

## 当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投資／内外／資産複合	
信託期間	信託期間は2009年1月16日から無期限です。	
運用方針	主として、下記のマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国および新興国の公社債および株式（DR（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。	
主要運用対象	世界経済インデックスファンド	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	国内株式インデックスマザーファンド	わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。
	外国債券インデックスマザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
	外国株式インデックスマザーファンド	原則として、MSCI コクサイ・インデックスを構成している国の株式を主要投資対象とします。
	新興国債券インデックスマザーファンド	新興国の債券を主要投資対象とします。
	新興国株式インデックスマザーファンド	取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。
組入制限	世界経済インデックスファンド	株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	国内債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は、行いません。
	国内株式インデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は、行いません。
	外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	外国株式インデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	新興国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	新興国株式インデックスマザーファンド	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます）への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。	

# 世界経済インデックスファンド

## 運用報告書（全体版）

第7期（決算日 2016年1月20日）

## 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

## お問い合わせ先

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

PCサイト <http://www.smtam.jp/>

モバイルサイト <http://m.smtam.jp/>

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-8574 東京都港区芝三丁目33番1号

**【本運用報告書の記載について】**

- ・ 基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・ 原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・ 一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・ 指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			株式組 比率	株式先 物比率	債券組 比率	債券先 物比率	投資信託 組入比率	資産 純総額
	(分配落)	税金 分配金	期中 騰落率						
第3期(2012年1月20日)	円 12,000	円 0	% △7.5	% 48.3	% 1.3	% 48.2	% -	% 0.7	百万円 1,737
第4期(2013年1月21日)	15,282	20	27.5	47.3	1.8	47.0	0.1	0.7	2,751
第5期(2014年1月20日)	18,162	20	19.0	49.2	1.8	45.6	0.2	0.6	4,684
第6期(2015年1月20日)	20,530	20	13.1	48.4	1.4	46.8	0.2	0.8	10,344
第7期(2016年1月20日)	18,276	0	△11.0	46.0	1.5	49.1	0.2	0.8	16,216

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率、債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		株式組 比率	株式先 物比率	債券組 比率	債券先 物比率	投資信託 組入比率
	騰落率						
(当期首) 2015年 1月20日	円 20,530	% -	% 48.4	% 1.4	% 46.8	% 0.2	% 0.8
1月末	20,695	0.8	48.1	2.1	46.3	0.4	0.8
2月末	21,186	3.2	49.9	1.3	45.1	0.3	0.8
3月末	21,040	2.5	49.6	1.3	45.8	0.5	0.8
4月末	21,503	4.7	49.6	1.4	46.0	0.2	0.8
5月末	21,946	6.9	49.7	1.4	45.8	0.2	0.8
6月末	21,273	3.6	48.9	1.4	46.2	0.2	0.8
7月末	21,292	3.7	48.8	2.5	46.4	0.2	0.8
8月末	20,009	△2.5	47.9	1.4	47.3	0.2	0.8
9月末	19,163	△6.7	45.8	2.3	48.2	0.2	0.8
10月末	20,319	△1.0	47.7	2.2	46.4	0.3	0.8
11月末	20,352	△0.9	47.9	2.4	46.6	0.1	0.8
12月末	19,847	△3.3	48.3	1.7	46.8	0.1	0.9
(当期末) 2016年 1月20日	18,276	△11.0	46.0	1.5	49.1	0.2	0.8

(注1) 期末基準価額は分配金込みで、騰落率は期首比です。

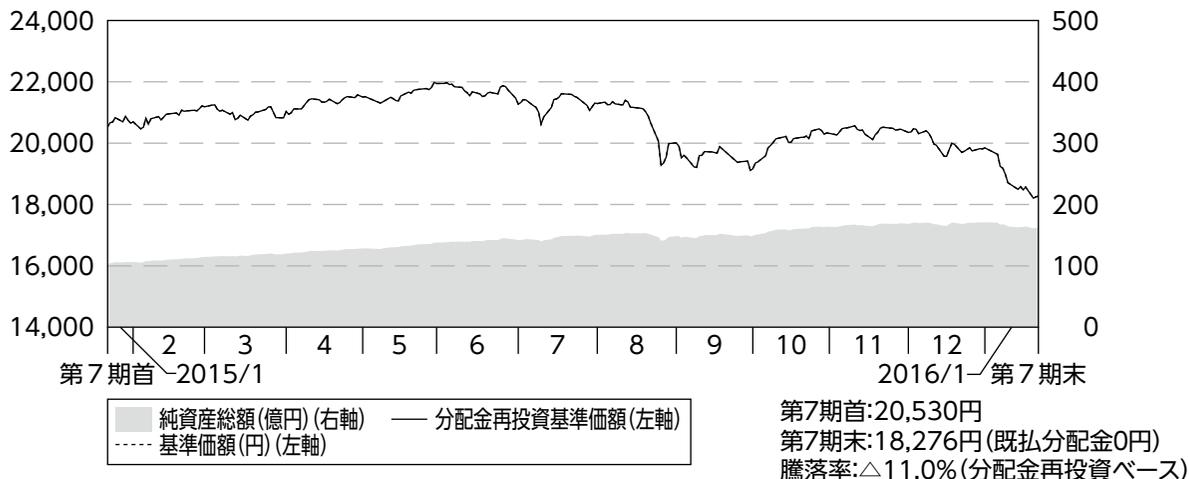
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率、債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)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2) 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3) 分配金再投資基準価額は、2015年1月20日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は米国の景気回復基調や世界的な金融緩和環境、外国為替市場における円安進行などを背景に2015年6月までは堅調に推移しましたが、その後はギリシャの債務問題や中国の景気減速懸念、原油安などを背景に当ファンドが投資対象とする国内、先進国および新興国の株式ならびに公社債の多くが軟調に推移したことを受けて、当ファンドの基準価額も下落しました。

組入ファンド	投資資産	基本組入比率	当作成対象 期間末組入比率	騰落率
国内債券インデックス マザーファンド	国内債券	5.0%	4.4%	0.6%
国内株式インデックス マザーファンド	国内株式	5.0%	5.3%	△2.3%
外国債券インデックス マザーファンド	先進国債券	27.5%	29.6%	△4.0%
外国株式インデックス マザーファンド	先進国株式	27.5%	27.3%	△8.5%
新興国債券インデックス マザーファンド	新興国債券	17.5%	16.1%	△18.5%
新興国株式インデックス マザーファンド	新興国株式	17.5%	15.7%	△23.3%

## 投資環境

### 国内債券市場

米国の利上げ観測などから債券利回りに上昇圧力がかかる場面も見られたものの、日銀による大規模な国債購入を背景とする引き締まった需給環境が下支え要因となり当期初からもみ合いで推移しました。2015年7月中旬以降はギリシャ債務問題や中国の景気減速懸念、原油安、地政学的リスクの高まりなどを背景にリスクを抑制する投資行動が広がったことから利回りは低下基調となり、当期末にかけて利回りは一段と低下する展開となりました。

### 国内株式市場

米国の景気回復基調などを背景に外国為替市場で円安が進行したことや、国内企業に対する業績回復期待が高まったことなどを背景に当期初より堅調に推移しました。しかし、2015年8月に中国人民銀行が中国・人民元を実質的に切り下げたことをきっかけに中国の景気減速懸念が急速に高まり株価は急落しました。その後、世界的な金融緩和環境を背景に海外株式市場が反発したことから国内株式市場も持ち直す場面も見られましたが、原油価格が下げ止まらないことが嫌気されたほか、中国の景気減速懸念や地政学的リスクの高まりなどを背景に下落しました。

### 先進国債券市場

当期初より米国ではFRB(米連邦準備理事会)による利上げ観測から、また欧州ではデフレ懸念が後退したことなどを背景に債券利回りは2015年6月にかけて上昇しましたが、7月中旬以降はギリシャ債務問題や中国の景気減速懸念、原油安などから利回りは低下基調となりました。その後、12月のFOMC(米連邦公開市場委員会)で米国の利上げが決定されたものの、今後の利上げペースは緩やかなものになるとの見方から債券利回りの上昇は限定的となり、中国の景気減速懸念や原油安などを背景にリスクを抑制する投資行動が強まり利回りは低下基調となりました。

外国為替市場は当期初から6月にかけては円安が進行したものの、その後は中国の景気減速懸念や原油安などを背景に安全資産として円を選好する動きが強まり、当期末にかけて円高基調となりました。

### 先進国株式市場

当期初より米国の景気回復基調やECB(欧州中央銀行)による追加金融緩和などを背景に堅調に推移しましたが、2015年6月以降、ギリシャの債務不履行懸念や中国の景気減速懸念などを嫌気し外国株式市場は調整を余儀なくされました。その後は、FRBが9月のFOMCで利上げを見送ったことや、ECBが追加的な金融緩和を示唆したことなどを背景に持ち直す場面もありましたが、原油価格が下げ止まりを見せないことや地政学的リスクが高まったことからリスクを抑制する投資行動が広がり下落する展開となりました。

### 新興国債券市場

当期初から原油価格の下落や米国の利上げ観測などを背景に軟調な推移となりました。2015年4月から6月にかけては世界的な金融緩和環境が下支えする場面も見られましたが、8月以降は中国の景気減速懸念が高まったことや原油価格が下げ止まりを見せず資源関連国に対する先行き不透明感も高まったことから新興国市場への投資を抑制する姿勢が強まり下落しました。

## 投資環境

### 新興国株式市場

当期初から原油価格の下落やギリシャ債務問題などを背景に上値の重い展開となりましたが、2015年4月から5月にかけては世界的な金融緩和環境を好感し上昇する場面も見られました。しかしながら、6月以降はギリシャの債務不履行懸念が高まったことや中国の景気減速懸念が高まったことなどを背景に株価は急落しました。その後も原油価格が下げ止まりを見せず資源関連国に対する先行き不透明感も高まったことから軟調に推移する展開となりました。

### 当ファンドのポートフォリオ

#### ○当ファンド

国内、先進国および新興国の株式・公社債へ分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行いました。各資産への配分は、概ね基本組入比率を維持する運用を行いました。

#### ○国内債券インデックス マザーファンド

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として、ベンチマークに合わせてデュレーション、債券種別や残存期間を調整しました。また、資金の流出入等に対応するため債券先物取引を利用し、先物を含む国内債券の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

#### ○国内株式インデックス マザーファンド

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)に連動する投資成果を目標として、現物株式については、東証一部上場銘柄の中から信用リスクが極めて高いと判断される銘柄を除外した上で、ベンチマークの個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成して運用を行いました。また、設定や解約による資金の流出入等に対応するため株価指数先物取引を利用し、先物を含む国内株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

#### ○外国債券インデックス マザーファンド

ベンチマークであるシティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動する投資成果を目標として、ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させた運用を行いました。また、資金の流出入等に対応するため債券先物取引を利用し、先物を含む外国債券の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

#### ○外国株式インデックス マザーファンド

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス(円ベース)に連動する投資成果を目標として、ベンチマークの個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成して運用を行いました。また、資金の流出入等に対応するため株価指数先物取引を利用し、先物を含む外国株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

#### ○新興国債券インデックス マザーファンド

ベンチマークであるJP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として、ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させた運用を行いました。

#### ○新興国株式インデックス マザーファンド

ベンチマークであるMSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として、ベンチマークの個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成して運用を行い、また、資金の流出入等に対応するため株価指数先物取引を利用し、先物を含む新興国株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

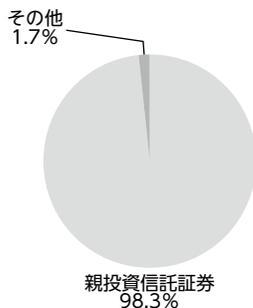
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

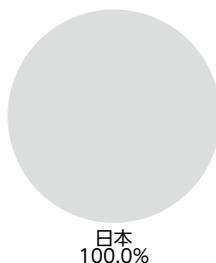
	当期末
	2016年1月20日
外国債券インデックス マザーファンド	29.6%
外国株式インデックス マザーファンド	27.3%
新興国債券インデックス マザーファンド	16.1%
新興国株式インデックス マザーファンド	15.7%
国内株式インデックス マザーファンド	5.3%
国内債券インデックス マザーファンド	4.4%
その他	1.7%
組入ファンド数	6

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

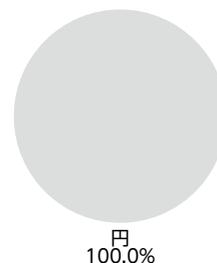
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分



(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

## 分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。

なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目	第7期	
	2015年1月21日~2016年1月20日	
当期分配金	(円)	—
(対基準価額比率)	(%)	(—)
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	8,275

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2)当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税引前)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3)—印は該当がないことを示します。

## 今後の運用方針

### ○当ファンド

主として、下記のマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国および新興国の公社債および株式(DR(預託証券)を含みます。)に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。株式(DR(預託証券)を含みます。)と債券の基本資産配分比率は、原則として株式50%、債券50%とします。

### ○国内債券インデックス マザーファンド

NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

### ○国内株式インデックス マザーファンド

原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

### ○外国債券インデックス マザーファンド

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

### ○外国株式インデックス マザーファンド

原則としてMSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

### ○新興国債券インデックス マザーファンド

主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマーGING・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

### ○新興国株式インデックス マザーファンド

主として、取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、MSCI エマーGING・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

# 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2015年1月21日~2016年1月20日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	112円	0.540%	(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20,718円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 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、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(45)	(0.216)	
(販売会社)	(56)	(0.270)	
(受託会社)	(11)	(0.054)	
(b) 売買委託手数料	2	0.008	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{〔期中の売買委託手数料〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(1)	(0.005)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(1)	(0.003)	
(c) 有価証券取引税	1	0.007	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{〔期中の有価証券取引税〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.007)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	17	0.082	(d) その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、証拠金利息の調整金額等
(保管費用)	(16)	(0.077)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	132	0.637	

(注1) 期中の費用(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。  
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンド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2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、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を乗じたものです。

## 売買および取引の状況

### <親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
新興国株式インデックス マザーファンド	652,316	1,551,580	8,431	21,010
国内株式インデックス マザーファンド	280,467	369,680	6,230	8,110
外国株式インデックス マザーファンド	979,160	2,023,340	22,031	44,660
国内債券インデックス マザーファンド	254,615	337,680	4,896	6,490
外国債券インデックス マザーファンド	766,177	2,169,600	15,750	44,660
新興国債券インデックス マザーファンド	872,991	1,435,880	17,501	28,430

## 株式売買比率

### <親投資信託の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		
	国内株式インデックス マザーファンド	外国株式インデックス マザーファンド	新興国株式インデックス マザーファンド
(a) 当期中の株式売買金額	46,544,021千円	84,818,304千円	7,080,289千円
(b) 当期中の平均組入株式時価総額	149,012,056千円	243,144,518千円	23,609,153千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.31	0.34	0.29

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

## 利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

### ■ 利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	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	$\frac{D}{C}$
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 66,021	百万円 3,443	% 5.2	百万円 65,874	百万円 3,392	% 5.1

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

### <国内債券インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	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	$\frac{D}{C}$
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 410,520	百万円 17,238	% 4.2	百万円 410,528	百万円 17,000	% 4.1

<平均保有割合 0.2%>

(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

### <国内株式インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	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	$\frac{D}{C}$
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 422,082	百万円 20,338	% 4.8	百万円 421,089	百万円 19,910	% 4.7

<平均保有割合 0.5%>

(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

### <外国債券インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	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	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 47,836	百万円 71	% 0.1	百万円 67,201	百万円 536	% 0.8
コ ー ル ・ ロ ー ン	744,088	23,298	3.1	744,777	23,000	3.1

<平均保有割合 1.8%>

(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

## <外国株式インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 84,693	百万円 28,333	% 33.5	百万円 50,634	百万円 41,999	% 82.9
コール・ローン	235,864	3,854	1.6	235,556	3,724	1.6

<平均保有割合 1.6%>

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## <新興国債券インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	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	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 40,087	百万円 2,307	% 5.8	百万円 40,161	百万円 2,297	% 5.7

<平均保有割合 15.3%>

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## <新興国株式インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 11,671	百万円 373	% 3.2	百万円 6,083	百万円 479	% 7.9
コール・ローン	10,313	526	5.1	10,347	525	5.1

<平均保有割合 9.8%>

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## ■利害関係人の発行する有価証券等

### <国内株式インデックス マザーファンド>

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	67百万円	158百万円	536百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注2) 当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

## 組入資産の明細

### <親投資信託残高>

	当 期 首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
新興国株式インデックス マザーファンド	700,135	1,344,021	2,542,753
国内株式インデックス マザーファンド	473,919	748,156	853,347
外国株式インデックス マザーファンド	1,513,145	2,470,275	4,421,298
国内債券インデックス マザーファンド	283,533	533,252	719,411
外国債券インデックス マザーファンド	1,008,735	1,759,161	4,795,123
新興国債券インデックス マザーファンド	982,456	1,837,945	2,609,330

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、以下の通りです。

新興国株式インデックス マザーファンド	11,448,031千口
国内株式インデックス マザーファンド	117,031,123千口
外国株式インデックス マザーファンド	132,735,037千口
国内債券インデックス マザーファンド	246,359,831千口
外国債券インデックス マザーファンド	79,917,600千口
新興国債券インデックス マザーファンド	11,182,201千口

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
新興国株式インデックス マザーファンド	2,542,753	15.6
国内株式インデックス マザーファンド	853,347	5.2
外国株式インデックス マザーファンド	4,421,298	27.2
国内債券インデックス マザーファンド	719,411	4.4
外国債券インデックス マザーファンド	4,795,123	29.5
新興国債券インデックス マザーファンド	2,609,330	16.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	337,965	2.1
投 資 信 託 財 産 総 額	16,279,227	100.0

(注1) 新興国株式インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(21,655,248千円)の投資信託財産総額(21,709,801千円)に対する比率は99.7%です。

(注2) 外国株式インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(236,787,404千円)の投資信託財産総額(238,151,956千円)に対する比率は99.4%です。

(注3) 外国債券インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(216,076,347千円)の投資信託財産総額(218,053,232千円)に対する比率は99.1%です。

(注4) 新興国債券インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(15,821,268千円)の投資信託財産総額(15,921,508千円)に対する比率は99.4%です。

(注5) 外貨建資産は、当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。1米ドル=117.55円、1カナダドル=80.62円、1メキシコペソ=6.43円、1ブラジルレアル=28.92円、1チリペソ=0.1619円、1コロンビアペソ=0.0355円、1ペルーヌエボソル=34.19円、1ユーロ=128.38円、1イギリスポンド=166.58円、1スイスフラン=117.20円、1スウェーデンクローナ=13.78円、1ノルウェークローネ=13.34円、1デンマーククローネ=17.20円、1トルコリラ=38.72円、1チェココルナ=4.75円、1ハンガリーフォリント=0.4071円、1ポーランドズロチ=28.85円、1ロシアルーブル=1.49円、1オーストラリアドル=81.17円、1ニュージーランドドル=75.01円、1香港ドル=15.03円、1シンガポールドル=81.81円、1マレーシアリンギット=26.84円、1タイバーツ=3.24円、1フィリピンペソ=2.52円、1インドネシアルピア=0.0085円、1韓国ウォン=0.0974円、1新台湾ドル=3.49円、1インドルピー=1.75円、1イスラエルシェケル=29.59円、1カタールリアル=32.34円、1南アフリカランド=7.01円、1アラブ首長国連邦ディルハム=32.06円です。

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2016年1月20日現在
(A)資 産	16,279,227,797円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	337,962,521
新興国株式インデックス マザーファンド(評価額)	2,542,753,649
国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	853,347,154
外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	4,421,298,237
国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	719,411,036
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	4,795,123,760
新興国債券インデックス マザーファンド(評価額)	2,609,330,931
未 収 利 息	509
(B)負 債	63,107,924
未 払 解 約 金	19,031,787
未 払 信 託 報 酬	43,305,809
そ の 他 未 払 費 用	770,328
(C)純 資 産 総 額(A-B)	16,216,119,873
元 本	8,873,094,446
次 期 繰 越 損 益 金	7,343,025,427
(D)受 益 権 総 口 数	8,873,094,446口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,276円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2015年1月21日 至 2016年1月20日
(A)配 当 等 収 益	154,198円
受 取 利 息	154,198
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△1,984,757,372
売 買 益	64,045,417
売 買 損	△2,048,802,789
(C)信 託 報 酬 等	△77,814,987
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△2,062,418,161
(E)前 期 繰 越 損 益 金	1,061,946,518
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	8,343,497,070
(配 当 等 相 当 額)	(5,155,941,426)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,187,555,644)
(G) 計 (D+E+F)	7,343,025,427
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	7,343,025,427
追 加 信 託 差 損 益 金	8,343,497,070
(配 当 等 相 当 額)	(5,172,543,787)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,170,953,283)
分 配 準 備 積 立 金	1,403,825,005
繰 越 損 益 金	△2,404,296,648

(注1) (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2) (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3) (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。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は5,038,845,504円、期中追加設定元本額は5,409,151,344円、期中一部解約元本額は1,574,902,402円です。

※分配金の計算過程

項	目	当	期
(A)	配当等収益額(費用控除後)		341,878,487円
(B)	有価証券売買等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後)		－円
(C)	収益調整金額		5,939,200,422円
(D)	分配準備積立金額		1,061,946,518円
(E)	分配対象収益額(A+B+C+D)		7,343,025,427円
(F)	期末残存口数		8,873,094,446口
(G)	収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)		8,275円
(H)	分配金額(1万口当たり)		－円
(I)	収益分配金金額(F×H/10,000)		－円

## お知らせ

---

一般社団法人投資信託協会「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」の一部改正及び「信用リスク集中回避のための投資制限に係るガイドライン」の制定に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2015年4月21日)

# 国内債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第15期（決算日 2015年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運用方針	わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資は、行いません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物率	純資産額
	期騰落率	期中騰落率	期騰落率	期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
第11期(2011年5月30日)	12,087	1.6	331,753	1.7	99.9	—	173,894
第12期(2012年5月29日)	12,436	2.9	341,318	2.9	99.4	—	197,259
第13期(2013年5月29日)	12,514	0.6	343,438	0.6	99.3	0.2	246,098
第14期(2014年5月29日)	12,915	3.2	354,471	3.2	99.3	0.3	256,692
第15期(2015年5月29日)	13,215	2.3	362,770	2.3	99.6	—	319,978

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物率
	騰落率	期中騰落率	騰落率	期中騰落率		
(当期首) 2014年 5月29日	円	%		%	%	%
	12,915	—	354,471	—	99.3	0.3
5月末	12,912	△0.0	354,387	△0.0	99.5	0.2
6月末	12,950	0.3	355,413	0.3	99.6	0.2
7月末	12,971	0.4	356,015	0.4	99.5	0.2
8月末	13,012	0.8	357,148	0.8	99.5	0.1
9月末	13,021	0.8	357,408	0.8	99.8	—
10月末	13,081	1.3	359,079	1.3	99.5	0.2
11月末	13,159	1.9	361,194	1.9	99.6	—
12月末	13,295	2.9	364,961	3.0	99.5	0.2
2015年 1月末	13,298	3.0	365,067	3.0	99.5	0.0
2月末	13,227	2.4	363,039	2.4	99.5	—
3月末	13,233	2.5	363,279	2.5	99.7	—
4月末	13,277	2.8	364,501	2.8	99.7	—
(当期末) 2015年 5月29日	13,215	2.3	362,770	2.3	99.6	—

(注1)騰落率は期首比です。

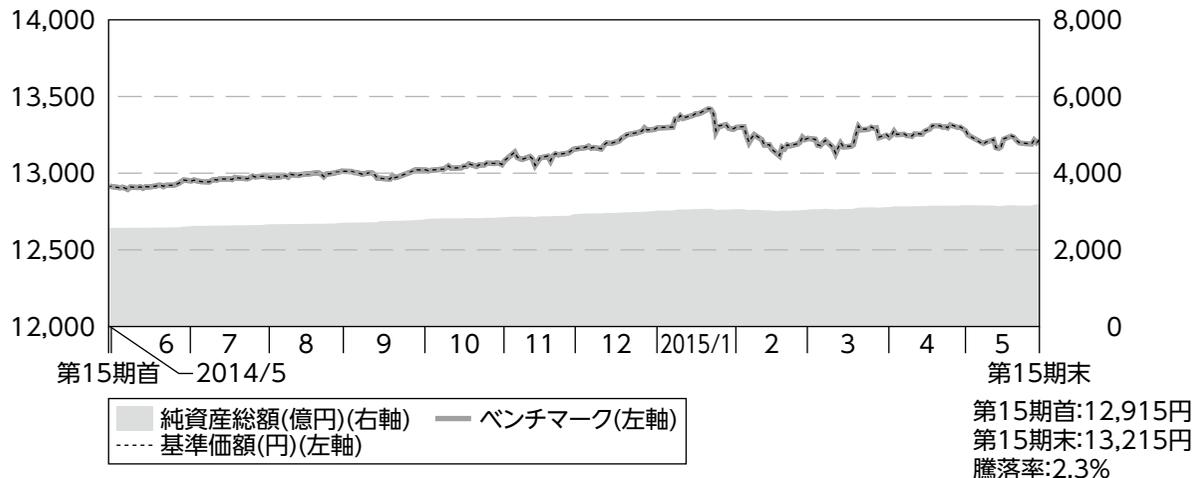
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

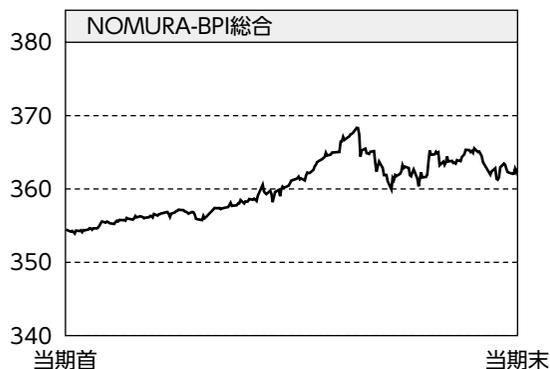


(注)ベンチマークは、2014年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

期初から2015年1月中旬にかけては、日銀による大規模な国債購入に伴う良好な需給環境が続いたことやECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和観測などを背景に欧米金利が低下した影響に加え、原油価格の急落を背景としたインフレ率の鈍化懸念から国内金利が低下（債券価格は上昇）し、基準価額は上昇しました。その後は、高値警戒感や国債入札の不調を背景に金利が上昇（債券価格は下落）したことから2月中旬にかけて基準価額は下落しましたが、2月下旬以降は、ECBの量的金融緩和開始や米国の早期利上げ観測の後退が金利低下要因となる一方、国債入札への警戒感や、ユーロ圏のデフレ懸念後退などから欧州金利が上昇したことが金利上昇要因となり、基準価額はもみ合いの展開となりました。この結果、期を通じて基準価額は上昇しました。

## 投資環境



期初より、日銀による大規模な国債購入に伴う良好な需給環境や原油価格の急落を背景としたインフレ率の鈍化懸念などから10年国債利回りは低下基調となり、2015年1月中旬には一時0.2%台を割り込んで過去最低利回りを更新しました。しかし、その後は高値警戒感や国債入札の不調から2月中旬にかけて利回りは上昇しました。2月下旬以降は、ECBの量的金融緩和開始や米国の早期利上げ観測の後退が利回り低下要因となる一方、国債入札への警戒感や、ユーロ圏のデフレ懸念後退などから欧州金利が上昇したことが利回り上昇要因となり、10年国債利回りはもみ合いとなりました。

## 当該投資信託のポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、公社債の組入比率を高位に保ち、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

### (1) 債券組入比率

キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引を利用し、先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

### (2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、ベンチマークの構成銘柄変更に合わせて毎月組入銘柄の見直しを実施することで、ベンチマークとの連動を目指しました。

当該投資信託の組入資産の内容

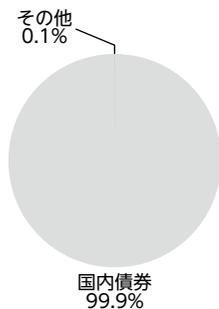
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	第118回利付国債(5年)	日本	1.5%
2	第122回利付国債(5年)	日本	1.5%
3	第117回利付国債(5年)	日本	1.4%
4	第113回利付国債(5年)	日本	1.4%
5	第123回利付国債(5年)	日本	1.4%
6	第120回利付国債(5年)	日本	1.3%

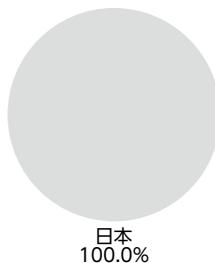
順位	銘柄名	国	組入比率
7	第116回利付国債(5年)	日本	1.3%
8	第338回利付国債(10年)	日本	1.1%
9	第105回利付国債(5年)	日本	1.1%
10	第106回利付国債(5年)	日本	1.0%
組入銘柄数		791	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

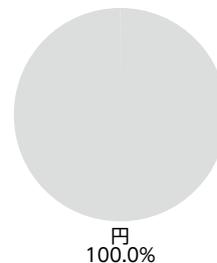
○資産別配分



○国別配分



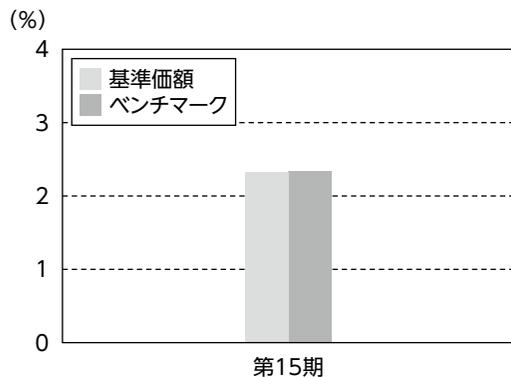
○通貨別配分



(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

## 当該投資信託のベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

## 今後の運用方針

NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2014年5月30日~2015年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (-) (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.000% (-) (-) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(a) 売買委託手数料= $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税= $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用)	- (-) (-)	- (-) (-)	(c) その他費用= $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
合計	0	0.000	

(注1) 期中の費用(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2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、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(13,119円)で除して100を乗じたものです。

(注4) -印は該当がないことを示します。

## 売買および取引の状況

### <公社債>

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
国   内	国 債 証 券	92,831,534	41,837,081
	地 方 債 証 券	7,349,492	3,723,992
	特 殊 債 券	8,226,859	3,801,264 (345,088)
	社債券(投資法人債券を含む)	4,994,069	2,774,332 (100,000)

(注1)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3)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		当 期			
		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 53,593	百万円 54,333	百万円 —	百万円 —

(注)金額は受渡代金です。

## 利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

当期中における利害関係人との取引等はありません。

※ 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す。

## 組入資産の明細

## &lt;国内(邦貨建)公社債&gt;

## (A) 債券種類別開示

区分	当			期			末		
	額面金額	評価額	組入比率	うちB 格組入	B 以下率	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	240,590,000 (300,000)	256,368,160 (302,734)	80.1 (0.1)	— (—)	48.7 (—)	23.7 (0.1)	7.6 (—)		
地方債証券	18,393,940 (18,393,940)	19,484,388 (19,484,388)	6.1 (6.1)	— (—)	3.9 (3.9)	1.2 (1.2)	1.0 (1.0)		
特殊債証券 (除く金融債)	21,983,278 (21,983,278)	23,246,371 (23,246,371)	7.3 (7.3)	— (—)	4.9 (4.9)	1.5 (1.5)	0.9 (0.9)		
金融債証券	3,000,000 (3,000,000)	3,010,239 (3,010,239)	0.9 (0.9)	— (—)	— (—)	0.6 (0.6)	0.3 (0.3)		
普通社債証券 (含む投資法人債券)	16,221,000 (16,221,000)	16,710,274 (16,710,274)	5.2 (5.2)	— (—)	1.6 (1.6)	2.5 (2.5)	1.1 (1.1)		
合計	300,188,218 (59,898,218)	318,819,434 (62,754,007)	99.6 (19.6)	— (—)	59.1 (10.4)	29.6 (5.9)	10.9 (3.3)		

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) ( )内は非上場債で内書きです。

(注3) 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) 個別銘柄開示

銘柄名	当			期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日			
<b>国債証券</b>							
第3 4 2 回利付国債 (2年)	0.1	1,170,000	1,171,427	2016/7/15			
第3 4 3 回利付国債 (2年)	0.1	1,300,000	1,301,716	2016/8/15			
第3 4 4 回利付国債 (2年)	0.1	1,560,000	1,562,199	2016/9/15			
第3 4 5 回利付国債 (2年)	0.1	2,060,000	2,063,090	2016/10/15			
第3 4 6 回利付国債 (2年)	0.1	590,000	590,944	2016/11/15			
第3 4 9 回利付国債 (2年)	0.1	1,850,000	1,853,626	2017/2/15			
第3 5 0 回利付国債 (2年)	0.1	1,030,000	1,032,111	2017/3/15			
第3 5 1 回利付国債 (2年)	0.1	130,000	130,278	2017/4/15			
第9 9 回利付国債 (5年)	0.4	2,600,000	2,613,858	2016/9/20			
第1 0 0 回利付国債 (5年)	0.3	490,000	491,974	2016/9/20			
第1 0 1 回利付国債 (5年)	0.4	950,000	956,032	2016/12/20			
第1 0 2 回利付国債 (5年)	0.3	2,280,000	2,290,944	2016/12/20			
第1 0 3 回利付国債 (5年)	0.3	2,500,000	2,513,925	2017/3/20			
第1 0 4 回利付国債 (5年)	0.2	810,000	813,053	2017/3/20			
第1 0 5 回利付国債 (5年)	0.2	3,500,000	3,514,700	2017/6/20			
第1 0 6 回利付国債 (5年)	0.2	3,260,000	3,275,354	2017/9/20			
第1 0 7 回利付国債 (5年)	0.2	1,120,000	1,125,846	2017/12/20			
第1 0 8 回利付国債 (5年)	0.1	590,000	591,575	2017/12/20			
第1 0 9 回利付国債 (5年)	0.1	1,190,000	1,193,486	2018/3/20			
第1 1 0 回利付国債 (5年)	0.3	700,000	705,971	2018/3/20			
第1 1 1 回利付国債 (5年)	0.4	1,590,000	1,608,014	2018/3/20			
第1 1 2 回利付国債 (5年)	0.4	900,000	911,115	2018/6/20			
第1 1 3 回利付国債 (5年)	0.3	4,390,000	4,430,827	2018/6/20			
第1 1 4 回利付国債 (5年)	0.3	1,210,000	1,221,979	2018/9/20			
第1 1 5 回利付国債 (5年)	0.2	2,660,000	2,677,556	2018/9/20			

銘柄名	当			期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日			
第1 1 6 回利付国債 (5年)	0.2	4,020,000	4,047,094	2018/12/20			
第1 1 7 回利付国債 (5年)	0.2	4,520,000	4,549,108	2019/3/20			
第1 1 8 回利付国債 (5年)	0.2	4,880,000	4,910,548	2019/6/20			
第1 1 9 回利付国債 (5年)	0.1	700,000	701,554	2019/6/20			
第1 2 0 回利付国債 (5年)	0.2	4,240,000	4,266,372	2019/9/20			
第1 2 1 回利付国債 (5年)	0.1	530,000	531,022	2019/9/20			
第1 2 2 回利付国債 (5年)	0.1	4,900,000	4,906,664	2019/12/20			
第1 2 3 回利付国債 (5年)	0.1	4,360,000	4,363,095	2020/3/20			
第1 回利付国債 (4 0年)	2.4	150,000	184,128	2048/3/20			
第2 回利付国債 (4 0年)	2.2	300,000	353,034	2049/3/20			
第3 回利付国債 (4 0年)	2.2	420,000	494,566	2050/3/20			
第4 回利付国債 (4 0年)	2.2	530,000	624,403	2051/3/20			
第5 回利付国債 (4 0年)	2.0	490,000	550,044	2052/3/20			
第6 回利付国債 (4 0年)	1.9	690,000	753,845	2053/3/20			
第7 回利付国債 (4 0年)	1.7	1,090,000	1,126,874	2054/3/20			
第8 回利付国債 (4 0年)	1.4	230,000	216,968	2055/3/20			
第2 8 2 回利付国債 (1 0年)	1.7	1,260,000	1,288,035	2016/9/20			
第2 8 3 回利付国債 (1 0年)	1.8	280,000	286,594	2016/9/20			
第2 8 4 回利付国債 (1 0年)	1.7	1,210,000	1,242,089	2016/12/20			
第2 8 5 回利付国債 (1 0年)	1.7	1,990,000	2,051,152	2017/3/20			
第2 8 6 回利付国債 (1 0年)	1.8	870,000	902,181	2017/6/20			
第2 8 7 回利付国債 (1 0年)	1.9	540,000	561,081	2017/6/20			
第2 8 8 回利付国債 (1 0年)	1.7	2,090,000	2,172,011	2017/9/20			
第2 8 9 回利付国債 (1 0年)	1.5	2,490,000	2,585,591	2017/12/20			
第2 9 0 回利付国債 (1 0年)	1.4	470,000	488,471	2018/3/20			
第2 9 1 回利付国債 (1 0年)	1.3	840,000	870,660	2018/3/20			

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第292回利付国債(10年)	1.7	1,110,000	1,162,935	2018/3/20
第293回利付国債(10年)	1.8	370,000	390,364	2018/6/20
第294回利付国債(10年)	1.7	180,000	189,358	2018/6/20
第295回利付国債(10年)	1.5	100,000	104,589	2018/6/20
第296回利付国債(10年)	1.5	2,100,000	2,203,614	2018/9/20
第297回利付国債(10年)	1.4	560,000	587,624	2018/12/20
第298回利付国債(10年)	1.3	1,660,000	1,735,994	2018/12/20
第299回利付国債(10年)	1.3	1,310,000	1,373,351	2019/3/20
第300回利付国債(10年)	1.5	830,000	876,438	2019/3/20
第301回利付国債(10年)	1.5	1,240,000	1,313,184	2019/6/20
第302回利付国債(10年)	1.4	200,000	210,996	2019/6/20
第303回利付国債(10年)	1.4	1,390,000	1,469,897	2019/9/20
第304回利付国債(10年)	1.3	480,000	505,531	2019/9/20
第305回利付国債(10年)	1.3	2,160,000	2,281,024	2019/12/20
第306回利付国債(10年)	1.4	1,370,000	1,456,419	2020/3/20
第307回利付国債(10年)	1.3	700,000	740,810	2020/3/20
第308回利付国債(10年)	1.3	990,000	1,049,944	2020/6/20
第309回利付国債(10年)	1.1	1,780,000	1,869,890	2020/6/20
第310回利付国債(10年)	1.0	1,590,000	1,665,016	2020/9/20
第311回利付国債(10年)	0.8	610,000	632,350	2020/9/20
第312回利付国債(10年)	1.2	2,170,000	2,299,852	2020/12/20
第313回利付国債(10年)	1.3	1,650,000	1,761,573	2021/3/20
第314回利付国債(10年)	1.1	760,000	802,643	2021/3/20
第315回利付国債(10年)	1.2	2,050,000	2,181,651	2021/6/20
第316回利付国債(10年)	1.1	720,000	761,918	2021/6/20
第317回利付国債(10年)	1.1	480,000	509,097	2021/9/20
第318回利付国債(10年)	1.0	1,810,000	1,908,409	2021/9/20
第319回利付国債(10年)	1.1	1,150,000	1,222,047	2021/12/20
第320回利付国債(10年)	1.0	2,100,000	2,217,936	2021/12/20
第321回利付国債(10年)	1.0	2,330,000	2,464,068	2022/3/20
第322回利付国債(10年)	0.9	950,000	998,611	2022/3/20
第323回利付国債(10年)	0.9	1,160,000	1,219,832	2022/6/20
第324回利付国債(10年)	0.8	1,860,000	1,942,974	2022/6/20
第325回利付国債(10年)	0.8	3,010,000	3,141,085	2022/9/20
第326回利付国債(10年)	0.7	530,000	548,894	2022/12/20
第327回利付国債(10年)	0.8	1,540,000	1,606,327	2022/12/20
第328回利付国債(10年)	0.6	2,540,000	2,609,977	2023/3/20
第329回利付国債(10年)	0.8	2,300,000	2,397,911	2023/6/20
第330回利付国債(10年)	0.8	2,240,000	2,334,483	2023/9/20
第331回利付国債(10年)	0.6	680,000	697,652	2023/9/20
第332回利付国債(10年)	0.6	2,900,000	2,972,529	2023/12/20
第333回利付国債(10年)	0.6	2,750,000	2,815,862	2024/3/20
第334回利付国債(10年)	0.6	2,950,000	3,018,646	2024/6/20
第335回利付国債(10年)	0.5	2,860,000	2,897,323	2024/9/20
第336回利付国債(10年)	0.5	1,310,000	1,325,706	2024/12/20
第337回利付国債(10年)	0.3	1,990,000	1,976,229	2024/12/20
第338回利付国債(10年)	0.4	3,590,000	3,593,374	2025/3/20
第1回利付国債(30年)	2.8	40,000	51,152	2029/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	160,000	196,299	2030/2/20
第3回利付国債(30年)	2.3	120,000	145,514	2030/5/20
第4回利付国債(30年)	2.9	110,000	142,978	2030/11/20
第5回利付国債(30年)	2.2	50,000	59,824	2031/5/20
第6回利付国債(30年)	2.4	190,000	232,879	2031/11/20
第7回利付国債(30年)	2.3	180,000	217,728	2032/5/20
第8回利付国債(30年)	1.8	50,000	56,411	2032/11/22
第9回利付国債(30年)	1.4	240,000	255,285	2032/12/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第10回利付国債(30年)	1.1	160,000	161,804	2033/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	90,000	99,631	2033/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	190,000	222,676	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	290,000	334,332	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	300,000	365,298	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	340,000	419,923	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	370,000	456,465	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	330,000	400,959	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	445,000	532,673	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	280,000	334,642	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	420,000	516,721	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	370,000	441,828	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	400,000	491,864	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	420,000	516,524	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	330,000	405,876	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	350,000	417,350	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	730,000	884,409	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	2.5	730,000	898,535	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	510,000	628,677	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	890,000	1,080,540	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	660,000	788,548	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	770,000	904,657	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	1,060,000	1,269,477	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	1,290,000	1,461,918	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	1,180,000	1,387,833	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	1,150,000	1,302,662	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	1,240,000	1,404,126	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	1,110,000	1,231,778	2042/9/20
第38回利付国債(30年)	1.8	950,000	1,031,196	2043/3/20
第39回利付国債(30年)	1.9	740,000	819,468	2043/6/20
第40回利付国債(30年)	1.8	720,000	779,954	2043/9/20
第41回利付国債(30年)	1.7	580,000	614,237	2043/12/20
第42回利付国債(30年)	1.7	630,000	666,735	2044/3/20
第43回利付国債(30年)	1.7	940,000	994,125	2044/6/20
第44回利付国債(30年)	1.7	680,000	718,651	2044/9/20
第45回利付国債(30年)	1.5	560,000	564,620	2044/12/20
第46回利付国債(30年)	1.5	1,010,000	1,017,322	2045/3/20
第33回利付国債(20年)	3.8	140,000	146,941	2016/9/20
第34回利付国債(20年)	3.5	50,000	53,154	2017/3/20
第35回利付国債(20年)	3.3	10,000	10,595	2017/3/20
第36回利付国債(20年)	3.0	70,000	74,832	2017/9/20
第37回利付国債(20年)	3.1	70,000	74,993	2017/9/20
第38回利付国債(20年)	2.7	20,000	21,513	2018/3/20
第39回利付国債(20年)	2.6	500,000	536,435	2018/3/20
第40回利付国債(20年)	2.3	100,000	107,575	2018/9/20
第41回利付国債(20年)	1.5	330,000	348,397	2019/3/20
第42回利付国債(20年)	2.6	80,000	87,797	2019/3/20
第43回利付国債(20年)	2.9	140,000	157,124	2019/9/20
第44回利付国債(20年)	2.5	170,000	189,704	2020/3/20
第45回利付国債(20年)	2.4	290,000	322,074	2020/3/20
第46回利付国債(20年)	2.2	170,000	188,001	2020/6/22
第47回利付国債(20年)	2.2	90,000	99,998	2020/9/21
第48回利付国債(20年)	2.5	130,000	147,149	2020/12/21
第49回利付国債(20年)	2.1	140,000	156,018	2021/3/22
第50回利付国債(20年)	1.9	220,000	242,635	2021/3/22
第51回利付国債(20年)	2.0	100,000	111,329	2021/6/21

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第52回利付国債(20年)	2.1	110,000	123,549	2021/9/21
第53回利付国債(20年)	2.1	80,000	90,236	2021/12/20
第54回利付国債(20年)	2.2	200,000	226,890	2021/12/20
第55回利付国債(20年)	2.0	140,000	157,592	2022/3/21
第56回利付国債(20年)	2.0	150,000	169,239	2022/6/20
第57回利付国債(20年)	1.9	240,000	269,109	2022/6/20
第58回利付国債(20年)	1.9	300,000	336,942	2022/9/20
第59回利付国債(20年)	1.7	200,000	222,148	2022/12/20
第60回利付国債(20年)	1.4	350,000	380,814	2022/12/20
第61回利付国債(20年)	1.0	240,000	253,960	2023/3/20
第62回利付国債(20年)	0.8	320,000	333,622	2023/6/20
第63回利付国債(20年)	1.8	200,000	224,460	2023/6/20
第64回利付国債(20年)	1.9	320,000	362,348	2023/9/20
第65回利付国債(20年)	1.9	220,000	249,761	2023/12/20
第66回利付国債(20年)	1.8	330,000	371,886	2023/12/20
第67回利付国債(20年)	1.9	130,000	147,890	2024/3/20
第68回利付国債(20年)	2.2	190,000	221,034	2024/3/20
第69回利付国債(20年)	2.1	390,000	450,165	2024/3/20
第70回利付国債(20年)	2.4	400,000	473,376	2024/6/20
第71回利付国債(20年)	2.2	200,000	233,170	2024/6/20
第72回利付国債(20年)	2.1	630,000	730,629	2024/9/20
第73回利付国債(20年)	2.0	360,000	414,892	2024/12/20
第74回利付国債(20年)	2.1	200,000	232,346	2024/12/20
第75回利付国債(20年)	2.1	130,000	151,334	2025/3/20
第76回利付国債(20年)	1.9	270,000	309,055	2025/3/20
第77回利付国債(20年)	2.0	290,000	334,848	2025/3/20
第78回利付国債(20年)	1.9	170,000	195,012	2025/6/20
第79回利付国債(20年)	2.0	270,000	312,489	2025/6/20
第80回利付国債(20年)	2.1	220,000	256,751	2025/6/20
第81回利付国債(20年)	2.0	390,000	451,959	2025/9/20
第82回利付国債(20年)	2.1	600,000	701,604	2025/9/20
第83回利付国債(20年)	2.1	290,000	339,563	2025/12/20
第84回利付国債(20年)	2.0	670,000	777,736	2025/12/20
第85回利付国債(20年)	2.1	290,000	339,969	2026/3/20
第86回利付国債(20年)	2.3	210,000	250,519	2026/3/20
第87回利付国債(20年)	2.2	550,000	650,446	2026/3/20
第88回利付国債(20年)	2.3	550,000	657,789	2026/6/20
第89回利付国債(20年)	2.2	450,000	533,452	2026/6/20
第90回利付国債(20年)	2.2	630,000	747,759	2026/9/20
第91回利付国債(20年)	2.3	450,000	539,239	2026/9/20
第92回利付国債(20年)	2.1	1,080,000	1,271,473	2026/12/20
第93回利付国債(20年)	2.0	410,000	478,511	2027/3/20
第94回利付国債(20年)	2.1	680,000	801,203	2027/3/20
第95回利付国債(20年)	2.3	660,000	794,105	2027/6/20
第96回利付国債(20年)	2.1	420,000	495,524	2027/6/20
第97回利付国債(20年)	2.2	640,000	763,424	2027/9/20
第98回利付国債(20年)	2.1	450,000	531,589	2027/9/20
第99回利付国債(20年)	2.1	1,000,000	1,181,970	2027/12/20
第100回利付国債(20年)	2.2	620,000	740,974	2028/3/20
第101回利付国債(20年)	2.4	435,000	530,578	2028/3/20
第102回利付国債(20年)	2.4	400,000	488,608	2028/6/20
第103回利付国債(20年)	2.3	380,000	459,564	2028/6/20
第104回利付国債(20年)	2.1	360,000	426,380	2028/6/20
第105回利付国債(20年)	2.1	870,000	1,030,114	2028/9/20
第106回利付国債(20年)	2.2	360,000	430,952	2028/9/20
第107回利付国債(20年)	2.1	370,000	438,450	2028/12/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第108回利付国債(20年)	1.9	650,000	753,532	2028/12/20
第109回利付国債(20年)	1.9	340,000	394,060	2029/3/20
第110回利付国債(20年)	2.1	850,000	1,007,326	2029/3/20
第111回利付国債(20年)	2.2	300,000	359,631	2029/6/20
第112回利付国債(20年)	2.1	800,000	948,112	2029/6/20
第113回利付国債(20年)	2.1	1,230,000	1,457,648	2029/9/20
第114回利付国債(20年)	2.1	630,000	746,965	2029/12/20
第115回利付国債(20年)	2.2	720,000	863,186	2029/12/20
第116回利付国債(20年)	2.2	550,000	659,290	2030/3/20
第117回利付国債(20年)	2.1	910,000	1,078,650	2030/3/20
第118回利付国債(20年)	2.0	850,000	995,227	2030/6/20
第119回利付国債(20年)	1.8	380,000	434,248	2030/6/20
第120回利付国債(20年)	1.6	300,000	334,257	2030/6/20
第121回利付国債(20年)	1.9	1,220,000	1,409,673	2030/9/20
第122回利付国債(20年)	1.8	280,000	319,477	2030/9/20
第123回利付国債(20年)	2.1	1,060,000	1,254,912	2030/12/20
第124回利付国債(20年)	2.0	400,000	467,676	2030/12/20
第125回利付国債(20年)	2.2	430,000	515,148	2031/3/20
第126回利付国債(20年)	2.0	390,000	455,633	2031/3/20
第127回利付国債(20年)	1.9	460,000	530,591	2031/3/20
第128回利付国債(20年)	1.9	660,000	760,551	2031/6/20
第129回利付国債(20年)	1.8	620,000	705,169	2031/6/20
第130回利付国債(20年)	1.8	550,000	624,805	2031/9/20
第131回利付国債(20年)	1.7	580,000	650,116	2031/9/20
第132回利付国債(20年)	1.7	530,000	592,783	2031/12/20
第133回利付国債(20年)	1.8	810,000	918,313	2031/12/20
第134回利付国債(20年)	1.8	420,000	475,498	2032/3/20
第135回利付国債(20年)	1.7	380,000	424,357	2032/3/20
第136回利付国債(20年)	1.6	710,000	781,944	2032/3/20
第137回利付国債(20年)	1.7	290,000	323,335	2032/6/20
第138回利付国債(20年)	1.5	630,000	682,844	2032/6/20
第139回利付国債(20年)	1.6	410,000	450,754	2032/6/20
第140回利付国債(20年)	1.7	1,610,000	1,792,074	2032/9/20
第141回利付国債(20年)	1.7	310,000	344,453	2032/12/20
第142回利付国債(20年)	1.8	730,000	823,337	2032/12/20
第143回利付国債(20年)	1.6	1,050,000	1,147,776	2033/3/20
第144回利付国債(20年)	1.5	640,000	688,864	2033/3/20
第145回利付国債(20年)	1.7	1,480,000	1,638,389	2033/6/20
第146回利付国債(20年)	1.7	1,810,000	1,999,814	2033/9/20
第147回利付国債(20年)	1.6	1,470,000	1,596,758	2033/12/20
第148回利付国債(20年)	1.5	1,530,000	1,630,398	2034/3/20
第149回利付国債(20年)	1.5	1,360,000	1,445,666	2034/6/20
第150回利付国債(20年)	1.4	1,750,000	1,824,865	2034/9/20
第151回利付国債(20年)	1.2	1,350,000	1,357,519	2034/12/20
第152回利付国債(20年)	1.2	1,590,000	1,593,816	2035/3/20
第18回メキシコ合衆国国債債券	0.8	100,000	101,112	2019/7/24
第14回ポーランド共和国国債債券	0.67	200,000	201,622	2018/11/15
小計		240,590,000	256,368,160	
<b>地方債証券</b>				
第3回東京都公債(20年)	2.26	100,000	116,313	2024/3/19
第6回東京都公債(20年)	2.0	100,000	114,823	2025/3/19
第9回東京都公債(30年)	2.37	100,000	117,327	2039/3/18
第11回東京都公債(30年)	2.19	100,000	113,808	2040/9/20
第17回東京都公債(20年)	2.09	100,000	117,437	2028/12/20
第19回東京都公債(20年)	2.13	100,000	117,930	2029/6/20
第23回東京都公債(20年)	2.12	100,000	117,536	2030/12/20

当		期		末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日	
第26回東京都公債券(20年)	1.74	200,000	222,196	2032/6/18	
第27回東京都公債券(20年)	1.68	200,000	219,510	2032/12/20	
第639回東京都公債券	1.83	50,000	51,161	2016/9/20	
第645回東京都公債券	1.77	300,000	309,201	2017/3/17	
第649回東京都公債券	1.73	102,000	105,936	2017/9/20	
第650回東京都公債券	1.85	140,000	145,790	2017/9/20	
第695回東京都公債券	1.2	100,000	105,890	2021/3/19	
第696回東京都公債券	1.19	100,000	106,049	2021/6/28	
第716回東京都公債券	0.77	100,000	103,666	2022/12/10	
第717回東京都公債券	0.63	100,000	102,556	2023/3/20	
第720回東京都公債券	0.87	100,000	104,403	2023/6/20	
第728回東京都公債券	0.65	100,000	102,493	2023/12/20	
平成18年度第10回北海道公債券	1.9	100,000	102,831	2016/12/28	
平成19年度第9回北海道公債券	1.7	110,000	114,360	2017/11/30	
平成20年度第14回北海道公債券	1.74	100,000	106,009	2019/2/27	
平成22年度第11回北海道公債券	1.36	100,000	106,258	2020/12/28	
平成24年度第14回北海道公債券	0.8	100,000	103,435	2023/2/28	
第4回神奈川県公債券(30年)	2.62	100,000	121,948	2038/3/19	
第16回神奈川県公債券(20年)	2.09	100,000	116,972	2031/1/24	
第20回神奈川県公債券(20年)	1.706	100,000	110,522	2032/6/18	
第27回神奈川県公債券(20年)	1.398	100,000	102,941	2034/9/20	
第144回神奈川県公債券	1.83	100,000	102,747	2016/12/20	
第150回神奈川県公債券	1.67	100,000	104,094	2017/12/20	
第172回神奈川県公債券	1.34	200,000	211,412	2020/3/20	
第7回大阪府公債券(20年)	1.84	200,000	224,698	2031/9/26	
第26回大阪府公債券(2年)	0.057	270,000	269,786	2017/1/27	
第91回大阪府公債券(5年)	0.17	100,000	100,180	2018/2/27	
第307回大阪府公債券(10年)	1.84	100,000	104,194	2017/10/30	
第311回大阪府公債券(10年)	1.68	100,000	104,327	2018/2/28	
第345回大阪府公債券(10年)	1.26	100,000	105,757	2020/12/25	
第349回大阪府公債券(10年)	1.38	100,000	106,770	2021/4/27	
第361回大阪府公債券(10年)	0.92	100,000	104,552	2022/6/28	
第371回大阪府公債券(10年)	0.58	100,000	101,770	2023/4/26	
第375回大阪府公債券(10年)	0.835	100,000	103,681	2023/8/29	
平成12年度第1回京都府公債券	1.7	100,000	102,553	2016/12/22	
平成22年度第2回京都府公債券	1.16	100,000	105,222	2020/9/24	
平成23年度第5回京都府公債券(20年)	1.79	100,000	112,313	2031/10/17	
平成20年度第7回京都府公債券	0.8	100,000	103,675	2023/9/19	
第1回兵庫県公債券(12年)	1.1	100,000	105,898	2024/6/26	
第3回兵庫県公債券(12年)	0.56	100,000	100,623	2025/4/16	
第7回兵庫県公債券(15年)	1.12	100,000	104,451	2028/12/25	
平成19年度第9回兵庫県公債券	1.84	100,000	104,149	2017/10/18	
平成22年度第1回兵庫県公債券	1.46	100,000	106,194	2020/4/16	
平成25年度第4回兵庫県公債券	0.82	100,000	103,631	2023/8/18	
平成19年度第2回静岡県公債券	1.93	100,000	103,869	2017/6/28	
平成20年度第4回静岡県公債券	1.65	100,000	105,131	2018/8/28	
平成21年度第10回静岡県公債券	1.4	100,000	105,985	2020/3/18	
平成23年度第3回静岡県公債券	1.193	103,290	109,424	2021/5/25	
平成23年度第8回静岡県公債券	1.025	100,000	105,219	2021/10/25	
平成24年度第10回静岡県公債券	0.678	100,000	102,846	2023/3/22	
平成20年度第6回愛知県公債券(10年)	1.71	100,000	105,709	2018/11/28	
平成21年度第5回愛知県公債券(20年)	2.28	100,000	119,842	2029/6/20	
平成22年度第3回愛知県公債券(10年)	1.364	200,000	211,990	2020/5/28	
平成23年度第1回愛知県公債券(10年)	1.38	100,000	106,992	2021/4/28	
平成23年度第3回愛知県公債券(10年)	1.212	100,000	106,057	2021/5/27	
平成24年度第19回愛知県公債券(10年)	0.639	100,000	102,515	2023/3/28	

当		期		末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日	
平成26年度第3回愛知県公債券(10年)	0.665	100,000	102,370	2024/4/30	
平成18年度第1回広島県公債券	2.1	100,000	102,518	2016/8/25	
平成19年度第2回広島県公債券	1.94	200,000	208,340	2017/8/24	
平成20年度第1回広島県公債券(20年)	2.34	100,000	120,451	2028/9/21	
平成22年度第1回広島県公債券	1.37	100,000	105,995	2020/5/27	
平成23年度第6回広島県公債券(5年)	0.35	200,000	200,948	2017/2/28	
平成24年度第4回広島県公債券	0.81	100,000	103,855	2022/11/28	
平成20年度第4回埼玉県公債券	1.6	100,000	105,098	2018/9/26	
平成22年度第10回埼玉県公債券	1.26	100,000	106,030	2021/1/28	
平成22年度第11回埼玉県公債券	1.28	193,000	205,012	2021/2/25	
平成23年度第11回埼玉県公債券(5年)	0.34	100,000	100,486	2017/3/28	
平成24年度第1回埼玉県公債券	1.05	100,000	105,699	2022/4/26	
平成24年度第9回埼玉県公債券	0.844	100,000	104,120	2023/1/31	
平成25年度第11回埼玉県公債券	0.655	100,000	102,304	2024/3/26	
平成18年度第1回福岡県公債券	2.1	100,000	102,552	2016/8/30	
平成20年度第2回福岡県公債券(20年)	2.05	100,000	116,869	2021/12/20	
平成23年度第1回福岡県公債券(20年)	2.008	100,000	115,669	2031/5/23	
平成23年度第1回福岡県公債券	1.18	200,000	211,904	2021/6/28	
平成24年度第1回福岡県公債券(30年)	2.12	100,000	111,907	2042/9/19	
第13回千葉県公債券(20年)	1.701	100,000	110,135	2032/10/15	
平成18年度第6回千葉県公債券	1.7	392,700	402,725	2016/12/22	
平成21年度第2回千葉県公債券	1.44	100,000	106,128	2020/2/25	
平成22年度第8回千葉県公債券	1.4	120,000	125,352	2020/11/25	
平成25年度第5回千葉県公債券	0.84	100,000	104,049	2023/8/25	
第40回共同発行市場公募地方債	2.1	120,000	122,822	2016/7/25	
第46回共同発行市場公募地方債	1.8	336,500	346,130	2017/1/25	
第52回共同発行市場公募地方債	1.9	100,000	103,942	2017/7/25	
第55回共同発行市場公募地方債	1.85	158,400	165,182	2017/10/25	
第56回共同発行市場公募地方債	1.72	100,000	104,092	2017/11/24	
第62回共同発行市場公募地方債	1.74	100,000	104,984	2018/5/25	
第67回共同発行市場公募地方債	1.5	165,700	173,756	2018/10/25	
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	110,000	116,607	2019/8/23	
第78回共同発行市場公募地方債	1.39	100,000	105,465	2019/9/25	
第85回共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	106,280	2020/4/24	
第87回共同発行市場公募地方債	1.29	100,000	105,687	2020/6/25	
第89回共同発行市場公募地方債	1.04	150,300	157,092	2020/8/25	
第91回共同発行市場公募地方債	0.9	100,000	103,880	2020/10/23	
第93回共同発行市場公募地方債	1.25	100,000	105,906	2020/12/25	
第94回共同発行市場公募地方債	1.24	100,000	105,909	2021/1/25	
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	250,000	265,560	2021/2/25	
第97回共同発行市場公募地方債	1.38	200,000	213,952	2021/4/23	
第98回共同発行市場公募地方債	1.18	100,000	105,862	2021/5/25	
第102回共同発行市場公募地方債	1.03	150,000	157,822	2021/9/24	
第108回共同発行市場公募地方債	1.01	100,000	105,417	2022/3/25	
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	105,696	2022/4/25	
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	104,601	2022/5/25	
第112回共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	104,220	2022/7/25	
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	103,183	2022/12/22	
第119回共同発行市場公募地方債	0.8	200,000	207,566	2023/2/24	
第125回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	103,889	2023/8/25	
第127回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	102,695	2023/10/25	
第128回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	102,513	2023/11/24	
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	103,272	2024/1/25	
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	307,038	2024/3/25	
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	101,774	2024/7/25	
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	101,343	2024/8/23	

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
平成24年度第2回熊本県公債(10年)	0.8	200,000	207,624	2022/10/26
平成22年度第1回静岡市公債	1.008	100,000	104,503	2020/11/25
第13回大阪府公債(20年)	2.08	200,000	233,132	2030/6/14
平成19年度第7回大阪府公債	1.82	100,000	103,970	2017/9/20
平成22年度第5回大阪府公債	1.2	100,000	105,248	2020/9/17
平成26年度第1回大阪府公債(3年)	0.142	200,000	200,152	2017/4/28
第5回名古屋市公債(30年)	2.49	100,000	119,677	2039/3/18
第9回名古屋市公債(20年)	2.07	100,000	117,189	2028/12/20
第11回名古屋市公債(30年)	1.774	100,000	103,194	2044/9/20
第458回名古屋市公債(10年)	1.71	200,000	205,882	2017/3/17
第481回名古屋市公債(10年)	0.744	100,000	103,397	2022/12/20
平成18年度第3回京都市公債	1.9	100,000	103,193	2017/2/27
平成22年度第2回京都市公債	1.11	102,000	106,957	2020/8/27
平成24年度第4回京都市公債	0.801	100,000	103,813	2022/10/21
平成24年度第5回京都市公債	0.854	100,000	104,156	2023/1/31
平成24年度第6回京都市公債	0.137	100,000	100,177	2018/3/28
第5回横浜市公債(20年)	2.17	100,000	116,703	2025/6/20
第20回横浜市公債(20年)	2.1	100,000	117,541	2029/10/19
平成21年度第1回横浜市公債	1.58	200,000	211,796	2019/5/24
平成21年度第5回横浜市公債	1.56	100,000	106,388	2019/11/19
平成23年度第5回横浜市公債	1.011	100,000	105,302	2022/1/28
平成18年度第4回札幌市公債	1.8	100,000	102,269	2016/9/20
平成24年度第10回札幌市公債(10年)	0.8	100,000	103,773	2022/12/20
第11回川崎市公債(20年)	1.84	100,000	113,326	2030/10/18
第81回川崎市公債	1.57	100,000	105,617	2019/3/20
第82回川崎市公債	1.52	100,000	106,006	2019/9/20
平成23年度第1回北九州市公債(5年)	0.36	100,000	100,381	2016/9/28
平成18年度第6回福岡市公債	1.8	120,050	123,315	2016/12/26
平成22年度第6回広島市公債	1.21	100,000	105,993	2021/5/31
平成25年度第3回広島市公債	0.67	150,000	153,613	2024/2/23
平成23年度第2回千葉市公債	1.06	100,000	105,478	2021/11/25
平成18年度第1回鹿児島県公債(10年)	1.9	100,000	102,591	2016/10/31
第113回福岡北九州高速道路債券	2.41	100,000	119,815	2027/12/20
小計		18,393,940	19,484,388	
特殊債券(除く金融債)				
第3回政府保証公営企業債券(15年)	2.2	300,000	336,237	2021/5/21
第867回政府保証公営企業債券	1.8	100,000	102,308	2016/9/21
第871回政府保証公営企業債券	1.8	100,000	102,913	2017/1/25
第872回政府保証公営企業債券	1.8	200,000	206,076	2017/2/20
第874回政府保証公営企業債券	1.7	100,000	103,121	2017/4/19
第875回政府保証公営企業債券	1.7	212,000	218,940	2017/5/22
第876回政府保証公営企業債券	1.9	122,000	126,648	2017/6/20
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	1.3	101,000	106,216	2019/9/17
第14回政府保証日本政策金融公庫債券	0.4	100,000	100,528	2016/11/22
第13回政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	106,000	108,577	2016/8/25
第14回政府保証日本政策投資銀行債券	2.1	100,000	112,052	2021/9/13
第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.668	100,000	102,959	2023/3/15
第22回政府保証日本政策投資銀行債券	2.2	100,000	115,081	2023/6/19
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	109,941	2021/2/26
第9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	220,082	2021/3/26
第17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	102,465	2016/8/31

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	100,000	102,612	2016/12/28
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	200,000	206,040	2017/3/28
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	303,000	312,977	2017/5/26
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	315,000	327,033	2017/6/20
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	300,000	312,402	2017/11/30
第47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	103,740	2017/12/27
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	30,000	31,144	2018/3/23
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	111,000	115,348	2018/4/20
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	105,412	2018/6/29
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	181,000	190,518	2018/7/31
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.4	100,000	118,520	2049/6/30
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	200,000	235,564	2029/9/28
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	300,000	316,536	2020/1/31
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	138,000	145,984	2020/5/29
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	116,003	2040/5/31
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	100,000	105,886	2020/6/30
第115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	104,461	2020/8/31
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	200,000	209,004	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	200,000	208,134	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	200,000	211,568	2020/12/28
第125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	117,522	2030/12/27
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	100,000	105,845	2021/1/29
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	106,654	2021/4/30
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	100,000	105,678	2021/7/30
第140回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.4	100,000	100,421	2016/7/29
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	100,000	104,750	2022/1/31
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.901	200,000	209,740	2022/5/31
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	100,000	104,819	2022/6/30
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	100,000	104,075	2022/8/31
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	300,000	310,458	2022/12/28
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.66	100,000	109,712	2032/12/28

当		期 末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
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	100,000	104,241	2023/1/31
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.815	300,000	312,297	2023/2/28
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	200,000	205,922	2023/3/17
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	100,000	101,942	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	300,000	307,272	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	104,595	2023/6/30
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	100,000	102,439	2023/3/29
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.475	200,000	210,710	2034/3/31
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	102,317	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	101,914	2024/7/31
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	101,217	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	100,000	100,470	2024/12/27
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.6	202,000	212,611	2018/10/16
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	100,000	105,747	2019/6/14
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	100,000	105,422	2019/7/12
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	101,000	105,081	2020/11/17
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	105,745	2020/12/14
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	101,000	107,600	2021/3/12
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	101,000	107,678	2021/4/16
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	100,000	104,738	2022/1/25
第7回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.541	100,000	101,937	2023/4/21
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	100,000	102,412	2023/5/16
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	100,000	104,203	2023/8/14
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.66	200,000	205,246	2024/2/16
第3回政府保証首都高速道路株式会社債券	1.7	103,000	106,105	2017/3/27
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	1.4	80,000	83,060	2018/3/26
第190回政府保証預金保険機構債	0.1	100,000	100,076	2016/10/7
第191回政府保証預金保険機構債	0.1	100,000	100,081	2016/11/14
第197回政府保証預金保険機構債	0.1	100,000	100,066	2016/8/8
第26回政府保証銀行等保有株式取得機構債	0.1	400,000	400,368	2017/1/20
第16回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.476	100,000	100,494	2016/9/20
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.45	100,000	119,380	2026/3/19
第14回道路債券	1.91	100,000	111,572	2022/12/20
第17回道路債券	1.54	100,000	108,805	2022/12/20
第21回道路債券	2.75	100,000	125,227	2033/6/20
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	120,066	2028/3/17
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.84	100,000	123,311	2048/3/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	120,652	2028/6/20
第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.69	100,000	104,837	2018/6/20
第42回道路債券	2.22	100,000	116,192	2025/3/21
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.62	100,000	105,357	2018/12/20
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.67	100,000	105,855	2019/3/20
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	100,000	120,659	2029/4/20
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.71	100,000	106,007	2019/3/20
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.38	100,000	105,247	2019/9/20
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.03	100,000	105,001	2021/12/20

当		期 末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.07	100,000	105,414	2022/3/18
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.773	100,000	110,343	2032/9/17
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.715	100,000	102,696	2023/3/20
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.038	100,000	105,148	2023/3/20
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.738	100,000	102,719	2023/9/20
第1回地方公営企業等金融機構債券	1.77	100,000	105,536	2018/9/25
第2回公営企業債券(20年)	1.45	100,000	108,301	2022/12/20
第3回公営企業債券(20年)	1.03	110,000	115,732	2023/3/22
第6回地方公共団体金融機構債券(5年)	0.435	100,000	100,384	2016/7/28
第7回公営企業債券(20年)	2.2	100,000	115,175	2024/3/22
第7回公営企業債券(30年)	2.67	100,000	122,776	2035/6/20
第7回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.202	100,000	117,818	2030/4/26
第8回公営企業債券(20年)	2.25	40,000	46,240	2024/3/22
第8回地方公共団体金融機構債券	1.453	100,000	105,942	2020/1/28
第10回地方公共団体金融機構債券	1.424	100,000	105,953	2020/3/27
第11回地方公共団体金融機構債券	1.465	200,000	212,468	2020/4/28
第15回地方公共団体金融機構債券	1.093	200,000	209,114	2020/8/28
第23回地方公共団体金融機構債券	1.418	100,000	106,932	2021/4/28
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.702	100,000	109,322	2032/9/28
第28回公営企業債券	1.89	100,000	104,290	2017/10/25
第30回公営企業債券	1.97	100,000	105,692	2018/6/20
第42回地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	103,485	2021/11/28
第58回地方公共団体金融機構債券	0.739	100,000	102,628	2024/3/28
第65回地方公共団体金融機構債券	0.535	200,000	201,082	2024/10/28
第11回首都高速道路株式会社社債	0.279	300,000	301,302	2017/12/20
第18回株式会社日本政策金融公社社債	2.157	100,000	116,894	2031/5/9
第43回都市再生債券	1.29	100,000	105,640	2020/9/18
第5回本州四国連絡橋債券	2.23	100,000	115,890	2024/12/20
第344回東京交通債券	1.67	100,000	109,884	2023/2/17
第346回東京交通債券	1.13	20,000	21,173	2023/6/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	32,819	35,347	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	26,188	28,229	2037/11/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	27,045	29,413	2037/11/10
第3回一般担保住宅金融公庫債券	2.1	100,000	107,485	2019/3/20
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	33,693	36,565	2042/8/10
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.03	28,735	30,920	2038/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	23,189	24,637	2036/11/10
第5回一般担保住宅金融支援機構債券	2.01	100,000	104,241	2017/8/21
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	48,224	52,314	2037/5/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.94	28,402	30,379	2038/11/10
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	25,138	27,182	2037/5/10
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.09	30,045	32,132	2039/5/10
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	1.73	100,000	103,751	2017/9/20
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	24,831	26,880	2037/5/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.09	30,918	32,908	2039/11/10
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.7	37,850	39,723	2032/5/10
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.65	38,253	40,070	2032/5/10
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.25	44,002	47,858	2044/4/10
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	45,427	49,581	2044/5/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	45,674	49,711	2044/6/10
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	52,061	55,942	2044/9/10

銘柄名	当 期		未 期	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	54,742	58,769	2044/11/10
第3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	56,282	60,168	2044/12/10
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	1.47	100,000	105,393	2019/6/20
第3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	117,838	125,754	2045/3/10
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	32,817	35,080	2040/11/10
第3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	65,022	69,351	2045/5/10
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	32,392	34,561	2041/2/10
第4回一般担保住宅金融支援機構債券	1.5	100,000	106,044	2019/12/20
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	31,839	34,769	2041/5/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	74,823	80,100	2046/2/10
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	29,166	31,781	2041/9/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	74,880	80,426	2046/3/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	73,840	79,431	2046/5/10
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	33,215	36,243	2041/12/10
第5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	147,994	157,187	2046/7/10
第5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	78,221	83,001	2046/8/10
第5回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	32,943	35,637	2042/4/10
第5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	83,652	87,663	2046/12/10
第5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	82,694	86,705	2047/1/10
第5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	83,197	87,342	2047/2/10
第5回一般担保住宅金融支援機構債券	1.04	100,000	104,328	2020/9/18
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	168,306	175,602	2047/5/10
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	1.33	100,000	106,063	2020/12/18
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	1.358	100,000	106,217	2020/12/18
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	175,292	180,217	2047/11/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	88,895	91,161	2047/12/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	89,287	92,625	2048/1/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	89,515	92,993	2048/2/10
第7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	88,406	91,698	2048/3/10
第7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	88,564	90,757	2048/5/10
第7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	90,495	94,160	2048/6/10
第7回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	173,115	2031/6/13
第7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	91,892	94,101	2048/12/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	95,047	96,899	2049/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	96,034	97,934	2049/6/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	96,736	98,159	2049/8/10
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	112,135	2031/11/18
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	195,428	198,081	2049/10/10
第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	97,855	98,644	2049/11/10
第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	197,082	196,378	2050/1/10
第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8	99,393	99,553	2050/3/10
第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	100,000	99,472	2050/5/10
第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.83	100,000	100,166	2050/6/10
第11回一般担保住宅金融支援機構債券	1.473	100,000	109,013	2027/9/17
第13回一般担保住宅金融支援機構債券	2.105	100,000	108,782	2043/3/20
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	0.757	100,000	102,896	2024/1/19
第12回農林漁業金融公庫債券	2.24	100,000	117,954	2027/3/19
第19回東日本高速道路株式会社債	0.33	100,000	100,577	2017/12/20
第20回東日本高速道路株式会社債	0.289	100,000	100,472	2017/12/20
第28回中日本高速道路株式会社債	0.782	100,000	101,870	2018/3/20
第33回中日本高速道路株式会社債	1.084	100,000	105,110	2021/9/17
第43回中日本高速道路株式会社債	0.362	100,000	100,595	2017/9/20
第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8	200,000	207,086	2022/12/20
小 計		21,983,278	23,246,371	
金融債券				
い第736号商工債	0.45	100,000	100,413	2016/9/27

銘柄名	当 期		未 期	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
い第738号商工債	0.45	100,000	100,455	2016/11/25
い第741号商工債	0.45	100,000	100,525	2017/2/27
い第750号商工債	0.3	100,000	100,388	2017/11/27
い第752号商工債	0.3	200,000	200,800	2018/1/26
い第756号商工債	0.3	100,000	100,463	2018/5/25
い第740号農林債	0.5	100,000	100,541	2017/1/27
い第743号農林債	0.45	100,000	100,520	2017/4/27
い第746号農林債	0.35	100,000	100,378	2017/7/27
い第748号農林債	0.35	100,000	100,408	2017/9/27
い第749号農林債	0.3	300,000	300,906	2017/10/27
い第752号農林債	0.3	200,000	200,640	2018/1/26
第265回信金中金債(5年)	0.5	300,000	301,731	2016/12/27
第267回信金中金債(5年)	0.45	200,000	201,086	2017/2/27
第274回信金中金債(5年)	0.3	100,000	100,385	2017/9/27
第290回信金中金債(5年)	0.3	100,000	100,546	2019/1/25
第299回信金中金債(5年)	0.2	100,000	100,021	2019/10/25
第175号商工債(3年)	0.15	100,000	100,013	2017/8/25
第178号商工債(3年)	0.15	300,000	300,042	2017/11/27
第179号商工債(3年)	0.14	200,000	199,978	2017/12/27
小 計		3,000,000	3,010,239	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第455回東京電力株式会社社債	2.075	120,000	123,877	2018/10/23
第459回東京電力株式会社社債	2.7	10,000	10,547	2019/1/29
第518回東京電力株式会社社債	1.36	100,000	100,108	2015/8/12
第521回東京電力株式会社社債	1.97	100,000	101,199	2016/6/27
第528回東京電力株式会社社債	1.905	100,000	102,620	2016/6/13
第536回東京電力株式会社社債	1.672	100,000	101,618	2018/1/25
第542回東京電力株式会社社債	1.602	100,000	101,559	2018/4/29
第544回東京電力株式会社社債	1.976	100,000	102,776	2018/6/25
第554回東京電力株式会社社債	1.608	100,000	101,655	2019/5/29
第499回中部電力株式会社社債	1.194	100,000	104,975	2023/6/23
第503回中部電力株式会社社債	0.584	100,000	99,073	2025/3/25
第451回関西電力株式会社社債	1.85	100,000	102,054	2016/9/20
第473回関西電力株式会社社債	1.665	100,000	104,766	2019/4/25
第474回関西電力株式会社社債	1.682	100,000	104,998	2019/6/20
第491回関西電力株式会社社債	0.527	100,000	100,362	2016/12/20
第496回関西電力株式会社社債	0.908	100,000	99,894	2025/2/25
第358回中国電力株式会社社債	1.702	100,000	104,942	2018/10/25
第362回中国電力株式会社社債	1.665	100,000	105,373	2019/4/25
第371回中国電力株式会社社債	0.575	100,000	100,805	2017/6/23
第286回北陸電力株式会社社債	1.99	100,000	106,846	2019/6/25
第307回北陸電力株式会社社債	1.055	100,000	101,827	2026/6/25
第380回東北電力株式会社社債	3.35	100,000	105,004	2016/11/25
第382回東北電力株式会社社債	3.125	20,000	21,106	2017/4/25
第466回東北電力株式会社社債	0.833	100,000	101,575	2018/2/23
第471回東北電力株式会社社債	1.168	100,000	103,954	2023/12/25
第253回四国電力株式会社社債	1.0	100,000	103,436	2023/6/23
第276回四国電力株式会社社債	0.592	100,000	100,944	2017/9/25
第279回四国電力株式会社社債	0.579	100,000	100,994	2018/2/23
第408回九州電力株式会社社債	1.672	100,000	105,185	2019/6/25
第417回九州電力株式会社社債	0.641	100,000	100,862	2017/8/25
第420回九州電力株式会社社債	0.82	100,000	101,486	2018/4/25
第423回九州電力株式会社社債	0.959	100,000	102,355	2019/9/25
第426回九州電力株式会社社債	1.064	100,000	101,659	2024/2/23
第261回北海道電力株式会社社債	2.775	31,000	32,885	2017/11/24
第320回北海道電力株式会社社債	0.585	101,000	101,417	2021/12/24

当		期			末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日		
第21回清水建設株式会社無担保社債	0.39	100,000	100,339	2021/12/3		
第5回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.325	100,000	100,513	2017/12/20		
第3回キリンホールディングス株式会社無担保社債	1.69	100,000	104,319	2018/3/19		
第7回キリンホールディングス株式会社無担保社債	1.639	100,000	106,155	2019/11/5		
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	0.949	100,000	102,512	2024/4/24		
第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.856	100,000	101,647	2024/7/29		
第3回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	1.94	100,000	105,536	2018/6/20		
第8回旭化成株式会社無担保社債	1.455	100,000	105,666	2019/12/11		
第12回日本製紙株式会社無担保社債	0.97	100,000	101,819	2024/6/19		
第48回住友化学株式会社無担保社債	0.623	100,000	101,265	2018/6/12		
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.948	100,000	102,938	2020/6/4		
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	0.54	100,000	101,384	2019/7/19		
第4回株式会社フジ・メディア・ホールディングス無担保社債	1.066	100,000	101,475	2016/12/20		
第10回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.33	100,000	100,517	2017/12/4		
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	0.925	100,000	98,467	2024/10/23		
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	0.82	100,000	100,461	2024/6/4		
第5回東海ゴム工業無担保社債	0.288	100,000	100,285	2018/2/28		
第13回旭硝子株式会社無担保社債	0.31	100,000	100,398	2017/12/20		
第67回住友金属工業株式会社無担保社債	0.48	100,000	100,473	2016/10/20		
第22回日新製鋼株式会社無担保社債	0.33	100,000	100,116	2017/3/10		
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.77	100,000	101,948	2018/8/31		
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	0.494	100,000	100,079	2022/2/25		
第16回株式会社豊田自動織機無担保社債	1.95	100,000	102,412	2016/9/20		
第9回株式会社小松製作所無担保社債	0.319	100,000	100,523	2017/12/19		
第36回富士通株式会社無担保社債	0.562	200,000	201,552	2021/6/11		
第11回パナソニック株式会社無担保社債	1.081	100,000	102,563	2018/3/20		
第13回パナソニック株式会社無担保社債	0.568	100,000	100,106	2022/3/18		
第27回ソーニー株式会社無担保社債	0.664	100,000	100,464	2017/3/17		
第24回三菱重工株式会社無担保社債	1.482	100,000	105,567	2019/12/9		
第29回三菱重工株式会社無担保社債	0.662	100,000	100,766	2024/9/3		
第37回川崎重工株式会社無担保社債	0.572	100,000	101,258	2018/7/18		
第10回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	0.87	100,000	101,671	2018/8/3		
第10回B号明治安田生命2012基金特定目的会社特定社債	0.85	100,000	101,158	2017/8/9		
第52回日産自動車株式会社無担保社債	1.17	100,000	101,978	2017/4/28		
第57回日産自動車株式会社無担保社債	0.314	100,000	100,362	2019/3/20		
第12回トヨタ自動車株式会社無担保社債	0.317	100,000	100,468	2017/9/20		
第8回株式会社ドンキホーテホールディングス無担保社債	0.55	100,000	99,850	2020/3/12		
第21回株式会社ニコン無担保社債	0.864	100,000	102,413	2024/3/14		
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.65	100,000	106,259	2020/3/12		
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.785	100,000	100,844	2024/5/30		
第89回丸紅株式会社無担保社債	0.92	100,000	102,112	2019/1/31		
第70回三井物産株式会社無担保社債	2.021	100,000	111,535	2033/3/4		
第69回三菱商事株式会社無担保社債	1.99	100,000	105,479	2018/5/22		
第74回三菱商事株式会社無担保社債	1.657	100,000	106,075	2019/7/29		
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.904	100,000	101,324	2024/4/24		

当		期			末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日		
第26回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	0.54	300,000	301,281	2016/7/20		
第29回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	0.46	100,000	100,540	2017/4/21		
第30回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	0.34	100,000	100,356	2017/7/25		
第2回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	0.27	200,000	200,508	2018/1/24		
第33回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	0.41	200,000	201,358	2018/4/20		
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.91	100,000	124,409	2029/10/16		
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.31	100,000	105,028	2020/11/12		
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.62	100,000	107,309	2021/6/9		
第134回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	0.41	100,000	100,495	2017/4/20		
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.849	100,000	100,422	2024/9/12		
第6回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	2.084	100,000	107,837	2020/3/4		
第6回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	1.9	100,000	107,294	2020/3/2		
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	2.21	100,000	107,933	2019/7/24		
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	1.43	100,000	105,589	2020/9/28		
第56回株式会社三井住友銀行無担保社債	0.47	100,000	100,551	2017/1/20		
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.04	100,000	108,248	2020/8/7		
第10回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.06	200,000	209,276	2018/1/26		
第20回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	0.538	100,000	100,770	2017/3/17		
第17回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.465	100,000	100,570	2016/12/20		
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	1.82	100,000	103,120	2017/3/17		
第47回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.501	100,000	100,650	2016/12/20		
第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.572	100,000	100,565	2021/3/18		
第67回アコム株式会社無担保社債	0.5	100,000	100,186	2019/6/6		
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	100,000	100,909	2026/9/18		
第138回オリックス株式会社無担保社債	1.69	100,000	103,372	2017/8/25		
第167回オリックス株式会社無担保社債	0.508	100,000	100,838	2018/3/7		
第19回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.412	100,000	100,162	2020/2/25		
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.853	100,000	101,606	2018/2/26		
第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債	1.249	100,000	103,945	2020/2/26		
第43回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.454	100,000	100,521	2019/2/25		
第44回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.723	100,000	101,263	2021/2/25		
第31回三菱地所株式会社無担保社債	3.125	100,000	107,018	2017/9/26		
第103回三菱地所株式会社無担保社債	0.459	100,000	100,562	2016/12/22		
第84回住友不動産株式会社無担保社債	0.388	100,000	100,559	2018/2/28		
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	100,277	2024/4/26		

銘柄名	当 期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	1.12	100,000	104,963	2021/9/17
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	1.168	100,000	104,447	2023/6/26
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	100,000	102,337	2026/6/17
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.453	100,000	100,965	2018/6/12
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	100,000	102,873	2025/12/12
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	1.412	100,000	105,431	2019/12/9
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	2.3	100,000	111,610	2021/2/25
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.36	100,000	113,920	2022/2/25
第56回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.7	100,000	105,566	2018/12/20
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.376	200,000	240,408	2028/12/12
第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.598	200,000	202,502	2017/12/22
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.28	19,000	21,572	2022/3/25
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.427	100,000	120,360	2028/3/17
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.2	20,000	22,628	2022/5/10
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.875	100,000	107,184	2019/9/20
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.375	100,000	114,739	2039/12/16
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.917	100,000	103,368	2044/10/28
第9回東京地下鉄株式会社社債	1.442	100,000	105,810	2020/3/19
第39回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	1.25	100,000	101,820	2017/1/27
第9回三井倉庫株式会社無担保社債	1.27	100,000	102,045	2017/4/19
第63回日本電信電話株式会社電信債券	0.69	100,000	102,428	2023/3/20
第20回KDDI株式会社無担保社債	0.803	100,000	102,607	2023/12/20
第30回電源開発株式会社無担保社債	1.394	100,000	104,788	2020/5/20
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	100,000	102,446	2023/12/20
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	2.9	100,000	107,399	2018/1/30
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	0.9	100,000	104,107	2023/6/20
第2回ノルデアバンク・アクツィエボラーグ・アプリクト円貨社債	1.2	100,000	102,009	2017/6/15

銘柄名	当 期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第6回ノルデアバンク・アクツィエボラーグ・アプリクト円貨社債	0.288	100,000	100,161	2017/5/26
第4回スウェンスカ・ハンデルスバンケンAB円貨社債	0.325	100,000	100,172	2019/9/4
第26回GEキャピタル・コーポ円貨社債	0.313	200,000	200,514	2017/2/13
第9回JPMorgan・チェース・アンド・カンパニー円貨社債	1.32	100,000	101,914	2017/2/9
第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	2.11	100,000	102,924	2016/12/28
第9回モルガン・スタンレー円貨社債	0.557	100,000	100,701	2018/5/22
第6回ビー・エヌ・ビー・パリバ円貨社債	0.439	100,000	100,263	2019/9/17
第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	0.457	100,000	100,869	2019/1/17
第11回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	0.284	100,000	100,051	2020/1/16
第7回オーストラリア・コモモンウェルス銀行円貨社債	0.315	100,000	100,257	2016/11/18
第9回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	1.2	100,000	101,858	2017/3/9
第14回ラポバンク・ネーデルランド円貨社債	1.187	100,000	101,444	2016/11/17
第16回ラポバンク・ネーデルランド円貨社債	1.142	200,000	203,554	2017/5/25
第27回ラポバンク・ネーデルランド円貨社債	0.38	100,000	100,143	2020/5/22
小 計		16,221,000	16,710,274	
合 計		300,188,218	318,819,434	

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%	千円	%
公 社 債	318,819,434	96.6	318,819,434	96.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	11,195,034	3.4	11,195,034	3.4
投 資 信 託 財 産 総 額	330,014,468	100.0	330,014,468	100.0

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2015年5月29日現在
(A) 資 産	330,119,417,632円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,589,802,818
公 社 債(評価額)	318,819,434,160
未 収 入 金	7,625,920,760
未 収 利 息	949,795,599
前 払 費 用	29,515,295
差 入 委 託 証 拠 金	104,949,000
(B) 負 債	10,140,480,942
未 払 金	9,824,451,515
未 払 解 約 金	211,080,427
差入委託証拠金代用有価証券	104,949,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	319,978,936,690
元 本	242,124,189,619
次 期 繰 越 損 益 金	77,854,747,071
(D) 受 益 権 総 口 数	242,124,189,619口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,215円

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2014年5月30日 至 2015年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	3,260,837,417円
受 取 利 息	3,260,837,417
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,121,203,716
売 買 益	3,918,284,868
売 買 損	△797,081,152
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	12,801,860
取 引 益	42,534,524
取 引 損	△29,732,664
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	6,394,842,993
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	57,935,132,559
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	20,162,845,518
(G) 解 約 差 損 益 金	△6,638,073,999
(H) 計 (D+E+F+G)	77,854,747,071
次 期 繰 越 損 益 金(H)	77,854,747,071

(注1) (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2) (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3) (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。

## お知らせ

一般社団法人投資信託協会「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」の一部改正に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2014年12月27日)

一般社団法人投資信託協会「信用リスク集中回避のための投資制限に係るガイドライン」の制定に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2015年2月11日)

# 国内株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第15期（決算日 2015年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運用方針	わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX(東証株価指数)と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は、行いません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 株式先物率	純資産額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
	円	%		%	%	百万円
第11期(2011年5月30日)	6,389	△4.4	823.68	△6.4	98.2	122,295
第12期(2012年5月29日)	5,771	△9.7	727.03	△11.7	97.4	113,418
第13期(2013年5月29日)	9,567	65.8	1,178.87	62.1	97.8	149,398
第14期(2014年5月29日)	9,940	3.9	1,200.68	1.9	97.9	142,008
第15期(2015年5月29日)	14,114	42.0	1,673.65	39.4	97.9	157,438

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 株式先物率	株式先物率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(当期首) 2014年 5月29日	円	%		%	%	%
	9,940	—	1,200.68	—	97.9	2.2
5月末	9,946	0.1	1,201.41	0.1	97.9	2.0
6月末	10,460	5.2	1,262.56	5.2	98.7	1.0
7月末	10,683	7.5	1,289.42	7.4	99.0	0.7
8月末	10,590	6.5	1,277.97	6.4	99.1	0.9
9月末	11,068	11.3	1,326.29	10.5	97.9	1.8
10月末	11,130	12.0	1,333.64	11.1	98.5	1.5
11月末	11,774	18.5	1,410.34	17.5	98.4	1.5
12月末	11,762	18.3	1,407.51	17.2	99.2	0.8
2015年 1月末	11,826	19.0	1,415.07	17.9	99.1	0.8
2月末	12,740	28.2	1,523.85	26.9	98.2	1.0
3月末	13,002	30.8	1,543.11	28.5	98.0	1.7
4月末	13,425	35.1	1,592.79	32.7	98.4	1.5
(当期末) 2015年 5月29日	14,114	42.0	1,673.65	39.4	97.9	1.8

(注1) 騰落率は期首比です。

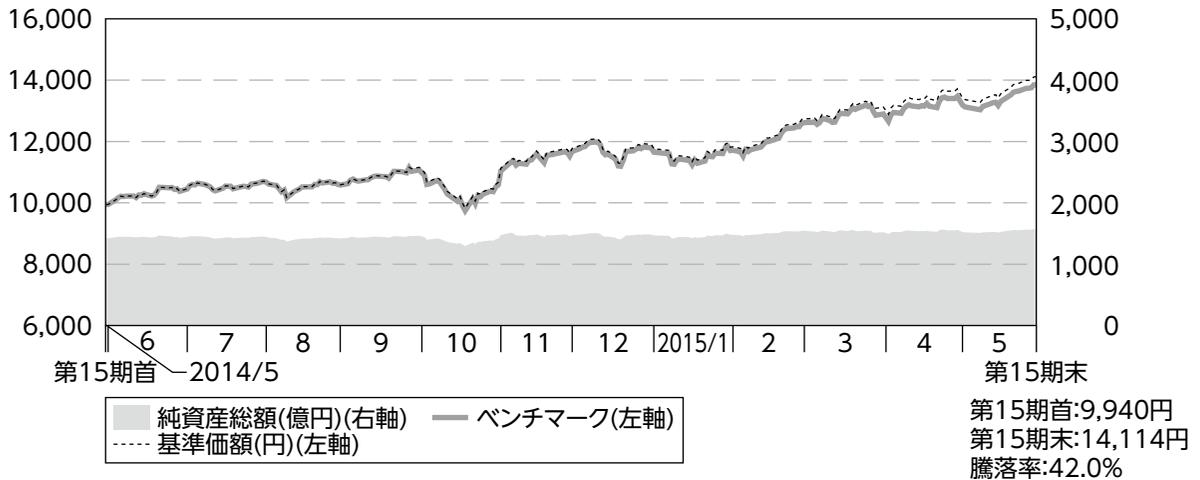
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

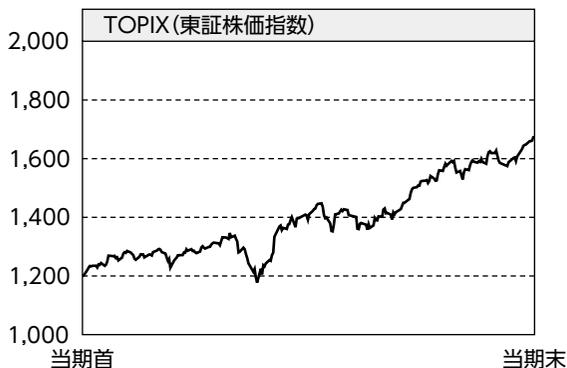


(注)ベンチマークは、2014年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)の動きを反映して、基準価額は値上がりしました。

## 投資環境



当期の国内株式市場は、期首より政府の成長戦略への期待、米国株式市場の上昇や為替市場の円安進行を受けて上昇基調で推移しました。その後、世界経済の減速懸念や円高の進行を嫌気して下落する局面もありましたが、米国の景況感改善や日銀の予想外の追加金融緩和により上昇に転じました。その後、原油安、ギリシャの政局不安などの外部環境の悪化により上値が重くなる場面もありましたが、ECB(欧州中央銀行)が量的金融緩和を決定したことをきっかけに投資家心理が改善し世界的な株高となりました。為替市場で円安ドル高が進展したことも好感されて、国内株式市場は一段高となり期末を迎えました。

## 当該投資信託のポートフォリオ

ベンチマーク(TOPIX(東証株価指数))と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

- (1) 株式組入比率は期を通じて100%に近い水準で維持し、効率的な運用に努めました。設定や解約による資金変動には、取引コスト抑制の観点から株価指数先物取引を活用しました。
- (2) 東証一部上場銘柄の中から信用リスクが極めて高いと判断される銘柄を除外し、TOPIX(東証株価指数)の個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成しました。

## 当該投資信託の組入資産の内容

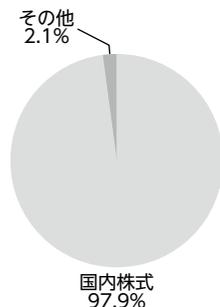
## ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	4.7%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	2.9%
3	三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.7%
4	ソフトバンク	日本	1.6%
5	本田技研工業	日本	1.5%
6	みずほフィナンシャルグループ	日本	1.5%

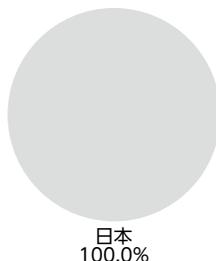
順位	銘柄名	国	組入比率
7	日本電信電話	日本	1.3%
8	ファナック	日本	1.1%
9	日本たばこ産業	日本	1.1%
10	KDDI	日本	1.1%
組入銘柄数		1,837	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

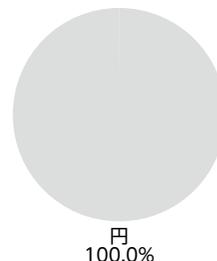
## ○資産別配分



## ○国別配分



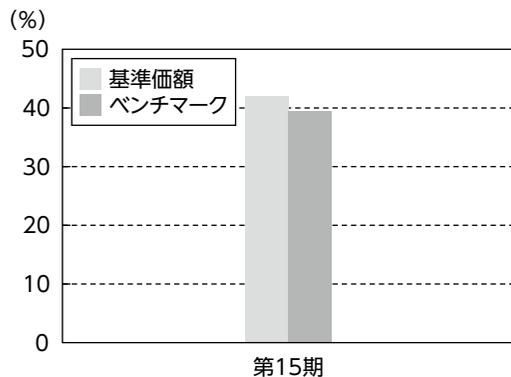
## ○通貨別配分



(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

## 当該投資信託のベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマークに概ね連動しました。

差異の主な要因は、ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)が配当相当分を含まない指数であることによるものです。

## 今後の運用方針

原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2014年5月30日~2015年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (0) (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.001% (0.000) (-) (-) (-) (-) (-) (0.001)	(a) 売買委託手数料= $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税= $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用)	- (-) (-)	- (-) (-)	(c) その他費用= $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
合計	0	0.001	

(注1) 期中の費用(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2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、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(11,533円)で除して100を乗じたものです。

(注4) -印は該当がないことを示します。

## 売買および取引の状況

### <株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株 7,347	千円 7,784,940	千株 33,487 (519)	千円 41,755,208 (-)

(注1)金額は受渡代金です。

(注2) ( )内は株式分割、予約権行使、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		当 期			
		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 37,447	百万円 38,426	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

## 株式売買比率

### <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) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	49,540,149千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	145,699,078千円
(c) 売 買 高 比 率(a) / (b)	0.34

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

## 利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

### ■利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	84百万円	194百万円	782百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注2) 当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

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

## 組入資産の明細

## &lt;国内株式(上場株式)&gt;

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
<b>水産・農林業(0.1%)</b>			
極洋	36	30	8,700
日本水産	111.7	86.7	31,905
マルハニチロ	17.5	13.9	26,104
サカタのタネ	13.4	11.4	24,954
ホクト	10.1	7.8	18,548
<b>鉱業(0.4%)</b>			
住石ホールディングス	25.2	19.6	2,430
日鉄鉱業	23	20	10,940
三井松島産業	59	46	6,302
国際石油開発帝石	441.8	371.6	568,548
日本海洋掘削	2.3	2.1	8,190
石油資源開発	13	10.1	41,965
K&Oエナジーグループ	4.5	4.7	7,571
<b>建設業(2.6%)</b>			
ショーボンドホールディングス	8.1	6.8	36,992
ミライト・ホールディングス	25.8	21.7	30,662
タマホーム	6.6	5.3	3,058
サンヨーホームズ	1.7	0.8	503
ダイセキ環境ソリューション	1.1	0.8	1,548
安藤・間	60.6	47.3	32,069
東急建設	38.4	25.2	19,731
コムシスホールディングス	44.1	31.4	56,708
ミサワホーム	12	8.9	10,039
高松コンストラクショングループ	6.9	5.3	14,246
東建コーポレーション	3.6	2.7	18,198
ヤマウラ	9.3	3.8	1,953
大成建設	460	366	248,514
大林組	273	212	172,780
清水建設	278	216	205,632
飛島建設	—	47.5	10,592
長谷工コーポレーション	121.2	88.2	128,331
松井建設	12	8	5,360
銭高組	—	10	3,800
鹿島建設	400	310	169,570
不動テトラ	64.2	53.9	10,564
鉄建建設	55	44	17,512
日鉄住金テックスエンジ	17	13	9,269
西松建設	125	76	34,960
三井住友建設	244.2	286.2	47,795
大豊建設	—	20	11,140
前田建設工業	58	47	41,360

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
佐田建設	31	26	3,640
ナカノフドー建設	16.2	6.2	3,211
奥村組	81	67	38,056
大和小田急建設	4.9	4	4,740
東鉄工業	10.9	8.5	22,746
イチケン	19	9	2,610
戸田建設	106	89	44,500
熊谷組	98	89	32,129
青木あすなろ建設	5.7	4.6	3,882
北野建設	19	15	4,710
植木組	25	10	2,490
三井ホーム	12	9	4,977
矢作建設工業	13.4	8.7	7,569
ピーエス三菱	7.2	8	3,320
日本ハウスホールディングス	12.2	9	5,139
大東建託	34.5	26.4	365,508
新日本建設	17.9	8.4	4,779
N I P P O	21	16	34,640
東亜道路工業	19	13	6,058
前田道路	28	22	53,790
日本道路	25	21	13,104
東亜建設工業	83	53	10,918
若築建設	49	41	7,503
東洋建設	30.7	20.6	9,414
五洋建設	108.3	78.3	39,933
大林道路	11	8	5,712
世紀東急工業	—	10.3	5,603
福田組	20	11	8,932
住友林業	62.6	52	84,344
日本基礎技術	11.6	8.4	3,586
日成ビルド工業	33	20	7,560
巴コーポレーション	11.3	9.5	4,066
パナホーム	34	26	23,712
大和ハウス工業	249	206.6	617,114
ライト工業	19.4	11.3	12,102
積水ハウス	242.2	221.6	459,930
日特建設	12.4	9.4	4,897
北陸電気工事	6	4	4,624
ユアテック	14	11	9,669
西部電気工業	8	6	2,736
四電工	8	6	2,736
中電工	13.1	10.2	24,327

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
関電工	41	32	24,544	
きんでん	60	47	79,853	
東京エネシス	10	8	9,560	
トーエネック	13	10	6,590	
住友電設	6.3	5.6	8,820	
日本電設工業	14.8	11.5	24,932	
協和エクシオ	35.6	29.9	43,833	
新日本空調	7.8	6.1	6,575	
NDS	14	12	3,756	
九電工	18	13	24,024	
三機工業	21	14.5	14,500	
日揮	91	71	177,109	
中外炉工業	24	22	6,204	
ヤマト	8	7	2,919	
太平電業	14	10	11,250	
高砂熱学工業	25.4	19.4	28,324	
三晃金属工業	16	8	2,032	
朝日工業社	11	8	3,664	
明星工業	18	11.6	7,203	
大気社	12.1	10.1	33,279	
ダイダン	12	10	8,830	
日比谷総合設備	10.6	9.1	15,597	
東芝プラントシステム	15.3	11.5	17,284	
OSJBホールディングス	—	9.6	2,582	
東洋エンジニアリング	49	35	11,270	
千代田化工建設	72	51	56,151	
新興プランテック	18.7	14.5	15,094	
<b>食料品(4.0%)</b>				
日本製粉	56	43	29,369	
日清製粉グループ本社	90.6	77.4	120,124	
日東富士製粉	7	6	2,052	
昭和産業	37	29	14,181	
鳥越製粉	7.3	5.6	4,020	
協同飼料	31	—	—	
中部飼料	8.7	6.8	6,106	
日本配合飼料	28	—	—	
フィード・ワンホールディングス	—	42.7	5,764	
東洋精糖	14	11	1,155	
日本甜菜製糖	46	36	7,236	
三井製糖	36	28	12,460	
塩水港精糖	7.2	7.6	1,991	
森永製菓	89	64	30,208	
中村屋	21	16	7,568	
江崎グリコ	31	16.3	88,672	
名糖産業	4	3.1	3,971	
不二家	52	40	7,880	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
山崎製パン	67	52	107,640	
第一屋製パン	12	9	1,116	
モロゾフ	14	11	4,367	
亀田製菓	5.1	3.9	18,739	
寿スピリッツ	2	1.7	4,335	
カルビー	33.6	26.1	124,627	
森永乳業	77	63	27,153	
六甲バター	4.1	3.2	4,134	
ヤクルト本社	53.2	37.8	261,576	
明治ホールディングス	26.9	20.9	295,944	
雪印メグミルク	19.6	16.6	26,078	
プリマハム	45	40	13,840	
日本ハム	63	52	140,192	
伊藤ハム	50	39	24,063	
丸大食品	43	36	16,236	
米久	2.9	2.3	4,158	
S Foods	5.7	4.4	10,115	
サッポロホールディングス	149	116	54,288	
アサヒグループホールディングス	182.6	141.8	564,576	
キリンホールディングス	388.7	285.9	511,618	
宝ホールディングス	71	55.4	52,186	
オエノンホールディングス	22	18	3,978	
養命酒製造	7	4	4,092	
コカ・コーラウエスト	28	23.9	53,607	
コカ・コーライーストジャパン	18.8	21.5	49,471	
サントリー食品インターナショナル	62.2	42.3	219,114	
ダイドードリンコ	4.2	3.6	19,728	
伊藤園	24.7	20.9	56,221	
キーコーヒー	8.6	6.2	12,282	
ユニカフェ	2.5	1.9	1,746	
ジャパンフーズ	1.2	0.9	1,005	
日清オイリオグループ	19	34	15,742	
不二製油	22.1	18.8	37,092	
かどや製油	0.9	0.7	1,903	
J-オイルミルズ	38	30	12,660	
キッコーマン	74	58	201,840	
味の素	216	163	418,665	
キュービー	46.2	35.9	98,437	
ハウス食品グループ本社	32	26.1	61,622	
カゴメ	35.1	27.3	51,760	
焼津水産化学工業	4	3.3	3,352	
アリアケジャパン	8.3	6.4	29,056	
エバラ食品工業	—	1.2	2,402	
ニチレイ	97	75	52,350	
東洋水産	45	36.9	159,223	
イートアンド	0.8	0.8	1,556	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
日清食品ホールディングス	35.5	29.9	158,470	
永谷園	9	7	7,868	
一正蒲鉾	—	2.4	2,812	
フジッコ	9	7	14,231	
ロック・フィールド	4.7	3.7	9,364	
日本たばこ産業	503.5	391	1,775,140	
ケンコーマヨネーズ	3	2.3	3,788	
わらべや日洋	5.3	4.1	11,279	
なとり	4.2	3.3	4,963	
ユウグレナ	—	23.6	43,943	
ミヨシ油脂	31	24	3,456	
理研ビタミン	—	2.1	8,253	
<b>繊維製品(0.7%)</b>				
片倉工業	9.8	8.4	11,314	
グンゼ	69	53	17,649	
東洋紡	359	261	51,939	
ユニチカ	233	192	11,328	
富士紡ホールディングス	44	32	9,568	
日清紡ホールディングス	54	42	58,674	
倉敷紡績	87	68	17,816	
シキボウ	49	38	4,978	
日本毛織	27	21	18,984	
トーア紡コーポレーション	36	30	2,280	
ダイドーリミテッド	9.6	7.6	3,914	
帝国繊維	8.9	6.9	11,730	
帝人	347	270	125,010	
東レ	616	510	528,105	
サカイオーボックス	23	17	3,485	
住江織物	27	19	6,251	
日本フェルト	4.9	3.8	2,036	
イチカワ	6	5	1,760	
日本バイリーン	10	9	7,425	
芦森工業	25	18	3,546	
アツギ	71	56	6,664	
ダイニック	16	12	2,280	
セーレン	22.9	16.4	21,352	
東海染工	12	9	1,242	
小松精練	16	11.5	6,566	
ワコールホールディングス	51	39	58,227	
ホギメディカル	5.4	4.2	25,452	
レナウン	20.4	15.8	3,365	
クラウディア	1.8	2.6	1,651	
T S I ホールディングス	41.9	29.6	26,580	
三陽商会	45	36	12,528	
オンワードホールディングス	57	47	40,044	
ルック	18	13	3,055	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
ゴールドウイン	21	16	14,944	
デサント	20	15.4	29,167	
キング	4.3	3.4	1,479	
ヤマトインターナショナル	5.6	4.4	1,883	
<b>パルプ・紙(0.2%)</b>				
特種東海製紙	49	38	10,982	
王子ホールディングス	375	271	149,863	
日本製紙	43.9	31.8	69,960	
三菱製紙	121	100	9,800	
北越紀州製紙	58	40.9	27,934	
中越パルプ工業	32	25	6,300	
巴川製紙所	13	10	2,510	
大王製紙	29	29	37,555	
レンゴー	68	58	31,900	
トーモク	27	21	6,258	
ザ・バック	6	4.7	12,158	
<b>化学(5.9%)</b>				
クラレ	134.9	112.3	183,385	
旭化成	530	411	453,949	
共和レザー	5.7	4.4	4,395	
コープケミカル	13	10	930	
昭和電工	565	439	76,386	
住友化学	625	485	351,625	
日本化成	16	12	1,932	
住友精化	18	14	11,396	
日産化学工業	56.7	43.2	116,899	
ラサ工業	32	25	3,725	
クレハ	60	46	23,414	
多木化学	5	4	2,916	
テイカ	14	11	5,533	
石原産業	153	111	14,208	
片倉チッカリン	5	4	1,164	
日本曹達	54	42	31,374	
東ソー	227	165	122,760	
トクヤマ	132	103	27,501	
セントラル硝子	81	67	35,108	
東亜合成	100	83	44,405	
ダイソー	34	26	10,972	
関東電化工業	20	16	14,688	
電気化学工業	170	137	77,268	
信越化学工業	152.3	118.3	898,843	
日本カーバイド工業	25	22	5,346	
堺化学工業	34	27	11,070	
エア・ウォーター	70	58	129,572	
大陽日酸	109	84.7	129,675	
日本化学工業	31	24	6,264	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
日本パーカライジング	20	31.1	42,233	
高压ガス工業	13	10	6,520	
チタン工業	10	8	1,952	
四国化成工業	12	10	10,870	
戸田工業	15	13	4,732	
ステラ ケミファ	4.3	3.4	4,562	
保土谷化学工業	25	20	4,060	
日本触媒	72	52	89,440	
大日精化工業	33	27	17,766	
カネカ	106	89	80,901	
三菱瓦斯化学	134	113	81,586	
三井化学	386	300	121,800	
J S R	77.9	65.1	147,516	
東京応化工業	16.4	13.7	51,717	
大阪有機化学工業	5.8	4.7	2,528	
三菱ケミカルホールディングス	531.1	412.3	322,954	
日本合成化学工業	17	15	13,605	
ダイセル	110	92.7	150,081	
住友ベークライト	66	62	35,960	
積水化学工業	174	153	256,734	
日本ゼオン	67	57	66,348	
アイカ工業	23.8	19.8	55,182	
宇部興産	428	332	73,040	
積水樹脂	11.9	10.2	17,187	
タキロン	20	14	7,742	
旭有機材工業	30	23	6,164	
日立化成	36.7	32.6	80,293	
ニチバン	9	6	3,144	
リケンテクノス	14	10.7	5,339	
大倉工業	20	16	5,888	
積水化成工業	24	19	8,987	
群栄化学工業	23	18	6,174	
タイガースポリマー	4.3	3.2	2,768	
ミライアル	2.8	2.4	3,499	
ダイキアクシス	—	0.8	845	
ダイキョーニシカワ	2.1	1.6	6,768	
日本化薬	60	43	59,727	
カーリットホールディングス	6.9	5.4	3,461	
日本精化	7	5.5	5,362	
A D E K A	36.5	30.4	52,409	
日油	71	54	51,840	
ハリマ化成グループ	7.4	5.8	2,813	
花王	220.9	177.4	1,003,551	
第一工業製薬	15	15	5,520	
ニイタカ	—	1	1,839	
三洋化成工業	27	21	19,110	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
大日本塗料	49	38	7,144	
日本ペイントホールディングス	74	57.1	220,406	
関西ペイント	103	80	171,840	
神東塗料	7	5	1,160	
中国塗料	24	19	18,487	
日本特殊塗料	6.5	5.1	4,554	
藤倉化成	10.7	9	5,301	
太陽ホールディングス	6.9	5.4	27,810	
D I C	301	264	94,248	
サカタインクス	17.3	13.5	16,618	
東洋インキSCホールディングス	76	65	36,985	
T & K T O K A	3.1	2.2	5,165	
富士フイルムホールディングス	194.4	150.9	717,378	
資生堂	151.1	117.3	292,722	
ライオン	98	76	66,880	
高砂香料工業	31	22	12,606	
マンダム	8.5	6.6	31,911	
ミルボン	5.4	3.9	15,268	
ファンケル	19.7	15.3	21,940	
コーセー	13.7	10.7	86,884	
コタ	2.5	2.3	3,270	
ドクターシーラボ	5.8	4.5	19,980	
シーボン	0.8	0.8	2,166	
ポーラ・オルビスホールディングス	8.7	7.8	53,196	
ノエビアホールディングス	5.7	4.2	10,361	
アジュバンコスメジャパン	1.4	1.2	1,082	
エステー	5.3	4.5	5,053	
アグロ カネショウ	—	1.8	1,668	
コニシ	6.1	5.2	12,823	
長谷川香料	10.8	8.3	14,832	
星光PMC	4.7	3.6	3,949	
小林製薬	13.9	10.8	87,156	
荒川化学工業	7.1	5.6	7,985	
メック	6.6	5.1	4,758	
日本高純度化学	2.4	1.9	4,742	
J C U	1.3	1.8	9,090	
新田ゼラチン	5.1	4.1	3,202	
アース製薬	6.1	4.7	21,455	
イハラケミカル工業	13.1	10.3	16,655	
北興化学工業	8	7	3,318	
大成ラミック	2.2	1.8	5,214	
クミアイ化学工業	18	13.6	14,987	
日本農薬	19.4	15.1	17,818	
アキレス	68	56	9,240	
有沢製作所	14.2	11.1	11,832	
日東電工	70	51	492,558	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
レック	2.7	2.3	3,026	
きもと	12.6	11.8	3,481	
藤森工業	7.3	5.7	22,230	
前澤化成工業	5.9	4.6	5,593	
J S P	5.6	4.9	10,167	
エフピコ	8.4	5.8	26,796	
天馬	6.8	5.1	10,745	
信越ポリマー	16.6	12.9	7,765	
東リ	22	17	5,831	
ニフコ	19	14.7	75,999	
日本バルカー工業	35	27	8,667	
ユニ・チャーム	52.1	133.5	366,858	
<b>医薬品(4.6%)</b>				
協和発酵キリン	102	79	123,951	
武田薬品工業	318.1	247.1	1,492,484	
アステラス製薬	977.9	751	1,360,812	
大日本住友製薬	60.1	46.7	65,940	
塩野義製薬	132.6	103	453,715	
田辺三菱製薬	70.7	76.8	151,603	
わかもと製薬	10	7	2,016	
あすか製薬	10	7.8	9,765	
日本新薬	19	15	56,925	
ビオフェルミン製薬	1.4	1.1	3,144	
中外製薬	84.5	65.6	244,032	
科研製薬	31	23	93,725	
エーザイ	104.5	87	678,600	
ロート製薬	35.6	30	52,710	
小野薬品工業	38.6	29.9	406,640	
久光製薬	26.4	18.6	93,744	
有機合成薬品工業	6	4	1,160	
持田製薬	6.1	4.5	31,365	
参天製薬	31.2	121.2	209,312	
扶桑薬品工業	29	22	6,468	
日本ケミファ	12	8	4,960	
ツムラ	24.9	20.8	56,472	
日医工	19.9	15.4	44,352	
キッセイ薬品工業	15.8	12.2	40,077	
生化学工業	17.7	12.6	24,872	
栄研化学	6.6	5.5	14,476	
日水製薬	3.4	2.6	3,658	
鳥居薬品	5.8	4.5	14,422	
J C R ファーマ	6.5	5.1	15,147	
東和薬品	4.3	3.4	23,222	
富士製薬工業	2.4	1.8	3,996	
沢井製薬	13.4	10.4	74,568	
ゼリア新薬工業	13.4	13.5	24,975	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
第一三共	267.8	221.8	520,453	
キョーリン製薬ホールディングス	22.6	17.6	45,936	
大幸薬品	4	2.9	5,051	
ダイト	2.8	2.9	7,629	
大塚ホールディングス	168.5	130.9	509,462	
大正製薬ホールディングス	20.4	15.9	136,899	
<b>石油・石炭製品(0.5%)</b>				
日本コークス工業	68.5	59.1	6,973	
昭和シェル石油	75.9	58.9	68,441	
コスモ石油	235	182	38,220	
ニチレキ	10	8	8,528	
東燃ゼネラル石油	128	99	116,127	
ユシロ化学工業	4.6	3.5	5,537	
ビービー・カストロール	3.5	2.7	3,704	
富士石油	21.7	15.3	6,502	
MORESCO	2.7	1.7	3,959	
出光興産	40.3	31.3	76,904	
J Xホールディングス	942.4	731.8	402,124	
<b>ゴム製品(0.9%)</b>				
横浜ゴム	95	73	102,419	
東洋ゴム工業	70	29.8	82,486	
ブリヂストン	266.1	206.6	1,069,361	
住友ゴム工業	66.2	51.4	112,617	
藤倉ゴム工業	5.3	5.5	4,042	
オカモト	30	23	10,856	
フコク	3.5	2.8	3,382	
ニッタ	8.4	6.5	22,360	
住友理工	15.7	12.2	13,176	
三ツ星ベルト	22	16	15,600	
バンドー化学	31	24	12,432	
<b>ガラス・土石製品(0.9%)</b>				
日東紡績	63	49	25,039	
旭硝子	418	325	263,900	
日本板硝子	409	318	41,340	
石塚硝子	11	9	2,241	
日本山村硝子	34	27	5,427	
日本電気硝子	175	126	83,412	
オハラ	3.3	2.7	1,663	
住友大阪セメント	158	123	54,858	
太平洋セメント	499	412	149,968	
デイ・シイ	9.4	7.3	3,328	
日本ヒューム	8	7	5,859	
日本コンクリート工業	17	11.5	6,164	
三谷セキサン	4.5	3.3	6,108	
ジャパンパイル	10.5	8.9	5,900	
東海カーボン	79	57	21,489	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
日本カーボン	45	35	12,915	
東洋炭素	5.2	3.7	7,869	
ノリタケカンパニーリミテド	48	38	11,324	
TOTO	125	97	199,626	
日本碍子	107	83	256,470	
日本特殊陶業	73	56.8	214,420	
MARUWA	2.2	2	5,616	
品川リフラクトリーズ	22	17	4,998	
黒崎播磨	20	15	3,975	
ヨータイ	5	4	1,520	
イソライト工業	5.6	3.5	850	
東京窯業	11	8	1,800	
ニッカトー	3.1	2.6	1,118	
フジミインコーポレーテッド	7.8	6.4	12,064	
ニチアス	41	29	22,562	
ニチハ	10.4	8.8	14,775	
<b>鉄鋼(1.5%)</b>				
新日鐵住金	3,589	2,787	952,875	
神戸製鋼所	1,355	1,140	265,620	
合同製鐵	46	35	8,400	
ジェイ エフ イー ホールディングス	216.6	168.2	510,739	
日新製鋼	36.4	28.4	45,809	
東京製鐵	46.9	33.7	32,621	
共英製鋼	7.9	7	15,708	
大和工業	17.6	15	44,925	
東京鐵鋼	18	13	7,397	
大阪製鐵	4.3	4.1	9,516	
淀川製鋼所	60	46	25,944	
東洋鋼板	20	15.8	9,227	
丸一鋼管	28.4	20.2	66,458	
モリ工業	13	11	4,422	
大同特殊鋼	142	110	66,220	
日本高周波鋼業	37	29	3,451	
日本冶金工業	67.9	54.7	13,128	
山陽特殊製鋼	46	40	23,560	
愛知製鋼	45	39	23,322	
日立金属	76	67	138,489	
日本金属	22	17	2,839	
大平洋金属	59	42	17,178	
新日本電工	36	40.2	11,778	
栗本鐵工所	44	34	8,466	
虹技	12	9	1,935	
日本鑄鉄管	9	6	1,392	
三菱製鋼	53	44	12,364	
日亜鋼業	12	9.2	2,842	
日本精練	7	5	3,200	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
シンニッタン	8.2	6.9	3,988	
新家工業	19	13	2,353	
<b>非鉄金属(1.0%)</b>				
大紀アルミニウム工業所	14	11	4,675	
日本軽金属ホールディングス	192.3	160	35,040	
三井金属鉱業	216	179	60,681	
東邦亜鉛	48	38	17,290	
三菱マテリアル	530	411	202,623	
住友金属鉱山	220	182	349,895	
DOWAホールディングス	94	79	88,164	
古河機械金属	143	103	22,557	
大阪チタニウムテクノロジーズ	9.3	6.5	21,157	
東邦チタニウム	14.4	11.1	15,495	
UACJ	108	75	24,600	
古河電気工業	267	194	46,754	
住友電気工業	319.8	248.4	493,570	
フジクラ	136	92	63,480	
昭和電線ホールディングス	109	72	6,984	
東京特殊電線	12	0.9	1,223	
タツタ電線	13.5	12.4	6,348	
沖電線	13	8	2,432	
カナレ電気	1.2	1.1	2,514	
平河ヒューテック	1.9	1.7	2,357	
リョービ	52	37	18,426	
アーレスティ	7.3	5.9	5,876	
アサヒホールディングス	12.8	9.9	22,007	
<b>金属製品(0.6%)</b>				
稲葉製作所	3.6	2.9	4,236	
宮地エンジニアリンググループ	28	21	3,906	
トーカロ	5.2	4.3	12,220	
アルファC o	3.3	2.7	3,747	
SUMCO	53.2	51.9	97,675	
川田テクノロジーズ	2.1	1.5	5,812	
東洋製罐グループホールディングス	60.4	46.9	88,359	
ホッカンホールディングス	24	18	5,562	
コロナ	4.5	3.4	4,120	
横河ブリッジホールディングス	16.6	12.5	15,912	
OSJBホールディングス	18.5	—	—	
駒井ハルテック	20	13	3,354	
高田機工	10	6	1,596	
三和ホールディングス	71	62	67,146	
文化シャッター	21	18.8	19,796	
三協立山	10.8	9	18,072	
アルインコ	—	2.8	3,217	
東洋シャッター	3.6	2.2	2,270	
LIXILグループ	118.2	98.1	233,085	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
日本フィルコン	7.8	5.8	3,010	
ノーリツ	16.6	12.9	28,638	
長府製作所	9.1	7	20,930	
リンナイ	13.2	12.2	116,754	
ダイニチ工業	4.4	3.4	2,733	
日東精工	13	10	3,550	
三洋工業	14	9	1,980	
岡部	16.7	13	13,195	
ジーテクト	—	4.8	6,230	
東ブレ	16.9	12.7	26,720	
高周波熱錬	12.5	11.4	10,294	
サンコール	6	4	2,756	
モリテック スチール	5.3	3.5	1,106	
パイオラックス	4	3.4	19,652	
日本発條	67.6	57.3	83,715	
中央発條	11	9	3,033	
アドバネクス	—	17	3,094	
三益半導体工業	7.2	4.9	6,556	
<b>機械(5.1%)</b>				
日本ドライケミカル	1	0.9	2,091	
日本製鋼所	122	94	54,238	
三浦工業	12.6	29.4	40,131	
タクマ	27	21	17,304	
ツガミ	26	19	14,554	
オークマ	55	43	58,394	
東芝機械	46	36	21,168	
アマダホールディングス	130	98.2	124,910	
アイダエン지니어リング	19.9	14.4	20,851	
滝澤鉄工所	31	21	4,998	
富士機械製造	25.9	21.5	28,208	
牧野フライス製作所	42	33	40,458	
オーエスジー	34.9	30	78,390	
ダイジェット工業	14	10	2,200	
旭ダイヤモンド工業	21.8	18.1	25,340	
DMG森精機	50.2	41.6	102,793	
ソディック	—	13.4	14,485	
ディスコ	9.4	7.7	89,320	
日東工器	5	3.8	9,610	
パンチ工業	1.9	1.8	2,379	
豊和工業	5	3.8	2,945	
大阪機工	33	29	4,959	
東洋機械金属	6.9	4.6	2,576	
津田駒工業	23	16	2,384	
島精機製作所	11.1	9.3	19,883	
日阪製作所	11	8.3	9,237	
やまびこ	3.4	2.6	13,026	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ペガサスマシン製造	9.6	6.6	3,821	
ナブテスコ	38.8	40.1	128,721	
三井海洋開発	7.5	6.6	12,652	
レオン自動機	9	5.2	2,912	
SMC	24.3	19.8	745,470	
新川	7.5	5.5	5,109	
ホソカワミクロン	15	11	6,765	
ユニオンツール	3.7	3.3	12,886	
オイレス工業	8.1	7.8	17,136	
日精エー・エス・ビー機械	2.9	2.3	5,423	
サトーホールディングス	9.3	8.2	26,363	
日本エアテック	3.6	2.6	1,630	
日精樹脂工業	6.2	4.9	5,360	
ワイエイシイ	4.3	2.7	2,473	
小松製作所	396	323	847,390	
住友重機械工業	232	180	147,420	
日立建機	43.3	29.4	66,767	
日工	14	9	4,203	
巴工業	3.1	2.5	4,360	
井関農機	87	67	15,745	
TOWA	8	5.4	4,595	
丸山製作所	19	15	3,555	
北川鉄工所	42	31	10,044	
クボタ	441	317	657,458	
荏原実業	2.2	2	2,962	
三菱化工機	29	22	8,976	
月島機械	14	11.6	16,193	
帝国電機製作所	2.9	4.4	4,950	
新東工業	19.9	15.5	18,274	
澁谷工業	7.4	5.5	12,705	
アイチ コーポレーション	12	9.3	6,361	
小森コーポレーション	20.6	16	25,568	
鶴見製作所	6	4.9	9,084	
住友精密工業	15	10	4,870	
酒井重工業	17	13	3,640	
荏原製作所	187	137	82,885	
石井鐵工所	15	11	2,442	
西島製作所	9.1	6.5	6,253	
北越工業	7	5.2	4,841	
ダイキン工業	110.7	91.7	874,909	
オルガノ	13	13	7,397	
トーヨーカネツ	45	38	9,082	
栗田工業	51	37.3	111,377	
椿本チエイン	43	34	37,842	
大同工業	19	15	3,810	
日本コンベヤ	26	21	4,284	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
木村化工機	9.1	6.9	3,636	
アネスト岩田	14.2	9.9	7,712	
ダイフク	34.3	31.1	58,716	
サムコ	1.3	0.9	1,067	
加藤製作所	20	14	10,878	
油研工業	18	14	3,766	
タダノ	36	30	50,100	
フジテック	23.7	18.4	26,680	
CKD	22.9	17.7	23,151	
キトー	5	6.9	8,894	
平和	17.9	13.7	33,003	
理想科学工業	6.3	7.7	18,949	
SANKYO	24.6	17.5	80,500	
日本金銭機械	7.5	5.8	10,016	
マースエンジニアリング	4.6	3.6	7,948	
福島工業	4.6	3.5	7,644	
オーイズミ	3.3	2.7	2,278	
ダイコク電機	3.4	2.6	4,591	
竹内製作所	—	2.7	18,036	
アマノ	23.2	21	35,658	
JUKI	—	47	17,907	
サンデンホールディングス	47	39	23,166	
マックス	13	10	13,030	
グローリー	24.2	20.1	78,792	
新晃工業	5.9	4.4	5,231	
大和冷機工業	13	9.1	7,507	
セガサミーホールディングス	87.2	67.7	121,589	
日本ピストンリング	32	26	6,448	
リケン	33	27	13,365	
TPR	9.3	7	25,550	
ホシザキ電機	17.8	13.8	105,846	
大豊工業	6.2	5.2	8,777	
日本精工	180	129.3	265,194	
NTN	189	146	107,456	
ジェイテクト	86.2	67.1	152,920	
不二越	76	59	41,713	
日本トムソン	26	22	16,016	
THK	50.6	41.9	125,658	
ユーション精機	3.6	2.8	7,772	
前澤給装工業	3.3	2.4	3,885	
イーグル工業	10.2	8.8	24,208	
前澤工業	7.9	5.8	2,470	
日本ビラー工業	9.2	6.9	7,769	
キッツ	36.9	28.3	17,008	
日立工機	21.8	16.9	18,302	
マキタ	52.9	41.1	278,658	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
日立造船	65.2	49.2	34,243	
三菱重工業	1,444	1,055	832,395	
IHI	584	454	272,400	
電気機器 (13.1%)				
イビデン	49.4	41.3	96,063	
コニカミノルタ	214.2	150.1	235,356	
ブラザー工業	104.8	81.4	158,730	
ミネベア	111	94	216,200	
日立製作所	1,951	1,512	1,285,200	
東芝	1,600	1,325	577,302	
三菱電機	811	630	1,074,150	
富士電機	226	175	103,775	
東洋電機製造	17	12	5,592	
安川電機	89	76.8	134,400	
シンフォニアテクノロジー	49	44	11,000	
明電舎	75	58	26,680	
オリジン電気	12	9	4,005	
山洋電気	16	14	14,392	
デンヨー	8	5.4	10,724	
東芝テック	51	45	29,745	
芝浦メカトロニクス	16	10	2,970	
マブチモーター	11.4	18	135,900	
日本電産	87.7	69	626,865	
東光高岳	4.8	3.2	5,273	
ダイヘン	48	34	21,828	
田淵電機	—	5.5	6,836	
ヤーマン	1.1	0.8	1,262	
JVCケンウッド	57.7	46.3	16,714	
ミマキエンジニアリング	—	3.8	3,743	
第一精工	3.4	2.3	5,181	
日新電機	16	14.8	12,520	
大崎電気工業	13	11	8,074	
オムロン	91.5	68	393,720	
日東工業	11.9	10.1	29,189	
IDEC	10.6	7.5	8,040	
不二電機工業	—	0.6	898	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	156	121	66,187	
サクサホールディングス	21	16	3,936	
メルコホールディングス	3.9	3.5	8,522	
テクノメディカ	1.8	1.4	3,994	
日本電気	1,115	815	332,520	
富士通	782	607	423,079	
沖電気工業	313	222	57,276	
岩崎通信機	38	28	2,604	
電気興業	23	18	10,530	
サンケン電気	44	32	28,800	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
ナカヨ	8	6		2,208
アイホン	4.7	3.6		7,354
ルネサスエレクトロニクス	42	32.6		32,241
セイコーエプソン	55.4	85.9		197,484
ワコム	63.9	49.6		23,956
アルバック	14.9	10.6		22,684
アクセル	4.1	2.9		4,732
E I Z O	7.5	5.8		16,936
ジャパンディスプレイ	136.3	129.4		67,676
日本信号	22.4	17.4		23,733
京三製作所	19	15		5,760
能美防災	11	8.3		12,474
ホーチキ	6	4.6		3,997
エレコム	3	2		6,470
日本無線	21	13		5,629
パナソニック	926.4	767.3	1,404,926	
シャープ	585	532		92,568
アンリツ	47.2	37.8		33,339
富士通ゼネラル	19	19		32,452
日立国際電気	16	16		29,520
ソニー	447.2	411.6	1,589,599	
TDK	48.9	38		378,480
帝国通信工業	19	15		3,375
ミツミ電機	30.9	22.3		19,534
タムラ製作所	31	24		12,624
アルプス電気	59.4	49.7		158,543
池上通信機	—	21		3,780
パイオニア	112.7	94.6		20,717
日本電波工業	7.8	5.7		5,215
鈴木	—	0.8		1,166
日本トリム	1.8	1.5		5,152
ローランド ディー、ジー	3.7	2.5		7,887
フォスター電機	8.3	6.7		20,602
クラリオン	50	33		12,210
SMK	24	19		10,469
ヨコオ	6.9	4.9		3,547
東光	19	15		5,475
ホシデン	23.9	19.1		17,304
ヒロセ電機	14.1	10.7		189,818
日本航空電子工業	21	18		61,380
TOA	8.7	6.8		8,704
日立マクセル	14.1	12.5		24,675
古野電気	10.5	7.5		7,290
ユニデン	26	17		3,876
アルパイン	17.6	15		39,870
スミダコーポレーション	7.2	5.7		4,947

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
アイコム	4.5	3.5		10,727
リオン	2.5	1.9		3,209
船井電機	8.2	6.4		9,696
横河電機	87.9	63		92,799
新電元工業	26	24		16,488
アズビル	24.6	20.6		69,731
東亜ディーケーケー	3.1	2.7		1,719
日本光電工業	17.3	26.9		80,969
チノー	15	2.2		2,686
共和電業	10	7.7		3,911
日本電子材料	3.6	2.7		2,103
堀場製作所	15	11.6		57,594
アドバンテスト	55.3	42.9		63,706
小野測器	8	3.1		3,251
エスベック	8.4	7		9,814
パナソニック デバイスSUNX	7.2	5.6		4,883
キーエンス	18.4	14.3		959,530
日置電機	4.3	3.3		8,085
シスメックス	67.9	48.8		351,848
メガチップス	7.3	6.6		10,494
OBARA GROUP	5.3	4.1		32,923
日本電産コバル電子	8.4	—		—
澤藤電機	6	4		980
コーセル	11.8	9.2		13,781
新日本無線	6	5		3,555
オプテックス	5.1	4.3		11,326
千代田インテグレ	3.6	2.8		9,100
レーザーテック	8.3	6.5		11,401
スタンレー電気	58.4	45.2		134,244
岩崎電気	31	22		6,688
ウシオ電機	49.2	38.2		69,982
岡谷電機産業	4.4	3.4		1,434
ヘリオス テクノ ホールディング	7	5.9		2,478
日本セラミック	4.7	3.6		6,408
遠藤照明	4.5	2.9		4,097
日本デジタル研究所	6	5.3		9,333
古河電池	6	5		4,275
双信電機	4	3.1		1,274
山一電機	—	7.3		8,869
図研	5.3	4.6		5,520
日本電子	32	27		16,308
カシオ計算機	84.3	63.1		148,221
ファナック	90.5	65.6		1,806,624
日本シイエムケイ	19.2	16.1		5,168
エンプラス	3.1	2.9		15,399
大真空	16	12		3,720

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
ローム	42.8	31	273,110	
浜松ホトニクス	33.7	49.1	188,298	
三井ハイテック	10.7	8.3	7,926	
新光電気工業	27.3	23.8	24,061	
京セラ	142.6	103.4	700,535	
太陽誘電	39.5	33	61,479	
村田製作所	85.1	66.1	1,337,533	
ユーシン	11.9	8.8	7,268	
双葉電子工業	15	10.8	26,233	
北陸電気工業	33	27	4,968	
ニチコン	25.6	19.9	20,934	
日本ケミコン	58	51	20,247	
KOA	10.2	8.7	11,014	
市光工業	22	15	4,185	
小糸製作所	44.5	37.7	184,353	
ミツバ	15.2	11.6	40,426	
スター精密	15.4	12	24,948	
SCREENホールディングス	77	60	57,420	
キャノン電子	7.5	5.8	14,720	
キャノン	470.1	365	1,566,580	
リコー	243.8	189.3	246,090	
MUTOHホールディングス	11	9	3,600	
東京エレクトロン	72.8	53	421,191	
<b>輸送用機器 (11.6%)</b>				
トヨタ紡織	28.3	22.5	44,460	
鬼怒川ゴム工業	15	14	9,184	
ユニプレス	13.1	12.1	33,456	
豊田自動織機	73.8	57.5	431,250	
モリタホールディングス	14	11	12,859	
三櫻工業	10.3	8.1	6,925	
デンソー	200.3	155.7	1,013,762	
東海理化電機製作所	21.4	16.7	53,607	
三井造船	314	244	54,656	
佐世保重工業	57	—	—	
川崎重工業	631	457	286,996	
名村造船所	15.8	17.9	17,810	
サノヤスホールディングス	9.8	11.3	3,186	
日本車輛製造	30	23	8,073	
ニチユ三菱フォークリフト	9	7.3	4,620	
近畿車輛	14	9	3,240	
日産自動車	1,138.1	883.8	1,149,381	
いすゞ自動車	470	199	336,608	
トヨタ自動車	1,128.5	868.7	7,474,294	
日野自動車	101.3	89.9	152,020	
三菱自動車工業	290.1	230.8	267,035	
エフテック	3.4	3.7	4,798	
レシップホールディングス	2.7	2.1	1,753	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
GMB	—	1	0.9	1,141
ファルテック	—	—	0.7	1,116
武蔵精密工業	8.6	6.7	17,460	
日産車体	39.6	27.7	48,198	
新明和工業	33	25	31,550	
極東開発工業	14	11.7	16,532	
日信工業	16.5	11.5	24,219	
トピー工業	67	54	17,928	
ティラド	32	24	6,120	
曙ブレーキ工業	37.7	28.3	11,970	
タチエス	11.9	10	18,250	
NOK	39.2	30.6	126,072	
フタバ産業	24.7	20.9	12,372	
カヤバ工業	76	71	32,589	
シロキ工業	18	14	5,796	
大同メタル工業	11	9	11,340	
プレス工業	32	32.1	17,783	
ミクニ	—	—	7.6	4,430
カルソニックカンセイ	55	49	45,815	
太平洋工業	16.5	12.9	15,002	
ケーヒン	18.6	14.5	30,203	
河西工業	11	7.9	9,519	
アイシン精機	74.2	57.8	331,772	
富士機工	9	7.4	5,039	
マツダ	1,208	187.6	501,830	
ダイハツ工業	86	75.1	136,381	
今仙電機製作所	6	5.3	7,441	
本田技研工業	729.7	566.6	2,414,282	
スズキ	169.5	131.6	570,420	
富士重工業	275.9	214.3	1,006,781	
安永	—	—	2.1	1,239
ヤマハ発動機	123.3	95.8	298,417	
ショーワ	19.1	14.9	19,459	
TBK	9	8.1	4,560	
エクセディ	9.8	8.6	27,864	
豊田合成	26.2	20.4	63,036	
愛三工業	9.8	10.1	11,705	
盟和産業	—	—	5	775
ヨロズ	5.9	5.9	15,534	
エフ・シー・シー	13.3	9.3	18,646	
シマノ	35	27.2	480,624	
タカタ	14.7	—	—	
テイ・エス テック	17.1	13.4	48,106	
ジャムコ	—	—	2.6	9,984
<b>精密機器 (1.3%)</b>				
テルモ	124.3	96.5	272,709	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
クリエートメディック	2.7	2.1	2,198	
日機装	26.3	20.4	24,112	
島津製作所	104	75	123,900	
JMS	15	12	3,588	
ショットモリテックス	1.8	1.4	359	
長野計器	5.2	4	3,512	
ブイ・テクノロジー	1.7	1.3	5,317	
東京計器	28	22	6,116	
愛知時計電機	11	8	2,728	
オーバル	—	4.8	1,468	
東京精密	14.6	11.3	32,668	
マニー	2.2	1.8	14,346	
ニコン	151.4	117.6	181,456	
トプコン	21.8	19	54,986	
オリンパス	120.8	93.8	398,181	
理研計器	7.2	5.6	7,806	
タムロン	6.2	4.8	13,641	
HOYA	197.1	149.8	688,405	
ノーリツ鋼機	7.3	5.7	4,109	
エー・アンド・デイ	7.4	5.7	2,986	
シチズンホールディングス	99.8	77.5	70,215	
リズム時計工業	37	28	4,564	
大研医器	2.8	4.5	6,187	
松風	4	3.1	3,921	
セイコーホールディングス	52	45	30,780	
ニプロ	43.2	40.2	48,079	
<b>その他製品(1.5%)</b>				
パラマウントベッドホールディングス	7.8	6.6	22,407	
トランザクション	—	0.5	598	
SHO-BI	2.7	2.1	863	
前田工繊	7.8	6.4	6,649	
永大産業	11	9	4,230	
アートネイチャー	2.7	4.5	4,909	
ダンロップスポーツ	4.4	4	4,960	
バンダイナムコホールディングス	89.4	69.4	177,247	
共立印刷	15	11.4	3,488	
フランスベッドホールディングス	51	44	8,096	
パイロットコーポレーション	7.2	5.5	45,210	
萩原工業	—	1.3	2,788	
トッパン・フォームズ	14.5	11.2	18,132	
フジシールインターナショナル	9.9	7.6	26,562	
タカラトミー	26.8	22.6	15,503	
廣済堂	7.5	5.8	4,065	
As-um e エステール	—	1.7	1,361	
アーク	—	19.9	2,646	
タカノ	4.3	2.8	2,220	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
プロネクス	8.5	6.4	4,876	
ホクシン	8.8	5	665	
ウッドワン	14	11	3,278	
大建工業	34	26	8,112	
凸版印刷	229	178	187,434	
大日本印刷	247	192	252,288	
図書印刷	15	10	4,190	
共同印刷	26	19	7,106	
日本写真印刷	13.7	10.6	23,903	
光村印刷	8	6	1,602	
宝印刷	4.8	3.3	3,960	
アシックス	80.6	62.5	206,875	
ツツミ	4.1	3.1	8,928	
ローランド	7.8	—	—	
小松ウオール工業	2.8	1.9	4,761	
ヤマハ	59.6	46.3	117,139	
河合楽器製作所	29	2.2	5,902	
クリナップ	8.8	5.7	5,033	
ビジョン	13.3	35.7	116,382	
兼松日産農林	13	8	1,384	
キングジム	6.8	5.2	4,846	
リントック	19.3	15	42,735	
TASAKI	—	1.2	3,834	
イトーキ	17.6	13.3	9,602	
任天堂	49.9	38.8	819,456	
三菱鉛筆	6.8	5.2	28,236	
タカラスタンダード	34	26	23,790	
コクヨ	42.2	32.7	35,512	
ナカバヤシ	17	13	2,951	
グローブライド	43	30	5,430	
岡村製作所	31	24.2	26,184	
美津濃	40	34	21,794	
アデランス	10.2	7.3	8,044	
<b>電気・ガス業(2.1%)</b>				
東京電力	687.8	534.1	378,676	
中部電力	267.2	192.6	361,702	
関西電力	330.9	256.9	354,650	
中国電力	112.1	87	163,908	
北陸電力	79.4	61.7	116,427	
東北電力	202.6	157.3	274,173	
四国電力	73	56.7	104,384	
九州電力	179.1	139	201,967	
北海道電力	75.9	58.9	74,272	
沖縄電力	5.3	6.15	19,741	
電源開発	50.3	45.6	196,992	
東京瓦斯	951	765	526,396	

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
大阪瓦斯	839	652	324,826			
東邦瓦斯	206	160	124,160			
北海道瓦斯	16	13	3,692			
広島ガス	—	10	4,840			
西部瓦斯	91	71	20,022			
静岡ガス	21.1	17.9	15,036			
メタウォーター	—	3	9,375			
<b>陸運業(3.9%)</b>						
SBSホールディングス	5.1	4.8	4,886			
東武鉄道	460	336	184,128			
相鉄ホールディングス	139	108	61,884			
東京急行電鉄	477	342	279,072			
京浜急行電鉄	208	173	165,561			
小田急電鉄	260	202	238,158			
京王電鉄	227	176	161,568			
京成電鉄	122	94	135,078			
富士急行	22	17	19,159			
新京成電鉄	10	8	3,368			
東日本旅客鉄道	149.2	115.4	1,311,521			
西日本旅客鉄道	73.2	60.6	447,834			
東海旅客鉄道	72.6	56.4	1,219,650			
西武ホールディングス	64.6	50.2	140,610			
鴻池運輸	5.7	7.8	12,051			
西日本鉄道	105	81	43,173			
ハマキョウレックス	2.3	2	9,630			
サカイ引越センター	1.3	1.1	4,708			
近鉄グループホールディングス	816	634	263,744			
阪急阪神ホールディングス	544	423	315,981			
南海電気鉄道	169	141	79,524			
京阪電気鉄道	171	141	100,392			
神戸電鉄	20	15	5,475			
名糖運輸	3.3	2.6	1,981			
名古屋鉄道	285	229	107,859			
山陽電気鉄道	30	23	10,902			
日本通運	321	244	167,628			
ヤマトホールディングス	148.8	110.7	281,676			
山九	99	76	50,388			
丸運	5.1	3.4	962			
丸全昭和運輸	27	21	9,387			
センコー	32	27	20,844			
トナミホールディングス	17	13	5,460			
日本梱包運輸倉庫	24.8	20.6	47,112			
日本石油輸送	9	7	1,771			
福山通運	49	38	28,120			
セイノーホールディングス	58	48.7	74,754			
神奈川中央交通	10	7	4,123			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
日立物流	16.9	13.1	27,379			
丸和運輸機関	—	0.6	1,908			
<b>海運業(0.3%)</b>						
日本郵船	687	533	200,408			
商船三井	457	331	141,337			
川崎汽船	360	277	87,255			
NSユナイテッド海運	43	33	8,910			
乾汽船	13.4	—	—			
飯野海運	36.1	34	20,434			
共栄タンカー	16	11	2,486			
<b>空運業(0.6%)</b>						
日本航空	68.5	120.5	515,137			
ANAホールディングス	1,594	1,237	423,425			
スカイマーク	23	—	—			
パスコ	7	6	2,130			
<b>倉庫・運輸関連業(0.2%)</b>						
トランコム	2.3	1.8	10,458			
日新	31	24	8,208			
三菱倉庫	53	41	72,365			
三井倉庫ホールディングス	41	36	14,472			
住友倉庫	54	46	32,154			
澁澤倉庫	19	16	5,616			
東陽倉庫	14	11	3,245			
乾汽船	—	4.2	4,095			
日本トランスシティ	17	14	5,950			
ケイヒン	15	12	2,364			
中央倉庫	4.7	3.6	3,520			
安田倉庫	6.3	4.9	4,988			
東洋埠頭	23	20	4,160			
宇徳	6.6	5.1	2,769			
上組	97	75	86,700			
サンリツ	2	1.5	859			
キムラユニティ	1.8	1.6	1,771			
キューソー流通システム	2.6	1.7	2,932			
郵船ロジスティクス	7.4	5.8	9,077			
近鉄エクスプレス	7.3	5.6	35,448			
東海運	4.4	3.4	982			
エーアイティ	3	2.9	3,395			
内外トランスライン	—	0.7	1,731			
<b>情報・通信業(6.6%)</b>						
NECネットエスアイ	8.8	7.8	20,701			
システナ	7.8	6.1	5,898			
デジタルアーツ	2.8	3.3	4,306			
新日鉄住金ソリューションズ	6.7	5.2	20,930			
キューブシステム	1.7	2.7	1,755			
コア	3	2.6	2,293			

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ソフトクリエイトホールディングス	2.6	2	1,886	
I Tホールディングス	28.7	20.6	50,181	
ネオス	1.7	1.7	1,166	
電算システム	2.5	2.2	3,517	
グリー	48.2	37.6	29,252	
コーエーテックモホールディングス	15.8	14	30,058	
三菱総合研究所	3.1	2.4	7,008	
ボルテージ	1.4	1.1	2,077	
電算	0.7	0.7	1,611	
A G S	1.7	1	1,049	
ファインデックス	—	2.7	4,425	
ヒト・コミュニケーションズ	1.1	0.7	1,392	
ブレインパッド	0.8	0.7	781	
K L a b	5.6	6.6	9,662	
ポルトウウィン・ビット クルーホールディングス	4.8	4.1	4,145	
イーブクイニシアティブジャパン	1.5	1.4	1,457	
ネクソン	66.4	59.1	98,874	
アイスタイル	2.6	2.3	1,750	
エムアップ	1.9	1.7	1,319	
エイチーム	1	1.6	4,094	
e n i s h	1.5	1.6	2,556	
コロブラ	13.9	17.1	43,964	
モバイルクリエイト	0.9	3	2,319	
オルトプラス	1.4	1.2	1,110	
ブロードリーフ	10.5	5.1	8,562	
ハーツユナイテッドグループ	1.8	1.9	3,644	
ドワンゴ	9.2	—	—	
ベリサーブ	0.5	0.7	849	
ティーガイア	8	6.2	10,707	
豆蔵ホールディングス	6.2	4.9	3,150	
テクマトリックス	3.4	2.7	2,227	
GMOペイメントゲートウェイ	3.5	5.4	16,632	
ザッパラス	4.4	3.5	2,068	
インターネットイニシアティブ	11.8	10	20,520	
GMOクラウド	—	1.1	994	
ビットアイル	9	7	3,591	
S R Aホールディングス	3.8	3.3	6,213	
システムインテグレータ	0.8	—	—	
パイプドビッツ	—	0.6	1,121	
朝日ネット	7.4	6.4	3,308	
コムチュア	0.9	1	2,023	
g u m i	—	4.8	7,156	
パソニック インフォメーションシステムズ	1.6	1.5	6,817	
フェイス	2.4	1.9	3,028	
ハイマックス	—	0.8	892	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
野村総合研究所	45.3	35.2	168,080	
サイバネットシステム	6.5	5.1	2,351	
C Eホールディングス	—	0.7	875	
インテージホールディングス	4.3	3.5	6,377	
東邦システムサイエンス	1.3	1.8	1,114	
ソースネクスト	4	3.1	2,241	
ティー・ワイ・オー	7.7	6.3	1,297	
クレスコ	1.8	1.4	2,675	
フジ・メディア・ホールディングス	77.4	64.7	109,537	
オービック	27.6	21.4	108,926	
ジャストシステム	10.9	8.7	7,160	
TDCソフトウェアエンジニアリング	1.7	1.4	1,729	
ヤフー	573.5	445.3	247,586	
トレンドマイクロ	35.3	32.9	143,773	
インフォメーション・ディベロPMENT	—	1.2	1,117	
日本オラクル	12.8	10	53,700	
アルファシステムズ	2.6	2	3,514	
フューチャーアーキテクト	9.6	6.5	4,777	
C A C H o l d i n g s	4.9	4.2	4,620	
ソフトバンク・テクノロジー	1.9	1.7	2,369	
トーセ	2	1.6	1,350	
オービックビジネスコンサルタント	4.1	3.9	17,355	
伊藤忠テクノソリューションズ	9.1	14.1	41,425	
アイティフォー	8.9	7.5	3,457	
東計電算	1.4	1.1	2,095	
エックスネット	0.7	0.6	924	
大塚商会	7.2	16.7	100,868	
サイボウズ	12	8.3	2,855	
ソフトブレイン	10.9	8.5	1,589	
アグレックス	1.9	—	—	
電通国際情報サービス	4.9	3.8	4,932	
E Mシステムズ	1.1	0.7	1,566	
ウェザーニューズ	2.4	1.9	6,726	
C I J	7.4	5.6	3,270	
東洋ビジネスエンジニアリング	0.8	0.6	882	
日本エンタープライズ	5	4.2	1,432	
WOWOW	2.5	3	10,785	
フュージョンパートナー	—	2.7	2,049	
日本コロムビア	4	2.1	848	
イマジカ・ロボット ホールディングス	4.2	3.3	2,046	
ネットワンシステムズ	31.4	25.2	23,335	
アルゴグラフィックス	3	2.6	4,695	
マーベラス	12.1	10.5	16,779	
エイバックス・グループ・ホールディングス	14.7	12.3	28,548	
日本ユニシス	19.3	17.2	20,227	
兼松エレクトロニクス	5	3.9	7,893	

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
東京放送ホールディングス	43.2	37.2	61,119
日本テレビホールディングス	79.7	56.7	120,657
朝日放送	—	6.1	6,118
テレビ朝日ホールディングス	20.3	17	36,040
スカパーJ SATホールディングス	60.7	47.2	32,473
テレビ東京ホールディングス	6.5	5.1	10,261
日本BS放送	—	1	1,055
コネクシオ	7	4.4	5,539
クロップス	0.5	0.6	311
日本電信電話	314.4	243.2	2,108,300
KDDI	248.4	631.3	1,774,584
光通信	7.2	5.6	49,000
NTTドコモ	659.4	479.2	1,071,491
エムティーアイ	—	7.9	6,288
GMOインターネット	26.7	20.7	30,056
KADOKAWA・DWANGO	—	15.2	26,797
学研ホールディングス	27	21	5,313
ゼンリン	10.6	8.2	13,308
昭文社	4.8	3.7	3,152
KADOKAWA	8.1	—	—
インプレスホールディングス	5.6	4.4	963
アイネット	3.3	3.2	3,241
松竹	53	41	42,968
東宝	57.1	44.3	138,880
東映	33	23	21,068
AOI Pro.	3.7	2.9	2,746
エヌ・ティ・ティ・データ	56.5	38.4	212,352
ビー・シー・エー	—	0.8	1,304
DTS	7.6	6.4	17,036
スクウェア・エニックス・ホールディングス	29.1	23.9	64,936
シーイーシー	4.7	4	3,952
カプコン	20.5	15.9	38,271
アイ・エス・ビー	—	0.7	638
ジャストテック	5.1	3.6	3,499
SCSK	19	14.8	49,950
日本システムウエア	3	2.3	2,171
アイネス	10.9	8.4	10,080
TKC	6.7	5.3	16,059
富士ソフト	10.2	8.6	21,861
NSD	17	14.5	23,591
コナミ	36.1	25.2	58,590
福井コンピュータホールディングス	1.1	1.7	1,213
JBCホールディングス	6.7	5.2	4,227
ミロク情報サービス	5.3	4.1	2,952
ソフトバンク	393	328.6	2,447,084
卸売業(4.2%)			
ハウスイ	7	5	725

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
高千穂交易	3.4	2.4	2,608
伊藤忠食品	2	1.5	6,562
エレマテック	3.8	2.9	8,859
JALUX	2.3	1.8	4,323
あらた	18	14	5,152
トーマンデバイス	1.2	0.9	1,878
東京エレクトロン デバイス	1.6	1.3	2,256
フィールズ	—	4.1	8,573
双日	535.6	415.9	128,929
アルフレッサ ホールディングス	23.7	73.5	140,017
横浜冷凍	19.9	15.4	13,167
山下医科器械	0.7	0.5	980
ラサ商事	3.5	3	1,884
アルコニックス	2.4	3.5	7,045
神戸物産	1.1	2	10,880
あい ホールディングス	12.8	10	21,030
ディーブイエックス	—	1.8	2,017
ダイワボウホールディングス	73	57	13,623
マクニカ・富士エレホールディングス	—	11.2	18,928
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15.1	11.7	10,272
八洲電機	6.3	4.8	2,894
UKCホールディングス	5.2	4	8,932
OCHIホールディングス	—	1.6	2,180
TOKAIホールディングス	39.2	30.4	15,716
三洋貿易	4.8	3.4	5,882
ウイン・パートナーズ	—	2	3,044
ミタチ産業	1.9	1.5	1,194
シップヘルスケアホールディングス	11.5	11.4	28,853
明治電機工業	—	1.8	2,401
デリカフーズ	—	1.1	1,140
スターティア	0.7	0.6	967
富士興産	2.9	2.4	1,389
協栄産業	10	8	1,760
小野建	7	5.4	5,929
佐鳥電機	6.4	4.9	4,027
エコートレーディング	2	1.5	1,038
伯東	4.9	4.3	6,445
コンドーテック	6.6	4.5	3,510
中山福	4.6	3.6	3,250
ナガイレーベン	11.6	9	20,412
三菱食品	8.8	6.8	18,842
松田産業	5.9	4.5	6,948
メディバルホールディングス	80.1	62.2	119,921
アドヴァン	4.1	3.2	5,097
SPK	1.9	1.3	3,105
萩原電気	—	1.7	3,413

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
アズワン	5.2	4.5	19,507	
スズデン	2.9	2	1,818	
尾家産業	2.6	2	1,802	
シモジマ	5.5	3.8	3,990	
ドウシシャ	8.5	8.1	16,524	
小津産業	—	1.2	2,637	
高速	4.8	3.7	3,315	
たけびし	—	2.2	2,376	
黒田電気	12.8	10.8	23,814	
丸文	7.1	5.5	4,790	
ハビネット	4.9	3.8	5,137	
トーマンエレクトロニクス	4	—	—	
橋本総業	—	1.2	1,689	
エクセル	3.7	2.8	4,104	
マルカキカイ	2.6	2	4,218	
ガリバーインターナショナル	27	18.8	19,213	
日本エム・ディ・エム	6.8	5.2	2,808	
進和	4.8	3.7	7,807	
エスケイジャパン	2.1	1.6	379	
ダイトエレクトロン	3.8	2.9	2,401	
シークス	5.1	3.9	14,176	
田中商事	2.5	1.9	1,425	
オーハシテクニカ	4.1	3.8	6,330	
マクニカ	4.1	—	—	
白銅	2.6	2	3,104	
伊藤忠商事	638.4	520.1	873,768	
丸紅	700	543.6	395,740	
高島	15	12	3,360	
長瀬産業	45.3	34.9	58,527	
蝶理	5.1	4	8,028	
豊田通商	89.2	69.2	241,162	
三共生興	13.7	10.6	5,225	
兼松	170	124	27,900	
ツカモトコーポレーション	14	11	1,606	
三井物産	723.6	526.8	919,529	
日本紙バルブ商事	42	32	10,816	
日立ハイテクノロジーズ	24.3	21.5	75,572	
カメイ	10.5	8.1	8,756	
東都水産	14	10	2,050	
OUGホールディングス	12	10	2,460	
スターゼン	29	24	8,616	
山善	30.8	23.9	27,724	
椿本興業	9	7	2,401	
住友商事	472.3	366.7	543,266	
内田洋行	20	15	6,255	
三菱商事	624.4	476.2	1,327,169	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
第一実業	18	15	9,825	
キャノンマーケティングジャパン	22.8	17.7	38,993	
西華産業	26	20	6,620	
佐藤商事	7.2	5.6	4,642	
菱洋エレクトロ	9.3	7.2	10,915	
東京産業	8	6.2	3,162	
ユアサ商事	82	5.4	15,778	
神鋼商事	20	16	4,448	
小林産業	5.4	4.6	1,196	
阪和興業	80	62	34,348	
カナデン	8	5.4	5,205	
菱電商事	12	10	9,240	
フルサト工業	4.4	3.4	6,538	
岩谷産業	89	69	55,890	
すてきなニスグループ	34	27	5,616	
昭光通商	26	22	2,728	
ニチモウ	13	10	2,010	
極東貿易	9	7	2,625	
イワキ	12	9	2,241	
三愛石油	19	16	13,344	
稲畑産業	19.7	14.9	19,355	
G S I クレオス	21	17	2,397	
明和産業	7.5	5	2,260	
ワキタ	15.7	13.2	17,001	
東邦ホールディングス	25.6	21.4	56,046	
サンゲツ	14.2	21.7	40,123	
ミツウロコグループホールディングス	12.9	10	5,980	
シナネン	17	13	6,500	
伊藤忠エネクス	17.7	13.7	13,686	
サンリオ	20.2	17.4	60,639	
サンワテクノス	4.3	4	4,920	
リョーサン	11.9	10.5	33,705	
新光商事	8.8	7.3	9,066	
トーヨー	17	14	7,252	
三信電気	9.6	8.6	10,569	
東陽テクニカ	11.8	9.1	10,783	
モスフードサービス	10.5	8.1	20,703	
加賀電子	7.3	5.6	8,971	
ソーダニッカ	8	6.4	3,641	
立花エレテック	4.9	4.6	6,582	
フォーバル	—	1.2	2,149	
P a l t a c	11.2	10	19,590	
三谷産業	—	6.6	3,359	
ヤマタネ	40	31	6,262	
丸紅建材リース	7	5	1,350	
日鉄住金物産	53	41	18,655	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
トラスコ中山	9.2	7.8	30,186	
オートバックスセブン	28.1	22.9	45,868	
加藤産業	11.5	9.2	25,024	
イノテック	7.4	5.8	2,865	
イエローハット	6.9	5.9	14,708	
富士エレクトロニクス	4.1	—	—	
J Kホールディングス	7.3	6.3	3,717	
日伝	3.6	2.6	8,164	
北沢産業	6.8	5.3	980	
杉本商事	4.3	3.4	5,100	
因幡電機産業	11	9.2	39,100	
バイテック	2.8	2.1	2,822	
ミスミグループ本社	32.1	23.2	120,640	
江守グループホールディングス	3.4	—	—	
アルテック	3.9	4.5	1,125	
タキヒヨー	13	10	4,780	
蔵王産業	—	0.8	1,129	
スズケン	33.1	28.3	114,756	
ジェコス	5.5	4.3	5,693	
ルネサスイーストン	—	3.1	1,925	
<b>小売業(4.4%)</b>				
ローソン	32.8	23.5	203,980	
サンエー	6	4.7	24,064	
キリン堂	2.9	—	—	
ダイユーエイト	1.6	1.4	1,134	
カワチ薬品	5.6	4.8	8,990	
エービーシー・マート	11.4	8.8	63,360	
ハードオフコーポレーション	3.9	3	3,804	
アスクル	8.3	6.5	20,475	
ゲオホールディングス	13.7	11.7	16,567	
アダストリアホールディングス	6.1	5.3	18,815	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	10	8	976	
くらコーポレーション	4.7	3.6	16,974	
キャンドゥ	3.8	3	4,566	
パル	4.7	3.6	15,372	
エディオン	36.7	28.7	26,691	
サーラコーポレーション	6.9	5.4	3,169	
ワッツ	3.2	2.5	2,537	
あみやき亭	1.4	1.1	5,445	
ひらまつ	9.8	8.6	5,968	
ゲンキー	0.8	0.6	6,354	
サッポロドラッグストアー	—	0.6	1,076	
大黒天物産	1.9	1.5	7,140	
ハニーズ	6.3	5.5	5,373	
ファーマライズホールディングス	—	1.2	718	
アルペン	7.1	5.5	10,714	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
クオール	5.9	6.3	7,818	
ジェイアイエヌ	5.4	4.2	20,223	
ビックカメラ	34.7	30.6	37,821	
DCMホールディングス	38.7	30.1	34,253	
MonotaRO	12.4	12.1	54,208	
きちり	—	1.3	912	
アークランドサービス	—	0.7	3,843	
J. フロント リテイリング	189	78.7	172,274	
ドトール・日レスホールディングス	14	10.9	25,920	
マツモトキヨシホールディングス	16.5	13.9	69,778	
ブロンコピリー	1.3	1.1	5,753	
スタートトゥデイ	24.9	19.3	64,655	
トレジャー・ファクトリー	—	1.2	1,783	
物語コーポレーション	2	1.7	6,749	
ココカラファイン	8.3	6.5	22,230	
三越伊勢丹ホールディングス	159.1	123.6	258,076	
ウエルシアホールディングス	3.6	5.3	30,316	
クリエイトSDホールディングス	3.4	2.9	14,964	
丸善CHIホールディングス	7	7.2	2,721	
ミサワ	—	0.7	560	
エー・ピーカンパニー	0.9	0.9	1,665	
チムニー	2.9	1.2	3,738	
ネクステージ	—	0.6	526	
ジョイフル本田	4.4	4.5	22,050	
キリン堂ホールディングス	—	2	2,564	
すかいらーく	—	30.5	52,094	
ユナイテッド・スーパーマー ケット・ホールディングス	—	20.4	21,440	
ブックオフコーポレーション	4.4	3.8	3,412	
あさひ	4.6	4.1	4,407	
日本調剤	1.01	0.8	5,176	
コスモス薬品	4.5	3.1	52,328	
トーエル	4.3	3.3	2,610	
一六堂	1.7	1.5	646	
セブン&アイ・ホールディングス	334.8	259.9	1,340,304	
薬王堂	—	0.9	2,475	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1.3	4.3	10,388	
ツルハホールディングス	15.8	13.3	124,355	
サンマルクホールディングス	2.6	4.5	18,720	
フェリシモ	2.3	1.6	1,809	
トリドール	6.9	6.7	10,157	
クスリのアオキ	3.6	4.9	22,099	
メディカルシステムネットワーク	6.6	5.6	2,872	
総合メディカル	1.9	3	10,125	
はるやま商事	3.3	2.6	1,991	
カッパ・クリエイトホールディングス	11.7	9.7	11,446	

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
ライトオン	6	4.7	4,723			
良品計画	8.5	7.7	162,239			
三城ホールディングス	9.9	7.7	3,619			
アルビス	—	1.4	2,941			
コナカ	9.4	7.3	5,438			
ハウス オブ ローゼ	0.9	0.7	1,022			
G-7ホールディングス	2.4	1.3	1,794			
イオン北海道	6	4.2	2,738			
コジマ	11.8	9.2	3,284			
ヒマラヤ	1.9	1.6	1,675			
コーナン商事	10.5	9.8	13,896			
エコス	2.7	2.4	2,320			
ワタミ	9.5	—	—			
マルシェ	1.9	1.5	1,368			
ドンキホーテホールディングス	27.6	20.1	192,960			
西松屋チェーン	15.8	12.3	14,046			
ゼンショーホールディングス	36.7	32	36,480			
幸楽苑	5	4.1	6,334			
ハークスレイ	2.2	1.9	1,879			
サイゼリヤ	11.9	9.4	23,161			
魚力	—	1.7	3,610			
ポプラ	2.9	1.5	822			
ユナイテッドアローズ	10.5	8.1	32,764			
ハイデイ日高	5.1	4.7	14,217			
京都きもの友禅	5.3	3.7	3,696			
コロナイド	26.5	20.8	38,126			
壺番屋	3.2	2.8	14,308			
トップカルチャー	2.9	2.8	1,467			
P L A N T	2	1.4	2,090			
スギホールディングス	14.4	11.1	67,044			
スクロール	10.4	8.1	2,405			
ヨンドシーホールディングス	6.1	4.7	12,605			
ファミリーマート	27.1	21	109,620			
木曽路	9.8	7.6	15,222			
サトレストランシステムズ	7.5	5.9	5,369			
千趣会	14.4	11.2	9,688			
タカキュー	6.2	4.4	954			
ケーヨー	13.6	12.1	6,933			
上新電機	17	14	13,328			
日本瓦斯	11.9	10	35,550			
ベスト電器	25.8	20	2,960			
マルエツ	16	—	—			
ロイヤルホールディングス	13.4	10.4	22,578			
東天紅	6	5	940			
いなげや	9	7	9,408			
島忠	19.4	16.1	52,325			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
チヨダ	9.4	7.3	20,060			
ライフコーポレーション	6.4	4	9,208			
カスミ	16.4	—	—			
リンガーハット	7.8	6	13,686			
M r M a x	8	7	1,911			
テナアライド	6	5.2	2,012			
A O K Iホールディングス	13.8	14.3	25,296			
オークワ	13	10	10,330			
コメリ	12.3	10.6	30,485			
青山商事	20.1	15.6	74,022			
しまむら	9.3	7.2	96,408			
C F Sコーポレーション	6	4.2	4,750			
はせがわ	2.8	2.2	1,166			
高島屋	108	90	107,640			
松屋	17.2	12.6	25,086			
エイチ・ツー・オー リテイリング	47	29.4	67,678			
近鉄百貨店	31	24	8,112			
ニッセンホールディングス	16	13.1	3,484			
パルコ	7.7	6	6,984			
丸井グループ	104.4	65.5	102,835			
アクシアル リテイリング	4.4	4.8	14,928			
ダイエー	49.4	—	—			
イズミヤ	32	—	—			
イオン	319.7	256.4	425,880			
ユニグループ・ホールディングス	76.7	60	41,820			
イズミ	17.9	13.9	68,666			
東武ストア	11	8	2,544			
平和堂	16.3	12.6	34,977			
フジ	8.9	7	16,604			
ヤオコー	4	7.1	35,322			
ゼビオ	9.7	8.4	20,571			
ケーズホールディングス	16.9	14.3	66,709			
O l y m p i cグループ	4.7	3.8	3,066			
日産東京販売ホールディングス	12	10.5	3,769			
アインファーマシーズ	4.4	7.5	37,087			
元気寿司	2.5	1.9	4,531			
ヤマダ電機	316.3	245.9	128,605			
アー克蘭ドサカモト	5.2	4.5	13,113			
ニトリホールディングス	31.7	26.8	256,476			
グルメ杵屋	6	5	4,920			
愛眼	6.4	4.9	1,205			
ケーユーホールディングス	3.4	3.3	2,488			
吉野家ホールディングス	21.7	17.6	25,080			
松屋フーズ	3.8	3	6,990			
サガミチェーン	10	8	9,872			
関西スーパーマーケット	6	4.9	4,037			

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
王将フードサービス	5.3	4.6	19,274
ブレナス	8.9	6.9	15,821
ミニストップ	6	4.6	8,758
アークス	13.7	10.8	28,123
パロー	17.2	13.4	34,143
藤久	0.6	0.5	887
ベルク	3.9	2.8	9,688
大庄	4.3	2.9	4,373
ファーストリテイリング	16	12.4	636,120
サンドラッグ	16.9	13.1	86,198
サクスポー ホールディングス	4	4.7	10,636
ヤマザワ	1.9	1.3	2,237
やまや	1.6	1.1	2,099
ペルーナ	20	15.5	9,207
<b>銀行業(9.8%)</b>			
島根銀行	1.7	1.3	2,121
じもとホールディングス	57.4	44.6	9,856
足利ホールディングス	42	39.1	20,292
東京TYフィナンシャルグループ	—	8	33,240
新生銀行	692	591	148,932
あおぞら銀行	415	419	200,701
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,062.2	4,985.8	4,592,918
りそなホールディングス	760.7	727	518,205
三井住友トラスト・ホールディングス	1,572	1,373	782,472
三井住友フィナンシャルグループ	605.2	469.9	2,664,333
第四銀行	101	79	38,473
北越銀行	86	67	17,286
西日本シティ銀行	281	218	76,300
千葉銀行	309	240	235,440
横浜銀行	520	417	322,591
常陽銀行	298	225	151,425
群馬銀行	179	147	128,184
武蔵野銀行	12.8	9.9	44,649
千葉興業銀行	16.6	12.9	12,319
筑波銀行	33.3	25.8	10,139
東京都民銀行	14.1	—	—
七十七銀行	125	105	73,080
青森銀行	59	49	19,649
秋田銀行	55	41	15,785
山形銀行	49	37	20,128
岩手銀行	5.2	4.3	24,596
東邦銀行	72	56	30,632
東北銀行	41	33	5,643
みちのく銀行	43	31	6,665
ふくおかフィナンシャルグループ	325	252	168,588
静岡銀行	234	182	247,884

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
十六銀行	100	78	36,582
スルガ銀行	78	65.6	173,774
八十二銀行	148	112	105,728
山梨中央銀行	51	38	21,660
大垣共立銀行	100	78	34,944
福井銀行	68	53	14,098
北國銀行	89	69	29,877
清水銀行	2.7	2.1	7,245
滋賀銀行	75	62	41,974
南都銀行	77	60	27,060
百五銀行	72	60	35,400
京都銀行	153	119	169,218
紀陽銀行	31.4	24.4	43,578
三重銀行	33	28	7,700
ほくほくフィナンシャルグループ	544	423	124,362
広島銀行	236	183	134,139
山陰合同銀行	49	38	43,244
中国銀行	57.6	44	84,216
鳥取銀行	25	20	4,700
伊予銀行	85.6	66.5	101,146
百十四銀行	88	68	30,804
四国銀行	58	48	12,576
阿波銀行	65	51	38,760
鹿児島銀行	56	43	37,539
大分銀行	49	38	19,760
宮崎銀行	53	41	19,721
肥後銀行	65	51	40,239
佐賀銀行	49	38	11,666
十八銀行	50	38	14,706
沖縄銀行	5.9	4.9	26,215
琉球銀行	15.5	12.8	24,729
八千代銀行	3.8	—	—
セブン銀行	299.8	209.5	123,186
みずほフィナンシャルグループ	10,384.9	8,664.1	2,379,161
高知銀行	31	24	4,152
山口フィナンシャルグループ	80	62	97,960
長野銀行	26	20	4,200
名古屋銀行	72	56	25,928
北洋銀行	120.6	93.6	48,952
愛知銀行	2.9	2.2	14,190
第三銀行	45	35	6,685
中京銀行	33	26	6,058
東日本銀行	35	27	11,799
大光銀行	28	22	5,654
愛媛銀行	47	37	9,583
トマト銀行	31	24	4,968

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
みなと銀行	72	56	16,856	
京葉銀行	66	51	34,629	
関西アーバン銀行	111	8.7	11,919	
栃木銀行	40	31	20,863	
北日本銀行	2.5	1.9	6,878	
東和銀行	97	87	10,005	
福島銀行	98	76	7,372	
大東銀行	51	40	7,080	
トモニホールディングス	61.4	47.7	26,855	
フィデアホールディングス	46.1	36.6	10,101	
池田泉州ホールディングス	60	59.2	33,211	
<b>証券、商品先物取引業(1.4%)</b>				
F P G	7.4	16.5	15,526	
S B I ホールディングス	97.3	74.7	133,264	
ジャフコ	11.3	8.6	41,280	
大和証券グループ本社	793	582	574,608	
野村ホールディングス	1,637	1,271	1,046,795	
岡三証券グループ	63	53	48,230	
丸三証券	23.8	19.8	24,156	
東洋証券	33	24	9,504	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	84.8	71.3	64,597	
光世証券	—	15	3,540	
水戸証券	25.7	20	9,000	
いちよし証券	15.7	13.1	15,785	
松井証券	40.7	31.6	34,633	
だいこう証券ビジネス	5.5	3.3	3,306	
マネックスグループ	87	73.2	26,937	
カブドットコム証券	31.4	27.6	23,791	
極東証券	10	8.5	15,580	
岩井コスモホールディングス	8.3	6.4	10,336	
藍澤証券	—	8.7	7,386	
マネースクウェアHD	2.7	2.1	2,988	
マネーパートナーズグループ	10.3	6.9	2,691	
<b>保険業(2.7%)</b>				
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	177.8	138	625,140	
アニコム ホールディングス	—	2.7	5,931	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	239.2	198.1	765,656	
ソニーフィナンシャルホールディングス	76.7	59.5	129,472	
第一生命保険	402.8	398.1	869,052	
東京海上ホールディングス	310	251.8	1,295,259	
T&Dホールディングス	274.5	226.5	421,516	
<b>その他金融業(1.3%)</b>				
全国保証	20.8	16.2	67,716	
クレディセゾン	66.6	50.8	124,460	
アクリーティブ	—	4.2	2,511	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
芙蓉総合リース	9.2	6.5	34,190	
興銀リース	15.1	11.7	31,005	
東京センチュリーリース	19.1	14.6	56,794	
日本証券金融	40.1	27.4	20,139	
アイフル	—	104	39,832	
ポケットカード	15.3	4.7	2,411	
リコーリース	6.6	4.9	17,909	
イオンフィナンシャルサービス	47.1	40.8	123,216	
アコム	168.7	124.8	49,920	
ジャックス	55	34	19,958	
オリエントコーポレーション	192.1	143.6	31,161	
日立キャピタル	16.8	12.2	36,417	
アプラスフィナンシャル	68.5	29.8	4,142	
オリックス	500.1	439.9	868,582	
三菱UFJリース	204.6	157.6	103,228	
日本取引所グループ	118.9	91.2	345,192	
イー・ギランティ	4.6	1.8	4,248	
アサックス	1.4	1.1	1,804	
NECキャピタルソリューション	5.1	2.5	4,667	
<b>不動産業(2.9%)</b>				
日本駐車場開発	87.2	67.7	13,878	
ヒューリック	135.1	115.4	148,289	
東京建物不動産販売	4.1	3.3	1,953	
三栄建築設計	3.2	2.5	2,422	
野村不動産ホールディングス	52.9	37.4	95,519	
三重交通グループホールディングス	—	11.1	4,972	
日本商業開発	—	2	3,724	
プレサンスコーポレーション	1.9	2.1	8,337	
常和ホールディングス	2.8	3.4	15,946	
日本管理センター	—	3.1	5,186	
サンセイラディック	—	0.8	653	
エストラスト	—	0.7	438	
フージャースホールディングス	12	9.3	4,956	
オープンハウス	5	4	14,980	
東急不動産ホールディングス	177.5	162.9	152,311	
飯田グループホールディングス	35.1	40.3	81,849	
パーク24	42	31.3	68,640	
パラカ	3	2.2	2,827	
三井不動産	377	329	1,193,118	
三菱地所	560	462	1,283,898	
平和不動産	16.2	11.8	20,296	
東京建物	164	135	130,140	
ダイビル	23.6	16	18,480	
京阪神ビルディング	13.3	10.3	7,364	
住友不動産	192	149	713,710	
大京	135	99	18,216	

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
テーオーシー	27.6	21.4		20,800
東京楽天地	13	10		5,060
レオバレス 2 1	92	68		48,892
スターツコーポレーション	—	7.1		13,766
フジ住宅	10.3	8		5,640
空港施設	9.7	7.6		5,297
明和地所	3.9	3.6		2,091
住友不動産販売	5.8	4.5		14,512
ゴールドクレスト	6.3	5.6		13,260
日本エスリード	3.1	2.4		3,108
日神不動産	10.7	8.3		3,834
タカラレーベン	26.3	27.6		21,252
サンヨーハウジング名古屋	4.5	3.5		4,406
イオンモール	51.6	40.1		91,668
ファースト住建	3	2.3		3,284
トーセイ	11	8.5		7,420
穴吹興産	7	6		1,578
エヌ・ティ・ティ都市開発	49.8	38.6		49,948
サンフロンティア不動産	7.6	6.7		7,142
エフ・ジェー・ネクスト	4.3	4.8		2,755
ランドビジネス	4	3.2		1,305
グランディハウス	6.3	5.5		1,947
日本空港ビルデング	27.7	21.5		155,875
<b>サービス業(3.1%)</b>				
日本工営	28	22		11,022
ネクスト	7.5	15.8		11,976
日本M&Aセンター	13.1	10.2		48,195
ノバレーゼ	2.2	1.9		1,734
アコーディア・ゴルフ	34.5	24.9		28,759
タケエイ	5.9	6.5		7,566
トラスト・テック	1.8	1.2		2,629
パソナグループ	6.3	5.1		4,294
CDS	1.8	1.5		1,533
リンクアンドモチベーション	10.9	9.8		1,636
GCAサヴィアン	5.1	5.2		7,898
エス・エム・エス	4.8	7.4		11,248
テンポホールディングス	18.5	13		57,005
リニカル	2.7	1.8		1,936
クックパッド	4.2	4.2		22,050
エスクリ	3.7	2.6		2,948
アイ・ケイ・ケイ	1.9	3.8		2,428
学情	3.3	2.6		3,226
スタジオアリス	3.5	3.1		6,975
シミックホールディングス	3.4	2.7		4,506
NJS	—	1.5		2,374
総合警備保障	30.8	22		95,920

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
カカクコム	51.4	43.4		83,979
アイロムホールディングス	—	1.7		3,678
ルネサンス	3.8	3.5		4,504
ディップ	2.2	1.5		14,835
オプトホールディング	4.5	3.1		2,185
ツクイ	9.1	8.2		7,560
総合臨床ホールディングス	3.8	3.1		1,537
キャリアデザインセンター	3.1	1.9		2,217
エムスリー	57	56.9		134,625
ツカダ・グローバルホールディング	5	5.1		4,080
アウトソーシング	4.3	2.6		4,557
ウエルネット	—	1.8		4,982
ディー・エヌ・エー	45.6	32.5		86,157
博報堂DYホールディングス	117.4	91.2		122,664
ぐるなび	11.9	7.6		15,777
エスアールジータカミヤ	—	5.7		4,252
一休	6	5.2		12,656
ジャパンベストレスキューシステム	9.3	—		—
ファンコミュニケーションズ	14.7	15.2		15,701
ジェイコムホールディングス	1.7	1.6		1,524
PGMホールディングス	11.9	9.5		12,312
WDBホールディングス	1.2	2.4		2,940
ティア	—	2.1		1,344
バリューコマース	5.8	5.6		3,270
J Pホールディングス	18.9	17		5,729
E P Sホールディングス	10	6.1		8,472
プレステージ・インターナショナル	5.8	5.1		4,590
アミューズ	2.4	2		6,990
ドリームインキュベータ	2.2	2.3		6,329
クイック	—	2.4		2,496
TAC	—	4.6		979
ケネディクス	102.5	94		49,914
電通	79.9	73.3		460,324
テイクアンドギヴ・ニーズ	3.8	2.9		2,276
びあ	2.5	1.9		4,487
イオンファンタジー	2.8	2.2		4,686
ネクシィーズ	3.8	2.5		1,652
みらかホールディングス	22.3	16.8		100,800
アルプス技研	3.4	2.7		6,166
サニックス	12.3	—		—
ダイオーズ	1.5	1.4		1,541
日本空調サービス	4.2	3.3		3,138
オリエンタルランド	22.9	71.1		569,511
ダスキン	22.4	18.6		37,981
明光ネットワークジャパン	8.4	6.7		9,674
ファルコホールディングス	4.3	3.2		4,905

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
秀英予備校	3.1	1.3	439
田谷	1.3	1.1	876
ラウンドワン	25	18.9	11,207
リゾートトラスト	28.6	24.9	78,310
ビー・エム・エル	5.5	3.9	14,820
ワタベウェディング	2.8	2.4	1,159
もしもしホットライン	15.8	12.2	17,995
早稲田アカデミー	1.3	1	857
ユー・エス・エス	102.5	79.6	185,627
東京個別指導学院	5.7	3.3	2,055
サイバーエージェント	—	16.1	92,897
楽天	367.4	286	584,298
テー・オー・ダブリュー	2.8	2	2,122
セントラルスポーツ	2.6	2.3	5,287
フルキャストホールディングス	7.8	6.8	5,052
リゾートソリューション	8	8	2,224
テクノプロ・ホールディングス	—	9.4	28,905
リブセンス	4.8	4	2,388
ジャパンマテリアル	1	2.8	4,972
ベクトル	—	1.1	1,911
ウチヤマホールディングス	—	3.3	1,788
サクセスホールディングス	0.8	0.9	1,075
キャリアリンク	—	0.9	1,658
アサンテ	1.6	1.7	2,648
N・フィールド	—	1.7	3,129
M&Aキャピタルパートナーズ	—	0.2	566
ERIホールディングス	2	1.7	1,711
アピスト	—	0.8	1,157
ウィルグループ	—	0.7	1,122
リクルートホールディングス	—	99.5	387,055
リロ・ホールディング	3.2	2.2	22,022
東祥	2	1.5	3,952
エイチ・アイ・エス	13.8	10.8	41,958
共立メンテナンス	4.2	3.9	26,988
イチネンホールディングス	9.6	7.2	8,618
建設技術研究所	5	4	4,920
スペース	4.1	3.6	4,500
燦ホールディングス	1.7	1.3	2,338
スバル興業	6	5	2,190
東京テアトル	32	25	3,525
よみうりランド	19	14	6,412
東京都競馬	65	45	13,095
カナモト	10.8	9.2	32,338
東京ドーム	65	46	23,920
西尾レントオール	6.8	5.3	17,331
トランス・コスモス	11.1	8.6	25,172

銘柄	当期首(前期末)			
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	
乃村工藝社	16.6	12.9	17,969	
藤田観光	22	24	10,248	
KNT-CTホールディングス	27	32	5,376	
日本管財	3.6	3.2	9,020	
トーカイ	3.7	2.9	12,658	
白洋舎	11	8	2,176	
セコム	88.1	63.8	530,241	
セントラル警備保障	3.7	3	4,185	
丹青社	10.6	7.8	8,143	
メイテック	11.5	8.8	39,952	
アサツー ディ・ケイ	14.9	12.4	39,246	
応用地質	8.1	6.9	11,605	
船井総研ホールディングス	8.7	7.2	9,928	
進学会	3.6	2.9	1,667	
ベネッセホールディングス	28.4	24	78,120	
イオンディライト	8.2	6.4	21,760	
ナック	4.3	4.6	4,659	
ニチイ学館	18.4	13	13,403	
ダイセキ	12.5	10.6	25,037	
ステップ	2.9	2.3	2,309	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	131,324 1,752	104,665 1,837	154,204,742 <97.9%>

(注1)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です。

(注2)合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

### <先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	当期末	
	買建額 (百万円)	売建額 (百万円)
国内 T O P I X	2,840	—

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	154,204,742	97.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,562,252	2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	157,766,994	100.0

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2015年5月29日現在
(A) 資 産	157,766,718,357円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,207,254,400
株 式(評価額)	154,204,742,110
未 収 入 金	84,296,640
未 収 配 当 金	1,270,612,060
未 収 利 息	3,147
差 入 委 託 証 拠 金	△190,000
(B) 負 債	328,048,010
未 払 金	20,654,387
未 払 解 約 金	307,393,623
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	157,438,670,347
元 本	111,550,527,745
次 期 繰 越 損 益 金	45,888,142,602
(D) 受 益 権 総 口 数	111,550,527,745口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,114円

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2014年5月30日 至 2015年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	2,731,489,645円
受 取 配 当 金	2,729,169,906
受 取 利 息	702,195
そ の 他 収 益 金	1,617,544
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	49,188,723,590
売 買 益	49,893,178,765
売 買 損	△704,455,175
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	698,096,960
取 引 益	895,199,260
取 引 損	△197,102,300
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	52,618,310,195
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△853,924,812
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,256,139,395
(G) 解 約 差 損 益 金	△8,132,382,176
(H) 計 (D+E+F+G)	45,888,142,602
次 期 繰 越 損 益 金(H)	45,888,142,602

(注1) (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2) (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3) (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。

## お知らせ

---

一般社団法人投資信託協会「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」の一部改正に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2014年12月27日)

一般社団法人投資信託協会「信用リスク集中回避のための投資制限に係るガイドライン」の制定に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2015年2月11日)

# 外国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第15期（決算日 2015年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運用方針	日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 組入比率	純資産額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
	円	%		%	%	百万円
第11期(2011年5月30日)	17,698	△1.5	291,909	△1.3	98.3	233,417
第12期(2012年5月29日)	17,637	△0.3	290,859	△0.4	98.4	196,358
第13期(2013年5月29日)	23,637	34.0	391,203	34.5	98.7	244,967
第14期(2014年5月29日)	25,092	6.2	414,505	6.0	97.2	222,288
第15期(2015年5月29日)	28,802	14.8	477,014	15.1	98.2	217,598

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 組入比率	債券先物率 比
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(当期首) 2014年 5月29日	円	%		%	%	%
	25,092	—	414,505	—	97.2	1.3
5月末	25,063	△0.1	413,818	△0.2	96.9	1.6
6月末	25,161	0.3	415,582	0.3	97.2	1.7
7月末	25,400	1.2	419,355	1.2	97.5	1.0
8月末	25,809	2.9	426,420	2.9	97.1	1.2
9月末	26,543	5.8	438,138	5.7	96.7	1.9
10月末	26,592	6.0	438,300	5.7	97.8	0.7
11月末	28,845	15.0	475,708	14.8	97.9	0.7
12月末	29,153	16.2	482,546	16.4	96.8	1.6
2015年 1月末	28,281	12.7	467,265	12.7	97.2	1.4
2月末	28,340	12.9	469,431	13.3	97.5	1.2
3月末	28,245	12.6	465,962	12.4	96.7	1.7
4月末	28,233	12.5	467,467	12.8	97.8	0.9
(当期末) 2015年 5月29日	28,802	14.8	477,014	15.1	98.2	0.7

(注1)騰落率は期首比です。

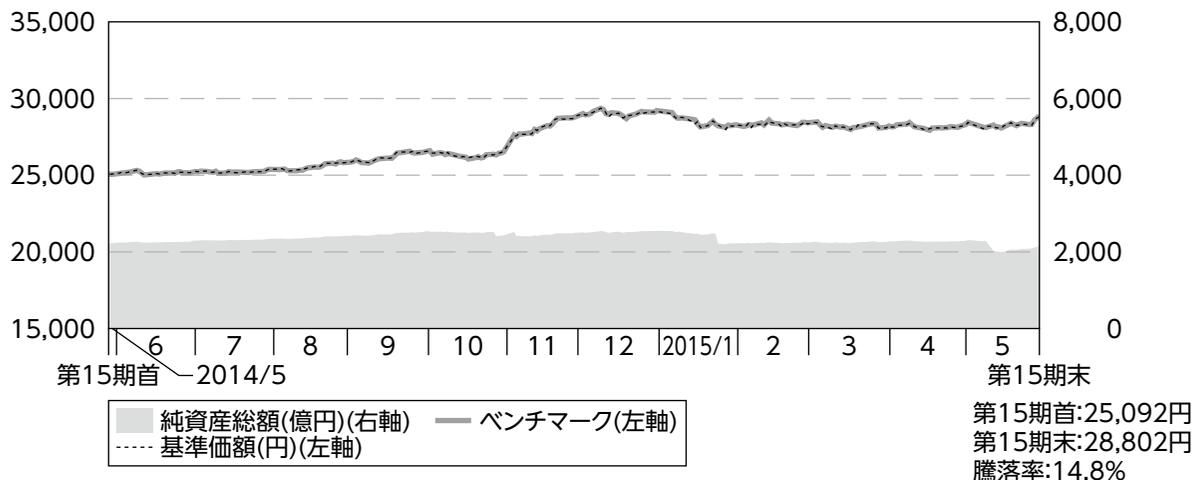
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益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。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

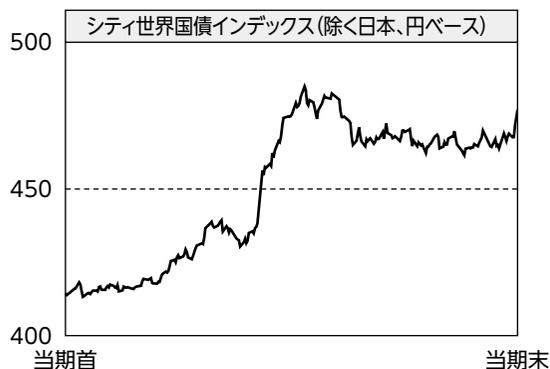


(注)ベンチマークは、2014年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

基準価額は、12月上旬にかけて、ウクライナにおける地政学的リスクの高まりなどを受けて主要国の長期金利が低下(債券価格は上昇)したことや、10月末に日銀が追加金融緩和を実施し、その後に日本政府が消費税増税の先送りを決定したことなどを受けて円安が進行したことから、大幅に上昇しました。1月には、スイス国立銀行による自国通貨の対ユーロでの上限撤廃が外国為替市場の混乱を招き、リスク回避的な円高の動きから下落しました。2月以降は、主要国の長期金利がECB(欧州中央銀行)による量的金融緩和の実施決定などから低下する局面があった一方、ユーロ圏のデフレ懸念後退やFRB(米連邦準備理事会)による利上げ開始時期が意識されたことから上昇(債券価格は下落)する局面もありました。外国為替市場でも、米ドルがFRBの利上げ観測を受けて上昇した一方、ユーロはECBの量的金融緩和やギリシャのデフォルト懸念などを受けて下落するなどまちまちな動きとなり、基準価額は一進一退となりました。

## 投資環境



主要国の長期金利は、ウクライナなどにおける地政学的リスクの高まり、世界的にインフレ率が弱含んだことやECBによる量的金融緩和の実施決定などを受けて、低下推移となりましたが、4月以降期末にかけて、ユーロ圏のデフレ懸念後退の影響やFRBによる利上げ開始時期が意識されたことなどから上昇しました。

外国為替市場では、米ドルがFRBによる利上げ開始時期が意識されたことから上昇しました。一方ユーロは日銀の追加金融緩和を受けて対円で上昇する場面がありました。スイス国立銀行による自国通貨の対ユーロでの上限撤廃による市場混乱、ECBの量的金融緩和やギリシャのデフォルト懸念などを受けて下落しました。

## 当該投資信託のポートフォリオ

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。当期の運用につきましては、インデックスとの連動性を考慮し外国債券の組入比率を高位に維持するとともに適宜ポートフォリオの見直しを行い、投資対象国の拡大と保有債券の残存期間を意識した銘柄分散に努めました。当期末時点では全てのベンチマーク対象国に分散投資を図りました。

当該投資信託の組入資産の内容

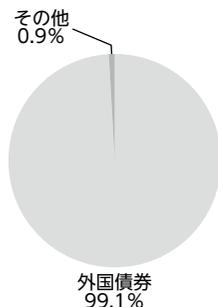
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	T 0.625% 07/15/16	アメリカ	0.8%
2	T 0.625% 11/15/16	アメリカ	0.7%
3	T 0.75% 01/15/17	アメリカ	0.7%
4	T 2.875% 05/15/43	アメリカ	0.6%
5	T 2.75% 02/15/24	アメリカ	0.6%
6	T 0.875% 01/31/17	アメリカ	0.6%

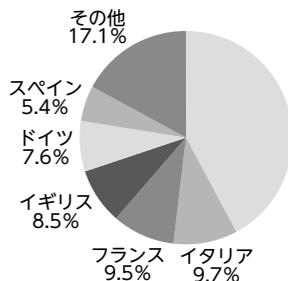
順位	銘柄名	国	組入比率
7	T 0.625% 12/15/16	アメリカ	0.6%
8	T 3% 02/28/17	アメリカ	0.6%
9	T 1.75% 05/31/16	アメリカ	0.6%
10	T 2.75% 12/31/17	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		609	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

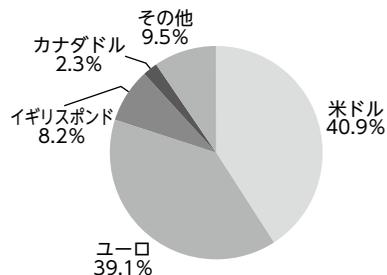
○資産別配分



○国別配分



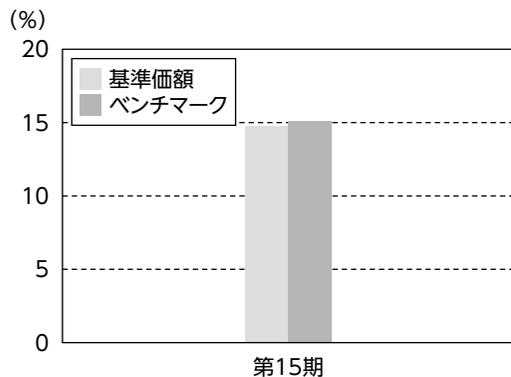
○通貨別配分



(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

## 当該投資信託のベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差要因\*です。

\*当ファンドとベンチマークで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異です。

## 今後の運用方針

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2014年5月30日~2015年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (-) (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.001% (-) (-) (-) (-) (-) (-) (0.001)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	7 (7) (-) (0)	0.026 (0.026) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、証拠金利息の調整金額等
合計	7	0.027	

(注1) 期中の費用(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2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、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(27,138円)で除して100を乗じたものです。

(注4) -印は該当がないことを示します。

## 売買および取引の状況

### <公社債>

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 378,970	千米ドル 471,721
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 23,559	千カナダドル 29,618
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 141,777	千メキシコペソ 157,371
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 44,334	千ユーロ 66,435
	イ タ リ ア	国 債 証 券	55,766	73,693
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	46,459	68,833
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	13,090	18,595
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	34,809	42,589
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	10,854	16,931
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	6,746	10,543
国	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	3,287	5,201
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	4,514	6,166
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 31,621	千イギリスポンド 45,141
	ス イ ス	国 債 証 券	千スイスフラン 1,071	千スイスフラン 3,924
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 23,720	千スウェーデンクローナ 34,213
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 11,334	千ノルウェークローネ 22,658
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 21,870	千デンマーククローネ 40,898
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 20,262	千ポーランドズロチ 26,850
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 15,204	千オーストラリアドル 14,672
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 3,690	千シンガポールドル 4,748
マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 12,437	千マレーシアリンギット 14,764	
南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカランド 40,033	千南アフリカランド 41,879	

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分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		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
外 国	債 券 先 物 取 引	百万円 39,714	百万円 41,297	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	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	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 45,244	百万円 -	% -	百万円 80,736	百万円 90	% 0.1

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

## 組入資産の明細

### <外国(外貨建)公社債>

#### (A) 債券種類別開示

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	千米ドル 705,920	千米ドル 731,434	千円 90,500,389	% 41.6	% —	% 15.8	% 15.5	% 10.3
カ ナ ダ	千カナダドル 44,160	千カナダドル 49,679	4,948,574	2.3	—	1.1	0.8	0.4
メ キ シ コ	千メキシコペソ 259,850	千メキシコペソ 286,887	2,318,050	1.1	—	0.7	0.3	0.1
ド イ ツ	千ユーロ 100,030	千ユーロ 119,726	16,236,112	7.5	—	4.4	2.1	1.0
イ タ リ ア	129,470	153,692	20,842,226	9.6	—	5.8	2.8	1.0
フ ラ ン ス	123,370	149,595	20,286,623	9.3	—	5.7	2.5	1.1
オ ラ ン ダ	33,750	40,018	5,426,965	2.5	—	1.4	0.8	0.3
ス ペ イ ン	71,780	84,221	11,421,212	5.2	—	2.9	1.6	0.8
ベルギー	32,120	40,274	5,461,679	2.5	—	1.8	0.6	0.1
オーストリア	20,480	25,104	3,404,355	1.6	—	1.0	0.4	0.1
フィンランド	8,070	9,262	1,256,032	0.6	—	0.4	0.2	—
アイルランド	10,380	12,287	1,666,328	0.8	—	0.4	0.4	—
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 80,190	千イギリスポンド 95,618	18,126,362	8.3	—	6.1	1.8	0.4
ス イ ス	千スイスフラン 4,050	千スイスフラン 4,931	647,084	0.3	—	0.2	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 63,340	千スウェーデンクローナ 74,336	1,086,792	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 33,990	千ノルウェークローネ 37,404	593,609	0.3	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 64,300	千デンマーククローネ 82,780	1,504,954	0.7	—	0.5	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 34,660	千ポーランドズロチ 37,711	1,234,670	0.6	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 35,680	千オーストラリアドル 39,267	3,723,736	1.7	—	0.9	0.5	0.3
シンガポール	千シンガポールドル 8,320	千シンガポールドル 8,660	796,032	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 33,690	千マレーシアリンギット 33,850	1,150,253	0.5	—	0.3	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 114,450	千南アフリカランド 111,537	1,138,797	0.5	—	0.4	0.1	—
合 計	—	—	213,770,843	98.2	—	50.5	31.4	16.3

(注1) 邦貨換算金額は、当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2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 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) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	当 期 末			
		額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
(アメリカ) 国債証券		千米ドル	千米ドル		
T 0.375% 05/31/16	0.375	1,500	1,501	185,754	2016/5/31
T 0.5% 03/31/17	0.5	1,000	998	123,563	2017/3/31
T 0.5% 07/31/17	0.5	2,000	1,991	246,430	2017/7/31
T 0.625% 07/15/16	0.625	13,300	13,341	1,650,719	2016/7/15
T 0.625% 08/15/16	0.625	7,300	7,321	905,875	2016/8/15
T 0.625% 08/31/17	0.625	7,000	6,985	864,266	2017/8/31
T 0.625% 09/30/17	0.625	1,000	997	123,360	2017/9/30
T 0.625% 10/15/16	0.625	5,500	5,514	682,282	2016/10/15
T 0.625% 11/15/16	0.625	13,000	13,030	1,612,291	2016/11/15
T 0.625% 11/30/17	0.625	5,000	4,976	615,689	2017/11/30
T 0.625% 12/15/16	0.625	10,000	10,020	1,239,885	2016/12/15
T 0.75% 01/15/17	0.75	12,000	12,046	1,490,559	2017/1/15
T 0.75% 02/28/18	0.75	4,400	4,381	542,179	2018/2/28
T 0.75% 04/15/18	0.75	3,000	2,983	369,196	2018/4/15
T 0.75% 06/30/17	0.75	6,000	6,011	743,844	2017/6/30
T 0.75% 12/31/17	0.75	2,900	2,893	358,018	2017/12/31
T 0.875% 01/31/17	0.875	10,000	10,058	1,244,477	2017/1/31
T 0.875% 01/31/18	0.875	5,500	5,501	680,647	2018/1/31
T 0.875% 04/15/17	0.875	5,000	5,027	622,009	2017/4/15
T 0.875% 06/15/17	0.875	5,000	5,024	621,622	2017/6/15
T 0.875% 07/15/17	0.875	4,000	4,017	497,056	2017/7/15
T 0.875% 08/15/17	0.875	8,800	8,831	1,092,736	2017/8/15
T 0.875% 09/15/16	0.875	5,200	5,231	647,291	2016/9/15
T 1% 03/15/18	1.0	2,800	2,806	347,242	2018/3/15
T 1% 03/31/17	1.0	1,400	1,411	174,602	2017/3/31
T 1% 06/30/19	1.0	9,000	8,891	1,100,128	2019/6/30
T 1% 09/30/16	1.0	7,900	7,961	985,065	2016/9/30
T 1% 09/30/19	1.0	4,000	3,935	486,993	2019/9/30
T 1% 11/30/19	1.0	6,300	6,182	764,989	2019/11/30
T 1.125% 04/30/20	1.125	2,000	1,964	243,056	2020/4/30
T 1.125% 12/31/19	1.125	3,050	3,006	371,959	2019/12/31
T 1.25% 01/31/19	1.25	900	901	111,589	2019/1/31
T 1.25% 01/31/20	1.25	8,520	8,440	1,044,358	2020/1/31
T 1.25% 02/29/20	1.25	7,000	6,927	857,127	2020/2/29
T 1.25% 10/31/18	1.25	6,500	6,527	807,653	2018/10/31
T 1.25% 10/31/19	1.25	5,500	5,466	676,394	2019/10/31
T 1.25% 11/30/18	1.25	9,400	9,433	1,167,219	2018/11/30
T 1.375% 01/31/20	1.375	5,000	4,982	616,535	2020/1/31
T 1.375% 02/28/19	1.375	2,100	2,111	261,289	2019/2/28
T 1.375% 03/31/20	1.375	4,880	4,855	600,759	2020/3/31
T 1.375% 05/31/20	1.375	3,800	3,774	466,996	2020/5/31
T 1.375% 06/30/18	1.375	2,200	2,224	275,257	2018/6/30
T 1.375% 09/30/18	1.375	3,900	3,935	486,901	2018/9/30
T 1.375% 12/31/18	1.375	3,000	3,021	373,807	2018/12/31
T 1.5% 01/31/19	1.5	2,000	2,021	250,152	2019/1/31
T 1.5% 01/31/22	1.5	4,500	4,399	544,366	2022/1/31
T 1.5% 02/28/19	1.5	2,000	2,020	249,987	2019/2/28
T 1.5% 03/31/19	1.5	4,400	4,442	549,654	2019/3/31
T 1.5% 07/31/16	1.5	4,300	4,357	539,136	2016/7/31
T 1.5% 08/31/18	1.5	5,800	5,879	727,459	2018/8/31
T 1.5% 10/31/19	1.5	3,550	3,564	441,008	2019/10/31
T 1.5% 11/30/19	1.5	5,000	5,018	620,982	2019/11/30
T 1.625% 03/31/19	1.625	3,000	3,042	376,417	2019/3/31
T 1.625% 04/30/19	1.625	5,000	5,068	627,071	2019/4/30
T 1.625% 08/15/22	1.625	4,500	4,416	546,464	2022/8/15
T 1.625% 08/31/19	1.625	7,500	7,584	938,414	2019/8/31
T 1.625% 11/15/22	1.625	7,150	6,999	866,077	2022/11/15
T 1.75% 02/28/22	1.75	2,500	2,482	307,131	2022/2/28
T 1.75% 03/31/22	1.75	2,500	2,480	306,908	2022/3/31
T 1.75% 05/15/22	1.75	3,800	3,769	466,353	2022/5/15
T 1.75% 05/15/23	1.75	1,900	1,866	230,908	2023/5/15
T 1.75% 05/31/16	1.75	9,500	9,637	1,192,492	2016/5/31
T 1.75% 10/31/20	1.75	4,000	4,026	498,216	2020/10/31
T 1.875% 06/30/20	1.875	5,200	5,286	654,140	2020/6/30
T 1.875% 08/31/17	1.875	7,900	8,102	1,002,495	2017/8/31
T 1.875% 09/30/17	1.875	850	872	107,912	2017/9/30
T 1.875% 10/31/17	1.875	2,500	2,565	317,450	2017/10/31

銘柄	利率 (%)	当 期 末			
		額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
T 1.875% 11/30/21	1.875	5,400	5,416	670,125	2021/11/30
T 2% 02/15/22	2.0	2,500	2,525	312,520	2022/2/15
T 2% 02/15/23	2.0	1,100	1,104	136,602	2023/2/15
T 2% 02/15/25	2.0	5,800	5,729	708,901	2025/2/15
T 2% 02/28/21	2.0	4,000	4,067	503,262	2021/2/28
T 2% 05/31/21	2.0	3,800	3,855	477,015	2021/5/31
T 2% 07/31/20	2.0	5,000	5,315	657,709	2020/7/31
T 2% 08/31/21	2.0	6,800	6,885	851,963	2021/8/31
T 2% 10/31/21	2.0	6,200	6,269	775,741	2021/10/31
T 2% 11/15/21	2.0	2,400	2,427	300,333	2021/11/15
T 2% 11/30/20	2.0	5,500	5,603	693,380	2020/11/30
T 2.125% 01/31/21	2.125	3,000	3,072	380,129	2021/1/31
T 2.125% 06/30/21	2.125	1,000	1,021	126,339	2021/6/30
T 2.125% 08/15/21	2.125	6,100	6,222	769,921	2021/8/15
T 2.125% 08/31/20	2.125	6,500	6,678	826,377	2020/8/31
T 2.25% 03/31/21	2.25	6,600	6,796	840,988	2021/3/31
T 2.25% 04/30/21	2.25	3,500	3,602	445,792	2021/4/30
T 2.25% 07/31/18	2.25	5,750	5,968	738,515	2018/7/31
T 2.25% 11/15/24	2.25	8,150	8,236	1,019,094	2024/11/15
T 2.375% 05/31/18	2.375	4,000	4,166	515,538	2018/5/31
T 2.375% 08/15/24	2.375	8,500	8,691	1,075,450	2024/8/15
T 2.5% 02/15/45	2.5	4,580	4,208	520,728	2045/2/15
T 2.5% 05/15/24	2.5	8,400	8,684	1,074,551	2024/5/15
T 2.625% 04/30/18	2.625	5,000	5,242	648,688	2018/4/30
T 2.625% 11/15/20	2.625	2,000	2,103	260,267	2020/11/15
T 2.75% 02/15/19	2.75	4,600	4,858	601,162	2019/2/15
T 2.75% 02/15/24	2.75	10,600	11,185	1,383,928	2024/2/15
T 2.75% 02/28/18	2.75	3,800	3,991	493,903	2018/2/28
T 2.75% 05/31/17	2.75	8,000	8,337	1,031,656	2017/5/31
T 2.75% 11/15/23	2.75	6,900	7,291	902,193	2023/11/15
T 2.75% 11/15/42	2.75	4,200	4,067	503,243	2042/11/15
T 2.75% 11/30/16	2.75	6,250	6,464	799,804	2016/11/30
T 2.75% 12/31/17	2.75	9,100	9,545	1,181,096	2017/12/31
T 2.875% 03/31/18	2.875	3,900	4,113	508,983	2018/3/31
T 2.875% 05/15/43	2.875	11,500	11,413	1,412,195	2043/5/15
T 3% 02/28/17	3.0	9,500	9,905	1,225,620	2017/2/28
T 3% 05/15/42	3.0	5,500	5,604	693,500	2042/5/15
T 3% 08/31/16	3.0	8,700	8,982	1,111,414	2016/8/31
T 3% 09/30/16	3.0	5,500	5,689	703,987	2016/9/30
T 3% 11/15/44	3.0	1,100	1,121	138,729	2044/11/15
T 3.125% 01/31/17	3.125	3,500	3,651	451,840	2017/1/31
T 3.125% 02/15/43	3.125	1,000	1,041	128,872	2043/2/15
T 3.125% 04/30/17	3.125	6,500	6,814	843,122	2017/4/30
T 3.125% 05/15/19	3.125	5,000	5,355	662,992	2019/5/15
T 3.125% 05/15/21	3.125	5,300	5,717	707,487	2021/5/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	6,150	6,420	794,408	2044/8/15
T 3.125% 10/31/16	3.125	6,500	6,746	834,718	2016/10/31
T 3.125% 11/15/41	3.125	2,800	2,929	362,527	2041/11/15
T 3.25% 06/30/16	3.25	5,400	5,571	689,308	2016/6/30
T 3.25% 07/31/16	3.25	2,500	2,584	319,782	2016/7/31
T 3.25% 12/31/16	3.25	3,500	3,652	451,933	2016/12/31
T 3.375% 05/15/44	3.375	7,500	8,197	1,014,320	2044/5/15
T 3.5% 02/15/18	3.5	5,700	6,101	754,877	2018/2/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	1,000	1,114	137,864	2039/2/15
T 3.625% 02/15/20	3.625	5,150	5,658	700,084	2020/2/15
T 3.625% 02/15/21	3.625	7,000	7,743	958,100	2021/2/15
T 3.625% 02/15/44	3.625	5,000	5,714	707,013	2044/2/15
T 3.625% 08/15/19	3.625	2,700	2,952	365,279	2019/8/15
T 3.75% 08/15/41	3.75	2,200	2,563	317,183	2041/8/15
T 3.75% 11/15/18	3.75	5,000	5,448	674,111	2018/11/15
T 3.75% 11/15/43	3.75	2,300	2,686	332,418	2043/11/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	4,200	4,969	614,931	2040/8/15
T 4.0% 08/15/18	4.0	3,300	3,613	447,098	2018/8/15
T 4.25% 05/15/39	4.25	600	747	92,549	2039/5/15
T 4.25% 11/15/17	4.25	2,500	2,764	342,064	2017/11/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	1,000	1,253	155,039	2040/11/15
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,200	1,522	188,402	2038/2/15
T 4.375% 05/15/40	4.375				

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
T 4.375% 11/15/39	4.375	2,700	3,432	424,655	2039/11/15
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,840	2,378	294,352	2036/2/15
T 4.5% 05/15/17	4.5	4,800	5,162	638,794	2017/5/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	1,000	1,289	159,582	2038/5/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	2,100	2,715	335,940	2039/8/15
T 4.625% 02/15/17	4.625	5,000	5,348	661,738	2017/2/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	1,650	2,175	269,125	2040/2/15
T 4.75% 08/15/17	4.75	1,300	1,415	175,136	2017/8/15
T 5.0% 05/15/37	5.0	500	689	85,349	2037/5/15
T 5.25% 02/15/29	5.25	400	532	65,898	2029/2/15
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,728	213,828	2028/11/15
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,600	2,197	271,943	2031/2/15
T 5.5% 08/15/28	5.5	1,200	1,627	201,387	2028/8/15
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	2,321	287,230	2026/2/15
T 6.125% 11/15/27	6.125	350	495	61,271	2027/11/15
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,100	1,620	200,547	2030/5/15
T 6.25% 08/15/23	6.25	2,700	3,578	442,768	2023/8/15
T 7.5% 11/15/16	7.5	3,000	3,307	409,236	2016/11/15
T 8.0% 11/15/21	8.0	1,700	2,345	290,262	2021/11/15
T 8.125% 08/15/19	8.125	2,100	2,686	332,393	2019/8/15
小 計				90,500,389	
<b>(カナダ)</b>					
<b>国債証券</b>					
CAN 1% 05/01/16	1.0	850	852	84,925	2016/5/1
CAN 1.25% 02/01/18	1.25	850	864	86,072	2018/2/1
CAN 1.25% 03/01/18	1.25	1,990	2,025	201,774	2018/3/1
CAN 1.25% 08/01/17	1.25	2,250	2,279	227,077	2017/8/1
CAN 1.25% 09/01/18	1.25	500	510	50,803	2018/9/1
CAN 1.5% 02/01/17	1.5	2,500	2,536	252,678	2017/2/1
CAN 1.5% 03/01/20	1.5	850	871	86,857	2020/3/1
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,650	1,655	164,876	2023/6/1
CAN 1.5% 09/01/17	1.5	1,650	1,682	167,626	2017/9/1
CAN 1.75% 03/01/19	1.75	1,400	1,453	144,822	2019/3/1
CAN 1.75% 09/01/19	1.75	850	883	87,972	2019/9/1
CAN 2% 06/01/16	2.0	1,400	1,418	141,292	2016/6/1
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,550	1,634	162,803	2025/6/1
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,700	1,834	182,741	2024/6/1
CAN 2.75% 06/01/22	2.75	1,300	1,424	141,905	2022/6/1
CAN 2.75% 09/01/16	2.75	2,250	2,309	230,035	2016/9/1
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	650	726	72,328	2048/12/1
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	370	428	42,652	2064/12/1
CAN 3.25% 06/01/21	3.25	1,200	1,347	134,251	2021/6/1
CAN 3.5% 06/01/20	3.5	2,100	2,356	234,712	2020/6/1
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	1,820	2,324	231,513	2045/12/1
CAN 3.75% 06/01/19	3.75	2,700	3,017	300,573	2019/6/1
CAN 4% 06/01/16	4.0	2,050	2,117	210,952	2016/6/1
CAN 4% 06/01/17	4.0	1,400	1,494	148,853	2017/6/1
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	1,700	2,280	227,202	2041/6/1
CAN 4.25% 06/01/18	4.25	1,750	1,937	193,009	2018/6/1
CAN 5% 06/01/37	5.0	1,600	2,377	236,798	2037/6/1
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,250	1,830	182,313	2029/6/1
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	1,480	2,287	227,831	2033/6/1
CAN 8.0% 06/01/27	8.0	550	916	91,314	2027/6/1
小 計				4,948,574	
<b>(メキシコ)</b>					
<b>国債証券</b>					
MBONO 10% 11/20/36	10.0	12,000	16,682	134,794	2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24	10.0	8,100	10,460	84,522	2024/12/5
MBONO 4.75% 06/14/18	4.75	43,000	43,155	348,695	2018/6/14
MBONO 5% 06/15/17	5.0	21,800	22,215	179,499	2017/6/15
MBONO 5% 12/11/19	5.0	11,300	11,193	90,442	2019/12/11
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	6,800	7,101	57,383	2022/6/9
MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	20,800	21,802	176,161	2021/6/10
MBONO 7.25% 12/15/16	7.25	18,100	19,026	153,735	2016/12/15
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	16,000	17,678	142,845	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	12,500	14,103	113,958	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	1,800	2,036	16,453	2042/11/13
MBONO 7.75% 12/14/17	7.75	9,700	10,494	84,798	2017/12/14
MBONO 8% 06/11/20	8.0	14,500	16,209	130,976	2020/6/11
MBONO 8% 12/07/23	8.0	26,450	30,067	242,945	2023/12/7
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	20,500	24,608	198,835	2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	16,500	20,049	162,003	2038/11/18
小 計				2,318,050	

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
<b>(ドイツ)</b>					
<b>国債証券</b>					
DBR 1% 08/15/24	1.0	2,150	2,250	305,254	2024/8/15
DBR 1.5% 02/15/23	1.5	2,750	3,002	407,205	2023/2/15
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	1,950	2,130	288,909	2023/5/15
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	3,850	4,207	570,533	2024/5/15
DBR 1.5% 09/04/22	1.5	1,450	1,581	214,446	2022/9/4
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	2,970	3,192	449,167	2024/2/15
DBR 1.75% 07/04/22	1.75	2,700	2,930	405,584	2022/7/4
DBR 2% 01/04/22	2.0	2,600	2,913	395,077	2022/1/4
DBR 2% 08/15/23	2.0	1,100	1,247	169,156	2023/8/15
DBR 2.25% 09/04/20	2.25	2,500	2,792	378,746	2020/9/4
DBR 2.25% 09/04/21	2.25	2,000	2,264	307,079	2021/9/4
DBR 2.5% 01/04/21	2.5	2,100	2,386	323,670	2021/1/4
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	1,750	2,345	318,131	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	1,000	1,352	183,345	2046/8/15
DBR 3% 07/04/20	3.0	2,300	2,649	359,284	2020/7/4
DBR 3.25% 01/04/20	3.25	4,700	5,409	733,523	2020/1/4
DBR 3.25% 07/04/21	3.25	1,700	2,023	274,454	2021/7/4
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	1,810	2,713	368,022	2042/7/4
DBR 3.5% 07/04/19	3.5	3,500	4,013	544,244	2019/7/4
DBR 3.75% 01/04/17	3.75	3,600	3,829	519,372	2017/1/4
DBR 3.75% 01/04/19	3.75	4,150	4,728	641,281	2019/1/4
DBR 4% 07/04/16	4.0	2,600	2,720	368,923	2016/7/4
DBR 4.0% 01/04/18	4.0	1,000	1,109	150,460	2018/1/4
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,550	4,005	543,205	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/17	4.25	3,200	3,500	474,656	2017/7/4
DBR 4.25% 07/04/18	4.25	1,850	2,103	285,272	2018/7/4
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	2,160	2,760	374,325	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	1,150	1,723	233,664	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	2,400	3,966	537,879	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	1,850	3,333	452,405	2040/7/4
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	1,890	3,158	428,303	2031/1/4
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	1,150	1,829	248,065	2028/1/4
DBR 6% 06/20/16	6.0	560	596	80,930	2016/6/20
DBR 6.25% 01/04/24	6.25	1,600	2,399	325,344	2024/1/4
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,250	2,186	296,482	2030/1/4
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	1,550	2,597	352,186	2027/7/4
OBL 0.25% 04/13/18	0.25	2,100	2,126	288,401	2018/4/13
OBL 0.25% 10/11/19	0.25	450	455	61,831	2019/10/11
OBL 0.5% 02/23/18	0.5	2,900	2,955	400,786	2018/2/23
OBL 0.5% 04/07/17	0.5	2,400	2,432	329,883	2017/4/7
OBL 0.5% 04/12/19	0.5	3,250	3,325	450,953	2019/4/12
OBL 0.5% 10/13/17	0.5	450	457	62,065	2017/10/13
OBL 0.75% 02/24/17	0.75	3,000	3,051	413,827	2017/2/24
OBL 1% 10/12/18	1.0	2,750	2,856	387,354	2018/10/12
OBL 1.25% 10/14/16	1.25	3,850	3,928	532,767	2016/10/14
<b>(イタリア)</b>					
<b>国債証券</b>					
BTPS 0.75% 01/15/18	0.75	2,600	2,630	356,681	2018/1/15
BTPS 1.05% 12/01/19	1.05	500	505	68,598	2019/12/1
BTPS 1.15% 05/15/17	1.15	800	815	110,623	2017/5/15
BTPS 1.35% 04/15/22	1.35	1,300	1,296	175,796	2022/4/15
BTPS 1.5% 08/01/19	1.5	2,400	2,480	336,358	2019/8/1
BTPS 1.5% 12/15/16	1.5	1,200	1,226	166,301	2016/12/15
BTPS 2.15% 12/15/21	2.15	2,500	2,626	356,194	2021/12/15
BTPS 2.5% 05/01/19	2.5	2,000	2,144	290,818	2019/5/1
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	2,450	2,584	350,464	2024/12/1
BTPS 2.75% 11/15/16	2.75	500	519	70,450	2016/11/15
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	1,000	1,071	145,350	2046/9/1
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	2,850	3,260	442,152	2030/3/1
BTPS 3.5% 06/01/18	3.5	1,100	1,202	163,010	2018/6/1
BTPS 3.5% 11/01/17	3.5	2,000	2,156	292,490	2017/11/1
BTPS 3.5% 12/01/18	3.5	3,200	3,532	479,224	2018/12/1
BTPS 3.75% 03/01/21	3.75	3,500	4,012	544,185	2021/3/1
BTPS 3.75% 05/01/21	3.75	750	859	116,597	2021/5/1
BTPS 3.75% 08/01/16	3.75	2,900	3,026	410,362	2016/8/1
BTPS 3.75% 08/01/21	3.75	4,000	4,592	622,791	2021/8/1
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	3,300	3,832	519,743	2024/9/1
BTPS 4% 02/01/17	4.0	4,950	5,272	714,945	2017/2/1
BTPS 4% 02/01/37	4.0	3,050	3,662	496,677	2037/2/1

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
BTPS 4% 09/01/20	4.0	2,200	2,539	344,358	2020/9/1
BTPS 4.25% 02/01/19	4.25	3,800	4,309	584,404	2019/2/1
BTPS 4.25% 03/01/20	4.25	3,500	4,056	550,123	2020/3/1
BTPS 4.25% 09/01/19	4.25	2,650	3,042	412,543	2019/9/1
BTPS 4.5% 02/01/18	4.5	2,400	2,666	361,610	2018/2/1
BTPS 4.5% 02/01/20	4.5	2,650	3,097	420,006	2020/2/1
BTPS 4.5% 03/01/19	4.5	1,600	1,833	248,649	2019/3/1
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	2,250	2,747	372,597	2024/3/1
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,700	3,345	453,722	2026/3/1
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	1,050	1,276	173,050	2023/5/1
BTPS 4.5% 08/01/18	4.5	4,000	4,512	611,964	2018/8/1
BTPS 4.75% 05/01/17	4.75	1,770	1,925	261,176	2017/5/1
BTPS 4.75% 06/01/17	4.75	3,800	4,147	562,448	2017/6/1
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	4,400	5,436	737,235	2023/8/1
BTPS 4.75% 09/01/21	4.75	2,400	2,899	393,261	2021/9/1
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	1,850	2,372	321,791	2028/9/1
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	1,700	2,322	314,908	2044/9/1
BTPS 4.75% 09/15/16	4.75	2,400	2,545	345,154	2016/9/15
BTPS 5% 03/01/22	5.0	2,800	3,456	468,747	2022/3/1
BTPS 5% 03/01/25	5.0	1,700	2,168	294,043	2025/3/1
BTPS 5% 08/01/34	5.0	2,500	3,400	461,162	2034/8/1
BTPS 5% 09/01/40	5.0	2,400	3,314	449,429	2040/9/1
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	2,300	3,170	429,939	2039/8/1
BTPS 5.25% 08/01/17	5.25	3,050	3,384	459,010	2017/8/1
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	2,850	3,864	524,014	2029/11/1
BTPS 5.5% 09/01/22	5.5	2,100	2,677	363,087	2022/9/1
BTPS 5.5% 11/01/22	5.5	2,950	3,763	510,391	2022/11/1
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	2,050	2,997	406,542	2033/2/1
BTPS 6% 05/01/31	6.0	3,800	5,605	760,204	2031/5/1
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	2,800	4,107	557,050	2027/11/1
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	2,133	289,292	2026/11/1
BTPS 9% 11/01/23	9.0	800	1,257	170,479	2023/11/1
<b>(フランス)</b>					
<b>国債証券</b>					
BINS 1% 07/25/17	1.0	3,600	3,690	500,522	2017/7/25
BINS 1.75% 02/25/17	1.75	2,500	2,584	350,419	2017/2/25
BINS 2.5% 07/25/16	2.5	3,000	3,092	419,401	2016/7/25
FRTR 0.5% 11/25/19	0.5	3,400	3,464	469,806	2019/11/25
FRTR 1% 05/25/18	1.0	3,500	3,613	490,079	2018/5/25
FRTR 1% 05/25/19	1.0	3,250	3,376	457,892	2019/5/25
FRTR 1% 11/25/18	1.0	2,500	2,590	351,296	2018/11/25
FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	3,000	3,282	445,080	2023/5/25
FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	3,200	3,490	473,343	2024/11/25
FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	4,400	4,997	677,734	2024/5/25
FRTR 2.25% 10/25/22	2.25	3,600	4,065	551,366	2022/10/25
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	2,500	2,939	398,676	2030/5/25
FRTR 2.5% 10/25/20	2.5	5,150	5,790	785,288	2020/10/25
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	4,100	4,905	665,280	2027/10/25
FRTR 3% 04/25/22	3.0	5,000	5,885	798,132	2022/4/25
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	1,550	2,142	290,533	2045/5/25
FRTR 3.25% 10/25/21	3.25	4,300	5,097	691,204	2021/10/25
FRTR 3.5% 04/25/20	3.5	5,050	5,883	797,865	2020/4/25
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	4,950	6,290	853,005	2026/4/25
FRTR 3.75% 04/25/17	3.75	6,100	6,555	889,014	2017/4/25
FRTR 3.75% 04/25/21	3.75	4,050	4,882	662,077	2021/4/25
FRTR 3.75% 10/25/19	3.75	3,050	3,546	480,884	2019/10/25
FRTR 4% 04/25/18	4.0	1,880	2,104	285,326	2018/4/25
FRTR 4% 04/25/55	4.0	1,700	2,802	380,110	2055/4/25
FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,230	2,069	280,597	2060/4/25
FRTR 4% 10/25/38	4.0	2,780	4,160	564,238	2038/10/25
FRTR 4.25% 04/25/19	4.25	2,000	2,331	316,214	2019/4/25
FRTR 4.25% 10/25/17	4.25	3,250	3,594	487,483	2017/10/25
FRTR 4.25% 10/25/18	4.25	3,900	4,471	606,335	2018/10/25
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	3,600	4,680	634,747	2023/10/25
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	2,850	4,659	631,895	2041/4/25
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	2,800	4,442	602,444	2035/4/25
FRTR 5% 10/25/16	5.0	5,000	5,363	727,361	2016/10/25
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	3,140	4,903	664,897	2029/4/25
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	2,970	5,042	683,867	2032/10/25
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	2,400	3,643	494,114	2025/10/25
FRTR 8.5% 04/25/23	8.5	1,000	1,620	219,774	2023/4/25
FRTR 8.5% 10/25/19	8.5	1,120	1,536	208,308	2019/10/25

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
<b>(オランダ)</b>					
<b>国債証券</b>					
NETHER 0.25% 01/15/20	0.25	1,400	1,412	191,066	2020/1/15
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	700	668	90,673	2025/7/15
NETHER 1.25% 01/15/18	1.25	2,350	2,436	330,369	2018/1/15
NETHER 1.25% 01/15/19	1.25	1,700	1,780	241,405	2019/1/15
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	2,000	2,199	298,257	2023/7/15
NETHER 2% 07/15/24	2.0	1,700	1,912	259,332	2024/7/15
NETHER 2.25% 07/15/22	2.25	750	849	115,149	2022/7/15
NETHER 2.5% 01/15/17	2.5	3,250	3,393	460,179	2017/1/15
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	1,100	1,357	184,097	2033/1/15
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	760	1,055	143,126	2047/1/15
NETHER 3.25% 07/15/21	3.25	1,850	2,190	297,025	2021/7/15
NETHER 3.5% 07/15/20	3.5	1,950	2,287	310,187	2020/7/15
NETHER 3.75% 01/15/23	3.75	2,230	2,788	378,106	2023/1/15
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	1,750	2,795	379,136	2042/1/15
NETHER 4% 01/15/37	4.0	1,630	2,542	344,750	2037/1/15
NETHER 4% 07/15/16	4.0	1,200	1,566	170,429	2016/7/15
NETHER 4% 07/15/19	4.0	1,900	2,213	300,127	2019/7/15
NETHER 4.0% 07/15/18	4.0	1,400	1,579	214,129	2018/7/15
NETHER 4.5% 07/15/17	4.5	2,450	2,694	365,390	2017/7/15
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,480	2,300	311,969	2028/1/15
NETHER 7.5% 01/15/23	7.5	200	306	41,602	2023/1/15
<b>(スペイン)</b>					
<b>国債証券</b>					
SPGB 0.5% 10/31/17	0.5	1,200	1,208	163,832	2017/10/31
SPGB 1.4% 01/31/20	1.4	2,800	2,877	390,267	2020/1/31
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	1,900	1,860	252,257	2025/4/30
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	1,000	946	128,312	2030/7/30
SPGB 2.1% 04/30/17	2.1	3,000	3,114	422,326	2017/4/30
SPGB 2.75% 04/30/19	2.75	2,800	3,036	411,844	2019/4/30
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	2,150	2,321	314,864	2024/10/31
SPGB 3.3% 07/30/16	3.3	2,950	3,062	415,275	2016/7/30
SPGB 3.75% 10/31/18	3.75	1,400	1,558	211,316	2018/10/31
SPGB 3.8% 01/31/17	3.8	4,050	4,303	583,651	2017/1/31
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	2,800	3,267	443,069	2024/4/30
SPGB 4% 04/30/20	4.0	2,900	3,336	452,457	2020/4/30
SPGB 4.1% 07/30/18	4.1	2,400	2,682	363,740	2018/7/30
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	1,900	2,350	318,791	2037/1/31
SPGB 4.25% 10/31/16	4.25	1,850	1,960	265,912	2016/10/31
SPGB 4.3% 10/31/19	4.3	2,950	3,409	462,309	2019/10/31
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	1,000	1,213	164,530	2023/10/31
SPGB 4.5% 01/31/18	4.5	2,590	2,880	390,688	2018/1/31
SPGB 4.6% 07/30/19	4.6	1,200	1,395	189,243	2019/7/30
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	1,900	2,384	323,422	2025/7/30
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	1,430	1,912	259,390	2041/7/30
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	3,050	3,810	516,793	2024/1/31
SPGB 4.85% 01/31/20	4.85	2,150	2,586	350,748	2020/1/31
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	1,400	1,960	260,284	2040/7/30
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	2,580	3,421	463,981	2028/10/31
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,200	1,734	235,172	2044/10/31
SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	2,000	2,556	346,720	2023/1/31
SPGB 5.5% 04/30/21	5.5	2,100	2,624	355,860	2021/4/30
SPGB 5.5% 07/30/17	5.5	3,200	3,568	483,991	2017/7/30
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	1,950	2,396	384,598	2032/7/30
SPGB 5.85% 01/31/22	5.85	2,800	3,610	489,570	2022/1/31
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	1,680	2,326	315,454	2026/7/30
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,500	2,142	290,529	2029/1/31
<b>(ベルギー)</b>					
<b>国債証券</b>					
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	800	797	108,106	2025/6/22
BGB 1% 06/22/31	1.0	250	239	32,466	2031/6/22
BGB 1.25% 06/22/18	1.25	1,100	1,144	155,230	2018/6/22
BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,700	1,924	260,941	2023/6/22
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	1,750	2,040	276,675	2024/6/22
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,050	1,338	181,464	2034/6/22
BGB 3% 09/28/19	3.0	1,550	1,747	236,968	2019/9/28
BGB 3.25% 09/28/16	3.25	100	104	14,180	2016/9/28
BGB 3.5% 06/28/17	3.5	700	753	102,165	2017/6/28
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	740	1,117	151,581	2045/6/22
BGB 3.75% 09/28/20	3.75	2,500	2,977	403,836	2020/9/28

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
BGB 4% 03/28/18	4.0	1,400	1,563	211,995	2018/3/28
BGB 4% 03/28/22	4.0	1,400	1,741	236,216	2022/3/28
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,100	1,552	210,530	2032/3/28
BGB 4.0% 03/28/17	4.0	1,910	2,056	278,880	2017/3/28
BGB 4.0% 03/28/19	4.0	1,700	1,960	265,797	2019/3/28
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	1,670	2,654	359,970	2041/3/28
BGB 4.25% 09/28/21	4.25	1,850	2,309	313,172	2021/9/28
BGB 4.25% 09/28/22	4.25	1,850	2,356	319,515	2022/9/28
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,550	2,128	288,640	2026/3/28
BGB 5% 03/28/35	5.0	1,900	3,087	418,675	2035/3/28
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	1,650	2,529	342,958	2028/3/28
BGB 5.5% 09/28/17	5.5	1,900	2,151	291,708	2017/9/28
<b>(オーストリア)</b>					
<b>国債証券</b>					
RAGB 0.25% 10/18/19	0.25	500	504	68,450	2019/10/18
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	600	654	88,750	2024/10/21
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	1,850	2,033	275,696	2023/10/20
RAGB 1.95% 06/18/19	1.95	800	862	116,982	2019/6/18
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	500	606	82,274	2034/5/23
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	660	957	129,856	2044/6/20
RAGB 3.2% 02/20/17	3.2	1,050	1,111	150,682	2017/2/20
RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	850	1,036	140,586	2022/11/22
RAGB 3.5% 09/15/21	3.5	1,470	1,766	239,596	2021/9/15
RAGB 3.65% 04/20/22	3.65	1,100	1,348	182,811	2022/4/20
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	380	689	93,568	2062/1/26
RAGB 3.9% 07/15/20	3.9	1,650	1,968	267,006	2020/7/15
RAGB 4% 09/15/16	4.0	1,200	1,265	171,558	2016/9/15
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,370	2,152	291,873	2037/3/15
RAGB 4.3% 09/15/17	4.3	900	992	134,549	2017/9/15
RAGB 4.35% 03/15/19	4.35	2,300	2,681	363,593	2019/3/15
RAGB 4.65% 01/15/18	4.65	1,350	1,519	206,111	2018/1/15
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	1,050	1,494	202,712	2026/3/15
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	900	1,457	197,693	2027/7/15
<b>(フィンランド)</b>					
<b>国債証券</b>					
RFGB 0.375% 09/15/20	0.375	550	557	75,586	2020/9/15
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	400	382	51,893	2031/4/15
RFGB 1.125% 09/15/18	1.125	150	155	21,152	2018/9/15
RFGB 1.5% 04/15/23	1.5	650	701	95,092	2023/4/15
RFGB 1.625% 09/15/22	1.625	350	380	51,635	2022/9/15
RFGB 2% 04/15/24	2.0	650	729	98,926	2024/4/15
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	370	497	67,403	2042/7/4
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	550	673	91,321	2028/7/4
RFGB 3.375% 04/15/20	3.375	600	696	94,406	2020/4/15
RFGB 3.5% 04/15/21	3.5	700	834	113,233	2021/4/15
RFGB 3.875% 09/15/17	3.875	1,300	1,421	192,767	2017/9/15
RFGB 4% 07/04/25	4.0	750	993	134,772	2025/7/4
RFGB 4.375% 07/04/19	4.375	1,050	1,237	167,842	2019/7/4
<b>(アイルランド)</b>					
<b>国債証券</b>					
IRISH 0.8% 03/15/22	0.8	900	906	122,923	2022/3/15
IRISH 2% 02/18/45	2.0	540	546	74,107	2045/2/18
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	630	701	95,190	2030/5/15
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	900	1,073	148,533	2024/3/18
IRISH 3.9% 03/20/23	3.9	550	671	91,115	2023/3/20
IRISH 4.4% 06/18/19	4.4	1,100	1,290	174,985	2019/6/18
IRISH 4.5% 04/18/20	4.5	1,860	2,226	301,967	2020/4/18
IRISH 4.5% 10/18/18	4.5	890	1,024	138,869	2018/10/18
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,400	1,938	262,890	2025/3/13
IRISH 5.5% 10/18/17	5.5	860	974	132,178	2017/10/18
IRISH 5.9% 10/18/19	5.9	750	933	126,566	2019/10/18
<b>ユーロ計</b>					
				86,001,534	
<b>(イギリス)</b>					
<b>国債証券</b>					
UKT 1% 09/07/17	1.0	3,000	3,024	573,296	2017/9/7
UKT 1.25% 07/22/18	1.25	3,650	3,688	699,188	2018/7/22
UKT 1.75% 01/22/17	1.75	3,810	3,888	737,071	2017/1/22
UKT 1.75% 07/22/19	1.75	2,200	2,252	426,919	2019/7/22
UKT 1.75% 09/07/22	1.75	2,850	2,875	545,112	2022/9/7
UKT 2% 07/22/20	2.0	2,200	2,270	430,364	2020/7/22
UKT 2% 09/07/25	2.0	600	604	114,576	2025/9/7

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
UKT 2.25% 09/07/23	2.25	3,250	3,379	640,620	2023/9/7
UKT 2.75% 09/07/24	2.75	2,850	3,072	582,461	2024/9/7
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,700	3,091	586,055	2044/1/22
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	1,650	1,979	375,226	2045/1/22
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	1,700	2,221	421,203	2068/7/22
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	1,600	2,085	395,315	2052/7/22
UKT 3.75% 09/07/19	3.75	550	609	115,619	2019/9/7
UKT 3.75% 09/07/20	3.75	2,650	2,977	564,396	2020/9/7
UKT 3.75% 09/07/21	3.75	2,250	2,559	485,142	2021/9/7
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,650	2,338	443,338	2060/1/22
UKT 4% 03/07/22	4.0	2,050	2,379	451,032	2022/3/7
UKT 4% 09/07/16	4.0	850	888	168,370	2016/9/7
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	2,300	2,980	565,098	2036/3/7
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	2,330	2,963	561,738	2032/6/7
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,650	2,180	411,401	2039/9/7
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,400	1,739	329,872	2027/12/7
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	2,200	2,926	554,802	2040/12/7
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,800	2,483	470,856	2046/12/7
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,900	2,677	507,532	2049/12/7
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,800	2,628	498,276	2055/12/7
UKT 4.5% 03/07/19	4.5	2,300	2,597	492,317	2019/3/7
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	2,450	3,246	615,400	2034/9/7
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,100	2,936	556,744	2042/12/7
UKT 4.75% 03/07/20	4.75	4,150	4,825	914,714	2020/3/7
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	2,100	2,793	529,624	2030/12/7
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,900	2,678	507,690	2038/12/7
UKT 5% 03/07/18	5.0	2,050	2,290	434,152	2018/3/7
UKT 5% 03/07/25	5.0	1,900	2,439	462,455	2025/3/7
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,100	1,611	305,663	2028/12/7
UKT 8% 06/07/21	8.0	1,200	1,655	313,871	2021/6/7
UKT 8.75% 08/25/17	8.75	1,500	1,777	337,024	2017/8/25
<b>小 計</b>				18,126,362	
<b>(スイス)</b>					
<b>国債証券</b>					
SWISS 2.25% 07/06/20	2.25	450	514	67,487	2020/7/6
SWISS 3% 01/08/18	3.0	1,970	2,171	284,867	2018/1/8
SWISS 4% 02/11/23	4.0	1,140	1,513	198,633	2023/2/11
SWISS 4% 04/08/28	4.0	490	732	96,096	2028/4/8
<b>小 計</b>				647,084	
<b>(スウェーデン)</b>					
<b>国債証券</b>					
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	7,550	8,110	118,571	2023/11/13
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	8,400	9,840	143,875	2025/5/12
SGB 3% 07/12/16	3.0	6,550	6,798	99,394	2016/7/12
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	5,090	7,159	104,669	2039/3/30
SGB 3.5% 06/01/22	3.5	8,200	9,930	145,180	2022/6/1
SGB 3.75% 08/12/17	3.75	8,650	9,420	137,723	2017/8/12
SGB 4.25% 03/12/19	4.25	7,900	9,188	134,340	2019/3/12
SGB 5% 12/01/20	5.0	11,000	13,887	203,037	2020/12/1
<b>小 計</b>				1,086,792	
<b>(ノルウェー)</b>					
<b>国債証券</b>					
NOB 1.75% 03/13/25	1.75	2,500	2,547	40,431	2025/3/13
NOB 2% 05/24/23	2.0	5,240	5,490	87,126	2023/5/24
NOB 3% 03/14/24	3.0	5,550	6,242	99,073	2024/3/14
NOB 3.75% 05/25/21	3.75	5,500	6,306	100,088	2021/5/25
NOB 4.25% 05/19/17	4.25	7,000	7,479	118,997	2017/5/19
NOB 4.5% 05/22/19	4.5	8,200	9,337	148,192	2019/5/22
<b>小 計</b>				593,609	
<b>(デンマーク)</b>					
<b>国債証券</b>					
DNB 1.5% 11/15/23	1.5	6,150	6,697	121,758	2023/11/15
DNB 1.75% 11/15/25	1.75	5,150	5,710	103,819	2025/11/15
DNB 2.5% 11/15/16	2.5	7,450	7,768	141,238	2016/11/15
DNB 3% 11/15/21	3.0	11,800	13,890	252,526	2021/11/15
DNB 4% 11/15/17	4.0	6,500	7,192	130,765	2017/11/15
DNB 4% 11/15/19	4.0	8,950	10,562	192,300	2019/11/15
DNB 4.5% 11/15/39	4.5	14,350	24,611	447,433	2039/11/15
DNB 7% 11/10/24	7.0	3,950	6,346	115,381	2024/11/10
<b>小 計</b>				1,504,954	

当		期				末
銘柄	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 (千円)		
<b>(ポーランド)</b>						
国債証券		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			
POLBG 1.5% 04/25/20	1.5	1,200	1,147	37,556	2020/4/25	
POLBG 2.5% 07/25/18	2.5	3,100	3,137	102,727	2018/7/25	
POLBG 3.25% 07/25/19	3.25	2,800	2,903	95,059	2019/7/25	
POLBG 3.25% 07/25/25	3.25	1,940	1,992	65,248	2025/7/25	
POLBG 3.75% 04/25/18	3.75	1,250	1,310	42,910	2018/4/25	
POLBG 4% 10/25/23	4.0	3,150	3,424	112,107	2023/10/25	
POLBG 4.75% 04/25/17	4.75	2,720	2,872	94,031	2017/4/25	
POLBG 4.75% 10/25/16	4.75	3,650	3,803	124,514	2016/10/25	
POLBG 5.25% 10/25/17	5.25	4,100	4,427	144,958	2017/10/25	
POLBG 5.25% 10/25/20	5.25	2,180	2,483	81,325	2020/10/25	
POLBG 5.5% 10/25/19	5.5	2,600	2,943	96,360	2019/10/25	
POLBG 5.75% 04/25/29	5.75	1,400	1,821	59,623	2029/4/25	
POLBG 5.75% 09/23/22	5.75	2,720	3,256	106,619	2022/9/23	
POLBG 5.75% 10/25/21	5.75	1,850	2,187	71,627	2021/10/25	
小計				1,234,670		
<b>(オーストラリア)</b>						
国債証券		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル			
ACGB 1.75% 11/21/20	1.75	300	292	27,713	2020/11/21	
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	2,000	2,010	190,668	2024/4/21	
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	380	349	33,145	2035/6/21	
ACGB 2.75% 10/21/19	2.75	1,020	1,048	99,418	2019/10/21	
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	2,100	2,188	207,537	2025/4/21	
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	1,550	1,590	150,800	2029/4/21	
ACGB 3.25% 10/21/18	3.25	1,200	1,249	118,512	2018/10/21	
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	900	958	90,848	2037/4/21	
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	1,550	1,755	166,457	2026/4/21	
ACGB 4.25% 07/21/17	4.25	1,800	1,887	178,999	2017/7/21	
ACGB 4.5% 04/15/20	4.5	2,600	2,882	273,376	2020/4/15	
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	1,100	1,299	123,231	2033/4/21	
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	1,590	1,887	179,005	2027/4/21	
ACGB 4.75% 06/15/16	4.75	2,300	2,366	224,395	2016/6/15	
ACGB 5.25% 03/15/19	5.25	2,690	3,007	285,230	2019/3/15	
ACGB 5.5% 01/21/18	5.5	1,950	2,128	201,875	2018/1/21	
ACGB 5.5% 04/21/23	5.5	2,400	2,900	275,060	2023/4/21	
ACGB 5.75% 05/15/21	5.75	2,500	2,974	282,082	2021/5/15	
ACGB 5.75% 07/15/22	5.75	2,400	2,910	276,009	2022/7/15	
ACGB 6% 02/15/17	6.0	3,350	3,578	339,365	2017/2/15	
小計				3,723,736		
<b>(シンガポール)</b>						
国債証券		千シンガポールドル	千シンガポールドル			
SIGB 0.5% 04/01/18	0.5	600	587	53,992	2018/4/1	
SIGB 1.625% 10/01/19	1.625	110	109	10,085	2019/10/1	
SIGB 2.25% 06/01/21	2.25	280	283	26,059	2021/6/1	
SIGB 2.375% 04/01/17	2.375	520	532	48,987	2017/4/1	
SIGB 2.5% 06/01/19	2.5	900	932	85,716	2019/6/1	
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	520	507	46,626	2042/4/1	
SIGB 2.75% 07/01/23	2.75	250	258	23,749	2023/7/1	
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	200	204	18,823	2029/7/1	
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	300	305	28,077	2030/9/1	
SIGB 3% 09/01/24	3.0	770	810	74,540	2024/9/1	
SIGB 3.125% 09/01/22	3.125	800	849	78,125	2022/9/1	
SIGB 3.25% 09/01/20	3.25	930	991	91,172	2020/9/1	
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	400	432	39,733	2033/9/1	
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	510	559	51,466	2027/3/1	
SIGB 3.75% 09/01/16	3.75	800	827	76,084	2016/9/1	
SIGB 4% 09/01/18	4.0	430	465	42,793	2018/9/1	
小計				796,032		
<b>(マレーシア)</b>						
国債証券		千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット			
MCS 3.172% 07/15/16	3.172	2,600	2,605	88,543	2016/7/15	
MCS 3.26% 03/01/18	3.26	1,450	1,441	48,977	2018/3/1	
MCS 3.314% 10/31/17	3.314	1,000	999	33,976	2017/10/31	
MCS 3.418% 08/15/22	3.418	2,400	2,328	79,123	2022/8/15	
MCS 3.48% 03/15/23	3.48	1,450	1,407	47,814	2023/3/15	

当		期				末
銘柄	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 (千円)		
MGS 3.492% 03/31/20	3.492	1,550	1,537	52,256	2020/3/31	
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	800	753	25,614	2027/5/31	
MGS 3.58% 09/28/18	3.58	2,400	2,405	81,727	2018/9/28	
MGS 3.654% 10/31/19	3.654	1,200	1,201	40,826	2019/10/31	
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	450	430	14,612	2028/6/15	
MGS 3.814% 02/15/17	3.814	2,700	2,723	92,538	2017/2/15	
MGS 3.889% 07/31/20	3.889	1,500	1,514	51,450	2020/7/31	
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	750	733	24,929	2027/3/15	
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	540	542	18,437	2025/9/15	
MGS 4.048% 09/30/21	4.048	1,400	1,415	48,100	2021/9/30	
MGS 4.127% 04/15/32	4.127	1,400	1,371	46,614	2032/4/15	
MGS 4.16% 07/15/21	4.16	1,650	1,682	57,186	2021/7/15	
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	950	964	32,765	2024/7/15	
MGS 4.24% 02/07/18	4.24	1,150	1,172	39,848	2018/2/7	
MGS 4.262% 09/15/16	4.262	1,000	1,014	34,476	2016/9/15	
MGS 4.378% 11/29/19	4.378	2,600	2,680	91,068	2019/11/29	
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	1,100	1,131	38,459	2026/4/15	
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	650	681	23,166	2043/9/30	
MGS 5.248% 09/15/28	5.248	1,000	1,110	37,740	2028/9/15	
小計				1,150,253		
<b>(南アフリカ)</b>						
国債証券		千南アフリカランド	千南アフリカランド			
SAGB 10.5% 12/21/26	10.5	22,500	26,370	269,237	2026/12/21	
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	8,950	6,835	69,794	2036/3/31	
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	7,300	5,611	57,290	2041/2/28	
SAGB 6.75% 03/31/21	6.75	11,000	10,464	106,837	2021/3/31	
SAGB 7% 02/28/31	7.0	15,200	13,087	133,628	2031/2/28	
SAGB 7.25% 01/15/20	7.25	7,400	7,276	74,291	2020/1/15	
SAGB 7.75% 02/28/23	7.75	5,700	5,617	57,354	2023/2/28	
SAGB 8% 12/21/18	8.0	8,700	8,845	90,312	2018/12/21	
SAGB 8.25% 09/15/17	8.25	5,400	5,518	56,348	2017/9/15	
SAGB 8.5% 01/31/37	8.5	8,200	7,974	81,416	2037/1/31	
SAGB 8.75% 01/31/44	8.75	1,700	1,679	17,151	2044/1/31	
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	12,400	12,255	125,133	2048/2/28	
小計				1,138,797		
合計				2,137,770,843		

(注)邦貨換算金額は、当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。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別		当		期		末
		買	建	売	建	額
		(百万円)		(百万円)		
外国	EURO-SCHATZ		180			—
	US 5YR NOTE		280			—
	EURO-BOBL FU		261			—
	EURO-BUND		504			—
	US 10YR NOTE		173			—
	US LONG BOND		114			—

(注)外貨建資産は、当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

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 213,770,843	95.7%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	9,671,206	4.3
投 資 信 託 財 産 総 額	223,442,049	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(210,963,382千円)の投資信託財産総額(223,442,049千円)に対する比率は94.4%です。

(注2) 外貨建資産は、当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。1米ドル=123.73円、1カナダドル=99.61円、1メキシコペソ=8.08円、1ユーロ=135.61円、1イギリスポンド=189.57円、1スイスフラン=131.21円、1スウェーデンクローナ=14.62円、1ノルウェークローネ=15.87円、1デンマーククローネ=18.18円、1ポーランドズロチ=32.74円、1オーストラリアドル=94.83円、1シンガポールドル=91.92円、1マレーシアリングギット=33.98円、1南アフリカランド=10.21円です。

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2015年5月29日現在
(A) 資 産	230,488,650,760円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	7,642,856,226
公 社 債(評価額)	213,770,843,567
未 収 入 金	7,124,145,684
未 収 利 息	1,763,571,320
前 払 費 用	125,723,611
差 入 委 託 証 拠 金	61,510,352
(B) 負 債	12,890,502,829
未 払 金	12,074,827,819
未 払 解 約 金	815,675,010
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	217,598,147,931
元 本	75,548,796,118
次 期 繰 越 損 益 金	142,049,351,813
(D) 受 益 権 総 口 数	75,548,796,118口
1万口当たり基準価額(C/D)	28,802円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2014年5月30日 至 2015年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	6,554,905,531円
受 取 利 息	6,554,905,531
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	26,236,466,502
売 買 益	30,368,295,475
売 買 損	△4,131,828,973
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	113,756,532
取 引 益	194,819,308
取 引 損	△81,062,776
(D) そ の 他 費 用	△66,568,304
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	32,838,560,261
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	133,697,617,446
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	63,049,187,167
(H) 解 約 差 損 益 金	△87,536,013,061
(I) 計 (E+F+G+H)	142,049,351,813
次 期 繰 越 損 益 金(I)	142,049,351,813

(注1) (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2) (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3) (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。

## お知らせ

---

一般社団法人投資信託協会「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」の一部改正に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2014年12月20日)

一般社団法人投資信託協会「信用リスク集中回避のための投資制限に係るガイドライン」の制定に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2015年2月11日)

# 外国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第15期（決算日 2015年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運用方針	日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	原則として、MSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組 比率	株式先 物率	投資信託 証券組 入比率	純資産 総額
	円	騰落率	円	騰落率				
第11期(2011年5月30日)	9,723	14.4	301.77	12.2	93.8	4.9	1.7	127,019
第12期(2012年5月29日)	8,714	△10.4	263.71	△12.6	89.9	8.2	1.9	119,455
第13期(2013年5月29日)	14,450	65.8	426.72	61.8	95.9	1.8	2.2	170,810
第14期(2014年5月29日)	16,956	17.3	488.37	14.4	94.0	4.0	2.1	168,036
第15期(2015年5月29日)	21,973	29.6	621.17	27.2	94.4	3.3	2.3	272,048

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組 比率	株式先 物率	投資信託 証券組 入比率
	円	騰落率	円	騰落率			
(当期首) 2014年 5月29日	16,956	—	488.37	—	94.0	4.0	2.1
5月末	17,012	0.3	489.40	0.2	93.8	4.2	2.1
6月末	17,228	1.6	495.29	1.4	93.0	5.2	2.1
7月末	17,472	3.0	501.41	2.7	94.7	3.1	2.1
8月末	17,739	4.6	508.33	4.1	95.0	2.8	2.2
9月末	18,258	7.7	521.87	6.9	93.9	4.4	2.1
10月末	18,161	7.1	517.48	6.0	95.1	2.9	2.3
11月末	20,358	20.1	579.00	18.6	94.3	3.4	2.2
12月末	20,624	21.6	587.87	20.4	92.4	5.5	2.2
2015年 1月末	19,748	16.5	561.41	15.0	92.5	5.2	2.5
2月末	20,876	23.1	593.54	21.5	94.5	3.0	2.3
3月末	20,838	22.9	589.49	20.7	95.2	2.7	2.4
4月末	21,037	24.1	595.40	21.9	94.3	3.4	2.3
(当期末) 2015年 5月29日	21,973	29.6	621.17	27.2	94.4	3.3	2.3

(注1)騰落率は期首比です。

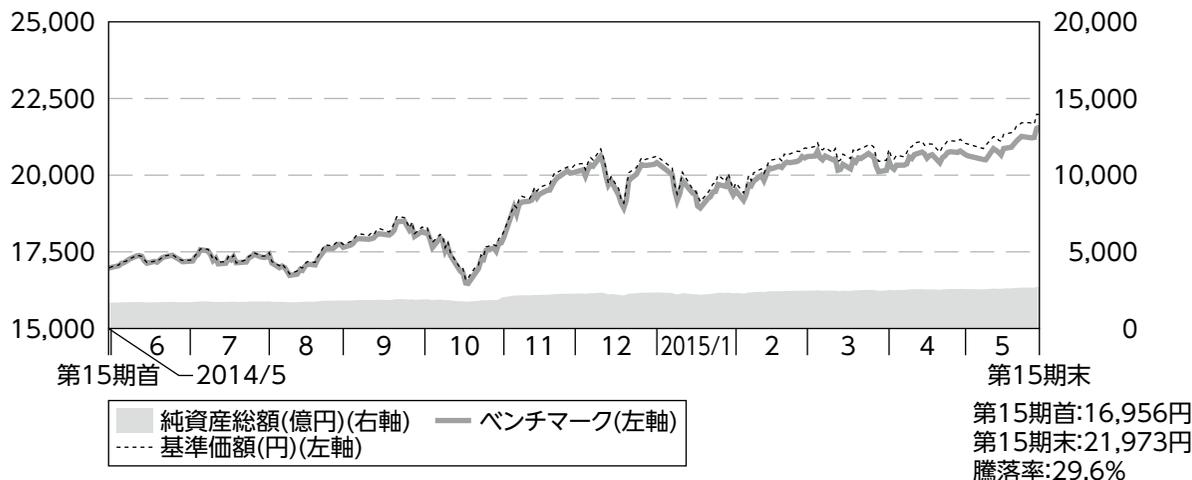
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)です。

MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2014年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

<当期首～2014年9月>

欧米が金融緩和政策を維持する中、概して良好なマクロ景気指標や好調な企業決算の発表を受けて外国株式市場は上昇し、基準価額にプラス寄与しました。

<2014年9月～2014年10月>

欧州景気の減速懸念、香港民主化デモなどが嫌気されて外国株式市場は下落し、基準価額にマイナスに働きました。

<2014年10月～2014年12月>

米国の景気回復期待、中国の利下げなどから外国株式市場が上昇したことや、円安が進行したことなどが、基準価額の上昇に寄与しました。

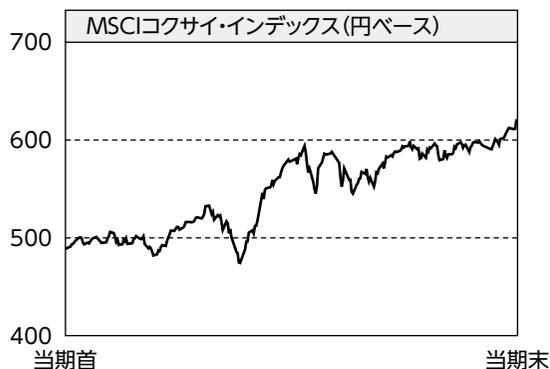
<2014年12月～2015年1月>

原油価格の下落、ロシアルーブルの急落を受けてリスク回避の動きが広がったことや、ギリシャの政治不安定化への懸念などから、外国株式市場は下落し、基準価額にマイナスに影響しました。

<2015年1月～当期末>

米国の早期利上げ観測が後退したことや、ECB(欧州中央銀行)による量的金融緩和導入の決定などから外国株式市場が上昇したことが基準価額にプラス寄与しました。

## 投資環境



米国株式市場は、期初から9月にかけては世界的に金融緩和政策が持続する中、良好な企業業績を背景として堅調に推移しました。10月中旬にかけては世界景気の不透明感や、中東などの地政学的リスクの高まりを受けて急落しましたが、日銀の追加金融緩和、米国中間選挙での共和党勝利による企業重視の政策期待などから反発しました。期末にかけては、FRB(米連邦準備理事会)による早期利上げ観測の後退、商品市況の回復を受けて上昇しました。

欧州株式市場は、期前半は欧州景気の低迷を受けて低調な展開となりましたが、期後半はECBによる量的金融緩和導入の決定を受けて大幅に上昇しました。為替市場では米ドル/円相場で円安が進行しました。

## 当該投資信託のポートフォリオ

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス(円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

### (1) 株式組入比率

取引コストに留意しながらリバランスを実施し、先物を含む外国株式を高位に組み入れ運用を行いました。

### (2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、個別銘柄の構成比を極力ベンチマークに近づけることで連動を目指しました。

## 当該投資信託の組入資産の内容

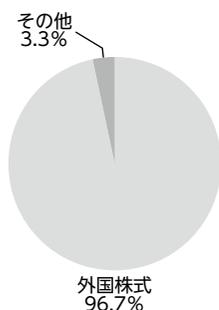
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	APPLE INC	アメリカ	2.3%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.1%
3	EXXON MOBIL	アメリカ	1.1%
4	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
5	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	0.8%
6	WELLS FARGO & CO	アメリカ	0.8%

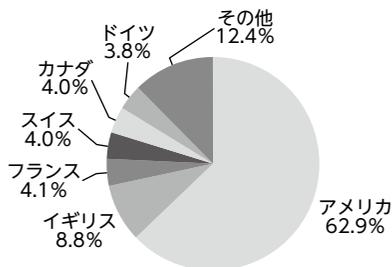
順位	銘柄名	国	組入比率
7	NESTLE SA - REGISTERED	スイス	0.8%
8	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	0.8%
9	NOVARTIS	スイス	0.7%
10	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	0.7%
組入銘柄数		1,330	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

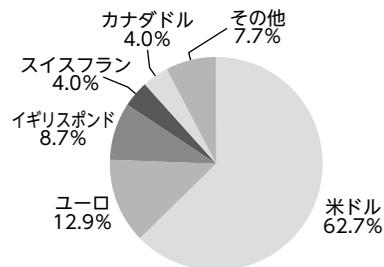
### ○資産別配分



### ○国別配分



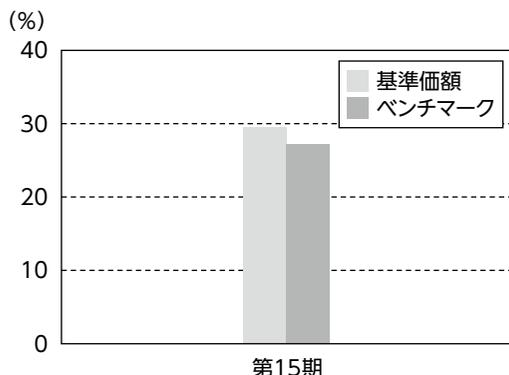
### ○通貨別配分



(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

## 当該投資信託のベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマークに概ね連動しました。差異の主な要因は、プラスの影響としては配当要因\*1、マイナスの影響としては為替評価差要因\*2です。

\*1 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差異要因です。

\*2 ファンドとベンチマークとで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異です。

## 今後の運用方針

原則としてMSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2014年5月30日~2015年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	1円 (0) (-) (-) (-) (0) (-) (1)	0.006% (0.002) (-) (-) (-) (0.000) (-) (0.004)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	3 (3) (-) (-) (-) (-) (0)	0.015 (0.015) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	7 (7) (-) (0)	0.039 (0.039) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、証拠金利息の調整金額等
合計	11	0.060	

(注1) 期中の費用(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2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、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(19,112円)で除して100を乗じたものです。

(注4) -印は該当がないことを示します。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 53,723 (6,338)	千米ドル 310,523 (1,617)	百株 8,953 (902)	千米ドル 44,052 (6,872)
	カ ナ ダ	7,920 (691)	千カナダドル 27,268 (109)	2,632 (52)	千カナダドル 3,705 (634)
	ド イ ツ	4,161 (1,145)	千ユーロ 17,610 (-)	1,266 (-)	千ユーロ 1,675 (111)
	イ タ リ ア	9,683	4,053	703 (470)	354 (375)
	フ ラ ン ス	4,885 (399)	16,540 (-)	391 (0.03)	1,353 (110)
	オ ラ ン ダ	3,158 (470)	5,962 (365)	538	1,458
	ス ペ イ ン	10,342 (63,447)	8,599 (1,009)	38,076 (24,895)	1,113 (826)
	ベ ル ギ ー	296	2,103	17	141
	オ ー ス ト リ ア	122	275	712	306
	ル ク セ ン ブ ル ク	304	600	-	-
	フ ィ ン ラ ン ド	1,097	1,524	143	139
	ア イ ル ラ ン ド	166	451	-	-
	ポ ル ト ガ ル	24,981	497	85	30
国	イ ギ リ ス	49,491 (-)	千イギリスポンド 29,078 (11)	3,951 (381)	千イギリスポンド 2,384 (245)
	ス イ ス	2,584 (2,320)	千スイスフラン 17,945 (3,317)	206 (2,281)	千スイスフラン 1,331 (4,137)
	ス ウ ェ ー デ ン	3,798 (1,380)	千スウェーデンクローナ 51,761 (332)	373 (-)	千スウェーデンクローナ 4,602 (332)
	ノ ル ウ ェ ー	881 (80)	千ノルウェークローネ 9,460 (607)	226 (-)	千ノルウェークローネ 1,506 (607)
	デ ン マ ー ク	845 (51)	千デンマーククローネ 22,697 (-)	123	千デンマーククローネ 3,924
	オ ー ス ト ラ リ ア	13,320 (3,715)	千オーストラリアドル 19,494 (791)	2,393 (175)	千オーストラリアドル 2,057 (621)

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ニュージーランド	百株 2,085 (-)	千ニュージーランドドル 629 (55)	百株 74	千ニュージーランドドル 88
	香 港	15,765 (3,635)	千香港ドル 48,348 (-)	4,022	千香港ドル 4,427
国	シンガポール	8,781 (183)	千シンガポールドル 3,639 (-)	2,503	千シンガポールドル 649
	イスラエル	718 (11)	千イスラエルシェケル 4,892 (92)	23 (-)	千イスラエルシェケル 353 (92)

(注1)金額は受渡代金です。

(注2) ( )内は増資割当、株式転換、株式分割、予約権行使、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。

<投資信託受益証券、投資証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	国				
	アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
	BOSTON PROPERTIES	2	303	-	-
	SL GREEN REALTY CORP	1	231	-	-
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	10	111	-	-
	PROLOGIS INC	8	340	-	-
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2	330	-	-
	CAMDEN PROPERTY TRUST	1	112	-	-
	DUKE REALTY CORP	2	62	-	-
	CROWN CASTLE INTL CORP	6	505	0.685	55
	ESSEX PROPERTY TRUST	1	216	-	-
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	7	544	0.785	55
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	154	0.243	30
	HCP INC	8	363	1	53
	HEALTH CARE REIT INC	8	635	0.761	55
	RAYONIER INC	1	45	8 (-)	216 (87)
	KIMCO REALTY CORP	5	149	-	-
	LIBERTY PROPERTY TRUST	1	56	-	-
	IRON MOUNTAIN INC	6 (9)	242 (285)	1	62

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	MACERICH CO/THE	1	116	—	—
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	12	281	2	53
	PLUM CREEK TIMBER COMMON	2	103	—	—
	REALTY INCOME CORP	4	194	—	—
	REGENCY CENTERS CORP	1	99	—	—
	UDR INC	2	65	—	—
	SIMON PROPERTY GROUP	5	942	0.424	75
	PUBLIC STORAGE	2	459	0.309	57
	VENTAS INC	6	465	—	—
	VORNADO REALTY TRUST	2	247	—	—
	EXTRA SPACE STORAGE INC	7	541	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	1	120	—	—
	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	4	99	—	—
	AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	12	126	—	—
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	11	316	—	—
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	72	51	—	—
	AMERICAN TOWER CORPORATION	7	748	0.625	62
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12	318	—	—
	WP GLIMCHER INC	— (8)	— (—)	8	154
	URBAN EDGE PROPERTIES	— (5)	— (—)	5	125
	EQUINIX INC	0.679 (3)	165 (644)	—	—
	COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	— (7)	— (283)	—	—
	小 計	249 (33)	9,870 (1,213)	31 (—)	1,059 (87)
	カナダ	千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	1	46	—	—
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2	75	—	—
	小 計	4	122	—	—
	フランス	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	ICADE	0.709	60	—	—
	UNIBAIL-RODAMCO SE	1	385	0.209	42
	KLEPIERRE	5	226	—	—

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	GECINA SA	1	126	—	—
	FONCIERE DES REGIONS	0.661	62	(—)	(3)
	FONCIERE DES REGIONS-RTS	(1)	(—)	1	2
	小 計	9 (1)	860 (—)	1 (—)	44 (3)
	オランダ				
	CORIO NV	1	61	5	220
	小 計	1	61	5	220
	ユ ー ロ 計	11 (1)	921 (—)	6 (—)	265 (3)
	イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC	16	127	—	—
	HAMMERSON PLC	12	75	—	—
	INTU PROPERTIES PLC	16	54	—	—
	SEGRO PLC	10	40	—	—
	LAND SECURITIES GROUP PLC	10	127	—	—
	小 計	66	425	—	—
	オーストラリア	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
	MIRVAC GROUP	59	111	—	—
	APA GROUP	33	258	—	—
	GPT GROUP	19	77	—	—
	SYDNEY AIRPORT	12	61	—	—
	STOCKLAND	34	146	—	—
	WESTFIELD CORP	22	184	—	—
	DEXUS PROPERTY GROUP	64	77	(296)	(—)
	GOODMAN GROUP	28	162	—	—
	FEDERATION CENTRES	29	80	—	—
	LEND LEASE GROUP	4	67	—	—
	WESTFIELD RETAIL TRUST	—	—	(165)	(490)
	SCENTRE GROUP	110 (283)	410 (490)	16	57
	小 計	417 (283)	1,637 (490)	16 (461)	57 (490)

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
LINK REIT	21	1,046	—	—
HKT TRUST AND HKT LTD	57	555	—	—
HKT TRUST AND HKT LTD-RTS	— (23)	— (—)	23	41
小 計	78 (23)	1,601 (—)	23	41
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 MALL TRUST	32	63	—	—
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	27	67	— (—)	— (0.07479)
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	33	58	—	—
SUNTEC REIT	173	328	— (—)	— (0.3114)
小 計	265	518	— (—)	— (0.38619)

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( )内は合併・分割・減資・償還による増減分で、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	当 期			
	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 96,987	百万円 96,147	百万円 —	百万円 —

(注) 金額は受渡代金です。

### 株式売買比率

#### <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) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	65,171,641千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	204,214,950千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.31

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

## 利害関係人<sup>\*</sup>との取引状況等

### ■ 利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	D C
為 替 直 物 取 引	百万円 59,349	百万円 29,954	% 50.5	百万円 12,640	百万円 1,848	% 14.6

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## 組入資産の明細

### <外国株式(上場、登録株式)>

銘 柄	当 期 首 (前 期 末)	当 期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(アメリカ)			千 米 ド ル		
ABBOTT LABORATORIES	801	1,016	5,005	619,355	ヘルスケア機器・サービス
AES CORP	372	448	597	73,981	公益事業
INTL BUSINESS MACHINES CORP	519	632	10,856	1,343,258	ソフトウェア・サービス
ACE LTD	178	221	2,380	294,543	保険
AGCO CORP	47	59	307	38,086	資本財
AIRGAS INC	33	42	448	55,440	素材
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	109	136	2,026	250,755	素材
ENERGEN CORP	36	48	325	40,265	エネルギー
ALLEGHANY CORP	8	11	532	65,920	保険
ALLERGAN INC	156	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	488	603	4,310	533,361	素材
RALPH LAUREN CORPORATION	32	39	521	64,570	耐久消費財・アパレル
ALLSTATE CORP	234	280	1,898	234,956	保険
HONEYWELL INTL INC	386	493	5,215	645,285	資本財
ALCOA	576	843	1,069	132,348	素材
HESS CORP	153	173	1,168	144,594	エネルギー
AMERICAN EXPRESS	500	617	4,949	612,349	各種金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	254	327	1,835	227,103	公益事業
AFLAC	244	292	1,832	226,720	保険
AMERICAN INT'L GROUP	725	918	5,458	675,375	保険
JARDEN CORP	—	119	648	80,229	耐久消費財・アパレル
ANADARKO PETROLEUM CORP	264	337	2,828	349,921	エネルギー
TYCO INTERNATIONAL PLC	238	281	1,147	141,977	商業・専門サービス
JONES LANG LASALLE INC	—	31	536	66,405	不動産
VALERO ENERGY CORP	284	347	2,046	253,267	エネルギー
APACHE CORP	206	252	1,508	186,661	エネルギー
ALBEMARLE CORP	43	70	430	53,212	素材
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	345	430	2,265	280,275	食品・飲料・タバコ

\* 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。

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
PINNACLE WEST CAPITAL	61	70	430	53,268	公益事業
AMEREN CORPORATION	132	152	618	76,495	公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	58	65	402	49,850	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AUTOLIV INC	49	60	773	95,760	自動車・自動車部品
AUTOZONE INC	18	21	1,460	180,762	小売
AVERY DENNISON CORP	49	60	382	47,281	素材
AVNET INC	76	90	406	50,293	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AVON PRODUCTS INC	243	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
BAKER HUGHES	232	288	1,863	230,614	エネルギー
BALL CORP	73	84	606	75,095	素材
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	588	775	11,220	1,388,280	各種金融
BANK NEW YORK CO	604	749	3,292	407,333	各種金融
BARD C R INC	40	48	820	101,506	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL	285	361	2,424	300,010	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	101	139	1,977	244,725	ヘルスケア機器・サービス
AMETEK INC	131	155	840	103,995	資本財
VERIZON COMMUNICATIONS	2,208	2,787	13,807	1,708,431	電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	57	70	348	43,060	保険
BEST BUY COMPANY INC	146	218	748	92,612	小売
YUM BRANDS INC	234	291	2,679	331,540	消費者サービス
FIRSTENERGY CORP	217	283	1,023	126,689	公益事業
BLOCK H & R INC	140	174	558	69,143	消費者サービス
BOEING CO	370	448	6,389	790,517	資本財
ROBERT HALF INTL INC	73	93	531	65,790	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	123	156	943	116,791	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	699	889	1,625	201,120	ヘルスケア機器・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	17	18	616	76,298	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	866	1,116	7,722	955,491	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	27	37	849	105,084	各種金融
ONEOK INC	106	132	557	69,012	エネルギー
UNITED RENTALS INC	50	62	593	73,414	資本財
SEMPRA ENERGY	119	159	1,727	213,685	公益事業
FEDEX CORP	157	179	3,134	387,805	運輸
AMPHENOL CORPORATION	80	208	1,201	148,657	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	62	77	731	90,471	食品・飲料・タバコ
QUANTA SERVICES INC	105	140	412	50,999	資本財
CSX CORP	534	664	2,306	285,372	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	106	131	333	41,235	メディア
CABOT OIL & GAS CORP	219	284	963	119,269	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO (US)	104	129	626	77,463	食品・飲料・タバコ
WHITING PETROLEUM CORP	59	140	453	56,126	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	89	110	1,318	163,107	食品・飲料・タバコ
CARDINAL HEALTH	177	220	1,946	240,854	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR	334	382	3,289	407,025	資本財
CORE LABORATORIES N. V.	23	27	323	40,088	エネルギー
CHESAPEAKE ENERGY CORP	276	417	586	72,613	エネルギー
CENTURYLINK INC	306	382	1,303	161,308	電気通信サービス
JPMORGAN CHASE & CO	1,987	2,500	16,551	2,047,862	銀行
CHUBB CORPORATION	128	157	1,552	192,113	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	69	86	728	90,166	家庭用品・パーソナル用品

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CIGNA CORP	141	173	2,360	292,044	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	51	65	353	43,755	資本財
CLOROX COMPANY	70	87	952	117,864	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	2,081	2,781	11,444	1,416,016	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA ENTERPRISES	131	150	673	83,365	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE CO	479	577	3,885	480,725	家庭用品・パーソナル用品
AON PLC	152	190	1,958	242,350	保険
COMERICA INC	95	118	587	72,687	銀行
NRG ENERGY INC	162	213	543	67,222	公益事業
COMPUTER SCIENCES CORP	79	92	638	78,947	ソフトウェア・サービス
CONAGRA	228	286	1,109	137,329	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	152	200	1,241	153,566	公益事業
CMS ENERGY CORP	149	188	644	79,759	公益事業
CAMERON INTERNATIONAL CORP	113	128	657	81,296	エネルギー
THE COOPER COS INC	—	31	571	70,704	ヘルスケア機器・サービス
CORNING	731	858	1,806	223,548	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	98	147	728	90,167	素材
CUMMINS INC	93	116	1,616	200,033	資本財
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	48	54	644	79,712	資本財
DR HORTON INC	165	216	571	70,722	耐久消費財・アパレル
DANAHER CORP	329	420	3,667	453,772	資本財
MOODY'S CORP	98	120	1,315	162,731	各種金融
TARGET (DAYTON HUDSON)	315	402	3,218	398,233	小売
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	34	48	148	18,326	エネルギー
DEERE&CO	184	215	2,015	249,329	資本財
MORGAN STANLEY	772	975	3,778	467,460	各種金融
REPUBLIC SERVICES INC	155	163	656	81,258	商業・専門サービス
THE WALT DISNEY CO	874	1,083	11,973	1,481,494	メディア
DOVER CORP	92	104	796	98,567	資本財
DOW CHEMICAL CO	640	785	4,053	501,501	素材
OMNICOM GROUP	131	166	1,257	155,559	メディア
DTE ENERGY COMPANY	94	119	951	117,738	公益事業
XL GROUP PLC	147	210	791	97,935	保険
DUKE ENERGY CORP	365	469	3,568	441,503	公益事業
FLOWSERVE CORP	72	89	498	61,700	資本財
DARDEN RESTAURANTS INC	66	73	477	59,089	消費者サービス
EMC CORP	1,067	1,332	3,534	437,347	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BANK OF AMERICA CORP	5,551	7,058	11,766	1,455,910	銀行
CITIGROUP	1,594	2,035	11,106	1,374,158	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	83	96	740	91,608	素材
EATON CORP	248	316	2,306	285,361	資本財
EATON VANCE CORP	66	78	320	39,687	各種金融
ECOLAB INC	142	183	2,110	261,101	素材
SALESFORCE.COM INC	295	400	2,907	359,797	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	364	462	2,819	348,908	資本財
ENTERGY CORP	96	122	933	115,552	公益事業
EOG RESOURCES INC	282	364	3,246	401,665	エネルギー
EQUIFAX INC	64	78	790	97,806	商業・専門サービス
EQT CORPORATION	78	102	880	108,961	エネルギー
ESTEE LAUDER CO-CL A	124	155	1,375	170,131	家庭用品・パーソナル用品
EXXON MOBIL	2,268	2,803	23,863	2,952,586	エネルギー

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
FMC CORP	73	85	495	61,308	素材
NEXTERA ENERGY INC	225	299	3,064	379,147	公益事業
FAMILY DOLLAR STORES	55	67	523	64,787	小売
ASSURANT INC	40	47	314	38,861	保険
M & T BANK CORP	63	80	977	120,974	銀行
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	62	—	—	—	自動車・自動車部品
MACY'S INC	189	232	1,579	195,412	小売
FOREST LABORATORIES INC	124	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FRANKLIN RESOURCES INC	216	271	1,398	173,066	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC	546	698	1,408	174,305	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	—	114	556	68,899	保険
GANNETT CO	—	150	540	66,932	メディア
GAP	134	176	679	84,053	小売
GENERAL DYNAMICS CORP	154	187	2,636	326,211	資本財
GENERAL MILLS INC	327	400	2,254	278,900	食品・飲料・タバコ
GENUINE PARTS CO	80	103	955	118,180	小売
STARWOOD HOTELS & RESORTS	101	113	955	118,257	消費者サービス
GARTNER INC	—	60	537	66,518	ソフトウェア・サービス
MCKESSON CORP	118	154	3,663	453,278	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL ELECTRIC CO	5,269	6,747	18,643	2,306,761	資本財
GRAINGER (WW) INC	32	41	1,013	125,446	資本財
HALLIBURTON CO	446	564	2,562	316,996	エネルギー
GOLDMAN SACHS GROUP INC	223	263	5,502	680,787	各種金融
HARLEY-DAVIDSON	116	136	739	91,502	自動車・自動車部品
HARMAN INTL INDS INC	—	47	580	71,783	耐久消費財・アパレル
HARRIS CORP	53	68	542	67,138	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CONSOL ENERGY INC	114	147	419	51,945	エネルギー
DENBURY RESOURCES INC	189	—	—	—	エネルギー
HELMERICH & PAYNE	54	68	503	62,245	エネルギー
HERSHEY FOODS CORPORATION	80	102	959	118,694	食品・飲料・タバコ
HEWLETT-PACKARD CO	997	1,225	4,123	510,255	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CROWN HOLDINGS INC	74	89	502	62,113	素材
REYNOLDS AMERICAN INC	165	213	1,638	202,767	食品・飲料・タバコ
JUNIPER NETWORKS INC	273	243	672	83,215	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLLYFRONTIER CORP	97	124	523	64,780	エネルギー
UNUM GROUP	141	163	575	71,215	保険
HOME DEPOT	739	884	9,925	1,228,075	小売
HORMEL FOODS CORP	81	92	539	66,775	食品・飲料・タバコ
CENTERPOINT ENERGY INC	225	257	525	65,009	公益事業
HUMANA INC	81	99	1,776	219,841	ヘルスケア機器・サービス
RED HAT INC	97	119	930	115,080	ソフトウェア・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS	211	228	2,184	270,279	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	41	53	632	78,287	素材
INT'L PAPER CO	216	270	1,425	176,427	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS	216	268	553	68,464	メディア
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	67	79	343	42,454	資本財
JOHNSON & JOHNSON	1,485	1,864	18,858	2,333,400	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARTFORD FINANCIAL SVCS	225	280	1,161	143,726	保険
JOHNSON CONTROLS INC	348	444	2,355	291,489	自動車・自動車部品
DEVON ENERGY CORPORATION	201	264	1,728	213,917	エネルギー
KELLOGG CO	141	179	1,121	138,726	食品・飲料・タバコ

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
KEY CORP	472	564	838	103,792	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	201	243	2,677	331,262	家庭用品・パーソナル用品
BLACKROCK INC	70	83	3,069	379,745	各種金融
KOHL'S CORP	108	130	855	105,858	小売
KROGER CO	253	310	2,298	284,429	食品・生活必需品小売り
PACKAGING CORP OF AMERICA	—	68	485	60,075	素材
LEGG MASON INC	62	62	332	41,169	各種金融
LEGETT & PLATT INC	71	90	429	53,090	耐久消費財・アパレル
LENNAR CORP-CL A	80	110	524	64,911	耐久消費財・アパレル
LEUCADIA NATIONAL CORP	166	216	540	66,882	各種金融
LILLY (ELI) & CO	525	664	5,078	628,364	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
L BRANDS INC	128	166	1,456	180,266	小売
LINCOLN NATIONAL CORP	137	175	1,012	125,336	保険
UNITED PARCEL SERVICE B	371	466	4,654	575,906	運輸
AGILENT TECHNOLOGIES	169	225	940	116,327	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOCKHEED MARTIN CORP	143	178	3,392	419,707	資本財
LOEWS CORP	178	198	799	98,947	保険
CARNIVAL CORPORATION	199	283	1,336	165,314	消費者サービス
RANGE RESOURCES CORP	88	107	596	73,793	エネルギー
LOWES COMPANIES	541	654	4,612	570,643	小売
DOMINION RESOURCES	300	388	2,757	341,190	公益事業
IRON MOUNTAIN INC	85	—	—	—	商業・専門サービス
SCANA CORP	67	85	457	56,609	公益事業
MDU RESOURCES GROUP INC	88	123	259	32,103	公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	200	250	504	62,477	消費者サービス
MCCORMICK & CO-NON Vtg SHRS	59	74	589	72,964	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	517	645	6,223	770,050	消費者サービス
MCGRAW-HILL FINANCIAL	142	185	1,955	242,010	各種金融
EVEREST RE GROUP LTD	24	29	541	67,010	保険
MANPOWER GROUP	44	52	450	55,719	商業・専門サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	56	72	942	116,600	ヘルスケア機器・サービス
MARSH & MCLENNAN COS	288	361	2,122	262,659	保険
ENERGIZER HOLDINGS INC	34	39	567	70,214	家庭用品・パーソナル用品
MASCO CORP	190	232	641	79,341	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS	23	37	564	69,851	素材
METLIFE INC	493	642	3,398	420,444	保険
MEDTRONIC PLC	525	951	7,349	909,311	ヘルスケア機器・サービス
CVS HEALTH CORP	618	753	7,771	961,560	食品・生活必需品小売り
MERCK & CO	1,543	1,904	11,372	1,407,140	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CRP OF AMER	48	65	777	96,206	ヘルスケア機器・サービス
RACKSPACE HOSTING INC	69	80	336	41,641	ソフトウェア・サービス
3 M COMPANY	332	426	6,857	848,506	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	33	40	757	93,782	耐久消費財・アパレル
MOTOROLA SOLUTIONS INC	125	136	811	100,459	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	57	75	693	85,790	運輸
MURPHY OIL CORP	89	110	481	59,525	エネルギー
XCEL ENERGY INC	269	331	1,129	139,778	公益事業
FORD MOTOR COMPANY	1,908	2,487	3,803	470,545	自動車・自動車部品
NATIONAL OILWELL VARCO INC	224	280	1,399	173,180	エネルギー
NEWELL RUBBERMAID	148	177	707	87,600	耐久消費財・アパレル
DUN & BRADSTREET CORP	20	24	314	38,899	商業・専門サービス

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
NEWMONT MINING CORP	270	321	883	109,361	素材
NIKE B	368	462	4,729	585,147	耐久消費財・アパレル
NOBLE ENERGY INC	188	259	1,131	140,016	エネルギー
NORDSTROM INC	75	91	672	83,194	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	163	206	1,935	239,442	運輸
EVERSOURCE ENERGY	163	207	1,024	126,718	公益事業
NISOURCE INC	168	213	1,012	125,230	公益事業
COACH INC	146	177	625	77,389	耐久消費財・アパレル
NORTHROP GRUMMAN CORP	108	128	2,055	254,337	資本財
WELLS FARGO & CO	2,624	3,282	18,449	2,282,794	銀行
NUCOR CORP	166	215	1,026	127,007	素材
MONSANTO CO	273	322	3,825	473,366	素材
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	298	370	3,120	386,093	各種金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	418	517	4,023	497,813	エネルギー
OCEANEERING INTL INC	53	71	364	45,125	エネルギー
OGE ENERGY CORP	111	127	402	49,744	公益事業
OMNICARE INC	58	64	614	76,046	ヘルスケア機器・サービス
ORACLE CORP	1,899	2,350	10,307	1,275,313	ソフトウェア・サービス
OWENS-ILLINOIS INC	82	—	—	—	素材
PALL CORP	59	69	863	106,779	資本財
EXELON CORP	448	574	1,950	241,347	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	77	97	1,190	147,245	資本財
PARTNERRE LTD	25	29	393	48,648	保険
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	59	59	326	40,429	保険
PPL CORPORATION	329	454	1,583	195,909	公益事業
PEPSICO INC	797	991	9,618	1,190,115	食品・飲料・タバコ
PENTAIR PLC	107	121	780	96,567	資本財
PERRIGO CO PLC	68	95	1,856	229,667	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER	3,350	4,104	14,135	1,749,000	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CONOCOPHILLIPS	643	828	5,293	654,978	エネルギー
PG&E CORP	232	317	1,695	209,812	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES	75	101	1,510	186,899	エネルギー
ALTRIA GROUP INC	1,038	1,309	6,760	836,414	食品・飲料・タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	279	349	3,358	415,495	銀行
POLARIS INDUSTRIES INC	33	40	589	72,984	耐久消費財・アパレル
AETNA INC	194	234	2,729	337,730	ヘルスケア機器・サービス
FLUOR CORP	88	100	566	70,058	資本財
PPG INDUSTRIES INC	75	91	2,113	261,550	素材
PRAXAIR INC	155	194	2,392	295,996	素材
PRECISION CASTPARTS CORP	76	95	2,056	254,426	資本財
QUEST DIAGNOSTICS	72	91	694	85,974	ヘルスケア機器・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	1,423	1,811	14,368	1,777,842	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	297	404	1,110	137,372	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	263	339	1,463	181,076	公益事業
PULTE GROUP INC	178	205	400	49,497	耐久消費財・アパレル
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	246	283	501	62,104	銀行
TIME WARNER INC	469	556	4,715	583,507	メディア
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	64	86	506	62,721	各種金融
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	21	32	334	41,353	保険
AUTONATION INC	40	50	317	39,327	小売
RESMED INC	79	89	524	64,875	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
US BANCORP	948	1,186	5,186	641,708	銀行
RITE AID CORP	—	683	594	73,582	食品・生活必需品小売り
ROCK-TENN COMPANY -CL A	36	93	619	76,704	素材
ROPER TECHNOLOGIES INC	51	67	1,192	147,604	資本財
PEABODY ENERGY CORP	142	—	—	—	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	70	91	1,135	140,471	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	87	113	864	106,990	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	169	205	2,149	265,993	資本財
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	53	—	—	—	エネルギー
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	26	42	1,289	159,500	ソフトウェア・サービス
FMC TECHNOLOGIES INC	127	152	640	79,290	エネルギー
ACCENTURE PLC-CL A	329	417	4,043	500,298	ソフトウェア・サービス
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	85	109	526	65,146	保険
SAFEWAY INC	120	—	—	—	食品・生活必需品小売り
ROCKWELL COLLIN	66	91	883	109,316	資本財
ST JUDE MEDICAL INC	148	186	1,384	171,362	ヘルスケア機器・サービス
TRAVELERS COS INC/THE	187	214	2,190	271,069	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	152	190	1,209	149,696	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER	684	852	7,728	956,264	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	606	783	2,499	309,226	各種金融
JOY GLOBAL INC	52	—	—	—	資本財
ZIMMER HOLDINGS INC	88	112	1,275	157,862	ヘルスケア機器・サービス
SPX CORP	19	—	—	—	資本財
BUNGE LIMITED	79	93	857	106,137	食品・飲料・タバコ
ANTHEM INC	148	179	2,950	365,050	ヘルスケア機器・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	120	139	1,573	194,724	ヘルスケア機器・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	153	198	1,036	128,259	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	44	54	1,590	196,785	素材
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	77	—	—	—	エネルギー
CENTENE CORP	—	78	566	70,061	ヘルスケア機器・サービス
ACUITY BRANDS INC	—	30	537	66,515	資本財
SNAP-ON INC	—	38	596	73,747	資本財
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	243	303	2,586	319,971	保険
ADVANCE AUTO PARTS	37	46	720	89,161	小売
SOUTHWESTERN ENERGY CO	190	243	625	77,397	エネルギー
EDISON INTL	161	222	1,357	167,919	公益事業
SOUTHERN CO	466	598	2,605	322,395	公益事業
BB&T CORP	368	489	1,953	241,725	銀行
INGERSOLL-RAND PLC	148	178	1,240	153,449	資本財
SOUTHWEST AIRLINES CO	82	111	409	50,723	運輸
AT&T INC	2,777	3,482	12,118	1,499,414	電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,001	1,261	13,024	1,611,476	エネルギー
MEADWESTVACO CORP	88	110	567	70,184	素材
STANLEY BLACK&DECKER	74	108	1,117	138,283	資本財
STATE STREET CORP	226	278	2,204	272,804	各種金融
STRYKER CORP	178	227	2,187	270,687	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS	274	349	1,505	186,230	銀行
SYSCO CORP	298	404	1,505	186,261	食品・生活必需品小売り
TESORO CORP	72	82	733	90,770	エネルギー
TEXTRON	144	175	808	100,017	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	205	265	3,457	427,787	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
NOBLE CORP PLC	126	—	—	—	エネルギー
TIFFANY & CO	68	89	851	105,330	小売
TOLL BROTHERS INC	81	111	405	50,214	耐久消費財・アパレル
TORCHMARK CORP	48	83	480	59,464	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	93	109	451	55,860	ソフトウェア・サービス
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	89	116	978	121,059	ヘルスケア機器・サービス
TYSON FOODS INC	145	207	879	108,870	食品・飲料・タバコ
MARATHON OIL CORP	371	453	1,234	152,796	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	239	589	5,973	739,057	運輸
UNITED TECHNOLOGIES CORP	453	546	6,436	796,383	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	522	636	7,607	941,317	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	50	63	827	102,333	ヘルスケア機器・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	55	67	588	72,778	ヘルスケア機器・サービス
VF CORP	180	235	1,673	207,019	耐久消費財・アパレル
CBS CORP-CL B	296	306	1,902	235,414	メディア
VULCAN MATERIALS CO	66	92	833	103,095	素材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	470	—	—	—	食品・生活必需品小売り
WAL-MART STORES	846	1,082	8,102	1,002,482	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	232	312	1,557	192,694	商業・専門サービス
WATERS CORP	42	53	715	88,563	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACTAVIS PLC	89	253	7,921	980,172	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JM SMUCKER CO	56	66	789	97,704	食品・飲料・タバコ
WABTEC CORP	—	62	630	77,965	資本財
WEYERHAEUSER CO	297	339	1,120	138,628	不動産
WHIRLPOOL CORP	42	52	984	121,809	耐久消費財・アパレル
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	398	528	719	88,994	エネルギー
NABORS INDUSTRIES LTD	139	185	269	33,311	エネルギー
WILLIAMS COS	357	473	2,426	300,277	エネルギー
DICK'S SPORTING GOODS INC	53	63	342	42,434	小売
PEPCO HOLDINGS INC	143	164	445	55,175	公益事業
ALLIANT ENERGY CORPORATION	61	70	435	53,839	公益事業
WISCONSIN ENERGY CORP	122	144	700	86,666	公益事業
FOOT LOCKER INC	—	93	592	73,330	小売
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	39	55	402	49,766	公益事業
TD AMERITRADE HOLDING CORP	144	178	671	83,022	各種金融
CARMAX INC	120	140	1,020	126,237	小売
XEROX CORP	591	690	794	98,287	ソフトウェア・サービス
CIMAREX ENERGY CO	43	64	742	91,860	エネルギー
TJX COMPANIES INC	376	460	3,038	375,995	小売
HOSPIRA INC	92	114	1,010	124,998	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	260	—	—	—	保険
CBRE GROUP INC-A	144	190	728	90,085	不動産
REGIONS FINL CORP	725	932	953	117,953	銀行
WESTLAKE CHEMICAL CORP	24	32	230	28,517	素材
LAS VEGAS SANDS CORP	216	268	1,371	169,639	消費者サービス
MOSAIC CO/THE	170	216	1,008	124,820	素材
HERBALIFE LTD	44	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	82	101	698	86,372	素材
MOLSON COORS BREWING CO -B	77	106	793	98,232	食品・飲料・タバコ
IHS INC-CLASS A	35	44	557	68,995	商業・専門サービス
ASHLAND INC	39	41	526	65,161	素材

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	29	31	1,027	127,114	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	103	123	1,568	194,111	各種金融
FIDELITY NATIONAL FINL-A	129	—	—	—	保険
GAMESTOP CORP-CLASS A	56	74	306	37,927	小売
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	59	75	1,780	220,288	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	82	113	887	109,761	耐久消費財・アパレル
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	16	20	1,307	161,830	消費者サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	53	61	327	40,537	運輸
TRANSDIGM GROUP INC	25	36	829	102,625	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	541	674	6,264	775,085	ソフトウェア・サービス
OCWEN FINANCIAL CORP	61	—	—	—	銀行
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	71	80	689	85,277	消費者サービス
HANESBRANDS INC	—	254	811	100,379	耐久消費財・アパレル
WESTERN UNION CO	284	346	759	93,980	ソフトウェア・サービス
KBR INC	81	—	—	—	資本財
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	243	255	516	63,948	運輸
SPECTRA ENERGY CORP	350	437	1,530	189,316	エネルギー
TIME WARNER CABLE-A	145	186	3,403	421,146	メディア
DELTA AIR LINES INC	106	133	563	69,720	運輸
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	25	62	284	35,161	エネルギー
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	253	303	1,790	221,553	各種金融
COVIDIEN PLC	233	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
TE CONNECTIVITY LTD	216	271	1,890	233,850	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CONCHO RESOURCES INC	56	80	940	116,379	エネルギー
WABCO HOLDINGS INC	—	38	497	61,585	資本財
VMWARE INC-CLASS A	46	54	475	58,844	ソフトウェア・サービス
TERADATA CORP	83	95	368	45,577	ソフトウェア・サービス
INVESCO LTD	227	289	1,169	144,721	各種金融
NETSUITE INC	17	22	218	26,984	ソフトウェア・サービス
CALPINE CORP	172	252	513	63,568	公益事業
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	833	1,039	8,755	1,083,364	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	263	1,323	9,204	1,138,858	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	105	131	1,010	124,999	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC	95	115	611	75,633	公益事業
LORILLARD INC	188	245	1,777	219,916	食品・飲料・タバコ
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	42	49	332	41,099	メディア
SIGNET JEWELERS LTD	—	49	650	80,455	小売
MARATHON PETROLEUM CORP	154	181	1,869	231,299	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	—	110	515	63,795	資本財
CAREFUSION CORP	114	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
KINDER MORGAN INC	352	1,218	5,072	627,592	エネルギー
XYLEM INC	100	117	430	53,205	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	243	272	2,768	342,526	素材
PVH CORP	41	52	548	67,836	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A	53	72	1,420	175,808	ソフトウェア・サービス
FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD	—	77	343	42,535	半導体・半導体製造装置
HCA HOLDINGS INC	169	228	1,866	230,913	ヘルスケア機器・サービス
NIELSEN NV	143	231	1,043	129,115	商業・専門サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	37	50	772	95,606	ソフトウェア・サービス
ENSCO PLC-CL A	121	148	357	44,229	エネルギー
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	105	138	1,340	165,868	食品・飲料・タバコ

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	66	88	544	67,424	銀行
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	145	199	200	24,843	エネルギー
CIT GROUP INC	98	120	562	69,625	銀行
LEAR CORP	—	53	619	76,590	自動車・自動車部品
DOLLAR GENERAL CORP	168	203	1,484	183,658	小売
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	—	192	1,070	132,453	電気通信サービス
REALOGY HOLDINGS CORP	74	94	446	55,293	不動産
TOWERS WATSON & CO-CL A	34	—	—	—	商業・専門サービス
QEP RESOURCES INC	99	—	—	—	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	83	118	660	81,691	資本財
GENERAL MOTORS CO	668	976	3,551	439,456	自動車・自動車部品
VANTIV INC - CL A	63	97	388	48,038	ソフトウェア・サービス
ALLY FINANCIAL INC	—	272	619	76,702	各種金融
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	98	139	637	78,847	耐久消費財・アパレル
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	160	198	1,737	214,975	自動車・自動車部品
PHILLIPS 66	308	362	2,886	357,119	エネルギー
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	—	20	405	50,197	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	30	54	386	47,775	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADT CORPORATION	107	114	422	52,330	商業・専門サービス
SERVICENOW INC	65	91	714	88,419	ソフトウェア・サービス
WHITEWAVE FOODS CO	—	121	588	72,871	食品・飲料・タバコ
PALO ALTO NETWORKS INC	—	44	742	91,808	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WORKDAY INC-CLASS A	46	68	545	67,436	ソフトウェア・サービス
ABBVIE INC	829	1,071	7,229	894,444	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
T-MOBILE US INC	127	196	753	93,252	電気通信サービス
ZOETIS INC	260	317	1,558	192,791	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC	—	78	1,022	126,473	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SPRINT CORP	419	533	247	30,572	電気通信サービス
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	—	128	478	59,233	ヘルスケア機器・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	27	38	155	19,216	エネルギー
TWITTER INC	61	332	1,223	151,387	ソフトウェア・サービス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	—	338	994	123,074	消費者サービス
ARAMARK	—	117	370	45,813	消費者サービス
VOYA FINANCIAL INC	73	155	708	87,620	各種金融
FNF GROUP	—	162	622	77,055	保険
SYNCHRONY FINANCIAL	—	115	375	46,508	各種金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	—	226	608	75,260	銀行
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	—	83	281	34,846	素材
CHENIERE ENERGY INC	118	154	1,168	144,593	エネルギー
AMAZON.COM	205	264	11,298	1,397,917	小売
ADOBE SYSTEMS INC	250	339	2,716	336,074	ソフトウェア・サービス
ALTERA CORPORATION	172	200	939	116,231	半導体・半導体製造装置
AMGEN	396	509	8,021	992,544	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANALOG DEVICES	158	206	1,407	174,111	半導体・半導体製造装置
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	103	137	2,277	281,791	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMCAST CORP-CL A	1,124	1,424	8,409	1,040,504	メディア
ANSYS INC	52	59	537	66,476	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	469	3,914	51,587	6,382,940	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS	619	815	1,661	205,534	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	115	146	796	98,589	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESS	253	321	2,761	341,673	ソフトウェア・サービス

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
BED BATH & BEYOND INC	109	125	899	111,349	小売
B/E AEROSPACE INC	54	69	410	50,784	資本財
COMCAST CORP-SPECIAL A	241	266	1,560	193,045	メディア
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	75	93	585	72,412	運輸
VERISIGN INC	66	75	479	59,326	ソフトウェア・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,676	1,660	630	78,056	メディア
SEAGATE TECHNOLOGY	167	225	1,272	157,411	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELGENE CORP	213	538	6,187	765,634	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	101	103	678	83,943	ソフトウェア・サービス
CERNER CORP	161	205	1,405	173,916	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	87	98	505	62,593	保険
CINTAS CORP	55	64	556	68,845	商業・専門サービス
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	530	691	357	44,253	電気通信サービス
CISCO SYSTEMS	2,707	3,438	10,090	1,248,508	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EQUINIX INC	27	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MARRIOTT INTL A	125	145	1,152	142,656	消費者サービス
CA INC	165	211	648	80,254	ソフトウェア・サービス
DIRECTV	258	317	2,903	359,227	メディア
CREE INC	66	—	—	—	半導体・半導体製造装置
BROADCOM CORP-CL A	278	363	2,046	253,197	半導体・半導体製造装置
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	316	406	2,633	325,783	ソフトウェア・サービス
DOLLAR TREE INC	112	141	1,077	133,288	小売
EBAY	646	730	4,425	547,602	ソフトウェア・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	—	200	597	73,938	各種金融
DISH NETWORK CORPORATION-A	113	149	1,053	130,342	メディア
ELECTRONIC ARTS INC	154	209	1,325	164,051	ソフトウェア・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	110	124	571	70,658	運輸
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	407	487	4,347	537,933	ヘルスケア機器・サービス
FASTENAL CO	146	191	814	100,787	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	462	565	1,164	144,097	銀行
FISERV INC	131	164	1,326	164,076	ソフトウェア・サービス
FLIR SYSTEMS INC	68	92	287	35,575	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOSSIL GROUP INC	24	—	—	—	耐久消費財・アパレル
FLEXTRONICS INTL LTD	335	386	471	58,376	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	79	90	472	58,446	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	807	999	11,274	1,394,938	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	—	186	597	73,879	自動車・自動車部品
NVIDIA CORP	298	352	781	96,667	半導体・半導体製造装置
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	65	82	725	89,746	食品・飲料・タバコ
NUANCE COMMUNICATIONS INC	120	175	298	36,968	ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	73	95	1,234	152,729	食品・飲料・タバコ
HASBRO INC	59	69	505	62,561	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	44	54	779	96,446	ヘルスケア機器・サービス
F5 NETWORKS INC	38	47	597	73,912	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	66	86	978	121,115	電気通信サービス
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	32	586	72,585	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HOLOGIC INC	115	167	590	73,107	ヘルスケア機器・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	72	108	1,384	171,253	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUDSON CITY BANCORP INC	276	335	321	39,840	銀行
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	47	61	517	64,074	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	—	532	600	74,287	銀行

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
BIOGEN INC	124	156	6,262	774,842	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC	138	176	1,854	229,499	ソフトウェア・サービス
ISIS PHARMACEUTICALS INC	—	76	511	63,267	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTEL CORP	2,612	3,181	10,818	1,338,599	半導体・半導体製造装置
INCYTE CORP	—	106	1,146	141,856	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KLA-TENCOR CORP	89	107	645	79,807	半導体・半導体製造装置
LAM RESEARCH CORP	87	102	843	104,415	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	90	115	886	109,719	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP	120	166	801	99,135	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	179	219	567	70,187	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	146	184	640	79,229	半導体・半導体製造装置
ACTIVISION BLIZZARD INC	251	350	902	111,712	ソフトウェア・サービス
MICROSOFT CORP	4,136	5,240	24,866	3,076,715	ソフトウェア・サービス
MICRON TECHNOLOGY	557	718	2,030	251,269	半導体・半導体製造装置
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	99	130	635	78,629	半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	194	249	353	43,799	半導体・半導体製造装置
MYLAN NV	199	281	2,044	252,928	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	68	97	2,036	251,930	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	184	205	684	84,737	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NORTHERN TRUST CORP	118	150	1,140	141,160	各種金融
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	54	68	1,516	187,649	小売
PACCAR INC	181	237	1,544	191,161	資本財
PATTERSON COMPANIES INC	46	55	264	32,685	ヘルスケア機器・サービス
PAYCHEX INC	171	220	1,091	135,056	ソフトウェア・サービス
PETSMART INC	50	—	—	—	小売
PHARMACYCLICS INC	35	43	1,130	139,867	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARMIN LTD	57	76	351	43,503	耐久消費財・アパレル
COSTCO WHOLESALE CORP	230	296	4,282	529,927	食品・生活必需品小売り
PRICE T ROWE GROUP INC	133	174	1,414	174,997	各種金融
QUALCOMM	888	1,102	7,786	963,368	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REGENERON PHARMACEUTICALS	40	50	2,586	320,054	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	68	88	566	70,043	保険
ROSS STORES INC	110	140	1,363	168,665	小売
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	891	1,102	4,462	552,195	食品・飲料・タバコ
SANDISK CORP	122	140	978	121,027	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PRICELINE GROUP INC/THE	27	34	4,137	511,890	小売
SEI INVESTMENTS COMPANY	69	94	449	55,648	各種金融
SIGMA-ALDRICH	64	80	1,116	138,156	素材
STAPLES INC	341	416	687	85,070	小売
STARBUCKS CORP	397	1,009	5,230	647,211	消費者サービス
NETFLIX INC	29	38	2,437	301,642	小売
STERICYCLE INC	46	54	756	93,565	商業・専門サービス
SYMANTEC CORP	354	465	1,155	142,933	ソフトウェア・サービス
SYNOPSIS INC	81	107	536	66,439	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	20	23	1,152	142,636	ヘルスケア機器・サービス
TEXAS INSTRUMENTS	567	702	3,928	486,033	半導体・半導体製造装置
TRACTOR SUPPLY COMPANY	75	89	788	97,564	小売
TRIMBLE NAVIGATION LTD	129	170	405	50,208	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	121	160	2,045	253,109	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
URBAN OUTFITTERS INC	61	73	253	31,318	小売
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	—	578	4,976	615,799	食品・生活必需品小売り

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
WESTERN DIGITAL CORP	117	158	1,568	194,110	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	—	128	1,382	171,049	半導体・半導体製造装置	
WYNN RESORTS LTD	41	55	569	70,494	消費者サービス	
WHOLE FOODS MKT INC	195	241	1,020	126,280	食品・生活必需品小売り	
NASDAQ OMX GROUP	63	76	397	49,243	各種金融	
CME GROUP INC	166	212	1,997	247,206	各種金融	
LQ4 CORP	155	197	569	70,480	小売	
XILINX INC	138	169	808	100,034	半導体・半導体製造装置	
YAHOO	509	599	2,583	319,663	ソフトウェア・サービス	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	52	668	82,771	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	110	173	1,000	123,758	メディア	
GOOGLE INC-CL A	147	193	10,704	1,324,472	ソフトウェア・サービス	
MEDIVATION INC	—	50	658	81,481	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	228	296	1,001	123,875	メディア	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	768	886	3,011	372,596	メディア	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	79	98	323	40,087	メディア	
EXPEDIA INC	57	66	730	90,342	小売	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	272	424	2,272	281,177	メディア	
VIACOM INC-CLASS B	203	232	1,564	193,626	メディア	
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	243	291	824	102,019	小売	
WINDSTREAM HOLDINGS INC	331	—	—	—	電気通信サービス	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	182	218	339	42,041	銀行	
LULULEMON ATHLETICA INC	51	71	435	53,910	耐久消費財・アパレル	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	31	39	623	77,205	小売	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	47	182	564	69,865	メディア	
ALKERMES PLC	—	94	564	69,831	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	127	168	2,405	297,580	半導体・半導体製造装置	
SPLUNK INC	—	86	615	76,186	ソフトウェア・サービス	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	81	110	809	100,170	商業・専門サービス	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	—	38	692	85,733	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHARTER COMMUNICATION-A	38	57	1,015	125,645	メディア	
TOWERS WATSON & CO-CL A	—	44	618	76,559	商業・専門サービス	
TESLA MOTORS INC	43	64	1,614	199,769	自動車・自動車部品	
TRIPADVISOR INC	63	76	587	72,665	小売	
LIBERTY MEDIA CORP	49	63	243	30,110	メディア	
FACEBOOK INC-A	986	1,354	10,859	1,343,624	ソフトウェア・サービス	
KRAFT FOODS GROUP INC	312	391	3,334	412,568	食品・飲料・タバコ	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	—	97	532	65,919	消費者サービス	
NEWS CORP-CLASS A	201	231	355	43,965	メディア	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	94	122	514	63,639	運輸	
FIREEYE INC	33	79	370	45,869	ソフトウェア・サービス	
ENDO INTERNATIONAL PLC	74	112	931	115,315	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GOOGLE INC-CL C	150	206	11,165	1,381,555	ソフトウェア・サービス	
NAVIENT CORP	226	253	488	60,408	各種金融	
LIBERTY MEDIA CORP-C	—	130	495	61,329	メディア	
CDK GLOBAL INC	—	95	519	64,270	ソフトウェア・サービス	
QORVO INC	—	103	849	105,118	半導体・半導体製造装置	
ZILLOW GROUP INC - CL A	—	31	288	35,690	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	159,422	209,628	1,299,916	160,838,662
	584	607	—	<59.1%>		

銘柄	当期末(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(カナダ)			千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES	100	138	550	54,861	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	210	295	1,431	142,545	食品・生活必需品小売り
BARRICK GOLD CORP	598	751	1,121	111,720	素材
ATCO LTD -CLASS I	40	52	226	22,599	公益事業
TALISMAN ENERGY INC	559	—	—	—	エネルギー
BANK MONTREAL	332	433	3,343	333,021	銀行
BANK NOVA SCOTIA	641	812	5,244	522,411	銀行
NATIONAL BANK OF CANADA	176	232	1,144	114,044	銀行
BCE INC	139	103	563	56,161	電気通信サービス
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	286	572	2,556	254,674	不動産
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	168	212	6,395	637,017	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOMBARDIER B	713	1,578	404	40,248	資本財
SAPUTO INC	62	167	575	57,360	食品・飲料・タバコ
CGI GROUP INC - CL A	121	144	760	75,798	ソフトウェア・サービス
CAE INC	120	184	275	27,480	資本財
CAMECO CORP	211	287	531	52,933	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	198	233	1,005	100,124	電気通信サービス
CANADIAN IMPERIAL BANK	206	267	2,559	254,936	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	561	733	2,805	279,449	エネルギー
CANADIAN TIRE CORP -CL A	41	52	696	69,396	小売
CANADIAN UTILITIES LTD A	57	72	267	26,609	公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	435	544	4,026	401,124	運輸
FIRST CAPITAL REALTY INC	55	111	211	21,082	不動産
AGRIUM INC	75	92	1,216	121,174	素材
YAMANA GOLD INC	373	596	267	26,619	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	56	172	682	68,019	耐久消費財・アパレル
OPEN TEXT CORP	62	80	426	42,452	ソフトウェア・サービス
ELDORADO GOLD CORP	340	456	273	27,261	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	28	38	345	34,457	食品・生活必需品小売り
VERMILION ENERGY INC	50	71	376	37,463	エネルギー
FINNING INTERNATIONAL INC	89	117	293	29,236	資本財
FORTIS INC	119	178	681	67,844	公益事業
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	303	396	642	64,034	素材
TELUS CORP	164	164	699	69,722	電気通信サービス
GREAT-WEST LIFECO INC	151	196	722	71,988	保険
IMPERIAL OIL	158	192	936	93,297	エネルギー
ENBRIDGE	445	569	3,443	342,966	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	58	76	324	32,342	各種金融
JEAN COUTU GROUP INC A	—	55	128	12,808	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	950	1,324	3,049	303,797	保険
LOBLAW COMPANIES LTD	115	147	946	94,242	食品・生活必需品小売り
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	149	—	—	—	エネルギー
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	51	69	296	29,582	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	117	269	1,939	193,157	自動車・自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	314	417	1,668	166,181	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	10	13	836	83,306	保険
METRO INC	45	157	549	54,721	食品・生活必需品小売り
HUSKY ENERGY INC	185	226	554	55,248	エネルギー
METHANEX CORP	50	64	448	44,629	素材
ONEX CORP	43	59	426	42,453	各種金融

銘柄	当期末(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
TRANSCANADA CORP	364	477	2,607	259,774	エネルギー
GOLDCORP INC	416	580	1,284	127,986	素材
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	452	561	2,259	225,106	素材
POWER CORP OF CANADA	188	241	783	78,054	保険
POWER FINANCIAL CORP	133	166	604	60,189	保険
ROYAL BANK OF CANADA	760	972	7,783	775,338	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	80	118	531	52,966	資本財
CP RAILWAY LIMITED	93	107	2,254	224,603	運輸
ENCANA CORP	399	579	904	90,113	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	207	257	712	70,939	メディア
NEW GOLD INC	296	—	—	—	素材
SUNCOR ENERGY	770	973	3,551	353,785	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B	291	372	562	56,015	素材
THOMSON REUTERS CORP	202	232	1,166	116,157	メディア
TORONTO-DOMINION BANK	969	1,251	6,927	690,032	銀行
TRANSALTA CORP	156	156	168	16,804	公益事業
WEST FRASER TIMBER CO LTD	—	43	299	29,873	素材
WESTON (GEORGE) LTD	26	35	362	36,136	食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP	556	819	236	23,519	素材
INTACT FINANCIAL CORP	70	85	759	75,636	保険
SILVER WHEATON CORP	188	286	675	67,286	素材
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	—	45	143	14,269	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	—	12	637	63,522	ソフトウェア・サービス
CATAMARAN CORPORATION	110	134	1,005	100,142	ヘルスケア機器・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	72	101	656	65,443	素材
CI FINANCIAL CORP	82	150	527	52,514	各種金融
VERESEN INC	—	230	427	42,583	エネルギー
BELL ALIANT INC	52	—	—	—	電気通信サービス
TOURMALINE OIL CORP	87	115	452	45,024	エネルギー
KEYERA CORP	37	112	452	45,120	エネルギー
ALTAGAS INCOME LTD	69	87	348	34,690	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	172	243	981	97,791	エネルギー
TIM HORTONS INC	73	—	—	—	消費者サービス
DOLLARAMA INC	36	83	584	58,218	小売
BAYTEX ENERGY CORP	60	172	355	35,456	エネルギー
MEG ENERGY CORP	83	111	217	21,713	エネルギー
ATHABASCA OIL CORPORATION	200	—	—	—	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	392	566	1,163	115,849	エネルギー
ENERPLUS CORP	104	149	176	17,594	エネルギー
PENN WEST PETROLEUM LTD	230	—	—	—	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	167	213	480	47,833	エネルギー
CANADIAN OIL SANDS LTD	260	289	309	30,829	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	67	91	303	30,240	エネルギー
CRESCENT POINT ENERGY CORP	210	295	828	82,532	エネルギー
PENGROWTH ENERGY CORP	314	—	—	—	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	160	211	658	65,599	エネルギー
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	—	92	298	29,712	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	—	127	607	60,472	消費者サービス
CONSTELLATION SOFTWARE -RTS	—	12	0,309	30	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	20,230	26,157	104,930	10,452,119
	銘柄 数 <比率>	91	91	—	<3.8%>

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	109	141	1,034	140,229	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG	504	757	928	125,917	銀行
FRESENIUS SE&CO KGAA	64	254	1,475	200,092	ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	56	79	343	46,545	ソフトウェア・サービス
FUCHS PETROLUB SE -PREF	21	42	171	23,275	素材
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	32	39	354	48,064	保険
GEA GROUP AG	98	116	523	70,952	資本財
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-RIGISTERED	117	139	622	84,483	メディア
CONTINENTAL AG	57	72	1,553	210,606	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	508	647	1,823	247,323	運輸
AXEL SPRINGER SE	24	24	128	17,386	メディア
MERCK KGAA	35	90	909	123,312	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE STAMM	254	309	677	91,834	公益事業
SAP SE	483	664	4,523	613,488	ソフトウェア・サービス
E.ON SE	1,050	1,339	1,832	248,504	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	61	71	668	90,617	家庭用品・パーソナル用品
METRO STAMM	85	105	337	45,773	食品・生活必需品小売り
BAYER	434	556	7,427	1,007,272	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	92	119	1,323	179,506	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	482	609	5,260	713,325	素材
CELESIO AG	25	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
BEIERSDORF AG	54	64	536	72,807	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	12	—	—	—	資本財
HEIDELBERGCEMENT AG	76	89	681	92,357	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	111	146	1,162	157,615	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE-REG	244	309	4,539	615,640	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	121	147	194	26,319	運輸
MUENCHENER RUECKVERSICH.	94	117	2,014	273,217	保険
VOLKSWAGEN STAMM	15	25	571	77,564	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG-PFD	74	108	2,459	333,503	自動車・自動車部品
DAIMLER AG	505	649	5,688	771,357	自動車・自動車部品
MAN SE	16	23	219	29,716	資本財
THYSSEN KRUPP	242	258	638	86,568	素材
SIEMENS	416	526	5,128	695,433	資本財
LINDE AG	97	124	2,213	300,183	素材
DEUTSCHE BANK NAMEN	538	935	2,620	355,412	各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	170	220	2,275	308,615	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	26	35	276	37,557	自動車・自動車部品
K+S AG	83	142	441	59,900	素材
DEUTSCHE TELEKOM	1,636	2,111	3,396	460,650	電気通信サービス
INFINEON TECHNOLOGIES	585	791	962	130,567	半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE BOERSE	101	133	994	134,896	各種金融
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	79	103	854	115,812	自動車・自動車部品
FRAPORT AG	23	23	141	19,224	運輸
LANXESS	48	58	300	40,770	素材
SKY DEUTSCHLAND AG	232	—	—	—	メディア
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	161	186	423	57,455	不動産
SYMRISE AG	—	81	472	64,030	素材
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	13	13	162	21,977	メディア
BRENNTAG AG	27	98	550	74,600	資本財

銘柄	株数 (百株)	当期			業種	
		株数 (百株)	期末			
			外貨建金額	評価額 邦貨換算金額 (千円)		
EVONIK INDUSTRIES AG	—	74	254	34,461	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	167	375	190	25,816	電気通信サービス	
HUGO BOSS AG	16	46	486	65,975	耐久消費財・アパレル	
OSRAM LICHT AG	47	56	281	38,175	資本財	
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIE	—	234	690	93,679	不動産	
DEUTSCHE WOHNEN AG-RTS	—	186	2	278	不動産	
国小計	株数・金額 銘柄数<比率>	10,645	14,685	73,745	10,000,656	
		52	53	—	<3.7%>	
(イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	632	812	1,460	198,108	保険	
INTESA SANPAOLO	6,304	8,696	2,915	395,332	銀行	
INTESA SANPAOLO-RNC	650	650	189	25,685	銀行	
UNICREDIT SPA	2,354	3,318	2,127	288,468	銀行	
MEDIOBANCA	304	419	395	53,696	各種金融	
PIRELLI & CO	110	161	250	33,955	自動車・自動車部品	
SAIPEM	159	159	185	25,141	エネルギー	
LUXOTTICA GROUP SPA	90	111	679	92,130	耐久消費財・アパレル	
FIAT ORD	470	—	—	—	自動車・自動車部品	
FINMECCANICA SPA	211	289	353	47,881	資本財	
ENEL	3,505	4,815	2,145	290,980	公益事業	
ENI	1,344	1,713	2,839	385,035	エネルギー	
SNAM SPA	1,100	1,373	618	83,839	公益事業	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	458	658	496	67,396	銀行	
TELECOM ITALIA ORD	5,445	6,785	772	104,717	電気通信サービス	
TELECOM ITALIA RNC	3,194	4,127	373	50,714	電気通信サービス	
ATLANTIA SPA	232	271	640	86,849	運輸	
TERNA SPA	836	949	412	55,932	公益事業	
EXOR SPA	58	73	334	45,362	各種金融	
PRYSMIAN SPA	108	147	306	41,566	資本財	
ENEL GREEN POWER SPA	926	1,232	210	28,525	公益事業	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	470	711	177	24,126	保険	
国小計	株数・金額 銘柄数<比率>	28,969	37,478	17,885	2,425,445	
		22	21	—	<0.9%>	
(フランス)						
BOUYGUES ORD	97	139	512	69,567	資本財	
AIR LIQUIDE	161	230	2,762	374,569	素材	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	197	293	563	76,390	公益事業	
LOREAL	125	167	2,960	401,512	家庭用品・パーソナル用品	
CHRISTIAN DIOR	28	34	647	87,799	耐久消費財・アパレル	
LVMH	147	186	3,101	420,616	耐久消費財・アパレル	
THALES SA	46	61	355	48,257	資本財	
CAP GEMINI SA	75	105	864	117,216	ソフトウェア・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	28	36	269	36,549	食品・生活必需品小売り	
PUBLICIS GROUPE	93	128	963	130,632	メディア	
LAFARGE (FRANCE)	96	128	851	115,410	素材	
LAGADERE S. C. A	55	90	252	34,267	メディア	
BOLLORE	3	618	324	44,060	運輸	
MICHELIN	97	126	1,260	170,897	自動車・自動車部品	
PERNOD-RICARD	110	142	1,616	219,279	食品・飲料・タバコ	
RENAULT SA	99	130	1,260	170,983	自動車・自動車部品	
REMY COINTREAU	15	15	105	14,331	食品・飲料・タバコ	

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種		
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額				
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)			
VINCI S.A.	249	311	1,726	234,071	資本財		
SCHNEIDER ELECTRIC SE	275	373	2,656	360,191	資本財		
VIVENDI	630	764	1,801	244,270	メディア		
TECHNIP S.A.	54	72	437	59,396	エネルギー		
TOTAL SA	1,125	1,437	6,744	914,568	エネルギー		
VALLOUREC	55	74	168	22,846	資本財		
VALEO SA	39	54	814	110,441	自動車・自動車部品		
ORANGE	968	1,254	1,841	249,763	電気通信サービス		
HERMES INTERNATIONAL	—	16	577	78,331	耐久消費財・アパレル		
SOCIETE BIC SA	14	18	286	38,821	商業・専門サービス		
DASSAULT SYSTEMES SA	31	82	592	80,316	ソフトウェア・サービス		
KERING	40	48	784	106,437	耐久消費財・アパレル		
CNP ASSURANCES	85	118	182	24,809	保険		
CARREFOUR	321	364	1,156	156,787	食品・生活必需品小売り		
ATOS	43	52	373	50,708	ソフトウェア・サービス		
SANOFI	622	792	7,314	991,972	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ACCOR	93	143	731	99,164	消費者サービス		
SOCIETE GENERALE	381	497	2,164	293,532	銀行		
ALCATEL-LUCENT	1,488	1,811	662	89,873	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
EURAZEO	20	27	172	23,436	各種金融		
SODEXO	50	60	576	78,165	消費者サービス		
AXA	979	1,334	3,167	429,584	保険		
PEUGEOT SA	205	299	577	78,259	自動車・自動車部品		
JC DECAUX SA	31	46	175	23,788	メディア		
ESSILOR INTERNATIONAL	105	137	1,564	212,148	ヘルスケア機器・サービス		
CREDIT AGRICOLE SA	542	674	939	127,405	銀行		
ZODIAC AEROSPACE	89	131	447	60,675	資本財		
BNP PARIBAS	569	717	4,031	546,713	銀行		
SAINT-GOBAIN	236	323	1,407	190,918	資本財		
WENDEL	18	18	221	30,050	各種金融		
ILIAD SA	13	17	357	48,441	電気通信サービス		
IMERYS SA	19	19	136	18,501	素材		
DANONE (GROUPE)	298	387	2,485	337,084	食品・飲料・タバコ		
SAFRAN SA	139	196	1,312	177,971	資本財		
GDF SUEZ	766	988	1,860	252,289	公益事業		
ALSTOM RGPT	116	138	402	54,554	資本財		
EUTELSAT COMMUNICATIONS	71	119	376	51,109	メディア		
ELECTRICITE DE FRANCE	123	157	356	48,287	公益事業		
ARKEMA	31	42	299	40,624	素材		
LEGRAND SA	142	180	948	128,561	資本財		
ADP	17	17	196	26,596	運輸		
NATIXIS	468	669	463	62,811	銀行		
SCOR SE	77	103	329	44,703	保険		
REXEL SA	148	182	307	41,688	資本財		
BUREAU VERITAS SA	111	188	399	54,186	商業・専門サービス		
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	258	301	415	56,317	運輸		
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	145	207	371	50,361	公益事業		
EDENRED	113	133	310	42,150	商業・専門サービス		
NUMERICABLE-SFR	—	59	313	42,541	メディア		
国 小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	13,916	18,809	74,615	10,118,575	<3.7%>

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(オランダ)					
AIRBUS GROUP NV	310	393	2,545	345,242	資本財
REED ELSEVIER NV	375	453	1,029	139,593	メディア
RANDSTAD HOLDING NV	67	79	430	58,368	商業・専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD NV	482	612	1,159	157,172	食品・生活必需品小売り
AKZO NOBEL	124	163	1,157	156,974	素材
UNILEVER NV-CVA	854	1,087	4,301	583,305	食品・飲料・タバコ
WOLTERS KLUWER	153	193	558	75,736	メディア
QIAGEN N. V.	111	149	340	46,212	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KONINKLIJKE DSM NV	89	128	705	95,684	素材
VOPAK	36	45	201	27,271	エネルギー
AEGON	985	1,272	896	121,540	保険
ASML HOLDING NV	187	238	2,476	335,832	半導体・半導体製造装置
KPN (KON.)	1,719	2,061	693	93,993	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS	321	425	333	45,258	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS	508	610	1,539	208,763	資本財
ING GROEP NV-CVA	2,056	2,628	3,980	539,748	銀行
HEINEKEN NV	119	157	1,144	155,197	食品・飲料・タバコ
GEMALTO	42	58	476	64,615	ソフトウェア・サービス
FUGRO NV-CVA	36	—	—	—	エネルギー
HEINEKEN HOLDING NV	54	63	408	55,337	食品・飲料・タバコ
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	44	58	269	36,503	資本財
TNT EXPRESS	221	292	224	30,506	運輸
DELTA LLOYD NV	110	133	215	29,250	保険
ZIGGO NV	75	—	—	—	電気通信サービス
OCI NV	54	54	146	19,856	素材
CNH INDUSTRIAL NV	509	657	537	72,864	資本財
NN GROUP NV	—	120	315	42,771	保険
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	—	603	884	119,982	自動車・自動車部品
国 小 計	9,652	12,743	26,971	3,657,586	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	26	26	—	<1.3%>	
(スペイン)					
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	224	297	483	65,555	運輸
IBERDROLA SA	2,739	3,713	2,356	319,609	公益事業
ENDESA	—	202	348	47,282	公益事業
BANKINTER SA	—	465	315	42,831	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA	3,170	4,349	3,954	536,277	銀行
GAS NATURAL SDG SA	191	236	532	72,234	公益事業
REPSOL SA	465	718	1,260	170,945	エネルギー
BANCO SANTANDER SA	6,390	9,771	6,440	873,375	銀行
RED ELECTRICA CORPORACION SA	59	72	559	75,904	公益事業
TELEFONICA	2,169	2,995	3,897	528,606	電気通信サービス
ZARDOYA OTIS SA	102	134	157	21,376	資本財
INDITEX	117	738	2,271	307,979	小売
ENAGAS	104	152	402	54,638	公益事業
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	94	142	427	58,037	資本財
GRIFOLS SA	86	98	364	49,453	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FERROVIAL SA	220	323	647	87,773	資本財
MAPFRE SA	650	650	214	29,125	保険
BANCO DE SABADELL SA	1,877	3,467	801	108,712	銀行
CAIXABANK	927	1,563	689	93,467	銀行

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	208	311	1,318	178,849	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	568	602	480	65,162	運輸
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	333	462	341	46,376	食品・生活必需品小売り
AENA SA	—	50	488	66,296	運輸
国 小 計	20,702	31,521	28,758	3,899,874	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	20	23	—	<1.4%>	
(ベルギー)					
UMICORE	53	68	312	42,441	素材
DELHAIZE GROUP	52	71	591	80,151	食品・生活必需品小売り
KBC GROEP NV	133	177	1,097	148,817	銀行
ANHEUSER-BUSCH INBEV	420	536	6,018	816,230	食品・飲料・タバコ
SOLVAY SA	31	41	531	72,044	素材
UCB (GROUPE)	58	82	534	72,458	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT SA	44	44	184	25,014	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	42	50	384	52,207	各種金融
AGEAS	119	138	478	64,952	保険
BELGACOM	77	100	321	43,558	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	32	32	159	21,676	メディア
国 小 計	1,066	1,345	10,615	1,439,553	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	11	11	—	<0.5%>	
(オーストリア)					
TELEKOM AUSTRIA AG	138	—	—	—	電気通信サービス
OMV AG	81	98	254	34,552	エネルギー
VOESTALPINE AG	54	78	298	40,455	素材
ERSTE GROUP BANK AG	143	173	457	62,032	銀行
IMMOFINANZ AG	551	—	—	—	不動産
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	57	91	128	17,398	銀行
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	22	—	—	—	保険
ANDRITZ AG	34	52	296	40,192	資本財
国 小 計	1,084	494	1,435	194,631	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	8	5	—	<0.1%>	
(ルクセンブルク)					
TENARIS SA	256	348	459	62,364	エネルギー
SES	155	220	721	97,885	メディア
ARCELORMITTAL	519	635	635	86,177	素材
RTL GROUP	20	24	207	28,096	メディア
ALTICE SA	31	58	709	96,218	メディア
国 小 計	982	1,286	2,733	370,742	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	5	5	—	<0.1%>	
(フィンランド)					
WARTSILA OYJ	69	97	401	54,397	資本財
UPM KYMMENE CORP	275	364	606	82,284	素材
STORA ENSO OYJ R	312	360	348	47,251	素材
SAMPO OYJ-A SHS	231	310	1,356	183,973	保険
FORTUM OYJ	236	286	500	67,878	公益事業
ELISA A	70	100	276	37,490	電気通信サービス
METSO OYJ	65	65	173	23,467	資本財
NOKIA CORP	1,970	2,502	1,690	229,279	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OIL OYJ	63	93	218	29,597	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ	61	76	229	31,157	自動車・自動車部品
KONE OYJ-B	167	220	862	116,963	資本財

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
ORTON OYJ-CLASS B	58	58	176	23,905	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
国 小 計	3,584	4,538	6,840	927,646	
	銘柄数 <比率>	12	12	—	<0.3%>
(アイルランド)					
CRH	417	564	1,456	197,513	素材
KERRY GROUP PLC-A	90	110	762	103,342	食品・飲料・タバコ
国 小 計	508	674	2,218	300,855	
	銘柄数 <比率>	2	2	—	<0.1%>
(ポルトガル)					
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,146	1,594	570	77,302	公益事業
BCP BANCO COMERCIAL NOM	—	24,400	212	28,754	銀行
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	210	258	279	37,855	エネルギー
JERONIMO MARTINS	152	152	193	26,305	食品・生活必需品小売り
国 小 計	1,508	26,405	1,255	170,218	
	銘柄数 <比率>	3	4	—	<0.1%>
ユーロ計	92,622	149,983	247,074	33,505,786	
	銘柄数 <比率>	225	228	—	<12.3%>
(イギリス)			千イギリスポンド		
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	502	583	263	49,965	各種金融
AMEC FOSTER WHEELER PLC	152	261	249	47,215	エネルギー
ANTOFAGASTA PLC	193	254	192	36,427	素材
ASHTED GROUP PLC	—	327	380	72,068	資本財
SEVERN TRENT PLC	123	154	342	64,903	公益事業
BHP BILLITON PLC	1,096	1,398	1,925	365,007	素材
ARM HOLDINGS PLC	734	932	1,089	206,458	半導体・半導体製造装置
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	—	704	422	80,177	耐久消費財・アパレル
SKY PLC	534	689	736	139,533	メディア
AGGREKO PLC	123	187	305	58,002	商業・専門サービス
TULLOW OIL PLC	474	672	263	49,862	エネルギー
BUNZL PLC	171	213	407	77,300	資本財
CAPITA GROUP PLC	353	421	531	100,788	商業・専門サービス
AVIVA PIC	1,565	2,677	1,413	268,022	保険
CRODA INTERNATIONAL PLC	66	86	257	48,900	素材
DIAGEO	1,312	1,699	3,129	593,165	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC	59	79	270	51,214	各種金融
BAE SYSTEMS PLC	1,694	2,100	1,095	207,648	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO	984	1,255	4,634	878,497	食品・飲料・タバコ
STANDARD CHARTERED PLC	1,285	1,668	1,763	334,386	銀行
REXAM PLC	407	449	254	48,313	素材
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	510	634	2,138	405,361	食品・飲料・タバコ
IMI PLC	147	175	219	41,582	資本財
JOHNSON MATTHEY PLC	109	131	468	88,741	素材
SABMILLER PLC	506	640	2,290	434,204	食品・飲料・タバコ
ANGLO AMERICAN PLC	732	926	958	181,721	素材
COMPASS GROUP PLC	950	1,109	1,282	243,156	消費者サービス
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	10,102	13,118	8,180	1,550,779	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP	3,143	4,025	1,081	204,971	保険
UNILEVER PLC	676	850	2,475	469,316	食品・飲料・タバコ
MEGGITT PLC	406	509	261	49,635	資本財
MORRISON SUPERMARKETS	1,187	1,359	240	45,632	食品・生活必需品小売り
UNITED UTILITIES GROUP PLC	362	436	437	82,990	公益事業

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	548	702	303	57,481	保険
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	184	237	701	132,990	食品・飲料・タバコ
PEARSON	416	545	728	138,156	メディア
PERSIMMON PLC	155	198	389	73,823	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL	1,356	1,729	2,822	535,048	保険
RIO TINTO PLC REG	657	842	2,429	460,529	素材
VODAFONE GROUP PLC	13,891	17,859	4,531	858,942	電気通信サービス
RECKITT BENCKISER PLC	340	428	2,531	479,807	家庭用品・パーソナル用品
REED ELSEVIER PLC	616	756	836	158,546	メディア
OLD MUTUAL PLC	2,595	3,330	754	143,023	保険
ROYAL BANK OF SCOTLAND	1,310	1,749	609	115,597	銀行
TRAVIS PERKINS PLC	120	178	400	75,844	資本財
SSE PLC	505	656	1,099	208,339	公益事業
BP PLC	9,679	12,271	5,562	1,054,537	エネルギー
SAGE GROUP PLC	583	694	401	76,056	ソフトウェア・サービス
SMITHS GROUP PLC	210	248	298	56,620	資本財
LLOYDS BANKING GROUP PLC	30,650	38,470	3,383	641,341	銀行
TATE & LYLE	239	291	170	32,370	食品・飲料・タバコ
BG GROUP	1,768	2,261	2,604	493,645	エネルギー
TAYLOR WIMPAY PLC	—	2,307	426	80,849	耐久消費財・アパレル
TESCO	4,256	5,400	1,168	221,532	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	490	623	352	66,754	各種金融
SMITH & NEPHEW PLC	483	596	697	132,301	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE	2,552	3,275	4,781	906,517	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE	113	133	264	50,157	資本財
BABCOCK INTL GROUP PLC	265	192	217	41,178	商業・専門サービス
WPP PLC	701	874	1,379	261,451	メディア
WOLSELEY LTD	135	170	695	131,802	資本財
ASTRAZENECA	662	851	3,826	725,357	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEW GKN	878	1,028	379	71,854	自動車・自動車部品
BT GROUP PLC	4,103	5,659	2,545	482,497	電気通信サービス
ASOS PLC	30	—	—	—	小売
LONMIN PLC	—	79	10	2,049	素材
CARNIVAL PLC	94	118	380	72,073	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	1,924	2,493	2,332	442,087	公益事業
MARKS & SPENCER GROUP PLC	872	1,147	673	127,664	小売
BARCLAYS	8,778	11,110	3,012	571,008	銀行
INTERTEK GROUP PLC	86	102	259	49,103	商業・専門サービス
WILLIAM HILL	444	559	237	45,082	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	238	282	485	92,005	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	79	98	743	140,856	小売
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	970	1,255	1,273	241,490	資本財
KINGFISHER PLC	1,239	1,642	615	116,773	小売
ICAP PLC	323	422	234	44,519	各種金融
ITV PLC	2,009	2,560	702	133,266	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	94	208	520	98,595	各種金融
SAINSBURY (J) PLC	639	868	223	42,352	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD	45	59	280	53,138	素材
G4S PLC	766	1,006	303	57,551	商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC	115	159	238	45,267	保険
CENTRICA PLC	2,584	3,311	923	174,974	公益事業

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,047	2,621	5,121	970,885	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,288	1,647	3,269	619,805	エネルギー
INTERCONTINENTAL HOTELS	139	148	414	78,528	消費者サービス
WHITBREAD PLC	96	121	629	119,316	消費者サービス
COBHAM PLC	560	723	216	40,981	資本財
INMARSAT PLC	233	275	276	52,345	電気通信サービス
PETROFAC LTD	127	167	148	28,162	エネルギー
SHIRE PLC	302	390	2,206	418,285	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TUI AG-DI	—	320	380	72,211	消費者サービス
STANDARD LIFE PLC	1,257	1,332	657	124,551	保険
INVESTEC PLC	308	364	223	42,315	各種金融
EXPERIAN PLC	516	660	828	157,106	商業・専門サービス
MONDI PLC	—	261	390	74,074	素材
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	144	180	124	23,530	小売
HARGREAVES LANSDOWN PLC	105	197	255	48,522	各種金融
TUI TRAVEL PLC	204	—	—	—	消費者サービス
FRESNILLO PLC	94	177	131	24,907	素材
FRIENDS LIFE GROUP LTD	743	—	—	—	保険
MELROSE INDUSTRIES PLC	565	644	172	32,611	資本財
GLENCORE PLC	5,591	7,345	2,099	397,912	素材
DIXONS CARPHONE PLC	—	667	316	59,904	小売
EASYJET PLC	76	116	188	35,813	運輸
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	734	1,034	348	66,084	保険
COCA-COLA HBC AG-CDI	112	139	204	38,798	食品・飲料・タバコ
ROYAL MAIL PLC	369	449	236	44,808	運輸
MERLIN ENTERTAINME	—	485	223	42,395	消費者サービス
小 計	148,109	193,267	119,769	22,704,632	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	102	107	—	<8.3%>	
(スイス)			千スイスフラン		
SULZER AG-REG	11	16	167	21,971	資本財
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	141	18,584	食品・飲料・タバコ
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	0.49	0.62	311	40,837	食品・飲料・タバコ
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	0.05	0.07	415	54,520	食品・飲料・タバコ
SWATCH GROUP AG/THE-REG	23	28	216	28,451	耐久消費財・アパレル
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	4	4	193	25,347	素材
SWISS PRIME SITE-REG	—	38	292	38,392	不動産
PARGESA HOLDING SA-BR	12	18	126	16,618	各種金融
PARTNERS GROUP HOLDING AG	9	11	337	44,329	各種金融
SCHINDLER HOLDING AG-REG	10	13	222	29,199	資本財
ARYZTA AG	44	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SYNGENTA AG	48	63	2,675	351,046	素材
SIKA AG-BR	1	1	447	58,666	素材
SGS SA	2	3	640	84,003	商業・専門サービス
SWISSCOM	11	18	995	130,633	電気通信サービス
GEBERIT AG-REG	20	25	885	116,123	資本財
GIVAUDAN-REG	4	6	1,108	145,435	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	79	101	3,077	403,740	保険
NOVARTIS	1,206	1,544	15,202	1,994,674	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD	1,150	1,469	3,061	401,718	資本財
ROCHE HOLDING GENUSS	368	471	13,328	1,748,849	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO	86	119	908	119,176	商業・専門サービス

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
HOLCIM LTD	115	155	1,181	154,969	素材	
NESTLE SA - REGISTERED	1,688	2,164	15,963	2,094,539	食品・飲料・タバコ	
BALOISE HOLDING AG	25	31	374	49,147	保険	
UBS AG-REG	1,945	—	—	—	各種金融	
SONOVA HOLDING AG-REG	26	34	489	64,181	ヘルスケア機器・サービス	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	27	32	440	57,829	運輸	
CREDIT SUISSE GROUP AG	799	1,040	2,619	343,756	各種金融	
SWATCH GROUP AG(BEARER)	16	21	800	105,098	耐久消費財・アパレル	
LONZA GROUP AG-REG	27	33	459	60,297	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	16	20	481	63,113	保険	
SWISS PRIME SITE-REG	29	—	—	—	不動産	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	24	28	475	62,330	資本財	
ACTELION LTD-REG	55	65	875	114,842	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARYZTA AG	—	56	343	45,120	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	271	349	2,937	385,386	耐久消費財・アパレル	
JULIUS BAER GROUP LTD	123	143	746	97,949	各種金融	
SWISS RE LTD	187	244	2,079	272,911	保険	
TRANSOCEAN LTD	188	227	405	53,240	エネルギー	
UBS GROUP AG	—	2,477	5,127	672,821	各種金融	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	8,669	11,086	80,556	10,569,858	
(スウェーデン)		38	38	—	<3.9%>	
ATLAS COPCO A	348	450	11,836	173,053	資本財	
SKF AB-B	210	270	5,662	82,781	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	799	1,040	11,104	162,347	銀行	
SWEDBANK AB-A	478	617	12,313	180,024	銀行	
SCA SV CELLULOSA B	299	405	9,231	134,963	家庭用品・パーソナル用品	
VOLVO B	790	1,032	11,823	172,857	資本財	
SWEDISH MATCH AB	105	124	3,193	46,683	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	159	213	2,121	31,015	電気通信サービス	
NORDEA BANK AB	1,601	2,079	23,271	340,222	銀行	
ELECTROLUX AB-SER B	136	152	3,994	58,405	耐久消費財・アパレル	
SECURITAS B	151	228	2,649	38,741	商業・専門サービス	
INVESTOR AB-B SHS	251	312	10,637	155,517	各種金融	
HENNES & MAURITZ B	490	632	21,647	316,485	小売	
ASSA ABLOY B	169	224	11,463	167,593	資本財	
SVENSKA HANDELSBK A	260	1,021	13,272	194,042	銀行	
ERICSSON (LM) B	1,595	2,027	19,691	287,886	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SANDVIK AB	551	673	7,103	103,853	資本財	
TELIASONERA AB	1,238	1,739	8,782	128,406	電気通信サービス	
SKANSKA B	192	261	4,630	67,693	資本財	
LUNDIN PETROLEUM AB	113	141	1,931	28,236	エネルギー	
BOLIDEN AB	132	181	3,362	49,161	素材	
ALFA LAVAL AB	164	192	3,178	46,462	資本財	
GETINGE AB-B SHS	108	127	2,632	38,491	ヘルスケア機器・サービス	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	125	146	4,209	61,546	各種金融	
MILICOM INTL CELLULAR-SDR	33	43	2,965	43,353	電気通信サービス	
ELEKTA AB-B SHS	211	211	1,292	18,897	ヘルスケア機器・サービス	
ICA GRUPPEN AB	—	57	1,732	25,324	食品・生活必需品小売り	
HUSQVARNA AB-B SHS	198	277	1,812	26,500	耐久消費財・アパレル	
ATLAS COPCO B	207	248	5,816	85,032	資本財	

銘柄	株数 (百株)	当期首(前期末)	当 期 末		業 種
		株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	74	127	2,181	31,886	各種金融
HEXAGON AB-B SHS	135	175	5,496	80,363	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	—	450	267	3,918	資本財
ATLAS COPCO AB- B REDEMPTION	—	248	148	2,165	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	11,335 30	16,140 33	231,457 —	3,383,915 <1.2%>
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	530	637	8,727	138,498	銀行
NORSK HYDRO	695	838	2,976	47,239	素材
TELENOR ASA	417	479	8,444	134,008	電気通信サービス
SUBSEA 7 SA	133	183	1,501	23,834	エネルギー
ORKLA	389	580	3,577	56,770	食品・飲料・タバコ
STATOIL ASA	585	763	11,133	176,694	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	95	112	4,408	69,955	素材
SEADRILL LTD	202	234	2,230	35,392	エネルギー
AKASTOR ASA	80	—	—	—	エネルギー
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	101	134	1,644	26,101	保険
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	3,231 10	3,965 9	44,643 —	708,493 <0.3%>
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
CARLSBERG AS-B	54	68	4,396	79,922	食品・飲料・タバコ
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	3	4	6,560	119,268	運輸
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	1	2	3,131	56,923	運輸
DANSKE BANK A/S	358	490	9,851	179,101	銀行
NOVOZYMES A/S	126	167	5,502	100,027	素材
TDC A/S	411	524	2,651	48,197	電気通信サービス
DSV A/S	93	111	2,614	47,540	運輸
WILLIAM DEMANT HOLDING	14	14	841	15,297	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS	118	143	5,007	91,039	資本財
NOVO NORDISK A/S-B	1,038	1,272	49,180	894,102	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLOPLAST-B	56	69	3,581	65,110	ヘルスケア機器・サービス
TRYG A/S	12	64	908	16,509	保険
PANDORA A/S	61	72	5,053	91,879	耐久消費財・アパレル
ISS A/S	—	114	2,700	49,100	商業・専門サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	2,350 13	3,124 14	101,981 —	1,854,019 <0.7%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	65	106	702	66,638	ヘルスケア機器・サービス
AGL ENERGY LTD	294	435	702	66,609	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,446	1,844	6,036	572,420	銀行
AMCOR	650	771	1,116	105,874	素材
WESTPAC BANKING	1,637	2,076	6,878	652,284	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD	181	243	318	30,167	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	773	904	219	20,849	素材
TELSTRA CORP	2,241	2,773	1,705	161,725	電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	193	312	380	36,042	銀行
BRAMBLES LTD	794	996	1,133	107,456	商業・専門サービス
COCA-COLA AMATIL LIMITED	280	380	381	36,219	食品・飲料・タバコ
ASX LTD	104	126	522	49,581	各種金融
BHP BILLITON LTD	1,691	2,149	6,277	595,273	素材
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	84	203	689	65,380	エネルギー

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種		
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額				
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)			
ALS LTD	218	—	—	—	商業・専門サービス		
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	308	308	141	13,440	小売		
COMPUTERSHARE LIMITED	224	308	390	37,026	ソフトウェア・サービス		
CSL LIMITED	251	322	2,983	282,949	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
REA GROUP LTD	25	35	142	13,499	メディア		
TRANSURBAN GROUP	930	1,276	1,294	122,724	運輸		
COCHLEAR LIMITED	27	38	337	31,995	ヘルスケア機器・サービス		
ORIGIN ENERGY LIMITED	560	802	1,029	97,591	エネルギー		
COMMONWEALTH BANK OF AUST	850	1,081	9,026	856,000	銀行		
BORAL LIMITED	351	468	293	27,821	素材		
RIO TINTO LTD	231	305	1,761	167,004	素材		
ARISTOCRAT LEISURE LTD	—	459	362	34,390	消費者サービス		
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	1,218	1,496	844	80,055	保険		
TPG TELECOM LTD	200	200	178	16,936	電気通信サービス		
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	32	32	149	14,209	消費者サービス		
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	226	294	513	48,730	素材		
ORICA LTD	196	228	493	46,760	素材		
CIMIC GROUP LIMITED	53	53	127	12,088	資本財		
MACQUARIE GROUP LIMITED	147	191	1,552	147,210	各種金融		
WORLEYPARSONS LTD	105	150	164	15,588	エネルギー		
SUNCORP GROUP LIMITED	659	819	1,099	104,273	保険		
NATIONAL AUSTRALIA BANK	1,241	1,755	5,869	556,622	銀行		
NEWCREST MINING LIMITED	404	568	790	74,998	素材		
INCITEC PIVOT LTD	836	1,101	436	41,378	素材		
TOLL HOLDINGS LIMITED	417	—	—	—	運輸		
AMP LTD	1,586	1,884	1,240	117,614	保険		
QANTAS AIRWAYS LIMITED	771	363	125	11,900	運輸		
QBE INSURANCE GROUP	627	969	1,413	134,031	保険		
SANTOS	522	747	611	57,944	エネルギー		
SONIC HEALTHCARE LTD	216	247	493	46,785	ヘルスケア機器・サービス		
TABCORP HOLDINGS	457	627	310	29,446	消費者サービス		
WESFARMERS LTD	592	770	3,359	318,545	食品・生活必需品小売り		
ALUMINA LIMITED	1,195	1,704	290	27,560	素材		
ILUKA RESOURCES LTD	213	285	249	23,639	素材		
WOODSIDE PETROLEUM LTD	350	511	1,863	176,677	エネルギー		
WOOLWORTHS LTD	649	861	2,412	228,777	食品・生活必需品小売り		
METCASH LTD	553	—	—	—	食品・生活必需品小売り		
SEEK LTD	158	213	360	34,160	商業・専門サービス		
TATTS GROUP LTD	652	933	381	36,210	消費者サービス		
AUSNET SERVICES	874	1,202	181	17,216	公益事業		
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	—	202	156	14,846	各種金融		
ASCIANO GROUP	510	640	433	41,061	運輸		
CROWN RESORTS LTD	212	212	274	26,058	消費者サービス		
AURIZON HOLDINGS LTD	1,164	1,362	715	67,808	運輸		
TREASURY WINE ESTATES LTD	385	385	204	19,376	食品・飲料・タバコ		
HEALTHSCOPE LTD	—	885	247	23,441	ヘルスケア機器・サービス		
MEDIBANK PRIVATE LTD	—	2,133	458	43,503	保険		
SOUTH32 LTD	—	3,548	773	73,358	素材		
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	31,852	46,319	73,603	6,979,788	
			57	59	—	<2.6%>	

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	477	611	297	26,379	運輸
CONTACT ENERGY LTD	255	255	158	14,033	公益事業
RYMAN HEALTHCARE LTD	150	220	171	15,240	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	351	465	403	35,777	素材
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,080	1,080	295	26,222	電気通信サービス
XERO LTD	30	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MIGHTY RIVER POWER	—	617	169	15,068	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD	—	1,105	253	22,466	公益事業
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	金 額 <比 率>	
	2,344	4,355	1,748	155,188	
	6	7	—	<0.1%>	
(香港)			千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	138	138	1,126	17,972	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,200	1,390	3,509	56,015	不動産
BANK EAST ASIA	659	847	2,936	46,873	銀行
CLP HOLDINGS	945	1,265	8,551	136,480	公益事業
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	570	860	1,745	27,862	運輸
CHEUNG KONG HOLDINGS	720	—	—	—	不動産
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	310	410	2,648	42,271	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	566	755	22,665	361,734	各種金融
LI & FUNG	3,148	3,788	2,503	39,961	耐久消費財・アパレル
MTR CORP	710	940	3,482	55,583	運輸
FIRST PACIFIC CO	1,280	1,280	910	14,524	各種金融
HANG SENG BANK	414	488	7,637	121,889	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMEN	560	676	4,225	67,431	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	750	880	6,468	103,229	公益事業
WHARF HOLDINGS	770	960	5,150	82,200	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	2,919	4,451	8,288	132,291	公益事業
HUTCHISON WHAMPOA	1,120	1,440	16,560	264,297	資本財
HYSAN DEVELOPMENT CO	400	400	1,436	22,918	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,220	1,480	5,498	87,751	消費者サービス
KERRY PROPERTIES LTD	385	385	1,283	20,492	不動産
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	2,005	2,360	7,575	120,906	銀行
NWS HOLDINGS LTD	780	990	1,253	20,003	資本財
PCCW LTD	2,320	2,320	1,157	18,476	電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	465	465	1,262	20,149	耐久消費財・アパレル
NEW WORLD DEVELOPMENT	2,705	3,235	3,357	53,592	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD	980	980	1,199	19,144	消費者サービス
SINO LAND CO	1,394	2,274	3,065	48,923	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	850	1,170	15,514	247,606	不動産
SWIRE PACIFIC A	365	405	4,228	67,482	不動産
WHEELLOCK & CO LTD	530	650	2,811	44,867	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	720	935	2,515	40,141	耐久消費財・アパレル
SJM HOLDINGS LTD	950	1,320	1,316	21,003	消費者サービス
WYNN MACAU LTD	828	1,028	1,531	24,446	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	436	672	977	15,594	消費者サービス
AIA GROUP LTD	6,248	8,048	40,722	649,937	保険
SANDS CHINA LTD	1,240	1,540	4,697	74,964	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	518	692	1,858	29,653	不動産

銘柄	株数 (百株)	当	期		業	種
		株数 (百株)	評 価			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
WH GROUP LTD	—	4,650	2,715	43,340	食品・飲料・タバコ	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	—	930	11,253	179,597	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	42,119 37	57,498 38	215,640 —	3,441,615 <1.3%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	760	1,090	376	34,566	資本財	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	2,840	4,190	173	15,983	食品・飲料・タバコ	
DBS GROUP	910	1,184	2,408	221,366	銀行	
CITY DEVELOPMENTS LTD	240	240	249	22,965	不動産	
SEMBCORP MARINE LTD	410	609	182	16,737	資本財	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	60	60	239	21,978	小売	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	420	550	477	43,933	各種金融	
CAPITALAND LTD	1,305	1,655	582	53,548	不動産	
GENTING SINGAPORE PLC	3,130	4,250	393	36,136	消費者サービス	
KEPPEL CORP LTD	743	943	830	76,365	資本財	
COMFORTDELGRO CORP LTD	990	1,450	445	40,918	運輸	
OCBC BANK	1,350	1,971	2,020	185,703	銀行	
SINGAPORE AIRLINES	245	315	360	33,130	運輸	
KEPPEL LAND LTD	400	—	—	—	不動産	
UNITED OVERSEAS BANK	670	852	2,013	185,060	銀行	
UOL GROUP LIMITED	223	325	242	22,256	不動産	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	930	1,248	515	47,377	メディア	
NOBLE GROUP LTD	2,273	2,975	241	22,155	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,252	5,443	2,242	206,148	電気通信サービス	
STARHUB LTD	380	380	152	13,971	電気通信サービス	
OLAM INTERNATIONAL LTD	870	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	450	570	236	21,743	資本財	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,110	1,502	504	46,389	食品・飲料・タバコ	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,330	1,330	196	18,032	資本財	
CAPITAMALLS ASIA LTD	790	—	—	—	不動産	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	1,580	1,990	555	51,034	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	28,662 26	35,123 23	15,638 —	1,437,503 <0.5%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
BANK HAPOLIM BM	585	757	1,536	49,145	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	708	949	1,437	45,961	銀行	
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	1,116	1,116	723	23,133	電気通信サービス	
DELEK GROUP LTD	2	4	486	15,552	エネルギー	
ISRAEL CHEMICALS LTD	205	327	906	28,995	素材	
NICE SYSTEMS LTD	33	33	815	26,095	ソフトウェア・サービス	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	444	576	13,546	433,211	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	1	1	222	7,105	素材	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	82	82	360	11,543	銀行	
AZRIELI GROUP	—	37	616	19,708	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	3,180 9	3,886 10	20,652 —	660,453 <0.2%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	554,130 1,228	760,536 1,264	—	256,692,038 <94.4%>	

(注1) 邦貨換算金額は、当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2) < >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘柄	当期首(前期末)		当期		期末	
	口	数 (千口)	口	数 (千口)	評価額	
					外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)
(アメリカ)					千米ドル	
BOSTON PROPERTIES		7		10	1,352	167,324
SL GREEN REALTY CORP		4		6	784	97,114
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC		50		61	633	78,360
PROLOGIS INC		25		33	1,351	167,204
AVALONBAY COMMUNITIES INC		6		8	1,483	183,575
CAMDEN PROPERTY TRUST		4		5	454	56,245
DUKE REALTY CORP		18		21	430	53,250
CROWN CASTLE INTL CORP		17		22	1,867	231,059
ESSEX PROPERTY TRUST		3		4	970	120,060
EQUITY RESIDENTIAL PPTY		17		24	1,848	228,716
FEDERAL REALTY INVS TRUST		3		4	581	71,958
HCP INC		23		30	1,205	149,168
HEALTH CARE REIT INC		14		23	1,631	201,830
RAYONIER INC		7		—	—	—
KIMCO REALTY CORP		20		26	643	79,657
LIBERTY PROPERTY TRUST		8		9	344	42,617
IRON MOUNTAIN INC		—		14	517	63,995
MACERICH CO/THE		7		9	742	91,810
HOST HOTELS AND RESORTS INC		40		51	1,026	126,963
PLUM CREEK TIMBER COMMON		9		11	481	59,604
REALTY INCOME CORP		11		15	722	89,355
REGENCY CENTERS CORP		4		6	387	47,946
UDR INC		13		16	530	65,644
SIMON PROPERTY GROUP		16		21	3,896	482,128
PUBLIC STORAGE		7		9	1,918	237,344
VENTAS INC		15		21	1,455	180,107
VORNADO REALTY TRUST		8		11	1,120	138,584
EXTRA SPACE STORAGE INC		—		7	541	67,046
DIGITAL REALTY TRUST INC		6		8	571	70,678
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP		18		23	477	59,116
AMERICAN REALTY CAPITAL PRO		46		58	534	66,121
GENERAL GROWTH PROPERTIES		27		39	1,128	139,592
HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U		257		329	218	27,070
AMERICAN TOWER CORPORATION		20		27	2,637	326,331
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC		—		12	318	39,400

銘柄	当期首(前期末)		当期		期末	
	口数 (千口)	口数 (千口)	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)
EQUINIX INC	—	3		1,050		129,930
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	—	7		207		25,629
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	748 32	1,000 36	36,066 —		4,462,545 <1.6%>
(カナダ)				千カナダドル		
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	7	9		213		21,247
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7	10		296		29,488
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	15 2	19 2	509 —		50,735 <0.0%>
(フランス)				千ユーロ		
ICADE	2	2		200		27,229
UNIBAIL-RODAMCO SE	5	6		1,610		218,463
KLEPIERRE	5	10		451		61,277
GECINA SA	1	2		303		41,092
FONCIERE DES REGIONS	1	2		188		25,602
国小計	口数・金額 銘柄数<比率>	15 5	25 5	2,755 —		373,664 <0.1%>
(オランダ)						
CORIO NV	3	—		—		—
国小計	口数・金額 銘柄数<比率>	3 1	— —	— —		— <—%>
ユーロ計	口数・金額 銘柄数<比率>	18 6	25 5	2,755 —		373,664 <0.1%>
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC	49	66		577		109,482
HAMMERSON PLC	38	51		346		65,680
INTU PROPERTIES PLC	40	56		192		36,403
SEGRO PLC	38	48		210		39,984
LAND SECURITIES GROUP PLC	42	53		715		135,688
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	210 5	277 5	2,042 —		387,239 <0.1%>
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
MIRVAC GROUP	182	241		485		46,014
APA GROUP	40	74		685		64,992
NOVION PROPERTY GROUP	126	126		315		29,941
GPT GROUP	90	109		502		47,612
SYDNEY AIRPORT	58	70		399		37,844
STOCKLAND	116	150		649		61,581

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
WESTFIELD CORP	104	126	1,202	114,006	
DEXUS PROPERTY GROUP	290	59	462	43,904	
GOODMAN GROUP	91	119	771	73,114	
FEDERATION CENTRES	67	97	295	28,051	
LEND LEASE GROUP	28	33	548	52,004	
WESTFIELD RETAIL TRUST	165	—	—	—	
SCENTRE GROUP	—	376	1,479	140,334	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,365	1,586	7,797	739,403
	銘 柄 数 <比 率>	12	12	—	<0.3%>
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT	125	146	6,563	104,748	
HKT TRUST AND HKT LTD	130	187	1,834	29,278	
小 計	口 数 ・ 金 額	255	333	8,397	134,026
	銘 柄 数 <比 率>	2	2	—	<0.0%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST	109	141	311	28,643	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	111	138	344	31,654	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	110	143	231	21,294	
SUNTEC REIT	—	173	311	28,623	
小 計	口 数 ・ 金 額	330	595	1,199	110,215
	銘 柄 数 <比 率>	3	4	—	<0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額	2,942	3,838	—	6,257,831
	銘 柄 数 <比 率>	62	66	—	<2.3%>

(注1) 邦貨換算金額は、当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2) < >内は、純資産総額に対する各国別投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

### <先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外		
S&P/TSE 60	421	—
SWISS MKT IX	480	—
S&P 500 FUTU	5,709	—
DJ EURO STOXX	1,111	—
国		
SPI 200 FUTU	461	—
FTSE 100	919	—

(注) 外貨建資産は、当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

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 256,692,038	% 92.8
投 資 信 託 受 益 証 券	211,189	0.1
投 資 証 券	6,046,641	2.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	13,603,651	4.9
投 資 信 託 財 産 総 額	276,553,519	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(271,471,194千円)の投資信託財産総額(276,553,519千円)に対する比率は98.2%です。

(注2) 外貨建資産は、当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。1米ドル=123.73円、1カナダドル=99.61円、1ユーロ=135.61円、1イギリスポンド=189.57円、1スイスフラン=131.21円、1スウェーデンクローナ=14.62円、1ノルウェークローネ=15.87円、1デンマーククローネ=18.18円、1オーストラリアドル=94.83円、1ニュージーランドドル=88.75円、1香港ドル=15.96円、1シンガポールドル=91.92円、1イスラエルシェケル=31.98円です。

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2015年5月29日現在
(A) 資 産	277,177,445,750円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	11,121,649,836
株 式(評価額)	256,692,038,176
投資信託受益証券(評価額)	211,189,527
投 資 証 券(評価額)	6,046,641,814
未 収 入 金	1,509,877,226
未 収 配 当 金	600,201,655
未 収 利 息	1,214
差 入 委 託 証 拠 金	995,846,302
(B) 負 債	5,128,876,683
未 払 金	4,854,011,268
未 払 解 約 金	274,865,415
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	272,048,569,067
元 本	123,812,745,547
次 期 繰 越 損 益 金	148,235,823,520
(D) 受 益 権 総 口 数	123,812,745,547口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,973円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2014年5月30日 至 2015年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	5,027,780,385円
受 取 配 当 金	5,013,929,564
受 取 利 息	3,336,766
そ の 他 収 益 金	10,710,537
支 払 利 息	△196,482
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	51,511,836.475
売 買 益 損	60,020,563,285
売 買 損	△8,508,726,810
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	739,706,149
取 引 益 損	1,760,998,594
取 引 損	△1,021,292,445
(D) そ の 他 費 用	△89,565,577
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	57,189,757.432
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	68,936,733.095
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	41,966,723.068
(H) 解 約 差 損 益 金	△19,857,390.075
(I) 計 (E+F+G+H)	148,235,823.520
次 期 繰 越 損 益 金(I)	148,235,823.520

(注1) (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時価換えによるものを含みます。

(注2) (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3) (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。

## お知らせ

---

一般社団法人投資信託協会「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」の一部改正に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2014年12月27日)

一般社団法人投資信託協会「信用リスク集中回避のための投資制限に係るガイドライン」の制定に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2015年2月11日)

# 新興国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第7期（決算日 2015年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2008年12月11日から無期限です。
運用方針	新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	新興国の債券を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組比	券入率	債先比	債券率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率					
第3期(2011年11月10日)	12,072	△6.9	21,942.18	△6.0	96.1	—	—	百万円 3,771	
第4期(2012年11月12日)	13,432	11.3	24,482.00	11.6	96.8	—	—	16,160	
第5期(2013年11月11日)	15,769	17.4	29,055.22	18.7	97.8	—	—	25,030	
第6期(2014年11月10日)	17,749	12.6	33,027.74	13.7	93.3	—	—	22,962	
第7期(2015年11月10日)	15,765	△11.2	29,513.66	△10.6	97.5	—	—	16,343	

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物率
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2014年11月10日	17,749	—	33,027.74	—	93.3	—
11月末	18,568	4.6	34,717.41	5.1	96.1	—
12月末	17,691	△0.3	33,000.80	△0.1	96.4	—
2015年 1月末	17,586	△0.9	32,771.75	△0.8	97.6	—
2月末	17,394	△2.0	32,442.87	△1.8	96.8	—
3月末	16,986	△4.3	31,531.31	△4.5	96.8	—
4月末	17,414	△1.9	32,461.93	△1.7	97.1	—
5月末	17,536	△1.2	32,557.22	△1.4	97.4	—
6月末	17,081	△3.8	31,765.20	△3.8	95.9	—
7月末	16,815	△5.3	31,302.41	△5.2	96.7	—
8月末	15,623	△12.0	29,219.43	△11.5	96.3	—
9月末	14,773	△16.8	27,639.66	△16.3	95.2	—
10月末	15,616	△12.0	29,247.63	△11.4	96.5	—
(当期末) 2015年11月10日	15,765	△11.2	29,513.66	△10.6	97.5	—

(注1)騰落率は期首比です。

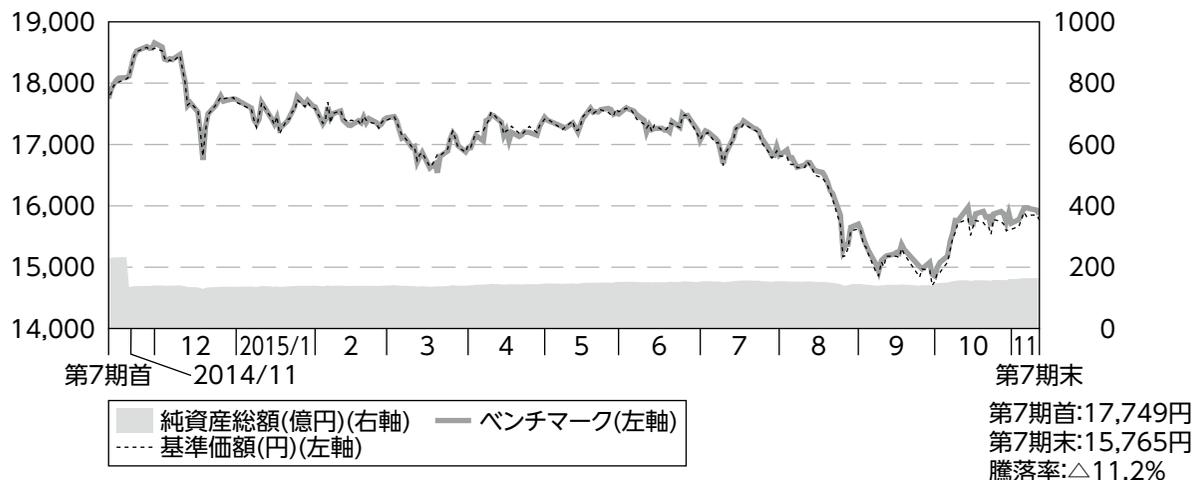
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円換算ベース)です。

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイドとは、新興国の現地通貨債市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

## 基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2014年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

## 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は下落しました。

当期初より、日銀の追加金融緩和決定などを受けた円安進行から基準価額は上昇しましたが、12月に入ると原油価格急落や中国景気の減速懸念などを受けてリスク回避姿勢が強まり、新興国通貨が下落したことから基準価額は下落しました。その後はECB(欧州中央銀行)が量的金融緩和を決定したことや中国人民銀行が追加金融緩和を決定したことなどからリスク選好の動きが強まる場面があった一方で、米国の早期利上げへの警戒感やギリシャの債務問題を受けてリスク回避の動きも強まり、基準価額はもみ合いでの推移となりました。2015年8月以降は、中国・人民元の基準値切り下げを背景に中国の景気減速懸念が高まったことに加え、中国株や原油価格急落を受けてリスク回避の動きが強まり、新興国通貨が下落したことから基準価額は下落しましたが、10月には低調な雇用統計などを受けて米国の利上げ観測が後退したことからリスク選好の動きが強まり、新興国通貨の上昇を背景に基準価額の下落幅は縮小しました。

## 投資環境



新興国為替市場では、米国の早期利上げ観測の高まりに加え、ギリシャの債務問題への不透明感や中国景気の減速懸念からリスク回避の動きが強まり、新興国通貨は対円で概ね下落しました。

新興国債券市場では、資源価格の下落を受けて資源国の財政や経済への懸念が高まったことに加え、米国の早期利上げへの警戒感や中国の景気減速懸念などを背景にリスク回避の動きが強まり、金利は概ね上昇しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

当ファンドでは、ベンチマークであるJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)との連動を目標に、外国債券の組入比率を高位に維持するとともに、投資対象国の配分や期間構成を意識した銘柄分散を行いました。

## 当ファンドの組入資産の内容

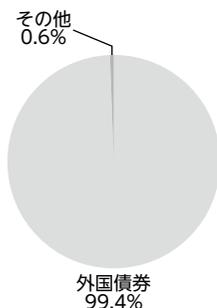
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	COLOM 7.75% 04/14/21	コロンビア	3.4%
2	SAGB 10.5% 12/21/26	南アフリカ	1.8%
3	COLOM 4.375% 03/21/23	コロンビア	1.8%
4	INDOGB 8.375% 03/15/24	インドネシア	1.6%
5	THAIGB 3.875% 06/13/19	タイ	1.6%
6	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	1.6%

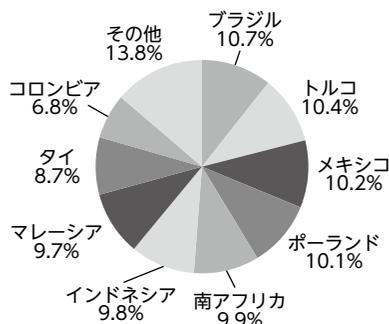
順位	銘柄名	国	組入比率
7	THAIGB 3.65% 12/17/21	タイ	1.5%
8	BLTN 0% 07/01/17	ブラジル	1.5%
9	BNTNF 10% 01/01/21	ブラジル	1.3%
10	BLTN 0% 01/01/18	ブラジル	1.2%
組入銘柄数		172	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

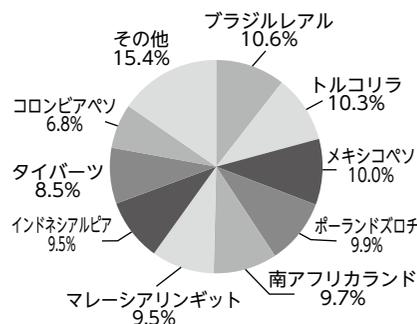
### ○資産別配分



### ○国別配分



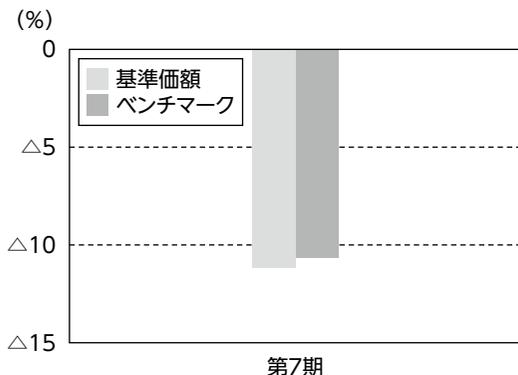
### ○通貨別配分



(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマークに概ね連動しました。

ベンチマークとの差異は、債券のポートフォリオ要因※、カストディコスト等のマイナスが主要要因です。

※ポートフォリオ要因とは、ベンチマークとファンドとで組入銘柄の構成比率が異なることによる差異です。

## 今後の運用方針

主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2014年11月1日~2015年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用)	32円 (32) (-)	0.191% (0.191) (-)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
合計	32	0.191	

(注1) 期中の費用(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2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、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(16,923円)で除して100を乗じたものです。

## 売買および取引の状況

## ＜公社債＞

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 92,083	千メキシコペソ 131,200
	ブ ラ ジ ル	国 債 証 券	千ブラジルリアル 39,903	千ブラジルリアル 33,999
	チ リ	国 債 証 券	千チリペソ 53,479	千チリペソ 52,438
	コ ロ ン ビ ア	国 債 証 券	千コロンビアペソ 13,530,931	千コロンビアペソ 17,863,944
	ペ ル ー	国 債 証 券	千ペルーヌエボソル 4,176	千ペルーヌエボソル 3,679
	ト ル コ	国 債 証 券	千トルコリラ 21,994	千トルコリラ 24,578
	ハ ン ガ リ ー	国 債 証 券	千ハンガリーフォリント 903,186	千ハンガリーフォリント 1,165,435
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 29,571	千ポーランドズロチ 42,652
	ロ シ ア	国 債 証 券	千ロシアルーブル 182,073	千ロシアルーブル 245,530
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリングgit 24,299	千マレーシアリングgit 33,206
国	タ イ	国 債 証 券	千タイバーツ 177,157	千タイバーツ 221,112
	フ ィ リ ピ ン	国 債 証 券	千フィリピンペソ 28,802	千フィリピンペソ 37,756
	イ ン ド ネ シ ア	国 債 証 券	千インドネシアルピア 73,818,220	千インドネシアルピア 78,062,125
	南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカランド 80,776	千南アフリカランド 106,508
ナ イ ジ ェ リ ア	国 債 証 券	千ナイジェリアナイラ 112,687	千ナイジェリアナイラ 679,939	

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

## 利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

### ■ 利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
コール・ローン	36,129	834	2.3	36,026	794	2.2

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## 組入資産の明細

### <外国(外貨建)公社債>

#### (A) 債券種類別開示

区 分	額 面 金 額	当		期		末		
		評 価 額		組入比率	うちB B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
メキシコ	千メキシコペソ 199,750	千メキシコペソ 220,247	千円 1,616,615	% 9.9	% —	% 5.7	% 3.2	% 0.9
ブラジル	千ブラジルレアル 66,600	千ブラジルレアル 52,267	1,694,498	10.4	—	3.1	4.1	3.1
チリ	千チリペソ 100,000	千チリペソ 104,373	18,296	0.1	—	—	0.1	—
コロンビア	千コロンビアペソ 25,480,000	千コロンビアペソ 25,316,522	1,065,825	6.5	—	6.5	—	—
ペルー	千ペルーヌエボソル 8,400	千ペルーヌエボソル 8,162	303,491	1.9	—	1.4	0.3	0.1
トルコ	千トルコリラ 41,050	千トルコリラ 39,107	1,649,574	10.1	—	4.4	5.2	0.6
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 1,842,000	千ハンガリーフォリント 2,077,812	877,460	5.4	—	2.3	2.6	0.4
ポーランド	千ポーランドズロチ 48,750	千ポーランドズロチ 52,226	1,625,805	9.9	—	3.5	4.9	1.5
ロシア	千ロシアルーブル 523,700	千ロシアルーブル 478,230	913,419	5.6	—	2.5	2.5	0.6
マレーシア	千マレーシアリンギット 56,150	千マレーシアリンギット 55,909	1,573,290	9.6	—	4.5	3.8	1.3
タイ	千タイバーツ 376,612	千タイバーツ 405,851	1,392,070	8.5	—	4.5	2.6	1.4
フィリピン	千フィリピンペソ 25,000	千フィリピンペソ 26,296	68,634	0.4	—	0.4	—	—
インドネシア	千インドネシアルピア 180,500,000	千インドネシアルピア 171,361,274	1,559,387	9.5	—	8.3	1.0	0.2
南アフリカ	千南アフリカランド 197,750	千南アフリカランド 183,404	1,580,947	9.7	—	7.6	1.4	0.7
合計	—	—	15,939,317	97.5	—	54.9	31.8	10.8

(注1)邦貨換算金額は、当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2)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3)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。

※ 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。

(B) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	期		末		償還年月日
		額面金額	評価額	額	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
<b>(メキシコ)</b>						
国債証券						
MBONO 10% 11/20/36	10.0	5,500	7,513	55,150		2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24	10.0	18,150	23,098	169,540		2024/12/5
MBONO 4.75% 06/14/18	4.75	20,800	20,879	153,255		2018/6/14
MBONO 5% 06/15/17	5.0	11,200	11,374	83,485		2017/6/15
MBONO 5% 12/11/19	5.0	9,900	9,832	72,168		2019/12/11
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	1,800	1,736	12,747		2026/3/5
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	8,600	8,903	65,348		2022/6/9
MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	13,500	14,091	103,435		2021/6/10
MBONO 7.25% 12/15/16	7.25	9,100	9,447	69,346		2016/12/15
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	7,150	7,813	57,354		2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	10,350	11,503	84,438		2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	9,550	10,540	77,365		2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	5,650	6,250	45,880		2034/11/23
MBONO 7.75% 12/14/17	7.75	10,700	11,476	84,239		2017/12/14
MBONO 8% 06/11/20	8.0	11,100	12,286	90,181		2020/6/11
MBONO 8% 12/07/23	8.0	10,700	12,064	88,555		2023/12/7
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	8,600	10,119	74,277		2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	11,900	14,193	104,181		2038/11/18
MBONO 8.5% 12/13/18	8.5	15,500	17,120	125,662		2018/12/13
小計				1,616,615		
<b>(ブラジル)</b>						
国債証券						
BLTN 0% 01/01/17	—	4,550	3,863	125,247		2017/1/1
BLTN 0% 01/01/18	—	8,300	6,086	197,335		2018/1/1
BLTN 0% 01/01/19	—	6,150	3,892	126,193		2019/1/1
BLTN 0% 07/01/17	—	9,300	7,333	237,761		2017/7/1
BLTN 0% 07/01/18	—	6,100	4,155	134,733		2018/7/1
BNTNF 10% 01/01/17	10.0	4,800	4,551	147,567		2017/1/1
BNTNF 10% 01/01/18	10.0	1,500	1,360	44,111		2018/1/1
BNTNF 10% 01/01/19	10.0	5,950	5,177	167,840		2019/1/1
BNTNF 10% 01/01/21	10.0	7,550	6,163	199,830		2021/1/1
BNTNF 10% 01/01/23	10.0	4,700	3,641	118,052		2023/1/1
BNTNF 10% 01/01/25	10.0	5,850	4,342	140,787		2025/1/1
BRAZIL 10.25% 01/10/28	10.25	1,100	975	31,627		2028/1/10
BRAZIL 12.5% 01/05/22	12.5	450	461	14,953		2022/1/5
BRAZIL 8.5% 01/05/24	8.5	300	260	8,455		2024/1/5
小計				1,694,498		
<b>(チリ)</b>						
国債証券						
CHILE 5.5% 08/05/20	5.5	100,000	104,373	18,296		2020/8/5
<b>(コロンビア)</b>						
国債証券						
COLOM 4.375% 03/21/23	4.375	7,950,000	6,643,059	279,672		2023/3/21
COLOM 7.75% 04/14/21	7.75	12,500,000	12,805,662	539,093		2021/4/14
COLOM 9.85% 06/28/27	9.85	5,030,000	5,868,400	247,059		2027/6/28
小計				1,065,825		
<b>(ペルー)</b>						
国債証券						
PERUGB 5.2% 09/12/23	5.2	1,200	1,080	40,183		2023/9/12
PERUGB 5.7% 08/12/24	5.7	1,650	1,517	56,423		2024/8/12
PERUGB 6.9% 08/12/37	6.9	1,500	1,379	51,280		2037/8/12
PERUGB 6.95% 08/12/31	6.95	1,200	1,132	42,089		2031/8/12
PERUGB 7.84% 08/12/20	7.84	1,400	1,501	55,809		2020/8/12
PERUGB 8.2% 08/12/26	8.2	1,000	1,073	39,902		2026/8/12
PERUGB 8.6% 08/12/17	8.6	450	478	17,802		2017/8/12
小計				303,491		
<b>(トルコ)</b>						
国債証券						
TURKGB 10.4% 03/20/24	10.4	1,850	1,915	80,804		2024/3/20
TURKGB 10.4% 03/27/19	10.4	2,700	2,732	115,277		2019/3/27
TURKGB 10.5% 01/15/20	10.5	1,900	1,950	82,261		2020/1/15
TURKGB 6.3% 02/14/18	6.3	2,650	2,454	103,521		2018/2/14
TURKGB 7.1% 03/08/23	7.1	3,850	3,314	139,788		2023/3/8

銘柄	利率 (%)	期		末		償還年月日
		額面金額	評価額	額	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
TURKGB 7.4% 02/05/20	7.4	3,100	2,842	119,893		2020/2/5
TURKGB 8% 03/12/25	8.0	2,350	2,107	88,913		2025/3/12
TURKGB 8.3% 06/20/18	8.3	3,250	3,131	132,065		2018/6/20
TURKGB 8.5% 07/10/19	8.5	2,650	2,533	106,878		2019/7/10
TURKGB 8.5% 09/14/22	8.5	2,400	2,241	94,558		2022/9/14
TURKGB 8.8% 09/27/23	8.8	2,950	2,787	117,586		2023/9/27
TURKGB 8.8% 11/14/18	8.8	3,250	3,154	133,062		2018/11/14
TURKGB 9% 03/08/17	9.0	2,250	2,219	93,624		2017/3/8
TURKGB 9% 07/24/24	9.0	2,500	2,382	100,473		2024/7/24
TURKGB 9.4% 07/08/20	9.4	1,250	1,225	51,682		2020/7/8
TURKGB 9.5% 01/12/22	9.5	2,150	2,114	89,182		2022/1/12
小計				1,649,574		
<b>(ハンガリー)</b>						
国債証券						
HGB 2.5% 06/22/18	2.5	120,000	121,876	51,468		2018/6/22
HGB 3.5% 06/24/20	3.5	161,000	167,460	70,718		2020/6/24
HGB 4% 04/25/18	4.0	165,000	174,015	73,486		2018/4/25
HGB 5.5% 06/24/25	5.5	199,000	231,948	97,951		2025/6/24
HGB 5.5% 12/20/18	5.5	130,000	143,115	60,347		2018/12/20
HGB 5.5% 12/22/16	5.5	37,000	38,942	16,445		2016/12/22
HGB 6.0% 11/24/23	6.0	192,000	227,028	95,874		2023/11/24
HGB 6.5% 06/24/19	6.5	242,000	276,598	116,807		2019/6/24
HGB 6.75% 02/24/17	6.75	123,000	131,894	55,699		2017/2/24
HGB 6.75% 11/24/17	6.75	120,000	132,930	56,136		2017/11/24
HGB 7% 06/24/22	7.0	159,000	195,222	82,442		2022/6/24
HGB 7.5% 11/12/20	7.5	194,000	236,779	99,992		2020/11/12
小計				877,460		
<b>(ポーランド)</b>						
国債証券						
POLGB 0% 07/25/17	—	1,250	1,216	37,867		2017/7/25
POLGB 1.5% 04/25/20	1.5	4,100	3,971	123,623		2020/4/25
POLGB 2.5% 07/25/18	2.5	5,400	5,497	171,124		2018/7/25
POLGB 3.25% 07/25/19	3.25	4,650	4,847	150,913		2019/7/25
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	3,950	4,056	126,287		2025/7/25
POLGB 3.75% 04/25/18	3.75	3,750	3,927	122,253		2018/4/25
POLGB 4% 10/25/23	4.0	5,700	6,178	192,322		2023/10/25
POLGB 4.75% 04/25/17	4.75	1,400	1,462	45,521		2017/4/25
POLGB 5.25% 10/25/17	5.25	4,850	5,182	161,324		2017/10/25
POLGB 5.25% 10/25/20	5.25	3,550	4,036	125,654		2020/10/25
POLGB 5.5% 10/25/19	5.5	3,250	3,668	114,203		2019/10/25
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	3,850	4,589	142,873		2022/9/23
POLGB 5.75% 10/25/21	5.75	3,050	3,592	111,835		2021/10/25
小計				1,625,805		
<b>(ロシア)</b>						
国債証券						
RFLB 6.4% 05/27/20	6.4	45,000	39,778	75,977		2020/5/27
RFLB 6.7% 05/15/19	6.7	30,000	27,369	52,276		2019/5/15
RFLB 6.8% 12/11/19	6.8	25,600	23,148	44,213		2019/12/11
RFLB 7% 01/25/23	7.0	38,000	33,134	63,287		2023/1/25
RFLB 7% 08/16/23	7.0	47,000	40,679	77,697		2023/8/16
RFLB 7.05% 01/19/28	7.05	28,900	24,092	46,017		2028/1/19
RFLB 7.4% 04/19/17	7.4	7,000	6,791	12,971		2017/4/19
RFLB 7.4% 06/14/17	7.4	45,000	43,488	83,063		2017/6/14
RFLB 7.5% 02/27/19	7.5	32,500	30,470	58,199		2019/2/27
RFLB 7.5% 03/15/18	7.5	10,000	9,549	18,238		2018/3/15
RFLB 7.6% 04/14/21	7.6	43,700	40,055	76,505		2021/4/14
RFLB 7.6% 07/20/22	7.6	40,000	35,989	68,738		2022/7/20
RFLB 8.15% 02/03/27	8.15	46,000	42,192	80,587		2027/2/3
RUSSIA 7.85% 03/10/18	7.85	85,000	81,489	155,644		2018/3/10
小計				913,419		
<b>(マレーシア)</b>						
国債証券						
MGS 3.26% 03/01/18	3.26	2,400	2,393	67,358		2018/3/1

銘柄	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 (千円)	
MGS 3.314% 10/31/17	3.314	2,900	2,917	82,106	2017/10/31
MGS 3.394% 03/15/17	3.394	1,800	1,811	50,964	2017/3/15
MGS 3.418% 08/15/22	3.418	3,100	2,963	83,384	2022/8/15
MGS 3.48% 03/15/23	3.48	3,150	3,019	84,962	2023/3/15
MGS 3.492% 03/31/20	3.492	2,850	2,812	79,153	2020/3/31
MGS 3.58% 09/28/18	3.58	2,350	2,359	66,393	2018/9/28
MGS 3.654% 10/31/19	3.654	2,800	2,793	78,598	2019/10/31
MGS 3.659% 10/15/20	3.659	2,700	2,683	75,503	2020/10/15
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	1,050	981	27,607	2028/6/15
MGS 3.795% 09/30/22	3.795	900	878	24,709	2022/9/30
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	550	504	14,206	2033/4/15
MGS 3.889% 07/31/20	3.889	1,600	1,604	45,146	2020/7/31
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	950	912	25,689	2027/3/15
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	1,700	1,662	46,795	2025/9/15
MGS 4.012% 09/15/17	4.012	2,550	2,599	73,136	2017/9/15
MGS 4.048% 09/30/21	4.048	3,050	3,052	85,899	2021/9/30
MGS 4.127% 04/15/32	4.127	1,950	1,863	52,442	2032/4/15
MGS 4.16% 07/15/21	4.16	3,150	3,167	89,143	2021/7/15
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	2,200	2,204	62,040	2024/7/15
MGS 4.24% 02/07/18	4.24	3,700	3,773	106,174	2018/2/7
MGS 4.378% 11/29/19	4.378	2,650	2,714	76,394	2019/11/29
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	3,200	3,232	90,976	2026/4/15
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	1,850	1,881	52,950	2030/4/15
MGS 5.734% 07/30/19	5.734	1,050	1,121	31,550	2019/7/30
小計				1,573,290	
(タイ)		千タイバート	千タイバート		
国債証券					
THAIGB 2.55% 06/26/20	2.55	11,500	11,693	40,107	2020/6/26
THAIGB 2.8% 10/10/17	2.8	20,000	20,459	70,174	2017/10/10
THAIGB 3.25% 06/16/17	3.25	44,300	45,518	156,127	2017/6/16
THAIGB 3.45% 03/08/19	3.45	13,000	13,660	46,856	2019/3/8
THAIGB 3.58% 12/17/27	3.58	18,500	19,887	68,213	2027/12/17
THAIGB 3.625% 06/16/23	3.625	40,000	42,807	146,829	2023/6/16
THAIGB 3.65% 12/17/21	3.65	65,000	69,140	237,153	2021/12/17
THAIGB 3.85% 12/12/25	3.85	29,500	32,533	111,591	2025/12/12
THAIGB 3.875% 06/13/19	3.875	71,000	75,859	260,197	2019/6/13
THAIGB 4.75% 12/20/24	4.75	12,262	14,249	48,875	2024/12/20
THAIGB 4.875% 06/22/29	4.875	30,750	37,580	128,901	2029/6/22
THAIGB 5.125% 03/13/18	5.125	20,800	22,461	77,044	2018/3/13
小計				1,392,070	
(フィリピン)		千フィリピンペソ	千フィリピンペソ		
国債証券					
PHILIP 3.9% 11/26/22	3.9	10,000	9,919	25,890	2022/11/26
PHILIP 4.95% 01/15/21	4.95	5,000	5,222	13,631	2021/1/15
PHILIP 6.25% 01/14/36	6.25	10,000	11,154	29,112	2036/1/14
小計				68,634	

銘柄	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 (千円)	
(インドネシア)		千インドネシアルピア	千インドネシアルピア		
国債証券					
INDOGB 10% 07/15/17	10.0	2,500,000	2,567,800	23,366	2017/7/15
INDOGB 10.5% 08/15/30	10.5	6,300,000	7,048,062	64,137	2030/8/15
INDOGB 11% 09/15/25	11.0	5,200,000	5,927,168	53,937	2025/9/15
INDOGB 11% 11/15/20	11.0	4,100,000	4,489,951	40,858	2020/11/15
INDOGB 12.8% 06/15/21	12.8	2,000,000	2,363,760	21,510	2021/6/15
INDOGB 5.25% 05/15/18	5.25	4,700,000	4,361,788	39,992	2018/5/15
INDOGB 5.625% 05/15/23	5.625	5,500,000	4,574,185	41,625	2023/5/15
INDOGB 6.125% 05/15/28	6.125	11,000,000	8,639,840	78,622	2028/5/15
INDOGB 6.25% 04/15/17	6.25	1,600,000	1,558,688	14,184	2017/4/15
INDOGB 6.625% 05/15/33	6.625	21,000,000	16,566,270	150,753	2033/5/15
INDOGB 7% 05/15/22	7.0	8,000,000	7,340,880	66,802	2022/5/15
INDOGB 7% 05/15/27	7.0	6,000,000	5,209,620	47,407	2027/5/15
INDOGB 7.875% 04/15/19	7.875	13,500,000	13,235,670	120,444	2019/4/15
INDOGB 8.25% 06/15/32	8.25	12,300,000	11,470,857	104,384	2032/6/15
INDOGB 8.25% 07/15/21	8.25	11,100,000	10,936,941	99,526	2021/7/15
INDOGB 8.375% 03/15/24	8.375	29,800,000	29,286,546	266,507	2024/3/15
INDOGB 8.375% 03/15/34	8.375	6,000,000	5,661,120	51,516	2034/3/15
INDOGB 8.375% 09/15/26	8.375	6,000,000	5,883,240	53,537	2026/9/15
INDOGB 9% 03/15/29	9.0	17,000,000	17,084,830	155,471	2029/3/15
INDOGB 9.5% 07/15/31	9.5	6,900,000	7,154,058	65,101	2031/7/15
小計				1,559,387	
(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					
SAGB 10.5% 12/21/26	10.5	28,650	32,520	280,323	2026/12/21
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	20,900	15,339	132,223	2036/3/31
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	18,200	13,359	115,157	2041/2/28
SAGB 6.75% 03/31/21	6.75	13,500	12,708	109,547	2021/3/31
SAGB 7% 02/28/31	7.0	20,400	17,004	146,578	2031/2/28
SAGB 7.25% 01/15/20	7.25	16,300	15,901	137,072	2020/1/15
SAGB 7.75% 02/28/23	7.75	9,700	9,380	80,859	2023/2/28
SAGB 8% 01/31/30	8.0	14,900	13,752	118,542	2030/1/31
SAGB 8% 12/21/18	8.0	10,000	10,087	86,949	2018/12/21
SAGB 8.25% 03/31/32	8.25	6,800	6,324	54,517	2032/3/31
SAGB 8.25% 09/15/17	8.25	12,900	13,105	112,966	2017/9/15
SAGB 8.5% 01/31/37	8.5	9,900	9,206	79,357	2037/1/31
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	15,600	14,715	126,851	2048/2/28
小計				1,580,947	
合計				15,939,317	

(注)邦貨換算金額は、当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

項目	当 期		比 率
	評 価 額	比 率	
公 社 債	15,939,317	千円	96.1 %
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	653,749		3.9 %
投 資 信 託 財 産 総 額	16,593,066		100.0 %

(注1)当期末における外貨建純資産(16,160,854千円)の投資信託財産総額(16,593,066千円)に対する比率は97.4%です。

(注2)外貨建資産は、当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。1米ドル=123.20円、1メキシコペソ=7.34円、1ブラジルレアル=32.42円、1チリペソ=0.1753円、1コロンビアペソ=0.0421円、1ペルーヌエボソル=37.18円、1トルコリラ=42.18円、1ハンガリーフォリント=0.4223円、1ポーランドズロチ=31.13円、1ロシアルブル=1.91円、1マレーシアリンギット=28.14円、1タイバート=3.43円、1フィリピンペソ=2.61円、1インドネシアルピア=0.0091円、1南アフリカランド=8.62円です。

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2015年11月10日現在
(A) 資 産	16,882,058,081円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	342,816,129
公 社 債(評価額)	15,939,317,306
未 収 入 金	289,479,400
未 収 利 息	274,407,815
前 払 費 用	36,037,431
(B) 負 債	538,273,419
未 払 金	516,062,872
未 払 解 約 金	22,210,547
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	16,343,784,662
元 本	10,367,217,083
次 期 繰 越 損 益 金	5,976,567,579
(D) 受 益 権 総 口 数	10,367,217,083口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,765円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2014年11月11日 至 2015年11月10日
(A) 配 当 等 収 益	900,748,092円
受 取 利 息	900,748,092
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△2,435,060,261
売 買 益	324,213,014
売 買 損	△2,759,273,275
(C) そ の 他 費 用	△28,072,563
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,562,384,732
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	10,025,425,091
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,285,715,988
(G) 解 約 差 損 益 金	△4,772,188,768
(H) 計 (D+E+F+G)	5,976,567,579
次 期 繰 越 損 益 金(H)	5,976,567,579

(注1) (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2) (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3) (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。

## お知らせ

信託契約の解約、変更等における書面決議の要件を緩和するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2014年12月1日)

信託契約の解約、変更等における書面決議に反対の受益者による買取請求権に係る条項を削除するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。なお、反対の受益者は解約の実行の請求を選択することによって対応できます。

(変更日:2014年12月1日)

一般社団法人投資信託協会「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」の一部改正及び「信用リスク集中回避のための投資制限に係るガイドライン」の制定に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2015年2月11日)

# 新興国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第7期（決算日 2015年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2008年12月12日から無期限です。
運用方針	主として取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)を主要投資対象とします。
組入制限	株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 組入比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
	円	騰落率	円	騰落率			
第3期(2011年11月10日)	15,511	△18.1	15,175	△19.2	99.0	0.3	10,663
第4期(2012年11月12日)	16,516	6.5	15,672	3.3	96.0	0.4	14,622
第5期(2013年11月11日)	21,178	28.2	19,592	25.0	97.4	0.4	21,878
第6期(2014年11月10日)	24,850	17.3	22,465	14.7	89.6	0.5	21,821
第7期(2015年11月10日)	23,378	△5.9	20,671	△8.0	93.8	0.8	25,618

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 組入比率	投資信託 組入比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2014年11月10日	24,850	－	22,465	－	89.6	0.5
11月末	26,250	5.6	23,812	6.0	95.8	0.8
12月末	25,370	2.1	22,987	2.3	94.8	0.7
2015年 1月末	25,325	1.9	22,889	1.9	96.0	0.7
2月末	26,092	5.0	23,576	4.9	97.3	0.8
3月末	25,718	3.5	23,158	3.1	96.7	0.7
4月末	27,813	11.9	25,077	11.6	97.8	0.7
5月末	27,671	11.4	24,844	10.6	97.5	0.7
6月末	26,178	5.3	23,366	4.0	96.6	1.0
7月末	24,810	△0.2	22,058	△1.8	95.2	0.8
8月末	22,204	△10.6	19,770	△12.0	97.0	0.8
9月末	20,949	△15.7	18,523	△17.5	92.9	0.8
10月末	23,035	△7.3	20,347	△9.4	93.9	0.8
(当期末) 2015年11月10日	23,378	△5.9	20,671	△8.0	93.8	0.8

(注1)騰落率は期首比です。

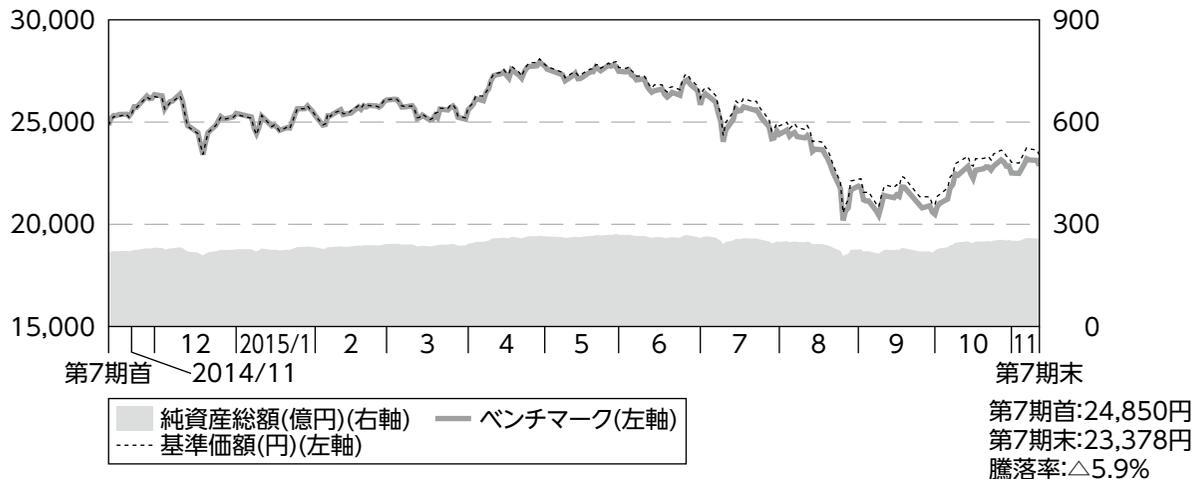
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)です。

MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。本報告書においては、設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

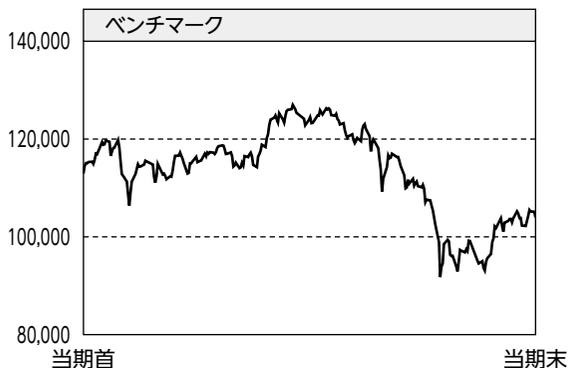


(注)ベンチマークは、2014年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるMSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)の動きを反映して、基準価額は下落しました。

## 投資環境



期初の新興国株式市場は、中国人民銀行による利下げや預金準備率の引き下げに加え、インド準備銀行による利下げやECB(欧州中央銀行)の予想を上回る規模の量的金融緩和導入など世界的な金融緩和の進展が好感されました。しかし、ギリシャ向け金融支援をめぐる協議が難航しギリシャが債務不履行となる懸念が強まったことに加え、FRB(米連邦準備理事会)による年内利上げ観測が高まったことや、中国の景気減速懸念が一段と強まったことなどから新興国株式市場は大幅に下落しました。

期末にかけては、FRBによる利上げ開始時期が後ずれするとの観測が強まったことや、中国人民銀行が追加金融緩和に踏み切ったことから新興国株式市場は反発し下げ幅を縮小しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるMSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

### (1)組入比率

資金の流出入などにはコスト抑制の観点から海外の株価指数先物を利用し、DR(預託証券)および先物を含む株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

### (2)ポートフォリオ構成

ベンチマーク構成銘柄およびそのDRに分散投資し、ベンチマークとの連動を目指しました。

## 当ファンドの組入資産の内容

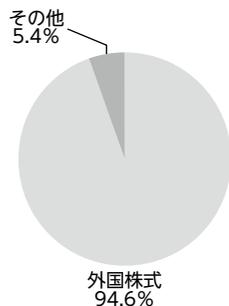
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	3.4%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	2.8%
3	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン諸島	2.7%
4	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	香港	1.9%
5	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	1.6%
6	NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	1.6%

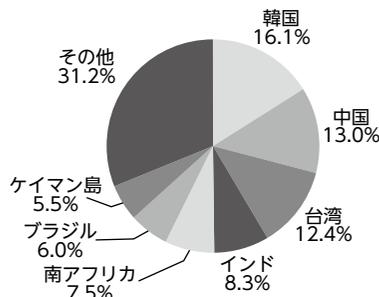
順位	銘柄名	国	組入比率
7	IND&COMM BK OF CHINA-H	中国	1.2%
8	BANK OF CHINA LTD-H	中国	1.0%
9	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	1.0%
10	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	0.8%
組入銘柄数			817

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

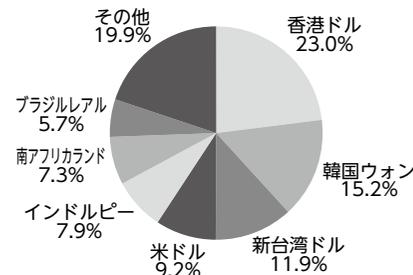
### ○資産別配分



### ○国別配分



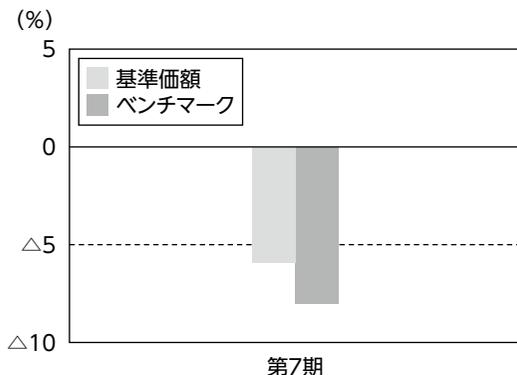
### ○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率は概ねベンチマークに連動しました。

差異の主な要因は、配当金要因\*およびコスト要因です。

\*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差異要因です。

## 今後の運用方針

主として、取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2014年11月1日~2015年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	9円 (6) (0) (-) (-) (1) (-) (3)	0.038% (0.023) (0.000) (-) (-) (0.003) (-) (0.011)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	5 (5) (0) (-) (-) (-) (0)	0.021 (0.021) (0.000) (-) (-) (-) (0.000)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用)	57 (57) (-)	0.228 (0.228) (-)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
合計	71	0.287	

(注1) 期中の費用(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2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、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(25,117円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 2,630	千米ドル 1,995	百株 561	千米ドル 1,068
	メ キ シ コ	9,528 (234)	千メキシコペソ 31,068 (-)	960 (-)	千メキシコペソ 1,445 (81)
	ブ ラ ジ ル	5,329	千ブラジルリアル 10,848	1,155 (606)	千ブラジルリアル 1,324 (12)
	チ リ	6,864 (245)	千チリペソ 402,894 (-)	38 (0.16)	千チリペソ 12,649 (-)
	コ ロ ン ビ ア	6,678 (43)	千コロンビアペソ 3,763,836 (152,169)	120 (42)	千コロンビアペソ 177,540 (152,169)
	ギ リ シ ャ	99	千ユーロ 149	752 (-)	千ユーロ 701 (0.5234)
	ト ル コ	2,331 (70)	千トルコリラ 1,971 (-)	31 (668)	千トルコリラ 42 (159)
	チ ェ コ	168	千チェココルナ 8,555	97	千チェココルナ 1,748
	ハ ン ガ リ ー	84	千ハンガリーフォリント 38,266	-	千ハンガリーフォリント -
	ポ ー ラ ン ド	1,447 (55)	千ポーランドズロチ 3,650 (17)	809 (-)	千ポーランドズロチ 200 (17)
	香 港	134,540 (4,811)	千香港ドル 116,144 (516)	10,680	千香港ドル 5,463
	国	マ レ ー シ ア	14,588 (1,036)	千マレーシアリンギット 7,355 (227)	1,732
タ イ		10,428 (1,076)	千タイバーツ 50,617 (24)	- (-)	千タイバーツ - (34)
フ ィ リ ピ ン		3,494 (56)	千フィリピンペソ 24,923 (414)	-	千フィリピンペソ -

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	インドネシア	百株 37,739	千インドネシアルピア 16,864,047	百株 206	千インドネシアルピア 308,281
	韓国	1,312 (166)	千韓国ウォン 10,016,684 (233,685)	123 (149)	千韓国ウォン 417,703 (183,450)
	台湾	49,260 (4,279)	千新台幣ドル 198,495 (2,100)	4,114	千新台幣ドル 9,073
	インド	7,718 (2,111)	千インドルピー 412,585 (927)	2,257	千インドルピー 52,885
	カタール	507 (2)	千カタールリアル 2,212 (-)	-	千カタールリアル -
	南アフリカ	4,276 (77)	千南アフリカランド 53,091 (238)	636 (1,153)	千南アフリカランド 1,513 (3,837)
	アラブ首長国連邦	1,218 (116)	千アラブ首長国連邦ディルハム 769 (-)	-	千アラブ首長国連邦ディルハム -

(注1)金額は受渡代金です。

(注2) ( )内は株式分割、予約権行使、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。

<新株予約権証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	タイ	証券 - (5,660)	千タイバーツ - (34)	証券 5,660	千タイバーツ 29

(注1)金額は受渡代金です。

(注2) ( )内は権利付与、権利行使および権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

<投資信託受益証券、投資証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国					
アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル	
GLOBAL X FTSE GREECE 20 ETF	56,000	663	56,000	549	
小 計	56,000	663	56,000	549	
メキシコ	口	千メキシコペソ	口	千メキシコペソ	
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	43,200	1,766	(-)	(173)	
小 計	43,200	1,766	(-)	(173)	
ブラジル	口	千ブラジルリアル	口	千ブラジルリアル	
SUL AMERICA SA-UNITS	11,400	199	-	-	
KLABIN SA-UNIT	9,700	200	-	-	
小 計	21,100	400	-	-	
トルコ	口	千トルコリラ	口	千トルコリラ	
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	68,772 (66,858)	222 (159)	-	-	
小 計	68,772 (66,858)	222 (159)	-	-	
南アフリカ	口	千南アフリカランド	口	千南アフリカランド	
REDEFINE PROPERTIES LTD	87,673 (4,247)	982 (40)	-	-	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	- (102,326)	- (2,685)	-	-	
RESILIENT PROPERTY INCOME	- (13,040)	- (1,093)	-	-	
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	22,923	2,747	-	-	
RESILIENT PROPERTY INCOM-RTS	- (1,239)	- (-)	1,239	2	
小 計	110,596 (120,852)	3,729 (3,819)	1,239	2	

(注1)金額は受渡代金です。

(注2) ( )内は合併・分割・減資・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		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国		百万円	百万円	百万円	百万円
株 式 先 物 取 引		8,766	9,500	-	-

(注)金額は受渡代金です。

## 株式売買比率

## &lt;株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合&gt;

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	7,773,142千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	23,343,188千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.33

(注1) (b)当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c)売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

## ■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為 替 直 物 取 引	14,645	373	2.5	9,229	479	5.2
コ ー ル ・ ロ ー ン	15,437	262	1.7	19,830	255	1.3

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## 組入資産の明細

## &lt;外国株式(上場、登録株式)&gt;

銘 柄	当期首(前期末)	当 期 末				業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
(アメリカ)			千米ドル			
BANCOLOMBIA S. A. -SPONS ADR	132	—	—	—	銀行	
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	169	169	95	11,742	素材	
CREDICORP LTD	28	36	406	50,078	銀行	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	244	306	208	25,639	電気通信サービス	
SOUTHERN COPPER CORP	69	69	185	22,855	素材	
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	245	—	—	—	エネルギー	
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	584	584	50	6,245	エネルギー	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	231	296	1,164	143,498	エネルギー	
GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR REG S	387	387	43	5,347	電気通信サービス	
GAZPROM OAO-SPON ADR	2,648	3,414	1,428	176,046	エネルギー	
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	444	523	271	33,481	銀行	
SURGUTNEFTGAGAZ-SP ADR	509	688	377	46,546	エネルギー	

※ 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。

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	50	—	—	—	電気通信サービス
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	41	53	505	62,300	エネルギー
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	262	340	499	61,530	素材
ROSTELECOM-SPONSORED ADR	58	124	110	13,567	電気通信サービス
ROSNEFT OJSC-GDR	564	818	332	40,973	エネルギー
URALKALI-SPON GDR-REG S	132	—	—	—	素材
SEVERSTAL - GDR REG S	94	155	179	22,112	素材
TATNEFT-SPONSORED REGS GDR	111	136	439	54,130	エネルギー
VTB BANK PJSC -GDR-REG S	1,337	1,624	379	46,801	銀行
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	117	151	702	86,580	食品・生活必需品小売り
RUSHYDRO PJSC-ADR	489	857	78	9,652	公益事業
SBERBANK-SPONSORED ADR	1,262	1,549	961	118,443	銀行
MEGAFON-PJSC	57	57	77	9,493	電気通信サービス
DP WORLD LTD	109	109	218	26,878	運輸
小 計	10,384	12,453	8,717	1,073,948	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	26	22	—	<4.2%>	
(メキシコ)			千メキシコペソ		
ALFA S. A. B. -A	1,216	1,750	6,004	44,071	資本財
COCA-COLA FEMSA SAB-SER	210	295	3,734	27,408	食品・飲料・タバコ
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	828	1,014	16,462	120,836	食品・飲料・タバコ
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	109	109	2,467	18,110	小売
GRUPO FIN SANTANDER-B	779	1,073	3,382	24,824	銀行
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	1,101	1,406	13,549	99,455	メディア
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	811	1,035	4,855	35,637	食品・飲料・タバコ
GRUMA S. A. B. -B	98	98	2,484	18,237	食品・飲料・タバコ
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	112	112	2,352	17,265	資本財
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	223	375	2,795	20,519	資本財
CEMEX SAB-SPONS	5,351	7,748	7,772	57,047	素材
GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	1,077	1,398	12,832	94,188	銀行
MEXICHEM SAB DE CV-*	394	621	2,598	19,076	素材
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	59	99	2,178	15,991	素材
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	641	926	3,772	27,690	家庭用品・パーソナル用品
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	99	99	2,568	18,856	運輸
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	1,645	2,267	8,956	65,737	素材
AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	14,719	17,644	24,684	181,184	電気通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	969	1,165	3,941	28,928	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	140	230	2,364	17,357	食品・飲料・タバコ
WALMART DE MEXICO-SER V	2,203	2,719	12,467	91,511	食品・生活必需品小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	174	174	2,698	19,804	運輸
GENOMMA LAB INTERNACIONAL-B	478	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OHL MEXICO SAB DE CV	376	376	757	5,558	運輸
MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	482	—	—	—	素材
GENTERA SAB DE CV	408	771	2,474	18,160	各種金融
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	196	196	918	6,738	食品・生活必需品小売り

銘柄	株数 (百株)	当期首(前期末)	当 期 末		業 種		
			株 数 (百株)	評 価 額		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
GRUPO LALA SAB DE CV	358	358	1,520	11,162	食品・飲料・タバコ		
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	35,262	44,064	150,594	1,105,360		
(ブラジル)		28	26	—	<4.3%>		
			千ブラジルレアル				
BRF SA	291	347	1,932	62,661	食品・飲料・タバコ		
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	161	161	146	4,734	耐久消費財・アパレル		
VALE SA	569	680	1,049	34,038	素材		
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	33	33	106	3,460	公益事業		
VALE SA-PREF A	871	1,122	1,447	46,930	素材		
TIM PARTICIPACOES SA	298	412	337	10,952	電気通信サービス		
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	177	177	186	6,053	公益事業		
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	163	—	—	—	公益事業		
BANCO DO BRASIL S. A.	392	471	799	25,928	銀行		
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	280	280	76	2,476	素材		
AES TIETE SA-PREF	61	61	88	2,885	公益事業		
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	1,468	2,178	1,601	51,916	銀行		
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	193	318	551	17,872	小売		
LOJAS AMERICANAS SA	90	90	110	3,574	小売		
GERDAU SA-PREF	432	432	240	7,787	素材		
METALURGICA GERDAU SA-PREF	87	—	—	—	素材		
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	1,311	1,564	1,449	47,003	エネルギー		
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	1,847	2,441	1,865	60,470	エネルギー		
SOUZA CRUZ SA	154	—	—	—	食品・飲料・タバコ		
KROTON EDUCATIONAL SA	609	726	736	23,870	消費者サービス		
CCR SA	415	415	525	17,033	運輸		
WEG SA	108	314	469	15,207	資本財		
BANCO BRADESCO SA-PREF	938	1,388	2,976	96,488	銀行		
BANCO BRADESCO S. A.	278	382	910	29,524	銀行		
ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	247	—	—	—	運輸		
NATURA COSMETICOS SA	60	107	255	8,280	家庭用品・パーソナル用品		
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	234	234	118	3,838	素材		
BRADESPAR SA -PREF	66	—	—	—	素材		
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	185	185	311	10,100	素材		
CPFL ENERGIA SA	71	156	241	7,824	公益事業		
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1,226	1,709	4,686	151,948	銀行		
PORTO SEGURO SA	20	73	236	7,670	保険		
FIBRIA CELULOSE SA	94	139	721	23,397	素材		
BRASKEM SA-PREF A	89	89	198	6,440	素材		
TRACTEBEL ENERGIA SA	57	57	199	6,462	公益事業		
LOCALIZA RENT A CAR	35	108	306	9,931	運輸		
LOJAS RENNEN S. A.	59	295	533	17,301	小売		
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	47	47	58	1,897	公益事業		
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	165	196	1,320	42,796	エネルギー		
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	43	43	107	3,485	エネルギー		

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS	34	—	—	—	公益事業
TOTVS SA	27	73	269	8,732	ソフトウェア・サービス
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	—	75	269	8,733	公益事業
EMBRAER SA	268	334	926	30,048	資本財
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	46	103	159	5,162	公益事業
BR PROPERTIES SA	130	—	—	—	不動産
M DIAS BRANCO SA	21	21	151	4,908	食品・飲料・タバコ
ODONTOPREV S. A.	124	124	125	4,080	ヘルスケア機器・サービス
B2W CIA DIGITAL	67	67	100	3,256	小売
BR MALLS PARTICIPACOES SA	224	224	268	8,699	不動産
JBS SA	306	444	619	20,080	食品・飲料・タバコ
OI SA-PREFERENCE	1,870	—	—	—	電気通信サービス
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	358	358	265	8,610	公益事業
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	131	261	471	15,273	公益事業
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	18	55	239	7,774	不動産
BANCO ESTADO RIO GRANDE SUL	15	115	70	2,292	銀行
ESTACIO PARTICIPACOES SA	138	138	215	7,001	消費者サービス
DURATEX SA	16	216	148	4,798	素材
HYPERMARCAS SA	122	216	462	14,985	家庭用品・パーソナル用品
BM&FBOVESPA SA	857	1,052	1,270	41,199	各種金融
TELEFONICA BRASIL S. A.	110	194	756	24,535	電気通信サービス
QUALICORP SA	83	83	135	4,407	ヘルスケア機器・サービス
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	114	114	424	13,776	各種金融
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	135	135	79	2,591	運輸
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	66	108	564	18,301	食品・生活必需品小売り
CIELO SA	317	450	1,648	53,453	ソフトウェア・サービス
RAIA DROGASIL SA	72	129	528	17,142	食品・生活必需品小売り
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	321	450	1,237	40,119	保険
AMBEV SA	2,077	2,587	4,837	156,837	食品・飲料・タバコ
小 計	21,998	25,565	43,153	1,399,049	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	68	61	—	<5.5%>	
(チリ)			千チリペソ		
BANCO SANTANDER CHILE	29,096	29,096	94,125	16,500	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSION	8	22	63,023	11,047	銀行
BANCO DE CHILE	10,901	11,147	80,515	14,114	銀行
CAP SA	38	—	—	—	素材
AES GENER SA	1,417	1,417	49,002	8,590	公益事業
EMPRESAS CMPC SA	569	569	95,645	16,766	素材
EMPRESAS COPEC SA	187	237	159,478	27,956	エネルギー
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	41	93	80,586	14,126	食品・飲料・タバコ
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	60	60	39,762	6,970	電気通信サービス
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	1,581	1,581	135,636	23,777	公益事業
ENERSIS SA	7,600	10,304	181,676	31,847	公益事業
COLBUN SA	2,652	4,758	88,048	15,434	公益事業

銘柄	株数 (百株)	当	期 末		業 種	
		株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
AGUAS ANDINAS SA-A	424	1,632	59,358	10,405	公益事業	
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	152	152	36,931	6,474	食品・飲料・タバコ	
LATAM AIRLINES GROUP SA	141	221	88,401	15,496	運輸	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	41	41	54,990	9,639	素材	
S. A. C. I. FALABELLA	430	515	239,294	41,948	小売	
CORPBANCA	84,199	84,199	51,749	9,071	銀行	
VINA CONCHA Y TORO SA	367	367	42,670	7,480	食品・飲料・タバコ	
CENCOSUD SA	451	673	103,435	18,132	食品・生活必需品小売り	
SONDA SA	—	342	38,943	6,826	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	140,363 20	147,435 20	1,783,277 —	312,608 <1.2%>	
(コロンビア)				千コロンビアペソ		
ALMACENES EXITO SA	—	127	163,748	6,893	食品・生活必需品小売り	
INTERCONEXION ELECTRICA SA	—	207	148,046	6,232	公益事業	
ISAGEN SA ESP	—	497	153,619	6,467	公益事業	
ECOPETROL SA	—	3,573	498,471	20,985	エネルギー	
BANCO DAVIVIENDA SA	—	59	142,368	5,993	銀行	
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	—	47	169,380	7,130	各種金融	
GRUPO AVAL ACCIONES-PF	—	1,309	153,212	6,450	銀行	
CEMENTOS ARGOS SA	—	117	114,865	4,835	素材	
GRUPO ARGOS SA	—	177	317,241	13,355	素材	
BANCOLOMBIA SA-PREF	—	253	634,649	26,718	銀行	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	—	145	526,491	22,165	各種金融	
CORP FIN COLOMBIANA-CD	—	42	163,677	6,890	各種金融	
CORP FINANCIERA COLOMB-ND	—	0.39	1,449	61	各種金融	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	— —	6,558 13	3,187,221 —	134,182 <0.5%>	
(ギリシャ)				千ユーロ		
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	233	—	—	—	電気通信サービス	
OPAP SA	184	—	—	—	消費者サービス	
JUMBO SA	137	—	—	—	小売	
TITAN CEMENT CO. S. A.	54	—	—	—	素材	
FF GROUP	42	—	—	—	小売	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	653 5	— —	— —	— <—%>	
(トルコ)				千トルコリラ		
AKBANK T. A. S.	806	1,328	1,025	43,254	銀行	
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	61	112	258	10,918	食品・飲料・タバコ	
ARCELIK AS	153	153	249	10,526	耐久消費財・アパレル	
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	284	316	166	7,023	資本財	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	613	613	239	10,087	素材	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	32	32	114	4,837	自動車・自動車部品	
KOC HOLDING AS	248	387	512	21,600	資本財	
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	—	320	147	6,210	素材	

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	326	364	122	5,181	資本財	
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	67	67	132	5,594	自動車・自動車部品	
TURK HAVA YOLLARI AO	323	323	296	12,500	運輸	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	377	377	448	18,924	電気通信サービス	
TURKIYE GARANTI BANKASI	1,030	1,371	1,093	46,110	銀行	
TURKIYE IS BANKASI-C	727	727	376	15,872	銀行	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	44	74	574	24,247	エネルギー	
ULKER BISKUVI SANAYI	96	96	184	7,795	食品・飲料・タバコ	
YAPI VE KREDI BANKASI	259	517	196	8,268	銀行	
HACI OMER SABANCI HOLDING	427	614	576	24,336	各種金融	
COCA-COLA ICECEK AS	44	44	173	7,321	食品・飲料・タバコ	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	103	103	619	26,137	食品・生活必需品小売り	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	169	519	232	9,793	銀行	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	98	98	229	9,687	運輸	
TURKIYE HALK BANKASI	220	353	433	18,289	銀行	
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	177	177	111	4,721	電気通信サービス	
KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	31	—	—	—	素材	
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	668	—	—	—	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	7,394 25	9,096 24	8,516 —	359,244 <1.4%>	
(チェコ)			千	千		
KOMERCNI BANKA AS	6	11	5,916	28,991	銀行	
CEZ AS	78	137	6,696	32,814	公益事業	
PEGAS NONWOVENS SA	—	7	525	2,572	耐久消費財・アパレル	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	85 2	155 3	13,138 —	64,378 <0.3%>	
(ハンガリー)			千	千		
RICHTER GEDEON NYRT	41	84	42,464	17,932	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	22	22	30,712	12,970	エネルギー	
OTP BANK NYRT	93	134	76,406	32,266	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	157 3	241 3	149,583 —	63,169 <0.2%>	
(ポーランド)			千	千		
BANK MILLENNIUM SA	330	330	187	5,838	銀行	
M BANK SA	4	8	275	8,568	銀行	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	20	20	144	4,493	銀行	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	59	83	745	23,217	素材	
BANK PEKAO SA	54	78	1,130	35,186	銀行	
ORANGE POLSKA SA	257	556	394	12,267	電気通信サービス	
POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	132	172	1,120	34,883	エネルギー	
LPP SA	0.38	0.67	460	14,349	耐久消費財・アパレル	
BANK ZACHODNI WBK SA	11	23	696	21,685	銀行	
PKO BANK POLSKI SA	369	498	1,376	42,864	銀行	
CCC SA	—	12	195	6,081	耐久消費財・アパレル	

銘柄	当期末(前期末)	期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
SYNTHOS SA	337	337	131	4,107	素材	
EUROCASH SA	50	50	245	7,635	食品・生活必需品小売り	
GRUPA LOTOS SA	55	55	151	4,723	エネルギー	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	660	1,464	937	29,186	エネルギー	
CYFROWY POLSAT SA	118	118	309	9,633	メディア	
GRUPA AZOTY SA	27	27	279	8,685	素材	
ENEA SA	129	129	157	4,908	公益事業	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	330	418	601	18,713	公益事業	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	570	570	179	5,592	公益事業	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	22	31	1,199	37,337	保険	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	55	—	—	—	素材	
GETIN NOBLE BANK SA	698	—	—	—	銀行	
ALIOR BANK SA	29	29	220	6,853	銀行	
ENERGA SA	128	128	196	6,107	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	4,456	5,149	11,337	352,923	
		24	23	—	<1.4%>	
(香港)				千香港ドル		
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	380	830	859	13,663	素材	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	680	680	719	11,431	運輸	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	—	860	538	8,554	運輸	
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	2,675	3,420	31,190	495,615	電気通信サービス	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	580	765	1,836	29,174	素材	
DATANG INTL POWER GENERATION CO. LTD. -H	1,580	1,580	445	7,079	公益事業	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	235	235	1,129	17,942	資本財	
HUANENG POWER INTL INC-H	1,500	1,900	1,544	24,545	公益事業	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	1,400	1,400	894	14,215	電気通信サービス	
YANZHOU COAL MINING CO-H	520	1,120	442	7,029	エネルギー	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	345	400	3,292	52,309	家庭用品・パーソナル用品	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	—	840	479	7,621	公益事業	
NEW WORLD CHINA LAND LTD	1,700	1,700	897	14,262	不動産	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	1,500	1,500	1,590	25,265	自動車・自動車部品	
CHINA INTL MARINE CO-H	356	356	494	7,851	資本財	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	740	2,120	1,490	23,681	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	1,910	2,110	5,613	89,201	不動産	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	760	1,731	3,747	59,553	不動産	
CITIC LTD	900	2,360	3,388	53,850	資本財	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	1,080	1,080	943	14,998	運輸	
LENOVO GROUP LTD	2,820	3,600	2,721	43,246	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
POLY PRORERTY GROUP CO LIMITED	1,370	—	—	—	不動産	
PETROCHINA CO LTD-H	9,320	11,700	6,973	110,804	エネルギー	
CHINA UNICOM (HONG KONG) LTD-R	2,140	3,160	3,131	49,760	電気通信サービス	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	658	1,018	2,652	42,148	保険	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	11,254	13,794	7,517	119,456	エネルギー	
CHAODA MODERN AGRICULTURE	680	—	—	—	食品・飲料・タバコ	

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	340	420	1,717	27,295	公益事業
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	1,120	1,620	1,012	16,088	エネルギー
COSCO PACIFIC LIMITED-R	560	1,020	1,022	16,251	運輸
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	3,440	3,440	478	7,597	不動産
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL-R	395	555	1,401	22,273	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,560	1,560	397	6,321	素材
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	360	620	1,261	20,048	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LTD	840	840	962	15,296	公益事業
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	93	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	1,700	2,950	1,147	18,234	自動車・自動車部品
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	300	520	1,089	17,310	公益事業
BYD CO LTD-H	260	370	1,827	29,043	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD-H	6,240	8,400	3,427	54,458	電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	720	1,040	887	14,096	エネルギー
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	3,200	5,300	1,134	18,022	メディア
SINOTRANS LIMITED-H	—	910	394	6,275	運輸
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	1,070	1,070	1,316	20,912	商業・専門サービス
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	830	—	—	—	素材
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,494	1,928	3,421	54,364	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	520	1,240	817	12,984	資本財
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	894	1,134	1,909	30,344	公益事業
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	497	1,492	1,510	24,000	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	3,350	4,150	11,869	188,598	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	3,790	3,790	780	12,405	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1,080	1,080	611	9,713	ヘルスケア機器・サービス
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	—	12,140	910	14,467	半導体・半導体製造装置
WEICHAI POWER CO LTD-H	142	544	462	7,356	資本財
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	310	1,990	652	10,371	素材
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	150	150	312	4,969	資本財
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	900	1,220	1,598	25,395	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	200	200	734	11,663	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	1,040	1,500	1,620	25,741	公益事業
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	400	660	918	14,598	食品・生活必需品小売り
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	880	880	875	13,913	運輸
CNOOC LTD-R	7,840	9,650	8,453	134,324	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,080	1,640	1,656	26,320	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	2,200	2,200	684	10,871	運輸
CHINA MENGNIU DAIRY CO-R	630	1,540	2,128	33,818	食品・飲料・タバコ
TENCENT HOLDINGS LTD	2,254	2,887	43,882	697,291	ソフトウェア・サービス
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	925	2,975	13,625	216,509	保険
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	1,420	2,220	1,371	21,800	公益事業
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	5,939	5,939	884	14,062	小売
CHINA POWER INTERNATIONAL	—	2,080	988	15,699	公益事業
AIR CHINA LIMITED-H	640	1,180	836	13,293	運輸

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
ZTE CORP-H	404	485	908	14,429	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	1,680	1,680	808	12,840	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	1,530	1,710	2,236	35,540	エネルギー
CHINA COSCO HOLDINGS-H	755	1,605	792	12,598	運輸
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	4,174	4,844	2,780	44,188	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	600	1,000	1,192	18,940	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	31,956	46,446	25,963	412,558	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	320	320	1,302	20,695	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,220	1,660	1,882	29,911	自動車・自動車部品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	320	1,010	534	8,489	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	1,340	1,340	609	9,688	素材
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	370	—	—	—	小売
BANK OF CHINA LTD-H	35,312	43,942	15,731	249,969	銀行
SHUI ON LAND LTD	2,092	2,092	475	7,548	不動産
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	655	655	886	14,092	不動産
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	688	688	564	8,975	不動産
CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	840	—	—	—	素材
CHINA MERCHANTS BANK-H	2,144	2,594	5,538	88,009	銀行
IND&COMM BK OF CHINA-H	32,745	40,505	19,766	314,089	銀行
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	160	1,300	417	6,630	電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1,640	2,390	2,533	40,255	資本財
CHINA COAL ENERGY CO - H	1,440	2,290	819	13,026	エネルギー
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	90	350	480	7,630	資本財
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	395	395	1,951	31,006	資本財
INTIME RETAIL GROUP CO LTD	700	—	—	—	小売
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	470	700	1,003	15,950	耐久消費財・アパレル
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	163	1,463	466	7,415	食品・飲料・タバコ
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,152	2,672	804	12,783	不動産
CHINA CITIC BANK-H	4,102	4,102	2,153	34,219	銀行
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	1,730	2,280	1,687	26,809	耐久消費財・アパレル
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	420	420	905	14,382	耐久消費財・アパレル
FOSUN INTERNATIONAL	670	930	1,408	22,373	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	2,200	2,200	508	8,075	不動産
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	930	1,875	810	12,877	不動産
SOHO CHINA LTD	1,130	1,130	452	7,182	不動産
KINGSOFT CORP LTD	170	400	759	12,063	ソフトウェア・サービス
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	3,570	5,510	898	14,271	半導体・半導体製造装置
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	2,000	2,000	1,432	22,754	資本財
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	936	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	655	1,095	1,285	20,427	資本財
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	2,690	3,290	2,049	32,569	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	1,222	1,548	5,108	81,172	保険
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	1,470	2,950	1,843	29,297	不動産
CRRC CORP LTD-H	1,400	2,340	2,317	36,818	資本財

銘柄	当期末(前期末)	期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
SUN ART RETAIL GROUP LTD	875	875	557	8,856	食品・生活必需品小売り	
BBMG CORPORATION - H	105	690	406	6,457	素材	
SINOPHARM GROUP CO-H	468	720	2,368	37,640	ヘルスケア機器・サービス	
CHINA RESOURCES CEMENT	1,340	1,340	406	6,451	素材	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	622	1,222	914	14,529	自動車・自動車部品	
YINGDE GASES GROUP COMPANY	610	—	—	—	素材	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	1,390	1,390	713	11,330	銀行	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	1,230	2,530	1,821	28,945	公益事業	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	430	430	802	12,749	ヘルスケア機器・サービス	
HUANENG RENEWABLES CORP-H	—	3,060	722	11,475	公益事業	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	1,770	1,770	777	12,355	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	—	780	411	6,531	不動産	
BIOSTIME INTERNATIONAL HOLDI	120	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	1,093	—	—	—	資本財	
LONGFOR PROPERTIES	240	730	817	12,991	不動産	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	347	488	1,756	27,915	保険	
CHINA MINSHENG BANKING-H	2,870	3,350	2,656	42,212	銀行	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	550	2,230	887	14,103	銀行	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	10,010	13,830	4,370	69,443	銀行	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	330	—	—	—	小売	
FAR EAST HORIZON LTD	760	1,410	995	15,817	各種金融	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	455	1,150	2,237	35,560	各種金融	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	—	510	569	9,043	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	528	2,036	3,058	48,592	各種金融	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	320	400	2,078	33,019	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	2,560	3,690	1,549	24,626	保険	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	260	260	678	10,782	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	680	680	427	6,796	資本財	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	—	1,725	1,342	21,325	各種金融	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	4,100	6,500	1,270	20,192	半導体・半導体製造装置	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	1,030	4,350	1,248	19,837	食品・飲料・タバコ	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	2,210	5,250	1,606	25,527	各種金融	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	—	855	1,518	24,128	資本財	
CHINA VANKE CO LTD-H	443	750	1,405	22,333	不動産	
LUYE PHARMA GROUP LTD	—	655	501	7,972	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CGN POWER CO LTD-H	—	4,900	1,577	25,071	公益事業	
DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	—	307	1,561	24,805	不動産	
GF SECURITIES CO LTD-H	—	716	1,270	20,183	各種金融	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	—	440	865	13,745	各種金融	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILI-B	251	476	733	11,648	自動車・自動車部品	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	297,340 140	426,011 143	368,485 —	5,855,236 <22.9%>	
(マレーシア)				千マレーシアリンギット		
AMMB HOLDINGS BHD		899	1,302	621	17,476	銀行

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
GENTING PLANTATIONS BHD	140	140	146	4,112	食品・飲料・タバコ	
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	2,197	3,108	1,451	40,854	銀行	
DIGI.COM BERHAD	1,153	1,520	790	22,241	電気通信サービス	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	446	535	281	7,917	運輸	
RHB CAPITAL BHD	336	339	211	5,950	銀行	
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	313	315	102	2,884	消費者サービス	
GAMUDA BHD	747	747	342	9,648	資本財	
YTL CORPORATION BERHAD	1,250	2,474	376	10,582	公益事業	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	17	149	210	5,933	銀行	
HONG LEONG BANK BERHAD	225	225	317	8,933	銀行	
IJM CORP BHD	275	1,148	377	10,628	資本財	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	190	286	669	18,832	食品・飲料・タバコ	
MALAYAN BANKING BHD	1,908	2,662	2,234	62,870	銀行	
LAFARGE MALAYAN BHD	261	261	237	6,676	素材	
MMC CORP BHD	538	—	—	—	資本財	
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	706	706	259	7,291	銀行	
MISC BHD	565	565	521	14,669	運輸	
PPB GROUP BERHAD	205	205	319	8,999	食品・飲料・タバコ	
PETRONAS DAGANGAN BHD	153	153	354	9,962	エネルギー	
PETRONAS GAS BHD	319	319	731	20,574	公益事業	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	51	51	305	8,602	食品・飲料・タバコ	
TELECOM MALAYSIA BHD	339	705	463	13,043	電気通信サービス	
TENAGA NATIONAL BHD	1,202	1,969	2,592	72,944	公益事業	
UMW HOLDINGS BHD	340	340	282	7,941	自動車・自動車部品	
DIALOG GROUP BHD	2,229	2,229	361	10,164	資本財	
PUBLIC BANK BHD-LOCAL MKT	1,182	1,483	2,696	75,878	銀行	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	1,223	1,223	187	5,266	公益事業	
AIRASIA BHD	648	648	88	2,498	運輸	
GENTING BHD	893	1,489	1,139	32,053	消費者サービス	
GENTING MALAYSIA BERHAD	982	1,584	693	19,523	消費者サービス	
IOI CORPORATION BHD	1,212	1,796	779	21,939	食品・飲料・タバコ	
SIME DARBY BERHAD	1,323	1,655	1,373	38,664	資本財	
AXIATA GROUP BERHAD	1,014	1,486	917	25,815	電気通信サービス	
UEM SUNRISE BHD	1,194	—	—	—	不動産	
BUMI ARMADA BERHAD	657	3,074	341	9,601	エネルギー	
MAXIS BHD	900	900	590	16,613	電気通信サービス	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	1,344	1,344	878	24,734	素材	
SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	1,612	2,826	621	17,495	エネルギー	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	424	1,185	340	9,570	メディア	
IHH HEALTHCARE BHD	1,154	1,154	760	21,400	ヘルスケア機器・サービス	
FELDA GLOBAL VENTURES	803	803	154	4,361	食品・飲料・タバコ	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	—	1,249	537	15,113	運輸	
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	121	1,230	259	7,306	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	33,699	47,591	26,921	757,572	
	銘柄 数 <比率>	43	42	—	<3.0%>	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
(タイ)			千タイバーツ			
BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	162	162	2,713	9,307	銀行	
KRUNG THAI BANK - NVDR	1,299	2,472	4,252	14,586	銀行	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	709	811	10,948	37,553	銀行	
TRUE CORP PCL-NVDR	3,780	5,987	6,107	20,947	電気通信サービス	
KASIKORN BANK PCL-NVDR	244	350	6,177	21,188	銀行	
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	4,306	4,306	1,162	3,987	銀行	
IRPC PCL - NVDR	5,728	5,728	2,325	7,976	エネルギー	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	790	790	1,643	5,636	エネルギー	
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	202	202	3,363	11,536	銀行	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	870	1,501	3,002	10,296	食品・飲料・タバコ	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	463	549	12,517	42,933	電気通信サービス	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	2,171	2,316	1,621	5,561	小売	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	—	323	2,648	9,084	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PTT PCL-NVDR	367	571	16,330	56,013	エネルギー	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	—	1,112	1,979	6,789	食品・飲料・タバコ	
SIAM CEMENT PUBLIC CO-FOR REG	126	126	5,846	20,053	素材	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	65	65	3,016	10,344	素材	
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	561	561	1,739	5,965	メディア	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	167	231	7,137	24,482	運輸	
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	565	686	12,245	42,000	銀行	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	748	748	3,459	11,866	不動産	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	958	2,050	3,915	13,430	ヘルスケア機器・サービス	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	74	256	5,299	18,176	ヘルスケア機器・サービス	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	397	1,079	3,588	12,306	消費者サービス	
THAI OIL PCL-NVDR	480	480	2,628	9,014	エネルギー	
GLOW ENERGY PCL - NVDR	98	296	2,501	8,579	公益事業	
CP ALL PCL-NVDR	1,922	2,999	14,695	50,404	食品・生活必需品小売り	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	3,675	3,675	3,564	12,227	運輸	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	579	762	5,638	19,341	エネルギー	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	83	874	2,053	7,044	素材	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	667	1,006	5,534	18,984	素材	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	—	687	1,648	5,655	エネルギー	
小 計	株 数 金 額	32,257	43,762	161,305	553,277	
	銘 柄 数 <比 率>	29	32	—	<2.2%>	
(フィリピン)			千フィリピンペソ			
AYALA LAND INC	3,013	3,700	13,264	34,620	不動産	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	639	639	3,632	9,480	資本財	
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	524	524	4,455	11,629	銀行	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	1,391	1,391	2,584	6,745	資本財	
DMCI HOLDINGS INC	3,454	3,454	4,532	11,829	資本財	
GLOBE TELECOM INC	17	17	3,884	10,138	電気通信サービス	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	85	85	594	1,552	運輸	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	947	1,320	9,732	25,402	資本財	

銘柄	当期末(前期末)	期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	254	254	5,263	13,736	消費者サービス	
METROPOLITAN BANK & TRUST	355	411	3,539	9,236	銀行	
BDO UNIBANK INC	567	799	8,156	21,287	銀行	
MEGAWORLD CORP	6,380	6,380	2,890	7,543	不動産	
PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	38	47	9,505	24,809	電気通信サービス	
SM PRIME HOLDINGS INC	2,665	4,674	10,143	26,474	不動産	
UNIVERSAL ROBINA CORP	340	459	9,466	24,707	食品・飲料・タバコ	
SM INVESTMENTS CORP	57	86	7,527	19,646	資本財	
AYALA CORPORATION	107	107	8,279	21,608	各種金融	
ENERGY DEVELOPMENT CORP	6,063	6,063	3,795	9,906	公益事業	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	7,357	7,357	3,862	10,080	各種金融	
ABOITIZ POWER CORP	895	895	3,714	9,694	公益事業	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	—	35	4,743	12,380	各種金融	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	35,154	38,705	123,567	322,511	
		20	21	—	<1.3%>	
(インドネシア)				千インドネシアルピア		
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	200	200	386,500	3,517	食品・飲料・タバコ	
UNITED TRACTORS TBK PT	679	679	1,215,410	11,060	資本財	
INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	1,458	2,489	1,381,395	12,570	食品・飲料・タバコ	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	9,033	11,357	7,296,872	66,401	自動車・自動車部品	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	2,497	4,321	1,136,423	10,341	食品・飲料・タバコ	
GUDANG GARAM TBK PT	169	169	802,327	7,301	食品・飲料・タバコ	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	571	571	1,054,922	9,599	素材	
SUMMARECON AGUNG TBK PT	—	4,532	625,416	5,691	不動産	
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	436	436	327,000	2,975	エネルギー	
BANK DANAMON INDONESIA TBK	1,965	1,965	563,955	5,131	銀行	
BANK MANDIRI	4,147	4,793	4,170,762	37,953	銀行	
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	794	1,250	1,912,500	17,403	小売	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	676	891	3,269,970	29,756	家庭用品・パーソナル用品	
PT BANK RAKYAT INDONESIA	4,940	6,371	6,737,332	61,309	銀行	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	4,916	4,916	1,381,396	12,570	公益事業	
BANK NEGARA INDONESIA PT	3,014	4,716	2,299,050	20,921	銀行	
KALBE FARMA TBK PT	8,045	12,534	1,804,896	16,424	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	1,347	1,347	1,380,675	12,564	素材	
BANK CENTRAL ASIA PT	5,477	6,829	8,963,062	81,563	銀行	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA	22,021	31,358	8,560,734	77,902	電気通信サービス	
XL AXIATA TBK PT	1,725	1,725	523,537	4,764	電気通信サービス	
LIPPO KARAWACI TBK PT	12,130	12,130	1,407,080	12,804	不動産	
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	4,730	4,730	435,160	3,959	メディア	
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	1,757	1,757	301,325	2,742	メディア	
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	1,235	1,235	615,030	5,596	運輸	
INDO TAMBANGRAYA MEGAH PT	206	—	—	—	エネルギー	
BUMI SERPONG DAMAI PT	1,607	6,834	1,124,193	10,230	不動産	
ADARO ENERGY PT	8,005	8,005	492,307	4,479	エネルギー	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	805	805	1,038,450	9,449	食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	313	1,334	903,785	8,224	電気通信サービス
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	772	2,924	909,364	8,275	メディア
小 計	105,670	143,203	63,020,832	573,489	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	30	30	—	<2.2%>	
(韓国)			千韓国ウォン		
CHEIL COMMUNICATIONS INC	50	50	101,146	10,792	メディア
HANMI PHARM CO LTD	—	5	96,950	10,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	15	20	247,981	26,459	自動車・自動車部品
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	14	18	602,316	64,267	保険
DONGBU INSURANCE CO LTD	16	27	179,130	19,113	保険
COWAY CO.,LTD.	22	30	278,556	29,721	耐久消費財・アパレル
KT&G CORP	46	59	664,113	70,860	食品・飲料・タバコ
S-1 CORPORATION	9	9	90,528	9,659	商業・専門サービス
KOREA GAS CORPORATION	2	14	58,712	6,264	公益事業
CJ CORP	4	8	198,924	21,225	資本財
DOOSAN INFRACORE CO LTD	32	89	56,120	5,988	資本財
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	43	—	—	—	資本財
SK TELECOM	9	5	117,935	12,583	電気通信サービス
DGB FINANCIAL GROUP INC	47	122	132,580	14,146	銀行
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	7	15	116,568	12,437	資本財
DAEWOO SECURITIES CO LTD	69	117	128,467	13,707	各種金融
NCSOFT CORPORATION	4	8	179,561	19,159	ソフトウェア・サービス
LG UPLUS CORP	125	125	137,641	14,686	電気通信サービス
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	7	33	67,007	7,149	資本財
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	82	82	51,439	5,488	資本財
DAEWOO INTERNATIONAL CORP	15	15	29,876	3,187	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	4	5	462,966	49,398	家庭用品・パーソナル用品
LG CHEM LTD	19	26	781,870	83,425	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	4	4	106,098	11,320	素材
LS CORP	10	—	—	—	資本財
LS INDUSTRIAL SYSTEMS	11	11	55,689	5,942	資本財
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	185	231	1,020,668	108,905	銀行
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	26	37	156,934	16,744	資本財
S-OIL CORPORATION	8	23	162,037	17,289	エネルギー
HANWHA CHEMICAL CORP	63	63	141,196	15,065	素材
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	29	29	135,559	14,464	各種金融
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	4	8	193,997	20,699	素材
HOTEL SHILLA CO LTD	15	21	236,720	25,258	小売
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	19	26	258,085	27,537	資本財
HYUNDAI MOBIS	29	36	926,796	98,889	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	249	318	996,218	106,296	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	28	40	133,562	14,251	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	12	12	148,750	15,871	自動車・自動車部品

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
HYUNDAI MOTOR CO	66	88	1,462,890	156,090	自動車・自動車部品	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	7	—	—	—	資本財	
HYUNDAI STEEL CO	33	46	236,748	25,261	素材	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	108	180	252,644	26,957	銀行	
KCC CORP	2	3	145,396	15,513	資本財	
KIA MOTORS CORPORATION	114	140	812,464	86,689	自動車・自動車部品	
KOREA ZINC CO LTD	3	4	223,366	23,833	素材	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	110	139	734,216	78,340	公益事業	
HANWHA CORPORATION	28	28	102,265	10,911	素材	
KOREAN AIR LINES CO LTD	16	19	58,302	6,220	運輸	
OCI COMPANY LTD	11	11	90,723	9,680	素材	
KOREA EXPRESS CO LTD	—	3	62,208	6,637	運輸	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	10	10	62,324	6,650	素材	
KT CORP	38	38	109,820	11,717	電気通信サービス	
LG ELECTRONICS INC	43	67	340,512	36,332	耐久消費財・アパレル	
WOORI FINANCE HOLDINGS CO	135	—	—	—	銀行	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	0.45	0.45	88,650	9,458	食品・飲料・タバコ	
HANSSEM CO LTD	—	6	132,532	14,141	耐久消費財・アパレル	
LG CORP	35	56	379,572	40,500	資本財	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	48	112	112,641	12,018	各種金融	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	33	33	75,095	8,012	資本財	
NAVER CORP	12	15	982,066	104,786	ソフトウェア・サービス	
HYUNDAI DEPT STORE CO	5	5	77,585	8,278	小売	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	12	22	126,505	13,498	各種金融	
DOOSAN CORP	4	4	51,606	5,506	資本財	
PACIFIC CORP	1	15	244,296	26,066	家庭用品・パーソナル用品	
KANGWON LAND INC	49	64	277,447	29,603	消費者サービス	
POSCO	28	40	718,408	76,654	素材	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	6	—	—	—	資本財	
SAMSUNG C&T CORP	54	—	—	—	資本財	
SAMSUNG SDI CO LTD	24	29	323,730	34,541	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	28	28	183,543	19,584	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	48	61	8,260,224	881,365	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	74	74	92,491	9,868	資本財	
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	23	—	—	—	資本財	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	8	11	1,321,240	140,976	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SHINSEGAE CO LTD	4	4	99,037	10,567	小売	
HYOSUNG CORPORATION	14	14	153,581	16,387	素材	
ORION CORP	1	2	211,562	22,573	食品・飲料・タバコ	
YUHAN CORPORATION	5	5	154,780	16,515	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SK HOLDINGS CO LTD	9	—	—	—	資本財	
HANON SYSTEMS	8	21	103,703	11,065	自動車・自動車部品	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	21	43	150,266	16,033	保険	
GS HOLDINGS CORP	25	25	130,795	13,955	エネルギー	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
LG DISPLAY CO LTD	99	116	252,223	26,912	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SK NETWORKS CO LTD	24	24	18,058	1,926	資本財	
HITE JINRO CO LTD	17	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
HANA FINANCIAL GROUP	127	161	441,945	47,155	銀行	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	5	9	188,496	20,112	運輸	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	15	38	78,662	8,393	各種金融	
LOTTE SHOPPING CO	4	7	155,490	16,590	小売	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	25	46	518,784	55,354	保険	
AMOREPACIFIC CORP	1	18	690,917	73,720	家庭用品・パーソナル用品	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	—	4	92,862	9,908	家庭用品・パーソナル用品	
SAMSUNG CARD CO	6	18	68,743	7,334	各種金融	
SK INNOVATION CO LTD	26	38	448,340	47,837	エネルギー	
CJ CHEILJEDANG CORP	3	5	173,535	18,516	食品・飲料・タバコ	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	—	9	97,864	10,442	商業・専門サービス	
LG INNOTEK CO LTD	8	8	77,987	8,321	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SK HOLDINGS CO LTD	8	21	541,215	57,747	資本財	
KB FINANCIAL GROUP INC	168	221	817,260	87,201	銀行	
HYUNDAI WIA CORP	6	6	92,817	9,903	自動車・自動車部品	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	25	25	231,043	24,652	資本財	
BNK FINANCIAL GROUP INC	84	193	269,451	28,750	銀行	
HANMI PHARM CO LTD	—	2	196,936	21,013	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HANWHA LIFE INSURANCE	122	122	101,181	10,796	保険	
EMART	8	11	258,881	27,622	食品・生活必需品小売り	
HANKOOK TIRE CO LTD	33	33	165,883	17,699	自動車・自動車部品	
BGF RETAIL CO LTD	—	3	62,699	6,689	食品・生活必需品小売り	
SAMSUNG SDS CO LTD	—	17	450,712	48,091	ソフトウェア・サービス	
WOORI BANK	—	208	207,811	22,173	銀行	
SAMSUNG C&T CORP	—	40	597,702	63,774	資本財	
KAKAO CORP	—	17	198,720	21,203	ソフトウェア・サービス	
PARADISE CO LTD	18	18	42,960	4,583	消費者サービス	
DONGSUH COMPANIES INC	—	15	53,691	5,728	食品・生活必需品小売り	
CELLTRION INC	19	34	268,114	28,607	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>	3,537 102	4,744 105	36,458,933 —	3,890,168 <15.2%>	
(台湾)			千新台幣ドル			
ACER INC	863	938	1,191	4,479	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASUSTEK COMPUTER INC	320	380	11,084	41,678	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	109	279	2,020	7,596	半導体・半導体製造装置	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	2,777	3,427	12,715	47,810	半導体・半導体製造装置	
ASIA CEMENT CORP	791	1,321	4,447	16,723	素材	
TAIWAN BUSINESS BANK	302	2,503	2,097	7,886	銀行	
FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS	32	—	—	—	消費者サービス	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	340	340	1,412	5,311	素材	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	300	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	282	283	2,161	8,127	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUANTA COMPUTER INC	1,212	1,562	8,735	32,845	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	324	421	1,939	7,292	不動産
EVA AIRWAYS CORP	1,160	1,330	2,595	9,757	運輸
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	287	347	11,277	42,403	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	2,160	2,311	3,894	14,643	銀行
CHINA AIRLINES LTD	292	1,402	1,675	6,299	運輸
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	600	850	5,078	19,093	自動車・自動車部品
CHINA STEEL	5,432	6,482	12,867	48,383	素材
CHINA MOTOR CORP	510	510	1,190	4,477	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	1,181	1,959	5,349	20,115	保険
ADVANTECH CO LTD	105	185	4,043	15,203	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	100	—	—	—	不動産
CLEVO COMPANY	380	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COMPAL ELECTRONICS	1,667	2,417	4,859	18,271	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CTCI CORP	170	170	700	2,633	資本財
DELTA ELECTRONICS INC	805	1,025	17,428	65,530	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	1,573	2,053	20,367	76,580	電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	3,960	5,900	5,653	21,255	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN MOBILE CO LTD	702	882	8,996	33,826	電気通信サービス
EVERGREEN MARINE	1,064	1,075	1,554	5,844	運輸
FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	506	—	—	—	小売
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	1,225	1,890	5,547	20,860	資本財
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	—	133	2,530	9,515	耐久消費財・アパレル
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	114	114	5,382	20,238	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	230	230	2,765	10,397	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	1,808	2,178	16,336	61,426	素材
FORMOSA TAFFETA CO.	400	400	1,340	5,038	耐久消費財・アパレル
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	1,410	1,690	12,375	46,530	素材
TRANSCEND INFORMATION INC	94	94	850	3,196	半導体・半導体製造装置
EPISTAR CORP	570	570	1,624	6,108	半導体・半導体製造装置
GIANT MANUFACTURING	134	134	3,278	12,327	耐久消費財・アパレル
MEDIATEK INC	628	848	24,253	91,194	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	2,970	3,660	20,097	75,568	各種金融
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	2,627	2,790	4,423	16,632	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	100	140	5,299	19,924	小売
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	670	950	6,602	24,825	電気通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	4,120	5,511	7,220	27,147	各種金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	3,539	4,809	23,133	86,982	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	6,077	8,657	7,653	28,777	銀行
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,858	4,047	8,094	30,434	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	5,473	7,668	65,947	247,961	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	4,355	5,885	13,566	51,009	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	50	60	15,824	59,501	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	3,435	4,935	6,317	23,754	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	3,600	6,157	4,704	17,688	保険
INVENTEC CO LTD	1,365	1,365	2,641	9,931	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HTC CORPORATION	254	374	3,031	11,399	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,002	1,007	3,368	12,665	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	261	261	2,602	9,785	半導体・半導体製造装置
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	4,113	6,205	6,733	25,316	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	5,990	8,524	15,385	57,851	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	3,287	5,205	8,171	30,726	銀行
MERIDA INDUSTRY CO LTD	115	115	2,408	9,054	耐久消費財・アパレル
POWERTECH TECHNOLOGY INC	117	477	3,382	12,716	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	2,087	2,727	17,265	64,917	素材
WISTRON CORP	1,149	1,184	1,978	7,437	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINSUS INTERCONNECT TECH	30	30	203	764	半導体・半導体製造装置
POU CHEN	1,087	1,087	5,090	19,141	耐久消費財・アパレル
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	1,990	2,753	15,146	56,951	食品・飲料・タバコ
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	245	335	7,178	26,990	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	412	682	5,343	20,090	エネルギー
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	84	464	1,867	7,020	不動産
RUENTEX INDUSTRIES LTD	368	368	2,177	8,187	耐久消費財・アパレル
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	488	493	4,205	15,811	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SILICONWARE PRECISION INDS	1,200	1,570	6,970	26,210	半導体・半導体製造装置
STANDARD FOODS CORP	281	309	2,391	8,990	食品・飲料・タバコ
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	343	743	2,599	9,774	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN CEMENT	1,499	1,959	7,102	26,705	素材
TAIWAN GLASS IND CORP	654	654	890	3,348	資本財
TSRC CORP	680	—	—	—	素材
TECO ELECTRIC & MACHINERY	500	1,110	3,019	11,352	資本財
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	10,793	13,633	193,601	727,940	半導体・半導体製造装置
U-MING MARINE TRANSPORT CORP	320	320	1,190	4,475	運輸
UNITED MICROELECTRONICS CORP	5,510	7,270	8,833	33,212	半導体・半導体製造装置
WALSIN LIHWA CORP	1,990	—	—	—	資本財
YANG MING MARINE TRANSPORT	1,439	1,439	1,394	5,242	運輸
YULON MOTOR COMPANY	120	510	1,741	6,548	自動車・自動車部品
INOTERA MEMORIES INC	930	1,920	4,953	18,625	半導体・半導体製造装置
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	—	5,520	5,851	22,000	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS CO LTD	811	811	2,744	10,317	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	121	125	2,240	8,422	資本財
PEGATRON CORP	734	954	7,723	29,041	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHAILEASE HOLDING CO LTD	359	674	4,153	15,617	各種金融
SCINOPHARM TAIWAN LTD	125	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TPK HOLDING CO LTD	169	169	1,747	6,571	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	230	230	264	994	電気通信サービス
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	219	219	2,115	7,954	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	2,430	4,203	6,052	22,758	銀行
CASETEK HOLDINGS LTD	—	90	1,462	5,499	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	540	540	2,311	8,690	半導体・半導体製造装置
SIMPLON TECHNOLOGY CO LTD	43	173	2,013	7,569	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PHISON ELECTRONICS CORP	115	115	3,050	11,470	半導体・半導体製造装置
HERMES MICROVISION INC	20	20	2,790	10,490	半導体・半導体製造装置
小 計	133,450	182,875	807,900	3,037,704	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	100	95	—	<11.9%>	
(インド)			千インドルピー		
RELIANCE INDUSTRIES LTD	564	744	71,535	133,770	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	60	110	10,021	18,739	エネルギー
ASIAN PAINTS LTD	128	128	10,483	19,603	素材
EICHER MOTORS LTD	—	6	10,416	19,479	資本財
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	74	—	—	—	公益事業
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	151	214	26,811	50,138	自動車・自動車部品
SHREE CEMENT LTD	—	3	4,186	7,828	素材
ICICI BANK LTD	99	615	16,200	30,295	銀行
ADITYA BIRLA NUVO LTD	23	23	4,608	8,617	資本財
STATE BANK OF INDIA	61	869	21,399	40,017	銀行
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	—	26	3,753	7,018	運輸
LIC HOUSING FINANCE LTD	57	143	6,848	12,806	銀行
RELIANCE CAPITAL LTD	53	—	—	—	各種金融
TATA STEEL LTD	110	258	5,742	10,738	素材
JSW STEEL LTD	15	43	3,852	7,205	素材
NESTLE INDIA LIMITED	12	12	7,877	14,731	食品・飲料・タバコ
GAIL INDIA LTD	178	178	5,056	9,455	公益事業
VEDANTA LTD	532	727	6,809	12,734	素材
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	332	459	11,454	21,420	エネルギー
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	5	5	3,096	5,790	食品・飲料・タバコ
LUPIN LTD	—	126	23,678	44,278	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACC LTD	17	17	2,418	4,521	素材
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	652	857	102,162	191,044	銀行
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	—	345	13,522	25,286	メディア
INFOSYS LTD	201	1,017	115,486	215,959	ソフトウェア・サービス
WIPRO LTD	272	355	19,944	37,295	ソフトウェア・サービス
HINDUSTAN UNILEVER LTD	330	421	33,857	63,313	家庭用品・パーソナル用品
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	11	41	5,487	10,261	ヘルスケア機器・サービス
HCL TECHNOLOGIES LTD	107	300	26,522	49,597	ソフトウェア・サービス
DABUR INDIA LTD	156	309	8,256	15,439	家庭用品・パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	13	32	8,493	15,882	自動車・自動車部品
DR. REDDY'S LABORATORIES	51	62	21,990	41,122	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BHARTI AIRTEL LTD	264	675	22,658	42,371	電気通信サービス
UNITED SPIRITS LTD	11	35	12,813	23,960	食品・飲料・タバコ
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	315	542	41,070	76,802	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
DIVI'S LABORATORIES LTD	26	53	6,137	11,477	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	—	62	5,974	11,171	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AUROBINDO PHARMA LTD	66	132	11,367	21,257	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JINDAL STEEL & POWER LTD	250	—	—	—	素材	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	—	164	4,687	8,764	自動車・自動車部品	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	76	76	6,810	12,735	各種金融	
CIPLA LTD	141	199	12,905	24,133	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LARSEN & TOUBRO LTD	141	164	22,408	41,902	資本財	
ULTRATECH CEMENT LTD	23	23	6,544	12,237	素材	
BOSCH LTD	—	4	8,326	15,569	自動車・自動車部品	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	205	264	65,305	122,121	ソフトウェア・サービス	
ADANI ENTERPRISES LTD	75	—	—	—	資本財	
NTPC LTD	713	974	13,010	24,328	公益事業	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	35	35	3,498	6,542	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMBUJA CEMENTS LTD	219	371	7,622	14,254	素材	
BHARAT FORGE LTD	—	66	5,898	11,029	自動車・自動車部品	
RANBAXY LABORATORIES LTD	73	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	444	790	6,317	11,814	素材	
ITC LTD	974	1,287	44,165	82,590	食品・飲料・タバコ	
UNITED PHOSPHORUS LTD	—	179	8,268	15,462	素材	
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	534	534	4,133	7,730	電気通信サービス	
SIEMENS INDIA LTD	53	53	6,766	12,653	資本財	
UNITED BREWERIES LTD	41	41	4,081	7,631	食品・飲料・タバコ	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	57	57	7,838	14,657	家庭用品・パーソナル用品	
TECH MAHINDRA LTD	23	164	8,748	16,359	ソフトウェア・サービス	
CAIRN INDIA LTD	221	221	3,209	6,001	エネルギー	
IDEA CELLULAR LTD	367	599	8,082	15,114	電気通信サービス	
MARICO LTD	—	103	4,186	7,828	家庭用品・パーソナル用品	
POWER FINANCE CORPORATION	192	192	4,347	8,129	各種金融	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	301	—	—	—	公益事業	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	143	401	11,085	20,730	運輸	
RELIANCE POWER LTD	558	—	—	—	公益事業	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	64	179	4,208	7,869	各種金融	
BAJAJ AUTO LTD	38	54	13,148	24,588	自動車・自動車部品	
OIL INDIA LTD	74	74	2,976	5,565	エネルギー	
COAL INDIA LTD	180	419	14,237	26,623	エネルギー	
HDFC BANK LTD	172	—	—	—	銀行	
TATA MOTORS LTD	302	508	20,927	39,133	自動車・自動車部品	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	202	339	6,274	11,732	資本財	
TATA POWER CO LTD	382	932	6,350	11,875	公益事業	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	162	162	3,653	6,831	各種金融	
BHARTI INFRATEL LTD	—	228	8,682	16,236	電気通信サービス	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	—	148	10,368	19,388	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	12,415 65	19,987 70	1,081,072 —	2,021,605 <7.9%>	

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(カタール)			千カタールリアル		
QATAR INSURANCE CO	—	32	291	9,896	保険
QATAR NATIONAL BANK	64	97	1,752	59,440	銀行
COMMERCIAL BANK QSC	26	64	335	11,364	銀行
OOREDOO QSC	72	72	534	18,119	電気通信サービス
DOHA BANK QSC	20	20	97	3,322	銀行
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	15	15	337	11,432	公益事業
INDUSTRIES QATAR	55	72	824	27,949	資本財
QATAR ISLAMIC BANK	58	58	692	23,476	銀行
MASRAF AL RAYAN	269	269	1,115	37,831	銀行
BARWA REAL ESTATE CO	38	38	164	5,565	不動産
EZDAN HOLDING GROUP	—	359	655	22,236	不動産
GULF INTERNATIONAL SERVICES	—	30	175	5,966	エネルギー
VODAFONE QATAR	195	195	265	9,006	電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	816 10	1,326 13	7,242 —	245,608 <1.0%>
(南アフリカ)			千南アフリカランド		
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	58	58	322	2,780	素材
BARLOWORLD LTD	123	123	1,007	8,681	資本財
BIDVEST GROUP LTD	144	165	5,744	49,521	資本財
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	149	232	2,398	20,674	小売
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	917	1,345	11,412	98,376	耐久消費財・アパレル
ASSORE LTD	18	—	—	—	素材
DISCOVERY LIMITED	129	217	3,191	27,509	保険
MASSMART HOLDINGS LTD	83	83	977	8,424	食品・生活必需品小売り
GOLD FIELDS LTD	319	425	1,496	12,900	素材
REMGRO LTD	218	244	6,619	57,061	各種金融
THE FOSCHINI GROUP LIMITED	62	108	1,621	13,973	小売
NORTHAM PLATINUM LTD	140	—	—	—	素材
HARMONY GOLD MINING CO LTD	242	—	—	—	素材
EXXARO RESOURCES LTD	46	46	261	2,256	エネルギー
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	—	14	894	7,706	銀行
LIBERTY HOLDINGS LTD	62	62	844	7,282	保険
MTN GROUP LTD	734	936	14,988	129,200	電気通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	182	283	2,803	24,166	素材
TELKOM SA LTD	—	113	730	6,294	電気通信サービス
FIRSTRAND LTD	1,381	1,893	9,619	82,920	各種金融
PSG GROUP LTD	—	38	1,060	9,140	各種金融
NASPERS LTD-N SHS	173	220	46,136	397,698	メディア
CORONATION FUND MANAGERS LTD	101	101	719	6,199	各種金融
NEDBANK GROUP LTD	93	93	2,058	17,746	銀行
NETCARE LTD	387	602	2,337	20,151	ヘルスケア機器・サービス
PICK N PAY STORES LTD	181	181	1,202	10,368	食品・生活必需品小売り
RMB HOLDINGS LTD	317	432	2,864	24,693	各種金融
ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	14	31	686	5,914	素材
SAPPI LIMITED	165	325	1,821	15,697	素材

銘柄	株数 (百株)	株数 (百株)	期 末		業 種
			評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
SASOL LTD	237	316	14,188	122,305	エネルギー
SHOPRITE HOLDINGS LTD	203	250	3,556	30,653	食品・生活必需品小売り
MR PRICE GROUP LTD	102	130	2,854	24,601	小売
BRAIT SE	203	203	3,205	27,628	各種金融
STANDARD BANK GROUP LTD	533	700	9,856	84,958	銀行
SPAR GROUP LIMITED/THE	78	78	1,568	13,523	食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	409	492	5,218	44,986	小売
IMPERIAL HOLDINGS LTD	80	124	2,047	17,650	小売
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	139	175	5,559	47,918	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BARCLAYS AFRICA GROUP	151	191	3,343	28,818	銀行
TIGER BRANDS LTD	71	89	2,951	25,437	食品・飲料・タバコ
NAMPAK LTD	361	361	767	6,617	素材
SANLAM LTD	815	1,040	6,253	53,908	保険
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	162	242	2,923	25,198	ヘルスケア機器・サービス
INVESTEC LTD	70	145	1,674	14,430	各種金融
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	202	280	994	8,573	素材
KUMBA IRON ORE LTD	12	39	219	1,889	素材
PPC LIMITED	182	—	—	—	素材
PIONEER FOODS LTD	—	88	1,641	14,149	食品・飲料・タバコ
MONDI LTD	—	101	3,280	28,279	素材
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	443	443	1,747	15,066	ヘルスケア機器・サービス
MMI HOLDINGS LTD	370	680	1,689	14,559	保険
RMI HOLDINGS	404	404	1,725	14,873	保険
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	—	253	618	5,331	消費者サービス
VODACOM GROUP	160	217	3,270	28,189	電気通信サービス
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	1,023	—	—	—	不動産
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	12,871 49	15,435 50	204,975 —	1,766,889 <6.9%>
(アラブ首長国連邦)				千アラブ首長国 連邦ディルハム	
DUBAI ISLAMIC BANK	312	312	193	6,485	銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC	1,272	1,581	985	33,106	不動産
ARABTEC HOLDING CO	661	694	98	3,313	資本財
DUBAI FINANCIAL MARKET	1,279	1,279	161	5,418	各種金融
EMAAR MALLS GROUP PJSC	—	731	227	7,641	不動産
FIRST GULF BANK	277	498	602	20,247	銀行
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	1,132	1,132	770	25,884	銀行
NATIONAL BANK OF ABU DHABI	409	450	383	12,875	銀行
ALDAR PROPERTIES PJSC	2,714	2,714	635	21,345	不動産
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,061 8	9,396 9	4,057 —	136,317 <0.5%>
合 計	株数・金額 銘柄数<比率>	896,030 797	1,183,761 805	— —	24,025,246 <93.8%>

(注1) 邦貨換算金額は、当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2) < >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
(メキシコ)			千メキシコペソ	
CONTROLADORA COML MEXIC-UB	17,400	17,400	851	6,250
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	98,400	141,600	4,956	36,377
小 計	口 数 ・ 金 額 115,800	159,000	5,807	42,627
	銘 柄 数 <比 率> 2	2	—	<0.2%>
(ブラジル)			千ブラジルレアル	
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	7,500	7,500	143	4,644
SUL AMERICA SA-UNITS	2,918	14,318	282	9,144
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,500	45,500	659	21,389
VIA VAREJO SA	6,400	6,400	26	871
KLABIN SA-UNIT	19,000	28,700	639	20,730
小 計	口 数 ・ 金 額 81,318	102,418	1,751	56,779
	銘 柄 数 <比 率> 5	5	—	<0.2%>
(トルコ)			千トルコリラ	
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	—	135,630	409	17,277
小 計	口 数 ・ 金 額 —	135,630	409	17,277
	銘 柄 数 <比 率> —	1	—	<0.1%>
(南アフリカ)			千南アフリカランド	
REDEFINE PROPERTIES LTD	124,452	216,372	2,445	21,075
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	—	102,326	2,552	21,998
RESILIENT PROPERTY INCOME	—	13,040	1,553	13,390
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	—	22,923	2,796	24,106
小 計	口 数 ・ 金 額 124,452	354,661	9,347	80,571
	銘 柄 数 <比 率> 1	4	—	<0.3%>
合 計	口 数 ・ 金 額 321,570	751,709	—	197,256
	銘 柄 数 <比 率> 8	12	—	<0.8%>

(注1) 邦貨換算金額は、当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2) < >内は、純資産総額に対する各国別投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄 別	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外国 MSCI EMERG M	1,382	—

(注) 外貨建資産は、当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

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	24,025,246	93.7
投 資 信 託 受 益 証 券	63,030	0.2
投 資 証 券	134,225	0.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,424,416	5.6
投 資 信 託 財 産 総 額	25,646,917	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(25,591,979千円)の投資信託財産総額(25,646,917千円)に対する比率は99.8%です。

(注2)外貨建資産は、当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。1米ドル=123.20円、1メキシコペソ=7.34円、1ブラジルリアル=32.42円、1チリペソ=0.1753円、1コロンビアペソ=0.0421円、1ユーロ=132.46円、1トルコリラ=42.18円、1チェココルナ=4.90円、1ハンガリーフォリント=0.4223円、1ポーランドズロチ=31.13円、1香港ドル=15.89円、1マレーシアリンギット=28.14円、1タイバツ=3.43円、1フィリピンペソ=2.61円、1インドネシアルピア=0.0091円、1韓国ウォン=0.1067円、1新台幣ドル=3.76円、1インドルピー=1.87円、1カタールリアル=33.91円、1南アフリカランド=8.62円、1アラブ首長国連邦ディルハム=33.60円です。

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2015年11月10日現在
(A) 資 産	25,650,333,854円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,099,475,781
株 式(評価額)	24,025,246,621
投資信託受益証券(評価額)	63,030,180
投 資 証 券(評価額)	134,225,865
未 収 入 金	60,373,998
未 収 配 当 金	7,714,425
未 収 利 息	53
差 入 委 託 証 拠 金	260,266,931
(B) 負 債	31,892,855
未 払 金	24,650,673
未 払 株 式 払 込 金	402,481
未 払 解 約 金	6,839,701
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	25,618,440,999
元 本	10,958,554,130
次 期 繰 越 損 益 金	14,659,886,869
(D) 受 益 権 総 口 数	10,958,554,130口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,378円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2014年11月11日 至 2015年11月10日
(A) 配 当 等 収 益	576,169,799円
受 取 配 当 金	575,517,734
受 取 利 息	652,065
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△2,022,100,930
売 買 益	2,259,767,912
売 買 損	△4,281,868,842
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△17,190,273
取 引 益	277,713,299
取 引 損	△294,903,572
(D) そ の 他 費 用	△56,798,302
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△1,519,919,706
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	13,040,073,443
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,979,800,413
(H) 解 約 差 損 益 金	△840,067,281
(I) 計 (E+F+G+H)	14,659,886,869
次 期 繰 越 損 益 金(I)	14,659,886,869

(注1) (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2) (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3) (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。

## お知らせ

---

信託契約の解約、変更等における書面決議の要件を緩和するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2014年12月1日)

信託契約の解約、変更等における書面決議に反対の受益者による買取請求権に係る条項を削除するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。なお、反対の受益者は解約の実行の請求を選択することによって対応できます。

(変更日:2014年12月1日)

一般社団法人投資信託協会「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」の一部改正及び「信用リスク集中回避のための投資制限に係るガイドライン」の制定に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2015年2月11日)