928274

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（2001年12月19日設定）	
運用方針	主として、マザーファンドを通じて国内債券27%、国内株式40%、外国債券５%、外国株式25%および短期金融商品３%の比率で配分した基本ポートフォリオのもと分散投資を行い、個別資産毎におけるパッシブ運用を行います。 当社が独自に指数化する合成インデックスをベンチマークとして、ベンチマークと同程度の投資成果をあげることをめざします。 長期的な運用環境の動向等により、基本ポートフォリオを見直す場合があります。 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。 資産配分については、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社からの投資助言を受けます。	
主要運用対象	ベビーファンド	日本債券インデックスマザーファンド受益証券、ＴＯＰＩＸ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および外国株式インデックス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を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コクサインデックス）（円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。
	日本債券インデックスマザーファンド	ＮＯＭＵＲＡ-ＢＰＩ総合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。
	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。
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80%未満とします。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45%未満とします。
	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。
	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。
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。

運用報告書（全体版）

三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）

第15期（決算日：2016年５月12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 ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）」は、去る５月12日に第15期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

三菱ＵＦＪ投信株式会社は2015年７月１日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、「三菱ＵＦＪ国際投信株式会社」となりました。

MUFG
三菱UFJ国際投信
東京都千代田区有楽町一丁目12番１号
URL:http://www.am.mufg.jp/

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先
お客さま専用フリーダイヤル TEL.0120-151034
（9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～１月３日を除く）
お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目 次

三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）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 …… 15

◇１万口当たりの費用明細 …… 16

◇売買及び取引の状況 …… 17

◇株式売買比率 …… 17

◇利害関係人との取引状況等 …… 18

◇組入資産の明細 …… 20

◇投資信託財産の構成 …… 20

◇資産、負債、元本及び基準価額の状況 …… 21

◇損益の状況 …… 21

◇お知らせ …… 22

マザーファンドのご報告

◇ＴＯＰＩＸマザーファンド …… 50

◇外国株式インデックスマザーファンド …… 83

◇日本債券インデックスマザーファンド …… 126

◇外国債券インデックスマザーファンド …… 158

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。

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額			合成インデックス		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						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
11期(2012年5月14日)	10,464	0	△ 4.3	96.25	△ 5.4	62.9	1.6	32.0	0.0	0.5	2,574
12期(2013年5月13日)	14,636	0	39.9	133.11	38.3	64.2	1.0	30.8	0.2	0.6	3,757
13期(2014年5月12日)	15,107	0	3.2	136.36	2.4	63.3	0.9	32.0	0.1	0.5	3,985
14期(2015年5月12日)	18,591	0	23.1	166.46	22.1	63.7	1.0	31.5	0.1	0.6	4,915
15期(2016年5月12日)	17,102	0	△ 8.0	151.77	△ 8.8	62.7	1.6	31.4	－	0.7	4,597

（注）当社が独自に指数化する合成インデックスとは、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合インデックス27%、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）40%、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）５%、ＭＳＣＩ Kokusai Index（ＭＳＣＩコクサイ インデックス）（円換算ベース）25%、無担保コール翌日物レート（短資協会発表）の平均値３%を合成したものです。
（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）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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年　月　日	基準価額		合成インデックス		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	%		%	%	%	%	%	%
2015年５月12日	18,591	－	166.46	－	63.7	1.0	31.5	0.1	0.6
５月末	19,122	2.9	171.01	2.7	62.7	1.0	31.2	0.1	0.5
６月末	18,716	0.7	167.38	0.6	63.0	0.7	32.3	0.1	0.5
７月末	19,006	2.2	170.04	2.2	64.5	0.7	31.4	0.1	0.6
８月末	18,095	△ 2.7	161.58	△ 2.9	64.5	1.3	30.4	0.1	0.6
９月末	17,245	△ 7.2	153.64	△ 7.7	62.4	1.3	32.3	0.0	0.6
10月末	18,432	△ 0.9	164.24	△ 1.3	63.1	0.9	31.5	0.0	0.6
11月末	18,583	△ 0.0	165.64	△ 0.5	63.6	2.0	31.9	0.0	0.6
12月末	18,340	△ 1.4	163.40	△ 1.8	63.5	1.3	31.5	－	0.6
2016年１月末	17,473	△ 6.0	155.63	△ 6.5	64.0	1.2	31.0	0.0	0.6
２月末	16,661	△10.4	148.50	△10.8	63.8	1.1	31.3	0.1	0.7
３月末	17,268	△ 7.1	153.37	△ 7.9	63.9	1.5	32.4	0.0	0.7
４月末	17,232	△ 7.3	153.00	△ 8.1	62.4	1.5	32.3	－	0.7
（期　末） 2016年５月12日	17,102	△ 8.0	151.77	△ 8.8	62.7	1.6	31.4	－	0.7

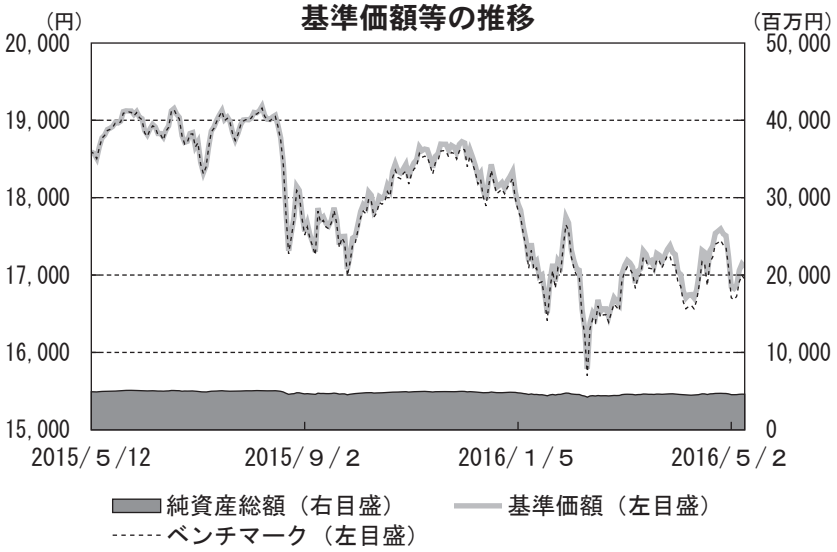
（注）騰落率は期首比。
（注）当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
（注）「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第15期：2015/５/13～2016/５/12）

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ8.0%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（－8.8%）を0.8%上回りました。



第15期首　：18,591円
第15期末　：17,102円
（既払分配金　　0円）
騰落率　　：　－8.0%

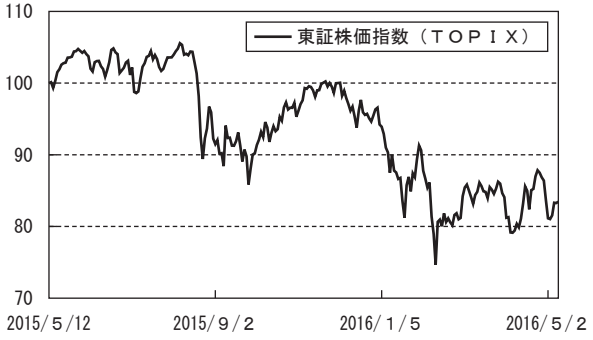
基準価額の主な変動要因

下落要因	主として内外株式市況の下落などが、基準価額のマイナス要因となりました。

投資環境について

（第15期：2015/５/13～2016/５/12）

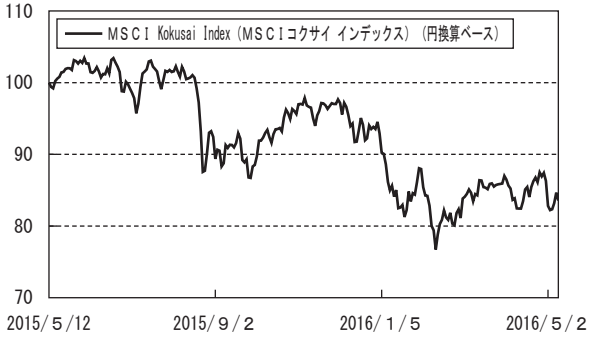
市況の推移
（期首を100として指数化）



・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。

◎国内株式市況
・中国経済減速への不安から世界同時株安となったことや、円高・米ドル安が進行したことなどから、期を通じて国内株式市況は下落しました。

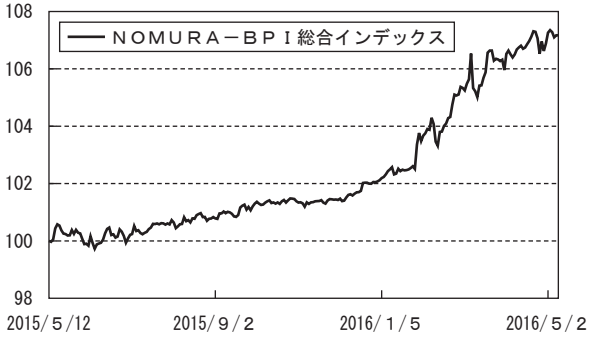
市況の推移
（期首を100として指数化）



・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。

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

市況の推移
（期首を100として指数化）

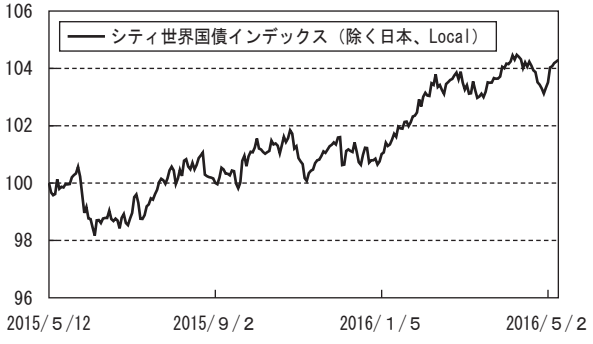


・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合インデックスとは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合インデックスは野村證券株式会社の知的財産であり、ファンドの運用成果に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。

◎国内債券市況

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

市況の推移
（期首を100として指数化）

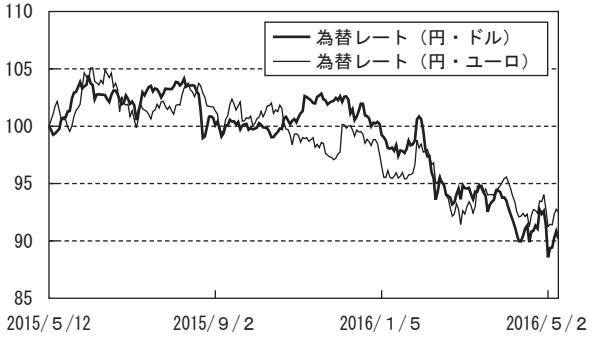


・シティ世界国債インデックス（除く日本、Local）は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

◎外国債券市況

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

為替市況の推移
（期首を100として指数化）



◎為替市況

・円・米ドル相場は、ＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）による政策金利の引き上げが意識されて米ドルが対円で上昇する局面もありましたが、世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に米ドルが対円で売られました。期首との比較では、米ドルは対円で9.8%下落しました。

・円・ユーロ相場は、ユーロ圏の景況感の改善などを背景に上昇する局面もありましたが、ＥＣＢ（欧州中央銀行）が緩和的な金融政策を維持したことなどを背景に、ユーロが対円で売られました。期首との比較では、ユーロは対円で7.5%下落しました。

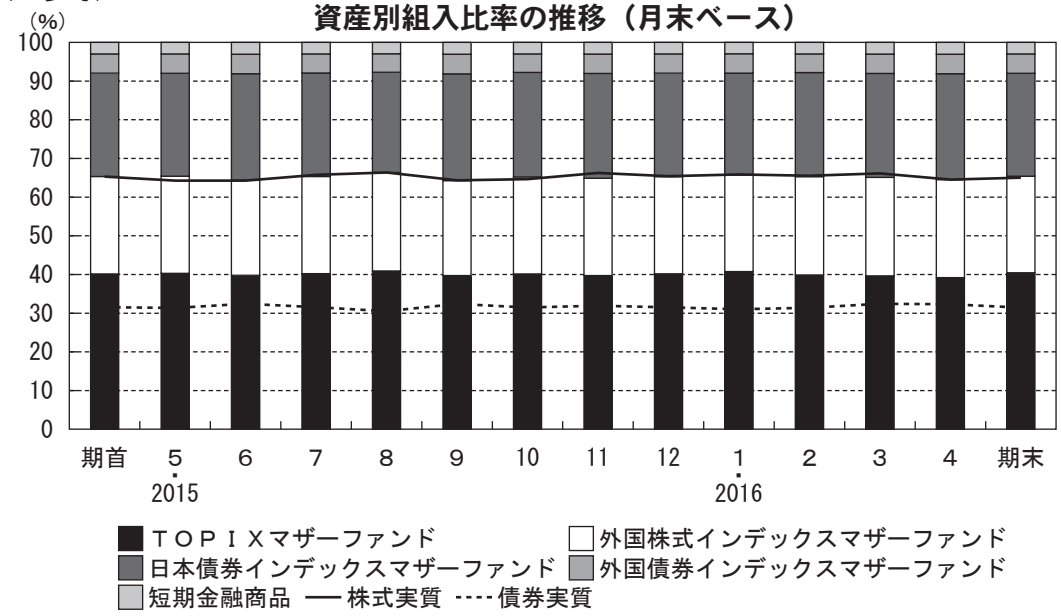
当該投資信託のポートフォリオについて

＜三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）＞

・内外の債券・株式に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を図るため各資産の指数を独自に合成した指数と同程度の投資成果をあげることをめざした運用を行いました。

・当期の資産配分の推移は以下の通りです。

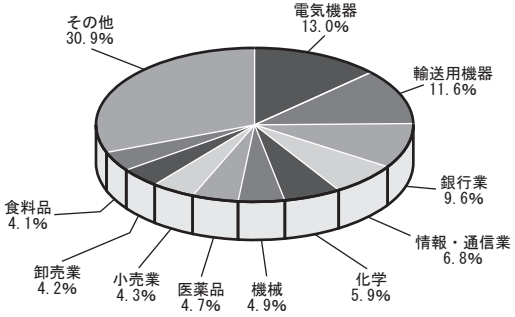
（ご参考）



＜ＴＯＰＩＸマザーファンド＞
基準価額は期首に比べ14.8%の下落となりました。
・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。

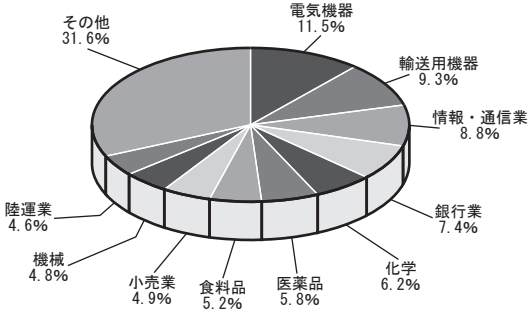
（ご参考）
組入上位10業種

期首（2015年５月12日）



（注）比率は現物株式評価額に対する割合です。

期末（2016年５月12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14.5%の下落となりました。
・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・ＲＥＩＴ（不動産投資信託証券）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。
・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。
（注）マルチファクターモデル
株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・通貨・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

＜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7.2%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。
・なお、期末時点では、資金フロー対応のため、債券先物のポジションは保有していません。
・ベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合インデックス）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。

（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（2015年５月12日）

最終利回り	0.4%
直接利回り	1.1%
デュレーション	8.0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。

期末（2016年５月12日）

最終利回り	−0.0%
直接利回り	1.0%
デュレーション	8.8年

・数値は債券現物部分で計算しております（先物は考慮しておりません）。
・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。

＜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6.1%の下落となりました。
・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。

（ご参考）
利回り・デュレーション

期首（2015年５月12日）

最終利回り	1.3%
直接利回り	2.7%
デュレーション	6.6年

・数値は債券現物部分で計算しております（先物は考慮しておりません）。
・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。

期末（2016年５月12日）

最終利回り	1.0%
直接利回り	2.4%
デュレーション	7.0年

・数値は債券現物部分で計算しております（先物は考慮しておりません）。
・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。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

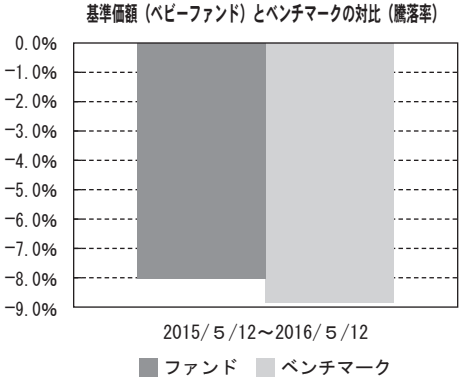
＜三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）＞

基準価額の騰落率は、8.0%の下落となり、ベンチマークの8.8%の下落を0.8%上回りました。

差異の内訳は以下の通りです。

（内訳）

ＴＯＰＩＸマザーファンド	0.9%程度
外国株式インデックスマザーファンド	△0.1%程度
日本債券インデックスマザーファンド	0.3%程度
外国債券インデックスマザーファンド	0.0%程度
その他（信託報酬等）	△0.3%程度



＜ＴＯＰＩＸマザーファンド＞

ベンチマークは16.5%の下落となったため、カイ離は1.7%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

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

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

・期中における先物組入比率の平均は、1.5%程度となりました。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.7%程度でした。

・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

プラス要因	配当・利子収入等	計 2.0%程度
マイナス要因	売買コスト等	計 △0.3%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16.4%の下落となったため、カイ離は1.9%程度となりました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合　　計
ベンチマークとのカイ離	△0.0%程度	△0.0%程度	1.9%程度	1.9%程度

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

◎組入比率要因
組入比率による影響は△0.0%程度でした。
・期中、ファンドの資産をほぼ全額株式（先物・ＲＥＩＴを含む）に投資しました。
・効率的に運用を行うため、円貨、外貨現金などを若干保有しました。

◎銘柄選択要因
銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。
ファンドとベンチマークの値動きや、推定トラッキングエラー、株式の国別比率、業種別比率などについてモニターし、必要に応じて定量モデルを用いた調整を図ることでベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。その際に、ファンドがベンチマークと連動する可能性をより高めるため、
・売買に係るコストを考慮しつつ、できる限り多くの銘柄に分散投資を行いました。
・ファンドの特性をよりベンチマークに近づけるべく、マルチファクターモデルを用いて組入銘柄とその組入比率を決定しています。

◎その他の要因
その他の要因による影響は1.9%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入・為替効果等	計　2.0%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料等	計　△0.1%程度

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

＜日本債券インデックスマザーファンド＞
ベンチマークは7.2%の上昇となったため、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、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6.2%の下落となったため、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。

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15期 2015年５月13日～2016年５月12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		10,967

（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 ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）＞

・資産配分方針については、引き続き基本ポートフォリオを維持する方針で臨みます。追加設定・解約要因や各マザーファンドの値動きによって生じる組入比率の歪みに対し、基本ポートフォリオからのカイ離を修正するリバランスを随時実施し、期を通じて各資産の組入比率が基本ポートフォリオに近づくことを目的とした運用を継続する方針です。こうした運用によりベンチマークに連動させることを目標に運用してまいります。

＜基本ポートフォリオ＞

国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期金融商品
40%	25%	27%	5%	3%

＜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。

＜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。

○１万口当たりの費用明細

（2015年５月13日～2016年５月12日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	72	0.400	(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）	(39)	(0.216)	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）	(23)	(0.130)	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）	(10)	(0.054)	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	0.006	(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）	(1)	(0.003)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.003)	
(c) 有価証券取引税	2	0.009	(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）	(2)	(0.009)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	3	0.017	(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）	(2)	(0.013)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（監査費用）	(1)	(0.004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	78	0.432	
期中の平均基準価額は、18,014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、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

（2015年５月13日～2016年５月12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
ＴＯＰＩＸマザーファンド	408,101	564,729	277,106	406,951
外国株式インデックスマザーファンド	118,849	244,581	73,926	157,049
日本債券インデックスマザーファンド	325,931	419,082	462,695	595,837
外国債券インデックスマザーファンド	33,622	68,981	33,071	68,138

○株式売買比率

（2015年５月13日～2016年５月12日）

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	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	186,175,306千円	233,432,694千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	228,672,502千円	224,041,096千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.81	1.04

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2015年５月13日～2016年５月12日）

利害関係人との取引状況

＜三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）＞

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	106,204	37,561	35.4	79,971	17,549	21.9

平均保有割合　0.8%

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

＜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	192,818	3,670	1.9	114,849	7,344	6.4

平均保有割合　0.5%

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

＜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	286,063	84,760	29.6	126,250	49,856	39.5

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。
（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	34,058	1,659	4.9	27,994	1,524	5.4

平均保有割合　0.2%

※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。

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	2,615	2,093	4,998

＜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	1,136	302	1,990

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

＜ＴＯＰＩＸマザーファンド＞

種　　類	買　付　額
	百万円
株式	276

＜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	1,600

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）	265千円
うち利害関係人への支払額（B）	0.628千円
（B）／（A）	0.2%

（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ＭＵＦＧ証券です。

○組入資産の明細

（2016年５月12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
ＴＯＰＩＸマザーファンド	1,237,980	1,368,975	1,859,479
外国株式インデックスマザーファンド	536,974	581,896	1,147,850
日本債券インデックスマザーファンド	1,044,074	907,309	1,222,418
外国債券インデックスマザーファンド	116,431	116,981	230,150

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

○投資信託財産の構成

（2016年５月12日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ＴＯＰＩＸマザーファンド	1,859,479	40.3
外国株式インデックスマザーファンド	1,147,850	24.9
日本債券インデックスマザーファンド	1,222,418	26.5
外国債券インデックスマザーファンド	230,150	5.0
コール・ローン等、その他	154,209	3.3
投資信託財産総額	4,614,106	100.0

（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（269,579,000千円）の投資信託財産総額（270,164,641千円）に対する比率は99.8%です。
（注）外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（156,139,125千円）の投資信託財産総額（156,472,309千円）に対する比率は99.8%です。
（注）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

１アメリカドル＝108.37円	１カナダドル＝84.33円	１メキシコペソ＝6.03円	１ユーロ＝123.81円
１イギリスポンド＝156.52円	１スイスフラン＝111.63円	１スウェーデンクローネ＝13.33円	１ノルウェークローネ＝13.28円
１デンマーククローネ＝16.64円	１ポーランドズロチ＝27.97円	１オーストラリアドル＝79.91円	１ニュージーランドドル＝74.03円
１香港ドル＝13.97円	１シンガポールドル＝79.31円	１マレーシアリンギット＝26.97円	１イスラエルシェケル＝28.84円
１南アフリカランド＝7.21円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年５月12日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,614,106,625
コール・ローン等	145,864,674
ＴＯＰＩＸマザーファンド(評価額)	1,859,479,466
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	1,147,850,010
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	1,222,418,459
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	230,150,016
未収入金	8,344,000
(B) 負債	16,777,432
未払解約金	7,433,696
未払信託報酬	9,253,378
未払利息	296
その他未払費用	90,062
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	4,597,329,193
元本	2,688,259,481
次期繰越損益金	1,909,069,712
(D) 受益権総口数	2,688,259,481口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	17,102円

＜注記事項＞

①期首元本額　2,643,786,469円
　期中追加設定元本額　432,999,552円
　期中一部解約元本額　388,526,540円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.7102円です。

○損益の状況 (2015年５月13日～2016年５月12日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	62,529
受取利息	69,859
支払利息	△ 7,330
(B) 有価証券売買損益	△ 359,876,937
売買益	111,506,532
売買損	△ 471,383,469
(C) 信託報酬等	△ 19,294,780
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	△ 379,109,188
(E) 前期繰越損益金	1,179,655,855
(F) 追加信託差損益金	1,108,523,045
(配当等相当額)	(1,701,055,495)
(売買損益相当額)	(△ 592,532,450)
(G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	1,909,069,712
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ)	1,909,069,712
追加信託差損益金	1,108,523,045
(配当等相当額)	(1,701,967,857)
(売買損益相当額)	(△ 593,444,812)
分配準備積立金	1,246,323,658
繰越損益金	△ 445,776,991

(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

項　　目	2015年５月13日～2016年５月12日
費用控除後の配当等収益額	66,667,803円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	1,701,967,857円
分配準備積立金額	1,179,655,855円
当ファンドの分配対象収益額	2,948,291,515円
１万口当たり収益分配対象額	10,967円
１万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

＊三菱ＵＦＪ国際投信では本資料のほか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］

2015年７月１日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。（2015年７月１日）

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2016年５月12日現在）

＜ＴＯＰＩＸマザーファンド＞

下記は、ＴＯＰＩＸマザーファンド全体(172,879,052千口)の内容です。

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	49	55	14,465
日本水産	141.5	148.2	94,403
マルハニチロ	23.5	26.3	66,118
サカタのタネ	18.5	19	53,580
ホクト	12.8	13.1	27,405
ホクリヨウ	－	1.2	1,272
鉱業（0.3%）			
住石ホールディングス	32.1	37.8	3,515
日鉄鉱業	32	36	13,752
三井松島産業	75	84	9,492
国際石油開発帝石	606.5	677.6	573,927
日本海洋掘削	3.4	3.8	8,888
石油資源開発	16.4	20.4	49,572
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	7.7	8.7	11,344
建設業（3.2%）			
ショーボンドホールディングス	11.1	13.5	65,677
ミライト・ホールディングス	35.4	39.6	41,104
タマホーム	8.6	9.6	4,300
サンヨーホームズ	1.6	2.7	1,309
ダイセキ環境ソリューション	1.3	3	3,357
安藤・間	76.8	85.8	49,077
東急建設	40.9	41.9	35,573
コムシスホールディングス	51.2	55.3	106,452
ミサワホーム	13.6	15.2	11,673
ビーアールホールディングス	－	5.1	2,147
高松コンストラクショングループ	8.7	9.7	24,608
東建コーポレーション	4.3	5.3	45,845
ソネック	－	1.4	798
ヤマウラ	5.5	6	3,162
大成建設	598	668	508,348
大林組	345	385.8	416,664
清水建設	352	393	397,323
飛島建設	77.5	103.2	18,885
長谷工コーポレーション	144	150.1	154,603
松井建設	13	14.2	11,658
錢高組	16	18	6,858
鹿島建設	506	603	426,321
不動テトラ	87.1	90.8	12,167
大末建設	4.4	4.9	4,454
鉄建建設	70	78	21,684
日鉄住金テックスエンジ	22	－	－
西松建設	124	149	65,709
三井住友建設	467.1	492.9	47,318
大豊建設	31	50	24,200
前田建設工業	77	79	67,229
佐田建設	40	8.9	3,729
ナカノフドー建設	8.9	9.8	5,047
奥村組	109	122	73,200
大和小田急建設	6.2	－	－
東鉄工業	13.8	15.4	45,892
イチケン	13	14	3,892
淺沼組	37	41	10,496
戸田建設	144	150	78,000
熊谷組	145	188	54,520
青木あすなろ建設	7.5	8.4	5,863
北野建設	24	27	7,047
植木組	14	16	3,520
三井ホーム	15	17	8,296
矢作建設工業	14.2	17.5	15,837
ピーエス三菱	12.1	15.2	6,308
日本ハウスホールディングス	19.1	26.2	9,353
大東建託	43	47.3	785,180
新日本建設	13.6	15.3	7,604

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＮＩＰＰＯ	27	30	56,490
東亜道路工業	22	24	8,784
前田道路	36	40	83,160
日本道路	34	38	18,734
東亜建設工業	86	112	19,152
若築建設	66	74	11,322
東洋建設	34.5	40.4	18,826
五洋建設	127.8	142.7	71,920
大林道路	13	15	10,725
世紀東急工業	16.8	20.2	10,342
福田組	17	21	26,628
住友林業	84.9	88.5	122,572
日本基礎技術	13.8	14.3	6,134
日成ビルド工業	32	35	16,800
ヤマダ・エスバイエルホーム	52	65	5,720
巴コーポレーション	14.2	16	5,696
パナホーム	43	48	42,096
大和ハウス工業	337.1	380	1,146,460
ライト工業	18.4	24.7	28,232
積水ハウス	358.1	430	825,600
日特建設	15.4	14.1	5,795
北陸電気工事	6	6.2	5,332
ユアテック	18	20	15,700
西部電気工業	10	11	4,598
四電工	10	10	4,050
中電工	16.6	18.6	41,422
関電工	52	51	44,064
きんでん	77	77.8	101,140
東京エネシス	13	15	15,990
トーエネック	16	18	10,476
住友電設	9.1	10.2	14,239
日本電設工業	18.8	21	40,971
協和エクシオ	48.9	50.4	74,844
新日本空調	9.7	10.8	11,242
ＮＤＳ	19	20	5,600
九電工	21	23.5	77,550
三機工業	23.4	28.5	24,994
日揮	116	129	223,299
中外炉工業	35	39	7,527

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ヤマト	10	11.5	5,646
太平電業	16	19	18,126
高砂熱学工業	31.7	38.4	50,764
三晃金属工業	11	13	3,926
朝日工業社	13	15	6,600
明星工業	18.9	23.3	11,347
大氣社	16.4	15.7	39,501
ダイダン	15	17	13,736
日比谷総合設備	14.8	15.5	24,428
東芝プラントシステム	18.7	20.9	29,594
ＯＳＪＢホールディングス	15.6	26.2	6,838
東洋エンジニアリング	55	69	20,769
千代田化工建設	83	93	72,447
新興プランテック	23.6	26.4	23,416
食料品（5.2%）			
日本製粉	71	82	69,536
日清製粉グループ本社	126.2	141	260,991
日東富士製粉	9	10	3,350
昭和産業	47	53	26,447
鳥越製粉	9.1	10.2	6,426
中部飼料	11	11.9	9,972
フィード・ワン	69	77.4	9,442
東洋精糖	17	19	2,166
日本甜菜製糖	59	66	12,474
三井製糖	45	50	25,800
塩水港精糖	12.2	13.7	3,329
日新製糖	－	5.5	7,727
森永製菓	104	116	64,496
中村屋	27	30	13,680
江崎グリコ	26.6	29.7	170,181
名糖産業	5.1	5.7	7,461
不二家	66	74	14,060
山崎製パン	84	94	241,956
第一屋製パン	15	20	2,160
モロゾフ	18	20	8,680
亀田製菓	6.4	7.2	34,344
寿スピリッツ	2.7	9.2	21,712
カルビー	42.6	47.7	207,733
森永乳業	103	115	73,715

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
六甲バター	5.1	5.7	10,875
ヤクルト本社	61.7	69	373,980
明治ホールディングス	34.1	76.2	749,808
雪印メグミルク	27.1	30.3	92,112
プリマハム	64	81	24,543
日本ハム	85	95	243,960
伊藤ハム	63	－	－
林兼産業	37	41	4,018
丸大食品	59	66	30,096
米久	3.7	－	－
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	7.2	8.1	23,060
伊藤ハム米久ホールディングス	－	76.8	64,204
サッポロホールディングス	189	197	118,003
アサヒグループホールディングス	231.4	241.3	860,234
キリンホールディングス	466.6	521.3	948,505
宝ホールディングス	90.3	93.1	90,027
オエノンホールディングス	29	35	7,490
養命酒製造	7	4	7,632
コカ・コーラウエスト	39	43.6	138,212
コカ・コーライーストジャパン	35	45.5	98,917
サントリー食品インターナショナル	69	88.1	459,882
ダイドードリンコ	5.8	6.5	36,335
伊藤園	34.2	38.2	134,846
キーコーヒー	10.1	11.3	21,289
ユニカフェ	3.1	3.5	3,132
ジャパンフーズ	1.5	1.6	1,891
日清オイリオグループ	55	68	34,952
不二製油グループ本社	30.7	34.3	69,045
かどや製油	1.1	1.3	3,616
Ｊ－オイルミルズ	48	54	19,386
キッコーマン	94	97	358,415
味の素	266	270.5	671,922
キユーピー	58.6	65.4	192,668
ハウス食品グループ本社	42.6	44	96,624
カゴメ	44.5	46.2	121,737
焼津水産化学工業	5.4	6	5,970
アリアケジャパン	10.5	10.5	68,145
ピエトロ	－	1.2	2,278
エバラ食品工業	1.9	3.1	6,038

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ニチレイ	123	137	130,972
東洋水産	60.1	63.2	258,488
イートアンド	1.3	1.4	3,098
日清食品ホールディングス	48.7	54.4	305,728
永谷園ホールディングス	11	12	13,260
一正蒲鉾	4	4.5	4,549
フジッコ	11	12.5	30,037
ロック・フィールド	6	13.4	22,766
日本たばこ産業	638.1	760.4	3,467,424
ケンコーマヨネーズ	3.7	4.2	10,025
わらべや日洋	6.7	6.9	14,393
なとり	5.3	6.4	10,752
北の達人コーポレーション	－	2.4	1,197
ユーグレナ	38.5	41.2	64,354
ミヨシ油脂	39	44	5,544
理研ビタミン	3.4	3.8	16,720
繊維製品（0.8%）			
片倉工業	13.5	15.1	18,180
グンゼ	87	97	31,137
東洋紡	426	476	88,060
ユニチカ	313	350	19,600
富士紡ホールディングス	52	58	12,934
日清紡ホールディングス	68	－	－
倉敷紡績	110	123	23,862
シキボウ	62	73	8,249
日本毛織	34	37	28,712
大東紡織	16	17	1,088
トーア紡コーポレーション	48	5.1	2,453
ダイドーリミテッド	12	13.4	6,217
帝国繊維	11.2	12.6	18,874
帝人	440	491	181,179
東レ	833	872	835,201
サカイオーベックス	28	32	5,504
住江織物	27	30	7,980
日本フエルト	5.7	6.4	2,860
イチカワ	7	8	2,168
日本バイリーン	15	－	－
日東製網	12	13	1,820
芦森工業	23	26	4,134

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アツギ	90	93	10,509
ダイニック	20	23	3,496
セーレン	26.8	29.9	35,850
東海染工	15	17	2,193
小松精練	17.9	18.5	11,026
ワコールホールディングス	64	72	86,328
ホギメディカル	6.8	7.6	48,944
レナウン	25.7	32.5	3,900
クラウディア	2.8	2.8	1,411
ＴＳＩホールディングス	48	53.7	37,267
三陽商会	56	67	16,884
ナイガイ	39	44	2,112
オンワードホールディングス	77	78	60,372
ルック	18	22	3,256
キムラタン	477	507	3,549
ゴールドウイン	25	5.1	23,358
デサント	24.5	27.4	37,428
キング	5.4	6	2,238
ヤマトインターナショナル	7.1	7.4	2,908
パルプ・紙（0.3%）			
特種東海製紙	63	70	24,430
王子ホールディングス	441	493	218,399
日本製紙	51.9	62.2	131,490
三菱製紙	164	183	14,640
北越紀州製紙	66.8	74.6	51,548
中越パルプ工業	41	48	10,224
巴川製紙所	17	19	3,553
大王製紙	48	53.2	60,488
レンゴー	95	106	61,480
トーモク	34	38	11,096
ザ・パック	7.6	8.5	21,734
化学（6.3%）			
クラレ	183.2	189.7	271,840
旭化成	671	750	552,375
共和レザー	7	7.9	7,204
コープケミカル	16	－	－
昭和電工	716	800	89,600
住友化学	792	885	441,615
日本化成	20	22	2,420

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
住友精化	22	25	14,150
日産化学工業	70.6	72.3	216,321
ラサ工業	41	45	4,770
クレハ	75	91	34,398
多木化学	7	8	5,088
テイカ	18	20	9,900
石原産業	180	216	16,632
片倉コープアグリ	7	14	2,954
日東エフシー	－	7	6,454
日本曹達	69	78	44,694
東ソー	269	324	166,536
トクヤマ	167	199	40,596
セントラル硝子	110	130	71,760
東亜合成	135	75.3	77,483
大阪ソーダ	43	52	20,956
関東電化工業	26	29	24,099
デンカ	223	249	123,255
信越化学工業	193	215.6	1,344,912
日本カーバイド工業	37	41	6,765
堺化学工業	44	49	15,190
エア・ウォーター	95	99	167,013
大陽日酸	138.2	92.6	100,934
日本化学工業	40	45	9,225
日本パーカライジング	50.8	61.4	59,680
高圧ガス工業	16	18	11,430
チタン工業	13	14	2,646
四国化成工業	16	17	14,569
戸田工業	21	24	7,272
ステラ　ケミファ	5.5	6.1	17,708
保土谷化学工業	32	36	8,316
日本触媒	85	17.5	96,075
大日精化工業	45	46	21,390
カネカ	145	162	148,878
三菱瓦斯化学	185	207	124,407
三井化学	489	510	187,680
ＪＳＲ	106.3	112.8	172,245
東京応化工業	22.3	24.1	62,057
大阪有機化学工業	7.7	8.6	5,538
三菱ケミカルホールディングス	672.8	805.4	464,232

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本合成化学工業	25	28	17,472
ダイセル	151.4	169.1	236,909
住友ベークライト	101	112	49,280
積水化学工業	249	272.9	378,239
日本ゼオン	93	101	80,901
アイカ工業	32.3	36.1	89,094
宇部興産	542	644	125,580
積水樹脂	16.6	18.6	28,532
タキロン	23	28	15,652
旭有機材	38	39	7,878
日立化成	53.2	59.4	116,186
ニチバン	11	12	7,608
リケンテクノス	17.3	25.9	11,629
大倉工業	26	29	8,091
積水化成品工業	31	31	11,191
群栄化学工業	29	32	9,376
タイガースポリマー	5.3	5.9	3,363
ミライアル	3.9	4.3	3,203
ダイキアクシス	1.6	2.2	1,973
ダイキョーニシカワ	3.5	15.5	21,033
日本化薬	70	78	80,730
カーリットホールディングス	8.5	11.1	5,427
日本精化	8.9	9.9	7,514
扶桑化学工業	－	7.6	12,646
ＡＤＥＫＡ	49.6	59.1	90,423
日油	88	90	83,160
新日本理化	17	19	3,496
ハリマ化成グループ	9.2	10.2	5,283
花王	289.4	323.4	1,981,471
第一工業製薬	23	27	9,234
ニイタカ	－	1.7	2,374
三洋化成工業	34	38	31,312
大日本塗料	62	69	13,455
日本ペイントホールディングス	93.1	92.8	260,953
関西ペイント	130	136	271,592
神東塗料	8	9	1,494
中国塗料	31	34	24,922
日本特殊塗料	8.3	8.4	8,206
藤倉化成	14.6	16.3	8,019

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	8.8	8.8	30,844
ＤＩＣ	431	475	119,225
サカタインクス	22	24.5	30,355
東洋インキＳＣホールディングス	106	119	51,884
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	3.6	8.7	7,830
富士フイルムホールディングス	246.3	275.1	1,251,154
資生堂	191.4	228.1	560,213
ライオン	124	139	231,018
高砂香料工業	35	7.9	20,840
マンダム	10.8	11.2	56,672
ミルボン	6.3	7.1	34,222
ファンケル	25	27.9	43,272
コーセー	17.4	19.4	174,406
コタ	3.7	4.1	4,481
シーズ・ホールディングス	7.3	15.1	32,736
シーボン	1.2	1.4	3,238
ポーラ・オルビスホールディングス	12.8	12.3	113,529
ノエビアホールディングス	6.8	7.6	23,826
アジュバンコスメジャパン	2	2.3	2,217
エステー	7.3	8.2	9,389
アグロ　カネショウ	2.9	4.7	4,700
コニシ	8.4	18.9	27,178
長谷川香料	13.6	15.2	28,074
星光ＰＭＣ	5.9	6.6	8,005
小林製薬	17.6	18.2	161,070
荒川化学工業	9.1	10.2	9,792
メック	8.3	9.3	7,812
日本高純度化学	3	3.4	7,010
タカラバイオ	－	25.8	35,991
ＪＣＵ	2.9	3.5	12,302
新田ゼラチン	6.4	7.9	5,996
ＯＡＴアグリオ	－	1.4	2,268
デクセリアルズ	－	35.9	31,520
アース製薬	7.7	8.6	41,925
イハラケミカル工業	16.5	18.5	25,289
北興化学工業	11	13	4,173
大成ラミック	3	3.4	9,227
クミアイ化学工業	22.2	24.8	23,113
日本農薬	24.6	27.5	15,675

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	91	98	13,426
有沢製作所	18.1	17.8	9,736
日東電工	83.2	92.9	633,113
レック	3.7	3.7	4,972
きもと	19.1	19.5	3,198
藤森工業	9.2	10.3	26,326
前澤化成工業	7.5	8.4	8,374
ＪＳＰ	8	7.8	17,534
エフピコ	9.5	10.7	52,537
天馬	8.3	9.2	16,201
信越ポリマー	21.1	23.6	15,812
東リ	28	31	10,478
ニフコ	24	23	123,970
日本バルカー工業	45	47	13,395
ユニ・チャーム	217.9	243.4	566,756
医薬品（5.8%）			
協和発酵キリン	129	143.8	285,874
武田薬品工業	403.3	478.9	2,399,767
アステラス製薬	1,225.7	1,346.3	1,985,792
大日本住友製薬	76.2	85.1	124,926
塩野義製薬	168	175.2	1,032,278
田辺三菱製薬	125.4	140.1	258,204
わかもと製薬	12	14	3,640
あすか製薬	12.7	15.3	22,032
日本新薬	25	27.5	138,050
ビオフェルミン製薬	1.7	1.9	6,336
中外製薬	107.1	119.7	438,700
科研製薬	37	20.7	120,474
エーザイ	141.9	148	975,912
ロート製薬	48.9	58.8	109,720
小野薬品工業	48.9	273	1,396,395
久光製薬	30.4	37.3	200,674
有機合成薬品工業	7	8	1,984
持田製薬	7.4	8.2	65,682
参天製薬	197.8	221.5	339,116
扶桑薬品工業	36	40	11,440
日本ケミファ	14	17	7,956
ツムラ	33.9	37.8	104,857
日医工	25.2	28.1	67,889

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キッセイ薬品工業	20	21.3	51,162
生化学工業	20.6	23	39,560
栄研化学	9	10.1	19,482
日水製薬	4.3	4.8	5,563
鳥居薬品	7.4	8.2	21,139
ＪＣＲファーマ	8.3	9.2	25,373
東和薬品	5.5	5.5	27,555
富士製薬工業	3	3.9	7,601
沢井製薬	17	20.4	144,432
ゼリア新薬工業	22	24.6	33,726
第一三共	361.9	404.4	1,035,870
キョーリン製薬ホールディングス	28.7	32.1	66,543
大幸薬品	4.8	5.9	8,861
ダイト	4.8	6.7	19,021
大塚ホールディングス	213.6	258.5	1,103,278
大正製薬ホールディングス	25.9	28.9	260,678
ペプチドリーム	－	20	130,800
石油・石炭製品（0.5%）			
日本コークス工業	96.1	97	7,275
昭和シェル石油	96.2	120.9	132,143
コスモ石油	298	－	－
ニチレキ	13	14.7	10,157
東燃ゼネラル石油	162	181	176,656
ユシロ化学工業	5.8	6.4	7,878
ビーピー・カストロール	4.4	4.9	6,340
富士石油	24.8	27.9	9,597
ＭＯＲＥＳＣＯ	2.8	3.8	4,370
出光興産	51	62.7	136,874
ＪＸホールディングス	1,194.3	1,423.2	635,031
コスモエネルギーホールディングス	－	36.3	48,932
ゴム製品（0.9%）			
横浜ゴム	119	72.5	134,705
東洋ゴム工業	48.7	54.4	88,454
ブリヂストン	337.3	405.8	1,571,663
住友ゴム工業	83.9	112.5	177,862
藤倉ゴム工業	9	10	4,400
オカモト	37	37	35,853
フコク	4.5	4.4	3,863
ニッタ	10.6	12.9	35,204

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
住友理工	19.9	26	23,582
三ツ星ベルト	26	29	24,853
バンドー化学	39	44	22,264
ガラス・土石製品（0.9%）			
日東紡績	79	79	27,571
旭硝子	530	634	427,950
日本板硝子	519	580	49,300
石塚硝子	14	17	3,060
日本山村硝子	43	48	7,872
日本電気硝子	206	248	127,472
オハラ	4.1	4.5	2,290
住友大阪セメント	200	238	106,386
太平洋セメント	671	750	209,250
デイ・シイ	11.1	11.1	3,907
日本ヒューム	11.2	11.5	6,727
日本コンクリート工業	18.4	24.7	7,286
三谷セキサン	5.4	6	10,320
アジアパイルホールディングス	14.3	14.8	6,216
東海カーボン	93	104	31,512
日本カーボン	57	59	13,393
東洋炭素	6	6.7	9,246
ノリタケカンパニーリミテド	61	68	16,864
ＴＯＴＯ	158	88.3	344,811
日本碍子	136	152	360,088
日本特殊陶業	92.7	103.6	209,375
ダントーホールディングス	14	14	2,562
ＭＡＲＵＷＡ	3.2	4.4	13,662
品川リフラクトリーズ	27	30	5,790
黒崎播磨	23	26	6,630
ヨータイ	6	7	2,002
イソライト工業	5.4	5.9	1,315
東京窯業	13	14.6	2,438
ニッカトー	3.9	4.2	1,579
フジミインコーポレーテッド	10.4	10.6	17,479
エーアンドエーマテリアル	22	25	2,000
ニチアス	48	62	49,848
ニチハ	14.3	16	25,232
鉄鋼（1.2%）			
新日鐵住金	4,548	542	1,198,633

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
神戸製鋼所	1,860	2,208	227,424
中山製鋼所	81	135	8,505
合同製鐵	55	67	12,797
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	274.5	328.5	481,416
日新製鋼	45.6	54.8	80,994
東京製鐵	54.4	66.3	41,835
共英製鋼	11.5	12.8	19,955
大和工業	24.5	26.5	66,594
東京鐵鋼	21	25	8,650
大阪製鐵	6.7	7.5	13,792
淀川製鋼所	74	17.9	46,253
東洋鋼鈑	25.7	28.7	8,810
丸一鋼管	33	40.2	136,680
モリ工業	17	19	5,605
大同特殊鋼	180	201	72,963
日本高周波鋼業	42	47	3,572
日本冶金工業	84.1	88.4	14,232
山陽特殊製鋼	64	71	32,873
愛知製鋼	63	71	30,388
日立金属	109	137.6	160,166
日本金属	28	31	3,286
大平洋金属	69	84	27,804
新日本電工	65.5	68	11,424
栗本鐵工所	56	57	10,146
虹技	15	17	2,618
日本鋳鉄管	11	13	1,989
三菱製鋼	70	84	14,868
日亜鋼業	14.8	16.6	3,818
日本精線	8	8	3,688
シンニッタン	11.1	10.8	6,771
新家工業	21	24	3,000
非鉄金属（0.8%）			
大紀アルミニウム工業所	18	19	5,206
日本軽金属ホールディングス	260.9	272	54,128
三井金属鉱業	292	306	56,304
東邦亜鉛	61	63	17,829
三菱マテリアル	671	750	263,250
住友金属鉱山	297	332	382,132
ＤＯＷＡホールディングス	129	155	100,750

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
古河機械金属	168	187	33,286
エス・サイエンス	52.6	54.6	2,020
大阪チタニウムテクノロジーズ	10.6	11.8	15,918
東邦チタニウム	18.2	20.3	15,103
ＵＡＣＪ	123	168	43,848
古河電気工業	316	378	97,524
住友電気工業	405.3	481.1	616,289
フジクラ	150	167	89,178
昭和電線ホールディングス	118	143	9,009
東京特殊電線	1.5	1.7	1,414
タツタ電線	20.1	25	8,375
沖電線	11	14	2,730
カナレ電気	1.7	1.9	3,712
平河ヒューテック	2.5	5.7	5,090
リョービ	60	73	31,317
アーレスティ	12.5	13.9	11,022
アサヒホールディングス	16.2	18.1	29,340
金属製品（0.6%）			
稲葉製作所	5.7	6.4	8,492
宮地エンジニアリンググループ	31	37	5,772
トーカロ	7.1	8.4	15,540
アルファＣｏ	3.6	4	4,008
ＳＵＭＣＯ	83.7	94.1	66,152
川田テクノロジーズ	2	2.3	8,015
東洋製罐グループホールディングス	76.4	85.4	187,880
ホッカンホールディングス	26	31	10,044
コロナ	5.6	6.3	6,867
横河ブリッジホールディングス	20.4	22.7	22,654
駒井ハルテック	19	21	4,662
高田機工	9	10	2,030
三和ホールディングス	101.2	119.3	105,819
文化シヤッター	29.9	33.5	31,322
三協立山	14.1	15.7	23,722
アルインコ	4.5	9	8,883
東洋シヤッター	2.6	3	1,602
ＬＩＸＩＬグループ	159.8	167.4	351,874
日本フイルコン	7.8	8.7	3,758
ノーリツ	21.1	23.5	44,744
長府製作所	11.5	12.8	31,500

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	22.3	211,850
ダイニチ工業	5.5	6.1	3,733
日東精工	15	17	4,845
三洋工業	13	15	2,730
岡部	21.2	24.9	18,525
ジーテクト	9.8	12.5	16,912
中国工業	1.6	1.8	1,252
東プレ	20.7	23.1	57,149
高周波熱錬	18.5	22.3	18,174
東京製綱	73	81	12,150
サンコール	7	6.4	3,078
モリテック　スチール	5.5	6	1,488
パイオラックス	5.4	6.1	33,611
日本発條	93.4	113.1	110,272
中央発條	14	15	4,425
アドバネクス	20	2.2	2,763
立川ブラインド工業	－	5	3,520
三益半導体工業	7.9	8.9	9,122
機械（4.8%）			
日本ドライケミカル	1.5	1.5	3,396
日本製鋼所	154	199	84,973
三浦工業	48	53.6	106,717
タクマ	34	44	40,920
ツガミ	31	35	15,505
オークマ	70	78	64,896
東芝機械	59	65	22,230
アマダホールディングス	160.3	175.2	206,385
アイダエンジニアリング	23.5	31.5	32,004
滝澤鉄工所	34	38	4,598
富士機械製造	35.1	39.2	44,805
牧野フライス製作所	54	60	40,860
オーエスジー	49	54.7	110,056
ダイジェット工業	12	14	1,946
旭ダイヤモンド工業	29.5	32.3	35,465
ＤＭＧ森精機	67.9	66.3	87,383
ソディック	20.5	30.5	27,297
ディスコ	12.5	15.3	145,044
日東工器	6.3	7	15,309
パンチ工業	3.8	4.7	3,976

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	6.7	3,611
ＯＫＫ	42	46	5,014
石川製作所	26	30	2,250
東洋機械金属	7.3	8.9	3,604
津田駒工業	26	29	3,625
エンシュウ	26	29	2,088
島精機製作所	15.2	17	40,290
ＮＣホールディングス	－	3.9	4,660
フリュー	－	2.4	6,638
ヤマシンフィルタ	－	2.3	1,069
日阪製作所	13.6	15.2	11,932
やまびこ	4.2	22	17,270
ペガサスミシン製造	9.4	12.4	6,906
ナブテスコ	65.5	62.4	165,297
三井海洋開発	10.8	14.1	25,873
レオン自動機	8.2	10.1	5,736
ＳＭＣ	32.2	36	982,620
新川	9	10.7	4,729
ホソカワミクロン	18	20	11,560
ユニオンツール	5.3	5.2	14,939
オイレス工業	12.7	15.5	27,342
日精エー・エス・ビー機械	3.9	3.8	8,189
サトーホールディングス	13.4	16.2	37,519
日本エアーテック	3.2	4.2	2,641
日精樹脂工業	7.8	8.7	5,594
オカダアイヨン	－	2.3	1,922
ワイエイシイ	4.3	4.8	5,702
小松製作所	527.2	589	1,063,145
住友重機械工業	294	350	189,700
日立建機	48	53.7	92,041
日工	15	18	5,868
巴工業	4	4.9	7,271
井関農機	110	123	29,643
ＴＯＷＡ	8.8	11.6	10,126
丸山製作所	22	25	4,175
北川鉄工所	49	55	10,890
タカキタ	－	4	2,260
クボタ	517	576.9	976,114
荏原実業	3.2	3.6	4,618

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三菱化工機	35	39	8,385
月島機械	18.9	22.8	21,865
帝国電機製作所	7.2	8.7	6,777
東京機械製作所	40	45	1,935
新東工業	25.3	27.2	23,228
澁谷工業	9	10	15,710
アイチ　コーポレーション	15.2	17	14,297
小森コーポレーション	26.1	29.2	37,580
鶴見製作所	8	8.9	13,198
住友精密工業	17	19	6,327
酒井重工業	20	23	4,186
荏原製作所	223	266	146,034
石井鐵工所	16	18	2,718
酉島製作所	10.5	12.8	13,465
北越工業	10.6	12.9	8,165
ダイキン工業	149.6	167.2	1,542,252
オルガノ	20	21	8,421
トーヨーカネツ	62	64	14,208
栗田工業	60.8	72.2	189,380
椿本チエイン	55	68	51,884
大同工業	21	24	4,632
日本コンベヤ	33	－	－
木村化工機	9.9	10.3	3,872
アネスト岩田	16	19.3	21,230
ダイフク	50.8	61.7	122,659
サムコ	1.5	2.9	2,659
加藤製作所	22	27	12,015
油研工業	20	23	4,140
タダノ	50	55.4	56,951
フジテック	29.9	33.4	36,606
ＣＫＤ	28.8	31.9	28,646
キトー	11.2	14.5	11,542
平和	22.3	35.6	78,747
理想科学工業	12.5	12.7	19,697
ＳＡＮＫＹＯ	28.6	31.9	128,716
日本金銭機械	9.5	10.6	9,232
マースエンジニアリング	5.8	6.5	12,792
福島工業	5.6	7.1	20,156
オーイズミ	3.6	4.8	2,260

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ダイコク電機	4.2	4.7	6,349
竹内製作所	4.3	22.7	38,748
アマノ	34.2	35.5	64,610
ＪＵＫＩ	76	17	18,666
サンデンホールディングス	63	70	27,370
蛇の目ミシン工業	100	11.1	6,637
マックス	16	18	22,518
グローリー	32.8	39.1	132,353
新晃工業	7.2	8	11,872
大和冷機工業	14.9	18.4	17,443
セガサミーホールディングス	110.4	123.4	149,560
日本ピストンリング	40	4.8	7,147
リケン	44	53	18,921
ＴＰＲ	11.5	14.1	38,930
ツバキ・ナカシマ	－	14.2	20,717
ホシザキ電機	22.5	25.2	250,488
大豊工業	8.3	9.3	11,652
日本精工	211.1	235.8	251,362
ＮＴＮ	238	285	100,890
ジェイテクト	109.5	122.4	176,868
不二越	95	107	37,343
日本トムソン	35	39.3	16,073
ＴＨＫ	68.3	76.3	163,968
ユーシン精機	4.5	4.4	7,774
前澤給装工業	3.9	4.7	6,791
イーグル工業	14.3	14.2	20,277
前澤工業	7.6	8.4	2,520
日本ピラー工業	11.2	11.6	10,614
キッツ	46.1	51.2	25,548
日立工機	27.5	30.7	22,533
マキタ	67	74.9	530,292
日立造船	80.3	91	55,510
三菱重工業	1,722	2,044	846,420
ＩＨＩ	740	882	227,556
電気機器（11.5%）			
日清紡ホールディングス	－	63.7	78,542
イビデン	67.4	70.3	93,358
コニカミノルタ	244.9	286.7	276,665
ブラザー工業	132.8	148.4	190,248

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ミネベア	153	185	164,835
日立製作所	2,467	2,929	1,419,979
東芝	2,163	2,417	538,749
三菱電機	1,028	1,225	1,512,875
富士電機	286	346	162,274
東洋電機製造	20	23	7,337
安川電機	125.3	142.6	182,385
シンフォニアテクノロジー	71	74	10,878
明電舎	94	105	50,505
オリジン電気	15	17	4,692
山洋電気	23	30	16,560
デンヨー	8.8	10.6	12,709
東芝テック	74	82	32,226
芝浦メカトロニクス	17	19	3,952
マブチモーター	31.4	32.9	184,240
日本電産	112.6	138.2	1,147,060
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	－	1.3	2,544
東光高岳	5.2	6.4	11,276
ダブル・スコープ	－	4.6	31,602
宮越ホールディングス	3.5	3.9	1,415
ダイヘン	56	68	36,176
田淵電機	11.6	13	5,603
ヤーマン	1.3	1.5	3,130
ＪＶＣケンウッド	75.4	84.2	22,818
ミマキエンジニアリング	6.1	10.3	5,510
第一精工	3.7	4.8	5,481
日新電機	24.1	26.9	31,607
大崎電気工業	19	21	16,233
オムロン	111	129.6	434,808
日東工業	16.5	18.4	31,114
ＩＤＥＣ	12.2	15	15,090
不二電機工業	1	1.1	1,573
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	198	221	104,975
サクサホールディングス	26	29	6,235
メルコホールディングス	5.7	6.3	14,011
テクノメディカ	2.3	2.6	5,288
日本電気	1,330	1,578	403,968
富士通	991	1,107	431,619
沖電気工業	362	497	82,502

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
岩崎通信機	45	54	3,834
電気興業	29	30	14,310
サンケン電気	52	63	19,215
ナカヨ	10	11	3,476
アイホン	5.9	6.5	10,809
ルネサスエレクトロニクス	53.2	59.4	35,580
セイコーエプソン	140.3	170.9	318,557
ワコム	80.9	90.4	37,787
アルバック	17.3	21.1	76,171
アクセル	4.7	5.2	4,643
ＥＩＺＯ	9.4	11.3	34,917
ジャパンディスプレイ	211.1	214.4	45,667
日本信号	28.3	31.7	30,812
京三製作所	24	27	9,666
能美防災	13.6	13	18,434
ホーチキ	7.4	8.3	10,889
エレコム	4.3	9.9	20,047
日本無線	22	34	9,826
パナソニック	1,252.3	1,311.5	1,249,990
シャープ	868	970	126,100
アンリツ	61.7	68.9	41,960
富士通ゼネラル	31	35	68,040
日立国際電気	27	26.3	34,216
ソニー	671.8	810	2,308,500
ＴＤＫ	62	69.3	417,186
帝国通信工業	24	27	4,509
ミツミ電機	36.3	43.7	23,029
タムラ製作所	40	44	13,860
アルプス電気	81.1	98.9	189,690
池上通信機	35	36	4,428
パイオニア	154.4	185.7	54,224
日本電波工業	9.3	10.4	7,467
鈴木	1.3	4.4	2,565
日本トリム	2.5	3.1	23,746
ローランド　ディー．ジー．	4.1	5.6	11,211
フォスター電機	12	14.4	28,641
クラリオン	54	60	17,520
ＳＭＫ	30	34	15,708
ヨコオ	8	8.2	4,149

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東光	24	－	－
ティアック	55	82	3,198
ホシデン	31.1	34.8	24,186
ヒロセ電機	17.4	18.5	239,945
日本航空電子工業	29	33	44,154
ＴＯＡ	11	13.5	13,459
日立マクセル	20.4	19	31,179
古野電気	12.2	13.6	8,241
ユニデンホールディングス	28	36	4,428
アルパイン	24.5	27.4	32,797
スミダコーポレーション	9.2	9.4	6,937
アイコム	5.7	6.4	13,062
リオン	3.9	4.4	7,471
本多通信工業	－	3	3,090
船井電機	10.4	11.6	10,196
横河電機	102.8	114.9	138,914
新電元工業	40	41	16,974
アズビル	33.6	37.5	106,125
東亜ディーケーケー	4.3	6.4	3,097
日本光電工業	43.8	48	146,640
チノー	3.7	4.1	4,116
共和電業	12.5	14	5,096
日本電子材料	4.4	4.5	1,948
堀場製作所	19	21.2	92,326
アドバンテスト	70	78.2	83,752
小野測器	5	5.6	4,642
エスペック	11.4	11.9	18,385
パナソニック　デバイスＳＵＮＸ	9	10.1	6,090
キーエンス	23.3	26	1,736,800
日置電機	5.4	6	13,944
シスメックス	79.6	89.1	699,435
日本マイクロニクス	－	21.4	18,061
メガチップス	10.7	11.5	13,685
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6.7	6.7	24,555
澤藤電機	6	6	1,044
コーセル	14.9	15.9	17,315
新日本無線	7	8.4	3,670
オプテックス	7	8.5	25,797
千代田インテグレ	5.4	6	12,582

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アイ・オー・データ機器	－	3.6	2,286
レーザーテック	10.5	13.4	17,232
スタンレー電気	73.7	82.1	188,830
岩崎電気	35	39	6,591
ウシオ電機	62.4	69.7	92,770
岡谷電機産業	5.6	6.1	2,287
ヘリオス　テクノ　ホールディング	9.4	9.8	3,635
日本セラミック	5.9	6.6	12,632
遠藤照明	4.7	5.8	6,252
日本デジタル研究所	8.7	9.7	14,414
古河電池	7	8	5,360
双信電機	5.1	5.6	1,624
山一電機	11.9	10	5,570
図研	7.4	8.3	8,864
日本電子	44	45	23,985
カシオ計算機	103	115.1	197,281
ファナック	107	117.4	1,910,685
日本シイエムケイ	26.2	24.7	9,978
エンプラス	4.7	5.8	17,806
大真空	19	21	5,103
ローム	50.7	56.6	250,455
浜松ホトニクス	80.2	89.6	251,417
三井ハイテック	13.5	16.7	11,322
新光電気工業	38.8	43.4	25,172
京セラ	168.7	188.4	1,009,070
太陽誘電	53.8	55.8	57,139
村田製作所	107.8	121.048	1,583,307
ユーシン	14.3	15.2	10,609
双葉電子工業	17.6	18.8	31,189
北陸電気工業	44	46	5,934
ニチコン	32.4	36.1	26,641
日本ケミコン	83	93	14,322
ＫＯＡ	14.2	15.9	12,449
市光工業	25	27	6,426
小糸製作所	61.6	68.8	332,648
ミツバ	18.9	19.5	32,389
スター精密	19.5	21.8	26,944
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	97	118	111,510
キヤノン電子	9.4	10.5	16,705

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キヤノン	595.8	618	1,902,822
リコー	309	371.7	354,601
ＭＵＴＯＨホールディングス	14	14	3,178
東京エレクトロン	86.4	94.2	687,660
輸送用機器（9.3%）			
トヨタ紡織	35.9	40.1	90,425
鬼怒川ゴム工業	24	26	20,020
ユニプレス	19.7	23.8	49,337
豊田自動織機	93.6	104.5	483,312
モリタホールディングス	18	20.1	28,521
三櫻工業	13	14.6	8,453
デンソー	253.9	283.6	1,150,848
東海理化電機製作所	27.1	33.6	65,822
三井造船	398	444	76,368
川崎重工業	746	893	285,760
名村造船所	28.6	34.4	28,380
サノヤスホールディングス	12.4	13.9	2,752
日本車輌製造	37	47	11,891
ニチユ三菱フォークリフト	11.8	13.2	7,233
近畿車輛	15	17	4,913
日産自動車	1,442.4	1,602.1	1,583,035
いすゞ自動車	324.8	332.7	411,383
トヨタ自動車	1,417.7	1,427.8	7,928,573
日野自動車	146.7	163.8	172,153
三菱自動車工業	376.6	455.8	262,085
エフテック	5.9	6	6,192
レシップホールディングス	3.4	3.8	2,698
ＧＭＢ	1.5	1.9	1,417
ファルテック	1.5	2	2,550
武蔵精密工業	11	12.2	27,181
日産車体	45.2	56	60,536
新明和工業	41	50	39,150
極東開発工業	19.1	22.9	25,304
日信工業	18.8	25.7	38,652
トピー工業	85	94	18,424
ティラド	40	45	7,740
曙ブレーキ工業	43.4	58.2	13,677
タチエス	16.3	18.2	26,808
ＮＯＫ	49.7	55.5	102,952

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フタバ産業	31.3	35	18,305
ＫＹＢ	115	128	45,952
シロキ工業	23	－	－
大同メタル工業	14.3	16	12,992
プレス工業	50.9	61	23,546
ミクニ	9.8	14.6	4,759
カルソニックカンセイ	78	88	68,200
太平洋工業	20.9	25.5	28,330
ケーヒン	23.6	26.4	45,540
河西工業	12.6	14.1	16,285
アイシン精機	94	117.7	499,636
富士機工	11.9	13.3	5,453
マツダ	306.2	363.5	645,939
ダイハツ工業	122.6	137	200,842
今仙電機製作所	8.7	10.5	10,017
本田技研工業	924.7	1,033.1	3,122,028
スズキ	214.8	210	640,290
富士重工業	349.7	362.8	1,408,026
安永	3.4	3.8	1,827
ヤマハ発動機	156.3	162.1	287,403
ショーワ	24.3	29.8	23,393
ＴＢＫ	13.1	13.6	5,032
エクセディ	14	15.6	40,965
豊田合成	33.2	41.7	85,693
愛三工業	15.9	20.1	17,647
盟和産業	8	1.9	1,919
ヨロズ	9.6	10.8	19,677
エフ・シー・シー	15.1	18.8	35,212
シマノ	44.4	46.3	766,728
タカタ	18.6	20.7	7,534
テイ・エス　テック	21.7	26.7	76,121
ジャムコ	3.9	6.7	14,425
精密機器（1.6%）			
テルモ	157.5	176	740,960
クリエートメディック	3.4	3.8	3,226
日機装	33.3	41.3	35,352
島津製作所	123	148	265,660
ＪＭＳ	19	21	6,111
クボテック	2.2	2.5	1,245

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
モリテックス	2.2	－	－
長野計器	6.6	6.9	4,084
ブイ・テクノロジー	2	2.7	16,524
東京計器	35	37	5,846
愛知時計電機	14	15	4,575
オーバル	10	11.2	2,688
東京精密	18.5	22.1	53,194
マニー	3.1	15.2	27,648
ニコン	191.9	214.3	335,379
トプコン	31	38.5	41,041
オリンパス	153.1	171	730,170
理研計器	9.1	9.3	10,202
タムロン	7.9	9.2	14,738
ＨＯＹＡ	244.5	259.6	1,033,467
ノーリツ鋼機	9.2	10.3	6,293
エー・アンド・デイ	9.3	10.4	4,014
シチズンホールディングス	126.5	141.3	91,421
リズム時計工業	45	50	7,450
大研医器	7.1	9.1	7,926
メニコン	－	7.7	29,106
松風	5	5.6	7,767
セイコーホールディングス	73	74	29,748
ニプロ	65.6	85.6	100,836
その他製品（1.6%）			
スノーピーク	－	1.3	4,732
パラマウントベッドホールディングス	10.8	12.1	52,090
トランザクション	0.8	2.3	1,660
ＳＨＯ－ＢＩ	3.5	3.8	1,516
ニホンフラッシュ	－	4.5	5,211
前田工繊	11.3	11.5	12,431
永大産業	15	16	6,928
アートネイチャー	7.4	12.3	11,365
ダンロップスポーツ	6.5	7.2	7,444
バンダイナムコホールディングス	113.3	118.7	289,271
アイフィスジャパン	－	2.6	1,170
共立印刷	18.5	19.1	5,348
ＳＨＯＥＩ	－	5.2	8,236
フランスベッドホールディングス	72	16	15,712
パイロットコーポレーション	9	20	100,600

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
萩原工業	2.1	3.2	8,294
トッパン・フォームズ	18.3	20.5	23,821
フジシールインターナショナル	12.5	13.9	56,920
タカラトミー	36.9	37.8	26,989
廣済堂	9.5	10.7	3,648
Ａｓ－ｍｅエステール	2.7	3.1	1,909
アーク	32.3	48.3	4,008
タカノ	4.5	5	3,205
プロネクサス	10.4	10.7	10,261
ホクシン	8.4	9.1	1,137
ウッドワン	17	21	5,166
大建工業	42	45	14,220
凸版印刷	290	324	305,856
大日本印刷	313	340	350,880
図書印刷	17	22	12,408
共同印刷	32	39	12,519
日本写真印刷	17.2	19.3	32,192
光村印刷	9	11	2,211
宝印刷	5.4	5.5	7,639
アシックス	102.1	106.9	247,152
ツツミ	5.1	5.7	13,110
小松ウオール工業	3.1	3.9	6,563
ヤマハ	75.5	84.4	261,218
河合楽器製作所	3.6	4.3	8,200
クリナップ	9.4	13.5	10,678
ピジョン	58.2	65	191,685
兼松日産農林	13	12	1,776
キングジム	8.5	9.5	8,141
リンテック	24.4	27.3	60,223
ＴＡＳＡＫＩ	1.9	2.2	3,326
イトーキ	21.6	24.2	15,294
任天堂	63.3	70.7	1,100,445
三菱鉛筆	8.5	8.6	46,182
タカラスタンダード	42	47	44,979
コクヨ	53.4	59.7	88,176
ナカバヤシ	22	23	6,992
グローブライド	50	5.6	7,504
岡村製作所	39.4	40.1	43,267
美津濃	55	62	33,418

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アデランス	11.9	19.9	10,885
電気・ガス業（2.0%）			
東京電力ホールディングス	871.6	973.8	520,983
中部電力	314.4	351.2	536,984
関西電力	419.3	468.4	478,002
中国電力	142.1	158.7	230,432
北陸電力	100.7	112.5	157,837
東北電力	256.7	286.8	412,418
四国電力	92.5	103.4	137,935
九州電力	226.9	253.5	281,892
北海道電力	96.2	107.4	103,104
沖縄電力	6.7	12.2	37,454
電源開発	74.5	97.9	314,748
ファーストエスコ	－	4.7	2,495
イーレックス	－	3.4	6,358
東京瓦斯	1,249	1,281	571,710
大阪瓦斯	1,064	1,188	492,426
東邦瓦斯	261	289	230,333
北海道瓦斯	22	28	7,812
広島ガス	16.2	20	7,120
西部瓦斯	116	129	34,314
静岡ガス	29.2	32.6	24,808
メタウォーター	6.4	7.4	21,430
陸運業（4.6%）			
ＳＢＳホールディングス	10.1	11.3	7,876
東武鉄道	549	613	340,215
相鉄ホールディングス	176	197	130,020
東京急行電鉄	558	668	639,944
京浜急行電鉄	282	315	306,180
小田急電鉄	329	368	421,360
京王電鉄	287	321	293,715
京成電鉄	154	172	245,272
富士急行	28	31	43,555
新京成電鉄	13	15	6,285
東日本旅客鉄道	188.3	209.9	2,077,380
西日本旅客鉄道	98.9	110.5	740,018
東海旅客鉄道	92	102.8	1,977,872
西武ホールディングス	81.9	121.9	266,839
鴻池運輸	12.7	16.2	19,666

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
西日本鉄道	133	149	84,632
ハマキョウレックス	3.2	8.8	19,527
サカイ引越センター	1.8	4.5	13,815
近鉄グループホールディングス	1,034	1,155	510,510
阪急阪神ホールディングス	690	770	519,750
南海電気鉄道	230	258	145,770
京阪ホールディングス	230	257	190,180
神戸電鉄	25	28	10,052
名糖運輸	4.2	－	－
名古屋鉄道	374	418	225,302
山陽電気鉄道	37	42	20,916
日本通運	397	444	211,788
ヤマトホールディングス	180.7	205.3	452,481
山九	125	151	82,446
丸運	5.6	6.2	1,512
丸全昭和運輸	34	39	15,990
センコー	45	51.6	35,449
トナミホールディングス	21	23	6,785
ニッコンホールディングス	33.6	36.5	82,745
日本石油輸送	12	13	3,003
福山通運	62	70	37,940
セイノーホールディングス	79.5	81.4	91,982
神奈川中央交通	12	13	7,514
日立物流	21.4	23.9	44,238
丸和運輸機関	－	3.4	9,469
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	－	11	10,395
海運業（0.2%）			
日本郵船	868	1,030	210,120
商船三井	539	559	127,452
川崎汽船	450	502	106,424
ＮＳユナイテッド海運	44	51	7,497
明治海運	9.3	10.3	3,883
飯野海運	53.2	59.4	23,047
共栄タンカー	9	10	1,460
第一中央汽船	118	－	－
乾汽船	－	9.1	7,871
空運業（0.7%）			
日本航空	196.7	219.8	877,881
ＡＮＡホールディングス	2,019	2,131	710,049

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
パスコ	9	11	3,960
倉庫・運輸関連業（0.2%）			
トランコム	3	3.3	21,714
日新	39	47	16,121
三菱倉庫	67	82	119,392
三井倉庫ホールディングス	60	67	19,296
住友倉庫	75	84	45,528
澁澤倉庫	27	30	8,280
東陽倉庫	18	20	4,400
乾汽船	6.9	－	－
日本トランスシティ	24	26	9,126
ケイヒン	19	21	2,982
中央倉庫	5.9	6.6	5,992
安田倉庫	8	8.9	6,390
東洋埠頭	32	33	4,917
宇徳	8.3	9.3	2,938
上組	123	137	138,233
サンリツ	2.5	2.8	1,332
キムラユニティー	2.6	2.9	3,152
キユーソー流通システム	2.8	3.2	8,284
郵船ロジスティクス	9.4	10.5	11,917
近鉄エクスプレス	9.2	20.5	31,570
東海運	5.6	6.2	1,674
エーアイテイー	4.7	7	6,391
内外トランスライン	1.2	3.8	3,724
情報・通信業（8.8%）			
ＮＥＣネッツエスアイ	12.7	14.2	25,929
システナ	9.9	11	19,162
デジタルアーツ	5.4	5.5	13,970
新日鉄住金ソリューションズ	8.5	18.9	34,473
キューブシステム	4.4	4.9	2,871
コア	4.3	4.8	6,086
ソフトクリエイトホールディングス	3.3	5.4	4,978
ＩＴホールディングス	33.6	37.5	98,775
ネオス	2.7	3.4	2,189
電算システム	3.5	3.9	6,072
グリー	61.4	68.7	43,830
コーエーテクモホールディングス	22.9	26.9	51,083
三菱総合研究所	3.9	4.4	14,476

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ボルテージ	1.8	2.2	2,633
電算	1.1	1.2	2,898
ＡＧＳ	1.6	2.5	2,465
ファインデックス	5.8	7.4	13,475
ヒト・コミュニケーションズ	1.1	2.6	5,197
ブレインパッド	1.5	1.7	1,327
ＫＬａｂ	10.7	17.5	11,322
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ	6.7	7.5	6,885
イーブックイニシアティブジャパン	2.3	2.5	1,915
ネクソン	96.5	108.6	166,266
アイスタイル	4.3	17.3	16,642
エムアップ	2.9	2.9	1,574
エイチーム	3.7	6.2	10,242
テクノスジャパン	－	3.3	9,751
ｅｎｉｓｈ	2.7	3.3	2,349
コロプラ	27.9	31.5	67,347
モバイルクリエイト	5.9	7.4	3,352
オルトプラス	3.7	4.2	1,797
ブロードリーフ	8.4	11.3	12,023
ハーツユナイテッドグループ	3	3.4	8,646
メディアドゥ	－	2.4	4,747
ブイキューブ	－	7.4	10,300
サイバーリンクス	－	1.7	1,866
ＶＯＹＡＧＥ　ＧＲＯＵＰ	－	3.8	4,734
オプティム	－	0.9	4,923
ベリサーブ	1.2	1.3	6,461
ティーガイア	10.1	11.3	15,514
日本アジアグループ	－	12.8	6,246
豆蔵ホールディングス	7.9	8.9	6,390
テクマトリックス	4.3	4.9	10,441
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	－	264	73,392
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	8.8	9.3	64,170
ザッパラス	5.7	6.3	2,507
インターネットイニシアティブ	16.4	18.3	41,778
さくらインターネット	－	7.4	9,990
ＧＭＯクラウド	2.2	2.5	2,972
ビットアイル	11.5	－	－
ＳＲＡホールディングス	5.3	6.5	16,666
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	－	2.2	2,017

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
システムインテグレータ	1.4	1.6	1,158
パイプドビッツ	1.3	－	－
朝日ネット	10.4	10.3	4,974
コムチュア	1.7	1.9	5,804
ｇｕｍｉ	10.2	11.7	12,086
パイプドＨＤ	－	1.4	1,860
パナソニック　インフォメーションシステム	2.4	－	－
フェイス	3.1	3	3,930
ハイマックス	1.3	1.5	1,744
野村総合研究所	57.4	79.4	321,173
サイバネットシステム	8.2	9.2	8,142
ＣＥホールディングス	1.5	1.7	1,540
インテージホールディングス	5.8	5.9	8,295
東邦システムサイエンス	3	3.3	2,042
ソースネクスト	5.1	5.7	2,964
ティー・ワイ・オー	13.9	22.2	3,818
フォーカスシステムズ	－	4.4	2,626
クレスコ	2.3	2.6	4,856
フジ・メディア・ホールディングス	105.6	118	152,692
オービック	35	39.1	228,344
ジャストシステム	18.4	20.6	19,734
ＴＤＣソフトウェアエンジニアリング	2.2	4.9	3,238
ヤフー	726.8	812	401,940
トレンドマイクロ	53.7	55	235,950
インフォメーション・ディベロプメント	1.9	2.1	2,053
日本オラクル	16.2	18.2	110,474
アルファシステムズ	3.3	3.7	6,611
フューチャー	10.6	13.6	10,118
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	6.9	8.4	6,837
ソフトバンク・テクノロジー	2.7	3.1	5,471
トーセ	2.7	3	1,998
オービックビジネスコンサルタント	6.4	5.8	27,724
伊藤忠テクノソリューションズ	23	25.7	65,663
アイティフォー	12.2	14.7	7,835
東計電算	1.8	2	3,852
エックスネット	0.9	1	1,535
大塚商会	27.3	30.5	166,530
サイボウズ	13.5	15	5,265
ソフトブレーン	14	16.6	2,855

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
電通国際情報サービス	6.2	7	14,049
ＥＭシステムズ	1.6	3.8	4,704
ウェザーニューズ	3	3.8	14,174
ＣＩＪ	9.2	10.3	5,191
東洋ビジネスエンジニアリング	1	1.1	1,521
日本エンタープライズ	8.9	11.6	2,981
WOWOW	4.8	5.4	13,413
フュージョンパートナー	5.7	7	3,976
日本コロムビア	3.4	3.9	1,716
イマジカ・ロボット　ホールディングス	7.1	9.5	3,895
ネットワンシステムズ	41.2	49	30,429
アルゴグラフィックス	4.2	5.2	9,027
マーベラス	17.1	19.1	18,240
エイベックス・グループ・ホールディングス	20.1	20.9	27,107
日本ユニシス	28	31.3	43,006
兼松エレクトロニクス	6.4	7.1	14,100
東京放送ホールディングス	60.8	67.9	97,843
日本テレビホールディングス	92.6	103.4	183,948
朝日放送	10	11.2	7,560
テレビ朝日ホールディングス	27.7	30.9	53,395
スカパーＪＳＡＴホールディングス	77	86	46,440
テレビ東京ホールディングス	8.3	10.3	20,085
日本ＢＳ放送	1.7	2.5	2,547
Ｕ－ＮＥＸＴ	－	3.5	3,475
ワイヤレスゲート	－	3.3	7,619
コネクシオ	7.1	10	14,610
日本通信	－	80.2	18,125
クロップス	1.2	2.1	1,104
日本電信電話	396.9	875.7	4,477,454
ＫＤＤＩ	1,030.3	1,151	3,921,457
光通信	9.1	13.6	113,968
ＮＴＴドコモ	782.2	846.6	2,388,681
エムティーアイ	12.9	17.2	14,448
ＧＭＯインターネット	33.8	41.3	56,126
カドカワ	24.9	35.4	57,525
学研ホールディングス	34	38	9,614
ゼンリン	13.4	15	39,135
昭文社	6.1	6.2	3,819
インプレスホールディングス	7.1	9.3	1,441

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アイネット	5.2	6.3	7,049
松竹	67	75	76,725
東宝	72.4	80.8	229,310
東映	38	42	35,994
ＡＯＩ　Ｐｒｏ．	4.7	5.7	5,380
エヌ・ティ・ティ・データ	62.6	70	387,800
ピー・シー・エー	1.3	1.4	1,815
ビジネスブレイン太田昭和	－	1.7	1,569
ＤＴＳ	10.5	12.6	29,043
スクウェア・エニックス・ホールディングス	39	48	142,272
シーイーシー	6.6	7.4	11,862
カプコン	25.9	29	70,876
アイ・エス・ビー	1.1	1.8	1,652
ジャステック	5.8	7.2	7,005
ＳＣＳＫ	24.1	26.9	108,138
日本システムウエア	3.8	4.2	4,599
アイネス	13.8	16	18,240
ＴＫＣ	9.4	10.5	31,920
富士ソフト	14	16.8	41,848
ＮＳＤ	23.7	24	42,456
コナミホールディングス	41.2	51.1	176,550
福井コンピュータホールディングス	2.8	3.3	5,190
ＪＢＣＣホールディングス	8.5	9.5	6,564
ミロク情報サービス	6.7	8.4	9,819
ソフトバンクグループ	536.3	641.9	3,891,839
卸売業（4.2%）			
ホウスイ	8	9	1,107
高千穂交易	3.9	4.4	3,885
伊藤忠食品	2.5	2.8	11,116
エレマテック	4.7	5.3	10,483
ＪＡＬＵＸ	2.9	3.6	7,218
あらた	23	5.1	12,301
トーメンデバイス	1.5	1.7	2,993
東京エレクトロン　デバイス	2.7	4.1	6,215
フィールズ	－	9.9	15,453
双日	678.8	713.7	172,001
アルフレッサ　ホールディングス	120	142.4	291,635
横浜冷凍	25.1	28	29,848
神栄	15	16	1,728

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
山下医科器械	0.8	0.9	1,702
ラサ商事	4.7	5.3	2,586
ラクーン	－	4.9	2,690
アルコニックス	5.7	6.4	10,144
神戸物産	3.3	7.3	17,541
あい　ホールディングス	16.3	20.2	64,741
ディーブイエックス	3	4	4,540
ダイワボウホールディングス	92	103	22,866
マクニカ・富士エレホールディングス	18.2	20.4	24,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	19	19.6	18,894
八洲電機	7.8	8.7	4,767
ＵＫＣホールディングス	6.5	7.3	14,096
ＯＣＨＩホールディングス	2.6	3.3	3,422
ＴＯＫＡＩホールディングス	49.5	49.8	33,764
三洋貿易	5.6	6.2	8,779
ウイン・パートナーズ	3.3	4.1	6,236
ミタチ産業	2.3	2.9	1,922
シップヘルスケアホールディングス	18.5	23	65,366
明治電機工業	2.9	3.5	3,685
デリカフーズ	1.7	2.4	2,268
スターティア	1.1	2.2	1,421
富士興産	3.9	4.4	1,826
協栄産業	12	15	1,890
小野建	8.8	9.8	10,887
佐鳥電機	8	9	6,777
エコートレーディング	2.3	2.6	1,495
伯東	6.9	8.6	8,058
コンドーテック	7.4	9	7,110
中山福	5.8	7	5,299
ナガイレーベン	14.6	16.4	36,703
三菱食品	11.1	12.4	33,814
松田産業	7.4	8.2	9,815
第一興商	－	20	95,600
メディパルホールディングス	101.4	113.3	192,043
アドヴァン	5.2	11.5	12,236
ＳＰＫ	2.2	2.6	5,239
萩原電気	2.8	3.9	7,296
アズワン	7.3	8.8	34,848
スズデン	3.3	3.6	3,513

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
尾家産業	3.2	3.6	3,070
シモジマ	6.2	7.8	7,690
ドウシシャ	13.1	13.3	28,528
小津産業	2	2.5	5,375
高速	6	6.7	5,989
たけびし	3.5	4	3,992
黒田電気	17.6	21.1	35,363
丸文	8.9	10	6,270
ハピネット	6.1	10.3	9,331
橋本総業ホールディングス	1.9	2.3	3,447
エクセル	4.6	5.5	7,590
マルカキカイ	3.3	3.7	4,654
ガリバーインターナショナル	30.7	30.5	33,977
日本エム・ディ・エム	8.4	9.4	6,862
進和	6	6.7	9,648
エスケイジャパン	2.6	2.7	801
ダイトエレクトロン	4.6	5.2	3,432
シークス	6.4	7.2	25,200
田中商事	3.1	3.5	2,201
オーハシテクニカ	6.2	6.4	7,756
白銅	3.3	3.2	3,232
伊藤忠商事	848.9	889.1	1,243,406
丸紅	887.2	1,115	582,253
高島	19	21	3,570
長瀬産業	56.9	68.1	79,949
蝶理	6.5	7.2	11,109
豊田通商	113	126.2	308,811
三共生興	17.2	17.1	6,395
兼松	202	241	41,211
ツカモトコーポレーション	18	20	2,140
三井物産	859.8	1,024.6	1,324,295
日本紙パルプ商事	53	59	18,880
日立ハイテクノロジーズ	35.2	39.3	118,686
カメイ	13.2	14.7	14,597
東都水産	17	19	3,249
ＯＵＧホールディングス	16	16	3,696
スターゼン	39	4.1	13,489
山善	38.9	43.5	37,453
椿本興業	11	13	3,731

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
住友商事	598.5	713.2	803,063
内田洋行	25	28	12,992
三菱商事	777.2	850.1	1,579,910
第一実業	25	26	13,260
キヤノンマーケティングジャパン	28.9	32.3	65,633
西華産業	33	36	7,884
佐藤商事	9	10.1	6,504
菱洋エレクトロ	11.7	12.8	16,729
東京産業	10	11.2	4,300
ユアサ商事	8.9	10.7	26,386
神鋼商事	25	25	4,575
小林産業	7.4	7.5	1,462
阪和興業	101	113	54,918
カナデン	8.7	10.8	9,072
菱電商事	16	18	11,502
フルサト工業	5.6	6.2	8,835
岩谷産業	112	134	85,626
すてきナイスグループ	43	48	6,384
昭光通商	36	40	3,080
ニチモウ	16	18	3,204
極東貿易	12	16	3,552
イワキ	15	17	3,434
三愛石油	26	27.8	22,073
稲畑産業	24.3	27.2	29,838
ＧＳＩクレオス	27	30	3,450
明和産業	8	10.4	3,858
ワキタ	21.6	24.1	18,412
東邦ホールディングス	35	36.3	86,611
サンゲツ	35.5	39.4	78,209
ミツウロコグループホールディングス	16.3	18.2	9,445
シナネンホールディングス	22	24	10,128
伊藤忠エネクス	22.4	29.2	27,097
サンリオ	28.4	34.9	73,639
サンワテクノス	6.4	7.2	5,544
リョーサン	17.1	18	48,132
新光商事	11.9	13.3	14,510
トーホー	23	5.1	12,408
三信電気	14	15.7	14,098
東陽テクニカ	14.8	15	16,230

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
モスフードサービス	13.3	14.8	44,770
加賀電子	9.2	10.2	12,229
ソーダニッカ	10.4	11.7	5,662
立花エレテック	7.5	8.3	9,877
フォーバル	2	5.9	4,655
ＰＡＬＴＡＣ	16.2	18.1	34,082
三谷産業	10.8	12	4,392
太平洋興発	40	47	3,431
ヤマタネ	51	53	7,897
丸紅建材リース	9	10	1,880
日鉄住金物産	67	99	39,897
トラスコ中山	12.6	12.9	61,468
オートバックスセブン	37.3	43.4	76,340
加藤産業	15.8	17.7	48,480
イノテック	9.3	10.4	4,524
イエローハット	9.6	10.7	24,749
ＪＫホールディングス	10.2	11.3	5,175
日伝	4.2	4.7	14,194
北沢産業	8.3	9.3	1,488
杉本商事	5.5	6.5	7,676
因幡電機産業	15.1	15.9	56,365
バイテックホールディングス	3.4	4.6	4,715
ミスミグループ本社	37.9	127.2	194,361
アルテック	7.4	9.7	1,425
タキヒヨー	17	19	8,322
蔵王産業	1.3	1.8	2,359
スズケン	46.2	51.6	173,892
ジェコス	7	7.8	8,923
ルネサスイーストン	5	9.4	3,948
小売業（4.9%）			
ローソン	38.4	42.9	369,798
サンエー	7.7	7.7	39,270
ダイユーエイト	2.4	3	2,043
カワチ薬品	7.8	8.8	22,985
エービーシー・マート	14.4	14.7	107,310
ハードオフコーポレーション	4.9	5.5	8,266
アスクル	10.6	13.8	58,374
ゲオホールディングス	19.1	18.9	31,581
アダストリア	8.6	20.9	73,463

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ジーフット	－	6.8	5,453
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	13	16	1,456
くらコーポレーション	5.9	6.6	31,680
キャンドゥ	4.8	6	9,600
パル	5.9	6.6	16,988
エディオン	46.5	47.9	39,661
サーラコーポレーション	8.7	9.7	5,461
ワッツ	4	4.9	4,498
ハローズ	－	3.7	8,606
あみやき亭	1.7	2.2	9,658
ひらまつ	14	15.6	10,686
ゲンキー	1	2.3	8,038
サッポロドラッグストアー	0.9	1.5	3,219
大黒天物産	2.4	2.7	12,933
ハニーズ	8.9	9.9	10,959
ファーマライズホールディングス	2.3	2.6	1,437
アルペン	9	10.1	18,180
クオール	10.3	11.5	17,675
ジェイアイエヌ	6.9	7.7	29,529
ビックカメラ	49.8	65	68,055
ＤＣＭホールディングス	49.1	55.7	43,501
ＭｏｎｏｔａＲＯ	19.8	40	138,200
東京一番フーズ	－	2.8	1,461
ダイヤモンドダイニング	－	2.4	2,409
きちり	2.7	3	1,956
アークランドサービス	1.2	3.5	11,480
Ｊ．フロント　リテイリング	128.3	143.4	182,118
ドトール・日レスホールディングス	17.8	19.8	37,956
マツモトキヨシホールディングス	22.7	23.4	134,550
ブロンコビリー	1.8	5.9	18,201
スタートトゥデイ	31.6	34.5	179,745
トレジャー・ファクトリー	1.2	3.2	3,699
物語コーポレーション	2.9	3	15,690
ココカラファイン	10.6	11.8	62,540
三越伊勢丹ホールディングス	201.6	225.3	244,450
ウエルシアホールディングス	8.7	9.8	58,996
クリエイトＳＤホールディングス	5	16.7	44,589
丸善ＣＨＩホールディングス	11.9	13.2	4,884
ミサワ	－	1.8	903

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エー・ピーカンパニー	1.4	1.9	1,989
チムニー	2.5	2.8	8,358
シュッピン	－	4.3	5,267
ネクステージ	1.3	1.8	1,153
ジョイフル本田	7.4	18.4	43,847
キリン堂ホールディングス	3.3	3.6	3,837
ホットランド	－	3.9	3,939
すかいらーく	49.6	34.7	46,151
綿半ホールディングス	－	4.2	6,186
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	33.3	37.5	38,925
ブックオフコーポレーション	5.8	6.4	5,452
ゴルフダイジェスト・オンライン	－	3.2	3,328
あさひ	6.7	8.4	13,599
日本調剤	1.3	2.9	12,122
コスモス薬品	5.1	5.7	107,730
トーエル	5.4	5.5	4,229
一六堂	2.5	2.7	912
セブン＆アイ・ホールディングス	424.2	473.9	2,244,390
薬王堂	1.4	2.1	7,980
クリエイト・レストランツ・ホールディング	7.1	30.4	30,552
ツルハホールディングス	21.7	26	285,220
サンマルクホールディングス	7.3	8.9	26,121
フェリシモ	2.6	3.2	3,257
トリドール	10.9	13.9	32,470
クスリのアオキ	4	10.1	63,327
メディカルシステムネットワーク	9.1	12.8	7,104
総合メディカル	4.9	5.5	17,820
はるやま商事	4.2	4.7	3,586
カッパ・クリエイト	15.8	15.9	19,509
ライトオン	7.6	8.4	11,970
ジーンズメイト	3.3	3.6	662
良品計画	12.5	13	325,390
三城ホールディングス	12.5	14	6,188
アルビス	2.3	3	6,276
コナカ	11.9	14.4	7,488
ハウス　オブ　ローゼ	1.1	1.4	1,999
Ｇ－７ホールディングス	2.1	3.3	4,068
イオン北海道	6.4	7.6	3,929
コジマ	15	16.7	4,074

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ヒマラヤ	3.1	3.5	3,535
コーナン商事	15.5	16.1	30,654
エコス	3.5	4.3	5,912
ワタミ	12	13.4	12,515
マルシェ	2.5	2.7	2,249
ドンキホーテホールディングス	32.7	73.3	270,843
西松屋チェーン	20	22.3	27,718
ゼンショーホールディングス	52.2	58.3	84,010
幸楽苑ホールディングス	6.3	7.1	10,621
ハークスレイ	2.8	3.1	3,220
サイゼリヤ	16.7	18.6	37,274
ＶＴホールディングス	－	38.3	18,920
魚力	2.8	3.5	4,606
ポプラ	2.5	2.8	1,296
ユナイテッドアローズ	13.3	16.2	58,887
ハイデイ日高	7.7	10.3	27,109
京都きもの友禅	5.9	7.7	6,922
コロワイド	33.6	37.6	71,252
ピーシーデポコーポレーション	－	12.5	17,275
壱番屋	4.6	5.1	36,618
トップカルチャー	4	4.1	1,877
ＰＬＡＮＴ	2.3	2.6	3,169
スギホールディングス	18.2	20.3	112,259
スクロール	13.1	17.1	7,831
ヨンドシーホールディングス	7.7	8.6	23,056
ファミリーマート	34.3	34.8	207,408
木曽路	12.4	13.9	31,052
サトレストランシステムズ	9.5	13.3	10,533
千趣会	18.2	22.3	16,747
タカキュー	7	8.7	1,609
ケーヨー	19	19.1	9,932
上新電機	22	27	23,625
日本瓦斯	16.3	17.3	42,782
ベスト電器	32.8	36.5	4,197
ロイヤルホールディングス	16.9	18.8	39,555
東天紅	7	8	1,032
いなげや	11.3	12.6	18,358
島忠	26.2	29.3	72,312
チヨダ	11.9	13.3	37,865

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ライフコーポレーション	6.4	7.1	21,974
リンガーハット	9.9	10.2	23,439
さが美	8	9	792
ＭｒＭａｘ	10.1	9.9	3,029
テンアライド	8.5	10.4	3,827
ＡＯＫＩホールディングス	23.3	25.8	31,785
オークワ	16	18	20,862
コメリ	17.4	17.5	48,772
青山商事	25.5	21.7	90,055
しまむら	11.8	13.2	195,756
ＣＦＳコーポレーション	6.6	－	－
はせがわ	3.5	5.3	2,231
高島屋	147	165	127,710
松屋	20.4	22.8	19,585
エイチ・ツー・オー　リテイリング	47.9	58	95,120
近鉄百貨店	39	43	13,158
丸栄	17	23	2,185
ニッセンホールディングス	21.2	16.6	1,942
パルコ	9.7	10.8	9,968
丸井グループ	106.7	139.1	233,131
アクシアル　リテイリング	7.8	8.8	31,724
井筒屋	55	61	3,111
イオン	418.2	466.2	770,628
ユニーグループ・ホールディングス	97.1	108.5	89,295
イズミ	22.6	22.5	97,650
東武ストア	13	14	4,284
平和堂	20.5	23	52,532
フジ	11.3	12.6	30,542
ヤオコー	11.5	12.8	63,296
ゼビオホールディングス	13.8	15.4	25,764
ケーズホールディングス	23.4	23.9	87,115
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	6	6.7	3,772
日産東京販売ホールディングス	16.9	19	5,035
アインホールディングス	12.2	13.6	76,976
元気寿司	3.1	3.2	6,944
ヤマダ電機	400.9	344.5	183,618
アークランドサカモト	7.3	19.2	21,811
ニトリホールディングス	43.8	49	519,890
グルメ杵屋	7	8	7,920

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
愛眼	8.2	9	1,908
ケーユーホールディングス	5.3	5.9	4,354
吉野家ホールディングス	28.6	41.8	59,397
松屋フーズ	4.9	5.4	15,076
サガミチェーン	13	15.1	18,316
関西スーパーマーケット	7.6	9.2	8,243
王将フードサービス	7.4	8.3	31,042
プレナス	11.3	12.7	24,879
ミニストップ	7.5	8.4	14,842
アークス	17.6	21.2	54,526
バローホールディングス	21.8	24.4	69,979
藤久	0.8	0.9	1,566
ベルク	4.5	5.6	24,612
大庄	4.7	6	8,688
ファーストリテイリング	20.3	18.9	548,478
サンドラッグ	21.4	23.9	193,112
サックスバー　ホールディングス	7.6	10.6	14,734
ヤマザワ	2.1	2.3	3,806
やまや	1.7	2.3	4,788
ベルーナ	25.3	28.2	17,625
銀行業（7.4%）			
島根銀行	2.1	2.4	2,724
じもとホールディングス	72.8	81.3	11,382
足利ホールディングス	63.8	83.1	26,508
東京ＴＹフィナンシャルグループ	13.1	15.6	44,085
九州フィナンシャルグループ	－	173.4	94,676
ゆうちょ銀行	－	290.3	382,325
富山第一銀行	－	28.8	14,659
コンコルディア・フィナンシャルグループ	－	789.3	382,494
新生銀行	965	980	164,640
あおぞら銀行	684	717	279,630
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	8,137.2	9,090.6	4,637,115
りそなホールディングス	1,186.4	1,325.5	514,426
三井住友トラスト・ホールディングス	2,242	2,365	799,370
三井住友フィナンシャルグループ	767	907.2	3,048,192
第四銀行	128	143	53,625
北越銀行	110	122	23,180
西日本シティ銀行	356	369	72,693
千葉銀行	391	437	235,980

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
横浜銀行	680	－	－
常陽銀行	367	410	153,340
群馬銀行	240	252	107,856
武蔵野銀行	16.2	18.1	50,480
千葉興業銀行	21	31	14,291
筑波銀行	42	47.1	13,376
七十七銀行	171	178	68,174
青森銀行	79	82	26,978
秋田銀行	67	74	21,534
山形銀行	61	64	25,408
岩手銀行	7.1	7.9	32,508
東邦銀行	91	101	37,168
東北銀行	55	58	8,294
みちのく銀行	51	56	9,968
ふくおかフィナンシャルグループ	411	490	171,990
静岡銀行	297	332	259,956
十六銀行	127	142	42,884
スルガ銀行	107.1	107.6	233,169
八十二銀行	183	204.9	94,458
山梨中央銀行	63	70	28,000
大垣共立銀行	127	151	50,132
福井銀行	87	97	20,661
北國銀行	113	120	37,560
清水銀行	3.4	3.8	8,861
富山銀行	－	2.2	7,260
滋賀銀行	102	106	50,138
南都銀行	98	109	33,899
百五銀行	97	102	40,902
京都銀行	194	216	151,848
紀陽銀行	39.8	44.5	58,384
三重銀行	45	50	9,900
ほくほくフィナンシャルグループ	690	771	102,543
広島銀行	299	334	131,596
山陰合同銀行	61	68.1	47,397
中国銀行	71.9	80.3	87,848
鳥取銀行	32	36	6,048
伊予銀行	108.5	121.2	87,021
百十四銀行	111	124	39,928
四国銀行	78	88	18,568

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
阿波銀行	83	91	50,778
鹿児島銀行	70	－	－
大分銀行	62	65	20,995
宮崎銀行	68	75	20,700
肥後銀行	83	－	－
佐賀銀行	62	69	15,042
十八銀行	62	70	16,940
沖縄銀行	8	8.6	32,465
琉球銀行	20.9	23.3	29,288
セブン銀行	342	424.5	198,241
みずほフィナンシャルグループ	14,140.5	16,059.4	2,681,919
高知銀行	39	44	4,840
山口フィナンシャルグループ	101	106	109,710
長野銀行	33	37	6,993
名古屋銀行	92	95	32,775
北洋銀行	152.8	170.7	47,283
愛知銀行	3.7	3.8	18,715
第三銀行	57	64	9,920
中京銀行	42	47	10,481
東日本銀行	44	－	－
大光銀行	36	40	7,960
愛媛銀行	60	67	15,611
トマト銀行	39	44	6,424
みなと銀行	92	103	16,274
京葉銀行	84	93	38,688
関西アーバン銀行	14.1	15.8	15,847
栃木銀行	51	59	23,895
北日本銀行	3.2	3.5	9,355
東和銀行	142	212	17,808
福島銀行	125	139	11,815
大東銀行	65	68	12,036
トモニホールディングス	77.8	86.9	27,460
フィデアホールディングス	60.2	92.4	15,061
池田泉州ホールディングス	96.7	120.2	48,200
証券、商品先物取引業（1.0%）			
ＦＰＧ	30	40.4	45,773
ＳＢＩホールディングス	121.8	136.1	169,988
日本アジア投資	74	7.7	2,086
ジャフコ	13.9	18.9	59,251

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大和証券グループ本社	949	1,060	659,850
野村ホールディングス	2,073.4	2,180	1,001,492
岡三証券グループ	86	96	53,088
丸三証券	32.3	33.6	32,760
東洋証券	39	44	10,604
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	116.4	130	69,550
光世証券	24	27	3,402
水戸証券	31.3	35.1	9,792
いちよし証券	21.3	25.3	22,542
松井証券	51.5	55.4	53,294
だいこう証券ビジネス	4.9	5.5	4,004
マネックスグループ	119.3	131.7	37,139
カブドットコム証券	45	96.6	33,810
極東証券	13.6	15.2	19,729
岩井コスモホールディングス	10.4	10.7	10,796
藍澤證券	14.2	21.2	12,529
マネースクウェアＨＤ	4.2	3.9	3,849
マネーパートナーズグループ	10.3	10.5	6,846
小林洋行	3	3.2	764
保険業（2.2%）			
かんぽ生命保険	－	46.1	111,654
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	225.3	251.7	722,756
アニコム　ホールディングス	5.7	7.7	22,253
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホール	323.3	338.6	999,208
ソニーフィナンシャルホールディングス	97.2	108.5	146,583
第一生命保険	649.8	725.9	971,254
東京海上ホールディングス	410.9	459	1,685,448
Ｔ＆Ｄホールディングス	369.6	412.9	419,299
その他金融業（1.4%）			
全国保証	26.4	29.5	116,230
クレディセゾン	82.8	85.9	179,702
アクリーティブ	6.9	9.3	4,752
芙蓉総合リース	10.6	13	63,115
興銀リース	19.1	21.3	42,621
東京センチュリーリース	23.8	26.6	103,341
日本証券金融	44.7	49.9	21,357
アイフル	169.7	189.7	77,207
ポケットカード	7.7	11.3	6,282
リコーリース	8	8.9	27,634

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
イオンフィナンシャルサービス	66.5	74.3	186,270
アコム	203.7	227.6	145,891
ジャックス	56	63	29,358
オリエントコーポレーション	234.4	489.9	114,636
日立キャピタル	19.9	26.7	65,868
アプラスフィナンシャル	48.4	54.3	5,810
オリックス	717.9	802.3	1,245,570
三菱ＵＦＪリース	257.2	287.4	141,688
日本取引所グループ	148.9	332.7	536,977
イー・ギャランティ	3	3.7	8,931
アサックス	1.8	2	2,730
ＮＥＣキャピタルソリューション	4.1	4.6	7,143
不動産業（2.8%）			
いちごグループホールディングス	－	125.4	59,314
日本駐車場開発	110.2	136.2	16,752
ヒューリック	188.3	236.2	257,458
東京建物不動産販売	5.2	－	－
三栄建築設計	4.1	4.5	5,827
野村不動産ホールディングス	61	75.2	145,361
三重交通グループホールディングス	17.9	20.1	11,698
サムティ	－	8.1	9,055
ディア・ライフ	－	7.7	3,526
エー・ディー・ワークス	－	103.7	4,562
日本商業開発	3.2	5	9,330
プレサンスコーポレーション	3.4	3.8	14,953
ユニゾホールディングス	5.6	7.1	40,186
日本管理センター	6.5	7.4	12,557
サンセイランディック	1.5	2.6	2,485
エストラスト	1.4	2	1,086
フージャースホールディングス	15.1	15.7	7,802
オープンハウス	7.3	16.4	42,836
東急不動産ホールディングス	265.8	274.1	202,834
飯田グループホールディングス	65.8	104.9	227,528
ムゲンエステート	－	1.6	4,011
エコナックホールディングス	35	37	1,850
パーク２４	51	57.2	178,464
パラカ	3.5	3.2	5,075
三井不動産	538	601	1,613,084
三菱地所	754	843	1,796,011

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
平和不動産	19.2	21.4	29,018
東京建物	221	123.7	171,695
ダイビル	26.1	29.2	29,900
京阪神ビルディング	16.8	18.8	10,998
住友不動産	243	272	845,104
大京	161	210	35,700
テーオーシー	34.9	43.9	41,397
東京楽天地	17	19	9,101
レオパレス２１	110.9	133.5	94,384
スターツコーポレーション	11.6	13	29,250
フジ住宅	12.9	14.4	9,993
空港施設	12.3	13.7	6,548
明和地所	5.9	6.2	3,850
住友不動産販売	7.3	8.2	16,662
ゴールドクレスト	9.1	8.9	14,159
日本エスリード	3.9	4.4	4,426
日神不動産	13.5	15.1	5,587
タカラレーベン	44.9	49.4	36,605
サンヨーハウジング名古屋	5.7	5.8	5,631
イオンモール	65.4	73.1	107,091
ファースト住建	3.8	4.2	5,485
ランド	39.6	52.9	793
トーセイ	13.9	17.2	13,450
穴吹興産	9	12	3,084
エヌ・ティ・ティ都市開発	63	70.4	78,988
サンフロンティア不動産	10.9	13.7	15,398
エフ・ジェー・ネクスト	7.7	9.9	5,167
ランドビジネス	6.8	6.7	1,755
グランディハウス	8.9	9.9	3,465
日本空港ビルデング	35	36.1	129,238
サービス業（3.9%）			
日本工営	36	40	14,040
ネクスト	12.6	33.9	39,493
ジェイエイシーリクルートメント	－	7.4	10,574
日本M&Aセンター	16.6	18.5	121,915
ノバレーゼ	2.7	3.1	2,566
アコーディア・ゴルフ	40.4	33.2	34,727
中広	－	1.1	690
タケエイ	10.5	10.5	10,584

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
トラスト・テック	1.8	4.8	6,648
パソナグループ	8	10.4	7,248
ＣＤＳ	2.4	2.7	2,475
リンクアンドモチベーション	14.6	24.2	3,388
ＧＣＡサヴィアン	8.5	10.6	11,130
エス・エム・エス	12	14.9	33,301
テンプホールディングス	21.1	84	135,324
リニカル	2.8	7.1	16,876
クックパッド	6.8	26.7	41,198
エスクリ	3.8	5.1	3,253
アイ・ケイ・ケイ	5.7	6.4	3,993
学情	4	4.4	4,782
スタジオアリス	4.9	5.5	14,811
シミックホールディングス	4.8	6.1	10,052
ＮＪＳ	2.4	2.4	2,848
綜合警備保障	35.8	40	231,200
カカクコム	70.8	86.1	177,624
アイロムグループ	2.7	3.4	3,804
ルネサンス	5.5	6.1	7,356
ディップ	2.4	13.3	37,479
オプトホールディング	4.8	7.5	5,902
新日本科学	10.2	11.3	8,554
ツクイ	12.7	14.2	18,857
綜合臨床ホールディングス	5.5	－	－
キャリアデザインセンター	2.9	2.5	2,467
エムスリー	92.9	103.8	331,122
ツカダ・グローバルホールディング	7.8	8.7	6,316
アウトソーシング	4.1	5.6	20,888
ウェルネット	3.8	4.5	17,482
ディー・エヌ・エー	52.9	53.8	109,913
博報堂ＤＹホールディングス	148.8	166.2	209,578
ぐるなび	12.4	13.9	39,851
エスアールジータカミヤ	8.6	12.9	6,140
一休	8.4	－	－
ジャパンベストレスキューシステム	12.1	14.8	3,448
ファンコミュニケーションズ	24.7	27.7	21,578
ジェイコムホールディングス	2.5	2.4	6,352
ＰＧＭホールディングス	15.1	－	－
ＷＤＢホールディングス	3.8	4.3	4,046

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ティア	4.5	5.8	3,874
バリューコマース	8.8	11.1	3,851
インフォマート	－	23.1	22,037
ＪＰホールディングス	26.5	29.7	10,216
ＥＰＳホールディングス	9.8	14.9	20,919
レッグス	－	2.3	1,656
プレステージ・インターナショナル	8.2	10.1	12,503
アミューズ	3.3	6.6	16,361
ドリームインキュベータ	3.5	4	8,980
クイック	4.9	6.1	4,715
ＴＡＣ	5.4	6.6	1,293
ケネディクス	152.6	161	75,992
電通	119.6	133.6	750,832
テイクアンドギヴ・ニーズ	4.2	5.6	2,536
ぴあ	3.1	3.6	7,754
イオンファンタジー	3.5	4.2	10,638
シーティーエス	－	3.6	2,761
ネクシィーズグループ	3.9	4.3	13,545
みらかホールディングス	27.3	30.6	138,465
アルプス技研	4.3	4.4	10,467
サニックス	12.5	19.2	3,801
ダイオーズ	2.3	2.2	2,378
日本空調サービス	5.2	10.5	5,607
オリエンタルランド	116	129.6	941,025
ダスキン	30.4	30.7	62,106
明光ネットワークジャパン	12.4	14.9	18,222
ファルコホールディングス	5.1	5.2	7,233
秀英予備校	2.1	2.2	917
田谷	1.8	2	1,374
ラウンドワン	30.5	37.4	28,162
リゾートトラスト	40.6	50.3	116,947
ビー・エム・エル	6.3	7.1	33,370
ワタベウェディング	3.5	3.5	1,683
りらいあコミュニケーションズ	20	19.8	21,740
リソー教育	16.5	22.3	9,276
早稲田アカデミー	1.6	1.6	1,369
ユー・エス・エス	129.9	145.2	234,498
東京個別指導学院	5.2	5.8	3,955
サイバーエージェント	26.2	31.5	161,910

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
楽天	466.8	561	685,261
テー・オー・ダブリュー	3.2	9.6	6,364
セントラルスポーツ	3.7	4.1	9,302
フルキャストホールディングス	11.1	11	8,096
リゾートソリューション	11	12	3,648
テクノプロ・ホールディングス	15.2	19.4	63,244
インターワークス	－	2.1	1,978
ＫｅｅＰｅｒ技研	－	1.4	2,727
ファーストロジック	－	0.6	1,513
リブセンス	6.3	8	4,240
ジャパンマテリアル	4.4	5	14,290
ベクトル	2.3	3.7	11,692
ウチヤマホールディングス	6.2	6.2	3,447
サクセスホールディングス	1.2	1.1	1,590
キャリアリンク	1.4	1.6	2,888
ＩＢＪ	－	9.3	5,459
アサンテ	3.5	4.4	6,111
Ｎ・フィールド	－	5.7	10,482
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	0.4	1.5	2,811
ライドオン・エクスプレス	－	2.6	4,222
ＥＲＩホールディングス	2.7	3.1	2,721
アビスト	1.1	1.8	3,969
ウィルグループ	1.2	2.7	2,683
日本ビューホテル	－	1.7	2,748
リクルートホールディングス	162.3	241.8	847,509
エラン	－	1.3	1,704
日本郵政	－	352.6	508,096
ベルシステム２４ホールディングス	－	23.5	22,654
リロ・ホールディング	3.7	4.5	66,015
東祥	2.3	3.6	14,238
エイチ・アイ・エス	17.5	19.5	54,093
ラックランド	－	1.7	2,883
共立メンテナンス	6.4	9	77,940
イチネンホールディングス	11.2	12.6	13,066
建設技術研究所	6.3	7.1	6,375
スペース	5.8	6.5	8,456
燦ホールディングス	2.1	2.4	3,256

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
スバル興業	8	9	3,402
東京テアトル	41	46	5,520
ナガワ	－	2.2	7,689
よみうりランド	21	24	11,040
東京都競馬	73	82	17,794
常磐興産	39	44	6,688
カナモト	15	16.7	43,269
東京ドーム	73	96	43,200
西尾レントオール	8.6	9.7	24,958
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	45	59	2,360
トランス・コスモス	14	13.9	44,132
乃村工藝社	21	25.6	44,825
藤田観光	39	44	22,616
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	52	58	9,860
日本管財	5.3	10.3	15,614
トーカイ	4.7	5.3	17,304
白洋舎	11	13	3,302
セコム	104.2	124.7	1,059,950
セントラル警備保障	4.7	5.3	10,986
丹青社	12.4	22.4	19,779
メイテック	14.4	14.5	54,375
アサツー　ディ・ケイ	20.2	21	56,784
応用地質	11.3	11.3	13,187
船井総研ホールディングス	11.6	16.7	26,669
進学会	4.5	5.7	3,140
オオバ	－	8.7	4,149
学究社	－	1.7	2,009
ベネッセホールディングス	39.2	40.2	102,590
イオンディライト	10.4	11.6	36,250
ナック	7.2	7.3	6,708
ニチイ学館	21	20.8	14,580
ダイセキ	17.3	22.5	48,150
ステップ	3.6	4	4,220
合計 株数・金額	172,353	191,228	227,318,263
合計 銘柄数＜比率＞	1,875	1,946	＜96.8%＞

（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、親投資信託の純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
国内	株式先物取引	ＴＯＰＩＸ	百万円 5,329	百万円 －

＜有価証券の貸付及び借入の状況＞

2016年５月12日現在における貸付株数の総株数は40,591,300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、40,591,300株です。

ＴＯＰＩＸマザーファンド

《第15期》決算日2016年３月25日

［計算期間：2015年３月26日～2016年３月25日］

「ＴＯＰＩＸマザーファンド」は、３月25日に第15期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額	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
11期(2012年３月26日)	7,888	1.8	851.82	△ 0.6	98.4	1.7	187,797
12期(2013年３月25日)	9,935	26.0	1,047.29	22.9	98.8	1.2	221,229
13期(2014年３月25日)	11,255	13.3	1,163.70	11.1	98.7	1.2	221,564
14期(2015年３月25日)	15,711	39.6	1,592.01	36.8	98.4	1.3	245,366
15期(2016年３月25日)	13,743	△12.5	1,366.05	△14.2	98.2	1.9	220,801

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

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

（注）「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

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

（注）騰落率は期首比。
（注）「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

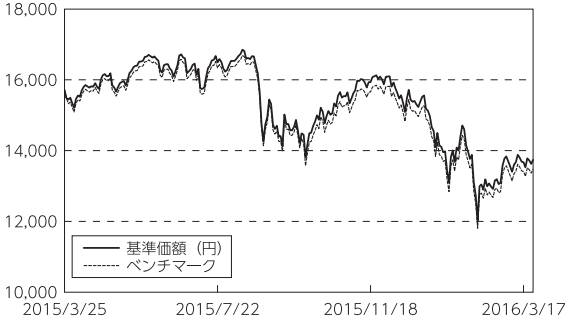
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ12.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内株式市況

・期首から2015年８月上旬にかけては、国内企業業績改善への期待が高まったことや、円安・米ドル高の進行などを受けて国内株式市況は上昇しました。

・８月中旬から期末にかけては、2015年内の米利上げ観測の高まりを受けて円安が進んだことなどから国内株式市況が一時上昇する場面もありましたが、中国経済減速への不安から世界同時株安となったことなどにより、国内株式市況は下落しました。

・期を通じてみると、国内株式市況は下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは14.2%の下落となったため、カイ離は1.7%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

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

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

・期中における先物組入比率の平均は、1.5%程度となりました。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.7%程度でした。

・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

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

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

○今後の運用方針

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2015年３月26日～2016年３月25日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	1	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)	(0.000)	
（先物・オプション）	(1)	(0.004)	
合計	1	0.004	
期中の平均基準価額は、15,388円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2015年３月26日～2016年３月25日）

株式

		買付 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	60,807 (△ 2,998)	81,253,363 (－)	52,180	71,378,260

（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	75,143	73,705	－	－

○株式売買比率

（2015年３月26日～2016年３月25日）

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2015年３月26日～2016年３月25日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	81,253	18,121	22.3	71,378	8,859	12.4

利害関係人の発行する有価証券等

種　　類	買　付　額	売　付　額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	2,092	1,952	4,875

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種　　類	買　付　額
	百万円
株式	294

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

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

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

○組入資産の明細

（2016年３月25日現在）

国内株式

銘柄	期首(前期末) 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	49	51	13,770
日本水産	142.9	138.6	77,200
マルハニチロ	22.3	24.6	54,562
サカタのタネ	18.7	17.8	50,819
ホクト	12.9	12.2	26,876
鉱業（0.3%）			
住石ホールディングス	32.2	35.6	3,560
日鉄鉱業	32	33	14,421
三井松島産業	76	79	9,796
国際石油開発帝石	612.4	633.7	561,711
日本海洋掘削	3.5	3.6	8,913
石油資源開発	16.6	19.1	48,628
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	7.8	8.1	11,340
建設業（3.2%）			
ショーボンドホールディングス	11.2	12.6	51,723
ミライト・ホールディングス	35.8	37	34,151
タマホーム	8.7	9.1	3,922
サンヨーホームズ	1.2	2.5	1,385
ダイセキ環境ソリューション	1.4	2.8	3,038
安藤・間	77.6	80.3	43,683
東急建設	41.3	39.1	36,636
コムシスホールディングス	51.7	51.7	91,560
ミサワホーム	13.7	14.2	11,076
髙松コンストラクショングループ	8.8	9.1	22,194
東建コーポレーション	4.3	4.9	45,129
ヤマウラ	5.5	5.7	2,764
大成建設	604	625	473,125
大林組	349	360.8	406,621
清水建設	356	368	352,912
飛島建設	75.7	96.6	18,354
長谷工コーポレーション	145.3	140.4	145,314
松井建設	13	13.3	9,881
錢高組	17	17	8,415
鹿島建設	511	564	406,080
不動テトラ	88	84.9	10,867
大末建設	4.4	4.6	3,822
鉄建建設	71	73	20,951
日鉄住金テックスエンジ	22	－	－
西松建設	125	139	68,805
三井住友建設	471.6	460.9	48,394
大豊建設	32	46	22,908
前田建設工業	78	74	61,346
佐田建設	40	8.4	3,679
ナカノフドー建設	8.9	9.2	5,354
奥村組	110	114	69,312
大和小田急建設	6.3	－	－
東鉄工業	14	14.4	49,320
イチケン	13	13	4,394
淺沼組	37	39	12,168
戸田建設	146	140	77,140
熊谷組	146	176	50,160
青木あすなろ建設	7	7.9	6,004
北野建設	24	25	7,325
植木組	14	15	3,555
三井ホーム	15	15	8,115
矢作建設工業	14.4	16.4	13,218
ピーエス三菱	12.3	14.2	5,651
日本ハウスホールディングス	14.4	24.5	10,045
大東建託	44.1	45	727,650
新日本建設	13.8	14.3	8,008
ＮＩＰＰＯ	27	28	51,044
東亜道路工業	22	23	8,786
前田道路	36	38	70,680
日本道路	35	36	19,260
東亜建設工業	87	105	27,930
若築建設	67	69	9,039
東洋建設	34.8	37.7	18,925

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ニチモウ	16	16	2,944
極東貿易	12	15	3,735
イワキ	15	16	3,024
三愛石油	26	27	22,815
稲畑産業	24.5	25.4	28,067
ＧＳＩクレオス	27	28	3,528
明和産業	8.2	9.8	3,567
ワキタ	21.8	22.5	20,902
東邦ホールディングス	35.3	33.9	79,834
サンゲツ	18.4	36.9	77,342
ミツウロコグループホールディングス	16.5	17	9,775
シナネンホールディングス	22	23	10,511
伊藤忠エネクス	22.6	27.3	25,088
サンリオ	28.7	32.7	74,719
サンワテクノス	6.5	6.7	4,917
リョーサン	17.2	16.8	49,761
新光商事	12	12.4	14,272
トーホー	23	4.8	11,769
三信電気	14.1	14.6	13,928
東陽テクニカ	15	15	17,430
モスフードサービス	13.4	13.9	42,047
加賀電子	9.2	9.6	14,620
ソーダニッカ	11	11	5,335
立花エレテック	6.3	7.8	9,461
フォーバル	2	4.2	3,024
ＰＡＬＴＡＣ	16.4	16.9	35,067
三谷産業	－	11.3	4,101
太平洋興発	40	44	3,476
ヤマタネ	51	49	7,742
丸紅建材リース	9	9	1,791
日鉄住金物産	67	70	26,600
トラスコ中山	12.8	12.1	53,663
オートバックスセブン	37.7	40.6	78,764
加藤産業	14.7	16.5	48,031
イノテック	9.4	9.8	4,429
イエローハット	9.6	10	22,670
富士エレクトロニクス	5.3	－	－
ＪＫホールディングス	10.3	10.6	5,300
日伝	4.2	4.4	12,949

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コロワイド	34	35.1	62,864
ピーシーデポコーポレーション	－	8.8	9,653
壱番屋	4.6	4.8	31,824
トップカルチャー	4.1	3.8	1,748
ＰＬＡＮＴ	2.6	2.4	2,968
スギホールディングス	18.4	19	114,380
スクロール	13.3	16	6,656
ヨンドシーホールディングス	7.8	8.1	23,149
ファミリーマート	34.6	32.6	190,058
木曽路	12.5	13	29,471
サトレストランシステムズ	9.5	12.5	10,200
千趣会	18.4	20.9	14,964
タカキュー	7.3	8.2	1,525
ケーヨー	19.2	17.8	9,006
上新電機	22	25	22,100
日本瓦斯	16.4	12.1	30,806
ベスト電器	33.3	34.4	4,128
ロイヤルホールディングス	17.1	17.6	39,547
東天紅	7	8	1,088
いなげや	11.4	11.8	16,944
島忠	24.8	27.4	73,706
チヨダ	12.1	12.5	39,875
ライフコーポレーション	6.5	6.7	18,297
リンガーハット	10	9.6	23,529
さが美	8	8	744
ＭｒＭａｘ	10.3	9.3	2,687
テンアライド	8.7	9.8	3,704
ＡＯＫＩホールディングス	23.5	24.2	33,783
オークワ	16	17	17,850
コメリ	17.5	16.3	38,044
青山商事	25.7	20.3	89,726
しまむら	11.9	12.3	174,045
ＣＦＳコーポレーション	6.7	－	－
はせがわ	3.6	3.8	1,729
高島屋	149	154	141,680
松屋	20.6	21.3	20,639
エイチ・ツー・オー　リテイリング	48.4	54.3	106,373
近鉄百貨店	39	40	11,840
丸栄	17	22	1,980

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
国内	株式先物取引	ＴＯＰＩＸ	4,104	－

○有価証券の貸付及び借入の状況

2016年３月25日現在における貸付株数の総株数は24,569,000株です。
うち利害関係人であるモルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券株式会社に対する貸付は、24,569,000株です。

○投資信託財産の構成

（2016年３月25日現在）

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2016年３月25日現在）

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

○損益の状況

（2015年３月26日～2016年３月25日）

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

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

＜注記事項＞

①期首元本額　156,174,324,083円
　期中追加設定元本額　90,299,508,544円
　期中一部解約元本額　85,804,501,617円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.3743円です。

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

ファンド・マネジャー（国内株式）	2,419,679,844円	インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	22,906,682円
ｅＭＡＸＩＳ ＴＯＰＩＸインデックス	21,330,711,385円	インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	76,085,335円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,592,208,146円	インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	142,479,268円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	111,177,712円	インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	120,583,422円
コアバランス	912,057円	三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ファンドＶＡ１	3,150,098,815円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,945,917,827円	三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ファンドＶＡ	834,278,300円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,790,783,904円	三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	107,865,555円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	527,242,271円	三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	896,042,538円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	4,309,348,804円	三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	104,323,312円
MUAM 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	15,138,673,776円	三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	802,533,806円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	6,747,383,047円	三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞ＴＯＰＩＸ・ファンド	2,128,408,178円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ７５型（適格機関投資家限定）	2,669,566,608円	三菱UFＪ<DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	566,144,963円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	636,641,903円	三菱UFＪ<DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	2,248,685,858円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４５型（適格機関投資家限定）	315,038,965円	三菱UFＪ<DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	1,775,755,051円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	176,444,031円	三菱UFＪ<DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	1,347,664,902円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	595,935,508円	三菱ＵＦＪ ＤＣ国内株式インデックスファンド	44,719,222,766円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,406,064,878円	三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	636,768,073円
三菱UFＪ グローバル型バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	26,070,308円	三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	107,973,296円
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）	1,399,846円	三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	94,918,456円
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）	143,580,107円	三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	170,809円
MUAM インデックスファンドＴＯＰＩＸｉ（適格機関投資家限定）	8,726,654円	三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	255,117円
三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ファンド	7,499,823,663円	三菱UFＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	298,365円
三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ライト	373,640,163円	ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	18,896,736円
		合計	160,669,331,010円

［お知らせ］

①2015年７月１日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
（2015年７月１日）

②新株引受権証券および新株予約権証券への投資制限について、買付基準の記載部分の「取得時において」の削除を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
（2015年12月２日）

③信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため（分散型に分類）、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行うための、所要の約款変更を行いました。
（2016年３月２日）

外国株式インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2016年５月12日

［計算期間：2015年５月13日～2016年５月12日］

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

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＭＳＣＩ Kokusai Index（ＭＳＣＩコクサイ インデックス）		株式組入比率	株式先物比率	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
11期(2012年５月14日)	9,921	△ 6.8	74.99	△ 9.3	95.2	2.6	2.0	142,226
12期(2013年５月13日)	15,535	56.6	114.32	52.4	96.3	1.0	2.3	199,188
13期(2014年５月12日)	18,176	17.0	130.71	14.3	96.7	1.1	2.1	197,280
14期(2015年５月12日)	23,063	26.9	162.29	24.2	96.5	1.2	2.2	227,514
15期(2016年５月12日)	19,726	△14.5	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7	270,065

（注）ＭＳＣＩ Kokusai Index（ＭＳＣＩコクサイ インデックス）とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。ＭＳＣＩ Kokusai Index（円換算ベース）は、ＭＳＣＩ Kokusai Index（米ドルベース）をもとに委託会社が計算したものです。また、ＭＳＣＩ Kokusai Indexに対する著作権及びその他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	%		%	%	%	%
2015年5月12日	23,063	－	162.29	－	96.5	1.2	2.2
5月末	23,848	3.4	167.17	3.0	94.8	1.2	2.2
6月末	22,902	△ 0.7	160.34	△ 1.2	96.0	1.8	2.2
7月末	23,546	2.1	164.73	1.5	98.2	1.1	2.3
8月末	21,677	△ 6.0	151.30	△ 6.8	94.5	3.0	2.4
9月末	20,196	△12.4	140.71	△13.3	95.4	2.3	2.5
10月末	22,402	△ 2.9	155.86	△ 4.0	95.1	1.4	2.5
11月末	22,647	△ 1.8	157.46	△ 3.0	94.8	5.3	2.4
12月末	22,114	△ 4.1	153.40	△ 5.5	94.3	3.8	2.5
2016年1月末	20,152	△12.6	139.74	△13.9	95.2	2.3	2.6
2月末	19,318	△16.2	133.62	△17.7	95.4	2.1	2.6
3月末	20,436	△11.4	141.17	△13.0	99.9	2.3	2.8
4月末	20,342	△11.8	140.05	△13.7	94.9	3.0	2.6
(期末)							
2016年5月12日	19,726	△14.5	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7

(注) 騰落率は期首比。
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

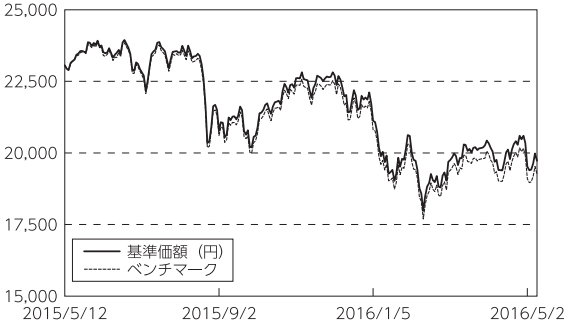
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国株式市況

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

◎為替市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは16.4%の下落となったため、カイ離は1.9%程度となりました。

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

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は△0.0%程度でした。

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

・効率的に運用を行うため、円貨、外貨現金などを若干保有しました。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

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

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

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

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.9%程度でした。

プラス要因	配当・利子収入・為替効果等	計 2.0%程度
マイナス要因	売買コスト・保管料等	計 △0.1%程度

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

○今後の運用方針

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

・売買に係るコストを考慮しつつ、多くの銘柄に分散投資を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2015年５月13日～2016年５月12日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	3	0.016	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(2)	(0.011)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(1)	(0.004)	
(b) 有価証券取引税	8	0.036	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(8)	(0.036)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
(c) その他費用	11	0.051	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(11)	(0.051)	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	22	0.103	
期中の平均基準価額は、21,631円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2015年５月13日～2016年５月12日）

株式

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

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

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

投資信託証券

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

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

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

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

先物取引の種類別取引状況

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

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

○株式売買比率

(2015年５月13日～2016年５月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年５月13日～2016年５月12日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	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	192,818	3,670	1.9	114,849	7,344	6.4

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

○組入資産の明細

（2016年５月12日現在）

外国株式

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	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	
PUBLICIS GROUPE	111	156	982	121,689	メディア
LAGARDERE SCA	71	95	202	25,118	メディア
JC DECAUX SA	40	61	218	27,078	メディア
SOCIETE BIC SA	17	23	294	36,493	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	99	167	487	60,359	資本財
THALES SA	54	86	666	82,567	資本財
PERNOD RICARD SA	125	175	1,679	207,901	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	610	874	795	98,490	銀行
ENGIE	860	1,215	1,595	197,600	公益事業
ALSTOM	127	128	284	35,219	資本財
ARKEMA	39	55	396	49,122	素材
LEGRAND SA	157	220	1,074	133,056	資本財
SCOR SE	91	126	371	45,943	保険
ADP	17	24	263	32,653	運輸
EDF	145	201	228	28,335	公益事業
NATIXIS	554	779	327	40,543	銀行
WENDEL	18	23	247	30,634	各種金融
BUREAU VERITAS SA	157	221	446	55,337	商業・専門サービス
EURAZEO	22	32	202	25,084	各種金融
EURAZEO-NEW	1	—	—	—	各種金融
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	179	255	386	47,864	公益事業
ILIAD SA	15	21	426	52,751	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	92	141	384	47,600	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	282	393	442	54,794	運輸
EDENRED	120	172	295	36,566	商業・専門サービス
REMY COINTREAU	14	19	140	17,357	食品・飲料・タバコ
REXEL SA	163	255	335	41,582	資本財
BOLLORE	511	711	239	29,617	運輸
NUMERICABLE-SFR	58	91	252	31,274	電気通信サービス
小計 株数・金額	16,447	20,923	77,814	9,634,233	
小計 銘柄数<比率>	67	64	—	<3.6%>	
(ユーロ…オランダ)					
QIAGEN N.V.	135	183	351	43,569	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV	566	786	490	60,697	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	535	743	499	61,847	自動車・自動車部品
FERRARI NV	—	105	400	49,595	自動車・自動車部品
AIRBUS GROUP SE	348	489	2,714	336,104	資本財
STMICROELECTRONICS NV	371	512	242	29,992	半導体・半導体製造装置
GEMALTO	46	66	380	47,085	ソフトウェア・サービス
WOLTERS KLUWER	180	249	852	105,562	メディア
KONINKLIJKE KPN NV	1,900	2,654	921	114,127	電気通信サービス
AKZO NOBEL	145	204	1,254	155,337	素材
HEINEKEN NV	136	190	1,575	195,012	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV	554	787	1,819	225,240	資本財
RELX NV	414	822	1,221	151,245	メディア
AEGON NV	1,074	1,506	727	90,046	保険
KONINKLIJKE AHOLD NV	530	688	1,327	164,408	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD HOLDING NV	75	105	492	60,973	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV	59	83	602	74,621	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	101	149	788	97,564	素材
ING GROEP NV-CVA	2,287	3,201	3,345	414,151	銀行
ASML HOLDING NV	207	286	2,326	288,076	半導体・半導体製造装置

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	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	
NEWCREST MINING LTD	454	637	1,309	104,632	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,392	2,050	1,240	99,113	保険
ORIGIN ENERGY LTD	664	1,462	743	59,381	エネルギー
ORICA LTD	222	312	426	34,094	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	229	332	678	54,231	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	590	1,400	568	45,443	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	776	1,080	1,390	111,130	保険
TRANSURBAN GROUP	1,097	1,714	2,130	170,279	運輸
WESFARMERS LTD	668	936	4,040	322,915	食品・生活必需品小売り
TOLL HOLDINGS LTD	412	—	—	—	運輸
CHALLENGER LTD	—	485	451	36,102	各種金融
SYDNEY AIRPORT	667	949	693	55,389	運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD	163	227	766	61,229	エネルギー
OIL SEARCH LTD	—	1,148	774	61,871	エネルギー
WORLEYPARSONS LTD	128	—	—	—	エネルギー
AGL ENERGY LTD	405	582	1,101	87,983	公益事業
TATTS GROUP LTD	891	1,244	491	39,281	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	911	1,276	371	29,678	素材
ASCIANO LTD	585	547	487	38,961	運輸
ILUKA RESOURCES LTD	251	354	216	17,313	素材
AUSNET SERVICES	1,155	1,718	278	22,250	公益事業
CROWN RESORTS LTD	212	300	361	28,896	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD	1,020	1,427	461	36,841	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	270	400	385	30,789	銀行
AURIZON HOLDINGS LTD	1,304	1,764	802	64,166	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	382	619	634	50,701	食品・飲料・タバコ
ALS LTD	252	—	—	—	商業・専門サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	79	120	836	66,825	ヘルスケア機器・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	34	47	185	14,860	消費者サービス
SEEK LTD	190	284	467	37,374	商業・専門サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	228	328	374	29,917	銀行
REA GROUP LTD	33	48	259	20,774	メディア
TPG TELECOM LTD	176	247	286	22,881	電気通信サービス
HEALTHSCOPE LTD	705	1,457	408	32,609	ヘルスケア機器・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,652	2,309	729	58,330	保険
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	139	195	120	9,600	各種金融
SOUTH32 LTD	—	4,430	717	57,356	素材
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	—	390	346	27,705	電気通信サービス
小計 株数・金額	39,535	63,400	87,989	7,031,240	
小計 銘柄数<比率>	61	63	—	<2.6%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,069	1,518	560	41,480	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	556	803	537	39,803	運輸
CONTACT ENERGY LTD	231	630	333	24,659	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD	393	573	492	36,486	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD	213	321	298	22,095	ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD	797	1,118	306	22,697	公益事業
MIGHTY RIVER POWER	452	644	197	14,592	公益事業
小計 株数・金額	3,713	5,610	2,726	201,815	
小計 銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>	
(香港)			千香港ドル		
WHARF HOLDINGS LTD	900	1,130	4,661	65,117	不動産

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

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

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

外国投資信託証券

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

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

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末 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	4,951	－
		SP/TSE60	297	－
		SWISS IX	281	－
		EURO ST	1,165	－
		SPI 200	299	－
		FTSE100	594	－

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

○投資信託財産の構成

（2016年５月12日現在）

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
株式	255,005,772	94.4
投資証券	7,251,695	2.7
コール・ローン等、その他	7,907,174	2.9
投資信託財産総額	270,164,641	100.0

（注）期末における外貨建純資産（269,579,000千円）の投資信託財産総額（270,164,641千円）に対する比率は99.8％です。
（注）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年５月12日現在)

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

＜注記事項＞

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

○損益の状況 (2015年５月13日～2016年５月12日)

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

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

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

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

［お知らせ］

①2015年７月１日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
（2015年７月１日）

②新株引受権証券および新株予約権証券への投資制限について、買付基準の記載部分の「取得時において」の削除を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
（2015年12月２日）

③信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため（分散型に分類）、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行うための、所要の約款変更を行いました。
（2016年３月２日）

日本債券インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2016年５月12日

［計算期間：2015年５月13日～2016年５月12日］

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

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合インデックス		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
11期(2012年５月14日)	11,862	2.8	340.97	2.8	99.4	0.1	203,547
12期(2013年５月13日)	12,036	1.5	345.99	1.5	98.9	0.8	269,276
13期(2014年５月12日)	12,299	2.2	353.58	2.2	99.4	0.2	283,162
14期(2015年５月12日)	12,572	2.2	361.38	2.2	99.4	0.3	343,834
15期(2016年５月12日)	13,473	7.2	387.29	7.2	99.6	－	529,456

（注）ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合インデックスとは、野村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) 2015年5月12日	12,572	－	361.38	－	99.4	0.3
5月末	12,620	0.4	362.77	0.4	99.2	0.4
6月末	12,613	0.3	362.54	0.3	99.5	0.3
7月末	12,649	0.6	363.58	0.6	99.3	0.4
8月末	12,670	0.8	364.20	0.8	99.3	0.4
9月末	12,707	1.1	365.24	1.1	99.0	0.1
10月末	12,755	1.5	366.65	1.5	98.9	0.1
11月末	12,754	1.4	366.58	1.4	99.4	0.1
12月末	12,832	2.1	368.88	2.1	99.4	－
2016年1月末	12,991	3.3	373.52	3.4	99.0	0.1
2月末	13,214	5.1	379.83	5.1	98.8	0.3
3月末	13,320	5.9	382.91	6.0	101.6	0.1
4月末	13,437	6.9	386.25	6.9	99.8	－
(期末) 2016年5月12日	13,473	7.2	387.29	7.2	99.6	－

(注) 騰落率は期首比。
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ7.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移

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

●投資環境について

◎国内債券市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは7.2%の上昇となったため、カイ離は△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（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

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

○１万口当たりの費用明細

（2015年５月13日～2016年５月12日）

項目	当期 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)	
(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	0.000	
期中の平均基準価額は、12,880円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2015年５月13日～2016年５月12日）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	240,143,108	110,760,622
	地方債証券	14,052,879	4,085,436
	特殊債券	20,627,787	5,898,067 (523,705)
	社債券	11,239,981	5,506,287 (980,000)

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建 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	11,739	12,952	－	－

○利害関係人との取引状況等

（2015年５月13日～2016年５月12日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	286,063	84,760	29.6	126,250	49,856	39.5

（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	1,136	302	1,990

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種　　類	買　付　額
	百万円
公社債	1,600

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

○組入資産の明細

（2016年５月12日現在）

国内公社債

（A）国内（邦貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					５年以上	２年以上	２年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	380,496,000	430,939,878	81.4	－	50.7	21.3	9.3
	(　100,000)	(　100,703)	(0.0)	(－)	(　－)	(0.0)	(　－)
地方債証券	28,006,180	30,032,413	5.7	－	4.0	1.4	0.2
	(28,006,180)	(30,032,413)	(5.7)	(－)	(4.0)	(1.4)	(0.2)
特殊債券（除く金融債）	36,130,167	39,037,654	7.4	－	5.3	1.4	0.7
	(36,130,167)	(39,037,654)	(7.4)	(－)	(5.3)	(1.4)	(0.7)
金融債券	4,340,000	4,372,982	0.8	－	0.0	0.6	0.2
	(　4,340,000)	(　4,372,982)	(0.8)	(－)	(0.0)	(0.6)	(0.2)
普通社債券	21,917,000	22,919,698	4.3	0.2	1.3	2.1	0.9
	(21,917,000)	(22,919,698)	(4.3)	(0.2)	(1.3)	(2.1)	(0.9)
合計	470,889,347	527,302,626	99.6	0.2	61.3	27.0	11.4
	(90,493,347)	(96,463,451)	(18.2)	(0.2)	(10.5)	(5.6)	(2.0)

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

（Ｂ）国内（邦貨建）公社債　銘柄別開示

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券	%	千円	千円	
第８回ナショナル・オーストラリア銀行	1.3	100,000	100,801	2017/１/20
第９回ナショナル・オーストラリア銀行	0.457	100,000	100,814	2019/１/17
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	100,445	2020/１/16
第８回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.407	300,000	302,295	2019/５/２
第８回ウエストパック・バンキング・コーポレーション	1.0	100,000	100,220	2016/８/12
第９回ラボバンク・ネダーランド	1.81	100,000	107,163	2021/１/28
第18回ラボバンク・ネダーランド	0.778	100,000	100,971	2017/11/２
第22回ラボバンク・ネダーランド	0.377	100,000	100,164	2016/12/19
第23回ラボバンク・ネダーランド	0.557	100,000	101,048	2018/12/19
第27回ラボバンク・ネダーランド	0.38	100,000	100,559	2020/５/22
小計		21,917,000	22,919,698	
合計		470,889,347	527,302,626	

○投資信託財産の構成

（2016年５月12日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	527,302,626	99.2
コール・ローン等、その他	4,274,375	0.8
投資信託財産総額	531,577,001	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年５月12日現在)

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

＜注記事項＞

①期首元本額　273,489,284,775円
　期中追加設定元本額　230,928,667,279円
　期中一部解約元本額　111,454,436,962円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.3473円です。

○損益の状況 (2015年５月13日～2016年５月12日)

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

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

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

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

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

ファンド・マネジャー（国内債券）	24,560,538,321円
ｅＭＡＸＩＳ 国内債券インデックス	16,932,463,018円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,513,899,345円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	318,764,587円
コアバランス	2,495,021円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	24,663,146,879円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	28,138,690,875円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	227,589,648円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,184,652,524円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,740,056,498円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	2,087,892,777円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	6,373,050,568円
ＭＵＡＭ 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	199,687,055,080円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	6,632,302,396円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ７５型（適格機関投資家限定）	2,642,591,636円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,901,143,295円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４５型（適格機関投資家限定）	552,810,923円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	174,759,098円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,411,642,373円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,201,886,464円
三菱ＵＦＪ グローバル型バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	35,492,792円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	58,782,800円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	90,216,225円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	118,748,080円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	73,430,230円
三菱ＵＦＪ 日本債券インデックスファンドＶＡ	23,134,363円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	267,175,876円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	641,170,860円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	261,546,394円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	645,178,699円
三菱ＵＦＪ〈ＤＣ〉日本債券インデックスファンド	2,887,689,697円
三菱ＵＦＪ〈ＤＣ〉インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	1,614,469,539円
三菱ＵＦＪ〈ＤＣ〉インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	3,107,456,915円
三菱ＵＦＪ〈ＤＣ〉インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	1,646,858,018円
三菱ＵＦＪ〈ＤＣ〉インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	907,309,775円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	6,129,391,967円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	617,588,982円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	713,503,002円
三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）	406,651,573円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	420,126円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	272,141円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	191,413円
ｅＭＡＸＩＳ 債券バランス（２資産均等型）	49,079,772円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	22,122,406円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	5,351,778円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	16,871,400円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	3,342,258円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	2,016,780円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	54,241円
ＭＵＫＡＭ バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	2,670,099,620円
ＭＵＫＡＭ バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	466,044円
合計	392,963,515,092円

［お知らせ］

①2015年７月１日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
（2015年７月１日）

②信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため（分散型に分類）、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行うための、所要の約款変更を行いました。
（2016年３月２日）

外国債券インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2016年５月12日

［計算期間：2015年５月13日～2016年５月12日］

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

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）		債券組入比率	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
11期(2012年５月14日)	13,365	2.3	74,734.13	2.1	98.7	－	158,535
12期(2013年５月13日)	17,815	33.3	99,491.98	33.1	98.8	－	195,142
13期(2014年５月12日)	18,707	5.0	104,415.94	4.9	98.8	－	185,030
14期(2015年５月12日)	20,959	12.0	117,169.90	12.2	98.8	－	159,683
15期(2016年５月12日)	19,674	△ 6.1	109,931.94	△ 6.2	98.9	－	156,155

(注) シティ世界国債インデックス（除く日本）は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、シティ世界国債インデックス（除く日本）をもとに、委託会社が計算したものです。
(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
（期　首） 2015年５月12日	20,959	－	117,169.90	－	98.8	－
５月末	21,469	2.4	119,576.28	2.1	97.3	－
６月末	21,143	0.9	117,821.48	0.6	98.7	－
７月末	21,435	2.3	119,513.99	2.0	98.8	－
８月末	21,102	0.7	117,759.56	0.5	98.1	－
９月末	21,048	0.4	117,295.48	0.1	98.8	－
10月末	21,064	0.5	117,390.65	0.2	98.7	－
11月末	21,049	0.4	117,622.76	0.4	98.9	－
12月末	20,757	△1.0	115,735.90	△1.2	98.5	－
2016年１月末	21,077	0.6	117,720.03	0.5	97.9	－
２月末	20,000	△4.6	111,665.52	△4.7	98.9	－
３月末	20,359	△2.9	113,814.57	△2.9	101.9	－
４月末	19,703	△6.0	109,994.30	△6.1	98.9	－
（期　末） 2016年５月12日	19,674	△6.1	109,931.94	△6.2	98.9	－

（注）騰落率は期首比。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

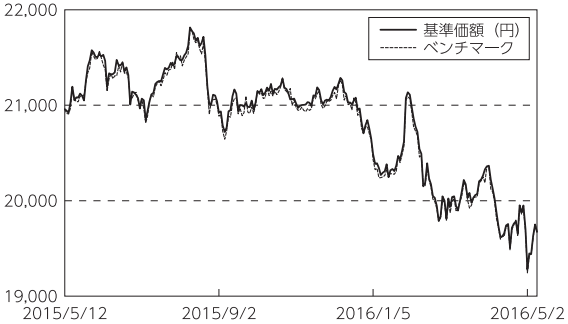
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.1%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎債券市況

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

◎為替市況

・円・米ドル相場は、ＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）による政策金利の引き上げが意識されて米ドルが対円で上昇する局面もありましたが、世界的に景気減速懸念が強まったことなどを背景に米ドルが対円で売られました。期首との比較では、米ドルは対円で9.8%下落しました。

・円・ユーロ相場は、ユーロ圏の景況感の改善などを背景に上昇する局面もありましたが、ＥＣＢ（欧州中央銀行）が緩和的な金融政策を維持したことなどを背景に、ユーロが対円で売られました。期首との比較では、ユーロは対円で7.5%下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

・ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは6.2%の下落となったため、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

（2015年５月13日～2016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	0.016	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(3)	(0.016)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	3	0.016	
期中の平均基準価額は、20,850円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2015年５月13日～2016年５月12日）

公社債

			買　付　額	売　付　額
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 250,628	千アメリカドル 207,257
	カナダ	国債証券	千カナダドル 14,520	千カナダドル 14,197
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 82,266	千メキシコペソ 53,859
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	32,612	30,597
	イタリア	国債証券	35,318	27,766
	フランス	国債証券	37,473	27,713
	オランダ	国債証券	8,541	8,739
	スペイン	国債証券	22,125	16,940
	ベルギー	国債証券	8,489	6,442
	オーストリア	国債証券	6,661	5,956
	フィンランド	国債証券	2,703	1,945
	アイルランド	国債証券	2,113	1,069
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 21,088	千イギリスポンド 17,009
	スイス	国債証券	千スイスフラン 488	千スイスフラン 412
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 17,764	千スウェーデンクローネ 13,804
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 9,603	千ノルウェークローネ 3,207
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 16,771	千デンマーククローネ 15,452
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 13,057	千ポーランドズロチ 8,331
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 12,624	千オーストラリアドル 7,616
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 2,291	千シンガポールドル 2,103
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 7,692	千マレーシアリンギット 6,702
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 28,054	千南アフリカランド 13,988

（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

（2015年５月13日～2016年５月12日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	34,058	1,659	4.9	27,994	1,524	5.4

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

○組入資産の明細

（2016年５月12日現在）

外国公社債

（A）外国（外貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	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	577,850	606,327	65,707,749	42.1	－	17.5	16.2	8.4
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	33,700	38,093	3,212,411	2.1	－	1.0	0.6	0.5
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	219,600	243,999	1,471,314	0.9	－	0.6	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	77,700	93,979	11,635,561	7.5	－	4.4	2.0	1.0
イタリア	104,600	124,581	15,424,452	9.9	－	6.2	2.8	0.9
フランス	101,500	123,991	15,351,399	9.8	－	6.1	2.8	0.9
オランダ	25,100	30,364	3,759,462	2.4	－	1.5	0.6	0.3
スペイン	58,700	69,178	8,564,969	5.5	－	3.1	1.7	0.7
ベルギー	25,900	32,740	4,053,611	2.6	－	1.9	0.5	0.2
オーストリア	15,950	19,540	2,419,359	1.5	－	1.0	0.4	0.2
フィンランド	6,800	7,768	961,757	0.6	－	0.4	0.2	0.1
アイルランド	8,700	10,254	1,269,585	0.8	－	0.4	0.4	0.0
	千イギリスポンド	千イギリスポンド						
イギリス	63,885	78,380	12,268,091	7.9	－	5.7	1.7	0.5
	千スイスフラン	千スイスフラン						
スイス	3,200	3,813	425,649	0.3	－	0.1	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	50,300	58,286	776,956	0.5	－	0.3	0.2	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	33,000	35,935	477,220	0.3	－	0.2	0.1	0.1
	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
デンマーク	49,500	63,757	1,060,921	0.7	－	0.5	0.1	0.1
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	30,900	32,499	909,011	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	31,350	34,943	2,792,339	1.8	－	1.1	0.5	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	6,440	6,808	539,944	0.3	－	0.2	0.1	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	26,250	26,441	713,120	0.5	－	0.2	0.1	0.1
	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
南アフリカ	102,750	92,584	667,536	0.4	－	0.3	0.1	0.0
合計	－	－	154,462,427	98.9	－	52.9	31.5	14.5

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

（B）外国（外貨建）公社債　銘柄別開示

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券	8 GILT 210607	8.0	1,100	1,494	233,912	2021/6/7
		8.75 GILT 170825	8.75	350	388	60,769	2017/8/25
小計						12,268,091	
スイス				千スイスフラン	千スイスフラン		
	国債証券	2 SWISS GOVT 210428	2.0	320	364	40,708	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	450	508	56,751	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 180108	3.0	550	584	65,270	2018/1/8
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	490	548	61,180	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	440	578	64,623	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	500	754	84,194	2028/4/8
		4.25 SWISS GOVT 170605	4.25	450	474	52,920	2017/6/5
小計						425,649	
スウェーデン				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	4,300	4,419	58,918	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	6,800	7,382	98,409	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	5,500	6,469	86,240	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	7,700	9,265	123,506	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	4,000	5,400	71,990	2039/3/30
		3.75 SWD GOVT 170812	3.75	5,700	6,011	80,135	2017/8/12
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	8,100	9,185	122,437	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	8,200	10,151	135,318	2020/12/1
小計						776,956	
ノルウェー				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	2,000	2,030	26,959	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	3,400	3,540	47,023	2025/3/13
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	4,600	4,887	64,912	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	4,200	4,779	63,467	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	6,600	7,532	100,028	2021/5/25
		4.25 NORWE GOVT 170519	4.25	5,800	6,015	79,889	2017/5/19
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	6,400	7,149	94,940	2019/5/22
小計						477,220	
デンマーク				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	3,000	3,048	50,728	2018/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	5,200	5,743	95,565	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	6,500	7,321	121,826	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	8,200	9,609	159,910	2021/11/15
		4 DMK GOVT 171115	4.0	4,700	5,020	83,533	2017/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	8,400	9,685	161,161	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	11,400	20,004	332,878	2039/11/15
		7 DMK GOVT 241110	7.0	2,100	3,324	55,316	2024/11/10
小計						1,060,921	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	2,600	2,553	71,416	2020/4/25
		1.75 POLAND 210725	1.75	1,100	1,069	29,917	2021/7/25
		2 POLAND 210425	2.0	2,400	2,377	66,486	2021/4/25
		2.5 POLAND 180725	2.5	2,200	2,241	62,681	2018/7/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	2,000	1,909	53,403	2026/7/25

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

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

銘柄			当期末 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
南アフリカ			%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円	
	国債証券	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	5,500	5,280	38,069	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	5,000	4,701	33,899	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	4,100	4,074	29,374	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	8,500	7,491	54,016	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	5,000	5,021	36,207	2017/9/15
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	5,800	5,123	36,938	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	7,000	6,179	44,556	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	5,000	4,440	32,014	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	9,700	8,597	61,984	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	2,500	2,308	16,641	2035/2/28
		9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	1,400	1,285	9,268	2040/1/31
小計						667,536	
合計						154,462,427	

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

○投資信託財産の構成

(2016年５月12日現在)

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
公社債	154,462,427	98.7
コール・ローン等、その他	2,009,882	1.3
投資信託財産総額	156,472,309	100.0

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

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年５月12日現在)

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

＜注記事項＞

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

○損益の状況 (2015年５月13日～2016年５月12日)

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

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

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

ファンド・マネジャー（海外債券）	1,807,611,362円
ｅＭＡＸＩＳ 先進国債券インデックス	11,534,490,043円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,137,218,484円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	226,352,324円
コアバランス	1,700,783円
三菱ＵＦＪ ＤＣ海外債券インデックスファンド	6,437,009,006円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	16,634,896,304円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,373,592,301円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	2,212,693,687円
ＭＵＡＭ 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	13,634,758,617円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	9,105,298,351円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ７５型（適格機関投資家限定）	2,745,502,453円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	650,178,523円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４５型（適格機関投資家限定）	218,583,584円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	80,427,144円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,835,690,297円
三菱ＵＦＪ グローバル型バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	43,989,417円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	7,156,437円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	14,999,999円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	25,991,372円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	9,528,671円
三菱ＵＦＪ 外国債券インデックスファンドＶＡ	164,114,246円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	72,157,907円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	148,729,507円

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

［お知らせ］

①2015年７月１日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
（2015年７月１日）

②信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため（分散型に分類）、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行うための、所要の約款変更を行いました。
（2016年３月２日）