35,420
キリン堂	4.7	—	—
ダイユーエイト	2.6	2.1	1,759
カワチ薬品	9.1	7.9	17,095
エービーシー・マート	18.6	14.6	105,996
ハードオフコーポレーション	6.3	4.9	6,002
アスクル	13.5	10.6	29,786
ゲオホールディングス	22.3	19.3	25,128
アダストリアホールディングス	10	8.6	27,047
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	17	13	1,599
くらコーポレーション	7.7	6	27,300
キャンドウ	6.2	4.9	7,746
バル	7.6	6	21,420
エディオオン	59.8	46.9	42,538
サーラコーポレーション	11.2	8.8	5,174
ワッツ	—	4	3,608
あみやき亭	2.3	1.8	7,497
ひらまつ	13.5	14.1	9,207
ゲンキー	1.3	1	9,850
サッポロドラッグストアー	—	0.9	1,534
大黒天物産	3.1	2.4	11,712
ハニーズ	10.32	9	9,657
ファーマライズホールディングス	—	1.7	992
アルベン	11.6	9.1	17,153
クオール	9.5	10.4	11,055
ジェイアイエヌ	6.6	7	27,125
ビックカメラ	49.6	44.4	56,432

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
DCMホールディングス	64.4	49.5	46,183
MonotaRO	20.2	20	87,400
きちり	—	2	1,404
アークランドサービス	—	1.2	5,910
J. フロント リテイリング	308	129.6	254,016
ドトール・日レスホールディングス	22.9	17.9	37,142
マツモトキヨシホールディングス	26.9	22.9	102,363
ブロンコビリー	2	1.8	7,353
スタートトゥデイ	40.6	31.9	101,442
トレジャー・ファクトリー	—	0.9	2,376
物語コーポレーション	2.4	2.9	11,252
ココカラファイン	13.6	10.7	38,627
三越伊勢丹ホールディングス	259.5	203.5	422,669
ウエルシアホールディングス	5	9.2	39,330
クリエイトSDホールディングス	5.5	5	25,150
丸善CHIホールディングス	11.4	11.9	4,462
エー・ピーカンパニー	1.1	1.4	2,584
チムニー	—	1.9	5,090
ネクステージ	—	1	872
ジョイフル本田	—	5.6	25,312
キリン堂ホールディングス	—	3.3	2,656
すかいらく	—	37.5	55,725
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	—	33.6	37,766
ブックオフコーポレーション	7.2	5.8	5,730
あさひ	7.5	6.8	8,296
日本調剤	1.65	1.3	7,930
コスモス薬品	7.4	5.2	94,900
トーエル	6.9	5.4	4,438
一六堂	1.9	2.5	1,105
セブン&アイ・ホールディングス	546.2	428.3	2,192,039
薬王堂	—	1.4	3,309
クリエイト・レストランツ・ホールディング	1.6	7.1	11,253
ツルハホールディングス	12.8	21.8	203,612
サンマルクホールディングス	4.2	3.7	31,561
フェリシモ	3.7	2.6	2,607
トリドール	11.3	11	17,974
クスリのアオキ	2.2	4	34,520
メディカルシステムネットワーク	10.7	9.2	4,324
総合メディカル	3.2	2.5	17,175

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
はるやま商事	5.4	4.2	3,423	
カッパ・クリエイトホールディングス	19.2	16	18,432	
ライトオン	9.7	7.6	6,452	
ジーンズメイト	4.2	3.3	904	
良品計画	13.8	12.7	222,885	
三城ホールディングス	16.1	12.6	6,350	
コナカ	16.6	12	9,372	
ハウス オブ ローゼ	1.4	1.1	1,618	
G-7ホールディングス	3.8	2.1	2,192	
イオン北海道	8.2	6.5	4,348	
コジマ	19.2	15.2	5,107	
ヒマラヤ	3	2.4	2,390	
コーナン商事	17.1	15.6	21,715	
エコス	4.5	3.5	3,356	
ワタミ	15.4	12.1	15,475	
マルシェ	3.2	2.5	2,295	
ドンキホーテホールディングス	45	33	314,160	
西松屋チェーン	25.7	20.2	21,290	
ゼンショーホールディングス	59.9	52.7	66,138	
幸楽苑	8	6.4	10,476	
ハークスレイ	3.6	2.8	2,934	
サイゼリヤ	19.3	15.2	35,400	
ポブラ	3.3	2.6	1,365	
ユナイテッドアローズ	17.1	13.4	48,776	
ハイデイ日高	8.2	7.8	23,478	
京都きもの友禅	8.6	6.4	6,688	
コロワイド	43.5	34	57,018	
老番屋	5.2	4.6	26,220	
トップカルチャー	4.7	4.1	2,066	
PLANT	2.5	2.6	3,403	
スキホールディングス	23.4	18.4	116,104	
スクロール	16.9	13.3	3,843	
ヨンドシーホールディングス	9.9	7.8	18,002	
ファミリーマート	44.1	34.6	176,114	
木曽路	16	12.5	26,225	
サトレストランシステムズ	12.2	9.5	10,811	
千趣会	23.5	18.4	15,824	
タカキュー	10.1	7.3	1,547	
ケーヨー	22	19.2	11,001	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
上新電機	28	22	21,758	
日本瓦斯	19.5	16.4	49,856	
ベスト電器	42	33.3	4,828	
マルエツ	26	—	—	
ロイヤルホールディングス	21.8	17.1	35,927	
東天紅	10	7	1,372	
いなげや	14.5	11.4	16,074	
島忠	29.6	24.8	81,468	
チヨダ	15.4	12.1	33,444	
ライフコーポレーション	9.9	6.5	13,728	
カスミ	26.7	—	—	
リンガーハット	12.7	10	21,490	
さが美	10	8	776	
MrMax	13	10.3	2,914	
テンアライド	9.8	8.7	3,393	
AOKIホールディングス	22.5	23.5	40,326	
オークワ	20	16	14,576	
コメリ	20.1	17.5	50,820	
青山商事	32.8	25.7	100,615	
しまむら	15.2	11.9	145,061	
CF S コーポレーション	8.5	6.7	6,009	
はせがわ	4.5	3.6	1,958	
高島屋	177	149	181,482	
松屋	26.3	20.6	37,883	
エイチ・ツー・オー リテイリング	76	48.4	112,288	
近鉄百貨店	50	39	13,377	
丸栄	21	17	2,329	
ニッセンホールディングス	26.1	21.5	5,848	
パルコ	12.5	9.8	11,338	
丸井グループ	170.2	123.2	177,777	
アクシアル リテイリング	7.2	7.9	27,136	
井筒屋	71	55	3,630	
ダイエー	80.6	—	—	
イズミヤ	49	—	—	
イオン	521.6	422.3	570,527	
ユニグループ・ホールディングス	125	98	69,678	
イズミ	29.2	22.9	102,019	
東武ストア	17	13	3,705	
平和堂	26.5	20.7	57,856	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
フジ	14.5	11.4	23,940	
ヤオコー	6.6	5.8	54,404	
ゼビオ	15.7	13.9	31,191	
ケーズホールディングス	27.6	23.6	91,568	
O l y m p i cグループ	7.7	6	4,890	
日産東京販売ホールディングス	19	17.2	5,005	
アインファーマシーズ	7.2	12.3	60,331	
元気寿司	4	3.1	7,545	
ヤマダ電機	516.2	404.7	202,350	
アークランドサカモト	8.5	7.3	19,790	
ニトリホールディングス	51.7	44.2	371,280	
グルメ杵屋	9	7	7,021	
愛眼	10.4	8.2	2,041	
ケーユーホールディングス	2.7	5.3	3,858	
吉野家ホールディングス	35.4	28.8	37,728	
松屋フーズ	6.3	4.9	11,764	
サガミチェーン	16	13	17,004	
関西スーパーマーケット	9.7	7.6	6,254	
王将フードサービス	6.5	7.5	32,700	
ブレナス	14.6	11.4	25,479	
ミニストップ	9.7	7.6	12,988	
アークス	22.3	17.8	51,353	
パロー	28.1	22.1	56,730	
藤久	1	0.8	1,384	
ベルク	6.4	4.5	15,885	
大庄	6.1	5.5	7,755	
ファーストリテイリング	30.5	20.5	961,962	
サンドラッグ	27.6	21.6	136,296	
サックスパー ホールディングス	6.5	7.7	15,015	
ヤマザワ	3	2.1	3,643	
やまや	2.7	1.7	3,053	
ベルーナ	32.5	25.5	15,504	
<b>銀行業 (9.0%)</b>				
島根銀行	2.7	2.2	3,504	
じもとホールディングス	93.7	73.5	17,346	
足利ホールディングス	51.3	64.4	31,105	
東京TYフィナンシャルグループ	—	13.2	43,560	
新生銀行	1,130	975	241,800	
あおぞら銀行	678	691	308,877	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,891.8	8,215.4	6,434,301	
りそなホールディングス	1,241.2	1,197.8	766,472	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,566	2,263	1,176,533	
三井住友フィナンシャルグループ	987.6	774.4	3,746,547	
第四銀行	166	130	57,980	
北越銀行	142	111	26,973	
西日本シティ銀行	458	359	131,394	
千葉銀行	504	395	359,845	
横浜銀行	861	708	526,114	
常陽銀行	486	370	239,390	
群馬銀行	293	243	206,793	
武蔵野銀行	20.8	16.3	68,704	
千葉興業銀行	27.1	21.2	17,405	
筑波銀行	54.3	42.5	17,552	
東京都民銀行	23	—	—	
七十七銀行	205	173	122,657	
青森銀行	96	80	32,800	
秋田銀行	90	68	25,908	
山形銀行	79	62	32,612	
岩手銀行	8.5	7.2	37,872	
東邦銀行	117	92	47,012	
東北銀行	66	55	9,680	
みちのく銀行	70	51	11,067	
ふくおかフィナンシャルグループ	530	415	274,315	
静岡銀行	383	300	372,000	
十六銀行	164	128	59,904	
スルガ銀行	127	108.1	279,654	
八十二銀行	241	185	165,945	
山梨中央銀行	83	65	34,970	
大垣共立銀行	163	128	51,456	
福井銀行	112	87	23,751	
北國銀行	147	114	49,818	
清水銀行	4.4	3.5	11,007	
滋賀銀行	123	103	65,096	
南都銀行	127	99	42,867	
百五銀行	117	98	56,252	
京都銀行	249	195	251,160	
紀陽銀行	51.3	40.2	71,355	
三重銀行	54	46	13,248	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ほくほくフィナンシャルグループ	888	697	195,160
広島銀行	385	302	204,152
山陰合同銀行	81	63	65,772
中国銀行	97.2	73.7	137,819
鳥取銀行	41	33	8,910
伊予銀行	139.7	109.5	162,279
百十四銀行	143	112	46,368
四国銀行	94	79	20,303
阿波銀行	107	84	59,724
鹿児島銀行	91	71	60,350
大分銀行	82	63	30,366
宮崎銀行	87	68	31,688
肥後銀行	107	84	63,840
佐賀銀行	79	62	20,150
十八銀行	81	63	24,507
沖縄銀行	9.7	8.1	42,363
琉球銀行	25.3	21.1	37,832
八千代銀行	6.2	—	—
セブン銀行	489.3	345.3	208,561
みずほフィナンシャルグループ	16,919.7	14,189.5	3,184,123
高知銀行	51	40	7,280
山口フィナンシャルグループ	130	102	145,146
長野銀行	43	33	6,798
名古屋銀行	118	92	39,008
北洋銀行	196.7	154.3	71,286
愛知銀行	4.7	3.7	23,421
第三銀行	74	58	11,774
中京銀行	54	42	8,862
東日本銀行	57	45	17,685
大光銀行	46	36	8,676
愛媛銀行	77	60	15,360
トマト銀行	50	40	8,400
みなと銀行	118	93	26,319
京葉銀行	108	84	61,068
関西アーバン銀行	182	14.3	19,347
栃木銀行	66	51	32,793
北日本銀行	4.1	3.2	11,136
東和銀行	156	143	14,729
福島銀行	161	126	11,844

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大東銀行	83	65	10,790
トモニホールディングス	100.2	78.6	44,094
フィデアホールディングス	75.1	58.9	13,605
池田泉州ホールディングス	98	84.5	50,700
<b>証券、商品先物取引業 (1.4%)</b>			
F P G	8.6	8.8	30,756
S B I ホールディングス	156.8	123	187,575
日本アジア投資	89	71	5,538
ジャフコ	17.9	14	65,940
大和証券グループ本社	1,294	958	950,144
野村ホールディングス	2,669.6	2,093.3	1,542,971
岡三証券グループ	103	87	87,435
丸三証券	38.8	32.6	47,465
東洋証券	53	41	16,236
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	138.3	117.5	113,975
光世証券	31	24	6,000
水戸証券	38	31.7	15,120
いちよし証券	25.6	21.5	29,218
松井証券	66.4	52	61,100
だいこう証券ビジネス	6.3	4.9	4,336
マネックスグループ	141.8	120.5	40,247
カブドットコム証券	50.6	45.4	37,954
極東証券	16.2	13.7	26,317
岩井コスモホールディングス	12.3	10.5	17,314
マネースクウェアHD	—	3.2	4,665
マネーパートナーズグループ	9.9	10.5	4,074
小林洋行	3.7	3	1,071
<b>保険業 (2.5%)</b>			
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	290.1	227.5	872,690
アニコム ホールディングス	—	4.3	8,191
MS&ADインシュアランスグループホール	390.2	326.4	1,139,462
ソニーフィナンシャルホールディングス	125.1	98.1	196,298
第一生命保険	657.3	656	1,159,480
東京海上ホールディングス	505.8	421.4	1,949,817
T&Dホールディングス	447.9	373.2	620,818
<b>その他金融業 (1.3%)</b>			
全国保証	31.2	26.6	119,301
クレディセゾン	106.7	83.6	184,839
アクリーティブ	8.8	7.1	2,165



銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
芙蓉総合リース	13.7	10.7	45,903
興銀リース	22.8	19.2	48,576
東京センチュリーリース	30.7	24	85,200
日本証券金融	57.3	48.4	38,187
アイフル	237.6	171.3	69,719
ポケットカード	13	7.7	4,127
リコーリース	9	8.1	29,686
イオンフィナンシャルサービス	76	67.2	211,008
アコム	262.3	205.7	75,080
ジャックス	79	56	37,072
オリエントコーポレーション	291.8	236.6	45,427
日立キャピタル	25.6	20.1	51,516
アプラスフィナンシャル	47	49.1	6,383
オリックス	808.3	724.8	1,276,735
三菱UFJリース	331.2	259.7	156,339
日本取引所グループ	191.7	150.3	538,074
イー・ギャランティ	3.8	3	5,796
アサックス	2.3	1.8	3,056
NECキャピタルソリューション	4.4	4.2	8,211
<b>不動産業 (3.0%)</b>			
日本駐車場開発	141.6	111.2	20,127
ヒューリック	220.3	172.9	227,363
東京建物不動産販売	6.8	5.3	2,909
三栄建築設計	3.9	4.1	3,866
野村不動産ホールディングス	86.3	61.5	137,514
日本商業開発	—	3.1	6,023
ブレサンスコーポレーション	2.4	3.5	14,052
常和ホールディングス	4.6	4.2	19,236
日本管理センター	—	5	7,640
サンセイランディック	—	1.1	915
エストラスト	—	1	689
フージャースホールディングス	19.4	15.2	9,652
オープンハウス	5.2	6.5	18,876
東急不動産ホールディングス	289.6	268.4	227,603
飯田グループホールディングス	57.2	66.4	101,193
エコナックホールディングス	39	36	2,088
パーク24	68.5	51.5	125,866
バラカ	3.3	3.8	4,940
三井不動産	615	543	1,995,253

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	914	761	2,224,403
平和不動産	26.3	19.4	33,193
東京建物	267	223	201,369
ダイビル	38.4	26.3	32,322
京阪神ビルディング	21.6	17	12,665
住友不動産	313	245	1,090,005
大京	220	163	30,155
テーオーシー	45	35.3	34,523
東京楽天地	21	17	8,398
レオパレス21	150.1	112	72,912
スターツコーポレーション	—	11.7	21,656
フジ住宅	16.7	13.1	9,301
空港施設	15.8	12.4	8,630
明和地所	6.4	5.9	2,991
住友不動産販売	9.4	7.4	24,457
ゴールドクレスト	10.3	9.2	20,102
日本エスリード	5.1	4	5,100
日神不動産	17.4	13.7	6,452
タカラレーベン	43.4	45.4	30,281
サンヨーハウジング名古屋	6.7	5.8	7,342
イオンモール	84.3	66.1	162,804
ファースト住建	3.6	3.8	5,608
ランド	37.2	39.6	871
トーセイ	17.9	14	10,892
穴吹興産	9	9	2,268
エス・ティ・ティ都市開発	81.1	63.6	78,991
サンフロンティア不動産	12.3	11	12,166
エフ・ジェー・ネクスト	5.2	7.8	4,290
ランドビジネス	8.8	5.2	2,158
グランディハウス	7.6	8.9	2,803
日本空港ビルデング	45.1	35.4	250,986
<b>サービス業 (3.1%)</b>			
日本工営	46	36	17,676
ネクスト	11.6	12.7	14,668
日本M&Aセンター	7.1	16.7	67,635
ノバレーゼ	3.5	2.8	2,570
アコーディア・ゴルフ	56.3	40.7	50,264
タケエイ	9.5	10.6	11,130
トラスト・テック	1.8	1.9	4,294

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
パソナグループ	10.3	8.1	6,083	
CDS	2.1	2.5	2,542	
リンクアンドモチベーション	0.177	14.9	2,369	
GCAサヴィアン	8.2	8.5	12,546	
エス・エム・エス	7.7	12.1	18,670	
テンプホールディングス	30.2	21.3	88,395	
リニカル	2.7	2.8	2,842	
クックパッド	6.8	6.9	34,914	
エスクリ	4.8	3.8	4,753	
アイ・ケイ・ケイ	3.1	2.9	3,596	
学情	4.5	4	4,872	
スタジオアリス	5.6	5	11,155	
シミックホールディングス	5.2	4.3	8,036	
NECフィールディング	11.2	—	—	
日本上下水道設計	—	2.4	3,832	
総合警備保障	50.3	36.2	153,669	
カカココム	83.8	71.4	146,013	
アイロムホールディングス	3.1	2.6	4,513	
ルネサンス	6.1	5.5	7,293	
ディップ	2.3	2.4	16,824	
オプト	5.5	4.8	3,393	
新日本科学	11.4	10.3	8,528	
ツクイ	14.9	12.8	12,019	
総合臨床ホールディングス	4	5	2,420	
キャリアデザインセンター	0.028	3.2	3,260	
エムスリー	0.465	93.8	238,064	
ツカダ・グローバルホールディング	8	7.9	6,169	
アウトソーシング	4.3	4.1	6,990	
ウェルネット	—	2.8	7,663	
ディー・エヌ・エー	74.3	53.4	113,902	
博報堂DYホールディングス	191.6	150.2	196,912	
ぐるなび	9.6	12.5	28,650	
エスアールジータカミヤ	—	8.7	7,151	
一休	0.098	8.5	17,280	
ジャパンバスタレスキューシステム	0.085	8.9	2,314	
ファンコミュニケーションズ	—	18.7	18,438	
ジェイコムホールディングス	2.8	2.5	2,140	
PGMホールディングス	19.5	15.3	21,205	
WDBホールディングス	1.2	3.9	3,432	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ティア	—	2.9	1,722	
バリューコマース	8.5	8.9	4,948	
J Pホールディングス	23.1	26.9	9,818	
E P Sホールディングス	0.149	13.6	20,168	
プレステージ・インターナショナル	9.4	8.2	7,224	
アミューズ	3.8	3.3	11,583	
ドリームインキュベータ	0.036	3.5	8,351	
クイック	—	3.7	3,108	
TAC	8.4	5.4	1,171	
ケネディクス	162.9	154	77,000	
電通	130.3	120.8	641,448	
テイクアンドギヴ・ニーズ	5.9	4.2	3,780	
びあ	4.1	3.2	8,153	
イオンファンタジー	4.5	3.5	6,478	
ネクシィーズ	5	3.9	2,406	
みらかホールディングス	36.3	28.5	169,290	
アルプス技研	5.5	4.3	9,928	
サニックス	20.1	12.7	4,749	
ダイオーズ	2.5	2.3	2,118	
日本空調サービス	3.4	5.3	4,605	
オリエンタルランド	37.4	29.3	1,077,800	
ダスキン	37.4	30.7	66,465	
明光ネットワークジャパン	13.7	10.7	13,728	
ファルコホールディングス	7.1	5.1	7,471	
秀英予備校	2.2	2.3	784	
田谷	2.1	1.8	1,535	
ラウンドワン	39.2	30.7	21,090	
リゾートトラスト	46.7	40	129,000	
ピー・エム・エル	9	6.4	23,200	
ワタベウエディング	4.5	3.5	1,778	
もしもしホットライン	25.7	20.1	29,305	
リソー教育	15.5	16.8	5,594	
早稲田アカデミー	2.1	1.6	1,419	
ユー・エス・エス	167.3	131.2	276,832	
東京個別指導学院	6.7	5.2	2,750	
サイバーエージェント	—	19.9	135,718	
楽天	448.7	470.8	1,004,216	
テー・オー・ダブリュー	4.5	3.3	2,884	
セントラルスポーツ	4.2	3.7	8,831	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
フルキャストホールディングス	12.6	11.2	8,377	
リゾートソリューション	11	11	2,981	
テクノプロ・ホールディングス	—	11.5	32,729	
リブセンス	6.8	6.3	3,805	
ジャパンマテリアル	1.2	4.5	7,677	
ベクトル	—	1.8	2,698	
ウチヤマホールディングス	—	4.7	2,655	
サクセスホールディングス	—	0.9	1,095	
キャリアリンク	—	1.1	1,645	
アサンテ	—	2.7	3,572	
M&Aキャピタルパートナーズ	—	0.2	700	
ERIホールディングス	2.4	2.8	2,783	
ウィルグループ	—	0.9	1,242	
リクルートホールディングス	—	122.9	471,936	
リロ・ホールディング	5.2	3.7	38,961	
東祥	—	2.3	6,444	
エイチ・アイ・エス	11.3	17.7	72,570	
共立メンテナンス	6.8	5.4	35,910	
イチネンホールディングス	14.5	11.3	12,904	
建設技術研究所	8.1	6.4	7,980	
スペース	6.7	5.8	7,441	
燦ホールディングス	2.7	2.2	4,030	
スバル興業	10	8	3,520	
東京テアトル	53	41	6,027	
よみうりランド	27	22	10,604	
東京都競馬	106	74	22,422	
常磐興産	45	40	6,440	
カナモト	17.6	15.1	52,699	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東京ドーム	102	74	39,812	
西尾レントオール	7.5	8.7	31,059	
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	56	45	1,980	
トランス・コスモス	18	14.1	34,601	
乃村工藝社	27.1	21.2	24,655	
藤田観光	35	39	19,734	
KN T-C Tホールディングス	44	52	8,788	
日本管財	5.9	5.3	15,613	
トーカイ	6.1	4.8	18,840	
白洋舎	14	11	2,794	
セコム	143.8	105.2	865,480	
セントラル警備保障	6.1	4.8	6,422	
丹青社	17.2	12.5	10,600	
メイテック	19	14.7	57,991	
アサツー ディ・ケイ	24.2	20.4	70,584	
応用地質	13.2	11.4	18,285	
船井総研ホールディングス	14.1	11.7	13,267	
進学会	5.8	4.5	2,286	
ベネッセホールディングス	46.3	39.6	158,796	
イオンディライト	13.4	10.5	31,374	
ナック	6.9	7.2	7,660	
ニチイ学館	30	21.2	23,786	
ダイセキ	20.4	17.4	38,819	
ステップ	4.1	3.6	3,344	
合 計	株 数 ・ 金 額	213,773	172,412	241,430,274
	銘柄数 < 比率 >	1,777	1,858	< 98.4% >

(注) 銘柄欄の ( ) 内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の < > 内は、純資産総額に対する評価額の比率。

### 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	
		百万円	百万円
		3,196	—

## ○有価証券の貸付および借入の状況

2015年3月25日現在における貸付株数の総株数は15,683,400株です。

うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUF G証券株式会社に対する貸付は、15,683,400株です。

## ○投資信託財産の構成

(2015年3月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	241,430,274	91.8
コール・ローン等、その他	21,664,402	8.2
投資信託財産総額	263,094,676	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年3月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	263,071,440,122
コール・ローン等	17,818,273,430
株式(評価額)	241,430,274,430
未収入金	3,543,057,585
未収配当金	215,795,053
未収利息	24,364
その他未収収益	29,651,260
差入委託証拠金	34,364,000
(B) 負債	17,704,527,488
未払解約金	3,114,852,556
未払利息	475,185
受入担保金	14,589,199,747
(C) 純資産総額(A-B)	245,366,912,634
元本	156,174,324,083
次期繰越損益金	89,192,588,551
(D) 受益権総口数	156,174,324,083口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,711円

## ○損益の状況 (2014年3月26日～2015年3月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,631,758,236
受取配当金	4,220,584,780
受取利息	19,266,102
その他収益金	402,101,389
支払利息	△ 10,194,035
(B) 有価証券売買損益	73,647,751,072
売買益	75,831,797,162
売買損	△ 2,184,046,090
(C) 先物取引等取引損益	1,104,628,680
取引益	1,531,287,016
取引損	△ 426,658,336
(D) 保管費用等	△ 1,046,177
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	79,383,091,811
(F) 前期繰越損益金	24,699,109,110
(G) 追加信託差損益金	21,936,193,747
(H) 解約差損益金	△36,825,806,117
(I) 計(E+F+G+H)	89,192,588,551
次期繰越損益金(I)	89,192,588,551

(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	196,865,740,751円		
期中追加設定元本額	70,136,268,196円		
期中一部解約元本額	110,827,684,864円		
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）	3,564,795,993円	三菱UFJ TOPIX・ライト	404,286,009円
eMAXIS TOPIXインデックス	8,705,160,746円	インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	33,360,818円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	909,285,619円	インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	137,612,969円
eMAXIS バランス（波乗り型）	729,678,462円	インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	186,882,380円
コアバランス	599,238円	インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	158,949,292円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	2,255,796,669円	三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	4,005,229,859円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	5,138,586,333円	三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	1,302,040,416円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	26,441,896,738円	三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	144,822,356円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	15,240,818,423円	三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	1,380,080,180円
三菱UFJ バランスファンドVA20型（適格機関投資家限定）	553,173,927円	三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	160,084,461円
三菱UFJ バランスファンドVA40型（適格機関投資家限定）	4,415,307,879円	三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	1,211,845,201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）	12,278,588,913円	三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	2,019,775,189円
三菱UFJ バランスファンドVA50型（適格機関投資家限定）	7,954,377,935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）	493,134,259円
三菱UFJ バランスファンドVA75型（適格機関投資家限定）	3,323,922,337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）	2,019,813,463円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	743,559,346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）	1,591,554,273円
三菱UFJ バランスファンドVA45型（適格機関投資家限定）	451,509,718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）	1,250,796,283円
三菱UFJ バランスファンドVA30型（適格機関投資家限定）	205,219,114円	三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	35,476,494,161円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	600,280,127円	三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	105,699,076円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	1,351,889,885円	三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	26,537,331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）	37,945,812円	三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	170,025,595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（FOF 5用）（適格機関投資家限定）	65,613,761円	三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	52,097,609円
MUAM トピックスリスクコントロール（0%）インデックスファンド（FOF 5用）（適格機関投資家限定）	335,052,479円	三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	3,808,729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	合計	156,174,324,083円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	8,527,608,066円		

【お知らせ】

- ①新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。  
（2014年12月1日）
- ②デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。  
（2014年12月1日）

## 日本短期債券マザーファンド

### 《第16期》決算日2014年7月22日

〔計算期間：2013年7月23日～2014年7月22日〕

「日本短期債券マザーファンド」は、7月22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	わが国の公社債・金融商品を主要投資対象とし、ポートフォリオのデュレーション調整と銘柄選択による収益獲得をめざして運用を行います。ポートフォリオのデュレーションはベンチマークの平均を中心に調整します。デュレーション調整は主としてファンダメンタルズ分析に基づく中期的な金利見通しに沿って行います。銘柄選択は信用リスクと金利スプレッドを定量的・定性的に分析して行います。NOMURA-BPI短期インデックスをベンチマークとし、同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。
主要運用対象	わが国の公社債・金融商品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。

### 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI 短期インデックス		債 券 組入比率	債 券 先物比率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首)	円	%		%	%	%
2013年7月22日	11,028	—	234.61	—	98.2	—
7月 末	11,031	0.0	234.66	0.0	98.1	—
8月 末	11,035	0.1	234.70	0.0	97.6	—
9月 末	11,041	0.1	234.79	0.1	97.3	—
10月 末	11,044	0.1	234.86	0.1	99.1	—
11月 末	11,050	0.2	234.95	0.1	98.2	—
12月 末	11,051	0.2	234.93	0.1	99.2	—
2014年1月 末	11,057	0.3	235.02	0.2	97.8	—
2月 末	11,062	0.3	235.13	0.2	97.8	—
3月 末	11,063	0.3	235.12	0.2	97.4	—
4月 末	11,065	0.3	235.15	0.2	99.3	—
5月 末	11,068	0.4	235.20	0.3	99.1	—
6月 末	11,073	0.4	235.30	0.3	96.6	—
(期 末)						
2014年7月22日	11,076	0.4	235.35	0.3	99.0	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) NOMURA-BPI短期インデックスは、NOMURA-BPI総合インデックスのサブインデックスで、残存期間1年から3年の債券で構成されています。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総合インデックスおよびNOMURA-BPI短期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關し野村證券株式会社は一切関係ありません。

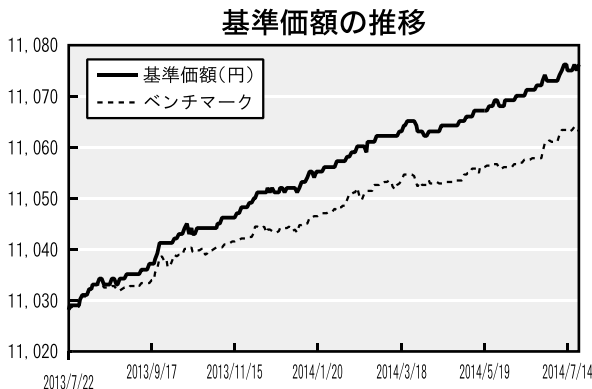
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 純資産総額は、期首6,509百万円、期末12,003百万円。

## 当期の運用経過

### ◆ 基準価額の推移

基準価額は期首に比べ0.4%の上昇となりました。



(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。

### ◆ 基準価額の変動要因

#### ◎ 債券市況

- ・新興国景気の先行きに対する不透明感や日銀による国債買入オペの弾力的運営の効果などから債券市況は上昇（利回りは低下）しました。

#### ◆ ベンチマークとの比較

当期の基準価額騰落率は、ベンチマークであるNOMURA-BPI短期インデックスを0.1%上回るものとなりました。この主な要因は、次の通りです。

#### ◎ 組入比率

- ・期を通じて高位組み入れを維持しました。

(プラス要因)

#### ◎ 債券種別構成

- ・期を通じて一般債をオーバーウェイト（投

資比率を基準となる配分比率より多くすること）としたこと。

## 今後の運用方針

### ◆ 運用環境の見通し

- ・本邦マクロ経済は、足下では2014年4月の消費税率引き上げに伴う駆け込み需要の反動が一部にみられていましたが、先行きについては生産・設備投資は横ばいから持ち直しで推移し、雇用環境も改善を続けており、国内景気については緩やかな回復基調を続けていくものと思われまます。
- ・日銀は「物価安定の目標」の実現に向けて量的・質的金融緩和政策を引き続き維持するものと思われまます。
- ・日銀の社債買入オペなどによる良好な需給環境を背景に、一般債の国債に対する金利差は低位での安定推移を予想します。
- ・国内金利は当面もみ合いでの推移を予想しますが、短期ゾーンに関しては低下余地は限定的と思われまます。

### ◆ 今後の運用方針

- ・安定した利子収益確保をめざし、債券組入比率は引き続き高位に維持する方針です。
- ・ファンド全体のデュレーションは、既に金利水準が低いことから当面ベンチマーク対比で短めの水準で機動的に調整する方針です。
- ・債券種別構成は、流動性や銘柄分散に留意しつつ、一般債の組入比率をベンチマーク比高めに維持します。

## 1 万口（元本10,000円）当たりの費用の明細

当期中に発生した費用はありません。

## 売買および取引の状況

(2013年7月23日～2014年7月22日)

## 公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	2,012,661	1,832,383
	特殊債券	3,345,779	1,694,515
	社債券	5,597,076	1,810,445
内			(100,000)

(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。

## 組入資産の明細

## 公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債の種類別開示

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	920,000	924,511	7.7	—	—	2.3	5.4
特殊債券 (除く金融債券)	2,400,000 (2,400,000)	2,403,881 (2,403,881)	20.0 (20.0)	— (—)	— (—)	8.3 (8.3)	11.7 (11.7)
金融債券	1,450,000 (1,450,000)	1,456,077 (1,456,077)	12.1 (12.1)	— (—)	— (—)	10.9 (10.9)	1.3 (1.3)
普通社債券	7,000,000 (7,000,000)	7,099,834 (7,099,834)	59.1 (59.1)	— (—)	— (—)	23.8 (23.8)	35.3 (35.3)
合 計	11,770,000 (10,850,000)	11,884,303 (10,959,792)	99.0 (91.3)	— (—)	— (—)	45.3 (43.0)	53.7 (48.3)

(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) 公社債の詳細開示(個別銘柄別)

2014年7月22日現在

種類	銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	第92回利付国債(5年)	0.3	400,000	401,156	2015/9/20
	第97回利付国債(5年)	0.4	250,000	251,595	2016/6/20
	第99回利付国債(5年)	0.4	170,000	171,208	2016/9/20
	第102回利付国債(5年)	0.3	100,000	100,552	2016/12/20
小計			920,000	924,511	
特殊債券 (除く金融債券)	第13回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	0.711	100,000	101,089	2016/6/20
	第43回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	0.162	300,000	300,189	2017/6/20
	第1回地方公共団体金融機構債券(2年)(財投機関債)	0.135	100,000	100,001	2016/2/26
	第13回首都高速道路債券(財投機関債)	1.48	200,000	201,774	2015/3/20
	第5回阪神高速道路	0.381	100,000	100,253	2015/9/24
	第11回水資源債券(財投機関債)	0.167	100,000	100,028	2016/12/20
	第40回日本政策金融公庫(財投機関債)	0.131	100,000	99,992	2016/5/10
	第72回都市再生債券(財投機関債)	0.176	100,000	100,051	2016/3/18
	第90回都市再生債券(財投機関債)	0.157	100,000	100,005	2017/6/20
	第36回福祉医療機構債券(財投機関債)	0.167	100,000	100,028	2016/12/20
	第33回日本学生支援債券(財投機関債)	0.187	100,000	100,108	2016/11/18
	第35回日本学生支援債券(財投機関債)	0.152	100,000	100,005	2017/6/20
	第50回中日本高速道路	0.232	100,000	100,118	2016/11/8
	第53回中日本高速道路	0.222	100,000	100,092	2017/6/20
第17回西日本高速道路	0.196	200,000	200,072	2015/12/18	
第4回韓国政策金融公社(2012)	0.58	100,000	100,108	2014/12/18	
第12回韓国輸出入銀行	0.4	400,000	399,968	2016/3/14	
小計			2,400,000	2,403,881	
金融債券	い第744号商工債券	0.35	100,000	100,552	2017/5/26
	い第746号商工債券	0.3	100,000	100,419	2017/7/27
	い第710号農林債券	1.0	50,000	50,004	2014/7/25
	い第741号農林債券	0.5	200,000	201,650	2017/2/27
	い第749号農林債券	0.3	100,000	100,308	2017/10/27
	い第750号農林債券	0.3	100,000	100,316	2017/11/27
	第248回信金中金債	0.55	100,000	100,460	2015/7/27
	第270回信金中金債	0.35	100,000	100,566	2017/5/26
	第271回信金中金債	0.35	100,000	100,568	2017/6/27
	第272回信金中金債	0.3	100,000	100,434	2017/7/27
	第273回信金中金債	0.3	100,000	100,446	2017/8/25
第168号商工債券(3年)	0.2	300,000	300,354	2017/1/27	
小計			1,450,000	1,456,077	
普通社債券	第406回中部電力	3.75	200,000	206,580	2015/6/25
	第473回中部電力	1.55	300,000	305,739	2015/12/25
	第382回九州電力	1.44	100,000	100,727	2015/2/25
	第419回九州電力	0.65	100,000	100,638	2016/2/25
	第425回九州電力	0.281	100,000	100,050	2017/2/24
	第7回新関西国際空港	0.217	100,000	100,052	2016/12/20
	第7回セブン&アイ・ホールディングス	0.258	200,000	200,358	2016/6/20
	第6回ブリヂストン	0.247	100,000	100,135	2016/4/22
	第13回トヨタ自動車	0.289	100,000	100,245	2016/6/20
	第20回みずほコーポレート銀行	0.71	100,000	100,420	2015/4/20
	第6回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	1.73	100,000	100,687	2014/12/22
	第8回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	1.64	100,000	101,502	2015/7/22
	第11回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	2.28	200,000	209,452	2016/10/31
	第132回三菱東京UFJ銀行	0.46	100,000	100,779	2017/1/24
第5回住友信託銀行(劣後特約付)	2.25	100,000	103,560	2016/4/27	
第10回三井住友銀行(劣後特約付)	2.11	500,000	524,320	2017/2/16	

種 類	銘 柄 名	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
普 通 社 債 券	第 6 回みずほ銀行（劣後特約付）	2.25	400,000	418,348	2016/11/4
	第 45 回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.15	100,000	100,046	2017/6/20
	第 19 回日産フィナンシャルサービス	0.412	100,000	100,169	2015/3/20
	第 27 回日産フィナンシャルサービス	0.146	100,000	99,904	2017/6/20
	第 52 回トヨタファイナンス	0.263	100,000	100,196	2016/6/20
	第 59 回トヨタファイナンス	0.157	100,000	100,020	2017/6/20
	第 62 回アコム	1.07	100,000	101,134	2016/3/4
	第133回オリックス	2.54	100,000	101,679	2015/4/8
	第149回オリックス	1.11	100,000	100,705	2015/4/28
	第 13 回三菱UFJリース	0.796	200,000	202,188	2016/4/22
	第 22 回三菱UFJリース	0.235	100,000	100,105	2016/2/26
	第 25 回三菱UFJリース	0.313	100,000	100,296	2017/11/21
	第 22 回野村ホールディングス	0.937	100,000	100,656	2015/6/24
	第 38 回野村ホールディングス	0.605	200,000	201,086	2016/2/26
	第 3 回新韓銀行	0.83	200,000	200,616	2015/7/29
	第 12 回ボスコ（2013）	0.93	100,000	100,230	2016/12/9
	第 23 回GEキャピタルコーポレーション	0.45	300,000	301,335	2016/9/20
	第 10 回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	0.462	500,000	502,175	2016/6/13
	第 9 回ゴールドマン・サックス・グループ・インク	2.11	100,000	104,333	2016/12/28
	第 10 回現代キャピタル・サービス・インク	0.75	100,000	100,397	2015/10/16
	第 4 回ビー・エヌ・ビー・パリバ	0.53	100,000	100,395	2016/9/13
	第 4 回ナショナル・オーストラリア銀行	1.16	100,000	100,955	2015/7/29
第 5 回オーストラリア・COMMONWEALTH銀行	0.89	200,000	202,476	2016/6/10	
第 7 回オーストラリア・COMMONWEALTH銀行	0.315	100,000	100,163	2016/11/18	
第5回ウエストパック・バンキング・コーポレーション	1.23	100,000	100,516	2015/1/27	
第 8 回オーストラリア・ニューージーランド銀行	1.09	200,000	202,628	2016/2/16	
第 17 回ラボバンク・ネダーランド	0.563	200,000	200,888	2015/11/2	
第 22 回ラボバンク・ネダーランド	0.377	300,000	300,951	2016/12/19	
小 計			7,000,000	7,099,834	
合 計			11,770,000	11,884,303	

## 投資信託財産の構成

2014年7月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	11,884,303	95.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	538,891	4.3
投 資 信 託 財 産 総 額	12,423,194	100.0

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

2014年7月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	12,423,194,390円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	176,180,130
公 社 債 ( 評 価 額 )	11,884,303,700
未 収 入 金	338,529,600
未 収 利 息	14,829,926
未 払 費 用	9,351,034
(B) 負 債	419,257,704
未 払 解 約 金	400,272,000
未 払 解 約 金	18,985,704
(C) 純 資 産 総 額 ( A - B )	12,003,936,686
元 本	10,838,030,764
次 期 繰 越 損 益 金	1,165,905,922
(D) 受 益 権 総 口 数	10,838,030,764口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 ( C / D )	11,076円

## 損益の状況

(2013年7月23日～2014年7月22日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益 息	54,987,067円
受 取 利 息	54,987,067
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 25,419,850
売 買 損 益	6,847,300
売 買 損 益	△ 32,267,150
(C) 当 期 損 益 金 ( A + B )	29,567,217
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	607,028,021
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	741,095,068
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 211,784,384
(G) 次 期 繰 越 損 益 金 ( C + D + E + F )	1,165,905,922

(注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 5,902,782,915円  
 期中追加設定元本額 6,945,849,111円  
 期中一部解約元本額 2,010,601,262円
- ②期末における元本の内訳 (当期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 グローバル・エコ・ウォーター・ファンド | 8,887,168円      |
| 地球温暖化対策株式ファンド             | 946,881円        |
| 三菱UFJ 日本短期債券ファンド          | 6,201,494,302円  |
| 日本短期債券ファンドVA (適格機関投資家限定)  | 160,937,845円    |
| 日本短期債券ファンド (適格機関投資家限定)    | 120,821,622円    |
| 三菱UFJ 積立ファンド (日本バランス型)    | 1,972,360,354円  |
| 三菱UFJ TOPIX・ライト           | 602,710,991円    |
| 三菱UFJ/ドイチェインド株式ファンド       | 19,078,594円     |
| 三菱UFJ 日本バランス20            | 138,829,736円    |
| 三菱UFJ 日本バランス50            | 100,686,230円    |
| 三菱UFJ 国内バランス20            | 1,323,174,034円  |
| 三菱UFJ 国内バランス50            | 188,103,007円    |
| 合計                        | 10,838,030,764円 |