

## 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9期（決算日 2018年1月22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

当報告書に添付する「外国債券インデックス マザーファンド」の運用報告書は、同マザーファンドの決算日現在の基準で作成されたものであり、ベンチマークの名称等は、同決算日時点での記載となっておりますのでご了承ください。

**【本運用報告書の記載について】**

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			株式組 比率	株式先 物比率	債券組 比率	債券先 物比率	投資信託 組入比率	資産 純総額
	(分配落)	税金 分配金	期中 騰落率						
第5期(2014年1月20日)	円 18,162	円 20	% 19.0	% 49.2	% 1.8	% 45.6	% 0.2	% 0.6	百万円 4,684
第6期(2015年1月20日)	20,530	20	13.1	48.4	1.4	46.8	0.2	0.8	10,344
第7期(2016年1月20日)	18,276	0	△11.0	46.0	1.5	49.1	0.2	0.8	16,216
第8期(2017年1月20日)	20,148	0	10.2	48.4	0.7	47.8	0.1	0.9	22,647
第9期(2018年1月22日)	23,375	0	16.0	50.1	1.8	45.1	0.3	0.8	54,410

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

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

## 当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		株式組 比率	株式先 物比率	債券組 比率	債券先 物比率	投資信託 組入比率
	騰落率						
(当期首) 2017年 1月20日	円 20,148	% -	% 48.4	% 0.7	% 47.8	% 0.1	% 0.9
1月末	20,056	△0.5	48.5	0.7	47.8	0.0	0.9
2月末	20,260	0.6	48.8	1.0	47.1	0.1	0.9
3月末	20,440	1.4	48.7	1.1	46.9	0.2	0.9
4月末	20,557	2.0	48.8	1.1	46.6	0.2	0.9
5月末	20,897	3.7	48.2	1.8	46.1	0.4	0.8
6月末	21,228	5.4	48.0	1.8	46.7	0.4	0.8
7月末	21,423	6.3	49.0	1.1	46.5	0.2	0.9
8月末	21,623	7.3	48.1	1.8	46.6	0.4	0.8
9月末	22,110	9.7	49.1	1.4	46.6	0.3	0.8
10月末	22,401	11.2	50.1	1.2	45.8	0.3	0.8
11月末	22,531	11.8	50.2	1.3	45.4	0.3	0.9
12月末	23,004	14.2	50.1	1.7	44.9	0.3	0.9
(当期末) 2018年 1月22日	23,375	16.0	50.1	1.8	45.1	0.3	0.8

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

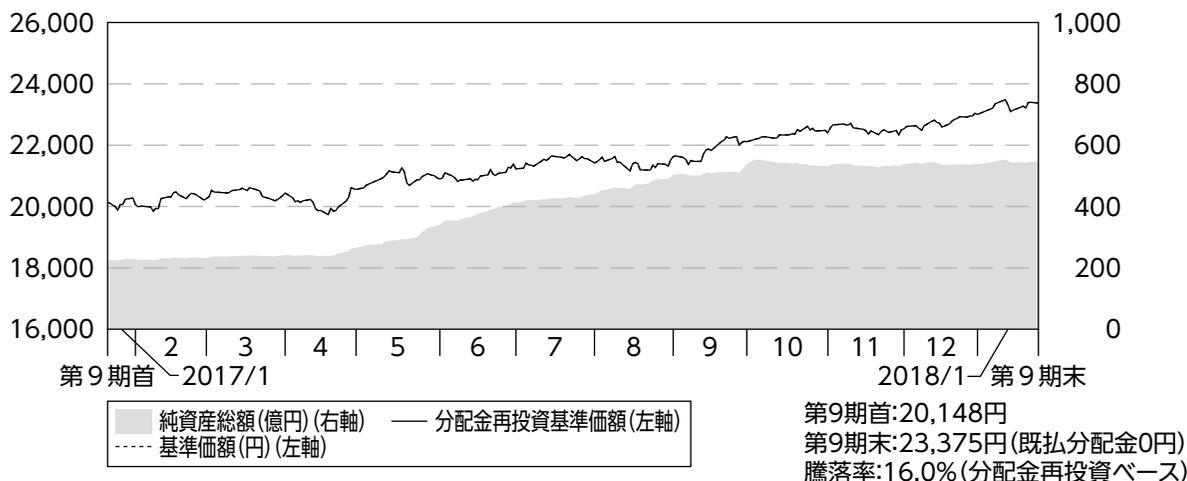
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(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す。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人の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、2017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、期初に欧米の政治リスクなどが警戒され軟調に推移する場面もありましたが、フランス大統領選挙を無事に通過すると投資家心理は徐々に改善し持ち直す展開となりました。その後、北朝鮮を巡る地政学リスクなどが重石となりましたが、欧米で良好な経済指標が示されたことや金融緩和環境の継続見通しなどを背景に世界の株式市場は堅調に推移し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%	3.6%	0.3%
国内株式インデックス マザーファンド	国内株式	5.0%	5.5%	26.0%
外国債券インデックス マザーファンド	先進国債券	30.0%	28.3%	5.0%
外国株式インデックス マザーファンド	先進国株式	30.0%	31.0%	21.7%
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%	14.6%	13.5%
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%	16.1%	35.5%

## 投資環境

### 国内債券市場

当期初は、日銀の金融緩和政策が維持されるとの見方から、債券利回りは低下基調で推移しました。当期の半ばは、北朝鮮を巡る地政学リスクへの懸念などが債券利回りの低下要因となった一方、フランス大統領選挙の結果を受けて投資家のリスク選好度が高まったことや良好な経済指標を背景とする米国の利上げ観測などが利回りの上昇要因となりみ合いで推移する展開となりました。当期末にかけては景況感の改善を受けた欧米金利の上昇などを受けて国内債券利回りは概ね上昇基調で推移しました。

### 国内株式市場

当期は、トランプ米大統領による政権運営やフランス大統領選挙の行方といった政治リスクが意識されたほか、北朝鮮を巡る地政学リスクの高まりなどを背景に軟調に推移する場面もありましたが、世界的に景況感が改善し企業業績に対する期待が高まり国内株式市場は上昇しました。また、2017年10月の衆議院総選挙において与党が勝利したことから現行の金融・経済政策が維持されるとの安心感が広がったことに加え、当期末にかけては米税制改革法案の可決により米国経済の拡大期待が高まったことなども株価を押し上げる要因となりました。

### 先進国債券市場

当期の前半は、FRB(米連邦準備理事会)による利上げ観測などをにらみ利回りが上昇する場面が見られた一方で、北朝鮮を巡る地政学リスクや米国インフレ率の伸び悩みなどから利回りは概ね低位で推移する展開となりました。当期の後半は、ECB(欧州中央銀行)による金融緩和縮小観測や欧米経済指標の回復などを背景に利回りは上昇基調で推移し、また当期末にかけては米税制改革法案が可決したことや、原油価格の上昇などを受けてインフレ率の上昇観測が広がったことから債券利回りは上昇しました。

外国為替市場は、米ドル/円相場はFRBが追加利上げを慎重に行う姿勢を示したことから日米金利差拡大観測がやや後退しもみ合いで推移した一方、ユーロ/円相場は欧州景気の改善やECBによる金融緩和縮小観測などを背景に金融政策の方向性の違いなどが意識されユーロ高円安基調で推移しました。

### 先進国株式市場

当期は、トランプ米大統領による政権運営やフランス大統領選挙の行方といった政治リスクに加えて、北朝鮮を巡る地政学リスクの高まりなどが株価の下押し要因となりましたが、欧米で良好な経済指標の発表が続いたことや、世界的な金融緩和環境の継続見通しが広がったことなどから上昇しました。当期末にかけては、景況感の改善を背景とする企業業績への期待感や、英国のEU(欧州連合)離脱交渉の前進、米税制改革法案の可決などを材料に上昇基調を維持する展開となりました。

### 新興国債券市場

当期は、FRBによる利上げ観測などを背景に軟調に推移する場面もありましたが、世界的な景況感の改善などを受けて投資家のリスク選好が高まり、相対的に高い利回りを確保できる新興国債券が買われる展開となったことから堅調に推移しました。

新興国通貨は当期の前半は対円で弱含む通貨も見られましたが、後半は原油価格や資源価格の上昇などを背景に投資家心理が改善しリスクを選好する動きが強まったことから概ね円に対して上昇する展開となりました。

### 新興国株式市場

当期は、欧米の政治リスクや北朝鮮を巡る地政学リスクなどが市場の重石となる場面もありましたが、欧米や中国で底堅い経済指標が発表され投資家心理が徐々に改善したことに加え、原油価格や資源価格が上昇したことも新興国株式市場への買い安心感を誘い上昇する展開となりました。また、米国の利上げペースが当初想定よりも緩やかなペースになるとの見方が広がったことも新興国株式市場の下支え要因となり堅調に推移しました。

### 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。

#### ・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FTSE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・インデックスーエマージング・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。

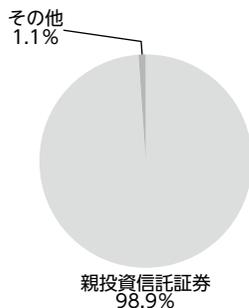
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

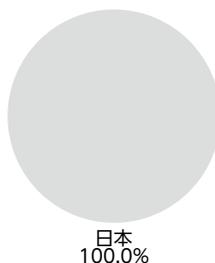
	当期末
	2018年1月22日
外国株式インデックス マザーファンド	31.0%
外国債券インデックス マザーファンド	28.3%
新興国株式インデックス マザーファンド	16.1%
新興国債券インデックス マザーファンド	14.6%
国内株式インデックス マザーファンド	5.5%
国内債券インデックス マザーファンド	3.6%
その他	1.1%
組入ファンド数	6

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

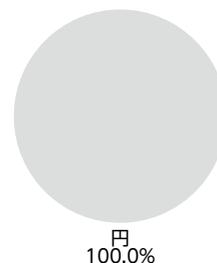
### ○資産別配分



### ○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9期	
	2017年1月21日~2018年1月22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)		13,374

(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

FTSE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
	(2017年1月21日~2018年1月22日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	116円	0.543%	(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21,377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)	(46)	(0.217)	
(販売会社)	(58)	(0.271)	
(受託会社)	(12)	(0.054)	
(b) 売買委託手数料	1	0.006	(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)	(0.003)	
(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)	(0.002)	
(c) 有価証券取引税	1	0.005	(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)	(0.005)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	15	0.069	(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)	(14)	(0.063)	
(監査費用)	(1)	(0.004)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	133	0.623	

(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	1,801,773	4,837,090	556,796	1,661,660
国内株式インデックス マザーファンド	1,167,310	1,652,090	222,510	338,320
外国株式インデックス マザーファンド	4,353,423	9,791,870	986,001	2,374,730
国内債券インデックス マザーファンド	938,718	1,297,660	195,672	270,640
外国債券インデックス マザーファンド	3,702,667	9,972,690	711,835	1,973,990
新興国債券インデックス マザーファンド	2,900,611	4,866,280	618,170	1,065,010

## 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	46,416,553千円	32,628,730千円	13,275,514千円
(b) 当期中の平均組入株式時価総額	167,601,968千円	296,889,019千円	38,804,938千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.27	0.10	0.34

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

## 利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

### ■利害関係人との取引状況

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 337	百万円 337	% 100.0	百万円 340	百万円 340	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	220,591	56,053	25.4	219,722	55,796	25.4

(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 1,375	百万円 1,375	% 100.0	百万円 1,378	百万円 1,378	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	379,758	94,107	24.8	379,157	93,896	24.8

<平均保有割合 0.5%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

### <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 1,483	百万円 1,483	% 100.0	百万円 1,489	百万円 1,489	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	512,231	126,882	24.8	511,120	126,501	24.7

<平均保有割合 1.2%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

### <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 40,873	百万円 3	% 0.0	百万円 11,377	百万円 331	% 2.9
金 銭 信 託	1,451	1,451	100.0	1,458	1,458	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	707,363	179,042	25.3	705,090	178,345	25.3

<平均保有割合 5.0%>

(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	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	28,088	5	0.0	47,326	1,277	2.7
金 銭 信 託	190	190	100.0	192	192	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	116,594	29,218	25.1	116,312	29,125	25.0

<平均保有割合 3.9%>

(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	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	17,732	—	—	9,604	3	0.0
金 銭 信 託	240	240	100.0	241	241	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	98,678	25,090	25.4	98,567	25,054	25.4

<平均保有割合 20.9%>

(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	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	20,486	14	0.1	11,726	14	0.1
金 銭 信 託	33	33	100.0	33	33	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	21,530	5,518	25.6	21,327	5,464	25.6

<平均保有割合 15.8%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## ■利害関係人の発行する有価証券等

### <国内株式インデックス マザーファンド>

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	76百万円	71百万円	691百万円

(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	1,464,831	2,709,808	8,742,383
国内株式インデックス マザーファンド	826,598	1,771,398	2,980,555
外国株式インデックス マザーファンド	3,189,853	6,557,275	16,855,476
国内債券インデックス マザーファンド	653,313	1,396,359	1,932,142
外国債券インデックス マザーファンド	2,543,290	5,534,122	15,379,327
新興国債券インデックス マザーファンド	2,154,282	4,436,723	7,917,332

(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	16,271,676千口
国内株式インデックス マザーファンド	121,805,661千口
外国株式インデックス マザーファンド	133,409,705千口
国内債券インデックス マザーファンド	256,411,785千口
外国債券インデックス マザーファンド	94,509,771千口
新興国債券インデックス マザーファンド	19,505,694千口

## 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	%
	8,742,383	15.8
国内株式インデックス マザーファンド	2,980,555	5.4
外国株式インデックス マザーファンド	16,855,476	30.4
国内債券インデックス マザーファンド	1,932,142	3.5
外国債券インデックス マザーファンド	15,379,327	27.8
新興国債券インデックス マザーファンド	7,917,332	14.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,610,108	2.8
投 資 信 託 財 産 総 額	55,417,323	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(52,488,182千円)の投資信託財産総額(52,713,774千円)に対する比率は99.6%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(343,044,028千円)の投資信託財産総額(343,620,076千円)に対する比率は99.8%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(259,001,767千円)の投資信託財産総額(262,839,617千円)に対する比率は98.5%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(34,605,335千円)の投資信託財産総額(35,314,676千円)に対する比率は98.0%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=110.75円

1ブラジルリアル=34.64円

1ペルーヌエボソル=34.42円

1イギリスポンド=153.73円

1ノルウェークローネ=14.09円

1チェココロナ=5.33円

1ロシアルーブル=1.96円

1香港ドル=14.16円

1タイバーツ=3.47円

1韓国ウォン=0.1038円

1イスラエルシェケル=32.37円

1アラブ首長国連邦ディルハム=30.10円

1カナダドル=88.72円

1チリペソ=0.182円

1ウルグアイペソ=3.89円

1スイスフラン=115.14円

1デンマーククローネ=18.21円

1ハンガリーフォリント=0.4384円

1オーストラリアドル=88.53円

1シンガポールドル=83.90円

1フィリピンペソ=2.18円

1新台幣ドル=3.77円

1カタールリアル=30.48円

1メキシコペソ=5.95円

1コロンビアペソ=0.0388円

1ユーロ=135.59円

1スウェーデンクローナ=13.80円

1トルコリラ=28.97円

1ポーランドズロチ=32.49円

1ニュージーランドドル=80.66円

1マレーシアリングギット=28.11円

1インドネシアルピア=0.0084円

1インドルピー=1.75円

1南アフリカランド=9.16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 2018年1月22日現在
(A)資 産	55,417,323,715円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,319,535,553
新 興 国 株 式 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	8,742,383,627
国 内 株 式 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	2,980,555,235
外 国 株 式 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	16,855,476,246
国 内 債 券 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	1,932,142,709
外 国 債 券 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	15,379,327,419
新 興 国 債 券 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	7,917,332,926
未 収 入 金	290,570,000
(B)負 債	1,006,691,560
未 払 解 約 金	862,960,474
未 払 信 託 報 酬	142,131,998
未 払 利 息	2,186
そ の 他 未 払 費 用	1,596,902
(C)純 資 産 総 額 (A-B)	54,410,632,155
元 本	23,277,415,648
次 期 繰 越 損 益 金	31,133,216,507
(D)受 益 権 総 口 数	23,277,415,648口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,375円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2017年1月21日 至 2018年1月22日
(A)配 当 等 収 益	△401,441円
受 取 利 息	539
支 払 利 息	△401,980
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	4,699,842,343
売 買 益	6,679,348,362
売 買 損	△1,979,506,019
(C)信 託 報 酬 等	△221,454,194
(D)当 期 損 益 金 (A+B+C)	4,477,986,708
(E)前 期 繰 越 損 益 金	470,923,464
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	26,184,306,335
(配 当 等 相 当 額)	(17,674,789,976)
(売 買 損 益 相 当 額)	(8,509,516,359)
(G) 計 (D+E+F)	31,133,216,507
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	31,133,216,507
追 加 信 託 差 損 益 金	26,184,306,335
(配 当 等 相 当 額)	(17,763,552,042)
(売 買 損 益 相 当 額)	(8,420,754,293)
分 配 準 備 積 立 金	4,948,910,172

(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11,240,555,468円、期中追加設定元本額は30,368,454,269円、期中一部解約元本額は18,331,594,089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)		1,053,364,454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)		3,172,393,494円
(C)	収益調整金額		26,184,306,335円
(D)	分配準備積立金額		723,152,224円
(E)	分配対象収益額(A+B+C+D)		31,133,216,507円
(F)	期末残存口数		23,277,415,648口
(G)	収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)		13,374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

---

デリバティブ取引について、リスク回避ならびに投資対象資産を保有した場合の代替の目的としてのみ利用することを明確にするために、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2017年10月2日)

# 国内債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第17期（決算日 2017年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
第13期(2013年5月29日)	12,514	0.6	343,438	0.6	99.3	0.2	246,098
第14期(2014年5月29日)	12,915	3.2	354,471	3.2	99.3	0.3	256,692
第15期(2015年5月29日)	13,215	2.3	362,770	2.3	99.6	—	319,978
第16期(2016年5月30日)	14,107	6.7	387,276	6.8	99.4	0.2	319,650
第17期(2017年5月29日)	13,829	△2.0	379,592	△2.0	99.7	—	300,760

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物率
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2016年 5月30日	14,107	—	387,276	—	99.4	0.2
5月末	14,119	0.1	387,599	0.1	99.4	0.2
6月末	14,291	1.3	392,355	1.3	99.4	0.2
7月末	14,171	0.5	389,242	0.5	99.5	0.1
8月末	14,035	△0.5	385,240	△0.5	99.4	0.2
9月末	14,044	△0.4	385,504	△0.5	99.7	—
10月末	14,006	△0.7	384,444	△0.7	99.7	—
11月末	13,917	△1.3	381,967	△1.4	99.7	—
12月末	13,840	△1.9	379,825	△1.9	99.7	—
2017年 1月末	13,764	△2.4	377,739	△2.5	99.6	0.0
2月末	13,806	△2.1	378,896	△2.2	99.6	—
3月末	13,788	△2.3	378,492	△2.3	99.7	0.0
4月末	13,856	△1.8	380,333	△1.8	99.7	—
(当期末) 2017年 5月29日	13,829	△2.0	379,592	△2.0	99.7	—

(注1) 騰落率は期首比です。

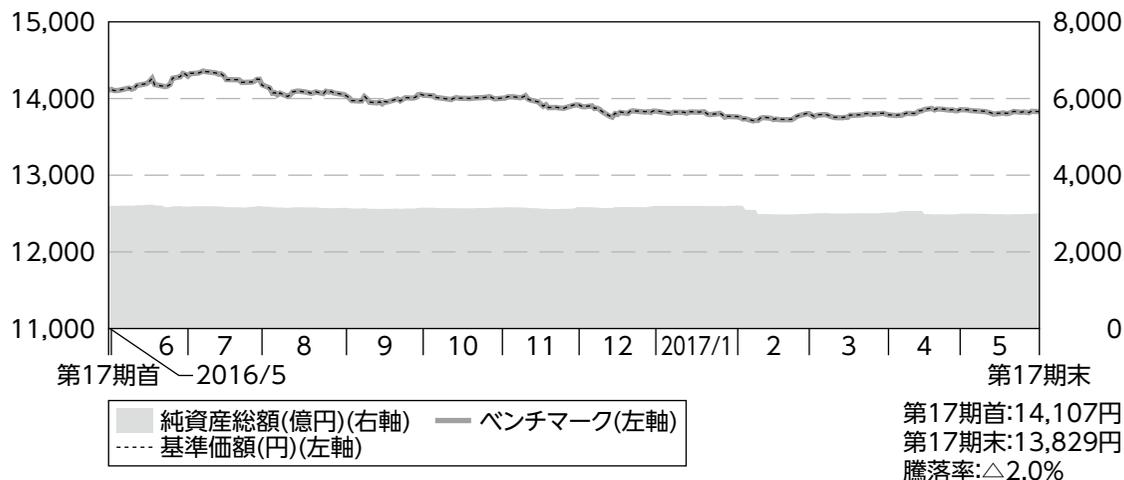
(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

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

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

## 基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2016年5月30日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

## 基準価額の主な変動要因

期初より7月上旬にかけて、英国の国民投票でEU(欧州連合)離脱派が勝利したことによるリスク回避の動きから金利は低下(債券価格は上昇)し、基準価額は上昇しました。その後は9月中旬にかけて、日銀の金融政策に対する先行きの不透明感や米国の早期利上げ観測の高まりを背景に金利は上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。9月下旬以降は、日銀のイールドカーブ・コントロール政策導入を受けて金利が横ばい圏で推移し基準価額も横ばい推移となりましたが、11月上旬以降2017年2月にかけては、米国大統領選挙の結果を受けた米トランプ政権の政策期待による米国金利上昇の影響や日銀の国債買い入れオペ運営に対する警戒感などから金利の上昇が続き、基準価額は下落推移となりました。2月上旬以降は日銀が指し値オペを実施し需給の引き締まりが意識される中、地政学リスクの高まりや欧州政治リスクへの警戒感を背景にリスク回避の動きが強まったことから金利は低下基調で推移し、基準価額は上昇しました。

## 投資環境



2016年7月上旬にかけて、英国の国民投票でEU離脱派が勝利したことを受けたリスク回避の動きから金利は低下しましたが、7月中旬から9月中旬にかけて、日銀による金融政策の先行き不透明感などから上昇しました。その後は、日銀のイールドカーブ・コントロール政策導入を受けて金利は横ばい圏で推移しましたが、11月上旬以降は、米国大統領選挙の結果を受けた米国金利上昇の影響などから上昇しました。2017年2月上旬以降は、日銀が指し値オペを実施し需給の引き締まりが意識される中、地政学リスクの高まりや欧州政治リスクへの警戒感を背景にリスク回避の動きが強まり、金利は低下基調で推移しました。

## 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

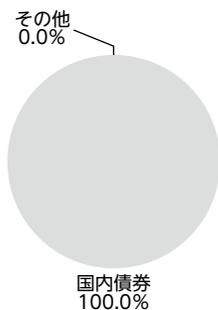
## ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	第113回利付国債(5年)	日本	1.5%
2	第131回利付国債(5年)	日本	1.4%
3	第127回利付国債(5年)	日本	1.3%
4	第116回利付国債(5年)	日本	1.3%
5	第125回利付国債(5年)	日本	1.2%
6	第122回利付国債(5年)	日本	1.2%

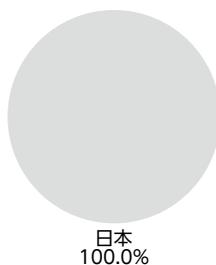
順位	銘柄名	国	組入比率
7	第118回利付国債(5年)	日本	1.2%
8	第117回利付国債(5年)	日本	1.1%
9	第339回利付国債(10年)	日本	1.1%
10	第129回利付国債(5年)	日本	1.1%
組入銘柄数		703	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

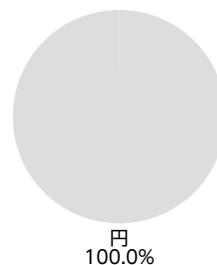
## ○資産別配分



## ○国別配分



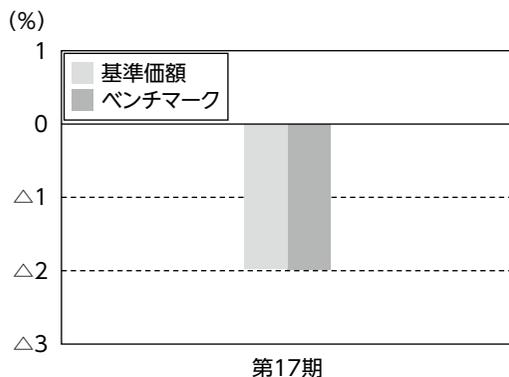
## ○通貨別配分



(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
	(2016年5月31日~2017年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.000% (-) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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(13,969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 75,073,251	千円 78,997,691
	地 方 債 証 券	1,232,658	2,316,350
	特 殊 債 券	3,160,377	4,070,746 (708,627)
	社債券(投資法人債券を含む)	1,939,141	3,574,027 (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 30,990	百万円 31,746	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 15,154	百万円 15,154	% 100.0	百万円 15,412	百万円 15,412	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	331,161	64,841	19.6	331,220	64,218	19.4

(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 B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千 円	千 円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	227,575,000 (5,720,000)	248,331,087 (5,744,170)	82.6 (1.9)	— (—)	51.7 (—)	19.9 (—)	10.9 (1.9)
地 方 債 証 券	15,824,590 (15,824,590)	16,991,916 (16,991,916)	5.6 (5.6)	— (—)	3.5 (3.5)	2.0 (2.0)	0.1 (0.1)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	18,775,470 (18,775,470)	20,130,919 (20,130,919)	6.7 (6.7)	— (—)	4.7 (4.7)	2.0 (2.0)	0.0 (0.0)
金 融 債 証 券	2,200,000 (2,200,000)	2,206,522 (2,206,522)	0.7 (0.7)	— (—)	— (—)	0.7 (0.7)	0.0 (0.0)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	11,796,000 (11,796,000)	12,246,422 (12,246,422)	4.1 (4.1)	— (—)	1.7 (1.7)	1.8 (1.8)	0.5 (0.5)
合 計	276,171,060 (54,316,060)	299,906,867 (57,319,951)	99.7 (19.1)	— (—)	61.7 (9.9)	26.5 (6.5)	11.5 (2.6)

(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365回利付国債(2年)	0.1	400,000	401,104	2018/6/15
第366回利付国債(2年)	0.1	1,110,000	1,113,307	2018/7/15
第367回利付国債(2年)	0.1	1,280,000	1,284,096	2018/8/15
第368回利付国債(2年)	0.1	650,000	652,184	2018/9/15
第369回利付国債(2年)	0.1	1,060,000	1,063,869	2018/10/15
第370回利付国債(2年)	0.1	1,340,000	1,345,293	2018/11/15
第371回利付国債(2年)	0.1	760,000	763,169	2018/12/15
第372回利付国債(2年)	0.1	920,000	924,048	2019/1/15
第373回利付国債(2年)	0.1	140,000	140,648	2019/2/15
第374回利付国債(2年)	0.1	560,000	562,710	2019/3/15
第375回利付国債(2年)	0.1	1,270,000	1,276,438	2019/4/15
第376回利付国債(2年)	0.1	880,000	884,655	2019/5/15
第112回利付国債(5年)	0.4	900,000	905,418	2018/6/20
第113回利付国債(5年)	0.3	4,390,000	4,411,774	2018/6/20
第114回利付国債(5年)	0.3	810,000	814,981	2018/9/20
第115回利付国債(5年)	0.2	2,450,000	2,461,858	2018/9/20
第116回利付国債(5年)	0.2	3,770,000	3,792,054	2018/12/20
第117回利付国債(5年)	0.2	3,300,000	3,322,077	2019/3/20
第118回利付国債(5年)	0.2	3,510,000	3,535,658	2019/6/20

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119回利付国債(5年)	0.1	1,000,000	1,005,250	2019/6/20
第120回利付国債(5年)	0.2	2,560,000	2,580,736	2019/9/20
第121回利付国債(5年)	0.1	630,000	633,641	2019/9/20
第122回利付国債(5年)	0.1	3,520,000	3,542,563	2019/12/20
第123回利付国債(5年)	0.1	3,140,000	3,162,074	2020/3/20
第124回利付国債(5年)	0.1	1,950,000	1,964,644	2020/6/20
第125回利付国債(5年)	0.1	3,610,000	3,639,385	2020/9/20
第126回利付国債(5年)	0.1	2,960,000	2,985,900	2020/12/20
第127回利付国債(5年)	0.1	3,790,000	3,825,474	2021/3/20
第128回利付国債(5年)	0.1	1,300,000	1,312,454	2021/6/20
第129回利付国債(5年)	0.1	3,200,000	3,231,872	2021/9/20
第130回利付国債(5年)	0.1	1,360,000	1,374,647	2021/12/20
第131回利付国債(5年)	0.1	4,290,000	4,335,559	2022/3/20
第1回利付国債(40年)	2.4	150,000	214,071	2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	420,000	579,352	2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	420,000	581,855	2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	630,000	876,336	2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	490,000	654,522	2052/3/20
第6回利付国債(40年)	1.9	390,000	510,104	2053/3/20
第7回利付国債(40年)	1.7	630,000	785,622	2054/3/20

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8回利付国債 (40年)	1.4	670,000	772,108	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	970,000	801,695	2056/3/20
第293回利付国債 (10年)	1.8	190,000	193,944	2018/6/20
第294回利付国債 (10年)	1.7	180,000	183,546	2018/6/20
第295回利付国債 (10年)	1.5	100,000	101,759	2018/6/20
第296回利付国債 (10年)	1.5	2,100,000	2,145,780	2018/9/20
第297回利付国債 (10年)	1.4	560,000	573,669	2018/12/20
第298回利付国債 (10年)	1.3	550,000	562,567	2018/12/20
第299回利付国債 (10年)	1.3	1,240,000	1,272,959	2019/3/20
第300回利付国債 (10年)	1.5	830,000	855,057	2019/3/20
第301回利付国債 (10年)	1.5	340,000	351,597	2019/6/20
第302回利付国債 (10年)	1.4	200,000	206,410	2019/6/20
第303回利付国債 (10年)	1.4	1,390,000	1,440,040	2019/9/20
第304回利付国債 (10年)	1.3	480,000	496,166	2019/9/20
第305回利付国債 (10年)	1.3	1,910,000	1,981,052	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)	1.4	1,170,000	1,220,859	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)	1.3	700,000	728,462	2020/3/20
第308回利付国債 (10年)	1.3	990,000	1,033,569	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	1,610,000	1,670,986	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	1,090,000	1,131,278	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	610,000	629,044	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	1,670,000	1,749,659	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	240,000	253,113	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	310,000	324,570	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	900,000	948,591	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	1,090,000	1,144,412	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	410,000	431,746	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	650,000	681,661	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	680,000	717,835	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	1,120,000	1,177,187	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	1,530,000	1,611,992	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	750,000	786,570	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	970,000	1,019,790	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	1,280,000	1,339,200	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	2,290,000	2,400,584	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	420,000	438,769	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	740,000	777,207	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	1,720,000	1,790,262	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	2,250,000	2,372,625	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	1,440,000	1,521,288	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	580,000	605,380	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	2,230,000	2,330,706	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	1,130,000	1,182,556	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	2,390,000	2,503,525	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	2,290,000	2,383,225	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	610,000	635,205	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	1,350,000	1,385,302	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	1,800,000	1,861,254	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	3,200,000	3,309,760	2025/6/20

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340回利付国債 (10年)	0.4	2,760,000	2,855,247	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	2,770,000	2,842,297	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	2,600,000	2,621,710	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	2,530,000	2,550,594	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	1,500,000	1,511,145	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	2,110,000	2,124,073	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	3,180,000	3,200,161	2027/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	40,000	52,904	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	160,000	204,955	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	120,000	152,532	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	110,000	149,163	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	50,000	63,460	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	190,000	247,579	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	180,000	232,741	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	50,000	61,094	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	240,000	279,028	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	160,000	178,636	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	90,000	108,799	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	190,000	241,851	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	290,000	364,880	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	300,000	397,281	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	340,000	456,178	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	370,000	497,376	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	330,000	438,626	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	345,000	453,185	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	280,000	368,340	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	420,000	567,541	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	270,000	355,849	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	400,000	542,152	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	430,000	583,677	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	260,000	353,111	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	290,000	383,672	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	410,000	550,859	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	600,000	819,708	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	690,000	945,576	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	660,000	894,570	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	640,000	857,203	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	740,000	978,709	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	880,000	1,186,020	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	1,110,000	1,427,748	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	845,000	1,126,596	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	1,160,000	1,498,140	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	930,000	1,203,299	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	1,060,000	1,349,411	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	540,000	675,723	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	840,000	1,071,562	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	600,000	751,632	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	480,000	590,131	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	650,000	799,396	2044/3/20

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4 3 回利付国債 (3 0年)	1.7	750,000	922,695	2044/6/20
第4 4 回利付国債 (3 0年)	1.7	470,000	578,405	2044/9/20
第4 5 回利付国債 (3 0年)	1.5	690,000	815,628	2044/12/20
第4 6 回利付国債 (3 0年)	1.5	810,000	957,460	2045/3/20
第4 7 回利付国債 (3 0年)	1.6	900,000	1,087,389	2045/6/20
第4 8 回利付国債 (3 0年)	1.4	1,100,000	1,274,383	2045/9/20
第4 9 回利付国債 (3 0年)	1.4	740,000	857,156	2045/12/20
第5 0 回利付国債 (3 0年)	0.8	520,000	521,830	2046/3/20
第5 1 回利付国債 (3 0年)	0.3	790,000	689,559	2046/6/20
第5 2 回利付国債 (3 0年)	0.5	770,000	710,933	2046/9/20
第5 3 回利付国債 (3 0年)	0.6	930,000	882,365	2046/12/20
第5 4 回利付国債 (3 0年)	0.8	750,000	750,000	2047/3/20
第4 0 回利付国債 (2 0年)	2.3	100,000	103,221	2018/9/20
第4 1 回利付国債 (2 0年)	1.5	330,000	339,933	2019/3/20
第4 2 回利付国債 (2 0年)	2.6	80,000	83,999	2019/3/20
第4 3 回利付国債 (2 0年)	2.9	140,000	149,884	2019/9/20
第4 4 回利付国債 (2 0年)	2.5	170,000	182,627	2020/3/20
第4 5 回利付国債 (2 0年)	2.4	290,000	310,726	2020/3/20
第4 6 回利付国債 (2 0年)	2.2	170,000	182,224	2020/6/22
第4 7 回利付国債 (2 0年)	2.2	90,000	96,985	2020/9/21
第4 8 回利付国債 (2 0年)	2.5	130,000	142,248	2020/12/21
第4 9 回利付国債 (2 0年)	2.1	140,000	151,977	2021/3/22
第5 0 回利付国債 (2 0年)	1.9	220,000	237,135	2021/3/22
第5 1 回利付国債 (2 0年)	2.0	100,000	108,644	2021/6/21
第5 2 回利付国債 (2 0年)	2.1	110,000	120,552	2021/9/21
第5 3 回利付国債 (2 0年)	2.1	80,000	88,116	2021/12/20
第5 4 回利付国債 (2 0年)	2.2	200,000	221,206	2021/12/20
第5 5 回利付国債 (2 0年)	2.0	140,000	154,270	2022/3/21
第5 6 回利付国債 (2 0年)	2.0	150,000	166,045	2022/6/20
第5 7 回利付国債 (2 0年)	1.9	240,000	264,451	2022/6/20
第5 8 回利付国債 (2 0年)	1.9	300,000	332,187	2022/9/20
第5 9 回利付国債 (2 0年)	1.7	200,000	220,174	2022/12/20
第6 0 回利付国債 (2 0年)	1.4	350,000	379,438	2022/12/20
第6 1 回利付国債 (2 0年)	1.0	240,000	255,408	2023/3/20
第6 2 回利付国債 (2 0年)	0.8	320,000	337,440	2023/6/20
第6 3 回利付国債 (2 0年)	1.8	200,000	223,080	2023/6/20
第6 4 回利付国債 (2 0年)	1.9	320,000	360,390	2023/9/20
第6 5 回利付国債 (2 0年)	1.9	220,000	248,789	2023/12/20
第6 6 回利付国債 (2 0年)	1.8	330,000	371,009	2023/12/20
第6 7 回利付国債 (2 0年)	1.9	130,000	147,555	2024/3/20
第6 8 回利付国債 (2 0年)	2.2	190,000	219,554	2024/3/20
第6 9 回利付国債 (2 0年)	2.1	390,000	447,996	2024/3/20
第7 0 回利付国債 (2 0年)	2.4	400,000	470,044	2024/6/20
第7 1 回利付国債 (2 0年)	2.2	200,000	232,186	2024/6/20
第7 2 回利付国債 (2 0年)	2.1	630,000	729,596	2024/9/20
第7 3 回利付国債 (2 0年)	2.0	360,000	415,659	2024/12/20
第7 4 回利付国債 (2 0年)	2.1	200,000	232,438	2024/12/20
第7 5 回利付国債 (2 0年)	2.1	130,000	151,655	2025/3/20
第7 6 回利付国債 (2 0年)	1.9	270,000	310,753	2025/3/20

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7 7 回利付国債 (2 0年)	2.0	290,000	336,040	2025/3/20
第7 8 回利付国債 (2 0年)	1.9	170,000	196,333	2025/6/20
第7 9 回利付国債 (2 0年)	2.0	270,000	313,999	2025/6/20
第8 0 回利付国債 (2 0年)	2.1	220,000	257,626	2025/6/20
第8 1 回利付国債 (2 0年)	2.0	390,000	455,169	2025/9/20
第8 2 回利付国債 (2 0年)	2.1	600,000	705,252	2025/9/20
第8 3 回利付国債 (2 0年)	2.1	290,000	342,104	2025/12/20
第8 4 回利付国債 (2 0年)	2.0	470,000	550,426	2025/12/20
第8 5 回利付国債 (2 0年)	2.1	290,000	343,455	2026/3/20
第8 6 回利付国債 (2 0年)	2.3	210,000	252,405	2026/3/20
第8 7 回利付国債 (2 0年)	2.2	550,000	656,221	2026/3/20
第8 8 回利付国債 (2 0年)	2.3	420,000	506,780	2026/6/20
第8 9 回利付国債 (2 0年)	2.2	350,000	419,149	2026/6/20
第9 0 回利付国債 (2 0年)	2.2	630,000	757,228	2026/9/20
第9 1 回利付国債 (2 0年)	2.3	450,000	545,053	2026/9/20
第9 2 回利付国債 (2 0年)	2.1	880,000	1,053,069	2026/12/20
第9 3 回利付国債 (2 0年)	2.0	410,000	488,465	2027/3/20
第9 4 回利付国債 (2 0年)	2.1	610,000	732,695	2027/3/20
第9 5 回利付国債 (2 0年)	2.3	610,000	747,683	2027/6/20
第9 6 回利付国債 (2 0年)	2.1	320,000	385,820	2027/6/20
第9 7 回利付国債 (2 0年)	2.2	340,000	414,531	2027/9/20
第9 8 回利付国債 (2 0年)	2.1	440,000	531,942	2027/9/20
第9 9 回利付国債 (2 0年)	2.1	870,000	1,055,057	2027/12/20
第1 0 0 回利付国債 (2 0年)	2.2	480,000	588,984	2028/3/20
第1 0 1 回利付国債 (2 0年)	2.4	415,000	518,115	2028/3/20
第1 0 2 回利付国債 (2 0年)	2.4	320,000	400,912	2028/6/20
第1 0 3 回利付国債 (2 0年)	2.3	160,000	198,704	2028/6/20
第1 0 4 回利付国債 (2 0年)	2.1	360,000	439,203	2028/6/20
第1 0 5 回利付国債 (2 0年)	2.1	760,000	929,936	2028/9/20
第1 0 6 回利付国債 (2 0年)	2.2	230,000	283,999	2028/9/20
第1 0 7 回利付国債 (2 0年)	2.1	150,000	184,062	2028/12/20
第1 0 8 回利付国債 (2 0年)	1.9	610,000	734,592	2028/12/20
第1 0 9 回利付国債 (2 0年)	1.9	130,000	156,929	2029/3/20
第1 1 0 回利付国債 (2 0年)	2.1	990,000	1,218,828	2029/3/20
第1 1 1 回利付国債 (2 0年)	2.2	290,000	361,461	2029/6/20
第1 1 2 回利付国債 (2 0年)	2.1	610,000	753,069	2029/6/20
第1 1 3 回利付国債 (2 0年)	2.1	1,290,000	1,595,884	2029/9/20
第1 1 4 回利付国債 (2 0年)	2.1	690,000	855,289	2029/12/20
第1 1 5 回利付国債 (2 0年)	2.2	380,000	475,710	2029/12/20
第1 1 6 回利付国債 (2 0年)	2.2	630,000	790,738	2030/3/20
第1 1 7 回利付国債 (2 0年)	2.1	630,000	782,838	2030/3/20
第1 1 8 回利付国債 (2 0年)	2.0	690,000	850,176	2030/6/20
第1 1 9 回利付国債 (2 0年)	1.8	220,000	265,458	2030/6/20
第1 2 0 回利付国債 (2 0年)	1.6	330,000	389,518	2030/6/20
第1 2 1 回利付国債 (2 0年)	1.9	930,000	1,136,394	2030/9/20
第1 2 2 回利付国債 (2 0年)	1.8	200,000	241,790	2030/9/20
第1 2 3 回利付国債 (2 0年)	2.1	1,000,000	1,250,760	2030/12/20
第1 2 4 回利付国債 (2 0年)	2.0	390,000	482,648	2030/12/20
第1 2 5 回利付国債 (2 0年)	2.2	310,000	392,748	2031/3/20

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第126回利付国債(20年)	2.0	570,000	706,857	2031/3/20
第127回利付国債(20年)	1.9	460,000	564,277	2031/3/20
第128回利付国債(20年)	1.9	840,000	1,031,688	2031/6/20
第129回利付国債(20年)	1.8	100,000	121,457	2031/6/20
第130回利付国債(20年)	1.8	630,000	766,464	2031/9/20
第131回利付国債(20年)	1.7	380,000	457,052	2031/9/20
第132回利付国債(20年)	1.7	690,000	830,518	2031/12/20
第133回利付国債(20年)	1.8	600,000	730,614	2031/12/20
第134回利付国債(20年)	1.8	560,000	682,925	2032/3/20
第135回利付国債(20年)	1.7	420,000	505,848	2032/3/20
第136回利付国債(20年)	1.6	410,000	487,961	2032/3/20
第137回利付国債(20年)	1.7	350,000	422,100	2032/6/20
第138回利付国債(20年)	1.5	390,000	458,729	2032/6/20
第139回利付国債(20年)	1.6	510,000	607,685	2032/6/20
第140回利付国債(20年)	1.7	1,310,000	1,580,711	2032/9/20
第141回利付国債(20年)	1.7	360,000	434,905	2032/12/20
第142回利付国債(20年)	1.8	420,000	513,630	2032/12/20
第143回利付国債(20年)	1.6	890,000	1,062,152	2033/3/20
第144回利付国債(20年)	1.5	540,000	635,844	2033/3/20
第145回利付国債(20年)	1.7	1,410,000	1,705,818	2033/6/20
第146回利付国債(20年)	1.7	1,390,000	1,682,066	2033/9/20
第147回利付国債(20年)	1.6	1,240,000	1,481,403	2033/12/20
第148回利付国債(20年)	1.5	1,170,000	1,378,049	2034/3/20
第149回利付国債(20年)	1.5	1,250,000	1,473,050	2034/6/20
第150回利付国債(20年)	1.4	1,220,000	1,416,322	2034/9/20
第151回利付国債(20年)	1.2	1,330,000	1,498,391	2034/12/20
第152回利付国債(20年)	1.2	1,360,000	1,531,904	2035/3/20
第153回利付国債(20年)	1.3	1,360,000	1,554,316	2035/6/20
第154回利付国債(20年)	1.2	1,010,000	1,136,189	2035/9/20
第155回利付国債(20年)	1.0	1,530,000	1,664,135	2035/12/20
第156回利付国債(20年)	0.4	930,000	910,879	2036/3/20
第157回利付国債(20年)	0.2	1,400,000	1,316,616	2036/6/20
第158回利付国債(20年)	0.5	1,280,000	1,269,926	2036/9/20
第159回利付国債(20年)	0.6	1,350,000	1,360,705	2036/12/20
第160回利付国債(20年)	0.7	910,000	932,704	2037/3/20
第14回ポーランド共和国国債債券	0.67	200,000	200,426	2018/11/15
小 計		227,575,000	248,331,087	
<b>地方債証券</b>				
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	100,000	114,991	2024/3/19
第6回東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	114,807	2025/3/19
第9回東京都公募公債(30年)	2.37	100,000	130,830	2039/3/18
第11回東京都公募公債(30年)	2.19	100,000	128,046	2040/9/20
第17回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	120,409	2028/12/20
第19回東京都公募公債(20年)	2.13	100,000	121,439	2029/6/20
第26回東京都公募公債(20年)	1.74	200,000	236,874	2032/6/18
第27回東京都公募公債(20年)	1.68	200,000	235,254	2032/12/20
第695回東京都公募公債	1.2	100,000	104,527	2021/3/19
第696回東京都公募公債	1.19	100,000	104,783	2021/6/18
第700回東京都公募公債	1.02	100,000	104,345	2021/9/17

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第702回東京都公募公債	1.04	200,000	209,392	2021/12/20
第716回東京都公募公債	0.77	100,000	104,106	2022/12/20
第717回東京都公募公債	0.63	100,000	103,509	2023/3/20
第720回東京都公募公債	0.87	100,000	105,081	2023/6/20
第728回東京都公募公債	0.65	100,000	103,992	2023/12/20
平成22年度第11回北海道公募公債	1.36	100,000	104,817	2020/12/28
平成23年度第6回北海道公募公債	1.11	200,000	209,228	2021/8/31
平成24年度第14回北海道公募公債	0.8	100,000	104,325	2023/2/28
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	135,000	2038/3/19
第20回神奈川県公募公債(20年)	1.706	100,000	117,790	2032/6/18
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	112,959	2034/9/20
第172回神奈川県公募公債	1.34	200,000	207,468	2020/3/20
第210回神奈川県公募公債	0.451	200,000	205,346	2024/12/20
第218回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,499	2025/12/19
第7回大阪府公募公債(20年)	1.84	200,000	237,748	2031/9/26
第345回大阪府公募公債(10年)	1.26	100,000	104,449	2020/12/25
第349回大阪府公募公債(10年)	1.38	100,000	105,316	2021/4/27
第361回大阪府公募公債(10年)	0.92	100,000	104,463	2022/6/28
第371回大阪府公募公債(10年)	0.58	100,000	103,153	2023/4/26
第375回大阪府公募公債(10年)	0.835	100,000	104,859	2023/8/29
第389回大阪府公募公債(10年)	0.53	100,000	103,164	2024/10/30
第399回大阪府公募公債(10年)	0.529	100,000	103,214	2025/8/28
第402回大阪府公募公債(10年)	0.493	100,000	102,915	2025/11/27
平成22年度第2回京都府公募公債	1.16	100,000	103,820	2020/9/24
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	1.79	100,000	118,668	2031/10/17
平成25年度第7回京都府公募公債	0.8	100,000	104,750	2023/9/19
平成27年度第4回京都府公募公債	0.553	100,000	103,497	2025/6/19
第1回兵庫県公募公債(12年)	1.1	100,000	107,178	2024/6/26
第3回兵庫県公募公債(12年)	0.56	100,000	103,436	2025/4/16
第7回兵庫県公募公債(15年)	1.12	100,000	108,930	2028/12/25
平成22年度第1回兵庫県公募公債	1.46	100,000	104,179	2020/4/16
平成25年度第4回兵庫県公募公債	0.82	100,000	104,776	2023/8/18
平成26年度第17回兵庫県公募公債	0.46	100,000	102,649	2025/12/26
第9回静岡県公募公債(30年)	1.539	100,000	114,024	2045/6/20
平成23年度第3回静岡県公募公債	1.193	103,290	108,162	2021/5/25
平成23年度第8回静岡県公募公債	1.025	100,000	104,449	2021/10/25
平成24年度第10回静岡県公募公債	0.678	100,000	103,730	2023/3/22
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	2.28	100,000	123,116	2029/6/20
平成22年度第3回愛知県公募公債(10年)	1.364	200,000	208,116	2020/5/28
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	1.38	100,000	105,362	2021/4/28
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	1.212	100,000	104,799	2021/5/27
平成23年度第14回愛知県公募公債(10年)	1.006	100,000	104,463	2021/11/30
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	0.639	100,000	103,514	2023/3/28
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	0.665	100,000	104,134	2024/4/30
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	2.34	100,000	122,794	2028/9/21
平成22年度第1回広島県公募公債	1.37	100,000	104,072	2020/5/27
平成24年度第4回広島県公募公債	0.81	100,000	104,225	2022/11/28
平成22年度第10回埼玉県公募公債	1.26	100,000	104,584	2021/1/28

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22年度第11回埼玉県公債	1.28	193,000	202,175	2021/2/25
平成24年度第1回埼玉県公債	1.05	100,000	105,016	2022/4/26
平成24年度第9回埼玉県公債	0.844	100,000	104,566	2023/1/31
平成25年度第11回埼玉県公債	0.655	100,000	104,044	2024/3/26
平成20年度第2回福岡県公債(20年)	2.05	100,000	119,826	2028/12/20
平成23年度第1回福岡県公債(20年)	2.008	100,000	121,455	2031/5/23
平成23年度第1回福岡県公債	1.18	200,000	209,550	2021/6/28
平成24年度第1回福岡県公債(30年)	2.12	100,000	127,364	2042/9/19
平成13回千葉県公債(20年)	1.701	100,000	117,743	2032/10/15
平成21年度第12回千葉県公債	1.44	100,000	103,925	2020/2/25
平成22年度第8回千葉県公債	1.0	120,000	124,147	2020/11/25
平成25年度第5回千葉県公債	0.84	100,000	104,947	2023/8/25
平成26年度第7回千葉県公債	0.429	100,000	102,489	2025/2/25
平成27年度第1回千葉県公債	0.549	100,000	103,474	2025/5/23
第78回共同発行市場公募地方債	1.39	100,000	103,209	2019/9/25
第85回共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	104,152	2020/4/24
第87回共同発行市場公募地方債	1.29	100,000	103,934	2020/6/25
第89回共同発行市場公募地方債	1.04	150,300	155,317	2020/8/25
第91回共同発行市場公募地方債	0.9	100,000	103,027	2020/10/23
第93回共同発行市場公募地方債	1.25	100,000	104,432	2020/12/25
第94回共同発行市場公募地方債	1.24	100,000	104,501	2021/1/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	104,754	2021/2/25
第97回共同発行市場公募地方債	1.38	356,000	375,021	2021/4/23
第98回共同発行市場公募地方債	1.18	100,000	104,666	2021/5/25
第102回共同発行市場公募地方債	1.03	150,000	156,577	2021/9/24
第108回共同発行市場公募地方債	1.01	100,000	104,742	2022/3/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	105,013	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	104,292	2022/5/25
第112回共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	104,170	2022/7/25
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	103,775	2022/12/22
第119回共同発行市場公募地方債	0.8	200,000	208,750	2023/2/24
第125回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	104,823	2023/8/25
第127回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	104,057	2023/10/25
第128回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	103,946	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	200,000	209,398	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	312,231	2024/3/25
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	103,812	2024/7/25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	103,491	2024/8/23
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	103,048	2024/11/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	200,000	204,640	2025/4/25
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	207,012	2025/5/23
第159回共同発行市場公募地方債	0.07	200,000	198,388	2026/6/25
平成24年度第2回熊本県公債(10年)	0.8	200,000	208,262	2022/10/26
平成22年度第1回静岡市公債	1.008	100,000	103,485	2020/11/25
第13回大阪市公債(20年)	2.08	200,000	243,312	2030/6/14
平成22年度第5回大阪市公債	1.2	100,000	103,931	2020/9/17
第5回名古屋市公債(30年)	2.49	100,000	133,088	2039/3/18
第9回名古屋市公債(20年)	2.07	100,000	120,591	2028/12/20
第11回名古屋市公債(30年)	1.774	100,000	119,027	2044/9/20

銘柄名	期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第481回名古屋市公債(10年)	0.744	100,000	103,904	2022/12/20
平成22年度第2回京都市公債	1.11	102,000	105,642	2020/8/27
平成23年度第4回京都市公債	1.067	100,000	104,801	2021/12/22
平成24年度第4回京都市公債	0.801	100,000	104,126	2022/10/21
平成24年度第5回京都市公債	0.854	100,000	104,623	2023/1/31
第5回横浜市公債(20年)	2.17	100,000	116,461	2025/6/20
第20回横浜市公債(20年)	2.1	100,000	121,284	2029/10/19
平成21年度第1回横浜市公債	1.58	200,000	206,234	2019/5/24
平成21年度第5回横浜市公債	1.56	100,000	103,838	2019/11/19
平成23年度第5回横浜市公債	1.011	100,000	104,622	2022/1/28
平成24年度第10回札幌市公債(10年)	0.8	100,000	104,215	2022/12/20
平成26年度第9回札幌市公債(10年)	0.43	100,000	102,515	2024/12/20
第11回川崎市公債(20年)	1.84	100,000	118,818	2030/10/18
第81回川崎市公債	1.57	100,000	102,820	2019/3/20
第82回川崎市公債	1.52	100,000	103,491	2019/9/20
平成26年度第2回北九州市公債	0.451	100,000	102,676	2024/12/24
平成26年度第5回福岡市公債	0.539	200,000	206,608	2024/10/28
平成22年度第6回広島市公債	1.21	100,000	104,805	2021/5/31
平成25年度第3回広島市公債	0.67	150,000	156,156	2024/2/23
平成26年度第2回広島市公債	0.456	100,000	102,715	2024/12/25
平成23年度第2回千葉市公債	1.06	200,000	209,384	2021/11/25
平成26年度第1回岡山県公債(10年)	0.33	200,000	203,502	2025/1/30
第113回福岡北九州高速道路債券	2.41	100,000	120,555	2027/12/20
小計		15,824,590	16,991,916	
<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	326,577	2021/5/21
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	1.3	101,000	104,084	2019/9/17
第14回政府保証日本政策投資銀行債券	2.1	100,000	109,131	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	104,019	2023/3/15
第22回政府保証日本政策投資銀行債券	2.2	100,000	113,463	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	107,221	2021/2/26
第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	200,000	214,738	2021/3/26
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	137,875	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	243,674	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	310,644	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	143,489	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	129,334	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	104,095	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	103,341	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	206,850	2020/9/30

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
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	206,492	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	208,786	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	122,999	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	104,501	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	105,199	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	104,695	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	313,602	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	314,033	2022/1/31
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.901	200,000	209,240	2022/5/31
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.895	100,000	104,660	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	104,321	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	312,642	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	117,788	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	104,865	2023/1/31
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.815	300,000	314,496	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	208,048	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	206,644	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	311,271	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	210,994	2023/6/30
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	148,000	155,659	2023/9/29
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	104,407	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	229,928	2034/3/31
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.669	102,000	106,649	2024/4/30
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	104,450	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	104,158	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	103,728	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	103,220	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	306,312	2025/1/31
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	100,000	103,023	2019/7/12

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	101,000	104,245	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	104,346	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	106,071	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	106,199	2021/4/16
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	100,000	104,315	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	104,803	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	103,311	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	103,731	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	105,284	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	208,890	2024/2/16
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	100,000	99,388	2026/3/13
第44回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.245	100,000	100,494	2019/6/20
第14回道路債券	1.91	100,000	110,222	2022/12/20
第17回道路債券	1.54	100,000	108,172	2022/12/20
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.35	400,000	479,688	2026/9/18
第21回道路債券	2.75	100,000	133,657	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	122,310	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	144,374	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	123,025	2028/6/20
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	100,000	124,157	2029/4/20
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.38	100,000	103,181	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	104,555	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	314,961	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	118,437	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	103,821	2023/3/20
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.038	100,000	105,691	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	104,230	2023/9/20
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.974	100,000	122,666	2055/3/19
第2回公営企業債券(20年)	1.45	100,000	107,673	2022/12/20
第3回公営企業債券(20年)	1.03	110,000	116,215	2023/3/22
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	1.176	100,000	109,685	2029/1/26
第7回公営企業債券(20年)	2.2	100,000	114,407	2024/3/22
第7回公営企業債券(30年)	2.67	100,000	134,286	2035/6/20
第8回公営企業債券(20年)	2.25	40,000	45,898	2024/3/22
第8回地方公共団体金融機構債券	1.453	100,000	103,864	2020/1/28
第10回地方公共団体金融機構債券	1.424	100,000	104,014	2020/3/27
第11回地方公共団体金融機構債券	1.465	100,000	104,256	2020/4/28
第15回地方公共団体金融機構債券	1.093	200,000	207,036	2020/8/28
第23回地方公共団体金融機構債券	1.418	100,000	105,511	2021/4/28
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.702	100,000	117,372	2032/9/28
第38回地方公共団体金融機構債券	0.835	500,000	519,815	2022/7/28
第42回地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	104,032	2022/11/28
第58回地方公共団体金融機構債券	0.739	100,000	104,477	2024/3/28
第65回地方公共団体金融機構債券	0.535	200,000	206,244	2024/10/28
第88回地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	98,944	2026/9/28
第18回株式会社日本政策金融公社債	2.157	100,000	123,127	2031/5/9

銘柄名	期 末			償還年月日
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	
第43回都市再生債券	1.29	100,000	104,232	2020/9/18
第5回本州四国連絡橋債券	2.23	100,000	115,901	2024/12/20
第344回東京交通債券	1.67	100,000	108,799	2023/2/17
第346回東京交通債券	1.13	20,000	21,208	2023/6/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	20,226	21,364	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	19,392	20,628	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	19,812	21,244	2037/11/10
第3回一般担保住宅金融公庫債券	2.1	100,000	103,788	2019/3/20
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	21,556	22,979	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	21,204	22,602	2038/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	16,948	17,703	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	35,640	37,896	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	20,712	21,939	2038/11/10
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	18,785	19,977	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	21,905	23,246	2039/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	18,699	19,911	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	21,627	22,825	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	25,116	25,990	2032/5/10
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.65	25,484	26,341	2032/5/10
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.25	29,278	31,704	2044/4/10
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	30,415	33,044	2044/5/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	32,742	35,608	2044/6/10
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	36,660	39,354	2044/9/10
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	38,633	41,421	2044/11/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	39,518	42,243	2044/12/10
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	1.47	100,000	103,018	2019/6/20
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	83,582	89,295	2045/3/10
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	19,809	20,752	2040/11/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	44,187	46,957	2045/5/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	19,927	20,868	2041/2/10
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	1.5	100,000	103,830	2019/12/20
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	19,582	20,849	2041/5/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	48,632	51,830	2046/2/10
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	18,160	19,269	2041/9/10
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	48,931	52,289	2046/3/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	46,467	49,736	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	20,019	21,352	2041/12/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	91,672	97,194	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	50,078	53,120	2046/8/10
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	20,526	21,791	2042/4/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	61,535	64,811	2046/12/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	59,490	62,667	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	59,372	62,589	2047/2/10
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	1.04	100,000	103,405	2020/9/18
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	125,974	132,213	2047/5/10
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	1.33	100,000	104,693	2020/12/18
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	1.358	100,000	104,792	2020/12/18

銘柄名	期 末			償還年月日
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	135,042	140,397	2047/11/10
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	68,359	70,966	2047/12/10
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	68,413	71,679	2048/1/10
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	69,930	73,369	2048/2/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	62,661	65,661	2048/3/10
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	64,421	66,936	2048/5/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	69,270	72,892	2048/6/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	182,976	2031/6/13
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	63,515	65,995	2048/12/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	70,824	73,418	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	72,651	75,355	2049/6/10
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	71,450	73,875	2049/8/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	119,443	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	150,894	155,950	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	76,367	78,563	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	157,872	161,496	2050/1/10
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8	84,377	86,650	2050/3/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	87,550	89,582	2050/5/10
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.83	86,803	89,332	2050/6/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	176,934	182,654	2050/8/10
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	87,988	90,586	2050/9/10
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	93,050	95,836	2051/1/10
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	97,724	97,529	2051/10/10
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	97,990	97,516	2051/11/10
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	1.473	100,000	112,225	2027/9/17
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	98,362	98,360	2051/12/10
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	98,748	99,330	2052/1/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	98,980	99,365	2052/2/10
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	2.105	100,000	125,636	2043/3/20
第12回農林漁業金融公庫債券	2.24	100,000	119,848	2027/3/19
第38回日本高速道路株式会社債	0.03	100,000	99,956	2021/9/17
第33回中日本高速道路株式会社債	1.084	200,000	208,970	2021/9/17
第59回中日本高速道路株式会社債	0.309	100,000	101,178	2021/12/20
第32回西日本高速道路株式会社債	0.2	100,000	99,631	2026/10/19
第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8	200,000	208,140	2022/12/20
第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.685	100,000	103,897	2023/9/20
小 計		18,775,470	20,130,919	
金融債券				
い第799号商工債	0.22	100,000	100,582	2020/4/27
い第786号商工債	0.22	300,000	301,884	2020/11/27
い第795号商工債	0.03	200,000	199,744	2021/8/27
い第768号農林債	0.3	100,000	100,558	2019/5/27
い第780号農林債	0.28	100,000	100,779	2020/5/27
い第795号農林債	0.03	100,000	99,872	2021/8/27
い第796号農林債	0.03	200,000	199,740	2021/9/27
第299回信中金債(5年)	0.2	100,000	100,433	2019/10/25
第300回信中金債(5年)	0.225	300,000	301,536	2019/11/27
第303回信中金債(5年)	0.25	100,000	100,632	2020/2/27
第309回信中金債(5年)	0.25	100,000	100,681	2020/8/27

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第317回信金中金債(5年)	0.06	200,000	200,156	2021/4/27
第201号商工債(3年)	0.01	300,000	299,925	2019/10/25
小 計		2,200,000	2,206,522	
<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	123,018	2018/10/23
第459回東京電力株式会社社債	2.7	10,000	10,400	2019/1/29
第528回東京電力株式会社社債	1.905	100,000	103,245	2019/6/13
第536回東京電力株式会社社債	1.672	100,000	101,024	2018/1/29
第542回東京電力株式会社社債	1.602	100,000	101,292	2018/4/25
第544回東京電力株式会社社債	1.976	100,000	101,865	2018/6/25
第554回東京電力株式会社社債	1.608	100,000	102,590	2019/5/29
第499回中部電力株式会社社債	1.194	100,000	105,801	2023/6/23
第503回中部電力株式会社社債	0.584	100,000	102,131	2025/3/25
第473回関西電力株式会社社債	1.665	100,000	102,880	2019/4/25
第496回関西電力株式会社社債	0.908	100,000	104,011	2025/2/25
第505回関西電力株式会社社債	0.24	100,000	99,723	2023/8/25
第358回中国電力株式会社社債	1.702	100,000	102,260	2018/10/25
第385回中国電力株式会社社債	0.728	100,000	103,284	2025/7/25
第286回北陸電力株式会社社債	1.99	100,000	103,847	2019/6/25
第307回北陸電力株式会社社債	1.055	100,000	106,107	2026/6/25
第471回東北電力株式会社社債	1.168	126,000	133,263	2023/12/25
第487回東北電力株式会社社債	0.17	100,000	99,347	2023/9/25
第253回四国電力株式会社社債	1.0	100,000	104,827	2023/6/23
第246回九州電力株式会社社債	1.064	100,000	105,022	2024/2/23
第320回北海道電力株式会社社債	0.585	101,000	102,645	2021/12/24
第21回清水建設株式会社無担保社債	0.39	100,000	100,419	2021/12/3
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	103,756	2019/11/5
第10回日本たばこ産業株式会社社債	0.358	100,000	101,110	2022/7/15
第5回ビューリック株式会社無担保社債	0.949	100,000	103,571	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	103,200	2024/7/29
第3回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	1.94	100,000	101,932	2018/6/20
第12回日本製紙株式会社無担保社債	0.97	100,000	103,615	2024/6/19
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.948	100,000	102,365	2020/6/4
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	0.54	100,000	100,875	2019/7/19
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	0.925	100,000	103,985	2024/10/23
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	0.82	100,000	103,418	2024/6/4
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	0.703	100,000	102,612	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	100,765	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	101,140	2022/2/25
第5回日本電産株式会社無担保社債	0.001	100,000	99,828	2019/11/25
第36回富士通株式会社無担保社債	0.562	200,000	202,978	2021/6/11
第12回パナソニック株式会社無担保社債	0.387	100,000	100,620	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	203,250	2022/3/18
第16回パナソニック株式会社無担保社債	0.3	100,000	100,145	2023/9/20

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第12回株式会社デンソー無担保社債	0.01	100,000	99,550	2021/9/17
第24回三菱重工株式会社無担保社債	1.482	100,000	103,463	2019/12/9
第29回三菱重工株式会社無担保社債	0.662	100,000	102,934	2024/9/3
第37回崎重工業株式会社無担保社債	0.572	100,000	100,519	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	100,813	2018/8/3
第6回J.A.三井リース株式会社無担保社債	0.2	100,000	99,949	2022/1/27
第57回日産自動車株式会社無担保社債	0.314	100,000	100,377	2019/3/20
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	100,552	2020/3/12
第21回株式会社ニコン無担保社債	0.864	100,000	103,811	2024/3/14
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.65	100,000	104,017	2020/3/12
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.785	100,000	102,680	2024/5/30
第70回三井物産株式会社無担保社債	2.021	100,000	118,169	2033/3/4
第74回三菱商事株式会社無担保社債	1.657	100,000	103,300	2019/7/29
第76回三菱商事株式会社無担保社債	1.303	100,000	104,461	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	102,376	2024/4/24
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	125,969	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	103,811	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	105,340	2021/6/9
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.34	100,000	120,271	2027/4/20
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.849	100,000	102,405	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	105,150	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	104,722	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	102,979	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	104,354	2019/7/24
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	1.43	100,000	104,073	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	105,835	2020/8/7
第39回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.001	100,000	99,798	2019/12/20
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	100,247	2021/9/17
第23回コーリス株式会社無担保社債	0.05	100,000	99,545	2021/9/24
第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.572	100,000	100,754	2021/3/18
第67回アコム株式会社無担保社債	0.5	100,000	100,331	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	104,233	2026/9/18
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,172	2023/10/25
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,765	2022/1/26
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	100,537	2020/2/25
第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債	1.249	100,000	103,007	2020/2/26

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	100,573	2019/2/25
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	103,133	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	103,745	2021/9/17
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	1.168	100,000	104,609	2023/6/26
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	100,000	106,205	2026/6/17
第63回小田急鉄道株式会社無担保社債	0.905	100,000	105,324	2025/12/12
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	1.412	100,000	103,287	2019/12/9
第17回東日本旅客鉄道株式会社債	2.3	100,000	108,269	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	110,673	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	102,542	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	246,456	2028/12/12
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.28	19,000	20,997	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	122,699	2028/3/17
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.024	100,000	92,013	2056/12/13
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.2	20,000	22,075	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	104,203	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	129,958	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	121,694	2044/10/28
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	0.69	200,000	205,922	2023/3/20
第20回KDDI株式会社無担保社債	0.803	100,000	103,126	2023/12/20
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	0.73	100,000	102,718	2023/9/20
第13回電源開発株式会社無担保社債	2.04	100,000	113,452	2025/6/20
第30回電源開発株式会社無担保社債	1.394	100,000	103,623	2020/5/20
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	100,000	104,722	2023/12/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	0.9	100,000	104,222	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	101,064	2022/12/16
第20回フランス相互信用連合銀行 (BFCM) 円貨社債	0.16	100,000	99,358	2021/10/14
第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.437	100,000	100,584	2020/12/11
第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.38	100,000	99,867	2024/1/26
第4回スウェンスカ・ハンデルスバンケンAB円貨社債	0.325	100,000	100,062	2019/9/4
第6回スウェンスカ・ハンデルスバンケンAB円貨社債	0.292	100,000	99,615	2020/9/3
第1回HSBC・ホールディングス・ビーエルシー円貨社債	0.45	100,000	100,580	2021/9/24
第6回ビー・エヌ・ビー・バリハ円貨社債	0.439	100,000	100,465	2019/9/17
第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	0.457	100,000	100,454	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	100,224	2020/1/16
第11回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.3	100,000	100,319	2021/1/22
第9回オーストラリア・ニューゼaland銀行円貨社債	0.343	100,000	100,437	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	200,092	2020/5/22
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	0.28	100,000	99,623	2023/6/2
小計		11,796,000	12,246,422	
合計		276,171,060	299,906,867	

## 投資信託財産の構成

項目	期		末	
	評価額	比率	評価額	比率
公社債	299,906,867	99.0		
コール・ローン等、その他	3,174,714	1.0		
投資信託財産総額	303,081,581	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 2017年5月29日現在
(A) 資 産	303,186,530,044円
コール・ローン等	2,390,259,799
公社債(評価額)	299,906,867,638
未 収 利 息	773,449,322
前 払 費 用	11,004,285
差入委託証拠金	104,949,000
(B) 負 債	2,426,281,639
未 払 金	2,297,210,528
未 払 解 約 金	24,116,283
未 払 利 息	5,828
差入委託証拠金代用有価証券	104,949,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	300,760,248,405
元 本	217,479,302,929
次 期 繰 越 損 益 金	83,280,945,476
(D) 受 益 権 総 口 数	217,479,302,929口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,829円

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2016年5月31日 至 2017年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	2,956,981,053円
受 取 利 息	2,957,878,676
支 払 利 息	△897,623
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△9,324,730,663
売 買 益	130,140,645
売 買 損	△9,454,871,308
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△4,584,460
取 引 益	18,702,004
取 引 損	△23,286,464
(D) そ の 他 費 用	△57,746
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	△6,372,391,816
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	93,058,233,527
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	15,883,710,017
(H) 解 約 差 損 益 金	△19,288,606,252
(I) 計 (E + F + G + H)	83,280,945,476
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	83,280,945,476

(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226,592,497,472円、期中追加設定元本額は40,375,203,761円、期中一部解約元本額は49,488,398,304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 104,770,000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	69,940,086,297円
DC日本債券インデックス・オープンP	31,218,115,591円
DCマイセクション50	18,218,093,765円
DCマイセクション25	15,767,023,152円
SMT 国内債券インデックス・オープン	9,626,726,316円
日本債券ファンド・シリーズ1	9,295,699,138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)	7,375,458,848円
DCマイセクションS50	7,193,338,355円
DCマイセクションS25	6,434,799,757円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	6,239,507,705円
DCマイセクション75	4,969,203,943円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,686,337,684円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,647,096,765円

SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,978,277,779円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,567,062,262円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,826,533,196円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,659,990,333円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,596,667,834円
DCマイセレクションS75	1,391,595,812円
DCターゲット・イヤールファン ド2025	1,274,132,238円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,229,870,247円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,051,592,120円
世界経済インデックスファンド	933,952,975円
DCターゲット・イヤールファン ド2035	885,841,161円
DC世界経済インデックスファンド	864,913,294円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	581,203,933円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	484,562,095円
DC日本債券インデックス・オープン	450,914,639円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	389,697,859円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	352,118,262円
DCターゲット・イヤールファン ド2045	258,985,553円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	236,807,865円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	191,776,992円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	190,010,457円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	104,974,542円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	103,362,839円
SMT インデックスバランス・オープン	85,193,106円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	59,407,120円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	35,490,769円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	28,330,415円
SBI資産設計オープン(分配型)	22,091,976円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	17,050,168円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	9,335,858円
SMT日米インデックスバランス・オープン	2,915,014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)	929,660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17期（決算日 2017年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式先物比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率		
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
第17期(2017年5月29日)	13,812	17.5	1,570.21	14.9	98.2	162,440

(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	株式先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2016年 5月30日	11,755	—	1,366.01	—	97.9	1.9
5月末	11,873	1.0	1,379.80	1.0	98.0	2.1
6月末	10,736	△8.7	1,245.82	△8.8	98.8	1.2
7月末	11,400	△3.0	1,322.74	△3.2	98.7	1.3
8月末	11,462	△2.5	1,329.54	△2.7	98.9	1.1
9月末	11,498	△2.2	1,322.78	△3.2	98.1	1.8
10月末	12,109	3.0	1,393.02	2.0	98.5	1.4
11月末	12,776	8.7	1,469.43	7.6	98.0	1.8
12月末	13,220	12.5	1,518.61	11.2	98.6	1.4
2017年 1月末	13,248	12.7	1,521.67	11.4	98.7	1.3
2月末	13,375	13.8	1,535.32	12.4	98.8	1.1
3月末	13,295	13.1	1,512.60	10.7	97.4	2.6
4月末	13,467	14.6	1,531.80	12.1	97.9	2.1
(当期末) 2017年 5月29日	13,812	17.5	1,570.21	14.9	98.2	1.8

(注1) 騰落率は期首比です。

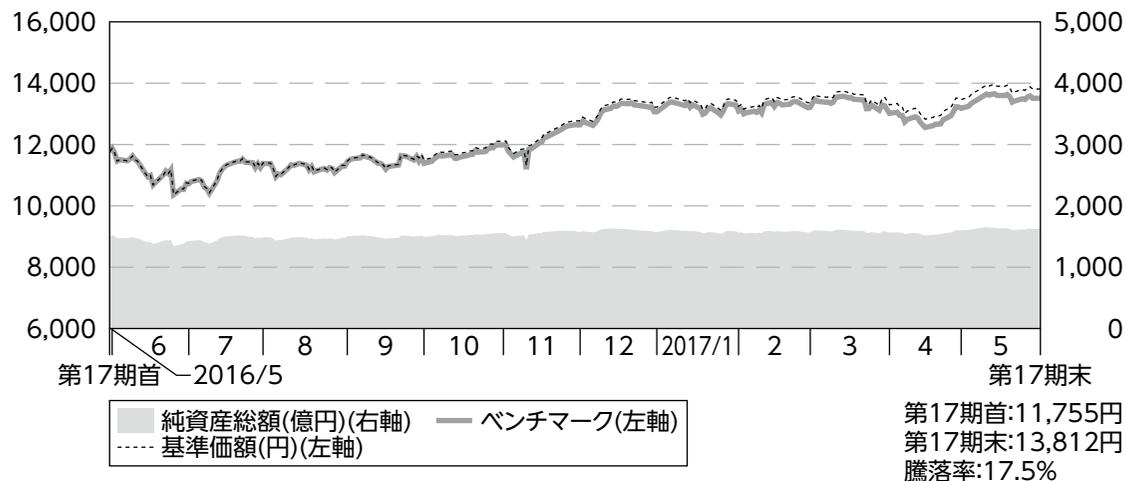
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

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

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2016年5月30日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)の動きを反映して基準価額は変動し、期首比では上昇しました。

## 投資環境



期前半の国内株式市場は、英国のEU(欧州連合)離脱決定後の先行きに対する不透明感などから、上値の重い展開が続きましたが、2016年11月から12月にかけては、トランプ氏が掲げる政策への好感や、米国金利の先高観などを背景とした円安・米ドル高の進行から、上昇しました。

その後は、それまでの急ピッチな上昇に対する警戒感に加え、トランプ米大統領による保護主義的な発言や、シリアや北朝鮮を巡る地政学リスクの高まりなどを背景に調整する局面もありましたが、地政学リスクの後退や、フランス大統領選挙の結果を受けて欧州の政治情勢に対する過度な懸念が後退したことなどから、期末にかけて上昇に転じました。

## 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

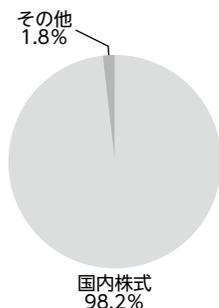
## ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	3.1%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	2.2%
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	三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.4%
6	KDDI	日本	1.3%

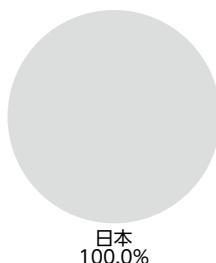
順位	銘柄名	国	組入比率
7	ソニー	日本	1.2%
8	本田技研工業	日本	1.2%
9	みずほフィナンシャルグループ	日本	1.1%
10	日本たばこ産業	日本	1.1%
組入銘柄数		1,967	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

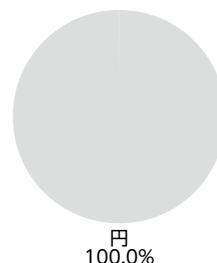
## ○資産別配分



## ○国別配分



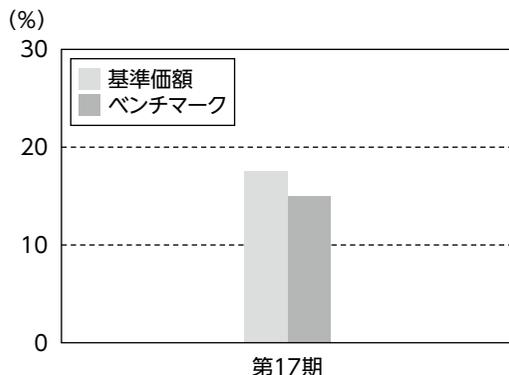
## ○通貨別配分



(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)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
	(2016年5月31日～2017年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (0) (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.001% (0.000) (-) (-) (-) (-) (-) (0.001)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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(12,371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 11,518 (△8,530)	千円 14,625,518 (-)	千株 19,013	千円 25,342,824

(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 33,148	百万円 33,405	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	39,968,343千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	151,070,732千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.26

(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 16,021	百万円 16,021	% 100.0	百万円 16,220	百万円 16,220	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	389,816	77,074	19.8	389,250	76,435	19.6

(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。

## ■ 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	45百万円	81百万円	538百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

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

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

## 組入資産の明細

## &lt;国内株式(上場株式)&gt;

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
<b>水産・農林業(0.1%)</b>			
極洋	35	3.1	9,501
日本水産	94.4	101.3	58,956
マルハニチロ	16.7	14.8	47,656
カネコ種苗	—	2.7	3,963
サカタのタネ	12.1	11.5	40,940
ホクト	8.3	7.9	15,981
ホクリヨウ	0.8	1.1	1,025
<b>鉱業(0.3%)</b>			
住石ホールディングス	24.1	21.7	2,170
日鉄鉱業	23	2.2	11,946
三井松島産業	54	4.8	6,691
国際石油開発帝石	431.4	410.9	417,474
日本海洋掘削	2.5	2.7	5,972
石油資源開発	13	12.4	27,887
K&Oエナジーグループ	5.5	5.2	9,484
<b>建設業(3.1%)</b>			
ショーボンドホールディングス	8.6	7.5	39,675
ミライト・ホールディングス	25.2	24	27,048
タマホーム	6.1	5.9	3,799
サンヨーホームズ	1.7	1.6	1,049
ファーストコーポレーション	—	1.7	1,912
インベスターズクラウド	—	1	4,375
ダイセキ環境ソリューション	1.9	2.2	2,853
安藤・間	54.7	56.1	44,992
東急建設	26.7	27.7	26,592
コムシスホールディングス	35.2	30.5	72,010
ミサワホーム	10.2	9.6	9,436
ピーアールホールディングス	3.2	7.7	2,979
高松コンストラクショングループ	6.2	5.9	16,348
東建コーポレーション	3.4	2.9	29,145
ソネット	0.9	1	742
ヤマウラ	4.2	3.8	3,192
大成建設	425	397	373,577
大林組	245.6	233.9	286,527
清水建設	251	239	268,158
飛鳥建設	65.7	76.8	13,209
長谷工コーポレーション	95.6	91	128,765
松井建設	9.1	8.6	7,688
銭高組	12	11	5,016
鹿島建設	384	343	289,149
不動産トラ	59.8	62.7	11,599
大末建設	3.1	2.8	2,665
鉄建建設	51	48	16,224

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
西松建設	95	90	54,630
三井住友建設	313.8	298.9	37,063
大豊建設	32	28	14,504
前田建設工業	50	51	60,639
佐田建設	6.2	5.7	2,490
ナカノフドー建設	6.7	6.1	3,647
奥村組	78	64	47,488
東鉄工業	9.8	9.4	33,229
イチケン	10	7	2,814
浅沼組	26	27	8,775
戸田建設	95	91	64,246
熊谷組	121	122	41,846
青木あすなろ建設	5.4	5.1	4,477
北野建設	18	16	5,088
植木組	11	11	2,871
三井ホーム	11	10	7,370
矢作建設工業	11.1	10.6	9,391
ピーエス三菱	10.1	8.7	4,080
日本ハウスホールディングス	16.7	15.9	8,093
大東建託	30.1	28.2	486,309
新日本建設	9.9	9.3	9,597
N I P P O	19	18	40,104
東亜道路工業	15	15	6,630
前田道路	26	24	53,928
日本道路	24	23	13,110
東亜建設工業	71	6.3	12,669
若築建設	47	45	7,515
東洋建設	25.7	22.5	9,405
五洋建設	90.9	86.5	53,976
大林道路	9.6	8.1	7,605
世紀東急工業	12.8	11.4	6,919
福田組	13	13	13,377
住友林業	56.4	53.7	95,586
日本基礎技術	9.1	8.7	3,071
日成ビルド工業	23	23	14,950
巴コーポレーション	10.8	10	3,510
パナホーム	31	29	35,641
大和ハウス工業	241.9	230.4	835,660
ライト工業	15.7	15	17,850
積水ハウス	273.8	244.2	466,422
日特建設	9	6.7	3,812
北陸電気工事	4	3.8	3,530
ユアテック	13	12	8,964
西部電気工業	7	1.3	2,974

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
四電工	6	6	2,958	
中電工	11.8	8.8	24,860	
関電工	33	31	34,968	
きんでん	49.5	51.9	87,607	
東京エネシス	9	8.1	7,719	
トーエネック	12	11	6,710	
住友電設	6.5	5.4	7,921	
日本電設工業	13.3	12.7	28,752	
協和エクシオ	32.1	30.6	56,977	
新日本空調	6.9	6	9,012	
NDS	13	1.2	3,582	
九電工	15	15.2	59,736	
三機工業	18.2	17.3	20,068	
日揮	82	72.8	121,576	
中外炉工業	25	24	5,136	
ヤマト	7.4	7.1	3,997	
太平電業	12	11	13,519	
高砂熱学工業	24.4	21.5	38,743	
三晃金属工業	9	0.7	2,240	
朝日工業社	10	1.8	5,661	
明星工業	14.8	14.1	9,038	
大気社	10	10.3	30,900	
ダイダン	11	10	12,330	
日比谷総合設備	9.8	8.7	15,425	
東芝プラントシステム	13.3	12.7	20,726	
OSJBホールディングス	16.7	23.9	6,883	
東洋エンジニアリング	44	47	12,220	
千代田化工建設	59	56	35,448	
新興プランテック	16.8	16	12,752	
<b>食料品 (4.8%)</b>				
日本製粉	54	23.2	40,762	
日清製粉グループ本社	89.8	85.5	159,115	
日東富士製粉	6	0.5	1,947	
昭和産業	34	32	18,720	
鳥越製粉	6.5	6.2	5,015	
中部飼料	7.6	8.5	12,410	
フィード・ワン	49.5	47	10,622	
東洋精糖	13	12	1,404	
日本甜菜製糖	42	4	8,916	
三井製糖	32	5.5	18,452	
塩水港精糖	8.9	8.3	2,008	
日新製糖	3.5	3.3	6,200	
森永製菓	74	15.2	99,256	
中村屋	19	1.8	9,090	
江崎グリコ	18.9	19.5	121,875	
名糖産業	3.6	3.4	5,001	
不二家	47	45	11,520	
山崎製パン	60	57.1	132,300	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
第一屋製パン	13	12	1,452	
モロゾフ	13	12	7,152	
亀田製菓	4.6	4.3	25,327	
寿スピリッツ	5.8	7.4	27,676	
カルビー	30.4	31.8	140,874	
森永乳業	74	70	65,520	
六甲バター	3.7	3.5	9,380	
ヤクルト本社	43.9	41.8	329,802	
明治ホールディングス	48.5	46.2	419,496	
雪印メグミルク	19.3	16.8	56,784	
プリマハム	52	49	29,057	
日本ハム	60	55	190,300	
林兼産業	—	2.5	2,120	
丸大食品	42	37	19,351	
S Foods	5.1	4.2	15,750	
伊藤ハム米久ホールディングス	48.9	45	46,440	
サッポロホールディングス	125	25.5	84,787	
アサヒグループホールディングス	153.7	146.3	656,009	
キリンホールディングス	331.9	335.8	786,275	
宝ホールディングス	59.3	56.5	64,410	
オエノンホールディングス	22	20	5,340	
養命酒製造	2.5	2.4	5,116	
コカ・コーラボトラーズジャパン	27.8	49.2	170,232	
コカ・コーライーストジャパン	29	—	—	
サントリー食品インターナショナル	56.1	53.4	286,224	
ダイドーグループホールディングス	4.1	3.6	20,088	
伊藤園	24.3	23.1	105,798	
キーコーヒー	7.2	6.9	15,255	
ユニカフェ	2.2	2.1	2,058	
ジャパンフーズ	1.1	1	1,348	
日清オイリオグループ	43	45	29,610	
不二製油グループ本社	21.9	20.8	55,224	
かどや製油	0.8	0.8	4,464	
J-オイルミルズ	34	3.6	14,580	
キッコーマン	62	54.6	192,738	
味の素	172.2	160.7	384,555	
キュービー	41.7	39.7	116,519	
ハウス食品グループ本社	28	28.9	80,110	
カゴメ	29.4	28	99,540	
焼津水産化学工業	3.9	3.7	4,591	
アリアケジャパン	6.7	6.4	51,008	
ビエトロ	0.8	0.9	1,458	
エバラ食品工業	2	1.9	4,014	
ニチレイ	87	38.4	121,728	
東洋水産	40.3	38.3	165,264	
イートアンド	0.9	0.9	2,066	
大冷	—	0.8	1,459	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	—	0.1	288	

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)
日清食品ホールディングス	34.7	30.5	212,585	
永谷園ホールディングス	8	7	10,003	
一正蒲鉾	2.9	2.7	3,580	
フジッコ	8	7.6	20,064	
ロック・フィールド	8.6	7.5	14,737	
日本たばこ産業	484.2	432.3	1,816,956	
ケンコーマヨネーズ	2.7	4.2	13,314	
わらべや日洋ホールディングス	4.4	4.6	13,869	
なとり	4.1	3.9	7,784	
イフジ産業	—	1.2	945	
北の達人コーポレーション	1.6	3.4	2,890	
ユーグレナ	27.6	26.9	31,957	
ミヨシ油脂	28	27	3,807	
理研ビタミン	2.4	2.3	10,108	
<b>繊維製品 (0.7%)</b>				
片倉工業	9.7	9.2	12,144	
グンゼ	62	55	21,670	
東洋紡	304	289	54,332	
ユニチカ	223	199	15,721	
富士紡ホールディングス	37	3.6	11,502	
倉敷紡績	78	74	19,462	
シキボウ	47	39	5,382	
日本毛織	23.6	20.6	17,468	
トーア紡コーポレーション	3.2	3.1	1,708	
ダイドーリミテッド	8.7	8.3	3,552	
帝国繊維	8	7.6	13,915	
帝人	313	59.6	124,385	
東レ	555	529	487,156	
サカイオーベックス	21	1.7	2,958	
住江織物	23	20	5,160	
日本フェルト	4.2	4.3	2,214	
イチカワ	6	5	1,555	
日東製網	—	0.8	1,444	
芦森工業	23	—	—	
アツギ	59	62	7,812	
ダイニック	14	14	2,688	
セーレン	19.1	18.2	29,192	
ソトー	—	2.7	3,113	
東海染工	11	14	1,876	
小松精練	12.5	10.3	7,652	
ワコールホールディングス	46	43	61,060	
ホギメディカル	4.8	4.6	34,040	
レナウン	20.7	19.7	2,718	
クラウディア	3.5	2.4	1,384	
T S I ホールディングス	34.2	30.1	21,551	
三陽商会	45	43	6,880	
オンワードホールディングス	51	47	37,318	
ルック	19	18	4,212	

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)
ゴールドウイン	3.4	3.2	19,712	
デサント	17.5	16.7	22,595	
キング	3.8	3.6	1,436	
ヤマトインターナショナル	4.7	4.9	2,082	
<b>パルプ・紙 (0.3%)</b>				
特種東海製紙	44	4.2	16,989	
王子ホールディングス	314	285	158,175	
日本製紙	39.6	32.7	71,384	
三菱製紙	117	10.4	7,675	
北越紀州製紙	47.5	40.7	35,490	
中越パルプ工業	30	29	7,076	
巴川製紙所	12	11	2,750	
大王製紙	33.9	29.1	40,187	
阿波製紙	—	1.8	1,121	
レンゴー	68	70.3	43,726	
トーモク	24	23	8,579	
ザ・バック	5.4	5.2	17,342	
<b>化学 (6.9%)</b>				
クラレ	120.8	122.7	244,418	
旭化成	477	455	483,210	
共和レザー	5	4.3	4,089	
昭和電工	510	48.5	99,425	
住友化学	564	537	313,608	
日本化成	14	—	—	
住友精化	16	3	14,730	
日産化学工業	46	39.9	155,211	
ラサ工業	29	27	3,834	
クレハ	58	5.5	30,965	
多木化学	5	5	4,615	
テイカ	13	11	10,725	
石原産業	137	13.1	13,846	
片倉コープアグリ	9	10	2,790	
日東エフシー	4.5	4.3	3,844	
日本曹達	49	44	24,904	
東ソー	207	211	198,129	
トクヤマ	127	113	54,127	
セントラル硝子	83	74	33,300	
東亜合成	47.9	45.6	56,954	
大阪ソーダ	33	31	15,655	
関東電化工業	18	14.9	13,618	
デンカ	159	151	85,013	
信越化学工業	137.3	130.8	1,296,489	
日本カーバイド工業	26	25	3,925	
堺化学工業	31	27	11,097	
エア・ウォーター	63	60.1	119,418	
大陽日酸	59	56.2	63,168	
日本化学工業	28	27	5,805	
日本パーカライジング	39.1	37.3	60,463	

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)
高圧ガス工業	11	10.8	8,218	
チタン工業	9	9	1,728	
四国化成工業	11	11	14,729	
戸田工業	15	15	4,005	
ステラ ケミファ	3.9	3.5	9,929	
保土谷化学工業	23	2.5	10,087	
日本触媒	11.1	11.5	76,705	
大日精化工業	30	30	23,940	
カネカ	103	98	82,320	
三菱瓦斯化学	132	67.9	148,565	
三井化学	325	331	178,409	
J S R	71.8	73.3	136,484	
東京応化工業	15.4	13.6	49,640	
大阪有機化学工業	5.5	4.7	6,180	
三菱ケミカルホールディングス	512.8	491.2	403,815	
KHネオケム	—	11.9	22,859	
日本合成化学工業	18	—	—	
ダイセル	107.7	98.3	126,905	
住友ベークライト	72	64	48,128	
積水化学工業	173.8	165.5	320,904	
日本ゼオン	66	61	67,283	
アイカ工業	23	23.4	75,933	
宇部興産	410	367	96,888	
積水樹脂	11.8	11.2	22,926	
タキロンシーアイ	18	15	8,385	
旭有機材	25	24	5,784	
日立化成	37.8	40.5	118,179	
ニチバン	8	7	6,594	
リケンテクノス	16.5	15.7	8,744	
大倉工業	18	17	9,775	
積水化成成品工業	20	10.2	8,588	
群栄化学工業	20	1.8	6,615	
タイガースポリマー	3.8	3.6	2,689	
ミライアル	2.8	2.7	2,430	
ダイキアクシス	1.5	1.2	2,498	
ダイキョーニシカワ	9.9	12.8	18,291	
日本化薬	50	47	72,521	
カーリットホールディングス	7.2	6.8	3,814	
日本精化	6.3	6	5,856	
扶桑化学工業	4.9	5.2	18,304	
A D E K A	37.6	31.4	50,114	
日油	58	56	79,800	
ハリマ化成グループ	6.6	6.2	4,854	
花王	205.9	181.9	1,256,565	
第一工業製薬	17	16	7,264	
日華化学	—	2.3	2,737	
ニイタカ	1.1	1.1	1,908	
三洋化成工業	24	4.6	23,690	

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)
有機合成薬品工業	—	4.9	1,347	
大日本塗料	44	42	11,424	
日本ペイントホールディングス	59.1	56.3	245,468	
関西ペイント	86.6	76.6	179,550	
神東塗料	6	5	1,045	
中国塗料	22	20.9	16,866	
日本特殊塗料	5.4	5.1	8,731	
藤倉化成	10.4	9.9	6,336	
太陽ホールディングス	5.6	5.9	28,438	
D I C	302	28.8	106,848	
サカタインクス	15.6	14.9	25,434	
東洋インキSCホールディングス	76	72	40,032	
T & K T O K A	5.6	5.3	6,020	
富士フイルムホールディングス	175.2	144.6	585,340	
資生堂	145.3	138.3	511,848	
ライオン	88	90.5	205,163	
高砂香料工業	5	4.8	19,008	
マンダム	7.1	7.3	41,683	
ミルボン	4.5	3.9	22,659	
ファンケル	17.8	15.5	32,271	
コーセー	12.4	11.8	138,178	
コタ	2.6	3	3,561	
シーズ・ホールディングス	9.8	9.5	33,060	
シーボン	0.9	0.8	1,980	
ポーラ・オルビスホールディングス	7.8	29.7	89,694	
ノエビアホールディングス	4.8	4.6	23,460	
アジュバンコスメジャパン	1.5	1.4	1,345	
エステー	5.3	5	11,560	
アグロ カネショウ	3	2.8	4,032	
コニシ	12	11.4	17,442	
長谷川香料	9.7	9.2	20,249	
星光PMC	4.2	4	4,856	
小林製薬	11.6	19.5	127,140	
荒川化学工業	6.5	6.2	11,904	
メック	6	5.7	7,147	
日本高純度化学	2.2	2.1	4,825	
タカラバイオ	16.4	20.8	30,950	
J C U	2.3	4.6	19,918	
新田ゼラチン	5.1	4.4	3,198	
O A T アグリオ	0.9	0.9	1,444	
デクセリアルズ	22.9	19.2	18,604	
アース製薬	5.5	5.2	30,524	
イハラケミカル工業	11.8	—	—	
北興化学工業	8	7	3,297	
大成ラミック	2.1	2.3	6,594	
クミアイ化学工業	15.8	30.9	19,745	
日本農薬	17.5	18.2	11,593	
アキレス	63	6	11,154	

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)
有沢製作所	11.3	12.4	10,081			
日東電工	59.1	52.6	465,615			
レック	2.4	4.5	13,302			
きもと	12.7	13.2	3,273			
藤森工業	6.6	5.4	17,928			
前澤化成工業	5.4	4.8	5,803			
J S P	5	3.4	9,224			
エフピコ	6.8	6.5	37,635			
天馬	5.9	4.8	9,604			
信越ポリマー	15	14.3	11,254			
東リ	20	17.4	6,107			
ニフコ	14.6	12.8	72,832			
日本バルカー工業	30	5.7	13,030			
ユニ・チャーム	155	147.6	435,567			
<b>医薬品 (4.7%)</b>						
協和発酵キリン	91.6	87.2	174,661			
武田薬品工業	304.9	273.4	1,583,259			
アステラス製薬	857.2	744.8	1,045,326			
大日本住友製薬	54.2	51.6	86,326			
塩野義製薬	111.6	92.5	558,977			
田辺三菱製薬	89.2	84.9	209,787			
わかもと製薬	9	8	2,208			
あすか製薬	9.7	7.9	13,674			
日本新薬	17.5	16.7	108,049			
ビオフェルミン製薬	1.2	1.2	3,624			
中外製薬	76.2	72.6	305,283			
科研製薬	13.2	13.6	88,672			
エーザイ	94.2	89.7	528,422			
ロート製薬	37.5	35.7	82,359			
小野薬品工業	173.8	165.6	388,332			
久光製薬	23.8	20.6	116,390			
有機合成薬品工業	5	—	—			
持田製薬	5.3	4.9	39,053			
参天製薬	141	131.7	198,603			
扶桑薬品工業	26	2.5	7,132			
日本ケミファ	11	1	5,250			
ツムラ	24.1	24.5	98,000			
日医工	17.9	17	27,931			
キッセイ薬品工業	13.6	12.9	36,494			
生化学工業	14.6	13.5	23,652			
栄研化学	6.4	6.1	19,703			
日水製薬	3.1	2.9	4,054			
鳥居薬品	5.2	5	13,640			
J C R ファーマ	5.9	5.6	14,901			
東和薬品	3.5	3.3	17,490			
富士製薬工業	2.5	2.4	9,624			
沢井製薬	13	12.4	76,384			
ゼリア新薬工業	15.7	14.9	25,777			

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)
第一三共	257.4	214.5	519,626			
キョーリン製薬ホールディングス	20.4	17.8	41,029			
大幸薬品	3.8	3.7	6,952			
ダイト	4.3	4.3	9,902			
大塚ホールディングス	164.6	156.7	788,984			
大正製薬ホールディングス	18.4	15.6	136,188			
ペプチドリーム	12.7	13.6	82,960			
<b>石油・石炭製品 (0.5%)</b>						
日本コークス工業	61.8	58.9	5,772			
昭和シェル石油	77	65.2	67,351			
ニチレキ	9.3	8.9	10,475			
東燃ゼネラル石油	115	—	—			
ユシロ化学工業	4.1	3.9	5,709			
ビービー・カストロール	3.1	3	5,790			
富士石油	17.7	16.9	5,779			
MORESCO	2.4	2.5	4,917			
出光興産	39.9	34.6	111,066			
J X T Gホールディングス	906.1	1,111.6	546,240			
コスモエネルギーホールディングス	23.1	22	37,730			
<b>ゴム製品 (1.0%)</b>						
横浜ゴム	46.2	44	96,668			
東洋ゴム工業	34.6	38.5	84,238			
ブリヂストン	258.3	246	1,159,890			
住友ゴム工業	71.6	68.2	130,125			
藤倉ゴム工業	6.4	6.1	4,001			
オカモト	24	22	27,478			
フコク	2.8	3	2,841			
ニッタ	8.2	6.5	21,092			
住友理工	16.5	13.5	15,363			
三ツ星ベルト	19	17	19,618			
バンドー化学	28	13.3	13,699			
<b>ガラス・土石製品 (1.0%)</b>						
日東紡績	51	59	32,214			
旭硝子	404	359	322,382			
日本板硝子	369	33.2	28,884			
石塚硝子	11	10	2,110			
日本山村硝子	32	29	5,307			
日本電気硝子	158	151	116,874			
オハラ	3.2	3	3,306			
住友大阪セメント	152	135	66,690			
太平洋セメント	478	440	157,080			
デイ・シイ	8.2	—	—			
日本ヒューム	7.6	7	4,704			
日本コンクリート工業	16.2	16.5	6,220			
三谷セキサン	3.8	3.7	9,886			
アジアパイルホールディングス	9.7	9.4	5,978			
東海カーボン	67	68.2	37,305			
日本カーボン	38	37	11,174			

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
東洋炭素	4.3	4.1	7,736	
ノリタケカンパニーリミテド	43	4.1	13,653	
TOTO	56.2	53.6	223,244	
日本碍子	97	92	205,068	
日本特殊陶業	66	62.8	141,676	
MARUWA	2.8	2.7	11,475	
品川リフラクトリーズ	20	19	5,320	
黒崎播磨	18	16	6,912	
ヨータイ	5	4	1,520	
イソライト工業	5.8	4.1	1,590	
東京窯業	11	9.2	1,812	
ニッカトー	3.2	2.5	1,277	
フジミンコンポレーテッド	6.7	6.3	13,230	
ニチアス	39	38	48,602	
ニチハ	10.2	9.7	38,897	
<b>鉄鋼(1.2%)</b>				
新日鐵住金	345.1	328.6	784,368	
神戸製鋼所	1,406	126	128,646	
中山製鋼所	—	8.2	5,379	
合同製鐵	44	4.1	7,363	
ジェイ エフ イー ホールディングス	209.2	199.2	364,934	
日新製鋼	35.2	23.7	29,459	
東京製鐵	42.3	36.9	32,804	
共英製鋼	8.3	7.8	13,275	
大和工業	16.9	14.6	39,317	
東京鐵鋼	16	15	5,925	
大阪製鐵	4.9	4.6	9,517	
淀川製鋼所	11.5	10.1	30,502	
東洋鋼鈑	18.5	17.5	6,842	
丸一鋼管	25.6	24.4	79,422	
モリ工業	14	2.3	5,365	
大同特殊鋼	129	122	71,614	
日本高周波鋼業	38	25	2,025	
日本冶金工業	60.7	60	13,500	
山陽特殊製鋼	46	43	24,553	
愛知製鋼	45	4.3	18,210	
日立金属	87.6	74.2	108,406	
日本金属	20	1.7	2,726	
大太平洋金属	54	47	13,583	
新日本電工	44.2	41	15,375	
栗本鐵工所	38	3.5	6,898	
虹技	14	10	2,100	
日本鑄鉄管	10	7	1,183	
三菱製鋼	55	51	12,393	
日亜鋼業	12.7	10.1	2,656	
日本精線	6	5	3,480	
シンニッタン	7.1	6	4,164	
新家工業	18	16	3,104	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
<b>非鉄金属(0.9%)</b>				
大紀アルミニウム工業所	12	12	7,308	
日本軽金属ホールディングス	173.3	187.6	47,087	
三井金属鉱業	195	198	82,170	
東邦亜鉛	40	41	17,261	
三菱マテリアル	478	45.5	141,277	
住友金属鉱山	211	189	257,512	
DOWAホールディングス	99	80	63,840	
古河機械金属	119	114	22,458	
大阪チタニウムテクノロジーズ	7.6	8	13,160	
東邦チタニウム	12.9	12.4	9,262	
UACJ	107	103	29,973	
古河電気工業	241	24.4	116,998	
住友電気工業	306.3	274.6	488,925	
フジクラ	106	95.9	90,625	
昭和電線ホールディングス	91	87	7,482	
東京特殊電線	1.3	1.2	2,180	
タツタ電線	16.6	14.1	7,740	
沖電線	11	9	1,944	
カナレ電気	1.3	1	2,327	
平河ヒューテック	3.9	3.6	5,112	
リョービ	47	44	20,108	
アーレスティ	8.9	8.4	9,198	
アサヒホールディングス	11.5	11	20,900	
<b>金属製品(0.7%)</b>				
稲葉製作所	4.1	3.9	5,432	
宮地エンジニアリンググループ	28	21	5,208	
トーカロ	5.5	4.8	16,872	
アルファC o	3.2	2.4	5,776	
SUMCO	60.9	76.1	135,458	
川田テクノロジーズ	1.7	1.4	9,058	
RS Technologies	—	0.4	3,480	
東洋罐詰グループホールディングス	54.4	51.8	91,012	
ホッカンホールディングス	22	19	8,474	
コロナ	4	3.8	4,347	
横河ブリッジホールディングス	15	12.8	19,443	
駒井ハルテック	17	1.4	3,222	
高田機工	8	6	1,650	
三和ホールディングス	76.8	72.3	86,832	
文化シャッター	21.3	20.3	17,478	
三協立山	10.5	9.6	15,628	
アルインコ	5.8	5	5,340	
東洋シャッター	2.9	1.8	1,132	
LIXILグループ	106.6	101.5	269,482	
日本ファイルコン	7	5.3	3,164	
ノーリツ	15	14.3	30,401	
長府製作所	8.2	7.8	20,974	
リンナイ	14.2	12.4	123,008	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	株 数 (千株)
ダイニチ工業	3.9	3.7	2,778	
日東精工	12	10.4	4,680	
三洋工業	12	9	1,917	
岡部	16.1	15.1	15,145	
ジーテクト	8.3	7.6	15,336	
東ブレ	14.7	14	42,980	
高周波熱錬	14.3	13.3	13,499	
東京製綱	—	4.9	8,530	
サンコール	4.5	3.9	2,441	
モリテック スチール	4.8	3.7	1,080	
パイオラックス	3.9	11	30,382	
エイチワン	—	5.5	6,886	
日本発條	72	68.6	80,262	
中央発條	11	8	2,744	
アドバネクス	2.1	1.3	1,957	
立川ブラインド工業	3.2	3	3,066	
三益半導体工業	5.7	6.1	11,108	
<b>機械 (5.0%)</b>				
日本ドライケミカル	1	0.9	2,149	
日本製鋼所	127	24.1	39,186	
三浦工業	34.1	29.8	64,725	
タクマ	28	23.3	23,789	
ツガミ	22	20	15,860	
オークマ	50	47	47,000	
東芝機械	42	43	21,199	
アマダホールディングス	111.6	98.1	128,216	
アイダエンジニアリング	20.1	20.7	20,244	
滝澤鉄工所	24	21	3,633	
富士機械製造	25	22.2	36,252	
牧野フライス製作所	38	36	32,832	
オーエスジー	34.9	33.2	73,040	
ダイジェット工業	13	13	2,366	
旭ダイヤモンド工業	20.7	20.5	16,933	
DMG 森精機	42.7	42.2	73,090	
ソディック	19.4	18.5	21,312	
ディスコ	9.7	8.5	159,375	
日東工器	4.5	4.2	10,659	
パンチ工業	3	2.6	2,914	
豊和工業	4.6	5.2	4,186	
OKK	34	32	4,000	
東洋機械金属	5.6	4.9	3,797	
島精機製作所	10.8	9.5	48,830	
N Cホールディングス	2.5	2.4	2,169	
フリュー	1.5	4.3	5,564	
ヤマシンフィルタ	1.5	1.9	4,406	
日阪製作所	9.7	9.9	9,335	
やまびこ	14	13.3	16,186	
ベガサスミシン製造	7.9	7	5,068	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	株 数 (千株)
ナブテスコ	39.8	37.9	123,364	
三井海洋開発	9	7.3	17,571	
レオン自動機	6.4	6.1	5,837	
SMC	22.9	21.8	764,526	
新川	6.8	6.1	3,958	
ホソカワミクロン	13	2.6	12,714	
ユニオンツール	3.3	3.1	10,152	
オイレス工業	9.9	8.9	17,168	
日精エー・エス・ビー機械	2.8	2.3	7,475	
サトーホールディングス	10.3	9.1	22,859	
日本エアージェット	2.7	2.4	2,052	
日精樹脂工業	6	6.1	6,374	
オカダアイヨン	1.5	2	2,802	
ワイエイシイホールディングス	3.1	2.7	4,220	
小松製作所	375	336.1	890,665	
住友重機械工業	223	213	152,508	
日立建機	34.2	32.6	84,303	
日工	12	2.2	4,681	
巴工業	3.1	3	5,334	
井関農機	79	75	17,250	
T OWA	7.4	5.9	9,646	
丸山製作所	18	1.8	3,247	
北川鉄工所	36	3.3	7,613	
ローツェ	—	3.4	9,200	
タカキタ	2.5	2.4	1,276	
クボタ	367.3	348.7	613,188	
荏原実業	2.3	2	2,936	
三菱化工機	27	24	5,952	
月島機械	14.5	13.8	16,477	
帝国電機製作所	5.6	5.3	5,904	
新東工業	17.4	16.5	18,298	
澁谷工業	6.4	6.1	20,740	
アイチ コーポレーション	10.9	10.3	7,828	
小森コーポレーション	18.6	17.5	25,830	
鶴見製作所	5.7	5.4	9,487	
住友精密工業	12	11	3,751	
酒井重工業	15	16	5,376	
荏原製作所	169	33	102,630	
石井鐵工所	14	1.1	1,818	
西島製作所	8.2	7.3	7,796	
北越工業	8.2	7.8	7,199	
ダイキン工業	106.4	95	1,036,925	
オルガノ	13	14	7,658	
トーヨーカネツ	41	35	10,815	
栗田工業	46	41.2	120,015	
椿本チエイン	43	41	39,073	
大同工業	17	16	4,704	
木村化工機	7.7	7.9	2,891	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
アネスト岩田	12.3	12.6	12,927	
ダイフク	39.3	34.7	115,030	
サムコ	1.8	1.9	1,886	
加藤製作所	18	3.9	12,616	
油研工業	16	14	3,276	
タダノ	35.3	36.4	47,793	
フジテック	21.3	20.3	26,126	
CKD	20.3	20.9	35,404	
キトー	9.2	8.8	10,076	
平和	22.7	21.6	53,049	
理想科学工業	8.1	6.9	15,490	
SANKYO	20.3	19.4	72,653	
日本金銭機械	6.7	6.4	7,436	
マースエンジニアリング	4.1	3.9	9,379	
福島工業	4.5	4.3	18,404	
オーイズミ	3.1	2.9	1,673	
ダイコク電機	3	2.9	5,063	
竹内製作所	14.5	12.7	23,393	
アマノ	22.6	21.5	54,158	
JUKI	10.8	11	16,236	
サンデンホールディングス	45	42	12,936	
蛇の目マシン工業	7.1	6.8	6,215	
マックス	11	11	17,754	
グローリー	24.9	22.3	82,621	
新晃工業	5.1	6.5	12,161	
大和冷機工業	11.7	11.2	13,641	
セガサミーホールディングス	78.5	69	97,497	
日本ピストンリング	3	2.7	6,091	
リケン	34	3.2	15,264	
T P R	9	7.8	29,055	
ツバキ・ナカシマ	9	7.8	15,623	
ホシザキ	16	20.3	197,519	
大豊工業	5.9	5.7	8,008	
日本精工	150.1	143	191,477	
NTN	181	161	81,627	
ジェイテクト	77.9	74.2	123,914	
不二越	68	70	39,410	
日本トムソン	25	22.1	13,392	
THK	48.6	49.2	148,092	
ユーシン精機	2.8	3.1	8,168	
前澤給装工業	3	2.6	4,108	
イーグル工業	9	7.5	13,365	
前澤工業	5.3	4.6	1,495	
日本ビラー工業	7.4	7	11,172	
キッツ	35.1	33.4	30,293	
日立工機	19.6	—	—	
マキタ	47.7	90.8	378,182	
日立造船	58	55.2	29,587	

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)
三菱重工業	1,302	1,167	512,079	
I H I	564	536	217,080	
スター精密	—	12.2	20,008	
<b>電気機器(13.1%)</b>				
日清紡ホールディングス	40.6	38.6	41,263	
イビデン	44.8	48.7	95,208	
コニカミノルタ	182.6	163	144,581	
ブラザー工業	94.5	90	221,400	
ミネベアミツミ	117.8	126.7	222,611	
日立製作所	1,865	1,671	1,116,060	
東芝	1,539	1,545	405,253	
三菱電機	780	742.5	1,150,503	
富士電機	220	210	124,530	
東洋電機製造	14	2.9	4,790	
安川電機	90.8	80.7	177,540	
シンフォニアテクノロジー	47	45	15,390	
明電舎	67	64	24,512	
オリジン電気	11	10	3,010	
山洋電気	19	18	17,838	
デンヨー	6.7	6.4	11,475	
東芝テック	52	44	26,576	
芝浦メカトロニクス	12	11	3,894	
マブチモーター	20.9	19.7	126,474	
日本電産	88	90.2	979,121	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	0.9	2.2	3,278	
東光高岳	4.1	3.5	5,796	
ダブル・スコープ	2.9	6.7	11,644	
ダイヘン	43	38	31,616	
田淵電機	8.4	10.6	3,423	
ヤーマン	0.9	0.9	5,148	
JVCケンウッド	53.8	51.2	15,001	
ミマキエンジニアリング	6.6	6.3	3,861	
第一精工	3.1	3.3	6,477	
日新電機	17.1	14	17,514	
大崎電気工業	13	14	11,718	
オムロン	82.5	74	339,290	
日東工業	11.7	10.2	18,176	
I D E C	9.5	9.1	14,232	
不二電機工業	0.7	0.8	1,082	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	141	134	67,536	
サクサホールディングス	18	18	3,744	
メルコホールディングス	4.1	3.9	12,343	
テクノメディカ	1.7	1.6	3,088	
日本電気	1,005	957	275,616	
富士通	705	671	541,765	
沖電気工業	317	30.2	50,222	
岩崎通信機	34	31	2,573	
電気興業	19	20	10,800	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
サンケン電気	40	41	18,696	
ナカヨ	7	7	2,779	
アイホン	4.1	3.9	7,421	
ルネサスエレクトロニクス	37.9	36.1	32,598	
セイコーエプソン	108.8	103.6	243,770	
ワコム	57.6	54.1	19,313	
アルバック	13.4	11.7	71,136	
アクセル	3.3	3	2,394	
E I Z O	7.2	6.9	29,566	
ジャパンディスプレイ	136.7	130.2	26,430	
日本信号	20.2	19.2	20,467	
京三製作所	17	16	8,880	
能美防災	8.3	7.9	12,023	
ホーチキ	5.3	5.1	8,001	
エレコム	6.3	6	14,274	
日本無線	21	4.3	5,839	
パナソニック	835.1	799.4	1,099,974	
シャープ	615	—	—	
アンリツ	43.9	50.7	47,455	
富士通ゼネラル	22	23.6	60,510	
日立国際電気	16.7	18.3	47,433	
ソニー	515.7	491.7	1,985,484	
TDK	44.1	39.2	261,856	
帝国通信工業	17	16	3,376	
ミツミ電機	27.9	—	—	
タムラ製作所	28	27	13,527	
アルプス電気	63	64.3	197,722	
池上通信機	23	22	3,300	
パイオニア	118.3	104.6	20,920	
日本電波工業	6.6	6.8	5,977	
鈴木	2.9	2.7	1,871	
日本トリム	2	1.7	7,012	
ローランド ディー、ジー、	3.6	3.6	9,410	
フォスター電機	9.2	8.1	13,446	
クラリオン	39	37	14,393	
SMK	22	18	6,930	
ヨコオ	5.3	5	6,955	
ホシデン	22.2	21.1	25,552	
ヒロセ電機	11.8	11.2	165,312	
日本航空電子工業	21	20	30,080	
TOA	8.6	8.2	8,200	
日立マクセル	12.1	10.4	22,380	
古野電気	8.7	9	6,075	
ユニデンホールディングス	23	20	5,100	
アルパイン	17.4	16.6	25,945	
スミダコーポレーション	6	6.3	10,508	
アイコム	4	3.9	10,518	
リオン	2.8	2.7	4,257	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
本多通信工業	2	3	4,173	
船井電機	7.4	7.8	6,942	
横河電機	73.2	75.5	144,809	
新電元工業	26	27	15,120	
アズビル	23.9	21.1	83,872	
東亜ディーケーケー	4.1	3.5	2,198	
日本光電工業	30.6	29.1	71,411	
チノー	2.6	2.5	3,100	
共和電業	8.9	7.9	3,468	
日本電子材料	2.9	2.8	1,934	
堀場製作所	13.5	13.8	92,460	
アドバンテスト	49.8	47.4	91,339	
小野測器	3.6	3.4	2,621	
エスペック	7.6	6.2	10,285	
パナソニック デバイスSUNX	6.5	—	—	
キーエンス	16.6	31.5	1,540,980	
日置電機	3.8	3.7	8,143	
シスメックス	56.7	54.1	347,322	
日本マイクロニクス	13.7	12.1	13,273	
メガチップス	7.6	6.5	16,536	
OBARA GROUP	4.7	4.1	24,026	
澤藤電機	4	4	2,212	
コーセル	10.2	9.7	13,162	
イリソ電子工業	—	2.9	23,925	
新日本無線	5.3	5.9	3,905	
オプテックスグループ	5.4	5.3	19,769	
千代田インテグレ	3.9	3.7	8,480	
アイ・オー・データ機器	2.3	2.9	4,016	
レーザーテック	8.6	15.3	23,975	
スタンレー電気	52.3	49.7	165,749	
岩崎電気	25	26	4,498	
ウシオ電機	44.4	42.3	60,362	
岡谷電機産業	4	3.8	1,482	
ヘリオス テクノ ホールディング	6.3	6.5	5,258	
日本セラミック	4.2	5.7	14,899	
遠藤照明	3.7	3.5	3,920	
日本デジタル研究所	6.2	—	—	
古河電池	5	5	3,885	
双信電機	3.7	3.5	1,053	
山一電機	6.4	6.6	12,401	
図研	5.3	4.5	7,195	
日本電子	29	25	13,775	
カシオ計算機	73.3	56	98,392	
ファナック	74.8	70.6	1,537,315	
日本シイエムケイ	15.8	15.1	13,242	
エンブラス	3.7	3.2	10,592	
大真空	13	2.6	3,920	
ローム	36	33.7	298,582	

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)
浜松ホトニクス	57	50.7	179,731	
三井ハイテック	10.6	9.2	11,067	
新光電気工業	27.7	26.3	22,933	
京セラ	120	114.3	730,719	
太陽誘電	35.6	33.9	53,223	
村田製作所	77.1	73	1,133,690	
ユーシン	9.7	9.7	7,003	
双葉電子工業	12.3	11.4	21,774	
北陸電気工業	30	28	3,892	
ニチコン	23.1	22	24,024	
日本ケミコン	59	60	23,040	
KOA	10.1	9.6	18,969	
市光工業	18	15	9,600	
小糸製作所	43.8	41.7	247,281	
ミツバ	12.4	12.8	24,076	
スター精密	13.9	—	—	
SCREENホールディングス	75	14.3	112,970	
キャノン電子	6.7	6.4	13,638	
キャノン	393.5	374.8	1,426,863	
リコー	236.7	209.3	197,369	
MUTOHホールディングス	9	10	2,450	
東京エレクトロン	60	46.4	733,816	
<b>輸送用機器 (8.6%)</b>				
トヨタ紡織	25.7	24.4	52,777	
芦森工業	—	17	3,417	
鬼怒川ゴム工業	17	—	—	
ユニプレス	15.2	13.4	34,652	
豊田自動織機	66.6	63.4	358,210	
モリタホールディングス	12.8	12.2	20,276	
三櫻工業	9.8	8.9	6,959	
デンソー	180.6	171.6	814,585	
東海理化電機製作所	21.4	18.3	38,045	
三井造船	283	259	40,145	
川崎重工業	569	545	175,490	
名村造船所	22.4	20.8	12,708	
サノヤスホールディングス	11.2	11.9	3,034	
日本車輛製造	30	—	—	
ニチユ三菱フォークリフト	8.4	10.4	7,134	
近畿車輛	11	1	2,538	
日産自動車	1,020	821	881,754	
いすゞ自動車	211.8	201.7	274,816	
トヨタ自動車	909	846.3	5,052,411	
日野自動車	104.3	99.4	133,693	
三菱自動車工業	288.3	256.4	183,069	
エフテック	4.2	4.3	5,736	
レシップホールディングス	2.4	2.3	2,056	
GMB	1.6	1.5	1,966	
ファルテック	1.6	1.2	1,514	

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)
武蔵精密工業	7.8	8.1	22,777	
日産車体	35.7	30.6	34,822	
新明和工業	32	29	25,636	
極東開発工業	14.5	14.4	25,588	
日信工業	16.3	15.6	27,424	
トピー工業	62	5.7	15,880	
ティラド	28	27	9,531	
曙ブレーキ工業	37	32.4	11,469	
タチエス	11.6	11.8	22,868	
NOK	35.5	33.7	81,048	
フタバ産業	23.4	22.2	18,981	
KYB	83	78	40,950	
大同メタル工業	10.3	8.7	8,439	
プレス工業	38.9	37	18,648	
ミクニ	10.7	9.5	4,398	
カルソニックカンセイ	56	—	—	
太平洋工業	16.3	15.7	23,204	
ケーヒン	16.8	16	25,168	
河西工業	9.3	9.5	13,062	
アイシン精機	74.9	63.7	358,631	
富士機工	8.5	6.9	5,085	
マツダ	231.4	220.8	334,291	
ダイハツ工業	87.2	—	—	
今仙電機製作所	6.7	6.4	7,526	
本田技研工業	657.7	626.4	1,919,289	
スズキ	133.2	138	716,634	
SUBARU	231	216.1	814,048	
安永	3.2	4.1	5,207	
ヤマハ発動機	103.2	98.4	274,929	
ショーワ	19	18.6	20,125	
TBK	9.4	9	4,581	
エクセディ	9.9	9.5	29,022	
豊田合成	26.6	22.5	60,435	
愛三工業	13	12.2	10,894	
盟和産業	1.3	1.1	1,322	
ヨロズ	6.8	6.5	10,998	
エフ・シー・シー	12	11.4	24,407	
シマノ	29.5	28.1	490,345	
テイ・エス テック	17	16.2	51,597	
ジャムコ	4.4	4.3	11,657	
<b>精密機器 (1.6%)</b>				
テルモ	112	106.7	475,348	
クリエートメディック	2.4	2.3	2,281	
日機装	26.5	24.1	25,811	
島津製作所	94	89.6	192,460	
JMS	14	13	4,095	
長野計器	4.6	5.5	3,850	
ブイ・テクノロジー	1.7	1.4	31,010	

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)
東京計器	23	24	6,024			
愛知時計電機	10	0.9	3,541			
インターアクション	—	2.6	2,082			
オーバル	7.3	6.9	1,780			
東京精密	14.1	13.5	50,827			
マニー	9.7	8.5	26,520			
ニコン	136.5	121.3	207,544			
トプコン	24.6	35.1	71,533			
オリンパス	108.9	111.1	452,177			
理研計器	5.9	6.2	11,662			
タムロン	5.9	6.2	12,623			
HOYA	165.3	143.2	780,440			
シード	—	0.9	2,124			
ノーリツ鋼機	6.6	7.1	6,390			
エー・アンド・デイ	6.7	6.4	2,841			
シチズン時計	90	76.2	56,464			
リズム時計工業	32	28	6,188			
大研医器	5.8	6.2	4,817			
メニコン	4.9	4.8	16,392			
松風	3.6	3.7	4,858			
セイコーホールディングス	47	49	22,932			
ニプロ	54.5	48.2	72,733			
<b>その他製品(2.1%)</b>						
スノーピーク	0.8	1.1	3,795			
パラマウントベッドホールディングス	7.7	6.7	31,758			
トランザクション	1.5	3.1	3,605			
SHO-B I	2.4	2.3	1,009			
ニホンフラッシュ	2.8	3.2	4,694			
前田工織	8	7	10,290			
永大産業	10	9	4,734			
アートネイチャー	7.8	7.4	5,461			
ダンロップスポーツ	4.6	4.4	4,721			
バンダイナムコホールディングス	75.6	76.8	303,360			
アイフィスジャパン	1.6	1.6	1,067			
共立印刷	12.1	11.6	3,955			
SHOE I	3.5	3.1	8,298			
フランスベッドホールディングス	10.2	8.7	8,534			
パイロットコーポレーション	12.7	12.1	52,272			
萩原工業	2	1.9	4,993			
トッパン・フォームズ	13	12.4	14,148			
フジシールインターナショナル	8.9	15.6	43,243			
タカラトミー	24	27.1	38,238			
廣済堂	6.8	7	2,548			
A s e m e エステール	2	1.9	1,352			
アーク	30.7	29.3	3,281			
タカノ	3.2	3.1	3,484			
プロネクサス	6.8	6.5	8,086			
ホクシン	5.8	4.9	833			

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)
ウッドワン	13	12	3,552			
大建工業	29	4.9	11,485			
凸版印刷	206	197	241,522			
大日本印刷	216	201	249,240			
図書印刷	14	9	4,653			
共同印刷	25	21	8,001			
日本写真印刷	12.3	12.1	37,328			
光村印刷	7	6	1,536			
宝印刷	3.6	3.6	5,965			
アシックス	68.1	69.2	129,196			
ツツミ	3.6	2.6	5,335			
小松ウオール工業	2.5	2.4	4,929			
ヤマハ	53.7	46.9	169,074			
河合楽器製作所	2.7	2.7	6,204			
クリナップ	8.6	8.2	6,609			
ピジョン	41.4	42.1	162,085			
兼松サステック	8	7	1,463			
キングジム	6.1	5.8	5,341			
リンテック	17.4	16.5	43,180			
T A S A K I	1.4	—	—			
イトーキ	15.4	14.7	10,980			
任天堂	45	42.9	1,456,455			
三菱鉛筆	5.5	5.7	37,050			
タカラスタンダード	30	14.4	26,611			
コクヨ	38	36.2	53,720			
ナカバヤシ	15	12	3,372			
グローブライド	3.5	3.4	6,602			
岡村製作所	25.5	24.3	24,154			
美津濃	39	37	24,568			
アデランス	12.7	—	—			
<b>電気・ガス業(1.9%)</b>						
東京電力ホールディングス	620	590.5	272,811			
中部電力	223.6	229.4	345,017			
関西電力	298.3	284	443,182			
中国電力	101	96.2	123,424			
北陸電力	71.6	68.2	75,565			
東北電力	182.6	173.9	285,543			
四国電力	65.8	62.7	89,410			
九州電力	161.4	153.7	212,567			
北海道電力	68.4	65.1	55,920			
沖縄電力	11.65	11.22	30,866			
電源開発	62.3	55.4	165,369			
エフオン	3	3.4	3,539			
イーレックス	2.2	8.7	9,161			
東京瓦斯	816	747	433,484			
大阪瓦斯	757	675	289,102			
東邦瓦斯	184	174	151,380			
北海道瓦斯	18	17	4,607			

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
広島ガス	12.7	14.4	5,054	
西部瓦斯	82	78	20,748	
静岡ガス	20.7	21.4	16,520	
メタウォーター	4.7	3.9	11,610	
<b>陸運業(4.3%)</b>				
SBSホールディングス	7.2	6.9	5,540	
東武鉄道	391	372	220,968	
相鉄ホールディングス	125	111	59,052	
東京急行電鉄	425	378	307,692	
京浜急行電鉄	200	191	258,996	
小田急電鉄	234	111.5	248,199	
京王電鉄	204	194	179,450	
京成電鉄	110	52.2	150,283	
富士急行	20	19	22,173	
新京成電鉄	9	9	3,807	
東日本旅客鉄道	133.6	134.7	1,441,290	
西日本旅客鉄道	70.3	67	523,002	
東海旅客鉄道	65.5	57.9	1,056,385	
西武ホールディングス	77.6	96.1	201,233	
鴻池運輸	10.3	9.8	15,425	
西日本鉄道	95	84	40,236	
ハマキョウレックス	5.6	4.5	11,326	
サカイ引越センター	2.9	3.2	12,640	
近鉄グループホールディングス	736	701	300,028	
阪急阪神ホールディングス	491	87.9	356,874	
南海電気鉄道	164	147	86,142	
京阪ホールディングス	164	156	113,412	
神戸電鉄	18	17	6,698	
名古屋鉄道	266	253	130,548	
山陽電気鉄道	27	25	14,125	
日本通運	283	259	175,861	
ヤマトホールディングス	130.7	124.5	298,737	
山九	96	92	63,940	
丸運	3.9	3.8	984	
丸全昭和運輸	25	23	10,419	
センコーグループホールディングス	32.9	32.9	21,944	
トナミホールディングス	15	14	5,964	
ニッコンホールディングス	23.8	23.6	57,418	
日本石油輸送	8	0.8	2,108	
福山通運	44	42	29,610	
セイノーホールディングス	51.8	49.4	68,567	
神奈川中央交通	9	8	5,840	
日立物流	15.2	14.5	35,742	
丸和運輸機関	2.2	1.7	5,312	
C&Fロジホールディングス	7	7.2	10,562	
九州旅客鉄道	—	69.2	253,618	
<b>海運業(0.2%)</b>				
日本郵船	656	588	119,364	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
商船三井	357	366	116,754	
川崎汽船	320	264	76,032	
NSユナイテッド海運	38	33	7,590	
飯野海運	39	37.6	17,183	
共栄タンカー	13	10	2,110	
乾汽船	6	5.1	4,554	
<b>空運業(0.5%)</b>				
日本航空	139.9	122.3	403,834	
ANAホールディングス	1,357	1,292	456,722	
パスコ	7	6	2,136	
<b>倉庫・運輸関連業(0.2%)</b>				
トランコム	2.1	2	11,740	
日新	30	28	12,544	
三菱倉庫	52	46	65,412	
三井倉庫ホールディングス	42	40	12,280	
住友倉庫	53	51	36,720	
澁澤倉庫	19	18	6,444	
東陽倉庫	12	11.9	3,534	
日本トランスシティ	17	16	7,152	
ケイヒン	13	13	2,015	
中央倉庫	4.2	4	4,316	
安田倉庫	5.7	5.4	3,904	
東洋埠頭	21	20	3,540	
宇徳	5.9	5.6	2,324	
上組	87	83	95,450	
サンリツ	1.8	1.7	936	
キムラユニティ	1.8	1.8	2,046	
キューソー流通システム	2	2.2	5,810	
郵船ロジスティクス	6.7	6.4	6,457	
近鉄エクスプレス	13.1	12.4	20,869	
東海運	3.9	3.8	1,637	
エーアイティ	4.5	4.3	4,416	
内外トランスライン	2.4	2.1	2,526	
<b>情報・通信業(8.1%)</b>				
NECネットエスアイ	9	7.5	18,120	
システナ	7	5.5	13,051	
デジタルアーツ	3.5	3.1	11,733	
新日鉄住金ソリューションズ	12	11.5	30,222	
キューブシステム	3.2	4	3,932	
コア	3	2.9	4,231	
ソフトクリエイトホールディングス	3.5	3.3	4,699	
TI S	23.9	22.8	73,302	
ネオス	2.2	2.1	1,016	
電算システム	2.5	2.4	4,101	
グリー	43.8	41.9	38,254	
コーエーテクモホールディングス	17.1	16.3	36,854	
三菱総合研究所	2.8	2.9	8,946	
ボルテージ	1.4	1.3	1,809	

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)
電算	0.8	0.8	1,806	
AGS	1.6	1.7	2,976	
ファインデックス	4.7	5.1	4,794	
ヒト・コミュニケーションズ	1.6	1.6	2,904	
ブレインパッド	1.1	1.5	1,876	
KL a b	11.2	13.1	17,711	
ポルトゥウィン・ビット クルーホールディングス	4.8	5	7,565	
イーブクイニシアティブジャパン	1.6	1.1	1,262	
ネクソン	69.2	75.5	156,813	
アイスタイル	11.6	14.5	15,138	
エムアップ	1.9	2	4,422	
エイチーム	4	4.6	14,283	
テクノスジャパン	2.1	5.3	6,413	
コロプラ	20.1	22.1	26,520	
モバイルクリエイト	4.8	5.1	1,978	
ブロードリーフ	7.4	17	12,053	
ハーツユナイテッドグループ	2.2	3.6	5,475	
メディアドゥ	1.5	2	4,934	
ブイキューブ	4.7	3.8	2,139	
サイバーリンクス	1.1	1.1	1,537	
ディー・エル・イー	2	3.1	1,466	
フィックスターズ	—	1.2	3,828	
VOYAGE GROUP	2.5	3.4	7,959	
オブティム	0.6	1.5	4,942	
セレス	—	1.7	2,840	
ベリサーブ	0.8	0.8	2,928	
ティーガイア	7.2	6.9	13,869	
日本アジアグループ	8.2	7.8	3,408	
豆蔵ホールディングス	5.7	5.1	5,232	
テクマトリックス	3.1	4.3	7,348	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	168.1	144.2	39,943	
GMOペイメントゲートウェイ	6.3	4.8	31,104	
ザッパラス	4.1	3.6	1,814	
システムリサーチ	—	0.7	1,662	
インターネットイニシアティブ	11.7	10.1	21,230	
さくらインターネット	4.7	5.6	5,359	
GMOクラウド	1.6	1.5	5,775	
SRAホールディングス	4.2	3.6	10,339	
Minor iソリューションズ	1.4	1.5	1,996	
朝日ネット	6.6	6.3	3,175	
アドソル日進	—	1.8	2,212	
フリービット	—	5.1	4,982	
コムチュア	1.2	1.2	5,538	
サイバーコム	0.8	1.3	1,281	
メディカル・データ・ビジョン	—	3	7,146	
g u m i	7.5	7.8	10,608	
ショーカーズ・ティービー	—	1.1	1,226	

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)
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	—	1	2,074	
P C Iホールディングス	—	1.2	3,210	
パイブドHD	0.9	1.3	1,357	
アイビシー	—	0.7	738	
オープンドア	—	0.9	2,830	
L I N E	—	15.4	58,982	
オークネット	—	2.2	3,130	
A O I T Y O Holdings	—	5.6	5,084	
マクロミル	—	8.8	17,987	
ソルクシーズ	—	2.7	2,224	
フェイス	1.9	1.8	2,140	
ハイマックス	1	0.9	1,446	
野村総合研究所	50.6	51.4	217,936	
サイバネットシステム	5.9	5.7	4,086	
C Eホールディングス	1.1	1	1,097	
インテージホールディングス	3.8	3.9	8,572	
東邦システムサイエンス	2.2	2.3	1,495	
ソースネクスト	3.6	4.2	2,688	
ティー・ワイ・オー	14.3	—	—	
フォーカスシステムズ	2.8	3.6	2,214	
クレスコ	1.6	1.6	6,264	
フジ・メディア・ホールディングス	75.1	71.6	108,044	
オービック	24.9	23.7	154,524	
ジャストシステム	13.1	11.1	18,503	
TDCソフトウェアエンジニアリング	3.2	3	3,837	
ヤフー	517	492.5	246,742	
トレンドマイクロ	35	36.4	200,564	
インフォメーション・ディベロPMENT	1.4	2	2,836	
日本オラクル	11.6	11	72,380	
アルファシステムズ	2.4	2.3	4,609	
フューチャー	8.7	9.3	8,091	
C A C Holdings	5.4	5.2	5,543	
ソフトバンク・テクノロジー	2	3.4	7,337	
トーセ	2	1.9	1,681	
オービックビジネスコンサルタント	3.7	3.5	19,775	
伊藤忠テクノソリューションズ	16.3	15.6	59,202	
アイティフォー	9.4	9	5,517	
東計電算	1.3	1.2	2,895	
エックスネット	0.7	1.3	1,158	
大塚商会	19.4	18.5	127,650	
サイボウズ	9.6	9.2	4,287	
ソフトブレイン	10.6	9.4	4,888	
電通国際情報サービス	4.4	4.2	11,176	
デジタルガレージ	—	13.3	26,280	
EMシステムズ	2.5	2.4	5,275	
ウェザーニューズ	2.4	2.3	8,843	
C I J	6.6	5.8	3,497	
東洋ビジネスエンジニアリング	0.7	0.7	1,192	

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)
日本エンタープライズ	7.5	7.1	1,824	
WOWOW	3.4	3.3	10,923	
スカラ	4.5	4.8	3,969	
日本コロムビア	2.5	2	1,380	
イマジカ・ロボット ホールディングス	6.1	5.8	4,611	
ネットワンシステムズ	31.3	29.8	30,604	
システムソフト	—	16.4	2,378	
アルゴグラフィックス	3.3	3.2	8,198	
マーベラス	12.2	11.6	14,152	
エイベックス・グループ・ホールディングス	13.3	12.7	18,110	
日本ユニシス	19.9	19	35,226	
兼松エレクトロニクス	4.6	4.3	14,770	
東京放送ホールディングス	43.2	45.3	83,216	
日本テレビホールディングス	65.9	62.7	110,540	
朝日放送	7.2	6.8	5,365	
テレビ朝日ホールディングス	19.7	18.8	37,186	
スカパーJ SATホールディングス	54.8	44.8	21,907	
テレビ東京ホールディングス	6.5	5.6	12,566	
日本BS放送	1.6	2.3	2,720	
ビジョン	—	1.1	5,643	
U-NEXT	2.3	1.8	1,902	
ワイヤレスゲート	2.1	3.2	4,956	
コネクシオ	6.4	6.1	11,730	
日本通信	51.2	57.6	9,734	
クロップス	1.4	1.5	856	
日本電信電話	557.6	551.5	2,894,823	
KDDI	732.8	679.7	2,079,882	
光通信	8.7	8.3	89,806	
NTTドコモ	539	505.7	1,375,504	
エムティーアイ	11	9.3	5,831	
GMOインターネット	26.6	25.1	37,148	
アイドママーケティングコミュニケーション	—	0.9	653	
カドカワ	22.5	19.9	27,860	
学研ホールディングス	24	2.3	7,440	
ゼンリン	9.5	9.1	24,469	
昭文社	4	4	2,916	
インプレスホールディングス	5.9	5.7	780	
アイネット	4	3.9	5,042	
松竹	47	45	61,290	
東宝	51.5	44.9	149,966	
東映	27	26	27,586	
AOI Pro.	3.7	—	—	
エヌ・ティ・ティ・データ	44.6	42.4	256,944	
ピー・シー・エー	0.9	1	1,537	
ビジネスブレイン太田昭和	1.1	1.2	1,258	
DTS	8	7.1	23,004	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	30.5	26.5	93,412	
シーエーシー	4.7	4.1	9,401	

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)
カプコン	18.5	16.1	42,520	
アイ・エス・ビー	1.2	1.3	2,316	
ジャステック	4.6	4.4	5,196	
S C S K	17.2	18.7	92,004	
日本システムウェア	2.7	2.3	3,813	
アイネス	10.2	8.7	10,074	
T K C	6.7	6.4	20,256	
富士ソフト	10.7	10.2	33,354	
NSD	15.3	14.6	28,630	
コナミホールディングス	32.6	31	169,570	
福井コンピュータホールディングス	2.1	2	6,930	
J B C Cホールディングス	6.1	5.8	4,877	
ミロク情報サービス	5.3	6.8	15,476	
ソフトバンクグループ	408.7	309.3	2,700,807	
<b>卸売業 (4.3%)</b>				
ハウスイ	6	6	702	
高千穂交易	2.8	2.7	2,894	
伊藤忠食品	1.8	1.7	7,930	
エレマテック	3.4	2.8	5,003	
J A L U X	2.3	2.2	5,742	
あらた	3.2	3.1	10,896	
トーマンデバイス	1.1	1	2,239	
東京エレクトロニクス デバイス	2.6	2.5	4,147	
フィールズ	6.3	5.3	6,312	
双日	454.4	405.7	108,727	
アルフレッサ ホールディングス	90.7	81.3	174,469	
横浜冷凍	17.9	16.2	17,334	
神栄	10	9	1,494	
山下医科器械	0.6	0.6	1,035	
ラサ商事	3.4	3	2,562	
ラクーン	3.1	4.4	2,301	
アルコニックス	4.1	3.9	7,449	
神戸物産	4.7	3.7	15,910	
あい ホールディングス	12.8	9.8	28,841	
ディーブイエックス	2.6	2.5	3,195	
ダイワボウホールディングス	66	58	23,548	
マクニカ・富士エレホールディングス	13	12.7	20,916	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	12.5	12.9	12,474	
八洲電機	5.6	5.3	3,678	
メディアスホールディングス	—	1.1	3,197	
UKCホールディングス	4.6	4.4	9,055	
OCHIホールディングス	2.1	2	2,658	
TOKAIホールディングス	31.7	30.1	24,170	
大阪工機	—	1.1	828	
三洋貿易	4	3.8	8,200	
ビューティガレージ	—	0.9	1,754	
ウイン・パートナーズ	2.6	5	5,830	
ミタチ産業	1.9	1.6	1,052	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
シッパヘルスケアホールディングス	14.6	13.2	40,854	
明治電機工業	2.3	2.4	3,031	
デリカフーズ	1.5	1.5	1,915	
スターティア	1.4	1.6	844	
コメダホールディングス	—	12.4	24,576	
富士興産	2.8	2.5	1,235	
協栄産業	10	8	1,368	
小野建	6.3	6	9,672	
佐島電機	5.7	5.1	4,064	
エコートレーディング	1.7	1.6	1,129	
伯東	5.5	4.7	6,528	
コンドーテック	5.7	5.5	5,148	
中山福	4.5	4	3,192	
ナガイレーベン	10.4	9.1	23,032	
三菱食品	7.9	7.5	25,050	
松田産業	5.3	5	7,370	
第一興商	12.8	11.2	59,584	
メディバルホールディングス	72.1	68.7	138,567	
アドヴァン	7.3	—	—	
SPK	1.7	1.5	4,012	
萩原電気	2.5	2.3	5,253	
アズワン	5.6	5.4	28,782	
スズデン	2.3	2.5	2,827	
尾家産業	2.3	2.2	2,618	
シモジマ	5	4.2	4,834	
ドウシシャ	8.5	8.1	16,758	
小津産業	1.6	1.5	3,250	
高速	4.3	4.1	4,218	
たけびし	2.5	2.4	3,484	
黒田電気	13.4	9.4	19,805	
リックス	—	1.6	2,955	
丸文	6.4	6.1	4,623	
ハビネット	6.6	5.7	12,431	
橋本総業ホールディングス	1.5	1.4	2,140	
日本ライフライン	—	7.8	30,498	
エクセル	3.5	2.9	4,274	
マルカキカイ	2.3	2.2	4,169	
I DOM	19.4	18.5	10,822	
日本エム・ディ・エム	6	5.2	4,409	
進和	4.3	4.1	8,068	
エスケイジャパン	1.8	1.4	400	
ダイトロン	3.3	3.1	3,803	
シークス	4.6	4.9	22,540	
田中商事	2.2	2.1	1,509	
オーハシテクニカ	4.1	3.9	5,541	
白銅	2.1	1.7	2,796	
伊藤忠商事	566.1	503.2	793,043	
丸紅	709.9	676.1	460,694	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
高島	—	14	12	2,508
長瀬産業	43.4	41.3	64,675	
蝶理	4.6	4.4	8,734	
豊田通商	80.4	76.5	260,100	
三共生興	10.9	10.4	4,004	
兼松	153	146	30,952	
ツカモトコーポレーション	13	12	1,428	
三井物産	652.3	621.3	929,464	
日本紙バルブ商事	38	36	14,436	
日立ハイテクノロジーズ	25	23.8	105,077	
カメイ	9.4	9	11,808	
東都水産	12	1.1	2,088	
OUGホールディングス	10	11	2,882	
スターゼン	2.6	2.9	13,485	
山善	27.7	26.4	28,432	
椿本興業	8	8	3,584	
住友商事	454.1	432.5	611,338	
内田洋行	18	3.2	8,086	
三菱商事	541.3	515.5	1,149,049	
第一実業	16	16	9,872	
キャノンマーケティングジャパン	20.6	19.6	45,628	
西華産業	24	21	7,665	
佐藤商事	6.5	6.1	5,343	
菱洋エレクトロ	8.3	6.4	10,771	
東京産業	7.2	6.9	3,084	
ユアサ商事	6.8	6.5	22,035	
神鋼商事	16	1.7	4,346	
小林産業	4.8	5.1	1,438	
阪和興業	72	69	53,751	
カナデン	6.9	6.6	7,293	
菱電商事	11	11	9,086	
フルサト工業	4	3.8	6,498	
岩谷産業	86	76	55,328	
すてきなニスグループ	31	29	4,292	
昭光通商	26	24	2,280	
ニチモウ	11	10	1,720	
極東貿易	10	11	2,871	
イワキ	11	10	3,210	
三菱石油	17.9	18.4	18,602	
稲畑産業	17.3	16.5	22,473	
G S I クレオス	19	17	2,550	
明和産業	6.7	6.4	2,643	
ワキタ	15.4	14.6	17,826	
東邦ホールディングス	23.1	22	49,588	
サンゲツ	25.2	23.5	46,154	
ミツウロコグループホールディングス	11.6	11.1	7,892	
シナネンホールディングス	16	3	6,612	
伊藤忠エネクス	18.6	15.2	13,923	

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)
サンリオ	22.2	21.2	44,117	
サンワテクノス	4.6	4.1	5,719	
リョーサン	11.4	10.2	40,647	
新光商事	8.5	7.5	9,720	
トーホー	3.3	3.1	9,141	
三信電気	10	7.6	10,343	
東陽テクニカ	10.3	7.9	8,334	
モスフードサービス	9.4	9	30,645	
加賀電子	6.5	6.2	12,821	
ソーダニッカ	7.5	7.1	3,706	
立花エレテック	5.3	4.7	6,786	
フォーバル	3.8	3	2,139	
PAL TAC	11.5	11	41,415	
三谷産業	7.7	7.3	2,847	
ヤマタネ	33	3.4	5,117	
丸紅建材リース	6	7	1,547	
日鉄住金物産	63	6	30,360	
トラスコ中山	8.2	15.7	38,810	
オートバックスセブン	27.6	25.4	44,754	
モリト	—	5.5	4,922	
加藤産業	11.3	10.7	30,002	
イノテック	6.7	5.9	3,994	
イエローハット	6.8	6.5	17,530	
J Kホールディングス	7.3	6.9	4,478	
日伝	3	2.8	10,094	
北沢産業	6	5.8	1,183	
杉本商事	4.2	4	6,132	
因幡電機産業	10.1	9.6	39,360	
パイテックホールディングス	3	2.8	3,679	
ミスミグループ本社	81	77.5	190,572	
アルテック	6.1	5.9	1,280	
タキヒヨー	12	10	4,590	
蔵王産業	1.2	1.1	1,624	
スズケン	32.8	31.3	112,367	
ジェコス	5	4.7	5,376	
ルネサスイーストン	6	6.3	3,710	
<b>小売業(4.8%)</b>				
ローソン	27.3	21.7	164,052	
サンエー	4.9	5.2	26,156	
ダイユーエイト	2.4	—	—	
カワチ薬品	5.6	5.3	14,696	
エービーシー・マート	9.4	12.5	80,500	
ハードオフコーポレーション	3.5	3.1	3,410	
アスクル	8.8	7.2	24,300	
ゲオホールディングス	12.1	11.6	13,595	
アダストリア	13.3	10.6	31,333	
ジーフット	4.4	4.3	3,345	
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	10	0.9	652	

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)
くらコーポレーション	4.2	4.5	22,590	
キャンドウ	3.8	3.6	6,080	
パルグループホールディングス	4.2	3.5	9,635	
エディオン	30.7	26.7	28,622	
サーラコーポレーション	6.2	8.6	5,607	
ワッツ	3.1	2.8	3,488	
ハローズ	2.4	2.3	5,375	
あみやき亭	1.4	1.3	5,317	
ひらまつ	10	9.5	6,403	
ゲンキー	1.5	2.8	8,400	
サッポロドラッグストアー	1	—	—	
大黒天物産	1.7	1.6	8,560	
ハニーズホールディングス	6.4	6.7	7,323	
ファーマライズホールディングス	2.3	1.7	897	
アルペン	6.5	5.3	10,191	
クオール	7.3	7.9	13,232	
ジンズ	4.9	4.7	30,127	
ビックカメラ	41.4	39.5	46,847	
DCMホールディングス	35.6	41.7	41,157	
MonotaRO	25.5	24.4	90,402	
東京一番フーズ	1.9	1.9	1,088	
ダイヤモンドダイニング	1.8	1.5	3,276	
きちり	2	2	1,316	
アークランドサービスホールディングス	2.3	2.9	10,498	
J・フロント リテイリング	91.3	86.9	137,736	
ドトール・日レスホールディングス	12.7	12	28,344	
マツモトキヨシホールディングス	14.9	13	83,590	
ブロンコピリー	3.8	3.6	9,478	
スタートトゥデイ	22	62.7	174,995	
トレジャー・ファクトリー	2.1	2.1	1,667	
物語コーポレーション	1.9	2	11,060	
ココカラファイン	7.5	7.2	38,448	
三越伊勢丹ホールディングス	143.5	136.7	156,248	
Hamee	—	2.3	2,582	
ウエルシアホールディングス	6.2	18.1	72,581	
クリエイトSDホールディングス	10.6	10.1	26,340	
丸善CHIホールディングス	8.4	8	2,768	
ミサワ	1.2	1.5	663	
ティーライフ	—	1	1,774	
エー・ビーカンパニー	1.3	1.3	1,250	
チムニー	1.8	2.1	5,768	
シュッピン	2.7	2.7	4,660	
ネクステージ	1.4	2.8	4,149	
ジョイフル本田	11.7	11.2	41,384	
鳥貴族	1.8	2.5	6,962	
キリン堂ホールディングス	2.5	2.4	2,032	
ホットランド	2.5	3.3	5,240	
すかいらーく	22.2	29.5	51,507	

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)
綿半ホールディングス	2.8	2.8	5,367			
ヨシックス	—	1	1,480			
ユナイテッド・スーパーマー ケット・ホールディングス	23.9	22.8	24,646			
ブックオフコーポレーション	4.5	3.9	3,026			
ゴルフダイジェスト・オンライン	2.1	3	2,685			
BEENOS	—	1.2	1,803			
あさひ	5.4	5.2	7,087			
日本調剤	1.9	2.5	9,900			
コスモス薬品	3.6	3.5	81,585			
トーエル	3.6	3.4	3,056			
一六堂	2.1	1.8	696			
オンリー	—	1.1	1,007			
セブン&アイ・ホールディングス	301.8	287.5	1,362,462			
薬王堂	1.4	3.5	12,582			
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	19.4	18.5	18,167			
ツルハホールディングス	16.6	13.7	166,729			
サンマルクホールディングス	5.7	4.4	14,894			
フェリシモ	2.1	2	2,130			
トリドールホールディングス	8.9	8.5	24,055			
クスリのアオキ	6.4	—	—			
TOKYO BASE	—	0.9	2,893			
サツドラホールディングス	—	1	2,068			
ダイユー・リックホールディングス	—	2.3	1,794			
パロックジャパンリミテッド	—	5.6	6,921			
クスリのアオキホールディングス	—	5.5	29,535			
スシローグローバルホールディングス	—	6.2	21,142			
メディカルシステムネットワーク	8.6	8	3,864			
総合メディカル	3.5	3.3	15,576			
はるやまホールディングス	3.3	3.3	3,224			
ノジマ	—	10.8	18,619			
カッパ・クリエイト	10.1	9.6	12,048			
ライトオン	5.4	5.8	5,968			
良品計画	8.3	9.1	259,896			
三城ホールディングス	9	8.6	4,042			
アドヴァン	—	7.1	7,952			
アルビス	2	1.8	8,325			
コナカ	9.3	8.9	5,331			
ハウス オブ ローゼ	1	0.9	1,403			
G-7ホールディングス	2.2	2.1	4,821			
イオン北海道	5	7	4,214			
コジマ	11.1	12.1	3,666			
ヒマラヤ	2.4	1.9	1,573			
コーナン商事	10.5	9.8	20,981			
エコス	3	2.8	3,343			
マルシェ	2	1.6	1,320			
ドンキホーテホールディングス	46.7	44.5	191,350			
西松屋チェーン	14.2	12.1	14,217			

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)
ゼンショーホールディングス	37.1	35.6	71,947			
幸楽苑ホールディングス	4.8	4.4	8,184			
ハークスレイ	2.2	1.7	1,910			
サイゼリヤ	11.9	10.2	32,130			
V Tホールディングス	24.4	23.4	14,180			
魚力	2.3	2.2	2,752			
ポプラ	1.8	1.7	943			
フジ・コーポレーション	—	1.1	2,191			
ユナイテッドアローズ	10.3	9.2	31,234			
ハイデイ日高	6.6	7.5	18,435			
京都きもの友禅	5	4.4	4,065			
コロナイド	24.1	22.8	42,750			
ピーシーデポコーポレーション	8	9.4	5,752			
壱番屋	6.6	4.8	18,168			
トップカルチャー	3.3	2.6	1,240			
P L A N T	1.8	1.6	1,939			
スギホールディングス	12.9	15.1	88,335			
ヴィア・ホールディングス	—	5.3	5,056			
スクロール	11	10.6	3,911			
ユンドシーホールディングス	5.5	7	18,445			
ユニー・ファミリーマートホールディングス	22.2	30.2	197,508			
木曽路	8.8	8.4	21,344			
サトレストランシステムズ	8.7	8.1	7,249			
千趣会	14.3	12.5	10,137			
タカキュー	6.4	6	1,182			
ケーヨー	12.2	11.8	8,720			
上新電機	17	16	22,448			
日本瓦斯	11	12.6	46,053			
ベスト電器	23.2	22.7	3,745			
ロイヤルホールディングス	12	11.3	26,611			
いなげや	8	7.7	14,221			
島忠	18.7	17.8	46,262			
チヨダ	8.5	8.1	22,761			
ライフコーポレーション	4.8	5.4	16,189			
リンガーハット	6.5	7.7	18,680			
Mr M a x	7.6	8.8	4,136			
テナアライド	6.6	6.3	2,507			
AOKIホールディングス	16.5	13.7	19,865			
オークワ	12	10	11,820			
コメリ	11.1	10.6	30,178			
青山商事	13.8	14.4	58,464			
しまむら	8.4	8	113,920			
はせがわ	3.9	3.8	1,808			
高島屋	105	115	120,175			
松屋	15.3	15.7	15,213			
エイチ・ツー・オー リテイリング	37	35.2	65,894			
近鉄百貨店	28	26	9,230			
パルコ	7	6.6	8,184			

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)
丸井グループ	88.6	72.6	118,773			
アクシアル リテイリング	5.6	5.3	23,108			
イオン	296.8	282.7	471,260			
ユニークグループ・ホールディングス	69.5	—	—			
イズミ	14.4	13.7	81,789			
東武ストア	9	0.8	2,385			
平和堂	14.6	13.9	33,638			
フジ	8.3	7.6	21,470			
ヤオコー	8.2	7.8	36,426			
ゼビオホールディングス	9.8	9.3	16,535			
ケーズホールディングス	30.4	29.1	67,221			
O l y m p i c グループ	4.6	4.3	2,455			
日産東京販売ホールディングス	12.8	10.4	4,544			
アインホールディングス	8.7	9	79,920			
元気寿司	2.1	1.7	3,833			
ヤマダ電機	219.5	229.8	135,122			
アークランドサカモト	12.2	11.7	17,538			
ニトリホールディングス	31.2	29.7	475,200			
グルメ杵屋	5	5	5,445			
愛眼	5.7	5	990			
ケーユーホールディングス	3.8	3.6	3,614			
吉野家ホールディングス	26.7	24	43,608			
松屋フーズ	3.5	3.3	13,678			
サガミチェーン	9.7	8.6	11,911			
関西スーパーマーケット	6.1	5.7	8,954			
王将フードサービス	5.3	5	20,475			
ブレナス	8.1	7.7	18,241			
ミニストップ	5.3	5.1	11,735			
アークス	13.5	12.9	31,218			
パローホールディングス	15.6	14.8	37,917			
藤久	0.7	0.6	1,047			
ベルク	3.6	3.1	16,306			
大庄	4	3.7	6,434			
ファーストリテイリング	12	11.5	427,800			
サンドラッグ	15.2	26.1	112,882			
サックスパー ホールディングス	6.8	6.6	8,032			
ヤマザワ	1.6	1.4	2,528			
やまや	1.5	1.5	2,443			
ペルーナ	18	14.8	18,204			
<b>銀行業(7.8%)</b>						
島根銀行	1.5	1.4	1,814			
じもとホールディングス	51.8	49.4	9,731			
めぶきフィナンシャルグループ	52.9	331.3	146,765			
東京TYフィナンシャルグループ	9.9	9.9	29,700			
九州フィナンシャルグループ	110.4	112.7	79,002			
ゆうちょ銀行	184.8	194.5	268,604			
富山第一銀行	18.3	17.5	9,030			
コンルディア・フィナンシャルグループ	502.5	445.3	237,968			

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)
西日本フィナンシャルホールディングス	—	46.6	50,980			
新生銀行	624	654	120,990			
あおぞら銀行	456	435	180,090			
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,787.9	5,206	3,633,267			
りそなホールディングス	843.9	803.7	456,180			
三井住友トラスト・ホールディングス	1,506	143.4	538,036			
三井住友フィナンシャルグループ	577.6	550.1	2,222,954			
第四銀行	91	84	40,572			
北越銀行	78	7.4	19,972			
西日本シティ銀行	235	—	—			
千葉銀行	278	265	197,955			
常陽銀行	261	—	—			
群馬銀行	160	152.7	91,314			
武蔵野銀行	11.5	11	37,345			
千葉興業銀行	19.8	18.7	10,958			
筑波銀行	30	28.6	9,094			
七十七銀行	113	108	53,892			
青森銀行	53	53	20,458			
秋田銀行	47	44	14,300			
山形銀行	41	39	18,837			
岩手銀行	5	4.5	19,192			
東邦銀行	64	61	23,851			
東北銀行	37	35	5,250			
みちのく銀行	36	41	7,708			
ふくおかフィナンシャルグループ	312	279	143,964			
静岡銀行	211	181	171,407			
十六銀行	90	92	30,084			
スルガ銀行	68.5	70.2	171,498			
八十二銀行	130.5	132.6	85,527			
山梨中央銀行	45	43	19,651			
大垣共立銀行	96	106	33,284			
福井銀行	62	59	16,520			
北國銀行	80	73	28,105			
清水銀行	2.5	2.3	8,291			
富山銀行	1.4	1.3	5,837			
滋賀銀行	68	65	35,555			
南都銀行	70	6.6	21,945			
百五銀行	65	62	27,590			
京都銀行	138	123	117,465			
紀陽銀行	28.3	25.8	46,749			
三重銀行	32	3.1	7,176			
ほくほくフィナンシャルグループ	491	45.7	75,405			
広島銀行	213	203	92,771			
山陰合同銀行	43.4	40.7	34,310			
中国銀行	51.1	48.7	75,533			
鳥取銀行	23	2.2	3,762			
伊予銀行	77.2	98	80,262			
百十四銀行	79	75	26,850			

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)
四国銀行	56	53	16,536	
阿波銀行	59	59	45,135	
大分銀行	41	39	16,185	
宮崎銀行	48	46	16,376	
佐賀銀行	44	42	11,508	
十八銀行	44	42	12,810	
沖縄銀行	5.7	6.7	28,609	
琉球銀行	14.9	14.1	21,248	
セブン銀行	270.3	257.5	107,635	
みずほフィナンシャルグループ	10,224.9	9,327.7	1,818,901	
高知銀行	28	25	3,150	
山口フィナンシャルグループ	67	64	81,344	
長野銀行	24	2.3	4,586	
名古屋銀行	60	5.6	22,204	
北洋銀行	108.7	112.1	43,382	
愛知銀行	2.4	2.3	14,352	
第三銀行	41	3.9	6,532	
中京銀行	30	2.8	6,490	
大光銀行	26	24	5,784	
愛媛銀行	42	8.7	11,919	
トマト銀行	28	2.7	4,114	
みなと銀行	65	6.2	12,449	
京葉銀行	59	56	25,424	
関西アーバン銀行	10	9.6	12,537	
栃木銀行	39	37.9	18,987	
北日本銀行	2.2	2.1	6,583	
東和銀行	135	129	15,996	
福島銀行	89	75	6,525	
大東銀行	43	36	5,940	
トモニホールディングス	55.3	56.6	30,903	
フィデアホールディングス	58.8	66.3	12,795	
池田泉州ホールディングス	76.5	72.9	33,606	
<b>証券・商品先物取引業(1.1%)</b>				
F P G	26.2	25.2	25,099	
S B I ホールディングス	86.8	77.7	111,577	
ジャフコ	12.2	11.5	48,875	
大和証券グループ本社	675	624	421,137	
野村ホールディングス	1,388	1,404.6	939,677	
岡三証券グループ	61	59	39,648	
丸三証券	21.4	21.9	19,293	
東洋証券	28	25	6,150	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	82.8	78.9	46,156	
光世証券	19	20	3,100	
水戸証券	22.4	21.4	6,548	
いちよし証券	16.2	15.4	13,413	
松井証券	36.2	39.3	36,352	
だいこう証券ビジネス	3.6	4.4	2,640	
マネックスグループ	84.4	74.8	20,420	

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)
カブドットコム証券	63.6	51.1	18,600	
極東証券	9.7	9.2	15,180	
岩井コスモホールディングス	6.8	6.5	7,397	
藍澤証券	13.5	12.9	8,617	
マネースクウェアHD	2.7	—	—	
マネーパートナーズグループ	7.2	9.6	5,001	
<b>保険業(2.5%)</b>				
かんぽ生命保険	29.4	25.9	62,056	
S O M P O ホールディングス	160.2	143.6	620,639	
アニコム ホールディングス	4.9	4.7	10,443	
MS & AD インシュアランス グループホールディングス	215.6	205.3	789,378	
ソニーフィナンシャルホールディングス	69.1	65.8	112,912	
第一生命ホールディングス	462.2	414.3	761,069	
東京海上ホールディングス	292.3	276.7	1,298,829	
T & D ホールディングス	262.9	250.4	390,749	
アドバンスクリエイト	—	1.6	3,051	
<b>その他金融業(1.3%)</b>				
全国保証	18.8	19.3	87,718	
クレディセゾン	54.7	52.1	109,462	
アクリーティブ	5.9	5.6	2,088	
芙蓉総合リース	8.2	7.9	46,373	
興銀リース	13.6	12.9	31,205	
東京センチュリー	16.9	13.8	56,925	
日本証券金融	31.8	30.3	16,816	
アイフル	120.8	115.2	36,979	
ポケットカード	7.2	5.2	3,504	
リコーリース	5.7	5.4	18,846	
イオンフィナンシャルサービス	47.3	43.9	101,496	
アコム	144.9	138	64,998	
ジャックス	40	38	17,784	
オリエン트コーポレーション	311.9	148.5	27,918	
日立キャピタル	17	16.2	42,719	
アプラスフィナンシャル	34.6	33	3,399	
オリックス	510.8	486.5	853,321	
三菱UFJリース	183	174.3	98,653	
日本取引所グループ	211.8	213.6	382,344	
イー・ギャランティ	2.3	2	5,116	
アサックス	1.2	1.2	2,018	
NECキャピタルソリューション	2.9	2.8	4,751	
<b>不動産業(2.5%)</b>				
いちご	79.9	65.3	21,222	
日本駐車場開発	87	82.4	13,019	
ヒューリック	150.4	143.3	149,318	
三栄建築設計	2.9	2.8	4,466	
野村不動産ホールディングス	47.9	45.7	110,639	
三重交通グループホールディングス	12.9	12.2	4,806	
サムティ	5.2	5.5	6,391	

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)
ディア・ライフ	5	6.1	2,366			
エー・ディー・ワークス	66.8	69.4	2,984			
日本商業開発	3.2	3.9	6,298			
プレサンスコーポレーション	2.5	10.7	16,039			
ユニゾホールディングス	4.5	5.7	16,165			
THEグローバル社	—	3.2	1,971			
日本管理センター	4.7	5.2	6,567			
サンセイランディック	1.7	1.7	1,319			
エストラスト	1.3	1.6	1,084			
フージャースホールディングス	10.1	8.9	7,805			
オープンハウス	10.4	11.2	39,368			
東急不動産ホールディングス	174.6	166.2	111,187			
飯田グループホールディングス	66.8	57.3	104,859			
ムゲンエステート	1.1	3.2	3,004			
ファーストブラザーズ	—	1	1,523			
ハウスドゥ	—	1.1	1,890			
シーアールイー	—	1.1	1,812			
ケイアイスター不動産	—	2.1	3,651			
パーク24	36.4	34.9	107,666			
パラカ	2.5	2.2	4,334			
三井不動産	383	364.3	940,986			
三菱地所	536	511	1,054,704			
平和不動産	13.7	13	23,959			
東京建物	78.8	79.7	122,897			
ダイビル	18.6	17.7	19,770			
京阪神ビルディング	12	11.4	7,546			
住友不動産	173	165	544,830			
大京	134	128	28,544			
テーオーシー	28	26.8	27,175			
東京楽天地	12	11	6,160			
レオパレス21	85	86.7	57,395			
スターツコーポレーション	8.3	9.3	24,951			
フジ住宅	9.2	8.8	6,415			
空港施設	8.8	8.3	4,905			
明和地所	4	3.8	3,351			
住友不動産販売	5.2	—	—			
ゴールドクレスト	5.7	6.2	14,334			
日本エスリード	2.8	2.7	4,792			
日神不動産	9.7	8.1	4,932			
日本エスコン	—	11.9	5,355			
タカラレーベン	31.5	29.5	15,517			
サンヨーハウジング名古屋	4.1	3.7	3,722			
イオンモール	46.6	44.2	90,919			
ファースト住建	2.7	2.6	4,004			
トーセイ	11	9.4	7,736			
穴吹興産	8	0.7	2,026			
エヌ・ティ・ティ都市開発	44.8	42.7	45,347			
サンフロンティア不動産	8.8	7.4	8,687			

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)
エフ・ジェー・ネクスト	6.4	6.6	5,616			
インテリックス	—	2.1	1,814			
ランドビジネス	4.9	4.1	1,225			
グランディハウス	6.4	6	2,550			
日本空港ビルデング	23	21.9	96,250			
<b>サービス業(3.9%)</b>						
日本工営	26	4.9	14,651			
Lifull	21.6	17.9	12,601			
ジェイエイシーリクルートメント	4.7	4.5	7,236			
日本M&Aセンター	11.8	21	91,770			
ノバレーゼ	2.4	—	—			
アコーディア・ゴルフ	21.4	—	—			
中広	1.3	0.9	671			
タケエイ	7.2	6.5	7,592			
トラスト・テック	3.1	3	6,483			
コシダカホールディングス	—	3.5	8,760			
パソナグループ	7.1	5.5	5,296			
CDS	2	1.8	2,394			
リンクアンドモチベーション	17.2	17.3	12,629			
GCA	7	6.6	5,966			
エス・エム・エス	9.5	10.3	31,363			
テンブホールディングス	53.5	56.3	121,157			
リニカル	4.6	4.3	7,030			
クックパッド	17	16.2	14,677			
エスクリ	4.4	3	2,181			
アイ・ケイ・ケイ	4.5	3.4	2,601			
学情	2.9	3.1	4,250			
スタジオアリス	3.5	3	7,161			
シミックホールディングス	4.1	3.8	5,392			
NJS	1.6	1.7	2,380			
総合警備保障	25.5	26.5	137,005			
カカコム	54.8	51.9	81,586			
アイロムグループ	2.2	2.2	3,410			
セントケア・ホールディング	—	1.1	1,757			
サイネックス	—	0.8	782			
ルネサンス	4.3	3.8	7,383			
ディップ	8.5	9.4	22,907			
オプトホールディング	4.9	5.4	8,051			
ツクイ	9.4	17.5	12,057			
キャリアデザインセンター	2.3	1.6	2,000			
エムスリー	66.1	63	200,970			
ツカダ・グローバルホールディング	6.2	5.6	3,119			
アウトソーシング	3.6	4.7	24,017			
ウェルネット	2.9	5.5	7,892			
ワールドホールディングス	—	2.3	5,855			
ディー・エヌ・エー	34.2	32.6	80,750			
博報堂DYホールディングス	105.8	100.8	149,587			
ぐるなび	8.8	10.5	20,958			

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)
エスアールジータカミヤ	8.9	8.1	4,341	
ジャパンベストレスキューシステム	—	8.3	2,241	
ファンコミュニケーションズ	17.7	18.5	18,074	
ライク	2.1	1.4	3,953	
ビジネス・ブレイクスルー	—	3.6	1,404	
WDBホールディングス	2.8	2.6	4,849	
ティア	4	3.7	2,786	
CDG	—	0.6	1,137	
パリュウコマース	7.6	6.8	4,318	
インフォマート	14.8	30.7	24,560	
J Pホールディングス	19.9	21.4	6,398	
E P Sホールディングス	9.5	10	16,340	
レグス	1.5	1.8	1,411	
プレステージ・インターナショナル	6.4	13.8	15,801	
アミューズ	4.2	4.1	12,956	
ドリームインキュベータ	2.6	2.3	4,639	
クイック	4	3.8	5,065	
T A C	8.3	5.3	1,224	
ケネディクス	102.7	92.4	52,945	
電通	85.1	81	463,320	
テイクアンドギヴ・ニーズ	5	3.6	3,074	
びあ	2.3	2.2	7,744	
イオンファンタジー	2.7	2.2	6,963	
シーティーエス	2.7	4.1	4,259	
ネクシィーズグループ	3.1	2.7	4,484	
みらかホールディングス	19.5	18.6	84,723	
アルプス技研	2.8	2.9	10,947	
ダイオーズ	1.4	1.4	1,622	
日本空調サービス	7.4	7.2	4,716	
オリエンタルランド	82.5	78.6	562,147	
ダスキン	19.6	17.9	49,063	
明光ネットワークジャパン	9.5	8.4	11,709	
ファルコホールディングス	3.5	3.5	5,362	
ラウンドワン	24	22.8	25,786	
リゾートトラスト	32.1	28.2	58,317	
ビー・エム・エル	4.5	9.5	21,346	
ワタベウエディング	3.3	1.3	700	
りらいあコミュニケーションズ	12.6	12	14,556	
リソー教育	14.7	12.5	10,712	
早稲田アカデミー	1.4	1	1,315	
ユー・エス・エス	92.4	88	195,272	
東京個別指導学院	3.8	2.4	3,595	
サイバーエージェント	20.1	43.7	170,648	
楽天	357.2	371.6	511,135	
クリーク・アンド・リバー社	—	3.5	3,318	
テー・オー・ダブリュー	6.2	5.9	4,808	
セントラルスポーツ	2.8	2.5	9,812	
フルキャストホールディングス	7.2	7.6	9,568	

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)
リソルホールディングス	10	8	2,888	
テクノプロ・ホールディングス	12.4	11.9	53,252	
アトラ	—	1.4	1,029	
インターワークス	1.4	1.6	1,897	
Ke e P e r 技研	0.9	1.1	2,645	
ファーストロジック	0.5	0.5	1,450	
デザインワン・ジャパン	—	1.3	1,911	
イー・ガーディアン	—	3.4	6,956	
リブセンス	6	5	2,825	
ジャパンマテリアル	3.2	5.3	10,107	
ベクトル	2.4	5.9	9,575	
ウチヤマホールディングス	4.9	3.6	1,630	
サクセスホールディングス	1.3	0.9	1,320	
キャリアリンク	2.4	2	1,174	
I B J	6.1	5.8	3,973	
アサンテ	2.8	2.7	4,922	
N・フィールド	3.7	3.5	4,931	
パリュウHR	—	0.8	2,318	
M&Aキャピタルパートナーズ	1	1.2	6,336	
ライドオン・エクスプレス	1.8	1.9	1,736	
E R Iホールディングス	2.3	2.1	1,766	
アビスト	1.2	1	3,660	
ウィルグループ	2.1	3.1	2,790	
エスクロー・エージェント・ジャパン	—	1.7	3,918	
日本ビューホテル	1.3	1.6	2,201	
リクルートホールディングス	154	158.8	913,100	
エラン	1.1	1	2,504	
土木管理総合試験所	—	1.2	840	
日本郵政	224.5	189.7	256,474	
ベルシステム24ホールディングス	15.3	11.4	11,992	
一蔵	—	0.9	1,003	
L I T A L I C O	—	0.9	1,500	
エボラブルアジア	—	1.4	4,047	
ソラスト	—	4.7	7,012	
リログループ	2.9	36.4	80,334	
東祥	2.3	2.1	11,592	
エイチ・アイ・エス	12.5	11.9	38,080	
ラックランド	1.2	1.4	3,033	
共立メンテナンス	5.7	11.8	38,350	
イチネンホールディングス	8.7	7.6	8,968	
建設技術研究所	4.5	4.7	5,306	
スペース	4.1	3.9	5,666	
燦ホールディングス	1.7	1.5	2,752	
スバル興業	6	5	2,425	
東京テアトル	29	28	3,920	
タナベ経営	—	1.5	2,089	
ナガワ	1.4	1.3	5,284	
よみうりランド	16	15	6,720	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	
東京都競馬	52	50	12,250	
カナモト	10.7	10.2	30,600	
東京ドーム	62	29.2	29,141	
西尾レントオール	6.2	5.9	18,319	
トランス・コスモス	8.9	8.4	20,353	
乃村工藝社	16.3	15.6	36,488	
藤田観光	29	24	8,568	
KNT-CTホールディングス	37	41	5,822	
日本管財	6.6	6.2	11,643	
トーカイ	3.4	3.2	13,760	
白洋舎	10	0.8	2,412	
セコム	79.4	75.6	615,762	
セントラル警備保障	3.4	3.3	6,138	
丹青社	14.3	12.6	14,011	
メイテック	9.5	8.4	39,396	
アサツー ディ・ケイ	13.4	11.8	32,072	
応用地質	7.9	6.9	10,239	
船井総研ホールディングス	10.6	9.2	23,506	
進学会	3.7	3.1	1,785	
オオバ	5.7	6	3,024	
いであ	—	1.4	1,629	
学究社	1.4	2	3,008	
ベネッセホールディングス	25.6	24.4	99,918	
イオンディライト	7.4	8.2	29,151	
ナック	5.1	4.6	4,503	
ニチイ学館	13.9	12.8	13,568	
ダイセキ	14.4	12.7	30,073	
ステップ	2.7	2.5	3,615	
合 計	株数・金額 銘柄数<比率>	120,967 1,905	104,942 1,967	159,491,000 <98.2%>

(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	2,936	—

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	159,491,000	97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,967,219	2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	163,458,219	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 2017年5月29日現在
(A) 資 産	163,451,917,414円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,455,460,039
株 式(評価額)	159,491,000,360
未 収 入 金	72,555,360
未 収 配 当 金	1,380,622,855
差 入 委 託 証 拠 金	52,278,800
(B) 負 債	1,011,232,116
未 払 金	901,612,940
未 払 解 約 金	109,613,189
未 払 利 息	5,987
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	162,440,685,298
元 本	117,609,049,928
次 期 繰 越 損 益 金	44,831,635,370
(D) 受 益 権 総 口 数	117,609,049,928口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,812円

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2016年5月31日 至 2017年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	3,336,586,787円
受 取 配 当 金	3,335,725,896
受 取 利 息	3,278
そ の 他 収 益 金	1,978,131
支 払 利 息	△1,120,518
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	22,310,321,725
売 買 益	25,745,845,270
売 買 損	△3,435,523,545
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	366,160,780
取 引 益	660,715,740
取 引 損	△294,554,960
(D) そ の 他 費 用	△66,202
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	26,013,003,090
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	22,544,640,558
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,744,548,770
(H) 解 約 差 損 益 金	△7,470,557,048
(I) 計 (E+F+G+H)	44,831,635,370
次 期 繰 越 損 益 金(I)	44,831,635,370

(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128,457,920,792円、期中追加設定元本額は17,732,358,198円、期中一部解約元本額は28,581,229,062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マイセクション50	16,811,893,795円
DCマイセクション75	15,529,920,865円
日本株式インデックス・オープン	9,693,935,710円
SMT TOPIXインデックス・オープン	8,142,871,783円
DCマイセクションS50	6,687,287,094円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	5,726,309,975円
DCマイセクション25	5,551,167,652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)	5,231,671,241円
DC日本株式インデックス・オープン	4,911,146,813円
DCマイセクションS75	4,326,872,130円
DC日本株式インデックス・オープンS	4,117,669,404円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,985,109,777円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,835,396,401円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,692,283,342円
DCマイセクションS25	2,276,716,529円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,224,613,674円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,573,293,713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)	1,362,407,617円
世界経済インデックスファンド	1,190,474,094円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,143,015,987円
DC世界経済インデックスファンド	1,142,025,115円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,022,027,489円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	897,923,057円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	891,829,193円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	866,558,083円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	825,534,512円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	750,845,593円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	638,800,855円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	574,204,997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)	567,669,371円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	433,367,528円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	331,404,641円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	315,554,301円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	225,629,401円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	203,550,715円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	202,152,001円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	118,321,687円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	110,276,396円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	100,111,813円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	95,154,833円
SMT インデックスバランス・オープン	90,625,183円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	68,798,358円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	51,896,937円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	28,707,607円
SBI資産設計オープン(分配型)	26,811,146円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	12,404,766円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,806,754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17期（決算日 2017年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 組入比率	純資産額
	騰落率	中率	騰落率	中率		
	円	%		%	%	百万円
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
第17期(2017年5月29日)	26,633	0.2	440.540	0.9	97.3	219,477

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 組入比率	債券先物率 比
	騰落率	中率	騰落率	中率		
(当期首) 2016年 5月30日	円	%		%	%	%
	26,579	—	436.679	—	97.9	0.9
5月末	26,669	0.3	441.613	1.1	97.8	0.9
6月末	25,170	△5.3	415.449	△4.9	97.7	1.0
7月末	25,609	△3.6	425.076	△2.7	97.9	0.8
8月末	25,406	△4.4	419.023	△4.0	98.1	0.7
9月末	24,925	△6.2	414.999	△5.0	98.5	0.5
10月末	24,972	△6.0	414.548	△5.1	98.2	0.6
11月末	25,988	△2.2	431.000	△1.3	97.7	0.9
12月末	26,786	0.8	442.149	1.3	97.9	0.8
2017年 1月末	26,136	△1.7	432.597	△0.9	98.9	0.1
2月末	26,014	△2.1	429.599	△1.6	98.4	0.4
3月末	26,009	△2.1	428.190	△1.9	98.0	0.8
4月末	26,179	△1.5	432.744	△0.9	98.3	0.6
(当期末) 2017年 5月29日	26,633	0.2	440.540	0.9	97.3	1.4

(注1)騰落率は期首比です。

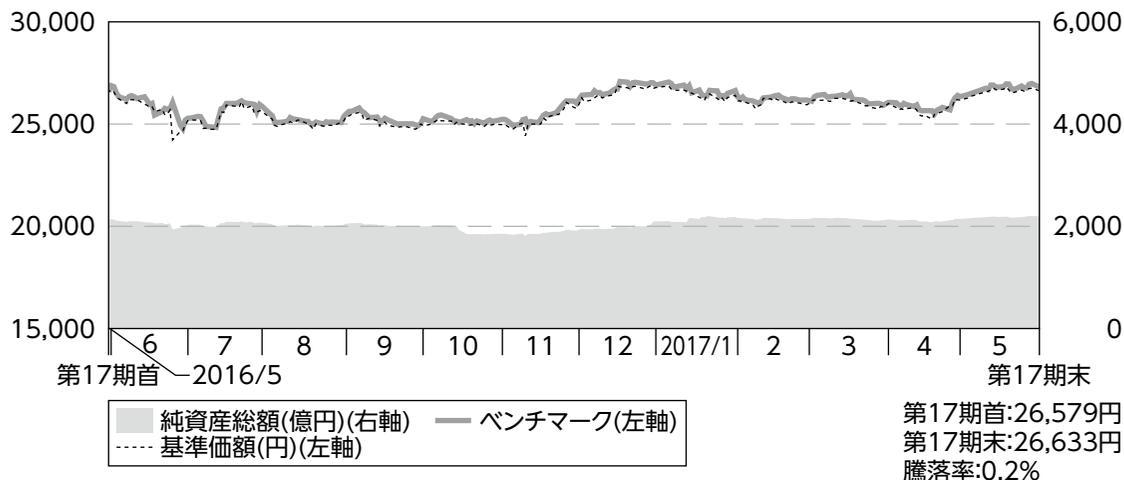
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、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

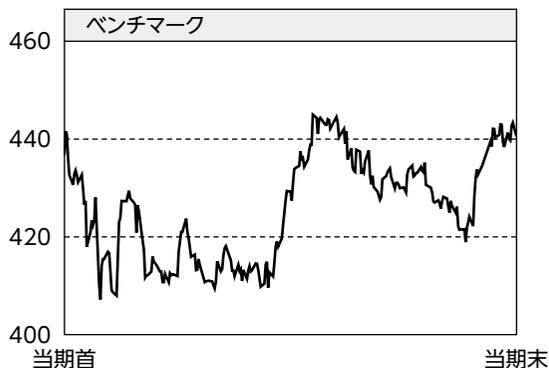


(注)ベンチマークは、2016年5月30日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

基準価額は、6月下旬に英国のEU(欧州連合)離脱の是非を問う国民投票の結果が大方の予想に反してEU離脱派の勝利となったことなどから、金利は低下(債券価格は上昇)したものの、外国為替市場で円高が進み、下落しました。その後、基準価額ともみ合い推移となりましたが、11月から12月にかけて、米国トランプ政権下での経済政策への期待や米国の利上げ観測の強まりなどを背景に金利が上昇(債券価格は下落)したものの、円安推移により、基準価額は上昇しました。4月中旬にかけては、米国トランプ政権の政策不透明感の高まりやフランス大統領選挙などを巡る欧州政治リスクへの警戒感から円高となり、基準価額は下落しました。4月中旬以降期末にかけては、フランス大統領選挙の結果や米国の利上げ期待が高まったことを背景に一時円高から円安方向に反転したことや、トランプ大統領を巡る米国の政情不安から金利が低下したことから、基準価額は上昇に転じました。

## 投資環境



主要国の長期金利は、7月上旬にかけて、英国でのEU離脱の是非を問う国民投票の予想外の結果を受けて低下しました。その後12月にかけて、米国の早期利上げ観測が強まったことや米国の経済政策への期待から長期金利は上昇しましたが、2017年3月以降は、米国の政策不透明感や地政学リスクの強まりなどを受けて低下しました。

外国為替市場では、9月にかけて、日銀による政策期待の後退などから主要通貨に対して円高となりました。11月以降に、米国の経済政策への期待から円安となりましたが、2017年1月から期末にかけては、米国の政策不透明感や地政学リスクの強まりなどから円高となりました。

## 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。当期末時点では全てのベンチマーク対象国に分散投資を図りました。

## 当ファンドの組入資産の内容

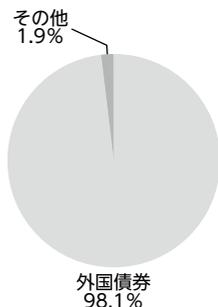
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	T 2.5% 02/15/46	アメリカ	0.8%
2	T 2.875% 05/15/43	アメリカ	0.7%
3	T 1.5% 08/15/26	アメリカ	0.6%
4	T 2% 08/15/25	アメリカ	0.6%
5	T 2.625% 11/15/20	アメリカ	0.6%
6	T 2.25% 11/15/24	アメリカ	0.5%

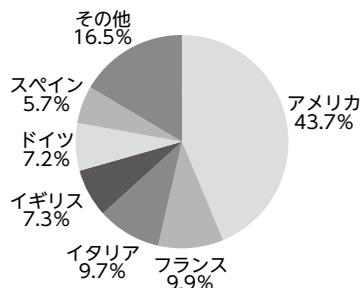
順位	銘柄名	国	組入比率
7	T 0.875% 07/15/18	アメリカ	0.5%
8	T 0.625% 04/30/18	アメリカ	0.5%
9	T 2.875% 08/15/45	アメリカ	0.5%
10	T 1.25% 03/31/21	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		661	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

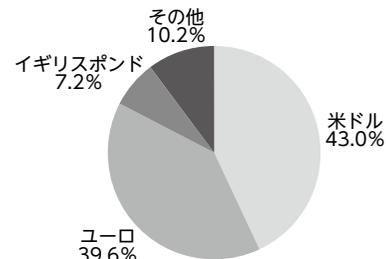
### ○資産別配分



### ○国別配分



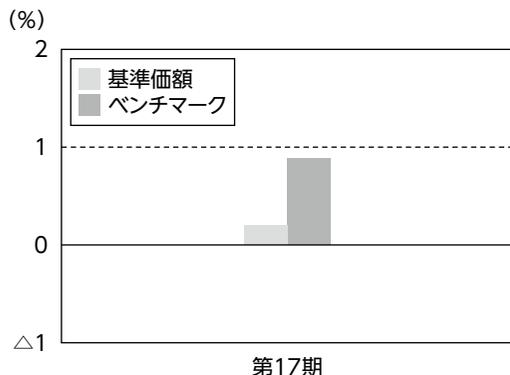
### ○通貨別配分



(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
	(2016年5月31日~2017年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	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
(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)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(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)	(-)	(-)	
(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)	(-)	(-)	
(c) その他費用	6	0.025	(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)	(6)	(0.025)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	6	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(25,821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 272,081	千米ドル 222,614
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 21,092	千カナダドル 17,120
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 84,659	千メキシコペソ 70,600
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 33,380	千ユーロ 31,938
	イ タ リ ア	国 債 証 券	44,958	38,678
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	40,025	30,444
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	10,667	11,975
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	24,905	19,931
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	10,635	9,824
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	6,191	5,774
国	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	1,924	1,468
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	2,831	2,209
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 20,799	千イギリスポンド 22,522
	ス イ ス	国 債 証 券	千スイスフラン 962	千スイスフラン 2,513
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 15,274	千スウェーデンクローナ 17,015
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 10,840	千ノルウェークローネ 12,186
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 17,272	千デンマーククローネ 22,038
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 15,607	千ポーランドズロチ 11,048
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 18,284	千オーストラリアドル 9,721
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 3,095	千シンガポールドル 2,041
マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 8,694	千マレーシアリンギット 9,538	
南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカランド 29,635	千南アフリカランド 18,688	

(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 26,185	百万円 24,949	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 31,008	百万円 68	% 0.2	百万円 25,239	百万円 676	% 2.7
金 銭 信 託	15,414	15,414	100.0	15,631	15,631	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	474,993	95,909	20.2	473,231	94,911	20.1

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

## 組入資産の明細

## &lt;外国(外貨建)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 829,790	千米ドル 840,892	千円 93,625,022	% 42.7	% —	% 17.4	% 17.8	% 7.4
カ ナ ダ	千カナダドル 49,510	千カナダドル 54,417	4,499,746	2.1	—	0.9	0.7	0.4
メ キ シ コ	千メキシコペソ 308,800	千メキシコペソ 318,224	1,915,711	0.9	—	0.5	0.2	0.1
ド イ ツ	千ユーロ 103,480	千ユーロ 123,099	15,301,237	7.0	—	4.1	1.9	0.9
イ タ リ ア	145,830	166,531	20,699,819	9.4	—	5.5	2.8	1.2
フ ラ ン ス	144,910	170,612	21,207,142	9.7	—	6.0	2.6	1.1
オ ラ ン ダ	32,250	38,142	4,741,099	2.2	—	1.4	0.5	0.2
ス ペ イ ン	83,110	97,031	12,060,960	5.5	—	3.3	1.6	0.6
ベルギー	35,630	43,570	5,415,855	2.5	—	1.8	0.5	0.2
オーストリア	21,810	25,898	3,219,205	1.5	—	0.9	0.4	0.1
フィンランド	9,610	10,678	1,327,289	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	12,320	14,093	1,751,825	0.8	—	0.4	0.3	0.1
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 85,080	千イギリスポンド 109,213	15,584,717	7.1	—	5.2	1.5	0.4
ス イ ス	千スイスフラン 2,990	千スイスフラン 3,587	409,585	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 65,600	千スウェーデンクローナ 75,582	967,458	0.4	—	0.3	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 42,970	千ノルウェークローネ 46,068	610,869	0.3	—	0.1	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 63,250	千デンマーククローネ 78,253	1,306,826	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 46,550	千ポーランドズロチ 47,551	1,413,224	0.6	—	0.3	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 50,270	千オーストラリアドル 54,655	4,528,794	2.1	—	1.3	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 9,850	千シンガポールドル 10,414	838,282	0.4	—	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 34,720	千マレーシアリンギット 34,902	910,251	0.4	—	0.3	0.1	0.0
南アフリカ	千南アフリカランド 149,820	千南アフリカランド 140,444	1,219,055	0.6	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	213,553,982	97.3	—	51.3	32.7	13.3

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	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 0.625% 04/30/18	0.625	10,000	9,949	1,107,777	2018/4/30
T 0.75% 10/31/18	0.75	3,300	3,277	364,961	2018/10/31
T 0.875% 07/15/18	0.875	10,000	9,964	1,109,460	2018/7/15
T 0.875% 07/31/19	0.875	5,500	5,447	606,569	2019/7/31
T 0.875% 10/15/18	0.875	4,000	3,981	443,271	2018/10/15
T 1% 05/15/18	1.0	5,550	5,540	616,900	2018/5/15
T 1% 05/31/18	1.0	5,000	4,990	553,697	2018/5/31
T 1% 06/30/19	1.0	9,000	8,944	995,831	2019/6/30
T 1% 08/31/19	1.0	7,500	7,444	828,901	2019/8/31
T 1% 09/15/18	1.0	5,200	5,185	577,365	2018/9/15
T 1% 09/30/19	1.0	4,000	3,969	441,911	2019/9/30
T 1% 11/30/18	1.0	5,200	5,181	576,956	2018/11/30
T 1% 11/30/19	1.0	6,300	6,243	695,122	2019/11/30
T 1.125% 01/15/19	1.125	5,800	5,787	644,430	2019/1/15
T 1.125% 01/31/19	1.125	2,850	2,843	316,614	2019/1/31
T 1.125% 04/30/20	1.125	4,000	3,963	441,349	2020/4/30
T 1.125% 06/15/18	1.125	3,000	2,998	333,819	2018/6/15
T 1.125% 06/30/21	1.125	9,800	9,582	1,066,968	2021/6/30
T 1.125% 07/31/21	1.125	5,000	4,884	543,818	2021/7/31
T 1.125% 12/31/19	1.125	7,050	7,003	779,798	2019/12/31
T 1.25% 01/31/19	1.25	900	899	100,187	2019/1/31
T 1.25% 01/31/20	1.25	1,320	1,314	146,380	2020/1/31
T 1.25% 02/29/20	1.25	3,400	3,384	376,862	2020/2/29
T 1.25% 03/31/21	1.25	10,000	9,853	1,097,048	2021/3/31
T 1.25% 07/31/23	1.25	4,550	4,358	485,322	2023/7/31
T 1.25% 10/31/18	1.25	6,500	6,502	723,975	2018/10/31
T 1.25% 10/31/19	1.25	5,500	5,486	610,863	2019/10/31
T 1.25% 11/30/18	1.25	6,550	6,550	729,330	2018/11/30
T 1.25% 12/15/18	1.25	2,520	2,520	280,592	2018/12/15
T 1.375% 01/15/20	1.375	5,000	4,997	556,422	2020/1/15
T 1.375% 01/31/20	1.375	5,000	4,996	556,308	2020/1/31
T 1.375% 01/31/21	1.375	4,800	4,758	529,849	2021/1/31
T 1.375% 02/28/19	1.375	2,100	2,103	234,227	2019/2/28
T 1.375% 02/29/20	1.375	5,000	4,993	555,991	2020/2/29
T 1.375% 03/31/20	1.375	4,880	4,872	542,524	2020/3/31
T 1.375% 04/30/20	1.375	1,000	997	111,097	2020/4/30
T 1.375% 04/30/21	1.375	9,500	9,398	1,046,471	2021/4/30
T 1.375% 05/31/20	1.375	1,550	1,545	172,060	2020/5/31
T 1.375% 06/30/18	1.375	2,200	2,204	245,413	2018/6/30
T 1.375% 06/30/23	1.375	5,000	4,831	537,900	2023/6/30
T 1.375% 07/31/18	1.375	4,000	4,008	446,261	2018/7/31
T 1.375% 08/31/23	1.375	2,500	2,410	268,396	2023/8/31
T 1.375% 09/30/18	1.375	3,900	3,907	435,113	2018/9/30
T 1.375% 09/30/20	1.375	4,000	3,977	442,866	2020/9/30
T 1.375% 09/30/23	1.375	8,000	7,705	857,914	2023/9/30
T 1.375% 10/31/20	1.375	6,000	5,961	663,798	2020/10/31
T 1.375% 12/15/19	1.375	7,650	7,648	851,588	2019/12/15
T 1.375% 12/31/18	1.375	3,000	3,005	334,635	2018/12/31
T 1.5% 01/31/19	1.5	2,000	2,007	223,556	2019/1/31
T 1.5% 01/31/22	1.5	4,500	4,445	494,915	2022/1/31
T 1.5% 02/28/19	1.5	2,000	2,007	223,550	2019/2/28
T 1.5% 02/28/23	1.5	2,400	2,344	261,043	2023/2/28
T 1.5% 03/31/19	1.5	4,400	4,418	491,931	2019/3/31
T 1.5% 03/31/23	1.5	4,000	3,903	434,644	2023/3/31
T 1.5% 05/31/19	1.5	3,250	3,262	363,287	2019/5/31
T 1.5% 08/15/26	1.5	13,200	12,394	1,379,957	2026/8/15
T 1.5% 08/31/18	1.5	5,800	5,820	648,095	2018/8/31
T 1.5% 10/31/19	1.5	3,550	3,561	396,561	2019/10/31
T 1.5% 11/30/19	1.5	5,000	5,015	558,419	2019/11/30

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 1.5% 12/31/18	1.5	2,550	2,559	285,009	2018/12/31
T 1.625% 02/15/26	1.625	8,100	7,724	860,000	2026/2/15
T 1.625% 03/31/19	1.625	3,000	3,018	336,121	2019/3/31
T 1.625% 04/30/19	1.625	5,000	5,032	560,299	2019/4/30
T 1.625% 05/15/26	1.625	8,270	7,869	876,244	2026/5/15
T 1.625% 05/31/23	1.625	4,906	4,906	546,139	2023/5/31
T 1.625% 06/30/20	1.625	3,000	3,011	335,317	2020/6/30
T 1.625% 07/31/20	1.625	5,000	5,017	558,668	2020/7/31
T 1.625% 08/15/22	1.625	4,500	4,451	495,662	2022/8/15
T 1.625% 08/31/19	1.625	7,500	7,549	840,531	2019/8/31
T 1.625% 10/31/23	1.625	9,000	8,798	979,643	2023/10/31
T 1.625% 11/15/22	1.625	7,150	7,055	785,578	2022/11/15
T 1.625% 11/30/20	1.625	3,050	3,054	340,104	2020/11/30
T 1.75% 01/31/23	1.75	7,550	7,483	833,249	2023/1/31
T 1.75% 02/28/22	1.75	2,500	2,496	277,941	2022/2/28
T 1.75% 03/31/22	1.75	9,550	9,300	1,061,092	2022/3/31
T 1.75% 04/30/22	1.75	5,750	5,736	638,646	2022/4/30
T 1.75% 05/15/22	1.75	3,800	3,791	422,175	2022/5/15
T 1.75% 05/15/23	1.75	7,000	6,920	770,527	2023/5/15
T 1.75% 09/30/19	1.75	5,000	5,046	561,896	2019/9/30
T 1.75% 09/30/22	1.75	2,000	1,988	221,404	2022/9/30
T 1.75% 10/31/20	1.75	4,000	4,025	448,180	2020/10/31
T 1.75% 12/31/20	1.75	8,200	8,242	917,767	2020/12/31
T 1.875% 02/28/22	1.875	2,500	2,511	279,676	2022/2/28
T 1.875% 06/30/20	1.875	5,200	5,261	585,799	2020/6/30
T 1.875% 08/31/22	1.875	4,000	4,005	446,012	2022/8/31
T 1.875% 10/31/22	1.875	3,150	3,150	350,764	2022/10/31
T 1.875% 11/30/21	1.875	5,400	5,429	604,553	2021/11/30
T 2% 02/15/22	2.0	2,500	2,526	281,356	2022/2/15
T 2% 02/15/23	2.0	2,600	2,611	290,805	2023/2/15
T 2% 02/15/25	2.0	8,400	8,317	926,070	2025/2/15
T 2% 02/28/21	2.0	4,000	4,055	451,534	2021/2/28
T 2% 05/31/21	2.0	3,800	3,848	428,526	2021/5/31
T 2% 07/31/20	2.0	5,200	5,278	587,690	2020/7/31
T 2% 07/31/22	2.0	3,000	3,023	336,679	2022/7/31
T 2% 08/15/25	2.0	12,300	12,136	1,351,231	2025/8/15
T 2% 08/31/21	2.0	6,800	6,879	765,493	2021/8/31
T 2% 09/30/20	2.0	5,000	5,073	564,929	2020/9/30
T 2% 10/31/21	2.0	400	404	45,029	2021/10/31
T 2% 11/15/21	2.0	2,400	2,427	270,301	2021/11/15
T 2% 11/15/26	2.0	1,300	1,272	141,707	2026/11/15
T 2% 11/30/20	2.0	5,500	5,577	621,043	2020/11/30
T 2% 11/30/22	2.0	2,000	2,011	224,009	2022/11/30
T 2% 12/31/21	2.0	2,200	2,223	247,527	2021/12/31
T 2.125% 01/31/21	2.125	3,000	3,054	340,088	2021/1/31
T 2.125% 03/31/24	2.125	7,400	7,436	827,989	2024/3/31
T 2.125% 05/15/25	2.125	8,700	8,680	966,441	2025/5/15
T 2.125% 06/30/21	2.125	7,500	7,628	849,407	2021/6/30
T 2.125% 06/30/22	2.125	3,500	3,550	395,347	2022/6/30
T 2.125% 08/15/21	2.125	6,100	6,205	690,908	2021/8/15
T 2.125% 08/31/20	2.125	6,500	6,622	737,388	2020/8/31
T 2.125% 09/30/21	2.125	2,000	2,033	226,408	2021/9/30
T 2.125% 11/30/23	2.125	2,000	2,024	224,329	2023/11/30
T 2.125% 12/31/21	2.125	4,500	4,572	509,069	2021/12/31
T 2.25% 02/15/27	2.25	2,500	2,499	278,243	2027/2/15
T 2.25% 03/31/21	2.25	3,050	3,118	347,246	2021/3/31
T 2.25% 04/30/21	2.25	3,500	3,578	398,413	2021/4/30
T 2.25% 07/31/18	2.25	5,300	5,364	597,239	2018/7/31
T 2.25% 07/31/21	2.25	3,000	3,065	341,364	2021/7/31
T 2.25% 08/15/46	2.25	2,700	2,338	260,386	2046/8/15
T 2.25% 11/15/24	2.25	10,150	10,246	1,140,889	2024/11/15

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	邦貨換算金額 (千円)		
T 2.25% 11/15/25	2.25	2,900	2,912	324,248	2025/11/15	
T 2.25% 12/31/23	2.25	2,000	2,028	225,847	2023/12/31	
T 2.375% 05/31/18	2.375	4,000	4,046	450,582	2018/5/31	
T 2.375% 08/15/24	2.375	8,500	8,667	964,985	2024/8/15	
T 2.375% 12/31/20	2.375	2,300	2,362	263,076	2020/12/31	
T 2.5% 02/15/45	2.5	6,300	5,794	645,186	2045/2/15	
T 2.5% 02/15/46	2.5	17,550	16,092	1,791,745	2046/2/15	
T 2.5% 05/15/24	2.5	8,400	8,642	962,310	2024/5/15	
T 2.5% 05/15/46	2.5	1,050	962	107,123	2046/5/15	
T 2.5% 08/15/23	2.5	4,550	4,688	522,014	2023/8/15	
T 2.625% 04/30/18	2.625	5,000	5,065	564,011	2018/4/30	
T 2.625% 08/15/20	2.625	5,500	5,690	633,586	2020/8/15	
T 2.625% 11/15/20	2.625	11,000	11,387	1,267,926	2020/11/15	
T 2.75% 02/15/19	2.75	4,600	4,716	525,087	2019/2/15	
T 2.75% 02/15/24	2.75	3,000	3,136	349,204	2024/2/15	
T 2.75% 08/15/42	2.75	3,000	2,926	325,890	2042/8/15	
T 2.75% 11/15/23	2.75	6,900	7,213	803,145	2023/11/15	
T 2.75% 11/15/42	2.75	4,200	4,092	455,672	2042/11/15	
T 2.875% 05/15/43	2.875	14,150	14,091	1,568,984	2043/5/15	
T 2.875% 08/15/45	2.875	9,900	9,816	1,092,946	2045/8/15	
T 3% 05/15/42	3.0	3,950	4,037	449,510	2042/5/15	
T 3% 05/15/45	3.0	3,500	3,558	396,206	2045/5/15	
T 3% 11/15/44	3.0	2,300	2,341	260,689	2044/11/15	
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,600	1,673	186,357	2042/2/15	
T 3.125% 02/15/43	3.125	1,000	1,042	116,089	2043/2/15	
T 3.125% 05/15/19	3.125	5,000	5,177	576,438	2019/5/15	
T 3.125% 05/15/21	3.125	5,300	5,596	623,078	2021/5/15	
T 3.125% 08/15/44	3.125	6,500	6,776	754,481	2044/8/15	
T 3.125% 11/15/41	3.125	2,400	2,512	279,692	2041/11/15	
T 3.375% 05/15/44	3.375	5,610	6,117	681,135	2044/5/15	
T 3.375% 11/15/19	3.375	8,750	9,175	1,021,616	2019/11/15	
T 3.5% 02/15/39	3.5	3,000	3,367	374,922	2039/2/15	
T 3.625% 02/15/20	3.625	7,000	7,411	825,189	2020/2/15	
T 3.625% 02/15/21	3.625	5,500	5,898	656,792	2021/2/15	
T 3.625% 02/15/44	3.625	5,000	5,689	633,428	2044/2/15	
T 3.625% 08/15/19	3.625	2,700	2,835	315,657	2019/8/15	
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,000	2,272	253,020	2043/8/15	
T 3.75% 08/15/41	3.75	3,900	4,519	503,191	2041/8/15	
T 3.75% 11/15/18	3.75	5,000	5,181	576,876	2018/11/15	
T 3.75% 11/15/43	3.75	2,300	2,670	297,304	2043/11/15	
T 3.875% 08/15/40	3.875	1,650	1,946	216,756	2040/8/15	
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	1,120	124,727	2039/5/15	
T 4.25% 11/15/40	4.25	1,450	1,806	201,107	2040/11/15	
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	1,269	141,346	2038/2/15	
T 4.375% 05/15/40	4.375	1,900	2,405	267,859	2040/5/15	
T 4.375% 05/15/41	4.375	1,500	1,904	212,083	2041/5/15	
T 4.375% 11/15/39	4.375	2,700	3,416	380,415	2039/11/15	
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,840	2,367	263,552	2036/2/15	
T 4.5% 05/15/38	4.5	1,000	1,290	143,719	2038/5/15	
T 4.5% 08/15/39	4.5	250	321	35,813	2039/8/15	
T 4.625% 02/15/40	4.625	3,900	5,106	568,552	2040/2/15	
T 5.0% 05/15/37	5.0	1,100	1,504	167,519	2037/5/15	
T 5.25% 02/15/29	5.25	400	518	57,743	2029/2/15	
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,679	187,000	2028/11/15	
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,600	2,161	240,628	2031/2/15	
T 5.5% 08/15/28	5.5	1,200	1,574	175,349	2028/8/15	
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	2,216	246,730	2026/2/15	
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,450	1,968	219,161	2027/11/15	
T 6.25% 05/15/30	6.25	400	572	63,785	2030/5/15	
T 6.25% 08/15/23	6.25	1,650	2,066	230,049	2023/8/15	
T 8.0% 11/15/21	8.0	1,700	2,156	240,080	2021/11/15	
T 8.125% 08/15/19	8.125	2,100	2,409	268,328	2019/8/15	
小 計				93,625,022		

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	邦貨換算金額 (千円)		
<b>(カナダ)</b>			千カナダドル	千カナダドル		
<b>国債証券</b>						
CAN 0.25% 05/01/18	0.25	3,650	3,636	300,736	2018/5/1	
CAN 0.5% 02/01/19	0.5	920	917	75,844	2019/2/1	
CAN 0.5% 03/01/22	0.5	3,100	3,032	250,786	2022/3/1	
CAN 0.5% 11/01/18	0.5	1,500	1,496	123,731	2018/11/1	
CAN 0.75% 03/01/21	0.75	1,250	1,244	102,384	2021/3/1	
CAN 0.75% 09/01/20	0.75	1,350	1,346	111,864	2020/9/1	
CAN 0.75% 09/01/21	0.75	1,730	1,718	142,101	2021/9/1	
CAN 1% 06/01/27	1.0	1,150	1,102	91,171	2027/6/1	
CAN 1.25% 09/01/18	1.25	500	503	41,650	2018/9/1	
CAN 1.5% 03/01/20	1.5	2,600	2,651	219,240	2020/3/1	
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,750	1,792	148,255	2023/6/1	
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	1,480	1,500	124,111	2026/6/1	
CAN 1.75% 03/01/19	1.75	1,400	1,425	117,908	2019/3/1	
CAN 1.75% 09/01/19	1.75	2,250	2,301	190,284	2019/9/1	
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,550	1,668	137,961	2025/6/1	
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,850	2,015	166,698	2024/6/1	
CAN 2.75% 06/01/22	2.75	2,550	2,768	228,934	2022/6/1	
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,450	1,676	138,604	2048/12/1	
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	420	510	42,223	2064/12/1	
CAN 3.25% 06/01/21	3.25	1,690	1,847	152,732	2021/6/1	
CAN 3.5% 06/01/20	3.5	1,800	1,944	160,788	2020/6/1	
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	1,970	2,555	211,295	2045/12/1	
CAN 3.75% 06/01/19	3.75	3,200	3,392	280,558	2019/6/1	
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	1,890	2,568	212,403	2041/6/1	
CAN 4.25% 06/01/18	4.25	2,100	2,175	179,915	2018/6/1	
CAN 5% 06/01/37	5.0	1,600	2,383	197,121	2037/6/1	
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,200	1,738	143,728	2029/6/1	
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	1,250	1,919	158,758	2033/6/1	
CAN 8.0% 06/01/27	8.0	360	579	47,951	2027/6/1	
小 計				4,499,746		
<b>(メキシコ)</b>			千メキシコペソ	千メキシコペソ		
<b>国債証券</b>						
MBONO 10% 11/20/36	10.0	10,650	13,351	80,375	2036/11/20	
MBONO 10% 12/05/24	10.0	30,950	35,855	215,848	2024/12/5	
MBONO 4.75% 06/14/18	4.75	22,400	21,877	131,701	2018/6/14	
MBONO 5% 12/11/19	5.0	31,100	29,539	177,828	2019/12/11	
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	10,350	9,321	56,115	2026/3/5	
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	11,800	11,432	68,822	2022/6/9	
MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	37,300	36,361	218,895	2021/6/10	
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	14,700	14,899	89,693	2027/6/3	
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	17,100	17,619	106,066	2031/5/29	
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	14,550	14,867	89,502	2042/11/13	
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	4,150	4,268	25,694	2034/11/23	
MBONO 8% 06/11/20	8.0	21,150	21,606	130,073	2020/6/11	
MBONO 8% 11/07/47	8.0	4,750	4,991	30,047	2047/11/7	
MBONO 8% 12/07/23	8.0	20,450	21,252	127,941	2023/12/7	
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	15,600	17,016	102,436	2029/5/31	
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	16,500	18,175	109,417	2038/11/18	
MBONO 8.5% 12/13/18	8.5	25,300	25,789	155,250	2018/12/13	
小 計				1,915,711		
<b>(ドイツ)</b>			千ユーロ	千ユーロ		
<b>国債証券</b>						
DBR 0% 08/15/26	—	2,100	2,052	255,109	2026/8/15	
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	1,550	1,538	191,246	2027/2/15	
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	2,400	2,491	309,638	2025/2/15	
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	4,450	4,581	569,521	2026/2/15	
DBR 1% 08/15/24	1.0	1,680	1,809	224,901	2024/8/15	
DBR 1% 08/15/25	1.0	2,450	2,635	327,547	2025/8/15	
DBR 1.5% 02/15/23	1.5	2,000	2,203	273,896	2023/2/15	
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	2,950	3,258	405,027	2023/5/15	
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	3,390	3,769	468,562	2024/5/15	

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)	
DBR 1.5% 09/04/22	1.5	1,450	1,591	197,871	2022/9/4
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,300	1,465	182,204	2022/2/15
DBR 1.75% 07/04/22	1.75	4,000	4,436	551,444	2024/7/4
DBR 2% 01/04/22	2.0	3,150	3,510	436,386	2022/1/4
DBR 2% 08/15/23	2.0	2,100	2,389	297,046	2023/8/15
DBR 2.25% 09/04/20	2.25	2,500	2,736	340,139	2020/9/4
DBR 2.25% 09/04/21	2.25	2,000	2,238	278,200	2021/9/4
DBR 2.5% 01/04/21	2.5	3,050	3,393	421,784	2021/1/4
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	2,450	3,235	402,208	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	2,500	3,331	414,145	2046/8/15
DBR 3% 07/04/20	3.0	3,500	3,899	484,700	2020/7/4
DBR 3.25% 01/04/20	3.25	3,000	3,310	411,528	2020/1/4
DBR 3.25% 07/04/21	3.25	3,400	3,934	489,028	2021/7/4
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	1,850	2,743	341,077	2042/7/4
DBR 3.5% 07/04/19	3.5	4,400	4,789	595,357	2019/7/4
DBR 3.75% 01/04/19	3.75	4,150	4,450	553,199	2019/1/4
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,850	4,454	553,751	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/18	4.25	6,050	6,384	793,620	2018/7/4
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	1,650	2,739	340,462	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	1,740	2,555	317,702	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	2,330	3,823	475,322	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	2,000	3,565	443,131	2040/7/4
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	2,200	3,614	449,260	2031/1/4
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	1,550	2,396	297,846	2028/1/4
DBR 6.25% 01/04/24	6.25	1,600	2,279	283,323	2024/1/4
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,050	1,784	221,845	2030/1/4
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	1,200	1,937	240,806	2027/7/4
OBL 0% 04/17/20	—	1,600	1,630	202,707	2020/4/17
OBL 0% 10/08/21	—	2,350	2,400	298,372	2021/10/8
OBL 0.25% 10/11/19	0.25	1,150	1,175	146,123	2019/10/11
OBL 0.25% 10/16/20	0.25	1,350	1,389	172,671	2020/10/16
OBL 0.5% 04/12/19	0.5	1,440	1,473	183,124	2019/4/12
OBL 1% 02/22/19	1.0	1,450	1,493	185,676	2019/2/22
OBL 1% 10/12/18	1.0	2,150	2,202	273,710	2018/10/12
<b>(イタリア)</b>					
<b>国債証券</b>					
BTFS 0.1% 04/15/19	0.1	1,000	1,003	124,751	2019/4/15
BTFS 0.25% 05/15/18	0.25	1,500	1,508	187,484	2018/5/15
BTFS 0.3% 10/15/18	0.3	1,000	1,006	125,153	2018/10/15
BTFS 0.35% 11/01/21	0.35	3,800	3,756	466,877	2021/11/1
BTFS 0.45% 06/01/21	0.45	1,400	1,399	173,985	2021/6/1
BTFS 0.65% 10/15/23	0.65	1,300	1,251	155,521	2023/10/15
BTFS 0.65% 11/01/20	0.65	3,900	3,947	490,652	2020/11/1
BTFS 0.95% 03/15/23	0.95	1,500	1,488	185,033	2023/3/15
BTFS 1.05% 12/01/19	1.05	4,350	4,450	553,227	2019/12/1
BTFS 1.25% 12/01/26	1.25	1,350	1,271	158,063	2026/12/1
BTFS 1.35% 04/15/22	1.35	650	666	82,849	2022/4/15
BTFS 1.5% 06/01/25	1.5	1,600	1,576	195,896	2025/6/1
BTFS 1.5% 08/01/19	1.5	2,400	2,477	307,960	2019/8/1
BTFS 1.6% 06/01/26	1.6	1,600	1,561	194,047	2026/6/1
BTFS 1.65% 03/01/32	1.65	2,100	1,908	237,216	2032/3/1
BTFS 2% 12/01/25	2.0	3,300	3,350	416,486	2025/12/1
BTFS 2.15% 12/15/21	2.15	2,500	2,666	331,393	2021/12/15
BTFS 2.2% 06/01/27	2.2	200	202	25,121	2027/6/1
BTFS 2.25% 09/01/36	2.25	1,550	1,446	179,817	2036/9/1
BTFS 2.5% 05/01/19	2.5	2,500	2,623	326,076	2019/5/1
BTFS 2.5% 12/01/24	2.5	2,450	2,603	323,612	2024/12/1
BTFS 2.7% 03/01/47	2.7	2,220	2,023	251,520	2047/3/1
BTFS 2.8% 03/01/67	2.8	550	469	58,299	2067/3/1
BTFS 3.25% 09/01/46	3.25	1,550	1,582	196,737	2046/9/1
BTFS 3.5% 03/01/30	3.5	2,760	3,107	386,285	2030/3/1
BTFS 3.5% 06/01/18	3.5	2,700	2,802	348,349	2018/6/1
BTFS 3.5% 12/01/18	3.5	800	843	104,897	2018/12/1

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
BTFS 3.75% 03/01/21	3.75	3,250	3,658	454,740	2021/3/1
BTFS 3.75% 05/01/21	3.75	1,550	1,747	217,270	2021/5/1
BTFS 3.75% 08/01/21	3.75	4,000	4,532	563,332	2021/8/1
BTFS 3.75% 09/01/24	3.75	1,800	2,069	257,226	2024/9/1
BTFS 4% 02/01/37	4.0	3,300	3,912	486,302	2037/2/1
BTFS 4% 09/01/20	4.0	3,550	3,978	494,510	2020/9/1
BTFS 4.25% 02/01/19	4.25	3,800	4,076	506,731	2019/2/1
BTFS 4.25% 03/01/20	4.25	4,500	5,002	621,767	2020/3/1
BTFS 4.25% 09/01/19	4.25	2,650	2,901	360,690	2019/9/1
BTFS 4.5% 02/01/20	4.5	1,650	1,840	228,753	2020/2/1
BTFS 4.5% 03/01/19	4.5	2,650	2,863	355,949	2019/3/1
BTFS 4.5% 03/01/24	4.5	2,950	3,531	439,015	2024/3/1
BTFS 4.5% 03/01/26	4.5	4,250	5,158	641,196	2026/3/1
BTFS 4.5% 05/01/23	4.5	2,050	2,443	303,753	2023/5/1
BTFS 4.5% 08/01/18	4.5	4,000	4,222	524,876	2018/8/1
BTFS 4.75% 08/01/23	4.75	5,150	6,246	776,451	2023/8/1
BTFS 4.75% 09/01/21	4.75	2,400	2,820	350,633	2021/9/1
BTFS 4.75% 09/01/28	4.75	2,750	3,429	426,689	2028/9/1
BTFS 4.75% 09/01/44	4.75	1,900	2,441	303,479	2044/9/1
BTFS 5% 03/01/22	5.0	2,600	3,108	386,439	2022/3/1
BTFS 5% 03/01/25	5.0	2,650	3,293	409,431	2025/3/1
BTFS 5% 08/01/34	5.0	2,950	3,896	484,341	2034/8/1
BTFS 5% 09/01/40	5.0	2,850	3,758	467,134	2040/9/1
BTFS 5.0% 08/01/39	5.0	2,450	3,260	405,273	2039/8/1
BTFS 5.25% 11/01/29	5.25	3,650	4,805	597,362	2029/11/1
BTFS 5.5% 09/01/22	5.5	3,400	4,194	521,417	2022/9/1
BTFS 5.5% 11/01/22	5.5	2,350	2,906	361,323	2022/11/1
BTFS 5.75% 02/01/33	5.75	2,700	3,807	473,215	2033/2/1
BTFS 6% 05/01/31	6.0	4,200	5,963	741,210	2031/5/1
BTFS 6.5% 11/01/27	6.5	3,150	4,439	551,841	2027/11/1
BTFS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	2,043	254,005	2026/11/1
BTFS 9% 11/01/23	9.0	800	1,179	146,551	2023/11/1
<b>(フランス)</b>					
<b>国債証券</b>					
FRTR 0% 05/25/21	—	3,000	3,041	378,100	2021/5/25
FRTR 0% 05/25/22	—	800	806	100,257	2022/5/25
FRTR 0.25% 11/25/20	0.25	3,500	3,584	445,499	2020/11/25
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	1,750	1,680	208,933	2026/11/25
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	4,200	4,237	526,695	2025/5/25
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	4,130	4,098	509,475	2026/5/25
FRTR 0.5% 11/25/19	0.5	3,350	3,437	427,552	2019/11/25
FRTR 1% 05/25/18	1.0	4,250	4,316	536,592	2018/5/25
FRTR 1% 05/25/19	1.0	3,250	3,351	416,631	2019/5/25
FRTR 1% 11/25/18	1.0	2,500	2,559	318,164	2018/11/25
FRTR 1% 11/25/25	1.0	4,250	4,432	550,474	2025/11/25
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	2,450	2,372	294,907	2036/5/25
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	4,350	4,564	567,329	2031/5/25
FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	5,650	6,249	776,769	2023/5/25
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	850	791	98,438	2066/5/25
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	750	779	96,896	2039/6/25
FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	4,550	5,048	627,514	2024/11/25
FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	3,450	3,951	491,219	2024/5/25
FRTR 2.25% 10/25/22	2.25	4,100	4,625	574,992	2022/10/25
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	3,500	4,126	512,969	2030/5/25
FRTR 2.5% 10/25/20	2.5	5,450	6,062	746,062	2020/10/25
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	4,950	5,920	735,927	2027/10/25
FRTR 3% 04/25/22	3.0	4,800	5,561	691,317	2022/4/25
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	3,050	4,077	506,795	2045/5/25
FRTR 3.25% 10/25/21	3.25	5,200	6,020	748,300	2021/10/25
FRTR 3.5% 04/25/20	3.5	5,700	6,368	791,565	2020/4/25
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	4,230	5,322	661,639	2026/4/25
FRTR 3.75% 04/25/21	3.75	3,950	4,591	570,784	2021/4/25
FRTR 3.75% 10/25/19	3.75	4,080	4,506	560,127	2019/10/25

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)
FRTR 4% 04/25/55	4.0	1,750	2,755	342,502	2055/4/25
FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,450	2,331	289,764	2060/4/25
FRTR 4% 10/25/38	4.0	3,250	4,762	591,936	2038/10/25
FRTR 4.25% 04/25/19	4.25	5,250	5,738	713,293	2019/4/25
FRTR 4.25% 10/25/18	4.25	3,900	4,167	517,981	2018/10/25
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	5,150	6,539	812,888	2023/10/25
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	3,750	5,936	737,938	2041/4/25
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	3,050	4,732	588,299	2035/4/25
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	3,050	4,639	576,656	2029/4/25
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	3,750	6,189	769,332	2032/10/25
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	2,400	3,517	437,238	2025/10/25
FRTR 8.5% 04/25/23	8.5	1,000	1,507	187,320	2023/4/25
FRTR 8.5% 10/25/19	8.5	1,120	1,366	169,851	2019/10/25
<b>(オランダ)</b>					
<b>国債証券</b>					
NETHER 0% 01/15/22	—	1,500	1,522	189,300	2022/1/15
NETHER 0.25% 01/15/20	0.25	1,900	1,944	241,676	2020/1/15
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	1,690	1,693	210,481	2025/7/15
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	1,950	1,972	245,133	2026/7/15
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	650	663	82,479	2027/7/15
NETHER 1.25% 01/15/19	1.25	900	928	115,356	2019/1/15
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	1,500	1,671	207,809	2023/7/15
NETHER 2% 07/15/24	2.0	2,000	2,277	283,106	2024/7/15
NETHER 2.25% 07/15/22	2.25	2,970	3,359	417,626	2022/7/15
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	1,550	1,936	240,651	2033/1/15
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	1,450	2,007	249,509	2047/1/15
NETHER 3.25% 07/15/21	3.25	2,050	2,367	294,252	2021/7/15
NETHER 3.5% 07/15/20	3.5	1,750	1,975	245,532	2020/7/15
NETHER 3.75% 01/15/23	3.75	750	918	114,155	2023/1/15
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	1,820	2,865	356,170	2042/1/15
NETHER 4% 01/15/37	4.0	1,880	2,916	362,575	2037/1/15
NETHER 4% 07/15/19	4.0	1,000	1,099	136,641	2019/7/15
NETHER 4.0% 07/15/18	4.0	3,150	3,316	412,291	2018/7/15
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,590	2,418	300,618	2028/1/15
NETHER 7.5% 01/15/23	7.5	200	287	35,728	2023/1/15
<b>(スペイン)</b>					
<b>国債証券</b>					
SPGB 0.25% 01/31/19	0.25	140	141	17,557	2019/1/31
SPGB 0.25% 04/30/18	0.25	3,050	3,067	381,241	2018/4/30
SPGB 0.75% 07/30/21	0.75	2,850	2,930	364,322	2021/7/30
SPGB 1.15% 07/30/20	1.15	1,350	1,403	174,447	2020/7/30
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	2,100	2,080	258,620	2026/10/31
SPGB 1.4% 01/31/20	1.4	2,360	2,461	305,904	2020/1/31
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	1,950	1,945	241,879	2027/4/30
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	1,350	1,398	173,886	2025/4/30
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	2,500	2,630	327,023	2026/4/30
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	2,750	2,759	342,944	2030/7/30
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	3,550	3,801	472,548	2025/10/31
SPGB 2.75% 04/30/19	2.75	2,250	2,382	296,115	2019/4/30
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	2,950	3,316	412,207	2024/10/31
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	1,050	1,062	132,085	2046/10/31
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	500	528	65,657	2066/7/30
SPGB 3.75% 10/31/18	3.75	1,400	1,483	184,356	2018/10/31
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	2,800	3,351	416,576	2024/4/30
SPGB 4% 04/30/20	4.0	3,000	3,360	417,765	2020/4/30
SPGB 4.1% 07/30/18	4.1	3,280	3,449	428,833	2018/7/30
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	2,800	3,576	444,582	2037/1/31
SPGB 4.3% 10/31/19	4.3	3,900	4,324	537,573	2019/10/31
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	1,750	2,156	268,028	2023/10/31
SPGB 4.6% 07/30/19	4.6	3,030	3,349	416,308	2019/7/30
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,600	3,301	410,322	2025/7/30
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	1,950	2,665	331,380	2041/7/30
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	3,050	3,845	477,959	2024/1/31

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)
SPGB 4.85% 10/31/20	4.85	2,500	2,919	362,831	2020/10/31
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	1,850	2,590	322,041	2040/7/30
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	3,150	4,275	531,477	2028/10/31
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,500	2,180	271,047	2044/10/31
SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	3,000	3,821	475,046	2023/1/31
SPGB 5.5% 04/30/21	5.5	3,000	3,645	453,174	2021/4/30
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,270	3,365	418,292	2032/7/30
SPGB 5.85% 01/31/22	5.85	2,850	3,595	446,890	2022/1/31
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	1,680	2,335	290,290	2026/7/30
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,050	1,526	189,736	2029/1/31
<b>(ベルギー)</b>					
<b>国債証券</b>					
BGB 0.2% 10/22/23	0.2	750	758	94,303	2023/10/22
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	1,570	1,626	202,225	2025/6/22
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	500	505	62,859	2027/6/22
BGB 1% 06/22/26	1.0	2,100	2,191	272,400	2026/6/22
BGB 1% 06/22/31	1.0	1,200	1,193	148,340	2031/6/22
BGB 1.25% 06/22/18	1.25	1,800	1,835	228,161	2018/6/22
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	700	684	85,109	2047/6/22
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	760	830	103,279	2038/6/22
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	350	367	45,682	2066/6/22
BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,500	1,713	212,977	2023/6/22
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	400	437	54,393	2057/6/22
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	2,250	2,638	328,255	2024/6/22
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,650	2,119	263,454	2034/6/22
BGB 3% 09/28/19	3.0	2,000	2,168	269,487	2019/9/28
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	1,150	1,704	211,833	2045/6/22
BGB 3.75% 09/28/20	3.75	2,350	2,684	333,719	2020/9/28
BGB 4% 03/28/22	4.0	1,200	1,451	180,365	2022/3/28
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,030	1,452	180,537	2032/3/28
BGB 4.0% 03/28/19	4.0	790	856	106,513	2019/3/28
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	2,130	3,327	413,580	2041/3/28
BGB 4.25% 09/28/21	4.25	2,100	2,523	313,630	2021/9/28
BGB 4.25% 09/28/22	4.25	2,250	2,787	346,531	2022/9/28
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,100	1,494	185,769	2026/3/28
BGB 5% 03/28/35	5.0	1,610	2,607	324,158	2035/3/28
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,390	3,608	448,517	2028/3/28
<b>(オーストリア)</b>					
<b>国債証券</b>					
RAGB 0.25% 10/18/19	0.25	1,050	1,071	133,132	2019/10/18
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	2,300	2,351	292,283	2026/10/20
RAGB 1.15% 10/19/18	1.15	400	409	50,941	2018/10/19
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,250	1,340	166,601	2025/10/20
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	300	299	37,253	2047/2/20
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	1,200	1,300	165,367	2024/10/21
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	1,750	1,949	242,341	2023/10/20
RAGB 1.95% 06/18/19	1.95	950	999	124,298	2019/6/18
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	750	906	112,710	2034/5/23
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	850	1,183	147,127	2044/6/20
RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	1,150	1,376	171,045	2022/11/22
RAGB 3.5% 09/15/21	3.5	1,770	2,066	256,903	2021/9/15
RAGB 3.65% 04/20/22	3.65	1,100	1,311	163,018	2022/4/20
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	420	705	87,706	2062/1/26
RAGB 3.9% 07/15/20	3.9	1,720	1,958	243,481	2020/7/15
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,500	2,286	284,216	2037/3/15
RAGB 4.35% 03/15/19	4.35	1,550	1,688	209,893	2019/3/15
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	950	1,323	164,487	2026/3/15
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	850	1,338	166,394	2027/7/15
<b>(フィンランド)</b>					
<b>国債証券</b>					
RFGB 0% 04/15/22	—	220	222	27,670	2022/4/15
RFGB 0% 09/15/23	—	490	489	60,886	2023/9/15
RFGB 0.375% 09/15/20	0.375	860	884	109,886	2020/9/15

当		期		末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額	外貨換算金額 (千円)	償還年月日
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	570	575	71,568	2026/4/15
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	540	533	66,356	2031/4/15
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	550	576	71,636	2025/9/15
RFGB 1.125% 09/15/18	1.125	550	562	69,964	2018/9/15
RFGB 1.5% 04/15/23	1.5	700	765	95,198	2023/4/15
RFGB 1.625% 09/15/22	1.625	590	646	80,395	2022/9/15
RFGB 2% 04/15/24	2.0	520	588	73,200	2024/4/15
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	550	723	89,963	2042/7/4
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	560	690	85,811	2028/7/4
RFGB 3.375% 04/15/20	3.375	700	779	96,877	2020/4/15
RFGB 3.5% 04/15/21	3.5	740	852	106,023	2021/4/15
RFGB 4% 07/04/25	4.0	800	1,044	129,809	2025/7/4
RFGB 4.375% 07/04/19	4.375	670	740	92,040	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	450	470	58,442	2022/3/15
IRISH 1% 05/15/26	1.0	1,080	1,101	136,873	2026/5/15
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	470	472	58,779	2037/5/15
IRISH 2% 02/18/45	2.0	810	823	102,382	2045/2/18
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	1,090	1,242	154,392	2030/5/15
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	900	1,087	135,151	2024/3/18
IRISH 3.9% 03/20/23	3.9	900	1,101	136,855	2023/3/20
IRISH 4.4% 06/18/19	4.4	1,100	1,211	150,554	2019/6/18
IRISH 4.5% 04/18/20	4.5	2,080	2,375	295,299	2020/4/18
IRISH 4.5% 10/18/18	4.5	890	951	118,278	2018/10/18
IRISH 5% 10/18/20	5.0	350	414	51,484	2020/10/18
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,400	1,919	238,639	2025/3/13
IRISH 5.9% 10/18/19	5.9	800	922	114,692	2019/10/18
ユ ー ロ 計				85,724,435	
<b>(イギリス)</b>					
<b>国債証券</b>					
UKT 0.5% 07/22/22	0.5	2,050	2,054	293,197	2022/7/22
UKT 1.25% 07/22/18	1.25	3,780	3,829	546,496	2018/7/22
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	200	203	28,984	2027/7/22
UKT 1.5% 01/22/21	1.5	3,430	3,589	512,169	2021/1/22
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	2,200	2,307	329,228	2026/7/22
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	1,150	1,110	158,424	2047/7/22
UKT 1.75% 07/22/19	1.75	5,050	5,229	746,300	2019/7/22
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	150	159	22,828	2057/7/22
UKT 1.75% 09/07/22	1.75	2,850	3,047	434,862	2022/9/7
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	550	558	79,765	2037/9/7
UKT 2% 07/22/20	2.0	5,100	5,395	769,962	2020/7/22
UKT 2% 09/07/25	2.0	2,690	2,947	420,560	2025/9/7
UKT 2.25% 09/07/23	2.25	2,400	2,650	378,255	2023/9/7
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	1,600	2,151	307,008	2065/7/22
UKT 2.75% 09/07/24	2.75	2,250	2,579	368,126	2024/9/7
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,900	3,860	550,925	2044/1/22
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	3,000	4,195	598,719	2045/1/22
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	2,250	3,863	551,369	2068/7/22
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	2,050	3,249	463,742	2052/7/22
UKT 3.75% 09/07/19	3.75	550	595	85,048	2019/9/7
UKT 3.75% 09/07/20	3.75	750	839	119,733	2020/9/7
UKT 3.75% 09/07/21	3.75	2,000	2,297	327,916	2021/9/7
UKT 4% 01/22/60	4.0	2,000	3,566	509,009	2060/1/22
UKT 4% 03/07/22	4.0	1,450	1,704	243,244	2022/3/7
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	2,650	3,805	543,098	2036/3/7
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	1,950	2,701	385,508	2032/6/7
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,700	2,519	359,522	2039/9/7
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,440	1,904	271,766	2027/12/7
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	2,100	3,154	450,096	2040/12/7
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	2,100	3,361	479,750	2046/12/7
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,670	2,779	396,626	2049/12/7

当		期		末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額	外貨換算金額 (千円)	償還年月日
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,920	3,431	489,676	2055/12/7
UKT 4.5% 03/07/19	4.5	2,300	2,480	353,971	2019/3/7
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	2,650	3,852	549,750	2034/9/7
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,200	3,494	498,654	2042/12/7
UKT 4.75% 03/07/20	4.75	2,100	2,371	338,445	2020/3/7
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,800	2,576	367,698	2030/12/7
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,900	2,979	425,224	2038/12/7
UKT 5% 03/07/25	5.0	1,900	2,514	358,858	2025/3/7
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,250	1,915	273,406	2028/12/7
UKT 8% 06/07/21	8.0	1,050	1,379	196,783	2021/6/7
小 計				15,584,717	
<b>(スイス)</b>					
<b>国債証券</b>					
SWISS 2% 04/28/21	2.0	1,000	1,108	126,525	2021/4/28
SWISS 2.25% 07/06/20	2.25	400	438	50,057	2020/7/6
SWISS 3% 05/12/19	3.0	350	377	43,055	2019/5/12
SWISS 4% 02/11/23	4.0	710	896	102,341	2023/2/11
SWISS 4% 04/08/28	4.0	530	767	87,605	2028/4/8
小 計				409,585	
<b>(スウェーデン)</b>					
<b>国債証券</b>					
SGB 1% 11/12/26	1.0	7,550	7,897	101,091	2026/11/12
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	10,200	11,116	142,288	2023/11/13
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	7,650	8,971	114,839	2025/5/12
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	5,500	7,574	96,953	2039/3/30
SGB 3.5% 06/01/22	3.5	10,800	12,774	163,507	2022/6/1
SGB 4.25% 03/12/19	4.25	12,100	13,183	168,749	2019/3/12
SGB 5% 12/01/20	5.0	11,800	14,064	180,028	2020/12/1
小 計				967,458	
<b>(ノルウェー)</b>					
<b>国債証券</b>					
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	4,620	4,649	61,652	2026/2/19
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	2,250	2,298	30,480	2027/2/17
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	4,100	4,224	56,019	2025/3/13
NGB 2% 05/24/23	2.0	6,900	7,257	96,236	2023/5/24
NGB 3% 03/14/24	3.0	5,550	6,195	82,148	2024/3/14
NGB 3.75% 05/25/21	3.75	10,150	11,311	149,993	2021/5/25
NGB 4.5% 05/22/19	4.5	9,400	10,331	134,339	2019/5/22
小 計				610,869	
<b>(デンマーク)</b>					
<b>国債証券</b>					
DGB 0.25% 11/15/18	0.25	6,100	6,174	103,113	2018/11/15
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	2,200	2,163	36,135	2027/11/15
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	6,600	7,206	120,345	2023/11/15
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	10,300	11,493	191,939	2025/11/15
DGB 3% 11/15/21	3.0	11,400	13,048	217,905	2021/11/15
DGB 4% 11/15/19	4.0	11,000	12,221	204,095	2019/11/15
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	15,650	25,945	433,291	2039/11/15
小 計				1,306,826	
<b>(ポーランド)</b>					
<b>国債証券</b>					
POLGB 1.5% 04/25/20	1.5	4,200	4,120	122,449	2020/4/25
POLGB 1.75% 07/25/21	1.75	3,200	3,101	92,181	2021/7/25
POLGB 2% 04/25/21	2.0	3,500	3,436	102,139	2021/4/25
POLGB 2.25% 04/25/22	2.25	2,150	2,106	62,608	2022/4/25
POLGB 2.5% 07/25/18	2.5	7,200	7,262	126,007	2018/7/25
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	4,500	4,262	126,690	2026/7/25
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	2,350	2,195	65,254	2027/7/25
POLGB 3.25% 07/25/19	3.25	2,000	2,053	61,038	2019/7/25

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)	
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	3,680	3,730	110,860	2025/7/25
POLGB 4% 10/25/23	4.0	3,650	3,891	115,653	2023/10/25
POLGB 5.25% 10/25/20	5.25	2,530	2,771	82,367	2020/10/25
POLGB 5.5% 10/25/19	5.5	2,600	2,810	83,542	2019/10/25
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	950	1,183	35,159	2029/4/25
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	2,890	3,317	98,584	2022/9/23
POLGB 5.75% 10/25/21	5.75	1,150	1,301	38,689	2021/10/25
小計				1,413,224	
<b>(オーストラリア)</b>		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
<b>国債証券</b>					
ACGB 1.75% 11/21/20	1.75	2,250	2,249	186,406	2020/11/21
ACGB 2% 12/21/21	2.0	1,300	1,306	108,219	2021/12/21
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	2,030	1,981	164,152	2028/5/21
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	2,940	3,046	252,417	2024/4/21
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	800	774	64,210	2035/6/21
ACGB 2.75% 10/21/19	2.75	2,450	2,514	208,388	2019/10/21
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	2,450	2,515	208,445	2027/11/21
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	1,600	1,634	135,464	2028/11/21
ACGB 3% 03/21/47	3.0	1,000	930	77,087	2047/3/21
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	3,350	3,584	297,026	2025/4/21
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	1,450	1,552	128,601	2029/4/21
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	650	659	54,656	2039/6/21
ACGB 3.25% 10/21/18	3.25	2,150	2,199	182,274	2018/10/21
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,100	1,213	100,570	2037/4/21
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	3,960	4,562	378,072	2026/4/21
ACGB 4.5% 04/15/20	4.5	3,020	3,260	270,136	2020/4/15
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	1,400	1,705	141,278	2033/4/21
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	3,350	4,040	334,826	2027/4/21
ACGB 5.25% 03/15/19	5.25	3,200	3,407	282,343	2019/3/15
ACGB 5.5% 04/21/23	5.5	3,300	3,928	325,503	2023/4/21
ACGB 5.75% 05/15/21	5.75	3,950	4,542	376,422	2021/5/15
ACGB 5.75% 07/15/22	5.75	2,570	3,044	252,290	2022/7/15
小計				4,528,794	
<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 1.25% 10/01/21	1.25	250	247	19,939	2021/10/1
SIGB 1.625% 10/01/19	1.625	160	161	12,996	2019/10/1
SIGB 1.75% 04/01/22	1.75	100	100	8,125	2022/4/1
SIGB 2% 07/01/20	2.0	400	408	32,881	2020/7/1
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	250	253	20,401	2026/6/1
SIGB 2.25% 06/01/21	2.25	870	894	72,019	2021/6/1
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	270	279	22,477	2025/6/1
SIGB 2.5% 06/01/19	2.5	1,150	1,180	94,996	2019/6/1
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	280	297	23,949	2046/3/1
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	620	660	53,127	2042/4/1
SIGB 2.75% 07/01/23	2.75	560	593	47,749	2023/7/1
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	200	215	17,316	2029/7/1
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	470	504	40,635	2030/9/1
SIGB 3% 09/01/24	3.0	770	830	66,860	2024/9/1
SIGB 3.125% 09/01/22	3.125	720	775	62,396	2022/9/1
SIGB 3.25% 09/01/20	3.25	590	626	50,395	2020/9/1
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	360	411	33,147	2033/9/1
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	850	957	77,081	2027/3/1
SIGB 4% 09/01/18	4.0	980	1,016	81,783	2018/9/1
小計				838,282	
<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 3.418% 08/15/22	3.418	2,500	2,467	64,349	2022/8/15
MGS 3.48% 03/15/23	3.48	2,050	2,018	52,647	2023/3/15
MGS 3.492% 03/31/20	3.492	2,000	1,999	52,135	2020/3/31

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)	
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	800	759	19,808	2027/5/31
MGS 3.58% 09/28/18	3.58	2,150	2,159	56,332	2018/9/28
MGS 3.654% 10/31/19	3.654	1,050	1,056	27,555	2019/10/31
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	1,300	1,244	32,457	2028/6/15
MGS 3.795% 09/30/22	3.795	500	502	13,109	2022/9/30
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	1,150	1,091	28,462	2033/4/15
MGS 3.889% 07/31/20	3.889	1,500	1,514	39,507	2020/7/31
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	1,130	1,112	29,021	2027/3/15
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	1,390	1,388	36,216	2025/9/15
MGS 4.048% 09/30/21	4.048	3,100	3,151	82,195	2021/9/30
MGS 4.127% 04/15/32	4.127	1,450	1,410	36,790	2032/4/15
MGS 4.16% 07/15/21	4.16	1,650	1,683	43,918	2021/7/15
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	2,350	2,394	62,436	2024/7/15
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	650	641	16,724	2031/6/30
MGS 4.378% 11/29/19	4.378	2,200	2,250	58,699	2019/11/29
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	1,849	1,849	48,238	2026/4/15
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	500	508	13,254	2030/4/15
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	1,600	1,627	42,438	2043/9/30
MGS 5.248% 09/15/28	5.248	1,900	2,068	53,951	2028/9/15
小計				910,251	
<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	22,400	25,300	219,607	2026/12/21
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	9,620	7,035	61,069	2036/3/31
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	8,850	6,379	55,376	2041/2/28
SAGB 6.75% 03/31/21	6.75	5,300	5,162	44,813	2021/3/31
SAGB 7% 02/28/31	7.0	12,900	10,866	94,323	2031/2/28
SAGB 7.25% 01/15/20	7.25	7,520	7,523	65,302	2020/1/15
SAGB 7.75% 02/28/23	7.75	8,300	8,238	71,509	2023/2/28
SAGB 8% 01/31/30	8.0	11,100	10,283	89,264	2030/1/31
SAGB 8% 12/21/18	8.0	4,850	4,896	42,504	2018/12/21
SAGB 8.25% 03/31/32	8.25	7,400	6,873	59,659	2032/3/31
SAGB 8.5% 01/31/37	8.5	11,550	10,589	91,917	2037/1/31
SAGB 8.75% 01/31/44	8.75	12,450	11,452	99,405	2044/1/31
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	13,850	12,726	110,469	2048/2/28
SAGB 8.875% 02/28/35	8.875	8,900	8,545	74,176	2035/2/28
SAGB 9% 01/31/40	9.0	4,800	4,568	39,655	2040/1/31
小計				1,219,055	
合計				213,553,982	

(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	390	—
外 US 5YR NOTE	604	—
外 EURO-BOBL FU	508	—
外 EURO-BUND	904	—
外 US 10YR NOTE	378	—
外 US LONG BOND	271	—

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

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 213,553,982	% 97.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,156,988	2.8
投 資 信 託 財 産 総 額	219,710,970	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(215,876,981千円)の投資信託財産総額(219,710,970千円)に対する比率は98.3%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=111.34円	1カナダドル=82.69円	1メキシコペソ=6.02円
1ユーロ=124.30円	1イギリスポンド=142.70円	1スイスフラン=114.18円
1スウェーデンクローナ=12.80円	1ノルウェークローネ=13.26円	1デンマーククローネ=16.70円
1ポーランドズロチ=29.72円	1オーストラリアドル=82.86円	1シンガポールドル=80.49円
1マレーシアリンギット=26.08円	1南アフリカランド=8.68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5月29日現在
(A) 資 産	223,933,468,323円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	4,299,281,581
公 社 債(評価額)	213,553,982,883
未 収 入 金	4,227,115,730
未 収 利 息	1,636,771,189
前 払 費 用	73,006,266
差 入 委 託 証 拠 金	143,310,674
(B) 負 債	4,456,153,060
未 払 金	4,258,142,443
未 払 解 約 金	198,001,277
未 払 利 息	9,340
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	219,477,315,263
元 本	82,408,164,040
次 期 繰 越 損 益 金	137,069,151,223
(D) 受 益 権 総 口 数	82,408,164,040口
1万口当たり基準価額(C/D)	26,633円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2016年5月31日 至 2017年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	5,115,218,643円
受 取 利 息	5,117,371,800
支 払 利 息	△2,153,157
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△5,685,021,332
売 買 益	3,425,476,162
売 買 損	△9,110,497,494
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	16,799,925
取 引 益	84,594,315
取 引 損	△67,794,390
(D) そ の 他 費 用	△52,551,622
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△605,554,386
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	132,839,353,885
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	32,143,777,606
(H) 解 約 差 損 益 金	△27,308,425,882
(I) 計 (E+F+G+H)	137,069,151,223
次 期 繰 越 損 益 金(I)	137,069,151,223

(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80,122,655,769円、期中追加設定元本額は19,826,581,417円、期中一部解約元本額は17,541,073,146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)	21,977,785,272円
コア投資戦略ファンド(成長型)	6,484,814,301円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	5,555,308,968円
世界経済インデックスファンド	3,651,364,890円
DC世界経済インデックスファンド	3,442,263,413円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,163,086,179円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,884,387,746円
外国債券オープン(毎月決算型)	2,354,816,143円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,272,158,879円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,090,912,966円
分散投資コア戦略ファンドS	2,047,146,155円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,815,112,091円
DC外国債券インデックス・オープン	1,586,357,819円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	1,415,582,834円
DCマイセレクション25	1,383,220,530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)	1,197,226,165円
DCマイセレクション50	1,183,135,629円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,158,283,975円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,093,017,669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)	1,079,528,233円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,056,150,735円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	927,048,945円
分散投資コア戦略ファンドA	922,467,652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)	907,804,231円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	841,132,454円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	816,316,203円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	715,398,232円
DCマイセレクション75	697,787,782円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	668,084,521円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	665,809,229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)	642,518,325円
外国債券ファンド・シリーズ1	573,831,140円
DCマイセレクションS25	565,741,631円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	506,634,196円
DCマイセレクションS50	468,740,579円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	440,040,245円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	407,523,533円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	382,974,159円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	370,674,662円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	311,455,980円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	273,160,051円
SMT インデックスバランス・オープン	265,375,721円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	232,475,588円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	196,202,888円
DCマイセレクションS75	190,448,230円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	112,048,879円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	96,675,012円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	89,757,341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)	76,577,996円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	56,204,029円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	51,171,943円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	21,269,433円

SBI資産設計オープン(分配型)	13,688,398円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	6,853,200円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	2,611,040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17期（決算日 2017年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	騰落率	円	騰落率				
第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
第17期(2017年5月29日)	22,222	17.5	596.68	15.6	95.1	2.5	2.5	306,484

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	円	騰落率			
(当期首) 2016年 5月30日	18,911	—	516.33	—	91.4	5.9	2.6
5月末	18,977	0.3	522.27	1.2	91.5	5.9	2.6
6月末	17,164	△9.2	469.88	△9.0	94.7	2.5	2.9
7月末	18,249	△3.5	502.17	△2.7	94.5	2.5	2.8
8月末	18,193	△3.8	495.95	△3.9	94.3	3.0	2.7
9月末	17,762	△6.1	487.95	△5.5	94.9	2.4	2.7
10月末	18,131	△4.1	496.88	△3.8	94.9	2.5	2.6
11月末	19,829	4.9	541.23	4.8	94.5	2.8	2.5
12月末	21,082	11.5	571.59	10.7	95.2	2.2	2.5
2017年 1月末	21,014	11.1	570.29	10.5	96.2	1.2	2.6
2月末	21,422	13.3	578.43	12.0	95.6	1.8	2.6
3月末	21,631	14.4	580.46	12.4	95.2	2.2	2.5
4月末	21,782	15.2	586.74	13.6	95.1	2.3	2.6
(当期末) 2017年 5月29日	22,222	17.5	596.68	15.6	95.1	2.5	2.5

(注1) 騰落率は期首比です。

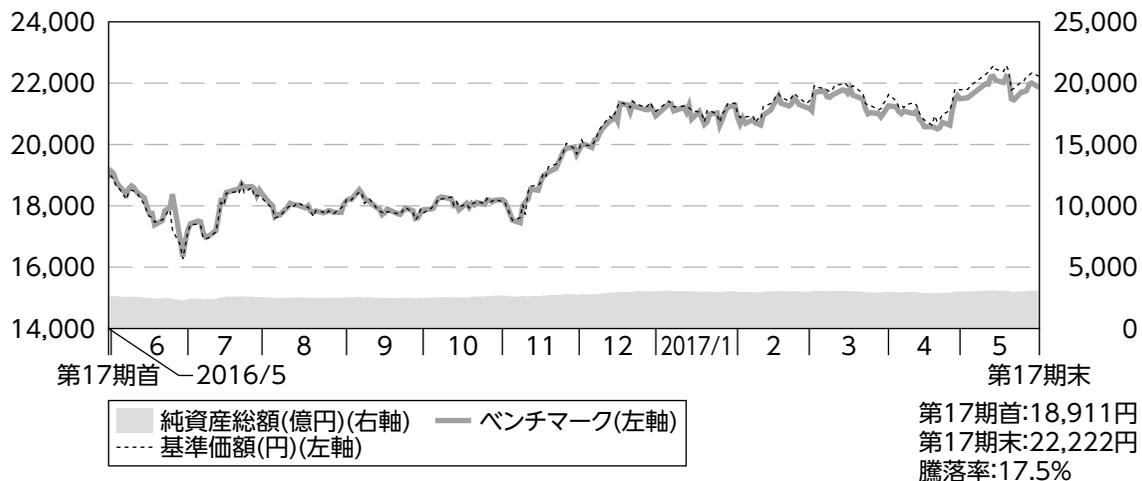
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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、2016年5月30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、基準価額は上昇しました。

## 投資環境



海外株式市場は、2016年6月に英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利したことを受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことから一時下落し、その後も米国の早期利上げへの警戒感などから上値の重い展開となりました。ただ、11月の米大統領選挙後は、トランプ氏の経済政策への期待が膨らんだことや、主要産油国の減産合意を受けた原油価格の上昇を背景に、堅調な展開となりました。期末にかけても、堅調な企業業績や欧州政治リスクへの警戒感の後退などを受けて、海外株式市場は上昇基調で推移しました。外国為替市場では、米大統領選挙後、投資家のリスク選好の動きが強まったことなどから主要通貨に対して円安が進行しました。

## 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

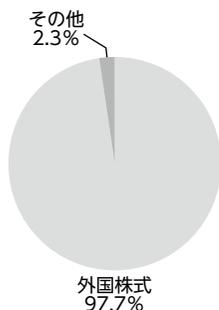
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	APPLE INC	アメリカ	2.4%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	1.5%
3	AMAZON.COM	アメリカ	1.2%
4	FACEBOOK INC-A	アメリカ	1.0%
5	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	1.0%
6	EXXON MOBIL	アメリカ	1.0%

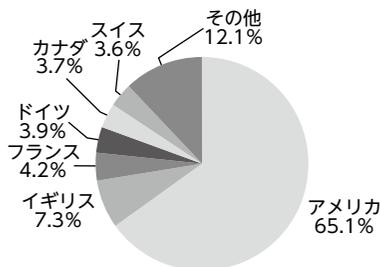
順位	銘柄名	国	組入比率
7	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	0.9%
8	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	0.9%
9	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	0.9%
10	NESTLE SA - REGISTERED	スイス	0.8%
組入銘柄数		1,321	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

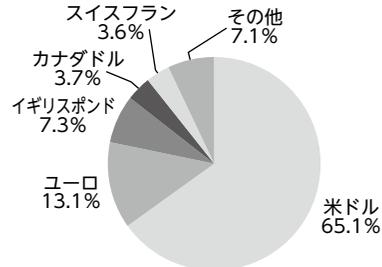
### ○資産別配分



### ○国別配分



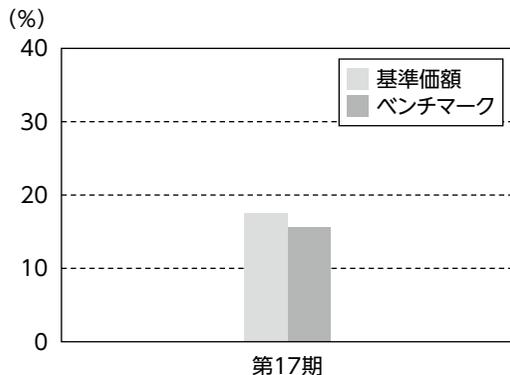
### ○通貨別配分



(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、プラスの影響としては配当要因<sup>※1</sup>、マイナスの影響としては為替評価差要因<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
	(2016年5月31日~2017年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	1円 (0) (-) (-) (0) (-) (1)	0.004% (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)	1 (1) (-) (-) (-) (0)	0.007 (0.007) (-) (-) (-) (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)	0.034 (0.033) (-) (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	9	0.045	

(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(19,603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 38,290 (6,976)	千米ドル 230,044 (17,523)	百株 30,109 (5,641)	千米ドル 181,450 (24,448)
	カ ナ ダ	6,001 (998)	千カナダドル 21,225 (2,662)	2,948 (-)	千カナダドル 12,706 (93)
	ド イ ツ	3,371 (1,559)	千ユーロ 13,644 (2,462)	2,686 (305)	千ユーロ 8,401 (2,617)
	イ タ リ ア	6,594 (△8,591)	3,882 (△353)	4,815	2,039
	フ ラ ン ス	2,775 (634)	12,884 (△94)	2,240 (92)	7,775 (463)
	オ ラ ン ダ	3,265 (462)	5,756 (984)	1,864	3,551
	ス ペ イ ン	6,805 (40,967)	4,467 (253)	37,811 (6,555)	3,106 (257)
	ベ ル ギ ー	177 (552)	1,667 (6,457)	132 (638)	1,250 (7,278)
	オ ー ス ト リ ア	115 (-)	310 (△25)	29	105
	ル ク セ ン ブ ル ク	1,032 (△1,018)	1,247 (-)	133	227
	フ ィ ン ラ ン ド	1,376	1,458	766	708
	ア イ ル ラ ン ド	98	332	82	254
	ポ ル ト ガ ル	-	-	24,400	74
	そ の 他	170 (184)	561 (448)	- (184)	- (448)
	国	イ ギ リ ス	42,443 (1,002)	千イギリスポンド 22,846 (36)	26,479 (188)
ス イ ス		2,014 (1,646)	千スイスフラン 12,376 (△647)	1,748	千スイスフラン 9,919
ス ウ ェ ー デ ン		2,707 (441)	千スウェーデンクローナ 34,233 (-)	1,945	千スウェーデンクローナ 19,875
ノ ル ウ ェ ー		768 (-)	千ノルウェークローネ 9,344 (△267)	282	千ノルウェークローネ 3,032
デ ン マ ー ク		723	千デンマーククローネ 17,516	325	千デンマーククローネ 9,802

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	オーストラリア	8,229 (357)	千オーストラリアドル 12,739 (-)	5,182	千オーストラリアドル 8,186
	ニュージーランド	303	千ニュージーランドドル 301	-	千ニュージーランドドル -
	香 港	12,227 (628)	千香港ドル 32,246 (-)	4,541	千香港ドル 20,556
	シンガポール	3,229 (2,975)	千シンガポールドル 1,975 (-)	9,337	千シンガポールドル 1,744
	イスラエル	630	千イスラエルシェケル 3,429	179 (734)	千イスラエルシェケル 722 (14,606)

(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
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5	577	-	-
	BOSTON PROPERTIES	1	221	0.822	97
	SL GREEN REALTY CORP	0.721	84	-	-
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	11	128	-	-
	PROLOGIS INC	5	284	4	240
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1	254	1	234
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	11	467	-	-
	DUKE REALTY CORP	3	100	-	-
	CROWN CASTLE INTL CORP	4	377	1	135
	ESSEX PROPERTY TRUST	0.838	181	0.546	116
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	4	289	3	225
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	166	0.64	90
	HCP INC	8	279	3 (-)	110 (118)
	WELLTOWER INC	4	317	1	112
	KIMCO REALTY CORP	6	170	3	100

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	IRON MOUNTAIN INC	6	235	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	3	348	—	—
	REALTY INCOME CORP	4	250	2	114
	REGENCY CENTERS CORP	4	316	—	—
	SIMON PROPERTY GROUP	3	655	2	388
	PUBLIC STORAGE	1	400	1	280
	VENTAS INC	4	327	3	204
	VORNADO REALTY TRUST	2	286	2	231
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1	120	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	3	309	2	222
	VEREIT INC	10	104	—	—
	GGP INC	8	225	4	117
	AMERICAN TOWER CORPORATION	5	641	3	435
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	11	319	—	—
	EQUINIX INC	1	398	0.633	231
	QUALITY CARE PROPERTIES	(7)	(118)	7	99
	PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	(9)	(228)	9	294
	SBA COMMUNICATIONS CORP	(10)	(1,051)	—	—
	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	44	635	—	—
	小 計	190 (28)	9,479 (1,397)	62 (—)	4,085 (118)
	カナダ	千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5	137	—	—
	小 計	5	137	—	—
	フランス	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	UNIBAIL-RODAMCO SE	1	230	1	236
	KLEPIERRE	5	195	3	106
	GEICINA SA	1	130	—	—
	FONCIERE DES REGIONS	(—)	(△2)	—	—
	小 計	7 (—)	556 (△2)	4	342
	ユ ー ロ 計	7 (—)	556 (△2)	4	342

	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	24	148	13	82
SEGRE PLC-NIL PAID RIGHTS	— (12)	— (—)	12	12
小 計	24 (12)	148 (—)	26	95
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
STOCKLAND	59	276	35	150
WESTFIELD CORP	16	177	—	—
DUET GROUP	—	—	177	533
VICINITY CENTERS	89	268	53	151
SCENTRE GROUP	35	157	32	137
小 計	201	879	298	973
香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
LINK REIT	16	933	14	767
HKT TRUST AND HKT LTD	81	840	—	—
小 計	97	1,774	14	767
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
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	59 (—)	135 (△1)	—	—
SUNTEC REIT	— (—)	— (△1)	—	—
小 計	59 (—)	135 (△2)	—	—

(注1)金額は受渡代金です。

(注2) ( )内は合併・分割・減資・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別	当 期			
	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	81,270	89,932	—	—

(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	68,900,736千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	262,019,425千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.26

(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	42,787	10,166	23.8	48,539	13,064	26.9
金 銭 信 託	2,037	2,037	100.0	2,080	2,080	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	97,330	20,220	20.8	97,222	20,086	20.7

(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

<外国株式(上場、登録株式)>

銘柄	当期首(前期末)	当		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
(アメリカ)				千米ドル		
ABBOTT LABORATORIES	1,148	1,385	6,196	689,872	ヘルスケア機器・サービス	
AES CORP	526	526	620	69,108	公益事業	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	708	723	11,026	1,227,696	ソフトウェア・サービス	
CHUBB LTD	354	373	5,308	591,005	保険	
AGCO CORP	59	59	381	42,507	資本財	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	156	162	2,342	260,789	素材	
ALLEGHANY CORP	11	12	750	83,599	保険	
DU PONT (E. I) DE NEMOURS	669	702	5,466	608,645	素材	
RALPH LAUREN CORPORATION	45	45	302	33,697	耐久消費財・アパレル	
ALLSTATE CORP	295	301	2,605	290,054	保険	
HONEYWELL INTL INC	557	582	7,755	863,532	資本財	
ALCOA	1,035	—	—	—	素材	
HESS CORP	220	238	1,150	128,091	エネルギー	
AMERICAN EXPRESS	642	629	4,879	543,242	各種金融	
AMERICAN ELECTRIC POWER	373	388	2,754	306,725	公益事業	
AFLAC	331	322	2,409	268,320	保険	
AMERICAN INT'L GROUP	947	817	5,198	578,746	保険	
ANADARKO PETROLEUM CORP	394	443	2,300	256,155	エネルギー	
TYCO INTERNATIONAL PLC	314	—	—	—	商業・専門サービス	
JONES LANG LASALLE INC	31	36	420	46,833	不動産	
VALERO ENERGY CORP	366	358	2,238	249,257	エネルギー	
APACHE CORP	279	298	1,436	159,944	エネルギー	
ALBEMARLE CORP	86	95	1,081	120,393	素材	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	447	473	2,008	223,647	食品・飲料・タバコ	
PINNACLE WEST CAPITAL	83	94	822	91,628	公益事業	
AMEREN CORPORATION	191	203	1,145	127,491	公益事業	
ARROW ELECTRONICS INC	65	66	499	55,590	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AGL RESOURCES INC	88	—	—	—	公益事業	
AUTOLIV INC	66	74	817	90,998	自動車・自動車部品	
AUTOZONE INC	23	23	1,459	162,447	小売	
AVERY DENNISON CORP	74	74	628	69,982	素材	
AVNET INC	109	109	401	44,674	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
BAKER HUGHES	337	316	1,756	195,561	エネルギー	
BALL CORP	93	271	1,104	122,964	素材	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	909	980	16,240	1,808,210	各種金融	
BANK NEW YORK CO	841	853	4,047	450,636	各種金融	
BARD C R INC	57	58	1,813	201,927	ヘルスケア機器・サービス	
BAXTER INTERNATIONAL	426	397	2,329	259,383	ヘルスケア機器・サービス	
BECTON DICKINSON & CO	159	168	3,142	349,913	ヘルスケア機器・サービス	
AMETEK INC	188	188	1,148	127,859	資本財	
VERIZON COMMUNICATIONS	3,117	3,262	14,787	1,646,410	電気通信サービス	
WR BERKLEY CORP	70	86	588	65,474	保険	
BEST BUY COMPANY INC	222	218	1,287	143,369	小売	
YUM BRANDS INC	328	272	1,963	218,561	消費者サービス	

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)	
FIRSTENERGY CORP	323	356	1,032	114,939	公益事業
BLOCK H & R INC	169	169	443	49,373	消費者サービス
BOEING CO	486	468	8,735	972,661	資本財
ROBERT HALF INTL INC	93	115	530	59,067	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	159	181	743	82,819	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,029	1,078	2,947	328,132	ヘルスケア機器・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	21	22	1,292	143,867	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,280	1,347	7,270	809,505	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	38	44	682	75,970	各種金融
ONEOK INC	155	177	916	102,096	エネルギー
UNITED RENTALS INC	73	64	716	79,786	資本財
SEMPRA ENERGY	181	187	2,141	238,404	公益事業
FEDEX CORP	204	201	3,918	436,276	運輸
AMPHENOL CORPORATION	229	242	1,811	201,668	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	84	178	923	102,797	食品・飲料・タバコ
QUANTA SERVICES INC	140	—	—	—	資本財
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	155	—	—	—	メディア
CABOT OIL & GAS CORP	362	393	902	100,503	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO (US)	147	163	966	107,626	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION BRANDS INC-A	131	140	2,535	282,328	食品・飲料・タバコ
CARDINAL HEALTH	251	252	1,845	205,524	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR	449	468	4,947	550,834	資本財
CORE LABORATORIES N. V.	33	33	343	38,263	エネルギー
CENTURYLINK INC	433	458	1,137	126,594	電気通信サービス
JPMORGAN CHASE & CO	2,821	2,866	24,467	2,724,212	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	96	211	1,079	120,195	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	195	203	3,286	365,891	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	65	—	—	—	資本財
CLOROX COMPANY	98	100	1,355	150,974	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	3,166	3,277	14,878	1,656,519	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA ENTERPRISES	170	—	—	—	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE CO	656	679	5,128	571,005	家庭用品・パーソナル用品
AON PLC	208	207	2,700	300,724	保険
COMERICA INC	135	146	1,012	112,714	銀行
NRG ENERGY INC	251	—	—	—	公益事業
CONAGRA BRANDS INC	338	332	1,297	144,460	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	228	239	1,965	218,854	公益事業
CMS ENERGY CORP	210	235	1,116	124,317	公益事業
THE COOPER COS INC	37	41	893	99,487	ヘルスケア機器・サービス
CORNING	900	749	2,196	244,584	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR GRACE & CO	56	56	405	45,172	素材
SEALED AIR CORP	147	146	654	72,860	素材
CUMMINS INC	130	129	2,033	226,462	資本財
L3 TECHNOLOGIES INC	61	61	1,022	113,833	資本財
WASTE CONNECTIONS INC	96	—	—	—	商業・専門サービス
DR HORTON INC	243	285	946	105,381	耐久消費財・アパレル
DANAHER CORP	475	498	4,206	468,379	ヘルスケア機器・サービス
MOODY'S CORP	133	139	1,638	182,481	各種金融
TARGET (DAYTON HUDSON)	446	420	2,288	254,843	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)	
DEERE&CO	242	210	2,589	288,262	資本財
MORGAN STANLEY	1,112	1,118	4,791	533,435	各種金融
REPUBLIC SERVICES INC	181	184	1,164	129,637	商業・専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,203	1,208	13,101	1,458,692	メディア
DOVER CORP	118	130	1,077	119,926	資本財
DOW CHEMICAL CO	867	905	5,526	615,365	素材
OMNICOM GROUP	180	190	1,586	176,661	メディア
DTE ENERGY COMPANY	134	143	1,562	174,021	公益事業
XL GROUP PLC	237	—	—	—	保険
DUKE ENERGY CORP	530	551	4,695	522,790	公益事業
FLOWSERVE CORP	108	108	520	57,978	資本財
DARDEN RESTAURANTS INC	84	100	882	98,227	消費者サービス
EMC CORP	1,496	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BANK OF AMERICA CORP	7,987	8,090	18,803	2,093,535	銀行
CITIGROUP	2,287	2,279	14,150	1,575,478	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	118	118	947	105,502	素材
EATON CORP	358	368	2,860	318,538	資本財
EATON VANCE CORP	78	100	475	52,973	各種金融
ECOLAB INC	204	208	2,732	304,249	素材
SALESFORCE.COM INC	487	515	4,682	521,386	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	506	509	3,000	334,088	資本財
ATMOS ENERGY CORP	80	80	664	73,962	公益事業
ENTERGY CORP	139	150	1,167	129,959	公益事業
EOG RESOURCES INC	417	463	4,229	470,862	エネルギー
EQUIFAX INC	87	100	1,365	152,068	商業・専門サービス
EQT CORPORATION	122	138	786	87,596	エネルギー
ESTEE LAUDER CO-CL A	172	178	1,669	185,929	家庭用品・パーソナル用品
EXXON MOBIL	3,188	3,332	27,174	3,025,626	エネルギー
FMC CORP	104	104	782	87,151	素材
NEXTERA ENERGY INC	354	370	5,211	580,261	公益事業
ASSURANT INC	47	47	473	52,715	保険
M & T BANK CORP	113	114	1,835	204,336	銀行
MACY'S INC	238	259	607	67,661	小売
FRANKLIN RESOURCES INC	307	307	1,281	142,643	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC	921	1,031	1,204	134,059	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	133	149	855	95,218	保険
TEGNA INC	150	150	361	40,236	メディア
GAP	178	208	467	52,069	小売
GENERAL DYNAMICS CORP	204	207	4,195	467,078	資本財
GENERAL MILLS INC	454	468	2,683	298,767	食品・飲料・タバコ
GENUINE PARTS CO	117	124	1,164	129,656	小売
STARWOOD HOTELS & RESORTS	125	—	—	—	消費者サービス
GARTNER INC	60	70	824	91,774	ソフトウェア・サービス
MCKESSON CORP	175	179	2,887	321,520	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL ELECTRIC CO	7,229	7,084	19,446	2,165,141	資本財
GRAINGER (WW) INC	42	47	824	91,781	資本財
HALLIBURTON CO	651	690	3,160	351,916	エネルギー
GOLDMAN SACHS GROUP INC	293	285	6,382	710,671	各種金融
HARLEY-DAVIDSON	146	146	767	85,498	自動車・自動車部品

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
HARMAN INTL INDS INC	54	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HARRIS CORP	99	—	1,097	122,248	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HELMERICH & PAYNE	83	83	446	49,687	エネルギー
HERSHEY FOODS CORPORATION	116	112	1,298	144,603	食品・飲料・タバコ
HP INC	1,400	1,351	2,496	277,962	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CROWN HOLDINGS INC	104	122	696	77,601	素材
REYNOLDS AMERICAN INC	648	686	4,600	512,192	食品・飲料・タバコ
JUNIPER NETWORKS INC	278	278	815	90,837	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLLYFRONTIER CORP	124	124	308	34,330	エネルギー
UNUM GROUP	185	185	836	93,164	保険
HOME DEPOT	972	973	15,086	1,679,694	小売
HORMEL FOODS CORP	215	234	777	86,529	食品・飲料・タバコ
CENTERPOINT ENERGY INC	305	345	978	108,907	公益事業
HUMANA INC	113	117	2,739	305,055	ヘルスケア機器・サービス
RED HAT INC	141	139	1,236	137,710	ソフトウェア・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS	252	254	3,575	398,112	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	60	67	940	104,691	素材
INT'L PAPER CO	305	306	1,604	178,624	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS	307	338	835	93,009	メディア
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	96	96	510	56,831	資本財
JOHNSON & JOHNSON	2,119	2,183	27,710	3,085,294	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARTFORD FINANCIAL SVCS	307	314	1,549	172,550	保険
JOHNSON CONTROLS INC	501	—	—	—	自動車・自動車部品
DEVON ENERGY CORPORATION	363	370	1,326	147,639	エネルギー
WESTAR ENERGY INC	—	114	608	67,712	公益事業
KELLOGG CO	207	210	1,528	170,208	食品・飲料・タバコ
KEY CORP	623	870	1,565	174,327	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	274	287	3,726	414,910	家庭用品・パーソナル用品
BLACKROCK INC	93	97	3,965	441,529	各種金融
KOHL'S CORP	143	154	600	66,817	小売
KROGER CO	706	707	2,084	232,140	食品・生活必需品小売り
PACKAGING CORP OF AMERICA	68	80	824	91,810	素材
LEGG MASON INC	77	—	—	—	各種金融
LEGGETT & PLATT INC	105	105	551	61,430	耐久消費財・アパレル
LENNAR CORP-CL A	144	144	745	82,996	耐久消費財・アパレル
LEUCADIA NATIONAL CORP	257	257	632	70,465	各種金融
LILLY (ELI) & CO	766	800	6,247	695,598	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
L BRANDS INC	190	194	984	109,658	小売
LINCOLN NATIONAL CORP	176	177	1,155	128,648	保険
UNITED PARCEL SERVICE B	536	555	5,886	655,365	運輸
AGILENT TECHNOLOGIES	261	253	1,506	167,786	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOCKHEED MARTIN CORP	210	212	6,015	669,813	資本財
LOEWS CORP	218	240	1,127	125,521	保険
CARNIVAL CORPORATION	306	271	1,720	191,614	消費者サービス
RANGE RESOURCES CORP	127	161	391	43,541	エネルギー
LOWES COMPANIES	699	691	5,594	622,867	小売
DOMINION ENERGY INC	460	502	4,069	453,051	公益事業
SCANA CORP	101	114	777	86,578	公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	361	361	1,150	128,052	消費者サービス

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)	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	85	92	969	107,905	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	701	662	9,927	1,105,291	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	209	204	2,873	319,884	各種金融
EVEREST RE GROUP LTD	33	33	833	92,830	保険
MANPOWER GROUP	52	51	521	58,071	商業・専門サービス
MARKEL CORP	10	11	1,095	121,949	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	159	167	1,916	213,400	ヘルスケア機器・サービス
MARSH & MCLENNAN COS	404	408	3,118	347,246	保険
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	45	45	330	36,788	家庭用品・パーソナル用品
MASCO CORP	259	278	1,030	114,693	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS	42	49	1,136	126,515	素材
METLIFE INC	716	747	3,816	424,911	保険
MEDTRONIC PLC	1,084	1,125	9,580	1,066,640	ヘルスケア機器・サービス
CVS HEALTH CORP	850	859	6,586	733,300	食品・生活必需品小売り
MERCK & CO	2,142	2,210	14,347	1,597,452	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CRP OF AMER	79	86	1,205	134,227	ヘルスケア機器・サービス
3 M COMPANY	470	480	9,641	1,073,494	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	47	50	1,194	132,948	耐久消費財・アパレル
MOTOROLA SOLUTIONS INC	116	126	1,033	115,022	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	87	87	838	93,402	運輸
MURPHY OIL CORP	110	138	351	39,164	エネルギー
XCEL ENERGY INC	376	407	1,928	214,673	公益事業
FORD MOTOR COMPANY	2,859	2,954	3,229	359,532	自動車・自動車部品
NATIONAL OILWELL VARCO INC	282	303	993	110,593	エネルギー
NEWFIELD EXPLORATION CO	—	160	531	59,198	エネルギー
NEWELL BRANDS INC	339	355	1,890	210,462	耐久消費財・アパレル
DUN & BRADSTREET CORP	24	31	325	36,252	商業・専門サービス
NEWMONT MINING CORP	394	429	1,465	163,123	素材
NIKE B	1,041	1,063	5,592	622,724	耐久消費財・アパレル
NOBLE ENERGY INC	318	347	1,022	113,806	エネルギー
NORDSTROM INC	100	100	428	47,730	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	232	238	2,912	324,324	運輸
EVERSOURCE ENERGY	241	253	1,558	173,511	公益事業
NISOURCE INC	—	260	665	74,051	公益事業
COACH INC	220	220	1,020	113,649	耐久消費財・アパレル
NORTHROP GRUMMAN CORP	132	132	3,411	379,869	資本財
WELLS FARGO & CO	3,718	3,821	20,025	2,229,685	銀行
NUCOR CORP	248	249	1,448	161,310	素材
MONSANTO CO	337	349	4,085	454,871	素材
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	413	382	3,053	340,028	各種金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	588	613	3,741	416,564	エネルギー
OCEANEERING INTL INC	71	—	—	—	エネルギー
OG E ENERGY CORP	156	156	551	61,388	公益事業
ORACLE CORP	2,454	2,463	11,148	1,241,282	ソフトウェア・サービス
EXELON CORP	710	730	2,615	291,254	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	101	109	1,742	194,023	資本財
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	73	73	474	52,837	保険
MEDNAX INC	69	81	447	49,814	ヘルスケア機器・サービス
PPL CORPORATION	521	534	2,131	237,313	公益事業

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)	
PEPSICO INC	1,117	1,147	13,524	1,505,871	食品・飲料・タバコ
PENTAIR PLC	135	135	899	100,191	資本財
PERRIGO CO PLC	112	120	844	94,011	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER	4,731	4,865	15,638	1,741,196	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CONOCOPHILLIPS	936	996	4,518	503,134	エネルギー
PG&E CORP	370	399	2,693	299,919	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES	122	134	2,289	254,938	エネルギー
ALTRIA GROUP INC	1,504	1,559	11,603	1,291,941	食品・飲料・タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	388	394	4,781	532,395	銀行
POLARIS INDUSTRIES INC	46	46	397	44,259	耐久消費財・アパレル
AETNA INC	264	280	4,080	454,303	ヘルスケア機器・サービス
FLUOR CORP	100	112	506	56,425	資本財
PPG INDUSTRIES INC	208	210	2,254	251,004	素材
PRAXAIR INC	219	226	2,989	332,896	素材
QUEST DIAGNOSTICS	114	114	1,235	137,525	ヘルスケア機器・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	2,084	2,047	17,860	1,988,560	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	434	467	1,975	219,951	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	394	406	1,804	200,871	公益事業
PULTE GROUP INC	246	246	561	62,563	耐久消費財・アパレル
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	390	390	508	56,630	銀行
GLOBAL PAYMENTS INC	95	125	1,149	127,965	ソフトウェア・サービス
TIME WARNER INC	613	613	6,079	676,850	メディア
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	99	99	731	81,477	各種金融
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	32	32	458	51,070	保険
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	—	54	682	75,985	保険
AUTONATION INC	50	50	196	21,927	小売
RESMED INC	105	119	835	93,034	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,328	1,356	6,978	776,940	銀行
RITE AID CORP	834	834	306	34,111	食品・生活必需品小売り
ROPER TECHNOLOGIES INC	74	81	1,839	204,793	資本財
ROCKWELL AUTOMATION INC	103	104	1,657	184,524	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	130	132	1,473	164,044	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	230	235	3,845	428,181	資本財
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	47	40	980	109,120	ソフトウェア・サービス
FMC TECHNOLOGIES INC	175	—	—	—	エネルギー
ACCENTURE PLC-CL A	481	500	6,153	685,182	ソフトウェア・サービス
ROCKWELL COLLIN	103	131	1,406	156,646	資本財
ST JUDE MEDICAL INC	208	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
TRAVELERS COS INC/THE	231	224	2,779	309,415	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	209	245	2,095	233,322	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER	1,069	1,125	7,889	878,437	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	899	952	3,764	419,110	各種金融
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	146	160	1,915	213,237	ヘルスケア機器・サービス
BUNGE LIMITED	105	117	966	107,654	食品・飲料・タバコ
ANTHEM INC	199	210	3,847	428,433	ヘルスケア機器・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	148	128	1,169	130,165	ヘルスケア機器・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	219	231	1,452	161,774	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	61	63	2,130	237,222	素材
CENTENE CORP	92	137	1,028	114,468	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)	
SMITH (A. O.) CORP	—	121	656	73,120	資本財
ACUIITY BRANDS INC	35	35	577	64,339	資本財
SNAP-ON INC	43	49	787	87,677	資本財
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	343	349	3,669	408,511	保険
ADVANCE AUTO PARTS	57	61	829	92,402	小売
SOUTHWESTERN ENERGY CO	291	387	256	28,527	エネルギー
EDISON INTL	253	261	2,093	233,109	公益事業
SOUTHERN CO	702	782	3,948	439,661	公益事業
BB&T CORP	595	642	2,736	304,660	銀行
INGERSOLL-RAND PLC	197	202	1,809	201,441	資本財
SOUTHWEST AIRLINES CO	132	132	801	89,260	運輸
AT&T INC	4,713	4,917	18,745	2,087,125	電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,442	1,515	15,872	1,767,199	エネルギー
STANLEY BLACK&DECKER	117	120	1,643	182,990	資本財
STATE STREET CORP	314	304	2,497	278,025	各種金融
STRYKER CORP	258	269	3,802	423,377	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS	379	402	2,187	243,516	銀行
SYSCO CORP	431	409	2,229	248,209	食品・生活必需品小売り
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	7	14	151	16,863	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TECO ENERGY INC	185	—	—	—	公益事業
TELEFLEX INC	—	33	668	74,377	ヘルスケア機器・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	—	718	2,048	228,076	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESORO CORP	92	100	837	93,268	エネルギー
TEXTRON	218	218	1,053	117,307	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	301	316	5,494	611,715	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	103	103	888	98,888	小売
TOLL BROTHERS INC	140	140	525	58,560	耐久消費財・アパレル
TORCHMARK CORP	95	95	721	80,343	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	125	126	751	83,650	ソフトウェア・サービス
DAVITA INC	133	133	866	96,488	ヘルスケア機器・サービス
TYSON FOODS INC	232	241	1,406	156,627	食品・飲料・タバコ
UGI CORP	—	139	703	78,311	公益事業
MARATHON OIL CORP	473	711	962	107,136	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	651	657	7,270	809,513	運輸
UNITED TECHNOLOGIES CORP	647	624	7,604	846,716	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	731	762	13,535	1,507,095	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	72	72	841	93,667	ヘルスケア機器・サービス
VALSPAR CORP/THE	—	61	693	77,180	素材
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	78	78	765	85,235	ヘルスケア機器・サービス
VF CORP	262	267	1,435	159,775	耐久消費財・アパレル
CBS CORP-CL B	338	307	1,891	210,571	メディア
VULCAN MATERIALS CO	104	107	1,357	151,183	素材
WAL-MART STORES	1,230	1,248	9,753	1,085,991	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	347	349	2,509	279,401	商業・専門サービス
WATERS CORP	65	65	1,159	129,128	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLERGAN PLC	302	299	6,690	744,942	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JM SMUCKER CO	92	95	1,225	136,454	食品・飲料・タバコ
WABTEC CORP	71	71	581	64,753	資本財
WEYERHAEUSER CO	610	588	1,942	216,319	不動産

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)	
WHIRLPOOL CORP	61	61	1,104	122,956	耐久消費財・アパレル
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	528	—	—	—	エネルギー
WILLIAMS COS	563	642	1,908	212,512	エネルギー
DICK'S SPORTING GOODS INC	63	78	330	36,757	小売
ALLIANT ENERGY CORPORATION	170	192	796	88,674	公益事業
WEC ENERGY GROUP INC	239	252	1,579	175,825	公益事業
FOOT LOCKER INC	105	114	682	75,994	小売
CARMAX INC	146	161	1,042	116,022	小売
XEROX CORP	739	668	468	52,118	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CIMAREX ENERGY CO	75	75	843	93,871	エネルギー
TJX COMPANIES INC	509	523	3,957	440,649	小売
CBRE GROUP INC-A	243	243	835	93,067	不動産
REGIONS FINL CORP	938	962	1,359	151,359	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	—	40	846	94,240	消費者サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	32	—	—	—	素材
LAS VEGAS SANDS CORP	295	341	1,980	220,497	消費者サービス
MOSAIC CO/THE	232	276	640	71,368	素材
CELANESE CORP-SERIES A	114	110	962	107,201	素材
MOLSON COORS BREWING CO -B	144	151	1,446	161,028	食品・飲料・タバコ
IHS INC-CLASS A	51	—	—	—	商業・専門サービス
ASHLAND INC	48	—	—	—	素材
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	173	205	578	64,390	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	136	123	1,514	168,604	各種金融
GAMESTOP CORP-CLASS A	74	—	—	—	小売
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	89	471	2,844	316,697	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	133	159	314	34,966	耐久消費財・アパレル
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	24	24	1,172	130,495	消費者サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	74	60	487	54,305	運輸
TRANSDIGM GROUP INC	41	44	1,182	131,623	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	762	769	9,357	1,041,821	ソフトウェア・サービス
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	93	93	927	103,318	消費者サービス
HANESBRANDS INC	311	311	644	71,760	耐久消費財・アパレル
WESTERN UNION CO	387	387	739	82,290	ソフトウェア・サービス
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	302	—	—	—	運輸
AERCAP HOLDINGS NV	68	113	507	56,514	資本財
SPECTRA ENERGY CORP	497	—	—	—	エネルギー
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	—	96	725	80,754	ソフトウェア・サービス
DELTA AIR LINES INC	150	150	766	85,378	運輸
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	62	76	302	33,724	エネルギー
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	320	310	1,859	207,054	各種金融
TE CONNECTIVITY LTD	294	280	2,184	243,275	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CONCHO RESOURCES INC	94	117	1,548	172,374	エネルギー
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	—	58	455	50,687	運輸
WABCO HOLDINGS INC	38	46	565	62,970	資本財
VMWARE INC-CLASS A	54	49	479	53,344	ソフトウェア・サービス
TERADATA CORP	95	—	—	—	ソフトウェア・サービス
INVESCO LTD	331	344	1,101	122,659	各種金融
MSCI INC	76	76	770	85,833	各種金融
NETSUITE INC	32	—	—	—	ソフトウェア・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)	
CALPINE CORP	252	252	336	37,441	公益事業
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,188	1,240	14,870	1,655,712	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,494	1,495	14,153	1,575,845	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	141	148	1,388	154,562	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC	133	142	1,107	123,293	公益事業
SIGNET JEWELERS LTD	54	54	266	29,685	小売
MARATHON PETROLEUM CORP	417	417	2,202	245,248	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	128	128	805	89,640	資本財
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	—	18	250	27,837	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	1,463	1,518	2,923	325,455	エネルギー
XYLEM INC	139	139	716	79,798	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	290	280	2,264	252,144	素材
PVH CORP	58	68	715	79,716	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A	91	—	—	—	ソフトウェア・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	—	39	778	86,624	資本財
HCA HEALTHCARE INC	254	236	1,955	217,728	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	62	77	1,137	126,691	ソフトウェア・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	150	150	1,345	149,839	食品・飲料・タバコ
FIRST REPUBLIC BANK/CA	116	125	1,165	129,722	銀行
CIT GROUP INC	120	165	754	83,963	銀行
TARGA RESOURCES CORP	—	141	668	74,476	エネルギー
LEAR CORP	53	52	780	86,873	自動車・自動車部品
DOLLAR GENERAL CORP	225	227	1,645	183,233	小売
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	225	245	1,457	162,230	電気通信サービス
REALOGY HOLDINGS CORP	113	—	—	—	不動産
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	120	138	560	62,354	資本財
GENERAL MOTORS CO	1,082	1,115	3,690	410,872	自動車・自動車部品
VANTIV INC - CL A	111	128	802	89,388	ソフトウェア・サービス
ALLY FINANCIAL INC	308	360	688	76,657	各種金融
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	139	139	511	56,972	耐久消費財・アパレル
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	209	223	1,958	218,012	自動車・自動車部品
PHILLIPS 66	407	372	2,882	320,986	エネルギー
INGREDION INC	—	58	675	75,257	食品・飲料・タバコ
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	65	124	1,067	118,894	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SERVICENOW INC	114	131	1,389	154,674	ソフトウェア・サービス
WHITEWAVE FOODS CO	123	—	—	—	食品・飲料・タバコ
PALO ALTO NETWORKS INC	64	72	851	94,803	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	33	—	—	—	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	79	91	912	101,565	ソフトウェア・サービス
ABBVIE INC	1,245	1,315	8,687	967,301	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOETIS INC	369	379	2,378	264,807	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COTY INC-CL A	—	390	743	82,763	家庭用品・パーソナル用品
MALLINCKRODT PLC	82	95	413	46,029	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SPRINT CORP	533	648	544	60,627	電気通信サービス
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	128	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ARCONIC INC	—	370	1,016	113,200	資本財
ENVISION HEALTHCARE	—	99	550	61,302	ヘルスケア機器・サービス
XL GROUP LTD	—	206	893	99,525	保険
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	—	187	1,289	143,620	ソフトウェア・サービス

銘柄	当 期		末		業 種
	当期首(前期末)	当	期	末	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 外貨建金額	額 邦貨換算金額 (千円)	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	133	162	294	32,759	耐久消費財・アパレル
TECHNIPFC PLC	—	360	1,046	116,535	エネルギー
ANTERO RESOURCES CORP	66	126	266	29,682	エネルギー
TWITTER INC	423	477	870	96,931	ソフトウェア・サービス
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	176	98	270	30,116	エネルギー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	392	165	1,082	120,567	消費者サービス
ARAMARK	170	199	739	82,375	消費者サービス
VOYA FINANCIAL INC	160	160	558	62,197	各種金融
IMS HEALTH HOLDINGS INC	123	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	—	161	496	55,327	エネルギー
FNF GROUP	186	207	881	98,173	保険
SYNCHRONY FINANCIAL	647	651	1,783	198,576	各種金融
MOBILEYE NV	62	147	913	101,725	ソフトウェア・サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	388	400	1,385	154,311	銀行
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	—	117	372	41,439	電気通信サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	110	176	558	62,218	素材
NIELSEN HOLDINGS PLC	260	299	1,153	128,478	商業・専門サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	—	744	3,130	348,575	資本財
WESTROCK CO	182	209	1,153	128,414	素材
FORTIVE CORP	—	242	1,542	171,787	資本財
WASTE CONNECTIONS INC	—	144	1,359	151,408	商業・専門サービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,391	1,320	2,486	276,891	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIRST DATA CORP- CLASS A	—	226	376	41,902	ソフトウェア・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	—	232	1,828	203,562	ソフトウェア・サービス
COLUMBIA PIPELINE GROUP	294	—	—	—	エネルギー
BAXALTA INC	472	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHENIERE ENERGY INC	156	156	790	88,015	エネルギー
AMAZON.COM	305	323	32,208	3,586,094	小売
ADVANCED MICRO DEVICES	—	604	665	74,051	半導体・半導体製造装置
ADOBE SYSTEMS INC	376	399	5,671	631,494	ソフトウェア・サービス
AMGEN	579	595	9,233	1,028,055	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERCO	6	6	209	23,344	運輸
ANALOG DEVICES	232	289	2,396	266,782	半導体・半導体製造装置
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	172	177	1,732	192,854	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMCAST CORP-CL A	1,903	3,811	15,591	1,735,998	メディア
ANSYS INC	68	68	863	96,093	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	4,275	4,278	65,718	7,317,098	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS	918	857	3,900	434,229	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	179	155	1,762	196,221	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESS	354	364	3,697	411,685	ソフトウェア・サービス
BED BATH & BEYOND INC	126	126	439	48,948	小売
B/E AEROSPACE INC	88	—	—	—	資本財
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	114	114	767	85,450	運輸
VERISIGN INC	74	72	657	73,153	ソフトウェア・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,660	1,295	685	76,276	メディア
CSX CORP	756	755	4,075	453,801	運輸
SEAGATE TECHNOLOGY	231	228	971	108,135	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHECK POINT SOFTWARE TECH	50	108	1,201	133,739	ソフトウェア・サービス
CELGENE CORP	604	625	7,304	813,227	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)	
CITRIX SYSTEMS INC	112	125	1,032	114,906	ソフトウェア・サービス
CERNER CORP	229	247	1,610	179,327	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	124	124	867	96,620	保険
CINTAS CORP	74	70	880	98,021	商業・専門サービス
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	826	1,035	137	15,331	電気通信サービス
CISCO SYSTEMS	3,897	4,018	12,659	1,409,509	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MARRIOTT INTL A	153	260	2,786	310,243	消費者サービス
CA INC	244	265	843	93,956	ソフトウェア・サービス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	462	480	3,209	357,393	ソフトウェア・サービス
COSTAR GROUP INC	—	24	635	70,726	ソフトウェア・サービス
DOLLAR TREE INC	165	183	1,432	159,497	小売
EBAY	834	841	2,936	326,909	ソフトウェア・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	238	231	810	90,263	各種金融
CADENCE DESIGN SYSTEMS	—	246	860	95,850	ソフトウェア・サービス
DISH NETWORK CORPORATION-A	167	182	1,168	130,060	メディア
ELECTRONIC ARTS INC	242	242	2,722	303,075	ソフトウェア・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	141	152	809	90,088	運輸
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	510	490	2,929	326,136	ヘルスケア機器・サービス
FASTENAL CO	217	232	1,009	112,422	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	622	622	1,510	168,157	銀行
FISERV INC	173	178	2,217	246,922	ソフトウェア・サービス
FLIR SYSTEMS INC	116	116	432	48,206	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLEX LTD	386	458	776	86,491	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DENTSPLY SIRONA INC	104	194	1,220	135,859	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	1,102	1,065	6,871	765,088	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	216	216	705	78,499	自動車・自動車部品
NVIDIA CORP	414	429	6,090	678,081	半導体・半導体製造装置
NUANCE COMMUNICATIONS INC	175	234	438	48,802	ソフトウェア・サービス
HASBRO INC	90	90	938	104,505	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	65	62	1,141	127,041	ヘルスケア機器・サービス
F5 NETWORKS INC	53	53	680	75,745	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	99	—	—	—	電気通信サービス
UNITED THERAPEUTICS CORP	32	32	386	43,049	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HOLOGIC INC	192	210	914	101,812	ヘルスケア機器・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	119	143	1,262	140,511	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	71	71	603	67,150	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	600	874	1,124	125,167	銀行
BIOGEN INC	170	176	4,416	491,742	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC	191	192	2,670	297,360	ソフトウェア・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	—	72	1,221	136,021	ヘルスケア機器・サービス
IONIS PHARMACEUTICALS INC	90	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTEL CORP	3,623	3,794	13,757	1,531,773	半導体・半導体製造装置
INCYTE CORP	132	133	1,791	199,471	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KLA-TENCOR CORP	118	131	1,374	153,025	半導体・半導体製造装置
LAM RESEARCH CORP	125	134	2,081	231,794	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	141	141	671	74,808	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP	190	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	252	273	617	68,730	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	210	234	1,119	124,636	半導体・半導体製造装置

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)	
ACTIVISION BLIZZARD INC	378	468	2,732	304,238	ソフトウェア・サービス
MICROSOFT CORP	5,817	5,924	41,447	4,614,728	ソフトウェア・サービス
MICRON TECHNOLOGY	805	819	2,439	271,559	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	—	43	560	62,378	資本財
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	148	174	1,422	158,424	半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	302	358	633	70,499	半導体・半導体製造装置
MYLAN NV	326	365	1,451	161,630	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	110	118	2,082	231,817	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	230	230	928	103,428	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NORTHERN TRUST CORP	164	173	1,536	171,030	各種金融
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	76	73	1,838	204,643	小売
PACCAR INC	262	275	1,725	192,098	資本財
PATTERSON COMPANIES INC	70	70	311	34,647	ヘルスケア機器・サービス
PAYCHEX INC	241	255	1,511	168,345	ソフトウェア・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	—	54	773	86,084	ヘルスケア機器・サービス
GARMIN LTD	95	95	501	55,798	耐久消費財・アパレル
COSTCO WHOLESALE CORP	336	352	6,271	698,271	食品・生活必需品小売り
PRICE T ROWE GROUP INC	196	189	1,323	147,385	各種金融
QUALCOMM	1,153	1,186	6,825	759,969	半導体・半導体製造装置
REGENERON PHARMACEUTICALS	57	61	2,792	310,913	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEATTLE GENETICS INC	—	74	489	54,542	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	87	101	965	107,470	保険
ROSS STORES INC	318	323	2,052	228,570	小売
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,216	1,251	5,812	647,140	食品・飲料・タバコ
WILLIS TOWERS WATSON PLC	101	105	1,523	169,612	保険
PRICELINE GROUP INC/THE	38	39	7,401	824,088	小売
SEI INVESTMENTS COMPANY	108	108	541	60,315	各種金融
STAPLES INC	474	555	498	55,496	小売
STARBUCKS CORP	1,140	1,159	7,337	816,913	消費者サービス
NETFLIX INC	306	343	5,575	620,766	小売
STERICYCLE INC	67	67	557	62,083	商業・専門サービス
SYMANTEC CORP	524	516	1,528	170,186	ソフトウェア・サービス
SYNOPSIS INC	110	122	912	101,550	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	29	30	2,787	310,362	ヘルスケア機器・サービス
TEXAS INSTRUMENTS	776	807	6,550	729,362	半導体・半導体製造装置
TRACTOR SUPPLY COMPANY	100	112	618	68,887	小売
TRIMBLE IMS HOLDINGS	206	206	737	82,106	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	186	198	2,384	265,489	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	670	740	6,019	670,173	食品・生活必需品小売り
WESTERN DIGITAL CORP	220	224	2,016	224,496	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SKYWORKS SOLUTIONS INC	142	145	1,536	171,069	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	66	66	832	92,657	消費者サービス
WHOLE FOODS MKT INC	251	251	882	98,257	食品・生活必需品小売り
NASDAQ INC	90	90	612	68,245	各種金融
CME GROUP INC	244	270	3,188	354,984	各種金融
LKQ CORP	225	246	779	86,741	小売
TD AMERITRADE HOLDING CORP	201	221	839	93,459	各種金融
XILINX INC	202	202	1,336	148,826	半導体・半導体製造装置
YAHOO	683	721	3,654	406,911	ソフトウェア・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)	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	53	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIGNATURE BANK	37	43	632	70,379	銀行
LIBERTY GLOBAL PLC-A	201	190	594	66,138	メディア
MEDIVATION INC	117	—	—	—	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	341	369	995	110,815	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	894	831	2,248	250,349	メディア
DEXCOM INC	—	62	431	48,069	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	128	128	331	36,880	メディア
EXPEDIA INC	94	98	1,416	157,755	小売
LIBERTY GLOBAL PLC-C	446	498	1,499	167,006	メディア
VIACOM INC-CLASS B	274	267	939	104,648	メディア
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	350	350	831	92,621	小売
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	84	176	387	43,164	消費者サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	218	273	461	51,435	銀行
LULULEMON ATHLETICA INC	84	84	408	45,494	耐久消費財・アパレル
MERCADOLIBRE INC	—	29	858	95,591	ソフトウェア・サービス
ULTA BEAUTY INC	45	49	1,485	165,349	小売
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	63	63	423	47,202	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	209	169	427	47,638	メディア
ALKERMES PLC	105	125	723	80,605	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SPLUNK INC	88	107	670	74,636	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	126	123	990	110,320	商業・専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	49	49	751	83,635	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NXP SEMICONDUCTORS NV	115	231	2,497	278,083	半導体・半導体製造装置
FORTINET INC	108	108	429	47,797	ソフトウェア・サービス
TESLA INC	76	101	3,295	366,898	自動車・自動車部品
TRIPADVISOR INC	87	103	406	45,210	小売
FACEBOOK INC-A	1,741	1,876	28,547	3,178,444	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	75	739	82,297	エネルギー
T-MOBILE US INC	226	225	1,526	169,969	電気通信サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	129	129	657	73,218	消費者サービス
NEWS CORP-CLASS A	277	334	449	50,023	メディア
CDW CORP/DE	107	124	740	82,453	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	123	99	483	53,832	運輸
IHS MARKIT LTD	—	288	1,334	148,553	商業・専門サービス
LIBERTY SIRIUSXM-A	63	63	266	29,696	メディア
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	152	152	635	70,741	メディア
BROADCOM LTD	299	318	7,682	855,373	半導体・半導体製造装置
ENDO INTERNATIONAL PLC	159	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SABRE CORP	133	172	389	43,311	ソフトウェア・サービス
NAVIENT CORP	298	236	341	38,073	各種金融
CDK GLOBAL INC	95	106	646	71,964	ソフトウェア・サービス
QORVO INC	106	106	825	91,945	半導体・半導体製造装置
LIBERTY BROADBAND-C	—	86	759	84,541	メディア
LIBERTY LILAC GROUP-C	—	90	185	20,693	メディア
KRAFT HEINZ CO/THE	460	488	4,543	505,872	食品・飲料・タバコ
ALPHABET INC-CL A	223	237	23,566	2,623,874	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	830	867	4,442	494,585	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC-C	62	98	426	47,516	ソフトウェア・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)	
ALPHABET INC-CL C	238	248	24,178	2,692,080	ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	105	334	1,701	189,460	食品・飲料・タバコ
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	164	173	5,867	653,314	メディア
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	449	987	738	82,199	不動産
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	196	199	1,270	141,470	資本財
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	—	165	684	76,240	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	240,776 595	250,292 595	1,701,934 —	189,493,437 <61.8%>
(カナダ)			千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES	169	176	1,167	96,575	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	320	340	2,091	172,915	食品・生活必需品小売り
BARRICK GOLD CORP	892	943	2,083	172,267	素材
ATCO LTD -CLASS I	52	52	266	22,041	公益事業
BANK MONTREAL	493	522	4,765	394,040	銀行
BANK NOVA SCOTIA	919	975	7,406	612,409	銀行
NATIONAL BANK OF CANADA	281	281	1,488	123,123	銀行
BCE INC	103	125	761	63,009	電気通信サービス
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	666	698	3,586	296,601	各種金融
BOMBARDIER B	1,578	1,578	355	29,365	資本財
SAPUTO INC	198	203	891	73,745	食品・飲料・タバコ
CGI GROUP INC - CL A	170	173	1,146	94,765	ソフトウェア・サービス
CCL INDUSTRIES INC - CL B	21	21	653	53,999	素材
CAE INC	184	183	402	33,270	資本財
CAMECO CORP	287	287	368	30,434	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	290	288	1,808	149,571	電気通信サービス
CANADIAN IMPERIAL BANK	311	319	3,367	278,468	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	862	894	3,576	295,742	エネルギー
CANADIAN TIRE CORP -CL A	54	54	822	68,052	小売
CANADIAN UTILITIES LTD A	103	103	419	34,676	公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	607	608	6,310	521,794	運輸
FIRST CAPITAL REALTY INC	69	124	247	20,501	不動産
AGRIUM INC	98	109	1,364	112,842	素材
YAMANA GOLD INC	596	852	316	26,212	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	176	176	679	56,174	耐久消費財・アパレル
OPEN TEXT CORP	99	199	874	72,348	ソフトウェア・サービス
ELDORADO GOLD CORP	456	672	302	25,009	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	114	114	237	19,616	食品・生活必需品小売り
VERMILION ENERGY INC	71	100	434	35,936	エネルギー
FINNING INTERNATIONAL INC	117	117	303	25,116	資本財
FORTIS INC	211	316	1,402	115,940	公益事業
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	—	569	674	55,802	素材
TELUS CORP	164	164	756	62,518	電気通信サービス
GREAT-WEST LIFECO INC	226	237	804	66,564	保険
IMPERIAL OIL	213	247	959	79,367	エネルギー
ENBRIDGE	661	1,334	7,004	579,219	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	76	76	304	25,215	各種金融
JEAN COUTU GROUP INC A	55	55	120	9,962	食品・生活必需品小売り
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	710	710	259	21,487	素材
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,514	1,597	3,786	313,092	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)	
LINAMAR CORP	38	38	240	19,915	自動車・自動車部品
LOBLAW COMPANIES LTD	183	183	1,393	115,216	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	69	82	412	34,142	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	307	316	1,918	158,651	自動車・自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	468	495	2,214	183,097	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	17	19	1,185	98,042	保険
METRO INC	191	191	862	71,318	食品・生活必需品小売り
HUSKY ENERGY INC	231	314	507	41,985	エネルギー
EMERA INC	—	40	195	16,153	公益事業
METHANEX CORP	64	70	408	33,776	素材
ONEX CORP	59	66	633	52,410	各種金融
TRANSCANADA CORP	555	694	4,395	363,484	エネルギー
GOLDCORP INC	666	686	1,268	104,906	素材
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	645	676	1,513	125,165	素材
POWER CORP OF CANADA	283	297	860	71,152	保険
POWER FINANCIAL CORP	207	207	669	55,377	保険
ROYAL BANK OF CANADA	1,146	1,185	11,130	920,400	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	121	121	629	52,065	資本財
CP RAILWAY LIMITED	114	113	2,419	200,089	運輸
ENCANA CORP	579	762	1,102	91,197	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	305	359	1,026	84,893	メディア
SUNCOR ENERGY	1,215	1,352	5,760	476,312	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B	372	456	1,150	95,105	素材
THOMSON REUTERS CORP	271	269	1,588	131,332	各種金融
TORONTO-DOMINION BANK	1,432	1,481	9,516	786,904	銀行
WEST FRASER TIMBER CO LTD	43	43	259	21,425	素材
WESTON (GEORGE) LTD	35	47	579	47,953	食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP	819	1,076	613	50,722	素材
INTACT FINANCIAL CORP	99	104	976	80,718	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	286	368	1,035	85,657	素材
CONSTELLATION SOFTWARE INC	14	15	1,049	86,812	ソフトウェア・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	141	142	1,412	116,818	素材
WASTE CONNECTIONS INC	99	—	—	—	商業・専門サービス
CI FINANCIAL CORP	186	186	504	41,716	各種金融
VERESEN INC	232	232	427	35,356	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	153	199	550	45,515	エネルギー
KEYERA CORP	149	149	604	49,959	エネルギー
ALTAGAS INCOME LTD	118	118	361	29,868	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	304	312	1,348	111,531	エネルギー
DOLLARAMA INC	100	90	1,096	90,681	小売
CENOVUS ENERGY INC	592	684	865	71,579	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	271	271	481	39,800	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	126	126	312	25,823	エネルギー
CRESCENT POINT ENERGY CORP	384	432	530	43,839	エネルギー
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	289	289	313	25,886	各種金融
INTER PIPELINE LTD	257	303	802	66,332	エネルギー
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	172	144	431	35,683	エネルギー
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	138	200	501	41,448	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	154	183	1,519	125,666	消費者サービス

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)
HYDRO ONE LTD		—	159	373	30,865	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	28,927	32,979	134,533	11,124,559	
		87	89	—	<3.6%>	
(ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG		158	149	2,576	320,203	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG		771	897	842	104,702	銀行
FRESENIUS SE&CO KGAA		299	323	2,466	306,553	ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		95	95	460	57,207	ソフトウェア・サービス
FUCHS PETROLUB SE -PREF		57	57	282	35,094	素材
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE		47	47	494	61,508	保険
GEA GROUP AG		138	158	583	72,570	資本財
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE		161	191	728	90,578	メディア
CONTINENTAL AG		86	88	1,758	218,586	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG		762	764	2,413	300,014	運輸
AXEL SPRINGER SE		38	38	216	26,967	メディア
MERCK KGAA		104	104	1,104	137,235	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE STAMM		368	428	751	93,374	公益事業
SAP SE		758	791	7,507	933,131	ソフトウェア・サービス
E.ON SE		1,483	1,622	1,223	152,026	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA		74	86	941	116,976	家庭用品・パーソナル用品
METRO STAMM		137	137	420	52,239	食品・生活必需品小売り
BAYER		637	666	7,775	966,478	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG & CO KGAA -PFD		135	143	1,782	221,603	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE		710	739	6,204	771,162	素材
BEIERSDORF AG		75	86	818	101,752	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG		—	19	313	38,940	資本財
HEIDELBERGCEMENT AG		101	114	942	117,188	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA		166	175	1,465	182,222	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE-REG		356	371	6,351	789,461	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		211	211	361	44,988	運輸
MUENCHENER RUECKVERSICH.		129	127	2,205	274,162	保険
VOLKSWAGEN STAMM		25	25	370	45,995	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG-PFD		139	147	2,038	253,435	自動車・自動車部品
DAIMLER AG		744	772	5,052	627,993	自動車・自動車部品
MAN SE		23	32	308	38,320	資本財
THYSSEN KRUPP		265	299	720	89,518	素材
SIEMENS		612	616	7,772	966,089	資本財
LINDE AG		142	146	2,504	311,277	素材
DEUTSCHE BANK NAMEN		1,069	1,671	2,755	342,526	各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		252	259	2,184	271,498	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD		35	49	367	45,622	自動車・自動車部品
K+S AG		143	143	332	41,351	素材
DEUTSCHE TELEKOM		2,437	2,624	4,700	584,291	電気通信サービス
INFINEON TECHNOLOGIES		877	907	1,784	221,864	半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE BOERSE		150	155	1,407	174,927	各種金融
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE		109	128	677	84,266	自動車・自動車部品
FRAPORT AG		35	35	257	31,962	運輸
LANXESS		72	72	461	57,346	素材
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR		255	275	962	119,646	不動産

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)		
SYMRISE AG	94	106	685	85,229	素材	
BRENTAG AG	115	132	694	86,380	資本財	
EVONIK INDUSTRIES AG	103	134	410	51,064	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	669	669	293	36,459	電気通信サービス	
HUGO BOSS AG	48	48	317	39,503	耐久消費財・アパレル	
OSRAM LICHT AG	78	78	531	66,071	資本財	
VONOVIA SE	365	372	1,303	162,050	不動産	
INNOGY SE	—	110	395	49,113	公益事業	
ZALANDO SE	68	68	290	36,050	小売	
COVESTRO AG	—	64	420	52,307	素材	
SCHAEFFLER AG	—	152	231	28,835	自動車・自動車部品	
国 小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	17,002	18,940	93,225	11,587,935
(イタリア)			52	56	—	<3.8%>
ASSICURAZIONI GENERALI	906	942	1,352	168,130	保険	
INTESA SANPAOLO	9,782	10,048	2,634	327,496	銀行	
INTESA SANPAOLO-RNC	650	650	159	19,875	銀行	
UNICREDIT SPA	3,720	1,547	2,567	319,187	銀行	
MEDIOBANCA	419	419	374	46,534	銀行	
SAIPEM SPA	5,902	590	220	27,365	エネルギー	
LUXOTTICA GROUP SPA	133	133	721	89,730	耐久消費財・アパレル	
LEONARDO SPA	289	354	549	68,339	資本財	
ENEL	5,997	6,003	2,886	358,763	公益事業	
ENI	1,938	2,026	2,900	360,524	エネルギー	
SNAM SPA	1,698	2,006	818	101,789	エネルギー	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	655	—	—	—	銀行	
TELECOM ITALIA ORD	8,525	8,525	732	91,083	電気通信サービス	
TELECOM ITALIA RNC	4,701	4,701	330	41,141	電気通信サービス	
ATLANTIA SPA	335	335	825	102,659	運輸	
TERNA SPA	1,137	1,309	659	82,015	公益事業	
EXOR SPA	73	—	—	—	各種金融	
PRYSMIAN SPA	147	147	370	46,037	資本財	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	950	950	197	24,511	保険	
POSTE ITALIANE SPA	—	460	297	37,022	保険	
国 小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	47,965	41,152	18,601	2,312,208
(フランス)			19	18	—	<0.8%>
BOUYGUES ORD	168	168	635	79,026	資本財	
AIR LIQUIDE	261	310	3,441	427,799	素材	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	333	368	730	90,845	公益事業	
LOREAL	190	201	3,814	474,098	家庭用品・パーソナル用品	
CHRISTIAN DIOR	40	44	1,131	140,622	耐久消費財・アパレル	
LVMH	211	223	5,078	631,317	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT AVIATION SA	—	2	285	35,509	資本財	
THALES SA	78	90	896	111,478	資本財	
CAP GEMINI SA	121	133	1,238	153,961	ソフトウェア・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	36	36	203	25,233	食品・生活必需品小売り	
INGENICO GROUP	38	46	406	50,574	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PUBLICIS GROUPE	149	145	972	120,844	メディア	

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)	
LAGADERE S. C. A	90	90	256	31,916	メディア
BOLLORE	618	618	250	31,075	運輸
MICHELIN	148	145	1,684	209,339	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD	167	170	2,053	255,189	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	143	156	1,323	164,550	自動車・自動車部品
REMY COINTREAU	15	15	152	19,017	食品・飲料・タバコ
SEB SA	—	20	321	39,900	耐久消費財・アパレル
VINCI S. A.	364	400	3,083	383,312	資本財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	425	448	3,090	384,133	資本財
VIVENDI	891	791	1,550	192,727	メディア
TECHNIP S. A.	72	—	—	—	エネルギー
TOTAL SA	1,690	1,818	8,623	1,071,923	エネルギー
VALEO SA	64	193	1,256	156,121	自動車・自動車部品
ORANGE	1,517	1,568	2,467	306,751	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	19	21	945	117,558	耐久消費財・アパレル
SOCIETE BIC SA	18	24	265	33,052	商業・専門サービス
DASSAULT SYSTEMES SA	95	104	861	107,096	ソフトウェア・サービス
KERING	59	60	1,786	222,060	耐久消費財・アパレル
CNP ASSURANCES	118	118	229	28,556	保険
CARREFOUR	426	434	1,004	124,844	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	65	76	940	116,857	ソフトウェア・サービス
SANOFI	905	934	8,202	1,019,555	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR	149	149	631	78,505	消費者サービス
SOCIETE GENERALE	563	616	3,044	378,417	銀行
EURAZEO	29	30	193	24,080	各種金融
SODEXO	70	78	951	118,280	消費者サービス
AXA	1,550	1,566	3,712	461,476	保険
PEUGEOT SA	313	408	732	91,091	自動車・自動車部品
JC DECAUX SA	46	46	138	17,185	メディア
ESSILOR INTERNATIONAL	161	162	1,944	241,683	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT AGRICOLE SA	837	928	1,346	167,319	銀行
ZODIAC AEROSPACE	178	178	420	52,221	資本財
BNP PARIBAS	822	859	5,707	709,390	銀行
SAINT-GOBAIN	359	390	1,954	242,901	資本財
WENDEL	18	27	368	45,761	各種金融
ILIAD SA	20	20	473	58,820	電気通信サービス
IMERYS SA	30	30	230	28,642	素材
DANONE (GROUPE)	450	466	3,103	385,722	食品・飲料・タバコ
SAFRAN SA	236	243	1,941	241,289	資本財
ENGIE	1,151	1,229	1,627	202,299	公益事業
ALSTOM	112	112	352	43,852	資本財
EUTELSAT COMMUNICATIONS	119	119	279	34,707	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE	157	227	219	27,245	公益事業
ARKEMA	59	58	555	68,999	素材
LEGRAND SA	205	213	1,304	162,097	資本財
EIFFAGE	—	49	392	48,774	資本財
ADP	23	23	322	40,074	運輸
NATIXIS	699	699	428	53,255	銀行
SCOR SE	133	133	467	58,079	保険

銘柄	株数 (百株)	当期			業種	
		株数 (百株)	期末			
			評価額	金額		
外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)					
REXEL SA	243	243	377	46,922	資本財	
BUREAU VERITAS SA	195	195	418	51,988	商業・専門サービス	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	364	364	383	47,699	運輸	
SUEZ	207	280	457	56,869	公益事業	
EDENRED	189	189	445	55,410	商業・専門サービス	
SFR GROUP SA	75	75	237	29,561	電気通信サービス	
国小計	株数・金額 銘柄数<比率>	19,328	20,405	94,348	11,727,485	
		64	66	—	<3.8%>	
(オランダ)						
AIRBUS SE	449	461	3,412	424,180	資本財	
RELX NV	791	795	1,451	180,450	商業・専門サービス	
RANDSTAD HOLDING NV	95	95	498	61,913	商業・専門サービス	
KONINKLIJKE AHOLD NV	660	1,005	1,988	247,118	食品・生活必需品小売り	
AKZO NOBEL	189	197	1,508	187,478	素材	
UNILEVER NV-CVA	1,258	1,310	6,621	823,014	家庭用品・パーソナル用品	
WOLTERS KLUWER	223	230	902	112,119	商業・専門サービス	
QIAGEN N.V.	149	175	515	64,084	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KONINKLIJKE DSM NV	134	138	913	113,585	素材	
VOPAK	45	63	261	32,487	エネルギー	
AEGON	1,318	1,334	588	73,129	保険	
ASML HOLDING NV	264	294	3,524	438,097	半導体・半導体製造装置	
KPN (KON.)	2,584	2,920	887	110,373	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS	425	533	785	97,614	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS	748	744	2,338	290,618	資本財	
ING GROEP NV-CVA	2,963	3,138	4,770	593,017	銀行	
HEINEKEN NV	175	184	1,611	200,370	食品・飲料・タバコ	
GEMALTO	61	61	324	40,292	ソフトウェア・サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	76	87	721	89,639	食品・飲料・タバコ	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	58	83	255	31,777	資本財	
OCI NV	54	—	—	—	素材	
FERRARI NV	109	106	810	100,777	自動車・自動車部品	
CNH INDUSTRIAL NV	657	859	882	109,669	資本財	
NN GROUP NV	183	264	851	105,809	保険	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	668	777	735	91,415	自動車・自動車部品	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	—	247	579	72,079	銀行	
EXOR NV	—	97	502	62,471	各種金融	
ALTICE NV -B	104	104	236	29,386	メディア	
ALTICE NV -A	283	283	641	79,763	メディア	
国小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,735	16,599	39,120	4,862,736	
		27	28	—	<1.6%>	
(スペイン)						
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	396	489	804	100,014	運輸	
IBERDROLA SA	4,281	4,375	3,065	380,999	公益事業	
ENDESA	247	247	543	67,516	公益事業	
BANKINTER SA	465	588	486	60,468	銀行	
BANCO BILBAO VIZCAYA	4,886	5,405	4,026	500,528	銀行	
GAS NATURAL SDG SA	265	260	568	70,610	公益事業	
REPSOL SA	851	885	1,324	164,673	エネルギー	
BANCO SANTANDER SA	11,318	11,867	6,962	865,491	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)		
RED ELECTRICA CORPORACION SA	81	377	744	92,556	公益事業	
TELEFONICA	3,423	3,598	3,616	449,516	電気通信サービス	
ZARDOYA OTIS SA	134	134	118	14,762	資本財	
INDITEX	830	864	3,136	389,837	小売	
ENAGAS	182	182	473	58,911	エネルギー	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	142	167	599	74,491	資本財	
GRIFOLS SA	227	221	550	68,446	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FERROVIAL SA	357	422	852	106,017	資本財	
MAPFRE SA	909	909	284	35,414	保険	
BANCO DE SABADELL SA	3,569	4,429	811	100,814	銀行	
CAIXABANK	1,847	2,568	1,085	134,932	銀行	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	329	352	1,771	220,186	ソフトウェア・サービス	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	602	765	537	66,751	運輸	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	462	462	253	31,490	食品・生活必需品小売り	
FERROVIAL SA - RTS	357	—	—	—	資本財	
AENA SA	56	56	965	120,009	運輸	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	36,228 24	39,634 23	33,583 —	4,174,441 <1.4%>	
(ベルギー)						
UMICORE	68	85	512	63,692	素材	
DELHAIZE GROUP	74	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
KBC GROEP NV	197	202	1,343	167,010	銀行	
ANHEUSER-BUSCH INBEV	619	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
SOLVAY SA	56	63	748	93,041	素材	
UCB (GROUPE)	93	104	635	78,997	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLRUYT SA	63	63	306	38,082	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	62	62	543	67,501	各種金融	
AGEAS	160	160	604	75,192	保険	
PROXIMUS	131	131	431	53,584	電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	49	49	293	36,492	メディア	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	—	613	6,479	805,349	食品・飲料・タバコ	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,578 11	1,537 10	11,898 —	1,478,944 <0.5%>	
(オーストリア)						
OMV AG	98	105	507	63,023	エネルギー	
VOESTALPINE AG	78	104	427	53,078	素材	
ERSTE GROUP BANK AG	205	259	881	109,515	銀行	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	91	91	224	27,939	銀行	
ANDRITZ AG	52	52	282	35,139	資本財	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	526 5	613 5	2,322 —	288,695 <0.1%>	
(ルクセンブルク)						
EUROFINS SCIENTIFIC	—	9	452	56,256	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TENARIS SA	348	406	568	70,634	エネルギー	
SES	269	313	681	84,689	メディア	
ARCELORMITTAL	751	509	1,016	126,332	素材	
RTL GROUP	24	35	242	30,134	メディア	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,393 4	1,274 5	2,960 —	368,047 <0.1%>	

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)	
(フィンランド)					
WARTSILA OYJ	114	114	608	75,652	資本財
UPM KYMMENE OYJ	383	443	1,119	139,148	素材
STORA ENSO OYJ R	483	483	553	68,750	素材
SAMPO OYJ-A SHS	353	362	1,633	203,007	保険
FORTUM OYJ	334	385	548	68,121	公益事業
ELISA A	100	128	453	56,382	電気通信サービス
METSO OYJ	95	95	292	36,401	資本財
NOKIA OYJ	4,178	4,586	2,630	326,984	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OIL OYJ	93	114	422	52,572	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ	76	102	388	48,229	自動車・自動車部品
KONE OYJ-B	261	269	1,190	147,922	資本財
ORION OYJ-CLASS B	79	79	459	57,148	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	6,556 12	7,166 12	10,300 —	1,280,322 <0.4%>
(アイルランド)					
CRH PLC	643	653	2,086	259,344	素材
KERRY GROUP PLC-A	127	134	1,059	131,641	食品・飲料・タバコ
PADDY POWER PLC	65	65	623	77,482	消費者サービス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	837 3	853 3	3,768 —	468,469 <0.2%>
(ポルトガル)					
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,932	1,932	617	76,743	公益事業
BCP BANCO COMERCIAL NOM	24,400	—	—	—	銀行
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	398	398	552	68,658	エネルギー
JERONIMO MARTINS	202	202	351	43,699	食品・生活必需品小売り
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	26,933 4	2,533 3	1,521 —	189,101 <0.1%>
(その他)					
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	—	170	633	78,704	食品・飲料・タバコ
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	— —	170 1	633 —	78,704 <0.0%>
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	173,085 225	150,880 230	312,285 —	38,817,092 <12.7%>
(イギリス)					
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	742	742	217	31,010	各種金融
ANTOFAGASTA PLC	254	358	295	42,186	素材
ASHTAD GROUP PLC	384	428	672	95,929	資本財
SEVERN TRENT PLC	181	181	458	65,493	公益事業
BHP BILLITON PLC	1,633	1,682	2,026	289,230	素材
ARM HOLDINGS PLC	1,067	—	—	—	半導体・半導体製造装置
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	732	877	527	75,271	耐久消費財・アパレル
SKY PLC	791	767	765	109,243	メディア
AGGREKO PLC	198	—	—	—	商業・専門サービス
BUNZL PLC	248	277	675	96,371	資本財
CAPITA GROUP PLC	533	533	303	43,343	商業・専門サービス
AVIVA PIC	3,143	3,182	1,675	239,114	保険
CRODA INTERNATIONAL PLC	102	102	405	57,911	素材
DIAGEO	1,938	2,026	4,735	675,703	食品・飲料・タバコ

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
SCHRODERS PLC	98	120	381	54,509	各種金融
DCC PLC	—	73	533	76,148	資本財
BAE SYSTEMS PLC	2,474	2,464	1,639	234,022	資本財
PROVIDENT FINANCIAL PLC	111	111	343	49,022	各種金融
BRITISH AMERICAN TOBACCO	1,432	1,485	8,305	1,185,240	食品・飲料・タバコ
STANDARD CHARTERED PLC	2,606	2,587	1,897	270,822	銀行
REXAM PLC	547	—	—	—	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	740	767	2,823	402,960	食品・飲料・タバコ
IMI PLC	175	239	297	42,501	資本財
JOHNSON MATTHEY PLC	143	167	530	75,753	素材
SABMILLER PLC	749	—	—	—	食品・飲料・タバコ
ANGLO AMERICAN PLC	986	1,083	1,140	162,801	素材
COMPASS GROUP PLC	1,279	1,277	2,098	299,452	消費者サービス
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	15,232	15,943	10,761	1,535,680	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP	4,458	4,854	1,215	173,381	保険
UNILEVER PLC	990	1,029	4,437	633,223	家庭用品・パーソナル用品
MEGGITT PLC	662	662	333	47,565	資本財
MORRISON SUPERMARKETS	1,681	1,681	415	59,354	食品・生活必需品小売り
UNITED UTILITIES GROUP PLC	504	588	609	86,977	公益事業
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	702	865	536	76,563	保険
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	272	302	893	127,476	食品・飲料・タバコ
PEARSON	663	663	463	66,137	メディア
PERSIMMON PLC	226	267	654	93,334	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL	1,963	2,084	3,645	520,151	保険
RIO TINTO PLC REG	958	991	3,161	451,157	素材
VODAFONE GROUP PLC	20,438	21,365	4,918	701,857	電気通信サービス
RECKITT BENCKISER PLC	491	507	3,992	569,796	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	852	877	1,450	207,048	商業・専門サービス
OLD MUTUAL PLC	3,975	3,975	781	111,520	保険
ROYAL BANK OF SCOTLAND	2,615	2,955	773	110,320	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	372	447	524	74,841	保険
TRAVIS PERKINS PLC	185	185	305	43,662	資本財
SSE PLC	788	808	1,227	175,195	公益事業
BP PLC	14,089	15,156	7,192	1,026,383	エネルギー
SAGE GROUP PLC	801	893	637	90,943	ソフトウェア・サービス
SMITHS GROUP PLC	296	342	541	77,304	資本財
LLOYDS BANKING GROUP PLC	44,675	51,949	3,726	531,827	銀行
TATE & LYLE	405	405	297	42,384	食品・飲料・タバコ
TAYLOR WIMPAY PLC	2,332	2,705	540	77,112	耐久消費財・アパレル
TESCO	6,020	6,560	1,225	174,886	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	740	844	733	104,699	各種金融
SMITH & NEPHEW PLC	689	710	959	136,931	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE	3,742	3,928	6,456	921,305	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	185	347	49,623	資本財
BABCOCK INTL GROUP PLC	196	196	185	26,457	商業・専門サービス
WPP PLC	1,008	1,039	1,805	257,712	メディア
WOLSELEY LTD	202	202	1,011	144,322	資本財
ASTRAZENECA	973	1,015	5,309	757,648	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEW GKN	1,234	1,484	526	75,087	自動車・自動車部品

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)	
BT GROUP PLC	6,533	6,636	2,082	297,161	電気通信サービス
CARNIVAL PLC	136	157	778	111,020	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	2,892	2,755	3,006	428,990	公益事業
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,168	1,352	522	74,563	小売
BARCLAYS	12,832	13,655	2,890	412,428	銀行
INTERTEK GROUP PLC	124	124	533	76,183	商業・専門サービス
WILLIAM HILL	703	703	201	28,711	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	328	317	565	80,637	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	112	112	491	70,079	小売
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,411	1,470	1,283	183,196	資本財
KINGFISHER PLC	1,651	1,873	614	87,751	小売
ICAP PLC	438	—	—	—	各種金融
ITV PLC	2,954	2,954	591	84,401	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	233	260	882	125,899	各種金融
SAINSBURY (J) PLC	1,141	1,483	417	59,628	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD	72	72	525	74,941	素材
G4S PLC	1,325	1,325	434	62,043	商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC	162	162	326	46,530	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	105	105	349	49,805	耐久消費財・アパレル
CENTRICA PLC	3,756	4,405	895	127,747	公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	3,032	3,491	7,395	1,055,299	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	2,983	3,021	6,545	933,974	エネルギー
INTERCONTINENTAL HOTELS	145	139	608	86,820	消費者サービス
WHITBREAD PLC	146	146	622	88,766	消費者サービス
COBHAM PLC	900	1,511	210	30,080	資本財
INMARSAT PLC	336	336	273	39,042	電気通信サービス
PETROFAC LTD	167	167	65	9,276	エネルギー
SHIRE PLC	449	720	3,350	478,059	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	122	206	29,473	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TUI AG-DI	354	420	491	70,154	消費者サービス
STANDARD LIFE PLC	1,416	1,649	633	90,352	保険
INVESTEC PLC	364	542	338	48,256	各種金融
EXPERIAN PLC	751	768	1,261	180,028	商業・専門サービス
MONDI PLC	272	317	639	91,190	素材
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	180	—	—	—	小売
HARGREAVES LANSDOWN PLC	204	204	284	40,600	各種金融
FRESNILLO PLC	177	177	280	40,029	素材
GLENORE PLC	9,034	9,791	2,863	408,677	素材
DIXONS CARPHONE PLC	667	832	276	39,388	小売
EASYJET PLC	116	116	161	23,008	運輸
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,137	1,137	392	56,048	保険
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	300	300	245	34,964	ヘルスケア機器・サービス
COCA-COLA HBC AG-CDI	139	139	317	45,326	食品・飲料・タバコ
ROYAL MAIL PLC	751	751	329	47,056	運輸
MERLIN ENTERTAINME	485	650	337	48,165	消費者サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	800	800	332	47,462	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY GROUP PLC	916	1,570	498	71,159	ソフトウェア・サービス
小 計	223,194	239,972	151,705	21,648,307	
銘柄数 <比率>	108	104	—	<7.1%>	

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)		
(スイス)			千スイスフラン			
SYNGENTA AG-REG	—	73	3,227	368,558	素材	
SULZER AG-REG	16	—	—	—	資本財	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	2	293	33,462	食品・飲料・タバコ	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	0.75	0.75	445	50,867	食品・飲料・タバコ	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.08	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	39	39	294	33,678	耐久消費財・アパレル	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	6	6	451	51,600	素材	
SWISS PRIME SITE-REG	50	62	558	63,715	不動産	
PARGESA HOLDING SA-BR	18	33	259	29,575	各種金融	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	12	—	—	—	各種金融	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	13	18	380	43,491	資本財	
ACTELION LTD-REG	—	76	2,084	238,016	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Credit Suisse Group AG - RTS	—	1,574	81	9,348	各種金融	
SYNGENTA AG-REG	70	—	—	—	素材	
SIKA AG-BR	1	1	1,022	116,753	素材	
SGS SA	4	4	1,012	115,560	商業・専門サービス	
SWISSCOM	20	20	960	109,656	電気通信サービス	
GEBERIT AG-REG	30	30	1,359	155,187	資本財	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	—	0.08	570	65,192	食品・飲料・タバコ	
GIVAUDAN-REG	7	7	1,478	168,817	素材	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	116	121	3,472	396,478	保険	
NOVARTIS	1,746	1,785	14,031	1,602,154	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABB LTD	1,669	1,503	3,656	417,528	資本財	
ROCHE HOLDING GENUSS	539	561	14,973	1,709,714	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	120	132	965	110,223	商業・専門サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD	358	366	2,134	243,661	素材	
NESTLE SA - REGISTERED	2,445	2,490	20,631	2,355,711	食品・飲料・タバコ	
BALOISE HOLDING AG	38	38	570	65,117	保険	
SONOVA HOLDING AG-REG	41	41	661	75,585	ヘルスケア機器・サービス	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	40	46	731	83,520	運輸	
CREDIT SUISSE GROUP AG	1,399	1,574	2,155	246,113	各種金融	
SWATCH GROUP AG (BEARER)	24	24	941	107,506	耐久消費財・アパレル	
LONZA GROUP AG-REG	39	45	934	106,732	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	24	27	893	102,035	保険	
VIFOR PHARMA AG	2	29	343	39,207	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DUFREY AG-REG	29	39	640	73,187	小売	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	—	14	875	100,005	各種金融	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	33	35	734	83,908	資本財	
ACTELION LTD-REG	81	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARYZTA AG	75	75	258	29,557	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	397	414	3,371	384,954	耐久消費財・アパレル	
JULIUS BAER GROUP LTD	162	188	959	109,600	各種金融	
SWISS RE LTD	273	256	2,251	257,122	保険	
UBS GROUP AG	2,861	2,962	4,696	536,228	各種金融	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	12,818 39	14,730 39	95,369 —	10,889,338 < 3.6% >	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ			
ATLAS COPCO A		515	538	17,145	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)		
LUNDBERGS AB-B SHS	—	36	2,449	31,356	各種金融	
SKF AB-B	334	334	5,912	75,678	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	1,188	1,224	12,909	165,245	銀行	
SWEDBANK AB-A	698	713	14,605	186,956	銀行	
SCA SV CELLULOSA B	450	485	14,717	188,377	家庭用品・パーソナル用品	
VOLVO B	1,188	1,232	17,557	224,742	資本財	
SWEDISH MATCH AB	151	151	4,478	57,318	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	213	335	3,023	38,705	電気通信サービス	
NORDEA BANK AB	2,330	2,441	27,587	353,116	銀行	
ELECTROLUX AB-SER B	181	181	4,998	63,981	耐久消費財・アパレル	
SECURITAS B	228	228	3,152	40,351	商業・専門サービス	
INVESTOR AB-B SHS	355	367	14,623	187,182	各種金融	
HENNES & MAURITZ B	722	739	16,545	211,779	小売	
ASSA ABLOY AB-B	758	802	15,424	197,435	資本財	
SVENSKA HANDELSBK A	1,174	1,201	14,721	188,437	銀行	
ERICSSON (LM) B	2,325	2,481	15,200	194,564	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SANDVIK AB	791	873	11,865	151,882	資本財	
TELIA CO AB	2,028	2,218	8,807	112,742	電気通信サービス	
SKANSKA B	285	285	5,860	75,008	資本財	
LUNDIN PETROLEUM AB	141	141	2,440	31,242	エネルギー	
BOLIDEN AB	181	236	5,769	73,852	素材	
ALFA LAVAL AB	257	257	4,492	57,507	資本財	
GETINGE AB-B SHS	158	158	2,886	36,953	ヘルスケア機器・サービス	
KINNEVIK AB - B	181	181	4,325	55,360	各種金融	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	43	61	3,193	40,870	電気通信サービス	
ICA GRUPPEN AB	57	57	1,808	23,147	食品・生活必需品小売り	
HUSQVARNA AB-B SHS	277	387	3,478	44,521	耐久消費財・アパレル	
ATLAS COPCO B	290	332	9,377	120,030	資本財	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	127	127	2,615	33,484	各種金融	
HEXAGON AB-B SHS	186	215	8,284	106,035	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	280,260	3,587,339		
	・ 金 額	・ 金 額	—	<1.2%>		
	<比 率>	<比 率>				
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	802	802	11,679	154,871	銀行	
NORSK HYDRO	1,061	1,061	5,040	66,830	素材	
TELENOR ASA	608	608	8,381	111,133	電気通信サービス	
SCHIBSTED ASA-CL A	59	59	1,237	16,415	メディア	
ORKLA	602	705	6,018	79,810	食品・飲料・タバコ	
STATOIL ASA	869	878	13,154	174,427	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	134	134	4,350	57,691	素材	
MARINE HARVEST	—	322	4,693	62,240	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	134	185	2,535	33,618	保険	
SCHIBSTED ASA-B SHS	69	69	1,338	17,747	メディア	
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	58,430	774,787		
	・ 金 額	・ 金 額	—	<0.3%>		
	<比 率>	<比 率>				
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
CARLSBERG AS-B	80	82	5,888	98,341	食品・飲料・タバコ	
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	5	5	6,339	105,875	運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	2	2	3,561	59,470	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)		
DANSKE BANK A/S	546	558	14,039	234,460	銀行	
GENMAB A/S	45	45	6,258	104,511	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S	172	176	5,263	87,902	素材	
TDC A/S	524	723	2,765	46,183	電気通信サービス	
DSV A/S	145	145	5,770	96,375	運輸	
WILLIAM DEMANT HOLDING	74	74	1,261	21,065	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS	174	177	10,614	177,258	資本財	
NOVO NORDISK A/S-B	1,509	1,536	42,553	710,635	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLOPLAST-B	83	101	5,647	94,313	ヘルスケア機器・サービス	
TRYG A/S	98	98	1,315	21,976	保険	
PANDORA A/S	80	84	5,286	88,280	耐久消費財・アパレル	
CHR HANSEN HOLDING A/S	74	74	3,446	57,558	素材	
ISS A/S	116	142	3,972	66,337	商業・専門サービス	
DONG ENERGY A/S	—	104	2,958	49,400	公益事業	
小 計	株 数 銘柄 数	金 額 <比 率>	3,734	4,132	126,942	2,119,946
	16	17	—	—	—	<0.7%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
RAMSAY HEALTH CARE LTD	107	122	859	71,233	ヘルスケア機器・サービス	
AGL ENERGY LTD	506	513	1,390	115,250	公益事業	
AUST AND NZ BANKING GROUP	2,255	2,350	6,633	549,642	銀行	
AMCOR	880	884	1,367	113,278	素材	
WESTPAC BANKING	2,566	2,692	8,191	678,785	銀行	
BANK OF QUEENSLAND LTD	243	356	399	33,126	銀行	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,360	1,346	653	54,122	素材	
TELSTRA CORP	3,406	3,423	1,533	127,080	電気通信サービス	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	312	424	482	39,942	銀行	
BRAMBLES LTD	1,165	1,292	1,355	112,277	商業・専門サービス	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	380	461	433	35,929	食品・飲料・タバコ	
ASX LTD	158	158	820	67,980	各種金融	
BHP BILLITON LTD	2,439	2,578	6,191	513,060	素材	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	206	206	673	55,809	エネルギー	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	579	451	166	13,808	小売	
COMPUTERSHARE LIMITED	308	325	476	39,448	ソフトウェア・サービス	
CSL LIMITED	351	363	4,801	397,849	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	234	19,434	メディア	
TRANSURBAN GROUP	1,549	1,628	1,996	165,427	運輸	
COCHLEAR LIMITED	38	50	738	61,219	ヘルスケア機器・サービス	
ORIGIN ENERGY LIMITED	1,314	1,507	1,195	99,038	エネルギー	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	1,316	1,383	11,087	918,686	銀行	
BORAL LIMITED	689	1,040	704	58,395	素材	
RIO TINTO LTD	310	348	2,215	183,581	素材	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	437	437	930	77,062	消費者サービス	
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	1,752	2,020	1,267	104,988	保険	
TPG TELECOM LTD	200	314	189	15,700	電気通信サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	32	32	116	9,644	消費者サービス	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	373	373	736	61,020	素材	
ORICA LTD	292	292	568	47,101	素材	
CIMIC GROUP LIMITED	92	92	376	31,208	資本財	
MACQUARIE GROUP LIMITED	244	245	2,180	180,700	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)		
SUNCORP GROUP LIMITED	951	1,029	1,443	119,648	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	1,990	2,111	6,278	520,273	銀行	
NEWCREST MINING LIMITED	582	611	1,280	106,116	素材	
OIL SEARCH LTD	1,017	1,187	869	72,044	エネルギー	
INCITEC PIVOT LTD	1,101	1,505	530	43,924	素材	
AMP LTD	2,177	2,442	1,257	104,220	各種金融	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	341	341	169	14,037	運輸	
QBE INSURANCE GROUP	1,005	1,130	1,474	122,196	保険	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	440	440	579	48,053	各種金融	
SANTOS	1,281	1,281	445	36,947	エネルギー	
SONIC HEALTHCARE LTD	317	317	717	59,427	ヘルスケア機器・サービス	
TABCORP HOLDINGS	627	627	289	24,014	消費者サービス	
WESFARMERS LTD	878	892	3,804	315,256	食品・生活必需品小売り	
ALUMINA LIMITED	1,704	1,704	325	26,977	素材	
ILUKA RESOURCES LTD	285	—	—	—	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	592	606	1,993	165,191	エネルギー	
WOOLWORTHS LTD	968	1,028	2,678	221,939	食品・生活必需品小売り	
SEEK LTD	213	263	464	38,482	商業・専門サービス	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	55	339	28,167	消費者サービス	
TATTS GROUP LTD	1,242	1,242	532	44,155	消費者サービス	
AUSNET SERVICES	1,202	1,202	207	17,234	公益事業	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	202	—	—	—	各種金融	
ASCIANO GROUP	470	—	—	—	運輸	
CROWN RESORTS LTD	303	303	392	32,543	消費者サービス	
VOCUS GROUP LTD	280	419	123	10,263	電気通信サービス	
AURIZON HOLDINGS LTD	1,594	1,594	881	73,079	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	583	583	757	62,783	食品・飲料・タバコ	
HEALTHSCOPE LTD	1,402	1,402	290	24,060	ヘルスケア機器・サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,145	2,145	602	49,946	保険	
SOUTH32 LTD	3,548	4,537	1,225	101,523	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	55,363 61	58,767 59	90,928 —	7,534,346 <2.5%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	849	849	596	46,741	運輸	
CONTACT ENERGY LTD	589	589	303	23,800	公益事業	
RYMAN HEALTHCARE LTD	220	363	309	24,223	ヘルスケア機器・サービス	
FLETCHER BUILDING LTD	465	626	490	38,422	素材	
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,454	1,454	546	42,865	電気通信サービス	
MERCURY NZ LTD	617	617	200	15,679	公益事業	
MERIDIAN ENERGY LTD	1,105	1,105	320	25,126	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	5,302 7	5,605 7	2,766 —	216,860 <0.1%>	
(香港)			千香港ドル			
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	138	237	2,652	37,870	半導体・半導体製造装置	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,730	1,730	3,383	48,321	不動産	
BANK EAST ASIA	847	1,091	3,520	50,271	銀行	
CLP HOLDINGS	1,455	1,335	11,180	159,659	公益事業	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	860	860	1,007	14,393	運輸	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	500	500	3,330	47,552	公益事業	

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)	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	898	915	17,934	256,097	各種金融
LI & FUNG	3,788	5,548	1,758	25,114	耐久消費財・アパレル
MTR CORP	1,140	1,140	4,919	70,244	運輸
FIRST PACIFIC CO	1,280	1,280	780	11,149	各種金融
HANG LUNG GROUP LTD	—	810	2,575	36,782	不動産
HANG SENG BANK	597	611	10,020	143,091	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMEN	863	949	4,707	67,216	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	1,110	1,110	7,708	110,083	公益事業
WHARF HOLDINGS	990	1,040	6,890	98,389	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	5,416	6,098	9,757	139,337	公益事業
HYSAN DEVELOPMENT CO	400	590	2,129	30,414	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,760	2,000	8,590	122,665	消費者サービス
KERRY PROPERTIES LTD	385	385	1,066	15,228	不動産
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	3,020	3,020	10,479	149,645	銀行
NWS HOLDINGS LTD	990	990	1,494	21,347	資本財
PCCW LTD	3,570	3,570	1,627	23,246	電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	465	685	2,185	31,203	耐久消費財・アパレル
NEW WORLD DEVELOPMENT	3,995	4,915	4,752	67,870	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD	980	980	1,113	15,897	消費者サービス
SINO LAND CO	2,354	2,354	3,121	44,573	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,370	1,170	13,431	191,803	不動産
SWIRE PACIFIC A	405	405	3,154	45,052	不動産
WHEELLOCK & CO LTD	650	650	3,766	53,789	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	935	1,190	4,230	60,410	耐久消費財・アパレル
SJM HOLDINGS LTD	1,320	1,320	971	13,873	消費者サービス
WYNN MACAU LTD	1,028	1,028	1,768	25,249	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	672	672	1,141	16,294	消費者サービス
AIA GROUP LTD	9,318	9,692	53,063	757,749	保険
SANDS CHINA LTD	1,740	2,028	7,077	101,069	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	962	962	2,510	35,854	不動産
WH GROUP LTD	4,765	6,990	4,955	70,770	食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,059	2,129	21,704	309,937	資本財
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	2,074	2,164	12,480	178,228	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	株 数 ・ 金 額	258,946	3,697,753	
	銘柄 数 <比率>	38	39	—	<1.2%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	1,090	1,090	405	32,637	資本財
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	4,190	4,190	161	12,984	食品・飲料・タバコ
DBS GROUP	1,398	1,396	2,903	233,717	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	240	312	330	26,619	不動産
SEMBCORP MARINE LTD	609	—	—	—	資本財
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	99	99	439	35,348	小売
SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	—	512	259	20,852	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	550	623	461	37,157	各種金融
CAPITALAND LTD	1,855	1,871	658	53,010	不動産
GENTING SINGAPORE PLC	4,250	4,250	495	39,852	消費者サービス
KEPPEL CORP LTD	1,123	1,123	731	58,844	資本財
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,450	1,665	399	32,163	運輸
OCBC BANK	2,450	2,453	2,558	205,931	銀行

銘柄	当期末(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)		
SINGAPORE AIRLINES	433	433	428	34,460	運輸	
UNITED OVERSEAS BANK	996	1,038	2,425	195,253	銀行	
UOL GROUP LIMITED	325	325	225	18,154	不動産	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	1,271	1,271	419	33,759	メディア	
NOBLE GROUP LTD	2,975	—	—	—	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	6,289	6,409	2,390	192,428	電気通信サービス	
STARHUB LTD	380	380	102	8,258	電気通信サービス	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	570	570	179	14,451	資本財	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,550	1,550	565	45,537	食品・飲料・タバコ	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	1,330	1,330	167	13,488	資本財	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	2,490	1,891	552	44,444	不動産	
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	37,914	34,781	17,261	1,389,356
			23	22	—	<0.5%>
(イスラエル)					千イスラエルシケル	
BANK HAPOALIM BM	800	937	2,178	67,786	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	949	1,157	2,011	62,572	銀行	
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	1,546	1,546	949	29,532	電気通信サービス	
DELEK GROUP LTD	4	—	—	—	エネルギー	
ELBIT SYSTEMS LTD	—	14	636	19,807	資本財	
FRUTAROM	—	22	527	16,413	素材	
ISRAEL CHEMICALS LTD	327	327	495	15,428	素材	
NICE LTD	48	48	1,359	42,295	ソフトウェア・サービス	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	686	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	82	82	513	15,966	銀行	
AZRIELI GROUP	17	43	833	25,929	不動産	
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	4,463	4,179	9,506	295,732
			9	9	—	<0.1%>
合 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	874,583	895,330	—	291,588,860
			1,247	1,251	—	<95.1%>

(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	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	—	5			698	77,766
BOSTON PROPERTIES	11	12			1,492	166,213
SL GREEN REALTY CORP	7	8			821	91,470
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	70	81			969	107,911
PROLOGIS INC	40	41			2,323	258,721
AVALONBAY COMMUNITIES INC	10	10			2,067	230,184
CAMDEN PROPERTY TRUST	7	7			590	65,712
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	—	11			423	47,176
DUKE REALTY CORP	26	29			857	95,503
CROWN CASTLE INTL CORP	25	28			2,889	321,691
ESSEX PROPERTY TRUST	5	5			1,407	156,693
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	27	28			1,871	208,385
FEDERAL REALTY INVS TRUST	5	6			761	84,794
HCP INC	34	39			1,225	136,495
WELLTOWER INC	26	29			2,165	241,109
KIMCO REALTY CORP	32	35			638	71,078
LIBERTY PROPERTY TRUST	11	11			486	54,177
IRON MOUNTAIN INC	14	20			720	80,231
MACERICH CO/THE	10	10			595	66,272
HOST HOTELS AND RESORTS INC	59	59			1,073	119,483
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5	9			967	107,700
REALTY INCOME CORP	19	21			1,196	133,263
REGENCY CENTERS CORP	7	11			726	80,883
UDR INC	20	20			803	89,450
SIMON PROPERTY GROUP	23	25			3,953	440,167
PUBLIC STORAGE	11	11			2,522	280,874
VENTAS INC	26	27			1,851	206,178
VORNADO REALTY TRUST	12	13			1,230	136,954
EXTRA SPACE STORAGE INC	8	10			787	87,644
DIGITAL REALTY TRUST INC	11	12			1,459	162,545
AGNC INVESTMENT CORP	27	27			556	61,963
VEREIT INC	67	77			648	72,154
GGP INC	43	48			1,091	121,560
HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	472	472			191	21,324
AMERICAN TOWER CORPORATION	32	33			4,441	494,543

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)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12	24	455	50,695
EQUINIX INC	5	5	2,481	276,330
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	10	1,423	158,547
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	—	44	619	68,977
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,236 35	1,392 39	51,489 <1.9%>
(カナダ)			千カナダドル	
SMART REAL ESTATE INVSTMENT	5	5	175	14,499
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9	9	211	17,520
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	10	15	394	32,585
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	25 3	30 3	781 <0.0%>
(フランス)			千ユーロ	
ICADE	2	2	201	25,090
UNIBAIL-RODAMCO SE	7	7	1,800	223,779
KLEPIERRE	16	18	700	87,100
GECINA SA	2	3	485	60,370
FONCIERE DES REGIONS	2	2	192	23,949
ユーロ計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	32 5	35 5	3,381 <0.1%>
(イギリス)			千イギリスポンド	
BRITISH LAND CO PLC	74	84	532	76,056
HAMMERSON PLC	61	61	355	50,726
INTU PROPERTIES PLC	73	73	198	28,283
SEGRO PLC	64	64	316	45,201
LAND SECURITIES GROUP PLC	62	62	671	95,805
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	335 5	346 5	2,074 <0.1%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル	
MIRVAC GROUP	306	306	697	57,826
APA GROUP	89	89	858	71,101
GPT GROUP	136	136	712	59,055
SYDNEY AIRPORT	89	89	652	54,056
STOCKLAND	182	207	972	80,603
WESTFIELD CORP	144	161	1,370	113,570
DUET GROUP	177	—	—	—
DEXUS PROPERTY GROUP	74	74	759	62,925

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)
GOODMAN GROUP	140	140	1,203	99,724
VICINITY CENTERS	254	291	815	67,541
LENDLEASE GROUP	44	44	730	60,496
SCENTRE GROUP	422	426	1,817	150,605
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,063 12	1,966 11	10,590 <0.3%>
(香港)			千香港ドル	
LINK REIT	177	179	10,796	154,180
HKT TRUST AND HKT LTD	187	268	2,733	39,035
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220	220	1,563	22,324
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	584 3	668 3	15,093 <0.1%>
(シンガポール)			千シンガポールドル	
CAPITALAND MALL TRUST	200	200	391	31,518
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	138	197	517	41,649
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	143	143	233	18,818
SUNTEC REIT	173	173	310	24,994
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	654 4	713 4	1,453 <0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	4,932 67	5,152 70	— <2.5%>

(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 500 EMIN	5,025	—
S&P/TSE 60	375	—
SWISS MKT IX	351	—
DJ EURO STOXX	863	—
国		
SPI 200 FUTU	250	—
FTSE 100	698	—

(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	291,588,860	95.1
投 資 信 託 受 益 証 券	268,339	0.1
投 資 証 券	7,455,494	2.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,258,519	2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	306,571,212	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(306,049,807千円)の投資信託財産総額(306,571,212千円)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=111.34円	1カナダドル=82.69円	1ユーロ=124.30円
1イギリスポンド=142.70円	1スイスフラン=114.18円	1スウェーデンクローナ=12.80円
1ノルウェークローネ=13.26円	1デンマーククローネ=16.70円	1オーストラリアドル=82.86円
1ニュージーランドドル=78.38円	1香港ドル=14.28円	1シンガポールドル=80.49円
1イスラエルシェケル=31.11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5月29日現在
(A) 資 産	307,420,978,394円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,187,223,131
株 式(評価額)	291,588,860,060
投資信託受益証券(評価額)	268,339,425
投資証券(評価額)	7,455,494,281
未 収 入 金	1,006,442,834
未 収 配 当 金	704,141,399
差 入 委 託 証 拠 金	1,210,477,264
(B) 負 債	936,475,954
未 払 金	856,971,882
未 払 解 約 金	79,502,814
未 払 利 息	1,258
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	306,484,502,440
元 本	137,921,770,096
次 期 繰 越 損 益 金	168,562,732,344
(D) 受 益 権 総 口 数	137,921,770,096口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,222円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2016年5月31日 至 2017年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	6,322,149,724円
受 取 配 当 金	6,314,971,592
受 取 利 息	1,356,897
そ の 他 収 益 金	13,562,532
支 払 利 息	△7,741,297
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	38,954,116,655
売 買 益	49,334,937,188
売 買 損	△10,380,820,533
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,139,092,380
取 引 益	1,527,971,061
取 引 損	△388,878,681
(D) そ の 他 費 用	△96,436,171
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	46,318,922,588
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	125,594,570,126
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	27,081,632,952
(H) 解 約 差 損 益 金	△30,432,393,322
(I) 計 (E+F+G+H)	168,562,732,344
次 期 繰 越 損 益 金(I)	168,562,732,344

(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140,946,174,108円、期中追加設定元本額は28,131,140,526円、期中一部解約元本額は31,155,544,538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セクション(SMA専用)	30,387,522,600円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	25,519,667,140円
コア投資戦略ファンド(成長型)	10,642,784,525円
DC外国株式インデックス・オープン	6,945,198,599円
DCマイセクション75	4,928,871,810円
DCマイセクション50	4,611,114,864円
世界経済インデックスファンド	4,526,939,143円
コア投資戦略ファンド(安定型)	4,454,781,648円
DC世界経済インデックスファンド	4,312,617,337円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,635,618,202円
分散投資コア戦略ファンドS	3,358,265,356円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	3,255,717,161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)	2,954,056,453円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	2,777,139,803円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,505,180,139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)	2,216,163,131円
分散投資コア戦略ファンドA	1,846,495,997円
DCマイセクションS50	1,825,144,226円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,769,634,612円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,738,363,555円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,589,968,281円
DCマイセクションS75	1,374,233,770円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,367,825,646円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,142,786,191円
外国株式インデックス・オープン	926,923,394円
DCマイセクション25	909,324,225円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	775,792,512円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	560,602,753円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	556,276,977円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	539,891,402円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	536,746,458円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	465,276,826円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	463,054,131円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	419,258,372円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	378,475,797円
DCマイセクションS25	371,775,438円
SMT インデックスバランス・オープン	339,904,693円
DCターゲット・イヤード2035	183,121,359円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	173,818,596円
DCターゲット・イヤード2025	136,003,613円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	124,723,798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)	101,048,182円
DCターゲット・イヤード2045	99,021,376円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	68,295,902円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	47,131,285円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	26,040,458円
SBI資産設計オープン(分配型)	16,587,039円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	16,585,321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9期（決算日 2017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	券物率	純資産額
	期騰	期中落率	期騰	期中落率					
第5期(2013年11月11日)	円	%		%	%	%	%	百万円	
	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	
第9期(2017年11月10日)	17,081	14.6	32,201.21	15.2	96.8	—	—	31,411	

(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	騰落率	騰落率		
(当期首) 2016年11月10日	円	%		%	%	%
	14,906	—	27,964.08	—	96.4	—
11月末	14,969	0.4	28,136.20	0.6	96.6	—
12月末	15,817	6.1	29,797.09	6.6	94.5	—
2017年 1月末	15,744	5.6	29,693.21	6.2	97.4	—
2月末	15,988	7.3	30,171.95	7.9	96.2	—
3月末	16,290	9.3	30,919.89	10.6	97.1	—
4月末	16,286	9.3	30,676.65	9.7	94.4	—
5月末	16,500	10.7	31,119.99	11.3	93.3	—
6月末	16,772	12.5	31,744.11	13.5	95.9	—
7月末	16,886	13.3	31,848.94	13.9	95.5	—
8月末	17,152	15.1	32,368.40	15.7	95.8	—
9月末	17,404	16.8	32,822.61	17.4	95.3	—
10月末	17,039	14.3	32,215.83	15.2	97.0	—
(当期末) 2017年11月10日	17,081	14.6	32,201.21	15.2	96.8	—

(注1)騰落率は期首比です。

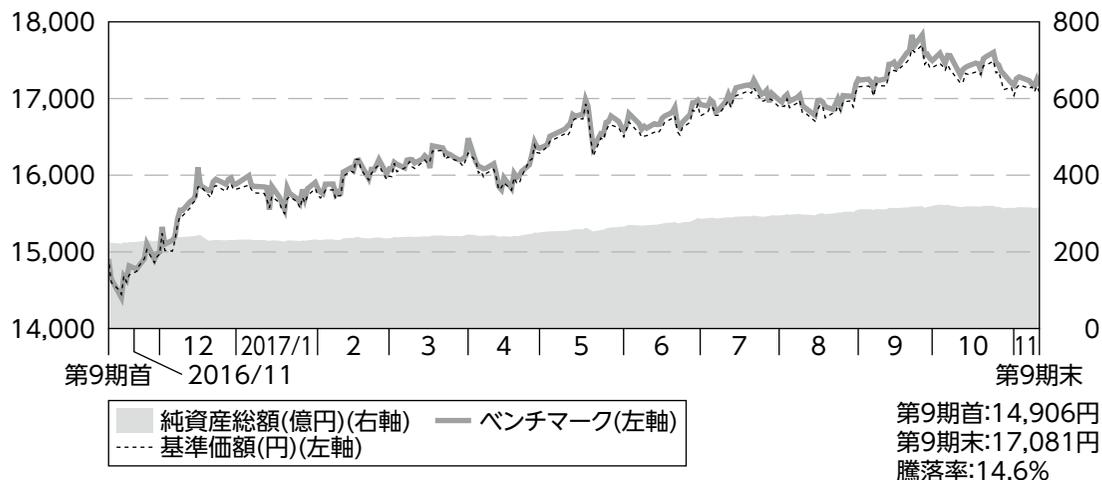
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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、新興国の現貨建債券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、2016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

当期の基準価額は上昇しました。

期初から12月中旬にかけては、米国の次期政権下での経済政策への思惑や利上げ観測の強まりを背景に米国金利が上昇(債券価格は下落)した影響を受けて新興国金利も上昇したものの、円安・米ドル高が進んだことを受けて新興国通貨が対円で上昇し、基準価額は上昇しました。その後は米国の利上げペースが緩やかになるとの見方や欧米株価が堅調に推移したことを受けてリスク選好の動きが強まり、新興国金利が低下(債券価格は上昇)したことから、基準価額は上昇基調で推移しました。9月下旬から期末にかけては、米国の利上げ観測の強まりを受けて新興国からの資金流出懸念が高まり、新興国通貨は対円で下落するとともに、新興国金利が上昇したことから、基準価額は下落しました。

## 投資環境



新興国為替市場では、12月中旬にかけて米国の次期政権下での経済政策への思惑や利上げ観測の強まりを背景に円安・米ドル高が進んだことを受けて新興国通貨は対円で上昇し、その後は概ねもみ合いとなりました。

新興国債券市場では、12月中旬にかけて米国の次期政権下での経済政策への思惑や利上げ観測の強まりを背景に新興国金利が一時上昇しましたが、その後は米国の利上げペースが緩やかになるとの見方などを受けてリスク選好の動きが強まり、低下基調で推移しました。9月下旬から期末にかけては、米国の利上げ観測の強まりを受けて新興国からの資金流出懸念が高まり、新興国金利は上昇しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

当ファンドでは、ベンチマークであるJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・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

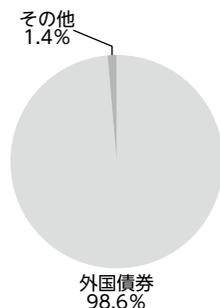
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	3.0%
2	COLOM 7.75% 04/14/21	コロンビア	2.6%
3	CHILE 5.5% 08/05/20	チリ	2.6%
4	BNTNF 10% 01/01/21	ブラジル	1.7%
5	BLTN 0% 01/01/20	ブラジル	1.7%
6	COLOM 4.375% 03/21/23	コロンビア	1.5%

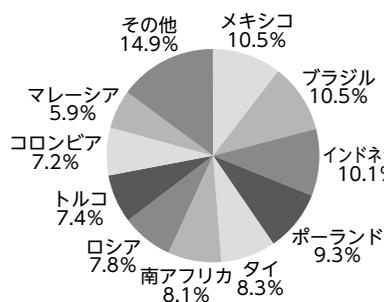
順位	銘柄名	国	組入比率
7	MBONO 5% 12/11/19	メキシコ	1.5%
8	SAGB 10.5% 12/21/26	南アフリカ	1.4%
9	BNTNF 10% 01/01/23	ブラジル	1.3%
10	MBONO 6.5% 06/10/21	メキシコ	1.2%
組入銘柄数		181	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

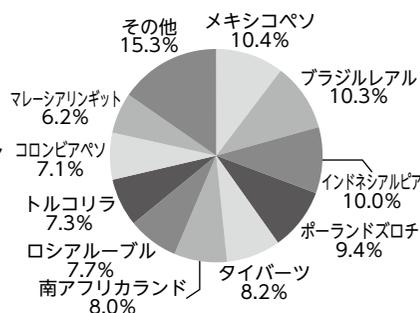
### ○資産別配分



### ○国別配分



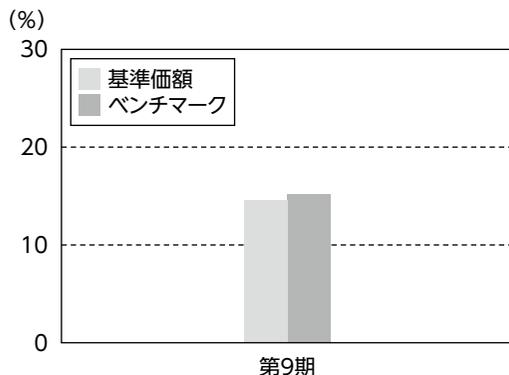
### ○通貨別配分



(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。

取引コスト、カストディコスト、為替および債券評価差\*などが主なマイナス要因となりました。

\*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および債券の評価価格が異なることによる差異です。

## 今後の運用方針

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

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2016年11月11日~2017年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用  (保管費用)  (監査費用) (その他)	22  (21)  (-) (1)	0.134  (0.125)  (-) (0.009)	(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	22	0.134	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(16,403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 245,400	千メキシコペソ 104,485
	ブ ラ ジ ル	国 債 証 券	千ブラジルリアル 51,526	千ブラジルリアル 36,785
	チ リ	国 債 証 券	千チリペソ 4,303,234	千チリペソ -
	コ ロ ン ビ ア	国 債 証 券	千コロンビアペソ 16,127,599	千コロンビアペソ 6,670,446
	ペ ル ー	国 債 証 券	千ペルーヌエボソル 11,447	千ペルーヌエボソル 1,731
	ウ ル グ ア イ	国 債 証 券	千ウルグアイペソ 23,890	千ウルグアイペソ 263
	ト ル コ	国 債 証 券	千トルコリラ 38,686	千トルコリラ 21,637
	チ ェ コ	国 債 証 券	千チェココルナ 248,522	千チェココルナ -
	ハ ン ガ リ ー	国 債 証 券	千ハンガリーフォリント 1,015,374	千ハンガリーフォリント 853,611
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 33,657	千ポーランドズロチ 29,031
	ロ シ ア	国 債 証 券	千ロシアルーブル 570,880	千ロシアルーブル 154,116
	国	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 26,226
タ イ		国 債 証 券	千タイバーツ 249,211	千タイバーツ 79,474
イ ン ド ネ シ ア		国 債 証 券	千インドネシアルピア 102,693,990	千インドネシアルピア 30,689,750
南 ア フ リ カ		国 債 証 券	千南アフリカランド 74,817	千南アフリカランド 40,435

(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	$\frac{B}{A}$ %	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 16,332	百万円 —	—	百万円 11,181	百万円 3	0.0
金 銭 信 託	381	381	100.0	385	385	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	84,770	20,875	24.6	84,713	20,862	24.6

(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。

※ 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;外国(外貨建)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 B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
メ キ シ コ	千メキシコペソ 519,350	千メキシコペソ 529,847	千円 3,157,892	% 10.1	% —	% 5.4	% 4.0	% 0.6	
ブ ラ ジ ル	千ブラジルリアル 97,350	千ブラジルリアル 91,304	3,183,796	10.1	10.1	3.1	4.5	2.6	
チ リ	千チリペソ 4,200,000	千チリペソ 4,435,053	796,979	2.5	—	—	2.5	—	
コ ロ ン ビ ア	千コロンビアペソ 52,050,000	千コロンビアペソ 57,438,893	2,159,702	6.9	—	4.4	2.5	—	
ペ ル ー	千ペルーヌエボソル 22,650	千ペルーヌエボソル 25,111	878,133	2.8	—	2.6	0.2	—	
ウ ル グ ア イ	千ウルグアイペソ 22,250	千ウルグアイペソ 22,921	88,934	0.3	—	0.1	0.2	—	
ト ル コ	千トルコリラ 84,350	千トルコリラ 76,204	2,233,554	7.1	—	3.1	3.3	0.7	
チ ェ コ	千チェココルナ 218,950	千チェココルナ 235,701	1,218,574	3.9	—	1.9	1.3	0.7	
ハン ガ リ ー	千ハンガリーフォリント 3,041,000	千ハンガリーフォリント 3,472,276	1,470,161	4.7	—	1.9	2.1	0.7	
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 90,800	千ポーランドズロチ 91,657	2,861,534	9.1	—	2.9	4.5	1.7	
ロ シ ア	千ロシアルーブル 1,236,850	千ロシアルーブル 1,242,084	2,372,382	7.6	—	4.8	1.9	0.8	
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 67,100	千マレーシアリンギット 66,712	1,804,561	5.7	—	2.9	2.3	0.5	
タ イ	千タイバーツ 691,350	千タイバーツ 744,422	2,553,368	8.1	—	4.3	2.8	1.1	
フィ リ ピ ン	千フィリピンペソ 40,000	千フィリピンペソ 42,764	94,509	0.3	—	0.2	0.1	—	
インドネシア	千インドネシアルピア 337,300,000	千インドネシアルピア 367,008,009	3,082,867	9.8	—	7.6	1.8	0.4	
南 ア フ リ カ	千南アフリカランド 348,300	千南アフリカランド 308,376	2,454,677	7.8	—	6.8	0.7	0.2	
合 計	—	—	30,411,630	96.8	10.1	52.1	34.7	10.0	

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	当期		期末		償還年月日
		額面金額	評価額		額	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
<b>(メキシコ)</b>						
国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ			
MBONO 10% 11/20/36	10.0	11,800	14,741	87,860	2036/11/20	
MBONO 10% 12/05/24	10.0	44,350	51,495	306,912	2024/12/5	
MBONO 5% 12/11/19	5.0	78,200	75,201	448,200	2019/12/11	
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	37,800	34,490	205,566	2026/3/5	
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	41,700	40,810	243,228	2022/6/9	
MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	63,000	61,953	369,245	2021/6/10	
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	27,100	27,599	164,490	2027/6/3	
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	24,800	25,580	152,461	2031/5/29	
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	40,250	41,048	244,648	2042/11/13	
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	24,600	25,328	150,960	2034/11/23	
MBONO 8% 06/11/20	8.0	34,200	35,015	208,690	2020/6/11	
MBONO 8% 11/07/47	8.0	8,000	8,383	49,965	2047/11/7	
MBONO 8% 12/07/23	8.0	17,300	18,096	107,857	2023/12/7	
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	18,700	20,465	121,971	2029/5/31	
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	16,350	18,000	107,281	2038/11/18	
MBONO 8.5% 12/13/18	8.5	31,200	31,636	188,551	2018/12/13	
小計				3,157,892		
<b>(ブラジル)</b>						
国債証券		千ブラジルレアル	千ブラジルレアル			
BLTN 0% 01/01/19	—	4,850	4,481	156,278	2019/1/1	
BLTN 0% 01/01/20	—	17,850	15,011	523,433	2020/1/1	
BLTN 0% 04/01/19	—	8,650	7,827	272,939	2019/4/1	
BLTN 0% 07/01/19	—	4,500	3,980	138,805	2019/7/1	
BLTN 0% 07/01/20	—	11,800	9,432	328,921	2020/7/1	
BNTNF 10% 01/01/19	10.0	6,750	6,943	242,130	2019/1/1	
BNTNF 10% 01/01/21	10.0	14,800	15,167	528,904	2021/1/1	
BNTNF 10% 01/01/23	10.0	11,100	11,253	392,401	2023/1/1	
BNTNF 10% 01/01/25	10.0	6,850	6,878	239,864	2025/1/1	
BNTNF 10% 01/01/27	10.0	7,450	7,430	259,093	2027/1/1	
BRAZIL 10.25% 01/10/28	10.25	400	437	15,264	2028/1/10	
BRAZIL 12.5% 01/05/22	12.5	450	511	17,849	2022/1/5	
BRAZIL 8.5% 01/05/24	8.5	1,900	1,947	67,909	2024/1/5	
小計				3,183,796		
<b>(チリ)</b>						
国債証券		千チリペソ	千チリペソ			
CHILE 5.5% 08/05/20	5.5	4,200,000	4,435,053	796,979	2020/8/5	
<b>(コロンビア)</b>						
国債証券		千コロンビアペソ	千コロンビアペソ			
COLOM 4.375% 03/21/23	4.375	12,950,000	12,253,484	460,731	2023/3/21	
COLOM 7.75% 04/14/21	7.75	19,600,000	20,812,652	782,555	2021/4/14	
COLOM 9.85% 06/28/27	9.85	19,500,000	24,372,757	916,415	2027/6/28	
小計				2,159,702		
<b>(ペルー)</b>						
国債証券		千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル			
PERUGB 5.7% 08/12/24	5.7	3,100	3,294	115,195	2024/8/12	
PERUGB 6.15% 08/12/32	6.15	3,850	4,048	141,573	2032/8/12	
PERUGB 6.35% 08/12/28	6.35	4,300	4,675	163,509	2028/8/12	
PERUGB 6.9% 08/12/37	6.9	2,800	3,105	108,597	2037/8/12	
PERUGB 6.95% 08/12/31	6.95	3,650	4,138	144,723	2031/8/12	
PERUGB 7.84% 08/12/20	7.84	1,650	1,823	63,759	2020/8/12	
PERUGB 8.2% 08/12/26	8.2	3,300	4,025	140,774	2026/8/12	
小計				878,133		
<b>(ウルグアイ)</b>						
国債証券		千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ			
URUGUA 8.5% 03/15/28	8.5	10,500	10,471	40,630	2028/3/15	
URUGUA 9.875% 06/20/22	9.875	11,750	12,449	48,303	2022/6/20	
小計				88,934		

銘柄	利率 (%)	当期		期末		償還年月日
		額面金額	評価額		額	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
<b>(トルコ)</b>						
国債証券		千トルコリラ	千トルコリラ			
TURKGB 10.4% 03/20/24	10.4	1,600	1,485	43,552	2024/3/20	
TURKGB 10.4% 03/27/19	10.4	2,700	2,604	76,325	2019/3/27	
TURKGB 10.5% 01/15/20	10.5	3,150	2,998	87,900	2020/1/15	
TURKGB 10.5% 08/11/27	10.5	4,000	3,684	107,978	2027/8/11	
TURKGB 10.6% 02/11/26	10.6	8,950	8,312	243,644	2026/2/11	
TURKGB 10.7% 02/17/21	10.7	6,500	6,130	179,683	2021/2/17	
TURKGB 10.7% 08/17/22	10.7	5,500	5,151	150,977	2022/8/17	
TURKGB 11% 02/24/27	11.0	1,800	1,704	49,959	2027/2/24	
TURKGB 11% 03/02/22	11.0	6,050	5,733	168,061	2022/3/2	
TURKGB 7.1% 03/08/23	7.1	4,950	3,968	116,313	2023/3/8	
TURKGB 7.4% 02/05/20	7.4	3,850	3,430	100,553	2020/2/5	
TURKGB 8% 03/12/25	8.0	6,450	5,213	152,819	2025/3/12	
TURKGB 8.5% 07/10/19	8.5	5,450	5,081	148,947	2019/7/10	
TURKGB 8.5% 09/14/22	8.5	2,450	2,112	61,919	2022/9/14	
TURKGB 8.8% 09/27/23	8.8	5,050	4,350	127,513	2023/9/27	
TURKGB 9% 07/24/24	9.0	5,000	4,339	127,198	2024/7/24	
TURKGB 9.2% 09/22/21	9.2	3,000	2,680	78,551	2021/9/22	
TURKGB 9.4% 07/08/20	9.4	4,900	4,513	132,290	2020/7/8	
TURKGB 9.5% 01/12/22	9.5	3,000	2,707	79,364	2022/1/12	
小計				2,233,554		
<b>(チェコ)</b>						
国債証券		千チェココルナ	千チェココルナ			
CZGB 0% 02/10/20	—	1,850	1,833	9,480	2020/2/10	
CZGB 0.45% 10/25/23	0.45	14,500	14,046	72,618	2023/10/25	
CZGB 0.95% 05/15/30	0.95	17,550	15,756	81,458	2030/5/15	
CZGB 1% 06/26/26	1.0	17,500	16,862	87,178	2026/6/26	
CZGB 1.5% 10/29/19	1.5	43,100	44,142	228,218	2019/10/29	
CZGB 2.4% 09/17/25	2.4	16,500	17,837	92,222	2025/9/17	
CZGB 2.5% 08/25/28	2.5	17,250	18,567	95,996	2028/8/25	
CZGB 3.75% 09/12/20	3.75	17,800	19,427	100,441	2020/9/12	
CZGB 3.85% 09/29/21	3.85	33,000	37,063	191,618	2021/9/29	
CZGB 4.7% 09/12/22	4.7	15,000	17,824	92,152	2022/9/12	
CZGB 5.7% 05/25/24	5.7	24,900	32,338	167,188	2024/5/25	
小計				1,218,574		
<b>(ハンガリー)</b>						
国債証券		千ハンガリーフォロント	千ハンガリーフォロント			
HGB 1% 09/23/20	1.0	139,000	140,777	59,605	2020/9/23	
HGB 1.75% 10/26/22	1.75	155,000	159,512	67,537	2022/10/26	
HGB 2% 10/30/19	2.0	173,000	179,621	76,051	2019/10/30	
HGB 2.5% 10/27/21	2.5	255,000	270,951	114,720	2021/10/27	
HGB 3% 06/26/24	3.0	278,000	301,869	127,811	2024/6/26	
HGB 3% 10/27/27	3.0	180,000	191,885	81,244	2027/10/27	
HGB 3.5% 06/24/20	3.5	302,000	326,757	138,349	2020/6/24	
HGB 5.5% 06/24/25	5.5	397,000	496,321	210,142	2025/6/24	
HGB 5.5% 12/20/18	5.5	98,000	103,907	43,994	2018/12/20	
HGB 6.0% 11/24/23	6.0	332,000	421,555	178,486	2023/11/24	
HGB 6.5% 06/24/19	6.5	210,000	231,853	98,166	2019/6/24	
HGB 7% 06/24/22	7.0	285,000	361,776	153,176	2022/6/24	
HGB 7.5% 11/12/20	7.5	237,000	285,486	120,875	2020/11/12	
小計				1,470,161		
<b>(ポーランド)</b>						
国債証券		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			
POLGB 0% 04/25/19	—	3,300	3,235	101,009	2019/4/25	
POLGB 1.5% 04/25/20	1.5	6,150	6,099	190,433	2020/4/25	
POLGB 1.75% 07/25/21	1.75	8,400	8,232	257,031	2021/7/25	

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)	
POLGB 2% 04/25/21	2.0	7,300	7,244	226,179	2021/4/25
POLGB 2.25% 04/25/22	2.25	10,300	10,163	317,318	2022/4/25
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	10,500	9,847	307,448	2026/7/25
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	6,350	5,880	183,579	2027/7/25
POLGB 3.25% 07/25/19	3.25	8,350	8,595	268,360	2019/7/25
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	6,900	6,913	215,841	2025/7/25
POLGB 4% 10/25/23	4.0	6,450	6,834	213,375	2023/10/25
POLGB 5.25% 10/25/20	5.25	4,650	5,080	158,615	2020/10/25
POLGB 5.5% 10/25/19	5.5	4,600	4,941	154,282	2019/10/25
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	5,550	6,334	197,773	2022/9/23
POLGB 5.75% 10/25/21	5.75	2,000	2,251	70,286	2021/10/25
小計				2,861,534	
<b>(ロシア)</b>		千ロシアルーブル	千ロシアルーブル		
<b>国債証券</b>					
RFLB 6.4% 05/27/20	6.4	62,000	60,773	116,077	2020/5/27
RFLB 6.7% 05/15/19	6.7	91,000	90,308	172,489	2019/5/15
RFLB 6.8% 12/11/19	6.8	46,200	45,829	87,534	2019/12/11
RFLB 7% 01/25/23	7.0	42,700	42,008	80,235	2023/1/25
RFLB 7% 08/16/23	7.0	81,200	79,898	152,605	2023/8/16
RFLB 7.05% 01/19/28	7.05	92,000	89,186	170,346	2028/1/19
RFLB 7.1% 10/16/24	7.1	90,000	88,134	168,337	2024/10/16
RFLB 7.4% 12/07/22	7.4	104,400	104,459	199,517	2022/12/7
RFLB 7.5% 02/27/19	7.5	45,800	45,968	87,799	2019/2/27
RFLB 7.5% 08/18/21	7.5	100,400	100,969	192,852	2021/8/18
RFLB 7.6% 04/14/21	7.6	64,350	64,990	124,132	2021/4/14
RFLB 7.6% 07/20/22	7.6	47,500	47,991	91,664	2022/7/20
RFLB 7.7% 03/23/33	7.7	88,600	88,555	169,140	2033/3/23
RFLB 7.75% 09/16/26	7.75	97,600	99,106	189,293	2026/9/16
RFLB 8.15% 02/03/27	8.15	105,000	109,569	209,277	2027/2/3
RFLB 8.5% 09/17/31	8.5	78,100	84,333	161,077	2031/9/17
小計				2,372,382	
<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 3.418% 08/15/22	3.418	3,400	3,341	90,395	2022/8/15
MGS 3.48% 03/15/23	3.48	5,200	5,104	138,074	2023/3/15
MGS 3.492% 03/31/20	3.492	7,000	7,049	190,678	2020/3/31
MGS 3.62% 11/30/21	3.62	3,850	3,834	103,713	2021/11/30
MGS 3.654% 10/31/19	3.654	4,550	4,580	123,892	2019/10/31
MGS 3.659% 10/15/20	3.659	5,100	5,134	138,899	2020/10/15
MGS 3.759% 03/15/19	3.759	1,400	1,409	38,117	2019/3/15
MGS 3.8% 08/17/23	3.8	5,500	5,450	147,444	2023/8/17
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	2,800	2,743	74,216	2027/11/16
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	2,400	2,341	63,330	2026/11/30
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	4,750	4,684	126,724	2025/9/15
MGS 4.059% 09/30/24	4.059	3,500	3,516	95,110	2024/9/30
MGS 4.16% 07/15/21	4.16	2,250	2,285	61,827	2021/7/15
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	3,700	3,718	100,594	2024/7/15
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	4,200	4,041	109,329	2031/6/30
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	2,450	2,313	62,593	2035/5/31
MGS 4.378% 11/29/19	4.378	5,050	5,161	139,618	2019/11/29
小計				1,804,561	
<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	79,000	79,294	271,980	2022/6/17
THAIGB 2% 12/17/22	2.0	7,000	7,051	24,186	2022/12/17
THAIGB 2.125% 12/17/26	2.125	36,000	35,491	121,735	2026/12/17
THAIGB 2.55% 06/26/20	2.55	76,750	78,814	270,333	2020/6/26
THAIGB 3.4% 06/17/36	3.4	38,000	41,259	141,521	2036/6/17

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 3.625% 06/16/23	3.625	74,500	81,235	278,636	2023/6/16
THAIGB 3.65% 06/20/31	3.65	60,000	66,397	227,742	2031/6/20
THAIGB 3.65% 12/17/21	3.65	91,000	98,055	336,330	2021/12/17
THAIGB 3.85% 12/12/25	3.85	65,400	73,246	251,235	2025/12/12
THAIGB 3.875% 06/13/19	3.875	94,700	98,345	337,323	2019/6/13
THAIGB 4.875% 06/22/29	4.875	69,000	85,231	292,343	2029/6/22
小計				2,553,368	
<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	9,919	21,921	2022/11/26
PHILIP 4.95% 01/15/21	4.95	10,000	10,303	22,770	2021/1/15
PHILIP 6.25% 01/14/36	6.25	20,000	22,541	49,816	2036/1/14
小計				94,509	
<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	8,053,227	67,647	2030/8/15
INDOGB 11% 09/15/25	11.0	6,700,000	8,417,377	70,705	2025/9/15
INDOGB 11% 11/15/20	11.0	12,500,000	14,172,375	119,047	2020/11/15
INDOGB 12.8% 06/15/21	12.8	6,800,000	8,231,842	69,147	2021/6/15
INDOGB 5.625% 05/15/23	5.625	14,500,000	14,018,817	117,758	2023/5/15
INDOGB 6.125% 05/15/28	6.125	6,500,000	6,128,427	51,478	2028/5/15
INDOGB 6.625% 05/15/33	6.625	26,500,000	25,399,455	213,355	2033/5/15
INDOGB 7% 05/15/22	7.0	17,000,000	17,581,825	147,687	2022/5/15
INDOGB 7% 05/15/27	7.0	22,200,000	22,953,246	192,807	2027/5/15
INDOGB 7.5% 08/15/32	7.5	4,000,000	4,151,420	34,871	2032/8/15
INDOGB 7.875% 04/15/19	7.875	13,200,000	13,649,328	114,654	2019/4/15
INDOGB 8.25% 05/15/36	8.25	16,700,000	18,309,796	153,802	2036/5/15
INDOGB 8.25% 06/15/32	8.25	16,600,000	18,037,394	151,514	2032/6/15
INDOGB 8.25% 07/15/21	8.25	26,200,000	28,057,056	235,679	2021/7/15
INDOGB 8.375% 03/15/24	8.375	32,000,000	35,222,080	295,865	2024/3/15
INDOGB 8.375% 03/15/34	8.375	21,000,000	23,238,180	195,200	2034/3/15
INDOGB 8.375% 09/15/26	8.375	33,800,000	37,889,800	318,274	2026/9/15
INDOGB 8.75% 05/15/31	8.75	21,900,000	24,927,456	209,390	2031/5/15
INDOGB 9% 03/15/29	9.0	21,500,000	24,909,255	209,237	2029/3/15
INDOGB 9.5% 07/15/31	9.5	11,400,000	13,659,651	114,741	2031/7/15
小計				3,082,867	
<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	49,000	52,567	418,436	2026/12/21
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	16,300	11,138	88,658	2036/3/31
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	29,300	19,734	157,089	2041/2/28
SAGB 6.75% 03/31/21	6.75	14,150	13,531	107,709	2021/3/31
SAGB 7% 02/28/31	7.0	25,800	20,391	162,318	2031/2/28
SAGB 7.25% 01/15/20	7.25	16,000	15,758	125,433	2020/1/15
SAGB 7.75% 02/28/23	7.75	19,100	18,421	146,632	2023/2/28
SAGB 8% 01/31/30	8.0	22,300	19,506	155,272	2030/1/31
SAGB 8% 12/21/18	8.0	9,450	9,484	75,495	2018/12/21
SAGB 8.25% 03/31/32	8.25	27,100	23,581	187,705	2032/3/31
SAGB 8.5% 01/31/37	8.5	31,300	26,884	214,004	2037/1/31
SAGB 8.75% 01/31/44	8.75	21,200	18,219	145,030	2044/1/31
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	29,650	25,522	203,162	2048/2/28
SAGB 8.875% 02/28/35	8.875	16,800	15,102	120,219	2035/2/28
SAGB 9% 01/31/40	9.0	20,850	18,531	147,508	2040/1/31
小計				2,454,677	
合計				30,411,630	

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

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	30,411,630	96.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,146,458	3.6
投 資 信 託 財 産 総 額	31,558,088	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(31,345,300千円)の投資信託財産総額(31,558,088千円)に対する比率は99.3%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=113.39円	1メキシコペソ=5.96円	1ブラジルレアル=34.87円
1チリペソ=0.1797円	1コロンビアペソ=0.0376円	1ペルーヌエボソル=34.97円
1ウルグアイペソ=3.88円	1トルコリラ=29.31円	1チェココルナ=5.17円
1ハンガリーフォリント=0.4234円	1ポーランドズロチ=31.22円	1ロシアルーブル=1.91円
1マレーシアリンギット=27.05円	1タイバーツ=3.43円	1フィリピンペソ=2.21円
1インドネシアルピア=0.0084円	1南アフリカランド=7.96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11月10日現在
(A) 資 産	31,677,825,422円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	580,034,043
公 社 債(評価額)	30,411,630,233
未 収 入 金	119,737,088
未 収 利 息	527,053,505
前 払 費 用	39,370,553
(B) 負 債	266,540,976
未 払 金	120,132,495
未 払 解 約 金	146,408,100
未 払 利 息	381
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	31,411,284,446
元 本	18,389,934,192
次 期 繰 越 損 益 金	13,021,350,254
(D) 受 益 権 総 口 数	18,389,934,192口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,081円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2016年11月11日 至 2017年11月10日
(A) 配 当 等 収 益	1,665,537,797円
受 取 利 息	1,663,524,528
そ の 他 収 益 金	2,257,637
支 払 利 息	△244,368
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,772,075,123
売 買 益	2,604,205,743
売 買 損	△832,130,620
(C) そ の 他 費 用	△35,805,828
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	3,401,807,092
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	7,512,613,318
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,417,992,907
(G) 解 約 差 損 益 金	△1,311,063,063
(H) 計 (D+E+F+G)	13,021,350,254
次 期 繰 越 損 益 金(H)	13,021,350,254

(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15,311,575,807円、期中追加設定元本額は5,136,113,897円、期中一部解約元本額は2,057,755,512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。

世界経済インデックスファンド	4,470,395,185円
SMT 新興国債券インデックス・オープン	3,476,164,332円
DC新興国債券インデックス・オープン	3,357,187,701円
DC世界経済インデックスファンド	3,296,051,209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)	1,912,162,764円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,205,559,435円
SMT インデックスバランス・オープン	217,190,033円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	175,279,702円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	103,880,848円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	92,552,261円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	29,734,815円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	28,175,176円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	24,983,878円
SMT 世界経済インデックス・オープン	384,616円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	232,237円

## お知らせ

デリバティブ取引について、リスク回避ならびに投資対象資産を保有した場合の代替の目的としてのみ利用することを明確にするために、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2017年10月2日)

# 新興国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第9期（決算日 2017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5期(2013年11月11日)	21,178	28.2	19,592	25.0	97.4	2.1	0.4	百万円 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
第9期(2017年11月10日)	30,310	41.2	25,570	38.3	98.5	1.0	0.5	47,713

(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) 2016年11月10日	21,467	—	18,491	—	98.6	0.7	0.7
11月末	22,283	3.8	19,195	3.8	98.5	0.7	0.7
12月末	23,106	7.6	19,890	7.6	95.0	4.3	0.7
2017年 1月末	23,960	11.6	20,669	11.8	97.5	1.9	0.7
2月末	24,460	13.9	21,052	13.8	97.1	2.4	0.7
3月末	25,081	16.8	21,633	17.0	97.1	2.2	0.6
4月末	25,295	17.8	21,685	17.3	97.5	2.0	0.6
5月末	26,097	21.6	22,329	20.8	94.0	5.8	0.6
6月末	26,488	23.4	22,589	22.2	95.8	3.6	0.6
7月末	27,516	28.2	23,330	26.2	96.7	3.1	0.6
8月末	28,230	31.5	23,895	29.2	96.0	3.5	0.6
9月末	28,497	32.7	24,044	30.0	97.3	2.8	0.5
10月末	29,737	38.5	25,107	35.8	96.7	2.8	0.5
(当期末) 2017年11月10日	30,310	41.2	25,570	38.3	98.5	1.0	0.5

(注1)騰落率は期首比です。

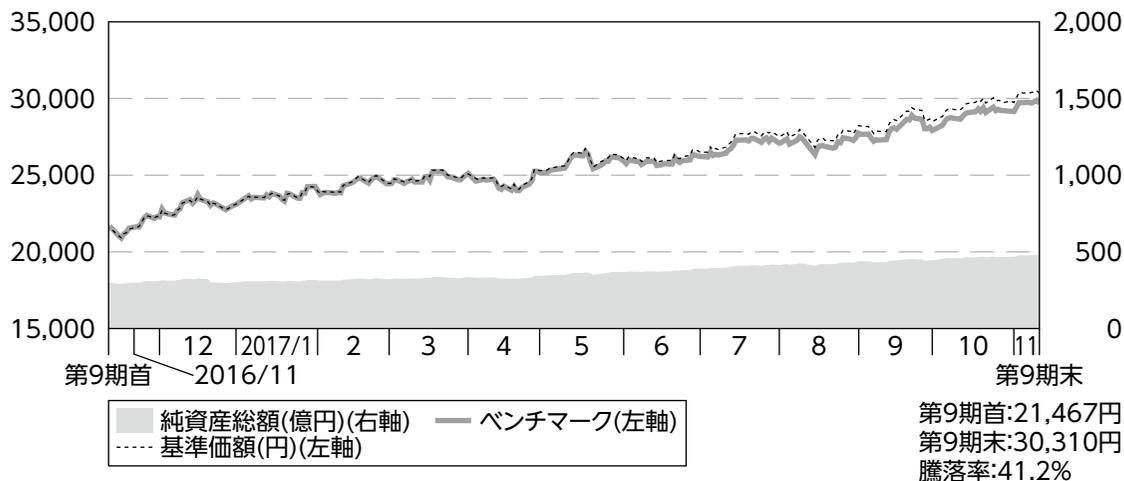
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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、2016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、基準価額は上昇しました。

## 投資環境



新興国株式市場は、中国などのマクロ景気指標が概ね堅調に推移したことや、主要な情報技術関連企業などの業績が好調だったことが好感され、上昇しました。国別では、中国において全国人民代表大会(全人代)が開催され政策期待が強まったことや、ブラジルにおいてBCB(ブラジル中央銀行)が利下げを実施し景気改善期待が強まったこと、インドにおいて税制改革の柱であるGST(物品・サービス税)を導入するなどモディ首相による経済改革が進展していることなどが好感され、新興国株式市場の上昇に寄与しました。外国為替市場では、リスク選好の動きを背景に、新興国通貨に対して円安が進行しました。

## 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

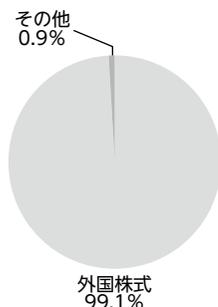
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン諸島	5.3%
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	4.7%
3	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ケイマン諸島	4.0%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	3.7%
5	NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	2.1%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	1.4%

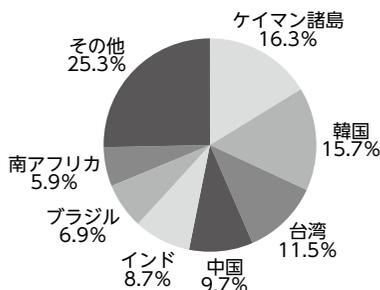
順位	銘柄名	国	組入比率
7	BAIDU INC - SPON ADR	ケイマン諸島	1.2%
8	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	香港	1.2%
9	IND&COMM BK OF CHINA-H	中国	1.1%
10	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	1.0%
組入銘柄数			827

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

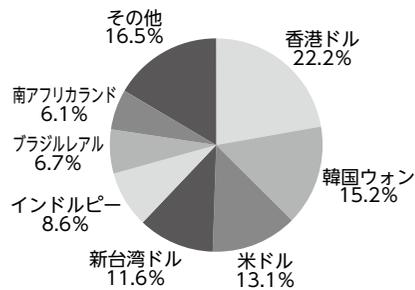
### ○資産別配分



### ○国別配分



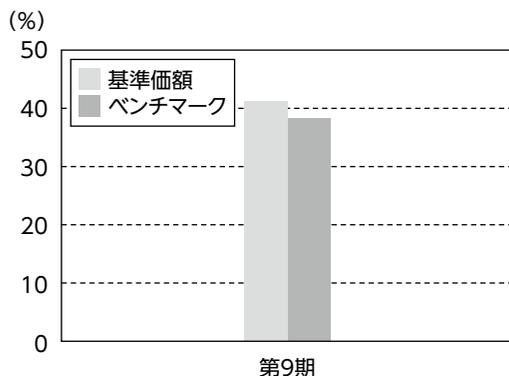
### ○通貨別配分



(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
	(2016年11月1日~2017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)	8円 (5) (-) (-) (-) (0) (-) (2)	0.030% (0.021) (-) (-) (-) (0.000) (-) (0.009)	(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)	7 (7) (-) (-) (-) (-) (0)	0.027 (0.027) (-) (-) (-) (-) (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)	43  (43)  (-) (0)	0.164  (0.164)  (-) (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	58	0.221	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(25,895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 4,182 (188)	千米ドル 10,040 (23)	百株 2,954 (-)	千米ドル 3,508 (23)
	メ キ シ コ	16,178 (392)	千メキシコペソ 53,716 (△103)	6,446	千メキシコペソ 21,162
	ブ ラ ジ ル	10,496 (1,762)	千ブラジルリアル 18,995 (2,498)	4,475 (1,142)	千ブラジルリアル 7,482 (2,866)
	チ リ	159,911 (4,506)	千チリペソ 624,176 (2)	99,082 (24)	千チリペソ 120,561 (2)
	コ ロ ン ビ ア	637	千コロンビアペソ 1,476,483	462	千コロンビアペソ 882,078
	ギ リ シ ャ	3,817 (-)	千ユーロ 187 (△4)	95 (3,534)	千ユーロ 83 (-)
	ト ル コ	2,780 (38)	千トルコリラ 3,155 (-)	1,677	千トルコリラ 924
	チ ェ コ	296 (-)	千チェココルナ 5,078 (△18)	41	千チェココルナ 3,716
	ハ ン ガ リ ー	52 (287)	千ハンガリーフォリント 72,408 (-)	41	千ハンガリーフォリント 34,602
	ポ ー ラ ン ド	689	千ポーランドズロチ 4,000	592	千ポーランドズロチ 1,671
国	香 港	128,342 (△18,434)	千香港ドル 136,034 (△56)	62,503	千香港ドル 51,891
	マ レ ー シ ア	8,067 (1,039)	千マレーシアリンギット 8,963 (265)	5,666 (-)	千マレーシアリンギット 4,184 (12)
	タ イ	10,327 (2,745)	千タイバーツ 64,656 (-)	6,080	千タイバーツ 22,328

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	フ ィ リ ピ ン	百株 10,725	千フィリピンペソ 55,703	百株 8,325	千フィリピンペソ 20,611
	イ ン ド ネ シ ア	45,820 (7,208)	千インドネシアルピア 22,134,776 (-)	19,054	千インドネシアルピア 8,446,419
	韓 国	1,945 (137)	千韓国ウォン 14,152,921 (503,823)	732 (18)	千韓国ウォン 5,412,368 (476,029)
	台 湾	68,830 (3,078)	千新台湾ドル 315,792 (721)	35,903	千新台湾ドル 132,726
	イ ン ド	11,805 (4,546)	千インドルピー 594,267 (-)	3,606	千インドルピー 177,906
	カ タ ー ル	211 (81)	千カタールリアル 1,274 (103)	195 (20)	千カタールリアル 176 (22)
	南 ア フ リ カ	6,611 (1,387)	千南アフリカランド 81,563 (3,559)	3,771 (199)	千南アフリカランド 29,425 (3,391)
	ア ラ ブ 首 長 国 連 邦	5,672 (624)	千アラブ首長国連邦ディルハム 2,327 (597)	3,769 (498)	千アラブ首長国連邦ディルハム 471 (597)

(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				
メキシコ	口	千メキシコペソ	口	千メキシコペソ
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	119,300 (-)	3,592 (△96)	-	-
小 計	119,300 (-)	3,592 (△96)	-	-
ブラジル	口	千ブラジルリアル	口	千ブラジルリアル
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	20,500	477	7,500	140
SUL AMERICA SA-UNITS	- (2,244)	- (-)	-	-
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	-	-	17,500	467
KLABIN SA-UNIT	27,400	463	17,200	306
小 計	47,900 (2,244)	940 (-)	42,200	914
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
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	- (9,864)	- (243)	-	-
RESILIENT REIT LTD	10,058	1,166	-	-
小 計	10,058 (9,864)	1,166 (243)	-	-

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( )内は合併・分割・減資・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別	当 期			
	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	11,817	11,859	-	-

(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	13,289,980千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	35,816,838千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.37

(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	18,475	22	0.1	13,202	22	0.2
金 銭 信 託	58	58	100.0	59	59	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	20,295	4,940	24.3	20,159	4,908	24.3

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## 組入資産の明細

<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	239	27,106	素材
CREDICORP LTD	42	58	1,216	137,888	銀行
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	403	398	435	49,347	電気通信サービス
SOUTHERN COPPER CORP	91	54	238	27,006	素材
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	97	113	971	110,165	消費者サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	254	362	306	34,804	小売
FANG HOLDINGS LTD-ADR	186	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TAL EDUCATION GROUP- ADR	25	221	678	76,986	消費者サービス
58.COM INC-ADR	49	73	490	55,641	ソフトウェア・サービス
AUTOHOME INC-ADR	—	38	242	27,446	ソフトウェア・サービス
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	784	902	16,716	1,895,504	ソフトウェア・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)		
YUM CHINA HOLDINGS INC	284	289	1,187	134,654	消費者サービス	
CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	269	317	1,456	165,100	小売	
SINA CORP	—	40	427	48,435	ソフトウェア・サービス	
NETEASE INC-ADR	54	61	1,938	219,768	ソフトウェア・サービス	
BAIDU INC - SPON ADR	191	215	5,183	587,742	ソフトウェア・サービス	
YY INC-ADR	23	43	392	44,517	ソフトウェア・サービス	
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	15	—	—	—	小売	
WEIBO CORP-SPON ADR	—	38	419	47,562	ソフトウェア・サービス	
JD.COM INC-ADR	474	545	2,172	246,360	小売	
MOMO INC-SPON ADR	—	101	293	33,281	ソフトウェア・サービス	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	453	453	69	7,828	不動産	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	336	372	2,108	239,088	エネルギー	
GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR REG S	387	—	—	—	電気通信サービス	
GAZPROM OAO-SPON ADR	4,372	4,546	2,003	227,190	エネルギー	
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	958	935	419	47,541	銀行	
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	814	1,184	607	68,939	エネルギー	
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	70	72	849	96,333	エネルギー	
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	—	95	207	23,559	素材	
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	401	498	977	110,886	素材	
ROSTELECOM-SPONSORED ADR	216	216	156	17,787	電気通信サービス	
ROSNEFT OJSC-GDR	818	1,081	618	70,115	エネルギー	
SEVERSTAL - GDR REG S	155	133	197	22,383	素材	
TATNEFT-SPONSORED ADR	163	221	1,104	125,220	エネルギー	
VTB BANK PJSC -GDR-REG S	2,002	2,642	558	63,380	銀行	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	207	235	640	72,659	食品・生活必需品小売り	
RUSHYDRO PJSC-ADR	1,678	1,095	148	16,839	公益事業	
SBERBANK-SPONSORED ADR	1,872	2,021	3,211	364,125	銀行	
PHOSAGRO OAO-GDR REG S	96	96	136	15,434	素材	
MEGAFON-PJSC	107	—	—	—	電気通信サービス	
DP WORLD LTD	109	109	259	29,403	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額	18,641	20,057	49,281	5,588,039	
	銘柄 数 <比率>	36	37	—	<11.7%>	
(メキシコ)				千メキシコペソ		
ALFA S. A. B. -A	1,750	2,429	4,870	29,026	資本財	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER	295	433	5,681	33,863	食品・飲料・タバコ	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	1,297	1,594	26,416	157,439	食品・飲料・タバコ	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	109	109	1,448	8,633	小売	
GRUPO FIN SANTANDER-B	1,518	1,697	5,325	31,738	銀行	
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	1,688	1,907	14,717	87,716	メディア	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,304	1,324	5,915	35,257	食品・飲料・タバコ	
GRUMA S. A. B. -B	142	142	3,606	21,495	食品・飲料・タバコ	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	169	169	3,239	19,306	運輸	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	375	375	2,393	14,266	資本財	
CEMEX SAB-SPONS	9,224	12,310	19,401	115,633	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)		
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	1,676	1,874	21,536	128,354	銀行	
MEXICHEM SAB DE CV-*	944	968	4,816	28,706	素材	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	99	99	4,091	24,386	素材	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	926	926	3,089	18,411	家庭用品・パーソナル用品	
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	154	154	5,311	31,659	運輸	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	2,589	3,007	18,784	111,955	素材	
AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	22,275	27,217	45,289	269,926	電気通信サービス	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	1,505	1,505	5,047	30,084	銀行	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	336	336	4,174	24,881	食品・飲料・タバコ	
WALMART DE MEXICO-SER V	3,775	3,862	17,382	103,600	食品・生活必需品小売り	
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	277	310	5,582	33,272	運輸	
OHL MEXICO SAB DE CV	376	—	—	—	運輸	
ENTERA SAB DE CV	771	771	1,471	8,772	各種金融	
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	196	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	—	377	3,910	23,309	公益事業	
GRUPO LALA SAB DE CV	358	358	1,073	6,398	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	54,136	64,261	234,579	1,398,094	
(ブラジル)		26	25	—	<2.9%>	
BRF SA	446	388	1,668	58,177	食品・飲料・タバコ	
VALE SA	867	1,927	6,323	220,495	素材	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	33	33	79	2,761	公益事業	
VALE SA-PREF A	1,334	459	1,403	48,928	素材	
TIM PARTICIPACOES SA	729	729	853	29,767	電気通信サービス	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	177	177	415	14,504	公益事業	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	—	125	255	8,909	公益事業	
BANCO DO BRASIL S. A.	635	691	2,229	77,731	銀行	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	2,722	3,486	3,650	127,279	銀行	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	382	637	983	34,304	小売	
LOJAS AMERICANAS SA	108	108	136	4,745	小売	
GERDAU SA-PREF	768	870	910	31,762	素材	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	2,134	2,533	4,432	154,569	エネルギー	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	2,676	2,977	4,978	173,590	エネルギー	
KROTON EDUCATIONAL SA	1,014	972	1,754	61,163	消費者サービス	
CCR SA	619	1,011	1,717	59,895	運輸	
WEG SA	475	514	1,115	38,887	資本財	
BANCO BRADESCO SA-PREF	1,966	2,357	7,710	268,850	銀行	
BANCO BRADESCO S. A.	531	725	2,211	77,125	銀行	
NATURA COSMETICOS SA	107	107	316	11,040	家庭用品・パーソナル用品	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	604	328	257	8,978	素材	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	185	403	851	29,693	素材	
CPFL ENERGIA SA	160	160	442	15,412	公益事業	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	2,264	2,550	10,570	368,597	銀行	
PORTO SEGURO SA	73	73	266	9,296	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)	
FIBRIA CELULOSE SA	139	249	1,297	45,236	素材
BRASKEM SA-PREF A	89	89	448	15,641	素材
ENGIE BRASIL SA	143	134	505	17,620	公益事業
LOCALIZA RENT A CAR	108	114	695	24,257	運輸
LOJAS RENNEN S.A.	427	603	2,082	72,604	小売
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	266	266	388	13,560	公益事業
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	237	287	2,125	74,106	エネルギー
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	134	184	683	23,816	エネルギー
TOTVS SA	73	—	—	—	ソフトウェア・サービス
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	128	128	777	27,119	公益事業
EMBRAER SA	414	414	654	22,823	資本財
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	103	—	—	—	公益事業
M DIAS BRANCO SA	21	63	297	10,388	食品・飲料・タバコ
ODONTOPREV S.A.	124	124	198	6,913	ヘルスケア機器・サービス
BR MALLS PARTICIPACOES SA	496	570	724	25,270	不動産
JBS SA	444	1,091	872	30,434	食品・飲料・タバコ
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	659	659	461	16,107	公益事業
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	261	261	752	26,247	公益事業
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	55	55	390	13,607	不動産
DURATEX SA	216	216	207	7,247	素材
HYPERMARCAS SA	216	353	1,157	40,373	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,186	1,725	3,938	137,326	各種金融
TELEFONICA BRASIL S.A.	325	318	1,568	54,689	電気通信サービス
QUALICORP SA	208	208	702	24,478	ヘルスケア機器・サービス
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	114	—	—	—	各種金融
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	108	108	795	27,751	食品・生活必需品小売り
CIELO SA	693	992	2,293	79,960	ソフトウェア・サービス
RAIA DROGASIL SA	170	170	1,381	48,176	食品・生活必需品小売り
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	450	563	1,579	55,086	保険
CIA ENERGETICA DE MIN GE-RTS	—	104	5	175	公益事業
AMBEV SA	3,256	3,690	7,461	260,171	食品・飲料・タバコ
RUMO SA	—	977	1,192	41,597	運輸
AES TIETE ENERGIA SA-UNIT	145	—	—	—	公益事業
小 計	32,423	39,063	91,174	3,179,257	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	55	54	—	<6.7%>	
(チリ)			千チリペソ		
BANCO SANTANDER CHILE	42,382	62,798	307,020	55,171	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSION	24	24	102,570	18,431	銀行
BANCO DE CHILE	11,395	22,841	217,634	39,108	銀行
AES GENER SA	1,417	1,417	30,388	5,460	公益事業
EMPRESAS CMPC SA	842	842	170,447	30,629	素材
EMPRESAS COPEC SA	324	324	308,636	55,462	エネルギー
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	93	93	80,146	14,402	食品・飲料・タバコ
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	77	185	130,376	23,428	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)		
ENEL GENERACION CHILE SA	2,160	2,160	118,312	21,260	公益事業	
ENEL AMERICAS SA	10,304	21,625	288,163	51,783	公益事業	
COLBUN SA	4,758	4,758	68,618	12,330	公益事業	
AGUAS ANDINAS SA-A	1,632	1,632	66,608	11,969	公益事業	
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	152	152	46,821	8,413	食品・飲料・タバコ	
LATAM AIRLINES GROUP SA	221	221	186,664	33,543	運輸	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	72	72	265,382	47,689	素材	
S. A. C. I. FALABELLA	515	530	318,876	57,302	小売	
ITAU CORPBANCA	152,847	167,491	95,419	17,146	銀行	
CENCOSUD SA	947	1,379	251,496	45,193	食品・生活必需品小売り	
ENDESA AMERICAS SA	2,160	—	—	—	公益事業	
ENEL CHILE SA	10,304	19,393	141,590	25,443	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	242,637	307,947	3,195,175	574,173	
	銘柄 数 <比 率>	20	19	—	<1.2%>	
(コロンビア)				千コロンビアペソ		
INTERCONEXION ELECTRICA SA	486	505	674,826	25,373	公益事業	
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	103	—	—	—	各種金融	
ECOPETROL SA	3,573	3,573	650,335	24,452	エネルギー	
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	47	125	464,757	17,474	各種金融	
GRUPO AVAL ACCIONES-PF	3,037	3,037	387,227	14,559	銀行	
CEMENTOS ARGOS SA	320	320	338,036	12,710	素材	
GRUPO ARGOS SA	177	177	358,359	13,474	素材	
BANCOLOMBIA SA	—	137	392,746	14,767	銀行	
BANCOLOMBIA SA-PREF	338	382	1,120,779	42,141	銀行	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	145	145	555,886	20,901	各種金融	
小 計	株 数 ・ 金 額	8,229	8,404	4,942,954	185,855	
	銘柄 数 <比 率>	9	9	—	<0.4%>	
(ギリシャ)				千ユーロ		
ALPHA BANK AE	944	944	142	18,843	銀行	
NATIONAL BANK OF GREECE	4,015	4,015	103	13,631	銀行	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	201	202	212	28,120	電気通信サービス	
EUROBANK ERGASIAS SA	1,489	1,489	94	12,418	銀行	
OPAP SA	176	176	169	22,405	消費者サービス	
JUMBO SA	85	85	115	15,278	小売	
TITAN CEMENT CO. S. A.	43	43	88	11,675	素材	
FF GROUP	34	34	55	7,284	小売	
PIRAEUS BANK S. A	—	186	41	5,479	銀行	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額	6,991	7,178	1,022	135,137	
	銘柄 数 <比 率>	8	9	—	<0.3%>	
(トルコ)				千トルコリラ		
AKBANK T. A. S.	1,614	1,760	1,697	49,756	銀行	
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	112	112	269	7,899	食品・飲料・タバコ	
ARCELIK AS	153	153	315	9,254	耐久消費財・アパレル	
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	—	238	935	27,427	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	1,167	1,167	1,146	33,604	素材	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	32	32	189	5,567	自動車・自動車部品	
KOC HOLDING AS	387	624	1,048	30,719	資本財	
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	480	480	317	9,316	素材	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	393	431	202	5,921	資本財	
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	67	67	229	6,730	自動車・自動車部品	
TURK HAVA YOLLARI AO	621	621	653	19,157	運輸	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	561	950	1,338	39,244	電気通信サービス	
TURKIYE GARANTI BANKASI	1,656	1,664	1,689	49,525	銀行	
TURKIYE IS BANKASI-C	1,111	1,111	758	22,222	銀行	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	74	116	1,467	43,020	エネルギー	
ULKER BISKUVI SANAYI	96	96	184	5,417	食品・飲料・タバコ	
YAPI VE KREDI BANKASI	1,055	1,097	490	14,384	銀行	
HACI OMER SABANCI HOLDING	614	614	658	19,288	各種金融	
COCA-COLA ICECEK AS	44	44	162	4,777	食品・飲料・タバコ	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	155	155	1,239	36,319	食品・生活必需品小売り	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	519	519	306	8,997	銀行	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	98	98	195	5,731	運輸	
TURKIYE HALK BANKASI	524	524	530	15,536	銀行	
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	177	177	109	3,207	電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	11,721	12,862	16,138	473,028	
	銘柄 数 <比 率>	23	24	—	<1.0%>	
(チェコ)				千チェココルナ		
KOMERCNI BANKA AS	87	74	6,903	35,689	銀行	
02 CZECH REPUBLIC AS	45	45	1,192	6,165	電気通信サービス	
CEZ AS	137	137	6,578	34,011	公益事業	
MONETA MONEY BANK AS	—	267	2,106	10,891	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	269	524	16,781	86,758	
	銘柄 数 <比 率>	3	4	—	<0.2%>	
(ハンガリー)				千ハンガリーフォリント		
RICHTER GEDEON NYRT	84	84	58,536	24,784	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	328	109,398	46,319	エネルギー	
OTP BANK NYRT	202	195	204,189	86,453	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	309	608	372,123	157,557	
	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	274	8,576	銀行	
M BANK SA	18	7	340	10,617	銀行	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	20	20	158	4,938	銀行	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	122	131	1,584	49,464	素材	
BANK PEKAO SA	78	106	1,310	40,924	銀行	
ORANGE POLSKA SA	556	556	315	9,835	電気通信サービス	
POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	215	215	2,640	82,426	エネルギー	
LPP SA	0.67	1	1,023	31,958	耐久消費財・アパレル	

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
BANK ZACHODNI WBK SA	23	23	916	28,613	銀行	
PKO BANK POLSKI SA	630	805	3,129	97,717	銀行	
CCC SA	12	31	778	24,296	耐久消費財・アパレル	
SYNTHOS SA	337	337	165	5,152	素材	
EUROCASH SA	50	50	174	5,443	食品・生活必需品小売り	
GRUPA LOTOS SA	55	55	363	11,353	エネルギー	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	1,464	1,464	985	30,780	エネルギー	
CYFROWY POLSAT SA	243	235	596	18,636	メディア	
GRUPA AZOTY SA	27	27	210	6,558	素材	
ENEA SA	129	—	—	—	公益事業	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	634	634	775	24,224	公益事業	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	570	570	184	5,769	公益事業	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	406	509	2,333	72,837	保険	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	—	41	388	12,142	素材	
ALIOR BANK SA	88	88	628	19,627	銀行	
ENERGA SA	128	—	—	—	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	6,148	6,245	19,279	601,894	
	銘 柄 数 < 比 率 >	23	22	—	< 1.3% >	
(香港)				千香港ドル		
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	830	830	1,030	14,988	素材	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	680	680	788	11,469	運輸	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1,760	1,760	1,036	15,072	運輸	
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	4,310	4,825	38,431	558,788	電気通信サービス	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	765	1,100	3,525	51,260	素材	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	390	390	1,813	26,368	資本財	
HUANENG POWER INTL INC-H	2,580	2,580	1,442	20,969	公益事業	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	2,240	2,240	967	14,070	ヘルスケア機器・サービス	
YANZHOU COAL MINING CO-H	1,120	1,120	871	12,669	エネルギー	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	490	665	5,303	77,111	家庭用品・パーソナル用品	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	840	—	—	—	公益事業	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	2,360	2,500	5,275	76,698	自動車・自動車部品	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	2,980	3,800	5,806	84,425	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	2,790	3,270	8,094	117,690	不動産	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	2,071	2,191	5,050	73,434	不動産	
CITIC LTD	2,880	5,020	5,742	83,501	資本財	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	1,080	1,080	1,401	20,382	運輸	
LENOVO GROUP LTD	5,680	5,780	2,641	38,406	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PETROCHINA CO LTD-H	15,140	17,540	9,752	141,797	エネルギー	
CHINA UNICOM (HONG KONG) LTD-R	4,440	4,420	5,259	76,477	電気通信サービス	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	1,018	1,418	3,985	57,945	保険	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	18,174	19,274	11,275	163,942	エネルギー	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	960	530	1,075	15,643	ソフトウェア・サービス	
ENN ENERGY HOLDINGS LIMITED	560	560	3,264	47,470	公益事業	
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	2,580	2,580	1,870	27,197	エネルギー	

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	1,020	1,020	909	13,229	運輸
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	915	975	2,277	33,118	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	3,400	3,400	1,965	28,574	素材
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	620	620	1,155	16,803	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,360	1,360	3,366	48,941	公益事業
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	4,250	3,900	10,218	148,569	自動車・自動車部品
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	520	860	2,476	36,012	公益事業
BYD CO LTD-H	495	495	3,628	52,756	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD-H	10,060	11,000	4,268	62,056	電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	1,040	1,040	796	11,583	エネルギー
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	7,800	7,800	998	14,516	メディア
SINOTRANS LIMITED-H	910	—	—	—	運輸
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	1,470	2,790	3,035	44,136	商業・専門サービス
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	3,208	4,088	6,877	99,991	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	1,240	1,240	550	8,005	資本財
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	1,134	1,754	2,746	39,937	公益事業
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2,037	2,037	1,882	27,373	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	5,300	5,830	16,032	233,112	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	3,790	7,290	1,975	28,725	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1,080	1,080	614	8,935	ヘルスケア機器・サービス
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	21,390	2,650	3,752	54,559	半導体・半導体製造装置
WEICHAI POWER CO LTD-H	544	1,088	1,070	15,566	資本財
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	1,990	1,990	919	13,367	素材
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	380	380	885	12,873	資本財
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	1,220	1,220	1,542	22,421	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	200	200	668	9,712	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	2,180	2,220	2,544	36,991	公益事業
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	1,280	1,420	3,337	48,519	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	880	880	820	11,925	運輸
CNOOC LTD-R	12,390	13,890	15,445	224,580	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	3,670	3,520	3,611	52,511	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	—	—	—	運輸
CHINA MENGNIU DAIRY CO-R	1,970	1,970	4,186	60,868	食品・飲料・タバコ
TENCENT HOLDINGS LTD	3,940	4,507	174,781	2,541,322	ソフトウェア・サービス
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	3,665	4,245	31,179	453,350	保険
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	3,580	4,080	2,668	38,797	公益事業
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	5,939	5,939	593	8,636	小売
CHINA POWER INTERNATIONAL	2,080	2,080	520	7,560	公益事業
AIR CHINA LIMITED-H	1,180	1,180	850	12,370	運輸
ZTE CORP-H	485	485	1,372	19,960	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	574	8,354	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	2,540	2,505	4,984	72,481	エネルギー
CHINA COSCO HOLDINGS-H	1,605	—	—	—	運輸
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	6,094	6,094	3,559	51,752	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)	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	1,000	1,700	1,829	26,596	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	58,446	66,046	45,439	660,694	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	320	690	5,074	73,789	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,660	2,660	2,793	40,610	自動車・自動車部品
MINTH GROUP LTD	—	520	2,441	35,497	自動車・自動車部品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	1,010	1,010	1,363	19,825	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	2,980	3,300	2,154	31,332	素材
BANK OF CHINA LTD-H	53,542	62,452	24,106	350,508	銀行
SHUI ON LAND LTD	2,092	—	—	—	不動産
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	655	655	1,055	15,352	不動産
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	688	688	1,169	17,005	不動産
CHINA MERCHANTS BANK-H	2,964	2,954	9,039	131,440	銀行
IND&COMM BK OF CHINA-H	51,495	58,695	36,801	535,099	銀行
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	1,300	1,300	626	9,110	電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	3,120	3,120	2,882	41,917	資本財
CHINA COAL ENERGY CO - H	2,290	510	183	2,662	エネルギー
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	350	350	840	12,213	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	395	395	1,777	25,844	資本財
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	700	1,160	2,656	38,624	耐久消費財・アパレル
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	4,212	4,212	5,198	75,588	不動産
CHINA CITIC BANK-H	6,272	6,272	3,154	45,871	銀行
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	4,010	—	—	—	耐久消費財・アパレル
SUNNY OPTICAL TECH	—	570	7,951	115,614	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	710	710	2,595	37,732	耐久消費財・アパレル
FOSUN INTERNATIONAL	1,850	1,850	3,522	51,215	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	2,200	2,200	785	11,419	不動産
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	1,875	1,875	934	13,583	不動産
SOHO CHINA LTD	1,130	1,130	516	7,508	不動産
KINGSOFT CORP LTD	660	660	1,409	20,488	ソフトウェア・サービス
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	10,350	10,350	1,428	20,767	半導体・半導体製造装置
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	3,000	3,000	1,821	26,477	資本財
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	1,095	1,095	1,040	15,125	資本財
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	3,290	3,290	2,214	32,194	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	1,768	2,052	8,064	117,255	保険
CHINA EVERGRANDE GROUP	2,950	2,380	7,330	106,584	不動産
CRRC CORP LTD-H	3,150	3,130	2,351	34,183	資本財
SUN ART RETAIL GROUP LTD	1,950	1,950	1,616	23,504	食品・生活必需品小売り
SINOPHARM GROUP CO-H	900	996	3,281	47,717	ヘルスケア機器・サービス
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	1,222	1,802	3,668	53,332	自動車・自動車部品
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	1,390	1,390	761	11,075	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	2,530	2,530	1,477	21,483	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	430	430	838	12,191	ヘルスケア機器・サービス
HUANENG RENEWABLES CORP-H	3,060	3,060	786	11,434	公益事業
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	—	3,210	885	12,881	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当期末(前期末)	期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1,900	1,760	6,327	91,997	不動産	
LONGFOR PROPERTIES	730	1,235	2,329	33,866	不動産	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	488	670	3,430	49,878	保険	
CHINA MINSHENG BANKING-H	4,210	4,595	3,427	49,841	銀行	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	2,230	2,230	813	11,834	銀行	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	15,910	22,890	8,377	121,812	銀行	
FAR EAST HORIZON LTD	1,410	1,410	1,058	15,396	各種金融	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	1,415	1,990	3,522	51,214	各種金融	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	1,000	1,000	1,508	21,926	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	2,768	3,349	48,698	各種金融	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	510	600	9,780	142,201	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	5,660	6,920	2,934	42,661	保険	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	260	260	1,066	15,499	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	444	6,466	資本財	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	2,590	3,285	2,227	32,383	各種金融	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	6,500	6,500	115	1,682	半導体・半導体製造装置	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	4,350	4,350	182	2,656	食品・飲料・タバコ	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	7,620	8,320	2,504	36,412	各種金融	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	855	1,595	2,548	37,059	資本財	
CHINA VANKE CO LTD-H	750	750	2,118	30,806	不動産	
LUYE PHARMA GROUP LTD	655	—	—	—	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	6,690	13,050	2,949	42,882	公益事業	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	—	4,600	1,518	22,071	不動産	
GF SECURITIES CO LTD-H	1,056	1,056	1,776	25,825	各種金融	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	—	272	858	12,477	自動車・自動車部品	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	1,054	1,054	1,787	25,991	各種金融	
3SBIO INC	845	845	1,238	18,011	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	—	5,280	1,948	28,328	各種金融	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILI-B	476	476	490	7,128	自動車・自動車部品	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	530,347 136	577,752 135	727,855 —	10,583,017 <22.2%>	
(マレーシア)			千マレーシアリンギット			
AMMB HOLDINGS BHD	1,302	1,302	570	15,425	銀行	
GENTING PLANTATIONS BHD	140	140	150	4,082	食品・飲料・タバコ	
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	3,253	2,939	1,825	49,380	銀行	
DIGI.COM BERHAD	2,750	3,117	1,517	41,061	電気通信サービス	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	535	535	450	12,177	運輸	
RHB BANK BHD	531	531	260	7,040	銀行	
HAP SENG CONSOLIDATED	382	382	355	9,609	資本財	
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	315	—	—	—	消費者サービス	
GAMUDA BHD	1,392	1,392	669	18,111	資本財	
YTL CORPORATION BERHAD	2,474	2,523	330	8,942	公益事業	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	149	149	248	6,729	銀行	
HONG LEONG BANK BERHAD	261	612	978	26,460	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)		
IJM CORP BHD	1,981	1,981	618	16,718	資本財	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	286	548	1,357	36,732	食品・飲料・タバコ	
MALAYAN BANKING BHD	3,106	2,703	2,476	66,989	銀行	
LAFARGE MALAYAN BHD	261	—	—	—	素材	
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	706	706	261	7,066	銀行	
MISC BHD	565	1,250	931	25,198	運輸	
PPB GROUP BERHAD	421	439	733	19,831	食品・飲料・タバコ	
PETRONAS DAGANGAN BHD	203	251	538	14,556	エネルギー	
PETRONAS GAS BHD	446	806	1,426	38,590	公益事業	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	109	109	434	11,752	食品・飲料・タバコ	
TELECOM MALAYSIA BHD	705	705	433	11,736	電気通信サービス	
TENAGA NATIONAL BHD	2,197	2,556	3,809	103,048	公益事業	
UMW HOLDINGS BHD	340	340	176	4,764	自動車・自動車部品	
DIALOG GROUP BHD	2,229	2,229	501	13,570	エネルギー	
PUBLIC BANK BERHAD	1,699	2,280	4,665	126,196	銀行	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	1,223	1,247	165	4,488	公益事業	
AIRASIA BHD	648	648	211	5,714	運輸	
GENTING BHD	1,489	2,053	1,946	52,645	消費者サービス	
GENTING MALAYSIA BERHAD	2,241	2,241	1,154	31,218	消費者サービス	
IOI CORPORATION BHD	1,796	1,796	802	21,720	食品・飲料・タバコ	
SIME DARBY BERHAD	1,655	1,672	1,515	40,987	資本財	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	360	360	298	8,082	ヘルスケア機器・サービス	
AXIATA GROUP BERHAD	1,539	1,565	851	23,040	電気通信サービス	
MAXIS BHD	1,355	1,355	813	21,991	電気通信サービス	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	1,388	2,101	1,554	42,055	素材	
SAPURA ENERGY BHD	2,826	2,826	412	11,160	エネルギー	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	1,185	1,185	329	8,911	メディア	
IHH HEALTHCARE BHD	2,293	2,293	1,293	34,982	ヘルスケア機器・サービス	
FELDA GLOBAL VENTURES	803	803	151	4,105	食品・飲料・タバコ	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	700	700	261	7,081	運輸	
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	1,230	1,538	306	8,280	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	51,477	54,917	37,790	1,022,242	
	銘柄 数 <比率>	43	41	—	<2.1%>	
(タイ)				千タイバツ		
BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	162	162	3,231	11,085	銀行	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	—	678	3,542	12,150	資本財	
KRUNG THAI BANK - NVDR	2,472	2,472	4,549	15,604	銀行	
ROBINSON PCL-NVDR	348	348	2,540	8,713	小売	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	990	1,480	21,978	75,384	銀行	
TRUE CORP PCL-NVDR	6,077	6,077	3,433	11,777	電気通信サービス	
KASIKORN BANK PCL-NVDR	516	516	11,352	38,937	銀行	
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	13,365	13,365	3,421	11,735	銀行	
IRPC PCL - NVDR	5,728	5,728	3,723	12,770	エネルギー	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,185	1,185	2,061	7,072	エネルギー	

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	—	232	5,220	17,904	公益事業	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	2,668	3,407	8,687	29,799	食品・飲料・タバコ	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	709	1,030	18,591	63,768	電気通信サービス	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	2,316	2,316	3,057	10,487	小売	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	323	323	2,656	9,112	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PTT PCL-NVDR	664	789	32,822	112,580	エネルギー	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	2,330	2,400	4,416	15,146	食品・飲料・タバコ	
SIAM CEMENT PUBLIC CO-FOR REG	187	187	8,863	30,402	素材	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	113	135	6,372	21,855	素材	
KCE ELECTRONICS - NVDR	—	247	2,105	7,222	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	561	561	959	3,290	メディア	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	305	3,050	17,690	60,676	運輸	
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	686	903	20,317	69,689	銀行	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	748	1,321	10,931	37,494	不動産	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	3,278	4,557	9,524	32,667	ヘルスケア機器・サービス	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	256	256	5,478	18,790	ヘルスケア機器・サービス	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,618	1,618	7,038	24,142	消費者サービス	
THAI OIL PCL-NVDR	480	480	4,692	16,093	エネルギー	
GLOW ENERGY PCL - NVDR	296	296	2,627	9,010	公益事業	
CP ALL PCL-NVDR	3,484	3,720	26,226	89,955	食品・生活必需品小売り	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	3,675	3,675	3,087	10,588	運輸	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	1,124	1,247	11,659	39,991	エネルギー	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	2,124	1,019	4,942	16,951	素材	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,487	1,487	11,898	40,812	素材	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	687	687	3,057	10,486	エネルギー	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	3,912	3,912	3,168	10,868	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	64,875 33	71,867 36	295,925 —	1,015,024 <2.1%>	
(フィリピン)			千フィリピンペソ			
AYALA LAND INC	5,807	6,370	28,282	62,504	不動産	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	1,146	1,146	8,475	18,731	資本財	
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	524	524	5,210	11,515	銀行	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	1,391	5,906	9,201	20,335	資本財	
DMCI HOLDINGS INC	3,454	3,454	5,354	11,833	資本財	
GLOBE TELECOM INC	17	17	3,669	8,109	電気通信サービス	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	632	632	6,475	14,311	運輸	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	2,298	2,303	17,726	39,174	資本財	
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	254	254	6,438	14,229	消費者サービス	
METROPOLITAN BANK & TRUST	411	411	3,913	8,648	銀行	
BDO UNIBANK INC	1,149	1,737	25,189	55,668	銀行	
MEGAWORLD CORP	6,380	6,380	3,630	8,022	不動産	
PLDT INC	62	62	10,675	23,593	電気通信サービス	
ROBINSONS LAND CO	930	930	2,292	5,066	不動産	
SECURITY BANK CORP	220	308	8,010	17,703	銀行	

銘柄	株数 (百株)	株数 (百株)	期 末		業 種
			評 価	額	
SM PRIME HOLDINGS INC	5,902	8,508	32,289	71,360	不動産
UNIVERSAL ROBINA CORP	633	633	8,695	19,217	食品・飲料・タバコ
SM INVESTMENTS CORP	200	228	22,348	49,391	資本財
AYALA CORPORATION	154	223	23,935	52,898	各種金融
ENERGY DEVELOPMENT CORP	6,063	—	—	—	公益事業
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	7,357	7,357	5,039	11,137	各種金融
ABOITIZ POWER CORP	895	895	3,794	8,386	公益事業
GT CAPITAL HOLDINGS INC	61	61	7,380	16,310	各種金融
小 計	45,946	48,346	248,032	548,151	
	株数・金額 銘柄数 <比率>	23	22	—	<1.1%>
(インドネシア)			千インドネシアルピア		
AKR CORPORINDO TBK PT	1,402	1,402	1,026,965	8,626	資本財
UNITED TRACTORS TBK PT	1,289	1,289	4,395,490	36,922	エネルギー
INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	2,489	4,291	3,411,345	28,655	食品・飲料・タバコ
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	14,100	17,212	14,242,930	119,640	自動車・自動車部品
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	4,321	4,321	1,391,362	11,687	食品・飲料・タバコ
GUDANG GARAM TBK PT	308	308	2,379,300	19,986	食品・飲料・タバコ
HM SAMPOERNA TBK PT	7,989	9,179	3,625,705	30,455	食品・飲料・タバコ
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	1,053	1,900	4,151,500	34,872	素材
SUMMARECON AGUNG TBK PT	4,532	4,532	459,998	3,863	不動産
BANK DANAMON INDONESIA TBK	1,965	1,965	1,124,962	9,449	銀行
BANK MANDIRI	6,667	14,249	10,081,846	84,687	銀行
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	1,855	1,855	1,855,000	15,582	小売
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,195	1,186	5,846,980	49,114	家庭用品・パーソナル用品
PT BANK RAKYAT INDONESIA	7,325	8,247	13,566,315	113,957	銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	7,915	7,915	1,452,402	12,200	公益事業
BANK NEGARA INDONESIA PT	4,716	7,916	6,313,010	53,029	銀行
KALBE FARMA TBK PT	12,534	12,534	2,005,440	16,845	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	2,346	2,346	2,369,460	19,903	素材
BANK CENTRAL ASIA PT	8,377	8,312	17,288,960	145,227	銀行
TELEKOMUNIKASI INDONESIA	34,635	39,289	16,344,224	137,291	電気通信サービス
XL AXIATA TBK PT	1,725	1,725	607,200	5,100	電気通信サービス
LIPPO KARAWACI TBK PT	12,130	12,130	770,255	6,470	不動産
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	4,730	—	—	—	メディア
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	6,305	6,305	1,043,477	8,765	メディア
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	1,235	1,235	830,537	6,976	運輸
BUMI SERPONG DAMAI PT	6,834	6,834	1,182,282	9,931	不動産
ADARO ENERGY PT	8,005	8,005	1,464,915	12,305	エネルギー
PAKUWON JATI TBK PT	—	16,104	1,006,500	8,454	不動産
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	1,610	1,610	1,368,500	11,495	食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,334	1,334	903,785	7,591	電気通信サービス
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	3,924	3,924	839,736	7,053	資本財
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	5,965	5,330	1,055,340	8,864	メディア
小 計	180,810	214,784	124,405,723	1,045,008	
	株数・金額 銘柄数 <比率>	31	31	—	<2.2%>

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)		
(韓国)				千韓国ウォン		
CHEIL COMMUNICATIONS INC	50	50	102,160	10,379	メディア	
HANMI SCIENCE CO LTD	5	6	57,440	5,835	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	29	28	312,336	31,733	自動車・自動車部品	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	23	25	685,809	69,678	保険	
DONGBU INSURANCE CO LTD	40	42	289,158	29,378	保険	
COWAY CO.,LTD.	39	39	406,164	41,266	耐久消費財・アパレル	
KT&G CORP	82	87	1,023,399	103,977	食品・飲料・タバコ	
S-1 CORPORATION	9	9	92,160	9,363	商業・専門サービス	
KOREA GAS CORPORATION	14	14	61,146	6,212	公益事業	
CJ CORP	12	12	241,695	24,556	資本財	
KAKAO CORP	—	33	510,417	51,858	ソフトウェア・サービス	
SK TELECOM	16	16	417,514	42,419	電気通信サービス	
DGB FINANCIAL GROUP INC	122	122	114,903	11,674	銀行	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	15	15	140,133	14,237	資本財	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	117	310	309,365	31,431	各種金融	
NCSOFT CORPORATION	11	16	694,650	70,576	ソフトウェア・サービス	
LG UPLUS CORP	125	—	—	—	電気通信サービス	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	33	33	58,485	5,942	資本財	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	82	82	55,160	5,604	資本財	
POSCO DAEWOO CORP	53	15	31,746	3,225	資本財	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	6	7	937,500	95,250	家庭用品・パーソナル用品	
LG CHEM LTD	32	38	1,591,416	161,687	素材	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	4	4	123,582	12,555	素材	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	1	1	92,070	9,354	家庭用品・パーソナル用品	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	294	326	1,581,131	160,642	銀行	
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	37	37	149,569	15,196	資本財	
S-OIL CORPORATION	34	34	433,627	44,056	エネルギー	
HANWHA CHEMICAL CORP	63	107	333,491	33,882	素材	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	50	57	206,780	21,008	各種金融	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	11	11	409,035	41,557	素材	
HOTEL SHILLA CO LTD	21	21	178,831	18,169	小売	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	26	28	455,430	46,271	資本財	
HYUNDAI MOBIS	47	55	1,497,424	152,138	自動車・自動車部品	
SK HYNIX INC	400	462	3,806,880	386,779	半導体・半導体製造装置	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	63	63	255,838	25,993	資本財	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	12	30	299,098	30,388	自動車・自動車部品	
HYUNDAI MOTOR CO	100	118	1,841,586	187,105	自動車・自動車部品	
HYUNDAI STEEL CO	62	72	418,587	42,528	素材	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	180	180	271,592	27,593	銀行	
KCC CORP	3	3	132,845	13,497	資本財	
KIA MOTORS CORPORATION	194	206	721,945	73,349	自動車・自動車部品	
KOREA ZINC CO LTD	4	7	407,160	41,367	素材	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	188	194	744,345	75,625	公益事業	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
HANWHA CORPORATION	28	28	124,582	12,657	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	19	23	72,291	7,344	運輸
OCI COMPANY LTD	11	11	138,621	14,083	素材
CJ LOGISTICS	3	3	49,896	5,069	運輸
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	10	10	77,774	7,901	素材
KT CORP	38	38	111,150	11,292	電気通信サービス
LG ELECTRONICS INC	67	80	769,440	78,175	耐久消費財・アパレル
LOTTE CORP	4	23	159,975	16,253	食品・飲料・タバコ
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	0.31	—	—	—	食品・飲料・タバコ
HANSSEM CO LTD	6	6	102,397	10,403	耐久消費財・アパレル
LG CORP	70	70	620,214	63,013	資本財
NH INVESTMENT & SECURITIES C	112	112	157,042	15,955	各種金融
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	33	33	94,294	9,580	資本財
NAVER CORP	19	21	1,764,675	179,290	ソフトウェア・サービス
HYUNDAI DEPT STORE CO	12	12	112,424	11,422	小売
DONGSUH COMPANIES INC	15	15	43,728	4,442	食品・生活必需品小売り
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	22	22	144,320	14,662	各種金融
OTTOGI CORPORATION	0.68	0.68	52,360	5,319	食品・飲料・タバコ
PACIFIC CORP	21	21	324,652	32,984	家庭用品・パーソナル用品
KANGWON LAND INC	86	86	310,851	31,582	消費者サービス
POSCO	48	57	1,818,619	184,771	素材
SAMSUNG SDI CO LTD	38	47	1,046,366	106,310	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	48	45	472,581	48,014	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	69	77	21,857,103	2,220,681	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	120	243	322,319	32,747	資本財
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	—	21	86,616	8,800	資本財
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	13	14	3,268,673	332,097	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINSEGAE CO LTD	4	4	105,501	10,718	小売
HYOSUNG CORPORATION	14	14	189,510	19,254	素材
ORTON HOLDINGS CORP	3	—	—	—	食品・飲料・タバコ
YUHAN CORPORATION	5	5	120,978	12,291	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANON SYSTEMS	108	108	142,348	14,462	自動車・自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	43	43	193,878	19,698	保険
GS HOLDINGS CORP	41	42	286,590	29,117	エネルギー
LG DISPLAY CO LTD	152	187	561,342	57,032	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK NETWORKS CO LTD	24	261	170,470	17,319	資本財
HANA FINANCIAL GROUP	190	217	1,005,866	102,196	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	14	14	216,795	22,026	運輸
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	75	—	—	—	各種金融
LOTTE SHOPPING CO	7	10	245,575	24,950	小売
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	54	53	702,250	71,348	保険
AMOREPACIFIC CORP	22	24	789,264	80,189	家庭用品・パーソナル用品
AMOREPACIFIC CORP-PREF	7	7	126,380	12,840	家庭用品・パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	18	18	72,636	7,379	各種金融

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)		
SK INNOVATION CO LTD	44	52	1,142,310	116,058	エネルギー	
CJ CHEILJEDANG CORP	5	5	201,200	20,441	食品・飲料・タバコ	
STX PAN OCEAN CO LTD	—	297	148,531	15,090	運輸	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	9	9	37,592	3,819	商業・専門サービス	
LG INNOTEK CO LTD	8	8	145,690	14,802	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SK HOLDINGS CO LTD	34	27	791,934	80,460	資本財	
KB FINANCIAL GROUP INC	272	338	1,951,529	198,275	銀行	
HYUNDAI WIA CORP	18	17	112,557	11,435	自動車・自動車部品	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	37	51	282,092	28,660	資本財	
BNK FINANCIAL GROUP INC	236	232	215,444	21,889	銀行	
HANMI PHARM CO LTD	3	3	183,960	18,690	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	91,650	9,311	保険	
EMART	11	16	386,182	39,236	食品・生活必需品小売り	
GS RETAIL CO LTD	13	13	46,671	4,741	食品・生活必需品小売り	
HANKOOK TIRE CO LTD	47	70	397,109	40,346	自動車・自動車部品	
HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	—	8	333,315	33,864	半導体・半導体製造装置	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	—	19	232,184	23,589	食品・飲料・タバコ	
NETMARBLE GAMES CORP	—	11	220,038	22,355	ソフトウェア・サービス	
BGF RETAIL CO LTD	7	15	124,661	12,665	食品・生活必需品小売り	
SAMSUNG SDS CO LTD	23	31	636,684	64,687	ソフトウェア・サービス	
WOORI BANK	208	299	475,600	48,321	銀行	
SAMSUNG C&T CORP	53	63	927,684	94,252	資本財	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	—	15	601,755	61,138	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DOOSAN BOBCAT INC	—	43	155,734	15,822	資本財	
KAKAO CORP	17	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
PARADISE CO LTD	18	—	—	—	消費者サービス	
CELLTRION INC	51	66	1,139,715	115,795	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MEDY-TOX INC	—	3	139,480	14,171	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	20	176,290	17,911	メディア	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	5,709 107	7,042 110	72,823,564 —	7,398,874 <15.5%>	
(台湾)			千新台幣ドル			
ACER INC	2,558	2,558	4,067	15,292	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASUSTEK COMPUTER INC	500	550	14,516	54,582	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	279	279	3,241	12,188	半導体・半導体製造装置	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	4,127	5,186	19,241	72,346	半導体・半導体製造装置	
ASIA CEMENT CORP	1,321	2,971	7,934	29,834	素材	
TAIWAN BUSINESS BANK	5,263	1,919	1,595	5,997	銀行	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	340	340	1,348	5,068	素材	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	—	310	2,402	9,033	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	285	286	2,177	8,186	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
QUANTA COMPUTER INC	1,962	1,962	14,190	53,355	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	421	421	1,703	6,406	不動産	
EVA AIRWAYS CORP	1,397	1,439	2,108	7,928	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)	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	417	507	16,705	62,813	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	3,774	3,963	6,441	24,218	銀行
CHINA AIRLINES LTD	3,272	1,302	1,432	5,385	運輸
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,220	1,770	10,411	39,146	自動車・自動車部品
CHINA STEEL	7,652	11,202	27,670	104,040	素材
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	3,119	1,539	4,379	16,465	保険
ADVANTECH CO LTD	185	204	4,202	15,802	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COMPAL ELECTRONICS	2,417	4,317	9,606	36,121	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA ELECTRONICS INC	1,429	1,439	19,930	74,938	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	480	480	4,089	15,376	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	2,753	2,853	29,387	110,496	電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	5,900	5,900	7,317	27,512	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,102	1,522	16,437	61,805	電気通信サービス
EVERGREEN MARINE	1,075	1,075	1,850	6,956	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	1,890	4,070	10,399	39,102	資本財
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	329	329	4,493	16,893	耐久消費財・アパレル
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	117	119	3,885	14,609	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	400	400	4,685	17,616	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	2,788	3,118	28,718	107,983	素材
FORMOSA TAPPETA CO.	400	400	1,224	4,602	耐久消費財・アパレル
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	2,310	2,470	23,026	86,578	素材
TRANSCEND INFORMATION INC	94	94	804	3,025	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GIANT MANUFACTURING	254	254	3,857	14,505	耐久消費財・アパレル
MEDIATEK INC	1,068	1,128	37,338	140,391	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	4,690	5,510	26,479	99,562	各種金融
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	4,535	8,162	13,508	50,793	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	140	260	9,074	34,118	小売
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	950	1,570	11,147	41,912	電気通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	7,751	7,721	10,231	38,468	各種金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	5,419	7,189	35,372	133,000	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	11,727	12,567	11,587	43,569	銀行
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	5,914	6,733	12,423	46,712	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	11,013	12,233	132,729	499,061	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	7,503	9,023	21,385	80,409	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	70	80	46,270	173,975	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	7,727	9,049	12,081	45,426	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	6,157	6,157	5,880	22,111	保険
INVENTEC CO LTD	1,365	1,365	3,208	12,062	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HTC CORPORATION	374	374	2,522	9,485	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,504	1,504	5,942	22,345	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	9,298	11,342	10,548	39,660	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	11,992	13,772	26,718	100,461	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	5,439	7,169	13,873	52,164	銀行
MERIDA INDUSTRY CO LTD	115	115	1,518	5,710	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)		
POWERTECH TECHNOLOGY INC	477	477	4,585	17,243	半導体・半導体製造装置	
NAN YA PLASTICS CORP	3,097	3,707	27,695	104,133	素材	
WISTRON CORP	1,219	2,357	6,283	23,625	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
POU CHEN	1,537	1,537	5,705	21,451	耐久消費財・アパレル	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	3,523	3,743	23,961	90,094	食品・飲料・タバコ	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	445	455	12,752	47,948	食品・生活必需品小売り	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	682	1,092	11,470	43,127	エネルギー	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	464	557	1,724	6,485	不動産	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	368	368	1,842	6,927	耐久消費財・アパレル	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	788	928	8,635	32,467	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SILICONWARE PRECISION INDS	1,570	1,590	7,608	28,606	半導体・半導体製造装置	
STANDARD FOODS CORP	343	357	2,656	9,989	食品・飲料・タバコ	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	781	781	2,928	11,012	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN CEMENT	2,669	2,979	9,980	37,527	素材	
TECO ELECTRIC & MACHINERY	1,110	1,110	3,108	11,686	資本財	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	17,213	19,483	469,561	1,765,552	半導体・半導体製造装置	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	7,270	9,770	15,338	57,674	半導体・半導体製造装置	
YULON MOTOR COMPANY	510	510	1,308	4,918	自動車・自動車部品	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	—	1,770	4,239	15,939	運輸	
INOTERA MEMORIES INC	1,920	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	5,520	7,750	9,997	37,590	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WPG HOLDINGS CO LTD	811	1,561	6,552	24,635	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	127	130	4,061	15,272	資本財	
PEGATRON CORP	1,224	1,594	12,438	46,770	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	1,144	1,354	11,850	44,556	各種金融	
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	1,980	1,980	1,924	7,236	電気通信サービス	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	219	219	1,591	5,984	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	6,263	7,254	11,824	44,460	銀行	
CASETEK HOLDINGS LTD	90	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	150	70	2,128	8,001	耐久消費財・アパレル	
GENERAL INTERFACE SOLUTION	—	140	3,430	12,896	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	540	540	3,223	12,121	半導体・半導体製造装置	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	173	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PHISON ELECTRONICS CORP	115	115	4,082	15,351	半導体・半導体製造装置	
TAIMED BIOLOGICS INC	130	130	2,808	10,558	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HERMES MICROVISION INC	40	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
OBI PHARMA INC	60	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GLOBALWAFERS CO LTD	—	180	6,030	22,672	半導体・半導体製造装置	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	231,187 90	267,191 89	1,468,654 —	5,522,142 <11.6%>	
(インド)			千インドルピー			
RELIANCE INDUSTRIES LTD	895	2,086	187,907	330,716	エネルギー	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	221	661	34,524	60,763	エネルギー	
ASIAN PAINTS LTD	181	249	29,842	52,522	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)	
EICHER MOTORS LTD	9	9	28,971	50,989	資本財
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	257	314	42,845	75,408	自動車・自動車部品
SHREE CEMENT LTD	7	9	16,317	28,718	素材
ICICI BANK LTD	766	1,909	59,453	104,637	銀行
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	—	594	25,644	45,134	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	1,047	1,325	41,565	73,155	銀行
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26	33	4,461	7,851	運輸
LIC HOUSING FINANCE LTD	255	279	16,297	28,683	銀行
TATA STEEL LTD	258	258	18,175	31,988	素材
JSW STEEL LTD	79	802	21,194	37,303	素材
NESTLE INDIA LIMITED	—	23	18,679	32,875	食品・飲料・タバコ
GAIL INDIA LTD	282	398	17,988	31,660	公益事業
VEDANTA LTD	727	1,105	35,776	62,967	素材
TITAN INDUSTRIES LTD	278	278	21,640	38,087	耐久消費財・アパレル
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	685	1,028	19,493	34,308	エネルギー
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	5	—	—	—	食品・飲料・タバコ
LUPIN LTD	164	163	13,569	23,882	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACC LTD	17	17	3,112	5,478	素材
BAJAJ FINANCE LTD	111	111	19,616	34,524	各種金融
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	1,031	1,200	207,158	364,599	銀行
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	458	493	26,534	46,700	メディア
INFOSYS LTD	1,268	1,517	144,850	254,936	ソフトウェア・サービス
WIPRO LTD	450	890	26,932	47,401	ソフトウェア・サービス
INDIAN OIL CORP LTD	—	588	23,204	40,839	エネルギー
HINDUSTAN UNILEVER LTD	482	489	61,293	107,875	家庭用品・パーソナル用品
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	41	41	4,126	7,262	ヘルスケア機器・サービス
HCL TECHNOLOGIES LTD	428	458	40,152	70,668	ソフトウェア・サービス
DABUR INDIA LTD	309	581	20,248	35,637	家庭用品・パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	32	32	11,689	20,572	自動車・自動車部品
DR. REDDY'S LABORATORIES	78	78	18,489	32,540	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BHARTI AIRTEL LTD	826	859	43,355	76,305	電気通信サービス
UNITED SPIRITS LTD	35	35	11,099	19,534	食品・飲料・タバコ
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	670	829	44,287	77,945	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	—	—	—	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	80	65,941	116,057	自動車・自動車部品
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	126	160	9,494	16,709	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUROBINDO PHARMA LTD	203	203	16,053	28,253	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	341	512	18,515	32,586	自動車・自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	121	121	15,333	26,987	各種金融
CIPLA LTD	299	313	19,240	33,862	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LARSEN & TOUBRO LTD	206	354	43,108	75,870	資本財
ULTRATECH CEMENT LTD	23	73	32,088	56,475	素材
ASHOK LEYLAND LIMITED	631	631	7,286	12,824	資本財
BOSCH LTD	4	4	9,105	16,025	自動車・自動車部品

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)		
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	322	361	98,940	174,134	ソフトウェア・サービス	
NTPC LTD	974	1,454	25,901	45,587	公益事業	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	64	64	16,954	29,839	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
YES BANK LTD	191	1,237	37,703	66,358	銀行	
AMBUJA CEMENTS LTD	371	371	10,077	17,735	素材	
BHARAT FORGE LTD	66	133	9,617	16,926	自動車・自動車部品	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	790	790	20,806	36,618	素材	
ITC LTD	2,416	2,726	70,890	124,768	食品・飲料・タバコ	
UNITED PHOSPHORUS LTD	262	262	19,520	34,356	素材	
SIEMENS INDIA LTD	53	53	6,503	11,445	資本財	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	93	186	18,150	31,944	家庭用品・パーソナル用品	
TECH MAHINDRA LTD	164	294	14,429	25,395	ソフトウェア・サービス	
CAIRN INDIA LTD	221	—	—	—	エネルギー	
IDEA CELLULAR LTD	599	1,422	13,748	24,198	電気通信サービス	
MARICO LTD	207	424	13,266	23,348	家庭用品・パーソナル用品	
POWER FINANCE CORPORATION	838	372	5,134	9,036	各種金融	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	625	625	27,098	47,693	運輸	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	—	481	7,921	13,941	各種金融	
BAJAJ FINSERV LTD	—	22	11,460	20,170	保険	
BAJAJ AUTO LTD	54	54	17,465	30,739	自動車・自動車部品	
COAL INDIA LTD	419	419	11,874	20,899	エネルギー	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	355	347	8,584	15,109	自動車・自動車部品	
TATA MOTORS LTD	1,116	1,407	61,967	109,062	自動車・自動車部品	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	339	509	4,696	8,266	資本財	
TATA POWER CO LTD	932	932	7,809	13,745	公益事業	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	162	162	6,848	12,052	各種金融	
BHARTI INFRA TEL LTD	362	362	15,537	27,346	電気通信サービス	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	200	269	33,243	58,508	銀行	
AXIS BANK LTD	1,093	1,415	76,489	134,622	銀行	
HAVELLS INDIA LTD	105	234	12,130	21,348	資本財	
CADILA HEALTHCARE LTD	105	105	5,030	8,853	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GRASIM INDUSTRIES LTD	—	273	33,556	59,060	素材	
IDFC BANK LTD	—	755	4,253	7,486	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	28,000 74	40,746 77	2,324,279 —	4,090,732 <8.6%>	
(カタル)			千カタルリアル			
QATAR INSURANCE CO	79	91	357	10,610	保険	
QATAR NATIONAL BANK	136	177	2,152	63,916	銀行	
COMMERCIAL BANK QSC	64	203	530	15,752	銀行	
OOREDOO QSC	72	72	611	18,162	電気通信サービス	
DOHA BANK QSC	102	123	336	9,980	銀行	
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	15	15	281	8,349	公益事業	
INDUSTRIES QATAR	99	159	1,502	44,613	資本財	
QATAR ISLAMIC BANK	58	58	553	16,435	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)		
QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	227	227	320	9,516	エネルギー	
MASRAF AL RAYAN	269	269	943	28,012	銀行	
BARWA REAL ESTATE CO	38	38	108	3,215	不動産	
EZDAN HOLDING GROUP	485	485	407	12,112	不動産	
VODAFONE QATAR	195	—	—	—	電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,845	1,923	8,103	240,676	
		13	12	—	<0.5%>	
(南アフリカ)			千南アフリカランド			
BIDVEST GROUP LTD	195	277	4,886	38,895	資本財	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	245	473	3,320	26,430	小売	
DISCOVERY LIMITED	217	217	3,225	25,673	保険	
MASSMART HOLDINGS LTD	83	83	939	7,479	食品・生活必需品小売り	
GOLD FIELDS LTD	645	645	3,668	29,204	素材	
REMGRO LTD	374	461	9,692	77,149	各種金融	
THE FOSCHINI GROUP LIMITED	115	240	3,338	26,576	小売	
EXXARO RESOURCES LTD	46	196	2,965	23,604	エネルギー	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	32	32	2,971	23,656	銀行	
LIBERTY HOLDINGS LTD	62	62	698	5,560	保険	
MTN GROUP LTD	1,204	1,325	16,851	134,137	電気通信サービス	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	283	480	6,656	52,988	素材	
TELKOM SA LTD	113	113	612	4,875	電気通信サービス	
FIRSTSTRAND LTD	2,354	2,494	13,074	104,072	各種金融	
PSG GROUP LTD	80	80	2,099	16,710	各種金融	
NASPERS LTD-N SHS	306	350	124,828	993,637	メディア	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	101	101	769	6,126	各種金融	
NEDBANK GROUP LTD	149	149	3,127	24,898	銀行	
NETCARE LTD	602	602	1,510	12,022	ヘルスケア機器・サービス	
PICK N PAY STORES LTD	181	528	3,118	24,824	食品・生活必需品小売り	
RMB HOLDINGS LTD	432	432	2,760	21,973	各種金融	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	31	31	1,331	10,595	素材	
SAPPI LIMITED	325	499	4,663	37,122	素材	
SASOL LTD	398	436	19,007	151,298	素材	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	321	344	7,239	57,630	食品・生活必需品小売り	
MR PRICE GROUP LTD	209	212	4,093	32,580	小売	
BRAIT SE	203	203	971	7,736	各種金融	
STANDARD BANK GROUP LTD	879	985	16,501	131,354	銀行	
SPAR GROUP LIMITED/THE	146	146	2,435	19,384	食品・生活必需品小売り	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	749	836	4,657	37,069	小売	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	124	124	2,587	20,596	小売	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	234	301	9,504	75,655	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BARCLAYS AFRICA GROUP	256	471	6,714	53,450	銀行	
TIGER BRANDS LTD	125	130	5,033	40,065	食品・飲料・タバコ	
SANLAM LTD	1,231	1,133	8,182	65,132	保険	
INVESTEC LTD	258	288	2,790	22,211	各種金融	

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)		
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	605	576	2,306	18,361	素材	
PIONEER FOODS LTD	88	88	1,025	8,166	食品・飲料・タバコ	
NEW EUROPE PROPERTY INVEST	194	—	—	—	不動産	
MONDI LTD	101	98	3,352	26,684	素材	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	761	784	1,945	15,485	ヘルスケア機器・サービス	
MMI HOLDINGS LTD	680	680	1,324	10,539	保険	
RAND MERCHANT INVESTMENT HD	404	404	1,560	12,418	保険	
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	253	—	—	—	消費者サービス	
VODACOM GROUP	217	422	6,431	51,197	電気通信サービス	
SIBANYE-STILLWATER	664	1,609	3,227	25,691	素材	
NEPI ROCKCASTLE PLC	—	309	6,196	49,325	不動産	
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	495	495	850	6,772	不動産	
FORTRESS INCOME FUND LTD	364	858	3,507	27,920	不動産	
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	2,046	2,390	13,984	111,314	耐久消費財・アパレル	
BID CORP LTD	249	264	8,156	64,925	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額	20,453	24,481	360,701	2,871,185	
	銘柄数 <比率>	50	49	—	<6.0%>	
(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	964	964	577	17,861	銀行	
EMAAR PROPERTIES PJSC	2,451	3,006	2,344	72,502	不動産	
ARABTEC HOLDING CO	2,489	—	—	—	資本財	
DUBAI FINANCIAL MARKET	1,279	—	—	—	各種金融	
EMAAR MALLS PJSC	1,796	1,796	400	12,386	不動産	
DXB ENTERTAINMENTS PJSC	—	2,344	154	4,762	消費者サービス	
DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	—	1,812	650	20,114	不動産	
FIRST GULF BANK	498	—	—	—	銀行	
EMIRATES TELECOM GROUP CO	1,128	1,377	2,368	73,245	電気通信サービス	
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	1,132	1,845	1,339	41,425	銀行	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	450	1,075	1,091	33,747	銀行	
ALDAR PROPERTIES PJSC	2,714	2,714	608	18,803	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	14,906	16,936	9,535	294,850	
	銘柄数 <比率>	10	9	—	<0.6%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	1,557,070	1,793,144	—	47,011,700	
	銘柄数 <比率>	816	817	—	<98.5%>	

(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		
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	189,100	308,400	9,258		55,178
小 計	口 数 ・ 金 額 189,100	口 数 ・ 金 額 308,400	9,258		55,178
	銘 柄 数 <比 率> 1	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	20,500	415		14,489
SUL AMERICA SA-UNITS	14,318	16,562	298		10,424
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,500	28,000	820		28,626
KLABIN SA-UNIT	44,900	55,100	1,046		36,486
小 計	口 数 ・ 金 額 112,218	口 数 ・ 金 額 120,162	2,581		90,026
	銘 柄 数 <比 率> 4	銘 柄 数 <比 率> 4	—		<0.2%>
(トルコ)			千トルコリラ		
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	135,630	135,630	360		10,574
小 計	口 数 ・ 金 額 135,630	口 数 ・ 金 額 135,630	360		10,574
	銘 柄 数 <比 率> 1	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	324,053	324,053	3,467		27,600
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	144,115	153,979	3,827		30,470
RESILIENT REIT LTD	13,040	23,098	3,301		26,280
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	22,923	22,923	2,488		19,810
小 計	口 数 ・ 金 額 504,131	口 数 ・ 金 額 524,053	13,085		104,161
	銘 柄 数 <比 率> 4	銘 柄 数 <比 率> 4	—		<0.2%>
合 計	口 数 ・ 金 額 941,079	口 数 ・ 金 額 1,088,245	—		259,941
	銘 柄 数 <比 率> 10	銘 柄 数 <比 率> 10	—		<0.5%>

(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	454	—

(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	47,011,700	96.4
投 資 信 託 受 益 証 券	90,026	0.2
投 資 証 券	169,914	0.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,509,289	3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	48,780,929	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(47,605,762千円)の投資信託財産総額(48,780,929千円)に対する比率は97.6%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=113.39円	1メキシコペソ=5.96円	1ブラジルレアル=34.87円
1チリペソ=0.1797円	1コロンビアペソ=0.0376円	1ユーロ=132.10円
1トルコリラ=29.31円	1チェココルナ=5.17円	1ハンガリーフォリント=0.4234円
1ポーランドズロチ=31.22円	1香港ドル=14.54円	1マレーシアリングギット=27.05円
1タイバーツ=3.43円	1フィリピンペソ=2.21円	1インドネシアルピア=0.0084円
1韓国ウォン=0.1016円	1新台湾ドル=3.76円	1インドルピー=1.76円
1カタールリアル=29.70円	1南アフリカランド=7.96円	1アラブ首長国連邦ディルハム=30.92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11月10日現在
(A) 資 産	49,082,113,982円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,339,830,103
株 式(評価額)	47,011,700,976
投資信託受益証券(評価額)	90,026,951
投 資 証 券(評価額)	169,914,898
未 収 入 金	308,299,591
未 収 配 当 金	24,231,654
差 入 委 託 証 拠 金	138,109,809
(B) 負 債	1,368,395,473
未 払 金	1,308,097,486
未 払 解 約 金	60,297,684
未 払 利 息	303
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	47,713,718,509
元 本	15,742,008,514
次 期 繰 越 損 益 金	31,971,709,995
(D) 受 益 権 総 口 数	15,742,008,514口
1万口当たり基準価額(C/D)	30,310円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2016年11月11日 至 2017年11月10日
(A) 配 当 等 収 益	836,440,813円
受 取 配 当 金	835,650,379
受 取 利 息	788,498
そ の 他 収 益 金	60,564
支 払 利 息	△58,628
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	11,646,220,529
売 買 益	12,677,267,733
売 買 損	△1,031,047,204
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	290,070,853
取 引 益	304,673,939
取 引 損	△14,603,086
(D) そ の 他 費 用	△61,214,942
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	12,711,517,253
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	15,892,598,634
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,263,516,414
(H) 解 約 差 損 益 金	△2,895,922,306
(I) 計 (E+F+G+H)	31,971,709,995
次 期 繰 越 損 益 金(I)	31,971,709,995

(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13,859,441,261円、期中追加設定元本額は3,784,989,162円、期中一部解約元本額は1,902,421,909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	6,404,751,337円
DC新興国株式インデックス・オープン	3,250,378,332円
世界経済インデックスファンド	2,894,954,558円
DC世界経済インデックスファンド	2,141,727,786円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	358,249,858円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	257,077,884円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	207,074,863円
SMT インデックスバランス・オープン	134,460,063円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	50,692,585円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	18,329,814円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	18,145,965円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	5,792,951円
SMT 世界経済インデックス・オープン	232,979円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	139,539円

## お知らせ

デリバティブ取引について、リスク回避ならびに投資対象資産を保有した場合の代替の目的としてのみ利用することを明確にするために、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2017年10月2日)