

## 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8期（決算日 2017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 率	投資 信託 組 比率	資 産 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 分 配 金	期 騰 落 率							
第4期(2013年1月21日)	円 15,282	円 20	% 27.5	% 47.3	% 1.8	% 47.0	% 0.1	% 0.7	% 0.7	百万円 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	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	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	0.8	16,216
第8期(2017年1月20日)	20,148	0	10.2	48.4	0.7	47.8	0.1	0.9	0.9	22,647

(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 率	投資 信 託 組 入 比 率	資 産 率
	騰落率							
(当期首) 2016年 1月20日	円 18,276	% -	% 46.0	% 1.5	% 49.1	% 0.2	% 0.8	% 0.8
1月末	19,011	4.0	46.3	1.5	48.9	0.1	0.8	0.8
2月末	18,170	△0.6	46.8	1.1	48.5	0.1	0.8	0.8
3月末	19,190	5.0	47.3	1.5	47.6	0.2	0.9	0.9
4月末	18,937	3.6	47.1	2.0	46.9	0.3	0.8	0.8
5月末	18,854	3.2	46.7	2.5	46.7	0.2	0.8	0.8
6月末	17,751	△2.9	46.6	1.4	48.0	0.3	0.9	0.9
7月末	18,463	1.0	48.1	1.2	47.0	0.2	0.9	0.9
8月末	18,449	0.9	48.4	1.2	46.8	0.2	0.9	0.9
9月末	18,193	△0.5	48.6	0.9	47.0	0.1	0.9	0.9
10月末	18,511	1.3	49.1	0.9	46.6	0.2	0.8	0.8
11月末	19,303	5.6	49.9	1.0	45.6	0.2	0.8	0.8
12月末	20,136	10.2	47.3	1.4	47.7	0.2	0.8	0.8
(当期末) 2017年 1月20日	20,148	10.2	48.4	0.7	47.8	0.1	0.9	0.9

(注1) 期末基準価額は分配金込みで、騰落率は期首比です。

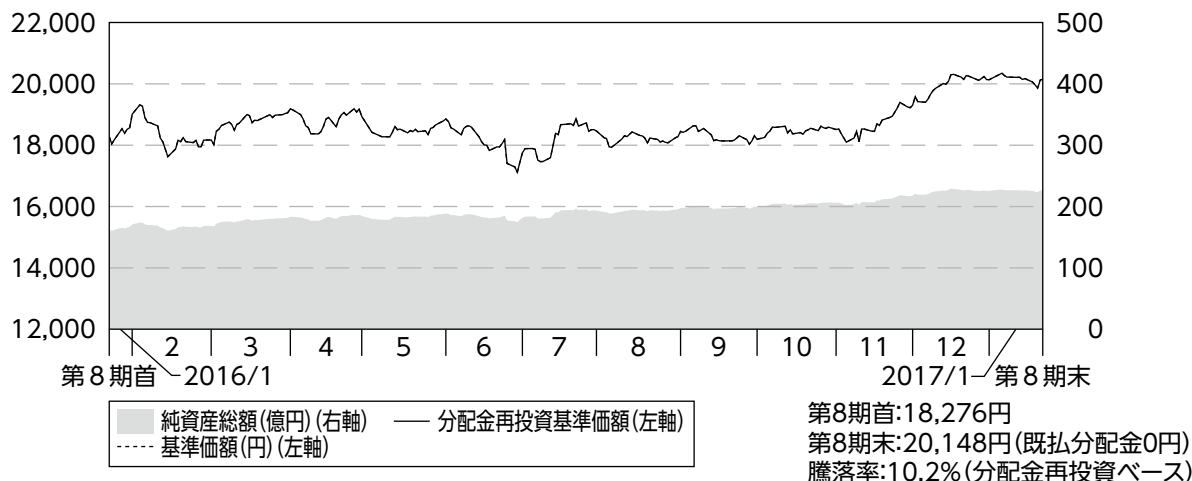
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(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、2016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、前半は原油価格の下落や円高の進行などを受けて軟調に推移しましたが、2016年7月以降は、原油価格の回復や米国経済の底堅い推移などを背景に持ち直す展開となりました。11月の米大統領選挙以降はトランプ次期米大統領が掲げる財政支出拡大政策などへの期待から株式市場が堅調に推移したことや米ドル高・円安が進行したことなどから当ファンドの基準価額は上昇しました。

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%	4.0%	2.2%
国内株式インデックス マザーファンド	国内株式	5.0%	4.9%	17.0%
外国債券インデックス マザーファンド	先進国債券	30.0%	29.7%	△2.9%
外国株式インデックス マザーファンド	先進国株式	30.0%	29.7%	18.0%
新興国債券インデックス マザーファンド	新興国債券	15.0%	15.0%	10.7%
新興国株式インデックス マザーファンド	新興国株式	15.0%	15.4%	25.8%

## 投資環境

### 国内債券市場

当期の前半は、日銀によるマイナス金利政策の導入に加え、原油価格の下落や英国のEU離脱問題などを背景に債券利回りは低下基調となりました。2016年8月以降は日銀による先行きの金融政策に対する不透明感が高まったことや、FRB(米連邦準備理事会)による追加的な利上げ観測を背景とする米国金利の上昇などを受けて利回りは上昇しました。

### 国内株式市場

当期初は原油価格の下落や円高の進行などを背景に軟調に推移しましたが、原油価格の回復とともにリスク回避姿勢が後退し持ち直す展開となりました。当期の半ばは、英国の国民投票でEU(欧州連合)離脱派が勝利したことを受けて投資家心理が悪化し一時下落しましたが、米国経済の底堅い推移や日銀によるETF買い入れ期待などが支え要因となり下げ渋りました。2016年11月以降は米大統領選挙で勝利したトランプ次期米大統領が掲げる財政支出拡大政策が米国経済の成長を押し上げるとの観測や円安の進行などが好感され上昇しました。

### 先進国債券市場

当期初は株式市場の下落や原油安などを背景にリスク回避姿勢が広がったことに加え、FRBによる利上げペースが緩やかになるとの見方が広がったことから債券利回りは低下基調で推移しました。6月に実施された英国の国民投票の結果を受けて利回りは低下する展開となったものの、その後は底堅い米国経済などを背景に米国の利上げを織り込む展開となり利回りは上昇しました。11月の米大統領選挙後はトランプ次期米大統領が掲げる財政支出拡大観測からインフレ期待が高まったことに加え、FRBによる今後の利上げペースが加速するとの見方も広がったことから利回りは上昇する展開となりました。

外国為替市場は当期初から9月にかけてはリスク回避姿勢から安全通貨としての円が選好される展開となり円高基調で推移しましたが、特に米大統領選挙以降は米国の利上げ観測を受け内外金利差が拡大するとと思惑などから円安基調が鮮明となりました。

### 先進国株式市場

当期初は原油価格の下落などを背景にリスク回避姿勢が広がり軟調に推移したものの、原油価格の回復基調や米国の底堅い経済指標、世界的な金融緩和環境の継続などから持ち直す展開となりました。当期の半ばには、英国の国民投票でEUからの離脱が可決されると世界景気に対する不透明感が広がり一時下落しましたが、米国経済の底堅い推移や良好な企業業績などを背景に堅調に推移しました。当期の後半は、米国の利上げなどを警戒し伸び悩む場面も見られましたが、11月の米大統領選挙後はトランプ次期米大統領が掲げる財政支出拡大政策への期待から欧米株式市場は上昇する展開となりました。

### 新興国債券市場

当期の前半は原油価格の下落などを背景に米国の利上げ観測が後退し利回りは低下基調となりましたが、後半は米国の金利上昇などを背景に利回りは概ね上昇する展開となりました。新興国通貨は中国の景気減速懸念や英国のEU離脱問題などを背景にリスク回避姿勢が強まり弱含む場面もありましたが、原油価格の回復基調や日銀の金融政策などを受けて対円では持ち直す展開となりました。

### 新興国株式市場

当期初は原油価格の下落などが株価の下押し要因となったものの、その後、中国政府が景気刺激策を打ち出すとの期待が高まったことや先進国株式市場の回復基調などを背景に堅調に推移する展開となりました。当期の後半は米国の利上げ観測を受け伸び悩む展開となったほか、米大統領選挙以降は保護主義的な政策を掲げるトランプ次期米大統領の政権運営に警戒感が広がり新興国市場への投資を手控える動きが広がり軟調に推移しました。

### 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。なお、2016年12月に基本組入比率の変更を行いました。

#### ・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。

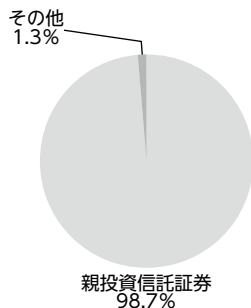
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

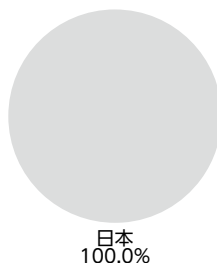
	当期末
	2017年1月20日
外国株式インデックス マザーファンド	29.7%
外国債券インデックス マザーファンド	29.7%
新興国株式インデックス マザーファンド	15.4%
新興国債券インデックス マザーファンド	15.0%
国内株式インデックス マザーファンド	4.9%
国内債券インデックス マザーファンド	4.0%
その他	1.3%
組入ファンド数	6

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

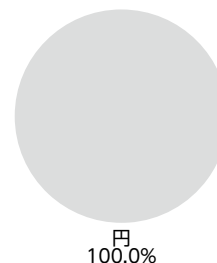
### ○資産別配分



### ○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8期	
	2016年1月21日~2017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)		10,147

(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・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
	(2016年1月21日~2017年1月20日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	101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18,747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)	(40)	(0.216)	
(販売会社)	(51)	(0.270)	
(受託会社)	(10)	(0.054)	
(b) 売買委託手数料	1	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)	(0)	(0.000)	
(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	0.008	(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)	(0.008)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(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	14	0.075	(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、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(13)	(0.069)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	117	0.631	

(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	425,893	867,050	305,083	705,140
国内株式インデックス マザーファンド	201,391	231,410	122,949	164,240
外国株式インデックス マザーファンド	788,477	1,455,670	68,898	139,680
国内債券インデックス マザーファンド	132,283	185,010	12,221	16,960
外国債券インデックス マザーファンド	827,434	2,177,530	43,305	114,310
新興国債券インデックス マザーファンド	572,841	844,140	256,504	403,860

## 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	46,535,370千円	73,470,739千円	10,453,503千円
(b) 当期中の平均組入株式時価総額	147,076,235千円	246,408,217千円	26,263,549千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.31	0.29	0.39

(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
金 銭 信 託	百万円 18,979	百万円 18,979	% 100.0	百万円 18,977	百万円 18,977	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	72,026	12,041	16.7	71,914	12,010	16.7

(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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 146,182	百万円 146,182	% 100.0	百万円 146,178	百万円 146,178	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	291,983	40,664	13.9	292,804	40,764	13.9

<平均保有割合 0.3%>

(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。

### <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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 106,786	百万円 106,786	% 100.0	百万円 106,780	百万円 106,780	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	308,824	47,748	15.5	310,364	47,940	15.4

<平均保有割合 0.7%>

(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	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 34,149	百万円 72	% 0.2	百万円 24,431	百万円 656	% 2.7
金 銭 信 託	118,811	118,811	100.0	118,804	118,804	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	388,963	63,192	16.2	389,401	63,210	16.2

<平均保有割合 2.6%>

(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。

※ 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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	54,713	11,808	21.6	36,139	11,808	32.7
金 銭 信 託	18,020	18,020	100.0	18,019	18,019	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	78,643	13,953	17.7	79,211	14,029	17.7

<平均保有割合 2.1%>

(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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託	17,325	17,325	100.0	17,325	17,325	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	49,430	7,497	15.2	49,389	7,487	15.2

<平均保有割合 15.4%>

(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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	12,017	67	0.6	9,064	51	0.6
金 銭 信 託	2,750	2,750	100.0	2,750	2,750	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	8,747	1,534	17.5	8,730	1,531	17.5

<平均保有割合 12.1%>

(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	79百万円	71百万円	608百万円

(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	1,344,021	1,464,831	3,486,446
国内株式インデックス マザーファンド	748,156	826,598	1,103,508
外国株式インデックス マザーファンド	2,470,275	3,189,853	6,735,056
国内債券インデックス マザーファンド	533,252	653,313	900,985
外国債券インデックス マザーファンド	1,759,161	2,543,290	6,733,362
新興国債券インデックス マザーファンド	1,837,945	2,154,282	3,386,747

(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	13,041,313千口
国内株式インデックス マザーファンド	117,889,777千口
外国株式インデックス マザーファンド	142,760,709千口
国内債券インデックス マザーファンド	231,388,249千口
外国債券インデックス マザーファンド	82,975,491千口
新興国債券インデックス マザーファンド	14,621,557千口

## 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	千円 3,486,446	% 15.3
国内株式インデックス マザーファンド	1,103,508	4.8
外国株式インデックス マザーファンド	6,735,056	29.5
国内債券インデックス マザーファンド	900,985	3.9
外国債券インデックス マザーファンド	6,733,362	29.5
新興国債券インデックス マザーファンド	3,386,747	14.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	477,350	2.2
投 資 信 託 財 産 総 額	22,823,454	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(31,065,643千円)の投資信託財産総額(31,088,046千円)に対する比率は99.9%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(302,019,662千円)の投資信託財産総額(302,393,457千円)に対する比率は99.9%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(218,696,539千円)の投資信託財産総額(220,241,807千円)に対する比率は99.3%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(22,921,715千円)の投資信託財産総額(23,377,048千円)に対する比率は98.1%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=115.15円

1ブラジルレアル=35.95円

1ペルーヌエボソル=34.71円

1スイスフラン=114.36円

1デンマーククローネ=16.50円

1ハンガリーフォリント=0.3973円

1オーストラリアドル=87.03円

1シンガポールドル=80.70円

1フィリピンペソ=2.30円

1新台幣ドル=3.64円

1カタールリアル=31.69円

1カナダドル=86.40円

1チリペソ=0.1743円

1ユーロ=122.73円

1スウェーデンクローナ=12.86円

1トルコリラ=30.09円

1ポーランドズロチ=28.06円

1ニュージーランドドル=82.75円

1マレーシアリングット=25.88円

1インドネシアルピア=0.0087円

1インドルピー=1.70円

1南アフリカランド=8.50円

1メキシコペソ=5.25円

1コロンビアペソ=0.0391円

1イギリスポンド=142.05円

1ノルウェークローネ=13.63円

1チェココロナ=4.54円

1ロシアルーブル=1.93円

1香港ドル=14.84円

1タイバーツ=3.26円

1韓国ウォン=0.098円

1イスラエルシケル=30.16円

1アラブ首長国連邦ディルハム=31.41円

## 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 2017年1月20日現在
(A)資 産	22,823,454,290円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	452,136,941
新興国株式インデックス マザーファンド(評価額)	3,486,446,431
国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,103,508,933
外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	6,735,056,599
国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	900,985,301
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	6,733,362,152
新興国債券インデックス マザーファンド(評価額)	3,386,747,933
未 収 入 金	25,210,000
(B)負 債	176,047,693
未 払 解 約 金	118,723,151
未 払 信 託 報 酬	56,281,509
未 払 利 息	971
そ の 他 未 払 費 用	1,042,062
(C)純 資 産 総 額(A-B)	22,647,406,597
元 本	11,240,555,468
次 期 繰 越 損 益 金	11,406,851,129
(D)受 益 権 総 口 数	11,240,555,468口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,148円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2016年1月21日 至 2017年1月20日
(A)配 当 等 収 益	△174,562円
受 取 利 息	11,138
支 払 利 息	△185,700
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	2,047,415,388
売 買 益	2,328,657,071
売 買 損	△281,241,683
(C)信 託 報 酬 等	△105,283,883
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	1,941,956,943
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△834,641,260
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	10,299,535,446
(配 当 等 相 当 額)	(7,157,370,892)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,142,164,554)
(G) 計 (D+E+F)	11,406,851,129
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	11,406,851,129
追 加 信 託 差 損 益 金	10,299,535,446
(配 当 等 相 当 額)	(7,168,708,902)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,130,826,544)
分 配 準 備 積 立 金	1,709,126,623
繰 越 損 益 金	△601,810,940

(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8,873,094,446円、期中追加設定元本額は4,258,831,911円、期中一部解約元本額は1,891,370,889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)		533,032,739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		9,697,724,506円
(D)	分配準備積立金額		1,176,093,884円
(E)	分配対象収益額(A+B+C+D)		11,406,851,129円
(F)	期末残存口数		11,240,555,468口
(G)	収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)		10,147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

---

該当事項はありません。

# 国内債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第16期（決算日 2016年5月30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		債券先物率 債組入比率	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	246,098
第14期(2014年5月29日)	12,915	3.2	354,471	3.2	99.3	256,692
第15期(2015年5月29日)	13,215	2.3	362,770	2.3	99.6	319,978
第16期(2016年5月30日)	14,107	6.7	387,276	6.8	99.4	319,650

(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 債組入比率
	騰落率	期中騰落率	騰落率	期中騰落率	
(当期首) 2015年 5月29日	円	%		%	%
	13,215	－	362,770	－	99.6
6月末	13,209	△0.0	362,542	△0.1	99.5
7月末	13,247	0.2	363,584	0.2	99.6
8月末	13,268	0.4	364,201	0.4	99.3
9月末	13,306	0.7	365,235	0.7	99.2
10月末	13,357	1.1	366,655	1.1	99.5
11月末	13,355	1.1	366,578	1.0	99.6
12月末	13,437	1.7	368,877	1.7	99.5
2016年 1月末	13,604	2.9	373,520	3.0	99.4
2月末	13,836	4.7	379,830	4.7	99.5
3月末	13,947	5.5	382,913	5.6	99.6
4月末	14,069	6.5	386,253	6.5	98.8
(当期末) 2016年 5月30日	14,107	6.7	387,276	6.8	99.4

(注1)騰落率は期首比です。

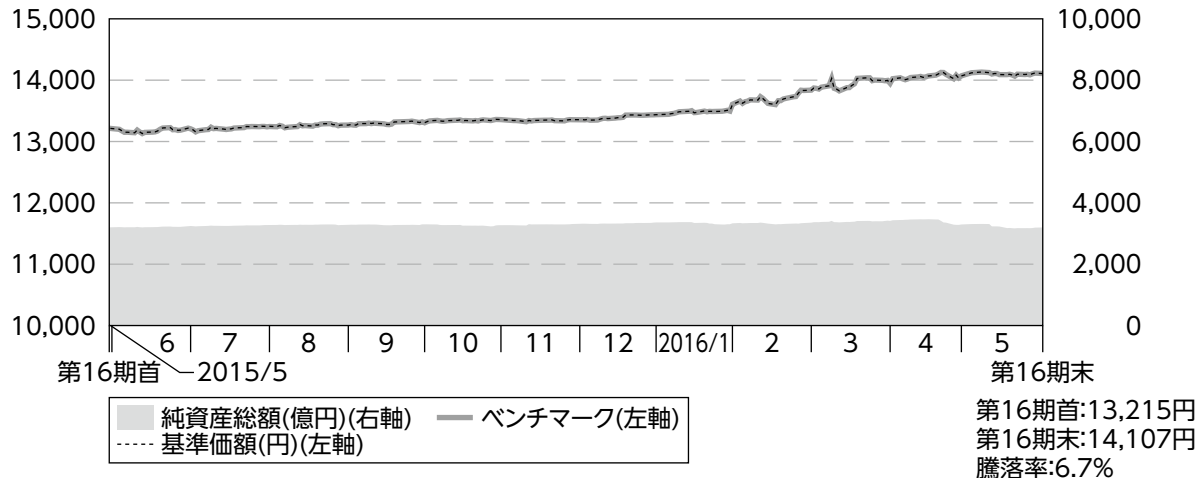
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

NOMURA-BPI総合とは、野村証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証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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

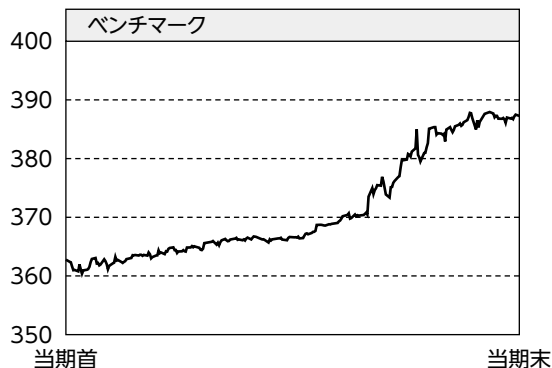


(注)ベンチマークは、2015年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

2015年6月に欧米長期金利の上昇の影響を受けて国内金利も上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落する局面もありましたが、その後2016年1月末にかけて、夏場以降の内外株式の下落に加え、原油価格の急落や中国の景気減速懸念、日銀やECB(欧州中央銀行)による追加金融緩和観測の高まりなどから、金利は低下(債券価格は上昇)基調で推移し、基準価額は上昇しました。1月末には、日銀がマイナス金利政策の導入を決定したことを受けて金利は急激に低下し、基準価額は一段と上昇しました。その後も、日銀の追加金融緩和期待が高まったことや国債需給の引き締まりが意識されたことから金利は低下基調で推移し、2月には長期ゾーンまでの国債がマイナス金利となりました。その後は、4月の日銀金融政策決定会合で大方の予想に反し追加金融緩和が見送られましたが、影響は限定的で、基準価額は期末にかけてほぼ横ばいで推移しました。

## 投資環境



2015年6月に欧米長期金利の上昇の影響から10年国債利回りが上昇する局面もありましたが、その後2016年1月末にかけて、内外株式の下落に加え、原油価格の急落や中国の景気減速懸念、日銀やECBによる追加金融緩和観測の高まりから、10年国債利回りは低下基調で推移しました。1月末には、日銀がマイナス金利政策の導入を決定したことを受けて10年国債利回りは急激に低下し、その後も、日銀の追加金融緩和期待が高まったことや国債需給の引き締まりが意識されたことから低下基調で推移し、2月にはマイナス利回りを付けました。4月の日銀金融政策決定会合では、大方の予想に反し追加金融緩和が見送られましたが、影響は限定的でした。

## 当ファンドのポートフォリオ

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

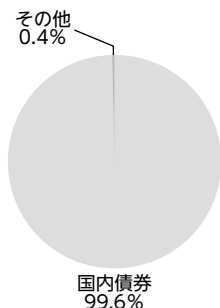
## ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	第113回利付国債(5年)	日本	1.4%
2	第116回利付国債(5年)	日本	1.2%
3	第125回利付国債(5年)	日本	1.1%
4	第122回利付国債(5年)	日本	1.1%
5	第117回利付国債(5年)	日本	1.1%
6	第118回利付国債(5年)	日本	1.1%

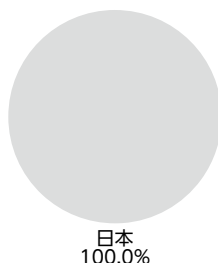
順位	銘柄名	国	組入比率
7	第126回利付国債(5年)	日本	1.1%
8	第105回利付国債(5年)	日本	1.1%
9	第106回利付国債(5年)	日本	1.0%
10	第339回利付国債(10年)	日本	1.0%
組入銘柄数		738	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

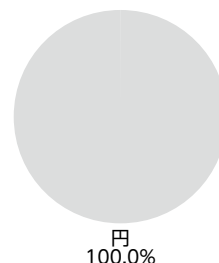
## ○資産別配分



## ○国別配分



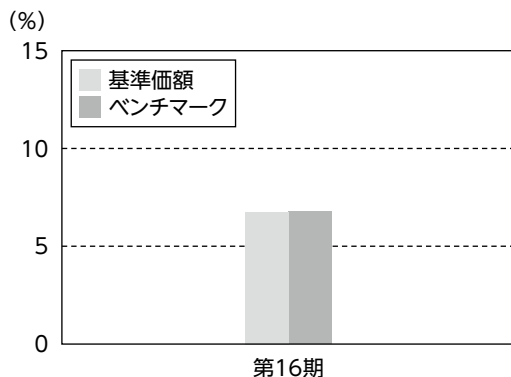
## ○通貨別配分



(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
	(2015年5月30日~2016年5月30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 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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)	0 (-) (-) (0)	0.000 (-) (-) (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、金銭信託預入に係る手数料等
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(13,487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
国 内	国 債 証 券	千円 61,498,082	千円 74,403,104
	地 方 債 証 券	3,271,847	4,836,914
	特 殊 債 券	3,587,305	5,594,098 (385,181)
	社債券(投資法人債券を含む)	1,845,114	4,484,271 (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 64,821	百万円 64,088	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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 131,619	百万円 131,619	% 100.0	百万円 131,361	百万円 131,361	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	361,354	20,705	5.7	361,495	20,705	5.7

(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

## &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 格以 組入比	B 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	230,130,000 (3,690,000)	260,746,470 (3,705,736)	81.6 (1.2)	— (—)	— (—)	50.9 (—)	21.5 (0.1)	9.2 (1.1)	
地方債証券	16,892,990 (16,892,990)	18,387,743 (18,387,743)	5.8 (5.8)	— (—)	— (—)	3.7 (3.7)	1.6 (1.6)	0.5 (0.5)	
特殊債証券 (除く金融債)	20,053,097 (20,053,097)	21,718,652 (21,718,652)	6.8 (6.8)	— (—)	— (—)	4.7 (4.7)	1.7 (1.7)	0.4 (0.4)	
金融債証券	2,600,000 (2,600,000)	2,612,051 (2,612,051)	0.8 (0.8)	— (—)	— (—)	— (—)	0.3 (0.3)	0.5 (0.5)	
普通社債証券 (含む投資法人債券)	13,527,000 (13,527,000)	14,128,695 (14,128,695)	4.4 (4.4)	— (—)	— (—)	1.8 (1.8)	1.7 (1.7)	1.0 (1.0)	
合計	283,203,087 (56,763,087)	317,593,613 (60,552,878)	99.4 (18.9)	— (—)	— (—)	61.1 (10.2)	26.7 (5.3)	11.6 (3.5)	

(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353回利付国債(2年)	0.1	1,600,000	1,605,904	2017/6/15			
第354回利付国債(2年)	0.1	550,000	552,189	2017/7/15			
第355回利付国債(2年)	0.1	1,790,000	1,797,679	2017/8/15			
第356回利付国債(2年)	0.1	1,090,000	1,095,079	2017/9/15			
第357回利付国債(2年)	0.1	740,000	743,663	2017/10/15			
第360回利付国債(2年)	0.1	600,000	603,420	2018/1/15			
第362回利付国債(2年)	0.1	1,600,000	1,609,888	2018/3/15			
第364回利付国債(2年)	0.1	410,000	412,693	2018/5/15			
第105回利付国債(5年)	0.2	3,500,000	3,516,415	2017/6/20			
第106回利付国債(5年)	0.2	3,260,000	3,278,973	2017/9/20			
第107回利付国債(5年)	0.2	1,120,000	1,127,851	2017/12/20			
第108回利付国債(5年)	0.1	590,000	593,215	2017/12/20			
第109回利付国債(5年)	0.1	1,190,000	1,197,520	2018/3/20			
第110回利付国債(5年)	0.3	700,000	706,895	2018/3/20			
第111回利付国債(5年)	0.4	1,200,000	1,214,100	2018/3/20			
第112回利付国債(5年)	0.4	900,000	911,970	2018/6/20			
第113回利付国債(5年)	0.3	4,390,000	4,439,343	2018/3/20			
第114回利付国債(5年)	0.3	810,000	820,222	2018/9/20			
第115回利付国債(5年)	0.2	2,450,000	2,475,259	2018/9/20			
第116回利付国債(5年)	0.2	3,830,000	3,873,776	2018/12/20			
第117回利付国債(5年)	0.2	3,520,000	3,564,140	2019/3/20			
第118回利付国債(5年)	0.2	3,510,000	3,557,455	2019/6/20			
第119回利付国債(5年)	0.1	1,000,000	1,010,450	2019/6/20			
第120回利付国債(5年)	0.2	3,080,000	3,125,122	2019/9/20			

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121回利付国債(5年)	0.1	630,000	637,131	2019/9/20			
第122回利付国債(5年)	0.1	3,560,000	3,602,720	2019/12/20			
第123回利付国債(5年)	0.1	3,140,000	3,179,721	2020/3/20			
第124回利付国債(5年)	0.1	2,810,000	2,847,906	2020/6/20			
第125回利付国債(5年)	0.1	3,610,000	3,661,767	2020/9/20			
第126回利付国債(5年)	0.1	3,480,000	3,532,826	2020/12/20			
第127回利付国債(5年)	0.1	650,000	660,406	2021/3/20			
第1回利付国債(40年)	2.4	150,000	243,210	2048/3/20			
第2回利付国債(40年)	2.2	420,000	661,256	2049/3/20			
第3回利付国債(40年)	2.2	420,000	666,934	2050/3/20			
第4回利付国債(40年)	2.2	530,000	848,641	2051/3/20			
第5回利付国債(40年)	2.0	490,000	758,064	2052/3/20			
第6回利付国債(40年)	1.9	690,000	1,052,388	2053/3/20			
第7回利付国債(40年)	1.7	790,000	1,157,626	2054/3/20			
第8回利付国債(40年)	1.4	670,000	915,005	2055/3/20			
第286回利付国債(10年)	1.8	870,000	888,809	2017/6/20			
第287回利付国債(10年)	1.9	540,000	552,241	2017/6/20			
第288回利付国債(10年)	1.7	2,090,000	2,143,315	2017/9/20			
第289回利付国債(10年)	1.5	2,490,000	2,557,752	2017/12/20			
第290回利付国債(10年)	1.4	470,000	483,888	2018/3/20			
第291回利付国債(10年)	1.3	840,000	863,301	2018/3/20			
第292回利付国債(10年)	1.7	1,110,000	1,148,816	2018/3/20			
第293回利付国債(10年)	1.8	370,000	385,562	2018/6/20			
第294回利付国債(10年)	1.7	180,000	187,200	2018/6/20			
第295回利付国債(10年)	1.5	100,000	103,588	2018/6/20			

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第296回利付国債(10年)	1.5	2,100,000	2,184,651	2018/9/20
第297回利付国債(10年)	1.4	560,000	583,441	2018/12/20
第298回利付国債(10年)	1.3	1,660,000	1,725,221	2018/12/20
第299回利付国債(10年)	1.3	1,310,000	1,366,670	2019/3/20
第300回利付国債(10年)	1.5	830,000	870,587	2019/3/20
第301回利付国債(10年)	1.5	640,000	674,233	2019/6/20
第302回利付国債(10年)	1.4	200,000	210,084	2019/6/20
第303回利付国債(10年)	1.4	1,390,000	1,465,671	2019/9/20
第304回利付国債(10年)	1.3	480,000	504,532	2019/9/20
第305回利付国債(10年)	1.3	2,160,000	2,278,389	2019/12/20
第306回利付国債(10年)	1.4	1,370,000	1,455,871	2020/3/20
第307回利付国債(10年)	1.3	700,000	741,195	2020/3/20
第308回利付国債(10年)	1.3	990,000	1,051,944	2020/6/20
第309回利付国債(10年)	1.1	1,780,000	1,876,814	2020/6/20
第310回利付国債(10年)	1.0	1,590,000	1,674,651	2020/9/20
第311回利付国債(10年)	0.8	610,000	637,169	2020/9/20
第312回利付国債(10年)	1.2	1,670,000	1,779,468	2020/12/20
第313回利付国債(10年)	1.3	1,650,000	1,772,083	2021/3/20
第314回利付国債(10年)	1.1	910,000	968,503	2021/3/20
第315回利付国債(10年)	1.2	1,350,000	1,449,036	2021/6/20
第316回利付国債(10年)	1.1	1,090,000	1,164,392	2021/6/20
第317回利付国債(10年)	1.1	620,000	664,633	2021/9/20
第318回利付国債(10年)	1.0	1,010,000	1,077,276	2021/9/20
第319回利付国債(10年)	1.1	750,000	806,565	2021/12/20
第320回利付国債(10年)	1.0	1,220,000	1,305,143	2021/12/20
第321回利付国債(10年)	1.0	1,640,000	1,759,605	2022/3/20
第322回利付国債(10年)	0.9	750,000	800,287	2022/3/20
第323回利付国債(10年)	0.9	970,000	1,037,909	2022/6/20
第324回利付国債(10年)	0.8	1,810,000	1,925,586	2022/6/20
第325回利付国債(10年)	0.8	2,290,000	2,442,422	2022/9/20
第326回利付国債(10年)	0.7	600,000	637,548	2022/12/20
第327回利付国債(10年)	0.8	740,000	791,237	2022/12/20
第328回利付国債(10年)	0.6	1,720,000	1,819,863	2023/3/20
第329回利付国債(10年)	0.8	2,660,000	2,857,398	2023/6/20
第330回利付国債(10年)	0.8	1,640,000	1,765,476	2023/9/20
第331回利付国債(10年)	0.6	680,000	721,922	2023/9/20
第332回利付国債(10年)	0.6	2,560,000	2,721,228	2023/12/20
第333回利付国債(10年)	0.6	2,060,000	2,192,313	2024/3/20
第334回利付国債(10年)	0.6	2,600,000	2,770,222	2024/6/20
第335回利付国債(10年)	0.5	2,390,000	2,529,121	2024/9/20
第336回利付国債(10年)	0.5	890,000	942,572	2024/12/20
第337回利付国債(10年)	0.3	1,350,000	1,406,281	2024/12/20
第338回利付国債(10年)	0.4	2,210,000	2,321,494	2025/3/20
第339回利付国債(10年)	0.4	3,080,000	3,236,926	2025/6/20
第340回利付国債(10年)	0.4	2,840,000	2,985,976	2025/9/20
第341回利付国債(10年)	0.3	2,950,000	3,072,690	2025/12/20
第342回利付国債(10年)	0.1	2,370,000	2,421,689	2026/3/20
第1回利付国債(30年)	2.8	40,000	54,936	2029/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	160,000	212,550	2030/2/20
第3回利付国債(30年)	2.3	120,000	158,328	2030/5/20
第4回利付国債(30年)	2.9	110,000	155,487	2030/11/20
第5回利付国債(30年)	2.2	50,000	66,019	2031/5/20
第6回利付国債(30年)	2.4	190,000	258,151	2031/11/20
第7回利付国債(30年)	2.3	180,000	243,190	2032/5/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第8回利付国債(30年)	1.8	50,000	63,778	2032/11/22
第9回利付国債(30年)	1.4	240,000	290,568	2032/12/20
第10回利付国債(30年)	1.1	160,000	185,820	2033/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	90,000	113,666	2033/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	190,000	253,344	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	290,000	382,411	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	300,000	417,024	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	340,000	480,008	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	370,000	523,501	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	330,000	461,943	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	445,000	615,991	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	280,000	388,270	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	420,000	598,987	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	270,000	375,634	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	400,000	573,036	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	430,000	617,690	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	320,000	460,905	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	350,000	491,704	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	630,000	900,477	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	2.5	680,000	992,480	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	530,000	778,135	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	800,000	1,164,592	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	610,000	879,735	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	740,000	1,056,601	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	930,000	1,355,214	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	920,000	1,284,467	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	1,090,000	1,582,647	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	1,180,000	1,665,487	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	1,120,000	1,589,257	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	1,160,000	1,624,371	2042/9/20
第38回利付国債(30年)	1.8	590,000	814,577	2043/3/20
第39回利付国債(30年)	1.9	850,000	1,197,777	2043/6/20
第40回利付国債(30年)	1.8	530,000	734,336	2043/9/20
第41回利付国債(30年)	1.7	580,000	790,673	2043/12/20
第42回利付国債(30年)	1.7	670,000	914,208	2044/3/20
第43回利付国債(30年)	1.7	800,000	1,095,456	2044/6/20
第44回利付国債(30年)	1.7	720,000	986,832	2044/9/20
第45回利付国債(30年)	1.5	680,000	896,967	2044/12/20
第46回利付国債(30年)	1.5	750,000	991,207	2045/3/20
第47回利付国債(30年)	1.6	820,000	1,107,820	2045/6/20
第48回利付国債(30年)	1.4	1,320,000	1,713,412	2045/9/20
第49回利付国債(30年)	1.4	630,000	819,233	2045/12/20
第50回利付国債(30年)	0.8	430,000	486,811	2046/3/20
第36回利付国債(20年)	3.0	70,000	72,976	2017/9/20
第37回利付国債(20年)	3.1	70,000	73,068	2017/9/20
第38回利付国債(20年)	2.7	20,000	21,062	2018/3/20
第39回利付国債(20年)	2.6	500,000	525,670	2018/3/20
第40回利付国債(20年)	2.3	100,000	105,860	2018/9/20
第41回利付国債(20年)	1.5	330,000	346,137	2019/3/20
第42回利付国債(20年)	2.6	80,000	86,392	2019/3/20
第43回利付国債(20年)	2.9	140,000	154,589	2019/9/20
第44回利付国債(20年)	2.5	170,000	187,754	2020/3/20
第45回利付国債(20年)	2.4	290,000	319,176	2020/3/20
第46回利付国債(20年)	2.2	170,000	186,841	2020/6/22

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第47回利付国債 (20年)	2.2	90,000	99,469	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	130,000	146,307	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)	2.1	140,000	155,811	2021/3/22
第50回利付国債 (20年)	1.9	220,000	242,651	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	100,000	111,433	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	110,000	123,801	2021/9/21
第53回利付国債 (20年)	2.1	80,000	90,510	2021/12/20
第54回利付国債 (20年)	2.2	200,000	227,402	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	140,000	158,453	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	150,000	170,634	2022/6/20
第57回利付国債 (20年)	1.9	240,000	271,540	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	300,000	341,094	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	200,000	225,758	2022/12/20
第60回利付国債 (20年)	1.4	350,000	388,087	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	240,000	260,570	2023/3/20
第62回利付国債 (20年)	0.8	320,000	343,747	2023/6/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	200,000	229,102	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	320,000	370,496	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	220,000	255,725	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	330,000	381,054	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)	1.9	130,000	151,690	2024/3/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	190,000	226,219	2024/3/20
第69回利付国債 (20年)	2.1	390,000	461,256	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	400,000	484,712	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	200,000	239,086	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	630,000	751,086	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	360,000	427,802	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	200,000	239,404	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	130,000	156,292	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	270,000	319,642	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	290,000	346,062	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)	1.9	170,000	202,072	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	270,000	323,268	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	220,000	265,423	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	390,000	468,674	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	600,000	726,696	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	290,000	352,216	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	670,000	807,269	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	290,000	353,666	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	210,000	260,265	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	550,000	676,197	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	420,000	522,349	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	350,000	431,739	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	630,000	780,047	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	450,000	561,856	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	880,000	1,084,749	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	410,000	502,901	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	610,000	754,868	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	610,000	771,454	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	320,000	397,564	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	590,000	742,178	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	440,000	548,477	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	940,000	1,175,526	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	600,000	760,242	2028/3/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第101回利付国債 (20年)	2.4	285,000	367,880	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	380,000	492,582	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	360,000	462,297	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	300,000	377,976	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	670,000	846,755	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	330,000	421,139	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	150,000	190,258	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	470,000	584,299	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	340,000	424,044	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	850,000	1,081,939	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	330,000	425,591	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	750,000	957,442	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	1,040,000	1,332,333	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	590,000	758,439	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	720,000	935,316	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	550,000	716,485	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	820,000	1,056,906	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	690,000	882,054	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	380,000	475,114	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	330,000	403,342	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	1,090,000	1,381,291	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	280,000	350,837	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	1,040,000	1,351,937	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	280,000	359,926	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	430,000	566,649	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	430,000	553,999	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	460,000	585,879	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	620,000	791,355	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	420,000	529,804	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	630,000	796,231	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	380,000	474,506	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	730,000	913,777	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	680,000	861,662	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	420,000	533,127	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	380,000	476,421	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	610,000	755,253	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	290,000	364,167	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	390,000	477,387	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	410,000	508,363	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	1,060,000	1,333,140	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	360,000	453,794	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	820,000	1,046,992	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	950,000	1,182,512	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	590,000	724,673	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	1,480,000	1,869,180	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	1,360,000	1,719,883	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	1,370,000	1,711,212	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	1,230,000	1,516,565	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	1,510,000	1,863,370	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	1,310,000	1,593,195	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	1,270,000	1,499,870	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	1,510,000	1,783,581	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	1,310,000	1,571,567	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	1,440,000	1,701,316	2035/9/20

銘柄名	期		末	
	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第155回利付国債(20年)	1.0	1,550,000	1,773,324	2035/12/20
第156回利付国債(20年)	0.4	430,000	442,164	2036/3/20
第18回メキシコ合衆国国債	0.8	100,000	100,851	2019/7/24
第14回ポーランド共和国国債	0.67	200,000	201,302	2018/11/15
小計		230,130,000	260,746,470	
<b>地方債証券</b>				
第3回東京都公債(20年)	2.26	100,000	117,177	2024/3/19
第6回東京都公債(20年)	2.0	100,000	117,039	2025/3/19
第9回東京都公債(30年)	2.37	100,000	140,141	2039/3/18
第11回東京都公債(30年)	2.19	100,000	138,253	2040/9/20
第17回東京都公債(20年)	2.09	100,000	124,380	2028/12/20
第19回東京都公債(20年)	2.13	100,000	125,510	2029/6/20
第26回東京都公債(20年)	1.74	200,000	248,094	2032/6/18
第27回東京都公債(20年)	1.68	200,000	246,846	2032/12/20
第695回東京都公債	1.2	100,000	105,558	2021/3/19
第696回東京都公債	1.19	100,000	105,771	2021/6/18
第700回東京都公債	1.02	100,000	105,156	2021/9/17
第702回東京都公債	1.04	200,000	211,034	2021/12/20
第716回東京都公債	0.77	100,000	104,741	2022/12/20
第717回東京都公債	0.63	100,000	103,933	2023/3/20
第720回東京都公債	0.87	100,000	105,655	2023/6/20
第728回東京都公債	0.65	100,000	104,400	2023/12/20
平成19年度第9回北海道公債	1.7	110,000	112,711	2017/11/30
平成20年度第14回北海道公債	1.74	100,000	104,637	2019/2/27
平成22年度第11回北海道公債	1.36	100,000	105,721	2020/12/28
平成23年度第6回北海道公債	1.11	200,000	210,614	2021/8/31
平成24年度第14回北海道公債	0.8	100,000	104,834	2023/2/28
第4回神奈川県公債(30年)	2.62	100,000	143,806	2038/3/19
第20回神奈川県公債(20年)	1.706	100,000	123,134	2032/6/18
第27回神奈川県公債(20年)	1.398	100,000	118,862	2034/9/20
第150回神奈川県公債	1.67	100,000	102,565	2017/12/20
第172回神奈川県公債	1.34	200,000	209,996	2020/3/20
第210回神奈川県公債	0.451	200,000	206,658	2024/12/20
第9回大阪府公債(20年)	1.84	200,000	247,482	2031/9/26
第91回大阪府公債(5年)	0.17	100,000	100,170	2018/2/27
第307回大阪府公債(10年)	1.84	100,000	102,495	2017/10/30
第311回大阪府公債(10年)	1.68	100,000	102,811	2018/2/28
第322回大阪府公債(10年)	1.62	100,000	104,114	2019/1/29
第345回大阪府公債(10年)	1.26	100,000	105,160	2020/12/25
第349回大阪府公債(10年)	1.38	100,000	106,341	2021/4/27
第361回大阪府公債(10年)	0.92	100,000	105,050	2022/6/28
第371回大阪府公債(10年)	0.58	100,000	103,541	2023/4/26
第375回大阪府公債(10年)	0.835	100,000	105,479	2023/8/29
第389回大阪府公債(10年)	0.53	100,000	103,806	2024/10/30
平成22年度第2回京都府公債	1.16	100,000	104,853	2020/9/24
平成23年度第5回京都府公債(20年)	1.79	100,000	123,818	2031/10/17
平成23年度第7回京都府公債	0.8	100,000	105,345	2023/9/19
第1回兵庫県公債(12年)	1.1	100,000	108,313	2024/6/26
第3回兵庫県公債(12年)	0.56	100,000	104,186	2025/4/16
第7回兵庫県公債(15年)	1.12	100,000	111,490	2028/12/25
平成19年度第9回兵庫県公債	1.84	100,000	102,452	2017/10/18
平成22年度第1回兵庫県公債	1.46	100,000	105,355	2020/4/16
平成25年度第4回兵庫県公債	0.82	100,000	105,273	2023/8/18
第9回静岡県公債(30年)	1.539	100,000	126,675	2045/6/20

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20年度第4回静岡県公債	1.65	100,000	103,706	2018/8/28
平成23年度第3回静岡県公債	1.193	103,290	109,262	2021/5/25
平成23年度第8回静岡県公債	1.025	100,000	105,313	2021/10/25
平成24年度第10回静岡県公債	0.678	100,000	104,369	2023/3/22
平成20年度第6回愛知県公債(10年)	1.71	100,000	104,233	2018/11/28
平成21年度第5回愛知県公債(20年)	2.28	100,000	127,027	2029/6/20
平成22年度第3回愛知県公債(10年)	1.364	200,000	210,642	2020/5/28
平成23年度第1回愛知県公債(10年)	1.38	100,000	106,632	2021/4/28
平成23年度第3回愛知県公債(10年)	1.212	100,000	105,884	2021/5/27
平成23年度第14回愛知県公債(10年)	1.006	100,000	105,305	2021/11/30
平成24年度第19回愛知県公債(10年)	0.639	100,000	104,113	2023/3/28
平成26年度第3回愛知県公債(10年)	0.665	100,000	104,891	2024/4/30
平成19年度第2回広島県公債	1.94	200,000	204,752	2017/8/24
平成20年度第1回広島県公債(20年)	2.34	100,000	126,551	2028/9/21
平成22年度第1回広島県公債	1.37	100,000	105,426	2020/5/27
平成24年度第4回広島県公債	0.81	100,000	104,990	2022/11/28
平成20年度第4回埼玉県公債	1.6	100,000	103,710	2018/9/26
平成20年度第6回埼玉県公債	1.49	100,000	103,934	2019/1/29
平成22年度第10回埼玉県公債	1.26	100,000	105,681	2021/1/28
平成22年度第11回埼玉県公債	1.28	193,000	204,373	2021/2/25
平成24年度第1回埼玉県公債	1.05	100,000	105,951	2022/4/26
平成24年度第9回埼玉県公債	0.844	100,000	105,386	2023/1/31
平成25年度第1回埼玉県公債	0.655	100,000	104,713	2024/3/26
平成20年度第2回福岡県公債(20年)	2.05	100,000	123,579	2028/12/20
平成23年度第1回福岡県公債(20年)	2.008	100,000	126,675	2031/5/23
平成23年度第1回福岡県公債	1.18	200,000	211,556	2021/6/28
平成24年度第1回福岡県公債(30年)	2.12	100,000	139,119	2042/9/19
第13回千葉県公債(20年)	1.701	100,000	123,632	2032/10/15
平成21年度第12回千葉県公債	1.44	100,000	105,289	2020/2/25
平成22年度第8回千葉県公債	1.0	120,000	125,163	2020/11/25
平成25年度第5回千葉県公債	0.84	100,000	105,773	2023/8/25
平成27年度第1回千葉県公債	0.549	100,000	104,368	2025/5/23
第55回共同発行市場公募地方債	1.85	158,400	162,474	2017/10/25
第56回共同発行市場公募地方債	1.72	100,000	102,522	2017/11/24
第62回共同発行市場公募地方債	1.74	100,000	103,437	2018/5/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.5	100,000	103,583	2018/10/25
第8回共同発行市場公募地方債	1.39	100,000	104,566	2019/9/25
第85回共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	105,534	2020/4/24
第87回共同発行市場公募地方債	1.29	100,000	105,143	2020/6/25
第89回共同発行市場公募地方債	1.04	150,300	156,758	2020/8/25
第91回共同発行市場公募地方債	0.9	100,000	103,800	2020/10/23
第93回共同発行市場公募地方債	1.25	100,000	105,547	2020/12/25
第94回共同発行市場公募地方債	1.24	100,000	105,578	2021/1/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	105,868	2021/2/25
第97回共同発行市場公募地方債	1.38	356,000	379,446	2021/4/23
第98回共同発行市場公募地方債	1.18	100,000	105,691	2021/5/25
第102回共同発行市場公募地方債	1.03	150,000	157,926	2021/9/24
第108回共同発行市場公募地方債	1.01	100,000	105,662	2022/3/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	105,980	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	105,076	2022/5/25
第112回共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	104,942	2022/7/25
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	104,486	2022/12/22

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第119回共同発行市場公募地方債	0.8	200,000	210,286	2023/2/24
第125回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	105,591	2023/8/25
第127回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	104,686	2023/10/25
第128回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	104,667	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	105,456	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	314,373	2024/3/25
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	104,555	2024/7/25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	104,273	2024/8/23
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	103,846	2024/11/25
第134回共同発行市場公募地方債	0.406	200,000	206,220	2025/4/25
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	208,806	2025/5/23
平成24年度第2回熊本県公債(10年)	0.8	200,000	209,782	2022/10/26
平成22年度第1回静岡県公債	1.008	100,000	104,339	2020/11/25
第132回大阪府公債(20年)	2.08	200,000	251,538	2030/6/14
平成19年度第7回大阪市公債	1.82	100,000	102,337	2017/9/20
平成22年度第5回大阪市公債	1.2	100,000	104,913	2020/9/17
第5回名古屋市公債(30年)	2.49	100,000	142,484	2039/3/18
第9回名古屋市公債(20年)	2.07	100,000	123,750	2028/12/20
第11回名古屋市公債(30年)	1.774	100,000	131,913	2044/9/20
第481回名古屋市公債(10年)	0.744	100,000	104,571	2022/12/20
平成22年度第2回京都市公債	1.11	102,000	106,555	2020/8/27
平成23年度第4回京都市公債	1.067	100,000	105,643	2021/12/22
平成24年度第4回京都市公債	0.801	100,000	104,786	2022/10/21
平成24年度第5回京都市公債	0.854	100,000	105,313	2023/1/31
平成24年度第6回京都市公債	0.137	100,000	100,194	2018/3/28
第5回横浜市公債(20年)	2.17	100,000	119,169	2025/6/20
第20回横浜市公債(20年)	2.1	100,000	125,186	2029/10/19
平成21年度第1回横浜市公債	1.58	200,000	209,214	2019/5/24
平成21年度第5回横浜市公債	1.56	100,000	105,291	2019/11/19
平成23年度第5回横浜市公債	1.011	100,000	105,429	2022/1/28
平成24年度第10回札幌市公債(10年)	0.8	100,000	104,971	2022/12/20
平成25年度第2回札幌市公債(5年)	0.31	100,000	100,607	2018/6/20
平成26年度第9回札幌市公債(10年)	0.43	100,000	103,150	2024/12/20
第11回川崎市公債(20年)	1.84	100,000	123,199	2030/10/18
第81回川崎市公債	1.57	100,000	104,390	2019/3/20
第82回川崎市公債	1.52	100,000	104,959	2019/9/20
平成26年度第2回北九州市公債	0.451	100,000	103,333	2024/12/24
平成19年度第3回福岡市公債	1.87	100,000	102,595	2017/10/24
平成26年度第5回福岡市公債	0.539	200,000	208,194	2024/10/28
平成22年度第6回広島市公債	1.21	100,000	105,861	2021/5/31
平成25年度第3回広島市公債	0.67	150,000	157,227	2024/2/23
平成23年度第2回千葉市公債	1.06	200,000	211,232	2021/11/25
第113回福岡北九州高速道路債券	2.41	100,000	125,315	2027/12/20
小計		16,892,990	18,387,743	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>				
第3回政府保証公営企業債券(15年)	2.2	300,000	332,715	2021/5/21
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	1.3	101,000	105,295	2019/9/17
第14回政府保証日本政策投資銀行債券	2.1	100,000	111,124	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	104,502	2023/3/15
第2回政府保証日本政策投資銀行債券	2.2	100,000	115,439	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	108,949	2021/2/26

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
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	218,200	2021/3/26
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	115,000	117,402	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	308,001	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	102,352	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	30,759	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	113,927	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	103,737	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	187,648	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	156,212	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	251,150	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	314,190	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	145,105	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	140,475	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	105,258	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	104,193	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	208,540	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	207,988	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	210,880	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	127,736	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	105,548	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	106,347	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	105,683	2021/7/30
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	300,000	316,248	2021/10/29
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	301,000	316,191	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	210,752	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	105,414	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	104,978	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	314,388	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	123,222	2032/12/28
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	100,000	105,531	2023/1/31

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	316,398	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	209,010	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	200,000	207,406	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	312,600	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	200,000	212,424	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	104,927	2024/3/29
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	241,408	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	105,076	2024/6/28
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.601	100,000	104,781	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	104,407	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	103,863	2024/12/27
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	300,000	307,926	2025/1/31
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.6	202,000	209,631	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	104,522	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	104,330	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	105,010	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	105,409	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	107,228	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	107,377	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	105,062	2022/1/25
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	105,442	2023/2/17
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.541	100,000	103,693	2023/4/21
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	100,000	104,175	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	105,942	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	210,026	2024/2/16
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	1.4	80,000	82,031	2018/3/26
第4回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.245	100,000	100,653	2019/6/20
第14回道路債券	1.91	100,000	112,343	2022/12/20
第17回道路債券	1.54	100,000	109,920	2022/12/20
第21回道路債券	2.75	100,000	139,310	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	125,674	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	159,452	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	126,507	2028/6/20
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.67	100,000	104,582	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	127,845	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	104,694	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	104,462	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	105,579	2021/12/20
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.07	300,000	318,156	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	122,792	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	104,688	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	106,882	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	105,125	2023/9/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.974	100,000	139,965	2055/3/19
第1回地方公営企業等金融機構債券	1.77	100,000	104,015	2018/9/25
第2回公営企業債券(20年)	1.45	100,000	109,331	2022/12/20
第3回公営企業債券(20年)	1.03	100,000	117,516	2023/3/22
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	1.176	100,000	111,979	2029/1/26
第7回公営企業債券(20年)	2.2	100,000	116,683	2024/3/22
第7回公営企業債券(30年)	2.67	100,000	140,701	2035/6/20
第8回公営企業債券(20年)	2.25	40,000	46,846	2024/3/22
第8回地方公共団体金融機構債券	1.453	100,000	105,191	2020/1/28
第10回地方公共団体金融機構債券	1.424	100,000	105,324	2020/3/27
第11回地方公共団体金融機構債券	1.465	100,000	105,585	2020/4/28
第15回地方公共団体金融機構債券	1.093	200,000	208,926	2020/8/28
第23回地方公共団体金融機構債券	1.418	100,000	106,792	2021/4/28
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.702	100,000	121,831	2032/9/28
第38回地方公共団体金融機構債券	0.835	500,000	524,915	2022/7/28
第42回地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	105,034	2022/11/28
第58回地方公共団体金融機構債券	0.739	100,000	105,330	2024/3/28
第65回地方公共団体金融機構債券	0.535	200,000	207,604	2024/10/28
第11回首都高速道路株式会社債	0.279	200,000	200,812	2017/12/20
第18回株式会社日本政策金融公社債	2.157	100,000	127,383	2031/5/9
第43回都市再生債券	1.29	100,000	105,348	2020/9/18
第5回本州四国連絡橋債券	2.23	100,000	118,276	2024/12/20
第344回東京交通債券	1.67	100,000	110,665	2023/2/17
第346回東京交通債券	1.13	20,000	21,481	2023/6/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	26,476	28,316	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	22,792	24,513	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	23,341	25,321	2037/11/10
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.1	100,000	105,788	2019/3/20
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	27,832	30,061	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	24,992	26,890	2038/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	19,935	21,050	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	41,818	45,011	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	24,467	26,131	2038/11/10
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	21,945	23,611	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	25,933	27,687	2039/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	21,625	23,272	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	26,063	27,623	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	31,268	32,626	2032/5/10
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.25	36,784	40,111	2044/4/10
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	38,099	41,673	2044/5/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	39,147	42,768	2044/6/10
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	44,449	48,048	2044/9/10
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	47,585	51,332	2044/11/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	48,555	52,202	2044/12/10
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	1.47	100,000	104,396	2019/6/20
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	102,576	110,194	2045/3/10
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	26,312	27,895	2040/11/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	56,528	60,462	2045/5/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	26,062	27,602	2041/2/10
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	1.5	100,000	105,189	2019/12/20
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	26,132	28,222	2041/5/10

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	66,485	71,425	2046/2/10
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	24,222	26,128	2041/9/10
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	66,872	72,052	2046/3/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	64,286	69,415	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	26,959	29,199	2041/12/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	128,214	137,060	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	68,941	73,762	2046/8/10
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	26,748	28,770	2042/4/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	77,443	82,283	2046/12/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	76,026	80,789	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	76,428	81,284	2047/2/10
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	1.04	100,000	104,274	2020/9/18
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	155,004	164,068	2047/5/10
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	1.33	100,000	105,864	2020/12/18
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	1.358	100,000	105,991	2020/12/18
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	162,448	170,563	2047/11/10
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	82,633	86,625	2047/12/10
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	83,034	87,915	2048/1/10
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	83,580	88,639	2048/2/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	81,265	85,860	2048/3/10
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	81,343	85,201	2048/5/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	84,401	89,644	2048/6/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	189,216	2031/6/13
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	83,934	87,937	2048/12/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	88,361	92,495	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	89,648	93,923	2049/6/10
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	90,911	94,920	2049/8/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	123,558	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	184,580	192,683	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	92,404	96,054	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	187,412	193,234	2050/1/10
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8	94,821	98,206	2050/3/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	95,443	98,484	2050/5/10
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.83	95,655	99,316	2050/6/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	193,764	201,946	2050/8/10
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	96,949	100,828	2050/9/10
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	98,602	102,655	2051/1/10
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	1.473	100,000	114,192	2027/9/17
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	2.105	100,000	137,286	2043/3/20
第12回農林漁業金融公庫債券	2.24	100,000	122,412	2027/3/19
第11回沖繩振興開発金融公庫債券	1.97	100,000	103,968	2018/6/20
第19回東日本高速道路株式会社債	0.33	100,000	100,486	2017/12/20
第20回東日本高速道路株式会社債	0.289	100,000	100,427	2017/12/20
第28回中日本高速道路株式会社債	0.782	100,000	101,383	2018/3/20
第33回中日本高速道路株式会社債	1.084	200,000	211,212	2021/9/17
第59回東日本高速道路株式会社債	0.309	100,000	101,576	2021/12/20
第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8	200,000	210,148	2022/12/20
小計		20,053,097	21,718,652	
<b>金融債券</b>				
い第750号商工債	0.3	100,000	100,419	2017/11/27
い第752号商工債	0.3	200,000	200,910	2018/1/26
い第756号商工債	0.3	100,000	100,506	2018/5/25
い第779号商工債	0.22	100,000	100,681	2020/4/27
い第748号農林債	0.35	100,000	100,438	2017/9/27

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
い第749号農林債	0.3	300,000	301,185	2017/10/27
い第752号農林債	0.3	200,000	200,910	2018/1/26
い第780号農林債	0.28	100,000	100,874	2020/5/27
第274回信金中金債(5年)	0.3	100,000	100,372	2017/9/27
第290回信金中金債(5年)	0.3	100,000	100,663	2019/1/25
第299回信金中金債(5年)	0.2	100,000	100,525	2019/10/25
第300回信金中金債(5年)	0.225	300,000	301,830	2019/11/27
第303回信金中金債(5年)	0.25	100,000	100,765	2020/2/27
第309回信金中金債(5年)	0.25	100,000	100,846	2020/8/27
第175号商工債(3年)	0.15	100,000	100,160	2017/8/25
第178号商工債(3年)	0.15	300,000	300,585	2017/11/27
第179号商工債(3年)	0.14	200,000	200,382	2017/12/27
小計		2,600,000	2,612,051	
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>				
第455回東京電力株式会社社債	2.075	120,000	124,881	2018/10/23
第459回東京電力株式会社社債	2.7	10,000	10,604	2019/1/29
第521回東京電力株式会社社債	1.97	100,000	100,124	2016/6/27
第528回東京電力株式会社社債	1.905	100,000	104,344	2019/6/13
第536回東京電力株式会社社債	1.672	100,000	102,184	2018/1/29
第542回東京電力株式会社社債	1.602	100,000	102,338	2018/4/25
第544回東京電力株式会社社債	1.976	100,000	103,313	2018/6/25
第554回東京電力株式会社社債	1.608	100,000	103,395	2019/5/29
第499回中部電力株式会社社債	1.194	100,000	106,962	2023/6/23
第503回中部電力株式会社社債	0.584	100,000	102,793	2025/3/25
第473回関西電力株式会社社債	1.665	100,000	104,313	2019/4/25
第496回関西電力株式会社社債	0.908	100,000	104,556	2025/2/25
第358回中国電力株式会社社債	1.702	100,000	103,919	2018/10/25
第385回中国電力株式会社社債	0.728	100,000	104,044	2025/7/25
第286回北陸電力株式会社社債	1.99	100,000	105,751	2019/6/25
第307回北陸電力株式会社社債	1.055	100,000	106,858	2026/6/25
第466回東北電力株式会社社債	0.833	100,000	101,231	2018/2/23
第471回東北電力株式会社社債	1.168	126,000	134,496	2025/12/25
第253回四国電力株式会社社債	1.0	100,000	105,610	2023/6/23
第276回四国電力株式会社社債	0.592	100,000	100,730	2017/9/25
第279回四国電力株式会社社債	0.579	100,000	100,913	2018/2/23
第417回九州電力株式会社社債	0.641	100,000	100,693	2017/8/25
第420回九州電力株式会社社債	0.82	100,000	101,320	2018/4/25
第423回九州電力株式会社社債	0.959	100,000	102,639	2019/9/25
第426回九州電力株式会社社債	1.064	100,000	105,577	2024/2/23
第261回北海道電力株式会社社債	2.775	31,000	32,220	2017/11/24
第320回北海道電力株式会社社債	0.585	101,000	102,943	2021/12/24
第21回清水建設株式会社無担保社債	0.39	100,000	101,284	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	100,502	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	102,934	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	105,233	2019/11/5
第10回日本たばこ産業株式会社社債	0.358	100,000	101,663	2022/7/15
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	0.949	100,000	105,125	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	103,395	2024/7/29
第3回株式会社セブン&アールホールディングス無担保社債	1.94	100,000	103,895	2018/6/20
第12回日本製紙株式会社無担保社債	0.97	100,000	103,713	2024/6/19

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第4回住友化学株式会社無担保社債	0.623	100,000	101,134	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	103,329	2020/6/4
第14回田島食品工業株式会社無担保社債	0.54	100,000	101,360	2019/7/19
第1回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	0.33	100,000	100,477	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	102,552	2024/10/23
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	0.82	100,000	102,776	2024/6/4
第5回東海ゴム工業無担保社債	0.288	100,000	100,389	2018/2/28
第13回旭硝子株式会社無担保社債	0.31	100,000	100,406	2017/12/20
第22回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	0.703	100,000	101,734	2024/9/19
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.77	100,000	101,541	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	100,781	2022/2/25
第9回株式会社小松製作所無担保社債	0.319	100,000	100,419	2017/12/19
第32回富士通株式会社無担保社債	0.562	200,000	203,044	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	101,749	2018/3/20
第12回パナソニック株式会社無担保社債	0.387	100,000	100,992	2020/3/19
第13回パナソニック株式会社無担保社債	0.568	200,000	203,112	2022/3/18
第24回三菱重工株式会社無担保社債	1.482	100,000	104,638	2019/12/9
第29回三菱重工株式会社無担保社債	0.662	100,000	103,001	2024/9/3
第37回川崎重工株式会社無担保社債	0.572	100,000	100,994	2018/7/18
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	0.87	100,000	101,507	2018/8/3
第1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	100,744	2017/8/9
第57回日産自動車株式会社無担保社債	0.314	100,000	100,598	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	100,378	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	101,030	2020/3/12
第21回株式会社ニコン無担保社債	0.864	100,000	105,248	2024/3/14
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.65	100,000	105,584	2020/3/12
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.785	100,000	103,460	2024/5/30
第70回三井物産株式会社無担保社債	2.021	100,000	123,057	2033/3/4
第69回三菱商事株式会社無担保社債	1.99	100,000	103,812	2018/5/22
第74回三菱商事株式会社無担保社債	1.657	100,000	105,060	2019/7/29
第76回三菱商事株式会社無担保社債	1.303	100,000	105,940	2021/5/24
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.904	100,000	102,947	2024/4/24
第32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	200,776	2018/1/24
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	131,299	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	104,994	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	107,278	2021/6/9
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	103,182	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	106,954	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	106,437	2020/3/2
第1回みずほFG無担保社債 (実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.95	100,000	103,590	2024/7/16
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	106,510	2019/7/24

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
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	105,350	2020/9/28
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	107,466	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	206,188	2018/1/26
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.233	100,000	100,940	2021/9/17
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	101,456	2021/3/18
第67回アコム株式会社無担保社債	0.5	100,000	100,719	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	105,929	2026/9/18
第138回オリックス株式会社無担保社債	1.69	100,000	102,017	2017/8/25
第167回オリックス株式会社無担保社債	0.508	100,000	100,640	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	100,937	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	101,302	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	104,151	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	100,885	2019/2/25
第31回三菱地所株式会社無担保社債	3.125	100,000	104,137	2017/9/26
第84回住友不動産株式会社無担保社債	0.388	100,000	100,529	2018/2/28
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	103,579	2024/4/26
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	105,240	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	105,860	2023/6/26
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	100,000	106,366	2026/6/17
第36回京浜急行鉄軌株式会社無担保社債	0.453	100,000	100,788	2018/6/12
第63回山陽電気鉄道株式会社無担保社債	0.905	100,000	106,491	2025/12/12
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	1.412	100,000	104,742	2019/12/9
第17回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.3	100,000	110,540	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	113,227	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	104,176	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	252,928	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	100,000	100,890	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	21,458	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	125,739	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	22,542	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	105,993	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	137,589	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	132,043	2044/10/28
第9回東京地下鉄株式会社無担保社債	0.442	100,000	105,241	2020/3/19
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	1.69	200,000	208,610	2023/3/30
第20回KDDI株式会社無担保社債	0.803	100,000	104,835	2023/12/20
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	0.73	100,000	104,832	2023/9/20
第30回電源開発株式会社無担保社債	1.394	100,000	105,120	2020/5/20
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	100,000	105,395	2023/12/20
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	2.9	100,000	104,750	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	106,052	2023/6/20
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.491	100,000	102,174	2022/12/16



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2回ノルデアバンク・アクツイエボラーク・プブリクト円貨社債	1.2	100,000	101,093	2017/6/15
第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.437	100,000	100,454	2020/12/11
第4回スヴェンスカ・ハンデルスパンケンAB円貨社債	0.325	100,000	100,678	2019/9/4
第6回スヴェンスカ・ハンデルスパンケンAB円貨社債	0.292	100,000	100,231	2020/9/3
第9回モルガン・スタンレー円貨社債	0.557	100,000	100,586	2018/5/22
第6回ビー・エス・ビー・バリバ円貨社債	0.439	100,000	100,558	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	101,026	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	100,698	2020/1/16
第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.3	100,000	100,804	2021/1/22
第9回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	0.343	100,000	100,961	2020/7/24
第27回ラボバンク・ネーデルランド円貨社債	0.38	200,000	201,928	2020/5/22
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	0.28	100,000	98,522	2023/6/2
小 計		13,527,000	14,128,695	
合 計		283,203,087	317,593,613	

<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 10年国債標準物	760	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 317,593,613	% 98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,611,210	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	321,204,823	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 2016年5月30日現在
(A) 資 産	321,309,772,089円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,707,181,235
公 社 債(評価額)	317,593,613,451
未 収 利 息	889,395,166
前 払 費 用	14,633,237
差 入 委 託 証 拠 金	104,949,000
(B) 負 債	1,659,041,090
未 払 金	1,500,981,120
未 払 解 約 金	52,960,197
未 払 利 息	6,714
差入委託証拠代用有価証券	104,949,000
そ の 他 未 払 費 用	144,059
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	319,650,730,999
元 本	226,592,497,472
次 期 繰 越 損 益 金	93,058,233,527
(D) 受 益 権 総 口 数	226,592,497,472口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,107円

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2015年5月30日 至 2016年5月30日
(A) 配 当 等 収 益	3,429,137,187円
受 取 利 息	3,429,385,563
支 払 利 息	△248,376
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	18,375,400,295
売 買 益	18,877,288,316
売 買 損	△501,888,021
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	27,050,388
取 引 益	50,875,776
取 引 損	△23,825,388
(D) そ の 他 費 用	△144,059
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	21,831,443,811
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	77,854,747,071
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	16,665,450,997
(H) 解 約 差 損 益 金	△23,293,408,352
(I) 計 (E+F+G+H)	93,058,233,527
次 期 繰 越 損 益 金(I)	93,058,233,527

(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。

## 〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は242,124,189,619円、期中追加設定元本額は47,493,545,266円、期中一部解約元本額は63,025,237,413円です。

※担保に供している資産

先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。

国債証券 106,555,000円

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DC日本債券インデックス・オープンS	63,402,052,606円
DC日本債券インデックス・オープンP	27,014,329,554円
国内債券SMTBセレクション (SMA専用)	16,472,702,807円
DCマイセレクション50	16,063,713,327円
DCマイセレクション25	14,121,936,865円
日本債券ファンド・シリーズ1	11,376,633,584円
SMT 国内債券インデックス・オープン	7,873,421,503円
バランスA (25) VA1 (適格機関投資家専用)	7,132,957,692円
DCマイセレクションS50	6,243,041,228円
DCマイセレクションS25	5,688,379,379円
バランスC (50) VA1 (適格機関投資家専用)	4,933,060,320円

DCマイセレクション75	4,436,822,519円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	4,304,752,312円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,106,303,391円
コア投資戦略ファンド(安定型)	3,751,117,456円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,857,552,493円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,768,551,569円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,528,307,003円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,989,153,158円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,850,694,165円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	1,824,468,170円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,580,141,003円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,346,461,291円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,238,877,798円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,170,297,429円
DCマイセレクションS75	1,168,831,033円
分散投資コア戦略ファンドA	1,069,229,249円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	1,044,228,831円
コア投資戦略ファンド(切替型)	811,006,764円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	726,850,571円
DC世界経済インデックスファンド	713,632,790円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	713,387,447円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	708,471,028円
世界経済インデックスファンド	591,952,932円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	493,734,884円
分散投資コア戦略ファンドS	464,147,189円
DC日本債券インデックス・オープン	422,133,707円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	257,763,388円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	256,808,168円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	204,302,431円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	191,958,236円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	144,264,006円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	128,450,493円
SMT インデックスバランス・オープン	74,624,813円
マイセレクション25	71,578,191円
マイセレクション50	70,346,438円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	55,477,743円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	32,995,858円
SBI資産設計オープン(分配型)	24,329,469円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	21,746,981円
マイセレクション75	20,315,766円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	18,488,628円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	12,251,462円
エマージング株式オープン	2,227,240円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	857,124円
債券コア戦略ファンド	375,990円

## お知らせ

該当事項はありません。

# 国内株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第16期（決算日 2016年5月30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		株式先物比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率		
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
第16期(2016年5月30日)	11,755	△16.7	1,366.01	△18.4	97.9	151,002

(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		株式先物比率
	円	騰落率	円	騰落率	
(当期首) 2015年 5月29日	14,114	—	1,673.65	—	97.9
6月末	13,761	△2.5	1,630.40	△2.6	98.5
7月末	14,007	△0.8	1,659.52	△0.8	99.0
8月末	12,976	△8.1	1,537.05	△8.2	99.1
9月末	12,004	△14.9	1,411.16	△15.7	97.0
10月末	13,256	△6.1	1,558.20	△6.9	98.3
11月末	13,446	△4.7	1,580.25	△5.6	98.2
12月末	13,181	△6.6	1,547.30	△7.5	98.5
2016年 1月末	12,201	△13.6	1,432.07	△14.4	99.0
2月末	11,059	△21.6	1,297.85	△22.5	98.7
3月末	11,589	△17.9	1,347.20	△19.5	98.0
4月末	11,530	△18.3	1,340.55	△19.9	98.1
(当期末) 2016年 5月30日	11,755	△16.7	1,366.01	△18.4	97.9

(注1)騰落率は期首比です。

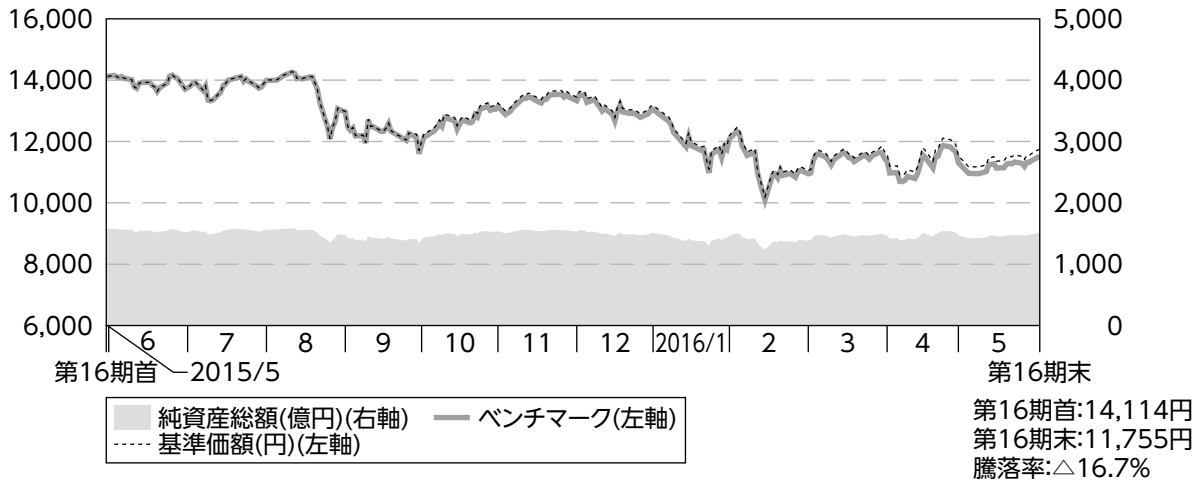
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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、2015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(TOPIX(東証株価指数))の動きを反映して基準価額は変動し、期首比では下落しました。

## 投資環境



国内株式市場は、期初は、一進一退の動きとなりましたが、2015年8月下旬以降は、中国株式市場急落により投資家心理が急激に悪化、世界的な株安となり国内株式市場も下落しました。

10月から11月にかけてはTPP（環太平洋戦略的経済連携協定）交渉の大筋合意や円安の進展などから一時反発しましたが、2016年1月以降は原油価格の下落や世界景気に対する不透明感に加え、円高進行による企業業績下振れへの懸念などから調整局面を迎えました。

期末にかけては、原油価格の底打ちや為替市場における円高一服を好感して、株式市場も落ち着きを取り戻しました。

## 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、主に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

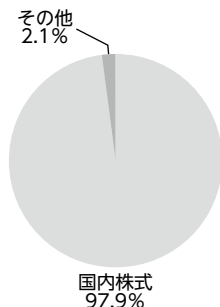
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	3.4%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	2.1%
3	日本電信電話	日本	1.8%
4	ソフトバンクグループ	日本	1.7%
5	KDDI	日本	1.5%
6	日本たばこ産業	日本	1.4%

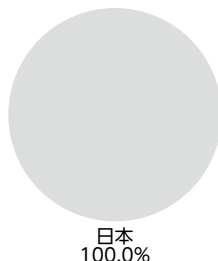
順位	銘柄名	国	組入比率
7	本田技研工業	日本	1.4%
8	三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.3%
9	みずほフィナンシャルグループ	日本	1.2%
10	ソニー	日本	1.1%
組入銘柄数		1,905	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

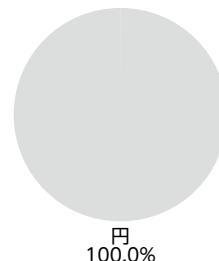
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

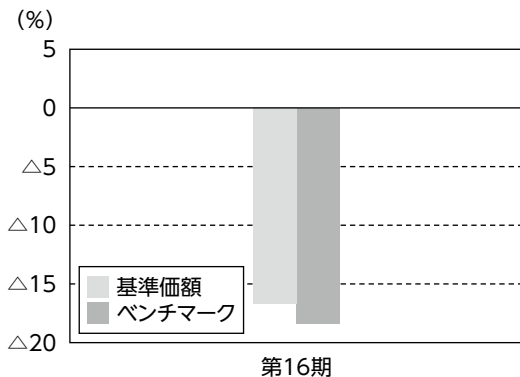


(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。



## 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騰落率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って生じる要因(プラス)などです。

## 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
	(2015年5月30日~2016年5月30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 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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)	0 (-) (-) (0)	0.000 (-) (-) (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、金銭信託預入に係る手数料等
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(12,760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
国内	上 場	千株 25,883 (△2,635)	千円 31,962,998 (－)	千株 6,945	千円 10,216,390

(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 36,752	百万円 36,531	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	42,179,389千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	146,141,615千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.28

(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	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 91,699	百万円 91,699	% 100.0	百万円 91,500	百万円 91,500	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	377,908	25,874	6.8	378,226	25,874	6.8

(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	114百万円	71百万円	579百万円

(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)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
<b>水産・農林業(0.1%)</b>			
極洋	30	35	9,310
日本水産	86.7	94.4	59,472
マルハニチロ	13.9	16.7	43,236
サカタのタネ	11.4	12.1	31,944
ホクト	7.8	8.3	16,707
ホクリョウ	—	0.8	800
<b>鉱業(0.3%)</b>			
住石ホールディングス	19.6	24.1	2,169
日鉄鉱業	20	23	8,809
三井松島産業	46	54	5,616
国際石油開発帝石	371.6	431.4	386,922
日本海洋掘削	2.1	2.5	6,167
石油資源開発	10.1	13	31,720
K&Oエナジーグループ	4.7	5.5	7,144
<b>建設業(3.3%)</b>			
ショーボンドホールディングス	6.8	8.6	44,204
ミライト・ホールディングス	21.7	25.2	27,997
タマホーム	5.3	6.1	2,696
サンヨーホームズ	0.8	1.7	797
ダイセキ環境ソリューション	0.8	1.9	2,209
安藤・間	47.3	54.7	33,968
東急建設	25.2	26.7	26,326
コムシスホールディングス	31.4	35.2	64,416
ミサワホーム	8.9	10.2	8,292
ピーアールホールディングス	—	3.2	1,404
高松コンストラクショングループ	5.3	6.2	16,647
東建コーポレーション	2.7	3.4	29,206
ソネック	—	0.9	524
ヤマウラ	3.8	4.2	2,234
大成建設	366	425	345,100
大林組	212	245.6	285,632
清水建設	216	251	250,247
飛鳥建設	47.5	65.7	12,220
長谷工コーポレーション	88.2	95.6	117,779
松井建設	8	9.1	9,846
銭高組	10	12	5,028
鹿島建設	310	384	288,768
不動産トラ	53.9	59.8	9,089
大末建設	—	3.1	3,301
鉄建建設	44	51	16,269
日鉄住金テックスエンジ	13	—	—
西松建設	76	95	44,365
三井住友建設	286.2	313.8	31,066

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
大豊建設	20	32	16,000
前田建設工業	47	50	42,900
佐田建設	26	6.2	2,560
ナカノフドー建設	6.2	6.7	3,229
奥村組	67	78	47,580
大和小田急建設	4	—	—
東鉄工業	8.5	9.8	28,988
イチケン	9	10	3,130
浅沼組	—	26	6,552
戸田建設	89	95	47,690
熊谷組	89	121	37,631
青木あすなろ建設	4.6	5.4	3,888
北野建設	15	18	4,752
植木組	10	11	2,376
三井ホーム	9	11	5,577
矢作建設工業	8.7	11.1	9,879
ビエス三菱	8	10.1	4,161
日本ハウスホールディングス	9	16.7	5,961
大東建託	26.4	30.1	491,533
新日本建設	8.4	9.9	6,662
N I P P O	16	19	37,848
東亜道路工業	13	15	4,650
前田道路	22	26	51,662
日本道路	21	24	10,896
東亜建設工業	53	71	11,999
若築建設	41	47	7,567
東洋建設	20.6	25.7	13,184
五洋建設	78.3	90.9	51,085
大林道路	8	9.6	7,209
世紀東急工業	10.3	12.8	6,912
福田組	11	13	15,639
住友林業	52	56.4	84,882
日本基礎技術	8.4	9.1	3,467
日成ビルド工業	20	23	11,500
巴コーポレーション	9.5	10.8	3,812
パナホーム	26	31	27,218
大和ハウス工業	206.6	241.9	776,982
ライト工業	11.3	15.7	18,918
積水ハウス	221.6	273.8	541,987
日特建設	9.4	9	3,969
北陸電気工事	4	4	3,292
ユアテック	11	13	10,673
西部電気工業	6	7	2,940
四電工	6	6	2,454

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)
中電工	10.2	11.8	25,924	
関電工	32	33	27,885	
きんでん	47	49.5	64,102	
東京エネシス	8	9	9,963	
トーエネック	10	12	7,056	
住友電設	5.6	6.5	9,100	
日本電設工業	11.5	13.3	25,309	
協和エクシオ	29.9	32.1	42,757	
新日本空調	6.1	6.9	7,265	
NDS	12	13	3,614	
九電工	13	15	49,050	
三機工業	14.5	18.2	16,016	
日揮	71	82	138,334	
中外炉工業	22	25	5,525	
ヤマト	7	7.4	3,936	
太平電業	10	12	13,428	
高砂熱学工業	19.4	24.4	34,428	
三晃金属工業	8	9	2,565	
朝日工業社	8	10	5,040	
明星工業	11.6	14.8	6,956	
大気社	10.1	10	25,880	
ダイダン	10	11	8,811	
日比谷総合設備	9.1	9.8	16,552	
東芝プラントシステム	11.5	13.3	20,947	
OSJBホールディングス	9.6	16.7	3,540	
東洋エンジニアリング	35	44	15,312	
千代田化工建設	51	59	46,256	
新興プランテック	14.5	16.8	14,834	
<b>食料品(5.2%)</b>				
日本製粉	43	54	45,900	
日清製粉グループ本社	77.4	89.8	168,195	
日東富士製粉	6	6	2,076	
昭和産業	29	34	16,694	
鳥越製粉	5.6	6.5	4,147	
中部飼料	6.8	7.6	6,095	
フィード・ワン	42.7	49.5	6,088	
東洋精糖	11	13	1,456	
日本甜菜製糖	36	42	7,854	
三井製糖	28	32	16,736	
塩水港精糖	7.6	8.9	2,127	
日新製糖	—	3.5	5,047	
森永製菓	64	74	42,402	
中村屋	16	19	8,835	
江崎グリコ	16.3	18.9	113,778	
名糖産業	3.1	3.6	4,784	
不二家	40	47	9,400	
山崎製パン	52	60	162,300	
第一屋製パン	9	13	1,547	

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)
モロゾフ	11	13	5,590	
亀田製菓	3.9	4.6	23,874	
寿スピリッツ	1.7	5.8	16,495	
カルビー	26.1	30.4	124,944	
森永乳業	63	74	49,802	
六甲バター	3.2	3.7	7,969	
ヤクルト本社	37.8	43.9	231,792	
明治ホールディングス	20.9	48.5	484,515	
雪印メグミルク	16.6	19.3	67,260	
プリマハム	40	52	15,392	
日本ハム	52	60	153,120	
伊藤ハム	39	—	—	
丸大食品	36	42	20,538	
米久	2.3	—	—	
S Foods	4.4	5.1	14,616	
伊藤ハム米久ホールディングス	—	48.9	47,579	
サッポロホールディングス	116	125	73,875	
アサヒグループホールディングス	141.8	153.7	577,912	
キリンホールディングス	285.9	331.9	620,818	
宝ホールディングス	55.4	59.3	58,529	
オエノンホールディングス	18	22	4,642	
養命酒製造	4	2.5	4,592	
コカ・コーラウエスト	23.9	27.8	86,736	
コカ・コーライーストジャパン	21.5	29	62,756	
サントリー食品インターナショナル	42.3	56.1	291,159	
ダイドードリンコ	3.6	4.1	24,026	
伊藤園	20.9	24.3	89,788	
キーコーヒー	6.2	7.2	13,356	
ユニカフェ	1.9	2.2	1,949	
ジャパンフーズ	0.9	1.1	1,329	
日清オイリオグループ	34	43	21,027	
不二製油グループ本社	18.8	21.9	41,960	
かどや製油	0.7	0.8	2,220	
J-オイルミルズ	30	34	12,444	
キッコーマン	58	62	243,660	
味の素	163	172.2	462,615	
キユーピー	35.9	41.7	123,765	
ハウス食品グループ本社	26.1	28	62,020	
カゴメ	27.3	29.4	78,292	
焼津水産化学工業	3.3	3.9	3,896	
アリアケジャパン	6.4	6.7	44,086	
ビエトロ	—	0.8	1,512	
エバラ食品工業	1.2	2	3,862	
ニチレイ	75	87	83,346	
東洋水産	36.9	40.3	173,693	
イートアンド	0.8	0.9	1,875	
日清食品ホールディングス	29.9	34.7	193,626	
永谷園ホールディングス	7	8	9,592	

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)
一正蒲鉾	2.4	2.9	3,059	
フジッコ	7	8	21,896	
ロック・フィールド	3.7	8.6	14,430	
日本たばこ産業	391	484.2	2,122,248	
ケンコーマヨネーズ	2.3	2.7	7,052	
わらべや日洋	4.1	4.4	9,174	
なとり	3.3	4.1	6,769	
北の達人コーポレーション	—	1.6	779	
ユウグレナ	23.6	27.6	46,340	
ミヨシ油脂	24	28	3,584	
理研ビタミン	2.1	2.4	11,016	
<b>繊維製品 (0.7%)</b>				
片倉工業	8.4	9.7	12,328	
グンゼ	53	62	20,522	
東洋紡	261	304	62,624	
ユニチカ	192	223	14,272	
富士紡ホールディングス	32	37	8,991	
日清紡ホールディングス	42	—	—	
倉敷紡績	68	78	15,600	
シキボウ	38	47	5,217	
日本毛織	21	23.6	17,747	
トーア紡コーポレーション	30	3.2	1,500	
ダイドーリミテッド	7.6	8.7	4,028	
帝国繊維	6.9	8	10,776	
帝人	270	313	119,566	
東レ	510	555	528,193	
サカイオーベックス	17	21	3,654	
住江織物	19	23	5,911	
日本フェルト	3.8	4.2	2,041	
イチカワ	5	6	1,626	
日本バイリーン	9	—	—	
芦森工業	18	23	3,887	
アツギ	56	59	6,608	
ダイニック	12	14	2,226	
セーレン	16.4	19.1	22,786	
東海染工	9	11	1,419	
小松精練	11.5	12.5	7,537	
ワコールホールディングス	39	46	54,234	
ホギメディカル	4.2	4.8	32,784	
レナウン	15.8	20.7	2,442	
クラウドシア	2.6	3.5	1,743	
T S I ホールディングス	29.6	34.2	21,614	
三陽商会	36	45	10,845	
オンワードホールディングス	47	51	38,352	
ルック	13	19	2,850	
ゴールドウイン	16	3.4	16,626	
デサント	15.4	17.5	24,447	
キング	3.4	3.8	1,371	

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)
ヤマトインターナショナル	4.4	4.7	1,795	
<b>パルプ・紙 (0.3%)</b>				
特種東海製紙	38	44	15,796	
王子ホールディングス	271	314	140,358	
日本製紙	31.8	39.6	76,428	
三菱製紙	100	117	9,477	
北越紀州製紙	40.9	47.5	36,242	
中越パルプ工業	25	30	6,930	
巴川製紙所	10	12	2,316	
大王製紙	29	33.9	39,968	
レンゴー	58	68	45,832	
トーモク	21	24	7,344	
ザ・バック	4.7	5.4	14,250	
<b>化学 (6.2%)</b>				
クラレ	112.3	120.8	176,005	
旭化成	411	477	350,499	
共和レザー	4.4	5	4,385	
コープケミカル	10	—	—	
昭和電工	439	510	57,120	
住友化学	485	564	279,744	
日本化成	12	14	1,596	
住友精化	14	16	9,072	
日産化学工業	43.2	46	147,890	
ラサ工業	25	29	3,016	
クレハ	46	58	23,606	
多木化学	4	5	3,320	
テイカ	11	13	7,124	
石原産業	111	137	10,549	
片倉コープアグリ	4	9	1,827	
日東エフシー	—	4.5	3,942	
日本曹達	42	49	25,137	
東ソー	165	207	109,503	
トクヤマ	103	127	37,084	
セントラル硝子	67	83	45,816	
東亜合成	83	47.9	49,863	
大阪ソーダ	26	33	13,728	
関東電化工業	16	18	16,308	
デンカ	137	159	76,002	
信越化学工業	118.3	137.3	871,855	
日本カーバイド工業	22	26	4,368	
堺化学工業	27	31	9,517	
エア・ウォーター	58	63	109,242	
大陽日酸	84.7	59	59,118	
日本化学工業	24	28	6,468	
日本パーカライジング	31.1	39.1	43,948	
高压ガス工業	10	11	7,161	
チタン工業	8	9	1,665	
四国化成工業	10	11	9,669	

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)
戸田工業	13	15	4,725	
ステラ ケミファ	3.4	3.9	11,001	
保土谷化学工業	20	23	6,762	
日本触媒	52	11.1	72,927	
大日精化工業	27	30	13,800	
カネカ	89	103	88,477	
三菱瓦斯化学	113	132	82,896	
三井化学	300	325	130,975	
J S R	65.1	71.8	115,310	
東京応化工業	13.7	15.4	43,643	
大阪有機化学工業	4.7	5.5	3,366	
三菱ケミカルホールディングス	412.3	512.8	287,116	
日本合成化学工業	15	18	11,538	
ダイセル	92.7	107.7	143,456	
住友ベークライト	62	72	38,448	
積水化学工業	153	173.8	251,314	
日本ゼオン	57	66	54,714	
アイカ工業	19.8	23	56,925	
宇部興産	332	410	83,640	
積水樹脂	10.2	11.8	18,703	
タキロン	14	18	9,252	
旭有機材	23	25	5,125	
日立化成	32.6	37.8	77,792	
ニチバン	6	8	6,280	
リケンテクノス	10.7	16.5	7,243	
大倉工業	16	18	5,778	
積水化成成品工業	19	20	7,200	
群栄化学工業	18	20	5,620	
タイガースポリマー	3.2	3.8	2,135	
ミライアル	2.4	2.8	2,167	
ダイキアクシス	0.8	1.5	1,315	
ダイキョーニシカワ	1.6	9.9	15,127	
日本化薬	43	50	54,350	
カーリットホールディングス	5.4	7.2	3,484	
日本精化	5.5	6.3	4,586	
扶桑化学工業	—	4.9	8,075	
ADEKA	30.4	37.6	56,475	
日油	54	58	54,926	
ハリマ化成グループ	5.8	6.6	3,577	
花王	177.4	205.9	1,253,107	
第一工業製薬	15	17	5,967	
ニイタカ	1	1.1	1,481	
三洋化成工業	21	24	21,168	
大日本塗料	38	44	8,932	
日本ペイントホールディングス	57.1	59.1	182,619	
関西ペイント	80	86.6	188,874	
神東塗料	5	6	1,044	
中国塗料	19	22	17,314	

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)
日本特殊塗料	5.1	5.4	5,616	
藤倉化成	9	10.4	5,855	
太陽ホールディングス	5.4	5.6	20,552	
D I C	264	302	78,218	
サカタインクス	13.5	15.6	19,843	
東洋インキS Cホールディングス	65	76	35,796	
T & K T O K A	2.2	5.6	4,922	
富士フイルムホールディングス	150.9	175.2	786,472	
資生堂	117.3	145.3	423,694	
ライオン	76	88	142,560	
高砂香料工業	22	5	12,925	
マンダム	6.6	7.1	36,068	
ミルボン	3.9	4.5	21,847	
ファンケル	15.3	17.8	25,774	
コーセー	10.7	12.4	121,272	
コタ	2.3	2.6	2,815	
シーズ・ホールディングス	4.5	9.8	22,491	
シーボン	0.8	0.9	2,027	
ポーラ・オルビスホールディングス	7.8	7.8	74,880	
ノエビアホールディングス	4.2	4.8	15,072	
アジュバンコスメジャパン	1.2	1.5	1,387	
エステー	4.5	5.3	6,185	
アグロ カネショウ	1.8	3	3,126	
コニシ	5.2	12	17,052	
長谷川香料	8.3	9.7	18,759	
星光PMC	3.6	4.2	5,174	
小林製薬	10.8	11.6	104,168	
荒川化学工業	5.6	6.5	6,272	
メック	5.1	6	4,986	
日本高純度化学	1.9	2.2	4,657	
タカラバイオ	—	16.4	23,616	
J C U	1.8	2.3	7,659	
新田ゼラチン	4.1	5.1	3,865	
O A Tアグリオ	—	0.9	1,386	
デクセリアルズ	—	22.9	21,251	
アース製薬	4.7	5.5	27,170	
イハラケミカル工業	10.3	11.8	15,151	
北興化学工業	7	8	2,568	
大成ラミック	1.8	2.1	5,842	
クミアイ化学工業	13.6	15.8	14,204	
日本農薬	15.1	17.5	8,837	
アキレス	56	63	8,568	
有沢製作所	11.1	11.3	6,248	
日東電工	51	59.1	421,974	
レック	2.3	2.4	3,405	
きもと	11.8	12.7	2,095	
藤森工業	5.7	6.6	15,424	
前澤化成工業	4.6	5.4	5,313	



銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
J S P	4.9	5	10,865	
エフピコ	5.8	6.8	32,844	
天馬	5.1	5.9	10,366	
信越ポリマー	12.9	15	9,990	
東リ	17	20	6,400	
ニフコ	14.7	14.6	83,074	
日本バルカー工業	27	30	8,430	
ユニ・チャーム	133.5	155	334,335	
<b>医薬品 (5.8%)</b>				
協和発酵キリン	79	91.6	188,421	
武田薬品工業	247.1	304.9	1,469,313	
アステラス製薬	751	857.2	1,280,228	
大日本住友製薬	46.7	54.2	88,346	
塩野義製薬	103	111.6	692,812	
田辺三菱製薬	76.8	89.2	165,822	
わかもと製薬	7	9	2,277	
あすか製薬	7.8	9.7	19,235	
日本新薬	15	17.5	104,300	
ピオフェルミン製薬	1.1	1.2	3,375	
中外製薬	65.6	76.2	298,704	
科研製薬	23	13.2	82,764	
エーザイ	87	94.2	656,668	
ロート製薬	30	37.5	64,200	
小野薬品工業	29.9	173.8	838,411	
久光製薬	18.6	23.8	139,944	
有機合成薬品工業	4	5	1,220	
持田製薬	4.5	5.3	45,050	
参天製薬	121.2	141	230,394	
扶桑薬品工業	22	26	7,644	
日本ケミファ	8	11	5,412	
ツムラ	20.8	24.1	62,250	
日医工	15.4	17.9	44,051	
キッセイ薬品工業	12.2	13.6	32,572	
生化学工業	12.6	14.6	22,980	
栄研化学	5.5	6.4	13,792	
日水製薬	2.6	3.1	3,620	
鳥居薬品	4.5	5.2	13,483	
J C R ファーマ	5.1	5.9	17,936	
東和薬品	3.4	3.5	20,790	
富士製薬工業	1.8	2.5	5,435	
沢井製薬	10.4	13	103,740	
ゼリア新薬工業	13.5	15.7	23,298	
第一三共	221.8	257.4	672,843	
キョーリン製薬ホールディングス	17.6	20.4	44,696	
大幸薬品	2.9	3.8	5,855	
ダイト	2.9	4.3	11,868	
大塚ホールディングス	130.9	164.6	751,563	
大正製薬ホールディングス	15.9	18.4	189,336	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ペプチドリーム	—	12.7	82,550	
<b>石油・石炭製品 (0.5%)</b>				
日本コークス工業	59.1	61.8	4,264	
昭和シェル石油	58.9	77	88,165	
コスモ石油	182	—	—	
ニチレキ	8	9.3	6,537	
東燃ゼネラル石油	99	115	120,635	
ユシロ化学工業	3.5	4.1	5,457	
ビービー・カストロール	2.7	3.1	3,940	
富士石油	15.3	17.7	7,168	
MORESCO	1.7	2.4	2,779	
出光興産	31.3	39.9	89,934	
J X ホールディングス	731.8	906.1	393,519	
コスモエネルギーホールディングス	—	23.1	36,059	
<b>ゴム製品 (0.9%)</b>				
横浜ゴム	73	46.2	77,800	
東洋ゴム工業	29.8	34.6	44,841	
ブリヂストン	206.6	258.3	964,492	
住友ゴム工業	51.4	71.6	115,490	
藤倉ゴム工業	5.5	6.4	2,739	
オカモト	23	24	25,680	
フコク	2.8	2.8	2,293	
ニッタ	6.5	8.2	22,058	
住友理工	12.2	16.5	15,130	
三ツ星ベルト	16	19	17,271	
バンドー化学	24	28	14,840	
<b>ガラス・土石製品 (0.9%)</b>				
日東紡績	49	51	17,544	
旭硝子	325	404	277,548	
日本板硝子	318	369	34,317	
石塚硝子	9	11	1,903	
日本山村硝子	27	32	5,184	
日本電気硝子	126	158	84,056	
オハラ	2.7	3.2	1,731	
住友大阪セメント	123	152	69,464	
太平洋セメント	412	478	142,444	
デイ・シイ	7.3	8.2	3,345	
日本ヒューム	7	7.6	4,529	
日本コンクリート工業	11.5	16.2	5,281	
三谷セキサン	3.3	3.8	6,919	
アジアパイルホールディングス	8.9	9.7	3,870	
東海カーボン	57	67	20,703	
日本カーボン	35	38	8,892	
東洋炭素	3.7	4.3	6,402	
ノリタケカンパニーリミテド	38	43	11,137	
TOTO	97	56.2	235,197	
日本碍子	83	97	232,218	
日本特殊陶業	56.8	66	139,326	

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)
MARUWA	2	2.8	8,974			
品川リフラクトリーズ	17	20	4,040			
黒崎播磨	15	18	4,662			
ヨータイ	4	5	1,415			
イソライト工業	3.5	5.8	1,554			
東京窯業	8	11	1,859			
ニッカトー	2.6	3.2	1,200			
フジミインコーポレーテッド	6.4	6.7	11,946			
ニチアス	29	39	33,111			
ニチハ	8.8	10.2	15,524			
<b>鉄鋼(1.2%)</b>						
新日鐵住金	2,787	345.1	776,992			
神戸製鋼所	1,140	1,406	137,788			
合同製鐵	35	44	7,832			
ジェイ エフ イー ホールディングス	168.2	209.2	304,909			
日新製鋼	28.4	35.2	49,033			
東京製鐵	33.7	42.3	27,410			
共英製鋼	7	8.3	14,060			
大和工業	15	16.9	44,210			
東京鐵鋼	13	16	5,248			
大阪製鐵	4.1	4.9	8,996			
淀川製鋼所	46	11.5	30,992			
東洋鋼鈑	15.8	18.5	5,513			
丸一鋼管	20.2	25.6	94,208			
モリ工業	11	14	4,410			
大同特殊鋼	110	129	49,407			
日本高周波鋼業	29	38	2,812			
日本冶金工業	54.7	60.7	9,469			
山陽特殊製鋼	40	46	22,954			
愛知製鋼	39	45	22,185			
日立金属	67	87.6	101,002			
日本金属	17	20	2,080			
大太平洋金属	42	54	18,468			
新日本電工	40.2	44.2	7,867			
栗本鐵工所	34	38	6,422			
缸技	9	14	2,184			
日本鑄鉄管	6	10	1,480			
三菱製鋼	44	55	9,900			
日亜鋼業	9.2	12.7	2,921			
日本精線	5	6	2,826			
シンニッタン	6.9	7.1	4,125			
新家工業	13	18	2,592			
<b>非鉄金属(0.9%)</b>						
大紀アルミニウム工業所	11	12	3,840			
日本軽金属ホールディングス	160	173.3	37,952			
三井金属鉱業	179	195	36,855			
東邦亜鉛	38	40	14,280			
三菱マテリアル	411	478	150,092			

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)
住友金属鉱山	182	211	236,847			
DOWAホールディングス	79	99	65,538			
古河機械金属	103	119	20,230			
大阪チタニウムテクノロジーズ	6.5	7.6	10,556			
東邦チタニウム	11.1	12.9	9,365			
UACJ	75	107	28,462			
古河電気工業	194	241	64,347			
住友電気工業	248.4	306.3	477,828			
フジクラ	92	106	60,950			
昭和電線ホールディングス	72	91	5,551			
東京特殊電線	0.9	1.3	1,042			
タツタ電線	12.4	16.6	5,411			
沖電線	8	11	2,156			
カナレ電気	1.1	1.3	2,585			
平河ヒューテック	1.7	3.9	3,381			
リョービ	37	47	21,432			
アーレスティ	5.9	8.9	6,853			
アサヒホールディングス	9.9	11.5	17,951			
<b>金属製品(0.6%)</b>						
稲葉製作所	2.9	4.1	5,666			
宮地エンジニアリンググループ	21	28	4,312			
トーカロ	4.3	5.5	10,312			
アルファC o	2.7	3.2	3,136			
SUMCO	51.9	60.9	46,284			
川田テクノロジーズ	1.5	1.7	6,052			
東洋製罐グループホールディングス	46.9	54.4	126,806			
ホッカンホールディングス	18	22	7,634			
コロナ	3.4	4	4,152			
横河ブリッジホールディングス	12.5	15	16,440			
駒井ハルテック	13	17	3,536			
高田機工	6	8	1,608			
三和ホールディングス	62	76.8	75,033			
文化シャッター	18.8	21.3	18,658			
三協立山	9	10.5	16,117			
アルインコ	2.8	5.8	5,823			
東洋シャッター	2.2	2.9	1,597			
L I X I Lグループ	98.1	106.6	212,773			
日本ファイルコン	5.8	7	3,017			
ノーリツ	12.9	15	32,115			
長府製作所	7	8.2	21,992			
リンナイ	12.2	14.2	134,332			
ダイニチ工業	3.4	3.9	2,379			
日東精工	10	12	3,600			
三洋工業	9	12	2,148			
岡部	13	16.1	13,024			
ジーテクト	4.8	8.3	11,611			
東プレ	12.7	14.7	36,456			
高周波熱練	11.4	14.3	12,069			

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)
サンコール	4	4.5	2,043	
モリテック スチール	3.5	4.8	1,252	
パイオラックス	3.4	3.9	22,035	
日本発條	57.3	72	68,760	
中央発條	9	11	3,234	
アドバネクス	17	2.1	2,662	
立川ブラインド工業	—	3.2	2,361	
三益半導体工業	4.9	5.7	5,757	
<b>機械 (4.8%)</b>				
日本ドライケミカル	0.9	1	2,114	
日本製鋼所	94	127	58,928	
三浦工業	29.4	34.1	78,464	
タクマ	21	28	28,392	
ツガミ	19	22	9,988	
オークマ	43	50	41,200	
東芝機械	36	42	14,616	
アマダホールディングス	98.2	111.6	135,594	
アイダエン지니어リング	14.4	20.1	21,788	
滝澤鉄工所	21	24	3,024	
富士機械製造	21.5	25	26,725	
牧野フライス製作所	33	38	25,840	
オーエスジー	30	34.9	69,346	
ダイジェット工業	10	13	1,885	
旭ダイヤモンド工業	18.1	20.7	18,650	
DMG森精機	41.6	42.7	57,346	
ソディック	13.4	19.4	18,624	
ディスコ	7.7	9.7	99,910	
日東工器	3.8	4.5	10,692	
パンチ工業	1.8	3	2,595	
豊和工業	3.8	4.6	2,539	
OKK	29	34	3,638	
東洋機械金属	4.6	5.6	2,245	
津田駒工業	16	—	—	
島精機製作所	9.3	10.8	24,775	
NCホールディングス	—	2.5	2,985	
フリュー	—	1.5	3,678	
ヤマシンフィルタ	—	1.5	627	
日阪製作所	8.3	9.7	8,458	
やまびこ	2.6	14	11,886	
ベガサスミシン製造	6.6	7.9	4,005	
ナブテスコ	40.1	39.8	109,529	
三井海洋開発	6.6	9	16,128	
レオン自動機	5.2	6.4	3,980	
SMC	19.8	22.9	634,673	
新川	5.5	6.8	3,522	
ホソカワミクロン	11	13	7,904	
ユニオンツール	3.3	3.3	9,738	
オイレス工業	7.8	9.9	18,166	

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)
日精エー・エス・ビー機械	2.3	2.8	5,787	
サトーホールディングス	8.2	10.3	24,132	
日本エアーテック	2.6	2.7	1,782	
日精樹脂工業	4.9	6	4,284	
オカダアイオン	—	1.5	1,215	
ワイエイシイ	2.7	3.1	3,007	
小松製作所	323	375	702,187	
住友重機械工業	180	223	119,751	
日立建機	29.4	34.2	57,866	
日工	9	12	3,696	
巴工業	2.5	3.1	4,615	
井関農機	67	79	21,172	
TOWA	5.4	7.4	6,452	
丸山製作所	15	18	3,150	
北川鉄工所	31	36	6,588	
タカキタ	—	2.5	1,325	
クボタ	317	367.3	596,127	
荏原実業	2	2.3	2,973	
三菱化工機	22	27	5,535	
日島機械	11.6	14.5	14,616	
帝国電機製作所	4.4	5.6	4,491	
新東工業	15.5	17.4	15,207	
澁谷工業	5.5	6.4	10,681	
アイチ コーポレーション	9.3	10.9	9,101	
小森コーポレーション	16	18.6	24,682	
鶴見製作所	4.9	5.7	7,968	
住友精密工業	10	12	4,080	
酒井重工業	13	15	2,730	
荏原製作所	137	169	94,640	
石井鐵工所	11	14	2,254	
西島製作所	6.5	8.2	8,798	
北越工業	5.2	8.2	4,952	
ダイキン工業	91.7	106.4	999,628	
オルガノ	13	13	5,564	
トーヨーカネツ	38	41	8,159	
栗田工業	37.3	46	117,990	
椿本チエイン	34	43	34,787	
大同工業	15	17	3,451	
日本コンベヤ	21	—	—	
木村化工機	6.9	7.7	2,587	
アネスト岩田	9.9	12.3	13,038	
ダイフク	31.1	39.3	74,748	
サムコ	0.9	1.8	1,668	
加藤製作所	14	18	7,614	
油研工業	14	16	2,848	
タダノ	30	35.3	35,405	
フジテック	18.4	21.3	22,471	
CKD	17.7	20.3	18,797	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
キトー	6.9	9.2	7,728	
平和	13.7	22.7	50,235	
理想科学工業	7.7	8.1	13,867	
SANKYO	17.5	20.3	83,839	
日本金銭機械	5.8	6.7	6,056	
マースエンジニアリング	3.6	4.1	8,638	
福島工業	3.5	4.5	12,708	
オーイズミ	2.7	3.1	1,432	
ダイコク電機	2.6	3	4,542	
竹内製作所	2.7	14.5	26,984	
アマノ	21	22.6	41,493	
JUKI	47	10.8	12,344	
サンデンホールディングス	39	45	16,650	
蛇の目ミシン工業	—	7.1	4,572	
マックス	10	11	14,069	
グローリー	20.1	24.9	80,178	
新晃工業	4.4	5.1	7,277	
大和冷機工業	9.1	11.7	10,845	
セガサミーホールディングス	67.7	78.5	104,640	
日本ビストンリング	26	3	4,722	
リケン	27	34	12,784	
T P R	7	9	25,002	
ツバキ・ナカシマ	—	9	13,752	
ホシザキ電機	13.8	16	168,480	
大豊工業	5.2	5.9	7,085	
日本精工	129.3	150.1	143,945	
NTN	146	181	66,789	
ジェイテクト	67.1	77.9	117,161	
不二越	59	68	26,384	
日本トムソン	22	25	9,575	
THK	41.9	48.6	100,699	
ユーション精機	2.8	2.8	4,813	
前澤給装工業	2.4	3	4,278	
イーグル工業	8.8	9	12,258	
前澤工業	5.8	5.3	1,415	
日本ビラー工業	6.9	7.4	6,756	
キッツ	28.3	35.1	16,883	
日立工機	16.9	19.6	14,170	
マキタ	41.1	47.7	342,963	
日立造船	49.2	58	33,466	
三菱重工	1,055	1,302	572,880	
I H I	454	564	158,484	
電気機器 (11.7%)				
日清紡ホールディングス	—	40.6	46,811	
イビデン	41.3	44.8	62,764	
コニカミノルタ	150.1	182.6	172,009	
ブラザー工業	81.4	94.5	124,834	
ミネベア	94	117.8	101,425	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
日立製作所	1,512	1,865	934,365	
東芝	1,325	1,539	428,765	
三菱電機	630	780	1,024,920	
富士電機	175	220	97,680	
東洋電機製造	12	14	4,564	
安川電機	76.8	90.8	125,031	
シンフォニアテクノロジー	44	47	8,977	
明電舎	58	67	29,681	
オリジン電気	9	11	3,113	
山洋電気	14	19	10,507	
デンヨー	5.4	6.7	8,073	
東芝テック	45	52	20,592	
芝浦メカトロニクス	10	12	2,760	
マブチモーター	18	20.9	110,352	
日本電産	69	88	737,616	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	—	0.9	2,048	
東光高岳	3.2	4.1	7,363	
ダブル・スコープ	—	2.9	17,806	
ダイヘン	34	43	21,973	
田淵電機	5.5	8.4	3,553	
ヤーマン	0.8	0.9	1,845	
JVCケンウッド	46.3	53.8	14,095	
ミマキエンジニアリング	3.8	6.6	3,630	
第一精工	2.3	3.1	3,394	
日新電機	14.8	17.1	22,623	
大崎電気工業	11	13	10,257	
オムロン	68	82.5	292,875	
日東工業	10.1	11.7	18,462	
I D E C	7.5	9.5	9,538	
不二電機工業	0.6	0.7	1,018	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	121	141	65,001	
サクサホールディングス	16	18	3,978	
メルコホールディングス	3.5	4.1	9,302	
テクノメディカ	1.4	1.7	3,427	
日本電気	815	1,005	257,280	
富士通	607	705	306,322	
沖電気工業	222	317	50,720	
岩崎通信機	28	34	2,380	
電気興業	18	19	9,671	
サンケン電気	32	40	12,760	
ナカヨ	6	7	2,233	
アイホン	3.6	4.1	7,117	
ルネサスエレクトロニクス	32.6	37.9	24,786	
セイコーエプソン	85.9	108.8	215,750	
ワコム	49.6	57.6	23,040	
アルバック	10.6	13.4	49,915	
アクセル	2.9	3.3	2,871	
E I Z O	5.8	7.2	22,572	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ジャパンディスプレイ	129.4	136.7	28,160	
日本信号	17.4	20.2	19,109	
京三製作所	15	17	5,797	
能美防災	8.3	8.3	11,412	
ホーチキ	4.6	5.3	6,964	
エレコム	2	6.3	12,379	
日本無線	13	21	5,964	
パナソニック	767.3	835.1	831,175	
シャープ	532	615	91,635	
アンリツ	37.8	43.9	27,042	
富士通ゼネラル	19	22	44,638	
日立国際電気	16	16.7	24,048	
ソニー	411.6	515.7	1,589,387	
TDK	38	44.1	283,563	
帝国通信工業	15	17	2,686	
ミツミ電機	22.3	27.9	14,229	
タムラ製作所	24	28	9,240	
アルプス電気	49.7	63	136,962	
池上通信機	21	23	2,875	
パイオニア	94.6	118.3	27,445	
日本電波工業	5.7	6.6	4,705	
鈴木	0.8	2.9	1,682	
日本トリム	1.5	2	12,800	
ローランド ディー、ジー、	2.5	3.6	7,531	
フォスター電機	6.7	9.2	19,044	
クラリオン	33	39	12,285	
SMK	19	22	9,900	
ヨコオ	4.9	5.3	2,597	
東光	15	—	—	
ホシデン	19.1	22.2	16,272	
ヒロセ電機	10.7	11.8	159,182	
日本航空電子工業	18	21	30,954	
TOA	6.8	8.6	8,651	
日立マクセル	12.5	12.1	18,997	
古野電気	7.5	8.7	5,176	
ユニデンホールディングス	17	23	2,990	
アルパイン	15	17.4	21,071	
スミダコーポレーション	5.7	6	4,680	
アイコム	3.5	4	8,420	
リオン	1.9	2.8	4,410	
本多通信工業	—	2	1,898	
船井電機	6.4	7.4	6,623	
横河電機	63	73.2	93,403	
新電元工業	24	26	10,686	
アズビル	20.6	23.9	74,209	
東亜ディーケーケー	2.7	4.1	2,029	
日本光電工業	26.9	30.6	98,685	
チノー	2.2	2.6	2,610	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
共和電業	7.7	8.9	3,195	
日本電子材料	2.7	2.9	1,342	
堀場製作所	11.6	13.5	63,585	
アドバンテスト	42.9	49.8	61,303	
小野測器	3.1	3.6	3,024	
エスベック	7	7.6	11,164	
パナソニック デバイスSUNX	5.6	6.5	4,075	
キーエンス	14.3	16.6	1,150,878	
日置電機	3.3	3.8	9,196	
シスメックス	48.8	56.7	457,002	
日本マイクロニクス	—	13.7	13,206	
メガチップス	6.6	7.6	10,123	
OBARA GROUP	4.1	4.7	18,753	
澤藤電機	4	4	708	
コーセル	9.2	10.2	12,331	
新日本無線	5	5.3	2,326	
オブテックス	4.3	5.4	18,225	
千代田インテグレ	2.8	3.9	8,073	
アイ・オー・データ機器	—	2.3	1,455	
レーザーテック	6.5	8.6	12,177	
スタンレー電気	45.2	52.3	123,166	
岩崎電気	22	25	4,025	
ウシオ電機	38.2	44.4	59,052	
岡谷電機産業	3.4	4	1,516	
ヘリオス テクノ ホールディング	5.9	6.3	2,312	
日本セラミック	3.6	4.2	8,328	
遠藤照明	2.9	3.7	3,762	
日本デジタル研究所	5.3	6.2	8,878	
古河電池	5	5	3,320	
双信電機	3.1	3.7	1,028	
山一電機	7.3	6.4	3,942	
図研	4.6	5.3	5,872	
日本電子	27	29	16,095	
カシオ計算機	63.1	73.3	126,076	
ファナック	65.6	74.8	1,251,778	
日本シイエムケイ	16.1	15.8	6,967	
エンプラス	2.9	3.7	11,803	
大真空	12	13	3,419	
ローム	31	36	166,860	
浜松ホトニクス	49.1	57	169,860	
三井ハイテック	8.3	10.6	7,875	
新光電気工業	23.8	27.7	17,478	
京セラ	103.4	120	657,720	
太陽誘電	33	35.6	42,791	
村田製作所	66.1	77.1	982,254	
ユースン	8.8	9.7	6,741	
双葉電子工業	10.8	12.3	24,895	
北陸電気工業	27	30	3,810	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ニチコン	19.9	23.1	17,325	
日本ケミコン	51	59	9,086	
KOA	8.7	10.1	8,029	
市光工業	15	18	5,472	
小糸製作所	37.7	43.8	225,570	
ミツバ	11.6	12.4	20,980	
スター精密	12	13.9	17,402	
SCREENホールディングス	60	75	80,475	
キャノン電子	5.8	6.7	10,753	
キャノン	365	393.5	1,243,460	
リコー	189.3	236.7	224,865	
MUTOHホールディングス	9	9	2,169	
東京エレクトロン	53	60	490,020	
<b>輸送用機器 (9.5%)</b>				
トヨタ紡織	22.5	25.7	56,540	
鬼怒川ゴム工業	14	17	13,141	
ユニプレス	12.1	15.2	33,379	
豊田自動織機	57.5	66.6	313,353	
モリタホールディングス	11	12.8	18,726	
三櫻工業	8.1	9.8	5,615	
デンソー	155.7	180.6	783,984	
東海理化電機製作所	16.7	21.4	41,409	
三井造船	244	283	50,091	
川崎重工業	457	569	192,322	
名村造船所	17.9	22.4	15,388	
サノヤスホールディングス	11.3	11.2	1,971	
日本車輛製造	23	30	8,610	
ニチユ三菱フォークリフト	7.3	8.4	4,384	
近畿車輛	9	11	3,234	
日産自動車	883.8	1,020	1,127,100	
いすゞ自動車	199	211.8	273,963	
トヨタ自動車	868.7	909	5,164,029	
日野自動車	89.9	104.3	117,024	
三菱自動車工業	230.8	288.3	165,484	
エフテック	3.7	4.2	4,439	
レシップホールディングス	2.1	2.4	1,843	
GMB	0.9	1.6	1,569	
ファルテック	0.7	1.6	1,990	
武蔵精密工業	6.7	7.8	17,612	
日産車体	27.7	35.7	44,482	
新明和工業	25	32	24,544	
極東開発工業	11.7	14.5	16,269	
日信工業	11.5	16.3	24,401	
トピー工業	54	62	13,516	
ティラド	24	28	5,432	
曙ブレーキ工業	28.3	37	9,583	
タチエス	10	11.6	20,775	
NOK	30.6	35.5	70,183	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
フタバ産業	20.9	23.4	12,799	
KYB	71	83	31,457	
シロキ工業	14	—	—	
大同メタル工業	9	10.3	10,289	
プレス工業	32.1	38.9	16,338	
ミクニ	7.6	10.7	3,359	
カルソニックカンセイ	49	56	48,776	
太平洋工業	12.9	16.3	18,125	
ケーヒン	14.5	16.8	30,391	
河西工業	7.9	9.3	11,067	
アイシン精機	57.8	74.9	337,050	
富士機工	7.4	8.5	3,553	
マツダ	187.6	231.4	430,519	
ダイハツ工業	75.1	87.2	129,928	
今仙電機製作所	5.3	6.7	6,331	
本田技研工業	566.6	657.7	2,053,339	
スズキ	131.6	133.2	382,750	
富士重工業	214.3	231	951,720	
安永	2.1	3.2	1,497	
ヤマハ発動機	95.8	103.2	195,564	
ショーワ	14.9	19	15,048	
TBK	8.1	9.4	3,459	
エクセディ	8.6	9.9	25,254	
豊田合成	20.4	26.6	57,589	
愛三工業	10.1	13	11,531	
盟和産業	5	1.3	1,302	
ヨロズ	5.9	6.8	11,804	
エフ・シー・シー	9.3	12	25,188	
シマノ	27.2	29.5	506,810	
テイ・エス テック	13.4	17	48,518	
ジャムコ	2.6	4.4	9,706	
<b>精密機器 (1.6%)</b>				
テルモ	96.5	112	510,720	
クリエートメディック	2.1	2.4	2,061	
日機装	20.4	26.5	21,332	
島津製作所	75	94	161,116	
JMS	12	14	3,976	
モリテックス	1.4	—	—	
長野計器	4	4.6	2,764	
ブイ・テクノロジ	1.3	1.7	15,028	
東京計器	22	23	4,002	
愛知時計電機	8	10	2,980	
オーバル	4.8	7.3	1,693	
東京精密	11.3	14.1	35,715	
マニー	1.8	9.7	17,033	
ニコン	117.6	136.5	209,254	
トプコン	19	24.6	27,355	
オリンパス	93.8	108.9	505,840	

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)
理研計器	5.6	5.9	6,631	
タムロン	4.8	5.9	9,369	
HOYA	149.8	165.3	635,247	
ノーリツ鋼機	5.7	6.6	5,412	
エー・アンド・デイ	5.7	6.7	2,874	
シチズンホールディングス	77.5	90	54,990	
リズム時計工業	28	32	5,376	
大研医器	4.5	5.8	5,034	
メニコン	—	4.9	15,288	
松風	3.1	3.6	5,248	
セイコーホールディングス	45	47	18,988	
ニプロ	40.2	54.5	68,016	
<b>その他製品(1.6%)</b>				
スノーピーク	—	0.8	3,108	
パラマウントベッドホールディングス	6.6	7.7	34,342	
トランザクション	0.5	1.5	1,380	
SHO-BI	2.1	2.4	960	
ニホンフラッシュ	—	2.8	3,351	
前田工織	6.4	8	8,776	
永大産業	9	10	4,310	
アートネイチャー	4.5	7.8	7,355	
ダンロップスポーツ	4	4.6	4,945	
バンダイナムコホールディングス	69.4	75.6	206,085	
アイフィスジャパン	—	1.6	680	
共立印刷	11.4	12.1	3,593	
SHOEI	—	3.5	6,384	
フランスベッドホールディングス	44	10.2	9,700	
パイロットコーポレーション	5.5	12.7	61,912	
萩原工業	1.3	2	5,146	
トッパン・フォームズ	11.2	13	16,250	
フジシールインターナショナル	7.6	8.9	37,869	
タカラトミー	22.6	24	20,040	
廣済堂	5.8	6.8	2,244	
As-me エステール	1.7	2	1,260	
アーク	19.9	30.7	2,548	
タカノ	2.8	3.2	1,971	
プロネクサス	6.4	6.8	6,847	
ホクシン	5	5.8	730	
ウッドワン	11	13	3,224	
大建工業	26	29	8,816	
凸版印刷	178	206	207,030	
大日本印刷	192	216	244,944	
図書印刷	10	14	7,980	
共同印刷	19	25	8,275	
日本写真印刷	10.6	12.3	30,823	
光村印刷	6	7	1,435	
宝印刷	3.3	3.6	4,892	
アシックス	62.5	68.1	169,569	

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)
ツツミ	3.1	3.6	7,992	
小松ウオール工業	1.9	2.5	4,192	
ヤマハ	46.3	53.7	179,358	
河合楽器製作所	2.2	2.7	5,332	
クリナップ	5.7	8.6	6,579	
ビジョン	35.7	41.4	124,614	
兼松日産農林	8	8	1,176	
キングジム	5.2	6.1	5,215	
リンテック	15	17.4	37,636	
TASAKI	1.2	1.4	2,198	
イトーキ	13.3	15.4	9,794	
任天堂	38.8	45	720,000	
三菱鉛筆	5.2	5.5	31,680	
タカラスタンダード	26	30	30,150	
コクヨ	32.7	38	55,290	
ナカバヤシ	13	15	4,395	
グローブライド	30	3.5	5,222	
岡村製作所	24.2	25.5	27,795	
美津濃	34	39	20,241	
アデランス	7.3	12.7	6,845	
<b>電気・ガス業(1.9%)</b>				
東京電力ホールディングス	534.1	620	317,440	
中部電力	192.6	223.6	334,058	
関西電力	256.9	298.3	308,143	
中国電力	87	101	139,279	
北陸電力	61.7	71.6	97,376	
東北電力	157.3	182.6	259,474	
四国電力	56.7	65.8	84,158	
九州電力	139	161.4	177,055	
北海道電力	58.9	68.4	63,885	
沖縄電力	6.15	11.65	24,896	
電源開発	45.6	62.3	175,436	
ファーストエスコ	—	3	1,701	
イーレックス	—	2.2	4,257	
東京瓦斯	765	816	366,710	
大阪瓦斯	652	757	312,716	
東邦瓦斯	160	184	150,696	
北海道瓦斯	13	18	5,004	
広島ガス	10	12.7	4,470	
西部瓦斯	71	82	20,500	
静岡ガス	17.9	20.7	15,525	
メタウォーター	3	4.7	13,446	
<b>陸運業(4.5%)</b>				
SBSホールディングス	4.8	7.2	6,098	
東武鉄道	336	391	219,742	
相鉄ホールディングス	108	125	83,375	
東京急行電鉄	342	425	400,775	
京浜急行電鉄	173	200	208,800	

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
小田急電鉄	202	234	279,630
京王電鉄	176	204	192,168
京成電鉄	94	110	157,300
富士急行	17	20	27,880
新京成電鉄	8	9	3,744
東日本旅客鉄道	115.4	133.6	1,346,688
西日本旅客鉄道	60.6	70.3	486,897
東海旅客鉄道	56.4	65.5	1,264,150
西武ホールディングス	50.2	77.6	159,623
鴻池運輸	7.8	10.3	13,091
西日本鉄道	81	95	56,905
ハマキョウレックス	2	5.6	11,827
サカイ引越センター	1.1	2.9	8,772
近鉄グループホールディングス	634	736	325,312
阪急阪神ホールディングス	423	491	371,687
南海電気鉄道	141	164	95,776
京阪ホールディングス	141	164	125,296
神戸電鉄	15	18	6,570
名糖運輸	2.6	—	—
名古屋鉄道	229	266	150,024
山陽電気鉄道	23	27	13,500
日本通運	244	283	134,142
ヤマトホールディングス	110.7	130.7	293,682
山九	76	96	57,216
丸運	3.4	3.9	928
丸全昭和運輸	21	25	9,975
センコー	27	32.9	21,121
トナミホールディングス	13	15	4,365
ニッコンホールディングス	20.6	23.8	53,502
日本石油輸送	7	8	1,840
福山通運	38	44	24,024
セイノーホールディングス	48.7	51.8	55,633
神奈川中央交通	7	9	5,670
日立物流	13.1	15.2	28,469
丸和運輸機関	0.6	2.2	6,285
C&F ロジホールディングス	—	7	6,664
<b>海運業(0.2%)</b>			
日本郵船	533	656	136,448
商船三井	331	357	88,536
川崎汽船	277	320	75,840
NSユナイテッド海運	33	38	5,624
飯野海運	34	39	15,678
共栄タンカー	11	13	2,483
乾汽船	—	6	5,214
<b>空運業(0.7%)</b>			
日本航空	120.5	139.9	532,179
ANAホールディングス	1,237	1,357	438,175
パスコ	6	7	2,632

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
<b>倉庫・運輸関連業(0.2%)</b>			
トランコム	1.8	2.1	13,356
日新	24	30	10,650
三菱倉庫	41	52	80,236
三井倉庫ホールディングス	36	42	12,474
住友倉庫	46	53	30,263
澁澤倉庫	16	19	5,396
東陽倉庫	11	12	2,700
乾汽船	4.2	—	—
日本トランスシティ	14	17	5,865
ケイヒン	12	13	1,820
中央倉庫	3.6	4.2	3,725
安田倉庫	4.9	5.7	4,035
東洋埠頭	20	21	3,318
宇徳	5.1	5.9	1,941
上組	75	87	89,088
サンリツ	1.5	1.8	867
キムラユニティー	1.6	1.8	1,922
キューソー流通システム	1.7	2	5,162
郵船ロジスティクス	5.8	6.7	7,845
近鉄エクスプレス	5.6	13.1	18,484
東海運	3.4	3.9	1,025
エーアイティー	2.9	4.5	4,104
内外トランスライン	0.7	2.4	2,385
<b>情報・通信業(8.4%)</b>			
NEC ネットエスアイ	7.8	9	17,217
システナ	6.1	7	11,424
デジタルアーツ	3.3	3.5	10,342
新日鉄住金ソリューションズ	5.2	12	22,932
キューブシステム	2.7	3.2	1,878
コア	2.6	3	3,690
ソフトクリエイトホールディングス	2	3.5	3,286
I Tホールディングス	20.6	23.9	62,618
ネオス	1.7	2.2	1,515
電算システム	2.2	2.5	3,807
グリー	37.6	43.8	27,813
コーエーテクモホールディングス	14	17.1	33,994
三菱総合研究所	2.4	2.8	10,248
ボルテージ	1.1	1.4	1,771
電算	0.7	0.8	1,583
AGS	1	1.6	1,608
ファインデックス	2.7	4.7	7,914
ヒト・コミュニケーションズ	0.7	1.6	3,072
ブレインパッド	0.7	1.1	1,233
KL a b	6.6	11.2	7,974
ポルトゥウイン・ビット	4.1	4.8	4,713
クルーホールディングス	—	—	—
イーブックイニシアティブジャパン	1.4	1.6	1,099



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)
ネクソン	59.1	69.2	125,736			
アイスタイル	2.3	11.6	10,776			
エムアップ	1.7	1.9	1,088			
エイチーム	1.6	4	6,628			
テクノスジャパン	—	2.1	5,848			
e n i s h	1.6	—	—			
コロブラ	17.1	20.1	43,094			
モバイルクリエイト	3	4.8	2,020			
オルトプラス	1.2	—	—			
ブロードリーフ	5.1	7.4	8,051			
ハーツユニテッドグループ	1.9	2.2	6,864			
メディアドゥ	—	1.5	2,485			
ブイキューブ	—	4.7	5,903			
サイバーリンクス	—	1.1	1,249			
ディー・エル・イー	—	2	2,466			
VOYAGE GROUP	—	2.5	3,415			
オブティム	—	0.6	2,994			
ベリサーブ	0.7	0.8	3,588			
ティーガイア	6.2	7.2	11,203			
日本アジアグループ	—	8.2	3,632			
豆蔵ホールディングス	4.9	5.7	4,542			
テクマトリックス	2.7	3.1	6,993			
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	—	168.1	52,615			
GMOペイメントゲートウェイ	5.4	6.3	43,785			
ザッパラス	3.5	4.1	1,730			
インターネットイニシアティブ	10	11.7	27,495			
さくらインターネット	—	4.7	5,799			
GMOクラウド	1.1	1.6	2,019			
ビットアイル	7	—	—			
SRAホールディングス	3.3	4.2	9,580			
Minorityソリューションズ	—	1.4	1,236			
パイブドビッツ	0.6	—	—			
朝日ネット	6.4	6.6	3,201			
コムチュア	1	1.2	3,732			
サイバーコム	—	0.8	909			
gumi	4.8	7.5	7,807			
パイブDHD	—	0.9	1,138			
パソニック インフォメーションシステムズ	1.5	—	—			
フェイス	1.9	1.9	2,268			
ハイマックス	0.8	1	1,161			
野村総合研究所	35.2	50.6	211,255			
サイバネットシステム	5.1	5.9	4,961			
CEホールディングス	0.7	1.1	1,125			
インタージホールディングス	3.5	3.8	5,669			
東邦システムサイエンス	1.8	2.2	1,339			
ソースネクスト	3.1	3.6	1,800			
ティー・ワイ・オー	6.3	14.3	2,388			
フォーカスシステムズ	—	2.8	1,330			

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)
クレスコ	1.4	1.6	3,025			
フジ・メディア・ホールディングス	64.7	75.1	101,009			
オービック	21.4	24.9	146,163			
ジャストシステム	8.7	13.1	11,776			
TDCソフトウェアエンジニアリング	1.4	3.2	2,214			
ヤフー	445.3	517	257,466			
トレンドマイクロ	32.9	35	140,175			
インフォメーション・ディベロプメント	1.2	1.4	1,449			
日本オラクル	10	11.6	67,280			
アルファシステムズ	2	2.4	4,077			
フューチャー	6.5	8.7	6,664			
CAC Holdings	4.2	5.4	4,433			
ソフトバンク・テクノロジー	1.7	2	3,946			
トーセ	1.6	2	1,372			
オービックビジネスコンサルタント	3.9	3.7	18,148			
伊藤忠テクノソリューションズ	14.1	16.3	39,120			
アイティフォー	7.5	9.4	5,094			
東計電算	1.1	1.3	2,367			
エックスネット	0.6	0.7	1,070			
大塚商会	16.7	19.4	100,298			
サイボウズ	8.3	9.6	3,446			
ソフトブレーン	8.5	10.6	2,151			
電通国際情報サービス	3.8	4.4	8,597			
EMシステムズ	0.7	2.5	2,975			
ウェザーニューズ	1.9	2.4	8,796			
C I J	5.6	6.6	3,306			
東洋ビジネスエンジニアリング	0.6	0.7	970			
日本エンタープライズ	4.2	7.5	1,927			
WOWOW	3	3.4	8,680			
フュージョンパートナー	2.7	4.5	2,704			
日本コロムビア	2.1	2.5	1,070			
イマジカ・ロボット ホールディングス	3.3	6.1	2,909			
ネットワンシステムズ	25.2	31.3	19,406			
アルゴグラフィックス	2.6	3.3	5,712			
マーベラス	10.5	12.2	11,992			
エイベックス・グループ・ホールディングス	12.3	13.3	18,447			
日本ユニシス	17.2	19.9	26,367			
兼松エレクトロニクス	3.9	4.6	8,855			
東京放送ホールディングス	37.2	43.2	67,651			
日本テレビホールディングス	56.7	65.9	128,900			
朝日放送	6.1	7.2	4,716			
テレビ朝日ホールディングス	17	19.7	35,460			
スカパーJSATホールディングス	47.2	54.8	28,879			
テレビ東京ホールディングス	5.1	6.5	15,028			
日本BS放送	1	1.6	1,608			
U-NEXT	—	2.3	2,051			
ワイヤレスゲート	—	2.1	4,473			
コネクシオ	4.4	6.4	8,864			

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)
日本通信	—	51.2	12,288	
クロップス	0.6	1.4	735	
日本電信電話	243.2	557.6	2,702,129	
KDD I	631.3	732.8	2,339,830	
光通信	5.6	8.7	78,474	
NTTドコモ	479.2	539	1,479,285	
エムティーアイ	7.9	11	7,546	
GMOインターネット	20.7	26.6	34,899	
カドカワ	15.2	22.5	28,845	
学研ホールディングス	21	24	6,168	
ゼンリン	8.2	9.5	24,462	
昭文社	3.7	4	2,332	
インプレスホールディングス	4.4	5.9	885	
アイネット	3.2	4	4,348	
松竹	41	47	50,995	
東宝	44.3	51.5	155,787	
東映	23	27	25,947	
AOI Pro.	2.9	3.7	3,774	
エヌ・ティ・ティ・データ	38.4	44.6	249,314	
ピー・シー・エー	0.8	0.9	1,154	
ビジネスブレイン太田昭和	—	1.1	1,017	
DTS	6.4	8	18,552	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	23.9	30.5	107,055	
シーイーシー	4	4.7	7,266	
カプコン	15.9	18.5	48,396	
アイ・エス・ピー	0.7	1.2	1,147	
ジャステック	3.6	4.6	4,383	
SCSK	14.8	17.2	71,896	
日本システムウエア	2.3	2.7	3,059	
アイネス	8.4	10.2	11,352	
TKC	5.3	6.7	19,470	
富士ソフト	8.6	10.7	27,295	
NSD	14.5	15.3	26,423	
コナミホールディングス	25.2	32.6	139,202	
福井コンピュータホールディングス	1.7	2.1	3,278	
JBCホールディングス	5.2	6.1	4,190	
ミロク情報サービス	4.1	5.3	6,980	
ソフトバンクグループ	328.6	408.7	2,523,722	
<b>卸売業 (4.2%)</b>				
ハウスイ	5	6	708	
高千穂交易	2.4	2.8	2,461	
伊藤忠食品	1.5	1.8	7,335	
エレマテック	2.9	3.4	6,874	
JALUX	1.8	2.3	4,528	
あらた	14	3.2	7,584	
トーマンデバイス	0.9	1.1	2,143	
東京エレクトロン デバイス	1.3	2.6	3,980	
フィールズ	4.1	6.3	9,834	

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)
双日	415.9	454.4	113,145	
アルフレッサ ホールディングス	73.5	90.7	213,507	
横浜冷凍	15.4	17.9	19,027	
神栄	—	10	1,260	
山下医科器械	0.5	0.6	1,047	
ラサ商事	3	3.4	1,601	
ラクーン	—	3.1	2,002	
アルコニックス	3.5	4.1	6,355	
神戸物産	2	4.7	11,684	
あい ホールディングス	10	12.8	34,201	
ディーブイエックス	1.8	2.6	2,896	
ダイワボウホールディングス	57	66	14,718	
マクニカ・富士エレホールディングス	11.2	13	15,600	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	11.7	12.5	12,800	
八洲電機	4.8	5.6	2,934	
UKCホールディングス	4	4.6	8,712	
OCHIホールディングス	1.6	2.1	2,148	
TOKAIホールディングス	30.4	31.7	21,460	
三洋貿易	3.4	4	5,544	
ウイン・パートナーズ	2	2.6	4,063	
ミタチ産業	1.5	1.9	1,183	
シップヘルスケアホールディングス	11.4	14.6	46,428	
明治電機工業	1.8	2.3	2,380	
デリカフーズ	1.1	1.5	1,423	
スターティア	0.6	1.4	844	
富士興産	2.4	2.8	1,173	
協栄産業	8	10	1,350	
小野建	5.4	6.3	7,938	
佐島電機	4.9	5.7	3,853	
エコートレーディング	1.5	1.7	975	
伯東	4.3	5.5	5,087	
コンドーテック	4.5	5.7	4,434	
中山福	3.6	4.5	3,505	
ナガイレーベン	9	10.4	25,812	
三菱食品	6.8	7.9	22,372	
松田産業	4.5	5.3	6,693	
第一興商	—	12.8	54,144	
メディバルホールディングス	62.2	72.1	138,504	
アドヴァン	3.2	7.3	8,614	
SPK	1.3	1.7	3,396	
萩原電気	1.7	2.5	4,397	
アズワン	4.5	5.6	23,660	
スズデン	2	2.3	2,210	
尾家産業	2	2.3	2,019	
シモジマ	3.8	5	5,160	
ドウシシャ	8.1	8.5	19,813	
小津産業	1.2	1.6	3,217	
高速	3.7	4.3	3,723	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
たけびし	2.2	2.5		2,500
黒田電気	10.8	13.4		25,058
丸文	5.5	6.4		3,808
ハビネット	3.8	6.6		5,748
橋本総業ホールディングス	1.2	1.5		2,233
エクセル	2.8	3.5		4,889
マルカキカイ	2	2.3		2,750
ガリバーインターナショナル	18.8	19.4		20,874
日本エム・ディ・エム	5.2	6		4,824
進和	3.7	4.3		6,118
エスケイジャパン	1.6	1.8		549
ダイトエレクトロン	2.9	3.3		2,098
シークス	3.9	4.6		17,158
田中商事	1.9	2.2		1,471
オーハシテクニカ	3.8	4.1		5,215
白銅	2	2.1		2,391
伊藤忠商事	520.1	566.1		781,784
丸紅	543.6	709.9		372,129
高島	12	14		2,338
長瀬産業	34.9	43.4		54,510
蝶理	4	4.6		7,005
豊田通商	69.2	80.4		208,075
三共生興	10.6	10.9		3,804
兼松	124	153		27,540
ツカモトコーポレーション	11	13		1,417
三井物産	526.8	652.3		859,079
日本紙パルプ商事	32	38		12,920
日立ハイテクノロジーズ	21.5	25		80,625
カメイ	8.1	9.4		8,563
東都水産	10	12		2,040
OUGホールディングス	10	10		2,520
スターゼン	24	2.6		9,789
山善	23.9	27.7		25,761
椿本興業	7	8		2,304
住友商事	366.7	454.1		509,954
内田洋行	15	18		8,388
三菱商事	476.2	541.3		1,048,227
第一実業	15	16		8,416
キャノンマーケティングジャパン	17.7	20.6		42,827
西華産業	20	24		6,936
佐藤商事	5.6	6.5		4,140
菱洋エレクトロ	7.2	8.3		11,254
東京産業	6.2	7.2		2,721
ユアサ商事	5.4	6.8		17,013
神鋼商事	16	16		2,896
小林産業	4.6	4.8		1,065
阪和興業	62	72		41,328
カナデン	5.4	6.9		6,065

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
菱電商事	10	11		7,161
フルサト工業	3.4	4		5,536
岩谷産業	69	86		53,922
すてきなイスグループ	27	31		5,053
昭光通商	22	26		1,950
ニチモウ	10	11		1,848
極東貿易	7	10		2,020
イワキ	9	11		2,156
三菱石油	16	17.9		13,908
稲畑産業	14.9	17.3		19,497
G S Iクレオス	17	19		2,109
明和産業	5	6.7		2,284
ワキタ	13.2	15.4		11,303
東邦ホールディングス	21.4	23.1		63,686
サンゲツ	21.7	25.2		51,634
ミツウロコグループホールディングス	10	11.6		6,310
シナネンホールディングス	13	16		6,768
伊藤忠エネクス	13.7	18.6		17,260
サンリオ	17.4	22.2		45,399
サンワテクノス	4	4.6		3,551
リョーサン	10.5	11.4		30,586
新光商事	7.3	8.5		9,086
トーホー	14	3.3		8,223
三信電気	8.6	10		8,710
東陽テクニカ	9.1	10.3		11,093
モスフードサービス	8.1	9.4		27,495
加賀電子	5.6	6.5		8,703
ソーダニッカ	6.4	7.5		3,645
立花エレテック	4.6	5.3		5,814
フォーバル	1.2	3.8		2,891
PALTA C	10	11.5		25,277
三谷産業	6.6	7.7		2,656
ヤマタネ	31	33		4,983
丸紅建材リース	5	6		1,134
日鉄住金物産	41	63		24,633
トラスコ中山	7.8	8.2		41,820
オートバックスセブン	22.9	27.6		46,561
加藤産業	9.2	11.3		31,007
イノテック	5.8	6.7		2,726
イエローハット	5.9	6.8		16,184
J Kホールディングス	6.3	7.3		3,365
日伝	2.6	3		8,811
北沢産業	5.3	6		942
杉本商事	3.4	4.2		4,758
因幡電機産業	9.2	10.1		37,925
バイテックホールディングス	2.1	3		3,087
ミスミグループ本社	23.2	81		135,999
アルテック	4.5	6.1		872

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)
タキビヨー	10	12	5,376	
蔵王産業	0.8	1.2	1,590	
ズケン	28.3	32.8	118,408	
ジェコス	4.3	5	5,510	
ルネサスイーストン	3.1	6	2,514	
<b>小売業(4.9%)</b>				
ローソン	23.5	27.3	237,237	
サンエー	4.7	4.9	24,892	
ダイユーエイト	1.4	2.4	1,648	
カワチ薬品	4.8	5.6	13,680	
エービーシー・マート	8.8	9.4	66,928	
ハードオフコーポレーション	3	3.5	4,686	
アスクル	6.5	8.8	35,992	
ゲオホールディングス	11.7	12.1	18,404	
アダストリア	5.3	13.3	48,611	
ジーフット	—	4.4	3,476	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	8	10	880	
くらコーポレーション	3.6	4.2	21,378	
キャンドウ	3	3.8	6,015	
パル	3.6	4.2	11,344	
エディオン	28.7	30.7	25,235	
サーラコーポレーション	5.4	6.2	3,335	
ワッツ	2.5	3.1	3,013	
ハローズ	—	2.4	5,392	
あみやき亭	1.1	1.4	6,139	
ひらまつ	8.6	10	7,420	
ゲンキー	0.6	1.5	5,242	
サッポロドラッグストアー	0.6	1	2,093	
大黒天物産	1.5	1.7	8,007	
ハニーズ	5.5	6.4	6,656	
ファーマライズホールディングス	1.2	2.3	1,246	
アルベン	5.5	6.5	11,121	
クオール	6.3	7.3	10,533	
ジェイアイエヌ	4.2	4.9	18,203	
ビックカメラ	30.6	41.4	41,607	
DCMホールディングス	30.1	35.6	28,373	
Monotaro	12.1	25.5	97,410	
東京一番フーズ	—	1.9	989	
ダイヤモンドダイニング	—	1.8	1,780	
きちり	1.3	2	1,292	
アーケランドサービス	0.7	2.3	7,647	
J. フロント リテイリング	78.7	91.3	116,955	
ドトール・日レスホールディングス	10.9	12.7	23,456	
マツモトキヨシホールディングス	13.9	14.9	89,400	
ブロンコビリー	1.1	3.8	11,609	
スタートトゥデイ	19.3	22	111,100	
トレジャー・ファクトリー	1.2	2.1	2,404	
物語コーポレーション	1.7	1.9	10,032	

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)
ココカラファイン	6.5	7.5	43,350	
三越伊勢丹ホールディングス	123.6	143.5	151,823	
ウエルシアホールディングス	5.3	6.2	38,626	
クリエイトSDホールディングス	2.9	10.6	28,365	
丸善CHIホールディングス	7.2	8.4	3,225	
ミサワ	0.7	1.2	618	
エー・ビーカンパニー	0.9	1.3	1,348	
チムニー	1.2	1.8	5,472	
シュッピン	—	2.7	3,118	
ネクステージ	0.6	1.4	984	
ジョイフル本田	4.5	11.7	29,331	
鳥貴族	—	1.8	4,136	
キリン堂ホールディングス	2	2.5	2,715	
ホットランド	—	2.5	2,557	
すかいらーく	30.5	22.2	28,993	
綿半ホールディングス	—	2.8	4,384	
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	23.9	25,955	
ブックオフコーポレーション	3.8	4.5	3,816	
ゴルフダイジェスト・オンライン	—	2.1	1,946	
あさひ	4.1	5.4	9,406	
日本調剤	0.8	1.9	8,835	
コスモス薬品	3.1	3.6	69,804	
トーエル	3.3	3.6	2,876	
一六堂	1.5	2.1	703	
セブン&アイ・ホールディングス	259.9	301.8	1,419,063	
薬王堂	0.9	1.4	5,782	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4.3	19.4	19,729	
ツルハホールディングス	13.3	16.6	188,410	
サンマルクホールディングス	4.5	5.7	18,553	
フェリシモ	1.6	2.1	2,160	
トリドール	6.7	8.9	25,658	
クスリのアオキ	4.9	6.4	41,216	
メディカルシステムネットワーク	5.6	8.6	4,652	
総合メディカル	3	3.5	13,247	
はるやま商事	2.6	3.3	2,468	
カッパ・クリエイト	9.7	10.1	12,473	
ライトオン	4.7	5.4	7,500	
良品計画	7.7	8.3	209,160	
三城ホールディングス	7.7	9	3,834	
アルビス	1.4	2	4,172	
コナカ	7.3	9.3	4,687	
ハウス オブ ローゼ	0.7	1	1,408	
G-7ホールディングス	1.3	2.2	2,692	
イオン北海道	4.2	5	2,560	
コジマ	9.2	11.1	2,730	
ヒマラヤ	1.6	2.4	2,431	
コーナン商事	9.8	10.5	20,139	

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)
エコス	2.4	3		4,020
マルシェ	1.5	2		1,652
ドンキホーテホールディングス	20.1	46.7	162,983	
西松屋チェーン	12.3	14.2	17,281	
ゼンショーホールディングス	32	37.1	54,240	
幸楽苑ホールディングス	4.1	4.8	7,329	
ハークスレイ	1.9	2.2	2,281	
サイゼリヤ	9.4	11.9	23,847	
V Tホールディングス	—	24.4	12,614	
魚力	1.7	2.3	2,996	
ポプラ	1.5	1.8	873	
ユナイテッドアローズ	8.1	10.3	32,908	
ハイデイ日高	4.7	6.6	17,490	
京都きもの友禅	3.7	5	4,265	
コロワイド	20.8	24.1	46,151	
ピーシーデポコーポレーション	—	8	12,160	
壺番屋	2.8	6.6	23,100	
トップカルチャー	2.8	3.3	1,521	
P L A N T	1.4	1.8	2,176	
スギホールディングス	11.1	12.9	73,272	
スクロール	8.1	11	5,280	
ヨンドシーホールディングス	4.7	5.5	13,909	
ファミリーマート	21	22.2	128,538	
木曽路	7.6	8.8	19,949	
サトレストラシスシステムズ	5.9	8.7	7,029	
千趣会	11.2	14.3	11,268	
タカキュー	4.4	6.4	1,158	
ケーヨー	12.1	12.2	6,527	
上新電機	14	17	15,657	
日本瓦斯	10	11	27,467	
ベスト電器	20	23.2	2,575	
ロイヤルホールディングス	10.4	12	25,320	
東天紅	5	—	—	
いなげや	7	8	11,752	
島忠	16.1	18.7	46,245	
チヨダ	7.3	8.5	22,049	
ライフコーポレーション	4	4.8	15,864	
リンガーハット	6	6.5	15,899	
M r M a x	7	7.6	2,272	
テンアライド	5.2	6.6	2,461	
A O K Iホールディングス	14.3	16.5	19,239	
オークワ	10	12	14,472	
コメリ	10.6	11.1	31,091	
青山商事	15.6	13.8	54,096	
しまむら	7.2	8.4	121,800	
C F Sコーポレーション	4.2	—	—	
はせがわ	2.2	3.9	1,606	
高島屋	90	105	80,745	

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)
松屋	12.6	15.3		12,928
エイチ・ツー・オー リテイリング	29.4	37		60,865
近鉄百貨店	24	28		9,884
ニッセンホールディングス	13.1	—		—
パルコ	6	7		6,342
丸井グループ	65.5	88.6		143,975
アクシアル リテイリング	4.8	5.6		21,420
イオン	256.4	296.8		495,359
ユニーグループ・ホールディングス	60	69.5		55,600
イズミ	13.9	14.4		60,696
東武ストア	8	9		2,664
平和堂	12.6	14.6		34,120
フジ	7	8.3		21,106
ヤオコー	7.1	8.2		39,934
ゼビオホールディングス	8.4	9.8		15,611
ケーズホールディングス	14.3	30.4		52,196
O l y m p i c グループ	3.8	4.6		2,502
日産東京販売ホールディングス	10.5	12.8		3,020
アインホールディングス	7.5	8.7		61,161
元気寿司	1.9	2.1		4,603
ヤマダ電機	245.9	219.5		111,286
アークランドサカモト	4.5	12.2		14,664
ニトリホールディングス	26.8	31.2		349,752
グルメ杵屋	5	5		4,935
愛眼	4.9	5.7		1,202
ケーユーホールディングス	3.3	3.8		2,774
吉野家ホールディングス	17.6	26.7		38,421
松屋フーズ	3	3.5		9,642
サガミチェーン	8	9.7		11,804
関西スーパーマーケット	4.9	6.1		6,453
王将フードサービス	4.6	5.3		19,769
ブレナス	6.9	8.1		15,519
ミニストップ	4.6	5.3		9,359
アークス	10.8	13.5		35,302
パローホールディングス	13.4	15.6		46,519
藤久	0.5	0.7		1,208
ベルク	2.8	3.6		15,642
大庄	2.9	4		6,032
ファーストリテイリング	12.4	12		352,620
サンドラッグ	13.1	15.2		139,384
サックスパー ホールディングス	4.7	6.8		8,935
ヤマザワ	1.3	1.6		2,716
やまや	1.1	1.5		2,923
ベルーナ	15.5	18		11,016
<b>銀行業(7.6%)</b>				
島根銀行	1.3	1.5		1,866
じもとホールディングス	44.6	51.8		7,821
足利ホールディングス	39.1	52.9		18,144

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	評 価 (千円)
東京TYフィナンシャルグループ	8	9.9	27,205	
九州フィナンシャルグループ	—	110.4	62,044	
ゆうちょ銀行	—	184.8	244,675	
富山第一銀行	—	18.3	9,644	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	—	502.5	256,727	
新生銀行	591	624	109,824	
あおぞら銀行	419	456	171,456	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,985.8	5,787.9	3,160,193	
りそなホールディングス	727	843.9	354,269	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,373	1,506	579,659	
三井住友フィナンシャルグループ	469.9	577.6	2,038,350	
第四銀行	79	91	34,216	
北越銀行	67	78	14,664	
西日本シティ銀行	218	235	47,940	
千葉銀行	240	278	159,850	
横浜銀行	417	—	—	
常陽銀行	225	261	105,444	
群馬銀行	147	160	68,640	
武蔵野銀行	9.9	11.5	31,728	
千葉興業銀行	12.9	19.8	8,830	
筑波銀行	25.8	30	9,030	
七十七銀行	105	113	43,618	
青森銀行	49	53	16,430	
秋田銀行	41	47	14,899	
山形銀行	37	41	16,974	
岩手銀行	4.3	5	21,275	
東邦銀行	56	64	23,040	
東北銀行	33	37	5,402	
みちのく銀行	31	36	6,732	
ふくおかフィナンシャルグループ	252	312	121,992	
静岡銀行	182	211	172,809	
十六銀行	78	90	27,360	
スルガ銀行	65.6	68.5	166,112	
八十二銀行	112	130.5	64,206	
山梨中央銀行	38	45	17,280	
大垣共立銀行	78	96	31,008	
福井銀行	53	62	13,206	
北國銀行	69	80	25,280	
清水銀行	2.1	2.5	6,255	
富山銀行	—	1.4	5,110	
滋賀銀行	62	68	32,232	
南都銀行	60	70	23,520	
百五銀行	60	65	26,455	
京都銀行	119	138	98,118	
紀陽銀行	24.4	28.3	40,921	
三重銀行	28	32	6,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	423	491	64,321	
広島銀行	183	213	85,839	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	評 価 (千円)
山陰合同銀行	38	43.4	31,378	
中国銀行	44	51.1	63,875	
鳥取銀行	20	23	3,979	
伊予銀行	66.5	77.2	57,128	
百十四銀行	68	79	25,912	
四国銀行	48	56	11,760	
阿波銀行	51	59	36,344	
鹿児島銀行	43	—	—	
大分銀行	38	41	13,448	
宮崎銀行	41	48	13,632	
肥後銀行	51	—	—	
佐賀銀行	38	44	10,428	
十八銀行	38	44	11,748	
沖縄銀行	4.9	5.7	21,631	
琉球銀行	12.8	14.9	17,924	
セブン銀行	209.5	270.3	110,282	
みずほフィナンシャルグループ	8,664.1	10,224.9	1,759,705	
高知銀行	24	28	2,912	
山口フィナンシャルグループ	62	67	73,968	
長野銀行	20	24	4,704	
名古屋銀行	56	60	21,360	
北洋銀行	93.6	108.7	33,805	
愛知銀行	2.2	2.4	12,096	
第三銀行	35	41	6,765	
中京銀行	26	30	7,260	
東日本銀行	27	—	—	
大光銀行	22	26	4,966	
愛媛銀行	37	42	9,870	
トマト銀行	24	28	4,088	
みなと銀行	56	65	11,570	
京葉銀行	51	59	24,308	
関西アーバン銀行	8.7	10	10,250	
栃木銀行	31	39	15,951	
北日本銀行	1.9	2.2	5,704	
東和銀行	87	135	12,015	
福島銀行	76	89	7,832	
大東銀行	4.0	43	7,568	
トモニホールディングス	47.7	55.3	18,802	
フィデアホールディングス	36.6	58.8	9,114	
池田泉州ホールディングス	59.2	76.5	32,053	
<b>証券、商品先物取引業 (1.0%)</b>				
F P G	16.5	26.2	31,073	
S B I ホールディングス	74.7	86.8	99,993	
ジャフコ	8.6	12.2	39,894	
大和証券グループ本社	582	675	433,687	
野村ホールディングス	1,271	1,388	659,438	
岡三証券グループ	53	61	34,709	
丸三証券	19.8	21.4	21,571	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	評 価 (千円)
東洋証券	24	28	6,468	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	71.3	82.8	45,043	
光世証券	15	19	2,489	
水戸証券	20	22.4	6,227	
いちよし証券	13.1	16.2	14,515	
松井証券	31.6	36.2	36,200	
だいがく証券ビジネス	3.3	3.6	2,660	
マネックスグループ	73.2	84.4	23,800	
カブドットコム証券	27.6	63.6	23,468	
極東証券	8.5	9.7	12,348	
岩井コスモホールディングス	6.4	6.8	7,010	
藍澤証券	8.7	13.5	8,356	
マネースクウェアHD	2.1	2.7	2,594	
マネーパートナーズグループ	6.9	7.2	5,212	
<b>保険業 (2.3%)</b>				
かんぽ生命保険	—	29.4	71,383	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	138	160.2	497,741	
アニコム ホールディングス	2.7	4.9	13,813	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	198.1	215.6	675,259	
ソニーフィナンシャルホールディングス	59.5	69.1	92,041	
第一生命保険	398.1	462.2	660,252	
東京海上ホールディングス	251.8	292.3	1,122,432	
T&Dホールディングス	226.5	262.9	287,612	
<b>その他金融業 (1.3%)</b>				
全国保証	16.2	18.8	67,680	
クレディセゾン	50.8	54.7	114,651	
アクリーティブ	4.2	5.9	2,643	
芙蓉総合リース	6.5	8.2	38,622	
興銀リース	11.7	13.6	27,036	
東京センチュリーリース	14.6	16.9	64,051	
日本証券金融	27.4	31.8	14,882	
アイフル	104	120.8	45,300	
ポケットカード	4.7	7.2	3,924	
リコーリース	4.9	5.7	17,328	
イオンフィナンシャルサービス	40.8	47.3	114,560	
アコム	124.8	144.9	88,389	
ジャックス	34	40	20,520	
オリエントコーポレーション	143.6	311.9	70,801	
日立キャピタル	12.2	17	41,684	
アプラスフィナンシャル	29.8	34.6	3,667	
オリックス	439.9	510.8	773,606	
三菱UFJリース	157.6	183	84,546	
日本取引所グループ	91.2	211.8	317,488	
イー・ギャランティ	1.8	2.3	6,060	
アサックス	1.1	1.2	1,611	
NECキャピタルソリューション	2.5	2.9	4,408	
<b>不動産業 (2.8%)</b>				
いちごグループホールディングス	—	79.9	36,754	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	評 価 (千円)
日本駐車場開発	67.7	87	11,484	
ヒューリック	115.4	150.4	163,635	
東京建物不動産販売	3.3	—	—	
三栄建築設計	2.5	2.9	3,584	
野村不動産ホールディングス	37.4	47.9	94,075	
三重交通グループホールディングス	11.1	12.9	5,572	
サムティ	—	5.2	5,631	
ディア・ライフ	—	5	1,870	
エー・ディー・ワークス	—	66.8	2,805	
日本商業開発	2	3.2	5,632	
プレサンスコーポレーション	2.1	2.5	9,912	
ユニゾホールディングス	3.4	4.5	24,300	
日本管理センター	3.1	4.7	7,844	
サンセイラディック	0.8	1.7	1,553	
エストラスト	0.7	1.3	703	
フージャースホールディングス	9.3	10.1	6,645	
オープンハウス	4	10.4	30,368	
東急不動産ホールディングス	162.9	174.6	126,759	
飯田グループホールディングス	40.3	66.8	158,182	
ムゲンエステート	—	1.1	2,489	
パーク24	31.3	36.4	114,660	
パラカ	2.2	2.5	4,022	
三井不動産	329	383	1,023,950	
三菱地所	462	536	1,139,000	
平和不動産	11.8	13.7	18,549	
東京建物	135	78.8	109,374	
ダイビル	16	18.6	18,860	
京阪神ビルディング	10.3	12	7,020	
住友不動産	149	173	534,224	
大京	99	134	22,378	
テーオーシー	21.4	28	26,908	
東京楽天地	10	12	5,748	
レオパレス21	68	85	58,820	
スターツコーポレーション	7.1	8.3	19,662	
フジ住宅	8	9.2	6,660	
空港施設	7.6	8.8	4,523	
明和地所	3.6	4	2,352	
住友不動産販売	4.5	5.2	11,336	
ゴールドクレスト	5.6	5.7	10,630	
日本エスリード	2.4	2.8	2,987	
日神不動産	8.3	9.7	3,715	
タカラレーベン	27.6	31.5	23,845	
サンヨーハウジング名古屋	3.5	4.1	3,936	
イオンモール	40.1	46.6	68,408	
ファースト住建	2.3	2.7	3,512	
トーセイ	8.5	11	8,624	
穴吹興産	6	8	2,096	
エス・ティ・ティ都市開発	38.6	44.8	49,817	

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
サンフロンティア不動産	6.7	8.8	10,560
エフ・ジェー・ネクスト	4.8	6.4	3,302
ランドビジネス	3.2	4.9	1,298
グランディハウス	5.5	6.4	2,156
日本空港ビルデング	21.5	23	86,480
<b>サービス業(3.9%)</b>			
日本工営	22	26	9,620
ネクスト	15.8	21.6	24,840
ジェイエイシーリクルートメント	—	4.7	8,018
日本M&Aセンター	10.2	11.8	79,060
ノバレーゼ	1.9	2.4	2,004
アコーディア・ゴルフ	24.9	21.4	21,828
中広	—	1.3	837
タケエイ	6.5	7.2	7,891
トラスト・テック	1.2	3.1	4,628
パソナグループ	5.1	7.1	5,140
CDS	1.5	2	1,740
リンクアンドモチベーション	9.8	17.2	2,717
GCAサヴィアン	5.2	7	7,322
エス・エム・エス	7.4	9.5	21,840
テンプホールディングス	13	53.5	95,390
リニカル	1.8	4.6	10,193
クックパッド	4.2	17	24,871
エスクリ	2.6	4.4	2,556
アイ・ケイ・ケイ	3.8	4.5	2,794
学情	2.6	2.9	3,053
スタジオアリス	3.1	3.5	9,506
シミックホールディングス	2.7	4.1	6,863
NJS	1.5	1.6	1,912
総合警備保障	22	25.5	138,720
カカコム	43.4	54.8	114,970
アイロムグループ	1.7	2.2	2,593
ルネサンス	3.5	4.3	5,108
ディップ	1.5	8.5	25,627
オプトホールディング	3.1	4.9	3,753
ツクイ	8.2	9.4	14,400
総合臨床ホールディングス	3.1	—	—
キャリアデザインセンター	1.9	2.3	2,286
エムスリー	56.9	66.1	213,172
ツカダ・グローバルホールディング	5.1	6.2	4,575
アウトソーシング	2.6	3.6	16,164
ウェルネット	1.8	2.9	12,542
ディー・エヌ・エー	32.5	34.2	77,155
博報堂DYホールディングス	91.2	105.8	147,379
ぐるなび	7.6	8.8	25,256
エスアールジータカミヤ	5.7	8.9	3,996
一休	5.2	—	—
ファンコミュニケーションズ	15.2	17.7	13,912

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
ジェイコムホールディングス	1.6	2.1	5,271
PGMホールディングス	9.5	—	—
WDBホールディングス	2.4	2.8	2,601
ティア	2.1	4	2,692
バリューコマース	5.6	7.6	2,903
インフォマート	—	14.8	14,992
J Pホールディングス	17	19.9	6,945
E P Sホールディングス	6.1	9.5	13,670
レッグス	—	1.5	1,084
プレステージ・インターナショナル	5.1	6.4	9,644
アミューズ	2	4.2	10,046
ドリームインキュベータ	2.3	2.6	6,055
クイック	2.4	4	3,088
TAC	4.6	8.3	1,767
ケネディクス	94	102.7	43,442
電通	73.3	85.1	468,901
テイクアンドギヴ・ニーズ	2.9	5	2,385
びあ	1.9	2.3	4,940
イオンファンタジー	2.2	2.7	7,576
シーティーエス	—	2.7	2,097
ネクシーズグループ	2.5	3.1	6,807
みらかホールディングス	16.8	19.5	91,942
アルプス技研	2.7	2.8	6,406
ダイオーズ	1.4	1.4	1,313
日本空調サービス	3.3	7.4	3,796
オリエンタルランド	71.1	82.5	601,837
ダスキン	18.6	19.6	38,494
明光ネットワークジャパン	6.7	9.5	12,122
ファルコホールディングス	3.2	3.5	4,634
秀英予備校	1.3	—	—
田谷	1.1	—	—
ラウンドワン	18.9	24	17,760
リゾートトラスト	24.9	32.1	74,183
ビー・エム・エル	3.9	4.5	23,625
ワタベウエディング	2.4	3.3	1,442
りらいあコミュニケーションズ	12.2	12.6	14,061
リソー教育	—	14.7	5,865
早稲田アカデミー	1	1.4	1,171
ユー・エス・エス	79.6	92.4	162,439
東京個別指導学院	3.3	3.8	2,565
サイバーエージェント	16.1	20.1	104,520
楽天	286	357.2	415,423
デー・オー・ダブリュー	2	6.2	4,023
セントラルスポーツ	2.3	2.8	6,683
フルキャストホールディングス	6.8	7.2	6,098
リゾートソリューション	8	10	3,040
テクノプロ・ホールディングス	9.4	12.4	39,370
インターワークス	—	1.4	1,650



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)
Keepertech	—	0.9	1,523	
ファーストロジック	—	0.5	1,226	
リブセンス	4	6	3,030	
ジャパンマテリアル	2.8	3.2	10,384	
ベクトル	1.1	2.4	7,608	
ウチヤマホールディングス	3.3	4.9	2,391	
サクセスホールディングス	0.9	1.3	1,726	
キャリアリンク	0.9	2.4	2,052	
I B J	—	6.1	3,464	
アサンテ	1.7	2.8	3,880	
N・フィールド	1.7	3.7	5,968	
M&Aキャピタルパートナーズ	0.2	1	2,143	
ライドオン・エクスプレス	—	1.8	2,586	
ER Iホールディングス	1.7	2.3	1,975	
アビスト	0.8	1.2	2,732	
ウィルグループ	0.7	2.1	2,503	
日本ビューホテル	—	1.3	2,025	
リクルートホールディングス	99.5	154	577,500	
エラン	—	1.1	1,492	
日本郵政	—	224.5	319,014	
ベルシステム24ホールディングス	—	15.3	14,152	
リロ・ホールディング	2.2	2.9	43,964	
東祥	1.5	2.3	9,913	
エイチ・アイ・エス	10.8	12.5	36,625	
ラックランド	—	1.2	2,094	
共立メンテナンス	3.9	5.7	48,792	
イチネンホールディングス	7.2	8.7	9,135	
建設技術研究所	4	4.5	4,135	
スペース	3.6	4.1	5,293	
燦ホールディングス	1.3	1.7	2,349	
スバル興業	5	6	2,244	
東京テアトル	25	29	3,393	
ナガワ	—	1.4	4,921	
よみうりランド	14	16	7,344	
東京都競馬	45	52	11,648	
カナモト	9.2	10.7	26,803	
東京ドーム	46	62	29,388	
西尾レントオール	5.3	6.2	15,227	
トランス・コスモス	8.6	8.9	28,391	
乃村工藝社	12.9	16.3	27,253	
藤田観光	24	29	15,312	
KN T-C Tホールディングス	32	37	6,142	
日本管財	3.2	6.6	10,296	
トーカイ	2.9	3.4	11,084	
白洋舎	8	10	2,530	
セコム	63.8	79.4	688,239	
セントラル警備保障	3	3.4	7,595	
丹青社	7.8	14.3	13,299	

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)
メイテック	8.8	9.5	36,860	
アサツー ディ・ケイ	12.4	13.4	36,876	
応用地質	6.9	7.9	9,211	
船井総研ホールディングス	7.2	10.6	16,218	
進学会	2.9	3.7	1,961	
オオバ	—	5.7	2,496	
学究社	—	1.4	1,645	
ベネッセホールディングス	24	25.6	62,643	
イオンディライト	6.4	7.4	23,680	
ナック	4.6	5.1	4,778	
ニチイ学館	13	13.9	10,035	
ダイセキ	10.6	14.4	30,225	
ステップ	2.3	2.7	2,891	
合 計	株 数・金 額	104,665	120,967	147,897,985
	銘柄数<比率>	1,837	1,905	<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	2,827	—

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	147,897,985	97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,669,481	2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	151,567,466	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 2016年5月30日現在
(A) 資 産	151,557,481,183円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,088,665,023
株 式(評価額)	147,897,985,080
未 収 入 金	56,183,620
未 収 配 当 金	1,397,883,460
差 入 委 託 証 拠 金	116,764,000
(B) 負 債	554,919,833
未 払 金	514,726,890
未 払 解 約 金	40,132,872
未 払 利 息	5,180
そ の 他 未 払 費 用	54,891
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	151,002,561,350
元 本	128,457,920,792
次 期 繰 越 損 益 金	22,544,640,558
(D) 受 益 権 総 口 数	128,457,920,792口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,755円

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2015年5月30日 至 2016年5月30日
(A) 配 当 等 収 益	2,945,695,089円
受 取 配 当 金	2,942,898,802
受 取 利 息	842,741
そ の 他 収 益 金	2,087,634
支 払 利 息	△134,088
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△28,053,364,848
売 買 益	5,590,264,508
売 買 損	△33,643,629,356
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△233,472,260
取 引 益	609,039,020
取 引 損	△842,511,280
(D) そ の 他 費 用	△54,891
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△25,341,196,910
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	45,888,142,602
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	7,258,927,500
(H) 解 約 差 損 益 金	△5,261,232,634
(I) 計 (E+F+G+H)	22,544,640,558
次 期 繰 越 損 益 金(I)	22,544,640,558

(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。

## 〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は111,550,527,745円、期中追加設定元本額は34,424,705,801円、期中一部解約元本額は17,517,312,754円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DCマイセレクション50	17,448,179,222円
日本株式インデックス・オープン	16,817,570,112円
DCマイセレクション75	15,530,618,733円
SMT TOP1Xインデックス・オープン	8,339,352,553円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	7,079,283,364円
DCマイセレクションS50	6,703,362,930円
DCマイセレクション25	5,647,373,346円
DC日本株式インデックス・オープン	4,831,896,827円
DCマイセレクションS75	4,151,162,817円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,066,936,993円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,765,847,635円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,642,752,973円
DC日本株式インデックス・オープンS	3,523,683,135円
FOFs用国内株式インデックスファンドP(適格機関投資家専用)	3,140,844,026円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,692,763,829円
DCマイセレクションS25	2,442,504,510円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,856,958,024円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,449,766,917円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,285,212,286円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,148,750,036円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,141,720,564円
DC世界経済インデックスファンド	1,117,380,063円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	1,097,542,423円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	1,083,231,845円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,045,179,290円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	976,309,928円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	850,050,970円
世界経済インデックスファンド	837,448,369円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	798,715,137円
日本株式ファンド・シリーズ2	678,770,861円
DCターゲット・イヤーファンド2035	584,001,369円
DCターゲット・イヤーファンド2025	514,306,720円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	387,008,344円
DCターゲット・イヤーファンド2045	307,097,543円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	296,483,987円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	196,733,513円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	176,866,191円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	133,444,558円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	93,240,412円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	92,071,996円
SMTインデックスバランス・オープン	79,815,193円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	76,145,525円
マイセレクション50	74,721,716円
マイセレクション75	70,711,268円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	64,209,570円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	45,800,081円
SBI資産設計オープン(分配型)	30,635,592円
マイセレクション25	27,822,757円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	12,520,792円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	3,113,947円

## お知らせ

---

該当事項はありません。

# 外国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第16期（決算日 2016年5月30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
	期騰落率	期中騰落率	期騰落率	期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
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
第16期(2016年5月30日)	26,579	△7.7	436,679	△8.5	97.9	212,962

(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
	騰落率	期中騰落率	騰落率	期中騰落率	
(当期首) 2015年 5月29日	円	%		%	%
	28,802	—	477,014	—	98.2
6月末	28,389	△1.4	468,925	△1.7	97.9
7月末	28,753	△0.2	475,956	△0.2	98.0
8月末	28,302	△1.7	467,181	△2.1	98.0
9月末	28,230	△2.0	465,877	△2.3	97.9
10月末	28,244	△1.9	467,317	△2.0	97.8
11月末	28,226	△2.0	467,104	△2.1	98.3
12月末	27,833	△3.4	459,321	△3.7	98.5
2016年 1月末	28,268	△1.9	459,284	△3.7	98.2
2月末	26,822	△6.9	444,836	△6.7	98.5
3月末	27,314	△5.2	451,281	△5.4	98.0
4月末	26,436	△8.2	443,058	△7.1	97.6
(当期末) 2016年 5月30日	26,579	△7.7	436,679	△8.5	97.9

(注1)騰落率は期首比です。

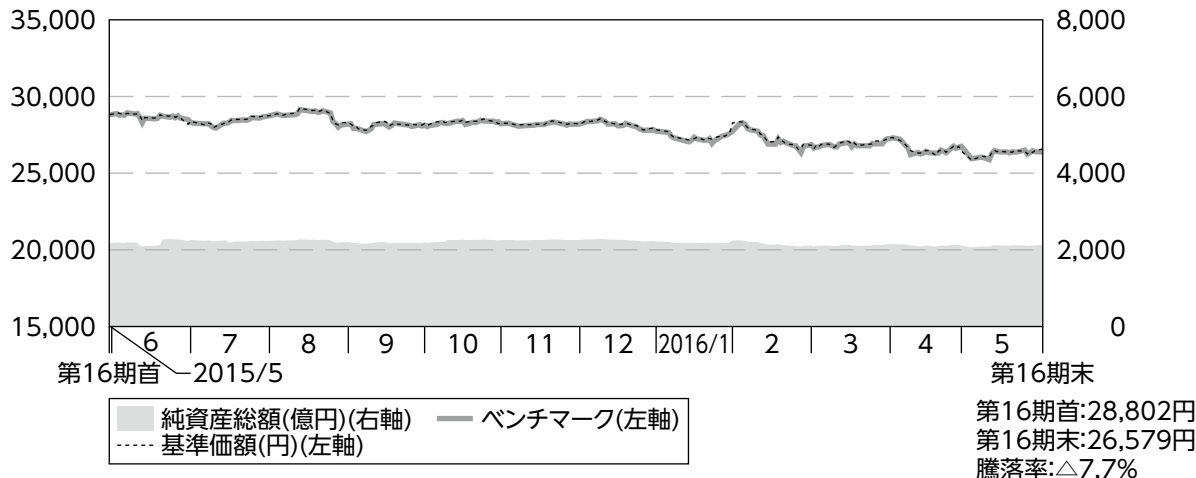
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

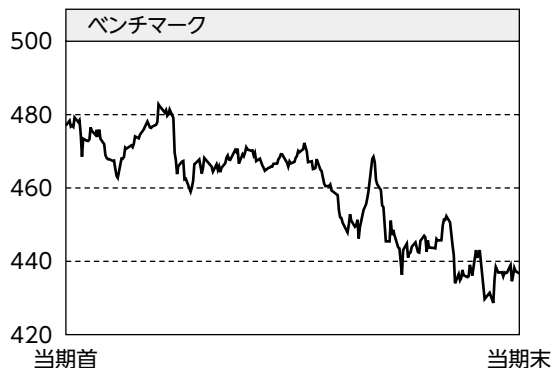


(注)ベンチマークは、2015年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

基準価額は、2015年7月上旬にかけてギリシャの債務問題を背景に乱高下しましたが、その後8月中旬までは、ギリシャに対する新たな金融支援合意への期待などから外国為替市場で円安推移となったことから上昇しました。8月中旬に世界的な株値急落を受けて円高となったことから一旦下落した後、12月上旬にかけて為替が安定的に推移する中、債券市場でも米国の利上げ観測が金利上昇(債券価格下落)要因となった一方で世界経済の減速懸念が金利低下(債券価格上昇)要因となったことから、基準価額はもみ合い推移となりました。12月上旬からは、世界経済の先行き不透明感の強まりを背景に金利が低下基調で推移したものの、外国為替市場ではリスク回避から円高が進み、基準価額は下落基調となりました。2016年1月末に日銀がマイナス金利政策の導入を決定すると急激な円安となったことから、基準価額は一旦上昇しましたが、その後は米国の利上げペースは緩やかになるという見方を受けて再度円高基調となったことから、下落が続き、期末の基準価額は期首から下落しました。

## 投資環境



主要国の長期金利は、米国の利上げ観測の強まりを受けて上昇圧力が強まる局面もありましたが、期を通じては世界経済の先行き不透明感の強まりやリスク回避の動きから、低下基調で推移しました。

外国為替市場では、2015年12月にかけて株価動向や金融政策の見通し変化などから上下動はあったものの、概ねレンジ内での推移となりました。12月後半以降期末にかけては、2016年1月末に日銀がマイナス金利政策の導入を決定すると急激な円安となる場面もありましたが、原油安や株安を受けて米国の利上げペースは緩やかになるという見方やリスク回避姿勢が強まったことから、概ね円高基調推移となりました。

## 当ファンドのポートフォリオ

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。当期末時点で全てのベンチマーク対象国に分散投資を図りました。



## 当ファンドの組入資産の内容

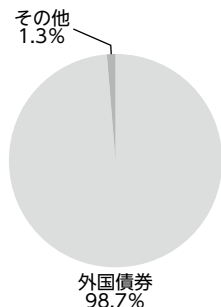
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	T 2.125% 05/15/25	アメリカ	0.7%
2	T 2% 08/15/25	アメリカ	0.7%
3	T 1.5% 12/31/18	アメリカ	0.6%
4	T 0.875% 04/30/17	アメリカ	0.6%
5	T 2.875% 05/15/43	アメリカ	0.6%
6	T 1.375% 04/30/20	アメリカ	0.5%

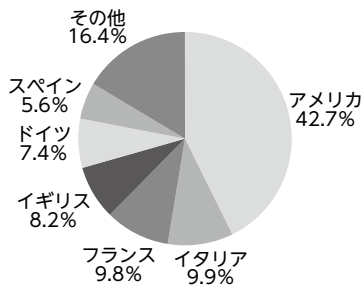
順位	銘柄名	国	組入比率
7	T 1.25% 03/31/21	アメリカ	0.5%
8	T 0.625% 04/30/18	アメリカ	0.5%
9	T 2.75% 12/31/17	アメリカ	0.5%
10	T 1% 06/30/19	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		646	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

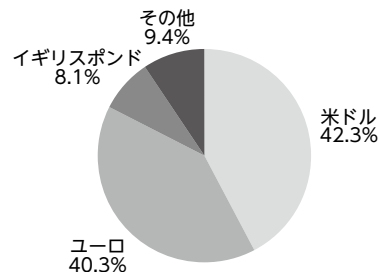
### ○資産別配分



### ○国別配分



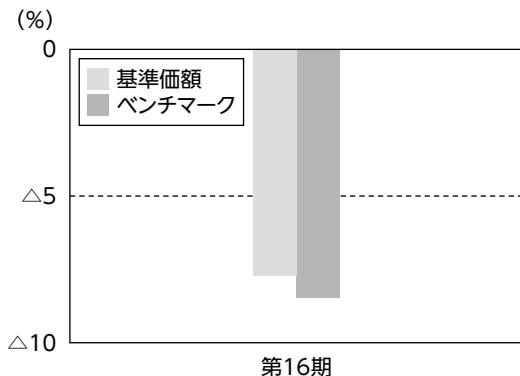
### ○通貨別配分



(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要因です。

## 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
	(2015年5月30日~2016年5月30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)	0.025 (0.025) (-) (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、金銭信託預入に係る手数料等
合計	7	0.026	

(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(27,968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	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 307,415	千米ドル 239,802
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 21,141	千カナダドル 19,986
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 109,116	千メキシコペソ 67,834
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 35,002	千ユーロ 30,809
	イ タ リ ア	国 債 証 券	43,581	32,049
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	41,404	26,295
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	10,066	10,043
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	26,900	18,714
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	9,519	6,250
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	5,411	4,299
国	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	2,271	1,172
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	2,385	926
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 21,784	千イギリスポンド 15,297
	ス イ ス	国 債 証 券	千スイスフラン 707	千スイスフラン 254
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 18,830	千スウェーデンクローナ 13,901
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 12,621	千ノルウェークローネ 1,496
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 16,865	千デンマーククローネ 13,822
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 15,720	千ポーランドズロチ 9,493
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 15,984	千オーストラリアドル 8,909
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 2,085	千シンガポールドル 1,560
マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 10,665	千マレーシアリンギット 8,886	
南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカランド 34,877	千南アフリカランド 13,581	

(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 23,481	百万円 23,065	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 32,603	百万円 75	% 0.2	百万円 20,405	百万円 715	% 3.5
金 銭 信 託	104,219	104,219	100.0	104,002	104,002	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	494,817	26,130	5.3	500,157	26,130	5.2

(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。

※ 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 775,890	千米ドル 806,630	千円 89,318,217	% 41.9	% —	% 17.1	% 15.9	% 9.0
カ ナ ダ	千カナダドル 45,180	千カナダドル 51,110	4,329,577	2.0	—	1.0	0.6	0.5
メ キ シ コ	千メキシコペソ 293,200	千メキシコペソ 323,263	1,939,582	0.9	—	0.6	0.2	0.1
ド イ ツ	千ユーロ 102,730	千ユーロ 125,484	15,422,072	7.2	—	4.3	2.0	0.9
イ タ リ ア	139,930	168,111	20,660,870	9.7	—	6.1	2.6	1.0
フ ラ ン ス	136,210	166,271	20,434,725	9.6	—	6.0	2.6	1.0
オ ラ ン ダ	33,510	40,505	4,978,112	2.3	—	1.5	0.7	0.2
ス ペ イ ン	78,760	93,438	11,483,626	5.4	—	3.0	1.6	0.7
ベルギー	34,960	43,912	5,396,826	2.5	—	1.9	0.4	0.3
オーストリア	21,290	26,229	3,223,637	1.5	—	1.0	0.3	0.2
フィンランド	9,130	10,429	1,281,761	0.6	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	11,780	13,785	1,694,272	0.8	—	0.4	0.3	0.1
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 85,790	千イギリスポンド 105,168	17,015,175	8.0	—	5.7	1.8	0.5
ス イ ス	千スイスフラン 4,460	千スイスフラン 5,294	589,379	0.3	—	0.1	0.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 67,620	千スウェーデンクローナ 78,201	1,035,390	0.5	—	0.3	0.2	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 44,290	千ノルウェークローネ 48,130	637,725	0.3	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 65,880	千デンマーククローネ 85,797	1,418,236	0.7	—	0.5	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 40,830	千ポーランドズロチ 43,579	1,221,086	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 42,060	千オーストラリアドル 46,973	3,733,914	1.8	—	1.0	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 8,820	千シンガポールドル 9,317	747,280	0.4	—	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 35,540	千マレーシアリンギット 35,833	969,646	0.5	—	0.3	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 137,590	千南アフリカランド 123,054	866,304	0.4	—	0.3	0.1	0.0
合 計	—	—	208,397,422	97.9	—	51.9	30.8	15.2

(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 (%)	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)	
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル		
国債証券					
T 0.5% 07/31/17	0.5	2,000	1,993	220,767	2017/7/31
T 0.625% 04/30/18	0.625	10,000	9,947	1,101,525	2018/4/30
T 0.625% 08/31/17	0.625	7,000	6,985	773,490	2017/8/31
T 0.625% 09/30/17	0.625	1,000	997	110,468	2017/9/30
T 0.625% 11/30/17	0.625	5,000	4,984	551,887	2017/11/30
T 0.75% 02/28/18	0.75	4,400	4,390	486,117	2018/2/28
T 0.75% 04/15/18	0.75	3,000	2,991	331,249	2018/4/15
T 0.75% 06/30/17	0.75	6,000	6,000	664,457	2017/6/30
T 0.75% 12/31/17	0.75	2,900	2,895	320,608	2017/12/31
T 0.875% 01/15/18	0.875	5,200	5,200	575,885	2018/1/15
T 0.875% 01/31/18	0.875	5,500	5,500	609,062	2018/1/31
T 0.875% 04/30/17	0.875	11,600	11,620	1,286,700	2017/4/30
T 0.875% 07/15/17	0.875	4,000	4,005	443,508	2017/7/15
T 0.875% 07/31/19	0.875	5,500	5,464	605,054	2019/7/31
T 0.875% 08/15/17	0.875	8,800	8,809	975,508	2017/8/15
T 0.875% 10/15/17	0.875	6,200	6,204	687,022	2017/10/15
T 0.875% 10/15/18	0.875	4,000	3,990	441,899	2018/10/15
T 0.875% 11/15/17	0.875	1,500	1,500	166,185	2017/11/15
T 1% 03/15/18	1.0	2,800	2,804	310,595	2018/3/15
T 1% 05/15/18	1.0	5,550	5,559	615,559	2018/5/15
T 1% 05/31/18	1.0	5,000	5,008	554,558	2018/5/31
T 1% 06/30/19	1.0	9,000	8,982	994,584	2019/6/30
T 1% 09/15/18	1.0	5,200	5,204	576,268	2018/9/15
T 1% 09/30/19	1.0	4,000	3,984	441,250	2019/9/30
T 1% 11/30/19	1.0	6,300	6,267	693,974	2019/11/30
T 1.125% 04/30/20	1.125	2,000	1,990	220,456	2020/4/30
T 1.125% 06/15/18	1.125	3,000	3,011	333,513	2018/6/15
T 1.125% 12/31/19	1.125	3,050	3,044	337,066	2019/12/31
T 1.25% 01/31/19	1.25	900	905	100,289	2019/1/31
T 1.25% 01/31/20	1.25	8,520	8,533	944,967	2020/1/31
T 1.25% 02/29/20	1.25	3,400	3,405	377,048	2020/2/29
T 1.25% 03/31/21	1.25	10,000	9,934	1,100,033	2021/3/31
T 1.25% 10/31/18	1.25	6,500	6,541	724,383	2018/10/31
T 1.25% 10/31/19	1.25	5,500	5,522	611,453	2019/10/31
T 1.25% 11/30/18	1.25	6,550	6,591	729,871	2018/11/30
T 1.375% 01/31/20	1.375	5,000	5,031	557,175	2020/1/31
T 1.375% 01/31/21	1.375	4,800	4,798	531,389	2021/1/31
T 1.375% 02/28/19	1.375	2,100	2,120	234,758	2019/2/28
T 1.375% 03/31/20	1.375	4,880	4,904	543,116	2020/3/31
T 1.375% 04/30/20	1.375	10,000	10,045	1,112,295	2020/4/30
T 1.375% 05/31/20	1.375	1,550	1,556	172,362	2020/5/31
T 1.375% 06/30/18	1.375	2,200	2,220	245,851	2018/6/30
T 1.375% 09/30/18	1.375	3,900	3,937	435,971	2018/9/30
T 1.375% 09/30/20	1.375	4,000	4,006	443,620	2020/9/30
T 1.375% 10/31/20	1.375	6,000	6,006	665,106	2020/10/31
T 1.375% 12/31/18	1.375	3,000	3,028	335,369	2018/12/31
T 1.5% 01/31/19	1.5	2,000	2,025	224,306	2019/1/31
T 1.5% 01/31/22	1.5	4,500	4,495	497,769	2022/1/31
T 1.5% 02/28/19	1.5	2,000	2,026	224,353	2019/2/28
T 1.5% 02/28/23	1.5	2,400	2,376	263,193	2023/2/28
T 1.5% 03/31/19	1.5	4,400	4,459	493,777	2019/3/31
T 1.5% 03/31/23	1.5	4,000	3,958	438,300	2023/3/31
T 1.5% 05/31/19	1.5	8,000	8,104	897,414	2019/5/31
T 1.5% 08/31/18	1.5	5,800	5,871	650,149	2018/8/31
T 1.5% 10/31/19	1.5	3,550	3,592	397,797	2019/10/31
T 1.5% 11/30/19	1.5	5,000	5,057	560,029	2019/11/30
T 1.5% 12/31/18	1.5	11,500	11,648	1,289,784	2018/12/31
T 1.625% 02/15/26	1.625	3,000	2,936	325,182	2026/2/15
T 1.625% 03/31/19	1.625	3,000	3,049	337,639	2019/3/31

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 1.625% 04/30/19	1.625	5,000	5,082	562,819	2019/4/30
T 1.625% 06/30/20	1.625	3,000	3,039	336,524	2020/6/30
T 1.625% 07/31/20	1.625	5,000	5,063	560,678	2020/7/31
T 1.625% 08/15/22	1.625	4,500	4,512	499,657	2022/8/15
T 1.625% 08/31/19	1.625	7,500	7,624	844,310	2019/8/31
T 1.625% 11/15/22	1.625	7,150	7,153	792,090	2022/11/15
T 1.75% 01/31/23	1.75	7,550	7,600	841,612	2023/1/31
T 1.75% 02/28/22	1.75	2,500	2,530	280,215	2022/2/28
T 1.75% 03/31/22	1.75	7,000	7,082	784,223	2022/3/31
T 1.75% 04/30/22	1.75	5,750	5,815	643,972	2022/4/30
T 1.75% 05/15/22	1.75	3,800	3,842	425,441	2022/5/15
T 1.75% 05/15/23	1.75	7,000	7,041	779,681	2023/5/15
T 1.75% 09/30/22	1.75	2,000	2,017	223,354	2022/9/30
T 1.75% 10/31/20	1.75	4,000	4,068	450,463	2020/10/31
T 1.875% 06/30/20	1.875	5,200	5,322	589,347	2020/6/30
T 1.875% 08/31/17	1.875	7,900	8,006	886,504	2017/8/31
T 1.875% 08/31/22	1.875	4,000	4,066	450,307	2022/8/31
T 1.875% 09/30/17	1.875	850	861	95,447	2017/9/30
T 1.875% 10/31/17	1.875	2,500	2,536	280,885	2017/10/31
T 1.875% 11/30/21	1.875	5,400	5,510	610,169	2021/11/30
T 2% 02/15/22	2.0	2,500	2,567	284,275	2022/2/15
T 2% 02/15/23	2.0	2,600	2,660	294,606	2023/2/15
T 2% 02/15/25	2.0	8,400	8,532	944,774	2025/2/15
T 2% 02/28/21	2.0	4,000	4,113	455,437	2021/2/28
T 2% 05/31/21	2.0	3,800	3,907	432,723	2021/5/31
T 2% 07/31/20	2.0	5,200	5,346	591,990	2020/7/31
T 2% 07/31/22	2.0	3,000	3,073	340,319	2022/7/31
T 2% 08/15/25	2.0	12,300	12,469	1,380,786	2025/8/15
T 2% 08/31/21	2.0	6,800	6,988	773,832	2021/8/31
T 2% 09/30/20	2.0	5,000	5,141	569,351	2020/9/30
T 2% 10/31/21	2.0	6,200	6,367	705,997	2021/10/31
T 2% 11/15/21	2.0	2,466	2,466	273,132	2021/11/15
T 2% 11/30/20	2.0	5,500	5,654	626,107	2020/11/30
T 2% 11/30/22	2.0	2,000	2,045	226,503	2022/11/30
T 2.125% 01/31/21	2.125	3,000	3,101	343,453	2021/1/31
T 2.125% 05/15/25	2.125	12,450	12,764	1,413,430	2025/5/15
T 2.125% 06/30/21	2.125	1,000	1,034	114,516	2021/6/30
T 2.125% 06/30/22	2.125	3,500	3,612	400,029	2022/6/30
T 2.125% 08/15/21	2.125	6,100	6,306	698,368	2021/8/15
T 2.125% 08/31/20	2.125	6,500	6,715	743,558	2020/8/31
T 2.125% 09/30/21	2.125	2,000	2,067	228,916	2021/9/30
T 2.125% 12/31/21	2.125	4,500	4,650	514,956	2021/12/31
T 2.25% 03/31/21	2.25	3,050	3,173	351,347	2021/3/31
T 2.25% 04/30/21	2.25	3,500	3,641	403,223	2021/4/30
T 2.25% 07/31/18	2.25	5,300	5,450	603,546	2018/7/31
T 2.25% 11/15/24	2.25	8,150	8,446	935,233	2024/11/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	2,900	3,001	332,312	2025/11/15
T 2.25% 11/30/17	2.25	5,000	5,104	565,252	2017/11/30
T 2.375% 05/31/18	2.375	4,000	4,115	455,757	2018/5/31
T 2.375% 08/15/24	2.375	8,500	8,894	984,919	2024/8/15
T 2.375% 12/31/20	2.375	2,300	2,402	266,079	2020/12/31
T 2.5% 02/15/45	2.5	6,300	6,110	676,575	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	6,900	6,685	740,280	2046/2/15
T 2.5% 05/15/24	2.5	8,400	8,876	982,851	2024/5/15
T 2.5% 08/15/23	2.5	4,550	4,806	532,190	2023/8/15
T 2.625% 01/31/18	2.625	8,000	8,232	911,532	2018/1/31
T 2.625% 04/30/18	2.625	5,000	5,164	571,892	2018/4/30
T 2.625% 08/15/20	2.625	5,500	5,793	641,559	2020/8/15
T 2.625% 11/15/20	2.625	2,000	2,109	233,618	2020/11/15
T 2.75% 02/15/19	2.75	4,600	4,817	533,403	2019/2/15
T 2.75% 02/15/24	2.75	3,000	3,225	357,162	2024/2/15

銘柄	利率 (%)	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 2.75% 02/28/18	2.75	3,800	3,923	434,440	2018/2/28
T 2.75% 05/31/17	2.75	8,000	8,161	903,677	2017/5/31
T 2.75% 08/15/42	2.75	2,000	2,060	228,190	2042/8/15
T 2.75% 11/15/23	2.75	6,900	7,413	820,921	2023/11/15
T 2.75% 11/15/42	2.75	4,200	4,319	478,300	2042/11/15
T 2.75% 12/31/17	2.75	9,100	9,368	1,037,380	2017/12/31
T 2.875% 03/31/18	2.875	5,250	5,439	602,360	2018/3/31
T 2.875% 05/15/43	2.875	10,300	10,826	1,198,836	2043/5/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	7,650	8,009	886,857	2045/8/15
T 3% 05/15/42	3.0	3,950	4,268	472,647	2042/5/15
T 3% 05/15/45	3.0	3,500	3,756	415,947	2045/5/15
T 3% 11/15/44	3.0	6,300	6,763	748,951	2044/11/15
T 3.125% 02/15/43	3.125	1,000	1,103	122,213	2043/2/15
T 3.125% 04/30/17	3.125	6,500	6,643	735,686	2017/4/30
T 3.125% 05/15/19	3.125	5,000	5,302	587,171	2019/5/15
T 3.125% 05/15/21	3.125	5,300	5,735	635,067	2021/5/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	6,500	7,151	791,846	2044/8/15
T 3.125% 11/15/41	3.125	4,800	5,316	588,640	2041/11/15
T 3.375% 05/15/44	3.375	4,000	4,613	510,811	2044/5/15
T 3.5% 02/15/18	3.5	5,700	5,953	659,242	2018/2/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	2,000	2,370	262,538	2039/2/15
T 3.625% 02/15/21	3.625	5,500	6,062	671,272	2021/2/15
T 3.625% 02/15/44	3.625	5,000	6,035	668,326	2044/2/15
T 3.625% 08/15/19	3.625	2,700	2,916	322,982	2019/8/15
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,000	2,417	267,685	2043/8/15
T 3.75% 08/15/41	3.75	3,200	3,924	434,608	2041/8/15
T 3.75% 11/15/18	3.75	5,000	5,338	591,161	2018/11/15
T 3.75% 11/15/43	3.75	2,300	2,842	314,787	2043/11/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	2,700	3,371	373,363	2040/8/15
T 4.0% 08/15/18	4.0	3,300	3,528	390,666	2018/8/15
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	1,186	131,340	2039/5/15
T 4.25% 11/15/17	4.25	2,550	2,676	296,319	2017/11/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	1,450	1,912	211,742	2040/11/15
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	1,344	148,851	2038/2/15
T 4.375% 05/15/40	4.375	3,000	4,023	445,523	2040/5/15
T 4.375% 11/15/39	4.375	2,700	3,618	400,667	2039/11/15
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,840	2,509	277,846	2036/2/15
T 4.5% 05/15/17	4.5	4,800	4,973	550,719	2017/5/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	1,000	1,367	151,369	2038/5/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	250	341	37,770	2039/8/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	3,900	5,409	598,968	2040/2/15
T 4.75% 08/15/17	4.75	3,500	3,667	406,137	2017/8/15
T 5.0% 05/15/37	5.0	1,100	1,599	177,142	2037/5/15
T 5.25% 02/15/29	5.25	400	545	60,351	2029/2/15
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,765	195,458	2028/11/15
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,600	2,273	251,779	2031/2/15
T 5.5% 08/15/28	5.5	1,200	1,656	183,472	2028/8/15
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	2,331	258,162	2026/2/15
T 6.125% 11/15/27	6.125	950	1,358	150,397	2027/11/15
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,100	1,663	184,184	2030/5/15
T 6.25% 08/15/23	6.25	1,650	2,166	239,924	2023/8/15
T 8.0% 11/15/21	8.0	1,700	2,283	252,823	2021/11/15
T 8.125% 08/15/19	8.125	2,100	2,565	284,062	2019/8/15
小 計				89,318,217	
<b>(カナダ)</b>					
<b>国債証券</b>		千カナダドル	千カナダドル		
CAN 0.25% 05/01/18	0.25	900	893	75,670	2018/5/1
CAN 0.75% 03/01/21	0.75	1,250	1,248	105,769	2021/3/1
CAN 0.75% 09/01/20	0.75	1,700	1,701	144,119	2020/9/1
CAN 1.25% 02/01/18	1.25	1,350	1,363	115,511	2018/2/1
CAN 1.25% 03/01/18	1.25	3,640	3,679	311,676	2018/3/1
CAN 1.25% 08/01/17	1.25	2,250	2,266	191,986	2017/8/1
CAN 1.25% 09/01/18	1.25	500	506	42,933	2018/9/1

銘柄	利率 (%)	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
CAN 1.5% 03/01/20	1.5	1,450	1,492	126,447	2020/3/1
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,450	1,497	126,828	2023/6/1
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	1,280	1,297	109,947	2026/6/1
CAN 1.5% 09/01/17	1.5	2,800	2,830	239,763	2017/9/1
CAN 1.75% 03/01/19	1.75	1,400	1,442	122,221	2019/3/1
CAN 1.75% 09/01/19	1.75	850	879	74,466	2019/9/1
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,550	1,683	142,640	2025/6/1
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,700	1,878	159,111	2024/6/1
CAN 2.75% 06/01/22	2.75	1,550	1,716	145,378	2022/6/1
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,000	1,179	99,902	2048/12/1
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	420	524	44,407	2064/12/1
CAN 3.25% 06/01/21	3.25	1,690	1,892	160,325	2021/6/1
CAN 3.5% 06/01/20	3.5	1,800	1,997	169,185	2020/6/1
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	1,810	2,421	205,096	2045/12/1
CAN 3.75% 06/01/19	3.75	2,300	2,509	212,554	2019/6/1
CAN 4% 06/01/17	4.0	1,400	1,447	122,619	2017/6/1
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	1,970	2,742	232,304	2041/6/1
CAN 4.25% 06/01/18	4.25	2,100	2,250	190,634	2018/6/1
CAN 5% 06/01/37	5.0	1,600	2,431	205,951	2037/6/1
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,550	2,293	194,277	2029/6/1
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	1,560	2,444	209,091	2033/6/1
CAN 8.0% 06/01/27	8.0	360	599	50,756	2027/6/1
小 計				4,329,577	
<b>(メキシコ)</b>					
<b>国債証券</b>		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MBONO 10% 11/20/36	10.0	12,000	16,253	97,520	2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24	10.0	19,100	24,235	145,413	2024/12/5
MBONO 4.75% 06/14/18	4.75	21,150	21,133	126,802	2018/6/14
MBONO 5% 06/15/17	5.0	21,800	21,954	131,724	2017/6/15
MBONO 5% 12/11/19	5.0	12,300	12,186	73,117	2019/12/11
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	11,800	12,261	73,567	2022/6/9
MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	24,000	24,993	149,961	2021/6/10
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	14,700	16,125	96,754	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	24,550	27,148	162,889	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	11,300	12,526	75,160	2042/11/13
MBONO 7.75% 12/14/17	7.75	25,700	27,043	162,258	2017/12/14
MBONO 8% 06/11/20	8.0	14,500	15,878	95,273	2020/6/11
MBONO 8% 12/07/23	8.0	28,600	32,245	193,472	2023/12/7
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	15,600	18,397	110,382	2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	16,500	19,633	117,802	2038/11/18
MBONO 8.5% 12/13/18	8.5	19,600	21,246	127,480	2018/12/13
小 計				1,939,582	
<b>(ドイツ)</b>					
<b>国債証券</b>		千ユーロ	千ユーロ		
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	2,400	2,508	308,318	2025/2/15
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	1,950	2,020	248,347	2026/2/15
DBR 1% 08/15/24	1.0	1,150	1,252	153,978	2024/8/15
DBR 1% 08/15/25	1.0	3,000	3,261	400,843	2025/8/15
DBR 1.5% 02/15/23	1.5	2,750	3,075	378,006	2023/2/15
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	1,950	2,187	268,836	2023/5/15
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	3,390	3,830	470,780	2024/5/15
DBR 1.5% 09/04/22	1.5	1,450	1,614	198,459	2022/9/4
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	2,970	3,408	418,954	2024/2/15
DBR 1.75% 07/04/22	1.75	2,700	3,041	373,814	2022/7/4
DBR 2% 01/04/22	2.0	3,150	3,567	438,476	2022/1/4
DBR 2% 08/15/23	2.0	1,100	1,276	156,913	2023/8/15
DBR 2.25% 09/04/20	2.25	2,500	2,793	343,311	2020/9/4
DBR 2.25% 09/04/21	2.25	2,000	2,280	280,242	2021/9/4
DBR 2.5% 01/04/21	2.5	3,000	3,409	418,974	2021/1/4
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	2,000	2,841	349,163	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	1,780	2,563	315,043	2046/8/15
DBR 3% 07/04/20	3.0	2,300	2,630	323,317	2020/7/4
DBR 3.25% 01/04/20	3.25	4,700	5,342	656,638	2020/1/4

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)		
DBR 3.25% 07/04/21	3.25	2,250	2,671	328,377	2021/7/4	
DBR 3.25% 07/04/22	3.25	1,900	2,999	368,609	2022/7/4	
DBR 3.5% 07/04/19	3.5	3,500	3,938	484,086	2019/7/4	
DBR 3.75% 01/04/19	3.75	4,150	4,615	567,253	2019/1/4	
DBR 4.0% 01/04/18	4.0	2,650	2,843	349,427	2018/1/4	
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,700	4,432	544,752	2037/1/4	
DBR 4.25% 07/04/17	4.25	4,700	4,946	607,955	2017/7/4	
DBR 4.25% 07/04/18	4.25	4,550	5,008	615,564	2018/7/4	
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	1,650	2,885	354,677	2039/7/4	
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	1,200	1,850	227,404	2028/7/4	
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	2,450	4,215	518,081	2034/7/4	
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	2,000	3,765	462,797	2040/7/4	
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	2,200	3,788	465,647	2031/1/4	
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	1,550	2,517	309,372	2028/1/4	
DBR 6.25% 01/04/24	6.25	1,600	2,387	293,456	2024/1/4	
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,050	1,885	231,714	2030/1/4	
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	1,550	2,637	324,191	2027/7/4	
OBL 0.25% 04/13/18	0.25	2,100	2,131	261,900	2018/4/13	
OBL 0.25% 10/11/19	0.25	1,450	1,488	182,894	2019/10/11	
OBL 0.25% 10/16/20	0.25	2,400	2,474	304,083	2020/10/16	
OBL 0.5% 02/23/18	0.5	2,900	2,951	362,793	2018/2/23	
OBL 0.5% 04/12/19	0.5	1,090	1,122	137,957	2019/4/12	
OBL 0.5% 10/13/17	0.5	2,750	2,788	342,737	2017/10/13	
OBL 1% 10/12/18	1.0	2,150	2,228	273,915	2018/10/12	
<b>(イタリア)</b>						
<b>国債証券</b>						
BTPS 0.25% 05/15/18	0.25	2,500	2,515	309,096	2018/5/15	
BTPS 0.3% 10/15/18	0.3	1,000	1,007	123,828	2018/10/15	
BTPS 0.65% 11/01/20	0.65	1,500	1,523	187,292	2020/11/1	
BTPS 0.75% 01/15/18	0.75	2,600	2,634	323,829	2018/1/15	
BTPS 0.95% 03/15/23	0.95	1,500	1,513	185,960	2023/3/15	
BTPS 1.05% 12/01/19	1.05	1,200	1,240	152,403	2019/12/1	
BTPS 1.15% 05/15/17	1.15	800	809	99,536	2017/5/15	
BTPS 1.35% 04/15/22	1.35	3,250	3,387	416,354	2022/4/15	
BTPS 1.45% 09/15/22	1.45	1,000	1,046	128,644	2022/9/15	
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	1,600	1,632	200,656	2025/6/1	
BTPS 1.5% 08/01/19	1.5	2,400	2,509	308,426	2019/8/1	
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	1,600	1,624	199,695	2026/6/1	
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	800	775	95,248	2032/3/1	
BTPS 2% 12/01/25	2.0	600	634	78,005	2025/12/1	
BTPS 2.15% 12/15/21	2.15	2,500	2,722	334,587	2021/12/15	
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	900	906	111,394	2036/9/1	
BTPS 2.5% 05/01/19	2.5	2,500	2,678	329,219	2019/5/1	
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	2,450	2,707	332,812	2024/12/1	
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	1,050	1,084	133,304	2047/3/1	
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	1,550	1,789	219,973	2046/9/1	
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	2,460	2,973	365,482	2030/3/1	
BTPS 3.5% 06/01/18	3.5	1,600	1,713	210,592	2018/6/1	
BTPS 3.5% 11/01/17	3.5	2,000	2,101	258,302	2017/11/1	
BTPS 3.5% 12/01/18	3.5	3,200	3,482	427,965	2018/12/1	
BTPS 3.75% 03/01/21	3.75	4,700	5,452	670,059	2021/3/1	
BTPS 3.75% 05/01/21	3.75	1,550	1,802	221,491	2021/5/1	
BTPS 3.75% 08/01/21	3.75	4,000	4,676	574,761	2021/8/1	
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	3,300	3,970	488,014	2024/9/1	
BTPS 4% 02/01/37	4.0	3,050	3,929	482,957	2037/2/1	
BTPS 4% 09/01/20	4.0	3,550	4,114	505,637	2020/9/1	
BTPS 4.25% 02/01/19	4.25	3,800	4,232	520,143	2019/2/1	
BTPS 4.25% 03/01/20	4.25	4,500	5,194	638,391	2020/3/1	
BTPS 4.25% 09/01/19	4.25	2,650	3,008	369,787	2019/9/1	
BTPS 4.5% 02/01/18	4.5	2,400	2,582	317,437	2018/2/1	
BTPS 4.5% 02/01/20	4.5	1,650	1,914	235,281	2020/2/1	
BTPS 4.5% 03/01/19	4.5	2,650	2,978	366,016	2019/3/1	
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	2,450	3,079	378,425	2024/3/1	

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)		
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,800	3,594	441,748	2026/3/1	
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	2,050	2,556	314,195	2023/5/1	
BTPS 4.5% 08/01/18	4.5	1,800	1,977	243,001	2018/8/1	
BTPS 4.75% 05/01/17	4.75	3,770	3,939	484,224	2017/5/1	
BTPS 4.75% 06/01/17	4.75	1,700	1,783	219,144	2017/6/1	
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	3,650	4,636	569,806	2023/8/1	
BTPS 4.75% 09/01/21	4.75	2,400	2,934	360,622	2021/9/1	
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	2,750	3,681	452,491	2028/9/1	
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	1,800	2,618	321,806	2044/9/1	
BTPS 5% 03/01/22	5.0	2,250	2,810	345,468	2022/3/1	
BTPS 5% 03/01/25	5.0	4,500	5,902	725,408	2025/3/1	
BTPS 5% 08/01/34	5.0	2,650	3,796	466,643	2034/8/1	
BTPS 5% 09/01/40	5.0	2,650	3,893	478,486	2040/9/1	
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	2,200	3,234	397,461	2039/8/1	
BTPS 5.25% 08/01/17	5.25	900	956	117,555	2017/8/1	
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	3,300	4,660	572,820	2029/11/1	
BTPS 5.5% 09/01/22	5.5	3,400	4,401	541,001	2022/9/1	
BTPS 5.5% 11/01/22	5.5	1,950	2,530	311,038	2022/11/1	
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	3,127	384,425	2033/2/1		
BTPS 6% 05/01/31	6.0	4,350	6,666	819,300	2031/5/1	
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	2,000	3,013	370,325	2027/11/1	
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	2,180	267,997	2026/11/1	
BTPS 9% 11/01/23	9.0	800	1,260	154,878	2023/11/1	
<b>(フランス)</b>						
<b>国債証券</b>						
BTNS 1% 07/25/17	1.0	3,600	3,661	450,030	2017/7/25	
FRTR 0.25% 11/25/20	0.25	2,600	2,660	326,975	2020/11/25	
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	4,200	4,273	525,197	2025/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	1,300	1,305	160,456	2026/5/25	
FRTR 0.5% 11/25/19	0.5	4,300	4,430	544,567	2019/11/25	
FRTR 1% 05/25/18	1.0	4,750	4,887	600,660	2018/5/25	
FRTR 1% 05/25/19	1.0	3,250	3,387	416,306	2019/5/25	
FRTR 1% 11/25/18	1.0	2,500	2,589	318,244	2018/11/25	
FRTR 1% 11/25/25	1.0	3,700	3,915	481,188	2025/11/25	
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	600	603	74,154	2036/5/25	
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	1,750	1,893	232,718	2031/5/25	
FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	3,760	4,221	518,801	2023/5/25	
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	450	444	54,580	2066/5/25	
FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	3,200	3,612	443,967	2024/11/25	
FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	4,400	5,141	631,842	2024/5/25	
FRTR 2.25% 10/25/22	2.25	4,100	4,711	579,017	2022/10/25	
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	3,500	4,277	525,759	2030/5/25	
FRTR 2.5% 10/25/20	2.5	5,450	6,124	752,683	2020/10/25	
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	4,100	5,075	623,780	2027/10/25	
FRTR 3% 04/25/22	3.0	4,700	5,574	685,121	2022/4/25	
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	2,050	2,935	360,804	2045/5/25	
FRTR 3.25% 10/25/21	3.25	5,200	6,171	758,524	2021/10/25	
FRTR 3.5% 04/25/20	3.5	5,050	5,812	714,365	2020/4/25	
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	3,850	5,009	615,634	2026/4/25	
FRTR 3.75% 04/25/21	3.75	4,700	5,624	691,252	2021/4/25	
FRTR 3.75% 10/25/19	3.75	3,750	4,282	526,307	2019/10/25	
FRTR 4% 04/25/18	4.0	4,480	4,861	597,505	2018/4/25	
FRTR 4% 04/25/55	4.0	1,750	2,964	364,314	2055/4/25	
FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,430	2,461	302,543	2060/4/25	
FRTR 4% 10/25/38	4.0	3,180	4,891	601,150	2038/10/25	
FRTR 4.25% 04/25/19	4.25	4,100	4,658	572,587	2019/4/25	
FRTR 4.25% 10/25/17	4.25	3,450	3,679	452,264	2017/10/25	
FRTR 4.25% 10/25/18	4.25	3,900	4,341	533,625	2018/10/25	
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	5,150	6,761	830,936	2023/10/25	
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	3,320	5,579	685,701	2041/4/25	
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	2,950	4,802	590,279	2035/4/25	
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	3,750	5,978	734,782	2029/4/25	
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	3,420	5,937	729,777	2032/10/25	



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)	
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	2,400	3,669	451,007	2025/10/25
FRTR 8.5% 04/25/23	8.5	1,000	1,591	195,653	2023/4/25
FRTR 8.5% 10/25/19	8.5	1,120	1,461	179,651	2019/10/25
<b>(オランダ)</b>					
<b>国債証券</b>					
NETHER 0.25% 01/15/20	0.25	1,900	1,947	239,395	2020/1/15
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	1,750	1,757	215,947	2025/7/15
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	750	762	93,695	2026/7/15
NETHER 1.25% 01/15/18	1.25	850	874	107,430	2018/1/15
NETHER 1.25% 01/15/19	1.25	2,700	2,822	346,929	2019/1/15
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	2,000	2,259	277,747	2023/7/15
NETHER 2% 07/15/24	2.0	1,700	1,967	241,842	2024/7/15
NETHER 2.25% 07/15/22	2.25	1,900	2,186	268,673	2022/7/15
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	1,450	1,868	229,692	2033/1/15
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	1,250	1,837	225,791	2047/1/15
NETHER 3.25% 07/15/21	3.25	2,050	2,427	298,282	2021/7/15
NETHER 3.5% 07/15/20	3.5	1,950	2,267	278,709	2020/7/15
NETHER 3.75% 01/15/23	3.75	1,320	1,661	204,204	2023/1/15
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	1,920	3,189	391,990	2042/1/15
NETHER 4% 01/15/37	4.0	1,630	2,638	324,210	2037/1/15
NETHER 4% 07/15/19	4.0	1,800	2,052	252,263	2019/7/15
NETHER 4.0% 07/15/18	4.0	2,350	2,574	316,431	2018/7/15
NETHER 4.5% 07/15/17	4.5	2,450	2,588	318,129	2017/7/15
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,590	2,519	309,638	2028/1/15
NETHER 7.5% 01/15/23	7.5	200	301	37,106	2023/1/15
<b>(スペイン)</b>					
<b>国債証券</b>					
SPGB 0.25% 04/30/18	0.25	3,200	3,221	395,903	2018/4/30
SPGB 0.5% 10/31/17	0.5	2,230	2,249	276,469	2017/10/31
SPGB 0.75% 07/30/21	0.75	800	811	99,714	2021/7/30
SPGB 1.15% 07/30/20	1.15	1,350	1,398	171,936	2020/7/30
SPGB 1.4% 01/31/20	1.4	2,800	2,924	359,397	2020/1/31
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	2,300	2,357	289,704	2025/4/30
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	1,250	1,303	160,230	2026/4/30
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	1,350	1,355	166,586	2030/7/30
SPGB 2.1% 04/30/17	2.1	1,000	1,020	125,461	2017/4/30
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	2,450	2,610	320,804	2025/10/31
SPGB 2.75% 04/30/19	2.75	2,250	2,426	298,261	2019/4/30
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	2,750	3,076	378,138	2024/10/31
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	770	799	98,254	2046/10/31
SPGB 3.75% 10/31/18	3.75	1,400	1,529	187,937	2018/10/31
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	2,800	3,358	412,771	2024/4/30
SPGB 4% 04/30/20	4.0	3,700	4,239	521,086	2020/4/30
SPGB 4.1% 07/30/18	4.1	2,730	2,977	365,975	2018/7/30
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	2,100	2,725	334,955	2037/1/31
SPGB 4.3% 10/31/19	4.3	2,950	3,368	413,963	2019/10/31
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	1,150	1,431	175,971	2023/10/31
SPGB 4.5% 01/31/18	4.5	2,830	3,047	374,542	2018/1/31
SPGB 4.6% 07/30/19	4.6	2,200	2,512	308,821	2019/7/30
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,450	3,145	386,546	2025/7/30
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	1,550	2,166	266,216	2041/7/30
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	3,050	3,890	478,097	2024/1/31
SPGB 4.85% 10/31/20	4.85	2,150	2,574	316,425	2020/10/31
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	1,600	2,290	281,474	2040/7/30
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	3,400	4,668	573,740	2028/10/31
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,400	2,100	258,159	2044/10/31
SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	2,350	3,055	375,472	2023/1/31
SPGB 5.5% 04/30/21	5.5	3,000	3,742	459,964	2021/4/30
SPGB 5.5% 07/30/17	5.5	3,200	3,410	419,181	2017/7/30
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,270	3,432	421,806	2032/7/30
SPGB 5.85% 01/31/22	5.85	2,800	3,631	446,361	2022/1/31
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	1,680	2,369	291,235	2026/7/30
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,500	2,213	272,053	2029/1/31

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>(ベルギー)</b>					
<b>国債証券</b>					
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	1,570	1,633	200,721	2025/6/22
BGB 1% 06/22/26	1.0	1,750	1,837	225,771	2026/6/22
BGB 1% 06/22/31	1.0	580	583	71,763	2031/6/22
BGB 1.25% 06/22/18	1.25	980	1,015	124,773	2018/6/22
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	460	466	57,390	2047/6/22
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	510	569	70,000	2038/6/22
BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,500	1,739	213,824	2023/6/22
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	2,140	2,556	314,221	2024/6/22
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,000	1,315	161,623	2034/6/22
BGB 3% 09/28/19	3.0	1,230	1,370	168,431	2019/9/28
BGB 3.5% 06/28/17	3.5	670	699	85,912	2017/6/28
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	1,010	1,570	192,977	2045/6/22
BGB 3.75% 09/28/20	3.75	2,500	2,945	362,061	2020/9/28
BGB 4% 03/28/18	4.0	1,660	1,797	220,859	2018/3/28
BGB 4% 03/28/22	4.0	1,110	1,382	169,850	2022/3/28
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,030	1,494	183,691	2032/3/28
BGB 4.0% 03/28/19	4.0	1,700	1,916	235,480	2019/3/28
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	1,890	3,071	377,008	2041/3/28
BGB 4.25% 09/28/21	4.25	2,100	2,604	320,053	2021/9/28
BGB 4.25% 09/28/22	4.25	2,250	2,874	353,217	2022/9/28
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,550	2,168	266,483	2026/3/28
BGB 5% 03/28/35	5.0	2,020	3,366	413,704	2035/3/28
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	1,850	2,882	354,285	2028/3/28
BGB 5.5% 09/28/17	5.5	1,900	2,052	252,216	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	950	971	119,371	2019/10/18
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	400	411	50,512	2026/10/20
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	700	758	93,179	2025/10/20
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	1,080	1,216	149,468	2024/10/21
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	1,750	1,980	243,387	2023/10/20
RAGB 1.95% 06/18/19	1.95	800	858	105,469	2019/6/18
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	660	819	100,697	2034/5/23
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	820	1,198	147,317	2044/6/20
RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	1,200	1,477	181,526	2022/11/22
RAGB 3.5% 09/15/21	3.5	1,770	2,125	261,163	2021/9/15
RAGB 3.65% 04/20/22	3.65	1,100	1,350	165,966	2022/4/20
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	450	801	98,493	2062/1/26
RAGB 3.9% 07/15/20	3.9	1,450	1,707	209,885	2020/7/15
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,450	2,294	282,037	2037/3/15
RAGB 4.3% 09/15/17	4.3	1,400	1,487	182,756	2017/9/15
RAGB 4.35% 03/15/19	4.35	1,950	2,211	271,805	2019/3/15
RAGB 4.65% 01/15/18	4.65	1,350	1,463	179,881	2018/1/15
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	950	1,365	167,862	2026/3/15
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	1,060	1,731	212,852	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	566	69,627	2020/9/15
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	470	474	58,351	2026/4/15
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	500	499	61,383	2031/4/15
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	500	525	64,585	2025/9/15
RFGB 1.125% 09/15/18	1.125	550	570	70,104	2018/9/15
RFGB 1.5% 04/15/23	1.5	560	619	76,092	2023/4/15
RFGB 1.625% 09/15/22	1.625	590	654	80,418	2022/9/15
RFGB 2% 04/15/24	2.0	570	655	80,593	2024/4/15
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	480	628	80,926	2042/7/4
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	640	805	99,001	2028/7/4
RFGB 3.375% 04/15/20	3.375	600	687	84,531	2020/4/15
RFGB 3.5% 04/15/21	3.5	700	829	101,935	2021/4/15
RFGB 3.875% 09/15/17	3.875	570	602	74,053	2017/9/15
RFGB 4% 07/04/25	4.0	800	1,071	131,672	2025/7/4

外国債券インデックス マザーファンド ー第16期ー

当		期			末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価	額	額	償還年月日
		外貨建金額	外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
RFBG 4.375% 07/04/19	4.375	1,050	1,208	148,484	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	1,000	1,039	127,698	2022/3/15	
IRISH 1% 05/15/26	1.0	650	664	81,695	2026/5/15	
IRISH 2% 02/18/45	2.0	670	709	87,147	2045/2/18	
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	800	925	113,751	2030/5/15	
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	900	1,099	135,090	2024/3/18	
IRISH 3.9% 03/20/23	3.9	750	932	114,610	2023/3/20	
IRISH 4.4% 06/18/19	4.4	1,100	1,257	154,522	2019/6/18	
IRISH 4.5% 04/18/20	4.5	1,950	2,303	283,091	2020/4/18	
IRISH 4.5% 10/18/18	4.5	890	992	122,030	2018/10/18	
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,400	1,961	241,052	2025/3/13	
IRISH 5.5% 10/18/17	5.5	920	995	122,339	2017/10/18	
IRISH 5.9% 10/18/19	5.9	750	905	111,242	2019/10/18	
ユ ー ロ 計				84,575,904		
<b>(イギリス)</b>						
<b>国債証券</b>						
UKT 1% 09/07/17	1.0	3,550	3,575	578,527	2017/9/7	
UKT 1.25% 07/22/18	1.25	3,780	3,844	621,968	2018/7/22	
UKT 1.5% 01/22/21	1.5	1,170	1,201	194,367	2021/1/22	
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	700	696	112,703	2026/7/22	
UKT 1.75% 07/22/19	1.75	3,550	3,671	594,020	2019/7/22	
UKT 1.75% 09/07/22	1.75	2,850	2,964	479,612	2022/9/7	
UKT 2% 07/22/20	2.0	3,300	3,459	559,758	2020/7/22	
UKT 2% 09/07/25	2.0	2,420	2,539	410,908	2025/9/7	
UKT 2.25% 09/07/23	2.25	2,800	3,002	485,853	2023/9/7	
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	700	794	128,526	2065/7/22	
UKT 2.75% 09/07/24	2.75	2,900	3,222	521,289	2024/9/7	
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,950	3,558	575,798	2044/1/22	
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	3,000	3,793	613,692	2045/1/22	
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	2,090	3,046	492,915	2068/7/22	
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	2,000	2,821	456,539	2052/7/22	
UKT 3.75% 09/07/19	3.75	550	606	98,115	2019/9/7	
UKT 3.75% 09/07/20	3.75	2,650	2,982	482,612	2020/9/7	
UKT 3.75% 09/07/21	3.75	2,350	2,690	435,345	2021/9/7	
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,750	2,727	441,211	2060/1/22	
UKT 4% 03/07/22	4.0	2,050	2,400	388,421	2022/3/7	
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	2,550	3,423	553,894	2036/3/7	
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	2,250	2,960	478,936	2032/6/7	
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,670	2,295	371,371	2039/9/7	
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,440	1,840	297,748	2027/12/7	
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	2,080	2,888	467,386	2040/12/7	
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	2,100	3,046	492,866	2046/12/7	
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,600	2,398	388,050	2049/12/7	
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,920	3,053	493,987	2055/12/7	
UKT 4.5% 03/07/19	4.5	2,300	2,555	413,416	2019/3/7	
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	2,770	3,796	614,283	2034/9/7	
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,300	3,354	542,767	2042/12/7	
UKT 4.75% 03/07/20	4.75	4,150	4,778	773,062	2020/3/7	
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	2,300	3,150	509,671	2030/12/7	
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,900	2,771	448,345	2038/12/7	
UKT 5% 03/07/18	5.0	1,800	1,948	315,272	2018/3/7	
UKT 5% 03/07/25	5.0	1,900	2,478	400,935	2025/3/7	
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,250	1,870	302,636	2028/12/7	
UKT 8% 06/07/21	8.0	1,250	1,686	272,858	2021/6/7	
UKT 8.75% 08/25/17	8.75	1,150	1,270	205,494	2017/8/25	
小 計				17,015,175		
<b>(スイス)</b>						
<b>国債証券</b>						
SWISS 2% 04/28/21	2.0	540	614	68,454	2021/4/28	
SWISS 2.25% 07/06/20	2.25	400	451	50,266	2020/7/6	

当		期			末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価	額	額	償還年月日
		外貨建金額	外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
SWISS 3% 01/08/18	3.0	1,970	2,093	233,059	2018/1/8	
SWISS 4% 02/11/23	4.0	1,060	1,395	155,328	2023/2/11	
SWISS 4% 04/08/28	4.0	490	739	82,271	2028/4/8	
小 計				589,379		
<b>(スウェーデン)</b>						
<b>国債証券</b>						
SGB 1% 11/12/26	1.0	4,800	4,913	65,057	2026/11/12	
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	9,600	10,413	137,877	2023/11/13	
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	7,600	8,915	118,042	2025/5/12	
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	5,470	7,366	97,539	2039/3/30	
SGB 3.5% 06/01/22	3.5	10,650	12,799	169,643	2022/6/1	
SGB 3.75% 08/12/17	3.75	8,650	9,104	120,549	2017/8/12	
SGB 4.25% 03/12/19	4.25	10,150	11,483	152,045	2019/3/12	
SGB 5% 12/01/20	5.0	10,700	13,203	174,814	2020/12/1	
小 計				1,035,390		
<b>(ノルウェー)</b>						
<b>国債証券</b>						
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	3,100	3,133	41,521	2026/2/19	
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	3,150	3,260	43,199	2025/3/13	
NGB 2% 05/24/23	2.0	7,040	7,465	98,914	2023/5/24	
NGB 3% 03/14/24	3.0	5,550	6,290	83,352	2024/3/14	
NGB 3.75% 05/25/21	3.75	9,350	10,644	141,034	2021/5/25	
NGB 4.25% 05/19/17	4.25	7,650	7,918	104,921	2017/5/19	
NGB 4.5% 05/22/19	4.5	8,450	9,417	124,782	2019/5/22	
小 計				637,725		
<b>(デンマーク)</b>						
<b>国債証券</b>						
DGB 0.25% 11/15/18	0.25	3,500	3,559	58,834	2018/11/15	
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	5,800	6,404	105,859	2023/11/15	
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	7,800	8,788	145,278	2025/11/15	
DGB 3% 11/15/21	3.0	11,450	13,422	212,866	2021/11/15	
DGB 4% 11/15/17	4.0	5,900	6,292	104,013	2017/11/15	
DGB 4% 11/15/19	4.0	11,450	13,191	218,056	2019/11/15	
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	14,980	26,242	433,955	2039/11/15	
DGB 7% 11/10/24	7.0	5,000	7,896	130,532	2024/11/10	
小 計				1,418,236		
<b>(ポーランド)</b>						
<b>国債証券</b>						
POLGB 1.5% 04/25/20	1.5	2,600	2,548	71,399	2020/4/25	
POLGB 2% 04/25/21	2.0	3,500	3,457	96,884	2021/4/25	
POLGB 2.5% 07/25/18	2.5	4,900	4,989	139,814	2018/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	2,100	2,001	56,074	2026/7/25	
POLGB 3.25% 07/25/19	3.25	2,800	2,922	81,890	2019/7/25	
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	3,260	3,341	93,627	2025/7/25	
POLGB 3.75% 04/25/18	3.75	1,800	1,873	52,484	2018/4/25	
POLGB 4% 10/25/23	4.0	3,150	3,412	95,629	2023/10/25	
POLGB 5.25% 10/25/17	5.25	4,100	4,314	120,896	2017/10/25	
POLGB 5.5% 10/25/19	5.5	2,600	2,865	80,292	2020/10/25	
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	1,400	1,766	49,487	2029/4/25	
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	2,890	3,426	96,014	2022/9/23	
POLGB 5.75% 10/25/21	5.75	3,200	3,749	105,067	2021/10/25	
小 計				1,221,086		
<b>(オーストラリア)</b>						
<b>国債証券</b>						
ACGB 1.75% 11/21/20	1.75	1,300	1,300	103,371	2020/11/21	
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	2,940	3,071	244,180	2024/4/21	
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	650	639	50,873	2035/6/21	
ACGB 2.75% 10/21/19	2.75	2,150	2,229	177,211	2019/10/21	
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	900	934	74,257	2027/11/21	

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)	
ACGB 3.25%	04/21/25	3.25	2,750	2,981	236,993	2025/4/21
ACGB 3.25%	04/21/29	3.25	1,680	1,820	144,746	2029/4/21
ACGB 3.25%	06/21/39	3.25	610	633	50,394	2039/6/21
ACGB 3.25%	10/21/18	3.25	2,050	2,127	169,137	2018/10/21
ACGB 3.75%	04/21/37	3.75	900	1,019	81,006	2037/4/21
ACGB 4.25%	04/21/26	4.25	3,560	4,188	332,948	2026/4/21
ACGB 4.25%	07/21/17	4.25	1,500	1,543	122,692	2017/7/21
ACGB 4.5%	04/15/20	4.5	2,600	2,876	228,659	2020/4/15
ACGB 4.5%	04/21/33	4.5	1,300	1,620	128,773	2033/4/21
ACGB 4.75%	04/21/27	4.75	2,410	2,973	236,344	2027/4/21
ACGB 5.25%	03/15/19	5.25	3,890	4,276	339,915	2019/3/15
ACGB 5.5%	01/21/18	5.5	2,770	2,942	233,900	2018/1/21
ACGB 5.5%	04/21/23	5.5	2,850	3,485	277,068	2023/4/21
ACGB 5.75%	05/15/21	5.75	2,850	3,381	268,784	2021/5/15
ACGB 5.75%	07/15/22	5.75	2,400	2,926	232,653	2022/7/15
小	計				3,733,914	
<b>(シンガポール)</b>			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
<b>国債証券</b>						
SIGB 0.5%	04/01/18	0.5	600	594	47,647	2018/4/1
SIGB 1.375%	10/01/17	1.375	340	342	27,439	2017/10/1
SIGB 1.625%	10/01/19	1.625	110	111	8,927	2019/10/1
SIGB 2%	07/01/20	2.0	150	153	12,299	2020/7/1
SIGB 2.25%	06/01/21	2.25	570	585	46,934	2021/6/1
SIGB 2.375%	06/01/25	2.375	270	275	22,088	2025/6/1
SIGB 2.5%	06/01/19	2.5	900	934	74,922	2019/6/1
SIGB 2.75%	03/01/46	2.75	210	220	17,691	2046/3/1
SIGB 2.75%	04/01/42	2.75	590	619	49,718	2042/4/1
SIGB 2.75%	07/01/23	2.75	420	440	35,360	2023/7/1
SIGB 2.875%	07/01/29	2.875	200	211	16,965	2029/7/1
SIGB 2.875%	09/01/30	2.875	300	316	25,377	2030/9/1
SIGB 3%	09/01/24	3.0	770	823	66,054	2024/9/1
SIGB 3.125%	09/01/22	3.125	720	773	62,002	2022/9/1
SIGB 3.25%	09/01/20	3.25	930	998	80,075	2020/9/1
SIGB 3.375%	09/01/33	3.375	400	451	36,195	2033/9/1
SIGB 3.5%	03/01/27	3.5	710	794	63,732	2027/3/1
SIGB 4%	09/01/18	4.0	630	671	53,846	2018/9/1
小	計				747,280	
<b>(マレーシア)</b>			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
<b>国債証券</b>						
MGS 3.26%	03/01/18	3.26	2,700	2,716	73,496	2018/3/1
MGS 3.314%	10/31/17	3.314	1,000	1,005	27,219	2017/10/31
MGS 3.418%	08/15/22	3.418	2,200	2,153	58,278	2022/8/15
MGS 3.48%	03/15/23	3.48	2,050	2,007	54,330	2023/3/15
MGS 3.492%	03/31/20	3.492	2,000	2,002	54,184	2020/3/31
MGS 3.502%	05/31/27	3.502	800	759	20,539	2027/5/31
MGS 3.58%	09/28/18	3.58	2,150	2,171	58,753	2018/9/28
MGS 3.654%	10/31/19	3.654	1,600	1,615	43,724	2019/10/31
MGS 3.733%	06/15/28	3.733	1,300	1,250	33,849	2028/6/15
MGS 3.844%	04/15/33	3.844	1,150	1,080	29,239	2033/4/15
MGS 3.889%	07/31/20	3.889	1,500	1,523	41,226	2020/7/31
MGS 3.892%	03/15/27	3.892	750	738	19,974	2027/3/15
MGS 3.955%	09/15/25	3.955	540	545	14,754	2025/9/15
MGS 4.012%	09/15/17	4.012	1,000	1,013	27,436	2017/9/15
MGS 4.048%	09/30/21	4.048	1,700	1,735	46,958	2021/9/30
MGS 4.127%	04/15/32	4.127	1,300	1,275	34,524	2032/4/15
MGS 4.16%	07/15/21	4.16	1,650	1,693	45,816	2021/7/15
MGS 4.181%	07/15/24	4.181	2,100	2,140	57,910	2024/7/15
MGS 4.24%	02/07/18	4.24	1,150	1,175	31,801	2018/2/7
MGS 4.378%	11/29/19	4.378	2,600	2,684	72,650	2019/11/29
MGS 4.392%	04/15/26	4.392	1,800	1,865	50,477	2026/4/15
MGS 4.498%	04/15/30	4.498	500	514	13,920	2030/4/15

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 4.935%	09/30/43	4.935	650	673	18,235	2043/9/30
MGS 5.248%	09/15/28	5.248	1,350	1,490	40,339	2028/9/15
小	計				969,646	
<b>(南アフリカ)</b>			千南アフリカランド	千南アフリカランド		
<b>国債証券</b>						
SAGB 10.5%	12/21/26	10.5	23,100	24,810	174,665	2026/12/21
SAGB 6.25%	03/31/36	6.25	9,620	6,629	46,673	2036/3/31
SAGB 6.5%	02/28/41	6.5	8,850	6,052	42,608	2041/2/28
SAGB 6.75%	03/31/21	6.75	8,020	7,362	51,834	2021/3/31
SAGB 7%	02/28/31	7.0	16,300	12,796	90,086	2031/2/28
SAGB 7.25%	01/15/20	7.25	6,800	6,493	45,715	2020/1/15
SAGB 7.75%	02/28/23	7.75	6,850	6,377	44,900	2023/2/28
SAGB 8%	01/31/30	8.0	3,200	2,781	19,584	2030/1/31
SAGB 8%	12/21/18	8.0	6,400	6,339	44,626	2018/12/21
SAGB 8.25%	03/31/32	8.25	5,800	5,058	35,612	2032/3/31
SAGB 8.25%	09/15/17	8.25	6,200	6,216	43,767	2017/9/15
SAGB 8.5%	01/31/37	8.5	10,450	9,119	64,202	2037/1/31
SAGB 8.75%	01/31/44	8.75	6,350	5,593	39,378	2044/1/31
SAGB 8.75%	02/28/48	8.75	14,950	13,130	92,440	2048/2/28
SAGB 8.875%	02/28/35	8.875	4,700	4,290	30,207	2035/2/28
小	計				866,304	
合	計				208,397,422	

(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 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)	
外	EURO-SCHATZ		219		—
	US 5YR NOTE		345		—
	EURO-BOBL FU		306		—
	EURO-BUND		584		—
国	US 10YR NOTE		215		—
	US LONG BOND		144		—

(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 208,397,422	97.8%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,593,849	2.2
投 資 信 託 財 産 総 額	212,991,271	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(210,684,871千円)の投資信託財産総額(212,991,271千円)に対する比率は98.9%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=110.73円、1カナダドル=84.71円、1メキシコペソ=6.00円、1ユーロ=122.90円、1イギリスポンド=161.79円、1スイスフラン=111.31円、1スウェーデンクローナ=13.24円、1ノルウェークローネ=13.25円、1デンマーククローネ=16.53円、1ポーランドズロチ=28.02円、1オーストラリアドル=79.49円、1シンガポールドル=80.20円、1マレーシアリングギット=27.06円、1南アフリカランド=7.04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5月30日現在
(A) 資 産	215,451,013,330円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,719,058,154
公 社 債(評価額)	208,397,422,364
未 収 入 金	2,483,916,133
未 収 利 息	1,683,926,596
前 払 費 用	77,304,031
差 入 委 託 証 拠 金	89,386,052
(B) 負 債	2,489,003,676
未 払 金	2,471,353,616
未 払 解 約 金	17,551,356
未 払 利 息	5,672
そ の 他 未 払 費 用	93,032
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	212,962,009,654
元 本	80,122,655,769
次 期 繰 越 損 益 金	132,839,353,885
(D) 受 益 権 総 口 数	80,122,655,769口
1万口当たり基準価額(C/D)	26,579円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2015年5月30日 至 2016年5月30日
(A) 配 当 等 収 益	5,280,824,559円
受 取 利 息	5,281,247,827
そ の 他 収 益 金	105,281
支 払 利 息	△528,549
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△22,893,038,071
売 買 益	4,127,373,883
売 買 損	△27,020,411,954
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	23,348,713
取 引 益	86,583,924
取 引 損	△63,235,211
(D) そ の 他 費 用	△51,226,974
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△17,640,091,773
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	142,049,351,813
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	54,662,662,514
(H) 解 約 差 損 益 金	△46,232,568,669
(I) 計 (E+F+G+H)	132,839,353,885
次 期 繰 越 損 益 金(I)	132,839,353,885

(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。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は75,548,796,118円、期中追加設定元本額は29,807,722,078円、期中一部解約元本額は25,233,862,427円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

外国債券SMTBセレクション (SMA専用)	22,335,708,640円
コア投資戦略ファンド (成長型)	7,155,574,131円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	5,232,568,345円
バランスA (25) VA1 (適格機関投資家専用)	3,628,175,000円
バランスC (50) VA1 (適格機関投資家専用)	2,952,353,423円
コア投資戦略ファンド (安定型)	2,871,297,369円
外国債券オープン (毎月決算型)	2,827,495,035円
DC世界経済インデックスファンド	2,470,784,175円
グローバルバランスファンドVA35 (適格機関投資家専用)	2,104,353,594円
世界経済インデックスファンド	1,944,514,097円
FOFs用外国債券オープン (適格機関投資家専用)	1,673,665,009円
SBI資産設計オープン (資産成長型)	1,618,281,121円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	1,523,320,834円
DC外国債券インデックス・オープン	1,467,939,547円
分散投資コア戦略ファンドS	1,317,727,090円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	1,279,792,209円
DCマイセレクション25	1,180,214,133円
グローバル・インカム&プラス (毎月決算型)	1,063,486,588円
グローバル債券ファンド・シリーズ1 (適格機関投資家専用)	1,018,942,769円
DCマイセレクション50	986,785,992円
FOFs用 外国債券インデックスファンドS (適格機関投資家専用)	981,491,926円
バランスD (35) VA1 (適格機関投資家専用)	912,370,552円
バランスB (37.5) VA1 (適格機関投資家専用)	880,563,096円
分散投資コア戦略ファンドA	791,895,037円
バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	772,843,004円
財産四分法ファンド (毎月決算型)	740,546,081円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	673,678,353円
DCマイセレクション75	650,408,120円
FOFs用 外国債券インデックスファンドP (適格機関投資家専用)	635,557,131円
コア投資戦略ファンド (切替型)	618,014,548円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	553,315,377円
外国債券ファンド・シリーズ1	481,675,587円
DCマイセレクションS25	477,101,874円
外国債券インデックス・オープン (SMA専用)	456,510,431円
バランスF (25) VA1 (適格機関投資家専用)	452,237,335円
バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	433,306,418円
DCマイセレクションS50	380,959,393円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	378,494,913円
SMTグローバル債券インデックス・オープン (為替ヘッジあり)	347,452,429円
バランスE (25) VA1 (適格機関投資家専用)	323,725,352円
バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	294,271,483円
SMT インデックスバランス・オープン	194,743,164円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり (SMA専用)	172,752,437円
DCマイセレクションS75	171,107,093円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	155,006,148円
外国債券オープン (3ヶ月決算型)	151,866,285円
外国債券インデックス・オープンVA1 (適格機関投資家専用)	99,856,158円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	88,976,830円
DCターゲット・イヤーフンド2025	53,049,337円
DC世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	49,602,045円
DCターゲット・イヤーフンド2035	40,837,516円
DCターゲット・イヤーフンド2045	16,042,041円

SBI資産設計オープン（分配型）	14,063,448円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	8,316,841円
マイセクション25	6,359,182円
マイセクション50	4,341,950円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	3,394,518円
マイセクション75	2,943,235円

## お知らせ

---

該当事項はありません。

# 外国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第16期（決算日 2016年5月30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		株式先物比率	株式物率	投資信託証券組入比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率				
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
第16期(2016年5月30日)	18,911	△13.9	516.33	△16.9	91.4	5.9	2.6	266,540

(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		株式先物比率	株式物率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	円	騰落率			
(当期首) 2015年5月29日	21,973	—	621.17	—	94.4	3.3	2.3
6月末	21,105	△4.0	594.43	△4.3	94.5	3.2	2.2
7月末	21,699	△1.2	611.06	△1.6	95.5	6.2	2.4
8月末	19,979	△9.1	559.10	△10.0	94.5	3.5	2.4
9月末	18,614	△15.3	520.58	△16.2	94.2	3.9	2.5
10月末	20,651	△6.0	577.94	△7.0	92.9	4.5	2.4
11月末	20,878	△5.0	582.47	△6.2	93.0	4.7	2.4
12月末	20,386	△7.2	567.09	△8.7	94.8	2.8	2.6
2016年1月末	18,582	△15.4	507.82	△18.2	94.4	3.1	2.6
2月末	17,816	△18.9	495.82	△20.2	94.7	2.7	2.6
3月末	18,849	△14.2	521.39	△16.1	94.4	2.9	2.7
4月末	18,761	△14.6	525.45	△15.4	92.5	4.9	2.6
(当期末) 2016年5月30日	18,911	△13.9	516.33	△16.9	91.4	5.9	2.6

(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。

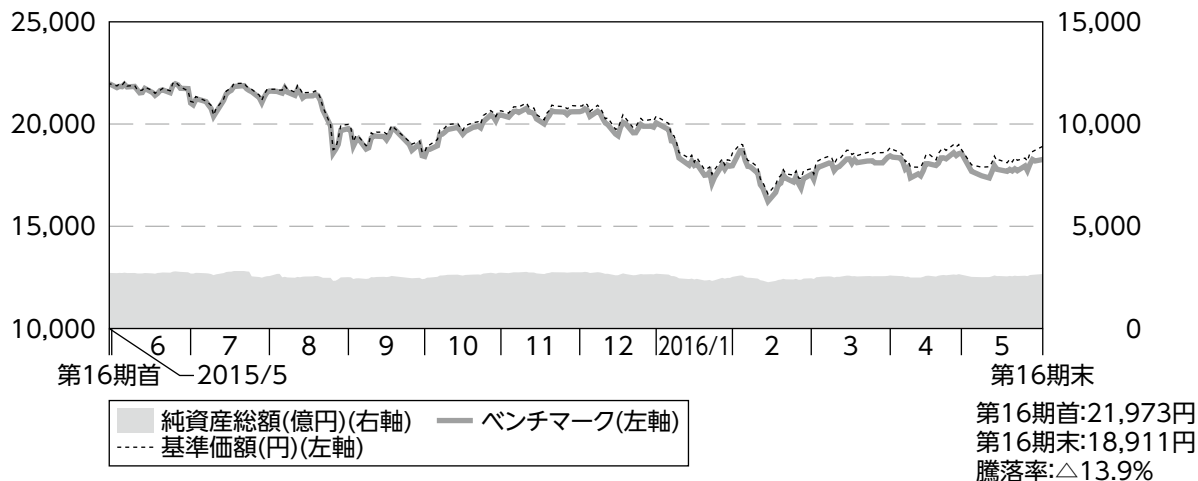
ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)です。

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

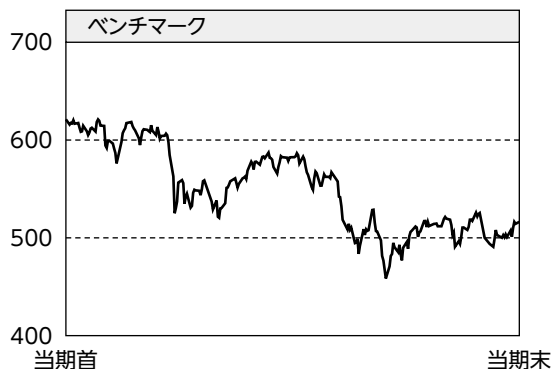


(注)ベンチマークは、2015年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス(円ベース)の動きを反映して、基準価額は下落しました。

## 投資環境



海外株式市場は、2015年8月に商品市況の悪化や新興国景気の先行きに対する懸念の強まりを受けて急落しました。その後は一時反発する場面もあったものの、2016年に入ると中国の景気減速懸念の高まりや原油価格の一段安などを背景に、再度大きく下落しました。2月以降、原油価格の反発やECB(欧州中央銀行)による予想を上回る追加金融緩和、米国の底堅い経済指標などを受けて投資家心理が改善し海外株式市場は上昇しましたが、期初の水準は下回って期末を迎えました。

外国為替市場では、投資家のリスク回避姿勢の強まりや英国のEU(欧州連合)離脱を巡る不透明感、米国の利上げペースが緩やかになるとの見方などを背景に円高が進行しました。

## 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) 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

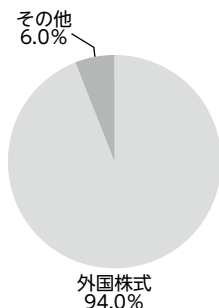
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	APPLE INC	アメリカ	1.8%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.3%
3	EXXON MOBIL	アメリカ	1.2%
4	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	1.0%
5	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	0.9%
6	AMAZON.COM	アメリカ	0.9%

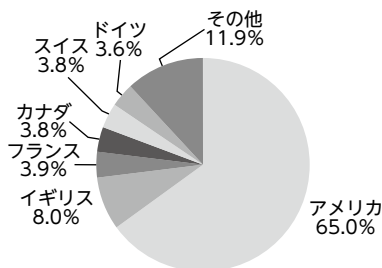
順位	銘柄名	国	組入比率
7	FACEBOOK INC-A	アメリカ	0.9%
8	WELLS FARGO & CO	アメリカ	0.8%
9	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	0.8%
10	AT&T INC	アメリカ	0.8%
組入銘柄数			1,314

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

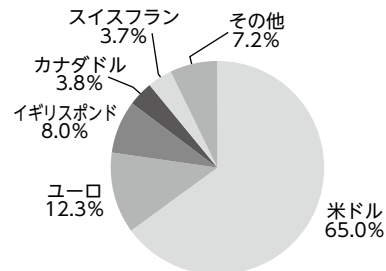
### ○資産別配分



### ○国別配分



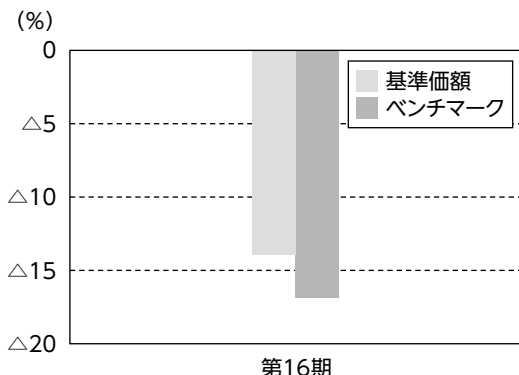
### ○通貨別配分



(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を上回りました。差異の主な要因は、配当要因<sup>※1</sup>および為替評価差要因<sup>※2</sup>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要因です。

## 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
	(2015年5月30日~2016年5月30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)	0.005% (0.002) (-) (-) (-) (0.000) (-) (0.003)	(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)	2 (2) (-) (-) (-) (-) (0)	0.012 (0.012) (-) (-) (-) (-) (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)	0.037 (0.036) (-) (0.001)	(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、金銭信託預入に係る手数料等
合計	10	0.054	

(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(19,941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 47,951 (7,422)	千米ドル 276,840 (17,305)	百株 21,844 (2,382)	千米ドル 123,960 (26,802)
	カ ナ ダ	6,380 (171)	千カナダドル 23,771 (322)	3,460 (320)	千カナダドル 11,249 (322)
	ド イ ツ	3,716 (234)	千ユーロ 16,062 (△171)	1,633	千ユーロ 6,256
	イ タ リ ア	14,370 (873)	3,966 (417)	3,524 (1,232)	2,066 (418)
	フ ラ ン ス	4,323 (△2,221)	15,956 (△1,723)	1,583	5,965
	オ ラ ン ダ	3,108 (543)	5,694 (1,041)	1,659 (-)	2,638 (334)
	ス ペ イ ン	6,638 (44,612)	5,226 (152)	41,240 (5,304)	2,695 (161)
	ベ ル ギ ー	324 (44)	2,453 (-)	135	925
	オ ー ス ト リ ア	67 (-)	176 (△10)	35	98
	ル ク セ ン ブ ル ク	282 (751)	349 (151)	868 (58)	236 (861)
	フ ィ ン ラ ン ド	1,082 (2,304)	1,399 (1,483)	216 (1,152)	315 (741)
	ア イ ル ラ ン ド	162	1,256	-	-
	ポ ル ト ガ ル	528	299	-	-
	そ の 他	- (115)	- (851)	- (115)	- (851)
	国	イ ギ リ ス	48,865 (2,230)	千イギリスポンド 27,158 (2,034)	17,919 (3,250)
ス イ ス		2,821 (1,269)	千スイスフラン 18,297 (101)	2,359	千スイスフラン 6,748
ス ウ ェ ー デ ン		3,327 (449)	千スウェーデンクローナ 43,155 (-)	2,088	千スウェーデンクローナ 18,265
ノ ル ウ ェ ー		1,085	千ノルウェークローネ 14,252	708	千ノルウェークローネ 6,504
デ ン マ ー ク		776 (59)	千デンマーククローネ 30,908 (-)	225	千デンマーククローネ 9,160

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	オーストラリア	12,765 (1,586)	千オーストラリアドル 18,069 (320)	5,306 (-)	千オーストラリアドル 6,565 (329)
	ニュージーランド	946	千ニュージーランドドル 448	-	千ニュージーランドドル -
	香 港	13,115 (3,412)	千香港ドル 40,638 (16,560)	5,753 (1,440)	千香港ドル 17,170 (16,560)
	シンガポール	4,383 (6)	千シンガポールドル 2,917 (4)	1,598 (-)	千シンガポールドル 1,114 (4)
	イスラエル	779	千イスラエルシェケル 5,180	202	千イスラエルシェケル 2,053

(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。

<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	1	224	0.754	94	
SL GREEN REALTY CORP	0.802	84	-	-	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	8	87	-	-	
PROLOGIS INC	10	437	3	136	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2	464	0.889	151	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1	82	-	-	
DUKE REALTY CORP	4	78	-	-	
CROWN CASTLE INTL CORP	4	331	1	102	
ESSEX PROPERTY TRUST	0.886	188	-	-	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	4	333	1	100	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	266	0.685	92	
HCP INC	5	221	2	86	
WELLTOWER INC	6	411	2	147	
KIMCO REALTY CORP	10	258	4	98	
LIBERTY PROPERTY TRUST	2	71	-	-	
MACERICH CO/THE	1	83	-	-	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	12	213	4	83	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5	544	-	-	

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	PLUM CREEK TIMBER COMMON	1	84	— (13)	— (565)
	REALTY INCOME CORP	5	310	1	97
	REGENCY CENTERS CORP	1	82	—	—
	UDR INC	7	260	2	91
	SIMON PROPERTY GROUP	4	859	1	366
	PUBLIC STORAGE	2	475	0.865	174
	VENTAS INC	6	381	2	137
	VORNADO REALTY TRUST	2	270	1	118
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1	93	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	4	308	1	91
	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	3	71	—	—
	VEREIT INC	8	71	—	—
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	7	202	2	78
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	143	77	—	—
	AMERICAN TOWER CORPORATION	6	595	2	213
	EQUINIX INC	1 (0.107)	433 (31)	0.32	86
	COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	—	—	7	155
	CARE CAPITAL PROPERTIES INC	— (5)	— (—)	5	169
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	— (2)	— (61)	2	54
	小 計	295 (8)	8,962 (93)	54 (13)	2,925 (565)
	カナダ	千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
	SMART REAL ESTATE INVSTMENT	5	180	—	—
	小 計	5	180	—	—
	フランス	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	ICADE	1	66	1	72
	UNIBAIL-RODAMCO SE	1	408	0.593	143
	KLEPIERRE	5	250	—	—
	FONCIERE DES REGIONS	— (—)	— (△2)	—	—
	小 計	8 (—)	725 (△2)	1	215
	ユ ー ロ 計	8 (—)	725 (△2)	1	215

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
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	8	67	—	—
HAMMERSON PLC	9	61	—	—
INTU PROPERTIES PLC	16	52	—	—
SEGRO PLC	15	65	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	12	150	3	49
小 計	62	396	3	49
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	64	120	—	—
APA GROUP	15	127	—	—
NOVION PROPERTY GROUP	— (△126)	— (△315)	—	—
GPT GROUP	26	117	—	—
SYDNEY AIRPORT	19	125	—	—
STOCKLAND	32	129	—	—
WESTFIELD CORP	32	306	14	137
DUET GROUP	177	418	—	—
DEXUS PROPERTY GROUP	14	109	—	—
GOODMAN GROUP	20	125	—	—
VICINITY CENTERS	87 (104)	248 (315)	34	102
LENDLEASE GROUP	18	285	8	128
SCENTRE GROUP	82	335	36	141
小 計	592 (△22)	2,449 (—)	93	510
香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
LINK REIT	46	2,045	16	736
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220	1,364	—	—
小 計	267	3,409	16	736
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	59	113	—	—
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	— (—)	— (△0.20052)	—	—
SUNTEC REIT	— (—)	— (△1)	—	—
小 計	59 (—)	113 (△1)	—	—

(注1)金額は受渡金です。

(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	株式先物取引	百万円 102,921	百万円 95,635	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	77,045,016千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	244,452,937千円
(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		
	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 81,710	百万円 13,852	% 17.0	百万円 50,491	百万円 40,150	% 79.5
金 銭 信 託	16,080	16,080	100.0	16,038	16,038	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	204,402	5,071	2.5	204,846	5,071	2.5

(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

<外国株式(上場、登録株式)>

銘柄	当	期		業	種	
	期首(前期末)	当	期			末
	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	1,016	1,148	4,515	499,974	ヘルスケア機器・サービス	
AES CORP	448	526	584	64,765	公益事業	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	632	708	10,823	1,198,471	ソフトウェア・サービス	
CHUBB LTD	221	354	4,509	499,302	保険	
AGCO CORP	59	59	306	33,919	資本財	
AIRGAS INC	42	—	—	—	素材	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	136	156	2,240	248,054	素材	
ENERGEN CORP	48	—	—	—	エネルギー	
ALLEGHANY CORP	11	11	599	66,427	保険	
DU PONT (E. I) DE NEMOURS	603	669	4,494	497,718	素材	
RALPH LAUREN CORPORATION	39	45	430	47,686	耐久消費財・アパレル	
ALLSTATE CORP	280	295	2,002	221,791	保険	
HONEYWELL INTL INC	493	557	6,377	706,199	資本財	
ALCOA	843	1,035	968	107,251	素材	
HESS CORP	173	220	1,327	147,017	エネルギー	
AMERICAN EXPRESS	617	642	4,207	465,918	各種金融	
AMERICAN ELECTRIC POWER	327	373	2,404	266,206	公益事業	
AFLAC	292	331	2,305	255,279	保険	
AMERICAN INT'L GROUP	918	947	5,527	612,106	保険	
JARDEN CORP	119	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
ANADARKO PETROLEUM CORP	337	394	2,033	225,195	エネルギー	
TYCO INTERNATIONAL PLC	281	314	1,341	148,550	商業・専門サービス	
JONES LANG LASALLE INC	31	31	363	40,248	不動産	
VALERO ENERGY CORP	347	366	2,001	221,646	エネルギー	
APACHE CORP	252	279	1,630	180,569	エネルギー	
ALBEMARLE CORP	70	86	695	77,057	素材	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	430	447	1,936	214,398	食品・飲料・タバコ	
PINNACLE WEST CAPITAL	70	83	609	67,509	公益事業	
AMEREN CORPORATION	152	191	922	102,149	公益事業	
ARROW ELECTRONICS INC	65	65	421	46,696	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AGL RESOURCES INC	—	88	582	64,491	公益事業	
AUTOLIV INC	60	66	816	90,366	自動車・自動車部品	
AUTOZONE INC	21	23	1,808	200,277	小売	
AVERY DENNISON CORP	60	74	556	61,656	素材	
AVNET INC	90	109	444	49,200	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
BAKER HUGHES	288	337	1,555	172,277	エネルギー	
BALL CORP	84	93	675	74,766	素材	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	775	909	13,033	1,443,202	各種金融	
BANK NEW YORK CO	749	841	3,555	393,667	各種金融	
BARD C R INC	48	57	1,250	138,491	ヘルスケア機器・サービス	
BAXTER INTERNATIONAL	361	426	1,845	204,403	ヘルスケア機器・サービス	
BECTON DICKINSON & CO	139	159	2,667	295,390	ヘルスケア機器・サービス	
AMETEK INC	155	188	902	99,918	資本財	
VERIZON COMMUNICATIONS	2,787	3,117	15,783	1,747,680	電気通信サービス	

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)	
WR BERKLEY CORP	70	70	400	44,349	保険
BEST BUY COMPANY INC	218	222	713	79,009	小売
YUM BRANDS INC	291	328	2,712	300,364	消費者サービス
FIRSTENERGY CORP	283	323	1,051	116,465	公益事業
BLOCK H & R INC	174	169	356	39,436	消費者サービス
BOEING CO	448	486	6,291	696,668	資本財
ROBERT HALF INTL INC	93	93	382	42,340	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	156	159	534	59,208	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	889	1,029	2,324	257,444	ヘルスケア機器・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	18	21	780	86,411	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,116	1,280	9,130	1,011,071	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	37	38	662	73,319	各種金融
ONEOK INC	132	155	665	73,659	エネルギー
UNITED RENTALS INC	62	73	499	55,304	資本財
SEMPRA ENERGY	159	181	1,909	211,412	公益事業
FEDEX CORP	179	204	3,359	371,975	運輸
AMPHENOL CORPORATION	208	229	1,336	147,960	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	77	84	827	91,651	食品・飲料・タバコ
QUANTA SERVICES INC	140	140	331	36,717	資本財
CSX CORP	664	—	—	—	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	131	155	539	59,754	メディア
CABOT OIL & GAS CORP	284	362	855	94,764	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO (US)	129	147	899	99,655	食品・飲料・タバコ
WHITING PETROLEUM CORP	140	—	—	—	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	110	131	2,075	229,833	食品・飲料・タバコ
CARDINAL HEALTH	220	251	1,965	217,645	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR	382	449	3,237	358,510	資本財
CORE LABORATORIES N.V.	27	33	409	45,293	エネルギー
CHESAPEAKE ENERGY CORP	417	—	—	—	エネルギー
CENTURYLINK INC	382	433	1,161	128,635	電気通信サービス
JPMORGAN CHASE & CO	2,500	2,821	18,458	2,043,883	銀行
CHUBB CORPORATION	157	—	—	—	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	86	96	944	104,572	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	173	195	2,513	278,338	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	65	65	247	27,387	資本財
CLOROX COMPANY	87	98	1,280	141,835	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	2,781	3,166	14,180	1,570,185	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA ENTERPRISES	150	170	880	97,472	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE CO	577	656	4,634	513,203	家庭用品・パーソナル用品
AON PLC	190	208	2,263	250,651	保険
COMERICA INC	118	135	637	70,575	銀行
NRG ENERGY INC	213	251	407	45,151	公益事業
COMPUTER SCIENCES CORP	92	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CONAGRA	286	338	1,534	169,916	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	200	228	1,663	184,230	公益事業
CMS ENERGY CORP	188	210	874	96,834	公益事業
CAMERON INTERNATIONAL CORP	128	—	—	—	エネルギー
THE COOPER COS INC	31	37	605	67,062	ヘルスケア機器・サービス
CORNING	858	900	1,845	204,396	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)	
WR GRACE & CO	—	56	440	48,800	素材
SEALED AIR CORP	147	147	692	76,695	素材
CUMMINS INC	116	130	1,477	163,647	資本財
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	54	61	843	93,397	資本財
WASTE CONNECTIONS INC	—	96	654	72,489	商業・専門サービス
DR HORTON INC	216	243	743	82,380	耐久消費財・アパレル
DANAHER CORP	420	475	4,702	520,727	資本財
MOODY'S CORP	120	133	1,320	146,176	各種金融
TARGET (DAYTON HUDSON)	402	446	3,073	340,327	小売
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	48	—	—	—	エネルギー
DEERE&CO	215	242	1,949	215,837	資本財
MORGAN STANLEY	975	1,112	3,062	339,076	各種金融
REPUBLIC SERVICES INC	163	181	878	97,247	商業・専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,083	1,203	12,074	1,336,999	メディア
DOVER CORP	104	118	789	87,439	資本財
DOW CHEMICAL CO	785	867	4,524	500,977	素材
OMNICOM GROUP	166	180	1,489	164,932	メディア
DTE ENERGY COMPANY	119	134	1,208	133,861	公益事業
XL GROUP PLC	210	237	817	90,539	保険
DUKE ENERGY CORP	469	530	4,138	458,262	公益事業
FLOWSERVE CORP	89	108	521	57,708	資本財
DARDEN RESTAURANTS INC	73	84	569	63,056	消費者サービス
EMC CORP	1,332	1,496	4,164	461,102	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BANK OF AMERICA CORP	7,058	7,987	11,885	1,316,060	銀行
CITIGROUP	2,035	2,287	10,655	1,179,863	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	96	118	874	96,849	素材
EATON CORP	316	358	2,209	244,705	資本財
EATON VANCE CORP	78	78	288	31,939	各種金融
ECOLAB INC	183	204	2,415	267,474	素材
SALESFORCE.COM INC	400	487	4,084	452,244	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	462	506	2,642	292,635	資本財
ATMOS ENERGY CORP	—	80	582	64,536	公益事業
ENTERGY CORP	122	139	1,051	116,453	公益事業
EOG RESOURCES INC	364	417	3,401	376,680	エネルギー
EQUIFAX INC	78	87	1,106	122,486	商業・専門サービス
EQT CORPORATION	102	122	892	98,832	エネルギー
ESTEE LAUDER CO-CL A	155	172	1,587	175,748	家庭用品・パーソナル用品
EXXON MOBIL	2,803	3,188	28,699	3,177,876	エネルギー
FMC CORP	85	104	500	55,425	素材
NEXTERA ENERGY INC	299	354	4,248	470,483	公益事業
FAMILY DOLLAR STORES	67	—	—	—	小売
ASSURANT INC	47	47	417	46,179	保険
M & T BANK CORP	80	113	1,350	149,559	銀行
MACY'S INC	232	238	781	86,566	小売
FRANKLIN RESOURCES INC	271	307	1,147	127,097	各種金融
FREEMPORT-MCMORAN INC	698	921	1,026	113,693	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	114	133	642	71,112	保険
TEGNA INC	150	150	342	37,888	メディア
GAP	176	178	323	35,838	小売

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)		
GENERAL DYNAMICS CORP	187	204	2,932	324,725	資本財	
GENERAL MILLS INC	400	454	2,859	316,627	食品・飲料・タバコ	
GENUINE PARTS CO	103	117	1,140	126,304	小売	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	113	125	923	102,268	消費者サービス	
GARTNER INC	60	60	623	69,064	ソフトウェア・サービス	
MCKESSON CORP	154	175	3,175	351,625	ヘルスケア機器・サービス	
GENERAL ELECTRIC CO	6,747	7,229	21,776	2,411,303	資本財	
GRAINGER (WW) INC	41	42	949	105,124	資本財	
HALLIBURTON CO	564	651	2,774	307,217	エネルギー	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	263	293	4,681	518,354	各種金融	
HARLEY-DAVIDSON	136	146	668	73,994	自動車・自動車部品	
HARMAN INTL INDS INC	47	54	424	47,047	耐久消費財・アパレル	
HARRIS CORP	68	99	788	87,345	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CONSOL ENERGY INC	147	—	—	—	エネルギー	
HELMERICH & PAYNE	68	83	503	55,786	エネルギー	
HERSHEY FOODS CORPORATION	102	116	1,074	118,951	食品・飲料・タバコ	
HP INC	1,225	1,400	1,845	204,308	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CROWN HOLDINGS INC	89	104	550	60,958	素材	
REYNOLDS AMERICAN INC	213	648	3,252	360,169	食品・飲料・タバコ	
JUNIPER NETWORKS INC	243	278	640	70,959	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HOLLYFRONTIER CORP	124	124	335	37,160	エネルギー	
UNUM GROUP	163	185	684	75,809	保険	
HOME DEPOT	884	972	13,027	1,442,509	小売	
HORMEL FOODS CORP	92	215	748	82,831	食品・飲料・タバコ	
CENTERPOINT ENERGY INC	257	305	686	76,064	公益事業	
HUMANA INC	99	113	1,975	218,700	ヘルスケア機器・サービス	
RED HAT INC	119	141	1,083	119,995	ソフトウェア・サービス	
ILLINOIS TOOL WORKS	228	252	2,655	294,080	資本財	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	53	60	779	86,331	素材	
INT'L PAPER CO	270	305	1,286	142,400	素材	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	268	307	729	80,786	メディア	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	79	96	486	53,826	資本財	
JOHNSON & JOHNSON	1,864	2,119	23,963	2,653,442	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	280	307	1,389	153,903	保険	
JOHNSON CONTROLS INC	444	501	2,213	245,082	自動車・自動車部品	
DEVON ENERGY CORPORATION	264	363	1,305	144,522	エネルギー	
KELLOGG CO	179	207	1,546	171,267	食品・飲料・タバコ	
KEY CORP	564	623	802	88,906	銀行	
KIMBERLY-CLARK CORP	243	274	3,523	390,158	家庭用品・パーソナル用品	
BLACKROCK INC	83	93	3,405	377,057	各種金融	
KOHL'S CORP	130	143	516	57,213	小売	
KROGER CO	310	706	2,523	279,460	食品・生活必需品小売り	
PACKAGING CORP OF AMERICA	68	68	470	52,108	素材	
LEGG MASON INC	62	77	263	29,160	各種金融	
LEGGETT & PLATT INC	90	105	527	58,407	耐久消費財・アパレル	
LENNAR CORP-CL A	110	144	661	73,267	耐久消費財・アパレル	
LEUCADIA NATIONAL CORP	216	257	461	51,150	各種金融	
LILLY (ELI) & CO	664	766	5,751	636,847	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
L BRANDS INC	166	190	1,295	143,504	小売	

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)	
LINCOLN NATIONAL CORP	175	176	815	90,255	保険
UNITED PARCEL SERVICE B	466	536	5,519	611,222	運輸
AGILENT TECHNOLOGIES	225	261	1,196	132,493	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOCKHEED MARTIN CORP	178	210	5,053	559,537	資本財
LOEWS CORP	198	218	889	98,521	保険
CARNIVAL CORPORATION	283	306	1,489	164,953	消費者サービス
RANGE RESOURCES CORP	107	127	528	58,479	エネルギー
LOWES COMPANIES	654	699	5,618	622,151	小売
DOMINION RESOURCES	388	460	3,294	364,775	公益事業
SCANA CORP	85	101	709	78,563	公益事業
MDU RESOURCES GROUP INC	123	—	—	—	公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	250	361	828	91,771	消費者サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	74	85	837	92,745	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	645	701	8,651	957,957	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	185	209	2,336	258,698	各種金融
EVEREST RE GROUP LTD	29	33	598	66,284	保険
MANPOWER GROUP	52	52	419	46,403	商業・専門サービス
MARKEL CORP	—	10	991	109,836	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	72	159	1,596	176,729	ヘルスケア機器・サービス
MARSH & MCLENNAN COS	361	404	2,666	295,207	保険
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	39	45	360	39,888	家庭用品・パーソナル用品
MASCO CORP	232	259	845	93,626	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS	37	42	816	90,381	素材
METLIFE INC	642	716	3,278	363,039	保険
MEDTRONIC PLC	951	1,084	8,863	981,422	ヘルスケア機器・サービス
CVS HEALTH CORP	753	850	8,241	912,586	食品・生活必需品小売り
MERCK & CO	1,904	2,142	12,103	1,340,169	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CRP OF AMER	65	79	1,023	113,325	ヘルスケア機器・サービス
RACKSPACE HOSTING INC	80	—	—	—	ソフトウェア・サービス
3 M COMPANY	426	470	7,946	879,909	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	40	47	936	103,711	耐久消費財・アパレル
MOTOROLA SOLUTIONS INC	136	116	807	89,401	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	75	87	816	90,392	運輸
MURPHY OIL CORP	110	110	340	37,670	エネルギー
XCEL ENERGY INC	331	376	1,538	170,381	公益事業
FORD MOTOR COMPANY	2,487	2,859	3,846	425,897	自動車・自動車部品
NATIONAL OILWELL VARCO INC	280	282	922	102,118	エネルギー
NEWELL BRANDS INC	177	339	1,620	179,469	耐久消費財・アパレル
DUN & BRADSTREET CORP	24	24	308	34,150	商業・専門サービス
NEWMONT MINING CORP	321	394	1,260	139,575	素材
NIKE B	462	1,041	5,854	648,305	耐久消費財・アパレル
NOBLE ENERGY INC	259	318	1,144	126,734	エネルギー
NORDSTROM INC	91	100	385	42,662	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	206	232	1,953	216,320	運輸
EVERSOURCE ENERGY	207	241	1,326	146,927	公益事業
NISOURCE INC	213	—	—	—	公益事業
COACH INC	177	220	872	96,608	耐久消費財・アパレル
NORTHROP GRUMMAN CORP	128	132	2,830	313,475	資本財
WELLS FARGO & CO	3,282	3,718	18,906	2,093,554	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)	
NUCOR CORP	215	248	1,202	133,114	素材
MONSANTO CO	322	337	3,692	408,888	素材
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	370	413	3,052	337,995	各種金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	517	588	4,482	496,304	エネルギー
OCEANEERING INTL INC	71	71	238	26,441	エネルギー
OGE ENERGY CORP	127	156	475	52,628	公益事業
OMNICARE INC	64	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ORACLE CORP	2,350	2,454	9,837	1,089,253	ソフトウェア・サービス
PALL CORP	69	—	—	—	資本財
EXELON CORP	574	710	2,440	270,223	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	97	101	1,151	127,560	資本財
PARTNERRE LTD	29	—	—	—	保険
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	59	73	400	44,308	保険
MEDNAX INC	—	69	472	52,362	ヘルスケア機器・サービス
PPL CORPORATION	454	521	2,018	223,535	公益事業
PEPSICO INC	991	1,117	11,393	1,261,604	食品・飲料・タバコ
PENTAIR PLC	121	135	823	91,160	資本財
PERRIGO CO PLC	95	112	1,085	120,219	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER	4,104	4,731	16,375	1,813,291	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CONOCOPHILLIPS	828	936	4,151	459,666	エネルギー
PG&E CORP	317	370	2,205	244,262	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES	101	122	1,986	219,912	エネルギー
ALTRIA GROUP INC	1,309	1,504	9,620	1,065,289	食品・飲料・タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	349	388	3,504	388,030	銀行
POLARIS INDUSTRIES INC	40	46	405	44,884	耐久消費財・アパレル
AETNA INC	234	264	2,992	331,348	ヘルスケア機器・サービス
FLUOR CORP	100	100	528	58,523	資本財
PPG INDUSTRIES INC	91	208	2,269	251,268	素材
PRAXAIR INC	194	219	2,432	269,376	素材
PRECISION CASTPARTS CORP	95	—	—	—	資本財
QUEST DIAGNOSTICS	91	114	883	97,797	ヘルスケア機器・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	1,811	2,084	16,974	1,879,585	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	404	434	1,445	160,046	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	339	394	1,755	194,406	公益事業
PULTE GROUP INC	205	246	463	51,378	耐久消費財・アパレル
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	283	390	611	67,705	銀行
GLOBAL PAYMENTS INC	—	95	734	81,345	ソフトウェア・サービス
TIME WARNER INC	556	613	4,618	511,373	メディア
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	86	99	550	60,916	各種金融
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	32	32	374	41,509	保険
AUTONATION INC	50	50	253	28,043	小売
RESMED INC	89	105	615	68,107	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,186	1,328	5,704	631,624	銀行
RITE AID CORP	683	834	646	71,638	食品・生活必需品小売り
ROCK-TENN COMPANY -CL A	93	—	—	—	素材
ROPER TECHNOLOGIES INC	67	74	1,280	141,737	資本財
ROCKWELL AUTOMATION INC	91	103	1,207	133,733	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	113	130	1,018	112,741	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	205	230	3,005	332,753	資本財

銘柄	当期首(前期末)		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)	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	42	47	1,016	112,566	ソフトウェア・サービス
FMC TECHNOLOGIES INC	152	175	473	52,478	エネルギー
ACCENTURE PLC-CL A	417	481	5,727	634,238	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	109	—	—	—	保険
ROCKWELL COLLIN	91	103	924	102,325	資本財
ST JUDE MEDICAL INC	186	208	1,632	180,729	ヘルスケア機器・サービス
TRAVELERS COS INC/THE	214	231	2,643	292,688	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	190	209	1,555	172,203	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER	852	1,069	8,254	913,968	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	783	899	2,754	305,018	各種金融
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	112	146	1,807	200,106	ヘルスケア機器・サービス
BUNGE LIMITED	93	105	696	77,096	食品・飲料・タバコ
ANTHEM INC	179	199	2,604	288,362	ヘルスケア機器・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	139	148	1,098	121,582	ヘルスケア機器・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	198	219	975	108,037	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	54	61	1,801	199,513	素材
CENTENE CORP	78	92	571	63,233	ヘルスケア機器・サービス
ACUITY BRANDS INC	30	35	898	99,437	資本財
SNAP-ON INC	38	43	701	77,702	資本財
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	303	343	2,732	302,580	保険
ADVANCE AUTO PARTS	46	57	905	100,231	小売
SOUTHWESTERN ENERGY CO	243	291	380	42,089	エネルギー
EDISON INTL	222	253	1,796	198,954	公益事業
SOUTHERN CO	598	702	3,451	382,143	公益事業
BB&T CORP	489	595	2,164	239,658	銀行
INGERSOLL-RAND PLC	178	197	1,312	145,386	資本財
SOUTHWEST AIRLINES CO	111	132	559	61,936	運輸
AT&T INC	3,482	4,713	18,378	2,035,088	電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,261	1,442	14,719	1,629,872	エネルギー
MEADWESTVACO CORP	110	—	—	—	素材
STANLEY BLACK&DECKER	108	117	1,333	147,644	資本財
STATE STREET CORP	278	314	1,990	220,452	各種金融
STRYKER CORP	227	258	2,886	319,642	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS	349	379	1,661	183,994	銀行
SYSCO CORP	404	431	2,101	232,664	食品・生活必需品小売り
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	—	7	110	12,192	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TECO ENERGY INC	—	185	510	56,486	公益事業
TESORO CORP	82	92	724	80,199	エネルギー
TEXTRON	175	218	836	92,634	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	265	301	4,586	507,853	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	89	103	644	71,369	小売
TOLL BROTHERS INC	111	140	410	45,405	耐久消費財・アパレル
TORCHMARK CORP	83	95	584	64,725	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	109	125	675	74,789	ソフトウェア・サービス
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	116	133	1,031	114,188	ヘルスケア機器・サービス
TYSON FOODS INC	207	232	1,510	167,254	食品・飲料・タバコ
MARATHON OIL CORP	453	473	610	67,614	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	589	651	5,404	598,449	運輸
UNITED TECHNOLOGIES CORP	546	647	6,526	722,715	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)	
UNITEDHEALTH GROUP INC	636	731	9,799	1,085,119	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	63	72	976	108,098	ヘルスケア機器・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	67	78	641	71,065	ヘルスケア機器・サービス
VF CORP	235	262	1,640	181,645	耐久消費財・アパレル
CBS CORP-CL B	306	338	1,859	205,870	メディア
VULCAN MATERIALS CO	92	104	1,236	136,954	素材
WAL-MART STORES	1,082	1,230	8,706	964,085	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	312	347	2,128	235,724	商業・専門サービス
WATERS CORP	53	65	895	99,126	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLERGAN PLC	253	302	7,136	790,222	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JM SMUCKER CO	66	92	1,188	131,652	食品・飲料・タバコ
WABTEC CORP	62	71	557	61,720	資本財
WEYERHAEUSER CO	339	610	1,922	212,845	不動産
WHIRLPOOL CORP	52	61	1,076	119,197	耐久消費財・アパレル
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	528	528	294	32,560	エネルギー
NABORS INDUSTRIES LTD	185	—	—	—	エネルギー
WILLIAMS COS	473	563	1,210	134,051	エネルギー
DICK'S SPORTING GOODS INC	63	63	273	30,269	小売
PEPCO HOLDINGS INC	164	—	—	—	公益事業
ALLIANT ENERGY CORPORATION	70	170	627	69,519	公益事業
WEC ENERGY GROUP INC	144	239	1,431	158,535	公益事業
FOOT LOCKER INC	93	105	581	64,407	小売
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	55	—	—	—	公益事業
TD AMERITRADE HOLDING CORP	178	—	—	—	各種金融
CARMAX INC	140	146	782	86,642	小売
XEROX CORP	690	739	727	80,541	ソフトウェア・サービス
CIMAREX ENERGY CO	64	75	895	99,163	エネルギー
TJX COMPANIES INC	460	509	3,903	432,266	小売
HOSPIRA INC	114	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CBRE GROUP INC-A	190	243	718	79,557	不動産
REGIONS FINL CORP	932	938	926	102,550	銀行
WESTLAKE CHEMICAL CORP	32	32	143	15,933	素材
LAS VEGAS SANDS CORP	268	295	1,364	151,131	消費者サービス
MOSAIC CO/THE	216	232	597	66,109	素材
CELANESE CORP-SERIES A	101	114	809	89,667	素材
MOLSON COORS BREWING CO -B	106	144	1,446	160,169	食品・飲料・タバコ
IHS INC-CLASS A	44	51	628	69,567	商業・専門サービス
ASHLAND INC	41	48	553	61,256	素材
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	31	173	479	53,084	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	123	136	1,384	153,342	各種金融
GAMESTOP CORP-CLASS A	74	74	215	23,888	小売
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	75	89	2,421	268,146	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	113	133	506	56,118	耐久消費財・アパレル
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	20	24	1,087	120,390	消費者サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	61	74	335	37,105	運輸
TRANSIGM GROUP INC	36	41	1,056	117,030	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	674	762	7,406	820,086	ソフトウェア・サービス
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	80	93	628	69,584	消費者サービス
HANESBRANDS INC	254	311	841	93,191	耐久消費財・アパレル

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)	
WESTERN UNION CO	346	387	754	83,556	ソフトウェア・サービス
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	255	302	279	30,928	運輸
AERCAP HOLDINGS NV	—	68	265	29,348	資本財
SPECTRA ENERGY CORP	437	497	1,574	174,320	エネルギー
TIME WARNER CABLE-A	186	—	—	—	メディア
DELTA AIR LINES INC	133	150	650	72,073	運輸
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	62	62	262	29,039	エネルギー
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	303	320	1,818	201,361	各種金融
TE CONNECTIVITY LTD	271	294	1,756	194,518	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CONCHO RESOURCES INC	80	94	1,159	128,387	エネルギー
WABCO HOLDINGS INC	38	38	410	45,490	資本財
VMWARE INC-CLASS A	54	54	325	36,044	ソフトウェア・サービス
TERADATA CORP	95	95	265	29,425	ソフトウェア・サービス
INVESCO LTD	289	331	1,041	115,293	各種金融
MSCI INC	—	76	608	67,366	各種金融
NETSUITE INC	22	32	254	28,230	ソフトウェア・サービス
CALPINE CORP	252	252	372	41,267	公益事業
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,039	1,188	11,782	1,304,718	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,323	1,494	11,902	1,318,014	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	131	141	1,307	144,730	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC	115	133	986	109,272	公益事業
LORILLARD INC	245	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	49	—	—	—	メディア
SIGNET JEWELERS LTD	49	54	539	59,752	小売
MARATHON PETROLEUM CORP	181	417	1,464	162,141	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	110	128	754	83,589	資本財
KINDER MORGAN INC	1,218	1,463	2,612	289,334	エネルギー
XYLEM INC	117	139	621	68,802	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	272	290	2,368	262,209	素材
PVH CORP	52	58	554	61,418	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A	72	91	1,196	132,494	ソフトウェア・サービス
FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD	77	—	—	—	半導体・半導体製造装置
HCA HOLDINGS INC	228	254	1,971	218,349	ヘルスケア機器・サービス
NIELSEN NV	231	—	—	—	商業・専門サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	50	62	935	103,544	ソフトウェア・サービス
ENSCO PLC-CL A	148	—	—	—	エネルギー
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	138	150	1,254	138,887	食品・飲料・タバコ
FIRST REPUBLIC BANK/CA	88	116	845	93,672	銀行
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	199	—	—	—	エネルギー
CIT GROUP INC	120	120	410	45,470	銀行
LEAR CORP	53	53	629	69,657	自動車・自動車部品
DOLLAR GENERAL CORP	203	225	2,026	224,426	小売
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	192	225	1,209	133,906	電気通信サービス
REALOGY HOLDINGS CORP	94	113	367	40,685	不動産
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	118	120	443	49,118	資本財
GENERAL MOTORS CO	976	1,082	3,397	376,176	自動車・自動車部品
VANTIV INC - CL A	97	111	604	66,920	ソフトウェア・サービス
ALLY FINANCIAL INC	272	308	547	60,646	各種金融
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	139	139	581	64,413	耐久消費財・アパレル

銘柄	当 期		期 末		業 種
	当期首(前期末)	当	評 価	額	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	198	209	1,420	157,265	自動車・自動車部品
PHILLIPS 66	362	407	3,284	363,715	エネルギー
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	20	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	54	65	439	48,693	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADT CORPORATION	114	—	—	—	商業・専門サービス
SERVICENOW INC	91	114	812	89,949	ソフトウェア・サービス
WHITEWAVE FOODS CO	121	123	555	61,501	食品・飲料・タバコ
PALO ALTO NETWORKS INC	44	64	833	92,272	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	—	33	169	18,777	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	68	79	607	67,283	ソフトウェア・サービス
ABBVIE INC	1,071	1,245	7,809	864,741	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
T-MOBILE US INC	196	—	—	—	電気通信サービス
ZOETIS INC	317	369	1,742	192,946	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MALLINCKRODT PLC	78	82	515	57,048	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SPRINT CORP	533	533	196	21,746	電気通信サービス
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	128	128	313	34,690	ヘルスケア機器・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	—	133	468	51,885	耐久消費財・アパレル
ANTERO RESOURCES CORP	38	66	185	20,573	エネルギー
TWITTER INC	332	423	640	70,887	ソフトウェア・サービス
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	—	176	159	17,634	エネルギー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	338	392	814	90,171	消費者サービス
ARAMARK	117	170	567	62,827	消費者サービス
VOYA FINANCIAL INC	155	160	535	59,290	各種金融
IMS HEALTH HOLDINGS INC	—	123	312	34,607	ヘルスケア機器・サービス
FNFG GROUP	162	186	645	71,475	保険
SYNCHRONY FINANCIAL	115	647	2,018	223,541	各種金融
MOBILEYE NV	—	62	236	26,149	ソフトウェア・サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	226	388	917	101,561	銀行
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	83	110	312	34,634	素材
NIELSEN HOLDINGS PLC	—	260	1,397	154,748	商業・専門サービス
WESTROCK CO	—	182	727	80,546	素材
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	—	1,391	2,541	281,393	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COLUMBIA PIPELINE GROUP	—	294	752	83,369	エネルギー
BAXALTA INC	—	472	2,152	238,353	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHENIERE ENERGY INC	154	156	514	56,936	エネルギー
AMAZON.COM	264	305	21,744	2,407,789	小売
ADOBE SYSTEMS INC	339	376	3,769	417,349	ソフトウェア・サービス
ALTERA CORPORATION	200	—	—	—	半導体・半導体製造装置
AMGEN	509	579	9,075	1,004,901	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERCO	—	6	224	24,893	運輸
ANALOG DEVICES	206	232	1,358	150,426	半導体・半導体製造装置
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	137	172	2,600	287,982	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMCAST CORP-CL A	1,424	1,903	11,971	1,325,635	メディア
ANSYS INC	59	68	611	67,699	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	3,914	4,275	42,903	4,750,675	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS	815	918	2,243	248,435	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	146	179	1,063	117,753	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESS	321	354	3,122	345,785	ソフトウェア・サービス
BED BATH & BEYOND INC	125	126	561	62,202	小売

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)	
B/E AEROSPACE INC	69	88	419	46,477	資本財
COMCAST CORP-SPECIAL A	266	—	—	—	メディア
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	93	114	860	95,300	運輸
VERISIGN INC	75	74	636	70,492	ソフトウェア・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,660	1,660	657	72,796	メディア
CSX CORP	—	756	1,959	216,988	運輸
SEAGATE TECHNOLOGY	225	231	501	55,516	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHECK POINT SOFTWARE TECH	—	50	425	47,118	ソフトウェア・サービス
CELGENE CORP	538	604	6,431	712,190	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	103	112	964	106,745	ソフトウェア・サービス
CERNER CORP	205	229	1,270	140,737	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	98	124	859	95,224	保険
CINTAS CORP	64	74	704	77,990	商業・専門サービス
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	691	826	425	47,130	電気通信サービス
CISCO SYSTEMS	3,438	3,897	11,270	1,248,001	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MARRIOTT INTL A	145	153	1,018	112,810	消費者サービス
CA INC	211	244	783	86,739	ソフトウェア・サービス
DIRECTV	317	—	—	—	メディア
BROADCOM CORP-CL A	363	—	—	—	半導体・半導体製造装置
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	406	462	2,890	320,053	ソフトウェア・サービス
DOLLAR TREE INC	141	165	1,474	163,226	小売
EBAY	730	834	2,032	225,085	ソフトウェア・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	200	238	663	73,436	各種金融
DISH NETWORK CORPORATION-A	149	167	821	91,000	メディア
ELECTRONIC ARTS INC	209	242	1,838	203,529	ソフトウェア・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	124	141	688	76,279	運輸
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	487	510	3,828	423,887	ヘルスケア機器・サービス
FASTENAL CO	191	217	999	110,673	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	565	622	1,173	129,942	銀行
FISERV INC	164	173	1,822	201,797	ソフトウェア・サービス
FLIR SYSTEMS INC	92	116	360	39,971	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLEXTRONICS INTL LTD	386	386	482	53,441	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DENTSPLY SIRONA INC	90	104	653	72,403	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	999	1,102	9,458	1,047,365	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	216	601	66,550	自動車・自動車部品
NVIDIA CORP	352	414	1,900	210,441	半導体・半導体製造装置
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	82	—	—	—	食品・飲料・タバコ
NUANCE COMMUNICATIONS INC	175	175	290	32,191	ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	95	—	—	—	食品・飲料・タバコ
HASBRO INC	69	90	786	87,048	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	54	65	1,131	125,284	ヘルスケア機器・サービス
F5 NETWORKS INC	47	53	582	64,459	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	86	99	984	108,996	電気通信サービス
UNITED THERAPEUTICS CORP	32	32	379	42,072	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HOLOGIC INC	167	192	663	73,461	ヘルスケア機器・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	108	119	1,067	118,211	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUDSON CITY BANCORP INC	335	—	—	—	銀行
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	61	71	585	64,886	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	532	600	635	70,351	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)	
BIOPEN INC	156	170	4,832	535,082	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC	176	191	2,070	229,220	ソフトウェア・サービス
IONIS PHARMACEUTICALS INC	76	90	198	21,975	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTEL CORP	3,181	3,623	11,439	1,266,725	半導体・半導体製造装置
INCYTE CORP	106	132	1,116	123,673	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KLA-TENCOR CORP	107	118	868	96,121	半導体・半導体製造装置
LAM RESEARCH CORP	102	125	1,040	115,254	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	115	141	768	85,090	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP	166	190	896	99,255	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	219	252	802	88,854	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	184	210	792	87,746	半導体・半導体製造装置
ACTIVISION BLIZZARD INC	350	378	1,487	164,757	ソフトウェア・サービス
MICROSOFT CORP	5,240	5,817	30,436	3,370,237	ソフトウェア・サービス
MICRON TECHNOLOGY	718	805	991	109,799	半導体・半導体製造装置
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	130	148	759	84,093	半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	249	302	304	33,770	半導体・半導体製造装置
MYLAN NV	281	326	1,405	155,657	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	97	110	1,587	175,771	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	205	230	584	64,697	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NORTHERN TRUST CORP	150	164	1,220	135,154	各種金融
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	68	76	2,036	225,517	小売
PACCAR INC	237	262	1,462	161,937	資本財
PATTERSON COMPANIES INC	55	70	346	38,354	ヘルスケア機器・サービス
PAYCHEX INC	220	241	1,312	145,351	ソフトウェア・サービス
PHARMACYCLICS INC	43	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARMIN LTD	76	95	398	44,171	耐久消費財・アパレル
COSTCO WHOLESALE CORP	296	336	5,019	555,795	食品・生活必需品小売り
PRICE T ROWE GROUP INC	174	196	1,511	167,421	各種金融
QUALCOMM	1,102	1,153	6,373	705,763	半導体・半導体製造装置
REGENERON PHARMACEUTICALS	50	57	2,286	253,237	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	88	87	634	70,226	保険
ROSS STORES INC	140	318	1,718	190,275	小売
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,102	1,216	5,448	603,309	食品・飲料・タバコ
WILLIS TOWERS WATSON PLC	—	101	1,294	143,306	保険
SANDISK CORP	140	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PRICELINE GROUP INC/THE	34	38	4,851	537,195	小売
SEI INVESTMENTS COMPANY	94	108	554	61,348	各種金融
SIGMA-ALDRICH	80	—	—	—	素材
STAPLES INC	416	474	413	45,782	小売
STARBUCKS CORP	1,009	1,140	6,290	696,543	消費者サービス
NETFLIX INC	38	306	3,171	351,136	小売
STERICYCLE INC	54	67	660	73,110	商業・専門サービス
SYMANTEC CORP	465	524	900	99,696	ソフトウェア・サービス
SYNOPSYS INC	107	110	569	63,090	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	23	29	1,853	205,214	ヘルスケア機器・サービス
TEXAS INSTRUMENTS	702	776	4,735	524,323	半導体・半導体製造装置
TRACTOR SUPPLY COMPANY	89	100	968	107,249	小売
TRIMBLE NAVIGATION LTD	170	206	515	57,109	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	160	186	1,687	186,805	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)	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)	
URBAN OUTFITTERS INC	73	—	—	—	小売
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	578	670	5,159	571,358	食品・生活必需品小売り
WESTERN DIGITAL CORP	158	220	991	109,767	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SKYWORKS SOLUTIONS INC	128	142	946	104,768	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	55	66	635	70,331	消費者サービス
WHOLE FOODS MKT INC	241	251	804	89,121	食品・生活必需品小売り
NASDAQ INC	76	90	595	65,953	各種金融
CME GROUP INC	212	244	2,411	267,069	各種金融
LKQ CORP	197	225	747	82,756	小売
TD AMERITRADE HOLDING CORP	—	201	653	72,407	各種金融
XILINX INC	169	202	961	106,451	半導体・半導体製造装置
YAHOO	599	683	2,583	286,044	ソフトウェア・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	52	53	362	40,170	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIGNATURE BANK	—	37	516	57,151	銀行
LIBERTY GLOBAL PLC-A	173	201	750	83,118	メディア
GOOGLE INC-CL A	193	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MEDIVATION INC	50	117	713	79,005	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	296	341	997	110,495	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	886	894	2,588	286,638	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	98	128	352	39,060	メディア
EXPEDIA INC	66	94	1,059	117,326	小売
LIBERTY GLOBAL PLC-C	424	446	1,614	178,782	メディア
VIACOM INC-CLASS B	232	274	1,215	134,581	メディア
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	291	350	949	105,162	小売
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	—	84	123	13,700	消費者サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	218	218	346	38,325	銀行
LULULEMON ATHLETICA INC	71	84	548	60,685	耐久消費財・アパレル
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	39	45	1,050	116,278	小売
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	—	63	404	44,775	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	182	209	551	61,094	メディア
ALKERMES PLC	94	105	485	53,746	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	168	—	—	—	半導体・半導体製造装置
SPLUNK INC	86	88	499	55,354	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	110	126	1,006	111,399	商業・専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	38	49	756	83,716	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHARTER COMMUNICATION-A	57	—	—	—	メディア
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	115	1,065	118,008	半導体・半導体製造装置
FORTINET INC	—	108	369	40,891	ソフトウェア・サービス
TOWERS WATSON & CO-CL A	44	—	—	—	商業・専門サービス
TESLA MOTORS INC	64	76	1,712	189,674	自動車・自動車部品
TRIPADVISOR INC	76	87	590	65,382	小売
LIBERTY MEDIA CORP	63	—	—	—	メディア
FACEBOOK INC-A	1,354	1,741	20,786	2,301,683	ソフトウェア・サービス
KRAFT FOODS GROUP INC	391	—	—	—	食品・飲料・タバコ
T-MOBILE US INC	—	226	961	106,517	電気通信サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	97	129	609	67,446	消費者サービス
NEWS CORP-CLASS A	231	277	330	36,558	メディア
CDW CORP/DE	—	107	449	49,733	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	122	123	390	43,232	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)		
FIREEYE INC	79	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
LIBERTY SIRIUSXM-A	—	63	204	22,613	メディア	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	—	152	480	53,200	メディア	
BROADCOM LTD	—	299	4,587	507,940	半導体・半導体製造装置	
ENDO INTERNATIONAL PLC	112	159	245	27,231	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GOOGLE INC-CL C	206	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
SABRE CORP	—	133	377	41,745	ソフトウェア・サービス	
NAVIENT CORP	253	298	402	44,606	各種金融	
LIBERTY MEDIA CORP-C	130	—	—	—	メディア	
CDK GLOBAL INC	95	95	526	58,256	ソフトウェア・サービス	
QORVO INC	103	106	536	59,359	半導体・半導体製造装置	
ZILLOW GROUP INC-A	31	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
KRAFT HEINZ CO/THE	—	460	3,874	428,975	食品・飲料・タバコ	
ALPHABET INC-CL A	—	223	16,705	1,849,758	ソフトウェア・サービス	
PAYPAL HOLDINGS INC	—	830	3,165	350,466	ソフトウェア・サービス	
ZILLOW GROUP INC-C	—	62	177	19,634	ソフトウェア・サービス	
ALPHABET INC-CL C	—	238	17,473	1,934,889	ソフトウェア・サービス	
MONSTER BEVERAGE CORP	—	105	1,593	176,459	食品・飲料・タバコ	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	—	164	3,614	400,214	メディア	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	—	449	276	30,576	不動産	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	—	196	1,087	120,452	資本財	
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	209,628	240,776	1,428,283	158,153,777
			607	595	—	<59.3%>
(カナダ)				千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES	138	169	977	82,773	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	295	320	1,857	157,362	食品・生活必需品小売り	
BARRICK GOLD CORP	751	892	1,934	163,879	素材	
ATCO LTD -CLASS I	52	52	225	19,086	公益事業	
BANK MONTREAL	433	493	4,121	349,147	銀行	
BANK NOVA SCOTIA	812	919	5,976	506,307	銀行	
NATIONAL BANK OF CANADA	232	281	1,240	105,041	銀行	
BCE INC	103	103	623	52,836	電気通信サービス	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	572	666	3,100	262,611	不動産	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	212	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BOMBARDIER B	1,578	1,578	315	26,740	資本財	
SAPUTO INC	167	198	799	67,730	食品・飲料・タバコ	
CGI GROUP INC - CL A	144	170	1,031	87,420	ソフトウェア・サービス	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	—	21	474	40,237	素材	
CAE INC	184	184	302	25,633	資本財	
CAMECO CORP	287	287	438	37,111	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	233	290	1,470	124,546	電気通信サービス	
CANADIAN IMPERIAL BANK	267	311	3,185	269,823	銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	733	862	3,353	284,080	エネルギー	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	52	54	781	66,158	小売	
CANADIAN UTILITIES LTD A	72	103	374	31,684	公益事業	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	544	607	4,754	402,762	運輸	
FIRST CAPITAL REALTY INC	111	69	146	12,379	不動産	
AGRIUM INC	92	98	1,172	99,283	素材	
YAMANA GOLD INC	596	596	324	27,488	素材	

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)	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	172	176	696	58,998	耐久消費財・アパレル
OPEN TEXT CORP	80	99	759	64,309	ソフトウェア・サービス
ELDORADO GOLD CORP	456	456	250	21,251	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	38	114	255	21,683	食品・生活必需品小売り
VERMILION ENERGY INC	71	71	307	26,066	エネルギー
FINNING INTERNATIONAL INC	117	117	253	21,465	資本財
FORTIS INC	178	211	867	73,512	公益事業
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	396	—	—	—	素材
TELUS CORP	164	164	683	57,941	電気通信サービス
GREAT-WEST LIFE CO INC	196	226	810	68,679	保険
IMPERIAL OIL	192	213	903	76,562	エネルギー
ENBRIDGE	569	661	3,492	295,885	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	76	76	292	24,757	各種金融
JEAN COUTU GROUP INC A	55	55	111	9,458	食品・生活必需品小売り
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	—	710	259	21,952	素材
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,324	1,514	2,955	250,348	保険
LINAMAR CORP	—	38	210	17,802	自動車・自動車部品
LOBLAW COMPANIES LTD	147	183	1,308	110,833	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	69	69	294	24,957	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	269	307	1,632	138,304	自動車・自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	417	468	2,144	181,639	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	13	17	1,186	100,531	保険
METRO INC	157	191	849	71,923	食品・生活必需品小売り
HUSKY ENERGY INC	226	231	352	29,837	エネルギー
METHANEX CORP	64	64	272	23,050	素材
ONEX CORP	59	59	474	40,199	各種金融
TRANSCANADA CORP	477	555	3,029	256,657	エネルギー
GOLDCORP INC	580	666	1,442	122,201	素材
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	561	645	1,394	118,129	素材
POWER CORP OF CANADA	241	283	844	71,499	保険
POWER FINANCIAL CORP	166	207	662	56,097	保険
ROYAL BANK OF CANADA	972	1,146	9,236	782,404	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	118	121	638	54,077	資本財
CP RAILWAY LIMITED	107	114	1,944	164,737	運輸
ENCANA CORP	579	579	576	48,865	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	257	305	762	64,610	メディア
SUNCOR ENERGY	973	1,215	4,362	369,556	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B	372	372	463	39,239	素材
THOMSON REUTERS CORP	232	271	1,495	126,685	メディア
TORONTO-DOMINION BANK	1,251	1,432	8,258	699,578	銀行
TRANSALTA CORP	156	—	—	—	公益事業
WEST FRASER TIMBER CO LTD	43	43	193	16,402	素材
WESTON (GEORGE) LTD	35	35	400	33,955	食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP	819	819	452	38,336	素材
INTACT FINANCIAL CORP	85	99	912	77,284	保険
SILVER WHEATON CORP	286	286	680	57,609	素材
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	45	—	—	—	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	12	14	765	64,887	ソフトウェア・サービス
CATAMARAN CORPORATION	134	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス



銘柄	当期首(前期末)		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)	
FRANCO-NEVADA CORP	101	141	1,160	98,340	素材
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	—	99	425	36,040	商業・専門サービス
CI FINANCIAL CORP	150	186	531	44,981	各種金融
VERESEN INC	230	232	234	19,863	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	115	153	474	40,155	エネルギー
KEYERA CORP	112	149	570	48,309	エネルギー
ALTAGAS INCOME LTD	87	118	360	30,568	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	243	304	1,174	99,451	エネルギー
DOLLARAMA INC	83	100	924	78,348	小売
BAYTEX ENERGY CORP	172	—	—	—	エネルギー
MEG ENERGY CORP	111	—	—	—	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	566	592	1,194	101,222	エネルギー
ENERPLUS CORP	149	—	—	—	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	213	271	584	49,548	エネルギー
CANADIAN OIL SANDS LTD	289	—	—	—	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	91	126	423	35,839	エネルギー
CRESCENT POINT ENERGY CORP	295	384	857	72,640	エネルギー
ELEMENT FINANCIAL CORP	—	289	448	37,960	各種金融
INTER PIPELINE LTD	211	257	696	59,033	エネルギー
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	92	172	436	36,963	エネルギー
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	—	138	360	30,546	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	127	154	855	72,465	消費者サービス
CONSTELLATION SOFTWARE -RTS	12	—	—	—	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 26,157	株 数 28,927	110,839	9,389,177	
	銘 柄 数 <比 率> 91	87	—	<3.5%>	
(ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	141	158	1,834	225,438	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG	757	771	600	73,822	銀行
FRESENIUS SE&CO KGAA	254	299	2,036	250,249	ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	79	95	407	50,068	ソフトウェア・サービス
FUCHS PETROLUB SE -PREF	42	57	214	26,382	素材
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	39	47	474	58,357	保険
GEA GROUP AG	116	138	568	69,821	資本財
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	139	161	742	91,257	メディア
CONTINENTAL AG	72	86	1,660	204,040	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	647	762	2,034	250,000	運輸
AXEL SPRINGER SE	24	38	195	24,034	メディア
MERCK KGAA	90	104	942	115,867	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE STAMM	309	368	442	54,337	公益事業
SAP SE	664	758	5,520	678,448	ソフトウェア・サービス
E.ON SE	1,339	1,483	1,320	162,265	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	71	74	687	84,437	家庭用品・パーソナル用品
METRO STAMM	105	137	406	49,991	食品・生活必需品小売り
BAYER	556	637	5,439	668,570	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG & CO KGAA -PPD	119	135	1,406	172,863	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	609	710	4,968	610,596	素材
BEIERSDORF AG	64	75	606	74,537	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	89	101	773	95,033	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	146	166	1,303	160,238	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)		
ALLIANZ SE-REG	309	356	5,228	642,643	保険	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	147	211	268	32,951	運輸	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	117	129	2,188	269,022	保険	
VOLKSWAGEN STAMM	25	25	363	44,648	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG-PFD	108	139	1,895	232,999	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG	649	744	4,515	554,985	自動車・自動車部品	
MAN SE	23	23	222	27,369	資本財	
THYSSEN KRUPP	258	265	521	64,061	素材	
SIEMENS	526	612	6,041	742,464	資本財	
LINDE AG	124	142	1,903	233,970	素材	
DEUTSCHE BANK NAMEN	935	1,069	1,741	214,048	各種金融	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	220	252	1,899	233,460	自動車・自動車部品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	35	35	235	28,919	自動車・自動車部品	
K+S AG	142	143	322	39,615	素材	
DEUTSCHE TELEKOM	2,111	2,437	3,874	476,148	電気通信サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES	791	877	1,176	144,586	半導体・半導体製造装置	
DEUTSCHE BOERSE	133	150	1,188	146,123	各種金融	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	103	109	541	66,593	自動車・自動車部品	
FRAPORT AG	23	35	183	22,569	運輸	
LANXESS	58	72	313	38,545	素材	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	186	255	731	89,881	不動産	
SYMRISE AG	81	94	531	65,369	素材	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	13	—	—	—	メディア	
BRENTAG AG	98	115	558	68,635	資本財	
EVONIK INDUSTRIES AG	74	103	273	33,653	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	375	669	275	33,842	電気通信サービス	
HUGO BOSS AG	46	48	268	33,029	耐久消費財・アパレル	
OSRAM LICHT AG	56	78	375	46,110	資本財	
VONOVIA SE	234	365	1,136	139,735	不動産	
ZALANDO SE	—	68	184	22,639	小売	
DEUTSCHE WOHNEN AG-RTS	186	—	—	—	不動産	
国 小 計	株 数 ・ 金 額	14,685	17,002	73,549	9,039,290	
	銘柄 数 < 比 率 >	53	52	—	< 3.4% >	
(イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	812	906	1,188	146,095	保険	
INTESA SANPAOLO	8,696	9,782	2,304	283,251	銀行	
INTESA SANPAOLO-RNC	650	650	143	17,670	銀行	
UNICREDIT SPA	3,318	3,720	1,110	136,536	銀行	
MEDIOBANCA	419	419	302	37,148	各種金融	
PIRELLI & CO	161	—	—	—	自動車・自動車部品	
SAIPEM	159	5,902	218	26,825	エネルギー	
LUXOTTICA GROUP SPA	111	133	651	80,126	耐久消費財・アパレル	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	289	289	316	38,876	資本財	
ENEL	4,815	5,997	2,457	302,050	公益事業	
ENI	1,713	1,938	2,681	329,501	エネルギー	
SNAM SPA	1,373	1,698	862	105,964	公益事業	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	658	655	227	28,012	銀行	
TELECOM ITALIA ORD	6,785	8,525	741	91,157	電気通信サービス	
TELECOM ITALIA RNC	4,127	4,701	334	41,169	電気通信サービス	

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)		
ATLANTIA SPA	271	335	808	99,315	運輸	
TERNA SPA	949	1,137	567	69,769	公益事業	
EXOR SPA	73	73	251	30,960	各種金融	
PRYSMIAN SPA	147	147	325	40,021	資本財	
ENEL GREEN POWER SPA	1,232	—	—	—	公益事業	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	711	950	170	20,916	保険	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	37,478	47,965	15,666	1,925,370	
		21	19	—	<0.7%>	
(フランス)						
BOUYGUES ORD	139	168	489	60,116	資本財	
AIR LIQUIDE	230	261	2,556	314,208	素材	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	293	333	673	82,772	公益事業	
LOREAL	167	190	3,183	391,307	家庭用品・パーソナル用品	
CHRISTIAN DIOR	34	40	590	72,579	耐久消費財・アパレル	
LVMH	186	211	3,065	376,712	耐久消費財・アパレル	
THALES SA	61	78	612	75,230	資本財	
CAP GEMINI SA	105	121	1,047	128,774	ソフトウェア・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	36	36	193	23,766	食品・生活必需品小売り	
INGENICO GROUP	—	38	420	51,737	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PUBLICIS GROUPE	128	149	966	118,820	メディア	
LAFARGE SA	128	—	—	—	素材	
LAGADERE S. C. A	90	90	194	23,909	メディア	
BOLLORE	618	618	201	24,823	運輸	
MICHELIN	126	148	1,352	166,203	自動車・自動車部品	
PERNOD-RICARD	142	167	1,641	201,727	食品・飲料・タバコ	
RENAULT SA	130	143	1,202	147,738	自動車・自動車部品	
REMY COINTREAU	15	15	116	14,316	食品・飲料・タバコ	
VINCI S. A.	311	364	2,488	305,786	資本財	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	373	425	2,478	304,651	資本財	
VIVENDI	764	891	1,595	196,126	メディア	
TECHNIP S. A.	72	72	349	42,971	エネルギー	
TOTAL SA	1,437	1,690	7,423	912,303	エネルギー	
VALLOUREC	74	—	—	—	資本財	
VALEO SA	54	64	887	109,076	自動車・自動車部品	
ORANGE	1,254	1,517	2,346	288,339	電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	16	19	636	78,206	耐久消費財・アパレル	
SOCIETE BIC SA	18	18	235	28,975	商業・専門サービス	
DASSAULT SYSTEMES SA	82	95	676	83,176	ソフトウェア・サービス	
KERING	48	59	869	106,804	耐久消費財・アパレル	
CNP ASSURANCES	118	118	177	21,844	保険	
CARREFOUR	364	426	1,038	127,651	食品・生活必需品小売り	
ATOS SE	52	65	541	66,527	ソフトウェア・サービス	
SANOFI	792	905	6,683	821,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACCOR	143	149	597	73,446	消費者サービス	
SOCIETE GENERALE	497	563	2,082	255,953	銀行	
ALCATEL-LUCENT SA	1,811	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
EURAZEO	27	29	170	20,981	各種金融	
SODEXO	60	70	662	81,408	消費者サービス	
AXA	1,334	1,550	3,520	432,705	保険	

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)		
PEUGEOT SA	299	313	441	54,254	自動車・自動車部品	
JC DECAUX SA	46	46	169	20,811	メディア	
ESSILOR INTERNATIONAL	137	161	1,908	234,503	ヘルスケア機器・サービス	
CREDIT AGRICOLE SA	674	837	761	93,554	銀行	
ZODIAC AEROSPACE	131	178	369	45,387	資本財	
BNP PARIBAS	717	822	4,091	502,848	銀行	
SAINT-GOBAIN	323	359	1,441	177,155	資本財	
WENDEL	18	18	196	24,131	各種金融	
ILIAD SA	17	20	406	49,970	電気通信サービス	
IMERYS SA	19	30	190	23,449	素材	
DANONE (GROUPE)	387	450	2,846	349,854	食品・飲料・タバコ	
SAFRAN SA	196	236	1,486	182,750	資本財	
ENGIE	988	1,151	1,598	196,450	公益事業	
ALSTOM	138	112	252	31,001	資本財	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	119	119	213	26,213	メディア	
ELECTRICITE DE FRANCE	157	157	192	23,707	公益事業	
ARKEMA	42	59	436	53,667	素材	
LEGRAND SA	180	205	1,036	127,443	資本財	
ADP	17	23	262	32,202	運輸	
NATIXIS	669	699	312	38,367	銀行	
SCOR SE	103	133	404	49,736	保険	
REXEL SA	182	243	333	40,935	資本財	
BUREAU VERITAS SA	188	195	377	46,415	商業・専門サービス	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	301	364	426	52,363	運輸	
SUEZ	207	207	317	39,080	公益事業	
EDENRED	133	189	314	38,653	商業・専門サービス	
NUMERICABLE-SFR	59	75	210	25,852	電気通信サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	18,809	19,328	74,969	9,213,789	
(オランダ)		66	64	—	<3.5%>	
AIRBUS GROUP SE	393	449	2,516	309,322	資本財	
RELX NV	453	791	1,231	151,399	メディア	
RANDSTAD HOLDING NV	79	95	464	57,038	商業・専門サービス	
KONINKLIJKE AHOLD NV	612	660	1,317	161,878	食品・生活必需品小売り	
AKZO NOBEL	163	189	1,175	144,416	素材	
UNILEVER NV-CVA	1,087	1,258	5,122	629,602	家庭用品・パーソナル用品	
WOLTERS KLUWER	193	223	803	98,689	メディア	
QIAGEN N. V.	149	149	288	35,502	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KONINKLIJKE DSM NV	128	134	725	89,192	素材	
VOPAK	45	45	211	25,992	エネルギー	
AEGON	1,272	1,318	603	74,123	保険	
ASML HOLDING NV	238	264	2,373	291,693	半導体・半導体製造装置	
KPN (KON.)	2,061	2,584	930	114,405	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS	425	425	230	28,363	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS	610	748	1,821	223,879	資本財	
ING GROEP NV-CVA	2,628	2,963	3,372	414,484	銀行	
HEINEKEN NV	157	175	1,469	180,619	食品・飲料・タバコ	
GEMALTO	58	61	344	42,306	ソフトウェア・サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	63	76	561	68,956	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)		
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	58	58	193	23,809	資本財	
TNT EXPRESS	292	—	—	—	運輸	
DELTA LLOYD NV	133	—	—	—	保険	
OCI NV	54	54	70	8,624	素材	
FERRARI NV	—	109	410	50,439	自動車・自動車部品	
CNH INDUSTRIAL NV	657	657	415	51,051	資本財	
NN GROUP NV	120	183	535	65,804	保険	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	603	668	415	51,113	自動車・自動車部品	
ALTICE NV -B	—	104	160	19,754	メディア	
ALTICE NV -A	—	283	436	53,652	メディア	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	12,743 26	14,735 27	28,202 —	3,466,116 <1.3%>	
(スペイン)						
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	297	396	580	71,361	運輸	
IBERDROLA SA	3,713	4,281	2,643	324,900	公益事業	
ENDESA	202	247	453	55,779	公益事業	
BANKINTER SA	465	465	320	39,337	銀行	
BANCO BILBAO VIZCAYA	4,349	4,886	2,960	363,785	銀行	
GAS NATURAL SDG SA	236	265	473	58,203	公益事業	
REPSOL SA	718	851	1,008	123,923	エネルギー	
BANCO SANTANDER SA	9,771	11,318	4,980	612,058	銀行	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	72	81	645	79,340	公益事業	
TELEFONICA	2,995	3,423	3,262	400,977	電気通信サービス	
ZARDOYA OTIS SA	134	134	127	15,641	資本財	
INDITEX	738	830	2,498	307,081	小売	
ENAGAS	152	182	497	61,193	公益事業	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	142	142	417	51,353	資本財	
GRIFOLS SA	98	227	457	56,172	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FERROVIAL SA	323	357	678	83,350	資本財	
MAPFRE SA	650	909	211	26,052	保険	
BANCO DE SABADELL SA	3,467	3,569	572	70,374	銀行	
CAIXABANK	1,563	1,847	460	56,605	銀行	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	311	329	1,353	166,355	ソフトウェア・サービス	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	602	602	431	53,006	運輸	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	462	462	249	30,664	食品・生活必需品小売り	
FERROVIAL SA - RTS	—	357	11	1,411	資本財	
AENA SA	50	56	684	84,115	運輸	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	31,521 23	36,228 24	25,980 —	3,193,047 <1.2%>	
(ベルギー)						
UMICORE	68	68	312	38,429	素材	
DELHAIZE GROUP	71	74	710	87,275	食品・生活必需品小売り	
KBC GROEP NV	177	197	1,057	129,908	銀行	
ANHEUSER-BUSCH INBEV	536	619	7,060	867,772	食品・飲料・タバコ	
SOLVAY SA	41	56	515	63,311	素材	
UCB (GROUPE)	82	93	604	74,308	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLRUYT SA	44	63	332	40,914	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	50	62	475	58,449	各種金融	
AGEAS	138	160	581	71,482	保険	

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)	
PROXIMUS	100	131	385	47,384	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	32	49	214	26,348	メディア
国 小 計	1,345	1,578	12,250	1,505,584	
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	11	11	—	<0.6%>
(オーストリア)					
OMV AG	98	98	250	30,742	エネルギー
VOESTALPINE AG	78	78	237	29,192	素材
ERSTE GROUP BANK AG	173	205	499	61,420	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	91	91	109	13,495	銀行
ANDRITZ AG	52	52	237	29,151	資本財
国 小 計	494	526	1,334	164,003	
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	5	5	—	<0.1%>
(ルクセンブルク)					
TENARIS SA	348	348	418	51,420	エネルギー
SES	220	269	536	65,946	メディア
ARCELORMITTAL	635	751	321	39,500	素材
RTL GROUP	24	24	205	25,257	メディア
ALTICE SA	58	—	—	—	メディア
国 小 計	1,286	1,393	1,481	182,124	
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	5	4	—	<0.1%>
(フィンランド)					
WARTSILA OYJ	97	114	422	51,881	資本財
UPM KYMMENE CORP	364	383	662	81,440	素材
STORA ENSO OYJ R	360	483	367	45,149	素材
SAMPO OYJ-A SHS	310	353	1,428	175,581	保険
FORTUM OYJ	286	334	454	55,859	公益事業
ELISA A	100	100	338	41,645	電気通信サービス
METSO OYJ	65	95	200	24,581	資本財
NOKIA OYJ	2,502	4,178	2,114	259,866	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OIL OYJ	93	93	280	34,418	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ	76	76	241	29,741	自動車・自動車部品
KONE OYJ-B	220	261	1,085	133,439	資本財
ORION OYJ-CLASS B	58	79	259	31,873	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
国 小 計	4,538	6,556	7,855	965,478	
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	12	12	—	<0.4%>
(アイルランド)					
CRH	564	643	1,764	216,810	素材
KERRY GROUP PLC-A	110	127	1,022	125,719	食品・飲料・タバコ
PADDY POWER PLC	—	65	794	97,702	消費者サービス
国 小 計	674	837	3,582	440,232	
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2	3	—	<0.2%>
(ポルトガル)					
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,594	1,932	573	70,440	公益事業
BCP BANCO COMERCIAL NOM	24,400	24,400	78	9,596	銀行
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	258	398	476	58,501	エネルギー
JERONIMO MARTINS	152	202	291	35,809	食品・生活必需品小売り
国 小 計	26,405	26,933	1,418	174,348	
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	4	4	—	<0.1%>
ユ ー ロ 計	149,983	173,085	246,292	30,269,384	
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	228	225	—	<11.4%>

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)	
(イギリス)				千イギリスポンド	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	583	742	208	33,790	各種金融
AMEC FOSTER WHEELER PLC	261	—	—	—	エネルギー
ANTOFAGASTA PLC	254	254	110	17,954	素材
ASHTED GROUP PLC	327	384	378	61,257	資本財
SEVERN TRENT PLC	154	181	414	67,134	公益事業
BHP BILLITON PLC	1,398	1,633	1,372	222,024	素材
ARM HOLDINGS PLC	932	1,067	1,048	169,659	半導体・半導体製造装置
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	704	732	438	70,894	耐久消費財・アパレル
SKY PLC	689	791	768	124,361	メディア
AGGREKO PLC	187	198	225	36,414	商業・専門サービス
TULLOW OIL PLC	672	—	—	—	エネルギー
BUNZL PLC	213	248	502	81,289	資本財
CAPITA GROUP PLC	421	533	573	92,760	商業・専門サービス
AVIVA PIC	2,677	3,143	1,432	231,729	保険
CRODA INTERNATIONAL PLC	86	102	302	48,887	素材
DIAGEO	1,699	1,938	3,650	590,638	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC	79	98	269	43,677	各種金融
BAE SYSTEMS PLC	2,100	2,474	1,195	193,358	資本財
PROVIDENT FINANCIAL PLC	—	111	323	52,397	各種金融
BRITISH AMERICAN TOBACCO	1,255	1,432	6,026	975,010	食品・飲料・タバコ
STANDARD CHARTERED PLC	1,668	2,606	1,414	228,864	銀行
REXAM PLC	449	547	343	55,589	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	634	740	2,804	453,699	食品・飲料・タバコ
IMI PLC	175	175	175	28,407	資本財
JOHNSON MATTHEY PLC	131	143	414	66,999	素材
SABMILLER PLC	640	749	3,211	519,590	食品・飲料・タバコ
ANGLO AMERICAN PLC	926	986	603	97,713	素材
COMPASS GROUP PLC	1,109	1,279	1,647	266,602	消費者サービス
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	13,118	15,232	6,831	1,105,209	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP	4,025	4,458	1,069	173,112	保険
UNILEVER PLC	850	990	3,123	505,350	家庭用品・パーソナル用品
MEGGITT PLC	509	662	257	41,653	資本財
MORRISON SUPERMARKETS	1,359	1,681	332	53,857	食品・生活必需品小売り
UNITED UTILITIES GROUP PLC	436	504	489	79,257	公益事業
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	702	702	338	54,759	保険
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	237	272	805	130,278	食品・飲料・タバコ
PEARSON	545	663	549	88,877	メディア
PERSIMMON PLC	198	226	478	77,360	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL	1,729	1,963	2,737	442,930	保険
RIO TINTO PLC REG	842	958	1,881	304,476	素材
VODAFONE GROUP PLC	17,859	20,438	4,753	769,141	電気通信サービス
RECKITT BENCKISER PLC	428	491	3,379	546,739	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	756	852	1,065	172,429	メディア
OLD MUTUAL PLC	3,330	3,975	707	114,477	保険
ROYAL BANK OF SCOTLAND	1,749	2,615	656	106,285	銀行
ST JAMES' S PLACE PLC	—	372	347	56,234	保険
TRAVIS PERKINS PLC	178	185	357	57,848	資本財
SSE PLC	656	788	1,218	197,067	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)	
BP PLC	12,271	14,089	5,099	825,079	エネルギー
SAGE GROUP PLC	694	801	484	78,394	ソフトウェア・サービス
SMITHS GROUP PLC	248	296	333	53,932	資本財
LLOYDS BANKING GROUP PLC	38,470	44,675	3,236	523,675	銀行
TATE & LYLE	291	405	254	41,095	食品・飲料・タバコ
BG GROUP	2,261	—	—	—	エネルギー
TAYLOR WIMPAY PLC	2,307	2,332	480	77,738	耐久消費財・アパレル
TESCO	5,400	6,020	1,006	162,901	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	623	740	408	66,146	各種金融
SMITH & NEPHEW PLC	596	689	812	131,480	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE	3,275	3,742	5,436	879,494	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE	133	133	162	26,256	資本財
BABCOCK INTL GROUP PLC	192	196	203	32,880	商業・専門サービス
WPP PLC	874	1,008	1,595	258,200	メディア
WOLSELEY LTD	170	202	826	133,648	資本財
ASTRAZENECA	851	973	3,915	633,423	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEW GKN	1,028	1,234	337	54,598	自動車・自動車部品
BT GROUP PLC	5,659	6,533	2,952	477,648	電気通信サービス
LONMIN PLC	79	—	—	—	素材
CARNIVAL PLC	118	136	469	75,940	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	2,493	2,892	2,918	472,174	公益事業
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,147	1,168	451	73,063	小売
BARCLAYS	11,110	12,832	2,389	386,579	銀行
INTERTEK GROUP PLC	102	124	391	63,348	商業・専門サービス
WILLIAM HILL	559	703	219	35,555	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	282	328	360	58,331	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	98	112	620	100,314	小売
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,255	1,411	868	140,481	資本財
KINGFISHER PLC	1,642	1,651	618	100,098	小売
ICAP PLC	422	438	188	30,492	各種金融
ITV PLC	2,560	2,954	651	105,395	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	208	233	636	102,938	各種金融
SAINSBURY (J) PLC	868	1,141	307	49,714	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD	59	72	418	67,678	素材
G4S PLC	1,006	1,325	252	40,811	商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC	159	162	316	51,204	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	—	105	352	57,103	耐久消費財・アパレル
CENTRICA PLC	3,311	3,756	771	124,761	公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,621	3,032	5,078	821,701	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,647	2,983	5,013	811,186	エネルギー
INTERCONTINENTAL HOTELS	148	145	389	63,027	消費者サービス
WHITBREAD PLC	121	146	623	100,807	消費者サービス
COBHAM PLC	723	900	147	23,942	資本財
INMARSAT PLC	275	336	251	40,728	電気通信サービス
PETROFAC LTD	167	167	131	21,210	エネルギー
SHIRE PLC	390	449	1,925	311,603	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TUI AG-DI	320	354	372	60,266	消費者サービス
STANDARD LIFE PLC	1,332	1,416	485	78,548	保険
INVESTEC PLC	364	364	177	28,762	各種金融



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)		
EXPERIAN PLC	660	751	969	156,870	商業・専門サービス	
MONDI PLC	261	272	370	59,946	素材	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	180	180	68	11,056	小売	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	197	204	275	44,575	各種金融	
FRESNILLO PLC	177	177	180	29,194	素材	
MELROSE INDUSTRIES PLC	644	—	—	—	資本財	
GLENCORE PLC	7,345	9,034	1,213	196,297	素材	
DIXONS CARPHONE PLC	667	667	297	48,146	小売	
EASYJET PLC	116	116	180	29,210	運輸	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,034	1,137	422	68,403	保険	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	—	300	261	42,289	ヘルスケア機器・サービス	
COCA-COLA HBC AG-CDI	139	139	185	30,032	食品・飲料・タバコ	
ROYAL MAIL PLC	449	751	400	64,729	運輸	
MERLIN ENTERTAINME	485	485	205	33,228	消費者サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC	—	800	318	51,481	ソフトウェア・サービス	
WORLDPAY GROUP PLC	—	916	249	40,371	ソフトウェア・サービス	
小 計	193,267	223,194	122,184	19,768,260		
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	107	108	—	<7.4%>		
(スイス)			千スイスフラン			
SULZER AG-REG	16	16	140	15,651	資本財	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	157	17,513	食品・飲料・タバコ	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	0.62	0.75	466	51,884	食品・飲料・タバコ	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	0.07	0.08	592	65,899	食品・飲料・タバコ	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	28	39	228	25,401	耐久消費財・アパレル	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	4	6	326	36,334	素材	
SWISS PRIME SITE-REG	38	50	430	47,946	不動産	
PARGESA HOLDING SA-BR	18	18	124	13,855	各種金融	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	11	12	511	56,946	各種金融	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	13	13	247	27,569	資本財	
SYNGENTA AG	63	70	2,796	311,245	素材	
SIKA AG-BR	1	1	703	78,349	素材	
SGS SA	3	4	872	97,162	商業・専門サービス	
SWISSCOM	18	20	988	109,978	電気通信サービス	
GEBERIT AG-REG	25	30	1,140	126,953	資本財	
GIVAUDAN-REG	6	7	1,403	156,180	素材	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	101	116	2,835	315,628	保険	
NOVARTIS	1,544	1,746	13,902	1,547,500	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABB LTD	1,469	1,669	3,499	389,478	資本財	
ROCHE HOLDING GENUSS	471	539	14,201	1,580,736	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	119	120	727	80,959	商業・専門サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD	155	358	1,611	179,336	素材	
NESTLE SA - REGISTERED	2,164	2,445	18,157	2,021,124	食品・飲料・タバコ	
BALOISE HOLDING AG	31	38	474	52,864	保険	
SONOVA HOLDING AG-REG	34	41	549	61,197	ヘルスケア機器・サービス	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	32	40	569	63,410	運輸	
CREDIT SUISSE GROUP AG	1,040	1,399	1,979	220,352	各種金融	
SWATCH GROUP AG(BEARER)	21	24	731	81,422	耐久消費財・アパレル	
LONZA GROUP AG-REG	33	39	678	75,552	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	20	24	629	70,068	保険	

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)	
GALENICA AG-REG	—	2	380	42,302	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DUFREY AG-REG	—	29	395	43,997	小売
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	28	33	621	69,227	資本財
ACTELION LTD-REG	65	81	1,328	147,924	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARYZTA AG	56	75	314	34,978	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	349	397	2,335	259,982	耐久消費財・アパレル
JULIUS BAER GROUP LTD	143	162	714	79,571	各種金融
SWISS RE LTD	244	273	2,439	271,560	保険
TRANSOCEAN LTD	227	—	—	—	エネルギー
UBS GROUP AG	2,477	2,861	4,388	488,521	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	11,086 38	12,818 39	84,597 —	9,416,572 <3.5%>
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
ATLAS COPCO A	450	515	11,103	147,004	資本財
SKF AB-B	270	334	4,978	65,913	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	1,040	1,188	9,633	127,545	銀行
SWEDBANK AB-A	617	698	12,966	171,674	銀行
SCA SV CELLULOSA B	405	450	11,857	156,991	家庭用品・パーソナル用品
VOLVO B	1,032	1,188	10,997	145,605	資本財
SWEDISH MATCH AB	124	151	4,305	57,002	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS	213	213	1,580	20,921	電気通信サービス
NORDEA BANK AB	2,079	2,330	19,147	253,508	銀行
ELECTROLUX AB-SER B	152	181	4,126	54,633	耐久消費財・アパレル
SECURITAS B	228	228	2,985	39,530	商業・専門サービス
INVESTOR AB-B SHS	312	355	10,412	137,859	各種金融
HENNES & MAURITZ B	632	722	18,682	247,349	小売
ASSA ABLOY AB-B	224	758	12,963	171,637	資本財
SVENSKA HANDELSBK A	1,021	1,174	12,673	167,802	銀行
ERICSSON (LM) B	2,027	2,325	14,974	198,262	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SANDVIK AB	673	791	6,558	86,834	資本財
TELIA CO AB	1,739	2,028	8,018	106,160	電気通信サービス
SKANSKA B	261	285	5,115	67,728	資本財
LUNDIN PETROLEUM AB	141	141	2,131	28,220	エネルギー
BOLIDEN AB	181	181	2,674	35,414	素材
ALFA LAVAL AB	192	257	3,242	42,927	資本財
GETINGE AB-B SHS	127	158	2,757	36,503	ヘルスケア機器・サービス
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	146	181	3,718	49,233	各種金融
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	43	43	2,099	27,798	電気通信サービス
ELEKTA AB-B SHS	211	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ICA GRUPPEN AB	57	57	1,628	21,560	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	277	277	1,861	24,641	耐久消費財・アパレル
ATLAS COPCO B	248	290	5,767	76,367	資本財
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	127	127	1,822	24,134	各種金融
HEXAGON AB-B SHS	175	186	6,017	79,674	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	450	—	—	—	資本財
ATLAS COPCO AB- B REDEMPTION	248	—	—	—	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	16,140 33	17,828 30	216,801 —	2,870,445 <1.1%>

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)
(ノルウェー)							
DNB ASA	637		802	8,647	114,577	銀行	
NORSK HYDRO	838		1,061	3,511	46,526	素材	
TELENOR ASA	479		608	8,563	113,467	電気通信サービス	
SCHIBSTED ASA-CL A	—		59	1,573	20,843	メディア	
SUBSEA 7 SA	183		—	—	—	エネルギー	
ORKLA	580		602	4,594	60,878	食品・飲料・タバコ	
STATOIL ASA	763		869	11,748	155,668	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	112		134	4,081	54,078	素材	
SEADRILL LTD	234		—	—	—	エネルギー	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	134		134	1,921	25,453	保険	
SCHIBSTED ASA-B SHS	—		69	1,724	22,851	メディア	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,965 9	4,342 9	46,365 —	614,346 <0.2%>		
(デンマーク)							
CARLSBERG AS-B	68		80	5,179	85,612	食品・飲料・タバコ	
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	4		5	4,333	71,628	運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	2		2	2,463	40,725	運輸	
DANSKE BANK A/S	490		546	10,515	173,818	銀行	
GENMAB A/S	—		45	5,310	87,784	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S	167		172	5,481	90,609	素材	
TDC A/S	524		524	1,782	29,461	電気通信サービス	
DSV A/S	111		145	4,397	72,687	運輸	
WILLIAM DEMANT HOLDING	14		74	1,062	17,563	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSYEMS	143		174	8,311	137,395	資本財	
NOVO NORDISK A/S-B	1,272		1,509	55,993	925,579	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLOPLAST-B	69		83	4,192	69,302	ヘルスケア機器・サービス	
TRYG A/S	64		98	1,287	21,281	保険	
PANDORA A/S	72		80	8,044	132,974	耐久消費財・アパレル	
CHR HANSEN HOLDING A/S	—		74	3,131	51,761	素材	
ISS A/S	114		116	3,129	51,725	商業・専門サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,124 14	3,734 16	124,616 —	2,059,913 <0.8%>		
(オーストラリア)							
RAMSAY HEALTH CARE LTD	106		107	783	62,247	ヘルスケア機器・サービス	
AGL ENERGY LTD	435		506	944	75,063	公益事業	
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,844		2,255	5,830	463,472	銀行	
AMCOR	771		880	1,442	114,674	素材	
WESTPAC BANKING	2,076		2,566	7,952	632,134	銀行	
BANK OF QUEENSLAND LTD	243		243	283	22,574	銀行	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	904		1,360	410	32,657	素材	
TELSTRA CORP	2,773		3,406	1,931	153,530	電気通信サービス	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	312		312	318	25,350	銀行	
BRAMBLES LTD	996		1,165	1,506	119,742	商業・専門サービス	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	380		380	336	26,765	食品・飲料・タバコ	
ASX LTD	126		158	702	55,876	各種金融	
BHP BILLITON LTD	2,149		2,439	4,725	375,668	素材	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	203		206	691	54,933	エネルギー	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	308		579	261	20,808	小売	

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)		
COMPUTERSHARE LIMITED	308	308	330	26,260	ソフトウェア・サービス	
CSL LIMITED	322	351	4,072	323,716	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REA GROUP LTD	35	35	198	15,779	メディア	
TRANSURBAN GROUP	1,276	1,549	1,851	147,183	運輸	
COCHLEAR LIMITED	38	38	460	36,634	ヘルスケア機器・サービス	
ORIGIN ENERGY LIMITED	802	1,314	747	59,453	エネルギー	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	1,081	1,316	10,385	825,545	銀行	
BORAL LIMITED	468	689	470	37,390	素材	
RIO TINTO LTD	305	310	1,391	110,572	素材	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	459	437	554	44,106	消費者サービス	
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	1,496	1,752	1,032	82,072	保険	
TPG TELECOM LTD	200	200	247	19,634	電気通信サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	32	32	106	8,504	消費者サービス	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	294	373	785	62,458	素材	
ORICA LTD	228	292	406	32,275	素材	
CIMIC GROUP LIMITED	53	92	349	27,820	資本財	
MACQUARIE GROUP LIMITED	191	244	1,797	142,898	各種金融	
WORLEYPARSONS LTD	150	—	—	—	エネルギー	
SUNCORP GROUP LIMITED	819	951	1,221	97,119	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	1,755	1,990	5,434	431,975	銀行	
NEWCREST MINING LIMITED	568	582	1,113	88,497	素材	
OIL SEARCH LTD	—	1,017	695	55,256	エネルギー	
INCITEC PIVOT LTD	1,101	1,101	371	29,517	素材	
AMP LTD	1,884	2,177	1,230	97,773	保険	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	363	341	102	8,144	運輸	
QBE INSURANCE GROUP	969	1,005	1,250	99,425	保険	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	—	440	412	32,752	各種金融	
SANTOS	747	1,281	579	46,037	エネルギー	
SONIC HEALTHCARE LTD	247	317	686	54,560	ヘルスケア機器・サービス	
TABCORP HOLDINGS	627	627	274	21,840	消費者サービス	
WESFARMERS LTD	770	878	3,614	287,350	食品・生活必需品小売り	
ALUMINA LIMITED	1,704	1,704	244	19,443	素材	
ILUKA RESOURCES LTD	285	285	184	14,640	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	511	592	1,649	131,144	エネルギー	
WOOLWORTHS LTD	861	968	2,139	170,058	食品・生活必需品小売り	
SEEK LTD	213	213	343	27,278	商業・専門サービス	
TATTS GROUP LTD	933	1,242	486	38,706	消費者サービス	
AUSNET SERVICES	1,202	1,202	189	15,052	公益事業	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	202	202	129	10,306	各種金融	
ASCIANO GROUP	640	470	417	33,153	運輸	
CROWN RESORTS LTD	212	303	367	29,218	消費者サービス	
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	—	280	263	20,921	電気通信サービス	
AURIZON HOLDINGS LTD	1,362	1,594	714	56,795	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	385	583	608	48,351	食品・飲料・タバコ	
HEALTHSCOPE LTD	885	1,402	420	33,452	ヘルスケア機器・サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,133	2,145	680	54,053	保険	
SOUTH32 LTD	3,548	3,548	571	45,413	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	46,319	55,363	79,708	6,336,052	
	銘柄数 <比率>	59	61	—	<2.4%>	

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)		
(ニュージーランド)						
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	611	849	544	40,311	運輸	
CONTACT ENERGY LTD	255	589	320	23,745	公益事業	
RYMAN HEALTHCARE LTD	220	220	209	15,516	ヘルスケア機器・サービス	
FLETCHER BUILDING LTD	465	465	408	30,256	素材	
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,080	1,454	542	40,163	電気通信サービス	
MIGHTY RIVER POWER	617	617	188	13,986	公益事業	
MERIDIAN ENERGY LTD	1,105	1,105	292	21,686	公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	4,355	5,302	2,507	185,666	
		7	7	—	<0.1%>	
(香港)						
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	138	138	782	11,157	半導体・半導体製造装置	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,390	1,730	2,543	36,264	不動産	
BANK EAST ASIA	847	847	2,373	33,842	銀行	
CLP HOLDINGS	1,265	1,455	10,636	151,670	公益事業	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	860	860	1,057	15,084	運輸	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	410	500	3,647	52,013	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	755	898	16,370	233,443	各種金融	
LI & FUNG	3,788	3,788	1,500	21,390	耐久消費財・アパレル	
MTR CORP	940	1,140	4,138	59,010	運輸	
FIRST PACIFIC CO	1,280	1,280	615	8,779	各種金融	
HANG SENG BANK	488	597	8,190	116,801	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMEN	676	863	3,946	56,279	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	880	1,110	8,513	121,405	公益事業	
WHARF HOLDINGS	960	990	4,103	58,516	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	4,451	5,416	7,995	114,011	公益事業	
HUTCHISON WHAMPOA	1,440	—	—	—	資本財	
HYSAN DEVELOPMENT CO	400	400	1,316	18,766	不動産	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,480	1,760	4,532	64,626	消費者サービス	
KERRY PROPERTIES LTD	385	385	736	10,497	不動産	
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	2,360	3,020	7,021	100,126	銀行	
NWS HOLDINGS LTD	990	990	1,223	17,449	資本財	
PCCW LTD	2,320	3,570	1,795	25,606	電気通信サービス	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	465	465	1,348	19,229	耐久消費財・アパレル	
NEW WORLD DEVELOPMENT	3,235	3,995	2,928	41,758	不動産	
SHANGRI-LA ASIA LTD	980	980	859	12,255	消費者サービス	
SINO LAND CO	2,274	2,354	2,758	39,341	不動産	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,170	1,370	12,227	174,360	不動産	
SWIRE PACIFIC A	405	405	3,377	48,166	不動産	
WHEELLOCK & CO LTD	650	650	2,187	31,190	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	935	935	2,879	41,065	耐久消費財・アパレル	
SJM HOLDINGS LTD	1,320	1,320	646	9,223	消費者サービス	
WYNN MACAU LTD	1,028	1,028	1,213	17,297	消費者サービス	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	672	672	705	10,061	消費者サービス	
AIA GROUP LTD	8,048	9,318	41,791	595,942	保険	
SANDS CHINA LTD	1,540	1,740	5,037	71,831	消費者サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	692	962	1,948	27,779	不動産	
WH GROUP LTD	4,650	4,765	2,777	39,614	食品・飲料・タバコ	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	930	2,059	18,611	265,403	資本財	

銘柄	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)	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING		—	2,074	10,001	142,618	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	57,498 38	66,832 38	204,339 —	2,913,885 <1.1%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING		1,090	1,090	349	28,061	資本財
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		4,190	4,190	159	12,769	食品・飲料・タバコ
DBS GROUP		1,184	1,398	2,172	174,233	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD		240	240	200	16,072	不動産
SEMBCORP MARINE LTD		609	609	95	7,619	資本財
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		60	99	333	26,717	小売
SINGAPORE EXCHANGE LTD		550	550	420	33,700	各種金融
CAPITALAND LTD		1,655	1,855	552	44,333	不動産
GENTING SINGAPORE PLC		4,250	4,250	312	25,052	消費者サービス
KEPPEL CORP LTD		943	1,123	609	48,905	資本財
COMFORTDELGRO CORP LTD		1,450	1,450	401	32,212	運輸
OCBC BANK		1,971	2,450	2,097	168,195	銀行
SINGAPORE AIRLINES		315	433	460	36,907	運輸
UNITED OVERSEAS BANK		852	996	1,813	145,460	銀行
UOL GROUP LIMITED		325	325	184	14,804	不動産
SINGAPORE PRESS HOLDINGS		1,248	1,271	495	39,754	メディア
NOBLE GROUP LTD		2,975	2,975	90	7,278	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		5,443	6,289	2,471	198,234	電気通信サービス
STARHUB LTD		380	380	133	10,727	電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		570	570	160	12,845	資本財
WILMAR INTERNATIONAL LTD		1,502	1,550	517	41,519	食品・飲料・タバコ
YANGZIJIANG SHIPBUILDING		1,330	1,330	123	9,866	資本財
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L		1,990	2,490	445	35,745	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	35,123 23	37,914 23	14,601 —	1,171,017 <0.4%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
BANK HAPOLIM BM		757	800	1,554	44,759	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		949	949	1,302	37,493	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP		1,116	1,546	1,131	32,582	電気通信サービス
DELEK GROUP LTD		4	4	313	9,025	エネルギー
ISRAEL CHEMICALS LTD		327	327	515	14,843	素材
NICE SYSTEMS LTD		33	48	1,221	35,168	ソフトウェア・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD		576	686	13,652	393,043	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	—	—	—	素材
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		82	82	365	10,512	銀行
AZRIELI GROUP		37	17	294	8,465	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	3,886 10	4,463 9	20,350 —	585,894 <0.2%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	760,536 1,264	874,583 1,247	— —	243,734,395 <91.4%>	

(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		10		11	1,424	157,710
SL GREEN REALTY CORP		6		7	738	81,814
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC		61		70	742	82,266
PROLOGIS INC		33		40	1,946	215,572
AVALONBAY COMMUNITIES INC		8		10	1,912	211,728
CAMDEN PROPERTY TRUST		5		7	604	66,930
DUKE REALTY CORP		21		26	617	68,368
CROWN CASTLE INTL CORP		22		25	2,314	256,293
ESSEX PROPERTY TRUST		4		5	1,179	130,622
EQUITY RESIDENTIAL PPTY		24		27	1,909	211,388
FEDERAL REALTY INVS TRUST		4		5	846	93,748
HCP INC		30		34	1,135	125,703
WELLTOWER INC		23		26	1,868	206,943
KIMCO REALTY CORP		26		32	919	101,866
LIBERTY PROPERTY TRUST		9		11	441	48,919
IRON MOUNTAIN INC		14		14	517	57,349
MACERICH CO/THE		9		10	771	85,445
HOST HOTELS AND RESORTS INC		51		59	908	100,613
MID-AMERICA APARTMENT COMM		—		5	606	67,194
PLUM CREEK TIMBER COMMON		11		—	—	—
REALTY INCOME CORP		15		19	1,173	129,961
REGENCY CENTERS CORP		6		7	561	62,137
UDR INC		16		20	757	83,923
SIMON PROPERTY GROUP		21		23	4,711	521,701
PUBLIC STORAGE		9		11	2,847	315,343
VENTAS INC		21		26	1,728	191,389
VORNADO REALTY TRUST		11		12	1,201	133,005
EXTRA SPACE STORAGE INC		7		8	817	90,481
DIGITAL REALTY TRUST INC		8		11	1,087	120,413
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP		23		27	511	56,671
VEREIT INC		58		67	645	71,454
GENERAL GROWTH PROPERTIES		39		43	1,184	131,214
HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U		329		472	210	23,302
AMERICAN TOWER CORPORATION		27		32	3,396	376,078
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC		12		12	323	35,843

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)	
EQUINIX INC	3	5	1,891	209,480	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	7	—	—	—	
小計	1,000	1,236	44,458	4,922,883	
	銘柄数 <比率>	36	35	—	<1.8%>
(カナダ)			千カナダドル		
SMART REAL ESTATE INVWSTMENT	—	5	196	16,647	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9	9	203	17,244	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	10	10	294	24,935	
小計	19	25	694	58,826	
	銘柄数 <比率>	2	3	—	<0.0%>
(フランス)			千ユーロ		
ICADE	2	2	186	22,975	
UNIBAIL-RODAMCO SE	6	7	1,921	236,096	
KLEPIERRE	10	16	697	85,763	
GECINA SA	2	2	321	39,519	
FONCIERE DES REGIONS	2	2	186	22,896	
ユーロ計	25	32	3,313	407,250	
	銘柄数 <比率>	5	5	—	<0.2%>
(イギリス)			千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC	66	74	563	91,157	
HAMMERSON PLC	51	61	360	58,255	
INTU PROPERTIES PLC	56	73	223	36,228	
SEGRO PLC	48	64	283	45,828	
LAND SECURITIES GROUP PLC	53	62	741	120,040	
小計	277	335	2,172	351,510	
	銘柄数 <比率>	5	5	—	<0.1%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
MIRVAC GROUP	241	306	601	47,810	
APA GROUP	74	89	786	62,513	
NOVION PROPERTY GROUP	126	—	—	—	
GPT GROUP	109	136	738	58,708	
SYDNEY AIRPORT	70	89	658	52,357	
STOCKLAND	150	182	835	66,380	
WESTFIELD CORP	126	144	1,539	122,339	
DUET GROUP	—	177	419	33,377	
DEXUS PROPERTY GROUP	59	74	645	51,296	
GOODMAN GROUP	119	140	994	79,054	
VICINITY CENTERS	97	254	833	66,253	



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)	
LENLEASE GROUP	33	44	587	46,701	
SCENTRE GROUP	376	422	1,962	155,984	
小 計	1,586	2,063	10,602	842,778	
	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	12	12	— <0.3%>	
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT	146	177	8,292	118,250	
HKT TRUST AND HKT LTD	187	187	2,116	30,186	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	—	220	1,519	21,664	
小 計	333	584	11,928	170,100	
	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2	3	— <0.1%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST	141	200	410	32,931	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	138	138	320	25,732	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	143	143	201	16,170	
SUNTEC REIT	173	173	286	22,962	
小 計	595	654	1,219	97,797	
	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	4	4	— <0.0%>	
合 計	3,838	4,932	—	6,851,148	
	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	66	67	— <2.6%>	

(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	796	—
SWISS MKT IX	618	—
S&P 500 FUTU	10,160	—
国		
DJ EURO STOXX	1,947	—
SPI 200 FUTU	655	—
FTSE 100	1,537	—

(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 243,734,395	% 91.4
投 資 信 託 受 益 証 券	270,103	0.1
投 資 証 券	6,581,044	2.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	16,195,465	6.0
投 資 信 託 財 産 総 額	266,781,007	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(266,328,811千円)の投資信託財産総額(266,781,007千円)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=110.73円、1カナダドル=84.71円、1ユーロ=122.90円、1イギリスポンド=161.79円、1スイスフラン=111.31円、1スウェーデンクローナ=13.24円、1ノルウェークローネ=13.25円、1デンマーククローネ=16.53円、1オーストラリアドル=79.49円、1ニュージーランドドル=74.03円、1香港ドル=14.26円、1シンガポールドル=80.20円、1イスラエルシェケル=28.79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5月30日現在
(A) 資 産	267,131,836,987円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	13,171,281,741
株 式(評価額)	243,734,395,426
投資信託受益証券(評価額)	270,103,533
投 資 証 券(評価額)	6,581,044,699
未 収 入 金	845,709,621
未 収 配 当 金	619,134,179
差 入 委 託 証 拠 金	1,910,167,788
(B) 負 債	591,092,753
未 払 金	351,399,242
未 払 解 約 金	239,680,408
未 払 利 息	1,116
そ の 他 未 払 費 用	11,987
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	266,540,744,234
元 本	140,946,174,108
次 期 繰 越 損 益 金	125,594,570,126
(D) 受 益 権 総 口 数	140,946,174,108口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,911円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2015年5月30日 至 2016年5月30日
(A) 配 当 等 収 益	5,587,518,215円
受 取 配 当 金	5,565,307,231
受 取 利 息	2,434,218
そ の 他 収 益 金	25,900,992
支 払 利 息	△6,124,226
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△42,964,244,604
売 買 益	14,324,027,061
売 買 損	△57,288,271,665
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	515,859,401
取 引 益	1,981,770,741
取 引 損	△1,465,911,340
(D) そ の 他 費 用	△90,810,659
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△36,951,677,647
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	148,235,823,520
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	63,052,972,111
(H) 解 約 差 損 益 金	△48,742,547,858
(I) 計 (E+F+G+H)	125,594,570,126
次 期 繰 越 損 益 金(I)	125,594,570,126

(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。

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は123,812,745,547円、期中追加設定元本額は60,785,837,155円、期中一部解約元本額は43,652,408,594円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

外国株式SMTBセレクション (SMA専用)	29,379,815,960円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	26,764,942,305円
コア投資戦略ファンド (成長型)	12,536,506,721円
DC外国株式インデックス・オープン	6,567,818,150円
コア投資戦略ファンド (安定型)	5,086,622,392円
DCマイセレクション75	4,946,171,460円
DCマイセレクション50	4,740,161,221円
バランスC (50) VA1 (適格機関投資家専用)	4,513,660,516円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	3,903,469,643円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	3,759,543,255円
FOFs用外国株式インデックス・オープン (適格機関投資家専用)	3,696,507,051円
DC世界経済インデックスファンド	3,587,594,658円
世界経済インデックスファンド	2,784,217,848円
SBI資産設計オープン (資産成長型)	2,401,096,988円
分散投資コア戦略ファンドS	2,303,691,062円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	1,919,165,022円
外国株式インデックス・オープン (SMA専用)	1,876,219,661円
DCマイセレクションS50	1,828,255,330円
FOFs用 外国株式インデックスファンドS (適格機関投資家専用)	1,801,306,312円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,760,908,098円
バランスA (25) VA1 (適格機関投資家専用)	1,454,614,057円
分散投資コア戦略ファンドA	1,421,221,379円
DCマイセレクションS75	1,324,024,550円
外国株式インデックス・オープン	1,115,588,929円
コア投資戦略ファンド (切替型)	1,096,773,300円
外国株式ファンド・シリーズ1	960,651,087円
DCマイセレクション25	896,366,683円
バランスB (37.5) VA1 (適格機関投資家専用)	708,750,260円
バランスD (35) VA1 (適格機関投資家専用)	693,297,361円
グローバルバランスファンドVA35 (適格機関投資家専用)	679,549,530円
バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	679,364,417円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	663,976,582円
バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	651,558,462円
DCマイセレクションS25	386,272,158円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	321,185,462円
SMT インデックスバランス・オープン	276,521,076円
DC世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	218,779,123円
バランスE (25) VA1 (適格機関投資家専用)	204,859,986円
バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	190,639,029円
DCターゲット・イヤール ファンド2035	181,670,145円
DCターゲット・イヤール ファンド2025	159,996,167円
外国株式インデックス・オープンVA1 (適格機関投資家専用)	126,294,072円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	110,966,515円
DCターゲット・イヤール ファンド2045	95,513,510円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	42,552,049円
マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	36,671,973円
マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	24,329,004円
マイセレクション75	22,136,016円
マイセレクション50	20,292,709円
SBI資産設計オープン (分配型)	19,595,434円
マイセレクション25	4,489,430円

## お知らせ

---

該当事項はありません。

# 新興国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第8期（決算日 2016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
	期騰	期中落率	期騰	期中落率					
	円	%		%	%	%	%	百万円	
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	
第8期(2016年11月10日)	14,906	△5.4	27,964.08	△5.3	96.4	—	—	22,824	

(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	騰	落率		
(当期首) 2015年11月10日	円	%		%	%	%
	15,765	—	29,513.66	—	97.5	—
11月末	15,644	△0.8	29,451.49	△0.2	96.7	—
12月末	15,114	△4.1	28,342.49	△4.0	96.0	—
2016年 1月末	14,909	△5.4	27,906.60	△5.4	97.6	—
2月末	14,233	△9.7	26,825.00	△9.1	95.6	—
3月末	15,357	△2.6	28,931.41	△2.0	96.4	—
4月末	15,308	△2.9	28,630.48	△3.0	94.9	—
5月末	14,812	△6.0	27,810.88	△5.8	94.2	—
6月末	14,503	△8.0	27,198.31	△7.8	96.0	—
7月末	14,699	△6.8	27,623.30	△6.4	97.4	—
8月末	14,692	△6.8	27,617.02	△6.4	97.1	—
9月末	14,586	△7.5	27,583.29	△6.5	95.7	—
10月末	14,964	△5.1	28,233.00	△4.3	96.3	—
(当期末) 2016年11月10日	14,906	△5.4	27,964.08	△5.3	96.4	—

(注1)騰落率は期首比です。

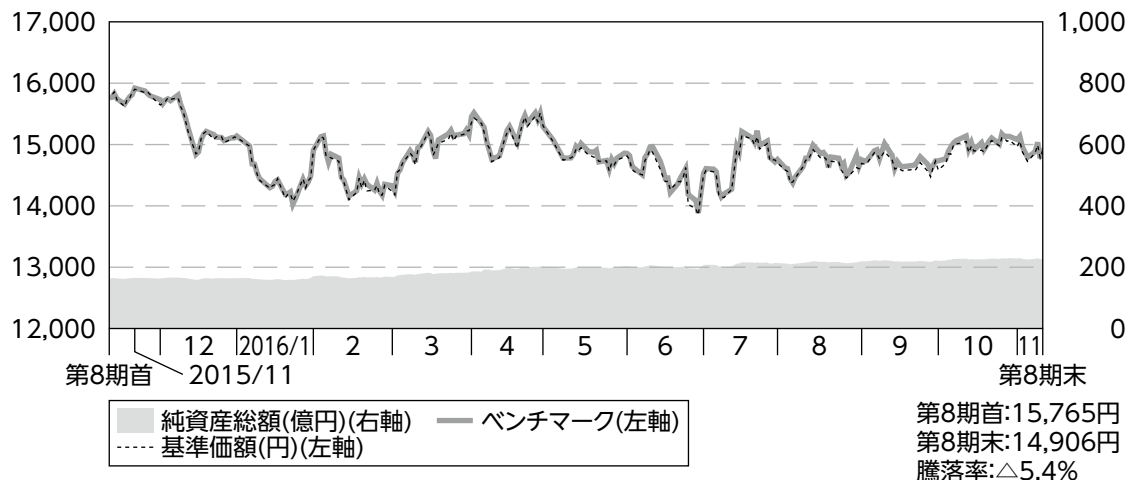
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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



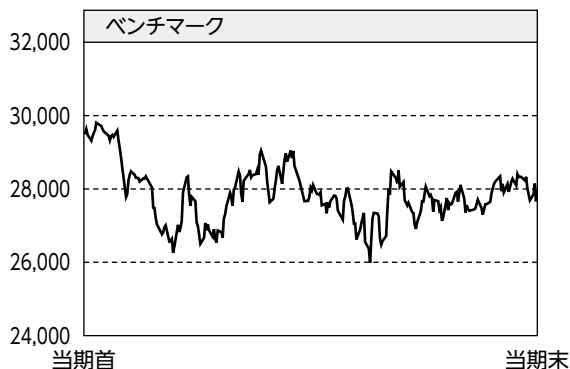
(注)ベンチマークは、2015年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

## 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。

2015年12月から2016年2月上旬にかけて、原油価格の下落や米国の利上げを受けて新興国通貨は下落し、基準価額も下落しました。2月中旬から4月にかけては、原油価格の反発や米国の先行きの利上げペースは緩やかになるとの見方を受けたリスク選好の動きから新興国通貨が上昇し、基準価額は上昇基調で推移しましたが、6月末にかけて、日銀が追加金融緩和を見送ったことによる円高進行や英国の国民投票におけるEU（欧州連合）離脱派勝利を受けてリスク回避の動きが強まったことから新興国通貨が下落し、基準価額は下落しました。7月中旬には日本政府・日銀の政策期待を背景とした円安が進み、基準価額は反発しましたが、その後は日本における追加政策期待の後退を受けて円高圧力がかかり下落しました。8月以降期末にかけては、米国の利上げ観測の高まりと後退が交錯する展開となる中、新興国通貨は概ねもみ合いで推移したことから、基準価額ももみ合いで推移しました。

## 投資環境



新興国為替市場では、2016年2月にかけて、原油価格の下落や米国の利上げを受けたリスク回避の動きから、新興国通貨は下落基調で推移しました。その後、原油価格の反発などをを受けたリスク選好の動きから新興国通貨は上昇に転じましたが、日銀の追加金融緩和見送りによる円高進行や英国国民投票におけるEU離脱派勝利などから、再度下落しました。8月以降は米国の利上げ観測の高まりと後退が交錯する展開となる中、新興国通貨は概ねもみ合いで推移しました。新興国債券市場では、米国の先行きの利上げペースは緩やかになるとの見方から、金利は低下(債券価格は上昇)基調で推移しましたが、期末にかけては反発しました。

## 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・ダイバーシファイド(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

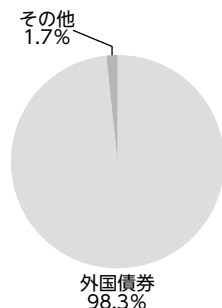
### ○上位10銘柄

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	BNTNF 10% 01/01/21	ブラジル	2.5%
3	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	2.2%
4	SAGB 10.5% 12/21/26	南アフリカ	1.8%
5	COLOM 4.375% 03/21/23	コロンビア	1.8%
6	THAIGB 3.875% 06/13/19	タイ	1.4%

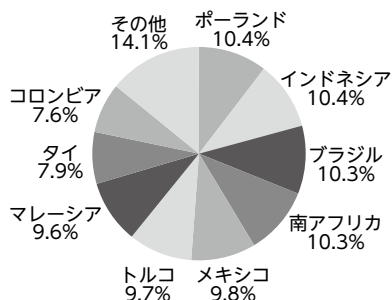
順位	銘柄名	国	組入比率
7	THAIGB 3.65% 12/17/21	タイ	1.4%
8	BNTNF 10% 01/01/23	ブラジル	1.3%
9	INDOGB 8.375% 09/15/26	インドネシア	1.2%
10	INDOGB 8.375% 03/15/24	インドネシア	1.2%
組入銘柄数		171	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

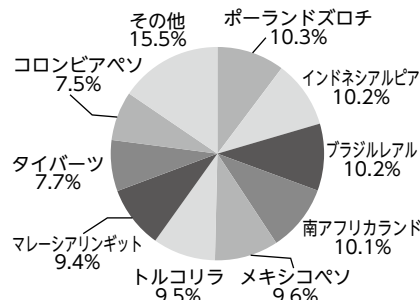
### ○資産別配分



### ○国別配分



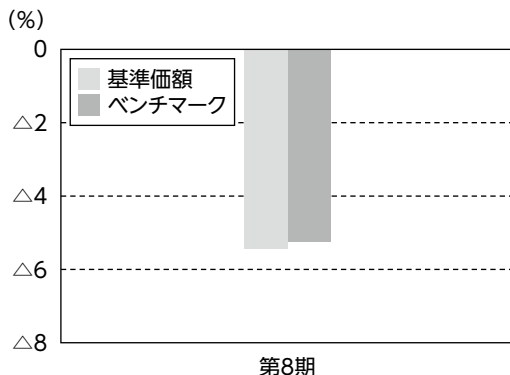
### ○通貨別配分



(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騰落率に概ね連動しました。

ベンチマークとの差異は、取引コストやカストディコストなどのマイナスが主要な要因です。

## 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
	(2015年11月1日~2016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 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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) (その他)	19 (19) (-) (0)	0.126 (0.126) (-) (0.000)	(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 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	19	0.126	

(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(14,901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 233,020	千メキシコペソ 36,033
	ブ ラ ジ ル	国 債 証 券	千ブラジルリアル 40,949	千ブラジルリアル 35,907
	チ リ	国 債 証 券	千チリペソ 53,228	千チリペソ -
	コ ロ ン ビ ア	国 債 証 券	千コロンビアペソ 20,857,337	千コロンビアペソ 1,049,625
	ペ ル ー	国 債 証 券	千ペルーヌエボソル 8,580	千ペルーヌエボソル 3,155
	ト ル コ	国 債 証 券	千トルコリラ 29,834	千トルコリラ 4,001
	ハ ン ガ リ ー	国 債 証 券	千ハンガリーフォリント 1,468,310	千ハンガリーフォリント 332,442
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 49,105	千ポーランドズロチ 12,807
	ロ シ ア	国 債 証 券	千ロシアルーブル 345,544	千ロシアルーブル 73,372
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 48,624	千マレーシアリンギット 19,851
国	タ イ	国 債 証 券	千タイバーツ 292,129	千タイバーツ 119,679
	フ ィ リ ピ ン	国 債 証 券	千フィリピンペソ 16,531	千フィリピンペソ -
	イ ン ド ネ シ ア	国 債 証 券	千インドネシアルピア 122,473,430	千インドネシアルピア 28,538,300
	南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカランド 147,462	千南アフリカランド 43,777

(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	%
金 銭 信 託	17,180	17,180	100.0	17,175	17,175	100.0
コー ル ・ ロ ー ン	49,484	6,931	14.0	49,533	6,936	14.0

(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(外貨建)公社債&gt;

## (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
メ キ シ コ	千メキシコペソ 378,250	千メキシコペソ 401,453	千円 2,139,746	% 9.4	% —	% 5.1	% 3.1	% 1.2
ブ ラ ジ ル	千ブラジルリアル 75,750	千ブラジルリアル 68,884	2,255,952	9.9	—	2.7	4.6	2.6
チ リ	千チリペソ 150,000	千チリペソ 158,955	25,846	0.1	—	—	0.1	—
コ ロ ン ビ ア	千コロンビアペソ 44,800,000	千コロンビアペソ 46,644,533	1,641,887	7.2	—	3.9	3.2	—
ペ ル ー	千ペルーヌエボソル 13,500	千ペルーヌエボソル 14,677	459,267	2.0	—	1.8	0.2	—
ト ル コ	千トルコリラ 67,250	千トルコリラ 64,550	2,121,113	9.3	—	4.1	4.2	1.0
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 2,871,100	千ハンガリーフォリント 3,241,195	1,224,523	5.4	—	2.1	2.6	0.6
ポーランド	千ポーランドズロチ 84,750	千ポーランドズロチ 87,102	2,317,797	10.2	—	3.4	5.1	1.6
ロシア	千ロシアルーブル 818,100	千ロシアルーブル 786,022	1,304,797	5.7	—	2.6	2.2	0.9
マレーシア	千マレーシアリンギット 84,130	千マレーシアリンギット 85,933	2,135,447	9.4	—	4.7	3.6	1.0
タイ	千タイバーツ 525,600	千タイバーツ 578,494	1,741,268	7.6	—	4.8	2.3	0.5
フィリピン	千フィリピンペソ 40,000	千フィリピンペソ 42,974	93,254	0.4	—	0.3	0.1	—
インドネシア	千インドネシアルピア 269,800,000	千インドネシアルピア 282,047,299	2,284,583	10.0	—	8.0	1.9	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 311,650	千南アフリカランド 287,387	2,253,121	9.9	—	8.4	1.4	—
合 計	—	—	21,998,608	96.4	—	52.0	34.7	9.7

(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	評価額	額	
		千メキシコペソ	千メキシコペソ	外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
<b>(メキシコ)</b>						
<b>国債証券</b>						
MBONO 10% 11/20/36	10.0	9,500	12,516	66,712	2036/11/20	
MBONO 10% 12/05/24	10.0	36,650	44,588	237,658	2024/12/5	
MBONO 4.75% 06/14/18	4.75	37,000	36,350	193,749	2018/6/14	
MBONO 5% 12/11/19	5.0	27,800	26,914	143,455	2019/12/11	
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	17,000	16,008	85,325	2026/3/5	
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	17,050	17,154	91,432	2022/6/9	
MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	44,500	44,831	238,954	2021/6/10	
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	12,950	13,698	73,013	2027/6/3	
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	21,500	23,012	122,659	2031/5/29	
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	23,600	25,407	135,422	2042/11/13	
MBONO 7.5% 11/23/34	7.75	10,000	10,719	57,133	2034/11/23	
MBONO 7.75% 12/14/17	7.75	15,200	15,542	82,838	2017/12/14	
MBONO 8% 06/11/20	8.0	19,300	20,400	108,736	2020/6/11	
MBONO 8% 12/07/23	8.0	13,700	14,906	79,452	2023/12/7	
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	14,100	16,016	85,369	2029/5/31	
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	20,700	23,889	127,331	2038/11/18	
MBONO 8.5% 12/13/18	8.5	37,700	39,493	210,501	2018/12/13	
小計				2,139,746		
<b>(ブラジル)</b>						
<b>国債証券</b>						
BLTN 0% 01/01/18	—	3,350	2,941	96,342	2018/1/1	
BLTN 0% 01/01/19	—	7,000	5,547	181,682	2019/1/1	
BLTN 0% 01/01/20	—	2,300	1,636	53,610	2020/1/1	
BLTN 0% 07/01/18	—	9,100	7,591	248,615	2018/7/1	
BLTN 0% 07/01/19	—	2,150	1,618	53,009	2019/7/1	
BNTNF 10% 01/01/18	10.0	7,800	7,640	250,227	2018/1/1	
BNTNF 10% 01/01/19	10.0	6,500	6,334	207,451	2019/1/1	
BNTNF 10% 01/01/21	10.0	17,850	17,078	559,331	2021/1/1	
BNTNF 10% 01/01/23	10.0	9,300	8,731	285,962	2023/1/1	
BNTNF 10% 01/01/25	10.0	5,500	5,104	167,178	2025/1/1	
BNTNF 10% 01/01/27	10.0	3,450	3,155	103,348	2027/1/1	
BRAZIL 10.25% 01/10/28	10.25	700	717	23,512	2028/1/10	
BRAZIL 12.5% 01/05/22	12.5	450	500	16,377	2022/1/5	
BRAZIL 8.5% 01/05/24	8.5	300	284	9,303	2024/1/5	
小計				2,255,952		
<b>(チリ)</b>						
<b>国債証券</b>						
CHILE 5.5% 08/05/20	5.5	150,000	158,955	25,846	2020/8/5	
<b>(コロンビア)</b>						
<b>国債証券</b>						
COLOM 4.375% 03/21/23	4.375	12,950,000	11,451,685	403,099	2023/3/21	
COLOM 7.75% 04/14/21	7.75	20,000,000	21,044,600	740,769	2021/4/14	
COLOM 9.85% 06/28/27	9.85	11,850,000	14,148,248	498,018	2027/6/28	
小計				1,641,887		
<b>(ペルー)</b>						
<b>国債証券</b>						
PERUGB 5.7% 08/12/24	5.7	1,800	1,848	57,846	2024/8/12	
PERUGB 6.35% 08/12/28	6.35	3,000	3,127	97,874	2028/8/12	
PERUGB 6.9% 08/12/37	6.9	1,700	1,807	56,548	2037/8/12	
PERUGB 6.95% 08/12/31	6.95	2,800	3,033	94,927	2031/8/12	
PERUGB 7.84% 08/12/20	7.84	1,350	1,490	46,647	2020/8/12	
PERUGB 8.2% 08/12/26	8.2	2,850	3,369	105,422	2026/8/12	
小計				459,267		

銘柄	利率 (%)	期		末		償還年月日
		額面金額	評価額	評価額	額	
		千トルコリラ	千トルコリラ	外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
<b>(トルコ)</b>						
<b>国債証券</b>						
TURKGB 10.4% 03/20/24	10.4	2,800	2,812	92,431	2024/3/20	
TURKGB 10.4% 03/27/19	10.4	2,700	2,748	90,321	2019/3/27	
TURKGB 10.5% 01/15/20	10.5	4,600	4,685	153,958	2020/1/15	
TURKGB 10.6% 02/11/26	10.6	3,300	3,359	110,401	2026/2/11	
TURKGB 10.7% 02/17/21	10.7	3,150	3,208	105,417	2021/2/17	
TURKGB 6.3% 02/14/18	6.3	3,100	2,992	98,319	2018/2/14	
TURKGB 7.1% 03/08/23	7.1	4,950	4,230	139,009	2023/3/8	
TURKGB 7.4% 02/05/20	7.4	3,850	3,586	117,840	2020/2/5	
TURKGB 8% 03/12/25	8.0	4,400	3,836	126,053	2025/3/12	
TURKGB 8.3% 06/20/18	8.3	4,000	3,937	129,377	2018/6/20	
TURKGB 8.5% 07/10/19	8.5	4,200	4,088	134,342	2019/7/10	
TURKGB 8.5% 09/14/22	8.5	3,800	3,510	115,344	2022/9/14	
TURKGB 8.8% 09/27/23	8.8	3,400	3,153	103,611	2023/9/27	
TURKGB 8.8% 11/14/18	8.8	5,950	5,880	193,224	2018/11/14	
TURKGB 9% 07/24/24	9.0	5,150	4,805	157,906	2024/7/24	
TURKGB 9.4% 07/08/20	9.4	4,900	4,803	157,850	2020/7/8	
TURKGB 9.5% 01/12/22	9.5	3,000	2,912	95,702	2022/1/12	
小計				2,121,113		
<b>(ハンガリー)</b>						
<b>国債証券</b>						
HGB 2% 10/30/19	2.0	155,000	158,630	59,930	2019/10/30	
HGB 2.5% 06/22/18	2.5	142,000	146,492	55,345	2018/6/22	
HGB 2.5% 10/27/21	2.5	206,000	211,531	79,116	2021/10/27	
HGB 3% 06/26/24	3.0	205,000	208,462	78,757	2024/6/26	
HGB 3.5% 06/24/20	3.5	282,000	301,782	114,013	2020/6/24	
HGB 4% 04/25/18	4.0	220,000	231,207	87,350	2018/4/25	
HGB 5.5% 06/24/25	5.5	291,000	347,728	131,372	2025/6/24	
HGB 5.5% 12/20/18	5.5	170,000	186,984	70,642	2018/12/20	
HGB 6.0% 11/24/23	6.0	328,100	402,680	152,132	2023/11/24	
HGB 6.5% 06/24/19	6.5	362,000	411,908	155,619	2019/6/24	
HGB 7% 06/24/22	7.0	256,000	321,960	121,636	2022/6/24	
HGB 7.5% 11/12/20	7.5	254,000	311,824	117,807	2020/11/12	
小計				1,224,523		
<b>(ポーランド)</b>						
<b>国債証券</b>						
POLGB 0% 10/25/18	—	1,300	1,255	33,396	2018/10/25	
POLGB 1.5% 04/25/20	1.5	8,950	8,735	232,459	2020/4/25	
POLGB 1.75% 07/25/21	1.75	8,400	8,103	215,645	2021/7/25	
POLGB 2% 04/25/21	2.0	5,400	5,297	140,960	2021/4/25	
POLGB 2.5% 07/25/18	2.5	6,650	6,730	179,111	2018/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	8,500	8,047	214,137	2026/7/25	
POLGB 3.25% 07/25/19	3.25	7,200	7,438	197,946	2019/7/25	
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	6,900	6,988	185,953	2025/7/25	
POLGB 3.75% 04/25/18	3.75	5,900	6,075	161,666	2018/4/25	
POLGB 4% 10/25/23	4.0	7,100	7,590	201,991	2023/10/25	
POLGB 5.25% 10/25/20	5.25	4,650	5,157	137,253	2020/10/25	
POLGB 5.5% 10/25/19	5.5	4,600	5,050	134,398	2019/10/25	
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	5,500	6,386	169,957	2022/9/23	
POLGB 5.75% 10/25/21	5.75	3,700	4,243	112,917	2021/10/25	
小計				2,317,797		

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>(ロシア)</b>		千シアルーブル		千シアルーブル		
<b>国債証券</b>						
RFLB 6.2% 01/31/18	6.2	32,000	31,213	51,814	2018/1/31	
RFLB 6.4% 05/27/20	6.4	56,000	52,512	87,170	2020/5/27	
RFLB 6.7% 05/15/19	6.7	58,500	56,316	93,484	2019/5/15	
RFLB 6.8% 12/11/19	6.8	46,200	44,191	73,358	2019/12/11	
RFLB 7.0% 01/25/23	7.0	42,700	39,823	66,107	2023/1/25	
RFLB 7% 08/16/23	7.0	84,700	78,903	130,979	2023/8/16	
RFLB 7.05% 01/19/28	7.05	79,300	71,912	119,375	2028/1/19	
RFLB 7.5% 02/27/19	7.5	39,500	38,818	64,438	2019/2/27	
RFLB 7.5% 03/15/18	7.5	28,100	27,842	46,218	2018/3/15	
RFLB 7.5% 08/18/21	7.5	75,500	72,773	120,804	2021/8/18	
RFLB 7.6% 04/14/21	7.6	35,000	33,992	56,427	2021/4/14	
RFLB 7.6% 07/20/22	7.6	47,500	45,754	75,952	2022/7/20	
RFLB 8.15% 02/03/27	8.15	75,000	74,245	123,248	2027/2/3	
RFLB 8.5% 09/17/31	8.5	48,100	49,558	80,606	2031/9/17	
RUSSIA 7.85% 03/10/18	7.85	70,000	69,164	114,812	2018/3/10	
小計				1,304,797		
<b>(マレーシア)</b>		千マレーシアリンギット		千マレーシアリンギット		
<b>国債証券</b>						
MGS 3.26% 03/01/18	3.26	3,250	3,283	81,592	2018/3/1	
MGS 3.418% 08/15/22	3.418	3,400	3,381	84,020	2022/8/15	
MGS 3.48% 03/15/23	3.48	4,850	4,835	120,163	2023/3/15	
MGS 3.492% 03/31/20	3.492	5,300	5,342	132,765	2020/3/31	
MGS 3.58% 09/28/18	3.58	4,950	5,027	124,940	2018/9/28	
MGS 3.62% 11/30/21	3.62	3,300	3,350	83,248	2021/11/30	
MGS 3.654% 10/31/19	3.654	4,500	4,567	113,510	2019/10/31	
MGS 3.659% 10/15/20	3.659	3,400	3,442	85,543	2020/10/15	
MGS 3.759% 03/15/19	3.759	1,250	1,271	31,587	2019/3/15	
MGS 3.795% 09/30/22	3.795	3,200	3,252	80,819	2022/9/30	
MGS 3.8% 08/17/23	3.8	3,100	3,152	78,343	2023/8/17	
MGS 3.889% 07/31/20	3.889	1,600	1,634	40,613	2020/7/31	
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	5,500	5,627	139,855	2026/11/30	
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	2,900	2,943	73,141	2025/9/15	
MGS 4.048% 09/30/21	4.048	3,950	4,068	101,108	2021/9/30	
MGS 4.16% 07/15/21	4.16	4,550	4,702	116,856	2021/7/15	
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	3,700	3,823	95,023	2024/7/15	
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	2,200	2,231	55,440	2031/6/30	
MGS 4.24% 02/07/18	4.24	1,300	1,327	32,999	2018/2/7	
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	1,450	1,434	35,652	2035/5/31	
MGS 4.378% 11/29/19	4.378	5,050	5,225	129,842	2019/11/29	
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	4,000	4,197	104,303	2026/4/15	
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	4,530	4,715	117,172	2030/4/15	
MGS 5.734% 07/30/19	5.734	2,900	3,094	76,902	2019/7/30	
小計				2,135,447		
<b>(タイ)</b>		千タイバート		千タイバート		
<b>国債証券</b>						
THAIGB 1.875% 06/17/22	1.875	16,000	15,925	47,935	2022/6/17	
THAIGB 2.55% 06/26/20	2.55	53,750	55,278	166,387	2020/6/26	
THAIGB 3.4% 06/17/36	3.4	16,000	17,758	53,452	2036/6/17	
THAIGB 3.45% 03/08/19	3.45	13,000	13,541	40,759	2019/3/8	
THAIGB 3.625% 06/16/23	3.625	65,700	72,216	217,372	2023/6/16	
THAIGB 3.65% 12/17/21	3.65	94,500	102,416	308,272	2021/12/17	
THAIGB 3.85% 12/12/25	3.85	60,400	68,830	207,180	2025/12/12	
THAIGB 3.875% 06/13/19	3.875	97,700	103,223	310,702	2019/6/13	
THAIGB 4.875% 06/22/29	4.875	71,550	90,553	272,566	2029/6/22	

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)		
THAIGB 5.125% 03/13/18	5.125	37,000	38,750	116,638	2018/3/13	
小計				1,741,268		
<b>(フィリピン)</b>		千フィリピンペソ		千フィリピンペソ		
<b>国債証券</b>						
PHILIP 3.9% 11/26/22	3.9	10,000	9,824	21,319	2022/11/26	
PHILIP 4.95% 01/15/21	4.95	10,000	10,324	22,403	2021/1/15	
PHILIP 6.25% 01/14/36	6.25	20,000	22,825	49,431	2036/1/14	
小計				93,254		
<b>(インドネシア)</b>		千インドネシアルピア		千インドネシアルピア		
<b>国債証券</b>						
INDOGB 10.5% 08/15/30	10.5	6,300,000	7,821,607	63,355	2030/8/15	
INDOGB 11% 09/15/25	11.0	6,700,000	8,242,842	66,767	2025/9/15	
INDOGB 11% 11/15/20	11.0	4,100,000	4,680,888	37,915	2020/11/15	
INDOGB 12.8% 06/15/21	12.8	5,700,000	6,988,599	56,607	2021/6/15	
INDOGB 5.25% 05/15/18	5.25	3,500,000	3,434,567	27,819	2018/5/15	
INDOGB 5.625% 05/15/23	5.625	11,000,000	10,092,995	81,753	2023/5/15	
INDOGB 6.125% 05/15/28	6.125	11,000,000	9,766,295	79,106	2028/5/15	
INDOGB 6.625% 05/15/33	6.625	17,000,000	15,075,175	122,108	2033/5/15	
INDOGB 7% 05/15/22	7.0	8,000,000	8,000,840	64,806	2022/5/15	
INDOGB 7% 05/15/27	7.0	8,900,000	8,670,202	70,228	2027/5/15	
INDOGB 7.875% 04/15/19	7.875	16,000,000	16,401,760	132,584	2019/4/15	
INDOGB 8.25% 05/15/36	8.25	9,200,000	9,542,010	77,290	2036/5/15	
INDOGB 8.25% 06/15/32	8.25	12,300,000	12,740,217	103,195	2032/6/15	
INDOGB 8.25% 07/15/21	8.25	23,400,000	24,568,713	199,006	2021/7/15	
INDOGB 8.375% 03/15/24	8.375	32,000,000	33,856,480	274,237	2024/3/15	
INDOGB 8.375% 03/15/34	8.375	21,000,000	21,904,365	177,425	2034/3/15	
INDOGB 8.375% 09/15/26	8.375	32,400,000	34,742,034	281,410	2026/9/15	
INDOGB 8.75% 05/15/31	8.75	12,400,000	13,385,242	108,420	2031/5/15	
INDOGB 9% 03/15/29	9.0	20,500,000	22,525,092	182,453	2029/3/15	
INDOGB 9.5% 07/15/31	9.5	8,400,000	9,607,374	77,819	2031/7/15	
小計				2,284,583		
<b>(南アフリカ)</b>		千南アフリカランド		千南アフリカランド		
<b>国債証券</b>						
SAGB 10.5% 12/21/26	10.5	46,100	51,207	401,469	2026/12/21	
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	23,000	16,582	130,003	2036/3/31	
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	21,800	15,662	122,794	2041/2/28	
SAGB 6.75% 03/31/21	6.75	15,700	14,860	116,510	2021/3/31	
SAGB 7% 02/28/31	7.0	21,600	17,772	139,334	2031/2/28	
SAGB 7.25% 01/15/20	7.25	15,500	15,159	118,850	2020/1/15	
SAGB 7.75% 02/28/23	7.75	16,600	16,010	125,523	2023/2/28	
SAGB 8% 01/31/30	8.0	29,600	26,807	210,168	2030/1/31	
SAGB 8% 12/21/18	8.0	11,950	11,984	93,955	2018/12/21	
SAGB 8.25% 03/31/32	8.25	19,000	17,304	135,669	2032/3/31	
SAGB 8.5% 01/31/37	8.5	22,400	20,357	159,598	2037/1/31	
SAGB 8.75% 01/31/44	8.75	19,500	17,944	140,687	2044/1/31	
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	24,700	22,784	178,633	2048/2/28	
SAGB 8.875% 02/28/35	8.875	10,500	9,970	78,171	2035/2/28	
SAGB 9% 01/31/40	9.0	13,700	12,978	101,749	2040/1/31	
小計				2,253,121		
合計				21,998,608		

(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取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 21,998,608	95.8 %
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	954,649	4.2
投 資 信 託 財 産 総 額	22,953,257	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(22,671,688千円)の投資信託財産総額(22,953,257千円)に対する比率は98.8%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=105.63円	1メキシコペソ=5.33円	1ブラジルレアル=32.75円
1チリペソ=0.1626円	1コロンビアペソ=0.0352円	1ペルーヌエボソル=31.29円
1トルコリラ=32.86円	1ハンガリーフォリント=0.3778円	1ポーランドズロチ=26.61円
1ロシアルーブル=1.66円	1マレーシアリンギット=24.85円	1タイバーツ=3.01円
1フィリピンペソ=2.17円	1インドネシアルピア=0.0081円	1南アフリカランド=7.84円

## 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11月10日現在
(A) 資 産	22,976,213,912円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	511,708,822
公 社 債(評価額)	21,998,608,465
未 収 入 金	23,302,349
未 収 利 息	408,310,913
前 払 費 用	34,283,363
(B) 負 債	152,024,787
未 払 金	143,596,618
未 払 解 約 金	8,427,844
未 払 利 息	319
そ の 他 未 払 費 用	6
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	22,824,189,125
元 本	15,311,575,807
次 期 繰 越 損 益 金	7,512,613,318
(D) 受 益 権 総 口 数	15,311,575,807口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,906円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2015年11月11日 至 2016年11月10日
(A) 配 当 等 収 益	1,246,687,413円
受 取 利 息	1,246,802,129
支 払 利 息	△114,716
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△2,098,626,631
売 買 益	711,885,630
売 買 損	△2,810,512,261
(C) そ の 他 費 用	△24,459,785
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△876,399,003
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	5,976,567,579
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,654,129,233
(G) 解 約 差 損 益 金	△241,684,491
(H) 計 (D+E+F+G)	7,512,613,318
次 期 繰 越 損 益 金(H)	7,512,613,318

(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。

## 〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は10,367,217,083円、期中追加設定元本額は5,467,869,744円、期中一部解約元本額は523,511,020円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

SMT 新興国債券インデックス・オープン	3,313,167,888円
DC世界経済インデックスファンド	3,007,671,988円
DC新興国債券インデックス・オープン	3,001,173,724円
世界経済インデックスファンド	2,355,655,238円
新興国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	2,030,043,228円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	957,772,611円
SMT インデックスバランス・オープン	245,478,620円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	184,657,735円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	110,962,144円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	75,260,515円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	18,872,568円
新興国債券インデックス・オープン	10,859,548円

## お知らせ

---

該当事項はありません。



# 新興国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第8期（決算日 2016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	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4期(2012年11月12日)	16,516	6.5	15,672	3.3	96.0	3.6	0.4	百万円 14,622
第5期(2013年11月11日)	21,178	28.2	19,592	25.0	97.4	2.1	0.4	21,878
第6期(2014年11月10日)	24,850	17.3	22,465	14.7	89.6	9.4	0.5	21,821
第7期(2015年11月10日)	23,378	△5.9	20,671	△8.0	93.8	5.4	0.8	25,618
第8期(2016年11月10日)	21,467	△8.2	18,491	△10.5	98.6	0.7	0.7	29,752

(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	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) 2015年11月10日	23,378	—	20,671	—	93.8	5.4	0.8
11月末	22,765	△2.6	20,187	△2.3	94.1	5.6	0.8
12月末	21,739	△7.0	19,184	△7.2	95.4	4.7	0.7
2016年 1月末	19,745	△15.5	17,363	△16.0	95.6	3.7	0.7
2月末	18,999	△18.7	16,723	△19.1	97.8	1.9	0.7
3月末	21,321	△8.8	18,691	△9.6	95.5	3.7	0.7
4月末	21,049	△10.0	18,405	△11.0	95.9	3.3	0.7
5月末	20,354	△12.9	17,821	△13.8	95.0	4.3	0.7
6月末	19,388	△17.1	16,821	△18.6	95.3	3.9	0.7
7月末	20,964	△10.3	18,183	△12.0	96.8	2.5	0.7
8月末	21,314	△8.8	18,448	△10.8	97.5	1.9	0.7
9月末	21,210	△9.3	18,370	△11.1	98.3	1.0	0.7
10月末	21,772	△6.9	18,844	△8.8	98.8	0.5	0.7
(当期末) 2016年11月10日	21,467	△8.2	18,491	△10.5	98.6	0.7	0.7

(注1)騰落率は期首比です。

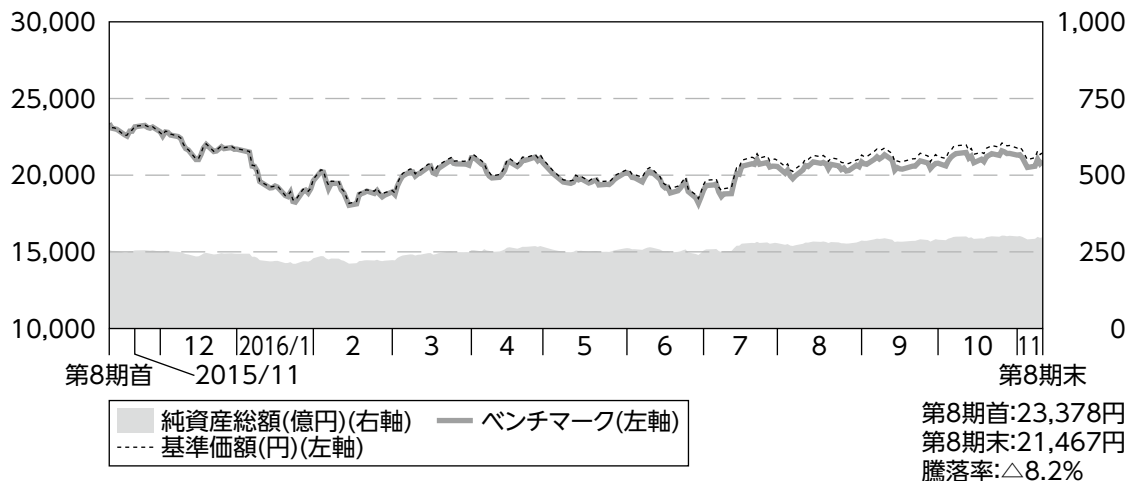
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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。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

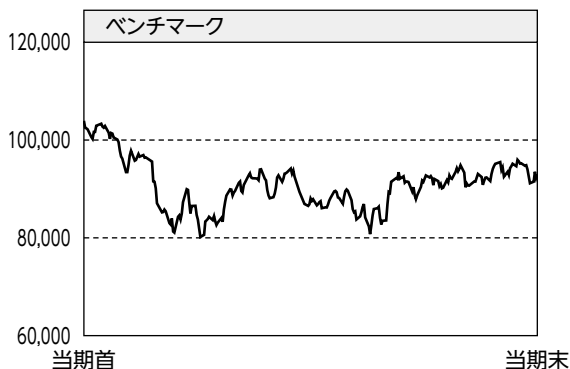


(注)ベンチマークは、2015年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 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



中国のマクロ景気指標が低調である中、中国・人民元安の進行に伴い景気減速懸念が強まったことや、原油など資源価格の下落により資源国の景気見通しが悪化したことが影響し、新興国株式市場は2016年1月にかけて下落しました。

その後は、不動産市場の活性化策など中国政府による景気刺激策への期待を背景に資源価格が反発したことに加え、米国の早期利上げ観測の後退やOPEC(石油輸出国機構)による生産調整の暫定合意が好感され、新興国株式市場は上昇しました。

外国為替市場では、世界的な景気減速や英国のEU(欧州連合)離脱の混乱を受け投資家のリスク回避姿勢が強まり、新興国通貨に対して円高が進行しました。

## 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

DRを含むベンチマーク構成銘柄に分散投資し、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

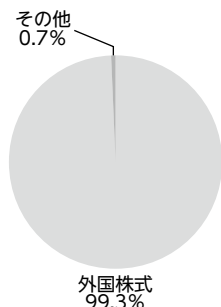
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン諸島	3.7%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	3.5%
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	3.4%
4	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ケイマン諸島	2.7%
5	NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	1.8%
6	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	香港	1.7%

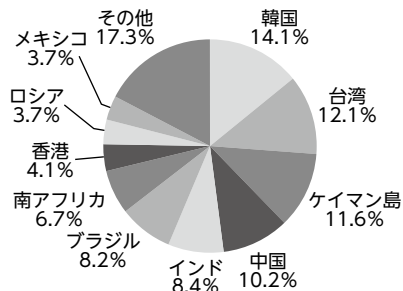
順位	銘柄名	国	組入比率
7	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	1.5%
8	BAIDU INC - SPON ADR	ケイマン諸島	1.1%
9	IND&COMM BK OF CHINA-H	中国	1.1%
10	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	1.0%
組入銘柄数		826	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

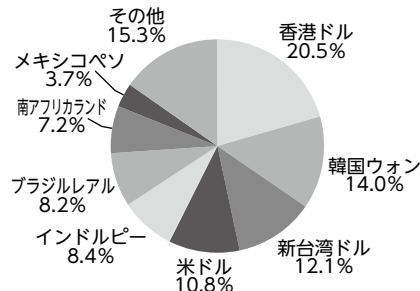
### ○資産別配分



### ○国別配分



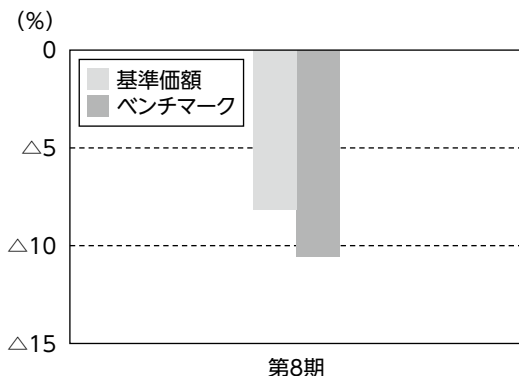
### ○通貨別配分



(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騰落率に連動しました。

差異の主な要因は、配当金要因\* (プラス要因) およびコスト要因 (マイナス要因) 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
	(2015年11月11日~2016年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	7円	0.035%	(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
(株式)	(5)	(0.023)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(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)	(2)	(0.012)	
(b) 有価証券取引税	4	0.017	(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
(株式)	(4)	(0.017)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(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)	
(c) その他費用	35	0.167	(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、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(35)	(0.167)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	46	0.219	

(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(20,885円)で除して100を乗じたものです。

## 売買および取引の状況

&lt;株 式&gt;

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 6,493 (372)	千米ドル 18,606 (-)	百株 676	千米ドル 597
	メ キ シ コ	9,716 (1,411)	千メキシコペソ 34,551 (174)	1,056	千メキシコペソ 1,247
	ブ ラ ジ ル	6,928 (1,036)	千ブラジルリアル 12,154 (23)	1,100 (4)	千ブラジルリアル 671 (18)
	チ リ	83,178 (12,752)	千チリペソ 312,867 (161,394)	710 (18)	千チリペソ 80,177 (146,872)
	コ ロ ン ビ ア	2,352 (45)	千コロンビアペソ 994,279 (163,677)	684 (42)	千コロンビアペソ 396,623 (163,677)
	ギ リ シ ャ	6,991	千ユーロ 860	-	千ユーロ -
	ト ル コ	2,752 (188)	千トルコリラ 1,921 (-)	316	千トルコリラ 140
	チ ェ コ	62 (58)	千チェココルナ 4,081 (-)	7	千チェココルナ 500
	ハ ン ガ リ ー	68	千ハンガリーフォリント 43,197	-	千ハンガリーフォリント -
	ポ ー ラ ン ド	711 (316)	千ポーランドズロチ 2,310 (-)	29	千ポーランドズロチ 32
国	香 港	116,466 (2,442)	千香港ドル 94,013 (211)	14,352 (220)	千香港ドル 6,341 (120)
	マ レ ー シ ア	7,457 (635)	千マレーシアリンギット 5,640 (227)	4,207	千マレーシアリンギット 919
	タ イ	20,830 (2,526)	千タイバーツ 45,159 (326)	2,243 (-)	千タイバーツ 3,056 (93)

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	フィリピン	百株 7,198 (43)	千フィリピンペソ 54,669 (-)	百株 -	千フィリピンペソ -
	インドネシア	33,046 (6,128)	千インドネシアルピア 22,966,388 (25,206)	1,567	千インドネシアルピア 592,284
	韓 国	895 (276)	千韓国ウォン 9,015,346 (97,920)	117 (88)	千韓国ウォン 810,138 (23,712)
	台 湾	46,860 (5,577)	千新台幣ドル 215,560 (2,496)	4,125 (-)	千新台幣ドル 8,939 (0.439)
	イ ン ド	7,658 (1,378)	千インドルピー 436,550 (-)	1,023	千インドルピー 18,778
	カ タ ー ル	519 (36)	千カタールリアル 1,957 (76)	30 (7)	千カタールリアル 157 (40)
	南 ア フ リ カ	5,787 (283)	千南アフリカランド 73,911 (384)	1,052	千南アフリカランド 9,842
	アラブ首長国連邦	5,431 (156)	千アラブ首長国連邦ディルハム 3,331 (41)	- (78)	千アラブ首長国連邦ディルハム - (16)

(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	イ タ	証券 - (39,500)	千タイバーツ - (-)	証券 39,500	千タイバーツ 314

(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				
メキシコ	口	千メキシコペソ	口	千メキシコペソ
CONTROLADORA COML MEXIC-UB	—	—	17,400 (—)	550 (267)
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	47,500 (—)	1,693 (△214)	—	—
小 計	47,500 (—)	1,693 (△214)	17,400 (—)	550 (267)
ブラジル	口	千ブラジルリアル	口	千ブラジルリアル
VIA VAREJO SA	—	—	6,400	25
KLABIN SA-UNIT	16,200	253	—	—
小 計	16,200	253	6,400	25
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	107,681	1,244	—	—
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	41,789	1,016	—	—
小 計	149,470	2,260	—	—

(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 株式先物取引	百万円 8,402	百万円 9,379	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	8,415,447千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	25,229,977千円
(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	11,333	59	0.5	5,357	43	0.8
金 銭 信 託	2,722	2,722	100.0	2,721	2,721	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	6,071	885	14.6	6,072	884	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		
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	169	169	218	23,105	素材
CREDICORP LTD	36	42	694	73,315	銀行
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	306	403	314	33,189	電気通信サービス
SOUTHERN COPPER CORP	69	91	272	28,791	素材
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	—	97	500	52,862	消費者サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	—	254	329	34,779	小売
FANG HOLDINGS LTD-ADR	—	186	61	6,457	ソフトウェア・サービス
TAL EDUCATION GROUP- ADR	—	25	199	21,111	消費者サービス
58.COM INC-ADR	—	49	200	21,150	ソフトウェア・サービス
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	—	784	7,586	801,358	ソフトウェア・サービス
YUM CHINA HOLDINGS INC	—	284	738	77,997	消費者サービス

※ 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)		
CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	—	269	1,138	120,276	小売	
NETEASE INC-ADR	—	54	1,360	143,688	ソフトウェア・サービス	
BAIDU INC - SPON ADR	—	191	3,237	341,933	ソフトウェア・サービス	
YY INC-ADR	—	23	108	11,431	ソフトウェア・サービス	
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	—	15	46	4,949	小売	
JD.COM INC-ADR	—	474	1,192	125,989	小売	
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	584	—	—	—	エネルギー	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	—	453	70	7,450	不動産	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	296	336	1,612	170,364	エネルギー	
GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR REG S	387	387	75	8,024	電気通信サービス	
GAZPROM OAO-SPON ADR	3,414	4,372	1,976	208,782	エネルギー	
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	523	958	378	39,975	銀行	
SURGUTNEFTGAZ-SP ADR	688	814	374	39,576	エネルギー	
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	53	70	751	79,341	エネルギー	
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	340	401	616	65,093	素材	
ROSTELECOM-SPONSORED ADR	124	216	165	17,462	電気通信サービス	
ROSNEFT OJSC-GDR	818	818	441	46,669	エネルギー	
SEVERSTAL - GDR REG S	155	155	214	22,652	素材	
TATNEFT-SPONSORED ADR	136	163	558	58,981	エネルギー	
VTB BANK PJSC -GDR-REG S	1,624	2,002	421	44,492	銀行	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	151	207	746	78,856	食品・生活必需品小売り	
RUSHYDRO PJSC-ADR	857	1,678	198	20,918	公益事業	
SBERBANK-SPONSORED ADR	1,549	1,872	1,814	191,659	銀行	
PHOSAGRO OAO-GDR REG S	—	96	119	12,651	素材	
MEGAFON-PJSC	57	107	99	10,560	電気通信サービス	
DP WORLD LTD	109	109	188	19,886	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額	12,453	18,641	29,023	3,065,789	
	銘 柄 数 <比 率>	22	36	—	<10.3%>	
(メキシコ)				千メキシコペソ		
ALFA S. A. B. -A	1,750	1,750	4,730	25,212	資本財	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER	295	295	4,180	22,280	食品・飲料・タバコ	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	1,014	1,297	22,934	122,238	食品・飲料・タバコ	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	109	109	2,028	10,811	小売	
GRUPO FIN SANTANDER-B	1,073	1,518	4,980	26,546	銀行	
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	1,406	1,688	15,694	83,654	メディア	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,035	1,304	6,782	36,148	食品・飲料・タバコ	
GRUMA S. A. B. -B	98	142	3,653	19,473	食品・飲料・タバコ	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	112	169	3,409	18,173	運輸	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	375	375	3,127	16,671	資本財	
CEMEX SAB-SPONS	7,748	9,224	15,091	80,437	素材	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	1,398	1,676	17,628	93,958	銀行	
MEXICHEM SAB DE CV-*	621	944	4,092	21,812	素材	
INDUSTRIAS PENOLAS SAB DE CV	99	99	5,548	29,573	素材	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	926	926	3,848	20,512	家庭用品・パーソナル用品	
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	99	154	4,713	25,122	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)		
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	2,267	2,589	13,169	70,194	素材	
AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	17,644	22,275	26,685	142,236	電気通信サービス	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	1,165	1,505	4,346	23,166	銀行	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	230	336	3,829	20,409	食品・飲料・タバコ	
WALMART DE MEXICO-SER V	2,719	3,775	15,254	81,305	食品・生活必需品小売り	
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	174	277	4,984	26,569	運輸	
OHL MEXICO SAB DE CV	376	376	819	4,366	運輸	
ENTERA SAB DE CV	771	771	2,780	14,822	各種金融	
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	196	196	825	4,402	食品・生活必需品小売り	
GRUPO LALA SAB DE CV	358	358	1,231	6,562	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	44,064 26	54,136 26	196,371 —	1,046,661 <3.5%>	
(ブラジル)			千ブラジルレアル			
BRF SA	347	446	2,372	77,706	食品・飲料・タバコ	
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	161	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
VALE SA	680	867	2,167	70,985	素材	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	33	33	115	3,797	公益事業	
VALE SA-PREF A	1,122	1,334	3,069	100,538	素材	
TIM PARTICIPACOES SA	412	729	634	20,771	電気通信サービス	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	177	177	474	15,541	公益事業	
BANCO DO BRASIL S. A.	471	635	1,732	56,732	銀行	
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	280	—	—	—	素材	
AES TIETE SA-PREF	61	—	—	—	公益事業	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	2,178	2,722	2,532	82,923	銀行	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	318	382	762	24,968	小売	
LOJAS AMERICANAS SA	90	108	163	5,347	小売	
GERDAU SA-PREF	432	768	924	30,283	素材	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	1,564	2,134	3,894	127,546	エネルギー	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	2,441	2,676	4,456	145,940	エネルギー	
KROTON EDUCATIONAL SA	726	1,014	1,533	50,219	消費者サービス	
CCR SA	415	619	1,034	33,874	運輸	
WEG SA	314	475	794	26,031	資本財	
BANCO BRADESCO SA-PREF	1,388	1,966	6,262	205,100	銀行	
BANCO BRADESCO S. A.	382	531	1,630	53,413	銀行	
NATURA COSMETICOS SA	107	107	284	9,331	家庭用品・パーソナル用品	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	234	604	654	21,442	素材	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	185	185	196	6,428	素材	
CPFL ENERGIA SA	156	160	387	12,678	公益事業	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1,709	2,264	8,363	273,920	銀行	
PORTO SEGURO SA	73	73	219	7,174	保険	
FIBRIA CELULOSE SA	139	139	353	11,585	素材	
BRASKEM SA-PREF A	89	89	243	7,974	素材	
ENGIE BRASIL SA	57	143	552	18,100	公益事業	
LOCALIZA RENT A CAR	108	108	411	13,481	運輸	
LOJAS RENNEN S. A.	295	427	1,046	34,261	小売	

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)		
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	47	266	400	13,110	公益事業	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	196	237	1,612	52,818	エネルギー	
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	43	134	565	18,519	エネルギー	
TOTVS SA	73	73	183	6,019	ソフトウェア・サービス	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	75	128	716	23,479	公益事業	
EMBRAER SA	334	414	723	23,700	資本財	
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	103	103	150	4,918	公益事業	
M DIAS BRANCO SA	21	21	268	8,803	食品・飲料・タバコ	
ODONTOPREV S. A.	124	124	144	4,722	ヘルスケア機器・サービス	
B2W CIA DIGITAL	67	—	—	—	小売	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	224	496	600	19,663	不動産	
JBS SA	444	444	404	13,261	食品・飲料・タバコ	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	358	659	597	19,559	公益事業	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	261	261	846	27,720	公益事業	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	55	55	342	11,225	不動産	
BANCO ESTADO RIO GRANDE SUL	115	—	—	—	銀行	
ESTACIO PARTICIPACOES SA	138	—	—	—	消費者サービス	
DURATEX SA	216	216	168	5,521	素材	
HYPERMARCAS SA	216	216	559	18,314	家庭用品・パーソナル用品	
BM&FBOVESPA SA	1,052	1,186	2,131	69,798	各種金融	
TELEFONICA BRASIL S. A.	194	325	1,481	48,514	電気通信サービス	
QUALICORP SA	83	208	407	13,344	ヘルスケア機器・サービス	
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	114	114	504	16,509	各種金融	
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	135	—	—	—	運輸	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	108	108	663	21,724	食品・生活必需品小売り	
CIELO SA	450	693	2,195	71,908	ソフトウェア・サービス	
RAIA DROGASIL SA	129	170	1,140	37,346	食品・生活必需品小売り	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	450	450	1,358	44,477	保険	
AMBEV SA	2,587	3,256	5,838	191,194	食品・飲料・タバコ	
AES TIETE ENERGIA SA-UNIT	—	145	230	7,553	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	25,565	32,423	71,506	2,341,835	
	銘柄 数 <比 率>	61	55	—	<7.9%>	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO SANTANDER CHILE	29,096	42,382	156,476	25,443	銀行	
BANCO DE CREDITO E INVERSION	22	24	82,666	13,441	銀行	
BANCO DE CHILE	11,147	11,395	88,352	14,366	銀行	
AES GENER SA	1,417	1,417	30,738	4,998	公益事業	
EMPRESAS CMPC SA	569	842	117,528	19,110	素材	
EMPRESAS COPEC SA	237	324	213,300	34,682	エネルギー	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	93	93	64,230	10,443	食品・飲料・タバコ	
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	60	77	54,905	8,927	電気通信サービス	
ENEL GENERACION CHILE SA	1,581	2,160	97,240	15,811	公益事業	
ENERSIS AMERICAS SA	10,304	10,304	115,487	18,778	公益事業	
COLBUN SA	4,758	4,758	67,966	11,051	公益事業	
AGUAS ANDINAS SA-A	1,632	1,632	69,855	11,358	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)		
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	152	152	40,279	6,549	食品・飲料・タバコ	
LATAM AIRLINES GROUP SA	221	221	140,635	22,867	運輸	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	41	72	135,660	22,058	素材	
S. A. C. I. FALABELLA	515	515	267,296	43,462	小売	
ITAU CORPBANCA	84,199	152,847	86,618	14,084	銀行	
VINA CONCHA Y TORO SA	367	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
CENCOSUD SA	673	947	201,072	32,694	食品・生活必需品小売り	
SONDA SA	342	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
ENDESA AMERICAS SA	—	2,160	67,533	10,980	公益事業	
ENEL CHILE SA	—	10,304	70,218	11,417	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	147,435 20	242,637 20	2,168,063 —	352,527 <1.2%>	
(コロンビア)			千コロンビアペソ			
ALMACENES EXITO SA	127	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
INTERCONEXION ELECTRICA SA	207	486	498,370	17,542	公益事業	
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	—	103	388,681	13,681	各種金融	
ISAGEN SA ESP	497	—	—	—	公益事業	
ECOPETROL SA	3,573	3,573	473,458	16,665	エネルギー	
BANCO DAVIVIENDA SA	59	—	—	—	銀行	
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	47	47	175,590	6,180	各種金融	
GRUPO AVAL ACCIONES-PF	1,309	3,037	370,523	13,042	銀行	
CEMENTOS ARGOS SA	117	320	371,327	13,070	素材	
GRUPO ARGOS SA	177	177	339,927	11,965	素材	
BANCOLOMBIA SA-PREF	253	338	961,486	33,844	銀行	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	145	145	555,013	19,536	各種金融	
CORP FIN COLOMBIANA-CD	42	—	—	—	各種金融	
CORP FINANCIERA COLOMB-ND	0.39	—	—	—	各種金融	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	6,558 13	8,229 9	4,134,378 —	145,530 <0.5%>	
(ギリシャ)			千ユーロ			
ALPHA BANK AE	—	944	145	16,794	銀行	
NATIONAL BANK OF GREECE	—	4,015	74	8,575	銀行	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	—	201	160	18,572	電気通信サービス	
EUROBANK ERGASIAS SA	—	1,489	75	8,770	銀行	
OPAP SA	—	176	153	17,744	消費者サービス	
JUMBO SA	—	85	102	11,852	小売	
TITAN CEMENT CO. S. A.	—	43	88	10,247	素材	
FF GROUP	—	34	71	8,232	小売	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	— —	6,991 8	873 —	100,790 <0.3%>	
(トルコ)			千トルコリラ			
AKBANK T. A. S.	1,328	1,614	1,276	41,959	銀行	
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	112	112	208	6,848	食品・飲料・タバコ	
ARCELIK AS	153	153	312	10,264	耐久消費財・アパレル	
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	316	—	—	—	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)		
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	613	1,167	471	15,499	素材	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	32	32	100	3,318	自動車・自動車部品	
KOC HOLDING AS	387	387	487	16,024	資本財	
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	320	480	186	6,121	素材	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	364	393	126	4,148	資本財	
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	67	67	151	4,972	自動車・自動車部品	
TURK HAVA YOLLARI AO	323	621	332	10,933	運輸	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	377	561	539	17,734	電気通信サービス	
TURKIYE GARANTI BANKASI	1,371	1,656	1,285	42,240	銀行	
TURKIYE IS BANKASI-C	727	1,111	544	17,899	銀行	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	74	74	478	15,737	エネルギー	
ULKER BISKUVI SANAYI	96	96	175	5,778	食品・飲料・タバコ	
YAPI VE KREDI BANKASI	517	1,055	355	11,692	銀行	
HACI OMER SABANCI HOLDING	614	614	546	17,949	各種金融	
COCA-COLA ICECEK AS	44	44	149	4,897	食品・飲料・タバコ	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	103	155	784	25,772	食品・生活必需品小売り	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	519	519	233	7,663	銀行	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	98	98	127	4,201	運輸	
TURKIYE HALK BANKASI	353	524	492	16,195	銀行	
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	177	177	102	3,374	電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	9,096	11,721	9,471	311,230	
	銘柄数 <比率>	24	23	—	<1.0%>	
(チェコ)				千チェココルナ		
KOMERCNI BANKA AS	11	87	7,855	33,541	銀行	
02 CZECH REPUBLIC AS	—	45	1,024	4,375	電気通信サービス	
CEZ AS	137	137	6,181	26,395	公益事業	
PEGAS NONWOVENS SA	7	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
小 計	株 数 ・ 金 額	155	269	15,061	64,312	
	銘柄数 <比率>	3	3	—	<0.2%>	
(ハンガリー)				千ハンガリーフォリント		
RICHTER GEDEON NYRT	84	84	52,107	19,686	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	42,631	16,106	エネルギー	
OTP BANK NYRT	134	202	161,110	60,867	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	241	309	255,849	96,659	
	銘柄数 <比率>	3	3	—	<0.3%>	
(ポーランド)				千ポーランドズロチ		
BANK MILLENNIUM SA	330	330	191	5,095	銀行	
M BANK SA	8	18	630	16,790	銀行	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	20	20	147	3,925	銀行	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	83	122	991	26,395	素材	
BANK PEKAO SA	78	78	939	25,003	銀行	
ORANGE POLSKA SA	556	556	301	8,012	電気通信サービス	
POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	172	215	1,577	41,981	エネルギー	
LPP SA	0.67	0.67	381	10,139	耐久消費財・アパレル	
BANK ZACHODNI WBK SA	23	23	736	19,589	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)		
PKO BANK POLSKI SA	498	630	1,712	45,563	銀行	
CCC SA	12	12	244	6,493	耐久消費財・アパレル	
SYNTHOS SA	337	337	148	3,960	素材	
EUROCASH SA	50	50	192	5,133	食品・生活必需品小売り	
GRUPA LOTOS SA	55	55	184	4,917	エネルギー	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	1,464	1,464	714	19,023	エネルギー	
CYFROWY POLSAT SA	118	243	590	15,723	メディア	
GRUPA AZOTY SA	27	27	155	4,150	素材	
ENEA SA	129	129	136	3,626	公益事業	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	418	634	657	17,487	公益事業	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	570	570	147	3,930	公益事業	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	31	406	1,114	29,644	保険	
ALIOR BANK SA	29	88	393	10,479	銀行	
ENERGA SA	128	128	101	2,713	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	5,149	6,148	12,393	329,781	
(香港)		23	23	—	<1.1%>	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	830	830	838	11,417	素材	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	680	680	734	10,002	運輸	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	860	1,760	769	10,475	運輸	
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	3,420	4,310	37,410	509,535	電気通信サービス	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	765	765	1,694	23,078	素材	
DATANG INTL POWER GENERATION CO. LTD. -H	1,580	—	—	—	公益事業	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	235	390	1,386	18,883	資本財	
HUANENG POWER INTL INC-H	1,900	2,580	1,235	16,831	公益事業	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	1,400	2,240	920	12,539	ヘルスケア機器・サービス	
YANZHOU COAL MINING CO-H	1,120	1,120	652	8,893	エネルギー	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	400	490	3,020	41,143	家庭用品・パーソナル用品	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	840	840	274	3,741	公益事業	
NEW WORLD CHINA LAND LTD	1,700	—	—	—	不動産	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	1,500	2,360	2,284	31,114	自動車・自動車部品	
CHINA INTL MARINE CO-H	356	—	—	—	資本財	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	2,120	2,980	2,351	32,023	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	2,110	2,790	6,585	89,692	不動産	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	1,731	2,071	3,955	53,878	不動産	
CITIC LTD	2,360	2,880	3,202	43,618	資本財	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	1,080	1,080	868	11,826	運輸	
LENOVO GROUP LTD	3,600	5,680	2,703	36,824	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PETROCHINA CO LTD-H	11,700	15,140	7,872	107,227	エネルギー	
CHINA UNICOM (HONG KONG) LTD-R	3,160	4,440	3,924	53,457	電気通信サービス	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	1,018	1,018	1,529	20,830	保険	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	13,794	18,174	9,923	135,151	エネルギー	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	—	960	1,593	21,704	ソフトウェア・サービス	
ENN ENERGY HOLDINGS LIMITED	420	560	2,002	27,267	公益事業	
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	1,620	2,580	1,486	20,240	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)	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	1,020	1,020	805	10,974	運輸
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	3,440	—	—	—	不動産
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	555	915	1,826	24,878	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,560	3,400	1,043	14,216	素材
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	620	620	939	12,801	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LTD	840	1,360	1,591	21,672	公益事業
GEEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	2,950	4,250	3,357	45,729	自動車・自動車部品
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	520	520	1,268	17,281	公益事業
BYD CO LTD-H	370	495	2,405	32,765	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD-H	8,400	10,060	3,933	53,573	電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	1,040	1,040	718	9,787	エネルギー
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	5,300	7,800	1,154	15,722	メディア
SINOTRANS LIMITED-H	910	910	327	4,461	運輸
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	1,070	1,470	1,403	19,120	商業・専門サービス
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,928	3,208	3,850	52,441	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	1,240	1,240	654	8,917	資本財
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	1,134	1,134	1,483	20,202	公益事業
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	1,492	2,037	1,477	20,119	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	4,150	5,300	10,101	137,586	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	3,790	3,790	1,038	14,143	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1,080	1,080	546	7,443	ヘルスケア機器・サービス
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	12,140	21,390	2,224	30,298	半導体・半導体製造装置
WEICHAJ POWER CO LTD-H	544	544	673	9,172	資本財
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	1,990	1,990	776	10,570	素材
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	150	380	893	12,162	資本財
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	1,220	1,220	1,072	14,605	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	200	200	616	8,389	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	1,500	2,180	2,620	35,689	公益事業
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	660	1,280	2,060	28,068	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	880	880	743	10,127	運輸
CNOOC LTD-R	9,650	12,390	11,807	160,820	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,640	3,670	1,981	26,992	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	358	4,884	運輸
CHINA MENGNIU DAIRY CO-R	1,540	1,970	2,951	40,193	食品・飲料・タバコ
TENCENT HOLDINGS LTD	2,887	3,940	79,745	1,086,135	ソフトウェア・サービス
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2,975	3,665	14,714	200,417	保険
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	2,220	3,580	2,115	28,816	公益事業
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	5,939	5,939	588	8,008	小売
CHINA POWER INTERNATIONAL	2,080	2,080	582	7,932	公益事業
AIR CHINA LIMITED-H	1,180	1,180	602	8,212	運輸
ZTE CORP-H	485	485	534	7,280	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	581	7,917	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	1,710	2,540	4,277	58,257	エネルギー
CHINA COSCO HOLDINGS-H	1,605	1,605	423	5,771	運輸
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	4,844	6,094	3,571	48,644	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)	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	1,000	1,000	1,208	16,452	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	46,446	58,446	32,262	439,412	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	320	320	1,572	21,421	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,660	1,660	1,318	17,951	自動車・自動車部品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	1,010	1,010	633	8,625	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	1,340	2,980	1,141	15,545	素材
BANK OF CHINA LTD-H	43,942	53,542	18,204	247,942	銀行
SHUI ON LAND LTD	2,092	2,092	401	5,472	不動産
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	655	655	674	9,188	不動産
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	688	688	748	10,195	不動産
CHINA MERCHANTS BANK-H	2,594	2,964	5,400	73,559	銀行
IND&COMM BK OF CHINA-H	40,505	51,495	23,584	321,224	銀行
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	1,300	1,300	590	8,038	電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	2,390	3,120	2,742	37,352	資本財
CHINA COAL ENERGY CO - H	2,290	2,290	957	13,037	エネルギー
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	350	350	521	7,102	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	395	395	1,520	20,712	資本財
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	700	700	898	12,241	耐久消費財・アパレル
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	1,463	-	-	-	食品・飲料・タバコ
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2,672	4,212	1,748	23,812	不動産
CHINA CITIC BANK-H	4,102	6,272	3,085	42,028	銀行
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	2,280	4,010	1,800	24,522	耐久消費財・アパレル
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	420	710	1,633	22,241	耐久消費財・アパレル
FOSUN INTERNATIONAL	930	1,850	2,097	28,573	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	2,200	2,200	468	6,382	不動産
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	1,875	1,875	611	8,329	不動産
SOHO CHINA LTD	1,130	1,130	444	6,048	不動産
KINGSOFT CORP LTD	400	660	1,125	15,335	ソフトウェア・サービス
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	5,510	10,350	1,055	14,378	半導体・半導体製造装置
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	2,000	3,000	1,887	25,700	資本財
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	1,095	1,095	1,121	15,271	資本財
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	3,290	3,290	1,533	20,881	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	1,548	1,768	4,862	66,220	保険
CHINA EVERGRANDE GROUP	2,950	2,950	1,572	21,415	不動産
CRRC CORP LTD-H	2,340	3,150	2,161	29,436	資本財
SUN ART RETAIL GROUP LTD	875	1,950	1,029	14,023	食品・生活必需品小売り
BBMG CORPORATION - H	690	-	-	-	素材
SINOPHARM GROUP CO-H	720	900	3,177	43,270	ヘルスケア機器・サービス
CHINA RESOURCES CEMENT	1,340	-	-	-	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	1,222	1,222	1,174	16,000	自動車・自動車部品
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	1,390	1,390	629	8,576	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	2,530	2,530	1,520	20,709	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	430	430	847	11,537	ヘルスケア機器・サービス
HUANENG RENEWABLES CORP-H	3,060	3,060	752	10,252	公益事業
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	1,770	-	-	-	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)	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)		
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	780	1,900	1,050	14,310	不動産	
LONGFOR PROPERTIES	730	730	730	9,942	不動産	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	488	488	1,649	22,465	保険	
CHINA MINSHENG BANKING-H	3,350	4,210	3,687	50,230	銀行	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	2,230	2,230	791	10,782	銀行	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	13,830	15,910	5,075	69,125	銀行	
FAR EAST HORIZON LTD	1,410	1,410	1,015	13,827	各種金融	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	1,150	1,415	2,397	32,647	各種金融	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	510	1,000	1,218	16,589	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	2,036	2,036	2,785	37,935	各種金融	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	400	510	3,567	48,588	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	3,690	5,660	1,692	23,049	保険	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	260	260	627	8,551	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	465	6,344	資本財	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	1,725	2,590	1,906	25,962	各種金融	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	6,500	6,500	115	1,575	半導体・半導体製造装置	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	4,350	4,350	1,257	17,122	食品・飲料・タバコ	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	5,250	7,620	2,057	28,021	各種金融	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	855	855	1,236	16,838	資本財	
CHINA VANKE CO LTD-H	750	750	1,545	21,042	不動産	
LUYE PHARMA GROUP LTD	655	655	328	4,469	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	6,690	1,485	20,228	公益事業	
DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	307	—	—	—	不動産	
GF SECURITIES CO LTD-H	716	1,056	1,786	24,335	各種金融	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	440	1,054	1,696	23,112	各種金融	
3SBIO INC	—	845	689	9,391	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	476	476	547	7,462	自動車・自動車部品	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	426,011	530,347	447,796	6,098,989	
		143	136	—	<20.5%>	
(マレーシア)				千マレーシアリンギット		
AMMB HOLDINGS BHD	1,302	1,302	528	13,136	銀行	
GENTING PLANTATIONS BHD	140	140	146	3,645	食品・飲料・タバコ	
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	3,108	3,253	1,561	38,802	銀行	
DIGI.COM BERHAD	1,520	2,750	1,380	34,305	電気通信サービス	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	535	535	344	8,563	運輸	
RHB BANK BHD	339	531	251	6,243	銀行	
HAP SENG CONSOLIDATED	—	382	298	7,423	資本財	
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	315	315	97	2,429	消費者サービス	
GAMUDA BHD	747	1,392	675	16,776	資本財	
YTL CORPORATION BERHAD	2,474	2,474	390	9,714	公益事業	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	149	149	227	5,655	銀行	
HONG LEONG BANK BERHAD	225	261	343	8,539	銀行	
IJM CORP BHD	1,148	1,981	643	15,999	資本財	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	286	286	674	16,772	食品・飲料・タバコ	
MALAYAN BANKING BHD	2,662	3,106	2,445	60,758	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)	
LAFARGE MALAYAN BHD	261	261	203	5,058	素材
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	706	706	267	6,649	銀行
MISC BHD	565	565	407	10,116	運輸
PPB GROUP BERHAD	205	421	673	16,738	食品・飲料・タバコ
PETRONAS DAGANGAN BHD	153	203	475	11,804	エネルギー
PETRONAS GAS BHD	319	446	980	24,360	公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	51	109	522	12,979	食品・飲料・タバコ
TELECOM MALAYSIA BHD	705	705	457	11,378	電気通信サービス
TENAGA NATIONAL BHD	1,969	2,197	3,138	77,988	公益事業
UMW HOLDINGS BHD	340	340	185	4,613	自動車・自動車部品
DIALOG GROUP BHD	2,229	2,229	338	8,421	資本財
PUBLIC BANK BHD-LOCAL MKT	1,483	1,699	3,344	83,099	銀行
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	1,223	1,223	174	4,346	公益事業
AIRASIA BHD	648	648	182	4,540	運輸
GENTING BHD	1,489	1,489	1,161	28,861	消費者サービス
GENTING MALAYSIA BERHAD	1,584	2,241	1,048	26,062	消費者サービス
IOI CORPORATION BHD	1,796	1,796	783	19,463	食品・飲料・タバコ
SIME DARBY BERHAD	1,655	1,655	1,357	33,732	資本財
HARTALEGA HOLDINGS BHD	—	360	170	4,240	ヘルスケア機器・サービス
AXIATA GROUP BERHAD	1,486	1,539	723	17,977	電気通信サービス
BUMI ARMADA BERHAD	3,074	—	—	—	エネルギー
MAXIS BHD	900	1,355	800	19,900	電気通信サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	1,344	1,388	959	23,833	素材
SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	2,826	2,826	418	10,393	エネルギー
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	1,185	1,185	322	8,009	メディア
IHH HEALTHCARE BHD	1,154	2,293	1,456	36,182	ヘルスケア機器・サービス
FELDA GLOBAL VENTURES	803	803	151	3,771	食品・飲料・タバコ
WESTPORTS HOLDINGS BHD	1,249	700	303	7,532	運輸
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	1,230	1,230	289	7,186	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	47,591 42	51,477 43	31,308 —	778,010 <2.6%>
(タイ)			千タイバーツ		
BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	162	162	2,600	7,826	銀行
KRUNG THAI BANK - NVDR	2,472	2,472	4,277	12,875	銀行
ROBINSON DEPT STORE-NVDR	—	348	2,044	6,153	小売
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	811	990	14,256	42,910	銀行
TRUE CORP PCL-NVDR	5,987	6,077	4,618	13,901	電気通信サービス
KASIKORNBANK PCL-NVDR	350	516	8,797	26,481	銀行
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	4,306	13,365	2,779	8,367	銀行
IRPC PCL - NVDR	5,728	5,728	2,772	8,344	エネルギー
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	790	1,185	2,429	7,312	エネルギー
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	202	—	—	—	銀行
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,501	2,668	8,137	24,493	食品・飲料・タバコ
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	549	709	10,812	32,544	電気通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	2,316	2,316	2,304	6,937	小売

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)	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	323	323	2,495	7,510	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PTT PCL-NVDR	571	664	22,908	68,953	エネルギー
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	1,112	2,330	5,126	15,429	食品・飲料・タバコ
SIAM CEMENT PUBLIC CO-FOR REG	126	187	9,387	28,256	素材
SIAM CEMENT PCL-NVDR	65	113	5,627	16,938	素材
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	561	561	1,138	3,427	メディア
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	231	305	11,376	34,243	運輸
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	686	686	11,696	35,205	銀行
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	748	748	4,095	12,326	不動産
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	2,050	3,278	7,539	22,693	ヘルスケア機器・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	256	256	4,787	14,409	ヘルスケア機器・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,079	1,618	6,108	18,386	消費者サービス
THAI OIL PCL-NVDR	480	480	3,444	10,366	エネルギー
GLOW ENERGY PCL - NVDR	296	296	2,360	7,105	公益事業
CP ALL PCL-NVDR	2,999	3,484	21,600	65,018	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	3,675	3,675	3,142	9,457	運輸
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	762	1,124	9,132	27,488	エネルギー
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	874	2,124	6,956	20,937	素材
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,006	1,487	8,812	26,525	素材
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	687	687	2,061	6,203	エネルギー
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	—	3,912	3,090	9,302	運輸
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	218,716	658,335	
	金額	金額	—	<2.2%>	
(フィリピン)			千フィリピンペソ		
AYALA LAND INC	3,700	5,807	19,743	42,844	不動産
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	639	1,146	8,699	18,877	資本財
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	524	524	5,058	10,977	銀行
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	1,391	1,391	1,863	4,044	資本財
DMCI HOLDINGS INC	3,454	3,454	4,394	9,535	資本財
GLOBE TELECOM INC	17	17	2,749	5,966	電気通信サービス
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	85	632	4,553	9,880	運輸
JG SUMMIT HOLDINGS INC	1,320	2,298	16,515	35,838	資本財
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	254	254	5,904	12,812	消費者サービス
METROPOLITAN BANK & TRUST	411	411	3,199	6,943	銀行
BDO UNIBANK INC	799	1,149	12,650	27,451	銀行
MEGAWORLD CORP	6,380	6,380	2,539	5,510	不動産
PLDT INC	47	62	8,988	19,505	電気通信サービス
ROBINSONS LAND CO	—	930	2,594	5,630	不動産
SECURITY BANK CORP	—	220	4,659	10,111	銀行
SM PRIME HOLDINGS INC	4,674	5,902	15,405	33,429	不動産
UNIVERSAL ROBINA CORP	459	633	10,933	23,724	食品・飲料・タバコ
SM INVESTMENTS CORP	86	200	13,136	28,505	資本財
AYALA CORPORATION	107	154	12,189	26,451	各種金融
ENERGY DEVELOPMENT CORP	6,063	6,063	3,364	7,301	公益事業
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	7,357	7,357	5,135	11,143	各種金融

銘柄	株数 (百株)	当期首(前期末)	株数 (百株)	期 末		業 種
				評 価	額	
ABOITIZ POWER CORP	895		895	4,054	8,797	公益事業
GT CAPITAL HOLDINGS INC	35		61	8,098	17,573	各種金融
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	38,705	45,946	176,432	382,857	
(インドネシア)		21	23	—	<1.3%>	
AKR CORPORINDO TBK PT	—		1,402	974,390	7,892	資本財
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	200		—	—	—	食品・飲料・タバコ
UNITED TRACTORS TBK PT	679		1,289	2,929,252	23,726	エネルギー
INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	2,489		2,489	2,040,980	16,531	食品・飲料・タバコ
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	11,357		14,100	11,632,500	94,223	自動車・自動車部品
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	4,321		4,321	1,551,239	12,565	食品・飲料・タバコ
GUDANG GARAM TBK PT	169		308	2,069,760	16,765	食品・飲料・タバコ
HM SAMPOERNA TBK PT	—		7,989	3,227,556	26,143	食品・飲料・タバコ
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	571		1,053	1,684,800	13,646	素材
SUMMARECON AGUNG TBK PT	4,532		4,532	663,938	5,377	不動産
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	436		—	—	—	エネルギー
BANK DANAMON INDONESIA TBK	1,965		1,965	736,875	5,968	銀行
BANK MANDIRI	4,793		6,667	7,568,157	61,302	銀行
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	1,250		1,855	3,097,850	25,092	小売
UNILEVER INDONESIA TBK PT	891		1,195	5,302,812	42,952	家庭用品・パーソナル用品
PT BANK RAKYAT INDONESIA	6,371		7,325	9,229,500	74,758	銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	4,916		7,915	1,962,920	15,899	公益事業
BANK NEGARA INDONESIA PT	4,716		4,716	2,629,170	21,296	銀行
KALBE FARMA TBK PT	12,534		12,534	2,143,314	17,360	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		2,346	2,164,185	17,529	素材
BANK CENTRAL ASIA PT	6,829		8,377	12,816,810	103,816	銀行
TELEKOMUNIKASI INDONESIA	31,358		34,635	14,269,620	115,583	電気通信サービス
XL AXIATA TBK PT	1,725		1,725	431,250	3,493	電気通信サービス
LIPPO KARAWACI TBK PT	12,130		12,130	1,073,505	8,695	不動産
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	4,730		4,730	380,765	3,084	メディア
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	1,757		6,305	1,245,237	10,086	メディア
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	1,235		1,235	560,690	4,541	運輸
BUMI SERPONG DAMAI PT	6,834		6,834	1,414,638	11,458	不動産
ADARO ENERGY PT	8,005		8,005	1,256,785	10,179	エネルギー
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	805		1,610	1,521,450	12,323	食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,334		1,334	783,725	6,348	電気通信サービス
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	—		3,924	961,380	7,787	資本財
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	2,924		5,965	1,479,320	11,982	メディア
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	143,203	180,810	99,804,374	808,415	
(韓国)		30	31	—	<2.7%>	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	50		50	80,866	7,423	メディア
HANMI SCIENCE CO LTD	5		5	41,923	3,848	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	20		29	278,980	25,610	自動車・自動車部品
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	18		23	686,167	62,990	保険

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)		
DONGBU INSURANCE CO LTD	27	40	282,874	25,967	保険	
COWAY CO.,LTD.	30	39	372,715	34,215	耐久消費財・アパレル	
KT&G CORP	59	82	922,208	84,658	食品・飲料・タバコ	
S-1 CORPORATION	9	9	89,856	8,248	商業・専門サービス	
KOREA GAS CORPORATION	14	14	65,299	5,994	公益事業	
CJ CORP	8	12	212,175	19,477	資本財	
DOOSAN INFRACORE CO LTD	89	—	—	—	資本財	
SK TELECOM	5	16	359,869	33,036	電気通信サービス	
DGB FINANCIAL GROUP INC	122	122	113,184	10,390	銀行	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	15	15	125,680	11,537	資本財	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	117	117	90,162	8,276	各種金融	
NCSOFT CORPORATION	8	11	313,458	28,775	ソフトウェア・サービス	
LG UPLUS CORP	125	125	147,069	13,500	電気通信サービス	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	33	33	80,709	7,409	資本財	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	82	82	51,852	4,760	資本財	
POSCO DAEWOO CORP	15	53	126,813	11,641	資本財	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	5	6	529,480	48,606	家庭用品・パーソナル用品	
LG CHEM LTD	26	32	790,130	72,533	素材	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	4	4	82,388	7,563	素材	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	—	1	67,095	6,159	家庭用品・パーソナル用品	
LS INDUSTRIAL SYSTEMS	11	—	—	—	資本財	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	231	294	1,238,624	113,705	銀行	
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	37	37	174,119	15,984	資本財	
S-OIL CORPORATION	23	34	280,922	25,788	エネルギー	
HANWHA CHEMICAL CORP	63	63	157,169	14,428	素材	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	29	50	173,094	15,890	各種金融	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	8	11	323,010	29,652	素材	
HOTEL SHILLA CO LTD	21	21	110,828	10,174	小売	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	26	26	371,772	34,128	資本財	
HYUNDAI MOBIS	36	47	1,255,050	115,213	自動車・自動車部品	
SK HYNIX INC	318	400	1,586,000	145,594	半導体・半導体製造装置	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	40	63	260,196	23,886	資本財	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	12	12	116,125	10,660	自動車・自動車部品	
HYUNDAI MOTOR CO	88	100	1,344,020	123,381	自動車・自動車部品	
HYUNDAI STEEL CO	46	62	299,249	27,471	素材	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	180	180	233,695	21,453	銀行	
KCC CORP	3	3	127,629	11,716	資本財	
KIA MOTORS CORPORATION	140	194	773,129	70,973	自動車・自動車部品	
KOREA ZINC CO LTD	4	4	233,288	21,415	素材	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	139	188	866,778	79,570	公益事業	
HANWHA CORPORATION	28	28	95,908	8,804	資本財	
KOREAN AIR LINES CO LTD	19	19	59,166	5,431	運輸	
OCI COMPANY LTD	11	11	96,133	8,825	素材	
KOREA EXPRESS CO LTD	3	3	63,666	5,844	運輸	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	10	10	69,366	6,367	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)	
KT CORP	38	38	120,270	11,040	電気通信サービス
LG ELECTRONICS INC	67	67	306,327	28,120	耐久消費財・アパレル
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	0.45	4	85,950	7,890	食品・飲料・タバコ
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	—	0.31	49,538	4,547	食品・飲料・タバコ
HANSSEM CO LTD	6	6	110,700	10,162	耐久消費財・アパレル
LG CORP	56	70	439,056	40,305	資本財
NH INVESTMENT & SECURITIES C	112	112	113,544	10,423	各種金融
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	33	33	88,178	8,094	資本財
NAVER CORP	15	19	1,548,015	142,107	ソフトウェア・サービス
HYUNDAI DEPT STORE CO	5	12	144,807	13,293	小売
DONGSUH COMPANIES INC	—	15	40,534	3,721	食品・生活必需品小売り
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	22	22	91,327	8,383	各種金融
OTTOGI CORPORATION	—	0.68	44,880	4,119	食品・飲料・タバコ
DOOSAN CORP	4	—	—	—	資本財
PACIFIC CORP	15	21	322,537	29,608	家庭用品・パーソナル用品
KANGWON LAND INC	64	86	319,968	29,373	消費者サービス
POSCO	40	48	1,120,923	102,900	素材
SAMSUNG SDI CO LTD	29	38	361,471	33,183	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	28	48	226,540	20,796	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	61	69	11,114,544	1,020,315	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	74	120	106,562	9,782	資本財
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	11	13	1,666,980	153,028	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINSEGAE CO LTD	4	4	79,647	7,311	小売
HYOSUNG CORPORATION	14	14	184,579	16,944	素材
ORION CORP	2	3	221,493	20,333	食品・飲料・タバコ
YUHAN CORPORATION	5	5	114,177	10,481	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANON SYSTEMS	21	108	116,368	10,682	自動車・自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	43	43	155,016	14,230	保険
GS HOLDINGS CORP	25	41	225,529	20,703	エネルギー
LG DISPLAY CO LTD	116	152	400,519	36,767	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK NETWORKS CO LTD	24	24	16,146	1,482	資本財
HANA FINANCIAL GROUP	161	190	615,961	56,545	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	9	14	245,167	22,506	運輸
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	38	75	170,471	15,649	各種金融
LOTTE SHOPPING CO	7	7	163,655	15,023	小売
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	46	54	567,226	52,071	保険
AMOREPACIFIC CORP	18	22	831,514	76,332	家庭用品・パーソナル用品
AMOREPACIFIC CORP-PREF	4	7	146,260	13,426	家庭用品・パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	18	18	86,404	7,931	各種金融
SK INNOVATION CO LTD	38	44	676,337	62,087	エネルギー
CJ CHEILJEDANG CORP	5	5	183,846	16,877	食品・飲料・タバコ
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	9	9	51,378	4,716	商業・専門サービス
LG INNOTEK CO LTD	8	8	67,360	6,183	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK HOLDINGS CO LTD	21	34	793,500	72,843	資本財
KB FINANCIAL GROUP INC	221	272	1,108,566	101,766	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)		
HYUNDAI WIA CORP	6	18	137,114	12,587	自動車・自動車部品	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	25	37	238,208	21,867	資本財	
BNK FINANCIAL GROUP INC	193	236	210,980	19,367	銀行	
HANMI PHARM CO LTD	2	3	122,436	11,239	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	70,876	6,506	保険	
EMART	11	11	211,757	19,439	食品・生活必需品小売り	
GS RETAIL CO LTD	—	13	64,632	5,933	食品・生活必需品小売り	
HANKOOK TIRE CO LTD	33	47	271,413	24,915	自動車・自動車部品	
BGF RETAIL CO LTD	3	7	143,416	13,165	食品・生活必需品小売り	
SAMSUNG SDS CO LTD	17	23	337,560	30,988	ソフトウェア・サービス	
WOORI BANK	208	208	252,744	23,201	銀行	
SAMSUNG C&T CORP	40	53	770,185	70,702	資本財	
KAKAO CORP	17	17	123,206	11,310	ソフトウェア・サービス	
PARADISE CO LTD	18	18	24,575	2,256	消費者サービス	
DONGSUH COMPANIES INC	15	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
CELLTRION INC	34	51	528,462	48,512	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CJ E&M CORP	—	22	151,267	13,886	メディア	
小 計	株 数 ・ 金 額	4,744	5,709	45,522,515	4,178,966	
	銘柄 数 <比率>	105	107	—	<14.0%>	
(台湾)			千新台湾ドル			
ACER INC	938	2,558	3,363	11,302	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASUSTEK COMPUTER INC	380	500	13,449	45,190	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	279	279	2,850	9,576	半導体・半導体製造装置	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	3,427	4,127	14,652	49,231	半導体・半導体製造装置	
ASIA CEMENT CORP	1,321	1,321	3,535	11,879	素材	
TAIWAN BUSINESS BANK	2,503	5,263	4,105	13,795	銀行	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	340	340	1,397	4,695	素材	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	283	285	2,175	7,308	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
QUANTA COMPUTER INC	1,562	1,962	12,090	40,623	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	421	421	1,798	6,043	不動産	
EVA AIRWAYS CORP	1,330	1,397	2,054	6,901	運輸	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	347	417	9,236	31,034	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	2,311	3,774	6,096	20,484	銀行	
CHINA AIRLINES LTD	1,402	3,272	2,997	10,070	運輸	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	850	1,220	7,860	26,412	自動車・自動車部品	
CHINA STEEL	6,482	7,652	17,907	60,167	素材	
CHINA MOTOR CORP	510	—	—	—	自動車・自動車部品	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	1,959	3,119	8,735	29,349	保険	
ADVANTECH CO LTD	185	185	4,599	15,455	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
COMPAL ELECTRONICS	2,417	2,417	4,460	14,987	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CTCI CORP	170	—	—	—	資本財	
DELTA ELECTRONICS INC	1,025	1,429	22,793	76,584	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NANYA TECHNOLOGY CORP	—	480	1,843	6,193	半導体・半導体製造装置	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	2,053	2,753	30,009	100,831	電気通信サービス	
AU OPTRONICS CORP	5,900	5,900	6,786	22,801	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)	
TAIWAN MOBILE CO LTD	882	1,102	11,956	40,174	電気通信サービス
EVERGREEN MARINE	1,075	1,075	1,220	4,102	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	1,890	1,890	4,470	15,020	資本財
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	133	329	3,966	13,327	耐久消費財・アパレル
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	114	117	3,663	12,307	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	230	400	4,244	14,262	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	2,178	2,788	23,476	78,882	素材
FORMOSA TAFFETA CO.	400	400	1,136	3,816	耐久消費財・アパレル
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	1,690	2,310	21,581	72,512	素材
TRANSCEND INFORMATION INC	94	94	803	2,700	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EPISTAR CORP	570	—	—	—	半導体・半導体製造装置
GIANT MANUFACTURING	134	254	5,576	18,737	耐久消費財・アパレル
MEDIATEK INC	848	1,068	23,550	79,128	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	3,660	4,690	20,076	67,457	各種金融
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	2,790	4,535	7,143	24,002	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	140	140	5,005	16,816	小売
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	950	950	7,125	23,940	電気通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	5,511	7,751	8,759	29,431	各種金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	4,809	5,419	21,190	71,199	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	8,657	11,727	8,901	29,908	銀行
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	4,047	5,914	10,380	34,879	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	7,668	11,013	88,545	297,512	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	5,885	7,503	16,507	55,465	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	60	70	23,513	79,005	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	4,935	7,727	8,692	29,208	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	6,157	6,157	4,101	13,779	保険
INVENTEC CO LTD	1,365	1,365	3,208	10,778	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HTC CORPORATION	374	374	3,016	10,136	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,007	1,504	6,529	21,939	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	261	—	—	—	半導体・半導体製造装置
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	6,205	9,298	8,284	27,837	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	8,524	11,992	20,027	67,291	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	5,205	5,439	8,893	29,881	銀行
MERIDA INDUSTRY CO LTD	115	115	1,593	5,355	耐久消費財・アパレル
POWERTECH TECHNOLOGY INC	477	477	4,098	13,771	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	2,727	3,097	19,948	67,025	素材
WISTRON CORP	1,184	1,219	2,750	9,243	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINSUS INTERCONNECT TECH	30	—	—	—	半導体・半導体製造装置
POU CHEN	1,087	1,537	6,228	20,926	耐久消費財・アパレル
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	2,753	3,523	19,910	66,898	食品・飲料・タバコ
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	335	445	10,735	36,069	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	682	682	7,131	23,960	エネルギー
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	464	464	1,595	5,360	不動産
RUENTEX INDUSTRIES LTD	368	368	1,753	5,893	耐久消費財・アパレル
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	493	788	6,970	23,420	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)	
SILICONWARE PRECISION INDS	1,570	1,570	7,253	24,371	半導体・半導体製造装置
STANDARD FOODS CORP	309	343	2,633	8,848	食品・飲料・タバコ
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	743	781	2,577	8,659	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN CEMENT	1,959	2,669	9,689	32,556	素材
TAIWAN GLASS IND CORP	654	—	—	—	資本財
TECO ELECTRIC & MACHINERY	1,110	1,110	2,952	9,920	資本財
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	13,633	17,213	313,292	1,052,663	半導体・半導体製造装置
U-MING MARINE TRANSPORT CORP	320	—	—	—	運輸
UNITED MICROELECTRONICS CORP	7,270	7,270	8,360	28,091	半導体・半導体製造装置
YANG MING MARINE TRANSPORT	1,439	—	—	—	運輸
YULON MOTOR COMPANY	510	510	1,387	4,660	自動車・自動車部品
INOTERA MEMORIES INC	1,920	1,920	5,683	19,095	半導体・半導体製造装置
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	5,520	5,520	5,906	19,845	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS CO LTD	811	811	3,072	10,325	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	125	127	1,633	5,489	資本財
PEGATRON CORP	954	1,224	10,006	33,620	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHAILEASE HOLDING CO LTD	674	1,144	6,121	20,569	各種金融
TPK HOLDING CO LTD	169	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	230	1,980	1,940	6,519	電気通信サービス
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	219	219	1,435	4,824	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	4,203	6,263	8,549	28,725	銀行
CASETEK HOLDINGS LTD	90	90	717	2,410	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	—	150	5,220	17,539	耐久消費財・アパレル
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	540	540	3,153	10,596	半導体・半導体製造装置
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	173	173	1,615	5,428	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PHISON ELECTRONICS CORP	115	115	2,482	8,340	半導体・半導体製造装置
TAIMED BIOLOGICS INC	—	130	2,281	7,665	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HERMES MICROVISION INC	20	40	5,580	18,748	半導体・半導体製造装置
OBI PHARMA INC	—	60	1,680	5,644	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>	182,875 95	231,187 90	1,068,289 —	3,589,454 <12.1%>
(インド)			千インドルピー		
RELIANCE INDUSTRIES LTD	744	895	89,963	143,942	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	110	221	14,649	23,439	エネルギー
ASIAN PAINTS LTD	128	181	19,106	30,570	素材
EICHER MOTORS LTD	6	9	21,908	35,052	資本財
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	214	257	34,271	54,833	自動車・自動車部品
SHREE CEMENT LTD	3	7	12,853	20,565	素材
ICICI BANK LTD	615	766	21,567	34,507	銀行
ADITYA BIRLA NUVO LTD	23	—	—	—	資本財
STATE BANK OF INDIA	869	1,047	27,232	43,571	銀行
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26	26	3,614	5,782	運輸
LIC HOUSING FINANCE LTD	143	255	13,439	21,503	銀行
TATA STEEL LTD	258	258	10,318	16,510	素材
JSW STEEL LTD	43	79	13,317	21,307	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)	
NESTLE INDIA LIMITED	12	12	8,234	13,174	食品・飲料・タバコ
GAIL INDIA LTD	178	282	12,606	20,171	公益事業
VEDANTA LTD	727	727	15,826	25,322	素材
TITAN INDUSTRIES LTD	—	278	9,703	15,525	耐久消費財・アパレル
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	459	685	18,499	29,599	エネルギー
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	5	5	3,031	4,849	食品・飲料・タバコ
LUPIN LTD	126	164	25,153	40,245	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACC LTD	17	17	2,572	4,116	素材
BAJAJ FINANCE LTD	—	111	10,397	16,635	各種金融
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	857	1,031	139,336	222,938	銀行
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	345	458	23,218	37,149	メディア
INFOSYS LTD	1,017	1,268	121,604	194,567	ソフトウェア・サービス
WIPRO LTD	355	450	20,144	32,231	ソフトウェア・サービス
HINDUSTAN UNILEVER LTD	421	482	39,996	63,995	家庭用品・パーソナル用品
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	41	41	5,373	8,597	ヘルスケア機器・サービス
HCL TECHNOLOGIES LTD	300	428	33,591	53,746	ソフトウェア・サービス
DABUR INDIA LTD	309	309	9,240	14,785	家庭用品・パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	32	32	10,513	16,821	自動車・自動車部品
DR. REDDY'S LABORATORIES	62	78	25,607	40,971	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BHARTI AIRTEL LTD	675	826	24,879	39,806	電気通信サービス
UNITED SPIRITS LTD	35	35	7,199	11,519	食品・飲料・タバコ
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	542	670	44,274	70,839	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DIVI'S LABORATORIES LTD	53	53	6,743	10,789	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	—	69	37,664	60,262	自動車・自動車部品
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	62	126	11,397	18,236	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUROBINDO PHARMA LTD	132	203	15,448	24,717	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	164	341	10,530	16,848	自動車・自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	76	121	11,990	19,185	各種金融
CIPLA LTD	199	299	15,741	25,185	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LARSEN & TOUBRO LTD	164	206	28,687	45,900	資本財
ULTRATECH CEMENT LTD	23	23	8,943	14,309	素材
ASHOK LEYLAND LIMITED	—	631	5,773	9,238	資本財
BOSCH LTD	4	4	9,162	14,660	自動車・自動車部品
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	264	322	70,044	112,071	ソフトウェア・サービス
NTPC LTD	974	974	15,011	24,019	公益事業
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	35	64	10,475	16,761	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YES BANK LTD	—	191	23,324	37,319	銀行
AMBUJA CEMENTS LTD	371	371	8,582	13,731	素材
BHARAT FORGE LTD	66	66	5,877	9,403	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	790	790	12,809	20,494	素材
ITC LTD	1,287	2,416	59,971	95,955	食品・飲料・タバコ
UNITED PHOSPHORUS LTD	179	262	17,335	27,736	素材
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	534	—	—	—	電気通信サービス
SIEMENS INDIA LTD	53	53	5,811	9,298	資本財
UNITED BREWERIES LTD	41	—	—	—	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)	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	57	93	13,799	22,079	家庭用品・パーソナル用品
TECH MAHINDRA LTD	164	164	7,139	11,423	ソフトウェア・サービス
CAIRN INDIA LTD	221	221	5,373	8,597	エネルギー
IDEA CELLULAR LTD	599	599	4,336	6,938	電気通信サービス
MARICO LTD	103	207	5,448	8,718	家庭用品・パーソナル用品
POWER FINANCE CORPORATION	192	838	9,759	15,615	各種金融
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	401	625	17,657	28,251	運輸
RURAL ELECTRIFICATION CORP	179	—	—	—	各種金融
BAJAJ AUTO LTD	54	54	15,165	24,264	自動車・自動車部品
OIL INDIA LTD	74	—	—	—	エネルギー
COAL INDIA LTD	419	419	13,292	21,267	エネルギー
TATA MOTORS LTD-A-DVR	—	355	12,282	19,652	自動車・自動車部品
TATA MOTORS LTD	508	1,116	59,568	95,309	自動車・自動車部品
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	339	339	4,711	7,539	資本財
TATA POWER CO LTD	932	932	6,686	10,697	公益事業
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	162	162	5,347	8,556	各種金融
BHARTI INFRAEL LTD	228	362	13,119	20,991	電気通信サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	148	200	14,495	23,193	銀行
AXIS BANK LTD	—	1,093	53,317	85,307	銀行
HAVELLS INDIA LTD	—	105	3,953	6,326	資本財
CADILA HEALTHCARE LTD	—	105	4,033	6,454	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>	19,987 70	28,000 74	1,554,066 —	2,486,506 <8.4%>
(カタル)			千カタルリアル		
QATAR INSURANCE CO	32	79	684	19,911	保険
QATAR NATIONAL BANK	97	136	2,125	61,801	銀行
COMMERCIAL BANK QSC	64	64	223	6,494	銀行
OOREDOO QSC	72	72	667	19,406	電気通信サービス
DOHA BANK QSC	20	102	366	10,645	銀行
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	15	15	334	9,735	公益事業
INDUSTRIES QATAR	72	99	1,022	29,714	資本財
QATAR ISLAMIC BANK	58	58	599	17,421	銀行
QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	—	227	511	14,873	エネルギー
MASRAF AL RAYAN	269	269	914	26,595	銀行
BARWA REAL ESTATE CO	38	38	119	3,470	不動産
EZDAN HOLDING GROUP	359	485	752	21,889	不動産
GULF INTERNATIONAL SERVICES	30	—	—	—	エネルギー
VODAFONE QATAR	195	195	202	5,887	電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	1,326 13	1,845 13	8,525 —	247,849 <0.8%>
(南アフリカ)			千南アフリカランド		
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	58	—	—	—	素材
BARLOWORLD LTD	123	—	—	—	資本財
BIDVEST GROUP LTD	165	195	3,278	25,703	資本財
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	232	245	1,679	13,168	小売

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)	
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	1,345	—	—	—	耐久消費財・アパレル
DISCOVERY LIMITED	217	217	2,532	19,851	保険
MASSMART HOLDINGS LTD	83	83	951	7,462	食品・生活必需品小売り
GOLD FIELDS LTD	425	645	3,704	29,042	素材
REMGRO LTD	244	374	8,567	67,168	各種金融
THE FOSCHINI GROUP LIMITED	108	115	1,535	12,040	小売
EXXARO RESOURCES LTD	46	46	503	3,944	エネルギー
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	14	32	2,166	16,984	銀行
LIBERTY HOLDINGS LTD	62	62	713	5,595	保険
MTN GROUP LTD	936	1,204	14,119	110,696	電気通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	283	283	5,251	41,170	素材
TELKOM SA LTD	113	113	718	5,634	電気通信サービス
FIRSTSTRAND LTD	1,893	2,354	12,000	94,080	各種金融
PSG GROUP LTD	38	80	1,646	12,908	各種金融
NASPERS LTD-N SHS	220	306	66,449	520,965	メディア
CORONATION FUND MANAGERS LTD	101	101	728	5,714	各種金融
NEDBANK GROUP LTD	93	149	3,456	27,100	銀行
NETCARE LTD	602	602	2,095	16,425	ヘルスケア機器・サービス
PICK N PAY STORES LTD	181	181	1,182	9,271	食品・生活必需品小売り
RMB HOLDINGS LTD	432	432	2,688	21,079	各種金融
ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	31	31	1,072	8,410	素材
SAPPI LIMITED	325	325	2,423	19,003	素材
SASOL LTD	316	398	14,820	116,189	エネルギー
SHOPRITE HOLDINGS LTD	250	321	6,056	47,483	食品・生活必需品小売り
MR PRICE GROUP LTD	130	209	3,061	24,003	小売
BRAIT SE	203	203	1,833	14,373	各種金融
STANDARD BANK GROUP LTD	700	879	13,064	102,424	銀行
SPAR GROUP LIMITED/THE	78	146	2,703	21,194	食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	492	749	5,467	42,861	小売
IMPERIAL HOLDINGS LTD	124	124	2,052	16,092	小売
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	175	234	7,146	56,026	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BARCLAYS AFRICA GROUP	191	256	4,011	31,451	銀行
TIGER BRANDS LTD	89	125	4,729	37,077	食品・飲料・タバコ
NAMPAK LTD	361	—	—	—	素材
SANLAM LTD	1,040	1,231	7,983	62,589	保険
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	242	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
INVESTEC LTD	145	258	2,165	16,980	各種金融
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	280	605	3,358	26,327	素材
KUMBA IRON ORE LTD	39	—	—	—	素材
PIONEER FOODS LTD	88	88	1,404	11,014	食品・飲料・タバコ
NEW EUROPE PROPERTY INVEST	—	194	3,261	25,570	不動産
MONDI LTD	101	101	2,749	21,558	素材
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	443	761	2,723	21,353	ヘルスケア機器・サービス
MMI HOLDINGS LTD	680	680	1,544	12,110	保険
RAND MERCHANT INVESTMENT HD	404	404	1,648	12,922	保険

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)
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	253		253	754	5,914	消費者サービス	
VODACOM GROUP	217		217	3,244	25,434	電気通信サービス	
SIBANYE GOLD LTD	—		664	2,561	20,084	素材	
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	—		495	827	6,491	不動産	
FORTRESS INCOME FUND LTD	—		364	1,116	8,749	不動産	
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	—		2,046	14,239	111,640	耐久消費財・アパレル	
BID CORP LTD	—		249	5,903	46,282	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額	15,435	20,453	259,901	2,037,624		
	銘 柄 数 <比 率>	50	50	—	<6.8%>		
(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		964	495	14,281	銀行	
EMAAR PROPERTIES PJSC	1,581		2,451	1,659	47,807	不動産	
ARABTEC HOLDING CO	694		2,489	328	9,466	資本財	
DUBAI FINANCIAL MARKET	1,279		1,279	144	4,166	各種金融	
EMAAR MALLS PJSC	731		1,796	467	13,456	不動産	
FIRST GULF BANK	498		498	597	17,217	銀行	
EMIRATES TELECOM GROUP CO	—		1,128	2,081	59,977	電気通信サービス	
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	1,132		1,132	674	19,419	銀行	
NATIONAL BANK OF ABU DHABI	450		450	401	11,559	銀行	
ALDAR PROPERTIES PJSC	2,714		2,714	719	20,726	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	9,396	14,906	7,569	218,080		
	銘 柄 数 <比 率>	9	10	—	<0.7%>		
合 計	株 数 ・ 金 額	1,183,761	1,557,070	—	29,340,207		
	銘 柄 数 <比 率>	805	816	—	<98.6%>		

(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	—	—	—	
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	141,600	189,100	6,592	35,135	
小 計	口 数 ・ 金 額 159,000	189,100	6,592	35,135	
	銘 柄 数 <比 率>	1	—	<0.1%>	
(ブラジル)			千ブラジルレアル		
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	7,500	7,500	152	4,986	
SUL AMERICA SA-UNITS	14,318	14,318	265	8,693	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,500	45,500	1,197	39,220	
VIA VAREJO SA	6,400	—	—	—	
KLABIN SA-UNIT	28,700	44,900	691	22,660	
小 計	口 数 ・ 金 額 102,418	112,218	2,307	75,559	
	銘 柄 数 <比 率>	4	—	<0.3%>	
(トルコ)			千トルコリラ		
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	135,630	135,630	420	13,816	
小 計	口 数 ・ 金 額 135,630	135,630	420	13,816	
	銘 柄 数 <比 率>	1	—	<0.0%>	
(南アフリカ)			千南アフリカランド		
REDEFINE PROPERTIES LTD	216,372	324,053	3,609	28,302	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	102,326	144,115	3,630	28,461	
RESILIENT REIT LTD	13,040	13,040	1,411	11,065	
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	22,923	22,923	2,652	20,793	
小 計	口 数 ・ 金 額 354,661	504,131	11,303	88,622	
	銘 柄 数 <比 率>	4	—	<0.3%>	
合 計	口 数 ・ 金 額 751,709	941,079	—	213,133	
	銘 柄 数 <比 率>	10	—	<0.7%>	

(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	195	—

(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	29,340,207	98.6
投 資 信 託 受 益 証 券	75,559	0.3
投 資 証 券	137,573	0.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	214,872	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	29,768,211	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(29,728,330千円)の投資信託財産総額(29,768,211千円)に対する比率は99.9%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=105.63円	1メキシコペソ=5.33円	1ブラジルレアル=32.75円
1チリペソ=0.1626円	1コロンビアペソ=0.0352円	1ユーロ=115.44円
1トルコリラ=32.86円	1チェココルナ=4.27円	1ハンガリーフォリント=0.3778円
1ポーランドズロチ=26.61円	1香港ドル=13.62円	1マレーシアリンギット=24.85円
1タイバーツ=3.01円	1フィリピンペソ=2.17円	1インドネシアルピア=0.0081円
1韓国ウォン=0.0918円	1新台湾ドル=3.36円	1インドルピー=1.60円
1カタールリアル=29.07円	1南アフリカランド=7.84円	1アラブ首長国連邦ディルハム=28.81円

## 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11月10日現在
(A) 資 産	29,786,953,506円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	136,677,473
株 式(評価額)	29,340,207,987
投資信託受益証券(評価額)	75,559,972
投 資 証 券(評価額)	137,573,751
未 収 入 金	19,332,035
未 収 配 当 金	20,278,338
差 入 委 託 証 拠 金	57,323,950
(B) 負 債	34,913,611
未 払 金	24,613,921
未 払 解 約 金	10,299,623
未 払 利 息	67
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	29,752,039,895
元 本	13,859,441,261
次 期 繰 越 損 益 金	15,892,598,634
(D) 受 益 権 総 口 数	13,859,441,261口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,467円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2015年11月11日 至 2016年11月10日
(A) 配 当 等 収 益	592,048,465円
受 取 配 当 金	591,252,390
受 取 利 息	806,812
支 払 利 息	△10,737
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△2,369,362,037
売 買 益	2,945,902,665
売 買 損	△5,315,264,702
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△26,046,859
取 引 益	187,657,505
取 引 損	△213,704,364
(D) そ の 他 費 用	△42,350,151
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△1,845,710,582
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	14,659,886,869
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,319,819,715
(H) 解 約 差 損 益 金	△241,397,368
(I) 計 (E+F+G+H)	15,892,598,634
次 期 繰 越 損 益 金(I)	15,892,598,634

(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。

## 〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は10,958,554,130円、期中追加設定元本額は3,126,009,415円、期中一部解約元本額は225,122,284円です。  
※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

SMT 新興国株式インデックス・オープン	6,129,945,567円
DC新興国株式インデックス・オープン	2,806,804,334円
DC世界経済インデックスファンド	2,158,744,506円
世界経済インデックスファンド	1,724,844,021円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	424,962,745円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	222,218,403円
SMT インデックスバランス・オープン	177,714,701円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	159,027,195円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	24,352,569円
新興国株式インデックス・オープン	16,218,571円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	14,608,649円

## お知らせ

---

該当事項はありません。