



■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合		
信託期間	2026年4月23日まで（2016年4月28日設定）		
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> 投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の株式、債券に実質的な投資を行います。 運用につきましては、安定性を重視します。 投資対象とする投資信託証券は、原則として、別に定める投資信託証券（以下、「指定投資信託証券」といいます。）の中から選定します。なお、選定する投資信託証券は、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、指定投資信託証券として指定されていた投資信託証券を指定から外したり、新たに投資信託証券（ファンド設定以降に設定された投資信託証券も含まれます。）を指定投資信託証券として指定する場合があります。 指定投資信託証券の投資配分比率については、三菱UFJ信託銀行株式会社からの投資助言及び情報提供をもとに決定します。なお、一部の指定投資信託証券への投資配分比率がゼロとなる場合があります。 投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 実質組入外貨建資産については、為替ヘッジを行う場合があります。 		
主要投資対象	当ファンド	指定投資信託証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、債券および短期金融資産を実質的な主要投資対象とします。	
	指定投資信託証券	MUAMインデックスファンドTOPIXi（適格機関投資家限定）	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。
		MUAM外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	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。
		MUAM日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	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。
		国内物価連動国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）	NOMURA物価連動国債インデックス（フロアあり）と連動する投資成果をめざして運用を行います。
		MUAM外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	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。
		MUAMヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家販売制限付）	シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。
マネープールファンド（F O F s 用）（適格機関投資家限定）	安定した収益の確保をめざして安定運用を行います。		
組入制限	株式への直接投資は行いません。投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行いません。同一銘柄の投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。		
分配方針	<ul style="list-style-type: none"> 年1回の決算時（4月23日（休業日の場合は翌営業日））に分配を行います。経費等控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額は、委託会社が分配可能額、基準価額水準、市況動向等を勘案のうえ決定します。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。 		

先進国資産配分コントロール ファンド＜安定型＞ （愛称：コア安定）

第1期 運用報告書（全体版）

決算日 2017年4月24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、「先進国資産配分コントロールファンド＜安定型＞（愛称：コア安定）」は2017年4月24日に第1期の決算を行いました。

当ファンドは、指定投資信託証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、債券および短期金融資産を実質的な主要投資対象とし、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざして運用を行ってまいりました。ここに期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

中国銀行グループ

中銀アセットマネジメント株式会社

岡山県岡山市北区柳町2丁目11番23号

＜お問い合わせ先＞

マーケティング部

電話番号：086-224-5310

受付時間：営業日の午前9時～午後5時

ホームページ：<http://www.chugin-am.jp>

*お取引内容等につきましては、ご購入された販売会社にお問い合わせください。

■設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			投 資 信 託 証 組 入 比 券 率	純 資 産 総 額
		税 分 配 込 金	騰 落 率	中 率		
(設 定 日) 2016年4月28日	円 10,000	円 —	% —	% —	百万円 1,111	
1期 (2017年4月24日)	9,915	0	△0.9	97.7	2,839	

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てております。

(注) 当ファンドにはベンチマークおよび参考指数はありません。

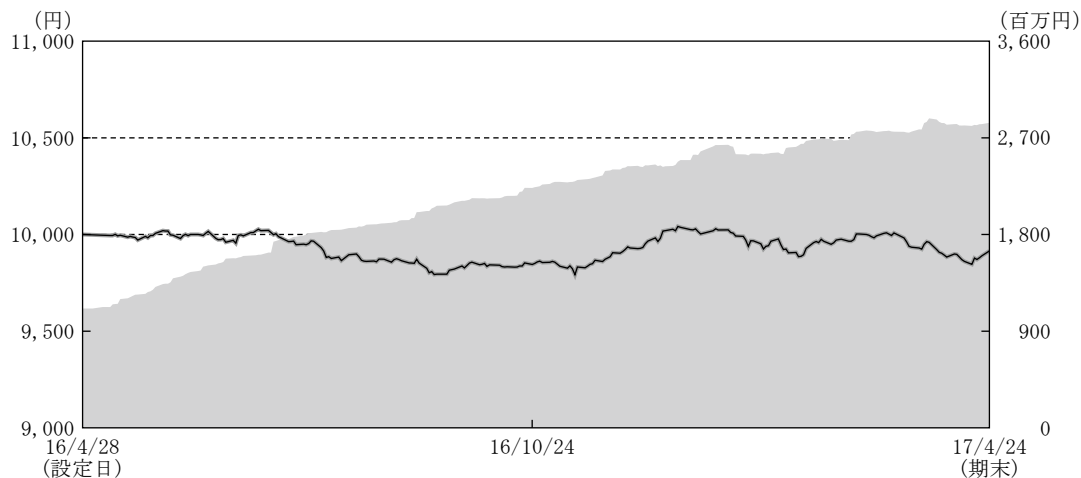
■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		投 資 信 託 証 組 入 比 券 率
		騰 落 率	率	
(設 定 日) 2016年 4月28日	円 10,000	% —	% —	
4月末	10,000	0.0	—	
5月末	10,018	0.2	83.8	
6月末	9,998	△0.0	77.5	
7月末	9,965	△0.4	76.1	
8月末	9,875	△1.3	80.4	
9月末	9,857	△1.4	80.0	
10月末	9,856	△1.4	86.1	
11月末	9,922	△0.8	91.4	
12月末	10,003	0.0	96.6	
2017年 1月末	9,946	△0.5	98.1	
2月末	9,965	△0.4	96.2	
3月末	9,959	△0.4	96.5	
(期 末) 2017年 4月24日	9,915	△0.9	97.7	

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。

運用経過

■基準価額等の推移について（2016年4月28日～2017年4月24日）



■ 純資産総額 (右軸) — 基準価額 (左軸) — 分配金再投資基準価額 (左軸)

設定日：10,000円

第1期末：9,915円（既払分配金0円）

騰落率：△0.9%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについては、お客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

■基準価額の主な変動要因

【上昇要因】

株式市況の戻りに伴い、国内外株式の組入比率を引き上げたことが基準価額に対して上昇要因となりました。

【下落要因】

期を通じて高位に組入れを行っていた国内外の債券価格が下落（金利は上昇）したことが基準価額に対して下落要因となりました。

■投資環境について

【概況】

当期の株式市況では、国内、先進国株式市況ともに上昇しました。債券市場は、国内、先進国債券市況ともに下落しました。

【株式】

国内株式および先進国株式は、6月に英国のEU離脱が決定したことや、11月の米国大統領選挙等の影響等を受け、大幅に下落した局面もあった一方、景気拡大期待等から反発する局面もあり、振れ幅の大きい展開となりましたが、期を通しては上昇しました。

【債券】

国内の長期金利は、マイナス金利導入や英国のEU離脱決定、長短金利操作付き量的・質的金融緩和等を受け低下した局面もありましたが、11月以降、米国金利の上昇に連動して上昇しました。先進国では、米国やドイツの長期金利は、米景気指標悪化や英国のEU離脱決定等を受けて低下した局面もありましたが、米国の利上げ観測の高まりや、米国次期大統領への政策期待等から期を通じては上昇しました。

【為替】

円は米ドル、ユーロに対して下落（円安）しました。

■当ファンドのポートフォリオについて

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

【組入比率】

2016年8月、国内株式の収益寄与が改善したことを受けて、株式の組入を開始しました。その後も、株式部分の収益寄与は上昇し、投資環境も良好であったことを受けて、組入比率の引き上げを行いました。先進国株式も、投資環境の改善等を受け、ウエイトの引き上げを行い、2016年12月にはウエイトを最大に引き上げました。国内債券に関しては、後半にかけて徐々に物価連動国債のウエイト引き上げを行いました。先進国債券は、期初はゼロにしていた外国債券（ヘッジ無し）のウエイトを、2016年10月以降はヘッジ付外国債券と同ウエイトとしました。

【パフォーマンス要因】

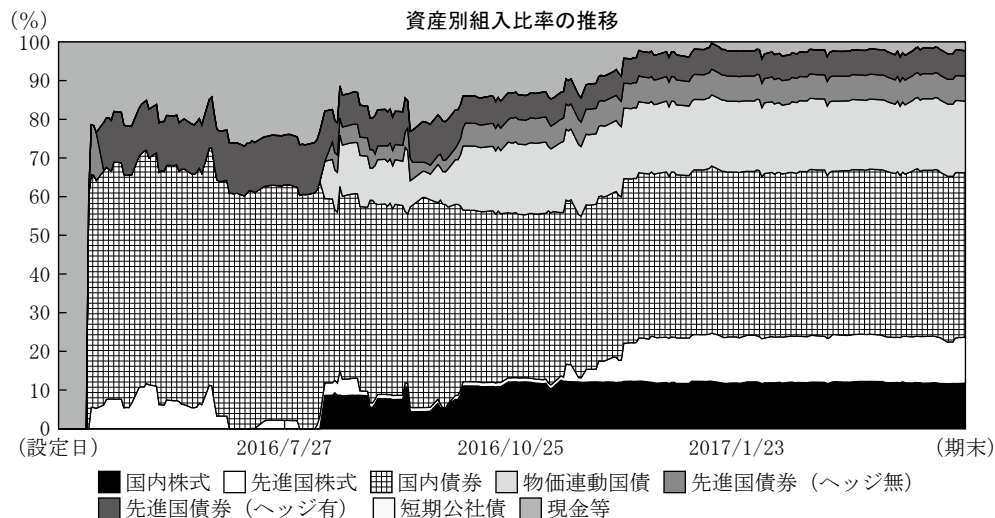
当期は、世界的な長期金利の上昇を受けて比較的高位に組入れを行っていた国内外の債券が基準価額にマイナスに影響しましたが、株式市況の戻りを捉え、国内外株式の組入を引き上げたことがプラスに寄与しました。

(ご参考)

資産別組入比率および基準価額騰落率

(2017年4月24日現在)

主要投資対象	投資信託証券名	組入可能範囲	組入比率	期中の基準価額騰落率
先進国債券 (ヘッジ有)	MUAMヘッジ付外国債券インデックスファンド (適格機関投資家転売制限付)	13.0% (原則、固定)	6.6%	△0.4%
先進国債券 (ヘッジ無)	MUAM外国債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)		6.5%	△3.4%
物価連動国債	国内物価連動国債インデックスファンド (適格機関投資家限定)	0.0%~61.0%	18.6%	△0.4%
国内債券	MUAM日本債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)		42.5%	△1.5%
先進国株式	MUAM外国株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)	0.0%~12.0%	11.9%	10.5%
国内株式	MUAMインデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)	0.0%~12.0%	11.7%	10.8%
短期公社債	マネープールファンド (FOF s用) (適格機関投資家限定)	—	—	△0.0%



(注) 比率は、各資産に対応する指定投資信託証券の純資産総額に対する割合です。

■ベンチマークとの差異について

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

従って、ベンチマークおよび参考指数との対比はできません。

■分配金について

当期につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、収益分配の実施は見送りといたしました。

分配原資の内訳

(単位：円・%、1万口当たり・税込み)

項 目	第 1 期
	2016年4月28日～2017年4月24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	—

(注) 「当期の収益」は、費用控除後の配当等収益および費用控除後・繰越欠損補填後の有価証券売買等損益から分配に充当した金額です。また「当期の収益以外」は収益調整金および分配準備積立金から分配に充当した金額です。

(注) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は小数点以下切捨てのため、合計額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(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、当ファンドの収益率とは異なります。

■今後の運用方針について

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

■1万口当たりの費用明細

項 目	当 期 2016年4月28日～2017年4月24日		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	136円	1.371%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ※期中の平均基準価額は9,947円です。
(投 信 会 社)	(59)	(0.589)	委託した資金の運用等の対価
(販 売 会 社)	(75)	(0.750)	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.032)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	1	0.006	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	137	1.377	

(注) 期中において発生した費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

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

■売買及び取引の状況（2016年4月28日から2017年4月24日まで）

投資信託証券

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	MUAMインデックスファンド TOPIXi（適格機関投資家限定）	514,582,392	594,000	253,639,187	290,000
	MUAM日本債券インデックス ファンド（適格機関投資家限定）	1,622,553,242	2,032,700	645,099,897	806,000
	国内物価連動国債インデックス ファンド（適格機関投資家限定）	897,646,876	897,000	370,567,527	369,000
	MUAM外国株式インデックス ファンド（適格機関投資家限定）	676,498,954	936,110	456,906,724	599,324
	MUAM外国債券インデックス ファンド（適格機関投資家限定）	377,366,111	473,020	232,194,858	293,524
	MUAMヘッジ付外国債券インデックス ファンド（適格機関投資家転売制限付）	374,362,890	436,960	210,912,935	249,500
合 計	4,463,010,465	5,369,790	2,169,321,128	2,607,348	

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 口数、金額の単位未満は切捨てております。

■利害関係人との取引状況等（2016年4月28日から2017年4月24日まで）

期中における利害関係人との取引はありません。

（注）利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細（2017年4月24日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘	柄	当 期		末
		口 数	評 価 額	比 率
		口	千円	%
MUAMインデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)		260,943,205	333,589	11.7
MUAM日本債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)		977,453,345	1,206,861	42.5
国内物価連動国債インデックスファンド (適格機関投資家限定)		527,079,349	527,026	18.6
MUAM外国株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)		219,592,230	337,710	11.9
MUAM外国債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)		145,171,253	183,990	6.5
MUAMヘッジ付外国債券インデックスファンド (適格機関投資家転売制限付)		163,449,955	186,431	6.6
合 計		2,293,689,337	2,775,610	97.7

（注）単位未満は切捨てております。

■投資信託財産の構成

（2017年4月24日現在）

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	
	千円	%	
投 資 信 託 受 益 証 券	2,775,610	97.1	
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	83,608	2.9	
投 資 信 託 財 産 総 額	2,859,218	100.0	

（注）比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2017年4月24日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,859,218,109円
コール・ローン等	83,608,076
投資信託受益証券(評価額)	2,775,610,033
(B) 負 債	19,433,905
未 払 解 約 金	1,822,800
未 払 信 託 報 酬	17,542,412
未 払 利 息	229
そ の 他 未 払 費 用	68,464
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,839,784,204
元 本	2,864,145,657
次 期 繰 越 損 益 金	△ 24,361,453
(D) 受 益 権 総 口 数	2,864,145,657口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,915円

(注) 当ファンドの期首元本額は1,111,080,000円、期中追加設定元本額は2,201,634,449円、期中一部解約元本額は448,568,792円です。

(注) 1口当たり純資産額は0.9915円です。

(注) 純資産総額が元本額を下回っており、その差額は24,361,453円です。

■損益の状況

当期 (自2016年4月28日 至2017年4月24日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,284,587円
受 取 配 当 金	3,515,982
支 払 利 息	△ 231,395
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	13,138,070
売 買 益	57,487,161
売 買 損	△44,349,091
(C) 信 託 報 酬 等	△29,605,300
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△13,182,643
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△11,178,810
(配 当 等 相 当 額)	(△ 51,686)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△11,127,124)
(F) 計 (D+E)	△24,361,453
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(F+G)	△24,361,453
追 加 信 託 差 損 益 金	△11,178,810
(配 当 等 相 当 額)	(△ 51,686)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△11,127,124)
繰 越 損 益 金	△13,182,643

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

(注) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)より分配対象収益は0円(10,000口当たり0円)ですが、当期に分配した金額はありません。

■分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----

◆収益分配金は決算日から起算して5営業日までにお支払い開始しております。

◆収益分配金を再投資される方の収益分配金は、税金を差し引いた後、決算日の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

■お知らせ

該当事項はございません。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型	
信託期間	2018年8月14日まで（2013年7月11日設定）	
運用方針	東京証券取引所第一部に上場されている株式、TOPIXマザーファンド受益証券および有価証券指数等先物取引等に投資を行い、東証株価指数（TOPIX）に連動する投資成果をめざして運用を行います。	
主要運用対象	ベビーファンド	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。なお、TOPIXマザーファンド受益証券および有価証券指数等先物取引等に投資することがあります。
	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。
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
	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。
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）

MUAM インデックスファンドTOPIX i （適格機関投資家限定）

第7期（決算日：2017年2月14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「MUAM インデックスファンドTOPIX i（適格機関投資家限定）」は、去る2月14日に第7期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
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。

本資料の表記にあたって

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			東証株価指数 (TOPIX)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	(分配額)	税込 分配金	期中 騰落率	(TOPIX)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
3期(2015年2月16日)	12,289	82	15.8	1,459.43	14.9	93.8	6.3	22,608
4期(2015年8月14日)	14,028	110	15.0	1,664.46	14.0	95.3	4.7	26,197
5期(2016年2月15日)	10,903	78	△21.7	1,292.23	△22.4	94.3	5.7	22,677
6期(2016年8月15日)	11,159	77	3.1	1,316.63	1.9	93.8	6.3	21,605
7期(2017年2月14日)	13,097	74	18.0	1,539.12	16.9	96.1	3.7	33,384

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(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) 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」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証株価指数 (TOPIX)		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	騰落率	(TOPIX)	騰落率		
(期首) 2016年8月15日	円	%		%	%	%
	11,159	—	1,316.63	—	93.8	6.3
8月末	11,272	1.0	1,329.54	1.0	94.1	5.9
9月末	11,307	1.3	1,322.78	0.5	92.7	7.5
10月末	11,907	6.7	1,393.02	5.8	91.7	8.3
11月末	12,562	12.6	1,469.43	11.6	92.4	7.6
12月末	12,995	16.5	1,518.61	15.3	96.5	3.5
2017年1月末	13,020	16.7	1,521.67	15.6	96.1	3.9
(期末) 2017年2月14日	円	%		%	%	%
	13,171	18.0	1,539.12	16.9	96.1	3.7

(注) 期末基準価額は分配金込み、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」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第7期：2016/8/16～2017/2/14)

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ18.0% (分配金再投資ベース) 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 (16.9%) を1.1%上回りました。



- ・分配金再投資基準価額は、収益分配金 (税込み) を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- ・実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なるため、お客さまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の主な変動要因

上昇要因	米国次期大統領政権下での景気刺激策への期待などから米国長期金利が上昇し、円安・米ドル高が進行したことなどを受けて、国内株式市況が上昇したことが基準価額の上昇要因となりました。
------	---

投資環境について

(第7期: 2016/8/16~2017/2/14)

◎国内株式市況

- ・日本銀行による上場投資信託(ETF)買入れによって投資家に安心感が広がったことや、米国次期大統領政権下での景気刺激策への期待などから米国長期金利が上昇し、円安・米ドル高が進行したことなどを受けて、期を通じて国内株式市況は上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

<MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)>

- ・TOPIXマザーファンド受益証券を含め、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。

<TOPIXマザーファンド>

基準価額は期首に比べ18.1%の上昇となりました。

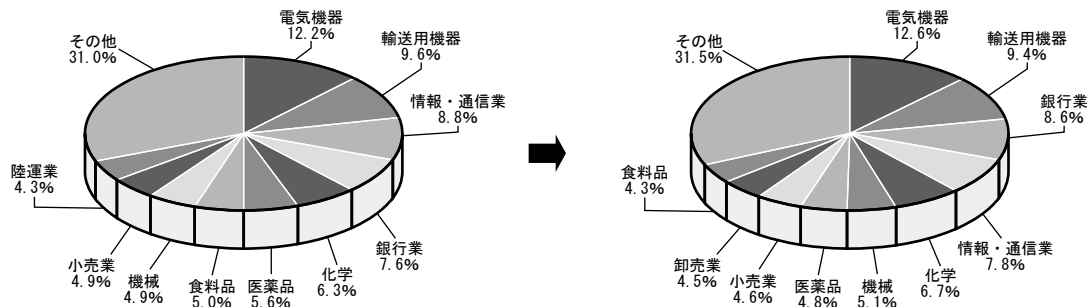
- ・資産のほぼ全額を株式(先物を含む)に投資しました。
- ・株式ポートフォリオはベンチマークである東証株価指数(TOPIX)の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

(ご参考)

組入上位10業種

期首 (2016年8月15日)

期末 (2017年2月14日)



(注) 比率は現物株式評価額に対する割合です。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

＜MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)＞

ベンチマークとのカイ離は1.1%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い運動性を維持しました。

	マザーファンド保有以外の要因			マザーファンド保有による要因	合計
	組入比率 要因	銘柄選択 要因	その他の 要因		
ベンチマークとのカイ離	0.1%程度	0.0%程度	1.0%程度	0.0%程度	1.1%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。

＜マザーファンド保有以外の要因＞

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.1%程度でした。

- ・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・期中における先物組入比率の平均は、5.9%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1.0%程度でした。

- ・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

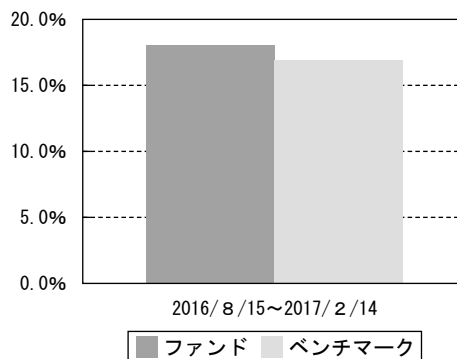
プラス要因	配当収入等	計	1.1%程度
マイナス要因	信託報酬等	計	△0.1%程度

＜マザーファンド保有による要因＞

マザーファンド保有による影響は0.0%程度でした。

- ・当ファンドは、資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に直接投資を行っていますが、安定的な運用を行うため、資産の一部をマザーファンドに投資しています。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



・ファンドの騰落率は分配金込みで計算していません。

<TOPIXマザーファンド>

ベンチマークは16.9%の上昇となったため、カイ離は1.2%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	1.2%程度	1.2%程度

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

◎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、1.1%程度となりました。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.2%程度でした。

- ・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

プラス要因	配当収入等	計	1.2%程度
マイナス要因	売買コスト等	計	△0.0%程度

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

分配金について

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

【分配原資の内訳】 (単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第7期
	2016年8月16日～2017年2月14日
当期分配金	74
(対基準価額比率)	0.562%
当期の収益	74
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	4,777

(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

<MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)>

- ・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。

<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。

○1万口当たりの費用明細

(2016年8月16日～2017年2月14日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	9	0.078	(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)	(6)	(0.050)	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)	(2)	(0.017)	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)	(1)	(0.011)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.002)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.001	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.001)	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
合 計	9	0.081	
期中の平均基準価額は、12,177円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

○売買及び取引の状況

(2016年8月16日～2017年2月14日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株	千円	千株	千円
		7,337 (△1,017)	10,462,231 ()	1,771	2,307,104

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円 5,082	百万円 5,473	百万円 -	百万円 -

○株式売買比率

(2016年8月16日～2017年2月14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	
	MUAM インデックスファンド TOPIX i (適格機関投資家限定)	TOPIXマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	12,769,335千円	168,752,346千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	24,263,154千円	273,387,490千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.52	0.61

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年8月16日～2017年2月14日)

利害関係人との取引状況

<MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定) >

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況 B	B A	%	うち利害関係人 との取引状況 D	D C	%
株式	百万円 10,462	百万円 31	0.3	百万円 2,307	百万円 34	1.5
株式先物取引	5,082	5,082	100.0	5,473	5,473	100.0

<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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
貸付有価証券(株式)	193,440	193,440	100.0	194,731	194,731	100.0

平均保有割合 0.0%

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

利害関係人の発行する有価証券等

<MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 264	百万円 61	百万円 860

<TOPIXマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 1,978	百万円 2,046	百万円 7,795

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

<MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)>

種 類	買 付 額
株式	百万円 0.3836

<TOPIXマザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 98

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)	485千円
うち利害関係人への支払額 (B)	452千円
(B) / (A)	93.1%

(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を含みます。

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UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱UFJリース、アコム、ジャックス、モルガン・スタンレーMUFJ証券、日立キャピタルです。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

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

○組入資産の明細

(2017年2月14日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
水産・農林業 (0.1%)				
極洋	5	0.6	1,680	
日本水産	13.4	20.8	11,876	
マルハニチロ	2.4	3	9,825	
カネコ種苗	0.4	0.5	720	
サカタのタネ	1.7	2.4	7,584	
ホクト	1.2	1.6	3,456	
ホクリヨウ	0.1	0.2	147	
鉱業 (0.4%)				
住石ホールディングス	3.4	4.4	431	
日鉄鉱業	3	0.4	2,392	
三井松島産業	8	1	1,542	
国際石油開発帝石	61.4	84.4	96,342	
日本海洋掘削	0.3	0.6	1,444	
石油資源開発	1.8	2.5	6,837	
K&Oエナジーグループ	0.8	1.1	2,016	
建設業 (2.9%)				
ショーボンドホールディングス	1.2	1.5	7,530	
ミライト・ホールディングス	3.6	4.9	5,159	
タマホーム	0.9	1.2	663	
サンヨーホームズ	0.2	0.3	195	
ファーストコーポレーション	—	0.3	276	
インベスターズクラウド	—	0.2	832	
ダイセキ環境ソリューション	0.3	0.4	662	
安藤・間	7.8	11.5	10,074	
東急建設	3.8	5.7	4,827	
コムシスホールディングス	5	6.3	12,744	
ミサワホーム	1.4	1.9	1,972	
ビーアールホールディングス	0.5	1.6	480	
高松コンストラクショングループ	0.9	1.2	3,140	
東建コーポレーション	0.5	0.6	4,812	
ソネック	0.1	0.2	129	
ヤマウラ	0.5	0.7	424	
大成建設	60	81	65,205	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
大林組	34.9	48	51,072	
清水建設	36	49	49,637	
飛鳥建設	9.3	15.4	2,695	
長谷工コーポレーション	13.6	18.7	23,505	
松井建設	1.3	1.8	1,868	
銭高組	2	2	844	
鹿島建設	55	70	51,520	
不動テトラ	8.2	12.9	2,631	
大末建設	0.4	0.6	592	
鉄建建設	7	10	3,380	
西松建設	13	19	11,039	
三井住友建設	44.6	61.4	7,613	
大豊建設	5	6	3,138	
前田建設工業	7	10	10,030	
佐田建設	0.8	1.1	463	
ナカノフドー建設	0.9	1.2	693	
奥村組	11	13	9,152	
東鉄工業	1.4	1.9	5,937	
イチケン	1	1	473	
浅沼組	4	5	1,820	
戸田建設	14	19	12,578	
熊谷組	17	25	7,800	
青木あすなろ建設	0.8	1	806	
北野建設	2	3	954	
植木組	1	2	516	
三井ホーム	1	2	1,180	
矢作建設工業	1.6	2.2	2,380	
ビーエス三菱	1.4	1.7	668	
日本ハウスホールディングス	2.4	3.3	1,689	
大東建託	4.3	5.9	94,282	
新日本建設	1.4	1.9	1,672	
N I P P O	3	4	8,508	
東亜道路工業	2	3	1,032	
前田道路	4	5	9,725	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
日本道路	3	5	2,385	
東亜建設工業	10	1.3	2,538	
若築建設	7	9	1,359	
東洋建設	3.7	4.6	1,932	
五洋建設	12.9	17.8	9,362	
大林道路	1.4	1.7	1,132	
世紀東急工業	1.8	2.3	1,175	
福田組	2	3	3,093	
住友林業	8	11	17,424	
日本基礎技術	1.3	1.8	651	
日成ビルド工業	3	5	2,710	
ヤマダ・エスバイエルホーム	6	8	640	
バコーボレーション	1.4	2	718	
バナホーム	4	6	6,168	
大和ハウス工業	34.4	47.3	147,386	
ライト工業	2.2	3.1	3,602	
積水ハウス	38.9	50.4	92,685	
日特建設	1.3	1.4	630	
北陸電気工事	0.6	0.8	701	
ユアテック	2	3	2,403	
西部電気工業	1	0.3	687	
四電工	1	1	418	
中電工	1.7	2	4,792	
関電工	5	6	5,550	
きんでん	7	10.6	15,507	
東京エネシス	1	2	1,938	
トーエネック	2	2	1,108	
住友電設	0.9	1.1	1,403	
日本電設工業	1.9	2.6	5,202	
協和エクシオ	4.6	6.3	9,872	
新日本空調	1	1.2	1,639	
NDS	2	0.3	873	
九電工	2.1	3.1	9,064	
三機工業	2.6	3.5	3,475	
日揮	11.7	14.9	29,978	
中外炉工業	4	5	1,135	
ヤマト	1	1.4	746	
太平電業	2	2	2,166	
高砂熱学工業	3.5	4.4	7,053	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
三晃金属工業	1	0.1	316	
朝日工業社	1	0.4	1,232	
明星工業	2.1	2.9	1,792	
大氣社	1.4	2.1	5,772	
ダイダン	2	2	1,882	
日比谷総合設備	1.4	1.8	3,097	
東芝プラントシステム	1.9	2.6	4,404	
OSJBホールディングス	2.4	4.9	1,244	
東洋エンジニアリング	6	9	2,457	
千代田化工建設	8	12	8,832	
新興ブランテック	2.4	3.3	2,989	
食料品 (4.3%)				
日本製粉	7	4.8	7,977	
日清製粉グループ本社	12.8	17.6	29,339	
日東富士製粉	1	0.1	390	
昭和産業	5	7	4,221	
鳥越製粉	0.9	1.3	1,032	
中部飼料	1.1	1.8	2,035	
フィード・ワン	7	9.6	1,670	
東洋精糖	2	2	232	
日本甜菜製糖	6	0.8	1,927	
三井製糖	5	1.1	2,842	
塩水港精糖	1.2	1.7	426	
日新製糖	0.5	0.7	1,222	
森永製菓	10	3.1	14,539	
中村屋	3	0.4	2,048	
江崎グリコ	2.7	4	20,800	
名糖産業	0.5	0.7	980	
不二家	7	9	2,052	
山崎製パン	8.5	11.7	26,477	
第一屋製パン	2	2	262	
モロゾフ	2	2	1,018	
亀田製菓	0.6	0.9	4,482	
寿スピリッツ	0.8	1.1	2,908	
カルビー	4.3	6.5	23,855	
森永乳業	10	14	10,262	
六甲バター	0.5	0.7	1,685	
ヤクルト本社	6.2	8.6	52,890	
明治ホールディングス	6.9	9.5	83,695	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
雪印メグミルク	2.7	3.5	10,290
ブリマハム	7	10	4,340
日本ハム	9	11	33,605
林兼産業	4	0.5	439
丸大食品	6	8	3,936
S Foods	0.7	0.9	2,907
伊藤ハム米久ホールディングス	7	9.2	9,807
サッポロホールディングス	3.8	5.2	14,638
アサヒグループホールディングス	21.9	30	117,660
キリンホールディングス	50.1	69	125,545
宝ホールディングス	8.4	11.6	12,620
オエノンホールディングス	3	4	1,064
養命酒製造	0.4	0.5	927
コカ・コーラウエスト	3.9	5.4	16,821
コカ・コーライーストジャパン	4.5	6.2	14,421
サントリー食品インターナショナル	8	11	49,775
ダイドールグループホールディングス	0.6	0.7	3,920
伊藤園	3.5	4.8	17,856
キーコーヒー	1	1.4	3,017
ユニカフェ	0.3	0.4	394
ジャパンフーズ	0.1	0.2	268
日清オイリオグループ	6	9	4,941
不二製油グループ本社	3.1	4.3	9,971
かどや製油	0.1	0.2	965
J-オイルミルズ	5	0.7	2,810
キッコーマン	9	11	37,290
味の素	24.5	33	74,844
キューピー	5.9	8.1	23,749
ハウス食品グループ本社	4	5.9	14,142
カゴメ	4.2	5.7	16,455
焼津水産化学工業	0.5	0.8	984
アリアケジャパン	1	1.3	8,112
ピエトロ	0.1	0.2	330
エバラ食品工業	0.3	0.4	832
ニチレイ	12	7.9	20,113
東洋水産	5.7	7.9	30,928
イートアンド	0.1	0.2	451
大冷	—	0.1	178
日清食品ホールディングス	4.9	6.3	37,737

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
永谷園ホールディングス	1	2	2,856
一正蒲鉾	0.4	0.6	700
フジッコ	1.1	1.6	3,905
ロック・フィールド	1.2	1.5	2,514
日本たばこ産業	64.5	88.8	330,957
ケンコーマヨネーズ	0.4	0.6	1,645
わらべや日洋ホールディングス	0.6	0.9	2,256
なとり	0.6	0.8	1,484
北の達人コーポレーション	0.2	0.3	182
ユーグレナ	3.7	5.2	6,536
ミヨシ油脂	4	5	705
理研ビタミン	0.3	0.5	2,157
繊維製品 (0.7%)			
片倉工業	1.4	1.9	2,593
グンゼ	9	11	4,664
東洋紡	43	59	11,446
ユニチカ	32	41	3,649
富士紡ホールディングス	5	0.7	2,282
倉敷紡績	11	15	3,510
シキボウ	7	8	1,208
日本毛織	3.1	4.2	3,784
ダイトウボウ	2	2	146
トーア紡コーポレーション	0.5	0.6	328
ダイドーリミテッド	1.2	1.7	751
帝国繊維	1.1	1.6	2,636
帝人	44	12.2	25,949
東レ	79	109	106,776
サカイオーベックス	3	0.4	750
住江織物	3	4	1,104
日本フェルト	0.6	0.9	469
イチカワ	1	1	297
日東製網	1	0.2	380
芦森工業	2	—	—
アツギ	8	12	1,524
ダイニック	2	3	576
セーレン	2.7	3.7	5,953
ソトー	0.4	0.6	702
東海染工	2	2	288
小松精練	1.7	2.1	1,530

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ワコールホールディングス	6	9	12,816	
ホギメディカル	0.7	0.9	6,003	
レナウン	2.9	4	456	
クラウドピア	0.3	0.3	163	
T S I ホールディングス	4.9	6.2	5,139	
三陽商会	6	8	1,424	
ナイガイ	4	5	325	
オンワードホールディングス	7	10	8,520	
ルック	2	3	570	
キムラタン	46	63	441	
ゴールドウイン	0.5	0.6	3,390	
デサント	2.5	3.4	4,161	
キング	0.5	0.7	289	
ヤマトインターナショナル	0.7	0.9	369	
パルプ・紙 (0.3%)				
特種東海製紙	6	0.9	3,793	
王子ホールディングス	43	59	30,562	
日本製紙	5.6	6.7	13,440	
三菱製紙	17	2.1	1,621	
北越紀州製紙	6.8	8.4	6,224	
中越パルプ工業	4	6	1,440	
巴川製紙所	2	2	490	
大玉製紙	4.8	6	7,710	
阿波製紙	—	0.3	179	
レンゾー	10	14.4	9,489	
トーモク	3	5	1,665	
ザ・バック	0.8	1.1	3,360	
化学 (6.7%)				
クラレ	18.3	25.2	42,361	
旭化成	68	93	101,556	
共和レザー	0.7	0.9	818	
昭和電工	7.2	10	19,490	
住友化学	80	110	68,640	
日本化成	2	—	—	
住友精化	2	0.6	2,925	
日産化学工業	6.5	8.2	32,185	
ラサ工業	4	6	852	
クレハ	8	1.1	5,483	
多木化学	1	1	935	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
テイカ	2	2	1,452	
石原産業	20	2.7	2,813	
片倉コープアグリ	1	2	480	
日東エフシー	0.6	0.9	847	
日本曹達	7	9	5,886	
東ソー	29	43	40,936	
トクヤマ	18	23	12,811	
セントラル硝子	12	15	7,995	
東亜合成	6.8	9.4	12,079	
大阪ソーダ	5	6	2,970	
関東電化工業	3	3	3,399	
デンカ	23	31	18,848	
信越化学工業	19.5	26.8	258,218	
日本カーバイド工業	4	5	805	
堺化学工業	4	6	2,472	
エア・ウォーター	9	12.3	26,937	
大陽日酸	8.4	11.5	16,468	
日本化学工業	4	6	1,440	
日本パーカライジング	5.6	7.7	11,134	
高圧ガス工業	2	2.2	1,689	
チタン工業	1	2	386	
四国化成工業	2	2	2,278	
戸田工業	2	3	849	
ステラ ケミファ	0.6	0.7	2,593	
保土谷化学工業	3	0.5	1,817	
日本触媒	1.6	2.4	18,576	
大日精化工業	4	6	4,428	
カネカ	15	20	18,060	
三菱瓦斯化学	19	13.9	32,720	
三井化学	46	68	35,360	
J S R	10.2	15	30,750	
東京応化工業	2.2	2.8	10,570	
大阪有機化学工業	0.7	1	947	
三菱ケミカルホールディングス	72.9	100.9	82,970	
KHネオケム	—	1.8	2,471	
日本合成化学工業	3	—	—	
ダイセル	14.7	20.2	27,512	
住友ベークライト	10	13	8,866	
積水化学工業	24.7	34	63,648	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本ゼオン	9	13	17,186
アイカ工業	3.3	4.8	14,116
宇部興産	58	75	20,475
積水樹脂	1.7	2.3	4,257
タキロン	3	3	1,617
旭有機材	4	5	1,195
日立化成	5.4	8.3	27,182
ニチバン	1	1	969
リケンテクノス	2.3	3.2	1,747
大倉工業	3	4	2,184
積水化成成品工業	3	2.1	1,738
群栄化学工業	3	0.4	1,420
タイガースポリマー	0.5	0.7	592
ミライアル	0.4	0.5	460
ダイキアクシス	0.2	0.2	256
ダイキョーニシカワ	1.4	2.6	3,673
日本化薬	7	10	15,670
カーリットホールディングス	1	1.4	809
日本精化	0.9	1.2	1,130
扶桑化学工業	0.7	1.1	3,421
ADEKA	5.4	6.4	9,990
日油	8	12	15,360
新日本理化	1.7	2.4	360
ハリマ化成グループ	0.9	1.3	1,049
花王	27.7	38	214,890
第一工業製薬	2	3	1,347
日華化学	—	0.5	615
ニイタカ	0.2	0.2	289
三洋化成工業	3	0.9	4,405
有機合成薬品工業	—	1	274
大日本塗料	6	9	2,106
日本ペイントホールディングス	8.4	11.6	41,296
関西ペイント	12.3	15.7	34,932
神東塗料	1	1	220
中国塗料	3	4.3	3,753
日本特殊塗料	0.8	1	1,751
藤倉化成	1.5	2	1,334
太陽ホールディングス	0.8	1.2	5,688
D I C	4.3	5.9	21,387

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サカタインクス	2.2	3.1	4,702
東洋インキSCホールディングス	11	15	8,385
T&K TOKA	0.8	1.1	1,203
富士フィルムホールディングス	24.9	29.7	129,224
資生堂	20.7	28.4	81,706
ライオン	14	19	36,252
高砂香料工業	0.7	1	3,570
マンダム	1	1.5	7,800
ミルボン	0.6	0.8	4,200
ファンケル	2.5	3.2	5,158
コーセー	1.8	2.4	21,936
コタ	0.4	0.6	784
シーズ・ホールディングス	1.4	1.9	6,203
シーボン	0.1	0.2	510
ポーラ・オルビスホールディングス	1.1	1.5	15,585
ノエビアホールディングス	0.7	0.9	3,681
アジュバンコスメジャパン	0.2	0.3	291
エステー	0.7	1	1,781
アグロ カネショウ	0.4	0.6	757
コニン	1.7	2.3	3,114
長谷川香料	1.4	1.9	3,743
星光PMC	0.6	0.8	934
小林製薬	3.3	4.2	21,798
荒川化学工業	0.9	1.3	2,533
メック	0.8	1.2	1,351
日本高純度化学	0.3	0.4	982
タカラバイオ	2.3	3.2	4,915
J C U	0.3	0.5	3,410
新田ゼラチン	0.7	0.9	673
OATアグリオ	0.1	0.2	292
デクセリアルズ	3.3	3.9	5,070
アース製薬	0.8	1.1	5,461
イハラケミカル工業	1.5	2.1	2,173
北興化学工業	1	1	478
大成ラミック	0.3	0.4	1,258
クミアイ化学工業	2.2	3.1	2,073
日本農薬	2.5	3.4	2,250
アキレス	9	1.2	2,145
有沢製作所	1.6	2.5	1,842

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日東電工	8.4	10.8	103,809
レック	0.3	0.5	2,330
きもと	1.8	2.7	658
藤森工業	0.9	1.1	3,300
前澤化成工業	0.8	1	1,197
J S P	0.7	0.7	1,823
エフピコ	1	1.3	6,786
天馬	0.8	1	2,169
信越ポリマー	2.1	2.9	2,470
東リ	3	3.6	1,432
ニフコ	2.1	2.6	14,508
日本バルカー工業	4	1.2	2,191
ユニ・チャーム	22	30.3	76,962
医薬品 (4.8%)			
協和発酵キリン	13	17.9	28,747
武田薬品工業	43.4	56.1	289,980
アステラス製薬	118.2	152.9	233,937
大日本住友製薬	7.7	10.6	20,574
塩野義製薬	15.9	20.3	109,823
田辺三菱製薬	12.7	17.4	40,107
わかもと製薬	1	2	506
あすか製薬	1.4	1.6	2,737
日本新薬	2.5	3.4	20,332
バイオフェルミン製薬	0.2	0.2	604
中外製薬	10.8	14.9	56,098
科研製薬	1.9	2.8	16,128
エーザイ	13.4	18.4	113,748
ロート製薬	5.3	7.3	15,527
小野薬品工業	24.7	34	85,153
久光製薬	3.4	4.2	25,200
有機合成薬品工業	1	—	—
持田製薬	0.7	1	8,280
参天製薬	20.1	27	43,767
扶桑薬品工業	4	0.5	1,430
日本ケミファ	2	0.2	1,114
ツムラ	3.4	5	16,300
日医工	2.5	3.5	6,037
キッセイ薬品工業	1.9	2.7	7,597
生化学工業	2	2.8	4,807

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
栄研化学	0.9	1.3	3,881
日水製薬	0.4	0.6	798
鳥居薬品	0.7	1	2,793
J C R ファーマ	0.8	1.2	3,369
東和薬品	0.5	0.7	3,377
富士製薬工業	0.4	0.5	1,540
沢井製薬	1.8	2.5	14,950
ゼリア新薬工業	2.2	3.1	5,242
第一三共	36.6	44	113,608
キョーリン製薬ホールディングス	2.9	3.7	8,558
大幸薬品	0.5	0.7	1,231
ダイト	0.6	0.9	2,005
大塚ホールディングス	23.4	32.2	170,563
大正製薬ホールディングス	2.6	3.2	29,568
ペプチドリーム	1.8	2.8	15,904
石油・石炭製品 (0.6%)			
日本コークス工業	8.8	12.1	1,246
昭和シェル石油	9.7	13.4	14,847
ニチレキ	1.3	1.8	1,594
東燃ゼネラル石油	18	24	32,112
ユシロ化学工業	0.6	0.8	1,158
ビービー・カストロール	0.4	0.6	1,060
富士石油	2.5	3.5	1,358
MORESCO	0.3	0.5	868
出光興産	5.7	7.1	24,885
J Xホールディングス	128.9	166.1	88,863
コスモエネルギーホールディングス	3.3	4.5	8,833
ゴム製品 (0.9%)			
横浜ゴム	6.6	9	19,260
東洋ゴム工業	5.7	7.9	10,593
ブリヂストン	36.7	50.5	215,635
住友ゴム工業	10.2	14	26,446
藤倉ゴム工業	0.9	1.2	829
オカモト	3	5	5,475
フコク	0.4	0.6	559
ニッタ	1.2	1.3	3,945
住友理工	2.4	2.8	3,248
三ツ星ベルト	3	4	4,040
バンドー化学	4	2.7	2,821

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ガラス・土石製品 (1.0%)				
日東紡織	7	12	5,928	
旭硝子	54	74	67,488	
日本板硝子	52	6.8	5,739	
石塚硝子	2	2	516	
日本山村硝子	4	6	1,254	
日本電気硝子	22	31	21,669	
オハラ	0.4	0.6	630	
住友大阪セメント	22	28	12,712	
太平洋セメント	69.375	90	38,070	
日本ヒューム	1	1.4	1,001	
日本コンクリート工業	2.2	3.3	1,151	
三谷セキサン	0.5	0.7	1,843	
アジアパイルホールディングス	1.3	1.8	1,040	
東海カーボン	10	14	6,818	
日本カーボン	5	7	2,128	
東洋炭素	0.6	0.8	1,561	
ノリタケカンパニーリミテド	6	0.8	2,328	
TOTO	8	11	46,145	
日本碍子	13.7	18.9	45,832	
日本特殊陶業	9.4	12.9	33,024	
ダントーホールディングス	1	1	192	
MARUWA	0.4	0.5	1,920	
品川リフラクトリーズ	3	4	1,160	
黒崎播磨	2	3	1,311	
ヨータイ	1	1	391	
イソライト工業	0.5	0.7	301	
東京窯業	1.3	1.8	372	
ニッカトー	0.4	0.5	212	
フジミインコーポレーテッド	0.9	1.3	3,473	
エーアンドエーマテリアル	2	3	396	
ニチアス	6	8	8,944	
ニチハ	1.4	2	6,250	
鉄鋼 (1.4%)				
新日鐵住金	49.1	67.5	189,843	
神戸製鋼所	200	25.9	29,189	
中山製鋼所	12	1.7	1,346	
合同製鐵	6	0.8	1,520	
ジェイ エフ イー ホールディングス	29.7	40.9	88,528	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日新製鋼	5	6.8	10,723	
東京製鐵	6	7.6	8,132	
共英製鋼	1.2	1.6	3,518	
大和工業	2.4	3	10,290	
東京鐵鋼	2	3	1,419	
大阪製鐵	0.7	0.9	2,017	
淀川製鋼所	1.6	2.1	7,150	
東洋鋼板	2.6	3.6	1,659	
丸一鋼管	3.6	5	18,150	
モリ工業	2	0.5	1,178	
大同特殊鋼	18	25	14,300	
日本高周波鋼業	4	5	430	
日本冶金工業	8	12.4	2,914	
山陽特殊製鋼	6	9	5,607	
愛知製鋼	6	0.9	4,414	
日立金属	12.5	15.2	25,247	
日本金属	3	0.4	530	
大平洋金属	8	10	4,000	
新日本電工	6.2	8.5	2,737	
栗本鐵工所	5	0.7	1,717	
虹技	2	2	508	
日本鑄鉄管	1	1	203	
三菱製鋼	8	10	2,580	
日亜鋼業	1.5	2.1	590	
日本精線	1	1	619	
シンニッタン	1	1.2	868	
新家工業	2	3	516	
非鉄金属 (1.0%)				
大紀アルミニウム工業所	2	3	1,578	
日本軽金属ホールディングス	24.6	36.5	10,366	
三井金属鉱業	28	41	15,211	
東邦亜鉛	6	8	4,992	
三菱マテリアル	68	9.3	35,758	
住友金属鉱山	30	39	63,999	
DOWAホールディングス	14	17	16,728	
古河機械金属	17	23	5,405	
エス・サイエンス	4.9	6.8	258	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1.1	1.6	3,107	
東邦チタニウム	1.8	2.5	2,312	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
UACJ	15	19	6,080
古河電気工業	34	5	20,325
住友電気工業	43.6	56.4	105,355
フジクラ	15	19.7	16,607
昭和電線ホールディングス	13	18	1,656
東京特殊電線	0.2	0.2	313
タツタ電線	2.3	2.8	1,285
沖電線	1	2	506
カナレ電気	0.2	0.2	452
平河ヒューテック	0.5	0.7	792
リョービ	7	9	4,509
アーレスティ	1.3	1.7	1,938
アサヒホールディングス	1.6	2.3	4,586
金属製品 (0.7%)			
稲葉製作所	0.6	0.8	1,064
宮地エンジニアリンググループ	3	4	888
トーカロ	0.8	1	2,753
アルファCo	0.4	0.5	660
SUMCO	11.4	15.6	27,456
川田テクノロジーズ	0.2	0.3	2,421
RS Technologies	—	0.1	456
東洋製織グループホールディングス	7.7	10.6	22,366
ホッカンホールディングス	3	4	2,176
コロナ	0.6	0.8	943
横河ブリッジホールディングス	2.1	2.6	3,608
駒井ハルテック	2	0.3	646
高田機工	1	1	241
三和ホールディングス	10.8	14.8	15,924
文化シャッター	3	4.2	3,595
三協立山	1.4	2	3,436
アルインコ	0.8	1	1,035
東洋シャッター	0.3	0.4	255
LIXILグループ	15.2	20.8	56,513
日本フィルコン	0.8	1.1	623
ノーリツ	2.1	2.9	6,052
長府製作所	1.2	1.6	4,192
リンナイ	2	2.5	22,250
ダイニチ工業	0.6	0.8	582
日東精工	2	2.1	900

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三洋工業	1	2	396
岡部	2.3	3.1	2,988
ジーテクト	1.1	1.6	3,451
中国工業	0.2	0.2	139
東ブレ	2.1	2.9	8,189
高周波熱練	2	2.8	2,643
東京製網	7	1	1,792
サンコール	0.6	0.8	451
モリテック スチール	0.5	0.8	236
パイオラックス	0.5	0.8	6,464
日本発條	10.2	14.1	18,062
中央発條	1	2	674
アドパネクス	0.2	0.3	573
立川ブラインド工業	0.5	0.6	542
三益半導体工業	0.8	1.3	2,314
機械 (5.1%)			
日本ドライケミカル	0.1	0.2	456
日本製鋼所	18	4.9	10,108
三浦工業	4.9	6.1	10,827
タクマ	4	4.8	4,843
ツガミ	3	4	2,764
オークマ	7	10	11,930
東芝機械	6	9	4,392
アマダホールディングス	15.9	20.1	26,130
アイダエンジニアリング	2.9	4.2	4,716
滝澤鉄工所	3	4	692
富士機械製造	3.6	4.6	7,051
牧野フライス製作所	5	7	7,329
オーエスジー	5	6.8	16,163
ダイジェット工業	1	2	362
旭ダイヤモンド工業	2.9	4.3	3,930
DMG森精機	6.4	8.8	14,044
ソディック	2.8	3.8	4,005
ディスコ	1.4	1.8	30,456
日東工器	0.6	0.9	2,264
パンチ工業	0.4	0.5	509
豊和工業	0.6	0.8	540
OKK	4	5	635
石川製作所	3	0.4	313

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東洋機械金属	0.8	1	575	
津田駒工業	2	3	546	
エンシュウ	3	4	388	
島精機製作所	1.5	1.9	7,438	
NCホールディングス	0.4	0.5	467	
フリー	0.2	0.3	1,423	
ヤマシンフィルタ	0.2	0.3	515	
日阪製作所	1.4	2	1,804	
やまびこ	2	2.7	4,166	
ベガサスミシン製造	1.1	1.4	1,118	
ナブテスコ	5.7	7.8	24,804	
三井海洋開発	1.1	1.5	3,778	
レオン自動車	0.9	1.3	1,487	
SMC	3.3	4.5	142,020	
新川	1	1.2	982	
ホソカワミクロン	2	2	1,682	
ユニオンツール	0.5	0.6	2,031	
オイレス工業	1.4	1.9	3,891	
日精エー・エス・ビー機械	0.3	0.5	1,183	
サトーホールディングス	1.5	1.9	4,824	
日本エアータック	0.4	0.5	329	
日精樹脂工業	0.8	1.2	1,298	
オカダアイヨン	0.2	0.3	344	
ワイエイシイ	0.4	0.6	798	
小松製作所	53.3	69	194,131	
住友重機械工業	32	44	35,552	
日立建機	4.9	6.7	17,929	
日工	2	0.4	832	
巴工業	0.4	0.6	1,156	
井関農機	11	15	3,465	
TOWA	1	1.2	2,301	
丸山製作所	2	3	585	
北川鉄工所	5	0.7	1,715	
ローツェ	—	0.5	1,108	
タカキタ	0.4	0.5	281	
クボタ	52.2	71.6	131,994	
荏原実業	0.3	0.4	544	
三菱化工機	4	5	1,105	
月島機械	2.1	2.8	3,617	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
帝国電機製作所	0.8	1.1	1,152	
東京機械製作所	4	6	456	
新東工業	2.5	3.4	3,604	
澁谷工業	0.9	1.2	3,355	
アイチ コーポレーション	1.5	2.1	1,879	
小森コーポレーション	2.6	3.6	5,486	
鶴見製作所	0.8	1.1	1,677	
住友精密工業	2	2	710	
酒井重工業	2	3	1,020	
荏原製作所	24	6.8	22,508	
石井鐵工所	2	0.2	354	
西島製作所	1.2	1.5	1,695	
北越工業	1.2	1.6	1,449	
ダイキン工業	15.1	19.5	210,307	
オルガノ	2	3	1,524	
トーヨーカネツ	5	7	2,443	
栗田工業	6.5	8.5	23,332	
椿本チエイン	6	8	7,576	
大同工業	2	3	831	
木村化工機	0.9	1.3	445	
アネスト岩田	1.8	2.6	2,802	
ダイフク	5.6	7.1	18,680	
サムコ	0.3	0.4	439	
加藤製作所	2	0.8	2,250	
油研工業	2	3	672	
タダノ	5	7.5	10,807	
フジテック	3	4.2	5,493	
CKD	2.9	4.3	6,342	
キトー	1.3	1.8	2,223	
平和	3.2	4.4	12,443	
理想科学工業	1.1	1.4	2,947	
SANKYO	2.9	4	15,920	
日本金銭機械	1	1.3	2,000	
マースエンジニアリング	0.6	0.8	1,838	
福島工業	0.6	0.9	3,321	
オーイズミ	0.4	0.6	420	
ダイコク電機	0.4	0.6	1,038	
竹内製作所	2.1	2.6	6,076	
アマノ	3.2	4.4	9,785	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
JUKI	1.6	2.3	2,971	
サンデンホールディングス	6	9	3,276	
蛇の目マシン工業	1	1.4	1,128	
マックス	2	2	3,136	
グローリー	3.5	4.6	17,457	
新晃工業	0.7	1	1,394	
大和冷機工業	1.7	2.3	2,320	
セガサミーホールディングス	11.2	14.2	24,551	
日本ビストンリング	0.4	0.6	1,408	
リケン	5	0.7	3,062	
TPR	1.3	1.6	5,384	
ツバキ・ナカシマ	1.2	1.6	3,118	
ホシザキ	2.3	3.1	26,474	
大豊工業	0.8	1.2	1,851	
日本精工	21.3	29.4	45,099	
NTN	26	33	17,589	
ジェイテクト	11.1	15.2	28,120	
不二越	10	14	8,246	
日本トムソン	3.6	4.6	2,580	
THK	6.9	10.1	29,966	
ユースン精機	0.4	0.6	1,872	
前澤給装工業	0.4	0.5	759	
イーグル工業	1.3	1.5	2,268	
前澤工業	0.8	1	329	
日本ビラー工業	1.1	1.4	2,091	
キッツ	4.6	6.9	4,581	
日立工機	2.8	3.8	3,298	
マキタ	6.8	9.3	71,889	
日立造船	8.2	11.3	7,085	
三菱重工業	185	240	109,464	
IHI	80	110	37,180	
スター精密	—	2.5	4,255	
電気機器 (12.6%)				
日清紡ホールディングス	5.8	7.9	8,792	
イビデン	6.4	10	19,250	
コニカミノルタ	26	33.5	36,950	
ブラザー工業	13.4	18.5	36,593	
ミネベアミツミ	16.7	26	36,764	
日立製作所	265	343	217,016	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東芝	219	320	73,536	
三菱電機	111	152.5	255,666	
富士電機	31	43	27,864	
東洋電機製造	2	0.6	1,023	
安川電機	12.9	16.6	35,225	
シンフォニアテクノロジー	7	9	2,835	
明電舎	10	13	4,875	
オリジン電気	2	2	630	
山洋電気	3	4	3,496	
デンヨー	1	1.3	2,371	
東芝テック	7	9	5,706	
芝浦メカトロニクス	2	2	578	
マブチモーター	2.9	4	24,200	
日本電産	12.5	18.5	196,007	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	0.1	0.2	591	
東光高岳	0.6	0.7	1,526	
ダブル・スコープ	1	1.4	2,674	
宮越ホールディングス	0.4	0.5	252	
ダイヘン	6	8	5,704	
田淵電機	1.2	2.2	759	
ヤーマン	0.1	0.2	1,234	
JVCケンウッド	7.6	10.5	3,160	
ミマキエン지니어リング	0.9	1.3	1,040	
第一精工	0.5	0.6	942	
日新電機	2.4	2.9	3,981	
大崎電気工業	2	3	3,213	
オムロン	11.7	15.2	75,088	
日東工業	1.7	2.1	3,234	
I D E C	1.4	1.9	2,141	
不二電機工業	0.1	0.2	283	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	20	28	13,664	
サクサホールディングス	3	4	928	
メルコホールディングス	0.6	0.8	2,696	
テクノメディカ	0.2	0.3	651	
日本電気	143	197	53,190	
富士通	100	138	89,410	
沖電気工業	45	6.2	9,827	
岩崎通信機	5	6	540	
電気興業	3	4	2,308	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
サンケン電気	6	8	4,136	
ナカヨ	1	1	416	
アイホン	0.6	0.8	1,478	
ルネサスエレクトロニクス	5.4	7.4	7,829	
セイコーエプソン	15.5	21.3	53,782	
ワコム	8.1	11.1	4,417	
アルバック	1.9	2.4	11,388	
アクセル	0.5	0.6	501	
E I Z O	1	1.4	4,599	
ジャパンディスプレイ	19.4	26.7	8,196	
日本信号	2.9	3.9	4,317	
京三製作所	2	3	1,206	
能美防災	1.2	1.6	2,417	
ホーチキ	0.8	1	1,424	
エレコム	0.9	1.2	2,418	
日本無線	3	0.9	1,242	
パナソニック	118.8	163.3	201,757	
アンリツ	6.2	10.4	8,964	
富士通ゼネラル	3	5	10,910	
日立国際電気	2.4	3.7	9,375	
ソニー	73.3	100.9	360,414	
TDK	6.3	8.1	62,856	
帝国通信工業	2	3	552	
ミツミ電機	4	—	—	
タムラ製作所	4	6	2,712	
アルプス電気	9	13.2	44,880	
池上通信機	3	5	780	
パイオニア	16.8	21.5	5,181	
日本電波工業	0.9	1.4	1,178	
鈴木	0.4	0.5	289	
日本トリム	0.3	0.3	1,216	
ローランド ディー. ジー.	0.5	0.7	2,460	
フォスター電機	1.3	1.7	3,206	
クラリオン	5	8	3,488	
SMK	3	4	1,684	
ヨコオ	0.7	1	1,354	
ティアック	7	10	460	
ホシデン	3.1	4.3	4,325	
ヒロセ電機	1.7	2.3	34,086	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本航空電子工業	3	4	5,992	
TOA	1.2	1.7	1,771	
日立マクセル	1.7	2.1	4,720	
古野電気	1.2	1.8	1,378	
ユニデンホールディングス	3	4	684	
アルパイン	2.5	3.4	5,888	
スミダコーポレーション	0.9	1.2	1,478	
アイコム	0.6	0.8	1,890	
リオン	0.4	0.5	788	
本多通信工業	0.3	0.5	646	
船井電機	1	1.6	1,480	
横河電機	10.4	15.5	26,551	
新元元工業	4	6	2,826	
アズビル	3.4	4.3	15,265	
東亜ディーケーケー	0.6	0.7	388	
日本光電工業	4.3	6	15,264	
チノー	0.4	0.5	604	
共和電業	1.2	1.6	715	
日本電子材料	0.4	0.6	379	
堀場製作所	2.1	2.8	16,660	
アドバンテスト	7.1	9.7	20,059	
小野測器	0.5	0.7	620	
エスバック	1.1	1.3	1,699	
パナソニック デバイスSUNX	0.9	1.3	1,084	
キーエンス	2.4	6.5	283,400	
日置電機	0.5	0.7	1,528	
シスメックス	8.1	11.1	70,929	
日本マイクロニクス	1.9	2.7	2,486	
メガチップス	1	1.3	3,695	
OBARA GROUP	0.6	0.8	4,024	
澤藤電機	1	1	226	
コーセル	1.4	2	2,744	
イリソ電子工業	0.3	0.5	3,595	
新日本無線	0.8	1.2	492	
オプテックスグループ	0.8	1.1	3,260	
千代田インテグレ	0.5	0.8	1,939	
アイ・オー・データ機器	0.3	0.4	494	
レーザーテック	1.2	1.6	4,452	
スタンレー電気	7.4	10.2	32,028	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
岩崎電気	4	5		880
ウシオ電機	6.3	8.7	12,536	
岡谷電機産業	0.6	0.8		333
ヘリオス テクノ ホールディング	0.9	1.3		776
日本セラミック	0.8	1.2	2,659	
遠藤照明	0.5	0.7		652
日本デジタル研究所	0.9	—	—	
古河電池	1	1		739
双信電機	0.5	0.7		205
山一電機	0.9	1.3	1,775	
図研	0.8	0.9	1,113	
日本電子	4	5	2,730	
カシオ計算機	10.4	11.5	17,480	
ファナック	10.5	14.5	323,060	
日本シイエムケイ	2.2	3.1	1,962	
エンプラス	0.5	0.6	2,091	
大真空	2	0.5	743	
ローム	5	6.9	52,854	
浜松ホトニクス	8.1	11.2	38,136	
三井ハイテック	1.5	1.9	1,691	
新光電気工業	3.9	5.4	4,206	
京セラ	17.1	23.5	146,123	
太陽誘電	5.1	7	10,542	
村田製作所	11	15	237,375	
ユーシン	1.4	1.9	1,520	
双葉電子工業	1.7	2.3	4,583	
北陸電気工業	4	6	840	
ニチコン	3.3	4.5	4,585	
日本ケミコン	8	12	3,648	
KOA	1.4	2	2,710	
市光工業	2	3	1,599	
小糸製作所	6.2	8.6	49,880	
ミツバ	1.8	2.6	5,878	
スター精密	2	—	—	
SCREENホールディングス	11	2.9	22,446	
キャノン電子	1	1.3	2,298	
キャノン	56	76.9	253,001	
リコー	33.7	43	43,000	
MUTOHホールディングス	1	2	532	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東京エレクトロン	8.5	9.5	110,770	
輸送用機器 (9.4%)				
トヨタ紡織	3.6	5	11,850	
芦森工業	—	3	507	
鬼怒川ゴム工業	2	—	—	
ユニプレス	2.2	2.8	6,487	
豊田自動織機	9.5	13	70,460	
モリタホールディングス	1.8	2.5	3,945	
三櫻工業	1.3	1.8	1,548	
デンソー	25.7	35.2	177,619	
東海理化電機製作所	3	3.8	8,417	
三井造船	40	52	9,152	
川崎重工業	81	111	40,515	
名村造船所	3.1	4.3	3,487	
サノヤスホールディングス	1.3	1.7	477	
日本車輛製造	4	5	1,500	
ニチユ三菱フォークリフト	1.2	1.6	1,148	
近畿車輛	2	0.2	535	
日産自動車	141.7	168.6	188,326	
いすゞ自動車	30.1	41.4	63,362	
トヨタ自動車	132.546	173.8	1,121,705	
日野自動車	14.8	20.4	27,234	
三菱自動車工業	41.3	52.4	35,684	
エフテック	0.5	0.8	1,053	
レシップホールディングス	0.3	0.5	434	
GMB	0.2	0.2	250	
ファルテック	0.2	0.2	282	
武蔵精密工業	1.1	1.7	5,346	
日産車体	5.1	6.3	6,961	
新明和工業	5	6	7,260	
極東開発工業	2.1	2.8	4,894	
日信工業	2.3	3.2	6,390	
トビー工業	9	1.2	3,948	
ティラド	4	6	1,848	
曙ブレーキ工業	5.3	6.6	1,775	
タチエス	1.6	2.4	4,927	
NOK	5	6.9	17,553	
フタバ産業	3.2	4.4	3,304	
KYB	12	16	9,824	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
大同メタル工業	1.5	1.8	1,872	
プレス工業	5.5	7.6	4,172	
ミクニ	1.3	1.8	779	
カルソニックカンセイ	8	10	18,100	
太平洋工業	2.3	2.9	4,112	
ケーヒン	2.4	3.3	6,415	
河西工業	1.3	1.9	2,595	
アイシン精機	10.7	13.1	72,574	
富士機工	1.2	1.4	715	
マツダ	32.9	45.3	71,732	
今仙電機製作所	1	1.3	1,297	
本田技研工業	93.5	128.6	462,960	
スズキ	19	28.3	126,189	
富士重工業	32.8	44.4	193,362	
安永	0.3	0.5	901	
ヤマハ発動機	14.7	20.2	51,691	
ショーワ	2.7	3.7	3,526	
T B K	1.2	1.8	979	
エクセディ	1.4	1.9	6,013	
豊田合成	3.8	4.6	12,889	
愛三工業	1.8	2.5	2,375	
盟和産業	0.2	0.2	238	
ヨロズ	1	1.3	2,202	
エフ・シー・シー	1.7	2.3	5,216	
シマノ	4.2	5.8	102,312	
タカタ	1.9	2.6	1,443	
テイ・エス テック	2.4	3.3	9,533	
ジャムコ	0.6	0.8	2,144	
精密機器 (1.5%)				
テルモ	15.9	21.9	85,848	
クリエートメディック	0.3	0.5	472	
日機装	3.7	4.9	5,331	
島津製作所	13	18.4	34,224	
JMS	2	3	984	
クボテック	0.2	0.3	169	
長野計器	0.6	1.1	773	
ブイ・テクノロジー	0.2	0.3	5,199	
東京計器	3	5	1,245	
愛知時計電機	1	0.2	738	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
オーバル	1	1.4	385	
東京精密	2	2.8	10,766	
マニー	1.4	1.9	5,226	
ニコン	19.4	24.9	40,039	
トプコン	3.5	7.2	14,529	
オリンパス	15.5	22.8	91,086	
理研計器	0.8	1.3	2,143	
タムロン	0.9	1.3	2,723	
HOYA	23.5	29.4	148,352	
ノーリツ鋼機	0.9	1.4	1,402	
エー・アンド・デイ	0.9	1.3	612	
シチズン時計	12.8	15.6	10,920	
リズム時計工業	5	6	1,122	
大研医器	0.8	1.3	1,040	
メニコン	0.7	1	3,475	
松風	0.5	0.8	1,092	
セイコーホールディングス	7	10	4,190	
ニプロ	7.7	9.9	13,632	
その他製品 (1.7%)				
スノーピーク	0.2	0.2	571	
パラマウントベッドホールディングス	1.1	1.4	5,845	
トランザクション	0.2	0.3	559	
SHO-B I	0.3	0.5	221	
ニホンフラッシュ	0.4	0.7	887	
前田工織	1	1.4	1,842	
永大産業	1	2	1,040	
アートネイチャー	1.1	1.5	1,116	
ダンロップスポーツ	0.7	0.9	969	
バンダイナムコホールディングス	10.7	15.8	49,138	
アイフィスジャパン	0.2	0.3	126	
共立印刷	1.7	2.4	792	
SHOE I	0.5	0.6	1,608	
フランスベッドホールディングス	1.4	1.8	1,681	
パイロットコーポレーション	1.8	2.5	11,312	
萩原工業	0.3	0.4	1,054	
トップパン・フォームズ	1.9	2.6	2,873	
フジシールインターナショナル	1.3	3.2	7,296	
タカラトミー	3.4	5.6	7,100	
廣済堂	1	1.4	529	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
A s - m e エステール	0.3	0.4	274	
アーケ	4.4	6	660	
タカノ	0.5	0.6	587	
プロネクス	1	1.3	1,700	
ホクシン	0.8	1	223	
ウッドワン	2	2	584	
大建工業	4	1	2,235	
凸版印刷	29	40	44,960	
大日本印刷	30	41	49,159	
図書印刷	2	2	946	
共同印刷	3	4	1,576	
日本写真印刷	1.7	2.4	7,944	
光村印刷	1	1	261	
宝印刷	0.5	0.7	1,075	
アシックス	10.3	14.2	27,690	
ツツミ	0.5	0.5	1,029	
小松ウオール工業	0.4	0.5	971	
ヤマハ	7.6	9.6	28,502	
河合楽器製作所	0.4	0.6	1,355	
クリナップ	1.2	1.7	1,395	
ビジョン	5.9	8.6	26,703	
兼松サステック	1	1	210	
キングジム	0.9	1.2	1,017	
リンテック	2.5	3.4	8,377	
TASAKI	0.3	0.4	597	
イトーキ	2.2	3	2,181	
任天堂	6.4	8.8	204,688	
三菱鉛筆	0.9	1.2	7,284	
タカラスタンダード	4	3	5,709	
コクヨ	5.4	7.4	10,774	
ナカバヤシ	2	3	819	
グローブライド	0.5	0.7	1,259	
岡村製作所	3.6	5	5,130	
美津濃	6	8	4,688	
アデランス	1.8	—	—	
電気・ガス業 (1.8%)				
東京電力ホールディングス	88.2	121.2	52,116	
中部電力	31.8	47.1	71,403	
関西電力	42.4	58.3	72,379	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
中国電力	14.4	19.8	24,670	
北陸電力	10.2	14	16,044	
東北電力	26	35.7	50,729	
四国電力	9.4	12.9	14,319	
九州電力	23	31.6	38,804	
北海道電力	9.7	13.4	10,921	
沖縄電力	1.7	2.1	5,523	
電源開発	8.9	11.4	31,806	
エフオン	0.4	0.5	494	
イーレックス	0.3	0.6	2,202	
東京瓦斯	116	153	80,110	
大阪瓦斯	108	139	60,701	
東邦瓦斯	26	36	29,304	
北海道瓦斯	3	3	831	
広島ガス	1.8	2.9	1,073	
西部瓦斯	12	16	4,176	
静岡ガス	3.2	4.4	3,190	
メタウォーター	0.7	0.8	2,384	
陸運業 (4.2%)				
SBSホールディングス	1	1.4	1,169	
東武鉄道	56	76	43,320	
相鉄ホールディングス	18	23	12,949	
東京急行電鉄	61	78	65,052	
京浜急行電鉄	28	39	48,516	
小田急電鉄	33	22.9	51,341	
京王電鉄	29	40	35,640	
京成電鉄	16	10.7	28,611	
富士急行	3	4	4,088	
新京成電鉄	1	2	844	
東日本旅客鉄道	19	27.6	284,418	
西日本旅客鉄道	10	13.8	101,029	
東海旅客鉄道	9.3	11.9	219,555	
西武ホールディングス	11	19.7	37,646	
鴻池運輸	1.5	2	2,948	
西日本鉄道	13	17	8,313	
ハマキョウレックス	0.8	0.9	1,845	
サカイ引越センター	0.4	0.5	1,547	
近鉄グループホールディングス	105	144	61,344	
阪急阪神ホールディングス	14	18.1	68,146	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
南海電気鉄道	23	30	16,530
京阪ホールディングス	23	32	23,296
神戸電鉄	3	3	1,155
名古屋鉄道	38	52	27,612
山陽電気鉄道	4	5	3,030
日本通運	40	55	31,900
ヤマトホールディングス	18.6	25.6	59,494
山九	14	19	13,433
丸運	0.6	0.8	200
丸全昭和運輸	3	5	2,235
センコー	4.7	6.5	4,784
トナミホールディングス	2	3	1,065
ニッコンホールディングス	3.3	4.8	11,275
日本石油輸送	1	0.2	500
福山通運	6	9	5,796
セイノーホールディングス	7.4	10.1	12,524
神奈川中央交通	1	2	1,434
日立物流	2.2	3	6,654
丸和運輸機関	0.3	0.4	1,048
C&Fロジホールディングス	1	1.5	2,257
九州旅客鉄道	—	10.7	35,470
海運業 (0.2%)			
日本郵船	93	121	29,161
商船三井	51	75	27,150
川崎汽船	45	54	15,822
NSユニテッド海運	5	6	1,314
明治海運	0.9	1.3	560
飯野海運	5.4	7.4	3,589
共栄タンカー	1	1	232
乾汽船	0.8	1	971
空運業 (0.6%)			
日本航空	19.9	25.8	92,776
ANAホールディングス	193	265	87,132
バスコ	1	1	423
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	0.3	0.4	2,244
日新	4	6	2,100
三菱倉庫	7	9	14,436
三井倉庫ホールディングス	6	8	2,712

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
住友倉庫	8	10	6,190
澁澤倉庫	3	4	1,400
東陽倉庫	2	2.4	717
日本トランスシティ	2	3	1,308
ケイヒン	2	3	462
中央倉庫	0.6	0.8	872
安田倉庫	0.8	1.1	828
東洋埠頭	3	4	748
宇徳	0.8	1.2	502
上組	12	17	18,105
サンリツ	0.3	0.3	156
キムラユニティ	0.3	0.4	479
キューソー流通システム	0.3	0.5	1,270
郵船ロジスティクス	1	1.3	1,540
近鉄エクスプレス	1.9	2.6	4,386
東海運	0.6	0.8	358
エーアイテイ	0.6	0.9	981
内外トランスライン	0.3	0.4	446
情報・通信業 (7.8%)			
NECネットエスアイ	1.3	1.5	3,204
システナ	1	1.1	1,811
デジタルアーツ	0.5	0.6	1,992
新日鉄住金ソリューションズ	1.7	2.4	5,460
キューブシステム	0.4	0.6	414
コア	0.4	0.6	837
ソフトクリエイトホールディングス	0.5	0.7	930
T I S	3.4	4.7	12,558
ネオス	0.3	0.4	178
電算システム	0.4	0.5	838
グリー	6.2	8.6	5,822
コーエーテックモホールディングス	2.4	3.3	6,834
三菱総合研究所	0.4	0.5	1,600
ボルテージ	0.2	0.3	304
電算	0.1	0.2	481
AGS	0.2	0.4	696
ファイナデックス	0.8	1	932
ヒト・コミュニケーションズ	0.2	0.3	499
ブレインパッド	0.2	0.3	349
KL a b	2	2.7	1,952

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ポルトゥワイン・ビットクルーホルディ	0.7	1	1,090
イーブックイニシアティブジャパン	0.2	0.2	196
ネクソン	11.3	15.4	29,414
アイスタイル	1.6	3	2,670
エムアップ	0.3	0.4	362
エイチーム	0.6	0.8	1,731
テクノスジャパン	0.3	1.1	1,328
e n i s h	0.3	0.4	223
コロブラ	2.9	3.9	4,145
モバイルクリエイト	0.7	1	418
オルトプラス	0.4	0.6	462
ブロードリーフ	1.3	3.5	2,520
ハーツユナイテッドグループ	0.3	0.7	1,020
メディアドゥ	0.2	0.3	484
ブイキューブ	0.6	0.8	492
サイバーリンクス	0.2	0.2	206
ディー・エル・イー	0.3	0.5	340
フィックスターズ	—	0.2	749
VOYAGE GROUP	0.3	0.5	833
オブティム	0.1	0.1	601
セレス	—	0.3	544
ベリサーブ	0.1	0.2	570
ティーガイア	1	1.4	2,444
日本アジアグループ	1.2	1.6	697
豆蔵ホールディングス	0.8	1	903
テクマトリックス	0.4	0.4	992
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	23.9	29.6	7,518
GMOペイメントゲートウェイ	0.8	1.2	7,728
ザッパラス	0.6	0.7	317
システムリサーチ	—	0.1	211
インターネットイニシアティブ	1.7	2.1	4,187
さくらインターネット	0.7	1.1	1,287
GMOクラウド	0.2	0.3	557
SRAホールディングス	0.6	0.7	1,880
M i n o r i ソリューションズ	0.2	0.3	375
システムインテグレータ	0.1	0.2	135
朝日ネット	0.9	1.3	677
アドソル日進	—	0.3	387
フリービット	—	0.8	752

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コムチュア	0.2	0.2	713
サイバーコム	0.1	0.2	196
メディカル・データ・ビジョン	—	0.2	567
g u m i	1.1	1.6	2,092
ショーケース・ティービー	—	0.2	244
P C I ホールディングス	—	0.2	564
パイブドHD	0.1	0.3	342
アイビーシー	—	0.1	102
オープンドア	—	0.1	338
L I N E	—	2.4	8,664
AOI TYO Holdings	—	1.1	962
ソルクシーズ	0.3	0.4	216
フェイス	0.3	0.4	558
ハイマックス	0.1	0.2	299
野村総合研究所	7	10.5	40,687
サイバネットシステム	0.8	1.2	948
CEホールディングス	0.2	0.2	230
インテージホールディングス	0.5	0.8	1,826
東邦システムサイエンス	0.3	0.5	327
ソースネクスト	0.5	0.8	544
ティー・ワイ・オー	2	—	—
フォーカスシステムズ	0.4	0.5	294
クレスコ	0.2	0.3	764
フジ・メディア・ホールディングス	10.7	14.7	22,814
オービック	3.5	4.9	26,411
ジャストシステム	1.9	2.3	2,808
TDCソフトウェアエンジニアリング	0.4	0.6	748
ヤフー	73.5	101.1	54,088
トレンドマイクロ	5.4	7.5	32,962
インフォメーション・ディベロップメント	0.2	0.4	462
日本オラクル	1.6	2.3	14,904
アルファシステムズ	0.3	0.5	985
フューチャー	1.4	1.9	1,601
CAC Holdings	0.8	1.1	1,091
ソフトバンク・テクノロジーズ	0.3	0.3	1,216
トーセ	0.3	0.4	329
オービックビジネスコンサルティング	0.5	0.7	3,885
伊藤忠テクノソリューションズ	2.3	3.2	9,968
アイティフォー	1.3	1.8	1,148

MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東計電算	0.2	0.2	446	
エクスネット	0.1	0.1	214	
大塚商会	2.8	3.8	22,382	
サイボウズ	1.4	1.9	851	
ソフトブレーン	1.4	1.9	853	
電通国際情報サービス	0.6	0.9	2,007	
デジタルガレージ	1.6	2	3,920	
EMシステムズ	0.3	0.5	820	
ウェザーニューズ	0.3	0.5	1,730	
C I J	0.9	1.2	636	
東洋ビジネスエンジニアリング	0.1	0.1	154	
日本エンタープライズ	1	1.4	390	
WOWOW	0.5	0.7	2,534	
スカラ	0.6	1	868	
日本コロムビア	0.3	0.4	288	
イマジカ・ロボット ホールディングス	0.9	1.2	888	
ネットワンシステムズ	4.4	6.1	5,276	
システムソフト	—	2.5	387	
アルゴグラフィックス	0.5	0.6	1,458	
マーベラス	1.7	2.4	2,210	
エイベックス・グループ・ホールディングス	1.9	2.6	4,238	
日本ユニシス	2.8	3.9	5,900	
兼松エレクトロニクス	0.6	0.9	2,303	
東京放送ホールディングス	6.1	9.3	18,925	
日本テレビホールディングス	9.4	12.9	26,393	
朝日放送	1	1.4	1,089	
テレビ朝日ホールディングス	2.8	3.9	9,211	
スカパーJ SATホールディングス	7.8	9.2	4,609	
テレビ東京ホールディングス	0.9	1.1	2,875	
日本BS放送	0.2	0.3	315	
ビジョン	—	0.2	704	
U-NEXT	0.3	0.4	356	
ワイヤレスゲート	0.4	0.5	764	
コネクシオ	0.9	1.2	1,843	
日本通信	7.3	11.8	2,112	
クロップス	0.2	0.3	179	
日本電信電話	79.3	113.2	538,832	
KDDI	101.5	139.5	413,059	
光通信	1.2	1.7	17,680	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
NTTドコモ	76.7	105.4	281,786	
エムティーアイ	1.6	2.2	1,540	
GMOインターネット	3.7	5.1	7,803	
カドカワ	3.2	4.1	6,683	
学研ホールディングス	3	5	1,550	
ゼンリン	1.4	1.9	4,259	
昭文社	0.6	0.8	557	
インプレスホールディングス	0.8	1.2	174	
アイネット	0.6	0.8	989	
松竹	7	9	11,988	
東宝	7.3	9.2	29,256	
東映	4	5	4,835	
AOI Pro.	0.5	—	—	
エヌ・ティ・ティ・データ	6.3	8.7	46,980	
ビー・シー・エー	0.1	0.2	312	
ビジネスブレイン太田昭和	0.2	0.2	212	
DTS	1.1	1.5	3,804	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	4.3	5.4	17,847	
シーイーシー	0.7	0.8	1,432	
カブコン	2.6	3.3	7,705	
アイ・エス・ビー	0.2	0.3	268	
ジャステック	0.6	0.9	947	
S C S K	2.4	3.8	15,865	
日本システムウエア	0.4	0.5	808	
アイネス	1.5	1.8	2,095	
TKC	0.9	1.3	4,550	
富士ソフト	1.5	2.1	6,012	
NSD	2.2	3	5,316	
コナミホールディングス	4.6	6.4	30,048	
福井コンピュータホールディングス	0.3	0.4	1,132	
J B C Cホールディングス	0.9	1.2	957	
ミロク情報サービス	0.8	1	1,830	
ソフトバンクグループ	58.1	63.5	541,972	
卸売業 (4.5%)				
ホウスイ	1	1	126	
高千穂交易	0.4	0.5	521	
伊藤忠食品	0.3	0.3	1,326	
エレマテック	0.5	0.6	1,167	
J A L U X	0.3	0.5	1,121	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
あらた	0.5	0.6	1,678	
トーメンデバイス	0.2	0.2	427	
東京エレクトロン デバイス	0.4	0.5	797	
フィールズ	0.9	1.1	1,366	
双日	64.6	83.3	24,073	
アルフレッサ ホールディングス	12.9	16.7	32,882	
横浜冷凍	2.5	3.5	3,626	
神栄	1	2	360	
山下医科器械	0.1	0.1	179	
ラサ商事	0.5	0.6	405	
ラクーン	0.4	0.7	359	
アルコニックス	0.6	0.8	1,396	
神戸物産	0.6	0.8	3,088	
あい ホールディングス	1.8	2	4,324	
ディーブイエックス	0.4	0.5	632	
ダイワボウホールディングス	9	12	3,456	
マクニカ・富士エレホールディングス	1.8	2.6	4,399	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	1.8	2.6	2,652	
八洲電機	0.8	1.1	707	
UKCホールディングス	0.7	0.9	2,015	
OCHIホールディングス	0.3	0.4	541	
TOKAIホールディングス	4.5	6.2	5,232	
大阪工機	0.1	0.2	144	
三洋貿易	0.6	0.8	1,370	
ビューティガレージ	—	0.1	111	
ウイン・パートナーズ	0.4	1	961	
ミタチ産業	0.3	0.3	189	
シップヘルスケアホールディングス	2.1	2.7	7,846	
明治電機工業	0.3	0.5	611	
デリカフーズ	0.2	0.3	311	
スターティア	0.2	0.3	167	
コメダホールディングス	1.4	1.9	3,583	
富士興産	0.4	0.5	241	
協栄産業	1	2	334	
小野建	0.9	1.2	1,684	
佐鳥電機	0.8	1	755	
エコートレーディング	0.2	0.3	212	
伯東	0.8	1	1,053	
コンドーテック	0.8	1.1	951	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
中山福	0.6	0.8	683	
ナガイレーベン	1.5	2	5,164	
三菱食品	1.1	1.5	5,130	
松田産業	0.7	1	1,586	
第一興商	1.8	2.3	10,879	
メディバルホールディングス	10.3	14.1	25,831	
アドヴァン	1	—	—	
S P K	0.2	0.3	748	
萩原電気	0.3	0.5	1,073	
アズワン	0.8	1.1	5,522	
スズデン	0.3	0.5	532	
尾家産業	0.3	0.5	577	
シモジマ	0.7	0.9	1,065	
ドウシシャ	1.2	1.7	3,612	
小津産業	0.2	0.3	651	
高速	0.6	0.8	896	
たけびし	0.4	0.5	677	
黒田電気	1.9	1.9	4,390	
リックス	0.2	0.3	489	
丸文	0.9	1.2	830	
ハビネット	0.9	1.2	1,710	
橋本総業ホールディングス	0.2	0.3	456	
日本ライフライン	0.5	1.2	2,236	
エクセル	0.5	0.6	915	
マルカキカイ	0.3	0.5	914	
I DOM	2.8	3.8	2,872	
日本エム・ディ・エム	0.9	1.1	893	
進和	0.6	0.8	1,431	
エスケイジャパン	0.2	0.3	92	
ダイトロン	0.5	0.6	582	
シークス	0.7	1	4,175	
田中商事	0.3	0.4	282	
オーハシテクニカ	0.6	0.8	1,108	
白銅	0.3	0.4	697	
伊藤忠商事	80.5	103.3	164,401	
丸紅	101	138.8	99,769	
高島	2	2	414	
長瀬産業	6.2	8.5	13,659	
蝶理	0.7	0.9	1,777	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
豊田通商	11.4	15.7	51,653	
三共生興	1.5	2.1	863	
兼松	22	30	5,760	
ツカモトコーポレーション	2	3	381	
三井物産	92.8	127.6	216,026	
日本紙パルプ商事	5	7	2,625	
日立ハイテクノロジーズ	3.6	4.9	23,422	
カメイ	1.3	1.8	2,390	
東都水産	2	0.2	390	
OUGホールディングス	1	2	522	
スターゼン	0.4	0.6	2,892	
山善	3.9	5.4	5,497	
椿本興業	1	2	794	
住友商事	64.6	88.8	131,157	
内田洋行	3	0.7	1,780	
三菱商事	77	105.8	270,953	
第一実業	2	3	2,226	
キャノンマーケティングジャパン	2.9	4	8,888	
西華産業	3	5	1,850	
佐藤商事	0.9	1.3	1,134	
菱洋エレクトロ	1.2	1.3	2,041	
東京産業	1	1.4	652	
ユアサ商事	1	1.3	4,023	
神鋼商事	2	0.4	984	
小林産業	0.7	1	278	
阪和興業	10	14	10,724	
カナデン	1	1.3	1,350	
菱電商事	2	2	1,472	
フルサト工業	0.6	0.8	1,376	
岩谷産業	12	16	10,640	
すてきなイスグループ	4	6	912	
昭光通商	4	5	490	
ニチモウ	2	2	372	
極東貿易	1	2	480	
イワキ	2	2	616	
三菱石油	2.5	3.8	3,328	
稲畑産業	2.5	3.4	4,940	
G S I クレオス	3	3	435	
明和産業	0.9	1.3	534	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ワキタ	2.2	3	3,051	
東邦ホールディングス	3.3	4.5	11,029	
サンゲツ	3.5	4.8	9,292	
ミツウロコグループホールディングス	1.6	2.3	1,674	
シナネンホールディングス	2	0.6	1,375	
伊藤忠エネクス	2.6	3.1	2,870	
サンリオ	3.2	4.3	10,006	
サンワテクノス	0.7	0.8	824	
リョーサン	1.6	2.1	7,560	
新光商事	1.2	1.5	1,957	
トーヨー	0.5	0.6	1,496	
三信電気	1.4	1.6	2,142	
東陽テクニカ	1.4	1.9	1,968	
モスフードサービス	1.3	1.8	6,048	
加賀電子	0.9	1.3	2,562	
ソーダニッカ	1.1	1.5	778	
立花エレテック	0.8	1	1,333	
フォーバル	0.5	0.6	418	
PAL TAC	1.6	2.3	7,084	
三谷産業	1.1	1.5	574	
太平洋興発	4	6	648	
ヤマタネ	5	0.7	1,113	
丸紅建材リース	1	1	229	
日鉄住金物産	9	1.2	5,820	
トラスコ中山	1.2	3.2	8,598	
オートボックスセブン	3.8	5.2	9,204	
モリト	—	1.1	1,092	
加藤産業	1.6	2.2	6,300	
イノテック	0.9	1.2	794	
イエローハット	1	1.3	3,528	
J Kホールディングス	1	1.4	931	
日伝	0.4	0.6	2,040	
北沢産業	0.8	1.2	259	
杉本商事	0.6	0.8	1,252	
因幡電機産業	1.4	2	8,050	
パイテックホールディングス	0.4	0.6	806	
ミスミグループ本社	11.5	15.9	33,612	
アルテック	0.9	1.2	258	
タキヒヨー	2	2	954	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
蔵王産業	0.2	0.2	300
スズケン	4.7	6.4	24,064
ジェコス	0.7	1	1,139
ルネサスイーストン	0.9	1.3	791
小売業 (4.6%)			
ローソン	3.9	4.9	40,082
サンエー	0.7	1.1	5,731
ダイユーエイト	0.3	—	—
カワチ薬品	0.8	1.1	3,261
エービーシー・マート	1.3	2.6	17,160
ハードオフコーポレーション	0.5	0.6	712
アスクル	1.2	1.5	5,422
ゲオホールディングス	1.7	2.4	3,264
アダストリア	1.9	2.2	6,699
ジーフット	0.6	0.8	651
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1	0.2	143
くらコーポレーション	0.7	0.9	4,171
キャンドゥ	0.5	0.7	1,273
バルグループホールディングス	0.6	0.7	1,955
エディオン	4.3	5.5	5,725
サーラコーポレーション	1.3	1.8	1,132
ワッツ	0.4	0.6	694
ハローズ	0.3	0.5	1,172
あみやき亭	0.2	0.3	1,201
ひらまつ	1.4	1.9	1,233
ゲンキー	0.2	0.3	1,809
サッポロドラッグストア	0.1	—	—
大黒天物産	0.2	0.3	1,551
ハニーズ	0.9	1.4	1,524
ファーマライズホールディングス	0.2	0.3	153
アルペン	0.9	1.1	2,156
クオール	1	1.6	2,385
ジェイアイエヌ	0.7	1	5,990
ビックカメラ	5.9	8.1	8,561
DCMホールディングス	5	8.6	8,479
Monotaro	3.6	5	16,625
東京一番フーズ	0.3	0.4	233
ダイヤモンドダイニング	0.2	0.3	572
きちり	0.3	0.4	265

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アークランドサービスホールディングス	0.3	0.4	1,272
J. フロント リテイリング	13	17.8	29,565
ドトール・日レスホールディングス	1.8	2.5	5,452
マツモトキヨシホールディングス	2.1	2.7	14,229
ブロンコビリー	0.5	0.7	1,958
スタートトゥデイ	3.1	12.9	32,069
トレジャー・ファクトリー	0.3	0.4	330
物語コーポレーション	0.3	0.4	1,740
ココカラファイン	1.1	1.5	7,057
三越伊勢丹ホールディングス	20.4	28.1	38,890
H a m e e	—	0.3	276
ウエルシアホールディングス	0.9	1.4	8,806
クリエイトSDホールディングス	1.5	2.1	5,340
丸善CHIホールディングス	1.2	1.6	584
ミサワ	0.2	0.3	137
ティーライフ	—	0.1	139
エー・ピーカンパニー	0.2	0.2	164
チムニー	0.3	0.4	1,130
シュッピン	0.4	0.5	654
ネクステージ	0.2	0.3	747
ジョイフル本田	1.7	2.3	7,256
鳥貴族	0.3	0.3	701
キリン堂ホールディングス	0.3	0.5	425
ホットランド	0.5	0.7	770
すかいらーく	4.4	6.1	9,662
綿半ホールディングス	0.4	0.6	968
ヨシックス	—	0.1	133
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	3.4	4.7	4,770
ブックオフコーポレーション	0.6	0.8	673
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.4	0.6	472
BEENOS	—	0.2	304
あさひ	0.8	1	1,325
日本調剤	0.3	0.5	1,860
コスモス薬品	0.5	0.7	14,847
トーエル	0.5	0.7	637
一六堂	0.2	0.3	121
オンリー	—	0.2	164
セブン&アイ・ホールディングス	42.9	59	262,432
薬王堂	0.2	0.7	1,500

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
クリエイト・レストランツ・ホールディング	2.8	3.8	3,929	
ツルハホールディングス	2.4	2.8	29,232	
サンマルクホールディングス	0.8	0.9	3,114	
フェリシモ	0.3	0.4	408	
トリドールホールディングス	1.3	1.7	4,102	
クスリのアオキ	0.9	—	—	
サツドラホールディングス	—	0.2	395	
ダイユー・リックホールディングス	—	0.5	396	
パロックジャパンリミテッド	—	0.8	1,132	
クスリのアオキホールディングス	—	1.1	5,043	
メディカルシステムネットワーク	1.2	1.6	694	
総合メディカル	0.5	0.7	2,824	
はるやまホールディングス	0.4	0.7	663	
ノジマ	1.2	1.6	2,041	
カッパ・クリエイト	1.4	2	2,536	
ライトオン	0.8	1.1	1,083	
ジーンズメイト	0.3	0.4	106	
良品計画	1.2	1.9	40,926	
三城ホールディングス	1.3	1.7	802	
アドヴァン	—	1.4	1,586	
アルビス	0.3	0.4	1,306	
コナカ	1.3	1.8	1,056	
ハウス オブ ローゼ	0.1	0.2	311	
G-7ホールディングス	0.3	0.4	855	
イオン北海道	0.7	1.4	858	
コジマ	1.5	2.1	577	
ヒマラヤ	0.3	0.4	342	
コーナン商事	1.5	2	4,292	
エコス	0.4	0.5	609	
ワタミ	1.2	1.7	2,040	
マルシェ	0.2	0.3	250	
ドンキホーテホールディングス	6.6	9.1	35,581	
西松屋チェーン	2	2.5	3,345	
ゼンショーホールディングス	5.3	7.3	14,417	
幸楽苑ホールディングス	0.6	0.9	1,505	
ハークスレイ	0.3	0.3	333	
サイゼリヤ	1.7	2.3	6,083	
V Tホールディングス	3.5	4.8	2,760	
魚力	0.3	0.4	520	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ポプラ	0.3	0.4	208	
フジ・コーポレーション	—	0.2	399	
ユナイテッドアローズ	1.5	1.9	6,716	
ハイデイ日高	0.9	1.3	3,653	
京都きもの友禅	0.7	0.9	888	
コロワイド	3.4	4.7	8,577	
ビーシーデポコーポレーション	1.1	1.9	1,062	
壳番屋	0.9	1	3,755	
トップカルチャー	0.4	0.5	239	
P L A N T	0.2	0.3	360	
スギホールディングス	1.8	3.1	16,368	
ヴィア・ホールディングス	—	1.1	1,274	
スクロール	1.6	2.1	730	
ヨンドシーホールディングス	0.8	1.1	2,747	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	3.2	6.2	46,004	
木曽路	1.3	1.7	4,025	
サトレストランシシステムズ	1.2	1.7	1,502	
千趣会	1.9	2.5	1,970	
タカキュー	0.8	1.1	235	
ケーヨー	1.7	2.4	1,401	
上新電機	2	3	3,264	
日本瓦斯	1.6	2.6	8,736	
ベスト電器	3.3	4.5	630	
ロイヤルホールディングス	1.7	2.3	4,480	
東天紅	1	1	169	
いなげや	1.1	1.6	2,483	
島忠	2.7	3.6	10,216	
チヨダ	1.2	1.7	4,647	
ライフコーポレーション	0.6	1.1	3,641	
リンガーハット	0.9	1.6	3,668	
さが美	1	1	122	
M r M a x	0.9	1.8	756	
テンアライド	0.9	1.3	510	
A O K I ホールディングス	2.3	2.8	3,847	
オークワ	2	2	2,296	
コメリ	1.6	2.2	5,926	
青山商事	2	2.9	11,542	
しまむら	1.2	1.6	23,648	
はせがわ	0.5	0.7	315	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
高島屋	15	24	23,592	
松屋	2.1	3.1	3,072	
エイチ・ツー・オー リテイリング	5.3	7.2	13,442	
近鉄百貨店	4	5	1,795	
丸栄	2	3	270	
ニッセンホールディングス	1.5	—	—	
バルコ	1	1.4	1,596	
丸井グループ	12.6	14.8	22,895	
アクシアル リテイリング	0.8	1.1	5,005	
井筒屋	6	0.8	309	
イオン	42.2	58	96,686	
ユニーグループ・ホールディングス	9.8	—	—	
イズミ	2	2.8	13,398	
東武ストア	1	0.2	586	
平和堂	2.1	2.9	7,606	
フジ	1.1	1.6	3,881	
ヤオコー	1.2	1.6	7,464	
ゼビオホールディングス	1.4	1.9	3,372	
ケーズホールディングス	4.3	6.5	13,669	
Olympicグループ	0.6	0.8	503	
日産東京販売ホールディングス	1.7	2.1	699	
アインホールディングス	1.2	1.8	14,778	
元気寿司	0.3	0.4	902	
ヤマダ電機	31.2	47.2	27,187	
アークランドサカモト	1.7	2.4	3,324	
ニトリホールディングス	4.4	6.1	76,860	
グルメ杵屋	1	1	1,033	
愛眼	0.8	1	196	
ケーユーホールディングス	0.5	0.7	626	
吉野家ホールディングス	3.8	4.9	8,134	
松屋フーズ	0.5	0.7	2,926	
サガミチェーン	1.4	1.8	2,415	
関西スーパーマーケット	0.8	1.1	1,678	
王将フードサービス	0.8	1	4,275	
ブレナス	1.1	1.6	3,964	
ミニストップ	0.8	1	2,142	
アークス	1.9	2.6	6,674	
パローホールディングス	2.2	3	8,256	
藤久	0.1	0.1	173	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
バルク	0.5	0.6	2,685	
大庄	0.5	0.8	1,268	
ファーストリテイリング	1.7	2.4	87,720	
サンドラッグ	2.2	2.7	20,331	
サックスパー ホールディングス	1	1.3	1,587	
ヤマザワ	0.2	0.3	548	
やまや	0.2	0.3	517	
ペルーナ	2.6	3.5	2,940	
銀行業 (8.6%)				
島根銀行	0.2	0.3	421	
じもとホールディングス	7.4	10.1	1,979	
めぶきフィナンシャルグループ	7.5	68	31,620	
東京TYフィナンシャルグループ	1.4	2	7,870	
九州フィナンシャルグループ	15.7	23.1	18,364	
ゆうちょ銀行	26.3	39.9	56,697	
富山第一銀行	2.6	3.6	1,926	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	71.5	92.3	56,146	
西日本フィナンシャルホールディングス	—	9.6	11,827	
新生銀行	89	134	27,202	
あおぞら銀行	65	89	36,668	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	823.1	1,068.9	807,660	
りそなホールディングス	120	165	100,336	
三井住友トラスト・ホールディングス	214	29.4	121,275	
三井住友フィナンシャルグループ	82.1	113	510,082	
第四銀行	13	17	8,874	
北越銀行	11	1.5	4,108	
西日本シティ銀行	33	—	—	
千葉銀行	40	54	40,986	
常陽銀行	37	—	—	
群馬銀行	22.8	31.3	20,658	
武蔵野銀行	1.6	2.3	8,349	
千葉興業銀行	2.8	3.9	2,433	
筑波銀行	4.3	5.9	2,065	
七十七銀行	16	22	11,638	
青森銀行	7	11	4,312	
秋田銀行	7	9	3,312	
山形銀行	6	8	3,936	
岩手銀行	0.7	0.9	4,239	
東邦銀行	9	13	5,668	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東北銀行	5	7	1,106	
みちのく銀行	5	8	1,544	
ふくおかフィナンシャルグループ	44	57	27,873	
静岡銀行	30	38	37,316	
十六銀行	13	19	7,638	
スルガ銀行	9.7	14.4	37,627	
八十二銀行	18.6	27.2	19,176	
山梨中央銀行	6	9	4,932	
大垣共立銀行	14	19	8,455	
福井銀行	9	12	3,360	
北國銀行	11	15	7,005	
清水銀行	0.3	0.5	1,860	
富山銀行	0.2	0.3	1,254	
滋賀銀行	10	13	8,372	
南都銀行	10	1.4	6,524	
百五銀行	9	13	6,474	
京都銀行	20	25	23,425	
紀陽銀行	4	5.3	9,990	
三重銀行	5	0.6	1,499	
ほくほくフィナンシャルグループ	70	9.4	19,072	
広島銀行	30	42	22,638	
山陰合同銀行	6.2	8.5	8,738	
中国銀行	7.3	10	17,930	
鳥取銀行	3	0.4	759	
伊予銀行	11	15.1	12,049	
百十四銀行	11	15	5,925	
四国銀行	8	11	3,289	
阿波銀行	8	12	8,808	
大分銀行	6	8	3,536	
宮崎銀行	7	9	3,348	
佐賀銀行	6	9	2,736	
十八銀行	6	9	3,186	
沖縄銀行	0.9	1.4	5,789	
琉球銀行	2.1	2.9	4,671	
セブン銀行	38.5	52.9	17,351	
みずほフィナンシャルグループ	1,459.4	1,915.2	399,319	
高知銀行	4	5	675	
山口フィナンシャルグループ	10	13	16,783	
長野銀行	3	0.5	1,006	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
名古屋銀行	9	1.2	5,160	
北洋銀行	15.5	23	10,810	
愛知銀行	0.3	0.5	3,510	
第三銀行	6	0.8	1,392	
中京銀行	4	0.6	1,408	
大光銀行	4	5	1,265	
愛媛銀行	6	1.7	2,414	
トマト銀行	4	0.5	801	
みなと銀行	9	1.3	2,810	
京葉銀行	8	11	5,973	
関西アーバン銀行	1.4	2	3,006	
栃木銀行	5	7.8	4,594	
北日本銀行	0.3	0.4	1,266	
東和銀行	19	26	3,172	
福島銀行	13	15	1,425	
大東銀行	6	7	1,169	
トモニホールディングス	7.9	11.6	7,447	
フィデアホールディングス	8.4	13.7	2,890	
池田泉州ホールディングス	10.9	15	7,725	
証券、商品先物取引業 (1.3%)				
F P G	3.7	5	5,170	
S B I ホールディングス	12.3	15.9	24,676	
日本アジア投資	0.7	1.3	660	
ジャフコ	1.7	2.4	9,240	
大和証券グループ本社	96	132	94,208	
野村ホールディングス	197.4	288.4	215,723	
岡三証券グループ	9	12	9,012	
丸三証券	3	4.5	4,311	
東洋証券	4	5	1,360	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	11.8	16.2	10,432	
光世証券	2	3	570	
水戸証券	3.2	4.4	1,377	
いちよし証券	2.3	3.2	2,870	
松井証券	5	8.1	7,638	
だいこう証券ビジネス	0.5	0.7	429	
マネックスグループ	11.9	15.1	4,484	
カブドットコム証券	8.3	10.2	3,988	
極東証券	1.4	1.9	3,201	
岩井コスモホールディングス	1	1.3	1,423	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
藍澤證券	1.9	2.6	1,677	
マネースクウェアHD	0.4	—	—	
マネーパートナーズグループ	1	1.8	943	
小林洋行	0.3	0.4	117	
保険業 (2.7%)				
かんぽ生命保険	4.2	5.3	14,262	
SOMPOホールディングス	22.8	29.5	120,212	
アニコム ホールディングス	0.7	1	2,274	
MS&ADインシュアランスグループホール	30.7	42.2	159,684	
ソニーフィナンシャルホールディングス	9.8	13.5	26,757	
第一生命ホールディングス	65.7	85.1	181,135	
東京海上ホールディングス	41.6	57.1	275,222	
T&Dホールディングス	37.4	51.4	88,973	
アドバンスクリエイト	—	0.3	610	
その他金融業 (1.2%)				
全国保証	2.7	4	14,620	
クレディセゾン	7.8	10.7	22,940	
アクリーティブ	0.8	1.2	489	
芙蓉総合リース	1.2	1.6	8,096	
興銀リース	1.9	2.6	6,190	
東京センチュリー	2.4	2.8	10,570	
日本証券金融	4.5	6.2	3,856	
アイフル	17.2	23.7	7,963	
ポケットカード	1	1.1	663	
リコーリース	0.8	1.1	3,811	
イオンフィナンシャルサービス	6.7	9	18,351	
アコム	19.5	27.4	13,152	
ジャックス	6	8	4,048	
オリエントコーポレーション	44.4	30.5	6,466	
日立キャピタル	2.4	3.3	9,474	
アブラスフィナンシャル	4.9	6.8	802	
オリックス	72.6	99.9	172,976	
三菱UFJリース	26	35.8	21,193	
日本取引所グループ	30.1	43.9	71,249	
イー・ギャランティ	0.3	0.4	1,095	
アサックス	0.2	0.2	327	
NECキャピタルソリューション	0.4	0.6	1,086	
不動産業 (2.6%)				
いちご	11.4	13.4	4,850	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本駐車場開発	12.3	17	2,584	
ヒューリック	21.4	29.4	32,075	
三栄建築設計	0.4	0.6	933	
野村不動産ホールディングス	6.8	9.4	18,217	
三重交通グループホールディングス	1.8	2.5	972	
サムティ	0.8	1.1	1,269	
ディア・ライフ	0.7	1	387	
エー・ディー・ワークス	9.4	12.9	554	
日本商業開発	0.5	0.8	1,592	
プレサンスコーポレーション	0.3	2.2	3,014	
ユニゾホールディングス	0.8	1.2	3,678	
THEグローバル社	—	0.5	226	
日本管理センター	0.7	1	1,283	
サンセイランディック	0.2	0.3	226	
エストラスト	0.2	0.2	154	
フージャースホールディングス	1.4	1.8	1,085	
オープンハウス	1.5	2	5,440	
東急不動産ホールディングス	24.8	34.1	22,301	
飯田グループホールディングス	9.5	11.8	21,712	
ムゲンエステート	0.4	0.5	344	
ファーストブラザーズ	—	0.1	167	
ハウスドゥ	—	0.2	286	
シーアールイー	0.1	0.2	328	
ケイアイスター不動産	—	0.3	476	
エコナックホールディングス	3	5	255	
パーク24	5.2	7.2	22,032	
バラカ	0.3	0.4	766	
三井不動産	54	75	200,887	
三菱地所	76	105	237,037	
平和不動産	1.9	2.7	4,347	
東京建物	11.9	16.4	26,371	
ダイビル	2.6	3.6	3,870	
京阪神ビルディング	1.7	2.3	1,458	
住友不動産	25	34	109,616	
大京	19	26	5,746	
テオーシー	4	5.5	5,302	
東京楽天地	2	2	1,044	
レオパレス21	12.1	17.8	10,964	
スターツコーポレーション	1.2	1.4	3,368	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
フジ住宅	1.3	1.8	1,332	
空港施設	1.2	1.7	999	
明和地所	0.6	0.8	559	
住友不動産販売	0.7	1.3	3,578	
ゴールドクレスト	0.8	1.3	2,723	
日本エスリード	0.4	0.5	739	
日神不動産	1.4	1.7	918	
日本エスコン	1.4	1.9	760	
タカラレーベン	4.5	6.2	3,596	
サンヨーハウジング名古屋	0.5	0.7	702	
イオンモール	6.6	9.1	15,260	
ファースト住建	0.4	0.5	702	
ランド	4.8	12.8	230	
トーセイ	1.4	1.9	1,444	
穴吹興産	1	0.2	536	
エヌ・ティ・ティ都市開発	6.4	8.8	9,108	
サンフロンティア不動産	1.2	1.5	1,527	
エフ・ジェー・ネクスト	0.9	1.2	936	
インテリックス	0.2	0.3	242	
ランドビジネス	0.6	0.8	231	
グランディハウス	0.9	1.2	505	
日本空港ビルデング	3.3	4.5	17,932	
サービス業 (3.6%)				
日本工営	4	1	2,592	
ネクスト	3.1	3.7	2,678	
ジェイエイシーリクルートメント	0.7	0.9	1,319	
日本M&Aセンター	1.7	4.3	14,835	
ノバレーゼ	0.3	—	—	
アコーディア・ゴルフ	3	—	—	
中広	0.1	0.1	70	
タケエイ	1	1.3	1,342	
トラスト・テック	0.4	0.6	1,041	
コシダカホールディングス	—	0.5	1,237	
パソナグループ	0.9	1.1	871	
CDS	0.2	0.3	298	
リンクアンドモチベーション	2.6	3.5	1,732	
GCA	1	1.3	1,107	
エス・エム・エス	1.4	2.1	5,447	
テンブホールディングス	7.6	11.5	22,862	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
リニカル	0.6	0.9	1,258	
クックパッド	2.4	3.3	3,300	
エスクリ	0.5	0.5	375	
アイ・ケイ・ケイ	0.5	0.7	492	
学情	0.5	0.6	710	
スタジオアリス	0.4	0.6	1,319	
シミックホールディングス	0.5	0.8	1,196	
NJS	0.2	0.3	417	
総合警備保障	3.6	5.4	23,814	
カカコム	7.8	10.6	17,373	
アイロムグループ	0.3	0.5	688	
セントケア・ホールディング	—	0.2	344	
サイネックス	—	0.1	116	
ルネサンス	0.6	0.8	1,313	
ディップ	1.2	1.9	4,383	
オプトホールディング	0.8	1.1	983	
新日本科学	1.1	1.7	974	
ツクイ	1.3	3.5	2,457	
キャリアデザインセンター	0.2	0.3	354	
エムスリー	9.4	12.9	37,177	
ツカダ・グローバルホールディング	0.8	1.1	680	
アウトソーシング	0.6	0.9	3,325	
ウェルネット	0.8	1.1	1,381	
ワールドホールディングス	0.2	0.3	550	
ディー・エヌ・エー	4.9	6.7	17,426	
博報堂DYホールディングス	15	20.7	27,303	
ぐるなび	1.3	2.2	4,873	
エスアールジータカミヤ	1.2	1.6	929	
ジャパンベストレスキューシステム	1.3	1.8	459	
ファンコミュニケーションズ	2.8	3.8	2,785	
ライク	0.2	0.3	744	
ビジネス・ブレークスルー	—	0.5	210	
WDBホールディングス	0.4	0.5	673	
ティア	0.5	0.7	485	
パリュエコマース	1	1.4	508	
インフォマート	2.3	6.3	3,924	
J Pホールディングス	2.7	4.3	1,100	
E P Sホールディングス	1.3	1.8	2,712	
レグス	0.2	0.3	260	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
プレステージ・インターナショナル	0.9	2.1	1,740
アミューズ	0.6	0.8	1,529
ドリームインキュベータ	0.4	0.5	1,010
クイック	0.6	0.8	919
TAC	0.6	0.8	183
ケネディクス	14.6	18.9	8,429
電通	12.1	16.6	89,142
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.5	0.7	702
ぴあ	0.3	0.5	1,454
イオンファンタジー	0.4	0.4	1,248
シーティーエス	0.3	0.4	662
ネクシィーズグループ	0.4	0.5	753
みらかホールディングス	2.8	3.8	19,380
アルプス技研	0.4	0.6	1,681
サニックス	1.7	2.4	451
ダイオーズ	0.2	0.3	321
日本空調サービス	1	1.4	956
オリエンタルランド	11.7	16.1	100,431
ダスキン	2.8	3.8	9,401
明光ネットワークジャパン	1.3	1.9	2,304
ファルコホールディングス	0.5	0.7	1,038
秀英予備校	0.2	0.3	141
田谷	0.2	0.2	134
ラウンドワン	3.4	4.7	3,901
リゾートトラスト	4.6	5.8	13,044
ビー・エム・エル	0.6	2	4,984
ワタベウエディング	0.3	0.2	111
りらいあコミュニケーションズ	1.8	2.5	2,720
リソー教育	2	2.5	1,537
早稲田アカデミー	0.1	0.2	230
ユー・エス・エス	13.1	18.1	35,964
東京個別指導学院	0.5	0.5	495
サイバーエージェント	2.9	7.9	23,897
楽天	55.5	76.3	84,540
クリーク・アンド・リバー社	—	0.5	545
デー・オー・ダブリュー	0.9	1.2	802
セントラルスポーツ	0.4	0.5	1,670
フルキャストホールディングス	1.1	1.5	1,563
リゾルホールディングス	1	1	347

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
テクノプロ・ホールディングス	1.8	2.4	9,324
アトラ	0.1	0.2	146
インターワークス	0.2	0.3	363
Ke e P e r 技研	0.1	0.2	418
ファーストロジック	0.1	0.1	234
デザインワン・ジャパン	—	0.1	282
イー・ガーディアン	—	0.5	955
リブセンス	0.7	1	444
ジャパンマテリアル	0.5	1.1	1,692
ベクトル	0.3	1.2	1,497
ウチヤマホールディングス	0.6	0.7	305
サクセスホールディングス	0.1	0.1	132
キャリアリンク	0.3	0.3	223
I B J	0.8	1.2	710
アサンテ	0.4	0.5	872
N・フィールド	0.5	0.7	975
パリュエーHR	—	0.1	254
M&Aキャピタルパートナーズ	0.1	0.2	823
ライドオン・エクスプレス	0.2	0.4	377
ER I ホールディングス	0.3	0.4	322
アビスト	0.2	0.2	782
ウィルグループ	0.2	0.6	435
エスクロー・エージェント・ジャパン	0.1	0.2	335
日本ビューホテル	0.2	0.3	407
リクルートホールディングス	21.9	32.6	170,824
エラン	0.1	0.2	264
土木管理総合試験所	—	0.1	70
日本郵政	31.9	39	56,745
ベルシステム24ホールディングス	2.1	2.3	2,277
一蔵	—	0.1	132
ソラスト	0.5	0.7	986
リログループ	0.4	0.6	9,462
東祥	0.3	0.3	1,512
エイチ・アイ・エス	1.8	2.4	7,089
ラックランド	0.2	0.3	580
共立メンテナンス	0.8	1.2	8,544
イチネンホールディングス	1.1	1.6	1,868
建設技術研究所	0.7	0.9	944
スペース	0.6	0.8	1,011

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
燦ホールディングス	0.2	0.3	475	
スバル興業	1	1	528	
東京テアトル	4	6	912	
タナベ経営	—	0.3	395	
ナガワ	0.2	0.3	1,333	
よみうりランド	2	3	1,389	
東京都競馬	7	10	2,700	
常磐興産	4	0.5	814	
カナモト	1.5	2.1	6,096	
東京ドーム	4.3	6	6,444	
西尾レントオール	0.9	1.2	3,996	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	5	7	252	
トランス・コスモス	1.3	1.7	4,406	
乃村工藝社	2.3	3.2	6,182	
藤田観光	4	5	1,770	
KNT-CTホールディングス	6	8	1,112	
日本管財	0.9	1.3	2,321	
トーカイ	0.5	0.7	2,828	
白洋舎	0.1	0.1	272	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
セコム	11.3	15.5	129,812	
セントラル警備保障	0.5	0.7	1,367	
丹青社	2	2.6	2,254	
メイテック	1.3	1.8	7,830	
アサツー デイ・ケイ	1.8	2.4	7,173	
応用地質	1	1.4	2,074	
船井総研ホールディングス	1.4	1.9	3,727	
進学会	0.5	0.6	342	
オオバ	0.8	1.2	566	
学究社	0.2	0.4	641	
ベネッセホールディングス	3.6	5	16,925	
イオンデイライト	1	1.7	5,720	
ナック	0.7	0.9	886	
ニチイ学館	1.9	2.6	2,194	
ダイセキ	2	2.6	5,922	
ステップ	0.4	0.5	702	
合 計	株 数 ・ 金 額	17,058	21,606	32,077,116
	銘柄数<比率>	1,963	1,998	<96.1%>

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	
		百万円 1,234	百万円 -

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
TOPIXマザーファンド	千口 8,726	千口 8,726	千円 13,806

○投資信託財産の構成

(2017年2月14日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 32,077,116	% 95.2
TOPIXマザーファンド	13,806	0.0
コール・ローン等、その他	1,608,441	4.8
投資信託財産総額	33,699,363	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年2月14日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	33,651,951,677
コール・ローン等	1,356,673,951
株式(評価額)	32,077,116,490
TOPIXマザーファンド(評価額)	13,806,439
未収入金	143,837,970
未収配当金	46,956,827
差入委託証拠金	13,560,000
(B) 負債	267,463,337
未払金	58,759,700
未払収益分配金	188,624,384
未払信託報酬	19,893,452
未払利息	1,133
その他未払費用	184,668
(C) 純資産総額(A-B)	33,384,488,340
元本	25,489,781,689
次期繰越損益金	7,894,706,651
(D) 受益権総口数	25,489,781,689口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,097円

○損益の状況 (2016年8月16日～2017年2月14日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	209,417,608
受取配当金	209,611,591
受取利息	7,654
その他収益金	148,867
支払利息	△ 350,504
(B) 有価証券売買損益	3,500,519,655
売買益	3,952,155,410
売買損	△ 451,635,755
(C) 先物取引等取引損益	256,872,090
取引益	261,617,091
取引損	△ 4,745,001
(D) 信託報酬等	△ 20,078,120
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	3,946,731,233
(F) 前期繰越損益金	709,903,602
(G) 追加信託差損益金	3,426,696,200
(配当等相当額)	(7,709,739,915)
(売買損益相当額)	(△4,283,043,715)
(H) 計(E+F+G)	8,083,331,035
(I) 収益分配金	△ 188,624,384
次期繰越損益金(H+I)	7,894,706,651
追加信託差損益金	3,426,696,200
(配当等相当額)	(7,709,747,193)
(売買損益相当額)	(△4,283,050,993)
分配準備積立金	4,468,010,451

<注記事項>

- ①期首元本額 19,361,365,890円
 期中追加設定元本額 8,728,921,646円
 期中一部解約元本額 2,600,505,847円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3097円です。

(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) (D)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) (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。

②分配金の計算過程

項 目	2016年8月16日～ 2017年2月14日
費用控除後の配当等収益額	208,482,710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	1,019,670,726円
収益調整金額	7,709,747,193円
分配準備積立金額	3,428,481,399円
当ファンドの分配対象収益額	12,366,382,028円
1万口当たり収益分配対象額	4,851円
1万口当たり分配金額	74円
収益分配金金額	188,624,384円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金 (税込み)	74円
-----------------	-----

◆分配金は決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、2017年2月14日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

○ (参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2017年2月14日現在)

<TOPIXマザーファンド>

下記は、TOPIXマザーファンド全体(184,999,882千口)の内容です。

国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				
極洋	59	5.7	15,965	
日本水産	161.1	188.2	107,462	
マルハニチロ	28.6	27.5	90,062	
カネコ種苗	4.8	5	7,205	
サカタのタネ	20.6	21.4	67,624	
ホクト	14.2	14.7	31,752	
ホクリョウ	1.5	1.5	1,105	
鉱業 (0.3%)				
住石ホールディングス	41.1	40.2	3,939	
日鉄鉱業	39	4	23,920	
三井松島産業	91	8.9	13,723	
国際石油開発帝石	736.5	763.4	871,421	
日本海洋掘削	4.2	5.1	12,280	
石油資源開発	22.1	23	62,905	
K&Oエナジーグループ	9.4	9.7	17,780	
建設業 (2.9%)				
ショーボンドホールディングス	14.7	14	70,280	
ミライト・ホールディングス	43	44.6	46,963	
タマホーム	10.5	10.9	6,027	
サンヨーホームズ	2.9	3	1,959	
ファーストコーポレーション	—	2.4	2,215	
インバスターズクラウド	—	1.4	5,824	
ダイセキ環境ソリューション	3.2	3.4	5,633	
安藤・間	93.3	104.1	91,191	
東急建設	45.5	51.4	43,535	
コムシスホールディングス	60.1	56.6	114,501	
ミサワホーム	16.5	17.1	17,749	
ビーアールホールディングス	5.5	14.3	4,290	
高松コンストラクショングループ	10.5	10.9	28,525	
東建コーポレーション	5.7	5.4	43,308	
ソネック	1.5	1.8	1,161	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ヤマウラ	6.5	6.8	4,120	
大成建設	726	737	593,285	
大林組	419.3	434.6	462,414	
清水建設	428	443	448,759	
飛鳥建設	112.2	139.6	24,430	
長谷工コーポレーション	163.2	169.1	212,558	
松井建設	15.4	16	16,608	
銭高組	20	21	8,862	
鹿島建設	655	637	468,832	
不動テトラ	98.7	117	23,868	
大末建設	5.3	5.1	5,033	
鉄建建設	85	88	29,744	
西松建設	162	167	97,027	
三井住友建設	535.7	555.2	68,844	
大豊建設	54	53	27,719	
前田建設工業	86	91	91,273	
佐田建設	9.6	10	4,210	
ナカノフドー建設	10.7	11.1	6,415	
奥村組	133	119	83,776	
東鉄工業	16.8	17.4	54,375	
イチケン	15	13	6,149	
浅沼組	45	47	17,108	
戸田建設	163	168	111,216	
熊谷組	205	227	70,824	
青木あすなろ建設	9.2	9.5	7,657	
北野建設	29	30	9,540	
植木組	17	18	4,644	
三井ホーム	18	19	11,210	
矢作建設工業	19	19.7	21,315	
ビーエス三菱	16.6	15.3	6,012	
日本ハウスホールディングス	28.5	29.5	15,104	
大東建託	51.4	53.3	851,734	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
新日本建設	16.6	17.2	15,136	
NIPPO	32	34	72,318	
東亜道路工業	26	27	9,288	
前田道路	44	45	87,525	
日本道路	42	43	20,511	
東亜建設工業	122	11.7	22,850	
若築建設	80	83	12,533	
東洋建設	43.9	41.7	17,514	
五洋建設	155.1	160.8	84,580	
大林道路	16.3	15	9,990	
世紀東急工業	21.9	21.1	10,782	
福田組	23	23	23,713	
住友林業	96.2	99.7	157,924	
日本基礎技術	15.5	16.1	5,828	
日成ビルド工業	39	43	23,306	
ヤマダ・エスバイエルホーム	71	74	5,920	
バコーボレーション	17.4	18	6,462	
バナホーム	52	54	55,512	
大和ハウス工業	413	428.1	1,333,959	
ライト工業	26.9	27.9	32,419	
積水ハウス	467.4	456	838,584	
日特建設	15.3	12.3	5,535	
北陸電気工事	6.8	7	6,139	
ユアテック	22	23	18,423	
西部電気工業	12	2.4	5,500	
四電工	11	11	4,598	
中電工	20.2	18.3	43,846	
関電工	56	58	53,650	
きんでん	84.5	96.4	141,033	
東京エネシス	16	15	14,535	
トーエネック	20	20	11,080	
住友電設	11	10	12,760	
日本電設工業	22.8	23.6	47,223	
協和エクシオ	54.8	56.8	89,005	
新日本空調	11.8	11.2	15,299	
NDS	22	2.3	6,699	
九電工	25.6	28.1	82,164	
三機工業	31	32.1	31,875	
日揮	140.5	135.2	272,022	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
中外炉工業	42	44	9,988	
ヤマト	12.5	13	6,929	
太平電業	20	20	21,660	
高砂熟学工業	41.7	39.9	63,959	
三晃金属工業	14	1.3	4,114	
朝日工業社	16	3.3	10,164	
明星工業	25.3	26.2	16,191	
大気社	17.1	19.2	52,780	
ダイダグ	19	19	17,879	
日比谷総合設備	16.8	16.2	27,880	
東芝プラントシステム	22.7	23.5	39,809	
OSJBホールディングス	28.5	44.3	11,252	
東洋エンジニアリング	75	85	23,205	
千代田化工建設	101	105	77,280	
新興ブランテック	28.7	29.8	26,998	
食料品 (4.3%)				
日本製粉	90	43.1	71,632	
日清製粉グループ本社	153.3	158.9	264,886	
日東富士製粉	11	0.9	3,514	
昭和産業	57	60	36,180	
鳥越製粉	11.1	11.5	9,131	
中部飼料	12.9	15.9	17,982	
フィード・ワン	84.1	87.2	15,172	
東洋精糖	21	22	2,552	
日本甜菜製糖	71	7.4	17,826	
三井製糖	55	10.2	26,356	
塩水港精糖	14.9	15.5	3,890	
日新製糖	5.9	6.1	10,656	
森永製菓	125	28.3	132,727	
中村屋	32	3.4	17,408	
江崎グリコ	32.3	36.2	188,240	
名糖産業	6.2	6.2	8,680	
不二家	80	83	18,924	
山崎製パン	102.4	106.1	240,104	
第一屋製パン	21	22	2,882	
モロゾフ	21	22	11,198	
亀田製菓	7.8	8.1	40,338	
寿スピリッツ	9.9	10.3	27,233	
カルビー	51.8	59.1	216,897	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
森永乳業	125	130	95,290	
六甲バター	6.2	6.5	15,652	
ヤクルト本社	75	77.7	477,855	
明治ホールディングス	82.8	85.8	755,898	
雪印メグミルク	32.9	31.3	92,022	
ブリマハム	88	91	39,494	
日本ハム	103	98	299,390	
林兼産業	45	4.7	4,131	
丸大食品	72	69	33,948	
S Foods	8.8	7.8	25,194	
伊藤ハム米久ホールディングス	83.5	83.6	89,117	
サッポロホールディングス	45.8	47.5	133,712	
アサヒグループホールディングス	262.3	271.9	1,066,391	
キリンホールディングス	602	623.9	1,135,186	
宝ホールディングス	101.2	104.9	114,131	
オエノンホールディングス	36	37	9,842	
養命酒製造	4.3	4.5	8,347	
コカ・コーラウエスト	47.4	49.1	152,946	
コカ・コーライーストジャパン	54.4	56.4	131,186	
サントリー食品インターナショナル	95.8	99.3	449,332	
ダイドーグループホールディングス	7.1	6.7	37,520	
伊藤園	41.5	43	159,960	
キーコーヒー	12.3	12.8	27,584	
ユニカフェ	3.8	3.9	3,841	
ジャパンフーズ	1.8	1.8	2,415	
日清オイリオグループ	74	84	46,116	
不二製油グループ本社	37.3	38.7	89,745	
かどや製油	1.4	1.4	6,755	
J-オイルミルズ	58	6.7	26,900	
キッコーマン	106	101	342,390	
味の素	294	298.5	676,998	
キューピー	71.1	73.7	216,088	
ハウス食品グループ本社	47.8	53.6	128,479	
カゴメ	50.2	52	150,124	
焼津水産化学工業	6.6	6.8	8,364	
アリアケジャパン	11.4	11.9	74,256	
ビエトロ	1.4	1.7	2,810	
エバラ食品工業	3.3	3.5	7,280	
ニチレイ	149	71.3	181,529	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東洋水産	68.7	71.2	278,748	
イトアンド	1.5	1.6	3,612	
大冷	—	1.1	1,959	
日清食品ホールディングス	59.2	56.6	339,034	
永谷園ホールディングス	13	14	19,992	
一正蒲鉾	4.9	5	5,835	
フジッコ	13.6	14.1	34,418	
ロック・フィールド	14.5	14	23,464	
日本たばこ産業	774.9	803.1	2,993,153	
ケンコーマヨネーズ	4.5	5.9	16,177	
わらべや日洋ホールディングス	7.5	8.5	21,309	
なとり	7	7.2	13,363	
北の達人コーポレーション	2.6	3.1	1,887	
ユーグレナ	44.8	46.7	58,701	
ミヨシ油脂	48	50	7,050	
理研ビタミン	4.1	4.3	18,554	
繊維製品 (0.7%)				
片倉工業	16.4	17	23,205	
グンゼ	106	101	42,824	
東洋紡	517	536	103,984	
ユニチカ	380	371	33,019	
富士紡ホールディングス	64	6.6	21,516	
倉敷紡績	132	137	32,058	
シキボウ	80	73	11,023	
日本毛織	36.9	38.2	34,418	
ダイトボウ	19	18	1,314	
トーア紡コーポレーション	5.5	5.7	3,123	
ダイドーリミテッド	14.6	15.1	6,674	
帝国繊維	13.7	14.2	23,401	
帝人	534	110.7	235,458	
東レ	948	983	962,946	
サカイオーベックス	34	3.3	6,194	
住江織物	33	37	10,212	
日本フェルト	6.9	7.8	4,071	
イチカワ	9	9	2,673	
日東製網	14	1.5	2,854	
芦森工業	28	—	—	
アツギ	101	111	14,097	
ダイニック	25	26	4,992	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
セーレン	32.6	33.7	54,223	
ソトー	4.9	5	5,850	
東海染工	18	19	2,736	
小松精練	20.1	19.1	13,923	
ワコールホールディングス	78	81	115,344	
ホギメディカル	8.2	8.5	56,695	
レナウン	35.3	36.6	4,172	
クラウディア	3	3.1	1,689	
T S I ホールディングス	58.3	55.8	46,258	
三陽商会	68	71	12,638	
ナイガイ	48	49	3,185	
オンワードホールディングス	85	88	74,976	
ルック	24	25	4,750	
キムラタン	545	572	4,004	
ゴールドウイン	5.5	5.7	32,205	
デサント	29.8	30.9	37,821	
キング	6.5	6.7	2,767	
ヤマトインターナショナル	8	8.3	3,411	
パルプ・紙 (0.3%)				
特種東海製紙	76	7.9	33,298	
王子ホールディングス	511	530	274,540	
日本製紙	67.6	60.7	121,764	
三菱製紙	199	19.3	14,899	
北越紀州製紙	81.1	75.6	56,019	
中越パルプ工業	52	54	12,960	
巴川製紙所	20	21	5,145	
大王製紙	57.9	54	69,390	
阿波製紙	—	2.5	1,492	
レンゴー	116	130.6	86,065	
トーモク	41	43	14,319	
ザ・バック	9.3	9.6	29,328	
化学 (6.7%)				
クラレ	220	228	383,268	
旭化成	815	845	922,740	
共和レザー	8.5	7.9	7,181	
昭和電工	87	90.2	175,799	
住友化学	962	997	622,128	
日本化成	24	—	—	
住友精化	27	5.6	27,300	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日産化学工業	78.1	74.2	291,235	
ラサ工業	49	51	7,242	
クレハ	99	10.2	50,847	
多木化学	9	9	8,415	
テイカ	22	21	15,246	
石原産業	235	24.3	25,320	
片倉コープアグリ	16	18	4,320	
日東エフシー	7.6	7.9	7,441	
日本曹達	84	81	52,974	
東ソー	353	392	373,184	
トクヤマ	217	211	117,527	
セントラル硝子	142	138	73,554	
東亜合成	81.8	84.8	108,968	
大阪ソーダ	56	58	28,710	
関東電化工業	31	28	31,724	
デンカ	271	281	170,848	
信越化学工業	234.4	242.9	2,340,341	
日本カーバイド工業	44	46	7,406	
堺化学工業	53	51	21,012	
エア・ウォーター	108	111.7	244,623	
大陽日酸	100.7	104.3	149,357	
日本化学工業	48	50	12,000	
日本パーカライジング	66.8	69.2	100,063	
高圧ガス工業	19	20.1	15,436	
チタン工業	15	16	3,088	
四国化成工業	19	20	22,780	
戸田工業	26	27	7,641	
ステラ ケミファ	6.7	6.4	23,712	
保土谷化学工業	39	4.7	17,084	
日本触媒	19	21.3	164,862	
大日精化工業	50	56	41,328	
カネカ	176	183	165,249	
三菱瓦斯化学	225	126.2	297,074	
三井化学	554	616	320,320	
J S R	122.6	136.2	279,210	
東京応化工業	26.2	25.4	95,885	
大阪有機化学工業	8.7	8.8	8,333	
三菱ケミカルホールディングス	875.4	912.6	750,430	
KHネオケム	—	16.6	22,791	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本合成化学工業	30	—	—	—
ダイセル	176.3	182.7	248,837	
住友ベークライト	115	119	81,158	
積水化学工業	296.7	307.5	575,640	
日本ゼオン	110	114	150,708	
アイカ工業	39.3	43.4	127,639	
宇部興産	699	682	186,186	
積水樹脂	20.2	20.9	38,685	
タキロン	30	28	15,092	
旭有機材	42	44	10,516	
日立化成	64.6	75.3	246,607	
ニチバン	13	13	12,597	
リケンテクノス	28.2	29.2	15,943	
大倉工業	31	32	17,472	
積水化成製品工業	33	19.3	15,980	
群栄化学工業	35	3.3	11,715	
タイガースポリマー	6.4	6.7	5,674	
ミライアル	4.7	4.9	4,508	
ダイキアクシス	2.2	2.2	2,822	
ダイキョーニシカワ	16.8	23.7	33,488	
日本化薬	85	88	137,896	
カーリットホールディングス	12.1	12.6	7,282	
日本精化	10.8	11.2	10,550	
扶桑化学工業	8.3	9.6	29,856	
ADEKA	64.3	58.3	91,006	
日油	98	109	139,520	
新日本理化	20.6	21.4	3,210	
ハリマ化成グループ	11.1	11.5	9,280	
花王	331.9	344.1	1,945,885	
第一工業製薬	29	30	13,470	
日華化学	—	4.3	5,293	
ニイタカ	1.9	2	2,896	
三洋化成工業	41	8.5	41,607	
有機合成薬品工業	—	8.8	2,411	
大日本塗料	75	78	18,252	
日本ペイントホールディングス	100.9	104.5	372,020	
関西ペイント	147.9	142.3	316,617	
神東塗料	10	10	2,200	
中国塗料	37	38.8	33,872	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本特殊塗料	9.1	9.5	16,634	
藤倉化成	17.7	18.4	12,272	
太陽ホールディングス	9.6	11	52,140	
D I C	51.6	53.5	193,937	
サカタインクス	26.7	27.7	42,020	
東洋インキSCホールディングス	129	134	74,906	
T&K TOKA	9.5	9.8	10,721	
富士フィルムホールディングス	299.1	268.6	1,168,678	
資生堂	248	257	739,389	
ライオン	162	168	320,544	
高砂香料工業	8.6	8.9	31,773	
マダム	12.2	13.6	70,720	
ミルボン	7.1	7.3	38,325	
ファンケル	30.3	28.8	46,425	
コーセー	21.1	21.9	200,166	
コタ	4.5	5.1	6,670	
シーズ・ホールディングス	16.5	17.6	57,464	
シーボン	1.5	1.5	3,826	
ポーラ・オルビスホールディングス	13.3	13.8	143,382	
ノエビアホールディングス	8.2	8.5	34,765	
アジュバンコスメジャパン	2.5	2.6	2,527	
エステー	8.9	9.2	16,385	
アグロ カネショウ	5.1	5.2	6,567	
コニシ	20.5	21.3	28,840	
長谷川香料	16.5	17.1	33,687	
星光PMC	7.1	7.4	8,643	
小林製薬	39.5	37.6	195,144	
荒川化学工業	11.1	11.6	22,608	
メック	10.1	10.5	11,823	
日本高純度化学	3.7	3.8	9,329	
タカラバイオ	28	29	44,544	
J C U	3.8	4.2	28,644	
新田ゼラチン	8.5	8.1	6,058	
OATアグリオ	1.5	1.6	2,336	
デクセリアルズ	39.1	35.5	46,150	
アース製薬	9.4	9.7	48,160	
イハラケミカル工業	18.1	18.7	19,354	
北興化学工業	13	13	6,214	
大成ラミック	3.7	3.8	11,951	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
クミアイ化学工業	27	27.9	18,665	
日本農薬	29.8	30.9	20,455	
アキレス	107	11.1	19,846	
有沢製作所	19.3	22.9	16,877	
日東電工	101	97.7	939,092	
レック	4.1	4.2	19,572	
きもと	21.2	24.2	5,904	
藤森工業	11.2	10.1	30,300	
前澤化成工業	9.1	8.8	10,533	
J S P	8.5	6.3	16,411	
エフピコ	11.6	12	62,640	
天馬	9.7	8.9	19,304	
信越ポリマー	25.6	26.5	22,578	
東リ	34	32.2	12,815	
ニフコ	25	23.7	132,246	
日本バルカー工業	51	10.5	19,173	
ユニ・チャーム	264.6	274.2	696,468	
医薬品 (4.8%)				
協和発酵キリン	156.3	162	260,172	
武田薬品工業	520.5	507.8	2,624,818	
アステラス製薬	1,418.6	1,383.8	2,117,214	
大日本住友製薬	92.5	95.9	186,141	
塩野義製薬	190.5	183.3	991,653	
田辺三菱製薬	152.3	157.8	363,729	
わかもと製薬	15	15	3,795	
あすか製薬	16.6	14.7	25,151	
日本新薬	29.9	31	185,380	
ビオフェルミン製薬	2.1	2.2	6,644	
中外製薬	130.1	134.8	507,522	
科研製薬	22.5	25.3	145,728	
エーザイ	160.9	166.7	1,030,539	
ロート製薬	64	66.3	141,020	
小野薬品工業	296.8	307.6	770,384	
久光製薬	40.6	38.2	229,200	
有機合成薬品工業	8.5	—	—	
持田製薬	8.9	9.3	77,004	
参天製薬	240.7	244.6	396,496	
扶桑薬品工業	44	4.6	13,160	
日本ケミファ	18	1.9	10,583	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ツムラ	41.1	45.5	148,330	
日医工	30.6	31.7	54,682	
キッセイ薬品工業	23.1	24	67,536	
生化学工業	24.2	25.1	43,096	
栄研化学	11	11.4	34,040	
日水製薬	5.2	5.4	7,187	
鳥居薬品	8.9	9.3	25,974	
J C R ファーマ	10	10.4	29,203	
東和薬品	6	6.2	29,915	
富士製薬工業	4.2	4.4	13,552	
沢井製薬	22.2	23	137,540	
ゼリア新薬工業	26.8	27.7	46,840	
第一三共	439.5	398.6	1,029,185	
キョーリン製薬ホールディングス	34.8	33.1	76,560	
大幸薬品	6.4	6.7	11,785	
ダイト	7.3	8	17,824	
大塚ホールディングス	281	291.2	1,542,486	
大正製薬ホールディングス	31.4	29	267,960	
ペプチドリーム	21.9	25.3	143,704	
石油・石炭製品 (0.6%)				
日本コークス工業	105.4	109.3	11,257	
昭和シェル石油	116.8	121.1	134,178	
ニチレキ	16	16.5	14,619	
東燃ゼネラル石油	213	220	294,360	
ユシロ化学工業	7	7.3	10,570	
ビービー・カストロール	5.3	5.5	9,718	
富士石油	30.3	31.4	12,183	
MORESCO	4.1	4.7	8,159	
出光興産	68.2	64.2	225,021	
J Xホールディングス	1,546.9	1,503.1	804,158	
コスモエネルギーホールディングス	39.4	40.8	80,090	
ゴム製品 (0.9%)				
横浜ゴム	78.8	81.7	174,838	
東洋ゴム工業	69	71.5	95,881	
ブリヂストン	441	457.1	1,951,817	
住友ゴム工業	122.3	126.8	239,525	
藤倉ゴム工業	10.9	11.3	7,808	
オカモト	40	41	44,895	
フコク	4.8	5.7	5,318	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニッタ	14.1	12.2	37,027
住友理工	28.2	25.1	29,116
三ツ星ベルト	32	33	33,330
バンドー化学	48	24.6	25,707
ガラス・土石製品 (1.0%)			
日東紡績	86	109	53,846
旭硝子	644	667	608,304
日本板硝子	630	61.7	52,074
石塚硝子	18	19	4,902
日本山村硝子	52	54	11,286
日本電気硝子	270	280	195,720
オハラ	4.9	5.1	5,360
住友大阪セメント	259	251	113,954
太平洋セメント	831.537	817	345,591
日本ヒューム	12.5	13	9,295
日本コンクリート工業	26.9	30.2	10,539
三谷セキサン	6.5	6.8	17,911
アジアバイルホールディングス	16.1	16.6	9,594
東海カーボン	122	126.5	61,605
日本カーボン	64	67	20,368
東洋炭素	7.2	7.5	14,640
ノリタケカンパニーリミテド	74	7.6	22,116
TOTO	96	99.5	417,402
日本碍子	165	171	414,675
日本特殊陶業	112.6	116.7	298,752
ダントーホールディングス	10	11	2,112
MARUWA	4.8	5	19,200
品川リフラクトリーズ	33	34	9,860
黒崎播磨	28	29	12,673
ヨータイ	7	8	3,128
イソライト工業	6.4	6.6	2,844
東京窯業	15.9	16.4	3,394
ニッカトー	4.6	4.4	1,870
フジミインコーポレーテッド	11.1	11.5	30,728
エーアンドエーマテリアル	27	28	3,696
ニチアス	67	71	79,378
ニチハ	17.4	18	56,250
鉄鋼 (1.4%)			
新日鐵住金	589.1	610.6	1,717,312

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	2,400	234.1	263,830
中山製鋼所	147	15.2	12,038
合同製鐵	73	7.6	14,440
ジェイ エフ イー ホールディングス	357.1	370.1	801,081
日新製鋼	59.6	61.8	97,458
東京製鐵	72.1	68.5	73,295
共英製鋼	13.9	14.4	31,665
大和工業	28.8	27.2	93,296
東京鐵鋼	27	28	13,244
大阪製鐵	8.2	8.5	19,057
淀川製鋼所	19.4	18.7	63,673
東洋鋼板	31.2	32.4	14,936
丸一鋼管	43.7	45.3	164,439
モリ工業	21	4.3	10,135
大同特殊鋼	219	227	129,844
日本高周波鋼業	51	47	4,042
日本冶金工業	96.1	112	26,320
山陽特殊製鋼	78	81	50,463
愛知製鋼	77	8	39,240
日立金属	149.6	137.8	228,885
日本金属	34	3.2	4,246
大太平洋金属	91	86	34,400
新日本電工	73.9	76.6	24,665
栗本鐵工所	62	6.5	15,951
虹技	18	19	4,826
日本鑄鉄管	14	13	2,639
三菱製鋼	91	94	24,252
日亜鋼業	18	18.7	5,254
日本精練	9	9	5,571
シンニッタン	11.7	11	7,964
新家工業	26	29	4,988
非鉄金属 (1.0%)			
大紀アルミニウム工業所	20	23	12,098
日本軽金属ホールディングス	295.7	330	93,720
三井金属鉱業	333	368	136,528
東邦亜鉛	68	76	47,424
三菱マテリアル	815	84.5	324,902
住友金属鉱山	361	350	574,350
DOWAホールディングス	168	149	146,616

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
古河機械金属	204	211	49,585	
エス・サイエンス	59.3	61.5	2,337	
大阪チタニウムテクノロジーズ	12.8	14.8	28,741	
東邦チタニウム	22.1	22.9	21,182	
UACJ	183	172	55,040	
古河電気工業	411	45.4	184,551	
住友電気工業	522.9	510.1	952,866	
フジクラ	182	178.2	150,222	
昭和電線ホールディングス	155	161	14,812	
東京特殊電線	1.8	1.9	2,979	
タツタ電線	27.2	25.4	11,658	
沖電線	15	14	3,542	
カナレ電気	1.8	1.9	4,297	
平河ヒューテック	6.1	6.4	7,244	
リョービ	80	83	41,583	
アーレスティ	15.1	15.7	17,898	
アサヒホールディングス	19.7	20.4	40,677	
金属製品 (0.7%)				
稲葉製作所	6.9	7.2	9,576	
宮地エンジニアリンググループ	40	39	8,658	
トーカロ	9.2	8.9	24,501	
アルファCo	4.3	4.5	5,940	
SUMCO	136.4	141.3	248,688	
川田テクノロジーズ	2.5	2.6	20,982	
RS Technologies	—	0.5	2,282	
東洋製織グループホールディングス	92.8	96.2	202,982	
ホッカンホールディングス	34	35	19,040	
コロナ	6.8	7.1	8,370	
横河ブリッジホールディングス	24.7	23.8	33,034	
駒井ハルテック	23	2.6	5,600	
高田機工	11	12	2,892	
三和ホールディングス	129.6	134.4	144,614	
文化シャッター	36.4	37.7	32,271	
三協立山	17.1	17.7	30,408	
アルインコ	9.8	9.3	9,625	
東洋シャッター	3.2	3.3	2,108	
LIXILグループ	181.9	188.6	512,426	
日本フィルコン	9.4	9.8	5,556	
ノーリツ	25.6	26.5	55,305	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
長府製作所	13.9	14.4	37,728	
リンナイ	24.3	23.1	205,590	
ダイニチ工業	6.6	6.9	5,023	
日東精工	19	19.3	8,279	
三洋工業	16	17	3,366	
岡部	27.1	28.1	27,088	
ジーテクト	13.6	14.1	30,413	
中国工業	2	1.9	1,322	
東プレ	25.1	26	73,424	
高周波熱練	24.3	25.1	23,694	
東京製網	88	9.1	16,307	
サンコール	6.9	7.2	4,060	
モリテック スチール	6.6	6.8	2,006	
パイオラックス	6.6	6.8	54,944	
日本発條	122.9	127.4	163,199	
中央発條	17	15	5,055	
アドバネクス	2.4	2.3	4,399	
立川ブラインド工業	5.4	5.6	5,062	
三益半導体工業	9.6	11.4	20,292	
機械 (5.1%)				
日本ドライケミカル	1.7	1.7	3,877	
日本製鋼所	216	44.7	92,216	
三浦工業	58.2	55.3	98,157	
タクマ	48	43.3	43,689	
ツガミ	38	36	24,876	
オークマ	85	88	104,984	
東芝機械	71	80	39,040	
アマダホールディングス	190.4	182.2	236,860	
アイダエンジニアリング	34.2	38.4	43,123	
滝澤鉄工所	41	40	6,920	
富士機械製造	42.6	41.2	63,159	
牧野フライス製作所	65	67	70,149	
オーエスジー	59.5	61.7	146,660	
ダイジェット工業	15	16	2,896	
旭ダイヤモンド工業	35.2	38.7	35,371	
DMG森精機	77.3	80.1	127,839	
ソディック	33.1	34.3	36,152	
デイスコ	16.6	15.8	267,336	
日東工器	7.6	7.9	19,876	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
バンチ工業	5.1	4.9	4,988	
豊和工業	7.3	7.6	5,137	
OKK	50	49	6,223	
石川製作所	32	3.3	2,587	
東洋機械金属	9.6	9.1	5,232	
津田駒工業	29	30	5,460	
エンシュウ	32	33	3,201	
島精機製作所	18.4	17.6	68,904	
NCホールディングス	4.2	4.4	4,114	
フリー	2.6	2.7	12,811	
ヤマシンフィルタ	2.5	2.6	4,469	
日阪製作所	16.5	18.4	16,596	
やまびこ	23.9	24.8	38,266	
ベガサスミシン製造	13.5	13	10,387	
ナプテスコ	67.9	70.3	223,554	
三井海洋開発	13.1	13.6	34,258	
レオン自動車	11	11.4	13,041	
SMC	39.2	40.6	1,281,336	
新川	11.7	11.3	9,254	
ホソカワミクロン	22	22	18,502	
ユニオンツール	5.6	5.8	19,633	
オイレス工業	16.9	17.5	35,840	
日精エー・エス・ビー機械	4.2	4.3	10,178	
サトーホールディングス	17.6	16.8	42,655	
日本エアータック	4.2	4.4	2,895	
日精樹脂工業	9.5	10.7	11,577	
オカダアイヨン	2.5	2.8	3,217	
ワイエイシイ	5.2	5.1	6,788	
小松製作所	640.2	624.5	1,757,030	
住友重機械工業	381	395	319,160	
日立建機	58.3	60.5	161,898	
日工	20	4.1	8,536	
巴工業	5.3	5.5	10,604	
井関農機	134	138	31,878	
TOWA	12.6	11.1	21,289	
丸山製作所	27	28	5,460	
北川鉄工所	60	6.2	15,190	
ロツェ	—	4.8	10,641	
タカキタ	4.3	4.5	2,529	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
クボタ	627	647.9	1,194,403	
荏原実業	3.6	3.8	5,168	
三菱化工機	43	44	9,724	
月島機械	24.7	25.7	33,204	
帝国電機製作所	9.5	9.8	10,270	
東京機械製作所	49	51	3,876	
新東工業	29.6	30.7	32,542	
澁谷工業	10.9	11.3	31,594	
アイチ コーポレーション	18.5	19.1	17,094	
小森コーポレーション	31.7	32.5	49,530	
鶴見製作所	9.7	10.1	15,402	
住友精密工業	21	21	7,455	
酒井重工業	25	26	8,840	
荏原製作所	289	61.3	202,903	
石井鐵工所	19	2	3,540	
西島製作所	13.9	13.2	14,916	
北越工業	14	14.5	13,137	
ダイキン工業	181.7	176.6	1,904,631	
オルガノ	22	26	13,208	
トーヨーカネツ	63	62	21,638	
栗田工業	78.5	76.6	210,267	
椿本チエイン	74	77	72,919	
大同工業	26	27	7,479	
木村化工機	11.2	11.6	3,978	
アネスト岩田	21	23.5	25,333	
ダイフク	67	64.5	169,699	
サムコ	3.1	3.2	3,516	
加藤製作所	30	7.1	19,972	
油研工業	24	25	5,600	
タダノ	60.2	67.6	97,411	
フジテック	36.3	37.7	49,311	
CKD	34.7	38.7	57,082	
キトー	15.7	16.3	20,130	
平和	38.7	40.1	113,402	
理想科学工業	13.8	12.8	26,944	
SANKYO	34.7	36	143,280	
日本金銭機械	11.5	11.9	18,314	
マースエンジニアリング	7	7.3	16,775	
福島工業	7.7	8	29,520	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
オーイズミ	5.2	5.4	3,785
ダイコク電機	5.2	5.3	9,174
竹内製作所	24.7	23.6	55,153
アマノ	38.6	40	88,960
JUKI	19.7	20.4	26,356
サンデンホールディングス	76	79	28,756
蛇の目マシン工業	12.1	12.5	10,075
マックス	19	20	31,360
グローリー	42.5	41.3	156,733
新晃工業	8.7	9	12,546
大和冷機工業	20	20.8	20,987
セガサミーホールディングス	134.1	128.3	221,830
日本ビストンリング	5.2	5	11,740
リケン	58	6	26,250
TPR	15.4	14.5	48,792
ツバキ・ナカシマ	13.9	14.5	28,260
ホシザキ	27.4	28.4	242,536
大豊工業	10.1	10.5	16,201
日本精工	256.3	265.6	407,430
NTN	309	299	159,367
ジェイテクト	133	137.8	254,930
不二越	126	130	76,570
日本トムソン	42.7	41.3	23,169
THK	83	91.4	271,183
ユースン精機	4.8	5.7	17,784
前澤給装工業	5.1	4.9	7,443
イーグル工業	15.4	14	21,168
前澤工業	9.1	8.6	2,829
日本ビラー工業	12.6	13.1	19,571
キッツ	55.6	62.1	41,234
日立工機	33.4	34.9	30,293
マキタ	81.4	84.3	651,639
日立造船	98.9	102.5	64,267
三菱重工業	2,222	2,168	988,824
IHI	959	994	335,972
スター精密	—	22.7	38,635
電気機器 (12.6%)			
日清紡ホールディングス	69.3	71.8	79,913
イビデン	76.4	90.5	174,212

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コニカミノルタ	311.6	302.8	333,988
ブラザー工業	161.3	167.2	330,721
ミネベアミツミ	201	235.3	332,714
日立製作所	3,183	3,105	1,964,533
東芝	2,627	2,893	664,811
三菱電機	1,331	1,379.6	2,312,899
富士電機	376	390	252,720
東洋電機製造	25	5.5	9,383
安川電機	155	149.9	318,087
シンフォニアテクノロジー	81	84	26,460
明電舎	115	119	44,625
オリジン電気	18	19	5,985
山洋電気	33	34	29,716
デンヨー	11.5	11.9	21,705
東芝テック	89	81	51,354
芝浦メカトロニクス	20	21	6,069
マブチモーター	35.2	36.5	220,825
日本電産	150.2	167.6	1,775,722
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1.5	1.5	4,438
東光高岳	6.9	6.5	14,176
ダブル・スコープ	12	12.4	23,684
宮越ホールディングス	4.2	4.4	2,222
ダイヘン	74	71	50,623
田淵電機	14.1	19.5	6,727
ヤママン	1.6	1.6	9,872
JVCケンウッド	91.5	94.9	28,564
ミマキエンジニアリング	11.2	11.6	9,280
第一精工	5.8	6	9,420
日新電機	29.2	26	35,698
大崎電気工業	23	26	27,846
オムロン	140.9	137.5	679,250
日東工業	20	19	29,260
I D E C	16.3	16.9	19,046
不二電機工業	1.2	1.4	1,981
ジーエス・ユアサ コーポレーション	240	249	121,512
サクサホールディングス	31	33	7,656
メルコホールディングス	6.9	7.1	23,927
テクノメディカ	2.8	2.9	6,298
日本電気	1,716	1,778	480,060

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
富士通	1,203	1,247	807,931	
沖電気工業	541	56	88,760	
岩崎通信機	59	57	5,130	
電気興業	33	37	21,349	
サンケン電気	68	76	39,292	
ナカヨ	12	13	5,408	
アイホン	7.1	7.3	13,490	
ルネサスエレクトロニクス	64.6	66.9	70,780	
セイコーエプソン	185.8	192.6	486,315	
ワコム	96.8	100.3	39,919	
アルバック	22.9	21.8	103,441	
アクセル	5.6	5.4	4,509	
E I Z O	12.3	12.8	42,048	
ジャパンディスプレイ	233	241.5	74,140	
日本信号	34.4	35.7	39,519	
京三製作所	29	30	12,060	
能美防災	14.1	14.7	22,211	
ホーチキ	9	9.4	13,385	
エレコム	10.8	11.2	22,568	
日本無線	37	7.9	10,902	
パナソニック	1,425.6	1,477.6	1,825,574	
アンリツ	74.9	94.3	81,286	
富士通ゼネラル	38	44	96,008	
日立国際電気	28.5	33.8	85,649	
ソニー	880.5	913.2	3,261,950	
TDK	75.3	72.9	565,704	
帝国通信工業	29	29	5,336	
ミツミ電機	47.5	—	—	
タムラ製作所	48	50	22,600	
アルプス電気	107.5	119.4	405,960	
池上通信機	40	41	6,396	
バイオニア	201.9	194.3	46,826	
日本電波工業	11.3	12.5	10,525	
鈴木	4.8	5	2,895	
日本トリム	3.4	3.1	12,570	
ローランド ディー. ジー.	6.4	6.6	23,199	
フォスター電機	15.7	15.1	28,478	
クラリオン	66	68	29,648	
SMK	35	33	13,893	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ヨコオ	8.9	9.2	12,456	
ティアック	90	93	4,278	
ホシデン	37.8	39.2	39,435	
ヒロセ電機	20.2	20.9	309,738	
日本航空電子工業	36	37	55,426	
TOA	14.7	15.3	15,942	
日立マクセル	20.7	19.3	43,386	
古野電気	14.8	16.6	12,715	
ユニデンホールディングス	39	38	6,498	
アルパイン	29.7	30.8	53,345	
スミダコーポレーション	10.2	10.6	13,059	
アイコム	6.9	7.2	17,013	
リオン	4.8	4.9	7,722	
本多通信工業	3.3	4.1	5,297	
船井電機	12.6	14.5	13,412	
横河電機	124.9	140.2	240,162	
新電元工業	44	50	23,550	
アズビル	40.7	39.2	139,160	
東亜ディーケーケー	6.9	6.4	3,552	
日本光電工業	52.1	54	137,376	
チノー	4.4	4.6	5,561	
共和電業	14.1	14.6	6,526	
日本電子材料	4.9	5.1	3,228	
堀場製作所	24.7	25.6	152,320	
アドバンテスト	85	88.2	182,397	
小野測器	6	6.3	5,588	
エスベック	12.9	11.5	15,030	
パナソニック デバイスSUNX	10.9	11.3	9,424	
キーエンス	28.3	58.6	2,554,960	
日置電機	6.5	6.8	14,851	
シスメックス	96.9	100.5	642,195	
日本マイクロニクス	23.3	24.1	22,196	
メガチップス	12.5	12	34,116	
OBARA GROUP	7.3	7.5	37,725	
澤藤電機	7	8	1,808	
コーセル	17.3	17.9	24,558	
イリソ電子工業	3.9	4.1	29,479	
新日本無線	9.1	11	4,510	
オブテックスグループ	9.2	9.8	29,047	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
千代田インテグレ	6.6	6.8	16,483	
アイ・オー・データ機器	3.9	4	4,944	
レーザーテック	14.6	14.2	39,518	
スタンレー電気	89.2	92.2	289,508	
岩崎電気	42	47	8,272	
ウシオ電機	75.7	78.5	113,118	
岡谷電機産業	6.7	6.9	2,877	
ヘリオス テクノ ホールディング	10.6	11.9	7,104	
日本セラミック	10.2	10.6	23,489	
遠藤照明	6.3	6.5	6,058	
日本デジタル研究所	10.5	—	—	
古河電池	9	9	6,651	
双信電機	6	6.3	1,852	
山一電機	10.8	12.2	16,665	
図研	9	8.4	10,390	
日本電子	49	47	25,662	
カシオ計算機	125.1	104	158,080	
ファナック	126.5	131.1	2,920,908	
日本シイエムケイ	26.9	27.9	17,660	
エンプラス	6.4	5.9	20,561	
大真空	23	4.7	6,984	
ローム	60.3	62.5	478,750	
浜松ホトニクス	97.4	100.9	343,564	
三井ハイテック	18.1	17.1	15,219	
新光電気工業	47.1	48.9	38,093	
京セラ	204.8	212.3	1,320,081	
太陽誘電	60.7	62.9	94,727	
村田製作所	131.6	135.7	2,147,452	
ユージン	16.5	17.2	13,760	
双葉電子工業	20.4	21.1	42,052	
北陸電気工業	50	52	7,280	
ニチコン	39.3	40.7	41,473	
日本ケミコン	101	111	33,744	
KOA	17.3	17.9	24,254	
市光工業	30	27	14,391	
小糸製作所	74.8	77.5	449,500	
ミツバ	21.2	23.8	53,811	
スター精密	23.7	—	—	
SCREENホールディングス	128	26.5	205,110	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
キヤノン電子	11.4	11.9	21,039	
キヤノン	671.8	696.3	2,290,827	
リコー	404	388.9	388,900	
MUTOHホールディングス	15	18	4,788	
東京エレクトロン	102.4	86.2	1,005,092	
輸送用機器 (9.4%)				
トヨタ紡織	43.6	45.2	107,124	
芦森工業	—	29	4,901	
鬼怒川ゴム工業	29	—	—	
ユニプレス	25.9	24.9	57,693	
豊田自動織機	113.6	117.8	638,476	
モリタホールディングス	21.8	22.6	35,662	
三櫻工業	15.8	16.4	14,104	
デンソー	308.3	318.9	1,609,169	
東海理化電機製作所	36.5	34.1	75,531	
三井造船	483	467	82,192	
川崎重工業	971	1,006	367,190	
名村造船所	37.4	38.8	31,466	
サノヤスホールディングス	15.2	15.7	4,411	
日本車輛製造	51	47	14,100	
ニチユ三菱フォークリフト	14.4	14.9	10,698	
近畿車輛	19	1.9	5,090	
日産自動車	1,701.1	1,525.4	1,703,871	
いすゞ自動車	361.6	374.8	573,631	
トヨタ自動車	1,590.69	1,572.3	10,147,624	
日野自動車	178.1	184.6	246,441	
三菱自動車工業	495.4	474	322,794	
エフテック	6.6	6.8	8,955	
レシップホールディングス	4.1	4.2	3,645	
GMB	2	2.1	2,631	
ファルテック	2.2	2.2	3,110	
武蔵精密工業	13.3	15	47,175	
日産車体	60.9	56.8	62,764	
新明和工業	54	52	62,920	
極東開発工業	24.8	25.7	44,923	
日信工業	27.9	28.9	57,713	
トビー工業	103	10.6	34,874	
ティラド	48	50	15,400	
曙ブレーキ工業	63.2	60.1	16,166	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タチエス	19.8	22	45,166
NOK	60.4	62.6	159,254
フタバ産業	38	39.4	29,589
KYB	140	145	89,030
大同メタル工業	17.4	16.2	16,848
プレス工業	66.3	68.7	37,716
ミクニ	15.8	16.4	7,101
カルソニックカンセイ	95	88	159,280
太平洋工業	27.7	26.6	37,718
ケーヒン	28.7	29.7	57,736
河西工業	15.3	17.5	23,905
アイシン精機	127.9	118.3	655,382
富士機工	14.4	12.8	6,540
マツダ	395.1	409.5	648,443
今仙電機製作所	11.4	11.8	11,776
本田技研工業	1,122.9	1,163.8	4,189,680
スズキ	228.3	256.3	1,142,841
富士重工業	394.3	401.5	1,748,532
安永	4.1	4.7	8,474
ヤマハ発動機	176.2	182.7	467,529
ショーワ	32.4	33.6	32,020
TBK	14.8	16.5	8,976
エクセディ	16.9	17.6	55,704
豊田合成	45.3	41.8	117,123
愛三工業	21.9	22.7	21,565
盟和産業	2	2	2,380
ヨロズ	11.6	12.1	20,497
エフ・シー・シー	20.4	21.1	47,854
シマノ	50.3	52.1	919,044
タカタ	22.6	23.4	12,987
テイ・エス テック	29	30	86,670
ジャムコ	7.3	7.6	20,368
精密機器 (1.5%)			
テルモ	191.3	198.2	776,944
クリエートメディック	4.1	4.3	4,059
日機装	44.9	44.7	48,633
島津製作所	161	166.4	309,504
JMS	23	24	7,872
クボテック	2.7	2.8	1,582

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
長野計器	7.5	10.1	7,100
ブイ・テクノロジー	3	2.6	45,058
東京計器	40	45	11,205
愛知時計電機	16	1.7	6,273
オーバル	12.2	12.6	3,465
東京精密	24.1	25	96,125
マニー	16.6	17.2	47,317
ニコン	233	225.4	362,443
トプコン	41.9	65.1	131,371
オリンパス	185.9	206.4	824,568
理研計器	10.1	11.4	18,798
タムロン	11.1	11.5	24,092
HOYA	282.2	266.1	1,342,740
ノーリツ銅機	11.2	13.1	13,126
エー・アンド・デイ	11.3	11.8	5,557
シチズン時計	153.6	141.5	99,050
リズム時計工業	54	52	9,724
大研医器	9.9	11.5	9,200
メニコン	8.4	8.9	30,927
松風	6.1	6.8	9,282
セイコーホールディングス	80	91	38,129
ニプロ	93	89.5	123,241
その他製品 (1.7%)			
スノーピーク	1.9	2	5,710
パラマウントベッドホールディングス	13.2	12.4	51,770
トランザクション	2.5	2.8	5,222
SHO-BI	4.2	4.3	1,900
ニホンフラッシュ	4.9	6	7,608
前田工織	12.5	12.9	16,976
永大産業	18	17	8,840
アートネイチャー	13.3	13.8	10,267
ダンロップスポーツ	7.9	8.2	8,831
バンダイナムコホールディングス	129	142.6	443,486
アイフィスジャパン	2.8	2.9	1,220
共立印刷	20.7	21.5	7,095
SHOEI	5.6	5.8	15,549
フランスベッドホールディングス	17.4	16.2	15,130
パイロットコーポレーション	21.8	22.6	102,265
萩原工業	3.5	3.6	9,486

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
トッパン・フォームズ	22.3	23.1	25,525	
フジシールインターナショナル	15.2	29	66,120	
タカラトミー	41	50.3	63,780	
廣済堂	11.6	13	4,914	
A s - m e エステール	3.3	3.5	2,401	
アーク	52.5	54.4	5,984	
タカノ	5.5	5.7	5,580	
ブロネクサス	11.7	12.1	15,826	
ホクシン	9.9	9.1	2,029	
ウッドワン	23	22	6,424	
大建工業	49	9.1	20,338	
凸版印刷	352	365	410,260	
大日本印刷	360	373	447,227	
図書印刷	23	17	8,041	
共同印刷	42	40	15,760	
日本写真印刷	20.9	21.7	71,827	
光村印刷	12	11	2,871	
宝印刷	6	6.8	10,444	
アシックス	124	128.5	250,575	
ツツミ	6.2	4.8	9,878	
小松ウオール工業	4.2	4.4	8,549	
ヤマハ	91.7	87.1	258,599	
河合楽器製作所	4.6	5.1	11,520	
クリナップ	14.6	15.2	12,479	
ビジョン	70.7	78.2	242,811	
兼松サステック	13	13	2,730	
キングジム	10.4	10.8	9,158	
リンテック	29.7	30.7	75,644	
T A S A K I	3.4	3.6	5,378	
イトーキ	26.3	27.2	19,774	
任天堂	76.8	79.6	1,851,496	
三菱鉛筆	10.3	10.6	64,342	
タカラスタンダード	52	26.7	50,810	
コクヨ	64.8	67.2	97,843	
ナカバヤシ	25	23	6,279	
グローブライド	6	6.3	11,333	
岡村製作所	43.5	45.1	46,272	
美津濃	67	69	40,434	
アデランス	21.6	—	—	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
電気・ガス業 (1.8%)				
東京電力ホールディングス	1,058.4	1,097	471,710	
中部電力	381.8	426.1	645,967	
関西電力	509.2	527.7	655,139	
中国電力	172.5	178.8	222,784	
北陸電力	122.2	126.7	145,198	
東北電力	311.7	323.1	459,125	
四国電力	112.4	116.5	129,315	
九州電力	275.6	285.6	350,716	
北海道電力	116.8	121	98,615	
沖縄電力	19.9	19	49,970	
電源開発	106.4	102.9	287,091	
エフオン	5.1	4.8	4,747	
イーレックス	3.8	5.4	19,818	
東京瓦斯	1,393	1,387	726,233	
大阪瓦斯	1,291	1,255	548,058	
東邦瓦斯	315	326	265,364	
北海道瓦斯	30	32	8,864	
広島ガス	21.7	26.6	9,842	
西部瓦斯	140	146	38,106	
静岡ガス	38.4	39.8	28,855	
メタウォーター	8	7.3	21,761	
陸運業 (4.2%)				
S B S ホールディングス	12.3	12.8	10,688	
東武鉄道	667	691	393,870	
相鉄ホールディングス	214	207	116,541	
東京急行電鉄	726	703	586,302	
京浜急行電鉄	342	354	440,376	
小田急電鉄	400	207.2	464,542	
京王電鉄	349	361	321,651	
京成電鉄	187	96.9	259,110	
富士急行	34	35	35,770	
新京成電鉄	16	17	7,174	
東日本旅客鉄道	228.1	250.2	2,578,311	
西日本旅客鉄道	120.1	124.5	911,464	
東海旅客鉄道	111.7	107.5	1,983,375	
西武ホールディングス	132.5	178.6	341,304	
鴻池運輸	17.6	18.3	26,974	
西日本鉄道	161	155	75,795	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ハマキョウレックス	9.6	8.4	17,228
サカイ引越センター	4.9	4.5	13,927
近鉄グループホールディングス	1,256	1,302	554,652
阪急阪神ホールディングス	167.5	163.4	615,201
南海電気鉄道	280	273	150,423
京阪ホールディングス	280	290	211,120
神戸電鉄	30	32	12,320
名古屋鉄道	454	471	250,101
山陽電気鉄道	45	47	28,482
日本通運	483	500	290,000
ヤマトホールディングス	223.1	231.2	537,308
山九	164	170	120,190
丸運	6.7	7	1,750
丸全昭和運輸	42	43	19,221
センコー	56.1	59	43,424
トナミホールディングス	26	26	9,230
ニッコンホールディングス	39.7	43.8	102,886
日本石油輸送	14	1.5	3,750
福山通運	76	78	50,232
セイノーホールディングス	88.5	91.7	113,708
神奈川中央交通	15	15	10,755
日立物流	26	26.9	59,664
丸和運輸機関	3.7	3.2	8,384
C&Fロジホールディングス	11.9	13.4	20,167
九州旅客鉄道	—	96.4	319,566
海運業 (0.2%)			
日本郵船	1,120	1,093	263,413
商船三井	608	678	245,436
川崎汽船	546	490	143,570
N Sユニテッド海運	56	58	12,702
明治海運	11.2	11.6	4,999
飯野海運	64.6	66.9	32,446
共栄タンカー	10	11	2,552
乾汽船	9.8	9.4	9,127
空運業 (0.6%)			
日本航空	238.9	233	837,868
ANAホールディングス	2,316	2,400	789,120
バスコ	11	12	5,076

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	3.6	3.7	20,757
日新	51	53	18,550
三菱倉庫	89	85	136,340
三井倉庫ホールディングス	72	75	25,425
住友倉庫	91	94	58,186
澁澤倉庫	32	34	11,900
東陽倉庫	21.3	22.1	6,607
日本トランスシティ	29	30	13,080
ケイヒン	23	24	3,696
中央倉庫	7.2	7.5	8,175
安田倉庫	9.7	10.1	7,605
東洋埠頭	36	37	6,919
宇徳	10.1	10.5	4,399
上組	149	154	164,010
サンリツ	3	3.1	1,615
キムラユニティ	3.2	3.3	3,953
キューソー流通システム	3.9	4.1	10,414
郵船ロジスティクス	11.5	11.9	14,101
近鉄エクスプレス	22.3	23.1	38,969
東海運	6.7	7	3,136
エアアイティー	7.7	7.9	8,618
内外トランスライン	3.7	3.9	4,348
情報・通信業 (7.8%)			
NECネットエスアイ	15.4	14	29,904
システナ	12	10.2	16,799
デジタルアーツ	6	5.7	18,924
新日鉄住金ソリューションズ	20.5	21.3	48,457
キューブシステム	5.3	5.5	3,800
コア	5.2	5.4	7,533
ソフトクリエイトホールディングス	5.9	6.1	8,106
T I S	40.8	42.3	113,025
ネオス	3.6	3.8	1,691
電算システム	4.3	4.4	7,374
グリー	74.8	77.7	52,602
コーエーテックモホールディングス	29.2	30.3	62,751
三菱総合研究所	4.8	4.9	15,680
ボルテージ	2.4	2.3	2,332
電算	1.4	1.4	3,369

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株			千円
AGS	2.8		3.2			5,571
ファインデックス	9.1		9.4			8,760
ヒト・コミュニケーションズ	2.8		2.9			4,825
ブレインパッド	1.8		2.7			3,148
KL a b	23.5		24.4			17,641
ポルトウウィン・ビットクルーホルディ	8.1		9.2			10,028
イーブックイニシアティブジャパン	2.7		2			1,962
ネクソン	135.3		139.7			266,827
アイスタイル	18.8		26.8			23,852
エムアップ	3.2		3.6			3,258
エイチーム	6.8		7			15,148
テクノスジャパン	3.6		9.8			11,838
e n i s h	3.6		3.8			2,120
コロブラ	34.2		35.6			37,842
モバイルクリエイト	8.1		9.3			3,887
オルトプラス	4.5		5.3			4,081
ブロードリーフ	15.2		31.4			22,608
ハーツユニテッドグループ	3.7		6.7			9,768
メディアドゥ	2.6		2.7			4,360
ブイキューブ	6.8		7			4,312
サイバーリンクス	1.9		1.9			1,962
ディー・エル・イー	3.4		4.3			2,924
フィックスターズ	—		1.8			6,741
VOYAGE GROUP	4.2		4.3			7,168
オブティム	1		1.3			7,813
セレス	—		2.3			4,172
ベリサーブ	1.4		1.5			4,275
ティーガイア	12.3		12.7			22,174
日本アジアグループ	13.9		14.4			6,278
豆蔵ホールディングス	9.7		9.3			8,397
テクマトリックス	5.3		4			9,924
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	286.9		267.6			67,970
GMOペイメントゲートウェイ	10.1		10.4			66,976
ザップラス	6.9		6.6			2,989
システムリサーチ	—		1.3			2,743
インターネットイニシアティブ	19.9		18.8			37,487
さくらインターネット	8.1		9.8			11,466
GMOクラウド	2.7		2.8			5,202
SRAホールディングス	7.1		6.7			17,996

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株			千円
Minor iソリューションズ	2.4		2.8			3,505
システムインテグレータ	1.7		1.8			1,216
朝日ネット	11.2		11.6			6,043
アドソル日進	—		2.5			3,225
フリービット	—		7.1			6,681
コムチュア	2.1		2.1			7,486
サイバーコム	1.4		1.7			1,672
メディカル・データ・ビジョン	—		2.1			5,953
g u m i	12.7		14.5			18,966
ショーケース・ティービー	—		1.4			1,712
P C Iホールディングス	—		1.5			4,231
パイブドHD	1.6		2.3			2,626
アイビーシー	—		1			1,029
オーブントア	—		1.3			4,394
L I N E	—		21.3			76,893
AOI T Y O H o l d i n g s	—		10.4			9,100
ソルクシーズ	3.5		3.6			1,951
フェイス	3.2		3.4			4,749
ハイマックス	1.6		1.7			2,541
野村総合研究所	83.7		95.4			369,675
サイバネットシステム	10		10.4			8,216
C Eホールディングス	1.9		1.9			2,188
インテージホールディングス	6.4		7.3			16,665
東邦システムサイエンス	3.6		4.2			2,746
ソースネクスト	6.1		7.6			5,168
ティー・ワイ・オー	24.2		—			—
フォーカスシステムズ	4.7		4.9			2,886
クレスコ	2.8		2.9			7,386
フジ・メディア・ホールディングス	128.2		132.9			206,260
オービック	42.4		44			237,160
ジャストシステム	22.4		20.6			25,152
TDCソフトウェアエンジニアリング	5.4		5.5			6,858
ヤフー	882.6		914.8			489,418
トレンドマイクロ	65.2		67.6			297,102
インフォメーション・ディベロプメント	2.3		3.6			4,158
日本オラクル	19.8		20.5			132,840
アルファシステムズ	4		4.2			8,278
フューチャー	16.6		17.2			14,499
CAC H o l d i n g s	9.2		9.5			9,424

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
ソフトバンク・テクノロジー	3.3		3	12,165
トーセ	3.3		3.4	2,798
オービックビジネスコンサルタント	6.3		6.5	36,075
伊藤忠テクノソリューションズ	27.9		28.9	90,023
アイティフォー	16		16.5	10,527
東計電算	2.2		2.3	5,138
エクスネット	1.1		1.2	2,574
大塚商会	33.1		34.3	202,027
サイボウズ	16.4		16.9	7,571
ソフトブレーン	16.8		17.4	7,812
電通国際情報サービス	7.6		7.9	17,617
デジタルガレージ	19.2		18.5	36,260
EMシステムズ	4.2		4.3	7,052
ウェザーニューズ	4.1		4.3	14,878
C I J	11.1		10.7	5,671
東洋ビジネスエンジニアリング	1.2		1.3	2,002
日本エンタープライズ	12.6		13	3,627
WOWOW	5.9		6.1	22,082
スカラ	7.6		8.8	7,638
日本コロムビア	4.2		3.8	2,736
イマジカ・ロボット ホールディングス	10.4		10.7	7,918
ネットワンシステムズ	53.3		55.3	47,834
システムソフト	—		22.5	3,487
アルゴグラフィックス	5.6		5.8	14,094
マーベラス	20.8		21.5	19,801
エイベックス・グループ・ホールディングス	22.7		23.5	38,305
日本ユニシス	34		35.2	53,257
兼松エレクトロニクス	7.8		8	20,472
東京放送ホールディングス	73.8		84.1	171,143
日本テレビホールディングス	112.4		116.5	238,359
朝日放送	12.2		12.6	9,802
テレビ朝日ホールディングス	33.6		34.9	82,433
スカパーJ SATホールディングス	93.5		83	41,583
テレビ東京ホールディングス	11.1		10.4	27,185
日本BS放送	2.8		2.9	3,053
ビジョン	—		1.5	5,280
U-NEXT	3.2		3.3	2,943
ワイヤレスゲート	4.2		4.4	6,723
コネクシオ	10.8		11.2	17,203

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
日本通信	87.2		106.7	19,099
クロップス	2.2		2.7	1,617
日本電信電話	951.9		1,024.6	4,877,096
KDD I	1,218.3		1,262.7	3,738,854
光通信	14.8		15.3	159,120
NTTドコモ	920.2		953.8	2,549,984
エムティーアイ	18.7		19.5	13,650
GMOインターネット	44.9		46.6	71,298
カドカワ	38.5		37	60,310
学研ホールディングス	41		43	13,330
ゼンリン	16.3		16.9	37,889
昭文社	6.7		7	4,879
インプレスホールディングス	10.1		10.5	1,522
アイネット	6.9		7.2	8,906
松竹	81		84	111,888
東宝	87.9		83.5	265,530
東映	46		47	45,449
AOI Pro.	6.2		—	—
エヌ・ティ・ティ・データ	76.1		78.8	425,520
ビー・シー・エー	1.6		1.9	2,969
ビジネスブレイン太田昭和	1.9		2.2	2,332
DTS	13.7		13.2	33,475
スクウェア・エニックス・ホールディングス	52.1		49.1	162,275
シーイーシー	8		7.5	13,425
カブコン	31.5		29.9	69,816
アイ・エス・ビー	2.4		2.5	2,237
ジャステック	7.8		8.1	8,529
SCSK	29.3		34.7	144,872
日本システムウエア	4.6		4.2	6,787
アイネス	17.4		16.1	18,740
TKC	11.4		11.8	41,300
富士ソフト	18.3		18.9	54,110
NSD	26.1		27.1	48,021
コナミホールディングス	55.6		57.6	270,432
福井コンピュータホールディングス	3.6		3.7	10,478
JBCホールディングス	10.3		10.7	8,538
ミロク情報サービス	9.1		9.4	17,202
ソフトバンクグループ	697.8		574.6	4,904,211

MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
卸売業 (4.5%)				
ハウスイ	10	10	1,260	
高千穂交易	4.7	4.9	5,110	
伊藤忠食品	3	3.1	13,702	
エレマテック	5.7	5.1	9,924	
JALUX	4	4.1	9,192	
あらた	5.5	5.7	15,948	
トーマンデバイス	1.8	1.9	4,062	
東京エレクトロン デバイス	4.5	4.6	7,332	
フィールズ	10.8	9.8	12,171	
双日	775.8	753.8	217,848	
アルフレッサ ホールディングス	154.8	151	297,319	
横浜冷凍	30.5	31.6	32,737	
神栄	17	17	3,060	
山下医科器械	1	1	1,795	
ラサ商事	5.8	5.5	3,718	
ラクーン	5.3	6.1	3,129	
アルコニックス	7	7.2	12,571	
神戸物産	6.6	6.9	26,634	
あい ホールディングス	21.9	18.2	39,348	
ディーブイエックス	4.4	4.5	5,688	
ダイワボウホールディングス	112	108	31,104	
マクニカ・富士エレホールディングス	22.2	23.6	39,931	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21.3	24	24,480	
八洲電機	9.5	9.8	6,301	
UKCホールディングス	7.9	8.2	18,359	
OCHIホールディングス	3.6	3.7	5,006	
TOKAIホールディングス	54.1	56.1	47,348	
大阪工機	1.4	1.4	1,009	
三洋貿易	6.7	7	11,991	
ビューティガレージ	—	1.3	1,453	
ウイン・パートナーズ	4.4	9.2	8,841	
ミタチ産業	3.1	3	1,890	
シップヘルスケアホールディングス	25	24.5	71,197	
明治電機工業	3.9	4.4	5,381	
デリカフーズ	2.6	2.7	2,802	
スターティア	2.4	2.9	1,621	
コマダホールディングス	16.5	17.2	32,439	
富士興産	4.7	4.6	2,217	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
協栄産業	16	15	2,505	
小野建	10.7	11.1	15,584	
佐島電機	9.7	9.4	7,097	
エコートレーディング	2.8	2.9	2,053	
伯東	9.4	8.7	9,161	
コンドテック	9.7	10.1	8,736	
中山福	7.6	7.3	6,234	
ナガイレーベン	17.8	18.4	47,508	
三菱食品	13.5	14	47,880	
松田産業	9	9.3	14,749	
第一興商	21.8	20.8	98,384	
メディバルホールディングス	123.2	127.6	233,763	
アドヴァン	12.5	—	—	
S PK	2.8	2.7	6,739	
萩原電気	4.2	4.3	9,232	
アズワン	9.6	10	50,200	
スズデン	4	4.6	4,894	
尾家産業	3.9	4.1	4,731	
シモジマ	8.5	7.8	9,235	
ドウシシャ	14.5	15	31,875	
小津産業	2.7	2.8	6,078	
高速	7.3	7.6	8,519	
たけびし	4.3	4.5	6,093	
黒田電気	22.9	17.4	40,211	
リックス	2.8	2.9	4,735	
丸文	10.9	11.3	7,819	
ハビネット	11.2	10.6	15,105	
橋本総業ホールディングス	2.5	2.6	3,954	
日本ライフライン	5.9	10.9	20,317	
エクセル	6	5.5	8,393	
マルカキカイ	4	4.1	7,498	
IDOM	33.1	34.3	25,930	
日本エム・ディ・エム	10.3	9.6	7,795	
進和	7.3	7.5	13,417	
エスケイジャパン	3	2.4	741	
ダイトロン	5.6	5.8	5,631	
シークス	8.8	9.1	37,992	
田中商事	3.8	3.9	2,753	
オーハシテクニカ	6.9	7.2	9,972	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
白銅	3.5	3.2	3.2	5,577
伊藤忠商事	966.4	934.8	1,487.734	
丸紅	1,212	1,256.2	902,956	
高島	23	22	4,554	
長瀬産業	74	76.7	123,256	
蝶理	7.8	8.1	15,997	
豊田通商	137.2	142.2	467,838	
三共生興	18.6	19.3	7,932	
兼松	262	271	52,032	
ツカモトコーポレーション	22	23	2,921	
三井物産	1,113.6	1,154.2	1,954,060	
日本紙パルプ商事	64	66	24,750	
日立ハイテクノロジーズ	42.7	44.2	211,276	
カメイ	16	16.6	22,044	
東都水産	20	1.9	3,706	
OUGホールディングス	18	20	5,220	
スターゼン	4.4	5.3	25,546	
山善	47.3	49	49,882	
椿本興業	14	14	5,558	
住友商事	775.2	803.5	1,186,769	
内田洋行	30	6.3	16,020	
三菱商事	924.1	957.8	2,452,925	
第一実業	28	29	21,518	
キャノンマーケティングジャパン	35.1	36.4	80,880	
西華産業	39	41	15,170	
佐藤商事	11	11.4	9,952	
菱洋エレクトロ	13.9	12.2	19,154	
東京産業	12.2	12.7	5,918	
ユアサ商事	11.7	12.1	37,449	
神鋼商事	27	3.2	7,878	
小林産業	9	9.3	2,585	
阪和興業	123	127	97,282	
カナデン	11.7	12.2	12,675	
菱電商事	19	20	14,720	
フルサト工業	6.8	7	12,047	
岩谷産業	146	141	93,765	
すてきなイスグループ	52	54	8,208	
昭光通商	44	45	4,410	
ニチモウ	19	18	3,348	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
極東貿易	18	20	20	4,800
イワキ	19	19	19	5,852
三愛石油	30.3	34.2	34.2	29,959
稲畑産業	29.5	30.6	30.6	44,461
G S I クレオス	33	31	31	4,495
明和産業	11.3	11.7	11.7	4,808
ワキタ	26.2	27.2	27.2	27,662
東邦ホールディングス	39.4	40.9	40.9	100,245
サンゲツ	42.5	43.7	43.7	84,603
ミツウロコグループホールディングス	19.8	20.5	20.5	14,924
シナネンホールディングス	26	5.5	5.5	12,606
伊藤忠エネクス	31.7	28.2	28.2	26,113
サンリオ	38	39.3	39.3	91,451
サンワテクノス	7.8	7.5	7.5	7,725
リョーサン	19.5	19	19	68,400
新光商事	14.4	14	14	18,270
トーホー	5.5	5.7	5.7	14,215
三信電気	17	14.1	14.1	18,879
東陽テクニカ	16.3	16.9	16.9	17,508
モスフードサービス	16.1	16.7	16.7	56,112
加賀電子	11.1	11.5	11.5	22,666
ソーダニッカ	12.7	13.1	13.1	6,798
立花エレテック	9.1	8.6	8.6	11,463
フォーバル	6.4	5.6	5.6	3,903
P A L T A C	19.7	20.4	20.4	62,832
三谷産業	13.1	13.5	13.5	5,170
太平洋興発	51	53	53	5,724
ヤマタネ	57	6.4	6.4	10,182
丸紅建材リース	11	12	12	2,748
日鉄住金物産	108	11.2	11.2	54,320
トラスコ中山	14.1	29.2	29.2	78,460
オートバックスセブン	45.6	47.3	47.3	83,721
モリト	—	10.2	10.2	10,128
加藤産業	19.2	19.9	19.9	56,993
イノテック	11.3	11	11	7,282
イエローハット	11.6	12	12	32,568
J K ホールディングス	12.3	12.8	12.8	8,512
日伝	5.1	5.3	5.3	18,020
北沢産業	10.2	10.5	10.5	2,268

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
杉本商事	7.1	7.3	11,424	
因幡電機産業	17.3	17.9	72,047	
バイテックホールディングス	5	5.2	6,988	
ミスミグループ本社	138.3	143.5	303,359	
アルテック	10.5	10.9	2,343	
タキヒヨー	20	19	9,063	
蔵王産業	2	2.1	3,156	
スズケン	56.1	58.1	218,456	
ジェコス	8.5	8.8	10,023	
ルネサスイーストン	10.2	11.7	7,125	
小売業 (4.6%)				
ローソン	46.6	44.3	362,374	
サンエー	8.4	9.6	50,016	
ダイユーエイト	3.2	—	—	
カワチ薬品	9.5	9.9	29,353	
エービーシー・マート	16	23.2	153,120	
ハードオフコーポレーション	5.9	5.6	6,647	
アスクル	15	13.3	48,079	
ゲオホールディングス	20.6	21.3	28,968	
アダストリア	22.7	19.6	59,682	
ジーフット	7.4	7.7	6,267	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	18	1.6	1,148	
くらコーポレーション	8	8.3	38,470	
キャンドゥ	6.5	6.7	12,187	
バルグループホールディングス	7.2	6.5	18,154	
エディオン	52.1	49.5	51,529	
サーラコーポレーション	15.4	15.9	10,001	
ワッツ	5.3	5.5	6,369	
ハローズ	4	4.2	9,849	
あみやき亭	2.4	2.5	10,012	
ひらまつ	16.9	17.6	11,422	
ゲンキー	2.5	2.5	15,075	
サッポロドラッグストアー	1.5	—	—	
大黒天物産	2.9	3	15,510	
ハニーズ	10.8	12.3	13,394	
ファーマライズホールディングス	2.8	2.9	1,487	
アルベン	11	9.8	19,208	
クオール	12.5	14.4	21,470	
ジェイアイエヌ	8.4	8.7	52,113	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ビックカメラ	70.7	73.3	77,478	
DCMホールディングス	60.5	77.4	76,316	
MonotaRO	43.5	45.2	150,290	
東京一番フーズ	3.1	3.2	1,865	
ダイヤモンドダイニング	2.7	2.8	5,342	
きちり	3.3	3.4	2,257	
アークランドサービスホールディングス	3.8	4	12,720	
J. フロント リテイリング	155.8	161.5	268,251	
ドトール・日レスホールディングス	21.6	22.4	48,854	
マツモトキヨシホールディングス	25.4	24.1	127,007	
ブロンコビリー	6.4	6.7	18,746	
スタートトゥデイ	37.5	116.5	289,619	
トレジャー・ファクトリー	3.5	3.6	2,973	
物語コーポレーション	3.3	3.6	15,660	
ココカラファイン	12.8	13.3	62,576	
三越伊勢丹ホールディングス	244.9	253.9	351,397	
Hamee	—	2.8	2,584	
ウエルシアホールディングス	10.7	12.6	79,254	
クリエイトSDホールディングス	18.1	18.8	47,808	
丸善CHIホールディングス	14.3	14.9	5,438	
ミサワ	1.9	2.3	1,055	
ティーライフ	—	1.2	1,676	
エー・ビーカンパニー	2	2.1	1,722	
チムニー	3.7	3.9	11,021	
シュッピン	4.6	4.8	6,278	
ネクステージ	2.4	2.5	6,225	
ジョイフル本田	20	20.7	65,308	
鳥貴族	3	3.1	7,247	
キリン堂ホールディングス	4	4.1	3,489	
ホットランド	5.7	5.9	6,490	
すかいらく	52.8	54.8	86,803	
綿半ホールディングス	4.6	5.1	8,231	
ヨシックス	—	1.2	1,596	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	40.8	42.3	42,934	
ブックオフコーポレーション	7	7.3	6,146	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4.9	5.1	4,018	
BEENOS	—	1.5	2,283	
あさひ	9.1	9.5	12,587	
日本調剤	3.1	4.5	16,740	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コスモス薬品	6.2	6.4	135,744
トーエル	5.9	6.1	5,551
一六堂	3	2.7	1,093
オンリー	—	1.4	1,148
セブン&アイ・ホールディングス	515.1	534.2	2,376,121
薬王堂	2.3	6.3	13,507
クリエイト・レストランツ・ホールディング	33	34.2	35,362
ツルハホールディングス	28.3	25.5	266,220
サンマルクホールディングス	9.7	8.2	28,372
フェリシモ	3.5	3.6	3,672
トリドールホールディングス	15.1	15.7	37,884
クスリのアオキ	11	—	—
サツドラホールディングス	—	1.7	3,360
ダイユー・リックホールディングス	—	4.1	3,251
パロックジャパンリミテッド	—	7.5	10,612
クスリのアオキホールディングス	—	10.1	46,308
メディカルシステムネットワーク	13.9	14.4	6,249
総合メディカル	5.9	6.2	25,017
はるやまホールディングス	5.1	6	5,688
ノジマ	14.2	14.8	18,884
カッパ・クリエイト	17.2	17.9	22,697
ライトオン	9.2	9.5	9,357
ジーンズメイト	3.9	4.1	1,086
良品計画	14.1	16.9	364,026
三城ホールディングス	15.2	15.8	7,457
アドヴァン	—	13	14,729
アルビス	3.2	3.3	10,774
コナカ	15.7	16.3	9,568
ハウス オブ ローゼ	1.5	1.6	2,489
G-7ホールディングス	3.6	3.7	7,914
イオン北海道	8.2	12.8	7,846
コジマ	18.1	18.8	5,170
ヒマラヤ	3.8	4	3,420
コーナン商事	17.5	18.1	38,842
エコス	4.7	4.9	5,968
ワタミ	14.5	15.1	18,120
マルシェ	3	2.8	2,338
ドンキホーテホールディングス	79.6	82.6	322,966
西松屋チェーン	24.3	22.4	29,971

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ゼンショーホールディングス	63.3	66.1	130,547
幸楽苑ホールディングス	7.8	8.1	13,551
ハークスレイ	3.4	3.1	3,441
サイゼリヤ	20.3	21	55,545
V Tホールディングス	41.6	43.1	24,782
魚力	3.8	4	5,204
ポブラ	3.1	3.2	1,664
フジ・コーポレーション	—	1.9	3,794
ユナイテッドアローズ	17.6	17	60,095
ハイデイ日高	11.2	11.6	32,596
京都市もの友禅	8.4	8.1	7,994
コロワイド	40.8	42.3	77,197
ピーシーデポコーポレーション	13.6	16.9	9,447
壺番屋	11.1	9	33,795
トップカルチャー	4.4	4.6	2,203
P L A N T	2.8	2.9	3,482
スギホールディングス	22.1	28	147,840
ヴィア・ホールディングス	—	9.7	11,242
スクロール	18.6	19.3	6,716
ヨンドシーホールディングス	9.4	9.7	24,230
ユニー・ファミリーマートホールディングス	37.8	56	415,520
木曽路	15.1	15.6	36,940
サトレストランシステムズ	14.5	15	13,260
千趣会	22.3	23.1	18,202
タカキュー	9.5	9.8	2,097
ケーヨー	20.7	21.5	12,556
上新電機	29	30	32,640
日本瓦斯	18.8	23.4	78,624
ベスト電器	39.7	41.1	5,754
ロイヤルホールディングス	20.4	21	40,908
東天紅	9	10	1,690
いなげや	13.7	14.2	22,038
島忠	31.9	33	93,654
チヨダ	14.5	15	41,010
ライフコーポレーション	7.8	9.7	32,107
リンガーハット	11.1	14.4	33,019
さが美	9	11	1,342
M r M a x	10.7	15.9	6,678
テンアライド	11.3	11.7	4,598

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
AOKIホールディングス	28.1	25.5	35,037	
オークワ	19	18	20,664	
コメリ	19	19.7	53,071	
青山商事	23.6	26.7	106,266	
しまむら	14.3	14.8	218,744	
はせがわ	5.8	6.7	3,015	
高島屋	179	214	210,362	
松屋	24.8	27.8	27,549	
エイチ・ツー・オー リテイリング	63.1	65.4	122,101	
近鉄百貨店	47	49	17,591	
丸栄	25	26	2,340	
ニッセンホールディングス	18.1	—	—	
パルコ	11.8	12.2	13,908	
丸井グループ	151.1	134.3	207,762	
アクシアル リテイリング	9.5	9.9	45,045	
井筒屋	67	6.9	2,670	
イオン	506.7	525.2	875,508	
ユニークグループ・ホールディングス	117.9	—	—	
イズミ	24.4	25.3	121,060	
東武ストア	15	1.5	4,398	
平和堂	25	25.9	67,935	
フジ	13.7	14.2	34,449	
ヤオコー	14	14.5	67,642	
ゼビオホールディングス	16.7	17.3	30,707	
ケーズホールディングス	52	58.8	123,656	
Olympicグループ	7.2	7.5	4,717	
日産東京販売ホールディングス	20.7	18.7	6,227	
アインホールディングス	14.8	16.6	136,286	
元気寿司	3.4	3.2	7,222	
ヤマダ電機	374.4	426.9	245,894	
アークランドサカモト	20.8	21.6	29,916	
ニトリホールディングス	53.2	55.1	694,260	
グルメ杵屋	9	9	9,297	
愛眼	9.8	9.3	1,822	
ケーユーホールディングス	6.4	6.6	5,907	
吉野家ホールディングス	45.4	44.5	73,870	
松屋フーズ	5.9	6.1	25,498	
サガミチェーン	16.4	16	21,472	
関西スーパーマーケット	10	10.4	15,870	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
王将フードサービス	9	9.4	40,185	
プレナス	13.8	14.3	35,435	
ミニストップ	9.1	9.4	20,134	
アークス	23	23.9	61,351	
パローホールディングス	26.5	27.5	75,680	
藤久	1	1	1,735	
ベルク	6.1	5.7	25,507	
大庄	6.6	6.8	10,778	
ファーストリテイリング	20.5	21.3	778,515	
サンドラッグ	26	24.3	182,979	
サックスパー ホールディングス	11.6	12	14,652	
ヤマザワ	2.5	2.6	4,750	
やまや	2.5	2.6	4,485	
ペルーナ	30.7	31.8	26,712	
銀行業 (8.6%)				
島根銀行	2.6	2.7	3,790	
じもとホールディングス	88.4	91.6	17,953	
めぶきフィナンシャルグループ	90.4	615.5	286,207	
東京TYフィナンシャルグループ	17	18.5	72,797	
九州フィナンシャルグループ	188.5	209.3	166,393	
ゆうちょ銀行	315.6	361.4	513,549	
富山第一銀行	31.3	32.4	17,334	
コンソルディア・フィナンシャルグループ	858	835.6	508,295	
西日本フィナンシャルホールディングス	—	86.5	106,568	
新生銀行	1,066	1,215	246,645	
あおぞら銀行	779	808	332,896	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,880.9	9,672.4	7,308,465	
りそなホールディングス	1,440.7	1,493.2	908,014	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,571	266.5	1,099,312	
三井住友フィナンシャルグループ	986.1	1,022.1	4,613,759	
第四銀行	156	156	81,432	
北越銀行	133	13.8	37,798	
西日本シティ銀行	401	—	—	
千葉銀行	475	492	373,428	
常陽銀行	445	—	—	
群馬銀行	273.7	283.6	187,176	
武蔵野銀行	19.6	20.4	74,052	
千葉興業銀行	33.7	35	21,840	
筑波銀行	51.2	53	18,550	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
七十七銀行	193	200	105,800	
青森銀行	89	99	38,808	
秋田銀行	80	82	30,176	
山形銀行	69	72	35,424	
岩手銀行	8.6	8.4	39,564	
東邦銀行	110	114	49,704	
東北銀行	63	65	10,270	
みちのく銀行	61	76	14,668	
ふくおかフィナンシャルグループ	533	518	253,302	
静岡銀行	361	347	340,754	
十六銀行	154	171	68,742	
スルガ銀行	116.9	130.5	340,996	
八十二銀行	222.8	246.3	173,641	
山梨中央銀行	76	79	43,292	
大垣共立銀行	164	170	75,650	
福井銀行	105	109	30,520	
北國銀行	131	135	63,045	
清水銀行	4.2	4.3	15,996	
富山銀行	2.4	2.5	10,450	
滋賀銀行	116	120	77,280	
南都銀行	119	12.3	57,318	
百五銀行	111	115	57,270	
京都銀行	235	228	213,636	
紀陽銀行	48.3	48	90,480	
三重銀行	55	5.7	14,244	
ほくほくフィナンシャルグループ	838	84.9	172,262	
広島銀行	363	377	203,203	
山陰合同銀行	74	76.7	78,847	
中国銀行	87.3	90.5	162,266	
鳥取銀行	39	4.1	7,781	
伊予銀行	131.7	136.5	108,927	
百十四銀行	135	140	55,300	
四国銀行	95	99	29,601	
阿波銀行	99	109	80,006	
大分銀行	71	73	32,266	
宮崎銀行	82	85	31,620	
佐賀銀行	75	77	23,408	
十八銀行	76	78	27,612	
沖縄銀行	11.3	12.4	51,274	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
琉球銀行	25.4	26.3	42,369	
セブン銀行	461.6	478.5	156,948	
みずほフィナンシャルグループ	17,518.5	17,330	3,613,305	
高知銀行	48	46	6,210	
山口フィナンシャルグループ	115	119	153,629	
長野銀行	40	4.2	8,450	
名古屋銀行	103	10.7	46,010	
北洋銀行	185.5	208.3	97,901	
愛知銀行	4.1	4.3	30,186	
第三銀行	70	7.2	12,528	
中京銀行	51	5.2	12,204	
大光銀行	44	45	11,385	
愛媛銀行	72	15.2	21,584	
トマト銀行	48	4.9	7,849	
みなと銀行	111	11.6	25,079	
京葉銀行	100	104	56,472	
関西アーバン銀行	17.2	17.8	26,753	
栃木銀行	64	70.4	41,465	
北日本銀行	3.8	4	12,660	
東和銀行	230	239	29,158	
福島銀行	151	139	13,205	
大東銀行	74	66	11,022	
トモニホールディングス	94.5	105.2	67,538	
フィデアホールディングス	100.5	123.8	26,121	
池田泉州ホールディングス	130.6	135.4	69,731	
証券・商品先物取引業 (1.3%)				
F P G	43.9	45.5	47,047	
S B I ホールディングス	147.9	144.3	223,953	
日本アジア投資	8.6	12.2	6,197	
ジャフコ	20.6	21.3	82,005	
大和証券グループ本社	1,152	1,194	852,157	
野村ホールディングス	2,369.5	2,609.5	1,951,906	
岡三証券グループ	105	109	81,859	
丸三証券	36.6	40.6	38,894	
東洋証券	47	46	12,512	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	141.3	146.5	94,346	
光世証券	29	30	5,700	
水戸証券	38.1	39.5	12,363	
いちよし証券	27.5	28.5	25,564	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
松井証券	60.3	72.9	68,744	
だいこう証券ビジネス	6	6.2	3,806	
マネックスグループ	143.1	136.9	40,659	
カブドットコム証券	105	96	37,536	
極東証券	16.5	17.1	28,813	
岩井コスモホールディングス	11.6	12.1	13,249	
藍澤證券	23	23.9	15,415	
マネースクウェアHD	4.2	—	—	
マネーパートナーズグループ	11.7	16.3	8,541	
小林洋行	3.5	3.6	1,054	
保険業 (2.7%)				
かんぽ生命保険	50.1	48.2	129,706	
SOMPOホールディングス	273.6	266.9	1,087,617	
アニコム ホールディングス	8.3	8.6	19,556	
MS&ADインシュアランスグループホール	368	381.5	1,443,596	
ソニーフィナンシャルホールディングス	118	122.3	242,398	
第一生命ホールディングス	789	769.7	1,638,306	
東京海上ホールディングス	498.9	517.1	2,492,422	
T&Dホールディングス	448.8	465.2	805,261	
アドバンスクリエイト	—	3	6,108	
その他金融業 (1.3%)				
全国保証	32	35.9	131,214	
クレディセゾン	93.4	96.8	207,539	
アクリーティブ	10.1	10.5	4,284	
芙蓉総合リース	14.1	14.6	73,876	
興銀リース	23.1	24	57,144	
東京センチュリー	28.9	25.7	97,017	
日本証券金融	54.2	56.2	34,956	
アイフル	206.3	214.1	71,937	
ポケットカード	12.3	9.6	5,788	
リコーリース	9.7	10	34,650	
イオンフィナンシャルサービス	80.8	81.5	166,178	
アコム	247.4	258.6	124,128	
ジャックス	68	70	35,420	
オリエントコーポレーション	532.5	276	58,512	
日立キャピタル	29	30.1	86,417	
アブラスフィナンシャル	59.1	61.2	7,221	
オリックス	872.1	903.9	1,565,102	
三菱UFJリース	312.4	323.8	191,689	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本取引所グループ	361.6	396.9	644,168	
イー・ギャランティ	4	3.7	10,134	
アサックス	2.1	2.2	3,603	
NECキャピタルソリューション	5	5.2	9,412	
不動産業 (2.6%)				
いちご	136.3	121.3	43,910	
日本駐車場開発	148.2	153.9	23,392	
ヒューリック	256.7	266.2	290,424	
三栄建築設計	4.9	5.1	7,930	
野村不動産ホールディングス	81.7	84.7	164,148	
三重交通グループホールディングス	21.8	22.6	8,791	
サムティ	9.9	10.2	11,770	
ディア・ライフ	8.3	8.7	3,366	
エー・ディー・ワークス	112.8	117	5,031	
日本商業開発	5.4	7.1	14,129	
プレサンスコーポレーション	4.2	19.8	27,126	
ユニゾホールディングス	9	10.5	32,182	
THEグローバル社	—	4.5	2,034	
日本管理センター	8.8	9.2	11,803	
サンセイランディック	2.5	2.6	1,960	
エストラスト	2.2	2.2	1,696	
フージャースホールディングス	17.1	16.5	9,949	
オープンハウス	17.8	18.4	50,048	
東急不動産ホールディングス	297.9	308.8	201,955	
飯田グループホールディングス	114.1	106.4	195,776	
ムゲンエステート	4.2	4.4	3,031	
ファーストブラザーズ	—	1.3	2,181	
ハウスドゥ	—	1.5	2,151	
シーアールイー	0.9	1.8	2,957	
ケイアイスター不動産	—	2.6	4,131	
エコナックホールディングス	40	48	2,448	
パーク24	62.2	64.7	197,982	
バラカ	3.5	3.7	7,089	
三井不動産	653	677	1,813,344	
三菱地所	916	949	2,142,367	
平和不動産	23.3	24.1	38,801	
東京建物	142.9	148.1	238,144	
ダイビル	31.7	32.8	35,260	
京阪神ビルディング	20.4	21.1	13,377	

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
住友不動産	295	306	986,544
大京	229	237	52,377
テーオーシー	47.7	49.5	47,718
東京薬天地	20	21	10,962
レオバレス21	145.1	161.1	99,237
スターツコーポレーション	14.1	13	31,278
フジ住宅	15.7	16.3	12,062
空港施設	14.9	15.4	9,055
明和地所	6.8	7	4,893
住友不動産販売	8.9	11.5	31,659
ゴールドクレスト	9.7	11.5	24,092
日本エスリード	4.8	5	7,390
日神不動産	16.4	15.1	8,154
日本エスコン	16.4	17	6,800
タカラレーベン	53.7	55.7	32,306
サンヨーハウジング名古屋	6.3	6.6	6,619
イオンモール	79.5	82.2	137,849
ファースト住建	4.6	4.8	6,739
ランド	57.5	116.2	2,091
トーセイ	16.8	17.4	13,224
穴吹興産	13	1.4	3,752
エヌ・ティ・ティ都市開発	76.5	79.3	82,075
サンフロンティア不動産	14.9	13.7	13,946
エフ・ジェー・ネクスト	10.7	11.1	8,658
インテリックス	2.6	2.9	2,346
ランドビジネス	7.3	7.5	2,167
グランディハウス	10.7	11.1	4,673
日本空港ビルデング	39.3	40.7	162,189
サービス業 (3.6%)			
日本工営	44	9	23,328
ネクスト	36.8	33.4	24,181
ジェイエイシーリクルートメント	8	8.3	12,167
日本M&Aセンター	20.1	39	134,550
ノバレーゼ	3.3	—	—
アコーディア・ゴルフ	36.1	—	—
中広	1.2	1.3	912
タケエイ	11.4	11.8	12,189
トラスト・テック	5.2	5.5	9,542
コシダカホールディングス	—	4.6	11,385

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
パソナグループ	11.3	10	7,920
CDS	3	3.1	3,081
リンクアンドモチベーション	30.7	31.8	15,741
GCA	11.5	12	10,224
エス・エム・エス	16.2	19.2	49,804
テンブホールディングス	91.4	104.5	207,746
リニカル	7.7	7.9	11,044
クックパッド	29.1	30.1	30,100
エスクリ	5.5	4.8	3,604
アイ・ケイ・ケイ	5.8	6	4,218
学情	5.4	5.6	6,630
スタジオアリス	5.3	5.5	12,094
シミックホールディングス	6.6	6.8	10,172
NJS	2.9	3	4,179
総合警備保障	43.5	49.2	216,972
カカココム	93.6	96.4	157,999
アイロムグループ	3.7	4.1	5,645
セントケア・ホールディング	—	1.7	2,929
サイネックス	—	1	1,166
ルネサンス	6.6	6.9	11,329
ディップ	14.4	17.4	40,141
オプトホールディング	9.3	9.7	8,671
新日本科学	12.9	15	8,595
ツクイ	15.4	32	22,464
キャリアデザインセンター	2.7	2.8	3,312
エムスリー	112.9	117	337,194
ツカダ・グローバルホールディング	9.5	9.8	6,066
アウトソーシング	7.4	7.7	28,451
ウエルネット	9.8	10.1	12,685
ワールドホールディングス	2.9	3	5,505
ディー・エヌ・エー	58.4	60.6	157,620
博報堂DYホールディングス	180.6	187.2	246,916
ぐるなび	15.1	19.5	43,192
エスアールジータカミヤ	14	14.6	8,482
ジャパンバストレスキューシステム	16.1	16.7	4,258
ファンコムコミュニケーションズ	33.1	34.3	25,141
ライク	2.7	2.4	5,952
ビジネス・ブレークスルー	—	4.3	1,810
WDBホールディングス	4.7	4.8	6,465

MUAM インデックスファンドTOPIX i (適格機関投資家限定)

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	6.3	6.5	4,511
バリュエコマース	12	12.5	4,537
インフォマート	27.6	57.3	35,697
J Pホールディングス	32.3	38.8	9,932
E P Sホールディングス	16.1	16.7	25,166
レグス	2.9	3	2,601
プレステージ・インターナショナル	11	19.1	15,833
アミューズ	7.2	7.5	14,340
ドリームインキュベータ	4.3	4.1	8,286
クイック	6.7	6.9	7,928
T A C	7.2	7.4	1,694
ケネディクス	175	171.3	76,399
電通	145.3	150.6	808,722
テイクアンドギヴ・ニーズ	6.1	6.3	6,325
びあ	3.9	4.1	11,926
イオンファンタジー	4.6	4	12,480
シーティーエス	3.9	3.6	5,961
ネクシィーズグループ	4.7	4.8	7,228
みらかホールディングス	33.3	34.5	175,950
アルプス技研	5.2	5.4	15,136
サニックス	20.8	21.6	4,060
ダイオーズ	2.3	2.4	2,568
日本空調サービス	11.4	12.9	8,810
オリエンタルランド	140.9	146	910,748
ダスキン	33.4	34.6	85,600
明光ネットワークジャパン	16.2	16.7	20,257
ファルコホールディングス	5.7	6.3	9,349
秀英予備校	2.3	2.7	1,271
田谷	2.2	2.3	1,545
ラウンドワン	40.7	42.2	35,026
リゾートトラスト	54.7	52.3	117,622
ビー・エム・エル	7.7	17.7	44,108
ワタベウエディング	3.8	2	1,118
りらいあコミュニケーションズ	21.5	22.3	24,262
リソー教育	24.2	23	14,145
早稲田アカデミー	1.7	1.8	2,077
ユー・エス・エス	157.8	163.5	324,874
東京個別指導学院	6.3	4.4	4,356
サイバーエージェント	34.3	71.1	215,077

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	665.7	690.2	764,741
クリーク・アンド・リバー社	—	4.8	5,236
テー・オー・ダブリュー	10.4	10.8	7,225
セントラルスポーツ	4.4	4.6	15,364
フルキャストホールディングス	13.4	13.9	14,483
リソルホールディングス	13	13	4,511
テクノプロ・ホールディングス	21.1	22	85,470
アトラ	1.4	1.6	1,168
インターワークス	2.3	2.7	3,272
K e e P e r 技研	1.5	1.5	3,141
ファーストロジック	0.7	0.7	1,640
デザインワン・ジャパン	—	0.9	2,545
イー・ガーディアン	—	4.4	8,404
リブセンス	8.7	9	3,996
ジャパンマテリアル	5.4	9.9	15,236
ベクトル	4.1	10.9	13,603
ウチヤマホールディングス	6.7	6.1	2,659
サクセスホールディングス	1	1.3	1,718
キャリアリンク	3.4	3	2,238
I B J	10.1	10.5	6,216
アサンテ	4.8	5	8,720
N・フィールド	6.1	6.4	8,915
バリュエHR	—	1	2,543
M&Aキャピタルパートナーズ	1.6	1.7	6,995
ライドオン・エクスプレス	2.8	3.3	3,115
E R I ホールディングス	3.3	3.5	2,821
アビスト	2	2.1	8,211
ウィルグループ	3	5.4	3,920
エスクロー・エージェント・ジャパン	1	2.2	3,687
日本ビューホテル	1.9	2.7	3,669
リクルートホールディングス	262.8	295.1	1,546,324
エラン	1.7	1.8	2,383
土木管理総合試験所	—	1.3	920
日本郵政	383.3	352.5	512,887
ベルシステム24ホールディングス	25.5	20.6	20,394
一蔵	—	1	1,325
ソラスト	5.8	6.2	8,735
リログループ	4.9	5.1	80,427
東洋	3.9	2.9	14,616

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エイチ・アイ・エス	21.2	22	64,988
ラックランド	2.3	2.4	4,641
共立メンテナンス	9.8	10.9	77,608
イチネンホールディングス	13.6	14.1	16,468
建設技術研究所	8.2	8.5	8,916
スペース	7	7.3	9,227
燦ホールディングス	2.6	2.7	4,279
スバル興業	9	10	5,280
東京テアトル	50	51	7,752
タナベ経営	—	2.6	3,429
ナガワ	2.4	2.5	11,112
よみうりランド	26	27	12,501
東京都競馬	89	92	24,840
常磐興産	48	5	8,140
カナモト	18.2	18.8	54,576
東京ドーム	52	53.9	57,888
西尾レントオール	10.5	10.9	36,297
アゴラ・ホスピタリティー・グループ	64	67	2,412
トランス・コスモス	15.1	15.7	40,694
乃村工藝社	27.9	28.9	55,834
藤田観光	43	44	15,576
KNT-CTホールディングス	74	76	10,564
日本管財	11.2	11.6	20,717

銘柄	期首(前期末)			
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
トーカイ	5.8	6	24,240	
白洋舎	1.2	1.3	3,538	
セコム	135.6	140.5	1,176,687	
セントラル警備保障	5.7	5.9	11,528	
丹青社	24.4	23.3	20,201	
メイテック	15.8	16.3	70,905	
アサツー ディ・ケイ	21.2	22	65,758	
応用地質	12.3	12.8	18,969	
船井総研ホールディングス	16.7	17.3	33,942	
進学会	6.2	5.6	3,192	
オオバ	9.4	10.5	4,956	
学究社	1.9	3.5	5,610	
ベネッセホールディングス	43.7	45.3	153,340	
イオンデイライト	12.6	15.2	51,148	
ナック	8	8.3	8,175	
ニチイ学館	22.6	23.5	19,834	
ダイセキ	24.5	23.6	53,760	
ステップ	4.4	4.5	6,318	
合 計	株数・金額	204,752	195,606	290,226,687
	銘柄数<比率>	1,963	1,998	<99.2%>

(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、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	百万円
		1,388	—

<有価証券の貸付及び借入の状況>

2017年2月14日現在における貸付株数の総株数は28,144,800株です。

うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUF G証券株式会社に対する貸付は、28,144,800株です。

T O P I X 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]

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(T O P I X)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
11期(2012年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(T O P I X)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。T O P I Xに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、T O P I Xの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。東京証券取引所は、T O P I Xの算出もしくは公表の方法の変更、T O P I Xの算出もしくは公表の停止またはT O P I Xの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

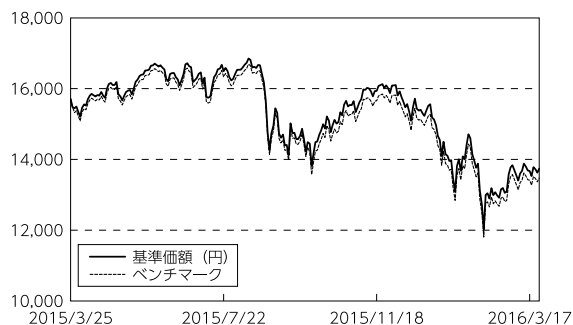
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ12.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内株式市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

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

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

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

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

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.7%程度でした。

- ・配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

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

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

◎今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2015年3月26日～2016年3月25日)

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年3月26日～2016年3月25日)

株式

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

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

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

○株式売買比率

(2015年3月26日～2016年3月25日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年3月26日～2016年3月25日)

利害関係人との取引状況

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

利害関係人の発行する有価証券等

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

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 294

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

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

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

○組入資産の明細

(2016年3月25日現在)

国内株式

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ダイダシ	16	16	12,432	
日比谷総合設備	15	14.5	23,751	
東芝プラントシステム	18.9	19.5	28,099	
OSJBホールディングス	15.8	24.5	6,198	
東洋エンジニアリング	56	64	18,880	
千代田化工建設	84	87	75,342	
新興ブランテック	23.9	24.7	21,365	
食料品 (5.0%)				
日本製粉	71	79	74,576	
日清製粉グループ本社	127.5	131.9	250,478	
日東富士製粉	9	9	3,339	
昭和産業	48	49	24,402	
鳥越製粉	9.2	9.5	6,194	
中部飼料	11.1	11.1	9,690	
フィード・ワン	69.9	72.4	9,267	
東洋精糖	18	18	1,872	
日本甜菜製糖	59	61	12,017	
三井製糖	46	47	24,158	
塩水港精糖	12.4	12.9	3,366	
日新製糖	—	5.1	7,558	
森永製菓	105	108	64,368	
中村屋	27	28	13,412	
江崎グリコ	26.8	27.8	160,406	
名糖産業	5.1	5.3	7,197	
不二家	66	69	13,317	
山崎製パン	85	88	206,008	
第一屋製パン	16	18	1,872	
モロゾフ	18	18	7,686	
亀田製菓	6.5	6.7	30,150	
寿スピリッツ	2.8	2.9	20,590	
カルビー	43	44.6	205,606	
森永乳業	104	108	64,800	
六甲バター	5.2	5.4	9,849	
ヤクルト本社	62.3	64.5	336,690	
明治ホールディングス	34.4	71.3	645,265	
雪印メグミルク	27.3	28.3	81,673	
ブリマハム	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	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
林兼産業	37	39	39	3,978
丸大食品	60	62	62	28,520
米久	3.7	3.8	3.8	10,263
S Foods	7.3	7.5	7.5	18,757
サッポロホールディングス	190	184	184	105,800
アサヒグループホールディングス	233.7	225.7	225.7	773,022
キリンホールディングス	497.4	487.5	487.5	774,150
宝ホールディングス	91.2	87.1	87.1	80,219
オエノンホールディングス	30	33	33	6,765
養命酒製造	7	3.7	3.7	7,396
コカ・コーラウエスト	39.4	40.7	40.7	111,721
コカ・コーライーストジャパン	35.3	42.6	42.6	81,706
サントリー食品インターナショナル	69.7	82.4	82.4	400,876
ダイドードリンコ	5.9	6.1	6.1	32,452
伊藤園	34.5	35.7	35.7	127,627
キーコーヒー	10.2	10.6	10.6	20,691
ユニカフェ	3.1	3.2	3.2	3,072
ジャパンフーズ	1.5	1.5	1.5	1,795
日清オイリオグループ	56	64	64	30,528
不二製油グループ本社	31	32.1	32.1	66,093
かどや製油	1.1	1.2	1.2	3,567
J-オイルミルズ	49	50	50	18,450
キッコーマン	95	91	91	343,980
味の素	268	258	258	705,888
キュービー	59.1	61.2	61.2	157,528
ハウス食品グループ本社	43	41.1	41.1	89,762
カゴメ	44.9	43.2	43.2	94,176
焼津水産化学工業	5.5	5.7	5.7	5,853
アリアケジャパン	10.6	9.8	9.8	65,072
ピエトロ	—	1.1	1.1	2,251
エバラ食品工業	1.9	2.9	2.9	5,988
ニチレイ	124	128	128	117,632
東洋水産	60.7	59.1	59.1	244,378
イートアンド	1.3	1.3	1.3	3,035
日清食品ホールディングス	49.2	50.9	50.9	280,968
永谷園ホールディングス	11	11	11	12,397
一正蒲鉾	2	4.2	4.2	4,170
フジッコ	11	11.7	11.7	28,126
ロック・フィールド	6	6.3	6.3	22,239

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本たばこ産業	644.2	711.1	711.1	3,290,970
ケンコーマヨネーズ	3.8	3.9	3.9	9,192
わらべや日洋	6.8	6.5	6.5	16,061
なとり	5.3	6	6	10,206
北の達人コーポレーション	—	1.7	1.7	799
ユーグレナ	25.3	40.7	40.7	65,852
ミヨシ油脂	40	41	41	5,166
理研ビタミン	3.4	3.5	3.5	14,350
繊維製品 (0.7%)				
片倉工業	13.6	14.1	14.1	16,186
グンゼ	88	91	91	30,303
東洋紡	430	445	445	76,095
ユニチカ	316	327	327	18,312
富士紡ホールディングス	53	55	55	12,375
日清紡ホールディングス	69	—	—	—
倉敷紡績	111	115	115	23,805
シキボウ	62	69	69	7,866
日本毛織	34	34.6	34.6	26,884
大東紡織	16	16	16	960
トーア紡コーポレーション	49	4.8	4.8	2,448
ダイドーリミテッド	12.1	12.7	12.7	6,197
帝国繊維	11.4	11.8	11.8	18,349
帝人	444	460	460	180,320
東レ	841	816	816	776,016
サカイオーベックス	29	30	30	5,370
住江織物	27	28	28	9,072
日本フェルト	5.8	6	6	2,802
イチカワ	7	7	7	2,002
日本バイリーン	15	—	—	—
日東製網	13	12	12	1,692
芦森工業	23	24	24	3,960
アツギ	91	87	87	10,005
ダイニック	21	21	21	3,360
セーレン	27.1	28	28	36,232
東海染工	15	16	16	2,160
小松精練	18.1	17.3	17.3	11,072
ワコールホールディングス	65	67	67	93,130
ホギメディカル	6.8	7.1	7.1	42,955
レナウン	26.3	30.7	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
T S Iホールディングス	48.5	50.2	38,352
三陽商会	57	63	16,191
ナイガイ	40	41	2,009
オンワードホールディングス	78	75	57,375
ルック	18	20	3,100
キムラタン	484	478	2,868
ゴールドウイン	25	4.8	22,752
デサント	24.8	25.6	41,472
キング	5.4	5.6	2,223
ヤマトインターナショナル	7.1	7	2,737
パルプ・紙 (0.3%)			
特種東海製紙	63	65	26,065
王子ホールディングス	446	461	214,826
日本製紙	52.4	58.1	121,661
三菱製紙	166	171	14,193
北越紀州製紙	67.4	69.8	47,813
中越パルプ工業	41	45	8,775
巴川製紙所	17	17	3,400
大王製紙	48	49.8	48,804
レンゴー	96	99	57,519
トーモク	34	35	9,695
ザ・バック	7.7	8	21,352
化学 (6.1%)			
クラレ	185	177.4	235,587
旭化成	678	701	510,468
共和レザー	7.1	7.4	6,578
コープケミカル	16	—	—
昭和電工	723	749	84,637
住友化学	800	828	424,764
日本化成	20	21	2,499
住友精化	23	23	14,536
日産化学工業	71.3	67.6	196,580
ラサ工業	41	42	4,620
クレハ	76	85	30,005
多木化学	7	7	4,697
テイカ	18	19	10,374
石原産業	182	202	15,554
片倉コープアグリ	7	14	3,318

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	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
日本パーカラライジング	25.6	57.5	58,477
高圧ガス工業	16	17	11,118
チタン工業	13	13	2,483
四国化成工業	16	16	15,408
戸田工業	22	22	6,798
ステラ ケミファ	5.5	5.7	12,431
保土谷化学工業	33	34	6,460
日本触媒	85	16.3	94,377
大日精化工業	45	43	20,425
カネカ	147	152	146,072
三菱瓦斯化学	187	193	117,923
三井化学	494	477	178,398
J S R	107.3	105.5	172,809
東京応化工業	22.5	22.6	65,110
大阪有機化学工業	7.8	8	4,688
三菱ケミカルホールディングス	679.3	753.2	454,857
日本合成化学工業	25	26	18,356
ダイセル	152.8	158.1	236,359
住友ベークライト	102	105	46,830
積水化学工業	252	255.3	350,782
日本ゼオン	94	97	70,907
アイカ工業	32.7	33.8	77,334
宇都興産	547	602	121,002
積水樹脂	16.8	17.3	25,880

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ゼリア新薬工業	22.2	23	34,132	
第一三共	365.4	378.1	957,160	
キョーリン製薬ホールディングス	29	30	64,980	
大幸薬品	4.8	5.5	7,612	
ダイト	4.4	4.7	13,921	
大塚ホールディングス	215.6	241.7	1,005,472	
大正製薬ホールディングス	26.1	27	243,810	
ペプチドリーム	—	13.8	82,524	
石油・石炭製品 (0.5%)				
日本コークス工業	97.4	90.7	7,437	
昭和シェル石油	97.1	113.1	112,308	
コスモ石油	300	—	—	
ニチレキ	13	13.7	11,398	
東燃ゼネラル石油	164	170	171,360	
ユシロ化学工業	6.4	6	8,040	
ピーピー・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	
パンドー化学	40	41	20,664	
ガラス・土石製品 (0.9%)				
日東紡績	80	74	26,936	
旭硝子	535	593	357,579	
日本板硝子	524	542	43,360	
石塚硝子	14	16	3,440	
日本山村硝子	43	45	7,830	

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

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

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	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C o	3.6	3.7	4,236
SUMCO	74.7	88	65,120
川田テクノロジーズ	2	2.1	7,518
東洋製織グループホールディングス	77.2	79.9	171,305
ホッカンホールディングス	26	29	9,048
コロナ	5.7	5.9	6,478
横河ブリッジホールディングス	20.5	21.3	24,984
駒井ハルテック	19	20	4,800
高田機工	9	10	2,070
三和ホールディングス	104.7	113.8	94,681
文化シャッター	30	31.3	29,860
三協立山	14.2	14.7	21,535
アルインコ	4.6	6.3	6,419
東洋シャッター	2.7	2.8	1,584
L I X I Lグループ	161.3	156.5	365,114
日本フィルコン	7.9	8.2	3,526
ノーリツ	21.3	22	39,974
長府製作所	11.6	12	30,612
リンナイ	20.2	20.9	212,135
ダイニチ工業	5.5	5.7	3,511
日東精工	15	16	4,608
三洋工業	14	14	2,212
岡部	21.4	23.3	18,057
ジーテクト	7.4	11.7	15,572
中国工業	1.7	1.7	1,190
東プレ	20.9	21.6	46,396
高周波熱練	18.7	20.9	16,448

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		
	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
バイオニア	155.9	173.7	46,725
日本電波工業	9.4	9.7	7,275
鈴木	1.3	3.1	1,596
日本トリム	2.5	2.9	15,979
ローランド ディー. ジー.	4.2	5.3	11,850
フォスター電機	10.6	13.5	32,319
クラリオン	55	57	19,380
SMK	31	32	18,656
ヨコオ	8.1	7.6	4,020
東光	24	22	8,272
ティアック	56	78	3,354
ホシデン	31.4	32.5	21,255
ヒロセ電機	16.8	17.3	219,191
日本航空電子工業	30	31	40,362
TOA	11.1	12.7	13,944
日立マクセル	15.5	17.8	30,669
古野電気	12.3	12.8	8,601
ユニデンホールディングス	28	34	4,488
アルパイン	24.7	25.6	33,024
スミダコーポレーション	9.3	8.8	6,512
アイコム	5.7	5.9	12,649
リオン	2.9	4.1	6,629

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
モバイルクリエイト	6	7	3,269
オルトプラス	1.9	3.9	1,532
ブロードリーフ	8.4	10.9	14,834
ハーツユナイテッドグループ	3.1	3.2	7,532
ブイキューブ	—	5.2	8,002
サイバーリンクス	—	1.2	1,098
VOYAGE GROUP	—	2.4	3,434
オブティム	—	0.7	3,507
ベリサーブ	1.2	1.2	4,536
ティーガイア	10.2	10.5	14,595
日本アジアグループ	—	9	5,031
豆蔵ホールディングス	8	8.3	6,200
テクマトリックス	4.4	4.5	8,356
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	—	185.1	56,085
GMOペイメントゲートウェイ	8.9	9.2	68,172
ザッパラス	5.7	6	2,364
インターネットイニシアティブ	16.7	17.1	38,936
さくらインターネット	—	5.2	7,144
GMOクラウド	1.7	2.3	2,295
ビットアイル	11.6	—	—
SRAホールディングス	5.4	6.1	16,152
Minor iソリューションズ	—	1.5	1,408
システムインテグレータ	1.5	1.5	1,275
パイブドビッツ	1	—	—
朝日ネット	10.5	9.6	4,771
コムチュア	1.7	1.8	4,230
gumi	7.7	10.9	7,139
パイブドHD	—	1.3	1,518
パナソニック インフォメーションシステム	2.4	—	—
フェイス	3.1	2.8	3,712
ハイマックス	—	1.4	1,692
野村総合研究所	58	74.3	280,111
サイバネットシステム	8.4	8.6	7,980
CEホールディングス	1.2	1.6	1,316
インテージホールディングス	5.8	5.5	8,112
東邦システムサイエンス	3	3.1	1,990
ソースネクスト	5.1	5.3	2,321
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
C I J	9.3	9.7	4,297
東洋ビジネスエンジニアリング	1	1.1	1,502
日本エンタープライズ	6.9	10.9	2,365
WOWOW	2.4	5	12,870
フュージョンパートナー	4.3	6	3,036
日本コロムビア	3.6	3.6	1,630
イマジカ・ロボット ホールディングス	5.4	9	3,708
ネットワンシステムズ	41.6	45.9	28,320
アルゴグラフィックス	4.2	4.8	8,313
マーベラス	17.3	17.9	17,935
エイベックス・グループ・ホールディングス	20.3	19.5	27,651
日本ユニシス	28.3	29.2	42,252
兼松エレクトロニクス	6.5	6.7	12,957
東京放送ホールディングス	61.3	63.5	110,998
日本テレビホールディングス	93.5	96.7	179,088

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
NSD	23.9	22.5	38,227	
コナミホールディングス	41.6	47.8	146,746	
福井コンピュータホールディングス	2.8	2.3	2,757	
J BCCホールディングス	8.6	8.9	6,230	
ミロク情報サービス	6.7	7.8	7,761	
ソフトバンクグループ	541.5	600.3	3,323,260	
卸売業 (4.3%)				
ハウスイ	8	8	952	
高千穂交易	3.9	4.1	3,944	
伊藤忠食品	2.5	2.6	11,362	
エレマテック	4.8	4.9	10,363	
JALUX	2.9	3.4	7,837	
あらた	23	4.8	12,187	
トーマンデバイス	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
メディバルホールディングス	102.4	106	191,754
アドヴァン	5.2	10.8	11,070
SPK	2.2	2.4	4,963
萩原電気	2.8	2.7	5,467
アズワン	7.3	8.3	34,818
スズデン	3.3	3.4	3,852
尾家産業	3.3	3.4	3,151
シモジマ	6.3	7.3	8,285
ドウシシャ	13.2	12.5	27,275
小津産業	2	2.3	5,135
高速	6.1	6.3	5,556
たけびし	3.6	3.7	3,751
黒田電気	17.2	19.7	34,140
丸文	9	9.4	7,463
ハビネット	6.2	9.6	9,753
橋本総業	1.9	2.2	3,473
エクセル	4.7	5.1	7,252
マルカキカイ	3.3	3.4	5,205
ガリバーインターナショナル	31	28.5	37,306
日本エム・ディ・エム	8.5	8.8	5,350
進和	6	6.2	9,262
エスケイジャパン	2.6	2.6	1,016
ダイトエレクトロン	4.7	4.8	3,628
シークス	6.5	6.7	23,282
田中商事	3.1	3.2	2,121
オーハシテクニカ	6.3	6	7,512

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	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
すてきなイスグループ	44	45	6,570
昭光通商	36	38	2,964

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	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	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			
イオンデジライト	10.5	10.8	40,338			
ナック	7.2	6.9	6,430			
ニチイ学館	21.2	19.5	15,502			
ダイセキ	17.4	21.1	39,963			
ステップ	3.6	3.8	3,826			
合 計	株数・金額	172,412	178,041	216,833,264		
	銘柄数<比率>	1,858	1,933	<98.2%>		

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	百万円	百万円
	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MUF G証券株式会社に対する貸付は、24,569,000株です。

○投資信託財産の構成

(2016年3月25日現在)

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年3月25日現在)

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

○損益の状況 (2015年3月26日～2016年3月25日)

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

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

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

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

<注記事項>

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

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

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

【お知らせ】

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型株式投資信託／国際株式型（一般型）	
信託期間	無期限（2007年3月15日設定）	
運用方針	マザーファンドを通じて、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。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。	
主要運用対象	ベビーフンド	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。なお、当ファンドで直接投資することがあります。
	マザーファンド	MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	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。
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。	

運用報告書（全体版）

MUAM 外国株式インデックスファンド （適格機関投資家限定）



第9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「MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）」は、去る5月12日に第9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。



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

お客様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)

お客様のお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			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 組入比率	純資産 総額	
	(分配落)	税 分	込 配	み 金	期 騰					中 落
	円	円	円	円換算ベース	騰落率	%	%	%	百万円	
5期(2012年5月14日)	6,774		0	△7.1	74.99	△9.3	95.2	2.6	2.0	7,208
6期(2013年5月13日)	10,579		0	56.2	114.32	52.4	96.3	1.0	2.3	20,400
7期(2014年5月12日)	12,345		0	16.7	130.71	14.3	96.7	1.1	2.1	21,945
8期(2015年5月12日)	15,620		0	26.5	162.29	24.2	96.5	1.2	2.2	22,307
9期(2016年5月12日)	13,324		0	△14.7	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7	91,817

- (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) 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」、「投資信託組入比率」は実質比率を記載しております。
- (注) 「株式先物比率」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		M S C I K o k u s a i I n d e x (MSCIコクサイインデックス)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	円	騰 落 率	(円換算ベース)	騰 落 率			
(期 首) 2015年5月12日	15,620	—	162.29	—	96.5	1.2	2.2
5月末	16,150	3.4	167.17	3.0	94.8	1.2	2.2
6月末	15,506	△ 0.7	160.34	△ 1.2	96.0	1.8	2.2
7月末	15,938	2.0	164.73	1.5	98.2	1.1	2.3
8月末	14,668	△ 6.1	151.30	△ 6.8	94.5	3.0	2.4
9月末	13,663	△12.5	140.71	△13.3	95.3	2.3	2.5
10月末	15,153	△ 3.0	155.86	△ 4.0	95.1	1.4	2.5
11月末	15,315	△ 2.0	157.46	△ 3.0	94.8	5.3	2.4
12月末	14,952	△ 4.3	153.40	△ 5.5	94.3	3.8	2.5
2016年1月末	13,621	△12.8	139.74	△13.9	95.2	2.3	2.6
2月末	13,055	△16.4	133.62	△17.7	95.3	2.1	2.6
3月末	13,807	△11.6	141.17	△13.0	99.9	2.3	2.8
4月末	13,741	△12.0	140.05	△13.7	94.9	3.0	2.6
(期 末) 2016年5月12日	13,324	△14.7	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7

(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」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

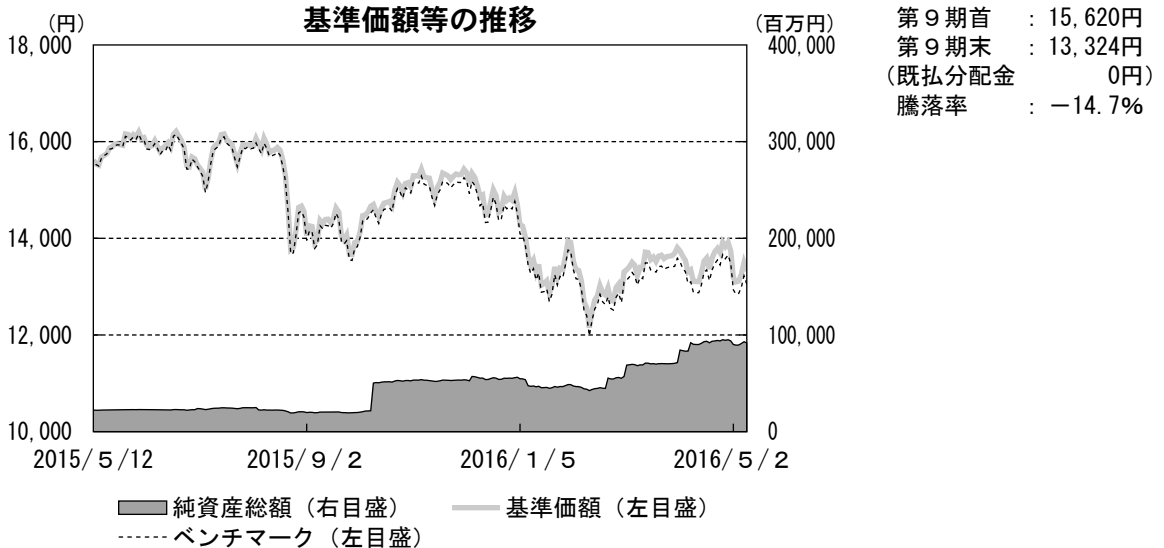
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第9期：2015/5/13～2016/5/12）

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ14.7%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1.7%上回りました。



基準価額の主な変動要因

下落要因	<ul style="list-style-type: none"> ・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が下落したことが、基準価額の下落要因となりました。さらに、米ドルやユーロが円に対して下落したことも基準価額の下落要因となりました。
------	---

投資環境について

（第9期：2015/5/13～2016/5/12）

◎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

<M U A M 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）>

- ・当ファンドは、主として、外国株式インデックスマザーファンド受益証券（以下、マザーファンド）に投資しており、これを通じて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。
- ・資産のほぼ全額をマザーファンドに投資することで、株式（先物・REIT（不動産投資信託証券）を含む）の実質組入比率は高水準を維持しました。このため基準価額は、外国株式市況とほぼ同様の推移となりました。

<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。

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

（注）マルチファクターモデル

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

当該投資信託のベンチマークとの差異について

<MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）>

ベンチマークとのカイ離は1.7%程度となりました。

	マザーファンド保有以外の要因	マザーファンド保有による要因	合計
ベンチマークとのカイ離	△0.2%程度	1.9%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。

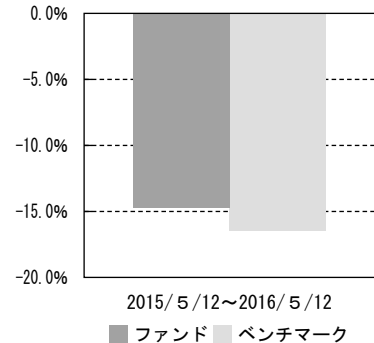
◎マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は△0.2%程度でした。

◎マザーファンド保有による要因

マザーファンド保有による影響は1.9%程度でした。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



<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。

分配金について

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

【分配原資の内訳】 (単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第9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	7,591

(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

<MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）>

- ・ファンド資産のほぼ全額を外国株式インデックスマザーファンド受益証券に投資し、株式の実質組入比率は高水準を維持します。

<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。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	36 (25) (3) (8)	0.248 (0.173) (0.022) (0.054)	(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) 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 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 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 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	3 (2) (0) (1)	0.017 (0.012) (0.000) (0.005)	(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
(c) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	6 (6) (0)	0.043 (0.042) (0.001)	(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
(d) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	8 (8) (0)	0.054 (0.054) (0.000)	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	53	0.362	
期中の平均基準価額は、14,630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
外国株式インデックスマザーファンド	41,513,310	85,750,804	4,642,675	10,002,265

○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	
	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	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

<MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）>

該当事項はございません。

<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		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
	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 20.9%

※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)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国株式インデックスマザーファンド	千口 9,671,569	千口 46,542,204	千円 91,809,151

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

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国株式インデックスマザーファンド	千円 91,809,151	% 99.9
コール・ローン等、その他	114,622	0.1
投資信託財産総額	91,923,773	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	91,923,773,452
コール・ローン等	114,496,607
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	91,809,151,845
未収入金	125,000
(B) 負債	106,615,864
未払解約金	28,799,999
未払信託報酬	77,815,558
未払利息	232
その他未払費用	75
(C) 純資産総額(A-B)	91,817,157,588
元本	68,912,739,710
次期繰越損益金	22,904,417,878
(D) 受益権総口数	68,912,739,710口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,324円

○損益の状況（2015年5月13日～2016年5月12日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	18,622
受取利息	27,152
支払利息	△ 8,530
(B) 有価証券売買損益	△ 5,868,075,724
売買益	511,769,659
売買損	△ 6,379,845,383
(C) 信託報酬等	△ 111,628,063
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 5,979,685,165
(E) 前期繰越損益金	6,410,934,451
(F) 追加信託差損益金	22,473,168,592
(配当等相当額)	(44,743,852,673)
(売買損益相当額)	(△22,270,684,081)
(G) 計(D+E+F)	22,904,417,878
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	22,904,417,878
追加信託差損益金	22,473,168,592
(配当等相当額)	(44,868,429,534)
(売買損益相当額)	(△22,395,260,942)
分配準備積立金	7,449,591,762
繰越損益金	△ 7,018,342,476

<注記事項>

- ①期首元本額 14,281,128,499円
 期中追加設定元本額 61,820,190,081円
 期中一部解約元本額 7,188,578,870円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3324円です。

- (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	1,038,657,311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	44,868,429,534円
分配準備積立金額	6,410,934,451円
当ファンドの分配対象収益額	52,318,021,296円
1万口当たり収益分配対象額	7,591円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－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16日)

外国株式インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2016年5月12日

[計算期間：2015年5月13日～2016年5月12日]

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

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

○最近5期の運用実績

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

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

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

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

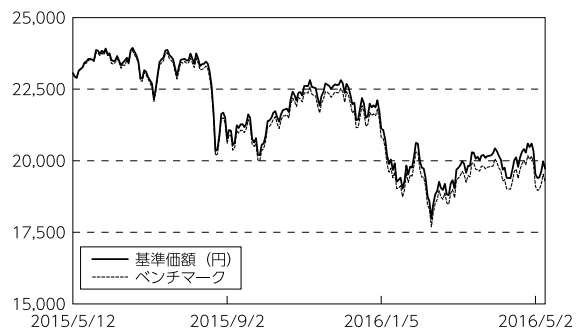
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎外国株式市況

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

◎為替市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

(注) マルチファクターモデル

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

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

	組入比率 要因	銘柄選択 要因	その他の 要因	合計
ベンチマーク とのカイ離	Δ0.0%程度	Δ0.0%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Δ0.0%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Δ0.0%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 Δ0.1%程度

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

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

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

◎今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016年5月12日)

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年5月13日～2016年5月12日)

株式

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
	百株	千アメリカドル	百株	千アメリカドル
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)
		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	千イスラエルシケル 14,127	1,044	千イスラエルシケル 6,150

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

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

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

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

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

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

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

○株式売買比率

(2015年5月13日～2016年5月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月13日～2016年5月12日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$	%
為替直物取引	百万円 192,818	百万円 3,670	1.9	百万円 114,849	百万円 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
EVERETT DENNISON CORP	53	75	570	61,797	素材
CHUBB LTD	196	380	4,713	510,750	保険
ANALOG DEVICES INC	185	258	1,438	155,922	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	18	25	1,943	210,587	小売
CVS HEALTH CORP	679	916	9,541	1,033,975	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ENTERPRISES	136	178	965	104,598	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	758	978	1,846	200,089	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	2,216	3,045	18,822	2,039,781	銀行
CIGNA CORP	154	212	2,779	301,225	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	340	481	3,490	378,215	資本財
COCA-COLA CO/THE	2,337	3,417	15,535	1,683,562	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	329	440	3,095	335,463	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	121	153	1,005	108,926	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	590	807	2,090	226,506	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	118	166	576	62,437	メディア
CHEVRON CORP	1,120	1,557	15,753	1,707,213	エネルギー
COACH INC	163	229	876	94,977	耐久消費財・アパレル

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	株数	当 期		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	
	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
	銘柄 数 < 比 率 >		52	52	—	< 3.6% >
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	692	961	1,260	156,119	保険	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	2,544	—	—	—	銀行	
INTESA SANPAOLO	7,501	10,499	2,368	293,275	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	5,980	9,508	805	99,707	電気通信サービス	
ENI SPA	1,505	2,105	2,827	350,055	エネルギー	
UNICREDIT SPA	2,601	3,948	1,120	138,745	銀行	
ENEL SPA	3,904	6,331	2,513	311,218	公益事業	
SAIPEM SPA	160	4,956	181	22,465	エネルギー	
ATLANTIA SPA	246	342	823	101,976	運輸	
INTESA SANPAOLO-RSP	556	762	165	20,505	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	99	139	664	82,317	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	360	466	298	37,009	各種金融	
SNAM SPA	1,246	1,760	930	115,227	公益事業	

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

銘柄	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	77,814	9,634,233	
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	株数	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UNILEVER NV-CVA	966	1,346	5,282	654,058	家庭用品・パーソナル用品	
VOPAK	41	58	271	33,622	エネルギー	
BOSKALIS WESTMINSTER	51	72	254	31,523	資本財	
DELTA LLOYD NV	130	—	—	—	保険	
TNT EXPRESS NV	259	417	332	41,214	運輸	
OCI NV	49	73	105	13,119	素材	
NN GROUP NV	93	261	776	96,078	保険	
ALTICE NV - B	—	87	121	15,008	メディア	
ALTICE NV - A	—	310	426	52,806	メディア	
小 計	株 数 ・ 金 額	11,264	16,445	29,906	3,702,693	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	28	—	< 1.4% >	
(ユーロ…スペイン)						
BANCO POPULAR ESPANOL	1,061	1,432	297	36,772	銀行	
ENDESA SA	191	265	481	59,643	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	102	158	435	53,896	資本財	
IBERDROLA SA	3,070	4,556	2,751	340,701	公益事業	
TELEFONICA SA	2,651	3,725	3,449	427,117	電気通信サービス	
BANCO SANTANDER SA	8,525	11,932	4,819	596,703	銀行	
BANKINTER SA	403	553	352	43,583	銀行	
REPSOL SA	615	908	1,021	126,497	エネルギー	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,743	5,369	2,960	366,536	銀行	
GAS NATURAL SDG SA	208	293	494	61,215	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	645	898	2,514	311,377	小売	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	239	429	622	77,044	運輸	
MAPPRE SA	539	892	189	23,491	保険	
FERROVIAL SA	246	390	707	87,546	資本財	
FERROVIAL SA-RTS	237	—	—	—	資本財	
ZARDOYA OTIS SA	103	153	139	17,220	資本財	
ENAGAS SA	122	182	478	59,299	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	65	90	705	87,346	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	2,560	4,311	663	82,094	銀行	
CAIXABANK S.A	1,364	2,194	525	65,022	銀行	
GRIFOLS SA	88	245	452	55,979	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	264	361	1,445	178,968	ソフトウェア・サービス	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	493	681	447	55,455	運輸	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	371	486	232	28,794	食品・生活必需品小売り	
BANKIA SA	2,716	3,782	289	35,829	銀行	
AENA SA	36	55	679	84,170	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額	30,669	44,354	27,157	3,362,311	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	25	—	< 1.2% >	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS	128	166	540	66,937	保険	
UCB SA	74	104	697	86,384	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	477	665	7,400	916,197	食品・飲料・タバコ	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	48	66	486	60,178	各種金融	
DELHAIZE GROUP	60	85	787	97,509	食品・生活必需品小売り	
UMICORE	55	78	352	43,607	素材	
COLRUYT SA	42	58	293	36,334	食品・生活必需品小売り	
KBC GROEP NV	149	207	947	117,290	銀行	
SOLVAY SA	34	61	549	67,977	素材	
PROXIMUS	90	126	354	43,869	電気通信サービス	

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

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

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

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

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	10	13	530	59,185	各種金融
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	211	23,628	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	5	6	317	35,414	素材
UBS GROUP AG-REG	2,164	3,026	4,688	523,404	各種金融
DUFREY AG-REG	—	33	439	49,023	小売
GALENICA AG-REG	—	3	435	48,573	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,781 38	13,757 39	87,547 —	9,772,976 <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 銘柄数<比率>	13,047 31	19,293 30	227,270 —	3,029,520 <1.1%>
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	580	809	7,980	105,982	銀行
NORSK HYDRO ASA	805	1,105	3,523	46,797	素材
ORKLA ASA	475	669	5,042	66,958	食品・飲料・タバコ
STATOIL ASA	662	924	12,477	165,699	エネルギー
TELENOR ASA	445	621	8,596	114,158	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	105	147	4,314	57,291	素材
SUBSEA 7 SA	166	—	—	—	エネルギー
SEADRILL LTD	233	—	—	—	エネルギー
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	119	170	2,335	31,020	保険

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
		株 数	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
	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
	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
LENLEASE GROUP	329	468	633	50,638	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	963	1,416	11,049	882,944	銀行
WESTPAC BANKING CORP	1,848	2,757	8,633	689,904	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,387	2,180	6,298	503,299	銀行
BRAMBLES LTD	940	1,325	1,734	138,565	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	373	494	168	13,476	運輸
BORAL LTD	466	622	428	34,251	素材
WOOLWORTHS LTD	750	1,057	2,410	192,634	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	2,553	3,585	2,047	163,585	電気通信サービス
AMP LTD	1,763	2,496	1,452	116,100	保険
TABCORP HOLDINGS LTD	518	692	297	23,798	消費者サービス
AMCOR LIMITED	722	970	1,559	124,595	素材
COMPUTERSHARE LTD	287	403	419	33,556	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	—	464	487	38,919	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	172	256	1,811	144,769	各種金融
CIMIC GROUP LTD	64	84	318	25,483	資本財
ASX LTD	117	165	742	59,312	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	351	501	460	36,780	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	35	48	563	45,021	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	276	377	743	59,438	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	354	467	218	17,499	小売

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
NEWREST MINING LTD	454	637	1,309	104,632	素材	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,392	2,050	1,240	99,113	保険	
ORIGIN ENERGY LTD	664	1,462	743	59,381	エネルギー	
ORICA LTD	222	312	426	34,094	素材	
SONIC HEALTHCARE LTD	229	332	678	54,231	ヘルスケア機器・サービス	
SANTOS LTD	590	1,400	568	45,443	エネルギー	
SUNCORP GROUP LTD	776	1,080	1,390	111,130	保険	
TRANSURBAN GROUP	1,097	1,714	2,130	170,279	運輸	
WESFARMERS LTD	668	936	4,040	322,915	食品・生活必需品小売り	
TOLL HOLDINGS LTD	412	—	—	—	運輸	
CHALLENGER LTD	—	485	451	36,102	各種金融	
SYDNEY AIRPORT	667	949	693	55,389	運輸	
CALTEX AUSTRALIA LTD	163	227	766	61,229	エネルギー	
OTL SEARCH LTD	—	1,148	774	61,871	エネルギー	
WORLEYPARSONS LTD	128	—	—	—	エネルギー	
AGL ENERGY LTD	405	582	1,101	87,983	公益事業	
TATTS GROUP LTD	891	1,244	491	39,281	消費者サービス	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	911	1,276	371	29,678	素材	
ASCIANO LTD	585	547	487	38,961	運輸	
ILUKA RESOURCES LTD	251	354	216	17,313	素材	
AUSNET SERVICES	1,155	1,718	278	22,250	公益事業	
CROWN RESORTS LTD	212	300	361	28,896	消費者サービス	
INCITEC PIVOT LTD	1,020	1,427	461	36,841	素材	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	270	400	385	30,789	銀行	
AURIZON HOLDINGS LTD	1,304	1,764	802	64,166	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	382	619	634	50,701	食品・飲料・タバコ	
ALS LTD	252	—	—	—	商業・専門サービス	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	79	120	836	66,825	ヘルスケア機器・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	34	47	185	14,860	消費者サービス	
SEEK LTD	190	284	467	37,374	商業・専門サービス	
BANK OF QUEENSLAND LTD	228	328	374	29,917	銀行	
REA GROUP LTD	33	48	259	20,774	メディア	
TPG TELECOM LTD	176	247	286	22,881	電気通信サービス	
HEALTHSCOPE LTD	705	1,457	408	32,609	ヘルスケア機器・サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,652	2,309	729	58,330	保険	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	139	195	120	9,600	各種金融	
SOUTH32 LTD	—	4,430	717	57,356	素材	
VOVOC COMMUNICATIONS LTD	—	390	346	27,705	電気通信サービス	
小 計	株 数	金 額	39,535	63,400	87,989	7,031,240
銘 柄 数 < 比 率 >	61	63	—	—	—	< 2.6% >
(ニュージーランド)			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
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
WHELOCK & CO LTD	550	750	2,606	36,409	不動産
WYNN MACAU LTD	904	1,272	1,422	19,866	消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD	1,150	1,660	790	11,038	消費者サービス
FIRST PACIFIC CO	1,420	2,080	1,002	14,005	各種金融
AIA GROUP LTD	7,146	9,976	43,345	605,539	保険
SWIRE PROPERTIES LTD	704	1,004	1,999	27,939	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,370	1,940	4,811	67,212	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	552	852	886	12,378	消費者サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,530	2,280	2,576	35,992	電気通信サービス
WH GROUP LTD	2,240	4,875	2,949	41,202	食品・飲料・タバコ
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	—	2,238	10,532	147,145	不動産
小 計	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	39	39	225,171	3,145,651	
	銘柄 数 < 比 率 >			< 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	
	銘柄 数 < 比 率 >	34	35	—	<2.0%>	
(カナダ)				千カナダドル		
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	—	5	181	15,299	0.0	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	7	11	240	20,250	0.0	

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

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

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

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

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

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

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

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

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

<注記事項>

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

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

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

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

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

【お 知 ら せ】

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型株式投資信託／バランス型	
信託期間	無期限（2007年3月15日設定）	
運用方針	マザーファンドを通じて、わが国の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI総合インデックスと連動する投資成果をめざします。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。	
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を主要投資対象とします。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。
	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。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

運用報告書（全体版）

MUAM 日本債券インデックスファンド （適格機関投資家限定）



第9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「MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）」は、去る5月12日に第9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。



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

お客様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)

お客様のお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	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
		税 分	込 配	み 金	期 騰	中 落			
	円		円			%	%	%	百万円
5期(2012年5月14日)	11,146		0		340.97	2.8	99.4	0.1	28,551
6期(2013年5月13日)	11,292		0		345.99	1.5	98.9	0.8	69,466
7期(2014年5月12日)	11,522		0		353.58	2.2	99.3	0.2	82,510
8期(2015年5月12日)	11,760		0		361.38	2.2	99.4	0.3	142,483
9期(2016年5月12日)	12,584		0		387.29	7.2	99.6	—	269,056

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I S 総 合 イ ン デ ッ ク ス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年 5月12日	円 11,760	% —	361.38	% —	% 99.4	% 0.3
5月 末	11,804	0.4	362.77	0.4	99.2	0.4
6月 末	11,796	0.3	362.54	0.3	99.5	0.3
7月 末	11,828	0.6	363.58	0.6	99.3	0.4
8月 末	11,847	0.7	364.20	0.8	99.3	0.4
9月 末	11,880	1.0	365.24	1.1	99.0	0.1
10月 末	11,923	1.4	366.65	1.5	98.9	0.1
11月 末	11,921	1.4	366.58	1.4	99.4	0.1
12月 末	11,992	2.0	368.88	2.1	99.4	—
2016年 1月 末	12,139	3.2	373.52	3.4	99.0	0.1
2月 末	12,346	5.0	379.83	5.1	98.8	0.3
3月 末	12,443	5.8	382.91	6.0	101.6	0.1
4月 末	12,551	6.7	386.25	6.9	99.8	—
(期 末) 2016年 5月12日	12,584	7.0	387.29	7.2	99.6	—

(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、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

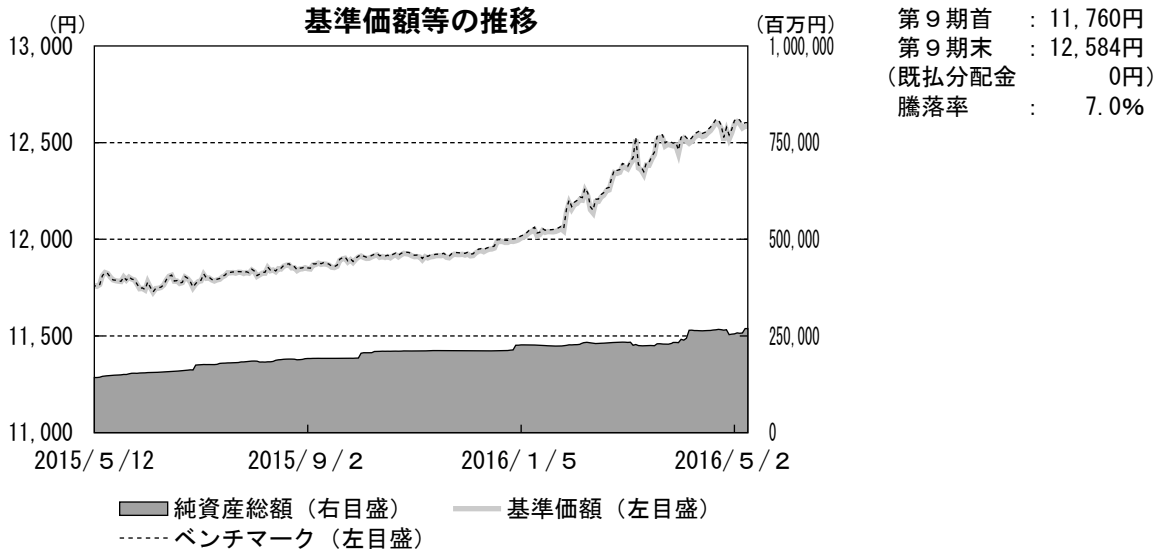
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第9期：2015/5/13～2016/5/12）

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ7.0%の上昇となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（7.2%）を0.2%下回りました。



基準価額の主な変動要因

上昇要因	原油価格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を背景に債券市況が上昇（利回りは低下）したことが基準価額の上昇要因となりました。
------	---

投資環境について

（第9期：2015/5/13～2016/5/12）

◎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

<MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）>

- ・当ファンドは日本債券インデックスマザーファンド受益証券（以下、マザーファンド）に資産のほぼ全額を投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

<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。

（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（先物は考慮していません）。
- ・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

＜MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞
ベンチマークとのカイ離は、 $\Delta 0.2\%$ 程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

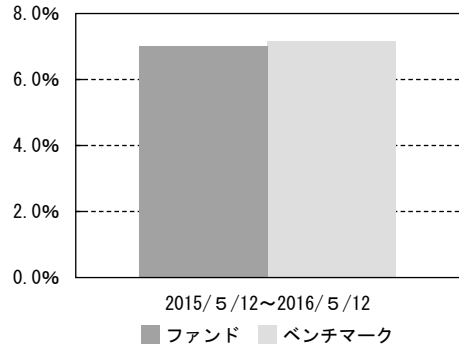
	マザーファンド 保有以外の要因	マザーファンド 保有による要因	合計
ベンチマーク とのカイ離	$\Delta 0.2\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度

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

◎マザーファンド保有以外の要因
ファンドの管理コスト等は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。

◎マザーファンド保有による要因
マザーファンド保有による要因は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

基準価額（ヘビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



<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 $\Delta 0.0\%$ 程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

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

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

- ・ 公社債の実質の組入比率については、期を通じて概ね100%の水準で推移させ、ベンチマークとの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、 $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

分配金について

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

【分配原資の内訳】 (単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第9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	2,584

(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

＜MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞

- ・ベンチマークであるNOMURA-BPI総合インデックスと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日本債券インデックスマザーファンド受益証券に投資し、高い実質公社債組入比率を維持します。

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

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

○ 1万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	円 18 (10) (3) (5)	% 0.151 (0.086) (0.022) (0.043)	(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) 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 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 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 (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	0 (0)	0.000 (0.000)	(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
(c) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	18	0.151	
期中の平均基準価額は、12,039円です。			

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

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

○ 売買及び取引の状況

(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
日本債券インデックスマザーファンド	千口 118,403,285	千円 153,486,472	千口 32,042,458	千円 42,246,787

○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

<MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）>

該当事項はございません。

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

平均保有割合 47.6%

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

(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

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<日本債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額
公社債	百万円 1,600

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

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日本債券インデックスマザーファンド	113,326,227	199,687,055	269,038,369

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

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本債券インデックスマザーファンド	269,038,369	99.9
コール・ローン等、その他	240,619	0.1
投資信託財産総額	269,278,988	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	269,278,988,058
コール・ローン等	240,618,749
日本債券インデックススマザーファンド(評価額)	269,038,369,309
(B) 負債	222,425,337
未払解約金	48,716,144
未払信託報酬	173,708,522
未払利息	488
その他未払費用	183
(C) 純資産総額(A-B)	269,056,562,721
元本	213,808,041,727
次期繰越損益金	55,248,520,994
(D) 受益権総口数	213,808,041,727口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,584円

<注記事項>

- ①期首元本額 121,155,852,303円
 期中追加設定元本額 134,034,262,680円
 期中一部解約元本額 41,382,073,256円
 また、1口当たり純資産額は、期末1,2584円です。

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	2,145,182,814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	11,056,466,421円
収益調整金額	38,499,556,884円
分配準備積立金額	3,547,314,875円
当ファンドの分配対象収益額	55,248,520,994円
1万口当たり収益分配対象額	2,584円
1万口当たり分配金額	—円
収益分配金金額	—円

○損益の状況（2015年5月13日～2016年5月12日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 11,804
受取利息	107,507
支払利息	△ 119,311
(B) 有価証券売買損益	13,513,561,787
売買益	15,416,210,819
売買損	△ 1,902,649,032
(C) 信託報酬等	△ 311,900,748
(D) 当期損益金(A+B+C)	13,201,649,235
(E) 前期繰越損益金	3,547,314,875
(F) 追加信託差損益金	38,499,556,884
(配当等相当額)	(25,284,549,647)
(売買損益相当額)	(13,215,007,237)
(G) 計(D+E+F)	55,248,520,994
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	55,248,520,994
追加信託差損益金	38,499,556,884
(配当等相当額)	(25,404,375,540)
(売買損益相当額)	(13,095,181,344)
分配準備積立金	16,748,964,110

- (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。

[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16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 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	円	騰落率		騰落率			
11期(2012年5月14日)	11,862	2.8	340.97	2.8	99.4	0.1	203,547
12期(2013年5月13日)	12,036	1.5	345.99	1.5	98.9	0.8	269,276
13期(2014年5月12日)	12,299	2.2	353.58	2.2	99.4	0.2	283,162
14期(2015年5月12日)	12,572	2.2	361.38	2.2	99.4	0.3	343,834
15期(2016年5月12日)	13,473	7.2	387.29	7.2	99.6	—	529,456

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

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ7.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内債券市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

*一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

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

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

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

◎組入比率要因

組入比率による影響は0.0%程度でした。

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

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

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

◎その他の要因

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

◎今後の運用方針

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

○1万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016年5月12日)

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年5月13日～2016年5月12日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		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		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債券先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
		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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 286,063	百万円 84,760	% 29.6	百万円 126,250	百万円 49,856	% 39.5

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

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

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公社債	百万円 1,600

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

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

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

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第89回大阪府公募公債（5年）	0.2	100,000	100,219	2017/12/27
第92回大阪府公募公債（5年）	0.14	100,000	100,131	2018/3/28
第306回大阪府公募公債	1.83	30,000	30,727	2017/9/27
第313回大阪府公募公債	1.66	100,000	103,120	2018/4/27
第314回大阪府公募公債	1.8	30,000	31,063	2018/5/29
第316回大阪府公募公債	1.85	100,000	103,951	2018/7/30
第325回大阪府公募公債	1.66	153,000	160,184	2019/4/26
第326回大阪府公募公債	1.66	10,000	10,482	2019/5/28
第331回大阪府公募公債	1.41	100,000	104,606	2019/10/29
第332回大阪府公募公債	1.58	71,600	75,386	2019/11/27
第334回大阪府公募公債	1.47	264,000	277,561	2020/1/28
第337回大阪府公募公債	1.44	110,000	115,897	2020/4/28
第343回大阪府公募公債	0.98	70,000	72,688	2020/10/28
第348回大阪府公募公債	1.32	10,000	10,605	2021/3/30
第351回大阪府公募公債	1.19	100,000	105,761	2021/7/28
第358回大阪府公募公債	0.97	56,000	58,844	2022/2/28
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000	58,948	2022/3/29
第366回大阪府公募公債	0.79	156,000	163,112	2022/11/29
第386回大阪府公募公債	0.585	100,000	104,249	2024/7/30
第389回大阪府公募公債	0.53	100,000	103,915	2024/10/30
平成21年度第5回京都市公募公債	1.35	20,000	20,950	2019/12/24
平成22年度第5回京都市公募公債	1.26	110,000	116,176	2020/12/21
平成23年度第9回京都市公募公債	1.01	140,000	147,919	2022/3/16
平成24年度第3回京都市公募公債（20年）	1.63	200,000	244,844	2032/8/13
平成24年度第10回京都市公募公債	0.67	100,000	104,352	2023/3/22
平成25年度第1回京都市公募公債	0.58	100,000	103,752	2023/4/28
平成25年度第2回京都市公募公債（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	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回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)		2.04	50,000	58,697	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)		1.991	70,000	88,039	2031/6/13
第11回国際協力機構債券(財投機関債)		1.14	30,000	31,855	2021/12/20
第18回東日本高速道路		0.387	100,000	100,546	2017/9/20
第21回東日本高速道路		0.58	100,000	101,180	2018/6/20
第22回東日本高速道路		0.401	100,000	100,803	2018/6/20
第28回東日本高速道路		0.248	100,000	100,767	2019/12/20
第3回中日本高速道路		1.92	300,000	307,779	2017/9/20
第21回中日本高速道路		0.592	100,000	100,818	2017/9/20
第33回中日本高速道路		1.084	50,000	52,829	2021/9/17
第42回中日本高速道路		0.942	100,000	105,358	2022/3/18
第43回中日本高速道路		0.362	100,000	100,521	2017/9/20
第45回中日本高速道路		0.904	300,000	316,758	2022/9/20
第46回中日本高速道路		0.351	200,000	200,950	2017/9/20
第59回中日本高速道路		0.309	100,000	101,590	2021/12/20
第18回西日本高速道路		0.893	100,000	105,873	2023/3/20
第20回西日本高速道路		0.759	100,000	105,239	2023/9/20
第21回西日本高速道路		0.754	400,000	421,180	2023/12/20
第132回福岡北九州高速道路債券		0.704	100,000	104,909	2024/3/19
第21回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		1.86	200,000	208,652	2018/9/20
第43回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		1.026	100,000	105,348	2021/9/17
第64回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		0.193	100,000	100,365	2018/6/20
第5回東京都住宅供給公社債券		2.02	100,000	102,579	2017/9/20
小	計		36,130,167	39,037,654	
金融債券					
い第745号商工債券		0.35	100,000	100,388	2017/6/27
い第773号商工債券		0.2	100,000	100,562	2019/10/25

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

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

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

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

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

○投資信託財産の構成

(2016年5月12日現在)

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

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

<注記事項>

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

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

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

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

②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）	
ファンド・マネジャー（国内債券）	24,560,538,321円
eMAXIS 国内債券インデックス	16,932,463,018円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,513,899,345円
eMAXIS バランス（波乗り型）	318,764,587円
コアバランス	2,495,021円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	24,663,146,879円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	28,138,690,875円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	227,589,648円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	29,184,652,524円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	14,740,056,498円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	2,087,892,777円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	6,373,056,568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)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型
信託期間	2026年2月23日まで（2016年3月25日設定）
運用方針	主としてわが国の物価連動国債に投資を行い、NOMURA 物価連動国債インデックス（フロアあり）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 物価連動国債の組入比率は高位を維持することを基本とします。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用して債券の実質投資比率が100%を超える場合があります。
主要運用対象	わが国の物価連動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は行いません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告に係わる情報

国内物価連動国債インデックスファンド
(適格機関投資家限定)

第1期（決算日：2017年2月23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「国内物価連動国債インデックスファンド（適格機関投資家限定）」は、去る2月23日に第1期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



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。

本資料の表記にあたって

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

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA 物価連動国債インデックス (フロアあり)		債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配	みみ騰落率	騰落率	騰落率			
(設定日)	円	円	%		%	%	%	百万円
2016年3月25日	10,000	—	—	102.66	—	—	—	350
1期(2017年2月23日)	10,021	0	0.2	103.10	0.4	99.7	—	865

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) NOMURA 物価連動国債インデックス (フロアあり) とは、野村證券株式会社が発表している日本国が発行したフロアありの物価連動国債のパフォーマンスインデックスで、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デレージョン等の各指標が日々公表されます。NOMURA 物価連動国債インデックス (フロアあり) 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。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		NOMURA 物価連動国債インデックス (フロアあり)		債組入比率	債券先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(設定日)	円	%		%	%	%
2016年3月25日	10,000	—	102.66	—	—	—
3月末	10,040	0.4	102.68	0.0	99.6	—
4月末	10,030	0.3	102.75	0.1	99.6	—
5月末	10,018	0.2	102.68	0.0	99.6	—
6月末	10,160	1.6	104.12	1.4	99.6	—
7月末	10,147	1.5	104.06	1.4	99.6	—
8月末	9,998	△0.0	102.53	△0.1	99.0	—
9月末	10,019	0.2	102.82	0.2	99.3	—
10月末	10,017	0.2	102.92	0.3	100.1	—
11月末	10,037	0.4	103.14	0.5	100.1	—
12月末	10,093	0.9	103.86	1.2	101.6	—
2017年1月末	10,029	0.3	103.16	0.5	99.6	—
(期末)						
2017年2月23日	10,021	0.2	103.10	0.4	99.7	—

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

(注) 「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

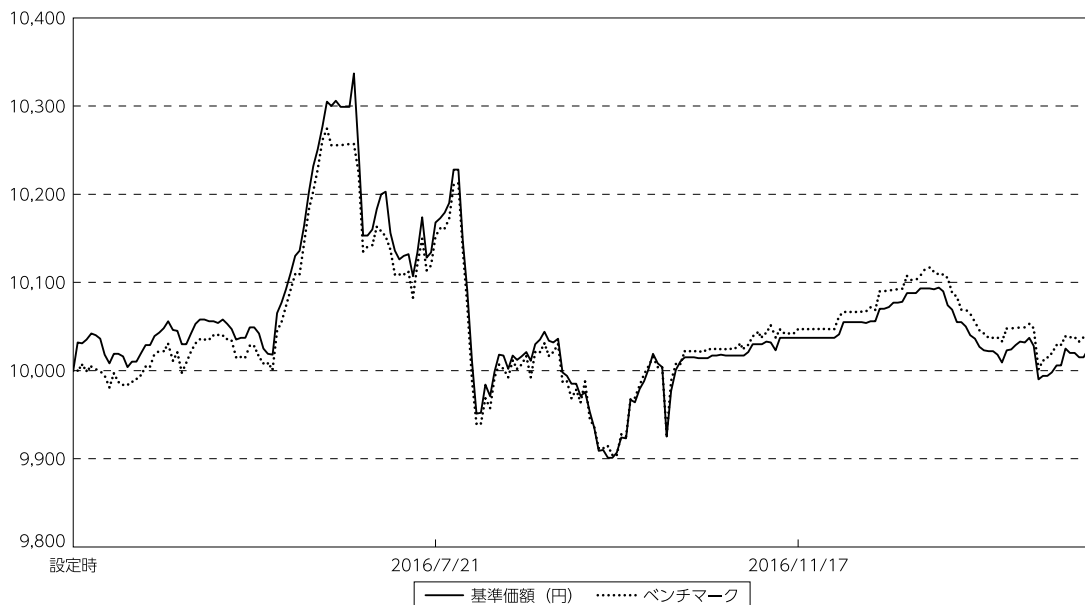
◎基準価額の動き

基準価額は設定時に比べ0.2%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（0.4%）を0.2%下回りました。

基準価額の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

原油価格などの上昇を受けた期待インフレ率の上昇が基準価額の上昇要因となりました。

(下落要因)

信託報酬等の費用などが基準価額の下落要因となりました。

● 投資環境について

◎ 物価連動国債市況

・原油価格が上昇したことなどから、期待インフレ率が上昇し、物価連動国債市況も上昇しました。

● 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に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
- ・ベンチマーク採用全銘柄に投資することで、指数を模倣しました。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.2\%$ 程度と低水準に抑制し、高い運動性を維持しました。

	管理コスト等要因	ポートフォリオ要因	取引要因	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	$\Delta 0.2\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	0.0% 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度

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

◎ 管理コスト等要因

ファンドの管理コスト等は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。

◎ ポートフォリオ要因

ポートフォリオによる影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

- ・公社債の組入比率については、期を通じて高位に保ち、ベンチマークとの運動性を高めるよう努めました。
- ・ベンチマーク採用全銘柄に投資することでベンチマークとの運動性を維持するよう努めました。

◎ 取引要因

取引による影響は 0.0% 程度でした。

◎ 評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は、 $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

- ・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要因です。

● 分配金について

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

【分配原資の内訳】

(単位：円、1万円当たり、税込み)

項目	第1期
	2016年3月25日～ 2017年2月23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	21

(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

- ・ベンチマークであるNOMURA 物価連動国債インデックス（フロアあり）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に投資し、高い公社債組入比率を維持します。
- ・原則としてベンチマークの採用全銘柄へ投資し、指数を模倣します。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2016年3月25日～2017年2月23日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(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 ）	(18)	(0.181)	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 ）	(1)	(0.010)	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 ）	(3)	(0.031)	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) そ の 他 費 用	0	0.003	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.003)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	22	0.226	
期中の平均基準価額は、10,053円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2016年3月25日～2017年2月23日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 1,461,695	千円 599,908

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2016年3月25日～2017年2月23日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 1,461	百万円 47	% 3.2	百万円 599	百万円 241	% 40.2

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

設定時残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 350	百万円 -	百万円 -	百万円 350	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2017年2月23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	816,000 (816,000)	863,378 (863,378)	99.7 (99.7)	— (—)	99.7 (99.7)	— (—)	— (—)
合 計	816,000 (816,000)	863,378 (863,378)	99.7 (99.7)	— (—)	99.7 (99.7)	— (—)	— (—)

(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
	%	千円	千円	
国債証券				
第17回利付国債 (物価連動・10年)	0.1	90,000	96,871	2023/9/10
第18回利付国債 (物価連動・10年)	0.1	108,000	115,734	2024/3/10
第19回利付国債 (物価連動・10年)	0.1	146,000	153,123	2024/9/10
第20回利付国債 (物価連動・10年)	0.1	295,000	310,749	2025/3/10
第21回利付国債 (物価連動・10年)	0.1	177,000	186,899	2026/3/10
合 計		816,000	863,378	

○投資信託財産の構成

(2017年2月23日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	863,378	99.6
コール・ローン等、その他	3,222	0.4
投資信託財産総額	866,600	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年2月23日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	866,600,066
コール・ローン等	2,852,794
公社債(評価額)	863,378,236
未収利息	275,495
前払費用	93,541
(B) 負債	809,627
未払信託報酬	800,002
未払利息	3
その他未払費用	9,622
(C) 純資産総額(A-B)	865,790,439
元本	863,974,853
次期繰越損益金	1,815,586
(D) 受益権総口数	863,974,853口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,021円

<注記事項>

- ①設定元本額 350,000,000円
 期中追加設定元本額 1,127,937,670円
 期中一部解約元本額 613,962,817円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0021円です。

②分配金の計算過程

項 目	2016年3月25日～ 2017年2月23日
費用控除後の配当等収益額	261,796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	1,211,924円
収益調整金額	341,866円
分配準備積立金額	－円
当ファンドの分配対象収益額	1,815,586円
1万口当たり収益分配対象額	21円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況（2016年3月25日～2017年2月23日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	492,553
受取利息	499,395
支払利息	△ 6,842
(B) 有価証券売買損益	2,279,742
売買益	5,986,007
売買損	△3,706,265
(C) 信託報酬等	△1,298,575
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,473,720
(E) 追加信託差損益金	341,866
(配当等相当額)	(10,572)
(売買損益相当額)	(331,294)
(F) 計(D+E)	1,815,586
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	1,815,586
追加信託差損益金	341,866
(配当等相当額)	(10,572)
(売買損益相当額)	(331,294)
分配準備積立金	1,473,720

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型株式投資信託／バランス型	
信託期間	無期限（2007年3月15日設定）	
運用方針	マザーファンドを通じて、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ます。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要運用対象	ベビーファンド	外国債券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することがあります。
	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	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	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。	

運用報告書（全体版）

MUAM 外国債券インデックスファンド （適格機関投資家限定）



第9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「MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）」は、去る5月12日に第9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。



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。

本資料の表記にあたって

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			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
	(分配落)	税込み 分配	み期 金騰落	中 率	期 騰落			
	円	円	%		%	%	%	百万円
5期(2012年5月14日)	8,861	0	2.1	74,734.13	2.1	98.7	—	3,920
6期(2013年5月13日)	11,787	0	33.0	99,491.98	33.1	98.7	—	10,388
7期(2014年5月12日)	12,351	0	4.8	104,415.94	4.9	98.8	—	12,838
8期(2015年5月12日)	13,809	0	11.8	117,169.90	12.2	98.8	—	19,563
9期(2016年5月12日)	12,935	0	△ 6.3	109,931.94	△ 6.2	98.9	—	26,827

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

(注) 「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 イ 世 界 国 債 イ ン デ ッ ク ス (除く日本、 円換算ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年5月12日	円	%		%	%	%
	13,809	—	117,169.90	—	98.8	—
5月末	14,144	2.4	119,576.28	2.1	97.3	—
6月末	13,926	0.8	117,821.48	0.6	98.7	—
7月末	14,116	2.2	119,513.99	2.0	98.8	—
8月末	13,894	0.6	117,759.56	0.5	98.1	—
9月末	13,856	0.3	117,295.48	0.1	98.8	—
10月末	13,864	0.4	117,390.65	0.2	98.7	—
11月末	13,852	0.3	117,622.76	0.4	98.9	—
12月末	13,657	△1.1	115,735.90	△1.2	98.5	—
2016年1月末	13,866	0.4	117,720.03	0.5	97.9	—
2月末	13,155	△4.7	111,665.52	△4.7	98.9	—
3月末	13,388	△3.0	113,814.57	△2.9	101.9	—
4月末	12,955	△6.2	109,994.30	△6.1	98.9	—
(期 末) 2016年5月12日	円	%		%	%	%
	12,935	△6.3	109,931.94	△6.2	98.9	—

(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、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「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9期：2015/5/13～2016/5/12）

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ6.3%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%下回りました。



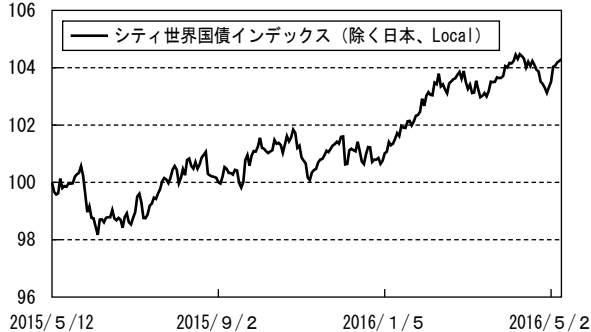
基準価額の主な変動要因

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> 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、先進国の債券市況の指標であるシティ世界国債インデックス（除く日本、Local）が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> 世界的な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たことが基準価額の下落要因となりました。 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たことが基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

（第9期：2015/5/13～2016/5/12）

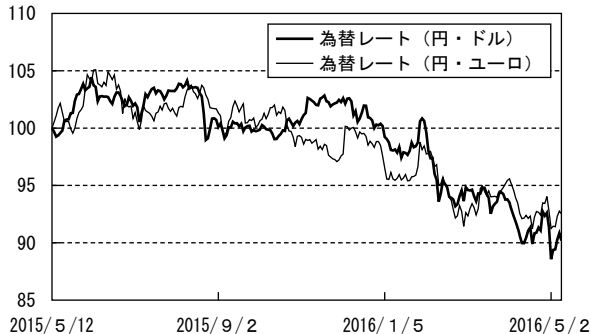
債券市況の推移
（期首を100として指数化）



◎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

<MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）>

- ・当ファンドは、外国債券インデックスマザーファンド受益証券（以下、マザーファンド）を主要投資対象とし、これを通じ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）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・債券の実質組入比率は運用の基本方針にしたがって高水準を維持しました。このため基準価額は、マザーファンドに組み入れられた資産の市況変動の影響を反映しています。

<外国債券インデックスマザーファンド>

基準価額は期首に比べ6.1%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（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	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

<MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）>

基準価額とベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。

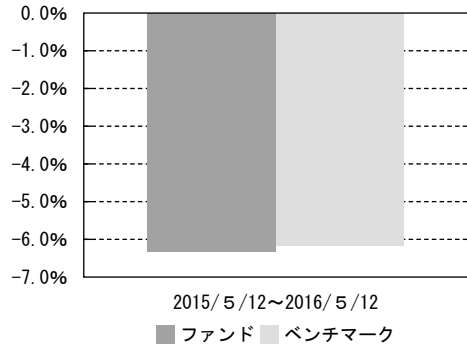
	マザーファンド 保有以外の要因	マザーファンド 保有による要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	$\Delta 0.2\%$ 程度	0.1%程度	$\Delta 0.1\%$ 程度

（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。

◎マザーファンド保有以外の要因
ファンドの管理コスト等は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。

◎マザーファンド保有による要因
マザーファンド保有による影響は0.1%程度でした。

基準価額（ペビィファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



<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	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 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 $\Delta 0.0\%$ 程度でした。
期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

◎管理コスト等要因
管理コスト等による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。
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す。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

【分配原資の内訳】 (単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第9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	4,530

(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

＜MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）＞

- ・ファンドの資産のほぼ全額を外国債券インデックスマザーファンド受益証券に投資し、高い実質外国公社債組入比率を維持します。

＜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		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(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)	(18)	(0.130)	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)	(3)	(0.022)	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)	(7)	(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) そ の 他 費 用	2	0.016	(b) 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)	(0.016)	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	30	0.221	
期中の平均基準価額は、13,722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) 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
外国債券インデックスマザーファンド	5,625,374	11,616,539	1,324,313	2,738,019

○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

<MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）>

該当事項はございません。

<外国債券インデックスマザーファンド>

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

平均保有割合 14.7%

※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）

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期	末
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券インデックスマザーファンド	千口 9,333,697	千口 13,634,758	千円 26,825,024

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

○投資信託財産の構成

（2016年5月12日現在）

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
外国債券インデックスマザーファンド	千円 26,825,024	% 99.9
コール・ローン等、その他	25,669	0.1
投資信託財産総額	26,850,693	100.0

(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	26,850,693,833
コール・ローン等	25,669,730
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	26,825,024,103
(B) 負債	23,692,454
未払信託報酬	23,692,379
未払利息	52
その他未払費用	23
(C) 純資産総額(A-B)	26,827,001,379
元本	20,740,347,400
次期繰越損益金	6,086,653,979
(D) 受益権総口数	20,740,347,400口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,935円

<注記事項>

- ①期首元本額 14,167,620,714円
 期中追加設定元本額 8,960,481,318円
 期中一部解約元本額 2,387,754,632円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.2935円です。

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	528,022,956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	6,255,645,516円
分配準備積立金額	2,613,259,158円
当ファンドの分配対象収益額	9,396,927,630円
1万口当たり収益分配対象額	4,530円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況（2015年5月13日～2016年5月12日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	6,259
受取利息	9,525
支払利息	△ 3,266
(B) 有価証券売買損益	△1,565,383,975
売買益	78,311,458
売買損	△1,643,695,433
(C) 信託報酬等	△ 46,045,898
(D) 当期損益金(A+B+C)	△1,611,423,614
(E) 前期繰越損益金	2,613,259,158
(F) 追加信託差損益金	5,084,818,435
(配当等相当額)	(6,233,586,359)
(売買損益相当額)	(△1,148,767,924)
(G) 計(D+E+F)	6,086,653,979
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	6,086,653,979
追加信託差損益金	5,084,818,435
(配当等相当額)	(6,255,645,516)
(売買損益相当額)	(△1,170,827,081)
分配準備積立金	3,141,282,114
繰越損益金	△2,139,446,570

- (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。

【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16日)

外国債券インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2016年5月12日

[計算期間：2015年5月13日～2016年5月12日]

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

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

○最近5期の運用実績

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

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

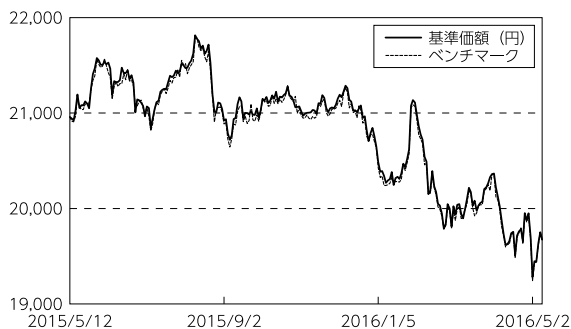
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.1%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎債券市況

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

◎為替市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

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

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は△0.0%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は△0.0%程度でした。

- ・コストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.1%程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。

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

○今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年5月13日～2016年5月12日)

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

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

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

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

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ						
	国債証券					
	0.5 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	評 価 額		償還年月日		
				利 率	額面金額		外貨建金額	邦貨換算金額
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
国債証券	1.125 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	評 価 額		償還年月日		
				利 率	額面金額		外貨建金額	邦貨換算金額
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
国債証券	1.625 T-NOTE 190831	1.625	3,100	3,170	343,584	2019/8/31		
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	2,700	2,759	299,091	2019/12/31		
	1.625 T-NOTE 200630	1.625	3,000	3,063	331,967	2020/6/30		
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	3,800	3,879	420,460	2020/7/31		
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	3,700	3,777	409,395	2020/11/30		
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,700	1,721	186,546	2022/8/15		
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	2,900	2,931	317,661	2022/11/15		
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	5,500	5,445	590,074	2026/2/15		
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	500	511	55,465	2018/10/31		
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	2,800	2,875	311,590	2019/9/30		
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	3,500	3,590	389,103	2020/10/31		
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	2,700	2,769	300,165	2020/12/31		
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	2,700	2,758	298,976	2022/2/28		
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	2,600	2,655	287,793	2022/3/31		
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	2,800	2,858	309,765	2022/4/30		
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	2,500	2,551	276,555	2022/5/15		
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	2,300	2,342	253,827	2022/9/30		
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	2,500	2,541	275,475	2023/1/31		
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	4,300	4,372	473,891	2023/5/15		
	1.875 T-NOTE 170831	1.875	1,900	1,930	209,176	2017/8/31		
	1.875 T-NOTE 170930	1.875	1,700	1,728	187,294	2017/9/30		
	1.875 T-NOTE 171031	1.875	2,500	2,543	275,655	2017/10/31		
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	1,800	1,857	201,245	2020/6/30		
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,800	2,885	312,657	2021/11/30		
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	2,900	2,980	323,013	2022/5/31		
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	2,200	2,257	244,690	2022/8/31		
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	3,700	3,795	411,337	2022/10/31		
	2 T-NOTE 200731	2.0	1,400	1,450	157,229	2020/7/31		
	2 T-NOTE 200930	2.0	1,600	1,659	179,840	2020/9/30		
	2 T-NOTE 201130	2.0	1,300	1,348	146,097	2020/11/30		
	2 T-NOTE 210228	2.0	2,400	2,489	269,800	2021/2/28		
	2 T-NOTE 210531	2.0	2,200	2,282	247,391	2021/5/31		
	2 T-NOTE 210831	2.0	2,400	2,489	269,800	2021/8/31		
	2 T-NOTE 211031	2.0	2,500	2,592	280,915	2021/10/31		
	2 T-NOTE 211115	2.0	3,900	4,044	438,327	2021/11/15		
	2 T-NOTE 220215	2.0	2,900	3,006	325,812	2022/2/15		
	2 T-NOTE 220731	2.0	2,100	2,172	235,399	2022/7/31		
	2 T-NOTE 221130	2.0	2,500	2,583	279,920	2022/11/30		
	2 T-NOTE 230215	2.0	4,400	4,548	492,958	2023/2/15		
	2 T-NOTE 250215	2.0	5,700	5,849	633,923	2025/2/15		
	2 T-NOTE 250815	2.0	5,900	6,045	655,167	2025/8/15		
	2.125 T-NOTE 200831	2.125	3,000	3,124	338,647	2020/8/31		
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	2,300	2,398	259,961	2021/1/31		
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	2,300	2,401	260,233	2021/6/30		
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	3,300	3,444	373,322	2021/8/15		
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	2,500	2,608	282,735	2021/9/30		
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,800	2,921	316,640	2021/12/31		

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
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				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	3.375 T-NOTE 191115		3.375	3,300	3,575	387,460	2019/11/15
	3.5 T-BOND 390215		3.5	1,000	1,201	130,255	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 180215		3.5	1,600	1,678	181,865	2018/2/15
	3.5 T-NOTE 200515		3.5	2,400	2,629	284,918	2020/5/15
	3.625 T-BOND 430815		3.625	4,500	5,512	597,427	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215		3.625	3,600	4,404	477,363	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 190815		3.625	1,700	1,848	200,363	2019/8/15
	3.625 T-NOTE 200215		3.625	4,700	5,158	558,999	2020/2/15
	3.625 T-NOTE 210215		3.625	3,700	4,115	445,984	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815		3.75	1,300	1,615	175,066	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115		3.75	3,600	4,510	488,823	2043/11/15
	3.75 T-NOTE 181115		3.75	2,800	3,006	325,790	2018/11/15
	3.875 T-BOND 400815		3.875	1,400	1,771	191,958	2040/8/15
	3.875 T-NOTE 180515		3.875	1,400	1,489	161,419	2018/5/15
	4 T-NOTE 180815		4.0	900	967	104,855	2018/8/15
	4.25 T-BOND 390515		4.25	800	1,068	115,820	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115		4.25	1,400	1,870	202,745	2040/11/15
	4.25 T-NOTE 171115		4.25	1,500	1,580	171,273	2017/11/15
	4.375 T-BOND 380215		4.375	500	681	73,860	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115		4.375	1,300	1,765	191,323	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515		4.375	1,300	1,765	191,367	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515		4.375	1,700	2,316	251,055	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215		4.5	1,300	1,797	194,845	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515		4.5	800	1,108	120,134	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815		4.5	1,100	1,520	164,775	2039/8/15
	4.5 T-NOTE 170515		4.5	1,100	1,143	123,900	2017/5/15
	4.625 T-BOND 400215		4.625	1,800	2,529	274,159	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215		4.75	1,600	2,292	248,478	2041/2/15
	4.75 T-NOTE 170815		4.75	2,400	2,524	273,569	2017/8/15
	5 T-BOND 370515		5.0	600	884	95,856	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115		5.25	900	1,235	133,925	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215		5.25	700	964	104,560	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215		5.375	1,100	1,582	171,443	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815		5.5	600	837	90,751	2028/8/15
	6 T-BOND 260215		6.0	700	971	105,319	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115		6.125	650	939	101,800	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815		6.25	600	797	86,403	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515		6.25	700	1,070	116,040	2030/5/15
	6.5 T-BOND 261115		6.5	500	728	78,902	2026/11/15
	8 T-BOND 211115		8.0	1,200	1,629	176,616	2021/11/15
	8.125 T-BOND 190815		8.125	600	738	80,053	2019/8/15
	8.75 T-BOND 170515		8.75	1,500	1,624	176,041	2017/5/15
	8.75 T-BOND 200815		8.75	700	922	99,997	2020/8/15
	8.875 T-BOND 190215		8.875	1,000	1,221	132,325	2019/2/15
小 計						65,707,749	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.25 CAN GOVT 170501		0.25	800	797	67,281	2017/5/1

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日	
		利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	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				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	4.25 BUND 390704	4.25	1,000	1,752	216,933	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	1,150	1,773	219,538	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,850	3,190	394,971	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,600	3,016	373,430	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,400	2,414	298,914	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,350	2,194	271,708	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	900	1,345	166,608	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	900	1,617	200,237	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	900	1,532	189,758	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	1,900	1,911	236,638	2018/5/15
		0.3 ITALY GOVT 181015	0.3	700	705	87,299	2018/10/15
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	900	912	112,961	2020/11/1
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	1,200	1,222	151,313	2020/5/1
		0.75 ITALY GOVT 180115	0.75	1,500	1,520	188,259	2018/1/15
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	600	601	74,468	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	1,900	1,961	242,848	2019/12/1
		1.15 ITALY GOVT 170515	1.15	1,200	1,215	150,436	2017/5/15
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,800	1,869	231,404	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	1,500	1,561	193,329	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,300	1,358	168,220	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,900	1,920	237,732	2025/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,300	1,238	153,339	2032/3/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,300	1,361	168,558	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,500	1,627	201,491	2021/12/15
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	550	541	67,016	2036/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,200	1,286	159,254	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	2,200	2,411	298,557	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	900	897	111,089	2047/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,200	1,340	165,954	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 171101	3.5	1,500	1,578	195,465	2017/11/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	2,300	2,466	305,365	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,600	1,742	215,776	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	2,000	2,381	294,865	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	2,000	2,317	286,892	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,400	1,625	201,258	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,600	3,034	375,648	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,800	2,149	266,148	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	2,000	2,316	286,843	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,300	2,894	358,359	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	2,300	2,565	317,596	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	2,600	2,953	365,685	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	2,400	2,770	342,978	2020/3/1
4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	2,200	2,372	293,736	2018/2/1		
4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	2,200	2,420	299,661	2018/8/1		
4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	2,000	2,250	278,646	2019/3/1		
4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	2,400	2,785	344,835	2020/2/1		
4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,400	1,737	215,081	2023/5/1		

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

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

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

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

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

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

銘	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
南アフリカ		%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円		
	国債証券	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	5,500	5,280	38,069	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	5,000	4,701	33,899	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	4,100	4,074	29,374	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	8,500	7,491	54,016	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	5,000	5,021	36,207	2017/9/15
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	5,800	5,123	36,938	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	7,000	6,179	44,556	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	5,000	4,440	32,014	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	9,700	8,597	61,984	2048/2/28
		8.875 SOUTH 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	比 率
	千円	%
公社債	154,462,427	98.7
コール・ローン等、その他	2,009,882	1.3
投資信託財産総額	156,472,309	100.0

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

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月12日現在)

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

<注記事項>

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

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

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

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

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

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

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

【お知らせ】

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

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／海外／債券／インデックス型	
信託期間	2019年9月9日まで（2009年8月28日設定）	
運用方針	マザーファンドを通じて、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。	
主要運用対象	ベビード ファンド	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界各国の公社債に直接投資することがあります。
	マザー ファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビード ファンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	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）

MUAM

ヘッジ付外国債券インデックスファンド （適格機関投資家転売制限付）



第15期（決算日：2017年3月9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「MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）」は、去る3月9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。

本資料の表記にあたって

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			シティ世界国債インデックス		債組入比率	債券先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み	騰落率	(除く日本、円ヘッジ・円ベース)	騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
11期(2015年3月9日)	11,403	50	3.6	377.84	3.6	96.6	—	8,049
12期(2015年9月9日)	11,291	40	△0.6	375.93	△0.5	96.8	—	14,785
13期(2016年3月9日)	11,551	40	2.7	386.67	2.9	98.4	—	22,179
14期(2016年9月9日)	11,867	10	2.8	398.02	2.9	98.5	—	50,900
15期(2017年3月9日)	11,245	30	△5.0	378.59	△4.9	100.1	—	46,917

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に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、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「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		債組入比率	債券先物比率
	騰落率	(除く日本、円ヘッジ・円ベース)	騰落率			
(期首) 2016年9月9日	円	%		%	%	%
	11,867	—	398.02	—	98.5	—
9月末	11,892	0.2	398.82	0.2	96.9	—
10月末	11,636	△1.9	390.37	△1.9	100.9	—
11月末	11,414	△3.8	382.83	△3.8	103.3	—
12月末	11,416	△3.8	383.04	△3.8	101.0	—
2017年1月末	11,276	△5.0	378.53	△4.9	97.2	—
2月末	11,389	△4.0	382.40	△3.9	97.3	—
(期末) 2017年3月9日	11,275	△5.0	378.59	△4.9	100.1	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、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、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

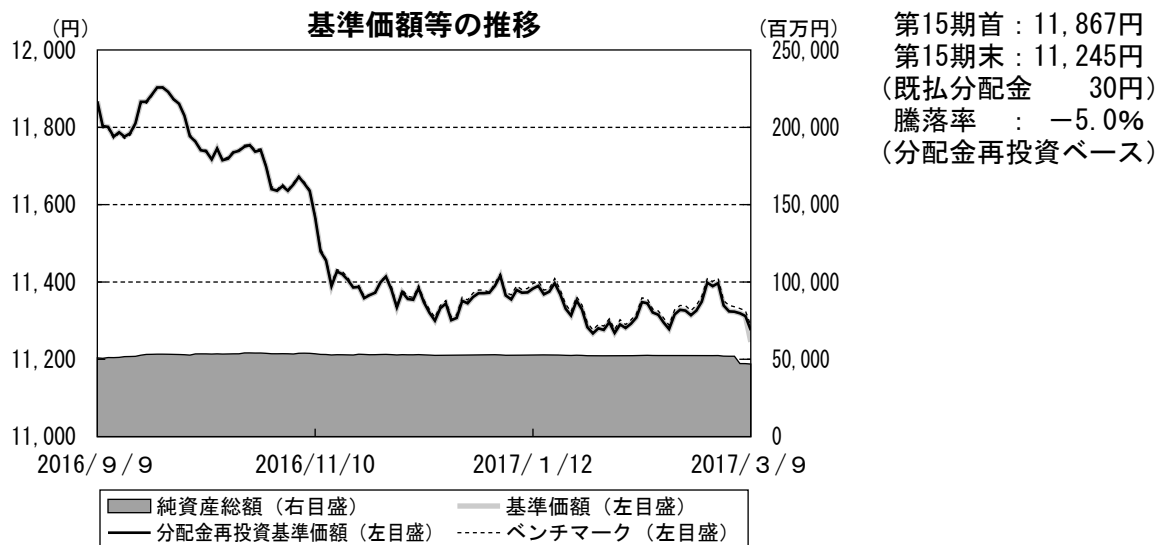
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第15期：2016/9/10～2017/3/9）

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ5.0%（分配金再投資ベース）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（-4.9%）を0.1%下回りました。



- ・分配金再投資基準価額は、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- ・実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なるため、お客さまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の主な変動要因

下落要因	米連邦準備制度理事会（FRB）の利上げに対する期待が高まったことなどを背景に、主要先進国の金利が総じて上昇したことが、基準価額の下落要因となりました。
------	---

投資環境について

（第15期：2016/9/10～2017/3/9）

市況の推移
（期首を100として指数化）



◎債券市況

- ・FRBの利上げに対する期待が高まったことなどから、主要先進国の金利は総じて上昇しました。

— シティ世界国債インデックス
（除く日本、Local）

当該投資信託のポートフォリオについて

<MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）>

- ・当ファンドは、マザーファンドを主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・債券の実質組入比率は運用の基本方針にしたがって高水準を維持しました。

<ヘッジ付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4.9%の下落となりました。

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

（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（2016年9月9日）

期末（2017年3月9日）

最終利回り	0.9%
直接利回り	2.3%
デュレーション	7.3年

最終利回り	1.5%
直接利回り	2.5%
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。
- ・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。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

＜MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）＞

ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。

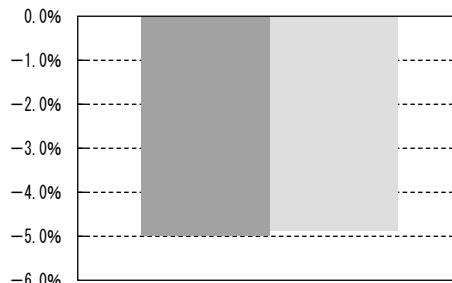
	マザーファンド 保有以外の要因	マザーファンド 保有による要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	$\Delta 0.1\%$ 程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.1\%$ 程度

（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。

◎マザーファンド保有以外の要因
ファンドの管理コスト等は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

◎マザーファンド保有による要因
マザーファンド保有による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

基準価額（ベビーファンド）と
ベンチマークの対比（騰落率）



2016/9/9～2017/3/9

■ ファンド ■ ベンチマーク

- ・ファンドの騰落率は分配金込みで計算していません。

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

ベンチマークは4.9%の下落となったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

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

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は0.0%程度でした。

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

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

為替ヘッジ効果、カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

為替ヘッジ効果：為替変動に伴う外貨建資産の価格変動リスクの低減効果が、ファンドとベンチマークで異なる
ために生じる差異。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は $\Delta 0.0\%$ 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す。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

【分配原資の内訳】 (単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第15期
	2016年9月10日～2017年3月9日
当期分配金	30
(対基準価額比率)	0.266%
当期の収益	30
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,874

(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

＜MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）＞

- ・ファンドの資産のほぼ全額をヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券に投資し、高い実質外国公社債組入比率を維持します。

＜ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド＞

- ・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。
- ・組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行います。

○1万口当たりの費用明細

(2016年9月10日～2017年3月9日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(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)	(6)	(0.053)	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)	(2)	(0.021)	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)	(2)	(0.021)	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) そ の 他 費 用	1	0.008	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.007)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.001)	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
合 計	12	0.104	
期中の平均基準価額は、11,503円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

○売買及び取引の状況

(2016年9月10日～2017年3月9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
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	千口 3,898,951	千円 5,061,769	千口 5,090,386	千円 6,405,002

○利害関係人との取引状況等

(2016年9月10日～2017年3月9日)

利害関係人との取引状況

<MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）>

該当事項はございません。

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	574,380	212,564	37.0	564,467	208,073	36.9
為替直物取引	12,826	9,313	72.6	18,578	8,453	45.5

平均保有割合 56.5%

※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。

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

○組入資産の明細

(2017年3月9日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)			当 期 末		
	口 数	口 数	口 数	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千口	千口	千口	千円
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	38,716,827	37,525,393	46,914,246			

○投資信託財産の構成

(2017年3月9日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	46,914,246	99.6
コール・ローン等、その他	179,823	0.4
投資信託財産総額	47,094,069	100.0

(注) ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（87,225,859千円）の投資信託財産総額（87,468,629千円）に対する比率は99.7%です。

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

1 アメリカドル=114.60円	1 カナダドル=84.91円	1 メキシコペソ=5.83円	1 ユーロ=120.74円
1 イギリスポンド=139.46円	1 スイスフラン=112.88円	1 スウェーデンクローネ=12.65円	1 ノルウェークローネ=13.41円
1 デンマーククローネ=16.24円	1 ポーランドズロチ=28.02円	1 オーストラリアドル=86.28円	1 シンガポールドル=80.80円
1 南アフリカランド=8.72円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年3月9日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	47,094,069,157
コール・ローン等	51,746,153
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	46,914,246,336
未収入金	128,076,668
(B) 負債	176,499,210
未払収益分配金	125,174,604
未払信託報酬	50,816,454
未払利息	44
その他未払費用	508,108
(C) 純資産総額(A-B)	46,917,569,947
元本	41,724,868,252
次期繰越損益金	5,192,701,695
(D) 受益権総口数	41,724,868,252口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,245円

<注記事項>

- ①期首元本額 42,893,846,983円
 期中追加設定元本額 4,435,595,263円
 期中一部解約元本額 5,604,573,994円
 また、1口当たり純資産額は、期末11,245円です。

②分配金の計算過程

項 目	2016年9月10日～ 2017年3月9日
費用控除後の配当等収益額	520,673,897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	6,058,407,830円
分配準備積立金額	1,368,523,018円
当ファンドの分配対象収益額	7,947,604,745円
1万口当たり収益分配対象額	1,904円
1万口当たり分配金額	30円
収益分配金金額	125,174,604円

○損益の状況（2016年9月10日～2017年3月9日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 5,275
受取利息	229
支払利息	△ 5,504
(B) 有価証券売買損益	△2,359,708,195
売買益	261,562,369
売買損	△2,621,270,564
(C) 信託報酬等	△ 51,324,562
(D) 当期損益金(A+B+C)	△2,411,038,032
(E) 前期繰越損益金	1,368,523,018
(F) 追加信託差損益金	6,360,391,313
(配当等相当額)	(6,049,764,983)
(売買損益相当額)	(310,626,330)
(G) 計(D+E+F)	5,317,876,299
(H) 収益分配金	△ 125,174,604
次期繰越損益金(G+H)	5,192,701,695
追加信託差損益金	6,360,391,313
(配当等相当額)	(6,058,407,830)
(売買損益相当額)	(301,983,483)
分配準備積立金	1,764,022,311
繰越損益金	△2,931,711,929

- (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。

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	30円
-----------------	-----

◆分配金は決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、2017年3月9日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2017年3月9日現在）

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

下記は、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド全体（68,761,646千口）の内容です。

外国公社債

(A) 外国（外貨建）公社債 種類別開示

区 分	額面金額	評 価 額		組 入 比 率		残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額	%	うちBB格以下 組入比率	5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 340,170	千アメリカドル 339,949	千円 38,958,201	% 45.3	% —	% 18.3	% 18.7	% 8.3
カナダ	千カナダドル 19,870	千カナダドル 21,503	1,825,838	2.1	—	1.0	0.7	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 123,800	千メキシコペソ 126,294	736,299	0.9	—	0.5	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	43,030	51,088	6,168,368	7.2	—	4.1	2.0	1.0
イタリア	58,440	65,846	7,950,343	9.2	—	5.4	2.8	1.0
フランス	59,540	69,108	8,344,196	9.7	—	6.2	2.7	0.8
オランダ	13,810	16,256	1,962,782	2.3	—	1.4	0.5	0.3
スペイン	33,560	38,505	4,649,146	5.4	—	3.2	1.7	0.4
ベルギー	15,060	18,222	2,200,177	2.6	—	1.9	0.5	0.2
オーストリア	8,560	10,253	1,237,981	1.4	—	1.0	0.4	0.0
フィンランド	3,920	4,403	531,666	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	5,000	5,684	686,299	0.8	—	0.5	0.3	0.1
イギリス	千イギリスポンド 34,960	千イギリスポンド 44,350	6,185,174	7.2	—	5.0	1.6	0.6
スイス	千スイスフラン 1,150	千スイスフラン 1,406	158,821	0.2	—	0.1	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 26,600	千スウェーデンクローネ 30,595	387,031	0.5	—	0.3	0.2	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 16,530	千ノルウェークローネ 17,612	236,178	0.3	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 24,850	千デンマーククローネ 31,213	506,906	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 19,510	千ポーランドズロチ 19,753	553,499	0.6	—	0.3	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 19,480	千オーストラリアドル 20,776	1,792,574	2.1	—	1.3	0.6	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 6,290	千シンガポールドル 6,560	530,094	0.6	—	0.4	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 60,400	千南アフリカランド 56,387	491,697	0.6	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	86,093,280	100.1	—	52.2	34.2	13.8

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

(注) 組入比率は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ						
	国債証券					
	0.625 T-NOTE 180430	0.625	2,400	2,385	273,374	2018/4/30
	0.625 T-NOTE 180630	0.625	500	496	56,881	2018/6/30
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	2,100	2,092	239,842	2018/2/28
	0.75 T-NOTE 180331	0.75	2,000	1,991	228,259	2018/3/31
	0.75 T-NOTE 180415	0.75	600	597	68,464	2018/4/15
	0.75 T-NOTE 180430	0.75	300	298	34,222	2018/4/30
	0.75 T-NOTE 180731	0.75	700	695	79,690	2018/7/31
	0.75 T-NOTE 181031	0.75	400	396	45,437	2018/10/31
	0.75 T-NOTE 190215	0.75	1,800	1,779	203,902	2019/2/15
	0.75 T-NOTE 190715	0.75	1,100	1,081	123,986	2019/7/15
	0.75 T-NOTE 190815	0.75	3,700	3,634	416,549	2019/8/15
	0.875 T-NOTE 180531	0.875	1,900	1,893	216,957	2018/5/31
	0.875 T-NOTE 180715	0.875	900	896	102,700	2018/7/15
	0.875 T-NOTE 181015	0.875	2,200	2,186	250,573	2018/10/15
	0.875 T-NOTE 190515	0.875	1,100	1,086	124,558	2019/5/15
	0.875 T-NOTE 190615	0.875	500	493	56,563	2019/6/15
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	500	492	56,487	2019/7/31
	0.875 T-NOTE 190915	0.875	1,700	1,673	191,737	2019/9/15
	1 T-NOTE 180315	1.0	700	699	80,122	2018/3/15
	1 T-NOTE 180515	1.0	3,800	3,793	434,680	2018/5/15
	1 T-NOTE 180531	1.0	1,200	1,197	137,224	2018/5/31
	1 T-NOTE 180815	1.0	1,700	1,694	194,218	2018/8/15
	1 T-NOTE 180915	1.0	1,900	1,892	216,880	2018/9/15
	1 T-NOTE 190315	1.0	1,200	1,190	136,472	2019/3/15
	1 T-NOTE 190630	1.0	400	395	45,358	2019/6/30
	1 T-NOTE 190831	1.0	2,000	1,975	226,343	2019/8/31
	1 T-NOTE 190930	1.0	1,500	1,481	169,731	2019/9/30
	1 T-NOTE 191130	1.0	1,300	1,280	146,716	2019/11/30
	1.125 T-NOTE 180615	1.125	2,200	2,198	251,932	2018/6/15
	1.125 T-NOTE 190115	1.125	2,000	1,992	228,313	2019/1/15
	1.125 T-NOTE 190131	1.125	1,000	995	114,129	2019/1/31
	1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,300	1,291	147,984	2019/5/31
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,800	1,776	203,637	2019/12/31
	1.125 T-NOTE 200430	1.125	1,000	982	112,630	2020/4/30
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	3,100	3,003	344,185	2021/2/28
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	2,200	2,119	242,941	2021/6/30
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	2,600	2,501	286,670	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210831	1.125	2,800	2,691	308,420	2021/8/31
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	1,200	1,151	131,965	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 181031	1.25	1,600	1,599	183,317	2018/10/31
	1.25 T-NOTE 181115	1.25	3,300	3,297	377,899	2018/11/15
	1.25 T-NOTE 181130	1.25	400	399	45,795	2018/11/30
	1.25 T-NOTE 181215	1.25	1,300	1,298	148,822	2018/12/15
	1.25 T-NOTE 190131	1.25	1,800	1,796	205,901	2019/1/31

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ						
国債証券						
	1.25 T-NOTE 190430	1.25	2,000	1,992	228,349	2019/4/30
	1.25 T-NOTE 191031	1.25	300	297	34,107	2019/10/31
	1.25 T-NOTE 200131	1.25	900	890	102,060	2020/1/31
	1.25 T-NOTE 200229	1.25	500	494	56,626	2020/2/29
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	1,700	1,653	189,462	2021/3/31
	1.25 T-NOTE 230731	1.25	700	655	75,087	2023/7/31
	1.375 T-NOTE 180630	1.375	600	601	68,923	2018/6/30
	1.375 T-NOTE 180731	1.375	800	801	91,894	2018/7/31
	1.375 T-NOTE 180930	1.375	1,800	1,803	206,682	2018/9/30
	1.375 T-NOTE 181130	1.375	2,400	2,403	275,394	2018/11/30
	1.375 T-NOTE 181231	1.375	1,600	1,601	183,524	2018/12/31
	1.375 T-NOTE 190228	1.375	500	500	57,308	2019/2/28
	1.375 T-NOTE 200131	1.375	3,600	3,574	409,610	2020/1/31
	1.375 T-NOTE 200215	1.375	2,700	2,679	307,087	2020/2/15
	1.375 T-NOTE 200229	1.375	1,600	1,586	181,855	2020/2/29
	1.375 T-NOTE 200331	1.375	900	891	102,213	2020/3/31
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	1,100	1,088	124,760	2020/4/30
	1.375 T-NOTE 200531	1.375	1,600	1,582	181,311	2020/5/31
	1.375 T-NOTE 200831	1.375	1,300	1,280	146,791	2020/8/31
	1.375 T-NOTE 200930	1.375	1,000	984	112,773	2020/9/30
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	2,100	2,064	236,598	2020/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	5,700	5,583	639,900	2021/1/31
	1.375 T-NOTE 210430	1.375	2,600	2,537	290,836	2021/4/30
	1.375 T-NOTE 210531	1.375	2,500	2,437	279,359	2021/5/31
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	1,900	1,794	205,696	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	2,000	1,885	216,038	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	800	753	86,300	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 180831	1.5	2,700	2,710	310,628	2018/8/31
	1.5 T-NOTE 181231	1.5	700	702	80,476	2018/12/31
	1.5 T-NOTE 190131	1.5	600	601	68,958	2019/1/31
	1.5 T-NOTE 190228	1.5	400	401	45,958	2019/2/28
	1.5 T-NOTE 190331	1.5	400	400	45,942	2019/3/31
	1.5 T-NOTE 190531	1.5	800	801	91,801	2019/5/31
	1.5 T-NOTE 191031	1.5	3,700	3,694	423,390	2019/10/31
	1.5 T-NOTE 191130	1.5	2,000	1,996	228,752	2019/11/30
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	1,400	1,389	159,236	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	800	777	89,130	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	1,700	1,625	186,296	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	2,100	2,005	229,886	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	3,000	2,734	313,422	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 190331	1.625	1,400	1,406	161,192	2019/3/31
	1.625 T-NOTE 190430	1.625	2,000	2,008	230,149	2019/4/30
	1.625 T-NOTE 190630	1.625	1,200	1,204	138,024	2019/6/30
	1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,600	1,604	183,904	2019/7/31
	1.625 T-NOTE 190831	1.625	2,500	2,507	287,372	2019/8/31

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ						
国債証券						
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	1,600	1,601	183,488	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 200630	1.625	1,500	1,493	171,161	2020/6/30
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	600	596	68,383	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,500	1,486	170,328	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	400	388	44,511	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	3,100	2,997	343,519	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	4,700	4,517	517,706	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	2,500	2,400	275,107	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	2,200	2,102	240,971	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	3,800	3,522	403,635	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	2,600	2,403	275,450	2026/5/15
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	300	302	34,644	2018/10/31
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	1,500	1,508	172,920	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	1,500	1,495	171,349	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	1,700	1,690	193,769	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	700	687	78,841	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	1,000	981	112,522	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	1,500	1,471	168,596	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,200	1,176	134,834	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,400	1,365	156,504	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	500	485	55,661	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,500	1,451	166,380	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	1,000	1,004	115,078	2020/6/30
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	700	693	79,496	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220131	1.875	2,000	1,979	226,890	2022/1/31
	1.875 T-NOTE 220228	1.875	2,500	2,475	283,724	2022/2/28
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	1,200	1,183	135,639	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,700	1,671	191,517	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	1,100	1,079	123,696	2022/10/31
	2 T-NOTE 200731	2.0	1,500	1,510	173,122	2020/7/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	2,200	2,213	253,695	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	1,200	1,205	138,143	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	2,100	2,105	241,318	2021/2/28
	2 T-NOTE 210531	2.0	1,500	1,500	172,007	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,000	998	114,380	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	1,100	1,096	125,675	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2.0	2,900	2,891	331,353	2021/11/15
	2 T-NOTE 211231	2.0	1,600	1,593	182,643	2021/12/31
	2 T-NOTE 220215	2.0	1,600	1,593	182,579	2022/2/15
	2 T-NOTE 220731	2.0	2,100	2,080	238,460	2022/7/31
	2 T-NOTE 221130	2.0	200	197	22,619	2022/11/30
	2 T-NOTE 230215	2.0	2,300	2,266	259,688	2023/2/15
	2 T-NOTE 250215	2.0	2,400	2,316	265,478	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	3,400	3,267	374,419	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	2,900	2,761	316,424	2026/11/15

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日		
		利 率	額面金額	評 価 額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ	国債証券	2.125	T-NOTE 200831	2.125	1,000	1,010	115,808	2020/8/31
		2.125	T-NOTE 210131	2.125	700	705	80,827	2021/1/31
		2.125	T-NOTE 210630	2.125	1,300	1,306	149,736	2021/6/30
		2.125	T-NOTE 210815	2.125	1,000	1,003	115,034	2021/8/15
		2.125	T-NOTE 210930	2.125	1,000	1,002	114,931	2021/9/30
		2.125	T-NOTE 211231	2.125	1,500	1,502	172,195	2021/12/31
		2.125	T-NOTE 220630	2.125	1,100	1,097	125,794	2022/6/30
		2.125	T-NOTE 231130	2.125	2,000	1,971	225,976	2023/11/30
		2.125	T-NOTE 250515	2.125	3,200	3,111	356,577	2025/5/15
		2.25	T-BOND 460815	2.25	1,250	1,031	118,170	2046/8/15
		2.25	T-NOTE 180731	2.25	600	608	69,753	2018/7/31
		2.25	T-NOTE 210331	2.25	1,800	1,820	208,665	2021/3/31
		2.25	T-NOTE 210430	2.25	900	909	104,284	2021/4/30
		2.25	T-NOTE 210731	2.25	700	706	80,959	2021/7/31
		2.25	T-NOTE 241115	2.25	3,900	3,843	440,445	2024/11/15
		2.25	T-NOTE 251115	2.25	3,400	3,325	381,147	2025/11/15
		2.25	T-NOTE 270215	2.25	1,300	1,265	145,069	2027/2/15
		2.375	T-NOTE 180531	2.375	2,300	2,333	267,389	2018/5/31
		2.375	T-NOTE 180630	2.375	900	913	104,707	2018/6/30
		2.375	T-NOTE 201231	2.375	700	712	81,642	2020/12/31
		2.375	T-NOTE 240815	2.375	3,300	3,287	376,791	2024/8/15
		2.5	T-BOND 450215	2.5	100	87	10,043	2045/2/15
		2.5	T-BOND 460215	2.5	1,600	1,398	160,253	2046/2/15
		2.5	T-BOND 460515	2.5	1,400	1,222	140,059	2046/5/15
		2.5	T-NOTE 230815	2.5	1,500	1,515	173,713	2023/8/15
		2.5	T-NOTE 240515	2.5	2,700	2,717	311,426	2024/5/15
		2.625	T-NOTE 180430	2.625	500	508	58,249	2018/4/30
		2.625	T-NOTE 200815	2.625	1,400	1,438	164,877	2020/8/15
		2.625	T-NOTE 201115	2.625	2,900	2,978	341,349	2020/11/15
		2.75	T-BOND 420815	2.75	1,300	1,210	138,760	2042/8/15
		2.75	T-BOND 421115	2.75	1,500	1,396	160,014	2042/11/15
		2.75	T-NOTE 180228	2.75	200	203	23,283	2018/2/28
		2.75	T-NOTE 190215	2.75	500	513	58,833	2019/2/15
		2.75	T-NOTE 231115	2.75	2,200	2,255	258,442	2023/11/15
		2.75	T-NOTE 240215	2.75	3,000	3,072	352,072	2024/2/15
		2.875	T-BOND 430515	2.875	2,300	2,188	250,751	2043/5/15
		2.875	T-BOND 450815	2.875	2,500	2,366	271,212	2045/8/15
		2.875	T-BOND 461115	2.875	900	852	97,684	2046/11/15
		2.875	T-NOTE 180331	2.875	1,900	1,935	221,754	2018/3/31
		3.0	T-BOND 420515	3.0	4,900	4,788	548,729	2042/5/15
		3.0	T-BOND 441115	3.0	1,200	1,166	133,630	2044/11/15
		3.0	T-BOND 450515	3.0	3,300	3,203	367,159	2045/5/15
		3.0	T-BOND 451115	3.0	2,450	2,376	272,390	2045/11/15
		3.0	T-BOND 470215	3.0	1,100	1,069	122,544	2047/2/15
		3.125	T-BOND 420215	3.125	4,800	4,799	549,994	2042/2/15

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）

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	3.125 T-BOND 430215	3.125	3,050	3,042	348,683	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	300	298	34,226	2044/8/15
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	690	714	81,931	2019/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	1,300	1,359	155,771	2021/5/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	1,600	1,667	191,138	2044/5/15
	3.375 T-NOTE 191115	3.375	1,060	1,110	127,260	2019/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	400	431	49,399	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	1,100	1,160	133,012	2020/5/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	1,750	1,905	218,395	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	1,500	1,633	187,196	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	720	756	86,660	2019/8/15
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	1,630	1,723	197,458	2020/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	3,000	3,194	366,093	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,000	1,110	127,228	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	1,600	1,780	204,059	2043/11/15
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	2,500	2,603	298,329	2018/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	800	905	103,770	2040/8/15
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	1,130	1,166	133,701	2018/5/15
	4 T-NOTE 180815	4.0	670	696	79,874	2018/8/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	600	718	82,313	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	800	956	109,650	2040/11/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	500	608	69,722	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	550	669	76,709	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	800	975	111,813	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	800	998	114,392	2036/2/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	500	618	70,935	2039/8/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	900	1,133	129,899	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	300	385	44,143	2041/2/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	750	945	108,397	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	200	253	29,002	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	500	658	75,421	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815	5.5	100	128	14,692	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	1,120	1,434	164,380	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	390	518	59,429	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	1,560	1,932	221,416	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	700	977	112,069	2030/5/15
	6.5 T-BOND 261115	6.5	140	187	21,503	2026/11/15
	8 T-BOND 211115	8.0	500	632	72,497	2021/11/15
	8.125 T-BOND 190815	8.125	160	185	21,240	2019/8/15
	8.75 T-BOND 200815	8.75	1,100	1,355	155,319	2020/8/15
小 計					38,958,201	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.25 CAN GOVT 180501	0.25	900	895	76,045	2018/5/1
	0.5 CAN GOVT 180801	0.5	900	896	76,163	2018/8/1
	0.5 CAN GOVT 181101	0.5	550	547	46,487	2018/11/1

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）

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		
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
国債証券	0.5 CAN GOVT 190201	0.5	300	298	25,322	2019/2/1
	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	500	482	40,981	2022/3/1
	0.75 CAN GOVT 190501	0.75	400	399	33,886	2019/5/1
	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	500	495	42,067	2020/9/1
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	700	690	58,608	2021/3/1
	0.75 CAN GOVT 210901	0.75	350	343	29,180	2021/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	450	413	35,097	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 180301	1.25	300	301	25,621	2018/3/1
	1.25 CAN GOVT 180901	1.25	350	352	29,935	2018/9/1
	1.5 CAN GOVT 200301	1.5	400	406	34,504	2020/3/1
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	760	763	64,821	2023/6/1
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	700	684	58,090	2026/6/1
	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	700	712	60,528	2019/3/1
	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	1,000	1,021	86,734	2019/9/1
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	500	522	44,354	2025/6/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	750	798	67,823	2024/6/1
	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	830	891	75,731	2022/6/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	600	638	54,186	2048/12/1
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	150	163	13,859	2064/12/1
	3.25 CAN GOVT 210601	3.25	1,250	1,358	115,338	2021/6/1
	3.5 CAN GOVT 200601	3.5	950	1,025	87,099	2020/6/1
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	900	1,082	91,949	2045/12/1
	3.75 CAN GOVT 190601	3.75	960	1,021	86,732	2019/6/1
	4 CAN GOVT 410601	4.0	650	827	70,247	2041/6/1
	4.25 CAN GOVT 180601	4.25	600	625	53,146	2018/6/1
	5 CAN GOVT 370601	5.0	650	916	77,811	2037/6/1
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	440	614	52,178	2029/6/1
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	690	1,012	86,004	2033/6/1
	8 CAN GOVT 270601	8.0	190	297	25,296	2027/6/1
小計					1,825,838	
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	12,100	14,089	82,142	2024/12/5
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	3,400	4,174	24,336	2036/11/20
	4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	10,500	10,250	59,762	2018/6/14
	5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	11,400	10,860	63,319	2019/12/11
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	6,000	5,380	31,370	2026/3/5
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	15,100	14,803	86,304	2021/6/10
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	6,100	5,937	34,618	2022/6/9
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	5,100	5,140	29,966	2027/6/3
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	7,500	7,603	44,329	2031/5/29
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	4,400	4,423	25,789	2034/11/23
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	9,100	9,062	52,836	2042/11/13
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	8,400	8,655	50,460	2020/6/11
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	5,100	5,327	31,061	2023/12/7
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	11,100	11,420	66,581	2018/12/13

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	3,500	3,784	22,061	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	5,000	5,378	31,359	2038/11/18
小 計						736,299	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	900	875	105,678	2026/8/15
		0 OBL 200417	—	1,100	1,125	135,906	2020/4/17
		0 OBL 210409	—	800	819	98,932	2021/4/9
		0 OBL 211008	—	500	511	61,815	2021/10/8
		0 SCHATS 180316	—	1,800	1,816	219,368	2018/3/16
		0 SCHATS 180615	—	200	202	24,420	2018/6/15
		0 SCHATS 180914	—	600	607	73,401	2018/9/14
		0.25 BUND 270215	0.25	300	296	35,784	2027/2/15
		0.25 OBL 180413	0.25	800	810	97,811	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	700	719	86,860	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	900	930	112,290	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	800	829	100,209	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	1,900	1,951	235,602	2026/2/15
		0.5 OBL 190412	0.5	500	514	62,093	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	500	539	65,093	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	1,650	1,773	214,148	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	500	514	62,170	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,400	1,451	175,238	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	900	993	119,906	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	600	664	80,193	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	950	1,053	127,205	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,000	1,114	134,562	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,300	1,450	175,187	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	900	1,018	122,985	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,100	1,233	148,948	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	900	1,029	124,287	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	700	772	93,314	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,100	1,239	149,671	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	900	1,009	121,890	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	750	986	119,100	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,120	1,485	179,409	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,000	1,125	135,916	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	1,100	1,227	148,188	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,300	1,517	183,256	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	800	1,181	142,645	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	1,430	1,575	190,231	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	1,190	1,291	155,944	2019/1/4
		4 BUND 370104	4.0	1,100	1,715	207,115	2037/1/4
		4.25 BUND 180704	4.25	620	662	79,962	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	750	1,240	149,718	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	350	516	62,396	2028/7/4

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	4.75 BUND 340704	4.75	1,050	1,725	208,307	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	810	1,438	173,656	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	800	1,319	159,292	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	650	1,010	122,023	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	680	978	118,197	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	700	1,196	144,420	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	630	1,023	123,604	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.1 ITALY GOVT 190415	0.1	500	499	60,337	2019/4/15
		0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	400	401	48,527	2018/5/15
		0.3 ITALY GOVT 181015	0.3	800	804	97,105	2018/10/15
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	800	790	95,389	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	700	703	84,927	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	300	281	34,034	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	400	403	48,718	2020/5/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,000	972	117,439	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	500	509	61,556	2019/12/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	950	866	104,643	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	700	706	85,254	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	500	504	60,944	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,000	1,029	124,321	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,000	961	116,053	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	1,000	949	114,588	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	650	572	69,119	2032/3/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,000	988	119,319	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,300	1,369	165,366	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	400	392	47,429	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	300	270	32,689	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	200	190	23,028	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	900	944	114,077	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	800	831	100,357	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	750	660	79,736	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	220	181	21,900	2067/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	550	541	65,409	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	500	522	63,063	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,000	1,060	128,006	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,000	1,094	132,174	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	1,600	1,794	216,664	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,150	1,290	155,756	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	1,430	1,609	194,369	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,350	1,520	183,614	2024/9/1
4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,300	1,456	175,806	2020/9/1		
4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,250	1,427	172,400	2037/2/1		
4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	1,500	1,618	195,425	2019/2/1		
4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	1,400	1,536	185,529	2019/9/1		
4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,130	1,259	152,075	2020/3/1		

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	1,410	1,500	181,139	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	1,100	1,195	144,324	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	1,600	1,790	216,159	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,700	1,996	241,013	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,400	1,647	198,899	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	800	947	114,396	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	1,200	1,402	169,353	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,230	1,468	177,264	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	800	974	117,612	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,000	1,240	149,765	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,400	1,659	200,361	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	780	951	114,908	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,800	2,311	279,143	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	950	1,216	146,838	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,120	1,426	172,292	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	1,650	2,113	255,227	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	550	672	81,144	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	1,000	1,223	147,730	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	840	1,152	139,115	2033/2/1
6 ITALY GOVT 310501	6.0	1,450	2,008	242,469	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	1,300	1,792	216,468	2027/11/1		
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	450	642	77,591	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	680	993	119,956	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O.A.T 190225	—	800	807	97,507	2019/2/25
		0 O.A.T 200525	—	1,300	1,311	158,394	2020/5/25
		0 O.A.T 210525	—	800	802	96,920	2021/5/25
		0 O.A.T 220525	—	500	496	59,896	2022/5/25
		0.25 O.A.T 201125	0.25	1,200	1,220	147,335	2020/11/25
		0.25 O.A.T 261125	0.25	900	835	100,829	2026/11/25
		0.5 O.A.T 191125	0.5	1,700	1,740	210,148	2019/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	1,800	1,763	212,928	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	800	768	92,781	2026/5/25
		1 O.A.T 180525	1.0	1,100	1,120	135,305	2018/5/25
		1 O.A.T 181125	1.0	950	974	117,641	2018/11/25
		1 O.A.T 190525	1.0	800	825	99,696	2019/5/25
		1 O.A.T 251125	1.0	1,500	1,518	183,324	2025/11/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	1,050	967	116,854	2036/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	1,550	1,563	188,722	2031/5/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	1,800	1,953	235,902	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	1,500	1,625	196,264	2024/11/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	300	251	30,408	2066/5/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	1,700	1,893	228,624	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	1,400	1,570	189,640	2024/5/25
		2.5 O.A.T 201025	2.5	2,100	2,308	278,680	2020/10/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	1,350	1,538	185,720	2030/5/25

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	2.75 O.A.T 271025	2.75	1,550	1,798	217,110	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	1,800	2,067	249,583	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	2,300	2,646	319,517	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	1,450	1,823	220,204	2045/5/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	1,520	1,701	205,429	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	2,900	3,560	429,869	2026/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	1,510	1,675	202,309	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	1,700	1,973	238,258	2021/4/25
		4 O.A.T 180425	4.0	1,900	1,998	241,244	2018/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	1,550	2,169	261,951	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	800	1,173	141,740	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	530	789	95,290	2060/4/25
		4.25 O.A.T 181025	4.25	880	948	114,546	2018/10/25
		4.25 O.A.T 190425	4.25	1,570	1,728	208,730	2019/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	2,300	2,876	347,331	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	1,400	2,107	254,401	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	900	1,343	162,227	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	1,750	2,587	312,364	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	1,720	2,747	331,761	2032/10/25
6 O.A.T 251025	6.0	910	1,306	157,735	2025/10/25		
8.5 O.A.T 191025	8.5	1,200	1,481	178,903	2019/10/25		
8.5 O.A.T 230425	8.5	500	746	90,155	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	700	706	85,294	2018/4/15
		0 NETH GOVT 220115	—	600	608	73,454	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	700	718	86,795	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	400	397	47,939	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,000	1,002	120,997	2026/7/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	400	404	48,851	2027/7/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	700	726	87,659	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,100	1,227	148,211	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	750	851	102,847	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	500	567	68,475	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	500	618	74,675	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	600	818	98,854	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	600	697	84,275	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	800	911	109,997	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	200	246	29,725	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	760	1,185	143,183	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	850	905	109,353	2018/7/15
4 NETH GOVT 190715	4.0	850	944	114,072	2019/7/15		
4 NETH GOVT 370115	4.0	800	1,227	148,243	2037/1/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	600	908	109,745	2028/1/15		
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	400	580	70,129	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	1,000	1,006	121,474	2018/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25	700	705	85,129	2019/1/31

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
スペイン	国債証券	0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	300	297	35,919	2022/4/30
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	1,200	1,222	147,577	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	1,100	1,138	137,495	2020/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	700	674	81,387	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	900	936	113,092	2020/1/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	500	486	58,715	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,500	1,515	182,960	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,100	1,125	135,885	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	1,050	1,018	122,954	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	800	835	100,843	2025/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,500	1,592	192,320	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	1,200	1,320	159,488	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	500	482	58,294	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	250	251	30,326	2066/7/30
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	450	479	57,949	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	900	1,057	127,698	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	1,080	1,212	146,449	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	880	933	112,715	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	900	1,107	133,743	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	1,160	1,292	156,060	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,150	1,398	168,892	2023/10/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,200	1,333	161,013	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,040	1,294	156,258	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	820	1,079	130,366	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	850	1,058	127,771	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	900	1,053	127,155	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	850	1,145	138,248	2040/7/30
5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	500	665	80,354	2028/10/31		
5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	400	557	67,349	2044/10/31		
5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	900	1,138	137,404	2023/1/31		
5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	1,100	1,338	161,554	2021/4/30		
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,000	1,440	173,871	2032/7/30		
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,000	1,259	152,077	2022/1/31		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	850	1,159	139,939	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,330	1,891	228,406	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	850	867	104,793	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	300	297	35,936	2027/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	750	769	92,861	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	500	484	58,552	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	900	921	111,320	2018/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	300	280	33,864	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	250	265	32,028	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	180	178	21,513	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	800	911	110,086	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	100	103	12,517	2057/6/22

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	2.6 BEL GOVT 240622	2.6	850	990	119,542	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	700	764	92,251	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	400	502	60,696	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,000	1,151	138,979	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	480	689	83,210	2045/6/22
		4 BEL GOVT 180328	4.0	400	419	50,675	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	200	219	26,443	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	800	972	117,414	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	500	692	83,606	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	900	1,090	131,611	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	800	994	120,111	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	800	1,219	147,258	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	500	671	81,044	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	800	1,272	153,672	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,000	1,492	180,183	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	300	307	37,100	2019/10/18
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	450	457	55,294	2026/10/20
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	250	257	31,118	2018/10/19
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	600	642	77,520	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	150	148	17,882	2047/2/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	500	554	66,974	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	600	669	80,778	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	450	477	57,630	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	330	397	48,020	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	300	413	49,947	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	500	600	72,511	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	870	1,021	123,369	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	600	718	86,781	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	190	315	38,042	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	570	655	79,198	2020/7/15
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	600	908	109,735	2037/3/15		
4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	550	606	73,204	2019/3/15		
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	450	627	75,815	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	300	472	57,052	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 220415	—	200	201	24,379	2022/4/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	400	412	49,764	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	250	249	30,156	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	200	195	23,547	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	50	51	6,267	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	250	257	31,057	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	400	437	52,799	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	300	329	39,758	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	150	169	20,471	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	220	285	34,438	2042/7/4
2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	300	367	44,352	2028/7/4		

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
フィンランド	国債証券	3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	250	280	33,892	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	250	290	35,075	2021/4/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	500	651	78,710	2025/7/4
		4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	200	223	26,994	2019/7/4
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	200	207	25,028	2022/3/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	400	397	47,976	2026/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	200	191	23,088	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	300	287	34,668	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	440	485	58,675	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	350	417	50,426	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	400	485	58,626	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	520	577	69,737	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	350	378	45,640	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	590	677	81,859	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	350	416	50,290	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	600	812	98,123	2025/3/13
		5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	300	349	42,156	2019/10/18
		小 計					
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
	国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	300	298	41,634	2022/7/22
		1.25 GILT 180722	1.25	1,600	1,625	226,720	2018/7/22
		1.5 GILT 210122	1.5	1,500	1,567	218,666	2021/1/22
		1.5 GILT 260722	1.5	950	979	136,606	2026/7/22
		1.5 GILT 470722	1.5	400	370	51,703	2047/7/22
		1.75 GILT 190722	1.75	1,500	1,559	217,419	2019/7/22
		1.75 GILT 220907	1.75	1,000	1,064	148,463	2022/9/7
		1.75 GILT 570722	1.75	50	50	7,069	2057/7/22
		2 GILT 200722	2.0	1,150	1,218	169,905	2020/7/22
		2 GILT 250907	2.0	900	972	135,658	2025/9/7
		2.25 GILT 230907	2.25	1,150	1,262	176,062	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	650	824	114,960	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	600	682	95,111	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	1,200	1,547	215,874	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	1,130	1,530	213,431	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	910	1,475	205,836	2068/7/22
		3.75 GILT 190907	3.75	820	895	124,830	2019/9/7
		3.75 GILT 200907	3.75	900	1,011	141,107	2020/9/7
		3.75 GILT 210907	3.75	960	1,105	154,177	2021/9/7
		3.75 GILT 520722	3.75	500	762	106,277	2052/7/22
		4 GILT 220307	4.0	900	1,058	147,655	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	850	1,449	202,089	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	700	912	127,248	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	840	1,142	159,321	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	1,100	1,543	215,216	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	1,050	1,516	211,466	2039/9/7

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）

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	4.25 GILT 401207	4.25	860	1,258	175,496	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	1,000	1,549	216,082	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	840	1,350	188,335	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	1,000	1,718	239,616	2055/12/7
		4.5 GILT 190307	4.5	1,000	1,088	151,870	2019/3/7
		4.5 GILT 340907	4.5	1,050	1,495	208,527	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	650	1,003	139,918	2042/12/7
		4.75 GILT 200307	4.75	1,000	1,138	158,753	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75	800	1,126	157,110	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	670	1,024	142,922	2038/12/7
		5 GILT 180307	5.0	650	681	95,069	2018/3/7
		5 GILT 250307	5.0	1,100	1,447	201,827	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	380	576	80,396	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	350	464	64,729	2021/6/7
小	計					6,185,174	
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	200	223	25,191	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	150	165	18,677	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	280	304	34,344	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	220	279	31,585	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	300	434	49,022	2028/4/8
小	計					158,821	
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	3,000	3,089	39,087	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	3,800	4,114	52,052	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	3,150	3,663	46,345	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	5,000	5,914	74,815	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	2,300	3,071	38,852	2039/3/30
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	4,650	5,108	64,621	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	4,700	5,632	71,256	2020/12/1
小	計					387,031	
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	1,850	1,818	24,384	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	1,950	1,970	26,420	2025/3/13
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	2,800	2,910	39,034	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	2,300	2,535	33,995	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	4,000	4,446	59,628	2021/5/25
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	3,630	3,931	52,716	2019/5/22
小	計					236,178	
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	2,500	2,538	41,228	2018/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	2,350	2,583	41,956	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	4,700	5,269	85,573	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	4,800	5,545	90,064	2021/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	4,100	4,597	74,660	2019/11/15

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
デンマーク		%	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	千円	
	国債証券 4.5 DMK GOVT 391115	4.5	6,400	10,678	173,422	2039/11/15
小	計				506,906	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券 1.5 POLAND 200425	1.5	1,500	1,458	40,853	2020/4/25
	1.75 POLAND 210725	1.75	1,200	1,147	32,144	2021/7/25
	2 POLAND 210425	2.0	1,450	1,405	39,389	2021/4/25
	2.25 POLAND 220425	2.25	600	578	16,198	2022/4/25
	2.5 POLAND 180725	2.5	1,400	1,414	39,628	2018/7/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	1,800	1,644	46,085	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	550	495	13,885	2027/7/25
	3.25 POLAND 190725	3.25	1,200	1,228	34,430	2019/7/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	1,500	1,474	41,325	2025/7/25
	3.75 POLAND 180425	3.75	950	973	27,276	2018/4/25
	4 POLAND 231025	4.0	1,300	1,354	37,961	2023/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	900	982	27,525	2020/10/25
	5.5 POLAND 191025	5.5	1,110	1,200	33,628	2019/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	850	954	26,732	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	1,400	1,586	44,464	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	500	597	16,741	2029/4/25
	POLAND 181025	—	1,100	1,065	29,868	2018/10/25
	POLAND 190425	—	200	191	5,358	2019/4/25
小	計				553,499	
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	800	787	67,973	2020/11/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	500	465	40,189	2028/5/21
	2.75 AUST GOVT 191021	2.75	1,370	1,396	120,503	2019/10/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,400	1,409	121,623	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	600	590	50,916	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	350	317	27,397	2035/6/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	400	340	29,396	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 181021	3.25	850	869	75,061	2018/10/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,300	1,347	116,248	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	1,200	1,225	105,712	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	180	170	14,673	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	520	538	46,442	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,600	1,783	153,870	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	1,400	1,501	129,566	2020/4/15
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	550	634	54,718	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,500	1,746	150,730	2027/4/21
	5.25 AUST GOVT 190315	5.25	1,000	1,066	92,013	2019/3/15
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,200	1,403	121,058	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,510	1,721	148,508	2021/5/15
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,250	1,460	125,969	2022/7/15
小	計				1,792,574	

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）

銘柄	当 期 末					償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
シンガポール		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
国債証券	0.5 SINGAPORGOVT 180401	0.5	350	348	28,127	2018/4/1
	1.25 SINGAPORGOVT 211001	1.25	100	98	7,941	2021/10/1
	1.625 SINGAPORGOV 191001	1.625	250	251	20,353	2019/10/1
	2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	250	254	20,537	2020/7/1
	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	250	247	19,967	2026/6/1
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	600	613	49,580	2021/6/1
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	50	50	4,086	2025/6/1
	2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	450	462	37,366	2019/6/1
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	550	573	46,306	2023/7/1
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	370	387	31,286	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	160	167	13,550	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	300	314	25,391	2029/7/1
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	200	209	16,906	2030/9/1
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	500	528	42,702	2024/9/1
	3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	400	425	34,382	2022/9/1
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	260	275	22,236	2020/9/1
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	390	435	35,183	2033/9/1
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	370	407	32,917	2027/3/1
	4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	490	510	41,270	2018/9/1
小 計					530,094	
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	9,200	10,314	89,945	2026/12/21
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	4,700	3,441	30,013	2036/3/31
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	3,600	2,609	22,756	2041/2/28
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	2,400	2,313	20,177	2021/3/31
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	4,900	4,107	35,815	2031/2/28
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	2,900	2,872	25,050	2020/1/15
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	3,200	3,135	27,344	2023/2/28
	8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	1,900	1,917	16,720	2018/12/21
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	4,700	4,336	37,814	2030/1/31
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	3,800	3,523	30,723	2032/3/31
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	4,500	4,140	36,102	2037/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	4,500	4,195	36,588	2044/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	6,500	6,017	52,473	2048/2/28
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	1,800	1,730	15,085	2035/2/28
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	1,800	1,729	15,084	2040/1/31
小 計					491,697	
合 計					86,093,280	

(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。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

《第8期》決算日2017年1月26日

[計算期間：2016年1月27日～2017年1月26日]

「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第8期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第8期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		債 組入比率	債 先物比率	純 総資産額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
4期(2013年1月28日)	11,375	4.5	343.56	4.6	103.8	—	22,835
5期(2014年1月27日)	11,480	0.9	346.93	1.0	94.3	—	21,815
6期(2015年1月26日)	12,640	10.1	382.26	10.2	91.3	—	33,121
7期(2016年1月26日)	12,613	△ 0.2	381.71	△ 0.1	95.6	—	57,354
8期(2017年1月26日)	12,509	△ 0.8	378.81	△ 0.8	96.9	—	92,179

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (<small>債(日本、円ヘッジ・円ベース)</small>)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
	円	騰 落 率	騰 落 率	%			
(期 首) 2016年1月26日	12,613	—	381.71	—	95.6	—	—
1 月 末	12,655	0.3	382.97	0.3	98.1	—	—
2 月 末	12,795	1.4	387.13	1.4	92.4	—	—
3 月 末	12,830	1.7	388.21	1.7	107.4	—	—
4 月 末	12,736	1.0	385.50	1.0	96.1	—	—
5 月 末	12,820	1.6	388.38	1.7	99.6	—	—
6 月 末	13,114	4.0	396.92	4.0	91.2	—	—
7 月 末	13,170	4.4	398.69	4.4	99.9	—	—
8 月 末	13,197	4.6	399.55	4.7	98.3	—	—
9 月 末	13,176	4.5	398.82	4.5	96.9	—	—
10 月 末	12,894	2.2	390.37	2.3	100.9	—	—
11 月 末	12,650	0.3	382.83	0.3	103.3	—	—
12 月 末	12,654	0.3	383.04	0.3	101.0	—	—
(期 末) 2017年1月26日	12,509	△0.8	378.81	△0.8	96.9	—	—

(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

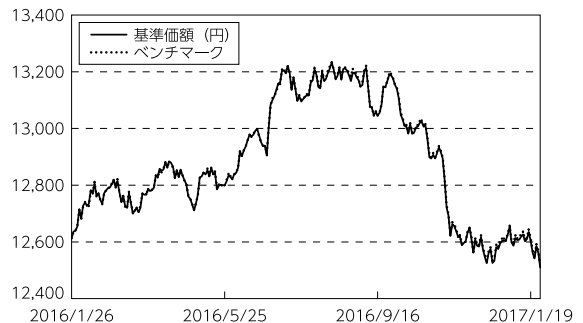
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.8%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−0.8%)と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

◎外国債券市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは0.8%の下落となったため、ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.0$ 程度となりました。

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

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

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は $\Delta 0.1\%$ 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0.1%程度でした。

- ・為替ヘッジ効果、カスタディーフィー、取引コスト等による要因です。

為替ヘッジ効果：為替変動に伴う外貨建資産の価格変動リスクの低減効果が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。

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

債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

○今後の運用方針

- ・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。
- ・組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年 1 月27日～2017年 1 月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.015)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	2	0.015	
期中の平均基準価額は、12,890円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2016年1月27日～2017年1月26日)

公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカドル 279,435	千アメリカドル 120,266
	カナダ	千カナダドル 17,490	千カナダドル 6,868
	メキシコ	千メキシコペソ 99,071	千メキシコペソ 38,380
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 40,312	17,258
	イタリア	国債証券 50,523	18,223
	フランス	国債証券 53,619	19,926
	オランダ	国債証券 11,808	5,021
	スペイン	国債証券 30,025	12,180
	ベルギー	国債証券 13,012	4,852
国	オーストリア	国債証券 7,420	2,579
	フィンランド	国債証券 3,449	1,488
	アイルランド	国債証券 3,540	998
	イギリス	千イギリスポンド 32,091	千イギリスポンド 13,508
	スイス	千スイスフラン 1,124	千スイスフラン 446
	スウェーデン	千スウェーデンクローネ 22,854	千スウェーデンクローネ 8,388
	ノルウェー	千ノルウェークローネ 12,841	千ノルウェークローネ 5,278
	デンマーク	千デンマーククローネ 25,466	千デンマーククローネ 8,974
	ポーランド	千ポーランドズロチ 15,461	千ポーランドズロチ 5,272
	オーストラリア	千オーストラリアドル 16,817	千オーストラリアドル 5,369
	シンガポール	千シンガポールドル 5,380	千シンガポールドル 2,233
	南アフリカ	千南アフリカランド 38,085	千南アフリカランド 11,938

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2016年1月27日～2017年1月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	983,021	474,947	48.3	1,020,009	511,226	50.1
為替直物取引	57,076	39,514	69.2	20,030	10,168	50.8

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三菱東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2017年1月26日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区分	額面金額	当 期		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		評 価 額				5年以上	2年以上	2年未満
		外貨建金額	邦貨換算金額					
アメリカ	千アメリカドル 348,590	千アメリカドル 349,914	千円 39,592,791	% 43.0	% —	% 17.5	% 16.9	% 8.6
カナダ	千カナダドル 20,640	千カナダドル 22,414	1,942,427	2.1	—	1.0	0.7	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 125,700	千メキシコペソ 126,598	679,832	0.7	—	0.4	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	45,850	54,088	6,585,842	7.1	—	3.9	2.3	0.9
イタリア	61,520	70,105	8,535,986	9.3	—	5.5	3.1	0.7
フランス	61,350	71,986	8,765,105	9.5	—	5.9	2.7	0.9
オランダ	14,650	17,187	2,092,732	2.3	—	1.3	0.5	0.4
スペイン	34,660	40,530	4,934,985	5.4	—	3.3	1.6	0.5
ベルギー	15,210	18,331	2,232,030	2.4	—	1.8	0.4	0.2
オーストリア	9,490	11,268	1,372,087	1.5	—	0.9	0.5	0.1
フィンランド	4,000	4,490	546,721	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	4,950	5,671	690,600	0.7	—	0.4	0.3	0.1
イギリス	千イギリスポンド 36,550	千イギリスポンド 45,180	6,460,380	7.0	—	5.0	1.6	0.4
スイス	千スイスフラン 1,550	千スイスフラン 1,842	208,924	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 28,300	千スウェーデンクローネ 32,542	418,172	0.5	—	0.3	0.2	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 17,080	千ノルウェークローネ 18,230	248,663	0.3	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 28,100	千デンマーククローネ 35,298	577,843	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 19,210	千ポーランドズロチ 19,546	546,918	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 20,610	千オーストラリアドル 22,190	1,903,293	2.1	—	1.3	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 6,410	千シンガポールドル 6,637	532,070	0.6	—	0.3	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 62,100	千南アフリカランド 57,568	492,212	0.5	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	89,359,623	96.9	—	50.5	32.6	13.9

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	0.625 T-NOTE 180430	0.625	2,400	2,390	270,435	2018/4/30
	0.625 T-NOTE 180630	0.625	2,500	2,486	281,339	2018/6/30
	0.75 T-NOTE 171231	0.75	1,300	1,298	146,962	2017/12/31
	0.75 T-NOTE 180131	0.75	1,500	1,498	169,559	2018/1/31
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	2,100	2,096	237,243	2018/2/28
	0.75 T-NOTE 180331	0.75	2,000	1,996	225,849	2018/3/31
	0.75 T-NOTE 180415	0.75	600	598	67,728	2018/4/15
	0.75 T-NOTE 180430	0.75	300	299	33,858	2018/4/30
	0.75 T-NOTE 180731	0.75	700	696	78,843	2018/7/31
	0.75 T-NOTE 181031	0.75	400	397	44,936	2018/10/31
	0.75 T-NOTE 190215	0.75	1,800	1,781	201,561	2019/2/15
	0.75 T-NOTE 190715	0.75	1,100	1,083	122,563	2019/7/15
	0.75 T-NOTE 190815	0.75	3,700	3,640	411,868	2019/8/15
	0.875 T-NOTE 180115	0.875	500	500	56,603	2018/1/15
	0.875 T-NOTE 180531	0.875	3,400	3,395	384,153	2018/5/31
	0.875 T-NOTE 180715	0.875	900	897	101,608	2018/7/15
	0.875 T-NOTE 181015	0.875	2,200	2,189	247,792	2018/10/15
	0.875 T-NOTE 190515	0.875	1,100	1,088	123,137	2019/5/15
	0.875 T-NOTE 190615	0.875	500	494	55,931	2019/6/15
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	500	493	55,854	2019/7/31
	0.875 T-NOTE 190915	0.875	1,700	1,675	189,612	2019/9/15
	1 T-NOTE 180215	1.0	1,000	1,001	113,309	2018/2/15
	1 T-NOTE 180315	1.0	2,700	2,702	305,803	2018/3/15
	1 T-NOTE 180515	1.0	3,800	3,800	430,053	2018/5/15
	1 T-NOTE 180531	1.0	1,200	1,200	135,780	2018/5/31
	1 T-NOTE 180815	1.0	1,700	1,698	192,152	2018/8/15
	1 T-NOTE 180915	1.0	1,900	1,896	214,573	2018/9/15
	1 T-NOTE 190315	1.0	1,200	1,192	134,947	2019/3/15
	1 T-NOTE 190630	1.0	400	396	44,871	2019/6/30
	1 T-NOTE 190831	1.0	2,000	1,978	223,886	2019/8/31
	1 T-NOTE 190930	1.0	1,500	1,483	167,802	2019/9/30
	1 T-NOTE 191130	1.0	1,300	1,282	145,118	2019/11/30
	1.125 T-NOTE 180615	1.125	2,200	2,203	249,328	2018/6/15
	1.125 T-NOTE 190115	1.125	2,000	1,995	225,831	2019/1/15
	1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,300	1,293	146,342	2019/5/31
	1.125 T-NOTE 191231	1.125	1,800	1,780	201,434	2019/12/31
	1.125 T-NOTE 200430	1.125	2,200	2,167	245,196	2020/4/30
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	3,100	3,011	340,790	2021/2/28
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	2,200	2,126	240,645	2021/6/30
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	2,800	2,702	305,805	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210831	1.125	2,800	2,700	305,558	2021/8/31
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	1,200	1,155	130,741	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 181031	1.25	1,600	1,602	181,308	2018/10/31
	1.25 T-NOTE 181115	1.25	3,400	3,404	385,205	2018/11/15
	1.25 T-NOTE 181130	1.25	400	400	45,307	2018/11/30
	1.25 T-NOTE 181215	1.25	1,300	1,300	147,204	2018/12/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ	国債証券	1.25	1,800	1,800	203,677	2019/1/31
		1.25	2,000	1,996	225,919	2019/4/30
		1.25	300	298	33,768	2019/10/31
		1.25	900	892	100,967	2020/1/31
		1.25	500	495	56,062	2020/2/29
		1.25	1,700	1,658	187,621	2021/3/31
		1.25	700	656	74,304	2023/7/31
		1.375	600	603	68,232	2018/6/30
		1.375	800	803	90,965	2018/7/31
		1.375	1,800	1,807	204,529	2018/9/30
		1.375	2,400	2,407	272,419	2018/11/30
		1.375	4,300	4,313	488,122	2018/12/31
		1.375	500	501	56,692	2019/2/28
		1.375	400	398	45,061	2020/1/31
		1.375	1,600	1,590	179,979	2020/2/29
		1.375	900	893	101,150	2020/3/31
		1.375	1,100	1,091	123,502	2020/4/30
		1.375	1,800	1,784	201,903	2020/5/31
		1.375	1,300	1,284	145,336	2020/8/31
		1.375	1,000	986	111,673	2020/9/30
		1.375	2,100	2,070	234,254	2020/10/31
		1.375	5,700	5,599	633,617	2021/1/31
		1.375	2,600	2,546	288,099	2021/4/30
		1.375	2,500	2,445	276,753	2021/5/31
		1.375	1,900	1,798	203,530	2023/6/30
		1.375	2,000	1,888	213,676	2023/8/31
		1.375	800	754	85,407	2023/9/30
		1.5	2,700	2,717	307,509	2018/8/31
		1.5	700	703	79,631	2018/12/31
		1.5	600	603	68,229	2019/1/31
		1.5	400	401	45,475	2019/2/28
		1.5	400	401	45,442	2019/3/31
		1.5	800	802	90,827	2019/5/31
		1.5	3,900	3,903	441,733	2019/10/31
		1.5	2,000	2,000	226,379	2019/11/30
		1.5	1,400	1,393	157,655	2020/5/31
		1.5	800	780	88,313	2022/1/31
		1.5	1,700	1,630	184,450	2023/2/28
		1.5	2,100	2,010	227,479	2023/3/31
		1.5	3,000	2,739	309,986	2026/8/15
		1.625	1,400	1,409	159,486	2019/3/31
		1.625	2,000	2,012	227,767	2019/4/30
		1.625	1,200	1,207	136,586	2019/6/30
		1.625	1,600	1,608	182,015	2019/7/31
		1.625	2,500	2,513	284,355	2019/8/31
		1.625	1,600	1,605	181,619	2019/12/31
		1.625	1,500	1,497	169,459	2020/6/30

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.625 T-NOTE 200731	1.625	2,600	2,593	293,477	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,500	1,490	168,703	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	400	389	44,071	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	3,200	3,105	351,330	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	4,700	4,529	512,527	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	2,500	2,406	272,289	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	5,200	4,827	546,274	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	2,600	2,408	272,516	2026/5/15
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	300	303	34,293	2018/10/31
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	1,500	1,512	171,104	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	3,100	3,099	350,682	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	1,700	1,696	191,949	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	700	690	78,122	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	1,000	985	111,470	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	1,500	1,476	167,020	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,200	1,180	133,547	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,400	1,369	154,957	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	500	487	55,107	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,500	1,455	164,726	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	1,000	1,006	113,910	2020/6/30
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	700	696	78,771	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	2,700	2,671	302,330	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,700	1,675	189,634	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	1,100	1,082	122,461	2022/10/31
	2 T-NOTE 200731	2.0	1,500	1,516	171,554	2020/7/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	2,200	2,220	251,263	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	1,200	1,209	136,851	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	2,100	2,112	239,044	2021/2/28
	2 T-NOTE 210531	2.0	1,500	1,506	170,441	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,000	1,001	113,370	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	1,100	1,100	124,533	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2.0	2,900	2,900	328,237	2021/11/15
	2 T-NOTE 220215	2.0	1,600	1,598	180,849	2022/2/15
	2 T-NOTE 220731	2.0	4,000	3,975	449,877	2022/7/31
	2 T-NOTE 221130	2.0	200	197	22,400	2022/11/30
	2 T-NOTE 230215	2.0	2,300	2,272	257,113	2023/2/15
	2 T-NOTE 250215	2.0	2,400	2,321	262,691	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	3,400	3,274	370,463	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	1,500	1,432	162,047	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 200831	2.125	1,000	1,013	114,679	2020/8/31
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	700	707	80,089	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,300	1,311	148,416	2021/6/30
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	1,000	1,007	114,011	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,000	1,006	113,927	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	1,500	1,509	170,759	2021/12/31
	2.125 T-NOTE 220630	2.125	1,100	1,101	124,610	2022/6/30
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	2,000	1,977	223,736	2023/11/30

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日		
		利 率	額面金額	評 価 額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ	国債証券	2.125	T-NOTE 250515	2.125	3,200	3,118	352,886	2025/5/15
		2.25	T-BOND 460815	2.25	1,250	1,039	117,647	2046/8/15
		2.25	T-NOTE 180731	2.25	600	610	69,101	2018/7/31
		2.25	T-NOTE 210331	2.25	1,800	1,827	206,836	2021/3/31
		2.25	T-NOTE 210430	2.25	900	913	103,362	2021/4/30
		2.25	T-NOTE 210731	2.25	700	709	80,275	2021/7/31
		2.25	T-NOTE 241115	2.25	4,000	3,952	447,190	2024/11/15
		2.25	T-NOTE 251115	2.25	3,400	3,333	377,166	2025/11/15
		2.375	T-NOTE 180531	2.375	2,300	2,342	265,012	2018/5/31
		2.375	T-NOTE 180630	2.375	900	917	103,764	2018/6/30
		2.375	T-NOTE 201231	2.375	700	715	80,931	2020/12/31
		2.375	T-NOTE 240815	2.375	3,300	3,298	373,190	2024/8/15
		2.5	T-BOND 450215	2.5	100	88	9,998	2045/2/15
		2.5	T-BOND 460215	2.5	1,600	1,408	159,400	2046/2/15
		2.5	T-BOND 460515	2.5	1,400	1,232	139,437	2046/5/15
		2.5	T-NOTE 230815	2.5	1,500	1,519	171,952	2023/8/15
		2.5	T-NOTE 240515	2.5	2,700	2,727	308,631	2024/5/15
		2.625	T-NOTE 180131	2.625	200	203	23,031	2018/1/31
		2.625	T-NOTE 180430	2.625	500	510	57,766	2018/4/30
		2.625	T-NOTE 200815	2.625	1,400	1,444	163,434	2020/8/15
		2.625	T-NOTE 201115	2.625	2,900	2,991	338,440	2020/11/15
		2.75	T-BOND 420815	2.75	1,300	1,220	138,085	2042/8/15
		2.75	T-BOND 421115	2.75	1,500	1,406	159,103	2042/11/15
		2.75	T-NOTE 180228	2.75	200	203	23,081	2018/2/28
		2.75	T-NOTE 190215	2.75	500	514	58,243	2019/2/15
		2.75	T-NOTE 231115	2.75	2,200	2,261	255,853	2023/11/15
		2.75	T-NOTE 240215	2.75	3,300	3,391	383,721	2024/2/15
		2.875	T-BOND 430515	2.875	2,300	2,205	249,591	2043/5/15
		2.875	T-BOND 450815	2.875	3,100	2,956	334,514	2045/8/15
		2.875	T-BOND 461115	2.875	100	95	10,806	2046/11/15
		2.875	T-NOTE 180331	2.875	1,900	1,943	219,855	2018/3/31
		3.0	T-BOND 420515	3.0	7,000	6,896	780,354	2042/5/15
		3.0	T-BOND 441115	3.0	1,200	1,176	133,096	2044/11/15
		3.0	T-BOND 450515	3.0	3,600	3,521	398,493	2045/5/15
		3.0	T-BOND 451115	3.0	2,450	2,394	270,936	2045/11/15
		3.125	T-BOND 420215	3.125	4,800	4,837	547,320	2042/2/15
		3.125	T-BOND 430215	3.125	3,050	3,065	346,859	2043/2/15
		3.125	T-BOND 440815	3.125	300	301	34,109	2044/8/15
		3.125	T-NOTE 190515	3.125	690	717	81,236	2019/5/15
		3.125	T-NOTE 210515	3.125	1,300	1,366	154,564	2021/5/15
		3.375	T-BOND 440515	3.375	1,600	1,684	190,601	2044/5/15
		3.375	T-NOTE 191115	3.375	1,060	1,115	126,174	2019/11/15
		3.5	T-BOND 390215	3.5	400	433	49,046	2039/2/15
		3.5	T-NOTE 180215	3.5	970	996	112,756	2018/2/15
		3.5	T-NOTE 200515	3.5	1,100	1,166	131,937	2020/5/15
		3.625	T-BOND 430815	3.625	1,350	1,483	167,896	2043/8/15
		3.625	T-BOND 440215	3.625	1,500	1,648	186,538	2044/2/15

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当期末						償還年月日
	利率	額面金額	評価額		債		
			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	3.625 T-NOTE 190815	3.625	720	759	85,977	2019/8/15	
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	1,630	1,730	195,803	2020/2/15	
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	3,000	3,211	363,423	2021/2/15	
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,000	1,119	126,621	2041/8/15	
	3.75 T-BOND 431115	3.75	1,600	1,799	203,599	2043/11/15	
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	2,500	2,614	295,814	2018/11/15	
	3.875 T-BOND 400815	3.875	800	912	103,206	2040/8/15	
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	1,130	1,172	132,639	2018/5/15	
	4 T-NOTE 180815	4.0	670	700	79,296	2018/8/15	
	4.25 T-BOND 390515	4.25	600	722	81,722	2039/5/15	
	4.25 T-BOND 401115	4.25	800	963	109,062	2040/11/15	
	4.375 T-BOND 391115	4.375	500	611	69,242	2039/11/15	
	4.375 T-BOND 400515	4.375	650	796	90,107	2040/5/15	
	4.375 T-BOND 410515	4.375	900	1,105	125,105	2041/5/15	
	4.5 T-BOND 360215	4.5	900	1,128	127,651	2036/2/15	
	4.5 T-BOND 390815	4.5	500	622	70,457	2039/8/15	
	4.625 T-BOND 400215	4.625	900	1,140	128,996	2040/2/15	
	4.75 T-BOND 410215	4.75	300	388	43,913	2041/2/15	
	5.25 T-BOND 281115	5.25	900	1,138	128,876	2028/11/15	
	5.25 T-BOND 290215	5.25	200	254	28,745	2029/2/15	
	5.375 T-BOND 310215	5.375	500	661	74,842	2031/2/15	
	5.5 T-BOND 280815	5.5	300	385	43,655	2028/8/15	
	6 T-BOND 260215	6.0	1,220	1,568	177,428	2026/2/15	
	6.125 T-BOND 271115	6.125	390	519	58,837	2027/11/15	
	6.25 T-BOND 230815	6.25	1,560	1,943	219,939	2023/8/15	
	6.25 T-BOND 300515	6.25	500	702	79,443	2030/5/15	
	6.5 T-BOND 261115	6.5	140	188	21,322	2026/11/15	
	8 T-BOND 211115	8.0	500	637	72,186	2021/11/15	
	8.125 T-BOND 190815	8.125	160	187	21,161	2019/8/15	
	8.75 T-BOND 200815	8.75	1,700	2,113	239,136	2020/8/15	
小計					39,592,791		
カナダ			千カナダドル	千カナダドル			
国債証券	0.25 CAN GOVT 180501	0.25	900	894	77,559	2018/5/1	
	0.5 CAN GOVT 180801	0.5	900	896	77,696	2018/8/1	
	0.5 CAN GOVT 181101	0.5	550	547	47,426	2018/11/1	
	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	500	494	42,862	2020/9/1	
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	700	689	59,755	2021/3/1	
	0.75 CAN GOVT 210901	0.75	350	343	29,766	2021/9/1	
	1 CAN GOVT 270601	1.0	450	411	35,619	2027/6/1	
	1.25 CAN GOVT 180201	1.25	900	905	78,475	2018/2/1	
	1.25 CAN GOVT 180301	1.25	800	805	69,776	2018/3/1	
	1.25 CAN GOVT 180901	1.25	350	352	30,554	2018/9/1	
	1.5 CAN GOVT 200301	1.5	400	406	35,194	2020/3/1	
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	760	762	66,066	2023/6/1	
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	750	729	63,210	2026/6/1	
	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	700	713	61,837	2019/3/1	
	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	1,000	1,022	88,582	2019/9/1	

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日	
			利 率	額面金額	評 価 額			
					外貨建金額	邦貨換算金額		
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
	国債証券	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	650	676	58,620	2025/6/1	
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	750	796	69,011	2024/6/1	
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	980	1,053	91,272	2022/6/1	
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	500	533	46,194	2048/12/1	
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	200	218	18,899	2064/12/1	
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	1,250	1,361	117,945	2021/6/1	
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	950	1,026	88,989	2020/6/1	
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	900	1,088	94,325	2045/12/1	
		3.75 CAN GOVT 190601	3.75	960	1,024	88,803	2019/6/1	
		4 CAN GOVT 410601	4.0	850	1,085	94,047	2041/6/1	
		4.25 CAN GOVT 180601	4.25	600	628	54,444	2018/6/1	
		5 CAN GOVT 370601	5.0	650	917	79,497	2037/6/1	
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	440	613	53,181	2029/6/1	
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	710	1,040	90,191	2033/6/1	
		8 CAN GOVT 270601	8.0	240	376	32,618	2027/6/1	
小	計					1,942,427		
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	13,600	15,604	83,796	2024/12/5	
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	3,400	4,046	21,729	2036/11/20	
		4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	10,500	10,225	54,911	2018/6/14	
		5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	13,400	12,712	68,265	2019/12/11	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	4,900	4,304	23,113	2026/3/5	
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	15,100	14,672	78,791	2021/6/10	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	6,100	5,871	31,529	2022/6/9	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	5,100	5,028	27,002	2027/6/3	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	7,700	7,554	40,565	2031/5/29	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	5,100	4,952	26,593	2034/11/23	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	8,500	8,221	44,150	2042/11/13	
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	6,200	6,366	34,189	2020/6/11	
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	5,200	5,345	28,703	2023/12/7	
		8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	11,100	11,426	61,362	2018/12/13	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	4,700	4,945	26,557	2029/5/31	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	5,100	5,320	28,571	2038/11/18	
小	計					679,832		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ			
	ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	900	866	105,555	2026/8/15
			0 OBL 200417	—	1,100	1,121	136,573	2020/4/17
			0 OBL 210409	—	800	815	99,300	2021/4/9
			0 OBL 211008	—	500	509	61,977	2021/10/8
			0 SCHATS 180316	—	1,800	1,813	220,846	2018/3/16
			0 SCHATS 180615	—	200	201	24,581	2018/6/15
			0.25 OBL 180413	0.25	800	809	98,524	2018/4/13
			0.25 OBL 191011	0.25	700	717	87,343	2019/10/11
			0.25 OBL 201016	0.25	900	926	112,824	2020/10/16
			0.5 BUND 250215	0.5	800	823	100,277	2025/2/15
			0.5 BUND 260215	0.5	2,100	2,137	260,273	2026/2/15
			0.5 OBL 180223	0.5	1,100	1,113	135,633	2018/2/23

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	0.5 OBL 190412	0.5	500	513	62,490	2019/4/12
		1 BUND 240815	1.0	500	535	65,235	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	1,650	1,760	214,348	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	500	514	62,625	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,400	1,449	176,473	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	900	989	120,442	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	600	661	80,535	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,000	1,104	134,458	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	400	443	53,986	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,500	1,665	202,840	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	900	1,013	123,382	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,100	1,227	149,508	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	900	1,025	124,838	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	700	771	93,983	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,100	1,236	150,577	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,500	1,679	204,534	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,000	1,306	159,096	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,050	1,382	168,298	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,000	1,124	136,892	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	1,100	1,226	149,380	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,300	1,515	184,559	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	800	1,170	142,486	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	2,330	2,569	312,844	2019/7/4
		3.75 BUND 190104	3.75	1,190	1,293	157,436	2019/1/4
		4 BUND 180104	4.0	700	730	89,003	2018/1/4
		4 BUND 370104	4.0	1,300	2,014	245,326	2037/1/4
		4.25 BUND 180704	4.25	620	664	80,883	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	590	967	117,836	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	350	513	62,500	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,050	1,712	208,528	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	810	1,427	173,829	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	800	1,310	159,519	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	650	1,005	122,480	2028/1/4
6.25 BUND 240104	6.25	980	1,408	171,475	2024/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	750	1,274	155,203	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	630	1,020	124,288	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.1 ITALY GOVT 190415	0.1	500	500	60,972	2019/4/15
		0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	400	402	48,969	2018/5/15
		0.3 ITALY GOVT 181015	0.3	800	805	98,068	2018/10/15
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	800	796	97,038	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	700	708	86,278	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	300	286	34,892	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	400	406	49,455	2020/5/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,000	987	120,254	2023/3/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	500	513	62,472	2019/12/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	750	694	84,526	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,000	1,022	124,515	2022/4/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
イタリア	国債証券	1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	500	512	62,351	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,000	1,035	126,043	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,000	975	118,734	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	1,000	964	117,424	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,050	943	114,892	2032/3/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,000	1,003	122,209	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,300	1,387	168,939	2021/12/15
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	400	370	45,101	2036/9/1
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,700	1,793	218,397	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	800	846	103,095	2024/12/1
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	650	583	71,105	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	300	250	30,440	2067/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	550	552	67,308	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	900	944	115,012	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,000	1,066	129,833	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,400	1,565	190,649	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	1,600	1,814	220,902	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,450	1,645	200,404	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	1,530	1,744	212,376	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,950	2,240	272,792	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,800	2,037	248,074	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,400	1,642	200,042	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	1,500	1,629	198,393	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	1,400	1,549	188,711	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	1,130	1,271	154,764	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	800	838	102,095	2018/2/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	1,410	1,508	183,733	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	1,100	1,203	146,508	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	1,600	1,807	220,035	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,700	2,034	247,737	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,400	1,682	204,819	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	800	963	117,328	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	1,200	1,422	173,234	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,230	1,498	182,440	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	800	996	121,283	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,000	1,279	155,802	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,400	1,687	205,499	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	780	969	118,105	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,300	1,710	208,245	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,150	1,519	184,962	2039/8/1
5 ITALY GOVT 400901	5.0	920	1,208	147,101	2040/9/1		
5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	1,650	2,163	263,375	2029/11/1		
5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	550	684	83,357	2022/9/1		
5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	500	623	75,930	2022/11/1		
5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	890	1,247	151,838	2033/2/1		
6 ITALY GOVT 310501	6.0	1,450	2,053	250,091	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	1,300	1,834	223,376	2027/11/1		

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	450	657	80,044	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	680	1,015	123,594	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O. A. T 180225	—	1,200	1,207	146,982	2018/2/25
		0 O. A. T 190225	—	100	101	12,302	2019/2/25
		0 O. A. T 200525	—	1,300	1,313	159,942	2020/5/25
		0 O. A. T 210525	—	800	805	98,027	2021/5/25
		0.25 O. A. T 201125	0.25	1,200	1,222	148,897	2020/11/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	500	466	56,795	2026/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	1,700	1,743	212,244	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	1,800	1,775	216,196	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	800	772	94,017	2026/5/25
		1 O. A. T 180525	1.0	1,100	1,122	136,699	2018/5/25
		1 O. A. T 181125	1.0	950	976	118,893	2018/11/25
		1 O. A. T 190525	1.0	800	827	100,724	2019/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	1,500	1,527	185,933	2025/11/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	850	786	95,816	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	1,600	1,620	197,353	2031/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	1,900	2,079	253,226	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	1,950	2,130	259,390	2024/11/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	200	167	20,402	2066/5/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	1,700	1,907	232,280	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	1,400	1,583	192,829	2024/5/25
		2.5 O. A. T 201025	2.5	2,100	2,319	282,420	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	1,350	1,548	188,544	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	1,550	1,814	220,931	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	1,800	2,082	253,588	2022/4/25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	2,300	2,664	324,435	2021/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	1,380	1,756	213,929	2045/5/25
		3.5 O. A. T 200425	3.5	1,120	1,260	153,430	2020/4/25
		3.5 O. A. T 260425	3.5	2,900	3,586	436,642	2026/4/25
		3.75 O. A. T 191025	3.75	1,510	1,684	205,058	2019/10/25
		3.75 O. A. T 210425	3.75	2,700	3,155	384,176	2021/4/25
		4 O. A. T 180425	4.0	1,900	2,007	244,478	2018/4/25
		4 O. A. T 381025	4.0	1,550	2,183	265,915	2038/10/25
		4 O. A. T 550425	4.0	800	1,191	145,050	2055/4/25
		4 O. A. T 600425	4.0	610	918	111,806	2060/4/25
		4.25 O. A. T 181025	4.25	1,680	1,821	221,748	2018/10/25
		4.25 O. A. T 190425	4.25	1,570	1,737	211,527	2019/4/25
		4.25 O. A. T 231025	4.25	2,300	2,909	354,270	2023/10/25
		4.5 O. A. T 410425	4.5	1,200	1,819	221,535	2041/4/25
		4.75 O. A. T 350425	4.75	1,100	1,655	201,525	2035/4/25
		5.5 O. A. T 290425	5.5	1,750	2,617	318,732	2029/4/25
		5.75 O. A. T 321025	5.75	1,820	2,933	357,124	2032/10/25
		6 O. A. T 251025	6.0	910	1,322	161,056	2025/10/25
		8.5 O. A. T 191025	8.5	1,200	1,496	182,169	2019/10/25
		8.5 O. A. T 230425	8.5	900	1,363	166,048	2023/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	700	705	85,853	2018/4/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	300	303	36,894	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	700	716	87,246	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	400	393	47,966	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,000	992	120,858	2026/7/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	800	814	99,165	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	700	725	88,321	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,100	1,221	148,672	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	950	1,073	130,721	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	500	566	68,926	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	700	859	104,614	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	600	811	98,788	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	900	1,046	127,369	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	800	911	111,038	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	200	245	29,934	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	760	1,175	143,183	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	850	907	110,499	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	850	946	115,262	2019/7/15
4 NETH GOVT 370115	4.0	800	1,223	148,931	2037/1/15		
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	640	966	117,740	2028/1/15		
7.5 NETH GOVT 230115	7.5	400	581	70,744	2023/1/15		
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	1,000	1,006	122,603	2018/4/30
		0.25 SPAIN GOVT 190131	0.25	700	706	85,996	2019/1/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	1,300	1,328	161,719	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	1,100	1,142	139,127	2020/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	700	685	83,442	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	900	938	114,303	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,500	1,539	187,461	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,100	1,146	139,547	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	1,050	1,045	127,313	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	800	850	103,512	2025/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,500	1,599	194,754	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	1,200	1,341	163,382	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	400	403	49,086	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	150	156	19,005	2066/7/30
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	450	482	58,726	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,200	1,431	174,240	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	1,080	1,219	148,519	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	880	938	114,212	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	900	1,149	139,971	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	1,160	1,300	158,292	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,150	1,417	172,600	2023/10/31
		4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	1,000	1,048	127,666	2018/1/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,200	1,342	163,409	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,040	1,317	160,388	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	820	1,121	136,575	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	750	946	115,275	2024/1/31
4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,100	1,295	157,763	2020/10/31		

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄		銘柄	当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	850	1,188	144,709	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	500	678	82,666	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	600	870	106,032	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	900	1,151	140,203	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	1,100	1,347	164,050	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,100	1,631	198,604	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,300	1,650	200,942	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	850	1,179	143,650	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,330	1,931	235,227	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	850	861	104,929	2025/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	750	762	92,900	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	500	478	58,213	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	900	922	112,354	2018/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	300	275	33,588	2047/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	350	365	44,483	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	180	172	20,968	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	800	908	110,611	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	850	987	120,213	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	700	764	93,124	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	600	743	90,531	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	900	1,036	126,188	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	480	680	82,814	2045/6/22
		4 BEL GOVT 180328	4.0	700	737	89,801	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	200	219	26,741	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	850	1,032	125,761	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	500	683	83,278	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	900	1,088	132,574	2021/9/28
4.25 BEL GOVT 220928	4.25	800	993	120,999	2022/9/28		
4.25 BEL GOVT 410328	4.25	750	1,128	137,405	2041/3/28		
4.5 BEL GOVT 260328	4.5	500	669	81,519	2026/3/28		
5 BEL GOVT 350328	5.0	800	1,258	153,242	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,050	1,558	189,784	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	300	306	37,291	2019/10/18
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	300	302	36,856	2026/10/20
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	250	257	31,357	2018/10/19
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	650	689	83,974	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	150	146	17,878	2047/2/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	500	551	67,141	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	600	666	81,170	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	450	477	58,085	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	330	394	48,091	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	400	550	66,996	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	500	600	73,112	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	870	1,022	124,512	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	600	719	87,556	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	190	309	37,721	2062/1/26
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	870	1,000	121,841	2020/7/15		

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
オーストリア	国債証券	4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	600	907	110,522	2037/3/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	550	607	73,997	2019/3/15
		4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	630	662	80,611	2018/1/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	450	624	76,041	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	300	470	57,324	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	400	411	50,047	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	350	346	42,173	2026/4/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	200	192	23,395	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	50	51	6,280	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	250	257	31,301	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	400	435	53,064	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	300	328	40,046	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	150	168	20,548	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	250	319	38,905	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	300	365	44,507	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	250	280	34,211	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	250	290	35,339	2021/4/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	500	649	79,123	2025/7/4
4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	350	392	47,777	2019/7/4		
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	200	207	25,224	2022/3/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	400	396	48,279	2026/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	300	288	35,105	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	440	484	59,047	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	350	416	50,700	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	450	545	66,448	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	620	691	84,167	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	350	380	46,288	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	590	679	82,787	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	350	418	50,928	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	600	812	98,881	2025/3/13
5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	300	351	42,738	2019/10/18		
小 計						35,756,092	
イギリス							
国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	300	294	42,067	2022/7/22	
	1.25 GILT 180722	1.25	1,600	1,626	232,514	2018/7/22	
	1.5 GILT 210122	1.5	1,600	1,658	237,136	2021/1/22	
	1.5 GILT 260722	1.5	700	702	100,407	2026/7/22	
	1.5 GILT 470722	1.5	400	352	50,375	2047/7/22	
	1.75 GILT 190722	1.75	1,500	1,554	222,342	2019/7/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	1,300	1,365	195,237	2022/9/7	
	2 GILT 200722	2.0	1,500	1,579	225,844	2020/7/22	
	2 GILT 250907	2.0	900	949	135,801	2025/9/7	
	2.25 GILT 230907	2.25	1,150	1,242	177,710	2023/9/7	
	2.5 GILT 650722	2.5	650	775	110,820	2065/7/22	
	2.75 GILT 240907	2.75	1,100	1,227	175,487	2024/9/7	
	3.25 GILT 440122	3.25	1,200	1,484	212,279	2044/1/22	
	3.5 GILT 450122	3.5	1,130	1,464	209,338	2045/1/22	

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
国債証券	3.5 GILT 680722	3.5	910	1,388	198,522	2068/7/22
	3.75 GILT 190907	3.75	820	894	127,935	2019/9/7
	3.75 GILT 200907	3.75	900	1,006	143,973	2020/9/7
	3.75 GILT 210907	3.75	960	1,096	156,787	2021/9/7
	3.75 GILT 520722	3.75	500	726	103,909	2052/7/22
	4 GILT 220307	4.0	900	1,049	150,024	2022/3/7
	4 GILT 600122	4.0	850	1,374	196,593	2060/1/22
	4.25 GILT 271207	4.25	700	887	126,889	2027/12/7
	4.25 GILT 320607	4.25	840	1,110	158,727	2032/6/7
	4.25 GILT 360307	4.25	1,300	1,766	252,568	2036/3/7
	4.25 GILT 390907	4.25	1,050	1,464	209,411	2039/9/7
	4.25 GILT 401207	4.25	710	1,000	143,025	2040/12/7
	4.25 GILT 461207	4.25	1,000	1,484	212,214	2046/12/7
	4.25 GILT 491207	4.25	870	1,336	191,167	2049/12/7
	4.25 GILT 551207	4.25	1,000	1,635	233,867	2055/12/7
	4.5 GILT 190307	4.5	1,000	1,090	155,976	2019/3/7
	4.5 GILT 340907	4.5	1,050	1,451	207,501	2034/9/7
	4.5 GILT 421207	4.5	1,110	1,650	236,057	2042/12/7
	4.75 GILT 200307	4.75	1,000	1,136	162,463	2020/3/7
	4.75 GILT 301207	4.75	900	1,231	176,158	2030/12/7
	4.75 GILT 381207	4.75	670	991	141,735	2038/12/7
	5 GILT 180307	5.0	650	684	97,942	2018/3/7
	5 GILT 250307	5.0	1,100	1,421	203,204	2025/3/7
	6 GILT 281207	6.0	380	560	80,216	2028/12/7
	8 GILT 210607	8.0	350	462	66,144	2021/6/7
小計					6,460,380	
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	200	223	25,344	2021/4/28
	2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	150	166	18,832	2020/7/6
	3 SWISS GOVT 180108	3.0	350	363	41,186	2018/1/8
	3 SWISS GOVT 190512	3.0	280	305	34,631	2019/5/12
	4 SWISS GOVT 230211	4.0	250	319	36,189	2023/2/11
	4 SWISS GOVT 280408	4.0	320	465	52,739	2028/4/8
小計					208,924	
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	3,250	3,330	42,791	2026/11/12
	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	4,200	4,541	58,360	2023/11/13
	2.5 SWD GOVT 250512	2.5	3,700	4,295	55,195	2025/5/12
	3.5 SWD GOVT 220601	3.5	5,000	5,919	76,066	2022/6/1
	3.5 SWD GOVT 390330	3.5	2,400	3,191	41,012	2039/3/30
	4.25 SWD GOVT 190312	4.25	4,650	5,129	65,911	2019/3/12
	5 SWD GOVT 201201	5.0	5,100	6,134	78,834	2020/12/1
小計					418,172	
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	1,972	26,905	2026/2/19
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	2,100	2,130	29,058	2025/3/13
	2 NORWE GOVT 230524	2.0	2,950	3,068	41,848	2023/5/24

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
ノルウェー		%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円	
国債証券	3 NORWE GOVT 240314	3.0	2,400	2,652	36,184	2024/3/14
	3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	4,000	4,457	60,794	2021/5/25
	4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	3,630	3,949	53,871	2019/5/22
小計					248,663	
デンマーク			千デンマーククロネ	千デンマーククロネ		
国債証券	0.25 DMK GOVT 181115	0.25	2,500	2,538	41,563	2018/11/15
	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	2,750	3,008	49,249	2023/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	5,000	5,549	90,849	2025/11/15
	3 DMK GOVT 211115	3.0	4,800	5,533	90,581	2021/11/15
	4 DMK GOVT 191115	4.0	5,310	5,968	97,703	2019/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	6,650	11,035	180,650	2039/11/15
	7 DMK GOVT 241110	7.0	1,090	1,664	27,246	2024/11/10
小計					577,843	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	1,500	1,454	40,689	2020/4/25
	1.75 POLAND 210725	1.75	1,200	1,143	31,991	2021/7/25
	2 POLAND 210425	2.0	1,450	1,400	39,191	2021/4/25
	2.5 POLAND 180725	2.5	1,900	1,920	53,725	2018/7/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	1,300	1,171	32,767	2026/7/25
	3.25 POLAND 190725	3.25	1,200	1,229	34,388	2019/7/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	2,250	2,184	61,108	2025/7/25
	3.75 POLAND 180425	3.75	950	974	27,274	2018/4/25
	4 POLAND 231025	4.0	1,300	1,341	37,539	2023/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	900	981	27,453	2020/10/25
	5.5 POLAND 191025	5.5	1,110	1,204	33,688	2019/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	850	953	26,679	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	1,400	1,580	44,221	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	800	945	26,459	2029/4/25
	POLAND 181025	—	1,100	1,062	29,739	2018/10/25
小計					546,918	
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	800	790	67,831	2020/11/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	300	282	24,261	2028/5/21
	2.75 AUST GOVT 191021	2.75	1,400	1,431	122,742	2019/10/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,400	1,421	121,883	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	600	597	51,243	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	350	320	27,460	2035/6/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	300	258	22,172	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 181021	3.25	850	871	74,740	2018/10/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,300	1,360	116,730	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	1,200	1,239	106,327	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	250	237	20,369	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	520	541	46,438	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,700	1,918	164,541	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	1,400	1,509	129,479	2020/4/15
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	600	699	60,005	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,700	2,004	171,957	2027/4/21

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円		
	国債証券	5.25 AUST GOVT 190315	5.25	1,330	1,424	122,149	2019/3/15
		5.5 AUST GOVT 180121	5.5	800	829	71,114	2018/1/21
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,200	1,415	121,415	2023/4/21
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,310	1,504	129,042	2021/5/15
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,300	1,531	131,385	2022/7/15
小	計					1,903,293	
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	100	99	7,961	2018/4/1
		1.25 SINGAPORGOVT 211001	1.25	100	97	7,827	2021/10/1
		1.625 SINGAPORGOVT 191001	1.625	250	251	20,156	2019/10/1
		2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	370	375	30,068	2020/7/1
		2.125 SINGAPORGOVT 260601	2.125	250	245	19,704	2026/6/1
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	600	611	49,014	2021/6/1
		2.375 SINGAPORGOVT 250601	2.375	150	150	12,096	2025/6/1
		2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	450	462	37,035	2019/6/1
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	550	570	45,754	2023/7/1
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	370	372	29,837	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	200	200	16,112	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOVT 290701	2.875	350	361	28,967	2029/7/1
		2.875 SINGAPORGOVT 300901	2.875	200	205	16,459	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	500	527	42,244	2024/9/1
		3.125 SINGAPORGOVT 220901	3.125	400	424	33,987	2022/9/1
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	260	274	22,027	2020/9/1
		3.375 SINGAPORGOVT 330901	3.375	450	490	39,282	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	370	405	32,491	2027/3/1
		4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	490	511	41,041	2018/9/1
小	計					532,070	
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	9,200	10,266	87,778	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	4,700	3,410	29,156	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	3,600	2,606	22,284	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	3,400	3,247	27,761	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	5,600	4,651	39,769	2031/2/28
		7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	2,900	2,851	24,383	2020/1/15
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	3,200	3,109	26,585	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	1,900	1,908	16,313	2018/12/21
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	4,700	4,295	36,727	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	3,800	3,480	29,760	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	5,100	4,668	39,918	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	4,700	4,369	37,362	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	6,500	6,027	51,531	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRICA 350228	8.875	1,600	1,528	13,068	2035/2/28
		9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	1,200	1,147	9,810	2040/1/31
小	計					492,212	
合	計					89,359,623	

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

○投資信託財産の構成

(2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 89,359,623	% 96.9
コール・ローン等、その他	2,872,912	3.1
投資信託財産総額	92,232,535	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(90,456,093千円)の投資信託財産総額(92,232,535千円)に対する比率は98.1%です。

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

1 アメリカドル=113.15円	1 カナダドル=86.66円	1 メキシコペソ=5.37円	1 ユーロ=121.76円
1 イギリスポンド=142.99円	1 スイスフラン=113.39円	1 スウェーデンクローネ=12.85円	1 ノルウェークローネ=13.64円
1 デンマーククローネ=16.37円	1 ポーランドズロチ=27.98円	1 オーストラリアドル=85.77円	1 シンガポールドル=80.16円
1 南アフリカランド=8.55円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	183,544,025,876
コール・ローン等	450,478,854
公社債(評価額)	89,359,623,726
未収入金	92,933,013,317
未収利息	746,061,431
前払費用	54,848,548
(B) 負債	91,364,407,437
未払金	91,360,321,640
未払解約金	4,085,578
未払利息	219
(C) 純資産総額(A-B)	92,179,618,439
元本	73,688,743,763
次期繰越損益金	18,490,874,676
(D) 受益権総口数	73,688,743,763口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,509円

<注記事項>

- ①期首元本額 45,472,741,060円
 期中追加設定元本額 36,627,504,520円
 期中一部解約元本額 8,411,501,817円
 また、1口当たり純資産額は、期末12,509円です。

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

eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	17,724,985円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	5,193,352,179円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	5,182,431,336円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	19,509,450円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	139,439,658円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	1,596,138,745円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	66,702,280円
MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド(適格機関投資家転売制限付)	41,815,849,105円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	14,503,171,426円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	429,836,891円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	499,408,174円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	1,230,227,777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)	179,490,028円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	211,829,180円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	2,603,632,549円
合計	73,688,743,763円

[お知らせ]

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため(分散型に分類)、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2016年3月16日)

○損益の状況 (2016年1月27日~2017年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,987,199,908
受取利息	1,987,449,349
支払利息	△ 249,441
(B) 有価証券売買損益	△ 3,590,820,610
売買益	18,213,147,829
売買損	△21,803,968,439
(C) 保管費用等	△ 12,474,555
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,616,095,257
(E) 前期繰越損益金	11,882,079,061
(F) 追加信託差損益金	10,686,056,557
(G) 解約差損益金	△ 2,461,165,685
(H) 計(D+E+F+G)	18,490,874,676
次期繰越損益金(H)	18,490,874,676

- (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。