

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（除く日本、円ベース）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6期（決算日 2015年1月20日）

受益者のみなさまへ

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

お問い合わせ先

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

PCサイト <http://www.smtam.jp/>

モバイルサイト <http://m.smtam.jp/>

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-8574 東京都港区芝三丁目33番1号

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)			株 組 比	式 入 率	株 先 比	式 物 率	債 組 比	券 入 率	債 先 比	券 物 率	投 信 託 証 券 組 入 比 率	資 産 純 総 額
	円	円	%										
第2期(2011年1月20日)	12,972	0	△2.7	48.6	2.7	45.9	—	0.5	1,022				
第3期(2012年1月20日)	12,000	0	△7.5	48.3	1.3	48.2	—	0.7	1,737				
第4期(2013年1月21日)	15,282	20	27.5	47.3	1.8	47.0	0.1	0.7	2,751				
第5期(2014年1月20日)	18,162	20	19.0	49.2	1.8	45.6	0.2	0.6	4,684				
第6期(2015年1月20日)	20,530	20	13.1	48.4	1.4	46.8	0.2	0.8	10,344				

(注1) 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 組 比	式 入 率	株 先 比	式 物 率	債 組 比	券 入 率	債 先 比	券 物 率	投 信 託 証 券 組 入 比 率
	円	%									
(当期首) 2014年 1月20日	18,162	—	49.2	1.8	45.6	0.2	0.6				
1月末	17,614	△3.0	48.3	1.8	46.4	0.1	0.6				
2月末	17,943	△1.2	48.5	1.7	46.1	0.2	0.6				
3月末	18,252	0.5	48.7	1.4	47.3	0.0	0.7				
4月末	18,378	1.2	48.5	1.8	46.9	0.1	0.7				
5月末	18,598	2.4	48.5	1.9	46.3	0.4	0.9				
6月末	18,771	3.4	48.3	2.4	46.0	0.5	0.8				
7月末	19,098	5.2	48.9	2.0	45.6	0.3	0.7				
8月末	19,326	6.4	49.6	1.3	45.7	0.3	0.7				
9月末	19,613	8.0	48.6	2.0	45.7	0.5	0.7				
10月末	19,657	8.2	47.9	2.1	46.1	0.2	0.7				
11月末	21,332	17.5	48.9	1.6	45.8	0.2	0.8				
12月末	21,183	16.6	48.2	2.5	45.8	0.5	0.8				
(当期末) 2015年 1月20日	20,550	13.1	48.4	1.4	46.8	0.2	0.8				

(注1) 期末基準価額は分配金込みです。

(注2) 騰落率は期首比です。

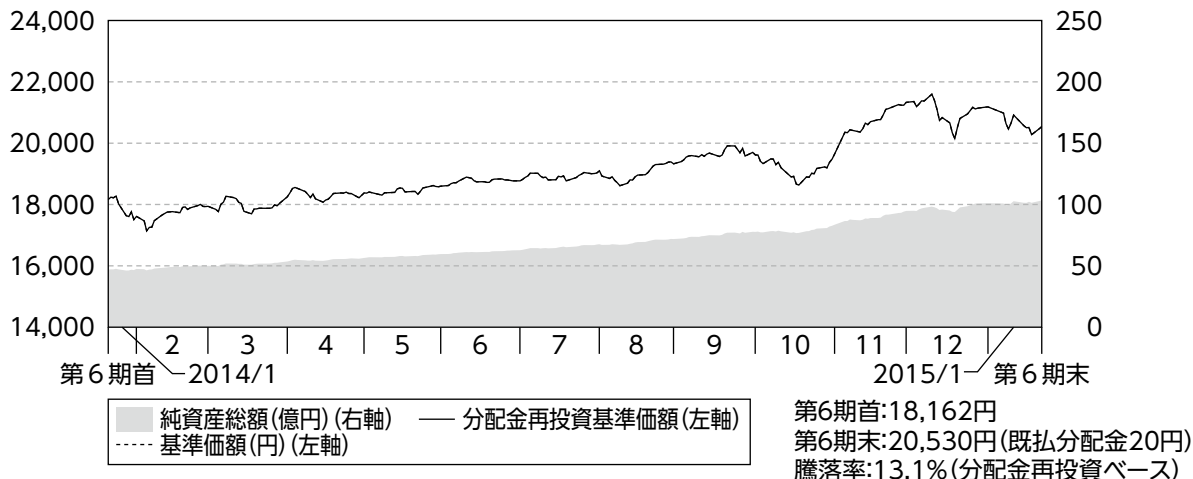
(注3) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注4) 株式先物比率、債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額は、2014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

当期の基準価額は地政学的リスクの高まりや外国為替市場の影響、原油価格下落に対する警戒感等により下落する場面も見られましたが、米国景気の回復基調や世界的な金融緩和の流れを受けて、当ファンドが実質的な投資対象とする国内、先進国および新興国の株式並びに公社債は概ね堅調に推移したことから当ファンドの基準価額も上昇しました。

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%	3.7%	4.7%
国内株式インデックス マザーファンド	国内株式	5.0%	5.4%	10.2%
外国債券インデックス マザーファンド	先進国債券	27.5%	27.7%	15.1%
外国株式インデックス マザーファンド	先進国株式	27.5%	28.6%	18.5%
新興国債券インデックス マザーファンド	新興国債券	17.5%	16.5%	8.1%
新興国株式インデックス マザーファンド	新興国株式	17.5%	16.7%	13.6%

投資環境

国内債券市場

日銀による大規模な国債購入を背景に需給の引き締まった状態が続いたことに加え、地政学的リスクの高まりやECB(欧州中央銀行)による追加金融緩和観測などを背景に国内金利は低下基調となりました。2014年10月末に日銀が追加金融緩和を発表したことで金利低下圧力が一層強まり、また、世界的な低金利を背景に当期末にかけては低下余地を探る展開となりました。

国内株式市場

当期初は主に天候要因による米国経済指標の悪化や地政学的リスクへの警戒感から軟調に推移する場面も見られましたが、その後は米国の景気回復期待が高まったことや円安が進行したことなどから堅調に推移しました。2014年10月には世界的な景気減速が懸念されたことから急落しましたが、10月末に日銀が追加金融緩和を発表したことで急激に円安が進行し、国内株式市場は大幅に上昇しました。当期末にかけては原油安などを背景に上値の重い展開が続きました。

先進国債券市場

米国では、FRB(米連邦準備理事会)が緩和的な金融政策を継続する姿勢を示したことや地政学的リスクの高まりなどを受けて利回りは低下しました。欧州では、ユーロ圏における低インフレが顕著となったことや域内の弱い経済指標が相次いだことなどをを受けてECBによる追加金融緩和観測が高まり、利回りは低下基調となりました。また、当期末にかけては原油安を背景に世界的に低インフレ傾向が強まったこともあり、利回りの低下基調が継続しました。

先進国株式市場

当期初は悪天候による影響を受けた米国経済指標の一時的な悪化や地政学的リスクなどを背景に株価が調整する場面が見られたものの、FRBによる超低金利政策の長期化観測やECBの追加金融緩和観測など世界的な金融緩和の流れを受けて底堅い推移となりました。2014年10月には世界経済の成長見通しが引き下げられたことなどを背景に株価は一時急落しましたが、FRBが利上げを急がない姿勢を示したことなどが好感され反発しました。当期末にかけては原油安やギリシャの政情不安などを背景に不安定な市場動向となり上値の重い展開となりました。

新興国債券市場

FRBが金融緩和を継続する姿勢を示したことなどを背景に堅調な推移が続いていましたが、ウクライナ情勢の緊迫化など地政学的リスクの高まりなどを受けて利回りが上昇する場面も見られました。当期末にかけては、原油安の影響が警戒されリスクを抑制する投資行動が広がったことなどを背景に軟調な推移となりました。

新興国株式市場

地政学的リスクの高まりや世界景気の先行き懸念などから下落する場面もありましたが、FRBが利上げを急がない姿勢を示したことやECBによる追加金融緩和期待などをを受けて底堅い推移となりました。当期末にかけては中国の景気減速懸念や原油安による産油国経済への影響などが警戒され軟調な展開が続きました。

○当ファンド

国内、先進国および新興国の株式・公社債へ実質的に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保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総合インデックス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東証株価指数(TOPIX)に連動する投資成果を目標として、現物株式については、東証一部上場銘柄の中から信用リスクが極めて高いと判断される銘柄を除外した上で、ベンチマークの個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成して運用を行いました。また、設定や解約による資金の流出入等に対応するため株価指数先物取引を利用し、先物を含む国内株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

○外国債券インデックス マザーファンド

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

○外国株式インデックス マザーファンド

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

○新興国債券インデックス マザーファンド

ベンチマークであるJP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として、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。

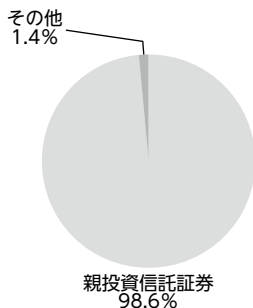
当該投資信託の組入資産の内容

○組入ファンド

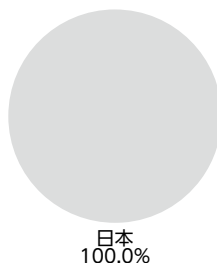
	第6期末
	2015年1月20日
外国株式インデックス マザーファンド	28.6%
外国債券インデックス マザーファンド	27.7%
新興国株式インデックス マザーファンド	16.7%
新興国債券インデックス マザーファンド	16.5%
国内株式インデックス マザーファンド	5.4%
国内債券インデックス マザーファンド	3.7%
その他	1.4%
組入ファンド数	6

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

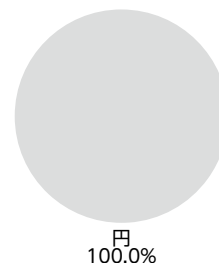
○資産別配分



○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、国別配分の比率はポートフォリオ部分に対する評価額の割合です。

当該投資信託のベンチマークとの差異

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

分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通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6期	
	2014年1月21日~2015年1月20日	
当期分配金	(円)	20
(対基準価額比率)	(%)	(0.097)
当期の収益	(円)	20
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	10,529

(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、各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総合インデック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。

○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、東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

○外国債券インデックス マザーファンド

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

○外国株式インデックス マザーファンド

原則としてMSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(除く日本、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
	(2014年1月21日~2015年1月20日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	103円	0.540%	(a) 信託報酬＝〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は19,147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)	(41)	(0.216)	
(販売会社)	(52)	(0.270)	
(受託会社)	(10)	(0.054)	
(b) 売買委託手数料	4	0.019	(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)	(2)	(0.011)	
(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)	(1)	(0.003)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(1)	(0.005)	
(c) 有価証券取引税	4	0.023	(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)	(4)	(0.023)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	23	0.121	(d) その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、証拠金利息の調整金額等
(保管費用)	(22)	(0.116)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	134	0.703	

(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。

(注4) -印は該当がないことを示します。

売買および取引の状況

<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	361,299	857,930	13,531	31,940
国内株式インデックス マザーファンド	223,197	239,360	8,430	9,120
外国株式インデックス マザーファンド	707,243	1,267,690	28,272	51,370
国内債券インデックス マザーファンド	158,211	206,580	5,601	7,290
外国債券インデックス マザーファンド	507,876	1,346,140	18,941	50,180
新興国債券インデックス マザーファンド	548,925	932,670	18,739	31,940

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	40,370,355千円	50,717,625千円	24,593,112千円
(b) 当期中の平均組入株式時価総額	141,084,922千円	173,932,990千円	24,749,439千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.28	0.29	0.99

(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[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

<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 27,679	百万円 —	% —	百万円 37,015	百万円 90	% 0.2

<平均保有割合 0.8%>

(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。

<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
為替直物取引	百万円 44,104	百万円 13,831	% 31.4	百万円 16,555	百万円 —	% —

<平均保有割合 1.1%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<新興国株式インデックス 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
為替直物取引	百万円 28,487	百万円 —	% —	百万円 30,849	百万円 380	% 1.2

<平均保有割合 4.6%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■利害関係人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	115百万円	118百万円	658百万円

(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

<親投資信託残高>

	当 期 首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
新興国株式インデックス マザーファンド	千口 352,368	千口 700,135	千円 1,727,585
国内株式インデックス マザーファンド	259,152	473,919	553,537
外国株式インデックス マザーファンド	834,174	1,513,145	2,958,956
国内債券インデックス マザーファンド	130,923	283,533	380,388
外国債券インデックス マザーファンド	519,799	1,008,735	2,863,294
新興国債券インデックス マザーファンド	452,270	982,456	1,710,947

(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	9,114,836千口
国内株式インデックス マザーファンド	125,624,543千口
外国株式インデックス マザーファンド	115,343,620千口
国内債券インデックス マザーファンド	229,010,770千口
外国債券インデックス マザーファンド	87,062,303千口
新興国債券インデックス マザーファンド	7,903,790千口

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	1,727,585	16.6
国内株式インデックス マザーファンド	553,537	5.3
外国株式インデックス マザーファンド	2,958,956	28.5
国内債券インデックス マザーファンド	380,388	3.7
外国債券インデックス マザーファンド	2,863,294	27.6
新興国債券インデックス マザーファンド	1,710,947	16.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	190,810	1.8
投 資 信 託 財 産 総 額	10,385,517	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(22,452,637千円)の投資信託財産総額(22,574,392千円)に対する比率は99.5%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(225,125,964千円)の投資信託財産総額(225,866,941千円)に対する比率は99.7%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(244,690,256千円)の投資信託財産総額(247,353,547千円)に対する比率は98.9%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(13,640,255千円)の投資信託財産総額(13,777,113千円)に対する比率は99.0%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=117.90円、1カナダドル=98.64円、1メキシコペソ=8.06円、1ブラジルレアル=44.47円、1チリペソ=0.1877円、1コロンビアペソ=0.0501円、1ペルーヌエボソル=39.15円、1ユーロ=136.65円、1イギリスポンド=177.89円、1スイスフラン=133.95円、1スウェーデンクローナ=14.48円、1ノルウェークローネ=15.43円、1デンマーククローネ=18.39円、1トルコリラ=50.48円、1チェココルナ=4.89円、1ハンガリーフォリント=0.4271円、1ポーランドズロチ=31.52円、1ロシアルーブル=1.82円、1オーストラリアドル=96.56円、1ニュージーランドドル=91.43円、1香港ドル=15.21円、1シンガポールドル=88.29円、1マレーシアリンギット=32.90円、1タイバーツ=3.61円、1フィリピンペソ=2.65円、1インドネシアルピア=0.0094円、1韓国ウォン=0.1091円、1新台湾ドル=3.74円、1インドルピー=1.93円、1イスラエルシェケル=30.10円、1カタールリアル=32.43円、1南アフリカランド=10.13円、1ナイジェリアナイラ=0.6325円、1アラブ首長国連邦ディルハム=32.15円です。

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2015年1月20日現在
(A)資 産	10,385,517,731円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	190,807,887
新興国株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,727,585,303
国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	553,537,923
外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	2,958,956,001
国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	380,388,634
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	2,863,294,399
新興国債券インデックス マザーファンド(評価額)	1,710,947,298
未 収 利 息	286
(B)負 債	40,871,405
未 払 収 益 分 配 金	10,077,691
未 払 解 約 金	7,801,209
未 払 信 託 報 酬	22,619,280
そ の 他 未 払 費 用	373,225
(C)純 資 産 総 額(A-B)	10,344,646,326
元 本	5,038,845,504
次 期 繰 越 損 益 金	5,305,800,822
(D)受 益 権 総 口 数	5,038,845,504口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,530円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2014年1月21日 至 2015年1月20日
(A)配 当 等 収 益	68,268円
受 取 利 息	68,268
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	827,537,977
売 買 益	936,253,015
売 買 損	△108,715,038
(C)信 託 報 酬 等	△37,707,397
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	789,898,848
(E)前 期 繰 越 損 益 金	560,635,635
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	3,965,344,030
(配 当 等 相 当 額)	(2,178,378,145)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,786,965,885)
(G) 計 (D+E+F)	5,315,878,513
(H)収 益 分 配 金	△10,077,691
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	5,305,800,822
追 加 信 託 差 損 益 金	3,965,344,030
(配 当 等 相 当 額)	(2,188,550,569)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,776,793,461)
分 配 準 備 積 立 金	1,340,456,792

(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2,579,115,686円、期中追加設定元本額は3,411,351,368円、期中一部解約元本額は951,621,550円です。

※1口当たり純資産額は2.0530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)		206,559,836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)		583,339,012円
(C)	収益調整金額		3,965,344,030円
(D)	分配準備積立金額		560,635,635円
(E)	分配対象収益額(A+B+C+D)		5,315,878,513円
(F)	期末残存口数		5,038,845,504口
(G)	収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)		10,549円
(H)	分配金額(1万口当たり)		20円
(I)	収益分配金金額(F×H/10,000)		10,077,691円

分配金のお知らせ

	当期
1万口当たり分配金	20円

(注)分配金は決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

【分配金の課税上の取扱いについて】

- ・収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

- A. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、
- B. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

- ・課税上の詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めいたします。
- ・税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になる場合があります。

お知らせ

運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2014年12月1日)

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

(変更日:2014年12月1日)

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

(変更日:2014年12月1日)

米国シティグループが同社の企業ブランドを「シティグループ」から「シティ」に変更したことに伴い、同社が算出するインデックスおよび指数開発者の名称が変更となりました。

国内債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日 2014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		債券先物率 債組入比率	純資産額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
	円	%		%	%	百万円
第10期(2010年5月31日)	11,891	3.5	326,266	3.5	98.5	161,375
第11期(2011年5月30日)	12,087	1.6	331,753	1.7	99.9	173,894
第12期(2012年5月29日)	12,436	2.9	341,318	2.9	99.4	197,259
第13期(2013年5月29日)	12,514	0.6	343,438	0.6	99.3	246,098
第14期(2014年5月29日)	12,915	3.2	354,471	3.2	99.3	256,692

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 債組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(当期首) 2013年 5月29日	円	%		%	%
	12,514	－	343,438	－	99.3
5月末	12,574	0.5	345,057	0.5	99.5
6月末	12,579	0.5	345,262	0.5	99.1
7月末	12,614	0.8	346,184	0.8	99.5
8月末	12,667	1.2	347,679	1.2	99.2
9月末	12,733	1.8	349,462	1.8	99.6
10月末	12,807	2.3	351,530	2.4	99.5
11月末	12,819	2.4	351,846	2.4	99.4
12月末	12,754	1.9	350,094	1.9	99.4
2014年 1月末	12,853	2.7	352,775	2.7	99.3
2月末	12,883	2.9	353,615	3.0	99.4
3月末	12,854	2.7	352,801	2.7	99.6
4月末	12,873	2.9	353,312	2.9	99.7
(当期末) 2014年 5月29日	12,915	3.2	354,471	3.2	99.3

(注1)騰落率は期首比です。

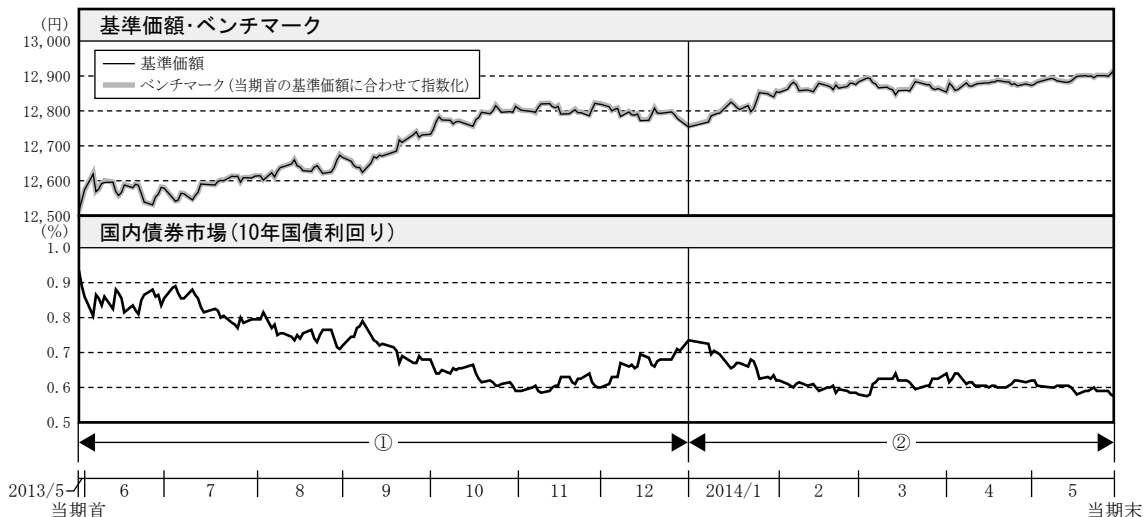
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

■ 基準価額の推移と変動要因



	①の期間	②の期間
基準価額の動き	上昇	上昇
国内債券市場	<p>5月下旬に日銀が国債買い入れオペの運営を見直したことから、これまで不安定な動きをしていた国内金利は徐々に落ち着きを取り戻し、10年国債利回りは0.8%台を中心にもみ合い推移しました。7月以降は、日銀の大量の国債買い入れを受け債券需給の引き締まりを意識した買いが優勢となり金利は低下基調で推移し、その後も9月にFRB(米連邦準備理事会)が量的金融緩和の縮小を見送ったことによる米国長期金利の低下や、10月には消費増税が正式決定したことが国債の買い安心感につながったことから国内金利は一層低下しました。しかし12月に入ると、米国の量的金融緩和縮小が決定したことや円安・株高基調が続いたことから国内金利は上昇基調で推移しました。</p>	<p>金利水準が上昇したことによる押し目買い需要が強まったことや円安・株高が一服したことなどから国内金利は低下基調で推移しました。その後も、ウクライナ情勢や中国経済の先行きに対する不透明感からリスク回避的な動きが強まったことに加え、日銀が2月の金融政策決定会合で「貸出増加支援資金供給等の制度」の延長・拡大を決定したことなどから、金利はさらに低下余地を探る展開となりました。</p> <p>3月以降は、国債買い入れオペ額が10年超ゾーンで2月に続きさらに減額され国債需給環境の悪化が意識されたことやFRBによる利上げ開始時期の前倒し観測などから国内金利は上昇する場面があったものの、欧米金利の低下や日銀による国債買い入れオペなどが金利上昇の抑制要因となり、概ね0.6%近辺で推移しました。10年国債利回りは0.575%で終了しました。</p>
基準価額への影響	プラス要因	プラス要因

◆パフォーマンス

当期の基準価額の騰落率は以下の通りであり、ベンチマーク騰落率に概ね追随する結果となりました。

①当期首 (前期末) 基準価額	②当期末 基準価額	③差引 (②-①)	④騰落率 (③/①)	⑤ベンチマーク 騰落率	④-⑤
12,514円	12,915円	+401円	+3.20%	+3.21%	△0.01%

■運用状況

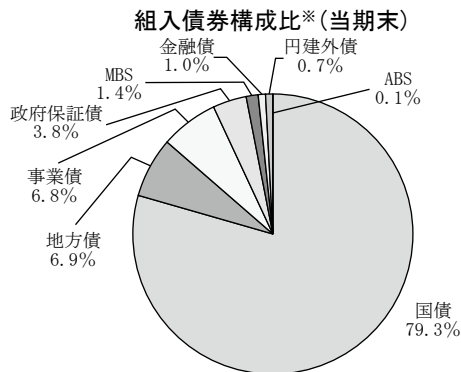
当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、公社債の組入比率を高位に保ち、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(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。当期末現在の債券組入比率は、99.3%となっています。

(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。当期末現在の債券の組入銘柄数は、748銘柄となっています。



■今後の運用方針

今後の運用にあたりましては、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す。

※ 比率は債券評価総額に対する評価額の比率です。(経過利子を含みます。)

1万口当たりの費用明細

項 目	当 期
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション)	0円 (0)
合 計	0

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 売買委託手数料は、期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

売買および取引の状況

<公社債>

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
国 内	国 債 証 券	92,767,255	84,576,196
	地 方 債 証 券	1,823,099	1,891,429
	特 殊 債 券	1,703,932	2,468,055 (336,934)
	社債券(投資法人債券を含む)	2,716,086	3,831,365 (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 27,704	百万円 27,427	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

主要な売買銘柄

<公社債>

当		期	
買	付	売	付
銘	柄	銘	柄
金額		金額	
千円		千円	
第113	回利付国債(5年)	第87	回利付国債(5年)
第329	回利付国債(10年)	第88	回利付国債(5年)
第332	回利付国債(10年)	第264	回利付国債(10年)
第330	回利付国債(10年)	第105	回利付国債(5年)
第116	回利付国債(5年)	第85	回利付国債(5年)
第115	回利付国債(5年)	第84	回利付国債(5年)
第117	回利付国債(5年)	第325	回利付国債(10年)
第333	回利付国債(10年)	第269	回利付国債(10年)
第333	回利付国債(2年)	第312	回利付国債(10年)
第105	回利付国債(5年)	第322	回利付国債(10年)
	5,195,861		2,832,379
	3,620,665		2,581,670
	3,090,069		2,436,230
	3,074,562		2,163,348
	2,920,164		1,791,160
	2,460,644		1,760,727
	2,310,794		1,724,624
	2,205,160		1,449,477
	2,160,280		1,441,571
	2,133,695		1,440,734

(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)国内の現先取引によるものは含まれておりません。

利害関係人^{*}との取引状況等

当期中における利害関係人との取引等はありません。

組入資産の明細

<国内(邦貨建)公社債>

(A)債券種類別開示

区 分	当			期			末		
	額面金額	評価額	組入比率	うち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	191,710,000 (200,000)	202,419,503 (200,948)	78.9 (0.1)	— (—)	45.7 (—)	22.6 (0.1)	10.5 (—)		
地方債証券	14,930,190 (14,930,190)	15,779,902 (15,779,902)	6.1 (6.1)	— (—)	3.9 (3.9)	1.4 (1.4)	0.9 (0.9)		
特殊債証券 (除く金融債)	18,434,366 (18,434,366)	19,513,080 (19,513,080)	7.6 (7.6)	— (—)	5.1 (5.1)	2.0 (2.0)	0.6 (0.6)		
金融債証券	2,550,000 (2,550,000)	2,564,630 (2,564,630)	1.0 (1.0)	— (—)	— (—)	0.5 (0.5)	0.5 (0.5)		
普通社債証券 (含む投資法人債券)	14,170,000 (14,170,000)	14,600,916 (14,600,916)	5.7 (5.7)	— (—)	1.8 (1.8)	3.1 (3.1)	0.8 (0.8)		
合 計	241,794,556 (50,284,556)	254,878,033 (52,659,477)	99.3 (20.5)	— (—)	56.4 (10.7)	29.6 (7.1)	13.3 (2.7)		

(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。

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

(B) 個別銘柄開示

銘柄名	利率	期		償還年月日
		額面金額	評価額	
国債証券	%	千円	千円	
第329回利付国債(2年)	0.2	770,000	770,993	2015/6/15
第330回利付国債(2年)	0.2	670,000	670,897	2015/7/15
第331回利付国債(2年)	0.1	790,000	790,189	2015/8/15
第332回利付国債(2年)	0.1	1,370,000	1,370,342	2015/9/15
第333回利付国債(2年)	0.1	1,290,000	1,290,348	2015/10/15
第334回利付国債(2年)	0.1	910,000	910,263	2015/11/15
第335回利付国債(2年)	0.1	1,190,000	1,190,357	2015/12/15
第336回利付国債(2年)	0.1	830,000	830,265	2016/1/15
第337回利付国債(2年)	0.1	1,050,000	1,050,262	2016/2/15
第338回利付国債(2年)	0.1	1,100,000	1,100,286	2016/3/15
第339回利付国債(2年)	0.1	680,000	680,183	2016/4/15
第89回利付国債(5年)	0.4	1,410,000	1,414,794	2015/6/20
第90回利付国債(5年)	0.3	220,000	220,517	2015/6/20
第91回利付国債(5年)	0.4	200,000	200,832	2015/9/20
第92回利付国債(5年)	0.3	1,260,000	1,263,603	2015/9/20
第93回利付国債(5年)	0.5	1,110,000	1,117,215	2015/12/20
第94回利付国債(5年)	0.6	1,310,000	1,320,545	2015/12/20
第95回利付国債(5年)	0.6	620,000	625,784	2016/3/20
第96回利付国債(5年)	0.5	1,770,000	1,783,328	2016/3/20
第97回利付国債(5年)	0.4	2,700,000	2,717,388	2016/6/20
第98回利付国債(5年)	0.3	230,000	231,009	2016/6/20
第99回利付国債(5年)	0.4	2,200,000	2,215,642	2016/9/20
第100回利付国債(5年)	0.3	390,000	391,879	2016/9/20
第101回利付国債(5年)	0.4	820,000	826,363	2016/12/20
第102回利付国債(5年)	0.3	2,280,000	2,291,878	2016/12/20
第103回利付国債(5年)	0.3	2,090,000	2,101,933	2017/3/20
第104回利付国債(5年)	0.2	410,000	411,197	2017/3/20
第105回利付国債(5年)	0.2	2,910,000	2,918,380	2017/6/20
第106回利付国債(5年)	0.2	2,280,000	2,286,361	2017/9/20
第107回利付国債(5年)	0.2	920,000	922,438	2017/12/20
第108回利付国債(5年)	0.1	790,000	789,296	2017/12/20
第109回利付国債(5年)	0.1	790,000	788,949	2018/3/20
第110回利付国債(5年)	0.3	900,000	905,607	2018/3/20
第111回利付国債(5年)	0.4	1,290,000	1,302,912	2018/3/20
第112回利付国債(5年)	0.4	740,000	747,592	2018/6/20
第113回利付国債(5年)	0.3	3,880,000	3,904,172	2018/6/20
第114回利付国債(5年)	0.3	1,110,000	1,116,870	2018/9/20
第115回利付国債(5年)	0.2	1,960,000	1,963,763	2018/9/20
第116回利付国債(5年)	0.2	2,920,000	2,924,613	2018/12/20
第117回利付国債(5年)	0.2	2,310,000	2,312,725	2019/3/20
第1回利付国債(40年)	2.4	150,000	176,322	2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	300,000	337,593	2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	340,000	382,513	2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	530,000	596,053	2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	490,000	523,824	2052/3/20
第6回利付国債(40年)	1.9	690,000	716,399	2053/3/20
第270回利付国債(10年)	1.3	2,000,000	2,025,680	2015/6/20
第271回利付国債(10年)	1.2	680,000	688,017	2015/6/20
第272回利付国債(10年)	1.4	930,000	945,958	2015/9/20
第273回利付国債(10年)	1.5	1,260,000	1,283,259	2015/9/20
第274回利付国債(10年)	1.5	730,000	746,052	2015/12/20
第275回利付国債(10年)	1.4	280,000	285,723	2015/12/20
第276回利付国債(10年)	1.6	480,000	491,299	2015/12/20
第277回利付国債(10年)	1.6	410,000	421,180	2016/3/20
第278回利付国債(10年)	1.8	720,000	742,219	2016/3/20
第279回利付国債(10年)	2.0	440,000	455,158	2016/3/20
第280回利付国債(10年)	1.9	600,000	622,338	2016/6/20
第281回利付国債(10年)	2.0	700,000	727,496	2016/6/20
第282回利付国債(10年)	1.7	1,260,000	1,306,733	2016/9/20

銘柄名	利率	期		償還年月日
		額面金額	評価額	
第283回利付国債(10年)	1.8	280,000	291,029	2016/9/20
第284回利付国債(10年)	1.7	1,210,000	1,259,573	2016/12/20
第285回利付国債(10年)	1.7	1,990,000	2,079,092	2017/3/20
第286回利付国債(10年)	1.8	870,000	914,961	2017/6/20
第287回利付国債(10年)	1.9	540,000	569,548	2017/6/20
第288回利付国債(10年)	1.7	2,090,000	2,199,307	2017/9/20
第289回利付国債(10年)	1.5	2,430,000	2,548,997	2017/12/20
第290回利付国債(10年)	1.4	470,000	492,550	2018/3/20
第291回利付国債(10年)	1.3	840,000	877,128	2018/3/20
第292回利付国債(10年)	1.7	860,000	911,015	2018/3/20
第293回利付国債(10年)	1.8	370,000	394,727	2018/6/20
第294回利付国債(10年)	1.7	180,000	191,305	2018/6/20
第295回利付国債(10年)	1.5	100,000	105,476	2018/6/20
第296回利付国債(10年)	1.5	2,100,000	2,221,149	2018/9/20
第297回利付国債(10年)	1.4	560,000	591,236	2018/12/20
第298回利付国債(10年)	1.3	1,660,000	1,745,091	2018/12/20
第299回利付国債(10年)	1.3	1,310,000	1,380,438	2019/3/20
第300回利付国債(10年)	1.5	830,000	882,522	2019/3/20
第301回利付国債(10年)	1.5	1,240,000	1,321,902	2019/6/20
第302回利付国債(10年)	1.4	200,000	212,208	2019/6/20
第303回利付国債(10年)	1.4	1,390,000	1,478,265	2019/9/20
第304回利付国債(10年)	1.3	300,000	317,475	2019/9/20
第305回利付国債(10年)	1.3	1,960,000	2,078,344	2019/12/20
第306回利付国債(10年)	1.4	940,000	1,003,779	2020/3/20
第307回利付国債(10年)	1.3	800,000	849,696	2020/3/20
第308回利付国債(10年)	1.3	490,000	521,276	2020/6/20
第309回利付国債(10年)	1.1	360,000	1,430,584	2020/6/20
第310回利付国債(10年)	1.0	1,590,000	1,663,966	2020/9/20
第311回利付国債(10年)	0.8	160,000	165,459	2020/9/20
第312回利付国債(10年)	1.2	1,370,000	1,452,008	2020/12/20
第313回利付国債(10年)	1.3	1,210,000	1,291,457	2021/3/20
第314回利付国債(10年)	1.1	580,000	611,314	2021/3/20
第315回利付国債(10年)	1.2	1,460,000	1,549,103	2021/6/20
第316回利付国債(10年)	1.1	820,000	864,386	2021/6/20
第317回利付国債(10年)	1.1	480,000	505,809	2021/9/20
第318回利付国債(10年)	1.0	1,910,000	1,999,082	2021/9/20
第319回利付国債(10年)	1.1	1,150,000	1,212,100	2021/12/20
第320回利付国債(10年)	1.0	1,620,000	1,695,589	2021/12/20
第321回利付国債(10年)	1.0	1,520,000	1,589,555	2022/3/20
第322回利付国債(10年)	0.9	1,030,000	1,069,335	2022/3/20
第323回利付国債(10年)	0.9	1,260,000	1,308,105	2022/6/20
第324回利付国債(10年)	0.8	1,420,000	1,462,571	2022/6/20
第325回利付国債(10年)	0.8	2,360,000	2,428,038	2022/9/20
第326回利付国債(10年)	0.7	300,000	305,796	2022/12/20
第327回利付国債(10年)	0.8	1,840,000	1,890,673	2022/12/20
第328回利付国債(10年)	0.6	2,710,000	2,735,121	2023/3/20
第329回利付国債(10年)	0.8	2,340,000	2,399,716	2023/6/20
第330回利付国債(10年)	0.8	2,240,000	2,295,641	2023/9/20
第331回利付国債(10年)	0.6	750,000	754,650	2023/9/20
第332回利付国債(10年)	0.6	3,000,000	3,014,970	2023/12/20
第333回利付国債(10年)	0.6	2,010,000	2,016,512	2024/3/20
第1回利付国債(30年)	2.8	40,000	49,952	2029/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	160,000	190,688	2030/2/20
第3回利付国債(30年)	2.3	120,000	141,183	2030/5/20
第4回利付国債(30年)	2.9	110,000	139,059	2030/11/20
第5回利付国債(30年)	2.2	50,000	57,780	2031/5/20
第6回利付国債(30年)	2.4	190,000	224,874	2031/11/20
第7回利付国債(30年)	2.3	180,000	209,570	2032/5/20
第8回利付国債(30年)	1.8	50,000	53,924	2032/11/22

国内債券インデックス マザーファンド ー第14期ー

銘柄名	利率	期 末		償還年月日
		額面金額	評 価 額	
	%	千円	千円	
第9回利付国債(30年)	1.4	240,000	242,678	2032/12/20
第10回利付国債(30年)	1.1	160,000	153,312	2033/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	90,000	94,988	2033/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	190,000	212,796	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	290,000	319,156	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	300,000	350,028	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	340,000	402,009	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	370,000	437,103	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	230,000	267,559	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	445,000	509,507	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	130,000	148,779	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	230,000	271,289	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	280,000	319,866	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	400,000	471,512	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	430,000	506,703	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	330,000	388,716	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	320,000	364,672	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	540,000	625,746	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	2.5	580,000	683,680	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	510,000	601,019	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	790,000	916,621	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	540,000	615,853	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	580,000	649,692	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	810,000	924,501	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	740,000	797,742	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	920,000	1,031,264	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	920,000	991,806	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	1,040,000	1,121,109	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	860,000	907,601	2042/9/20
第38回利付国債(30年)	1.8	540,000	557,442	2043/3/20
第39回利付国債(30年)	1.9	500,000	527,130	2043/6/20
第40回利付国債(30年)	1.8	720,000	742,660	2043/9/20
第41回利付国債(30年)	1.7	580,000	584,019	2043/12/20
第42回利付国債(30年)	1.7	330,000	331,966	2044/3/20
第29回利付国債(20年)	4.2	60,000	63,220	2015/9/21
第30回利付国債(20年)	3.7	80,000	83,767	2015/9/21
第31回利付国債(20年)	3.5	80,000	84,917	2016/3/21
第32回利付国債(20年)	3.7	50,000	53,253	2016/3/21
第33回利付国債(20年)	3.8	140,000	151,963	2016/9/20
第34回利付国債(20年)	3.5	50,000	54,749	2017/3/20
第35回利付国債(20年)	3.3	10,000	10,894	2017/3/20
第36回利付国債(20年)	3.0	70,000	76,654	2017/9/20
第37回利付国債(20年)	3.1	70,000	76,884	2017/9/20
第38回利付国債(20年)	2.7	20,000	21,938	2018/3/20
第39回利付国債(20年)	2.6	500,000	546,560	2018/3/20
第40回利付国債(20年)	2.3	100,000	109,188	2018/9/20
第41回利付国債(20年)	1.5	330,000	350,882	2019/3/20
第42回利付国債(20年)	2.6	80,000	89,271	2019/3/20
第43回利付国債(20年)	2.9	140,000	159,996	2019/9/20
第44回利付国債(20年)	2.5	170,000	192,297	2020/3/20
第45回利付国債(20年)	2.4	290,000	326,374	2020/3/20
第46回利付国債(20年)	2.2	170,000	190,111	2020/6/22
第47回利付国債(20年)	2.2	90,000	100,953	2020/9/21
第48回利付国債(20年)	2.5	130,000	148,762	2020/12/21
第49回利付国債(20年)	2.1	140,000	156,956	2021/3/22
第50回利付国債(20年)	1.9	220,000	243,709	2021/3/22
第1回利付国債(20年)	2.0	100,000	111,740	2021/6/21
第52回利付国債(20年)	2.1	110,000	123,885	2021/9/21
第53回利付国債(20年)	2.1	80,000	90,264	2021/12/20
第54回利付国債(20年)	2.2	200,000	227,134	2021/12/20
第55回利付国債(20年)	2.0	140,000	157,180	2022/3/21

銘柄名	利率	期 末		償還年月日
		額面金額	評 価 額	
	%	千円	千円	
第56回利付国債(20年)	2.0	150,000	168,781	2022/6/20
第57回利付国債(20年)	1.9	240,000	268,176	2022/6/20
第58回利付国債(20年)	1.9	300,000	335,481	2022/9/20
第59回利付国債(20年)	1.7	200,000	220,674	2022/12/20
第60回利付国債(20年)	1.4	350,000	377,377	2022/12/20
第61回利付国債(20年)	1.0	240,000	250,533	2023/3/20
第62回利付国債(20年)	0.8	320,000	328,166	2023/6/20
第63回利付国債(20年)	1.8	200,000	222,702	2023/6/20
第64回利付国債(20年)	1.9	320,000	359,657	2023/9/20
第65回利付国債(20年)	1.9	220,000	247,623	2023/12/20
第66回利付国債(20年)	1.8	330,000	368,263	2023/12/20
第67回利付国債(20年)	1.9	130,000	146,450	2024/3/20
第68回利付国債(20年)	2.2	190,000	219,450	2024/3/20
第69回利付国債(20年)	2.1	390,000	446,819	2024/3/20
第70回利付国債(20年)	2.4	400,000	470,468	2024/6/20
第71回利付国債(20年)	2.2	200,000	231,314	2024/6/20
第72回利付国債(20年)	2.1	630,000	723,435	2024/9/20
第73回利付国債(20年)	2.0	360,000	410,007	2024/12/20
第74回利付国債(20年)	2.1	200,000	229,880	2024/12/20
第75回利付国債(20年)	2.1	130,000	149,545	2025/3/20
第76回利付国債(20年)	1.9	170,000	192,020	2025/3/20
第77回利付国債(20年)	2.0	290,000	330,666	2025/3/20
第78回利付国債(20年)	1.9	170,000	192,202	2025/6/20
第79回利付国債(20年)	2.0	270,000	308,051	2025/6/20
第80回利付国債(20年)	2.1	220,000	253,407	2025/6/20
第81回利付国債(20年)	2.0	390,000	445,192	2025/9/20
第82回利付国債(20年)	2.1	480,000	553,272	2025/9/20
第83回利付国債(20年)	2.1	200,000	230,662	2025/12/20
第84回利付国債(20年)	2.0	570,000	650,922	2025/12/20
第85回利付国債(20年)	2.1	290,000	334,607	2026/3/20
第86回利付国債(20年)	2.3	300,000	352,884	2026/3/20
第87回利付国債(20年)	2.2	290,000	337,954	2026/3/20
第88回利付国債(20年)	2.3	550,000	647,784	2026/6/20
第89回利付国債(20年)	2.2	410,000	478,072	2026/6/20
第90回利付国債(20年)	2.2	590,000	688,671	2026/9/20
第91回利付国債(20年)	2.3	410,000	483,201	2026/9/20
第92回利付国債(20年)	2.1	840,000	970,636	2026/12/20
第93回利付国債(20年)	2.0	370,000	423,013	2027/3/20
第94回利付国債(20年)	2.1	490,000	566,244	2027/3/20
第95回利付国債(20年)	2.3	570,000	672,611	2027/6/20
第96回利付国債(20年)	2.1	350,000	404,239	2027/6/20
第97回利付国債(20年)	2.2	640,000	747,264	2027/9/20
第98回利付国債(20年)	2.1	320,000	369,788	2027/9/20
第99回利付国債(20年)	2.1	830,000	958,392	2027/12/20
第100回利付国債(20年)	2.2	550,000	642,086	2028/3/20
第101回利付国債(20年)	2.4	265,000	316,309	2028/3/20
第102回利付国債(20年)	2.4	400,000	477,512	2028/6/20
第103回利付国債(20年)	2.3	270,000	318,735	2028/6/20
第104回利付国債(20年)	2.1	360,000	415,432	2028/6/20
第105回利付国債(20年)	2.1	600,000	692,100	2028/9/20
第106回利付国債(20年)	2.2	330,000	385,086	2028/9/20
第107回利付国債(20年)	2.1	260,000	299,754	2028/12/20
第108回利付国債(20年)	1.9	620,000	697,971	2028/12/20
第109回利付国債(20年)	1.9	200,000	224,940	2029/3/20
第110回利付国債(20年)	2.1	850,000	979,353	2029/3/20
第111回利付国債(20年)	2.2	300,000	349,374	2029/6/20
第112回利付国債(20年)	2.1	600,000	690,396	2029/6/20
第113回利付国債(20年)	2.1	970,000	1,115,296	2029/9/20
第114回利付国債(20年)	2.1	490,000	562,912	2029/12/20
第115回利付国債(20年)	2.2	560,000	651,308	2029/12/20
第116回利付国債(20年)	2.2	490,000	569,438	2030/3/20

当 期		末			
銘 柄 名	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日	
	%	千円	千円		
第117回利付国債(20年)	2.1	770,000	883,736	2030/3/20	
第118回利付国債(20年)	2.0	850,000	962,225	2030/6/20	
第119回利付国債(20年)	1.8	380,000	418,855	2030/6/20	
第120回利付国債(20年)	1.6	200,000	214,664	2030/6/20	
第121回利付国債(20年)	1.9	940,000	1,048,288	2030/9/20	
第122回利付国債(20年)	1.8	280,000	308,156	2030/9/20	
第123回利付国債(20年)	2.1	700,000	800,247	2030/12/20	
第124回利付国債(20年)	2.0	400,000	451,352	2030/12/20	
第125回利付国債(20年)	2.2	280,000	323,895	2031/3/20	
第126回利付国債(20年)	2.0	390,000	439,140	2031/3/20	
第127回利付国債(20年)	1.9	460,000	511,083	2031/3/20	
第128回利付国債(20年)	1.9	460,000	509,900	2031/6/20	
第129回利付国債(20年)	1.8	560,000	611,884	2031/6/20	
第130回利付国債(20年)	1.8	440,000	479,881	2031/9/20	
第131回利付国債(20年)	1.7	480,000	516,230	2031/9/20	
第132回利付国債(20年)	1.7	530,000	568,414	2031/12/20	
第133回利付国債(20年)	1.8	660,000	718,449	2031/12/20	
第134回利付国債(20年)	1.8	420,000	455,952	2032/3/20	
第135回利付国債(20年)	1.7	380,000	406,372	2032/3/20	
第136回利付国債(20年)	1.6	530,000	558,222	2032/3/20	
第137回利付国債(20年)	1.7	290,000	309,218	2032/6/20	
第138回利付国債(20年)	1.5	520,000	537,560	2032/6/20	
第139回利付国債(20年)	1.6	470,000	493,857	2032/6/20	
第140回利付国債(20年)	1.7	1,170,000	1,243,780	2032/9/20	
第141回利付国債(20年)	1.7	260,000	275,748	2032/12/20	
第142回利付国債(20年)	1.8	580,000	624,741	2032/12/20	
第143回利付国債(20年)	1.6	1,050,000	1,093,449	2033/3/20	
第144回利付国債(20年)	1.5	250,000	256,197	2033/3/20	
第145回利付国債(20年)	1.7	1,020,000	1,076,538	2033/6/20	
第146回利付国債(20年)	1.7	1,240,000	1,304,442	2033/9/20	
第147回利付国債(20年)	1.6	1,470,000	1,517,451	2033/12/20	
第148回利付国債(20年)	1.5	700,000	708,106	2034/3/20	
第14回ポーランド共和国国債債券	0.67	200,000	200,948	2018/11/15	
小 計		191,710,000	202,419,503		
地方債証券					
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	100,000	115,420	2024/3/19	
第6回東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	113,345	2025/3/19	
第9回東京都公募公債(30年)	2.37	100,000	111,589	2039/3/18	
第11回東京都公募公債(30年)	2.19	100,000	107,929	2040/9/20	
第17回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	114,145	2028/12/20	
第19回東京都公募公債(20年)	2.13	100,000	114,566	2029/6/20	
第23回東京都公募公債(20年)	2.12	100,000	113,576	2030/12/20	
第27回東京都公募公債(20年)	1.68	200,000	209,166	2032/12/20	
第622回東京都公募公債	1.28	100,000	101,241	2015/6/19	
第633回東京都公募公債	1.97	129,000	133,315	2016/3/18	
第639回東京都公募公債	1.83	50,000	51,977	2016/9/20	
第649回東京都公募公債	1.73	102,000	107,364	2017/9/20	
第650回東京都公募公債	1.85	140,000	147,917	2017/9/20	
第674回東京都公募公債	1.38	100,000	106,060	2019/9/20	
第695回東京都公募公債	1.2	100,000	105,790	2021/3/19	
第696回東京都公募公債	1.19	100,000	105,745	2021/6/18	
第716回東京都公募公債	0.77	100,000	102,045	2022/12/20	
第720回東京都公募公債	0.87	100,000	102,709	2023/6/20	
平成18年度第1回北海道公募公債	1.8	100,000	103,101	2016/4/28	
平成18年度第10回北海道公募公債	1.9	100,000	104,409	2016/11/28	
平成19年度第9回北海道公募公債	1.7	110,000	115,725	2017/11/30	
平成20年度第14回北海道公募公債	1.74	100,000	106,947	2019/2/27	
平成22年度第11回北海道公募公債	1.36	100,000	106,293	2020/12/28	
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	116,493	2038/3/19	
第16回神奈川県公募公債(20年)	2.09	100,000	112,829	2031/1/24	
第144回神奈川県公募公債	1.83	100,000	104,340	2016/12/20	

当 期		末			
銘 柄 名	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日	
	%	千円	千円		
第150回神奈川県公募公債	1.67	100,000	105,366	2017/12/20	
第167回神奈川県公募公債	1.52	140,000	149,434	2019/9/20	
第172回神奈川県公募公債	1.34	200,000	212,362	2020/3/20	
第7回大阪府公募公債(20年)	1.84	200,000	215,288	2031/9/26	
第72回大阪府公募公債(5年)	0.61	100,000	100,838	2016/4/27	
第284回大阪府公募公債(10年)	1.6	100,000	102,138	2015/11/27	
第290回大阪府公募公債(10年)	2.0	100,000	103,662	2015/6/30	
第291回大阪府公募公債(10年)	2.0	100,000	103,812	2016/6/29	
第307回大阪府公募公債(10年)	1.84	100,000	105,591	2017/10/30	
第311回大阪府公募公債(10年)	1.68	100,000	105,474	2018/2/28	
第345回大阪府公募公債(10年)	1.26	100,000	105,712	2020/12/25	
第349回大阪府公募公債(10年)	1.38	100,000	106,605	2021/4/27	
平成18年度第1回京都市公募公債	1.7	100,000	104,016	2016/12/22	
平成22年度第2回京都市公募公債	1.16	100,000	105,336	2020/9/24	
平成25年度第7回京都市公募公債	0.8	100,000	101,872	2023/9/19	
第3回兵庫県公募公債(12年)	0.56	100,000	98,244	2025/4/16	
平成17年度第13回兵庫県公募公債	1.7	200,000	205,594	2016/3/23	
平成19年度第9回兵庫県公募公債	1.84	100,000	105,574	2017/10/18	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	1.46	100,000	106,675	2020/4/16	
平成19年度第2回静岡県公募公債	1.93	100,000	105,493	2017/6/28	
平成20年度第4回静岡県公募公債	1.65	100,000	106,199	2018/8/28	
平成21年度第10回静岡県公募公債	1.4	100,000	106,519	2020/3/18	
平成23年度第3回静岡県公募公債	1.193	103,290	109,144	2021/5/25	
平成203年度第8回静岡県公募公債	1.025	100,000	104,435	2021/10/25	
平成20年度第6回愛知県公募公債(10年)	1.71	100,000	106,760	2018/11/28	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	2.28	100,000	116,448	2029/6/30	
平成21年度第8回愛知県公募公債(10年)	1.39	100,000	106,063	2019/9/30	
平成22年度第3回愛知県公募公債(10年)	1.364	200,000	212,912	2020/5/28	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	1.38	100,000	106,932	2021/4/28	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	1.212	100,000	105,802	2021/5/27	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	2.34	100,000	117,292	2028/9/21	
平成22年度第1回広島県公募公債	1.37	100,000	106,426	2020/5/27	
平成24年度第4回広島県公募公債	0.81	100,000	102,275	2022/11/28	
平成17年度第3回埼玉県公募公債	1.3	100,000	101,372	2015/7/28	
平成18年度第2回埼玉県公募公債	2.0	100,000	103,756	2016/5/30	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	1.26	100,000	106,067	2021/1/28	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	1.28	193,000	205,027	2021/2/25	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	1.05	100,000	104,476	2022/4/26	
平成21年度第3回福岡県公募公債	1.55	100,000	106,813	2019/8/27	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	2.008	100,000	111,326	2031/5/23	
平成23年度第1回福岡県公募公債	1.18	200,000	211,178	2021/6/28	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.12	100,000	106,306	2042/9/19	
第13回千葉県公募公債(20年)	1.701	100,000	104,932	2032/10/15	
平成21年度第2回千葉県公募公債	1.57	100,000	106,659	2019/5/24	
平成21年度第9回千葉県公募公債	1.3	100,000	105,773	2019/12/25	
平成21年度第12回千葉県公募公債	1.44	100,000	106,711	2020/2/25	
平成22年度第8回千葉県公募公債	1.0	120,000	125,229	2020/11/25	
平成25年度第5回千葉県公募公債	0.84	100,000	102,247	2023/8/25	
平成17年度第2回新潟県公募公債	1.6	100,000	102,187	2015/11/24	
平成22年度第1回長野県公募公債	0.47	100,000	100,535	2015/12/25	
第29回共同発行市場公募地方債	1.4	200,000	203,172	2015/8/25	
第33回共同発行市場公募地方債	1.6	100,000	102,320	2015/12/25	
第35回共同発行市場公募地方債	1.6	100,000	102,577	2016/2/25	
第38回共同発行市場公募地方債	2.0	100,000	103,730	2016/5/25	
第40回共同発行市場公募地方債	2.1	120,000	125,096	2016/7/25	
第46回共同発行市場公募地方債	1.8	136,500	142,504	2017/1/25	
第2回共同発行市場公募地方債	1.9	100,000	105,530	2017/7/25	
第55回共同発行市場公募地方債	1.85	158,400	167,530	2017/10/25	
第56回共同発行市場公募地方債	1.72	100,000	105,433	2017/11/24	
第62回共同発行市場公募地方債	1.74	100,000	106,178	2018/5/25	
第67回共同発行市場公募地方債	1.5	165,700	175,187	2018/10/25	

当 期		末		
銘 柄 名	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
第75回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	107,098	2019/6/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	110,000	117,452	2019/8/23
第78回共同発行市場公募地方債	1.39	100,000	106,074	2019/9/25
第85回共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	106,831	2020/4/24
第87回共同発行市場公募地方債	1.29	100,000	106,063	2020/6/25
第89回共同発行市場公募地方債	1.04	150,300	157,161	2020/8/25
第91回共同発行市場公募地方債	0.9	100,000	103,703	2020/10/23
第93回共同発行市場公募地方債	1.25	100,000	105,954	2020/12/25
第94回共同発行市場公募地方債	1.24	100,000	105,930	2021/1/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	250,000	265,580	2021/2/25
第97回共同発行市場公募地方債	1.38	200,000	213,906	2021/4/23
第98回共同発行市場公募地方債	1.18	100,000	105,579	2021/5/25
第102回共同発行市場公募地方債	1.03	150,000	156,669	2021/9/24
第108回共同発行市場公募地方債	1.01	100,000	104,190	2022/3/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	103,221	2022/5/25
第112回共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	102,770	2022/7/25
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	101,554	2022/12/22
第119回共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	102,127	2023/2/24
第127回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	100,698	2023/10/25
平成17年度第1回静岡市公募債	1.6	100,000	102,183	2015/11/25
平成22年度第1回静岡市公募債	1.008	100,000	104,342	2020/11/25
平成17年度第10回大阪市公募債	1.5	100,000	102,231	2016/1/26
平成19年度第7回大阪市公募債	1.82	100,000	105,365	2017/9/20
平成22年度第2回大阪市公募債(5年)	0.46	100,000	100,349	2015/7/22
平成22年度第5回大阪市公募債	1.2	100,000	105,307	2020/9/17
第5回名古屋市公募債(30年)	2.49	100,000	113,977	2039/3/18
第9回名古屋市公募債(20年)	2.07	100,000	113,745	2028/12/20
第12回十号名古屋市公募債	1.7	100,000	102,833	2016/3/16
第481回名古屋市公募債(10年)	0.744	100,000	101,749	2022/12/20
平成22年度第1回京都市公募債	0.41	100,000	100,314	2015/7/28
平成22年度第2回京都市公募債	1.11	102,000	106,966	2020/8/27
平成24年度第4回京都市公募債	0.801	100,000	102,219	2022/10/21
平成17年度第13回神戸市公募債	1.6	100,000	102,524	2016/2/23
第3回横浜市公募債(20年)	2.17	100,000	115,091	2025/6/20
第20回横浜市公募債(20年)	2.1	100,000	113,766	2029/10/19
平成21年度第1回横浜市公募債	1.58	200,000	213,416	2019/5/24
平成21年度第5回横浜市公募債	1.56	100,000	107,124	2019/11/19
平成23年度第5回横浜市公募債	1.011	100,000	104,255	2022/1/28
平成17年度第6回札幌市公募債	1.5	100,000	102,151	2015/12/22
平成24年度第10回札幌市公募債(10年)	0.8	100,000	102,166	2022/12/20
第81回川崎市公募債	1.57	100,000	106,451	2019/3/20
第82回川崎市公募債	1.52	100,000	106,711	2019/9/20
平成23年度第1回北九州市公募債(5年)	0.36	100,000	100,488	2016/9/28
平成22年度第6回広島市公募債	1.21	100,000	105,655	2021/5/31
平成23年度第2回千葉市公募債	1.06	100,000	104,562	2021/11/25
平成18年度第1回鹿児島県公募債(10年)	1.9	100,000	104,240	2016/10/31
第113回福岡北九州高速道路債券	2.41	100,000	116,976	2027/12/20
小 計		14,930,190	15,779,902	
特殊債券(除く金融債)				
第347回政府保証道路債券	1.3	181,000	183,847	2015/9/22
第200回政府保証首都高速道路債券	1.3	100,000	101,583	2015/9/25
第3回政府保証公営企業債券(15年)	2.2	300,000	338,103	2021/5/21
第855回政府保証公営企業債券	1.3	140,000	142,184	2015/9/18
第859回政府保証公営企業債券	1.5	131,000	134,040	2016/1/25
第862回政府保証公営企業債券	1.8	100,000	103,192	2016/4/20
第867回政府保証公営企業債券	1.8	100,000	103,890	2016/9/21
第871回政府保証公営企業債券	1.8	100,000	104,455	2017/1/25
第872回政府保証公営企業債券	1.8	200,000	209,146	2017/2/20
第874回政府保証公営企業債券	1.7	100,000	104,536	2017/4/19

当 期		末		
銘 柄 名	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
第875回政府保証公営企業債券	1.7	212,000	221,881	2017/5/22
第876回政府保証公営企業債券	1.9	122,000	128,581	2017/6/20
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	1.3	101,000	106,743	2019/9/17
第13回政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	106,000	110,478	2016/8/25
第14回政府保証日本政策投資銀行債券	2.1	100,000	112,203	2021/9/13
第22回政府保証日本政策投資銀行債券	2.2	100,000	114,321	2023/6/19
第1回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	102,195	2015/12/25
第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	100,000	102,617	2016/2/26
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	110,471	2021/2/26
第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	100,000	102,723	2016/3/24
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	221,106	2021/3/26
第17回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	100,000	104,256	2016/8/31
第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	100,000	104,069	2016/12/28
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	100,000	104,441	2017/3/28
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	200,000	209,388	2017/5/26
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	315,000	332,044	2017/6/20
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	100,000	105,444	2017/11/30
第47回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	104,826	2017/12/27
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	30,000	31,416	2018/3/23
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	111,000	116,324	2018/4/20
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	106,634	2018/6/29
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	181,000	192,513	2018/7/31
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.4	100,000	113,152	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	228,342	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	317,898	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	146,521	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	110,422	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	106,231	2020/6/30
第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	104,427	2020/8/31
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	200,000	208,904	2020/9/30
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	200,000	207,658	2020/11/30
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	200,000	211,550	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	113,469	2030/12/27
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	100,000	105,816	2021/1/29
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	106,542	2021/4/30

当 期		末			
銘 柄 名	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日	
	%	千円	千円		
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	100,000	105,134	2021/7/30	
第140回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.4	100,000	100,626	2016/7/29	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	100,000	103,588	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	206,790	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	103,347	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	102,477	2022/8/31	
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	104,523	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	102,605	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	100,000	102,384	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	100,000	101,119	2023/3/17	
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	100,000	100,423	2023/5/31	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.6	202,000	214,568	2018/10/16	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	100,000	106,465	2019/6/14	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	100,000	106,028	2019/7/12	
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.3	100,000	105,176	2019/2/18	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	101,000	104,879	2020/11/17	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	105,776	2020/12/14	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	101,000	107,573	2021/3/12	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	101,000	107,602	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	103,583	2022/1/25	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.541	100,000	99,964	2023/4/21	
第3回政府保証首都高速道路株式会社債券	1.7	103,000	107,570	2017/3/27	
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	1.4	80,000	83,770	2018/3/26	
第190回政府保証預金保険機構債	0.1	100,000	99,964	2016/10/7	
第191回政府保証預金保険機構債	0.1	100,000	99,963	2016/11/14	
第2回政府保証成田国際空港債券	1.6	147,000	150,822	2016/2/22	
第1回政府保証東日本高速道路債券	1.6	100,000	102,229	2015/11/25	
第11回日本政策投資銀行債券	1.83	100,000	106,877	2018/9/20	
第16回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.476	100,000	100,716	2016/9/20	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.45	100,000	117,541	2026/3/19	
第21回道路債券	2.75	100,000	119,846	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	116,925	2028/3/17	
第6回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.84	100,000	114,074	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	117,295	2028/6/20	
第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.69	100,000	105,788	2018/6/20	
第42回道路債券	2.22	100,000	114,358	2025/3/21	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.62	100,000	106,083	2018/12/20	
第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.67	100,000	106,597	2019/3/20	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	100,000	117,087	2029/4/20	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.71	100,000	106,786	2019/3/20	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.38	100,000	105,589	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	103,861	2021/12/20	
第85回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.07	100,000	104,082	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	104,820	2032/9/17	
第11回地方公営企業等金融機構債券	1.77	100,000	106,665	2018/9/25	
第3回公営企業債券(20年)	1.03	10,000	10,360	2023/3/22	
第6回地方公共団体金融機構債券(5年)	0.435	100,000	100,593	2016/7/28	
第7回公営企業債券(20年)	2.2	100,000	114,346	2024/3/22	
第7回公営企業債券(30年)	2.67	100,000	117,492	2035/6/20	
第7回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.202	100,000	113,993	2030/4/26	
第8回公営企業債券(20年)	2.25	40,000	45,922	2024/3/22	

当 期		末			
銘 柄 名	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日	
	%	千円	千円		
第8回地方公共団体金融機構債券	1.453	100,000	106,456	2020/1/28	
第10回地方公共団体金融機構債券	1.424	100,000	106,409	2020/3/27	
第11回地方公共団体金融機構債券	1.465	200,000	213,296	2020/4/28	
第15回地方公共団体金融機構債券	1.093	200,000	209,150	2020/8/28	
第17回公営企業債券	1.57	100,000	101,876	2015/9/24	
第34回地方公共団体金融機構債券	1.418	100,000	106,792	2021/4/28	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.702	100,000	103,947	2032/9/28	
第28回公営企業債券	1.89	100,000	105,774	2017/10/25	
第30回公営企業債券	1.97	100,000	107,064	2018/6/20	
第42回地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	101,788	2022/11/28	
第8回株式会社日本政策金融公社債	2.157	100,000	112,766	2031/5/9	
第43回都市再生債券	1.29	100,000	105,539	2020/9/18	
第5回本州四国連絡橋債券	2.23	100,000	114,375	2024/12/20	
第322回東京交通債券	3.65	10,000	10,378	2015/6/29	
第344回東京交通債券	1.67	100,000	109,138	2023/2/17	
第346回東京交通債券	1.13	200,000	200,900	2023/6/20	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	39,517	42,410	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	30,202	32,355	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	31,049	33,551	2037/11/10	
第3回一般担保住宅金融公庫債券	2.1	100,000	108,714	2019/3/20	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	40,450	43,715	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	33,299	35,555	2038/5/10	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	26,584	28,118	2036/11/10	
第5回一般担保住宅金融支援機構債券	2.01	100,000	105,826	2017/8/21	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	54,902	59,278	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	32,850	34,878	2038/11/10	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.15	28,915	31,093	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	35,460	37,667	2039/5/10	
第9回一般担保住宅金融支援機構債券	1.73	100,000	105,051	2017/9/20	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	28,494	30,693	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	39,990	42,381	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	45,526	47,779	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	45,848	48,019	2032/5/10	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.25	52,203	56,418	2044/4/10	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	55,005	57,503	2044/5/10	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	52,859	57,155	2044/6/10	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	59,842	63,674	2044/9/10	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	62,447	66,812	2044/11/10	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	64,809	68,847	2044/12/10	
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	1.47	100,000	105,937	2019/6/20	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	133,524	141,634	2045/3/10	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	40,318	42,862	2040/11/10	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	73,685	78,029	2045/5/10	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	39,601	42,001	2041/2/10	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	1.5	100,000	106,505	2019/12/20	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	38,340	41,646	2041/5/10	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	82,841	87,941	2046/2/10	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	35,084	38,019	2041/9/10	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	82,621	88,057	2046/3/10	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	83,071	88,711	2046/5/10	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	39,379	42,664	2041/12/10	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	167,608	176,548	2046/7/10	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	86,059	90,515	2046/8/10	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	39,744	42,699	2042/4/10	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	89,127	92,428	2046/12/10	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	88,536	91,867	2047/1/10	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	89,085	92,566	2047/2/10	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	1.4	100,000	104,128	2020/9/18	

銘柄名	利率	期 末		償還年月日
		額面金額	評 価 額	
	%	千円	千円	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	180,638	186,447	2047/5/10
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	1.33	100,000	106,008	2020/12/18
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	1.358	100,000	106,187	2020/12/18
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	186,536	189,335	2047/11/10
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	93,912	95,047	2047/12/10
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	94,550	96,904	2048/1/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	94,633	97,128	2048/2/10
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	94,968	97,343	2048/3/10
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	95,205	96,280	2048/5/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	95,892	98,611	2048/6/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	165,922	2031/6/13
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	98,158	99,064	2048/12/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	100,000	100,256	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	100,000	100,202	2049/6/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	107,100	2031/11/18
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	1.473	100,000	105,905	2027/9/17
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	2.105	100,000	102,964	2043/3/20
第12回農林漁業金融公庫債券	2.24	100,000	115,423	2027/3/19
第19回東日本高速道路株式会社社債	0.33	100,000	100,317	2017/12/20
第28回中日本高速道路株式会社社債	0.782	100,000	101,987	2018/3/20
第33回中日本高速道路株式会社社債	1.084	100,000	104,151	2021/9/17
第43回中日本高速道路株式会社社債	0.362	100,000	100,433	2017/9/20
第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8	200,000	203,664	2022/12/20
第42回韓国産業銀行円貨債券	0.66	100,000	100,268	2016/6/7
第5回SAB銀行AB (publ) 円貨債券	1.09	100,000	100,978	2016/5/26
小 計		18,434,366	19,513,080	
金融債券				
い第721号商工債	0.55	150,000	150,636	2015/6/26
い第722号商工債	0.5	100,000	100,394	2015/7/27
い第726号商工債	0.45	100,000	100,426	2015/11/27
い第729号商工債	0.7	100,000	100,932	2016/2/26
い第731号商工債	0.7	100,000	101,019	2016/4/27
い第736号商工債	0.45	100,000	100,650	2016/9/27
い第738号商工債	0.45	100,000	100,682	2016/11/25
い第741号商工債	0.45	100,000	100,738	2017/2/27
い第741号商工債	0.3	100,000	100,283	2018/10/26
い第721号農林債	0.6	100,000	100,451	2015/6/26
い第722号農林債	0.55	100,000	100,423	2015/7/27
い第723号農林債	0.55	200,000	200,908	2015/8/27
い第740号農林債	0.5	100,000	100,768	2017/1/27
い第7403号農林債	0.45	100,000	100,680	2017/4/27
い第746号農林債	0.35	100,000	100,392	2017/7/27
い第748号農林債	0.35	100,000	100,396	2017/9/27
い第752号農林債	-0.3	100,000	100,199	2018/1/26
第247回信金中金債(5年)	0.55	100,000	100,430	2015/6/26
第258回信金中金債(5年)	0.55	100,000	100,775	2016/5/27
第259回信金中金債(5年)	0.55	100,000	100,808	2016/6/27
第265回信金中金債(5年)	0.5	100,000	100,847	2016/12/27
第267回信金中金債(5年)	0.45	200,000	201,504	2017/2/27
第288回信金中金債(5年)	0.3	100,000	100,289	2018/11/27
小 計		2,550,000	2,564,630	
普通社債券(含凸投資法人債券)				
第425回東京電力株式会社社債	5.0	100,000	100,628	2014/7/29
第455回東京電力株式会社社債	2.075	120,000	120,607	2018/10/23
第459回東京電力株式会社社債	2.7	10,000	10,301	2019/1/29
第518回東京電力株式会社社債	1.36	100,000	99,616	2015/8/12
第521回東京電力株式会社社債	1.97	100,000	100,380	2016/6/27
第528回東京電力株式会社社債	1.905	100,000	99,383	2019/6/13
第536回東京電力株式会社社債	1.672	100,000	99,268	2018/1/29
第542回東京電力株式会社社債	1.602	100,000	98,916	2018/4/25
第544回東京電力株式会社社債	1.976	100,000	100,306	2018/6/25

銘柄名	利率	期 末		償還年月日
		額面金額	評 価 額	
	%	千円	千円	
第554回東京電力株式会社社債	1.608	100,000	97,973	2019/5/29
第408回中部電力株式会社社債	3.7	50,000	52,723	2015/12/25
第499回中部電力株式会社社債	1.194	100,000	103,456	2023/6/23
第451回関西電力株式会社社債	1.185	100,000	103,405	2016/9/20
第473回関西電力株式会社社債	1.665	100,000	105,027	2019/4/25
第474回関西電力株式会社社債	1.682	100,000	105,236	2019/6/20
第489回関西電力株式会社社債	0.792	100,000	100,836	2016/4/25
第491回関西電力株式会社社債	0.527	100,000	100,360	2016/12/20
第358回中国電力株式会社社債	1.702	100,000	105,984	2018/10/25
第362回中国電力株式会社社債	1.665	100,000	106,293	2019/4/25
第371回中国電力株式会社社債	0.575	100,000	100,882	2017/6/23
第286回北陸電力株式会社社債	1.99	100,000	108,095	2019/6/25
第380回東北電力株式会社社債	3.55	100,000	108,109	2016/11/25
第382回東北電力株式会社社債	3.125	20,000	21,618	2017/4/25
第466回東北電力株式会社社債	0.833	100,000	101,670	2018/2/23
第471回東北電力株式会社社債	1.168	100,000	102,366	2023/12/25
第276回四国電力株式会社社債	0.592	100,000	100,994	2017/9/25
第279回四国電力株式会社社債	0.579	100,000	100,957	2018/2/23
第387回九州電力株式会社社債	1.69	100,000	102,573	2016/3/25
第408回九州電力株式会社社債	1.672	100,000	106,140	2019/6/25
第417回九州電力株式会社社債	0.641	100,000	100,948	2017/8/25
第420回九州電力株式会社社債	0.82	100,000	101,674	2018/4/25
第261回北海道電力株式会社社債	2.775	31,000	33,493	2017/11/24
第285回北海道電力株式会社社債	1.69	100,000	102,755	2016/6/24
第5回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.325	100,000	100,269	2017/12/20
第3回キリンホールディングス株式会社無担保社債	1.69	100,000	105,434	2018/3/19
第7回キリンホールディングス株式会社無担保社債	1.639	100,000	107,060	2019/11/5
第5回キュリック株式会社無担保社債	0.949	100,000	100,352	2024/4/24
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	106,717	2018/6/20
第8回旭化成株式会社無担保社債	1.455	100,000	106,171	2019/12/11
第48回住友化学株式会社無担保社債	0.623	100,000	101,156	2018/6/12
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.948	100,000	103,063	2020/6/4
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	0.54	100,000	101,142	2019/7/19
第2回大日本製薬株式会社無担保社債	0.782	100,000	100,963	2016/3/8
第4回株式会社フジ・メディア・ホールディングス無担保社債	1.066	100,000	102,152	2016/12/20
第1回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	0.33	100,000	100,283	2017/12/4
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	0.82	100,000	100,091	2024/6/4
第5回東海ゴム工業無担保社債	0.288	100,000	100,110	2018/2/28
第13回回硝子株式会社無担保社債	0.31	100,000	100,176	2017/12/20
第67回住友金属工業株式会社無担保社債	0.48	100,000	100,568	2016/10/20
第22回日新製鋼株式会社無担保社債	0.33	100,000	99,875	2017/3/10
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.77	100,000	101,924	2018/8/31
第16回株式会社豊田自動織機無担保社債	1.95	100,000	104,039	2016/9/20
第9回株式会社小松製作所無担保社債	0.319	100,000	100,208	2017/12/19
第50回株式会社東芝無担保社債	0.89	100,000	100,999	2015/12/15
第59回株式会社東芝無担保社債	0.567	100,000	100,455	2019/12/11
第30回富士通株式会社無担保社債	0.331	100,000	100,146	2015/10/16
第11回パナソニック株式会社無担保社債	1.081	100,000	102,947	2018/3/20
第27回ソニー株式会社無担保社債	0.664	100,000	100,314	2017/3/17
第3回松下電工株式会社無担保社債	1.66	100,000	101,511	2015/6/19
第24回三菱重工株式会社無担保社債	1.482	100,000	106,167	2019/12/19
第37回崎重工業株式会社無担保社債	0.572	100,000	100,977	2018/7/18
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	0.87	100,000	101,797	2018/8/3

当 期		末		
銘 柄 名	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
第1回B号明治安田生命2012基金特定目的会社特定社債	0.85	100,000	101,390	2017/8/9
第5回2回自動車動車株式会社無担保社債	1.17	100,000	102,721	2017/4/28
第12回自動車動車株式会社無担保社債	0.317	100,000	100,351	2017/9/20
第5回株式会社ドン・キホーテ無担保社債	1.57	100,000	102,095	2016/3/11
第21回株式会社ニコニコ無担保社債	0.864	100,000	100,576	2024/3/14
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.65	100,000	107,028	2020/3/12
第89回丸紅株式会社無担保社債	0.92	100,000	102,477	2019/1/31
第70回三井物産株式会社無担保社債	2.021	100,000	106,456	2033/3/4
第69回三菱商事株式会社無担保社債	1.99	100,000	106,719	2018/5/22
第74回三菱商事株式会社無担保社債	1.657	100,000	106,773	2019/7/29
第50回株式会社フレディセン無担保社債	0.904	100,000	100,307	2024/4/24
第23回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	0.43	100,000	100,296	2015/10/20
第25回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	0.755	100,000	101,014	2016/4/20
第26回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	0.54	300,000	302,067	2016/7/20
第29回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	0.46	100,000	100,646	2017/4/21
第30回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	0.34	100,000	100,330	2017/7/25
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	122,604	2029/10/16
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.31	100,000	105,330	2020/11/12
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.62	100,000	107,564	2021/6/9
第151回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	0.275	100,000	100,115	2019/1/23
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	109,046	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	108,371	2020/3/2
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	2.21	100,000	109,363	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	106,103	2020/9/28
第53回株式会社三井住友銀行無担保社債	0.69	100,000	100,986	2016/4/20
第56回株式会社三井住友銀行無担保社債	0.47	100,000	100,775	2017/1/20
第10回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.06	200,000	212,532	2018/1/26
第20回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	0.538	100,000	100,743	2017/3/17
第17回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.465	100,000	100,660	2016/12/20
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	1.82	100,000	104,568	2017/3/17
第47回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.501	100,000	100,831	2016/12/20
第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.572	100,000	100,325	2021/3/18
第138回オリックス株式会社無担保社債	1.69	100,000	104,396	2017/8/25
第167回オリックス株式会社無担保社債	0.508	100,000	100,557	2018/3/7
第19回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.487	100,000	100,661	2017/5/29
第22回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.937	100,000	100,704	2015/6/24
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.853	100,000	101,678	2018/2/26
第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債	1.249	100,000	103,913	2020/2/26
第44回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.723	100,000	100,487	2021/2/25

当 期		末		
銘 柄 名	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
第24回三井不動産株式会社無担保社債	1.65	100,000	102,238	2015/12/18
第31回三菱地所株式会社無担保社債	3.125	100,000	109,638	2017/9/26
第103回三菱地所株式会社無担保社債	0.459	100,000	100,646	2016/12/22
第84回住友不動産株式会社無担保社債	0.388	100,000	100,258	2018/2/28
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	102,833	2023/6/26
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.453	100,000	100,800	2018/6/12
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	100,000	100,677	2025/12/12
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	1.412	100,000	106,005	2019/12/9
第17回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.3	100,000	112,588	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	114,043	2022/2/25
第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.598	200,000	202,746	2017/12/22
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.28	19,000	21,569	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	117,659	2028/3/17
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.2	20,000	22,602	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	108,289	2019/9/20
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.695	100,000	102,749	2016/3/18
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.375	100,000	109,882	2039/12/16
第9回東京地下鉄株式会社社債	1.442	100,000	106,367	2020/3/19
第39回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	1.25	100,000	102,619	2017/1/27
第9回三井倉庫株式会社無担保社債	1.27	100,000	102,808	2017/4/19
第17回株式会社東京放送ホールディングス無担保社債	0.673	100,000	100,933	2016/6/2
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	0.69	100,000	100,754	2023/3/20
第20回KDDI株式会社無担保社債	0.803	100,000	100,912	2023/12/20
第17回電源開発株式会社無担保社債	2.07	200,000	207,410	2016/6/20
第30回電源開発株式会社無担保社債	1.394	100,000	105,548	2020/5/20
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	2.9	100,000	109,807	2018/1/30
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	0.9	100,000	102,306	2023/6/20
第2回ノルデアバンク・アクウィエポラージュ・アプリアト円貨社債	1.2	100,000	102,658	2017/6/15
第9回JPMorgan・チエース・アンド・パートナー円貨社債	1.32	100,000	102,755	2017/2/9
第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	2.11	100,000	104,522	2016/12/28
第9回モルガン・スタンレー円貨社債	0.557	100,000	100,010	2018/5/22
第4回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	1.16	100,000	101,079	2015/7/29
第7回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	1.07	100,000	101,046	2015/9/3
第9回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	1.2	100,000	102,552	2017/3/9
第6回オーストラリア・ニューゼaland銀行円貨社債	0.98	100,000	101,185	2016/1/21
第16回ラボバンク・ネーランド円貨社債	1.142	200,000	204,758	2017/5/25
第17回ラボバンク・ネーランド円貨社債	0.563	200,000	200,950	2015/11/2
第3回エイチエスピーシー・バンク・ビーエルシー円貨社債	0.91	100,000	101,116	2016/5/20
小 計		14,170,000	14,600,916	
合 計		241,794,556	254,878,033	

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘 柄 別	当 期		末
	買 建 額	売 建 額	
国内	10	727	1
	百万円	百万円	万円

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 254,878,033	98.8 %
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,032,836	1.2
投 資 信 託 財 産 総 額	257,910,869	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 2014年5月29日現在
(A) 資 産	258,015,818,127円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,073,350,789
公 社 債(評価額)	254,878,033,168
未 収 入 金	103,284,380
未 収 利 息	829,736,517
前 払 費 用	26,574,273
差 入 委 託 証 拠 金	104,839,000
(B) 負 債	1,323,098,713
未 払 金	1,103,149,900
未 払 解 約 金	114,999,813
差入委託証拠金代用有価証券	104,949,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	256,692,719,414
元 本	198,757,586,855
次 期 繰 越 損 益 金	57,935,132,559
(D) 受 益 権 総 口 数	198,757,586,855口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,915円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2013年5月30日 至 2014年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	3,060,357,175円
受 取 利 息	3,060,357,175
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	4,773,284,914
売 買 益	5,189,940,547
売 買 損	△416,655,633
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	26,118,914
取 引 益	34,325,246
取 引 損	△8,206,332
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	7,859,761,003
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	49,441,123,626
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	19,807,953,173
(G) 解 約 差 損 益 金	△19,173,705,243
(H) 計 (D+E+F+G)	57,935,132,559
次 期 繰 越 損 益 金(H)	57,935,132,559

(注1) (B) 有価証券売買損益および(C) 先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (G) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は196,657,037,542円、期中追加設定元本額は71,684,703,561円、期中一部解約元本額は69,584,154,248円です。

※1口当たり純資産額は1,2915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 105,986,000円(決算日現在の代用有価証券の時価額)

※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	48,756,265,499円
DC日本債券インデックス・オープンP	17,094,169,061円
国内債券SMTBセクション(SMA専用)	16,713,696,714円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	16,353,979,831円
DCマイセクション50	14,606,955,795円
DCマイセクション25	11,888,761,930円
日本債券ファンド・シリーズ1	6,911,874,152円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	6,362,199,088円
DCマイセクションS50	4,960,045,241円
SMT 国内債券インデックス・オープン	4,457,429,916円
DCマイセクションS25	4,382,371,740円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	4,142,426,605円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,103,226,100円
DCマイセクション75	4,033,107,022円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,983,779,913円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,581,111,566円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,880,034,500円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,687,951,337円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	2,414,932,715円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,397,465,550円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,306,829,100円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,943,352,893円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,822,216,113円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,384,390,138円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,348,374,043円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,106,082,207円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	957,176,165円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	941,460,798円
DCマイセクションS75	909,555,478円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	531,190,347円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	498,728,372円
DC日本債券インデックス・オープン	394,480,547円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	262,939,055円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	260,993,601円
分散投資コア戦略ファンドA	192,292,753円
コア投資戦略ファンド(切替型)	174,732,274円
世界経済インデックスファンド	164,076,501円
DC世界経済インデックスファンド	156,485,485円
マイセクション25	149,632,501円
分散投資コア戦略ファンドS	148,819,409円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	117,443,249円
マイセクション50	90,305,422円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	44,689,514円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	38,398,923円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	30,847,493円
マイセクション75	28,701,779円
SBI資産設計オープン(分配型)	12,747,660円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	8,659,064円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	8,274,776円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	6,471,999円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,195,782円
エマージング株式オープン	2,227,240円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	31,899円

国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日 2014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、東証株価指数(TOPIX)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。 同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は、行いません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 株式先物率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率		
第10期(2010年5月31日)	6,681	0.0	880.46	△1.9	97.9	129,815
第11期(2011年5月30日)	6,389	△4.4	823.68	△6.4	98.2	122,295
第12期(2012年5月29日)	5,771	△9.7	727.03	△11.7	97.4	113,418
第13期(2013年5月29日)	9,567	65.8	1,178.87	62.1	97.8	149,398
第14期(2014年5月29日)	9,940	3.9	1,200.68	1.9	97.9	142,008

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 株式先物率	株式先物率
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2013年 5月29日	9,567	—	1,178.87	—	97.8	2.2
5月末	9,216	△3.7	1,135.78	△3.7	97.5	2.5
6月末	9,210	△3.7	1,133.84	△3.8	98.2	1.6
7月末	9,193	△3.9	1,131.70	△4.0	98.3	1.3
8月末	8,988	△6.1	1,106.05	△6.2	98.6	1.3
9月末	9,771	2.1	1,194.10	1.3	97.4	1.8
10月末	9,773	2.2	1,194.26	1.3	98.3	1.7
11月末	10,302	7.7	1,258.66	6.8	98.2	1.4
12月末	10,667	11.5	1,302.29	10.5	98.5	1.2
2014年 1月末	9,998	4.5	1,220.64	3.5	98.6	1.4
2月末	9,929	3.8	1,211.66	2.8	99.1	0.9
3月末	9,953	4.0	1,202.89	2.0	98.0	2.0
4月末	9,618	0.5	1,162.44	△1.4	98.4	1.6
(当期末) 2014年 5月29日	9,940	3.9	1,200.68	1.9	97.9	2.2

(注1) 騰落率は期首比です。

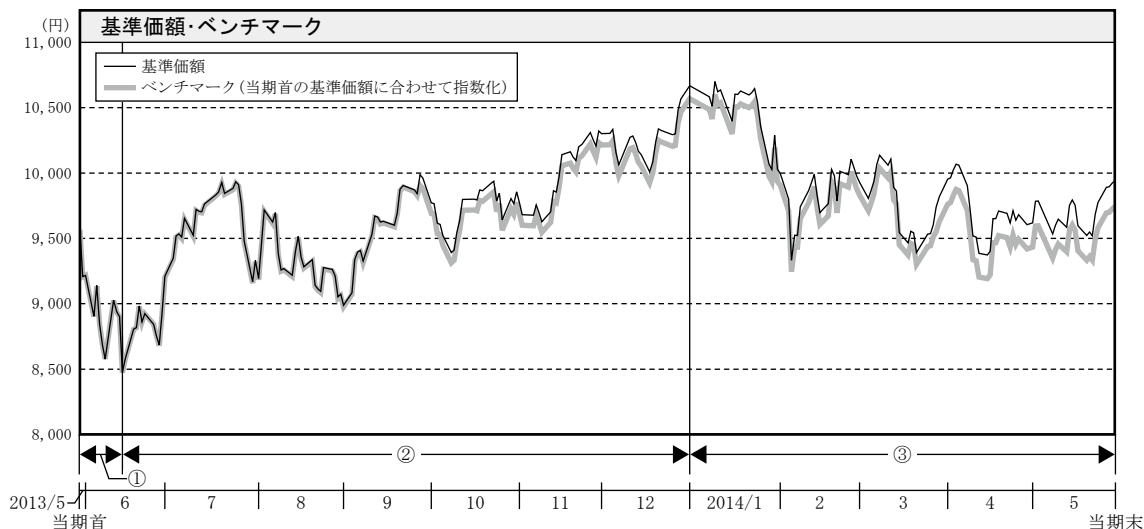
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、東証株価指数(TOPIX)です。

東証株価指数(TOPIX)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

■ 基準価額の推移と変動要因



日銀の異次元金融緩和による円安進行や政府の成長戦略への期待などから堅調に推移していた国内株式市場でしたが、米国の金融緩和縮小が懸念され、2013年6月にかけて大幅に下落しました。(①の期間)

その後は、企業業績の回復基調が下支えとなったことに加え、2020年東京オリンピック開催決定や景気回復期待の高まりによる米国の株高を好感し、年末にかけて日経平均株価は年初来高値を更新しました。(②の期間)

しかし2014年に入ると、それまでの急ピッチな上昇により高値警戒感が強まる中、新興国通貨の急落をきっかけに投資家のリスク回避姿勢が強まり、国内株式市場は大幅な調整を余儀なくされました。新興国通貨が落ち着きを取り戻すと、株式市場は反発する場面もありましたが、ウクライナ情勢の緊迫化により地政学リスクも台頭し不安定な値動きが続きました。期末にかけては、好調な国内企業の決算発表や米国の株高などを背景に反発しました。(③の期間)

	①の期間 下落	②の期間 上昇	③の期間 下落
基準価額の動き			
基準価額変動をもたらした主な要因	<p>〔プラス要因〕</p> <ul style="list-style-type: none"> 日銀の異次元金融緩和による円安の進行 政府の成長戦略への期待 企業業績の回復基調 <p>〔マイナス要因〕</p> <ul style="list-style-type: none"> 米国の金融緩和縮小懸念 新興国経済の減速懸念 	<p>〔プラス要因〕</p> <ul style="list-style-type: none"> 企業業績の回復基調 2020年東京オリンピック開催決定 米国の景気回復期待 円安の進行 <p>〔マイナス要因〕</p> <ul style="list-style-type: none"> 新興国経済の減速懸念 	<p>〔プラス要因〕</p> <ul style="list-style-type: none"> 企業業績の回復基調 米国の景気回復期待 <p>〔マイナス要因〕</p> <ul style="list-style-type: none"> 新興国経済の減速懸念 ウクライナ情勢の緊迫化による地政学リスクの台頭 日銀の追加金融緩和期待の後退による円安の一服

◆パフォーマンス

当期の基準価額の騰落率は以下の通りです。

①当期首 (前期末) 基準価額	②当期末 基準価額	③差引 (②-①)	④騰落率 (③/①)	⑤ベンチマーク 騰落率	④-⑤
9,567円	9,940円	+373円	+3.9%	+1.9%	+2.0%

基準価額騰落率がベンチマークの騰落率を上回った主な要因は以下の通りです。

- ・配当金要因^{*1} +2.0%

■運用状況

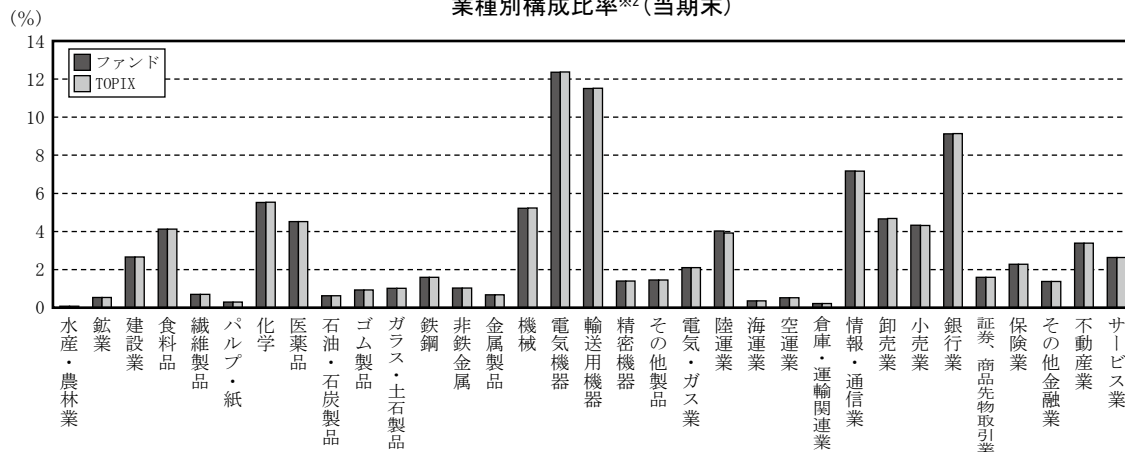
(1) 株式組入比率

期中を通じて株式組入比率を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への対応については、取引コスト抑制の観点から株価指数先物取引を適宜活用しております。なお、追加設定予定資金相当分についても株価変動リスクを回避する目的で株価指数先物の買建てを行っているため、先物建玉を含む株式組入比率が100%をわずかに超えている場合があります。

(2) ポートフォリオ構成

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、東証株価指数(TOPIX)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。

業種別構成比率^{*2}(当期末)

*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 比率は、株式評価総額に対する各業種の評価額の比率です。

■今後の運用方針

引き続き、ポートフォリオにおける個別銘柄の保有比率をTOPIXの銘柄構成比率に合わせることに
より、TOPIXの動きに連動・追随する投資成果を目指して運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項 目	当 期
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)
合 計	0

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 売買委託手数料は、期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株 16,279 (1,833)	千円 16,739,863 (4,495)	千株 25,250	千円 27,285,049

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

<新株予約権証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内	内	証券 — (13,300)	千円 — (—)	証券 — (13,300)	千円 — (—)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

<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 34,687	百万円 34,948	百万円 107	百万円 107

(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	44,024,913千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	140,218,677千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.31

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

(注2) (c)売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

主要な売買銘柄

＜株 式＞

当				期			
買		付		売		付	
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
トヨタ自動車	167.5	1,016,154	6,066	トヨタ自動車	187.1	1,166,410	6,234
楽天	372.8	610,216	1,636	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,152	734,302	637
本田技研工業	97.9	368,840	3,767	三井住友フィナンシャルグループ	115.2	556,895	4,834
三菱UFJフィナンシャル・グループ	535.6	312,384	583	ソフトバンク	68.6	493,884	7,199
サントリー食品インターナショナル	68.4	243,250	3,556	本田技研工業	122.1	478,642	3,920
三井住友フィナンシャルグループ	53.4	229,838	4,304	日本電信電話	85.5	447,135	5,229
ソフトバンク	34.4	228,055	6,629	みずほフィナンシャルグループ	1,963.5	419,073	213
KDDI	40.5	212,454	5,245	キャノン	127.8	406,806	3,183
ファナック	12.6	202,397	16,063	日本たばこ産業	97.3	344,087	3,536
日産自動車	195.6	195,104	997	ソニー	158.8	310,677	1,956

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人^{*}との取引状況等

■利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	63百万円	147百万円	646百万円

(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

<国内株式(上場株式)>

銘柄	当期末(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業(0.1%)			
極洋	42	36	9,324
日本水産	107.7	111.7	36,190
マルハニチロ	—	17.5	27,737
マルハニチロホールディングス	192	—	—
サカタのタネ	14.8	13.4	18,451
ホクト	10.2	10.1	19,553
鉱業(0.5%)			
住石ホールディングス	29.4	25.2	2,948
日鉄鉱業	25	23	9,200
三井松島産業	65	59	7,729
国際石油開発帝石	1,217	441.8	647,678
日本海洋掘削	2.5	2.3	9,108
関東天然瓦斯開発	10	—	—
石油資源開発	14.3	13	55,315
K&Oエナジーグループ	—	4.5	6,237
建設業(2.7%)			
ショーボンドホールディングス	8.9	8.1	36,328
ミライト・ホールディングス	28.5	25.8	24,819
タマホーム	4.5	6.6	4,870
サンヨーホームズ	—	1.7	1,147
ダイセキ環境ソリューション	0.011	1.1	1,694
安藤・間	56.5	60.6	29,815
東急建設	43.81	38.4	16,780
コムシスホールディングス	48.6	44.1	81,496
ミサワホーム	12.4	12	14,028
高松コンストラクショングループ	7.7	6.9	10,936
東建コーポレーション	3.93	3.6	16,038
ヤマウラ	9.5	9.3	2,790
大成建設	507	460	239,660
大林組	301	273	184,275
清水建設	308	278	184,036
長谷工コーポレーション	626	121.2	90,657
松井建設	13	12	4,776
鹿島建設	442	400	168,000
不動テトラ	—	64.2	12,583
鉄建建設	61	55	16,170
日鉄住金テックスエンジ	20	17	7,395
西松建設	129	125	50,250
三井住友建設	172.8	244.2	25,885
前田建設工業	64	58	42,572
佐田建設	—	31	3,503

銘柄	当期末(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ナカノフドー建設	17	16.2	4,228
奥村組	89	81	34,830
大和小田急建設	5	4.9	1,509
東鉄工業	13	10.9	23,271
イチケン	20	19	3,192
戸田建設	116	106	34,238
熊谷組	72	98	25,774
青木あすなろ建設	7.5	5.7	3,340
北野建設	24	19	4,655
植木組	18	25	5,250
三井ホーム	14	12	5,604
矢作建設工業	14.4	13.4	11,068
ビーエス三菱	8	7.2	3,384
東日本ハウス	—	12.2	6,270
大東建託	38.1	34.5	385,020
新日本建設	15.6	17.9	5,173
N I P P O	23	21	33,684
東亜道路工業	21	19	7,771
前田道路	29	28	45,808
日本道路	31	25	13,525
東亜建設工業	88	83	14,442
若築建設	—	49	6,321
東洋建設	31.1	30.7	10,837
五洋建設	119	108.3	32,165
大林道路	14	11	5,984
福田組	18	20	10,580
住友林業	69.1	62.6	67,733
日本基礎技術	12.1	11.6	3,839
日成ビルド工業	41	33	9,438
巴コーポレーション	13.6	11.3	4,700
パナホーム	39	34	25,500
大和ハウス工業	250	249	474,843
ライト工業	23.4	19.4	15,132
積水ハウス	301	242.2	321,399
日特建設	11.2	12.4	4,488
北陸電気工事	7	6	2,718
ユアテック	16	14	7,168
西部電気工業	9	8	3,616
四電工	9	8	2,992
中電工	14.5	13.1	19,492
関電工	46	41	22,919
きんでん	66	60	54,000

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	千円
東京エネシス	10	10	5,230	
トーエネック	14	13	6,942	
住友電設	7.3	6.3	6,394	
日本電設工業	18	14.8	21,489	
協和エクシオ	36	35.6	49,697	
新日本空調	9.2	7.8	4,820	
NDS	15	14	3,990	
九電工	16	18	16,146	
三機工業	24	21	13,713	
日揮	101	91	265,629	
中外炉工業	38	24	4,824	
ヤマト	14	8	2,656	
太平電業	12	14	9,996	
高砂熱学工業	28.9	25.4	26,822	
三晃金属工業	18	16	3,648	
朝日工業社	12	11	4,213	
明星工業	—	18	9,810	
大気社	14.4	12.1	27,200	
ダイダン	14	12	6,624	
日比谷総合設備	12.3	10.6	15,582	
東芝プラントシステム	16	15.3	23,057	
東洋エンジニアリング	56	49	24,647	
千代田化工建設	72	72	85,680	
新興プランテック	20.6	18.7	14,623	
食料品(4.1%)				
日本製粉	61	56	30,352	
日清製粉グループ本社	90.5	90.6	107,089	
日東富士製粉	8	7	2,191	
昭和産業	41	37	12,506	
鳥越製粉	8	7.3	4,905	
協同飼料	35	31	3,131	
中部飼料	9	8.7	5,263	
日本配合飼料	28	28	3,248	
東洋精糖	16	14	1,344	
日本甜菜製糖	51	46	8,464	
三井製糖	39	36	13,716	
塩水港精糖	—	7.2	1,872	
森永製菓	98	89	19,224	
中村屋	23	21	8,358	
江崎グリコ	36	31	40,238	
名糖産業	4.4	4	4,376	
不二家	57	52	9,984	
山崎製パン	73	67	80,132	
第一屋製パン	—	12	1,428	
モロゾフ	15	14	4,536	
亀田製菓	5.6	5.1	15,810	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	千円
寿スピリッツ	—	2	4,640	
カルビー	9.1	33.6	93,038	
森永乳業	86	77	29,953	
六甲バター	—	4.1	3,583	
ヤクルト本社	58.6	53.2	269,192	
明治ホールディングス	19.7	26.9	176,195	
雪印メグミルク	19.6	19.6	25,656	
プリマハム	57	45	10,575	
日本ハム	76	63	124,740	
伊藤ハム	55	50	22,300	
丸大食品	48	43	13,717	
丸久	4	2.9	2,467	
S Foods	6.5	5.7	7,934	
サッポロホールディングス	166	149	64,666	
アサヒグループホールディングス	201.3	182.6	534,835	
キリンホールディングス	428	388.7	559,339	
宝ホールディングス	79	71	52,256	
オエノンホールディングス	26	22	5,368	
養命酒製造	8	7	6,426	
三國コカ・コーラボトリング	10.4	—	—	
コカ・コーラウエスト	33.9	28	48,132	
コカ・コーライーストジャパン	12.5	18.8	45,496	
サントリー食品インターナショナル	—	62.2	238,226	
ダイドードリンコ	5.1	4.2	17,409	
伊藤園	27.2	24.7	57,304	
キーコーヒー	8.7	8.6	13,811	
ユニカフェ	2.7	2.5	1,562	
ジャパンフーズ	1.3	1.2	1,420	
日清オイリオグループ	43	39	13,767	
不二製油	24.3	22.1	28,221	
かどや製油	—	0.9	2,358	
J-オイルミルズ	42	38	11,628	
キッコーマン	82	74	158,434	
味の素	247	216	347,976	
キュービー	50.9	46.2	69,808	
ハウス食品グループ本社	35.2	32	59,232	
カゴメ	35.9	35.1	60,898	
焼津水産化学工業	4.7	4	3,760	
アリアケジャパン	9.1	8.3	20,866	
ニチレイ	107	97	49,373	
東洋水産	46	45	137,925	
イートアンド	—	0.8	1,208	
日清食品ホールディングス	39.1	35.5	173,417	
永谷園	10	9	9,090	
フジッコ	11	9	11,250	
ロック・フィールド	5.2	4.7	8,774	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	千円
日本たばこ産業	556.4	503.5	1,732,543	
ケンコーマヨネーズ	3.1	3	2,754	
わらべや日洋	6	5.3	10,276	
なとり	4.6	4.2	4,590	
ミヨシ油脂	32	31	4,216	
繊維製品(0.7%)				
片倉工業	11.8	9.8	11,897	
グンゼ	70	69	19,665	
東洋紡	396	359	58,876	
ユニチカ	256	233	10,252	
富士紡ホールディングス	45	44	12,276	
日清紡ホールディングス	60	54	51,570	
倉敷紡績	96	87	15,051	
シキボウ	57	49	5,439	
日本毛織	30	27	20,412	
トーア紡コーポレーション	42	36	2,484	
ダイドーリミテッド	10.6	9.6	5,001	
帝国繊維	10	8.9	17,853	
帝人	355	347	80,504	
東レ	724	616	398,552	
サカイオーボックス	25	23	3,772	
住江織物	28	27	8,370	
日本フェルト	5.4	4.9	2,209	
イチカワ	6	6	1,500	
日本バイリーン	12	10	5,390	
芦森工業	26	25	3,275	
アツギ	79	71	7,526	
ダイニック	18	16	2,432	
セーレン	25.2	22.9	18,617	
東海染工	13	12	1,368	
小松精練	16	16	8,480	
ワコールホールディングス	56	51	52,479	
ホギメディカル	5.9	5.4	29,430	
レナウン	20.2	20.4	2,346	
クラウディア	1.4	1.8	2,093	
T S I ホールディングス	49.1	41.9	27,695	
三陽商会	49	45	10,170	
オンワードホールディングス	62	57	39,615	
ルック	17	18	4,482	
ゴールドウイン	22	21	10,164	
デサント	24	20	17,080	
キング	—	4.3	1,715	
ヤマトインターナショナル	5.9	5.6	2,447	
パルプ・紙(0.3%)				
特種東海製紙	54	49	10,535	
王子ホールディングス	413	375	163,500	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	千円
日本製紙	45.2	43.9	92,541	
三菱製紙	133	121	10,648	
北越紀州製紙	58	58	29,870	
中越パルプ工業	36	32	5,632	
巴川製紙所	14	13	2,405	
大王製紙	39	29	35,351	
レンゴー	75	68	33,796	
トーモク	30	27	7,263	
ザ・バック	6.6	6	11,940	
化学(5.5%)				
クラレ	159.4	134.9	165,117	
旭化成	584	530	398,560	
共和レザー	5.4	5.7	2,639	
コープケミカル	14	13	1,443	
昭和電工	582	565	74,580	
住友化学	643	625	232,500	
日本化成	17	16	2,112	
住友精化	17	18	12,078	
日産化学工業	64.1	56.7	88,452	
ラサ工業	33	32	4,288	
クレハ	66	60	29,700	
多木化学	—	5	3,435	
テイカ	16	14	4,102	
石原産業	168	153	12,240	
片倉チッカリン	6	5	1,260	
日本曹達	56	54	28,080	
東ソー	250	227	110,322	
トクヤマ	136	132	38,280	
セントラル硝子	83	81	27,783	
東亜合成	110	100	43,700	
ダイソー	37	34	11,628	
関東電化工業	22	20	4,720	
電気化学工業	187	170	62,560	
信越化学工業	167.9	152.3	923,394	
日本カーバイド工業	27	25	6,300	
堺化学工業	35	34	9,894	
エア・ウォーター	77	70	107,100	
大陽日酸	123	109	97,337	
日本化学工業	35	31	3,999	
日本パーカライジング	22	20	44,880	
高圧ガス工業	14	13	7,319	
チタン工業	11	10	2,230	
四国化成工業	14	12	8,208	
戸田工業	13	15	4,245	
ステラ ケミファ	4.1	4.3	5,559	
保土谷化学工業	21	25	4,750	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
日本触媒	68	72	92,160	
大日精化工業	34	33	15,048	
カネカ	117	106	66,144	
三菱瓦斯化学	148	134	77,586	
三井化学	397	386	100,360	
J S R	85.8	77.9	133,754	
東京応化工業	18.1	16.4	36,703	
大阪有機化学工業	6.2	5.8	2,511	
三菱ケミカルホールディングス	585	531.1	220,937	
日本合成化学工業	19	17	12,818	
ダイセル	111	110	101,530	
住友ベークライト	73	66	24,816	
積水化学工業	192	174	193,662	
日本ゼオン	81	67	62,243	
アイカ工業	26.3	23.8	52,264	
宇部興産	448	428	72,332	
積水樹脂	13	11.9	16,612	
タキロン	22	20	9,980	
旭有機材工業	33	30	6,240	
日立化成	40.5	36.7	57,582	
ニチバン	9	9	3,150	
リケンテクノス	15	14	6,622	
大倉工業	22	20	6,360	
積水化成成品工業	24	24	6,504	
群栄化学工業	25	23	8,510	
タイガースポリマー	4.6	4.3	1,935	
ミライアル	2.3	2.8	4,544	
ダイキョーニシカワ	—	2.1	3,782	
日本カーリット	7.4	—	—	
日本化薬	66	60	77,520	
カーリットホールディングス	—	6.9	3,243	
日本精化	7.8	7	4,543	
A D E K A	40.3	36.5	42,887	
日油	73	71	55,877	
ハリマ化成グループ	8	7.4	3,278	
花王	248.2	220.9	907,457	
第一工業製薬	17	15	5,085	
三洋化成工業	29	27	18,009	
大日本塗料	54	49	7,448	
日本ペイント	81	74	119,732	
関西ペイント	106	103	161,813	
神東塗料	—	7	1,407	
中国塗料	29	24	17,232	
日本特殊塗料	7.2	6.5	3,601	
藤倉化成	10.9	10.7	5,296	
太陽ホールディングス	7.6	6.9	20,486	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
D I C	332	301	82,775	
サカティンクス	19	17.3	15,033	
東洋インキS Cホールディングス	84	76	33,288	
T & K T O K A	3.1	3.1	5,992	
富士フィルムホールディングス	199.9	194.4	512,049	
資生堂	166.5	151.1	261,403	
ライオン	108	98	57,428	
高砂香料工業	31	31	14,973	
マンダム	10	8.5	28,857	
ミルボン	4.6	5.4	18,603	
ファンケル	23.5	19.7	23,915	
コーセー	16.8	13.7	49,183	
コタ	—	2.5	2,947	
ドクターシーラボ	0.063	5.8	19,024	
シーボン	0.7	0.8	1,772	
ポーラ・オルビスホールディングス	11.1	8.7	34,713	
ノエビアホールディングス	5.8	5.7	10,824	
アジュパンコスメジャパン	—	1.4	1,218	
エステー	5.7	5.3	5,162	
コニシ	6.8	6.1	11,712	
長谷川香料	11.9	10.8	16,426	
星光PMC	3.8	4.7	5,978	
小林製薬	14.2	13.9	94,798	
荒川化学工業	7.3	7.1	6,489	
メック	6.7	6.6	5,306	
日本高純度化学	0.025	2.4	5,131	
J C U	1.4	1.3	8,476	
新田ゼラチン	3.8	5.1	4,584	
アース製薬	6.7	6.1	22,875	
イハラケミカル工業	16	13.1	10,742	
北興化学工業	9	8	2,816	
大成ラミック	2.6	2.2	5,621	
クミアイ化学工業	19	18	12,438	
日本農薬	21	19.4	21,611	
アキレス	74	68	9,180	
有沢製作所	14.6	14.2	9,002	
日東電工	77.1	70	330,890	
レック	2.9	2.7	2,794	
きもと	8.4	12.6	4,145	
藤森工業	7.9	7.3	24,017	
前澤化成工業	6.6	5.9	5,976	
J S P	6.1	5.6	9,032	
エフビコ	4.6	8.4	27,090	
天馬	7.4	6.8	9,601	
信越ポリマー	18.4	16.6	6,988	
東リ	24	22	4,642	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	千円
ニフコ	20.9	19	56,734	
日本バルカー工業	39	35	9,660	
ユニ・チャーム	51.7	52.1	318,331	
医薬品(4.5%)				
協和発酵キリン	112	102	127,092	
武田薬品工業	350.6	318.1	1,470,258	
アステラス製薬	207.8	977.9	1,265,402	
大日本住友製薬	66.2	60.1	67,071	
塩野義製薬	136.4	132.6	267,189	
田辺三菱製薬	77.9	70.7	104,282	
わかもと製薬	11	10	2,410	
あすか製薬	11	10	9,490	
日本新薬	19	19	37,810	
ピオフェルミン製薬	—	1.4	3,385	
中外製薬	108.7	84.5	236,600	
科研製薬	37	31	62,217	
エーザイ	115.2	104.5	435,347	
ロート製薬	39	35.6	55,322	
小野薬品工業	45.8	38.6	305,712	
久光製薬	29	26.4	110,616	
有機合成薬品工業	7	6	1,500	
持田製薬	34	6.1	41,907	
参天製薬	32	31.2	172,848	
扶桑薬品工業	31	29	9,077	
日本ケミファ	13	12	5,556	
ツムラ	25.5	24.9	58,091	
日医工	13.6	19.9	29,332	
キッセイ薬品工業	17.4	15.8	36,087	
生化学工業	17.9	17.7	20,213	
栄研化学	6.6	6.6	11,305	
日水製薬	3.8	3.4	3,760	
鳥居薬品	5.6	5.8	17,144	
JCRファーマ	—	6.5	14,937	
東和薬品	4.8	4.3	17,479	
富士製薬工業	2.5	2.4	4,444	
沢井製薬	6.2	13.4	85,224	
ゼリア新薬工業	13	13.4	29,882	
第一三共	295.1	267.8	466,507	
キョーリン製薬ホールディングス	25	22.6	43,866	
大幸薬品	4.4	4	6,212	
ダイト	3	2.8	4,278	
大塚ホールディングス	185.7	168.5	483,089	
大正製薬ホールディングス	22.5	20.4	149,124	
石油・石炭製品(0.6%)				
日本コークス工業	75.5	68.5	7,809	
昭和シェル石油	83.7	75.9	82,579	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	千円
コスモ石油	259	235	46,295	
ニチレキ	11	10	10,730	
東燃ゼネラル石油	141	128	123,520	
ユシロ化学工業	5.1	4.6	5,216	
ビービー・カストロール	3.8	3.5	2,135	
富士石油	21.7	21.7	6,423	
MORESCO	1.8	2.7	4,571	
出光興産	11.1	40.3	83,501	
JXホールディングス	1,038.6	942.4	494,760	
ゴム製品(0.9%)				
横浜ゴム	105	95	85,785	
東洋ゴム工業	78	70	62,090	
ブリヂストン	293.3	266.1	961,685	
住友ゴム工業	73	66.2	98,638	
藤倉ゴム工業	5.2	5.3	4,764	
オカモト	33	30	10,290	
フコク	3.9	3.5	3,157	
ニッタ	9.2	8.4	18,480	
東海ゴム工業	17.3	15.7	15,386	
三ツ星ベルト	24	22	12,606	
バンドー化学	31	31	11,966	
ガラス・土石製品(1.0%)				
日東紡績	69	63	24,759	
旭硝子	461	418	237,424	
日本板硝子	426	409	50,307	
石塚硝子	12	11	2,057	
日本山村硝子	37	34	5,202	
日本電気硝子	166	175	90,475	
オハラ	3.6	3.3	1,947	
住友大阪セメント	166	158	58,460	
太平洋セメント	517	499	192,614	
デイ・シイ	11	9.4	4,765	
日本ヒューム	9	8	4,592	
日本コンクリート工業	16	17	7,463	
三谷セキサン	—	4.5	6,678	
ジャパンバイル	7.6	10.5	8,295	
東海カーボン	81	79	22,831	
日本カーボン	49	45	7,605	
東洋炭素	5.2	5.2	11,824	
ノリタケカンパニーリミテド	49	48	11,856	
TOTO	144	125	161,125	
日本碍子	122	107	231,334	
日本特殊陶業	81	73	203,962	
MARUWA	2.1	2.2	8,558	
品川リフラクトリーズ	25	22	4,598	
黒崎播磨	23	20	4,320	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
ヨータイ	—	5	1,500	
イソライト工業	—	5.6	968	
東京窯業	12	11	2,090	
ニッカトー	3.1	3.1	1,243	
フジミインコーポレーテッド	8.6	7.8	9,235	
ニチアス	42	41	28,126	
ニチハ	10.4	10.4	10,795	
鉄鋼(1.6%)				
新日鐵住金	3,955	3,589	1,026,454	
神戸製鋼所	1,299	1,355	189,700	
合同製鐵	53	46	6,486	
ジェイ エフ イー ホールディングス	238.7	216.6	418,904	
日新製鋼	40	36.4	37,492	
東京製鐵	52.5	46.9	22,605	
共英製鋼	8.7	7.9	13,509	
大和工業	19.4	17.6	50,670	
東京鐵鋼	18	18	7,992	
大阪製鐵	4.7	4.3	7,310	
淀川製鋼所	67	60	24,540	
東洋鋼板	20	20	10,940	
住友鋼管	6.4	—	—	
丸一鋼管	31.3	28.4	71,085	
モリ工業	14	13	4,836	
大同特殊鋼	145	142	71,852	
日本高周波鋼業	38	37	3,330	
日本冶金工業	72.5	67.9	21,320	
山陽特殊製鋼	47	46	18,630	
愛知製鋼	50	45	16,515	
日立金属	66	76	110,808	
日本金属	24	22	2,992	
大平洋金属	60	59	28,851	
日本電工	37	36	9,972	
栗本鐵工所	41	44	10,824	
虹技	—	12	2,268	
日本鑄鉄管	10	9	2,016	
三菱製鋼	57	53	10,653	
日亜鋼業	13	12	3,492	
日本精線	6	7	2,828	
シンニッタン	7.4	8.2	3,296	
新家工業	21	19	2,850	
非鉄金属(1.0%)				
大紀アルミニウム工業所	16	14	3,990	
日本軽金属ホールディングス	197.1	192.3	28,845	
三井金属鉱業	239	216	54,000	
東邦亜鉛	53	48	16,368	
三菱マテリアル	547	530	165,890	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
住友金属鉱山	242	220	341,440	
DOWAホールディングス	103	94	86,010	
古河機械金属	158	143	27,742	
大阪チタニウムテクノロジーズ	9.2	9.3	19,697	
東邦チタニウム	15.9	14.4	10,036	
住友軽金属工業	227	—	—	
UACJ	32	108	38,340	
古河電気工業	294	267	56,070	
住友電気工業	330.5	319.8	443,562	
フジクラ	150	136	62,152	
昭和電線ホールディングス	120	109	10,682	
東京特殊電線	—	12	1,956	
タツタ電線	17.6	13.5	7,884	
日立電線	73	—	—	
沖電線	10	13	2,249	
カナレ電気	1.4	1.2	1,851	
平河ヒューテック	2.3	1.9	1,679	
リョービ	52	52	15,964	
アーレスティ	—	7.3	6,402	
アサヒホールディングス	14.1	12.8	21,862	
金属製品(0.7%)				
稲葉製作所	4	3.6	4,622	
宮地エンジニアリンググループ	—	28	5,264	
トーカロ	5.3	5.2	8,413	
アルファC o	3.8	3.3	3,257	
SUMCO	57.5	53.2	42,506	
川田テクノロジーズ	2.5	2.1	7,434	
東洋製鋼グループホールディングス	66.5	60.4	91,808	
ホッカンホールディングス	25	24	6,744	
コロナ	4.3	4.5	4,950	
横河ブリッジホールディングス	18	16.6	22,244	
O S J Bホールディングス	—	18.5	2,590	
駒井ハルテック	21	20	5,380	
高田機工	9	10	1,920	
三和ホールディングス	87	71	50,268	
文化シャッター	25	21	14,595	
三協立山	12.7	10.8	20,919	
東洋シャッター	3.2	3.6	2,613	
L I X I Lグループ	130.3	118.2	313,702	
日本ファイルコン	8.8	7.8	3,393	
ノーリツ	18.4	16.6	33,598	
長府製作所	9	9.1	23,223	
リンナイ	15.1	13.2	120,780	
ダイニチ工業	4.8	4.4	3,150	
日東精工	14	13	4,147	
三洋工業	15	14	2,660	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価	額
		千株	千株	千円
岡部	18.7	16.7	23,296	
東ブレ	18	16.9	19,874	
高周波熱錬	12.8	12.5	8,150	
東京製綱	63	—	—	
サンコール	—	6	3,438	
モリテック スチール	—	5.3	1,510	
バイオラックス	4	4	13,800	
日本発條	67.8	67.6	61,989	
中央発條	13	11	3,355	
三益半導体工業	8.1	7.2	6,451	
機械(5.2%)				
日本ドライケミカル	—	1	2,235	
アタカ大機	6	—	—	
日本製鋼所	144	122	49,166	
三浦工業	13.9	12.6	39,564	
タクマ	32	27	16,578	
ツガミ	25	26	13,884	
オークマ	61	55	52,140	
東芝機械	46	46	20,240	
アマダ	143	130	125,320	
アイダエンジニアリング	22	19.9	18,447	
滝澤鉄工所	28	31	5,363	
富士機械製造	—	25.9	21,756	
牧野フライス製作所	44	42	32,970	
オーエスジー	38.4	34.9	60,167	
ダイジェット工業	16	14	2,058	
旭ダイヤモンド工業	22.4	21.8	36,515	
DMG森精機	49.3	50.2	63,051	
ディスコ	10.4	9.4	60,066	
日東工器	5.5	5	9,735	
パンチ工業	—	1.9	1,698	
豊和工業	61	5	3,685	
大阪機工	36	33	4,455	
東洋機械金属	8.4	6.9	3,553	
津田駒工業	23	23	3,151	
島精機製作所	12.2	11.1	18,315	
日阪製作所	12	11	10,043	
やまびこ	3.9	3.4	14,195	
ベガサスミシン製造	10.8	9.6	3,686	
ナブテスコ	46.3	38.8	84,855	
三井海洋開発	7.8	7.5	16,920	
レオン自動車	9	9	3,978	
SMC	27.9	24.3	633,987	
新川	8.2	7.5	3,742	
ホソカワミクロン	16	15	9,105	
ユニオンツール	5.2	3.7	8,831	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価	額
		千株	千株	千円
オイレス工業	9.7	8.1	18,257	
日精ユー・エス・ビー機械	—	2.9	4,744	
サトーホールディングス	9.9	9.3	20,785	
日本エアータック	4.2	3.6	1,620	
日精樹脂工業	8.1	6.2	3,416	
ワイエイシイ	4.3	4.3	2,743	
小松製作所	436.5	396	879,120	
住友重機械工業	256	232	105,792	
日立建機	47.8	43.3	82,096	
日工	13	14	6,356	
巴工業	3.6	3.1	4,969	
井関農機	90	87	21,924	
TOWA	9.1	8	4,944	
丸山製作所	23	19	4,351	
北川鉄工所	42	42	6,636	
クボタ	488	441	612,990	
荏原実業	2.2	2.2	3,148	
三菱化工機	31	29	5,075	
月島機械	15	14	14,700	
帝国電機製作所	3	2.9	8,079	
新東工業	18.8	19.9	14,129	
澁谷工業	5.9	7.4	20,261	
アイチ コーポレーション	15.4	12	5,208	
小森コーポレーション	22.7	20.6	26,821	
鶴見製作所	7	6	7,800	
住友精密工業	15	15	5,925	
酒井重工業	18	17	5,236	
荏原製作所	192	187	118,371	
石井鐵工所	17	15	3,270	
西島製作所	10.8	9.1	7,152	
北越工業	—	7	3,892	
ダイキン工業	122	110.7	670,509	
オルガノ	16	13	6,175	
トーヨーカネツ	51	45	11,250	
栗田工業	51.6	51	111,690	
椿本チエイン	48	43	33,712	
大同工業	22	19	4,674	
日本コンベヤ	29	26	3,120	
木村化工機	9.5	9.1	4,322	
アネスト岩田	15	14.2	7,994	
ダイフク	41.5	34.3	46,407	
サムコ	—	1.3	1,556	
加藤製作所	23	20	11,900	
油研工業	22	18	3,906	
タダノ	43	36	53,568	
フジテック	26	23.7	26,354	

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	評 価 額	株 数
	千株	千株	千円	千株	千円	千円
CKD	25.3	22.9	20,358			
キトー	5.9	5	11,740			
平和	19.6	17.9	37,249			
理想科学工業	6	6.3	17,129			
SANKYO	27.1	24.6	94,587			
日本金銭機械	8.6	7.5	13,350			
マースエンジニアリング	5.1	4.6	8,671			
福島工業	2.6	4.6	6,596			
オーイズミ	3.8	3.3	3,012			
ダイコク電機	3.8	3.4	5,215			
アマノ	27.1	23.2	22,782			
サンデン	52	47	22,795			
マックス	14	13	14,378			
グローリー	26.7	24.2	72,963			
新晃工業	—	5.9	5,575			
大和冷機工業	15	13	8,489			
セガサミーホールディングス	96.1	87.2	168,557			
日本ピストンリング	33	32	5,696			
リケン	33	33	12,837			
T P R	10.4	9.3	19,046			
ホシザキ電機	19.5	17.8	83,304			
大豊工業	6.6	6.2	5,952			
日本精工	199	180	223,560			
NTN	194	189	76,167			
ジェイテクト	95.2	86.2	131,455			
不二越	84	76	49,780			
日本トムソン	31	26	12,558			
THK	59.5	50.6	111,320			
ユーシン精機	4.5	3.6	9,291			
前澤給装工業	3.4	3.3	4,557			
イーグル工業	12	10.2	18,482			
前澤工業	8.4	7.9	2,322			
日本ビラー工業	9	9.2	6,854			
キッツ	37.3	36.9	19,446			
日立工機	23.9	21.8	17,701			
マキタ	54.4	52.9	296,240			
日立造船	353.5	65.2	31,817			
三菱重工	1,498	1,444	856,292			
I H I	612	584	245,864			
電気機器 (12.4%)						
イビデン	54.5	49.4	92,081			
コニカミノルタ	236	214.2	188,710			
ブラザー工業	115.6	104.8	168,099			
ミネベア	122	111	114,885			
日立製作所	2,146	1,951	1,326,680			
東芝	1,764	1,600	660,800			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	評 価 額	株 数
	千株	千株	千円	千株	千円	千円
三菱電機	894	811	963,468			
富士電機	269	226	101,248			
東洋電機製造	18	17	6,324			
安川電機	98	89	109,470			
シンフォニアテクノロジー	54	49	7,350			
明電舎	89	75	30,975			
オリジン電気	13	12	3,516			
山洋電気	14	16	10,560			
デンヨー	8.8	8	12,104			
東芝テック	56	51	34,527			
芝浦メカトロニクス	16	16	4,288			
マブチモーター	12.6	11.4	85,500			
日本電産	48.3	87.7	525,323			
東光高岳	4.6	4.8	6,494			
ダイヘン	49	48	19,008			
ヤーマン	0.9	1.1	1,387			
J V Cケンウッド	54.2	57.7	11,193			
第一精工	2.8	3.4	4,617			
日新電機	18	16	9,568			
大崎電気工業	12	13	7,384			
オムロン	94.5	91.5	351,817			
日東工業	13.2	11.9	23,300			
I D E C	11.7	10.6	9,465			
ジーエス・ユアサ コーポレーション	172	156	90,948			
サクサホールディングス	23	21	3,402			
メルコホールディングス	5.6	3.9	6,871			
テクノメディカ	0.007	1.8	3,780			
日本電気	1,157	1,115	352,340			
富士通	862	782	548,964			
沖電気工業	325	313	65,730			
岩崎通信機	39	38	3,344			
電気興業	24	23	13,156			
サンケン電気	45	44	34,100			
ナカヨ通信機	9	8	2,800			
アイホン	5.2	4.7	8,018			
ルネサスエレクトロニクス	23.1	42	32,676			
セイコーエプソン	61	55.4	193,900			
ワコム	65.6	63.9	33,483			
アルバック	15.1	14.9	33,823			
アクセル	4.5	4.1	5,850			
E I Z O	7.6	7.5	19,912			
ジャパンディスプレイ	—	136.3	77,963			
日本信号	22.6	22.4	20,025			
京三製作所	19	19	6,479			
能美防災	12	11	15,851			
ホーチキ	8	6	3,840			

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
		千株	千株	千円
エレコム	2.8	3	6,264	
日本無線	19	21	9,912	
パナソニック	1,021	926.4	1,015,334	
シャープ	462	585	167,310	
アンリツ	48	47.2	49,512	
富士通ゼネラル	21	19	21,356	
日立国際電気	20	16	20,240	
ソニー	561.6	447.2	731,619	
TDK	50.4	48.9	215,404	
帝国通信工業	21	19	3,116	
ミツミ電機	34.1	30.9	19,343	
タムラ製作所	35	31	11,501	
アルプス電気	65.6	59.4	69,498	
パイオニア	108.8	112.7	24,455	
日本電波工業	7.5	7.8	6,739	
日本トリム	1.15	1.8	6,642	
ローランド ディー. ジー.	4	3.7	13,967	
フォスター電機	9.2	8.3	9,287	
クラリオン	47	50	11,400	
SMK	26	24	9,192	
ヨコオ	7.1	6.9	3,512	
東光	52	19	5,586	
ホシデン	24.3	23.9	13,455	
ヒロセ電機	15.6	14.1	201,489	
日本航空電子工業	21	21	38,136	
TOA	10	8.7	10,701	
日立マクセル	—	14.1	24,336	
古野電気	—	10.5	6,982	
ユニデン	26	26	6,058	
アルパイン	17.5	17.6	21,489	
スミダコーポレーション	6.1	7.2	4,658	
アイコム	5	4.5	10,660	
リオン	2.1	2.5	3,955	
船井電機	9.1	8.2	7,937	
横河電機	89.5	87.9	109,699	
新電元工業	29	26	13,858	
アズビル	25	24.6	56,801	
東亜ディーケーケー	—	3.1	1,556	
日本光電工業	17.8	17.3	78,888	
チノー	16	15	3,360	
共和電業	10	10	5,840	
日本電子材料	3.9	3.6	1,656	
堀場製作所	17.7	15	50,925	
アドバンテスト	60.9	55.3	63,705	
小野測器	10	8	3,816	
エスベック	9.3	8.4	6,585	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
		千株	千株	千円
パナソニック デバイスSUNX	8	7.2	3,355	
キーエンス	21.9	18.4	733,884	
日置電機	4.7	4.3	6,609	
シスメックス	31.6	67.9	242,403	
メガチップス	7.4	7.3	9,344	
OBARA GROUP	5.8	5.3	20,272	
日本電産コバル電子	9.3	8.4	6,946	
東京電波	2.7	—	—	
澤藤電機	6	6	1,248	
コーセル	13	11.8	13,747	
日立メディコ	7	—	—	
新日本無線	7	6	2,454	
オブテックス	5.7	5.1	8,904	
千代田インテグレ	4	3.6	5,598	
レーザーテック	3.2	8.3	8,441	
スタンレー電気	69.6	58.4	138,992	
岩崎電気	33	31	7,564	
ウシオ電機	54.3	49.2	61,598	
岡谷電機産業	4.9	4.4	1,663	
ヘリオス テクノ ホールディング	7.8	7	2,058	
日本セラミック	5.9	4.7	8,112	
遠藤照明	—	4.5	6,331	
日本デジタル研究所	7.6	6	9,678	
古河電池	6	6	4,032	
双信電機	4.5	4	1,444	
山一電機	9.7	—	—	
図研	5.2	5.3	4,457	
日本電子	33	32	10,944	
カシオ計算機	85.2	84.3	117,429	
ファナック	93	90.5	1,581,940	
日本シイエムケイ	19.4	19.2	4,780	
エンプラス	3.9	3.1	20,739	
大真空	—	16	6,304	
ローム	47.2	42.8	256,800	
浜松ホトニクス	34.9	33.7	165,298	
三井ハイテック	13	10.7	6,837	
新光電気工業	30.1	27.3	22,358	
京セラ	74.3	142.6	654,676	
太陽誘電	43.5	39.5	42,462	
村田製作所	93.8	85.1	730,413	
ユーシン	12.5	11.9	6,818	
双葉電子工業	16.6	15	22,995	
北陸電気工業	36	33	4,521	
ニチコン	28.2	25.6	20,044	
日本ケミコン	52	58	17,864	
KOA	11.3	10.2	9,822	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	千円
市光工業	22	22	3,300	
小糸製作所	45	44.5	103,373	
ミツバ	16	15.2	21,964	
スター精密	15.7	15.4	20,882	
大日本スクリーン製造	92	77	34,034	
キャノン電子	8.2	7.5	13,357	
キャノン	555.1	470.1	1,563,552	
リコー	269	243.8	302,555	
MUTOHホールディングス	12	11	5,005	
東京エレクトロン	75.2	72.8	453,980	
輸送用機器(11.5%)				
トヨタ紡織	31.2	28.3	33,139	
鬼怒川ゴム工業	17	15	7,155	
ユニプレス	15.7	13.1	28,060	
豊田自動織機	81.4	73.8	349,812	
モリタホールディングス	16	14	12,278	
三櫻工業	11.3	10.3	6,942	
デンソー	220.8	200.3	944,013	
東海理化電機製作所	20.9	21.4	37,878	
三井造船	346	314	61,544	
佐世保重工業	58	57	5,814	
川崎重工業	696	631	242,304	
名村造船所	—	15.8	13,193	
サノヤスホールディングス	—	9.8	2,126	
日本車輛製造	33	30	11,010	
ニチユ三菱フォークリフト	12	9	5,661	
近畿車輛	15	14	4,242	
日産自動車	1,128.9	1,138.1	1,055,018	
いすゞ自動車	518	470	292,340	
トヨタ自動車	1,148.1	1,128.5	6,390,695	
日野自動車	112	101.3	131,993	
三菱自動車工業	2,193	290.1	298,512	
エフテック	3.1	3.4	4,025	
レシップホールディングス	—	2.7	2,170	
GMB	—	1	1,294	
武蔵精密工業	9.5	8.6	19,513	
日産車体	31	39.6	66,132	
新明和工業	36	33	28,182	
極東開発工業	16.6	14	20,720	
日信工業	18.2	16.5	31,003	
トピー工業	67	67	12,395	
ティラド	30	32	7,904	
曙ブレーキ工業	41.5	37.7	18,284	
タチエス	12	11.9	18,837	
NOK	43.2	39.2	71,069	
フタバ産業	27.2	24.7	11,287	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	千円
カヤバ工業	68	76	32,224	
シロキ工業	20	18	3,600	
大同メタル工業	12	11	11,946	
プレス工業	38	32	11,808	
カルソニックカンセイ	61	55	35,255	
太平洋工業	18.2	16.5	12,787	
ケーヒン	18.5	18.6	28,402	
河西工業	11	11	7,491	
アイシン精機	81.8	74.2	273,056	
富士機工	10	9	3,447	
マツダ	1,415	1,208	532,728	
ダイハツ工業	95	86	152,048	
今仙電機製作所	6.6	6	8,064	
本田技研工業	753.9	729.7	2,578,759	
スズキ	186.8	169.5	520,365	
富士重工業	282	275.9	739,136	
ヤマハ発動機	135.9	123.3	201,718	
ショーワ	21.1	19.1	20,819	
T B K	9	9	4,374	
エクセディ	12.1	9.8	26,881	
豊田合成	25.3	26.2	52,321	
愛三工業	9.2	9.8	7,781	
ヨロズ	6.5	5.9	11,735	
エフ・シー・シー	14.6	13.3	22,649	
シマノ	36	35	366,450	
タカタ	16.2	14.7	32,795	
テイ・エス テック	18.9	17.1	45,981	
日本電産トソク	4.3	—	—	
精密機器(1.4%)				
テルモ	68.5	124.3	267,120	
クリエートメディック	2.7	2.7	2,616	
日機装	31	26.3	30,508	
島津製作所	107	104	90,688	
JMS	15	15	4,275	
ショットモリテックス	1.9	1.8	455	
長野計器	6.3	5.2	3,328	
プイ・テックロジ	0.019	1.7	6,417	
東京計器	29	28	6,608	
愛知時計電機	11	11	3,135	
東京精密	16	14.6	26,557	
マニー	2.7	2.2	10,450	
ニコン	166.9	151.4	245,570	
トプコン	20.6	21.8	43,665	
オリンパス	105.4	120.8	394,412	
理研計器	7.3	7.2	7,214	
タムロン	6.9	6.2	14,731	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
		千株	千株	千円
HOYA	217.3	197.1	622,836	
ノーリツ鋼機	8.1	7.3	4,635	
エー・アンド・デイ	8.1	7.4	3,618	
日本電産コパル	7	—	—	
シチズンホールディングス	100.9	99.8	78,742	
リズム時計工業	40	37	5,291	
大研医器	1.1	2.8	4,393	
松風	4.4	4	3,536	
セイコーホールディングス	57	52	21,580	
ニプロ	47.6	43.2	38,361	
その他製品(1.5%)				
パラマウントベッドホールディングス	7.7	7.8	26,169	
SHO-BI	2.4	2.7	1,098	
前田工繊	1	7.8	11,068	
永大産業	12	11	5,137	
アートネイチャー	—	2.7	7,892	
ダンロップスポーツ	4.9	4.4	5,420	
バンダイナムコホールディングス	92.4	89.4	195,786	
共立印刷	13.6	15	3,960	
フランスベッドホールディングス	56	51	9,333	
パイロットコーポレーション	0.08	7.2	30,636	
トップバン・フォームズ	16	14.5	13,731	
フジールインターナショナル	10.9	9.9	30,244	
タカラトミー	30.9	26.8	13,775	
廣済堂	7.6	7.5	3,225	
タカノ	4	4.3	2,339	
プロネクサス	10.5	8.5	6,689	
ホクシン	6.3	8.8	1,135	
ウッドワン	18	14	4,046	
大建工業	37	34	9,656	
凸版印刷	252	229	169,231	
大日本印刷	272	247	248,235	
図書印刷	18	15	6,405	
共同印刷	30	26	7,540	
日本写真印刷	13.8	13.7	21,591	
光村印刷	9	8	2,048	
宝印刷	5.1	4.8	3,537	
アシックス	83.3	80.6	175,708	
ツツミ	4.5	4.1	9,335	
ローランド	8	7.8	14,609	
小松ウオール工業	3.5	2.8	6,440	
ヤマハ	65.7	59.6	96,134	
河合楽器製作所	34	29	5,626	
クリナップ	9.2	8.8	7,638	
ビジョン	6.8	13.3	63,308	
兼松日産農林	14	13	1,898	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
		千株	千株	千円
キングジム	7.5	6.8	5,100	
リンテック	19.2	19.3	36,399	
イトーキ	19.1	17.6	14,836	
任天堂	51.1	49.9	589,319	
三菱鉛筆	7.4	6.8	19,842	
タカラスタンダード	41	34	26,996	
コクヨ	46.5	42.2	33,042	
ナカバヤシ	19	17	3,434	
グロープライド	43	43	5,074	
岡村製作所	34	31	27,280	
美津濃	44	40	24,680	
アデランス	11.2	10.2	15,422	
電気・ガス業(2.1%)				
東京電力	758	687.8	269,617	
中部電力	273.4	267.2	323,579	
関西電力	364.7	330.9	304,758	
中国電力	123.5	112.1	152,119	
北陸電力	87.5	79.4	102,584	
東北電力	223.3	202.6	215,971	
四国電力	80.5	73	96,579	
九州電力	197.4	179.1	199,159	
北海道電力	83.6	75.9	55,938	
沖縄電力	5.3	5.3	17,304	
電源開発	55.5	50.3	148,032	
東京瓦斯	1,073	951	545,874	
大阪瓦斯	867	839	336,439	
東邦瓦斯	227	206	107,120	
北海道瓦斯	16	16	4,416	
西部瓦斯	101	91	23,023	
静岡瓦斯	23.5	21.1	13,145	
陸運業(4.0%)				
SBSホールディングス	—	5.1	2,743	
東武鉄道	507	460	232,760	
相鉄ホールディングス	143	139	50,457	
東京急行電鉄	526	477	335,331	
京浜急行電鉄	230	208	174,304	
小田急電鉄	286	260	240,760	
京王電鉄	250	227	169,569	
京成電鉄	134	122	114,802	
富士急行	24	22	22,770	
新京成電鉄	11	10	3,730	
東日本旅客鉄道	164.8	149.2	1,147,944	
西日本旅客鉄道	77	73.2	315,858	
東海旅客鉄道	74.3	72.6	978,285	
西武ホールディングス	—	64.6	134,368	
鴻池運輸	3.6	5.7	9,878	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
		千株	千株	千円
西日本鉄道	116	105	41,370	
ハマキョウレックス	2.6	2.3	6,660	
サカイ引越センター	1.6	1.3	4,322	
近畿日本鉄道	807	816	296,208	
阪急阪神ホールディングス	564	544	308,448	
南海電気鉄道	186	169	68,614	
京阪電気鉄道	200	171	70,794	
神戸電鉄	—	20	6,840	
名糖運輸	3.7	3.3	2,171	
名古屋鉄道	312	285	100,605	
山陽電気鉄道	—	30	13,110	
日本通運	354	321	161,142	
ヤマトホールディングス	166.4	148.8	322,152	
山九	109	99	44,847	
丸運	4.8	5.1	1,218	
丸全昭和運輸	30	27	9,315	
センコー	36	32	16,384	
トナミホールディングス	18	17	3,655	
日本梱包運輸倉庫	27.3	24.8	43,400	
日本石油輸送	10	9	2,025	
福山通運	54	49	30,037	
セイノーホールディングス	69	58	65,656	
神奈川中央交通	10	10	5,040	
日立物流	15.5	16.9	27,513	
海運業(0.4%)				
日本郵船	709	687	204,726	
商船三井	440	457	169,090	
川崎汽船	399	360	78,120	
NSユニテッド海運	38	43	10,105	
乾汽船	11.7	13.4	4,180	
飯野海運	43.8	36.1	18,663	
共栄タンカー	18	16	3,168	
空運業(0.5%)				
日本航空	100.6	68.5	365,790	
ANAホールディングス	1,756	1,594	355,462	
スカイマーク	—	23	6,187	
パスコ	8	7	2,800	
倉庫・運輸関連業(0.2%)				
トランコム	2.4	2.3	8,418	
日新	34	31	9,114	
三菱倉庫	63	53	78,652	
三井倉庫	41	41	16,318	
住友倉庫	60	54	27,432	
澁澤倉庫	23	19	6,080	
東陽倉庫	14	14	3,500	
日本トランスシティ	20	17	5,576	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
		千株	千株	千円
ケイヒン	16	15	2,175	
中央倉庫	—	4.7	4,042	
安田倉庫	6.9	6.3	6,350	
東洋埠頭	26	23	4,807	
宇徳	7.2	6.6	2,376	
上組	99	97	89,143	
サンリツ	2.3	2	1,010	
キムラユニティ	2	1.8	1,654	
キューソー流通システム	2.5	2.6	2,620	
郵船ロジスティクス	7	7.4	8,036	
近鉄エクスプレス	8	7.3	28,616	
東海運	4.8	4.4	1,144	
ユーアイティ	1.4	3	2,283	
情報・通信業(7.2%)				
NECネットエスアイ	8.3	8.8	20,671	
システナ	9.4	7.8	5,608	
デジタルアーツ	3.3	2.8	2,399	
新日鉄住金ソリューションズ	5.9	6.7	16,897	
キューブシステム	—	1.7	1,375	
コア	3.3	3	2,178	
ソフトクリエイトホールディングス	1	2.6	2,108	
デジタルハーツ	1.6	—	—	
ITホールディングス	29.3	28.7	49,019	
ネオス	0.018	1.7	1,484	
電算システム	1	2.5	3,217	
グリー	45.7	48.2	43,910	
コーエーテクモホールディングス	17.5	15.8	19,686	
三菱総合研究所	3.4	3.1	7,139	
ボルテージ	1.3	1.4	1,787	
電算	0.5	0.7	1,446	
AGS	—	1.7	1,373	
ヒト・コミュニケーションズ	—	1.1	1,867	
ブレインパッド	—	0.8	1,048	
KL a b	3	5.6	4,228	
ポールトゥウィン・ビット クルーホールディングス	1.5	4.8	5,827	
イーブックイニシアティブジャパン	—	1.5	1,681	
ネクソン	72.6	66.4	59,361	
アイスタイル	1.9	2.6	1,157	
エムアップ	—	1.9	967	
エイチーム	0.6	1	5,590	
e n i s h	—	1.5	2,397	
コプロラ	—	13.9	32,901	
モバイルクリエイト	—	0.9	2,799	
オルトプラス	—	1.4	1,808	
ブロードリーフ	8.3	10.5	18,858	

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	評 価 額	株 数
		千株	千円		千株	千円
ハーツユニテッドグループ	—	1.8	3,780			
ドワンゴ	0.04	9.2	24,518			
ベリサーブ	0.005	0.5	861			
マクロミル	6.9	—	—			
ティーガイア	11	8	7,624			
豆蔵ホールディングス	—	6.2	2,349			
テクマトリックス	2.6	3.4	1,992			
GMOペイメントゲートウェイ	3.1	3.5	13,195			
ザッパラス	0.049	4.4	2,824			
インターネットイニシアティブ	10.3	11.8	31,081			
ビットアイル	—	9	5,679			
SRAホールディングス	4.3	3.8	5,912			
システムインテグレータ	—	0.8	613			
朝日ネット	7	7.4	3,751			
コムチュア	—	0.9	1,544			
パソニック インフォメーションシステムズ	2.1	1.6	4,078			
フェイス	0.302	2.4	2,407			
野村総合研究所	50	45.3	151,981			
サイバネットシステム	0.073	6.5	2,242			
インテジホールディングス	2.6	4.3	5,306			
東邦システムサイエンス	—	1.3	1,037			
シンプレクス・ホールディングス	0.165	—	—			
ソースネクスト	2.2	4	2,460			
ティー・ワイ・オー	—	7.7	1,270			
クレスコ	2	1.8	2,221			
フジ・メディア・ホールディングス	0.853	77.4	125,001			
オービック	3.04	27.6	88,734			
ジャストシステム	—	10.9	9,221			
TDCソフトウェアエンジニアリング	1.8	1.7	1,407			
ヤフー	6.384	573.5	260,942			
トレンドマイクロ	35	35.3	111,901			
日本オラクル	17.6	12.8	58,304			
アルファシステムズ	2.9	2.6	3,601			
フューチャーアーキテクト	0.107	9.6	5,616			
CAC Holdings	5.4	4.9	5,458			
ソフトバンク・テクノロジー	2.1	1.9	2,770			
トーセ	2.2	2	1,444			
オービックビジネスコンサルタント	2.8	4.1	12,853			
伊藤忠テクノソリューションズ	10.4	9.1	38,993			
アイティフォー	9.9	8.9	3,729			
東計電算	1.6	1.4	1,925			
エックスネット	0.008	0.7	949			
大塚商会	7.9	7.2	96,984			
サイボウズ	0.148	12	4,248			
ソフトブレーン	0.132	10.9	1,427			
アグレックス	2.4	1.9	1,989			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	評 価 額	株 数
		千株	千円		千株	千円
電通国際情報サービス	5.5	4.9	5,880			
EMシステムズ	1.4	1.1	1,887			
ウェザーニューズ	2.3	2.4	6,484			
C I J	8.2	7.4	3,182			
東洋ビジネスエンジニアリング	—	0.8	1,166			
日本エンタープライズ	—	5	1,150			
WOWOW	0.027	2.5	8,987			
日本コロムビア	—	4	2,520			
イマジカ・ロボット ホールディングス	—	4.2	2,242			
ネットワンシステムズ	32.1	31.4	24,240			
アルゴグラフィックス	3.2	3	4,857			
マーベラスAQL	0.107	12.1	9,837			
エイベックス・グループ・ホールディングス	16.7	14.7	25,181			
日本ユニシス	24.4	19.3	16,713			
兼松エレクトロニクス	5.6	5	6,990			
東京放送ホールディングス	47.6	43.2	49,593			
日本テレビホールディングス	80.5	79.7	130,787			
テレビ朝日ホールディングス	22.4	20.3	35,788			
スカパーJ SATホールディングス	0.766	60.7	31,806			
テレビ東京ホールディングス	6.4	6.5	9,626			
コネクシオ	7.8	7	5,915			
クロップス	—	0.5	249			
MXモバイルリング	3.4	—	—			
日本電信電話	371.3	314.4	1,881,369			
KDD I	248.9	248.4	1,472,763			
光通信	8.9	7.2	57,312			
NTTドコモ	7.267	659.4	1,115,045			
GMOインターネット	29.5	26.7	27,741			
学研ホールディングス	28	27	7,344			
ゼンリン	11.7	10.6	11,384			
昭文社	5.3	4.8	2,985			
KADOKAWA	7.6	8.1	25,677			
インプレスホールディングス	7.5	5.6	666			
アイネット	3.9	3.3	2,465			
松竹	58	53	45,951			
東宝	62.9	57.1	124,649			
東映	37	33	18,018			
AOI Pro.	4.1	3.7	2,297			
エヌ・ティ・ティ・データ	0.545	56.5	211,310			
DTS	8.4	7.6	13,406			
スクウェア・エニックス・ホールディングス	32	29.1	43,126			
シーイーシー	5.8	4.7	2,848			
カブコン	16.9	20.5	34,829			
ジャストテック	5.1	5.1	3,590			
S C S K	21	19	50,046			
日本システムウエア	3.4	3	1,518			

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
アイネス	12	10.9	6,986	
TKC	7.4	6.7	15,175	
富士ソフト	12.2	10.2	21,868	
NSD	17.4	17	22,134	
コナミ	39.8	36.1	85,593	
福井コンピュータホールディングス	1.3	1.1	894	
JBCホールディングス	7.4	6.7	4,991	
ミログ情報サービス	6	5.3	2,162	
ソフトバンク	427.2	393	2,842,962	
卸売業(4.7%)				
ハウスイ	7	7	875	
高千穂交易	3.7	3.4	3,440	
伊藤忠食品	2.2	2	6,940	
エレマテック	4.1	3.8	6,783	
JALUX	2.5	2.3	2,541	
あらた	20	18	5,778	
トーマンデバイス	1.3	1.2	2,076	
東京エレクトロニクス デバイス	0.018	1.6	2,137	
双日	555.6	535.6	87,838	
アルフレッサ ホールディングス	22.8	23.7	145,518	
横浜冷凍	21.9	19.9	15,641	
山下医科器械	0.7	0.7	1,301	
ラサ商事	3.9	3.5	1,634	
アルコニックス	2.5	2.4	5,796	
神戸物産	—	1.1	3,426	
あい ホールディングス	15.7	12.8	22,886	
ダイワボウホールディングス	80	73	13,505	
バイタルケ-エスケ-ホールディングス	16.6	15.1	11,189	
八洲電機	6.5	6.3	2,828	
UKCホールディングス	5.3	5.2	8,106	
TOKAIホールディングス	34.6	39.2	14,151	
三洋貿易	—	4.8	5,155	
ミタチ産業	2.1	1.9	1,090	
シップヘルスケアホールディングス	12.6	11.5	41,112	
スターティア	—	0.7	1,010	
富士興産	3.2	2.9	1,858	
協栄産業	11	10	1,790	
小野建	7.7	7	8,008	
佐島電機	6.6	6.4	4,070	
エコートレーディング	2.2	2	1,386	
伯東	5.4	4.9	4,635	
コンドーテック	7.2	6.6	4,620	
中山福	5.1	4.6	3,762	
ナガイレーベン	11.7	11.6	24,789	
三菱食品	9.7	8.8	21,181	
松田産業	6.5	5.9	7,144	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
メディカルホールディングス	88.2	80.1	114,462	
アドヴァン	4.5	4.1	4,444	
SPK	2.1	1.9	3,496	
アズワン	5.8	5.2	16,328	
スズデン	2.9	2.9	1,754	
尾家産業	2.9	2.6	2,124	
シモジマ	5.4	5.5	5,835	
ドウシシヤ	9.4	8.5	13,268	
高速	5.3	4.8	4,334	
黒田電気	11.8	12.8	18,752	
丸文	7.9	7.1	3,983	
ハビネット	5.4	4.9	6,085	
トーマンエレクトロニクス	4.5	4	6,576	
エクセル	3.8	3.7	6,589	
マルカキカイ	2.9	2.6	3,551	
ガリバーインターナショナル	29.7	27	21,681	
日本エム・ディ・エム	8.2	6.8	1,904	
進和	5.2	4.8	5,702	
エスケイジャパン	2.2	2.1	514	
ダイトエレクトロニクス	4.1	3.8	1,485	
シークス	5.6	5.1	8,109	
田中商事	3	2.5	1,482	
オーハシテクニカ	4.8	4.1	3,575	
マクニカ	4.5	4.1	12,402	
白銅	2.9	2.6	2,407	
伊藤忠商事	703.6	638.4	771,187	
丸紅	723	700	489,300	
高島	17	15	3,615	
ヨンドシーホールディングス	6.7	—	—	
長瀬産業	50	45.3	54,722	
蝶理	5.7	5.1	5,916	
豊田通商	98.3	89.2	242,178	
三共生興	15.1	13.7	5,219	
兼松	188	170	28,560	
ツカモトコーポレーション	15	14	1,848	
三井物産	761.3	723.6	1,125,921	
日本紙パルプ商事	46	42	14,238	
日立ハイテクノロジーズ	26.8	24.3	55,379	
カメイ	10.5	10.5	8,001	
東都水産	16	14	2,632	
OUGホールディングス	—	12	2,424	
スターゼン	29	29	8,004	
山善	33.9	30.8	20,697	
椿本興業	10	9	2,538	
住友商事	520.5	472.3	630,992	
内田洋行	20	20	6,080	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	千株	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
三菱商事	688.2		624.4	1,256,917
第一実業	20		18	7,902
キャノンマーケティングジャパン	29.4		22.8	39,352
西華産業	31		26	6,292
佐藤商事	7.9		7.2	4,723
菱洋エレクトロ	10.4		9.3	11,466
東京産業	9		8	3,184
ユアサ商事	90		82	16,400
神鋼商事	22		20	4,560
小林産業	—		5.4	1,582
阪和興業	88		80	32,880
カナデン	9		8	5,680
菱電商事	13		12	8,292
フルサト工業	4.5		4.4	5,196
岩谷産業	98		89	52,154
すてきなイスグループ	35		34	6,460
昭光通商	32		26	3,640
ニチモウ	13		13	2,171
極東貿易	10		9	1,782
イワキ	13		12	2,376
三愛石油	21		19	13,737
稲畑産業	21.7		19.7	17,651
G S I クレオス	24		21	2,667
明和産業	7.1		7.5	3,360
ワキタ	—		15.7	19,012
東邦ホールディングス	28.3		25.6	49,920
サンゲツ	15.6		14.2	37,218
ミツウロコグループホールディングス	14.3		12.9	7,120
シナネン	19		17	6,613
伊藤忠エネクス	19.5		17.7	11,363
サンリオ	22.3		20.2	55,913
サンワテクノス	4.3		4.3	4,196
リョーサン	14.4		11.9	23,740
新光商事	9.7		8.8	8,008
トーヨー	18		17	6,273
三信電気	12.7		9.6	6,134
東陽テクニカ	12.1		11.8	13,227
モスフードサービス	11.6		10.5	22,039
加賀電子	8.8		7.3	9,030
ソーダニッカ	9		8	3,456
立花エレテック	5.4		4.9	5,904
P a l t a c	10.5		11.2	15,422
ヤマタネ	41		40	6,560
丸紅建材リース	8		7	1,442
日鉄住金物産	20		53	19,451
トラスト中山	10.1		9.2	20,801

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	千株	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
オートバックスセブン	32.6		28.1	46,365
加藤産業	12.7		11.5	24,667
イノテック	7.7		7.4	3,367
イエコロハット	8.3		6.9	14,924
富士エレクトロニクス	4.6		4.1	5,120
J Kホールディングス	7.4		7.3	3,854
日伝	4		3.6	8,604
北沢産業	7		6.8	1,190
杉本商事	4.8		4.3	4,145
因幡電機産業	10.4		11	34,760
住金物産	46		—	—
パイテック	2.1		2.8	2,058
ミスミグループ本社	32.8		32.1	85,546
江守グループホールディングス	2		3.4	5,899
アルテック	4.3		3.9	904
タキヒヨー	13		13	5,304
スズケン	33.9		33.1	118,001
ジェコス	6.1		5.5	5,181
小売業(4.3%)				
ローソン	33.4		32.8	236,816
サンエー	3.3		6	17,250
キリン堂	3.2		2.9	1,908
ダイユーエイト	1.8		1.6	1,030
カワチ薬品	6.1		5.6	10,410
ユービーシー・マート	10.4		11.4	58,140
ハードオフコーポレーション	4.3		3.9	3,315
アスクル	7.5		8.3	20,285
ゲオホールディングス	0.151		13.7	11,412
アダストリアホールディングス	8.13		6.1	13,975
シー・ヴィ・エス・ペリエリア	11		10	1,720
くらコーポレーション	5.2		4.7	9,804
キャンドウ	4.7		3.8	5,935
パル	5.1		4.7	10,391
エディオン	38.1		36.7	26,313
サーラコーポレーション	7.6		6.9	3,698
ワッツ	—		3.2	2,902
あみやき亭	0.015		1.4	4,487
ひらまつ	9.1		9.8	6,036
ゲンキー	0.8		0.8	2,148
大黒天物産	1.8		1.9	4,867
ハニーズ	6.98		6.3	5,865
アルペン	6.7		7.1	12,417
クオール	2.9		5.9	3,475
ジェイアイエヌ	—		5.4	15,363
ビックカメラ	0.335		34.7	25,539
D C Mホールディングス	43.5		38.7	26,857

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
		千株	千株	千円
Monotaro	11.9	12.4	29,177	
J. フロント リテイリング	208	189	138,537	
ドール・日レスホールディングス	15.5	14	24,430	
マツモトキヨシホールディングス	14.9	16.5	58,327	
ブロンコピラー	0.6	1.3	3,012	
スタートトゥデイ	24.4	24.9	61,478	
物語コーポレーション	1.2	2	6,240	
ココカラファイン	9.2	8.3	24,402	
三越伊勢丹ホールディングス	175.3	159.1	214,148	
ウエルシアホールディングス	3.1	3.6	22,392	
クリエイトSDホールディングス	3.7	3.4	11,560	
丸善CHIホールディングス	5.1	7	2,240	
エー・ピーカンパニー	—	0.9	1,962	
チムニー	—	2.9	6,423	
ジョイフル本田	—	4.4	23,672	
ブックオフコーポレーション	4.9	4.4	3,242	
あさひ	5.1	4.6	6,196	
日本調剤	1.12	1.01	2,646	
コスモス薬品	4.4	4.5	47,070	
トーエル	—	4.3	2,356	
一六堂	1.1	1.7	763	
セブン&アイ・ホールディングス	369	334.8	1,366,653	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	—	1.3	3,625	
ツルハホールディングス	8.7	15.8	84,688	
サンマルクホールディングス	2.8	2.6	13,000	
フェリシモ	2.5	2.3	2,341	
トリドール	7.6	6.9	6,486	
クスリのアオキ	1.3	3.6	12,924	
メディカルシステムネットワーク	5.2	6.6	2,303	
総合メディカル	2.1	1.9	8,018	
はるやま商事	3.7	3.3	2,336	
カップ・クリエイトホールディングス	6.5	11.7	11,547	
ライトオン	6.6	6	4,212	
良品計画	9.4	8.5	95,115	
三城ホールディングス	10.9	9.9	4,989	
コナカ	11	9.4	6,222	
ハウス オブ ローゼ	1	0.9	1,228	
G-7ホールディングス	2.6	2.4	1,910	
イオン北海道	5.5	6	3,630	
コジマ	13	11.8	3,764	
ヒマラヤ	2.1	1.9	2,019	
コーナン商事	11.6	10.5	10,668	
エコス	3	2.7	1,827	
ワタミ	10.4	9.5	12,426	
マルシェ	2.2	1.9	1,563	
ドンキホーテホールディングス	25.8	27.6	167,808	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
		千株	千株	千円
メガネトップ	16.2	—	—	—
西松屋チェーン	17.4	15.8	12,387	
ゼンショーホールディングス	33.6	36.7	35,378	
幸楽苑	5.4	5	6,670	
ハークスレイ	2.5	2.2	1,724	
サイゼリヤ	13.1	11.9	14,875	
ポプラ	3.5	2.9	1,563	
ユナイテッドアローズ	9.4	10.5	43,942	
ハイデイ日高	4.6	5.1	11,026	
京都きもの友禅	5.8	5.3	5,363	
コロナイド	29.5	26.5	28,858	
壱番屋	3.5	3.2	12,688	
トップカルチャー	3.2	2.9	1,319	
P L A N T	—	2	1,942	
スギホールディングス	14.1	14.4	69,624	
スクロール	11.5	10.4	2,620	
ヨンドシーホールディングス	—	6.1	11,327	
ファミリーマート	27.1	27.1	118,291	
木曽路	10.8	9.8	18,463	
サトレストランシシステムズ	—	7.5	5,782	
千趣会	15.9	14.4	12,600	
タカキュー	7	6.2	1,252	
ケーヨー	14.9	13.6	6,460	
上新電機	19	17	14,824	
日本瓦斯	12.1	11.9	22,943	
ベスト電器	27.6	25.8	3,895	
マルエツ	20	16	5,600	
ロイヤルホールディングス	14.7	13.4	21,091	
東天紅	6	6	1,050	
いなげや	9.9	9	9,090	
島忠	20	19.4	44,212	
チヨダ	10.4	9.4	21,939	
ライフコーポレーション	5.7	6.4	10,412	
カスミ	18.1	16.4	11,775	
リンガーハット	8	7.8	11,871	
MrMax	8.8	8	2,672	
テンアライド	6.6	6	1,836	
AOKIホールディングス	7.6	13.8	20,189	
オークワ	14	13	12,129	
コメリ	13.6	12.3	34,624	
青山商事	24.3	20.1	55,074	
しまむら	10.2	9.3	92,442	
CFSコーポレーション	5.9	6	2,874	
はせがわ	2.7	2.8	1,607	
高島屋	120	108	108,648	
松屋	18.5	17.2	17,698	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	千円
エイチ・ツー・オー リテイリング	57	47	38,117	
近鉄百貨店	—	31	11,129	
ニッセンホールディングス	15.9	16	6,400	
パルコ	16.9	7.7	6,206	
丸井グループ	115.2	104.4	101,790	
アクシアル リテイリング	4.9	4.4	7,031	
ダイエー	51.05	49.4	15,363	
イズミヤ	35	32	15,552	
イオン	311	319.7	395,468	
ユニグループ・ホールディングス	85.3	76.7	49,778	
イズミ	22.1	17.9	57,101	
東武ストア	12	11	2,948	
平和堂	18.3	16.3	24,221	
フジ	9.8	8.9	17,826	
ヤオコー	4.5	4	19,760	
ゼビオ	12	9.7	19,341	
ケーズホールディングス	22	16.9	51,798	
O l y m p i c グループ	5.2	4.7	4,624	
日産東京販売ホールディングス	13	12	3,660	
アインファーマシーズ	5.3	4.4	20,460	
元気寿司	2.7	2.5	4,127	
ヤマダ電機	40.23	316.3	122,091	
アークランドサカモト	5.7	5.2	11,060	
ニトリホールディングス	17.45	31.7	160,085	
グルメ杵屋	6	6	4,488	
愛眼	7	6.4	1,715	
ケーユーホールディングス	—	3.4	2,067	
吉野家ホールディングス	0.239	21.7	28,383	
松屋フーズ	4.2	3.8	6,919	
サガミチェーン	10	10	9,410	
関西スーパーマーケット	—	6	4,818	
王将フードサービス	—	5.3	21,677	
ブレナス	9.9	8.9	19,936	
ミニストップ	6.5	6	9,342	
アークス	15	13.7	28,208	
パロー	19	17.2	27,932	
藤久	—	0.6	996	
ベルク	4.4	3.9	8,396	
大庄	4.1	4.3	5,491	
ファーストリテイリング	20.6	16	544,240	
サンドラッグ	16.8	16.9	77,486	
東京デリカ	3.1	4	6,932	
ヤマザワ	2.3	1.9	2,958	
やまや	1.8	1.6	3,049	
ペルーナ	11	20	9,840	
銀行業(9.1%)				
島根銀行	2	1.7	2,198	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	千円
じもとホールディングス	63.3	57.4	11,480	
足利ホールディングス	—	42	16,422	
新生銀行	763	692	148,088	
あおぞら銀行	321	415	128,650	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,678.6	6,062.2	3,497,889	
りそなホールディングス	907.2	760.7	404,692	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,732	1,572	646,092	
三井住友フィナンシャルグループ	667	605.2	2,482,530	
第四銀行	112	101	36,764	
北越銀行	89	86	17,802	
西日本シティ銀行	309	281	61,539	
千葉銀行	340	309	202,086	
横浜銀行	545	520	292,240	
常陽銀行	333	298	148,702	
群馬銀行	198	179	96,123	
武蔵野銀行	14.1	12.8	43,008	
千葉興業銀行	16.9	16.6	11,520	
筑波銀行	36.6	33.3	11,488	
東京都民銀行	16.7	14.1	15,933	
七十七銀行	138	125	61,000	
青森銀行	65	59	16,638	
秋田銀行	61	55	14,905	
山形銀行	54	49	22,099	
岩手銀行	6.4	5.2	22,776	
東邦銀行	74	72	24,552	
東北銀行	45	41	5,945	
みちのく銀行	44	43	9,030	
ふくおかフィナンシャルグループ	358	325	141,375	
静岡銀行	258	234	223,002	
十六銀行	110	100	34,400	
スルガ銀行	86	78	134,862	
八十二銀行	163	148	83,324	
山梨中央銀行	52	51	22,848	
大垣共立銀行	118	100	27,500	
福井銀行	76	68	16,048	
北國銀行	99	89	30,260	
清水銀行	3	2.7	7,020	
滋賀銀行	83	75	42,600	
南都銀行	86	77	30,184	
百五銀行	79	72	28,656	
京都銀行	158	153	130,509	
紀陽銀行	—	31.4	39,124	
三重銀行	36	33	7,260	
ほくほくフィナンシャルグループ	600	544	107,712	
広島銀行	260	236	106,200	
山陰合同銀行	51	49	34,398	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	千円
中国銀行	66	57.6	82,483	
鳥取銀行	28	25	4,775	
伊予銀行	94	85.6	79,864	
百十四銀行	97	88	30,888	
四国銀行	64	58	12,528	
阿波銀行	72	65	36,140	
鹿児島銀行	61	56	35,504	
大分銀行	52	49	17,199	
宮崎銀行	59	53	17,066	
肥後銀行	72	65	33,800	
佐賀銀行	53	49	10,633	
十八銀行	55	50	12,400	
沖縄銀行	6.6	5.9	25,547	
琉球銀行	18.3	15.5	21,421	
八千代銀行	4.5	3.8	11,571	
セブン銀行	297.4	299.8	113,324	
みずほフィナンシャルグループ	11,398.5	10,384.9	2,056,210	
紀陽ホールディングス	351	—	—	
高知銀行	—	31	4,588	
山口フィナンシャルグループ	88	80	77,440	
長野銀行	31	26	4,732	
名古屋銀行	80	72	26,928	
北洋銀行	132.9	120.6	47,395	
愛知銀行	3.2	2.9	14,529	
第三銀行	50	45	7,965	
中京銀行	36	33	5,874	
東日本銀行	38	35	8,750	
大光銀行	31	28	6,160	
愛媛銀行	52	47	10,904	
トマト銀行	34	31	5,332	
みなと銀行	80	72	12,672	
京葉銀行	73	66	30,360	
関西アーバン銀行	123	111	13,320	
栃木銀行	44	40	16,880	
北日本銀行	2.6	2.5	6,325	
東和銀行	97	97	9,021	
福島銀行	108	98	8,232	
大東銀行	56	51	5,610	
トモニホールディングス	67.7	61.4	25,910	
フィデアホールディングス	50.8	46.1	8,851	
池田泉州ホールディングス	72.8	60	28,860	
証券、商品先物取引業(1.6%)				
F P G	7.2	7.4	7,244	
S B I ホールディングス	113.3	97.3	112,770	
ジャフコ	12.5	11.3	46,330	
大和証券グループ本社	874	793	652,639	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	千円
野村ホールディングス	1,803.2	1,637	1,113,160	
岡三証券グループ	75	63	48,510	
丸三証券	27.4	23.8	17,588	
東洋証券	35	33	9,570	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	101.4	84.8	59,699	
水戸証券	29	25.7	8,943	
いちよし証券	20.4	15.7	20,692	
松井証券	52.4	40.7	40,984	
だいこう証券ビジネス	5.3	5.5	3,201	
マネックスグループ	1,001	87	29,928	
カブドットコム証券	35.6	31.4	13,690	
極東証券	12.3	10	15,410	
岩井コスモホールディングス	9	8.3	8,615	
マネースクウェア・ジャパン	—	2.7	2,843	
マネーパートナーズグループ	—	10.3	2,554	
保険業(2.3%)				
N K S J ホールディングス	195.9	177.8	506,374	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	263.6	239.2	569,774	
ソニーフィナンシャルホールディングス	84.5	76.7	130,006	
第一生命保険	4,717	402.8	614,270	
東京海上ホールディングス	341.6	310	979,290	
T & Dホールディングス	302.5	274.5	365,634	
その他金融業(1.4%)				
全国保証	10.3	20.8	51,854	
クレディセゾン	79.1	66.6	126,406	
芙蓉総合リース	9.3	9.2	36,846	
興銀リース	13.8	15.1	36,813	
東京センチュリーリース	22.2	19.1	60,929	
日本証券金融	39.9	40.1	25,343	
大阪証券金融	15	—	—	
ポケットカード	14	15.3	11,016	
リコーリース	6.4	6.6	17,958	
イオンフィナンシャルサービス	33.7	47.1	119,775	
アコム	19.24	168.7	67,311	
ジャックス	57	55	24,695	
オリエントコーポレーション	194.5	192.1	42,454	
日立キャピタル	18.7	16.8	41,798	
アプラスフィナンシャル	—	68.5	8,768	
オリックス	520.5	500.1	807,161	
三菱UFJリース	231.6	204.6	113,143	
日本取引所グループ	22.9	118.9	293,920	
イー・ギャランティ	3.8	4.6	9,365	
アサックス	0.015	1.4	1,652	
NECキャピタルソリューション	5.2	5.1	8,833	
不動産業(3.4%)				
日本駐車場開発	0.997	87.2	10,028	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価	額
		千株	千円	千円
ビューリック	117.3	135.1	186,167	
東京建物不動産販売	4.6	4.1	1,635	
三栄建築設計	2.7	3.2	2,633	
野村不動産ホールディングス	42.5	52.9	102,308	
プレサンスコーポレーション	—	1.9	5,342	
常和ホールディングス	2.8	2.8	9,730	
フージャースホールディングス	12.7	12	5,784	
オープンハウス	—	5	11,490	
東急不動産ホールディングス	—	177.5	143,775	
飯田グループホールディングス	—	35.1	53,632	
パーク24	46.2	42	80,598	
パラカ	—	3	2,211	
三井不動産	416	377	1,203,761	
三菱地所	617	560	1,394,400	
平和不動産	18	16.2	25,547	
東京建物	171	164	151,700	
ダイビル	24.3	23.6	23,812	
東急不動産	196	—	—	
京阪神ビルディング	14.8	13.3	7,009	
住友不動産	211	192	836,352	
大京	137	135	29,700	
テーオーシー	30.9	27.6	19,347	
東京楽天地	15	13	6,201	
レオパレス21	—	92	43,056	
フジ住宅	11.7	10.3	5,850	
空港施設	11.2	9.7	6,770	
明和地所	4.3	3.9	1,680	
住友不動産販売	3.23	5.8	17,150	
ゴールドクレスト	7.1	6.3	13,167	
東栄住宅	6.2	—	—	
日本エスリード	4.1	3.1	3,081	
東急リパブル	9.5	—	—	
飯田産業	10.2	—	—	
日神不動産	6.9	10.7	4,215	
アーネストワン	14.8	—	—	
タカラレーベン	10.2	26.3	8,994	
サンヨーハウジング名古屋	4.8	4.5	4,374	
イオンモール	40.3	51.6	133,747	
タクトホーム	0.049	—	—	
ファースト住建	—	3	4,035	
トーセイ	0.136	11	7,755	
穴吹興産	—	7	2,345	
エヌ・ティ・ティ都市開発	0.568	49.8	50,995	
サンフロンティア不動産	0.1	7.6	8,504	
エフ・ジェー・ネクスト	—	4.3	1,887	
ランドビジネス	5.9	4	1,560	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価	額
		千株	千円	千円
グランディハウス	6.6	6.3	2,072	
日本空港ビルデング	30.7	27.7	71,798	
サービス業(2.6%)				
日本工営	31	28	13,860	
ネクスト	4.2	7.5	6,832	
日本M&Aセンター	4.8	13.1	34,256	
ノバレーゼ	0.024	2.2	1,980	
アコーディア・ゴルフ	0.414	34.5	45,057	
タケエイ	1.3	5.9	5,876	
トラスト・テック	—	1.8	2,777	
パソナグループ	0.098	6.3	3,156	
CDS	—	1.8	1,692	
リンクアンドモチベーション	0.08	10.9	1,765	
GCAサヴィアン	4.4	5.1	4,360	
エス・エム・エス	5.2	4.8	11,812	
テンブホールディングス	12.7	18.5	56,887	
リニカル	2.6	2.7	2,338	
クックパッド	5.6	4.2	9,282	
エスクリ	3	3.7	3,189	
アイ・ケイ・ケイ	2.7	1.9	1,546	
学情	3.1	3.3	2,108	
スタジオアリス	4.3	3.5	5,173	
シミックホールディングス	3.5	3.4	5,038	
NECフィールディング	7.6	—	—	
総合警備保障	34	30.8	77,554	
カカコム	25.4	51.4	88,562	
ルネサンス	4.2	3.8	3,146	
ディップ	—	2.2	5,020	
オプト	—	4.5	3,388	
ツクイ	11.6	9.1	8,763	
総合臨床ホールディングス	—	3.8	1,850	
キャリアデザインセンター	—	3.1	2,821	
エムスリー	0.221	57	89,832	
ベストブライダル	0.028	5	3,010	
アウトソーシング	4.3	4.3	6,136	
ディー・エヌ・エー	46	45.6	60,648	
博報堂DYホールディングス	12.94	117.4	111,177	
ぐるなび	6.5	11.9	17,707	
一休	0.062	6	6,996	
ジャパンベストレスキューシステム	0.012	9.3	2,715	
ファンコミュニケーションズ	—	14.7	22,932	
ジェイコムホールディングス	1.7	1.7	1,230	
PGMホールディングス	0.139	11.9	12,376	
WDBホールディングス	—	1.2	1,557	
バリューコマース	0.038	5.8	5,208	
J Pホールディングス	3	18.9	7,919	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
イーピーエス	0.101	10	11,840	
プレステージ・インターナショナル	—	5.8	4,976	
アミューズ	2.9	2.4	3,993	
ドリームインキュベータ	0.036	2.2	3,302	
ケネディクス	0.89	102.5	45,612	
電通	84.9	79.9	319,999	
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.415	3.8	5,050	
ぴあ	2.7	2.5	4,377	
イオンファンタジー	3	2.8	3,511	
ネクシィーズ	3.4	3.8	3,157	
みらかホールディングス	24.4	22.3	106,482	
アルプス技研	3.8	3.4	3,427	
サニックス	13.6	12.3	19,003	
ダイオーズ	1.7	1.5	1,275	
日本空調サービス	2.3	4.2	2,822	
オリエンタルランド	27.8	22.9	384,720	
ダスキン	25.3	22.4	42,313	
明光ネットワークジャパン	9	8.4	9,878	
ファルコSDホールディングス	4.8	4.3	4,626	
秀英予備校	3.3	3.1	961	
田谷	1.4	1.3	969	
ラウンドワン	30.5	25	16,925	
リゾートトラスト	16.1	28.6	53,968	
ビー・エム・エル	5.5	5.5	21,835	
ワタベウエディング	2.8	2.8	1,699	
もしもしホットライン	15.4	15.8	15,894	
東急コミュニティー	2.4	—	—	
リソー教育	0.949	—	—	
早稲田アカデミー	1	1.3	1,004	
ユー・エス・エス	10.43	102.5	169,227	
東京個別指導学院	4.6	5.7	1,995	
楽天	—	367.4	481,294	
テー・オー・ダブリュー	3.1	2.8	1,920	
セントラルスポーツ	2.9	2.6	4,030	
フルキャストホールディングス	0.088	7.8	2,659	
リゾートソリューション	12	8	1,832	
リブセンス	0.8	4.8	4,060	
ジャパンマテリアル	—	1	2,101	
サクセスホールディングス	—	0.8	1,304	
アサンテ	—	1.6	1,932	
ERIホールディングス	—	2	2,390	
リロ・ホールディング	3.2	3.2	18,656	
東祥	—	2	3,416	
エイチ・アイ・エス	7.6	13.8	40,820	
共立メンテナンス	4.8	4.2	15,708	
イチネンホールディングス	11.1	9.6	7,142	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
建設技術研究所	5.1	5	5,025	
スペース	5.1	4.1	4,165	
燦ホールディングス	2	1.7	2,349	
スバル興業	7	6	2,046	
東京テアトル	36	32	4,384	
よみうりランド	20	19	8,208	
東京都競馬	72	65	18,460	
カナモト	11	10.8	41,418	
東京ドーム	71	65	32,760	
西尾レントオール	—	6.8	27,336	
トランス・コスモス	12.2	11.1	22,688	
乃村工藝社	20	16.6	11,736	
藤田観光	24	22	7,634	
KNT-CTホールディングス	—	27	4,563	
日本管財	3.4	3.6	8,434	
トーカイ	4.1	3.7	9,327	
白洋舎	12	11	2,684	
セコム	97.1	88.1	548,598	
セントラル警備保障	4.1	3.7	3,744	
丹青社	9	10.6	4,112	
メイテック	13.7	11.5	35,707	
アサツー ディ・ケイ	15.4	14.9	36,251	
応用地質	9.8	8.1	12,870	
船井総合研究所	9.6	8.7	7,212	
進学会	4.5	3.6	1,324	
ベネッセホールディングス	28.4	28.4	120,274	
イオンディライト	9	8.2	19,786	
ナック	4.2	4.3	5,792	
ニチイ学館	18.3	18.4	16,044	
ダイセキ	13.8	12.5	22,375	
ステップ	2.8	2.9	2,198	
合 計	株 数・金 額	株 数	千円	千円
	138,461	131,324	138,986,286	
	銘柄数<比率>	1,650銘柄	1,752銘柄	<97.9%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国 内	T O P I X	百万円 3,121	百万円 —

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	138,986,286	97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,490,107	2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	142,476,393	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 2014年5月29日現在
(A) 資 産	142,476,393,336円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,027,716,063
株 式(評価額)	138,986,286,600
未 収 入 金	117,482,391
未 収 配 当 金	1,353,263,636
未 収 利 息	2,646
差 入 委 託 証 拠 金	△8,358,000
(B) 負 債	467,625,506
未 払 金	209,751,208
未 払 解 約 金	257,874,298
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	142,008,767,830
元 本	142,862,692,642
次 期 繰 越 損 益 金	△853,924,812
(D) 受 益 権 総 口 数	142,862,692,642口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,940円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2013年5月30日 至 2014年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	2,760,582,136円
受 取 配 当 金	2,756,803,932
受 取 利 息	911,004
そ の 他 収 益 金	2,867,200
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,414,631,988
売 買 益	11,905,052,095
売 買 損	△8,490,420,107
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	101,381,430
取 引 益	664,234,615
取 引 損	△562,853,185
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	6,276,595,554
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△6,759,314,004
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△1,291,759,925
(G) 解 約 差 損 益 金	920,553,563
(H) 計 (D+E+F+G)	△853,924,812
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△853,924,812

(注1) (B) 有価証券売買損益および(C) 先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (G) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は156, 158, 053, 666円、期中追加設定元本額は32, 227, 641, 730円、期中一部解約元本額は45, 523, 002, 754円です。

※純資産総額が元本を下回っており、期末の差額は853, 924, 812円です。

※1口当たり純資産額は0. 9940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。

日本株式インデックス・オープン	17, 810, 416, 400円
DCマイセレクション50	16, 595, 504, 963円
DCマイセレクション75	15, 403, 226, 539円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	10, 385, 960, 748円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	8, 785, 681, 986円
SMT TOPIXインデックス・オープン	6, 347, 791, 246円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	5, 785, 895, 189円
DCマイセレクションS50	5, 739, 558, 104円
DCマイセレクション25	5, 085, 498, 998円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4, 426, 806, 742円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	4, 319, 353, 133円
DC日本株式インデックス・オープン	4, 059, 239, 092円
DCマイセレクションS75	3, 645, 301, 400円
POFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	3, 547, 993, 258円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	3, 002, 872, 933円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	2, 699, 301, 417円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	2, 542, 664, 076円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	2, 500, 724, 144円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2, 015, 922, 105円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	1, 895, 900, 764円
DCマイセレクションS25	1, 882, 848, 290円
DC日本株式インデックス・オープンS	1, 877, 295, 328円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1, 834, 045, 912円
バランスB(37. 5)VA1(適格機関投資家専用)	1, 746, 448, 736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)	1, 707, 891, 013円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1, 485, 048, 321円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1, 121, 692, 931円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	825, 787, 680円
日本株式ファンド・シリーズ2	508, 220, 331円
DCターゲット・イヤール ファンド2035	483, 319, 265円
DCターゲット・イヤール ファンド2025	468, 717, 148円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	409, 598, 549円
世界経済インデックスファンド	313, 580, 244円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	294, 348, 244円
DC世界経済インデックスファンド	275, 904, 740円
DCターゲット・イヤール ファンド2045	231, 011, 578円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	167, 410, 361円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	143, 408, 478円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	119, 168, 303円
マイセレクション75	109, 351, 482円
マイセレクション50	102, 163, 716円
マイセレクション25	63, 424, 801円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	32, 628, 830円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	24, 363, 952円
SBI資産設計オープン(分配型)	20, 644, 192円
DCターゲット・イヤール ファンド2015	13, 539, 830円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3, 683, 249円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1, 404, 888円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	129, 013円

外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日 2014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	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。

米国シティグループが同社の企業ブランドを「シティグループ」から「シティ」に変更したことに伴い、同社が算出するインデックスおよび指数開発者の名称が変更となりました。

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10期(2010年5月31日)	17,975	△5.4	295.732	△5.8	98.0	268,910
第11期(2011年5月30日)	17,698	△1.5	291.909	△1.3	98.3	233,417
第12期(2012年5月29日)	17,637	△0.3	290.859	△0.4	98.4	196,358
第13期(2013年5月29日)	23,637	34.0	391.203	34.5	98.7	244,967
第14期(2014年5月29日)	25,092	6.2	414.505	6.0	97.2	222,288

(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)	円	%		%	%	%
2013年 5月29日	23,637	—	391.203	—	98.7	0.0
5月末	23,550	△0.4	388.099	△0.8	98.8	0.0
6月末	22,549	△4.6	371.447	△5.1	97.9	0.8
7月末	22,694	△4.0	374.603	△4.2	98.1	0.5
8月末	22,613	△4.3	373.415	△4.5	98.1	0.3
9月末	22,934	△3.0	381.259	△2.5	97.6	1.1
10月末	23,508	△0.5	387.510	△0.9	98.3	0.2
11月末	24,332	2.9	400.816	2.5	98.7	0.0
12月末	24,939	5.5	410.483	4.9	97.2	1.0
2014年 1月末	24,528	3.8	404.629	3.4	98.2	0.3
2月末	24,690	4.5	407.861	4.3	98.0	0.6
3月末	25,043	5.9	413.385	5.7	98.6	0.1
4月末	25,168	6.5	415.471	6.2	98.1	0.4
(当期末)						
2014年 5月29日	25,092	6.2	414.505	6.0	97.2	1.3

(注1)騰落率は期首比です。

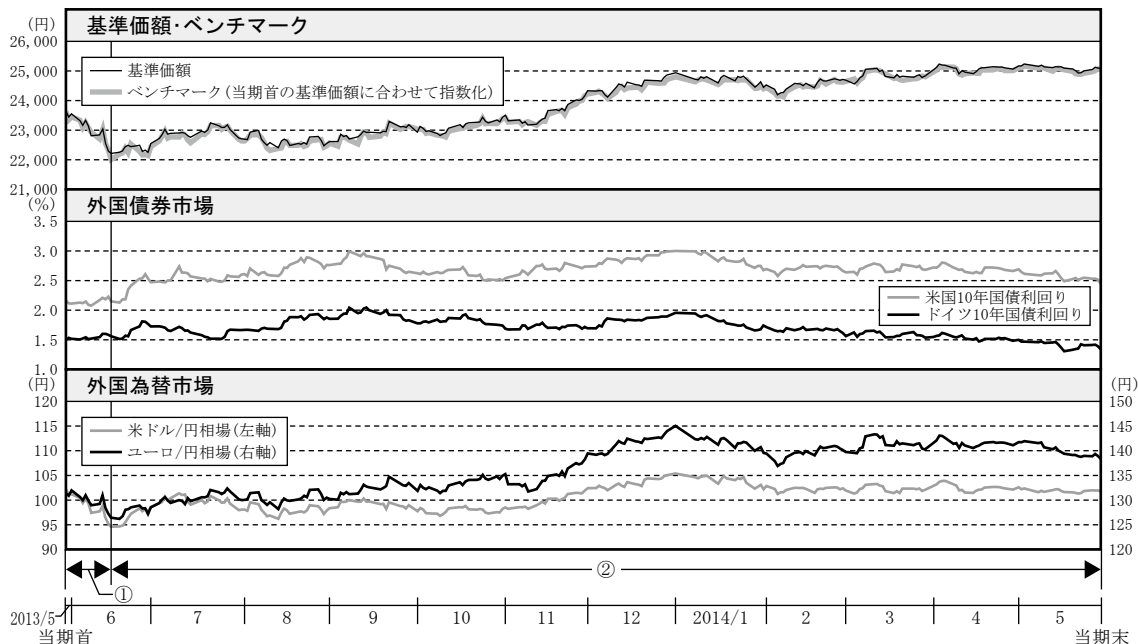
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

■ 基準価額の推移と変動要因



	①の期間	②の期間
基準価額の動き	下落	上昇
外国債券市場	米国では、雇用統計が底堅い内容であったことや、量的金融緩和の早期縮小観測を受けて利回りが上昇しました。欧州でも、米国に連れた動きに加え、ECB(欧州中央銀行)が2013年内における域内経済成長の回復見通しを示したことから利回りが上昇しました。	米国では、量的金融緩和の縮小観測を背景に利回りが上昇しました。1月以降はウクライナ情勢の緊迫化などから低下しましたが、通期では上昇しました。欧州では、ユーロ圏インフレ率の低下を受けてECBの量的金融緩和観測が強まり利回りが低下しました。
基準価額への影響	マイナス要因	プラス要因
外国為替市場	日銀金融政策決定会合で追加的な景気刺激策が発表されなかったことへの失望感や、アジア、欧州を中心に株式市場が大きく下落したことなどをを受けてリスク回避の動きが強まり、円高・米ドル安、ユーロ安が進みました。	FRB(米連邦準備理事会)による量的金融緩和の縮小観測を背景に円安・米ドル高が進みました。一方ECBは緩和的な金融政策スタンスを継続するものの、ユーロ圏内経済指標の改善を受けて円安・ユーロ高が進みました。
基準価額への影響	マイナス要因	プラス要因

◆パフォーマンス

当期の基準価額の騰落率は以下の通りです。

①当期首 (前期末) 基準価額	②当期末 基準価額	③差引 (②-①)	④騰落率 (③/①)	⑤ベンチマーク 騰落率	④-⑤
23,637円	25,092円	+1,455円	+6.16%	+5.96%	+0.20%

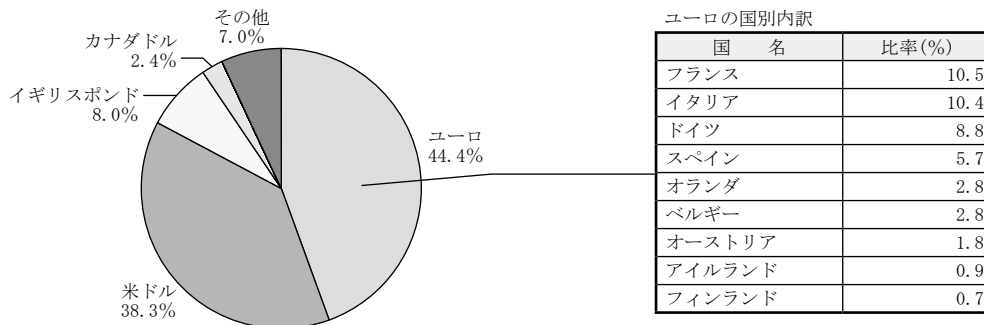
ベンチマーク騰落率との差異は+0.20%となりました。主な要因は、為替評価差^{※1}(+0.19%)です。

■運用状況

◆投資対象国・通貨の状況

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っています。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、投資銘柄も556銘柄になっています。

通貨別組入比率^{※2}(当期末)



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

※2 比率は、債券評価総額に対する評価額の比率です。(経過利子を含みます。)

◆デュレーション

ポートフォリオのデュレーション^{※1}は、ベンチマークとの連動を目標とし、期を通じ、約5.8年～6.2年で運用しました。

◆直利

当期末時点の直接利回り(直利)^{※2}は約2.9%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)のベンチマーク対象国の国債を中心に組み入れ、ベンチマークとの連動を高める運用を行ってまいります。

※1 デュレーションとは、債券価格の金利変動に対する感応度で、この値が大きいほど金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。

※2 直接利回り(直利) = (1年当たりの受取利息 / 当期末の債券時価) × 100 (%)

1万口当たりの費用明細

項 目	当 期
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション)	0円 (0)
(b) 保管費用等	7
合 計	7

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 売買委託手数料、(b) 保管費用等は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

売買および取引の状況

<公社債>

			当 期							
			買 付 額	売 付 額						
外 国	ア	メ	リ	カ	国 債 証 券	千米ドル 285,796	千米ドル 431,776			
	カ	ナ	ダ		国 債 証 券	千カナダドル 16,725	千カナダドル 27,554			
	メ	キ	シ	コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 70,856	千メキシコペソ 77,953			
	ユ ー ロ	ド	イ	ツ	国 債 証 券	千ユーロ 30,671	千ユーロ 53,584			
		イ	タ	リ	ア	国 債 証 券	34,947	59,034		
		フ	ラ	ン	ス	国 債 証 券	34,391	54,172		
		オ	ラ	ン	ダ	国 債 証 券	9,221	15,704		
		ス	ペ	イ	ン	国 債 証 券	27,003	35,336		
		ベ	ル	ギ	ー	国 債 証 券	10,131	15,307		
		オ	ー	ス	ト	リ	ア	国 債 証 券	5,623	10,513
		フ	ィ	ン	ラ	ン	ド	国 債 証 券	2,348	3,255
	ア	ィ	ル	ラ	ン	ド	国 債 証 券	1,955	3,981	
	イ	ギ	リ	ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 25,287	千イギリスポンド 35,925			
	ス	イ	ス		国 債 証 券	千スイスフラン 912	千スイスフラン 1,671			
	ス	ウ	ェ	ー	デン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 15,830	千スウェーデンクローナ 32,538		
	ノ	ル	ウ	ェ	ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 12,223	千ノルウェークローネ 7,193		
	デ	ン	マ	ー	ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 11,650	千デンマーククローネ 27,811		
	ポ	ー	ラ	ン	ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 13,288	千ポーランドズロチ 24,437		
	オ	ー	ス	ト	ラ	リ	ア	ド	国 債 証 券	千オーストラリアドル 11,754
シ	ン	ガ	ポ	ー	ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 3,170	千シンガポールドル 5,167		
マ	レ	ー	シ	ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 8,433	千マレーシアリンギット 13,953			
南	ア	フ	リ	カ	国 債 証 券	千南アフリカランド 21,004	千南アフリカランド 35,079			

(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 38,057	百万円 35,101	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

主要な売買銘柄

<公社債>

当		期	
買	付	売	付
銘	柄 金 額	銘	柄 金 額
	千円		千円
T 0.375% 06/30/15(アメリカ)	3,813,851	T 2.625% 07/31/14(アメリカ)	3,742,230
T 0.875% 04/15/17(アメリカ)	1,629,123	T 0.875% 02/28/17(アメリカ)	2,318,378
T 0.625% 07/15/16(アメリカ)	1,309,627	T 2.5% 03/31/15(アメリカ)	2,138,948
T 0.75% 01/15/17(アメリカ)	1,225,958	T 2.375% 02/28/15(アメリカ)	2,009,879
T 0.25% 10/15/15(アメリカ)	1,052,718	T 0.375% 06/30/15(アメリカ)	1,737,295
T 0.875% 01/31/17(アメリカ)	1,035,272	T 2.625% 06/30/14(アメリカ)	1,607,789
T 1.5% 01/31/19(アメリカ)	1,029,889	T 2.75% 11/30/16(アメリカ)	1,476,231
T 1.5% 02/28/19(アメリカ)	1,016,085	T 0.75% 06/30/17(アメリカ)	1,358,425
T 0.375% 06/15/15(アメリカ)	1,000,836	T 2.125% 11/30/14(アメリカ)	1,353,489
T 1.125% 12/31/19(アメリカ)	966,726	T 2.375% 08/31/14(アメリカ)	1,253,558

(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[※]との取引状況等

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

組入資産の明細

<外国(外貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期			末					
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
ア メ リ カ	千米ドル 792,650	千米ドル 817,905	千円 83,221,903	% 37.4	% —	% 12.8	% 14.9	% 9.8	
カ ナ ダ	千カナダドル 49,300	千カナダドル 54,243	5,075,555	2.3	—	1.1	0.8	0.4	
メ キ シ コ	千メキシコペソ 273,600	千メキシコペソ 305,451	2,416,118	1.1	—	0.7	0.2	0.2	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ							
	ド イ ツ	118,760	135,841	18,793,737	8.5	—	4.7	2.4	1.3
	イ タ リ ア	143,550	163,101	22,565,097	10.2	—	6.2	3.0	1.0
	フ ラ ン ス	142,370	163,808	22,662,892	10.2	—	5.9	2.9	1.4
	オ ラ ン ダ	38,050	43,479	6,015,396	2.7	—	1.6	0.9	0.2
	ス ペ イ ン	77,900	88,435	12,235,112	5.5	—	3.2	1.4	0.9
	ベルギー	36,850	43,625	6,035,524	2.7	—	1.8	0.9	0.1
	オーストリア	23,400	27,531	3,809,038	1.7	—	1.0	0.6	0.1
	フィンランド	9,750	10,777	1,491,132	0.7	—	0.4	0.1	0.1
アイルランド	11,600	13,424	1,857,254	0.8	—	0.6	0.1	0.1	
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 90,700	千イギリスポンド 100,820	17,150,648	7.7	—	5.6	1.6	0.6	
ス イ ス	千スイスフラン 6,600	千スイスフラン 7,696	872,059	0.4	—	0.2	0.2	0.1	
ス ウ ェー デ ン	千スウェーデンクローナ 73,750	千スウェーデンクローナ 80,948	1,240,138	0.6	—	0.3	0.2	0.1	
ノ ル ウ ェー	千ノルウェークローネ 44,600	千ノルウェークローネ 47,134	804,112	0.4	—	0.1	0.1	0.1	
デ ン マー ク	千デンマーククローネ 80,500	千デンマーククローネ 96,182	1,783,224	0.8	—	0.6	0.1	0.1	
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 40,600	千ポーランドズロチ 43,392	1,446,280	0.7	—	0.3	0.2	0.2	
オーストラリア	千オーストラリアドル 34,800	千オーストラリアドル 37,244	3,499,887	1.6	—	0.8	0.6	0.1	
シンガポール	千シンガポールドル 9,350	千シンガポールドル 9,842	797,601	0.4	—	0.2	0.1	0.1	
マレーシア	千マレーシアリンギット 35,900	千マレーシアリンギット 35,899	1,133,346	0.5	—	0.2	0.2	0.0	
南アフリカ	千南アフリカランド 117,950	千南アフリカランド 111,786	1,088,796	0.5	—	0.4	0.1	—	
合 計	—	—	215,994,856	97.2	—	48.5	31.9	16.8	

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

銘柄	利率	期 末				償還年月日
		額面金額	評 価 額		外債建金額	
			千ポランド ズロチ	千ポランド ズロチ		
(ポーランド)						
国債証券						
POLGB 2.5% 07/25/18	2.5	2,100	2,052	68,405	2018/7/25	
POLGB 3.75% 04/25/18	3.75	3,100	3,182	106,063	2018/4/25	
POLGB 4% 10/25/23	4.0	3,700	3,803	126,777	2023/10/25	
POLGB 4.75% 04/25/17	4.75	2,100	2,210	73,687	2017/4/25	
POLGB 4.75% 10/25/16	4.75	3,950	4,130	137,663	2016/10/25	
POLGB 5% 04/25/16	5.0	2,300	2,396	79,883	2016/4/25	
POLGB 5.25% 10/25/17	5.25	3,500	3,761	125,355	2017/10/25	
POLGB 5.25% 10/25/20	5.25	2,550	2,822	94,064	2020/10/25	
POLGB 5.5% 10/25/19	5.5	2,600	2,888	96,269	2019/10/25	
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	1,200	1,434	47,811	2029/4/25	
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	3,150	3,637	121,222	2022/9/23	
POLGB 5.75% 10/25/21	5.75	2,250	2,578	85,947	2021/10/25	
POLGB 6.25% 10/24/15	6.25	8,100	8,494	283,128	2015/10/24	
小 計				1,446,280		
(オーストラリア)						
国債証券						
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	1,700	1,573	147,871	2024/4/21	
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	1,400	1,339	125,861	2025/4/21	
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	900	821	77,218	2029/4/21	
ACGB 3.25% 10/21/18	3.25	550	554	52,064	2018/10/21	
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	1,100	1,146	107,719	2026/4/21	
ACGB 4.25% 07/21/17	4.25	1,850	1,927	181,166	2017/7/21	
ACGB 4.5% 04/15/20	4.5	2,750	2,936	275,970	2020/4/15	
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	850	884	83,097	2033/4/21	
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	1,550	1,685	158,432	2027/4/21	
ACGB 4.75% 06/15/16	4.75	2,800	2,916	274,106	2016/6/15	
ACGB 4.75% 10/21/15	4.75	2,050	2,110	198,328	2015/10/21	
ACGB 5.25% 03/15/19	5.25	2,800	3,066	288,139	2019/3/15	
ACGB 5.5% 01/21/18	5.5	3,000	3,263	306,705	2018/1/21	
ACGB 5.5% 04/21/23	5.5	3,300	3,784	355,595	2023/4/21	
ACGB 5.75% 05/15/21	5.75	2,600	2,982	280,294	2021/5/15	
ACGB 5.75% 07/15/22	5.75	2,400	2,780	261,241	2022/7/15	
ACGB 6% 02/15/17	6.0	3,200	3,469	326,072	2017/2/15	
小 計				3,499,887		
(シンガポール)						
国債証券						
SIGB 0.5% 04/01/18	0.5	400	395	32,066	2018/4/1	
SIGB 1.125% 04/01/16	1.125	650	658	53,386	2016/4/1	
SIGB 2.25% 06/01/21	2.25	500	511	41,421	2021/6/1	
SIGB 2.375% 04/01/17	2.375	550	579	47,001	2017/4/1	
SIGB 2.5% 06/01/19	2.5	750	794	64,381	2019/6/1	
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	450	429	34,840	2042/4/1	
SIGB 2.875% 07/01/15	2.875	1,050	1,079	87,447	2015/7/1	
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	400	400	32,466	2030/9/1	
SIGB 3% 09/01/24	3.0	550	580	47,018	2024/9/1	
SIGB 3.125% 09/01/22	3.125	900	969	78,544	2022/9/1	
SIGB 3.25% 09/01/20	3.25	700	764	61,944	2020/9/1	
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	200	212	17,219	2033/9/1	
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	800	872	70,688	2027/3/1	
SIGB 3.75% 09/01/16	3.75	800	859	69,678	2016/9/1	
SIGB 4% 09/01/18	4.0	650	734	59,495	2018/9/1	
小 計				797,601		
(マレーシア)						
国債証券						
MGS 3.172% 07/15/16	3.172	1,750	1,744	55,082	2016/7/15	
MGS 3.197% 10/15/15	3.197	500	500	15,793	2015/10/15	
MGS 3.26% 03/01/18	3.26	800	789	24,922	2018/3/1	
MGS 3.314% 10/31/17	3.314	2,650	2,624	82,842	2017/10/31	
MGS 3.418% 08/15/22	3.418	1,250	1,201	37,928	2022/8/15	
MGS 3.48% 03/15/23	3.48	1,450	1,393	43,980	2023/3/15	
MGS 3.492% 03/31/20	3.492	1,550	1,518	47,926	2020/3/31	
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	1,900	1,744	55,072	2027/5/31	

銘柄	利率	期 末				償還年月日
		額面金額	評 価 額		外債建金額	
			千マレーシア リンギット	千マレーシア リンギット		
(南アフリカ)						
国債証券						
SAGB 10.5% 12/21/26	10.5	19,600	23,030	224,316	2026/12/21	
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	13,900	10,277	100,106	2036/3/31	
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	11,200	8,273	80,580	2041/2/28	
SAGB 6.75% 03/31/21	6.75	13,400	12,609	122,816	2021/3/31	
SAGB 7% 02/28/31	7.0	14,000	11,791	114,849	2031/2/28	
SAGB 7.25% 01/15/20	7.25	12,200	11,945	116,345	2020/1/15	
SAGB 7.75% 02/28/23	7.75	5,300	5,191	50,566	2023/2/28	
SAGB 8% 12/21/18	8.0	12,000	12,236	119,184	2018/12/21	
SAGB 8.25% 09/15/17	8.25	11,300	11,615	113,134	2017/9/15	
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	5,050	4,814	46,896	2048/2/28	
小 計				1,088,796		
合 計				215,994,856		

(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	売 建 額	
外 国	EURO-SCHATZ	443	—
	US 5YR NOTE	536	—
	EURO-BOBL FU	579	—
	EURO-BUND	915	—
	US 10YR NOTE	294	—
	US LONG BOND	210	—

(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 215,994,856	97.1 %
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,555,417	2.9
投 資 信 託 財 産 総 額	222,550,273	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(218,749,331千円)の投資信託財産総額(222,550,273千円)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=101.75円、1カナダドル=93.57円、1メキシコペソ=7.91円、1ユーロ=138.35円、1イギリスポンド=170.11円、1スイスフラン=113.31円、1スウェーデンクローナ=15.32円、1ノルウェークローネ=17.06円、1デンマーククローネ=18.54円、1ポーランドズロチ=33.33円、1オーストラリアドル=93.97円、1シンガポールドル=81.04円、1マレーシアリングギット=31.57円、1南アフリカランド=9.74円です。

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2014年5月29日現在
(A) 資 産	226,724,050,708円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	4,258,271,755
公 社 債(評価額)	215,994,856,962
未 収 入 金	4,195,144,563
未 収 利 息	2,122,317,456
前 払 費 用	91,422,962
差 入 委 託 証 拠 金	62,037,010
(B) 負 債	4,435,148,751
未 払 金	4,205,415,950
未 払 解 約 金	229,732,801
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	222,288,901,957
元 本	88,591,284,511
次 期 繰 越 損 益 金	133,697,617,446
(D) 受 益 権 総 口 数	88,591,284,511口
1万口当たり基準価額(C/D)	25.092円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2013年5月30日 至 2014年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	6,844,336,297円
受 取 利 息	6,844,336,297
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	6,125,606,663
売 買 益	11,533,882,002
売 買 損	△5,408,275,339
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	2,594,326
取 引 益	89,414,925
取 引 損	△86,820,599
(D) 保 管 費 用 等	△62,732,081
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	12,909,805,205
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	141,329,563,289
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	36,712,644,252
(H) 解 約 差 損 益 金	△57,254,395,300
(I) 計 (E+F+G+H)	133,697,617,446
次 期 繰 越 損 益 金(I)	133,697,617,446

(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103,637,610,200円、期中追加設定元本額は26,812,085,176円、期中一部解約元本額は41,858,410,865円です。

※1口当たり純資産額は2,5092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。

外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	12,271,375,908円	DC世界経済インデックスファンド	591,062,571円
FOFs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	11,089,111,631円	グローバル・バランスファンド・シリーズ1	558,867,418円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	10,644,430,244円	バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	470,107,448円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	8,416,520,236円	DCマイセレクションS25	392,285,045円
外国債券オープン(毎月決算型)	4,137,193,832円	DCマイセレクションS50	326,332,299円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,932,232,135円	外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	272,768,994円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	3,825,518,528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)	236,432,169円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	3,354,390,757円	コア投資戦略ファンド(切替型)	222,243,181円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,988,640,684円	外国債券オープン(3ヶ月決算型)	204,088,168円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	2,733,632,690円	分散投資コア戦略ファンドS	186,312,259円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	2,585,653,075円	外国債券ファンド・シリーズ1	182,749,794円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,747,782,595円	DCマイセレクションS75	138,879,131円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	1,716,553,213円	分散投資コア戦略ファンドA	74,845,668円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	1,559,735,683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)	55,137,846円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	1,252,534,917円	DCターゲット・イヤー ファンド2025	43,223,821円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,237,313,697円	DCターゲット・イヤー ファンド2035	30,410,377円
DC外国債券インデックス・オープン	1,226,636,365円	世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	24,974,026円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,212,266,519円	世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	23,723,714円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,170,573,031円	マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	18,055,932円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,118,858,022円	マイセレクション25	12,800,154円
DCマイセレクション25	1,069,612,728円	DCターゲット・イヤー ファンド2045	11,035,285円
DCマイセレクション50	958,649,455円	DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,051,511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)	879,440,784円	SBI資産設計オープン(分配型)	8,330,865円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	800,399,215円	マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	6,853,193円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	682,698,400円	マイセレクション50	6,256,169円
世界経済インデックスファンド	637,905,720円	マイセレクション75	4,319,450円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	620,688,627円	DCターゲット・イヤー ファンド2015	1,333,815円
DCマイセレクション75	608,361,218円	DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	94,299円

約款変更のお知らせ

当ファンドのベンチマークの名称を変更すべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2014年2月11日)

外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日 2014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(除く日本、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。
主要運用対象	MSCIコクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)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。 同一銘柄の株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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10期(2010年5月31日)	8,500	10.4	268.93	7.3	96.2	3.5	1.7	113,682
第11期(2011年5月30日)	9,723	14.4	301.77	12.2	93.8	4.9	1.7	127,019
第12期(2012年5月29日)	8,714	△10.4	263.71	△12.6	89.9	8.2	1.9	119,455
第13期(2013年5月29日)	14,450	65.8	426.72	61.8	95.9	1.8	2.2	170,810
第14期(2014年5月29日)	16,956	17.3	488.37	14.4	94.0	4.0	2.1	168,036

(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) 2013年5月29日	14,450	—	426.72	—	95.9	1.8	2.2
5月末	14,279	△1.2	419.80	△1.6	91.9	4.8	2.1
6月末	13,394	△7.3	393.31	△7.8	94.2	4.1	2.1
7月末	14,019	△3.0	411.88	△3.5	94.8	2.5	2.1
8月末	13,847	△4.2	406.07	△4.8	94.4	3.7	2.0
9月末	14,404	△0.3	423.88	△0.7	95.3	2.5	2.0
10月末	15,122	4.7	440.95	3.3	94.7	2.6	2.0
11月末	15,944	10.3	464.14	8.8	94.6	3.4	1.9
12月末	16,701	15.6	484.97	13.7	94.8	3.5	1.8
2014年1月末	15,874	9.9	461.43	8.1	94.4	4.0	1.9
2月末	16,423	13.7	477.49	11.9	94.1	3.4	1.9
3月末	16,599	14.9	481.01	12.7	95.7	2.3	2.1
4月末	16,827	16.4	486.48	14.0	94.1	4.0	2.1
(当期末) 2014年5月29日	16,956	17.3	488.37	14.4	94.0	4.0	2.1

(注1)騰落率は期首比です。

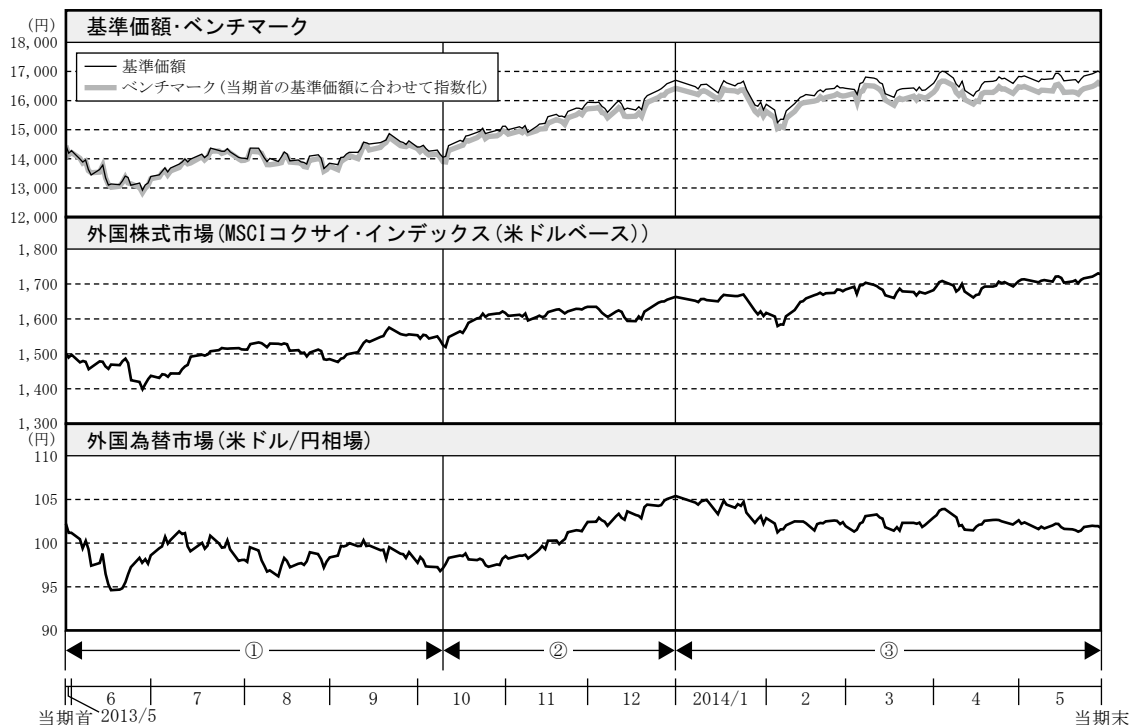
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス(除く日本、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

■ 基準価額の推移と変動要因



	①の期間	②の期間	③の期間
基準価額の動き	横ばい	上昇	横ばい
基準価額変動をもたらした主な要因	<p>【プラス要因】</p> <ul style="list-style-type: none"> ECB(欧州中央銀行)総裁が長期にわたり低金利を維持すると表明したこと 9月のFOMC(米連邦公開市場委員会)で大方の予想に反して量的金融緩和の縮小が見送られたこと <p>【マイナス要因】</p> <ul style="list-style-type: none"> 5月のFRB(米連邦準備理事会)議長発言以降、量的金融緩和が早期に縮小されるとの観測が強まったこと 中国における信用不安の高まり 	<p>【プラス要因】</p> <ul style="list-style-type: none"> 米国の景気回復期待や欧州の景気後退からの脱却 12月のFOMCで量的金融緩和の縮小開始と共に長期にわたるゼロ金利政策の維持が示唆されたこと 外国為替市場での円安進行 <p>【マイナス要因】</p> <p>(特になし)</p>	<p>【プラス要因】</p> <ul style="list-style-type: none"> 総じて市場予想を上回る企業決算 超低金利政策が長期化するとの観測が強まったこと <p>【マイナス要因】</p> <ul style="list-style-type: none"> アルゼンチンペソ急落に端を発した新興国経済の先行き不安 ウクライナ情勢の緊迫化

◆パフォーマンス

当期の基準価額の騰落率は以下の通りです。

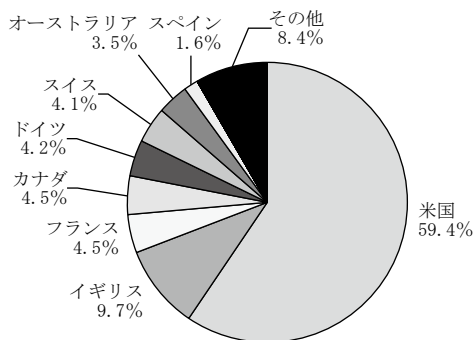
①当期首 (前期末) 基準価額	②当期末 基準価額	③差引 (②-①)	④騰落率 (③/①)	⑤ベンチマーク 騰落率	④-⑤
14,450円	16,956円	+2,506円	+17.3%	+14.4%	+2.9%

ベンチマーク騰落率との差異は+2.9%となりました。その内訳は、配当要因^{※1}+2.7%、為替評価差要因^{※2}+0.2%です。

■運用状況

MSCIコクサイ・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っており、当期につきましては約1,290銘柄に分散投資しました。また、資金の流出入等に対応するため一部海外の株価指数先物取引を行っており、先物を含む外国株式の組入比率は期を通じて概ね100%を維持しました。当期末における国・地域別組入比率は下記の通りです。

国・地域別組入比率^{※3}(当期末)



■今後の運用方針

今後につきましても、MSCIコクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)を構成している株式を中心に組み入れ、同インデックスとの連動を目指した運用を行ってまいります。

※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です。

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

※3 比率は、株式等評価総額に対する各国・地域の評価額の比率です。

1万口当たりの費用明細

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料	0円
(株 式)	(0)
(新 株 予 約 権 証 券)	(0)
(投 資 信 託 証 券)	(0)
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)
(b) 有 価 証 券 取 引 税	0
(株 式)	(0)
(新 株 予 約 権 証 券)	(0)
(投 資 信 託 証 券)	(0)
(c) 保 管 費 用 等	6
合 計	6

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 売買委託手数料、(b) 有価証券取引税、(c) 保管費用等は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期				
		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ア メ リ カ	百株	千米ドル	百株	千米ドル	
		5,297 (3,927)	29,756 (5,377)	40,077 (2,274)	199,521 (5,781)	
	カ ナ ダ	848 (1,110)	千カナダドル 4,073 (211)	5,491 (107)	千カナダドル 15,608 (496)	
		ユ ド イ ツ	1,470 (47)	千ユーロ 2,556 (-)	2,112 (-)	千ユーロ 9,785 (140)
	イ タ リ ア		2,370	762	5,935 (509)	1,987 (463)
		フ ラ ン ス	2,130 (463)	2,729 (260)	3,006 (27)	9,227 (223)
		オ ラ ン ダ	1,620 (563)	1,070 (625)	2,023 (40)	3,358 (55)
	ロ	ス ペ イ ン	1,330 (30,958)	738 (561)	12,663 (20,360)	2,914 (562)
		ベ ル ギ ー	30	131	237 (-)	1,224 (11)
		オ ー ス ト リ ア	47 (167)	135 (2)	336 (-)	379 (10)
ル ク セ ン ブ ル ク		66	367	218	324	
	フ ィ ン ラ ン ド	8 (149)	30 (-)	963	1,248	

		当 期				
		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ユ ー ロ	アイルランド	百株 15	千ユーロ 48	百株 95 (763)	千ユーロ 180 (300)
		ギリシャ	—	—	149	133
		ポルトガル	50	65	515	141
		イギリス	13,027 (—)	千イギリスポンド 4,173 (196)	33,056 (11,167)	千イギリスポンド 19,313 (2,223)
	スイス	292 (—)	千スイスフラン 1,326 (—)	1,788 (—)	千スイスフラン 11,367 (617)	
	スウェーデン	229	千スウェーデンクローナ 3,034	2,498	千スウェーデンクローナ 30,725	
	ノルウェー	171	千ノルウェークローネ 1,157	558	千ノルウェークローネ 6,794	
	デンマーク	314 (842)	千デンマーククローネ 7,253 (—)	243	千デンマーククローネ 9,659	
	オーストラリア	1,183 (1,190)	千オーストラリアドル 2,118 (324)	8,169 (172)	千オーストラリアドル 11,178 (264)	
	ニュージーランド	180 (—)	千ニュージーランドドル 213 (—)	940 (53)	千ニュージーランドドル 376 (7)	
香 港	香港	2,911 (1,389)	千香港ドル 7,553 (386)	11,173 (—)	千香港ドル 34,833 (432)	
	シンガポール	740	千シンガポールドル 268	6,580 (—)	千シンガポールドル 2,744 (8)	
	イスラエル	6 (—)	千イスラエルシェケル 243 (0.00106)	709 (—)	千イスラエルシェケル 3,208 (20)	

(注1)金額は受渡代金です。

(注2) ()内は増資割当、株式転換、株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

<新株予約権証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	香 港	証券 — (7,250)	千香港ドル — (46)	証券 7,250	千香港ドル 36

(注1)金額は受渡代金です。

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

<投資信託受益証券、投資証券>

	当期			
	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
外国				
アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
BOSTON PROPERTIES	—	—	1	180
SL GREEN REALTY CORP	—	—	1	101
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	—	—	11	139
PROLOGIS INC	—	—	3	158
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.958	130	0.924	113
CAMDEN PROPERTY TRUST	—	—	0.773	45
CROWN CASTLE INTL CORP	—	—	1	75
	(18)	(1,336)		
ESSEX PROPERTY TRUST	3	556	—	—
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	—	—	2	125
FEDERAL REALTY INVS TRUST	—	—	0.989	105
HCP INC	—	—	5	218
HEALTH CARE REIT INC	0.411	28	1	109
RAYONIER INC	—	—	0.829	39
KIMCO REALTY CORP	—	—	5	110
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.96	33	—	—
MACERICH CO/THE	—	—	0.798	46
HOST HOTELS AND RESORTS INC	—	—	5	103
PLUM CREEK TIMBER COMMON	—	—	1	46
REALTY INCOME CORP	2	121	1	54
REGENCY CENTERS CORP	—	—	1	59
UDR INC	—	—	2	50
SIMON PROPERTY GROUP	0.72	121	3	512
PUBLIC STORAGE	—	—	1	261
VENTAS INC	—	—	3	239
VORNADO REALTY TRUST	—	—	1	168
DIGITAL REALTY TRUST INC	—	—	1	48
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	1	33	4	96
AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	19 (27)	268 (350)	—	—
GENERAL GROWTH PROPERTIES	2	56	1	42
HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	33	24	111	75
AMERICAN TOWER CORPORATION	—	—	3	303
COLE REAL ESTATE INVESTMENT	24	350	— (24)	— (350)
小計	90 (45)	1,727 (1,687)	182 (24)	3,631 (350)

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
カナダ	千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	1	33	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	—	—	1	47
小 計	1	33	1	47
ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
フランス				
ICADE	0.538	34	—	—
UNIBAIL-RODAMCO SE	—	—	0.673	125
KLEPIERRE	—	—	1	38
FONCIERE DES REGIONS	—	—	(—)	(2)
小 計	0.538	34	1 (—)	163 (2)
オランダ				
CORIO NV	—	—	1	36
小 計	—	—	1	36
ユ ー ロ 計	0.538	34	2 (—)	200 (2)
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	—	—	4	27
HAMMERSON PLC	—	—	6	33
INTU PROPERTIES PLC	4	15	(—)	(12)
SEGRO PLC	—	—	8	28
LAND SECURITIES GROUP PLC	—	—	7	70
INTU PROPERTIES PLC-RTS	(11)	(12)	11	11
小 計	4 (11)	15 (12)	38 (—)	171 (12)
オーストラリア	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
MIRVAC GROUP	—	—	33	58
APA GROUP	—	—	12	71
CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	(8)	(14)	(8)	(14)
GPT GROUP	16	63	14	51
SYDNEY AIRPORT	29 (15)	117 (49)	—	—
STOCKLAND	—	—	24	93
WESTFIELD GROUP	—	—	30	326
DEXUS PROPERTY GROUP	48	52	46	49
GOODMAN GROUP	—	—	17	86

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
FEDERATION CENTRES	—	—	21	52
LEND LEASE GROUP	—	—	5	60
WESTFIELD RETAIL TRUST	—	—	19	61
小 計	94 (24)	234 (64)	226 (8)	911 (14)
香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
LINK REIT	—	—	21	845
HKT TRUST AND HKT LTD	—	—	28	203
小 計	—	—	49	1,049
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
CAPITAMALL TRUST	8	16	48	94
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	7	16	(—)	(0.0666)
KEPPEL REIT	— (6)	— (8)	6	8
小 計	15 (6)	33 (8)	54 (—)	102 (0.0666)

(注1)金額は受渡代金です。

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

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別	当 期			
	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 株式先物取引	百万円 58,132	百万円 55,295	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	39,063,919千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	153,725,968千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.25

(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。

主要な売買銘柄

<株 式>

当				期			
買		付		売		付	
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
BARCLAYS(イギリス)	273	118,491	432	APPLE INC(アメリカ)	12	624,366	52,030
GENERAL MOTORS CO(アメリカ)	27	100,878	3,723	EXXON MOBIL(アメリカ)	59	561,429	9,431
TESLA MOTORS INC(アメリカ)	5	85,054	16,742	PFIZER(アメリカ)	119	354,519	2,961
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD(アメリカ)	11	80,825	7,195	GENERAL ELECTRIC CO(アメリカ)	130	335,760	2,572
LLOYDS BANKING GROUP PLC(イギリス)	630	80,262	127	AT&T INC(アメリカ)	83	294,986	3,552
FACEBOOK INC-A(アメリカ)	11	74,568	6,743	INTL BUSINESS MACHINES CORP(アメリカ)	15	290,443	19,346
ZOETIS INC(アメリカ)	23	70,906	3,069	CHEVRON CORP(アメリカ)	22	283,446	12,429
VESTAS WIND SYSTEMS(デンマーク)	11	63,253	5,334	JOHNSON & JOHNSON(アメリカ)	28	264,457	9,348
LYONDELLBASELL INDU-CL A(アメリカ)	8	62,736	7,463	NESTLE SA - REGISTERED(スイス)	35	260,848	7,268
GOOGLE INC-CL A(アメリカ)	0.657	59,118	89,982	PROCTER & GAMBLE CO(アメリカ)	30	251,820	8,281

(注)金額は受渡代金です。

<新株予約権証券>

当			期		
買		付	売		付
銘 柄	金 額		銘 柄	金 額	
		千円			千円
		—	SUN HUNG KA-CW16(香港)		481

(注)金額は受渡代金です。

<投資信託受益証券、投資証券>

当			期		
買		付	売		付
銘 柄	口 数	金 額	銘 柄	口 数	金 額
		千円			千円
ESSEX PROPERTY TRUST(アメリカ)	3	57,148	SIMON PROPERTY GROUP(アメリカ)	3	52,234
COLE REAL ESTATE INVESTMENT(アメリカ)	24	35,910	AMERICAN TOWER CORPORATION(アメリカ)	3	30,836
AMERICAN REALTY CAPITAL PRO(アメリカ)	19	27,391	WESTFIELD GROUP(オーストラリア)	30	30,533
AVALONBAY COMMUNITIES INC(アメリカ)	0.958	13,248	PUBLIC STORAGE(アメリカ)	1	26,584
SIMON PROPERTY GROUP(アメリカ)	0.72	12,419	VENTAS INC(アメリカ)	3	24,415
REALTY INCOME CORP(アメリカ)	2	12,346	HCP INC(アメリカ)	5	22,328
SYDNEY AIRPORT(オーストラリア)	29	10,980	BOSTON PROPERTIES(アメリカ)	1	18,475
GPT GROUP(オーストラリア)	16	6,228	UNIBAIL-RODAMCO SE(ユーロ・フランス)	0.673	17,460
GENERAL GROWTH PROPERTIES(アメリカ)	2	5,794	VORNADO REALTY TRUST(アメリカ)	1	17,198
DEXUS PROPERTY GROUP(オーストラリア)	48	4,833	PROLOGIS INC(アメリカ)	3	16,013

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

当期中における利害関係人との取引等はありません。

組入資産の明細

<外国株式(上場、登録株式)>

銘柄	当期末(前期末)	当 期 末		業 種	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル 千円		
ABBOTT LABORATORIES	986	801	3,179	323,523	ヘルスケア機器・サービス
AES CORP	407	372	517	52,622	公益事業
INTL BUSINESS MACHINES CORP	670	519	9,518	968,471	ソフトウェア・サービス
ACE LTD	211	178	1,841	187,325	保険
AGCO CORP	62	47	257	26,192	資本財
AIRGAS INC	41	33	356	36,287	素材
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	135	109	1,289	131,226	素材
ENERGEN CORP	52	36	308	31,377	エネルギー
ALLEGHANY CORP	8	8	359	36,568	保険
ALLERGAN INC	196	156	2,445	248,873	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DU PONT (E. I) DE NEMOURS	584	488	3,344	340,309	素材
RALPH LAUREN CORPORATION	39	32	498	50,695	耐久消費財・アパレル
ALLSTATE CORP	299	234	1,365	138,908	保険
HONEYWELL INTL INC	466	386	3,578	364,071	資本財
ALCOA	683	576	770	78,414	素材
HESS CORP	196	153	1,382	140,667	エネルギー
BEAM INC	91	—	—	—	食品・飲料・タバコ
AMERICAN EXPRESS	626	500	4,559	463,934	各種金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	310	254	1,348	137,224	公益事業
AFLAC	300	244	1,487	151,351	保険
AMERICAN INT'L GROUP	881	725	3,881	394,966	保険
ANADARKO PETROLEUM CORP	313	264	2,696	274,397	エネルギー
TYCO INTERNATIONAL LTD	294	238	1,041	105,967	商業・専門サービス
VALERO ENERGY CORP	353	284	1,581	160,944	エネルギー
APACHE CORP	245	206	1,890	192,380	エネルギー
ALBEMARLE CORP	56	43	294	29,972	素材
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	421	345	1,530	155,713	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	70	61	337	34,376	公益事業
AMEREN CORPORATION	152	132	520	53,005	公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	68	58	335	34,187	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AUTOLIV INC	61	49	518	52,791	自動車・自動車部品
AUTOZONE INC	21	18	978	99,580	小売
AVERY DENNISON CORP	59	49	241	24,608	素材
AVNET INC	88	76	333	33,928	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AVON PRODUCTS INC	277	243	343	34,998	家庭用品・パーソナル用品
BAKER HUGHES	281	232	1,624	165,268	エネルギー
BALL CORP	92	73	442	44,995	素材

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

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末		業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	百株	百株	千米ドル	千円	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	617	588	7,495	762,645	各種金融
BANK NEW YORK CO	742	604	2,078	211,441	各種金融
BARD C R INC	50	40	595	60,580	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL	350	285	2,118	215,589	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	127	101	1,187	120,842	ヘルスケア機器・サービス
AMETEK INC	155	131	697	70,953	資本財
VERIZON COMMUNICATIONS	1,790	2,208	10,984	1,117,665	電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	80	57	253	25,780	保険
BEST BUY COMPANY INC	185	146	395	40,264	小売
YUM BRANDS INC	287	234	1,803	183,456	消費者サービス
FIRSTENERGY CORP	267	217	731	74,413	公益事業
BLOCK H & R INC	174	140	412	42,006	消費者サービス
BOEING CO	449	370	4,981	506,866	資本財
ROBERT HALF INTL INC	86	73	335	34,102	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	73	123	774	78,829	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	908	699	919	93,602	ヘルスケア機器・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	—	17	416	42,429	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,035	866	4,212	428,639	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	33	27	509	51,889	各種金融
ONEOK INC	124	106	693	70,544	エネルギー
UNITED RENTALS INC	—	50	511	52,067	資本財
SEMPRA ENERGY	147	119	1,188	120,913	公益事業
FEDEX CORP	187	157	2,265	230,503	運輸
AMPHENOL CORPORATION	102	80	768	78,193	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	78	62	566	57,596	食品・飲料・タバコ
QUANTA SERVICES INC	131	105	360	36,654	資本財
CSX CORP	652	534	1,580	160,836	運輸
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	106	106	184	18,811	メディア
CABOT OIL & GAS CORP	134	219	788	80,258	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO (US)	119	104	466	47,428	食品・飲料・タバコ
WHITING PETROLEUM CORP	75	59	424	43,168	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	96	89	740	75,357	食品・飲料・タバコ
CARDINAL HEALTH	218	177	1,233	125,494	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR	410	334	3,445	350,582	資本財
CORE LABORATORIES N.V.	30	23	371	37,845	エネルギー
CHESAPEAKE ENERGY CORP	425	276	786	80,064	エネルギー
CENTURYLINK INC	402	306	1,159	117,972	電気通信サービス
JPMORGAN CHASE & CO	2,383	1,987	11,023	1,121,620	銀行
CHUBB CORPORATION	162	128	1,192	121,375	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	89	69	475	48,373	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	184	141	1,269	129,170	ヘルスケア機器・サービス
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	—	51	418	42,563	資本財
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	89	—	—	—	素材
CLOROX COMPANY	77	70	623	63,453	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	2,523	2,081	8,447	859,512	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA ENTERPRISES	188	131	602	61,305	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE CO	589	479	3,172	322,755	家庭用品・パーソナル用品
MARRIOTT INTL A	165	—	—	—	消費者サービス
AON PLC	188	152	1,363	138,685	保険
COMERICA INC	121	95	445	45,353	銀行

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千米ドル	千円	
NRG ENERGY INC	159	162	572	58,299	公益事業
COMPUTER SCIENCES CORP	105	79	490	49,929	ソフトウェア・サービス
CONAGRA	260	228	722	73,477	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	187	152	832	84,675	公益事業
CMS ENERGY CORP	167	149	441	44,922	公益事業
CAMERON INTERNATIONAL CORP	157	113	720	73,349	エネルギー
CORNING	953	731	1,555	158,223	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	115	98	325	33,100	素材
CUMMINS INC	115	93	1,417	144,237	資本財
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	62	48	572	58,250	資本財
DR HORTON INC	165	165	386	39,353	耐久消費財・アパレル
DANAHER CORP	372	329	2,596	264,163	資本財
MOODY'S CORP	128	98	847	86,248	各種金融
TARGET (DAYTON HUDSON)	391	315	1,743	177,394	小売
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	43	34	174	17,726	エネルギー
DEERE&CO	233	184	1,675	170,516	資本財
MORGAN STANLEY	931	772	2,389	243,175	各種金融
REPUBLIC SERVICES INC	199	155	548	55,826	商業・専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,051	874	7,311	743,909	メディア
DOVER CORP	116	92	804	81,854	資本財
DOW CHEMICAL CO	753	640	3,317	337,516	素材
OMNICOM GROUP	171	131	930	94,652	メディア
DTE ENERGY COMPANY	110	94	712	72,515	公益事業
XL GROUP PLC	195	147	476	48,516	保険
DUKE ENERGY CORP	442	365	2,587	263,276	公益事業
CROWN CASTLE INTL CORP	189	—	—	—	電気通信サービス
FLOWSERVE CORP	32	72	539	54,856	資本財
DARDEN RESTAURANTS INC	82	66	334	34,009	消費者サービス
EMC CORP	1,319	1,067	2,835	288,562	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BANK OF AMERICA CORP	6,746	5,551	8,405	855,250	銀行
CITIGROUP	1,833	1,594	7,542	767,490	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	98	83	723	73,569	素材
EATON CORP	291	248	1,840	187,320	資本財
EATON VANCE CORP	78	66	248	25,265	各種金融
ECOLAB INC	183	142	1,541	156,869	素材
SALESFORCE.COM INC	337	295	1,577	160,524	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	456	364	2,428	247,116	資本財
ENTERGY CORP	113	96	718	73,063	公益事業
EOG RESOURCES INC	169	282	2,975	302,758	エネルギー
EQUIFAX INC	76	64	456	46,456	商業・専門サービス
EQT CORPORATION	95	78	815	83,003	エネルギー
ESTEE LAUDER CO-CL A	150	124	941	95,786	家庭用品・パーソナル用品
EXXON MOBIL	2,856	2,268	22,926	2,332,727	エネルギー
FMC CORP	87	73	562	57,266	素材
NEXTERA ENERGY INC	246	225	2,191	222,952	公益事業
FAMILY DOLLAR STORES	63	55	321	32,722	小売
ASSURANT INC	56	40	271	27,633	保険
M & T BANK CORP	72	63	773	78,735	銀行
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	70	62	536	54,546	自動車・自動車部品
MACY'S INC	247	189	1,108	112,775	小売

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千米ドル	千円	
FOREST LABORATORIES INC	166	124	1,175	119,595	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FRANKLIN RESOURCES INC	92	216	1,194	121,506	各種金融
FREEPORT-MCMOR-B	596	546	1,848	188,092	素材
GAP	200	134	549	55,909	小売
GENERAL DYNAMICS CORP	192	154	1,815	184,689	資本財
GENERAL MILLS INC	402	327	1,777	180,910	食品・飲料・タバコ
GENUINE PARTS CO	99	80	692	70,484	小売
STARWOOD HOTELS & RESORTS	126	101	800	81,498	消費者サービス
MCKESSON CORP	151	118	2,169	220,702	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL ELECTRIC CO	6,549	5,269	14,048	1,429,471	資本財
GRAINGER (WW) INC	37	32	826	84,137	資本財
HALLIBURTON CO	583	446	2,833	288,300	エネルギー
GOLDMAN SACHS GROUP INC	279	223	3,600	366,383	各種金融
HARLEY-DAVIDSON	146	116	826	84,057	自動車・自動車部品
HARRIS CORP	71	53	409	41,674	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CONSOL ENERGY INC	142	114	520	52,925	エネルギー
DENBURY RESOURCES INC	246	189	318	32,433	エネルギー
HEINZ (H. J) CO	205	—	—	—	食品・飲料・タバコ
HELMERICH & PAYNE	66	54	589	59,968	エネルギー
HERSHEY FOODS CORPORATION	100	80	777	79,138	食品・飲料・タバコ
HEWLETT-PACKARD CO	1,239	997	3,327	338,589	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CROWN HOLDINGS INC	95	74	363	36,942	素材
REYNOLDS AMERICAN INC	216	165	967	98,444	食品・飲料・タバコ
JUNIPER NETWORKS INC	337	273	688	70,090	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLLYFRONTIER CORP	121	97	478	48,730	エネルギー
UNUM GROUP	176	141	475	48,388	保険
HOME DEPOT	933	739	5,895	599,869	小売
HORMEL FOODS CORP	97	81	387	39,457	食品・飲料・タバコ
CENTERPOINT ENERGY INC	255	225	541	55,099	公益事業
HUMANA INC	103	81	1,014	103,182	ヘルスケア機器・サービス
RED HAT INC	120	97	487	49,638	ソフトウェア・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS	259	211	1,832	186,500	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	52	41	413	42,093	素材
INT'L GAME TECHNOLOGY	161	—	—	—	消費者サービス
INT'L PAPER CO	265	216	1,012	103,016	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS	268	216	409	41,640	メディア
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	82	67	368	37,502	資本財
JOHNSON & JOHNSON	1,733	1,485	14,895	1,515,622	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARTFORD FINANCIAL SVCS	265	225	779	79,314	保険
JOHNSON CONTROLS INC	439	348	1,693	172,356	自動車・自動車部品
DEVON ENERGY CORPORATION	246	201	1,482	150,870	エネルギー
KELLOGG CO	160	141	961	97,842	食品・飲料・タバコ
KEY CORP	604	472	640	65,172	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	243	201	2,225	226,489	家庭用品・パーソナル用品
BLACKROCK INC	83	70	2,128	216,623	各種金融
KOHL'S CORP	133	108	584	59,521	小売
KROGER CO	304	253	1,184	120,515	食品・生活必需品小売り
LEGG MASON INC	76	62	301	30,681	各種金融
LEGGETT & PLATT INC	88	71	239	24,395	耐久消費財・アパレル
LENNAR CORP-CL A	102	80	324	33,046	耐久消費財・アパレル

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末		業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	百株	百株	千米ドル	千円	
LEUCADIA NATIONAL CORP	130	166	428	43,551	各種金融
LILLY (ELI) & CO	656	525	3,138	319,335	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
L BRANDS INC	157	128	722	73,517	小売
LINCOLN NATIONAL CORP	179	137	658	66,987	保険
UNITED PARCEL SERVICE B	450	371	3,840	390,806	運輸
AGILENT TECHNOLOGIES	222	169	966	98,292	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOCKHEED MARTIN CORP	171	143	2,323	236,436	資本財
LOEWS CORP	203	178	773	78,684	保険
CARNIVAL CORPORATION	287	199	790	80,399	消費者サービス
RANGE RESOURCES CORP	103	88	797	81,157	エネルギー
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	63	—	—	—	素材
LOWES COMPANIES	702	541	2,527	257,185	小売
DOMINION RESOURCES	354	300	2,051	208,714	公益事業
IRON MOUNTAIN INC	87	85	263	26,773	商業・専門サービス
SCANA CORP	78	67	349	35,563	公益事業
MDU RESOURCES GROUP INC	126	88	299	30,514	公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	—	200	516	52,531	消費者サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	75	59	427	43,458	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	626	517	5,241	533,298	消費者サービス
MCGRAW-HILL FINANCIAL	161	142	1,156	117,677	各種金融
EVEREST RE GROUP LTD	32	24	398	40,578	保険
MANPOWER GROUP	44	44	368	37,537	商業・専門サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	72	56	452	45,993	ヘルスケア機器・サービス
MARSH & MCLENNAN COS	348	288	1,437	146,237	保険
ENERGIZER HOLDINGS INC	41	34	396	40,302	家庭用品・パーソナル用品
MASCO CORP	230	190	405	41,237	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS	28	23	287	29,274	素材
METLIFE INC	534	493	2,516	256,098	保険
MEDTRONIC	645	525	3,160	321,581	ヘルスケア機器・サービス
CVS CAREMARK CORPORATION	776	618	4,776	485,963	食品・生活必需品小売り
MERCK & CO	1,901	1,543	8,706	885,894	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CRP OF AMER	61	48	487	49,583	ヘルスケア機器・サービス
RACKSPACE HOSTING INC	69	69	244	24,902	ソフトウェア・サービス
3 M COMPANY	413	332	4,698	478,081	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	37	33	455	46,387	耐久消費財・アパレル
MOTOROLA SOLUTIONS INC	165	125	842	85,746	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	70	57	617	62,810	運輸
MURPHY OIL CORP	117	89	543	55,251	エネルギー
XCEL ENERGY INC	312	269	822	83,707	公益事業
FORD MOTOR COMPANY	2,238	1,908	3,113	316,805	自動車・自動車部品
NATIONAL OILWELL VARCO INC	265	224	1,838	187,039	エネルギー
NEWFIELD EXPLORATION CO	84	—	—	—	エネルギー
NEWELL RUBBERMAID	185	148	432	44,055	耐久消費財・アパレル
DUN & BRADSTREET CORP	28	20	210	21,391	商業・専門サービス
NEWMONT MINING CORP	311	270	607	61,790	素材
NIKE B	450	368	2,813	286,229	耐久消費財・アパレル
NOBLE ENERGY INC	114	188	1,330	135,404	エネルギー
NORDSTROM INC	103	75	507	51,671	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	197	163	1,637	166,645	運輸
NORTHEAST UTILITIES	200	163	737	75,060	公益事業

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千米ドル	千円	
NISOURCE INC	182	168	626	63,764	公益事業
COACH INC	182	146	599	61,003	耐久消費財・アパレル
NORTHROP GRUMMAN CORP	149	108	1,304	132,703	資本財
WELLS FARGO & CO	3,135	2,624	13,236	1,346,815	銀行
NUCOR CORP	203	166	852	86,712	素材
MONSANTO CO	334	273	3,290	334,845	素材
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	365	298	2,342	238,391	各種金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	509	418	4,144	421,738	エネルギー
OCEANEERING INTL INC	68	53	387	39,434	エネルギー
OGE ENERGY CORP	62	111	405	41,302	公益事業
OMNICARE INC	70	58	369	37,606	ヘルスケア機器・サービス
ORACLE CORP	—	1,899	7,894	803,305	ソフトウェア・サービス
OWENS-ILLINOIS INC	96	82	271	27,585	素材
PALL CORP	72	59	520	52,920	資本財
EXELON CORP	521	448	1,613	164,181	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	96	77	968	98,519	資本財
PARTNERRE LTD	39	25	272	27,702	保険
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	71	59	271	27,673	保険
J. C. PENNEY CO INC	111	—	—	—	小売
PPL CORPORATION	371	329	1,143	116,308	公益事業
PEPSICO INC	968	797	6,945	706,667	食品・飲料・タバコ
PENTAIR LTD	133	107	805	81,935	資本財
PERRIGO CO PLC	—	68	936	95,250	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER	4,616	3,350	9,921	1,009,543	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CONOCOPHILLIPS	725	643	5,121	521,106	エネルギー
PG&E CORP	273	232	1,052	107,096	公益事業
PITNEY BOWES INC	115	—	—	—	商業・専門サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES	74	75	1,522	154,904	エネルギー
ALTRIA GROUP INC	1,265	1,038	4,232	430,702	食品・飲料・タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	332	279	2,361	240,307	銀行
POLARIS INDUSTRIES INC	42	33	440	44,855	耐久消費財・アパレル
AETNA INC	246	194	1,495	152,143	ヘルスケア機器・サービス
FLUOR CORP	106	88	664	67,612	資本財
PPG INDUSTRIES INC	89	75	1,503	152,958	素材
PRAXAIR INC	187	155	2,021	205,651	素材
PRECISION CASTPARTS CORP	91	76	1,919	195,298	資本財
QUEST DIAGNOSTICS	101	72	422	42,991	ヘルスケア機器・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	1,713	1,423	11,401	1,160,104	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	370	297	751	76,502	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	324	263	1,007	102,484	公益事業
PULTE GROUP INC	222	178	352	35,842	耐久消費財・アパレル
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	281	246	377	38,454	銀行
TIME WARNER INC	598	469	3,316	337,472	メディア
ULTRA PETROLEUM CORP	111	—	—	—	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	—	64	311	31,666	各種金融
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	31	21	225	22,951	保険
AUTONATION INC	—	40	229	23,374	小売
RESMED INC	89	79	395	40,236	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,170	948	3,984	405,459	銀行
ROCK-TENN COMPANY -CL A	45	36	368	37,515	素材

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千米ドル	千円	
ROPER INDUSTRIES INC	62	51	726	73,942	資本財
ROWAN COMPANIES PLC	86	—	—	—	エネルギー
PEABODY ENERGY CORP	168	142	238	24,227	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	90	70	857	87,292	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	96	87	472	48,060	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	212	169	1,633	166,236	資本財
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	70	53	388	39,480	エネルギー
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	31	26	667	67,964	ソフトウェア・サービス
FMC TECHNOLOGIES INC	152	127	732	74,580	エネルギー
ACCENTURE PLC-CL A	399	329	2,622	266,877	ソフトウェア・サービス
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	111	85	355	36,164	保険
SAFEWAY INC	150	120	413	42,066	食品・生活必需品小売り
ROCKWELL COLLIN	86	66	513	52,237	資本財
ST JUDE MEDICAL INC	197	148	979	99,650	ヘルスケア機器・サービス
TRAVELERS COS INC/THE	241	187	1,754	178,494	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	151	152	820	83,527	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER	826	684	6,977	710,010	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	693	606	1,533	156,062	各種金融
JOY GLOBAL INC	67	52	302	30,747	資本財
ZIMMER HOLDINGS INC	111	88	908	92,470	ヘルスケア機器・サービス
SPX CORP	34	19	201	20,519	資本財
BUNGE LIMITED	93	79	609	61,968	食品・飲料・タバコ
WELLPOINT INC	189	148	1,599	162,730	ヘルスケア機器・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	158	120	874	89,015	ヘルスケア機器・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	189	153	714	72,692	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	55	44	889	90,551	素材
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	111	77	256	26,076	エネルギー
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	287	243	1,992	202,701	保険
ADVANCE AUTO PARTS	46	37	452	46,013	小売
UNITED STATES STEEL CORP	98	—	—	—	素材
SOUTHWESTERN ENERGY CO	223	190	861	87,639	エネルギー
EDISON INTL	197	161	875	89,062	公益事業
SOUTHERN CO	550	466	2,025	206,046	公益事業
BB&T CORP	448	368	1,405	143,018	銀行
INGERSOLL-RAND PLC	187	148	888	90,374	資本財
SOUTHWEST AIRLINES CO	129	82	219	22,315	運輸
AT&T INC	3,587	2,777	9,814	998,609	電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,222	1,001	12,270	1,248,486	エネルギー
MEADWESTVACO CORP	111	88	354	36,055	素材
STANLEY BLACK&DECKER	102	74	651	66,305	資本財
STATE STREET CORP	289	226	1,466	149,185	各種金融
STRYKER CORP	194	178	1,475	150,085	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS	345	274	1,051	106,973	銀行
SYSCO CORP	375	298	1,093	111,252	食品・生活必需品小売り
TESORO CORP	—	72	399	40,668	エネルギー
TEXTRON	179	144	565	57,537	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	223	205	2,386	242,875	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOBLE CORP PLC	158	126	384	39,164	エネルギー
TIFFANY & CO	81	68	674	68,599	小売
TOLL BROTHERS INC	95	81	296	30,146	耐久消費財・アパレル

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千米ドル	千円	
TORCHMARK CORP	64	48	394	40,132	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	114	93	285	29,068	ソフトウェア・サービス
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	62	89	619	63,003	ヘルスケア機器・サービス
TYSON FOODS INC	186	145	592	60,295	食品・飲料・タバコ
MARATHON OIL CORP	451	371	1,359	138,293	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	292	239	4,697	477,977	運輸
UNITED TECHNOLOGIES CORP	544	453	5,253	534,504	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	637	522	4,108	417,997	ヘルスケア機器・サービス
SPRINT NEXTEL CORPORATION	1,937	—	—	—	電気通信サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	—	50	446	45,456	ヘルスケア機器・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	70	55	456	46,417	ヘルスケア機器・サービス
VF CORP	56	180	1,132	115,270	耐久消費財・アパレル
CBS CORP-CL B	369	296	1,795	182,713	メディア
VULCAN MATERIALS CO	82	66	409	41,702	素材
WALGREEN CO	562	470	3,285	334,317	食品・生活必需品小売り
WAL-MART STORES	1,045	846	6,394	650,619	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	282	232	1,029	104,794	商業・専門サービス
WATERS CORP	55	42	428	43,553	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACTAVIS PLC	82	89	1,888	192,203	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JM SMUCKER CO	71	56	571	58,111	食品・飲料・タバコ
WEYERHAEUSER CO	344	297	925	94,162	不動産
WHIRLPOOL CORP	50	42	613	62,432	耐久消費財・アパレル
WEATHERFORD INTL LTD	477	398	835	84,993	エネルギー
NABORS INDUSTRIES LTD	199	139	363	37,021	エネルギー
WILLIAMS COS	424	357	1,671	170,029	エネルギー
DICK'S SPORTING GOODS INC	62	53	226	23,096	小売
PEPCO HOLDINGS INC	143	143	398	40,498	公益事業
ALLIANT ENERGY CORPORATION	71	61	357	36,392	公益事業
WISCONSIN ENERGY CORP	147	122	554	56,456	公益事業
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	80	—	—	—	エネルギー
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	49	39	228	23,199	公益事業
TD AMERITRADE HOLDING CORP	152	144	431	43,898	各種金融
CARMAX INC	146	120	541	55,067	小売
XEROX CORP	837	591	721	73,396	ソフトウェア・サービス
CIMAREX ENERGY CO	54	43	566	57,666	エネルギー
TJX COMPANIES INC	463	376	2,042	207,840	小売
HOSPIRA INC	104	92	446	45,450	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	—	260	450	45,812	保険
CBRE GROUP INC-A	199	144	427	43,463	不動産
REGIONS FINL CORP	905	725	732	74,562	銀行
WESTLAKE CHEMICAL CORP	—	24	194	19,760	素材
LAS VEGAS SANDS CORP	264	216	1,642	167,075	消費者サービス
MOSAIC CO/THE	177	170	839	85,449	素材
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	35	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HERBALIFE LTD	70	44	290	29,528	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP-SERIES A	100	82	504	51,334	素材
MOLSON COORS BREWING CO -B	101	77	499	50,828	食品・飲料・タバコ
VERIFONE SYSTEMS INC	75	—	—	—	ソフトウェア・サービス
IHS INC-CLASS A	36	35	445	45,306	商業・専門サービス
ASHLAND INC	—	39	402	40,934	素材

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千米ドル	千円	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	39	29	706	71,911	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	128	103	1,150	117,062	各種金融
FIDELITY NATIONAL FINL-A	129	129	430	43,850	保険
GAMESTOP CORP-CLASS A	79	56	216	22,075	小売
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	46	59	1,172	119,296	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	48	82	413	42,077	耐久消費財・アパレル
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	19	16	866	88,121	消費者サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	53	53	242	24,623	運輸
TRANSDIGM GROUP INC	31	25	471	47,925	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	66	541	4,166	423,952	ソフトウェア・サービス
OCWEN FINANCIAL CORP	—	61	211	21,520	銀行
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	91	71	520	52,961	消費者サービス
WESTERN UNION CO	385	284	452	45,998	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS	198	—	—	—	ソフトウェア・サービス
KBR INC	94	81	199	20,296	資本財
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	187	243	709	72,171	運輸
SPECTRA ENERGY CORP	417	350	1,428	145,398	エネルギー
TIME WARNER CABLE-A	188	145	2,045	208,139	メディア
NYSE EURONEXT	157	—	—	—	各種金融
DELTA AIR LINES INC	124	106	427	43,449	運輸
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	31	25	358	36,452	エネルギー
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	314	253	1,488	151,448	各種金融
COVIDIEN PLC	295	233	1,697	172,710	ヘルスケア機器・サービス
TE CONNECTIVITY LTD	273	216	1,265	128,788	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CONCHO RESOURCES INC	61	56	736	74,935	エネルギー
VMWARE INC-CLASS A	52	46	448	45,591	ソフトウェア・サービス
TERADATA CORP	107	83	348	35,420	ソフトウェア・サービス
INVESCO LTD	285	227	816	83,113	各種金融
NETSUITE INC	—	17	138	14,124	ソフトウェア・サービス
CALPINE CORP	191	172	394	40,104	公益事業
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,045	833	7,279	740,732	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	331	263	5,627	572,612	ソフトウェア・サービス
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	134	105	597	60,784	食品・飲料・タバコ
AMERICAN WATER WORKS CO INC	119	95	452	46,054	公益事業
LORILLARD INC	246	188	1,110	112,981	食品・飲料・タバコ
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	54	42	326	33,206	メディア
MARATHON PETROLEUM CORP	216	154	1,352	137,615	エネルギー
CAREFUSION CORP	151	114	487	49,652	ヘルスケア機器・サービス
KINDER MORGAN INC	413	352	1,184	120,483	エネルギー
XYLEM INC	119	100	385	39,188	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	202	243	2,414	245,661	素材
PVH CORP	45	41	549	55,881	耐久消費財・アパレル
LINKEDIN CORP - A	51	53	855	87,027	ソフトウェア・サービス
HCA HOLDINGS INC	154	169	903	91,893	ヘルスケア機器・サービス
NIELSEN NV	79	143	683	69,574	商業・専門サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	—	37	475	48,346	ソフトウェア・サービス
ENSCO PLC-CL A	149	121	624	63,526	エネルギー
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	130	105	919	93,592	食品・飲料・タバコ
FIRST REPUBLIC BANK/CA	64	66	337	34,385	銀行
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	127	145	263	26,816	エネルギー

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千米ドル	千円	
CIT GROUP INC	122	98	439	44,769	銀行
DOLLAR GENERAL CORP	168	168	918	93,444	小売
REALOGY HOLDINGS CORP	—	74	281	28,662	不動産
TOWERS WATSON & CO-CL A	—	34	393	40,058	商業・専門サービス
QEP RESOURCES INC	111	99	314	31,990	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	62	83	361	36,780	資本財
GENERAL MOTORS CO	502	668	2,311	235,161	自動車・自動車部品
VANTIV INC - CL A	—	63	198	20,156	ソフトウェア・サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	—	98	960	97,710	耐久消費財・アパレル
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	185	160	1,117	113,689	自動車・自動車部品
PHILLIPS 66	374	308	2,559	260,462	エネルギー
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	—	30	155	15,859	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADT CORPORATION	148	107	347	35,354	商業・専門サービス
SERVICENOW INC	—	65	352	35,824	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	—	46	386	39,360	ソフトウェア・サービス
ABBVIE INC	986	829	4,487	456,618	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
T-MOBILE US INC	109	127	439	44,715	電気通信サービス
ZOETIS INC	—	260	793	80,777	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SPRINT CORP	—	419	385	39,254	電気通信サービス
ANTERO RESOURCES CORP	—	27	170	17,316	エネルギー
TWITTER INC	—	61	208	21,204	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	—	73	267	27,203	各種金融
CHENIERE ENERGY INC	—	118	692	70,437	エネルギー
AMAZON.COM	226	205	6,361	647,302	小売
ADOBE SYSTEMS INC	315	250	1,623	165,174	ソフトウェア・サービス
ALTERA CORPORATION	204	172	572	58,282	半導体・半導体製造装置
AMGEN	477	396	4,584	466,457	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANALOG DEVICES	191	158	833	84,849	半導体・半導体製造装置
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	123	103	1,740	177,117	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMCAST CORP-CL A	1,333	1,124	5,828	593,003	メディア
ANSYS INC	59	52	388	39,481	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	589	469	29,294	2,980,679	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS	792	619	1,272	129,449	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	142	115	595	60,566	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESS	302	253	2,003	203,811	ソフトウェア・サービス
BMC SOFTWARE	101	—	—	—	ソフトウェア・サービス
BED BATH & BEYOND INC	141	109	661	67,319	小売
B/E AEROSPACE INC	—	54	518	52,744	資本財
COMCAST CORP-SPECIAL A	329	241	1,240	126,263	メディア
SLM CORP	300	—	—	—	各種金融
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	103	75	451	45,894	運輸
VERISIGN INC	99	66	333	33,914	ソフトウェア・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	2,061	1,676	552	56,215	メディア
SEAGATE TECHNOLOGY	211	167	889	90,538	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELGENE CORP	263	213	3,295	335,321	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	119	101	615	62,618	ソフトウェア・サービス
CERNER CORP	91	161	878	89,418	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	98	87	423	43,101	保険
CINTAS CORP	67	55	346	35,258	商業・専門サービス
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	633	530	315	32,114	電気通信サービス

銘柄	当期末(前期末)	期 末			業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千米ドル	千円	
CISCO SYSTEMS	3,306	2,707	6,718	683,655	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EQUINIX INC	31	27	551	56,093	ソフトウェア・サービス
MARRIOTT INTL A	—	125	746	75,981	消費者サービス
CA INC	206	165	477	48,551	ソフトウェア・サービス
DIRECTV	358	258	2,124	216,157	メディア
CREE INC	76	66	321	32,742	半導体・半導体製造装置
BROADCOM CORP-CL A	324	278	875	89,116	半導体・半導体製造装置
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	190	316	1,547	157,407	ソフトウェア・サービス
DELL INC	944	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DOLLAR TREE INC	147	112	596	60,679	小売
EBAY	729	646	3,256	331,369	ソフトウェア・サービス
DISH NETWORK CORPORATION-A	136	113	669	68,133	メディア
ELECTRONIC ARTS INC	200	154	537	54,719	ソフトウェア・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	134	110	509	51,794	運輸
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	519	407	2,895	294,652	ヘルスケア機器・サービス
FASTENAL CO	180	146	710	72,315	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	558	462	953	97,013	銀行
FISERV INC	87	131	787	80,090	ソフトウェア・サービス
FLIR SYSTEMS INC	108	68	240	24,420	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOSSIL GROUP INC	32	24	250	25,450	耐久消費財・アパレル
FLEXTRONICS INTL LTD	426	335	338	34,412	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	89	79	377	38,438	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	951	807	6,610	672,595	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	156	—	—	—	自動車・自動車部品
NVIDIA CORP	397	298	566	57,652	半導体・半導体製造装置
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	83	65	754	76,763	食品・飲料・タバコ
LIFE TECHNOLOGIES CORP	110	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	154	120	194	19,804	ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	95	73	501	50,997	食品・飲料・タバコ
HASBRO INC	68	59	317	32,312	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	56	44	527	53,705	ヘルスケア機器・サービス
F5 NETWORKS INC	50	38	420	42,830	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	77	66	671	68,356	電気通信サービス
HOLOGIC INC	169	115	275	28,062	ヘルスケア機器・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	—	72	414	42,211	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUDSON CITY BANCORP INC	329	276	272	27,748	銀行
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	58	47	371	37,839	運輸
BIOGEN IDEC INC	140	124	3,832	389,908	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC	179	138	1,098	111,724	ソフトウェア・サービス
INTEL CORP	3,098	2,612	7,023	714,633	半導体・半導体製造装置
KLA-TENCOR CORP	106	89	584	59,495	半導体・半導体製造装置
LSI CORP	390	—	—	—	半導体・半導体製造装置
LAM RESEARCH CORP	116	87	540	54,976	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	113	90	489	49,804	ソフトウェア・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP	145	120	555	56,477	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	219	179	690	70,269	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	183	146	501	51,021	半導体・半導体製造装置
ACTIVISION BLIZZARD INC	279	251	510	51,923	ソフトウェア・サービス
MICROSOFT CORP	4,724	4,136	16,549	1,683,927	ソフトウェア・サービス
MICRON TECHNOLOGY	639	557	1,594	162,259	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	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千米ドル	千円	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	121	99	471	47,937	半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	306	194	305	31,048	半導体・半導体製造装置
MYLAN INC	260	199	973	99,017	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	79	68	1,070	108,914	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	232	184	679	69,136	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEARS HOLDINGS CORPORATION	25	—	—	—	小売
NORTHERN TRUST CORP	139	118	720	73,315	各種金融
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	70	54	802	81,688	小売
ORACLE CORP	2,401	—	—	—	ソフトウェア・サービス
PACCAR INC	215	181	1,161	118,168	資本財
PATTERSON COMPANIES INC	61	46	180	18,376	ヘルスケア機器・サービス
PAYCHEX INC	209	171	703	71,592	ソフトウェア・サービス
PERRIGO CO PLC	60	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PETSMART INC	69	50	280	28,570	小売
PHARMACYCLICS INC	—	35	309	31,481	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARMIN LTD	80	57	336	34,263	耐久消費財・アパレル
COSTCO WHOLESALE CORP	271	230	2,636	268,291	食品・生活必需品小売り
PRICE T ROWE GROUP INC	162	133	1,086	110,554	各種金融
QUALCOMM	1,060	888	7,129	725,382	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REGENERON PHARMACEUTICALS	48	40	1,234	125,597	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	68	389	39,660	保険
ROSS STORES INC	145	110	745	75,870	小売
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,060	891	3,335	339,351	食品・飲料・タバコ
SANDISK CORP	154	122	1,171	119,206	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PRICELINE GROUP INC/THE	31	27	3,478	353,946	小売
SEI INVESTMENTS COMPANY	87	69	230	23,501	各種金融
SIGMA-ALDRICH	77	64	636	64,814	素材
STAPLES INC	438	341	387	39,392	小売
STARBUCKS CORP	463	397	2,909	296,069	消費者サービス
NETFLIX INC	33	29	1,197	121,825	小売
STERICYCLE INC	55	46	521	53,047	商業・専門サービス
SYMANTEC CORP	449	354	781	79,566	ソフトウェア・サービス
SYNOPSIS INC	93	81	318	32,438	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	25	20	753	76,698	ヘルスケア機器・サービス
TEXAS INSTRUMENTS	697	567	2,636	268,312	半導体・半導体製造装置
TRACTOR SUPPLY COMPANY	44	75	479	48,758	小売
TRIMBLE NAVIGATION LTD	160	129	466	47,424	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	138	121	870	88,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
URBAN OUTFITTERS INC	74	61	203	20,748	小売
WESTERN DIGITAL CORP	142	117	1,028	104,616	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WYNN RESORTS LTD	51	41	901	91,744	消費者サービス
WHOLE FOODS MKT INC	112	195	738	75,164	食品・生活必需品小売り
NASDAQ OMX GROUP	78	63	238	24,250	各種金融
CME GROUP INC	201	166	1,196	121,793	各種金融
LQ CORP	190	155	438	44,628	小売
XILINX INC	164	138	644	65,598	半導体・半導体製造装置
YAHOO	720	509	1,772	180,361	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	88	110	503	51,191	メディア
GOOGLE INC-CL A	165	147	8,419	856,660	ソフトウェア・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	281	228	780	79,432	メディア

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千米ドル	千円		
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	965	768	2,701	274,893	メディア	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	93	79	629	64,032	メディア	
EXPEDIA INC	62	57	421	42,934	小売	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	71	272	1,176	119,730	メディア	
VIACOM INC-CLASS B	281	203	1,745	177,578	メディア	
VIRGIN MEDIA INC	164	—	—	—	メディア	
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	330	243	707	71,985	小売	
WINDSTREAM HOLDINGS INC	380	331	321	32,684	電気通信サービス	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	220	182	264	26,872	銀行	
LULULEMON ATHLETICA INC	64	51	232	23,631	耐久消費財・アパレル	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	38	31	265	27,006	小売	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	54	47	365	37,168	メディア	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	154	127	897	91,283	半導体・半導体製造装置	
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	149	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	90	81	491	50,055	商業・専門サービス	
CHARTER COMMUNICATION-A	28	38	559	56,950	メディア	
TESLA MOTORS INC	—	43	923	93,974	自動車・自動車部品	
TRIPADVISOR INC	—	63	600	61,116	小売	
LIBERTY MEDIA CORP	65	49	628	63,926	メディア	
FACEBOOK INC-A	984	986	6,264	637,399	ソフトウェア・サービス	
KRAFT FOODS GROUP INC	350	312	1,823	185,512	食品・飲料・タバコ	
NEWS CORP-CLASS A	—	201	344	35,066	メディア	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	—	94	375	38,236	運輸	
FIREEYE INC	—	33	116	11,869	ソフトウェア・サービス	
ENDO INTERNATIONAL PLC	—	74	547	55,723	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GOOGLE INC-CL C	—	150	8,446	859,435	ソフトウェア・サービス	
NAVIENT CORP	—	226	354	36,063	各種金融	
小 計	株 数 ・ 金 額	192,549	159,422	918,348	93,441,957	
	銘柄数 <比率>	573銘柄	584銘柄	—	<55.6%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
AGNICO EAGLE MINES	110	100	325	30,432	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	79	210	615	57,634	食品・生活必需品小売り	
BARRICK GOLD CORP	633	598	1,019	95,439	素材	
ATCO LTD -CLASS I	—	40	206	19,335	公益事業	
TALISMAN ENERGY INC	660	559	623	58,314	エネルギー	
BANK MONTREAL	407	332	2,550	238,695	銀行	
BANK NOVA SCOTIA	730	641	4,417	413,370	銀行	
NATIONAL BANK OF CANADA	103	176	808	75,626	銀行	
BCE INC	165	139	695	65,078	電気通信サービス	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	350	286	1,366	127,904	不動産	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	171	168	2,330	218,061	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BOMBARDIER B	922	713	270	25,318	資本財	
SAPUTO INC	82	62	362	33,888	食品・飲料・タバコ	
BLACKBERRY LIMITED	302	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	177	—	—	—	不動産	
CGI GROUP INC - CL A	130	121	450	42,120	ソフトウェア・サービス	
CAE INC	161	120	179	16,829	資本財	
CAMECO CORP	252	211	450	42,168	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	246	198	894	83,658	電気通信サービス	
CANADIAN IMPERIAL BANK	254	206	2,042	191,135	銀行	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダドル	千円	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	689	561	2,465	230,727	エネルギー
CANADIAN TIRE CORP -CL A	50	41	425	39,786	小売
CANADIAN UTILITIES LTD A	36	57	225	21,142	公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	265	435	2,843	266,038	運輸
FIRST CAPITAL REALTY INC	—	55	103	9,652	不動産
AGRIUM INC	93	75	739	69,232	素材
YAMANA GOLD INC	472	373	288	27,026	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	68	56	336	31,456	耐久消費財・アパレル
OPEN TEXT CORP	36	62	314	29,466	ソフトウェア・サービス
ELDORADO GOLD CORP	433	340	209	19,587	素材
OSISKO MINING CORP	272	—	—	—	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	20	28	189	17,694	食品・生活必需品小売り
VERMILION ENERGY INC	60	50	372	34,880	エネルギー
FINNING INTERNATIONAL INC	109	89	262	24,566	資本財
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	55	—	—	—	商業・専門サービス
FORTIS INC	119	119	386	36,208	公益事業
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	358	303	693	64,892	素材
TELUS CORP	194	164	678	63,462	電気通信サービス
GREAT-WEST LIFE CO INC	182	151	449	42,042	保険
IAMGOLD CORP	240	—	—	—	素材
IMPERIAL OIL	190	158	859	80,380	エネルギー
ENBRIDGE	475	445	2,311	216,328	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	65	58	308	28,877	各種金融
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	256	—	—	—	素材
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,141	950	1,900	177,835	保険
LOBLAW COMPANIES LTD	70	115	535	50,061	食品・生活必需品小売り
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	193	149	308	28,903	エネルギー
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	61	51	216	20,294	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	137	117	1,304	122,072	自動車・自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	373	314	1,162	108,789	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	—	10	563	52,740	保険
METRO INC	61	45	303	28,392	食品・生活必需品小売り
HUSKY ENERGY INC	220	185	676	63,257	エネルギー
METHANEX CORP	—	50	319	29,916	素材
ONEX CORP	58	43	293	27,505	各種金融
TRANSCANADA CORP	443	364	1,846	172,769	エネルギー
PAN AMERICAN SILVER CORP	95	—	—	—	素材
GOLDCORP INC	509	416	1,048	98,121	素材
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	540	452	1,779	166,523	素材
POWER CORP OF CANADA	223	188	555	51,976	保険
POWER FINANCIAL CORP	158	133	443	41,525	保険
ROYAL BANK OF CANADA	898	760	5,715	534,803	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	93	80	419	39,284	資本財
CP RAILWAY LIMITED	107	93	1,690	158,136	運輸
ENCANA CORP	471	399	997	93,343	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	242	207	560	52,471	メディア
SHOPPERS DRUG MART CORP	132	—	—	—	食品・生活必需品小売り
NEW GOLD INC	296	296	163	15,323	素材
SUNCOR ENERGY	941	770	3,226	301,925	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B	362	291	715	66,960	素材

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千カナダドル	千円		
THOMSON REUTERS CORP	234	202	772	72,269	メディア	
TORONTO-DOMINION BANK	574	969	5,221	488,556	銀行	
TRANSALTA CORP	156	156	203	19,060	公益事業	
WESTON (GEORGE) LTD	32	26	212	19,909	食品・生活必需品小売り	
CENTERRA GOLD INC	114	—	—	—	素材	
KINROSS GOLD CORP	729	556	224	21,038	素材	
INTACT FINANCIAL CORP	82	70	510	47,754	保険	
SILVER WHEATON CORP	222	188	415	38,900	素材	
CATAMARAN CORPORATION	131	110	521	48,793	ヘルスケア機器・サービス	
FRANCO-NEVADA CORP	93	72	360	33,777	素材	
CI FINANCIAL CORP	97	82	276	25,903	各種金融	
BELL ALIANT INC	52	52	150	14,036	電気通信サービス	
TOURMALINE OIL CORP	82	87	468	43,825	エネルギー	
KEYERA CORP	—	37	280	26,226	エネルギー	
ALTAGAS INCOME LTD	—	69	336	31,477	エネルギー	
PEMBINA PIPELINE CORP	185	172	757	70,887	エネルギー	
TIM HORTONS INC	99	73	434	40,645	消費者サービス	
DOLLARAMA INC	42	36	326	30,524	小売	
BAYTEX ENERGY CORP	75	60	271	25,436	エネルギー	
MEG ENERGY CORP	91	83	310	29,089	エネルギー	
ATHABASCA OIL CORPORATION	200	200	147	13,810	エネルギー	
CENOVUS ENERGY INC	474	392	1,239	115,952	エネルギー	
ENERPLUS CORP	134	104	253	23,711	エネルギー	
PENN WEST PETROLEUM LTD	297	230	230	21,525	エネルギー	
ARC RESOURCES LTD	186	167	529	49,508	エネルギー	
CANADIAN OIL SANDS LTD	309	260	593	55,576	エネルギー	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	—	67	259	24,290	エネルギー	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	222	210	929	86,980	エネルギー	
BONAVISTA ENERGY CORP	104	—	—	—	エネルギー	
PENGROWTH ENERGY CORP	314	314	218	20,468	エネルギー	
INTER PIPELINE LTD	—	160	504	47,197	エネルギー	
小 計	株 数	金 額	23,869	20,230	77,787	7,278,531
銘 柄 数 <比 率>	93銘柄	91銘柄	—	—	—	<4.3%>
(ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ADIDAS AG	131	109	859	118,847	耐久消費財・アパレル	
COMMERZBANK AG	244	504	605	83,710	銀行	
FRESENIUS SE&CO KGAA	79	64	713	98,725	ヘルスケア機器・サービス	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	67	56	190	26,398	ソフトウェア・サービス	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	—	21	147	20,464	素材	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	38	32	211	29,203	保険	
GEA GROUP AG	109	98	318	44,101	資本財	
PROSIEBEN SAT. 1 MEDIA AG-RIGISTERED	55	117	393	54,395	メディア	
CONTINENTAL AG	70	57	1,004	138,924	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE POST AG-REG	570	508	1,377	190,611	運輸	
AXEL SPRINGER SE	24	24	117	16,222	メディア	
MERCK KGAA	41	35	444	61,463	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RWE STAMM	307	254	744	103,058	公益事業	
RWE AG-NON VTG PFD	26	—	—	—	公益事業	
SAP AG	579	483	2,712	375,261	ソフトウェア・サービス	
E.ON SE	1,132	1,050	1,488	205,963	公益事業	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
HENKEL AG & CO KGAA	83	61	454	62,947	家庭用品・パーソナル用品	
METRO STAMM	83	85	253	35,032	食品・生活必需品小売り	
BAYER	515	434	4,548	629,249	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	114	92	783	108,431	家庭用品・パーソナル用品	
BASF SE	572	482	4,090	565,869	素材	
CELESIO AG	59	25	65	9,119	ヘルスケア機器・サービス	
BELERSDORF AG	64	54	402	55,740	家庭用品・パーソナル用品	
HOCHTIEF AG	21	12	82	11,388	資本財	
HEIDELBERGCEMENT AG	90	76	487	67,400	素材	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	135	111	541	74,960	ヘルスケア機器・サービス	
ALLIANZ SE-REG	285	244	3,053	422,438	保険	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	146	121	235	32,592	運輸	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	113	94	1,540	213,073	保険	
SALZGITTER AG	26	—	—	—	素材	
VOLKSWAGEN STAMM	18	15	307	42,516	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG-PFD	90	74	1,452	200,921	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG	567	505	3,503	484,643	自動車・自動車部品	
MAN SE	27	16	152	21,086	資本財	
THYSSEN KRUPP	247	242	543	75,135	素材	
SIEMENS	517	416	4,080	564,587	資本財	
LINDE AG	116	97	1,496	206,987	素材	
DEUTSCHE BANK NAMEN	588	538	1,630	225,628	各種金融	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	208	170	1,561	216,062	自動車・自動車部品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	33	26	189	26,169	自動車・自動車部品	
K+S AG	110	83	215	29,752	素材	
SUEDZUCKER AG	57	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
DEUTSCHE TELEKOM	1,766	1,636	2,001	276,867	電気通信サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES	696	585	532	73,620	半導体・半導体製造装置	
DEUTSCHE BOERSE	124	101	561	77,653	各種金融	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	98	79	621	85,947	自動車・自動車部品	
FRAPORT AG	23	23	129	17,896	運輸	
LANXESS	53	48	250	34,708	素材	
SKY DEUTSCHLAND AG	—	232	160	22,169	メディア	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	—	161	261	36,207	不動産	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	56	13	137	19,035	メディア	
BRENNTAG AG	32	27	384	53,210	資本財	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	—	167	94	13,075	電気通信サービス	
HUGO BOSS AG	15	16	175	24,246	耐久消費財・アパレル	
OSRAM LICHT AG	—	47	176	24,442	資本財	
国 小 計	株 数 銘柄数	11,240 50銘柄	金 額 <比率>	10,645 52銘柄	48,486 —	6,708,169 <4.0%>
(イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ASSICURAZIONI GENERALI	739	632	1,054	145,827	保険	
INTESA SANPAOLO	6,377	6,304	1,535	212,463	銀行	
INTESA SANPAOLO-RNC	648	650	136	18,884	銀行	
UNICREDIT SPA	2,547	2,354	1,497	207,152	銀行	
MEDIOBANCA	346	304	220	30,449	各種金融	
PIRELLI & CO	149	110	134	18,666	自動車・自動車部品	
SAIPEM	169	159	308	42,653	エネルギー	
LUXOTTICA GROUP SPA	105	90	374	51,797	耐久消費財・アパレル	

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
FIAT ORD	560	470	365	50,524	自動車・自動車部品
FINMECCANICA SPA	254	211	126	17,559	資本財
ENEL	4,139	3,505	1,482	205,122	公益事業
ENI	1,599	1,344	2,537	351,072	エネルギー
SNAM SPA	1,082	1,100	470	65,046	公益事業
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	542	458	303	41,993	銀行
TELECOM ITALIA ORD	6,014	5,445	493	68,217	電気通信サービス
TELECOM ITALIA RNC	3,789	3,194	222	30,737	電気通信サービス
ATLANTIA SPA	208	232	461	63,859	運輸
TERNA SPA	836	836	323	44,729	公益事業
EXOR SPA	46	58	182	25,250	各種金融
PRYSMIAN SPA	128	108	186	25,765	資本財
BANCO POPOLARE SPA	1,109	—	—	—	銀行
ENEL GREEN POWER SPA	1,100	926	189	26,261	公益事業
FIAT INDUSTRIAL	548	—	—	—	資本財
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	—	470	115	16,009	保険
国 小 計	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	33,044	28,969	12,721	1,760,044	
銘 柄 数 < 比 率 >	23銘柄	22銘柄	—	<1.0%>	
(フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
BOUYGUES ORD	120	97	326	45,234	資本財
AIR LIQUIDE	196	161	1,725	238,763	素材
VEOLIA ENVIRONNEMENT	217	197	274	37,925	公益事業
LOREAL	151	125	1,600	221,412	家庭用品・パーソナル用品
CHRISTIAN DIOR	34	28	421	58,264	耐久消費財・アパレル
LVMH	158	147	2,126	294,143	耐久消費財・アパレル
THALES SA	58	46	204	28,224	資本財
CAP GEMINI SA	94	75	407	56,434	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	36	28	267	37,012	食品・生活必需品小売り
CGG	101	—	—	—	エネルギー
PUBLICIS GROUPE	111	93	592	81,928	メディア
LAFARGE (FRANCE)	119	96	617	85,494	素材
LAGADERE S. C. A	74	55	147	20,345	メディア
BOLLORE	—	3	147	20,351	運輸
MICHELIN	114	97	872	120,765	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD	132	110	981	135,807	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	123	99	693	95,894	自動車・自動車部品
REMY COINTREAU	15	15	102	14,152	食品・飲料・タバコ
VINCI S. A.	289	249	1,360	188,261	資本財
SCHNEIDER ELECTRIC	330	275	1,916	265,130	資本財
VIVENDI	818	630	1,207	167,123	電気通信サービス
TECHNIP S. A.	65	54	426	58,962	エネルギー
TOTAL SA	1,326	1,125	5,831	806,786	エネルギー
VALLOUREC	65	55	217	30,058	資本財
VALEO SA	—	39	388	53,813	自動車・自動車部品
ORANGE	1,165	968	1,178	163,027	電気通信サービス
SOCIETE BIC SA	18	14	135	18,799	商業・専門サービス
DASSAULT SYSTEMES SA	40	31	298	41,350	ソフトウェア・サービス
KERING	47	40	653	90,346	耐久消費財・アパレル
CNP ASSURANCES	113	85	135	18,802	保険
CARREFOUR	386	321	865	119,720	食品・生活必需品小売り

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
ATOS	34	43	280	38,827	ソフトウェア・サービス
SANOFI	741	622	4,853	671,510	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR	92	93	354	49,113	消費者サービス
SOCIETE GENERALE	444	381	1,642	227,266	銀行
ALCATEL-LUCENT	—	1,488	442	61,270	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EURAZEO	19	20	129	17,950	各種金融
SODEXO	60	50	399	55,299	消費者サービス
AXA	1,119	979	1,767	244,579	保険
PEUGEOT SA	136	205	211	29,226	自動車・自動車部品
JC DECAUX SA	46	31	90	12,524	メディア
ESSILOR INTERNATIONAL	126	105	819	113,337	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT AGRICOLE SA	644	542	648	89,688	銀行
ZODIAC AEROSPACE	21	89	229	31,754	資本財
BNP PARIBAS	628	569	3,023	418,369	銀行
SAINT-GOBAIN	255	236	990	137,026	資本財
WENDEL	21	18	211	29,304	各種金融
ILIAD SA	14	13	299	41,376	電気通信サービス
IMERYS SA	23	19	125	17,323	素材
DANONE (GROUPE)	363	298	1,612	223,112	食品・飲料・タバコ
SAFRAN SA	146	139	694	96,143	資本財
GDF SUEZ	803	766	1,561	216,099	公益事業
ALSTOM RGPT	132	116	337	46,705	資本財
EUTELSAT COMMUNICATIONS	84	71	181	25,088	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE	153	123	341	47,198	公益事業
ARKEMA	39	31	236	32,769	素材
LEGRAND SA	151	142	672	93,103	資本財
ADP	20	17	161	22,278	運輸
NATIXIS	637	468	232	32,166	銀行
SCOR SE	105	77	199	27,599	保険
REXEL SA	75	148	259	35,929	資本財
BUREAU VERITAS SA	34	111	243	33,702	商業・専門サービス
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	359	258	254	35,143	運輸
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	179	145	214	29,664	公益事業
EDENRED	108	113	262	36,320	商業・専門サービス
国 小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	50,112	6,933,117	
	・ 金 額 < 比 率 >	13,916 64銘柄	—	< 4.1% >	
(オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIRBUS GROUP NV	283	310	1,646	227,823	資本財
REED ELSEVIER NV	440	375	607	84,066	メディア
RANDSTAD HOLDING NV	77	67	293	40,564	商業・専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD NV	645	482	636	88,036	食品・生活必需品小売り
AKZO NOBEL	152	124	686	94,942	素材
UNILEVER NV-CVA	1,014	854	2,707	374,547	食品・飲料・タバコ
WOLTERS KLUWER	189	153	333	46,147	メディア
QIAGEN N. V.	151	111	189	26,193	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KONINKLIJKE DSM NV	98	89	472	65,356	素材
VOPAK	44	36	136	18,866	エネルギー
AEGON	1,128	985	630	87,205	保険
ASML HOLDING NV	198	187	1,171	162,050	半導体・半導体製造装置
KPN (KON.)	630	1,719	469	64,968	電気通信サービス

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
STMICROELECTRONICS	400	321	233	32,322	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS	596	508	1,180	163,325	資本財
ING GROEP	2,424	2,056	2,098	290,371	各種金融
HEINEKEN NV	147	119	606	83,907	食品・飲料・タバコ
GEMALTO	50	42	341	47,238	ソフトウェア・サービス
FUGRO NV-CVA	44	36	152	21,078	エネルギー
HEINEKEN HOLDING NV	62	54	261	36,179	食品・飲料・タバコ
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	51	44	183	25,335	資本財
TNT EXPRESS	221	221	142	19,728	運輸
DELTA LLOYD NV	87	110	196	27,212	保険
ZIGGO NV	75	75	258	35,734	電気通信サービス
DE MASTER BLENDERS1753 NV	314	—	—	—	食品・飲料・タバコ
OCI NV	—	54	153	21,183	資本財
CNH INDUSTRIAL NV	—	509	407	56,348	資本財
国 小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	外 貨 建 金 額 —	邦 貨 換 算 金 額 2,240,735	
	9,531 <比率>	9,652 <比率>	16,196	<1.3%>	
(スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	237	224	359	49,675	運輸
IBERDROLA SA	3,079	2,739	1,433	198,307	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA	3,465	3,170	2,978	412,090	銀行
ACCIONA SA	18	—	—	—	公益事業
GAS NATURAL SDG SA	226	191	406	56,264	公益事業
REPSOL SA	529	465	952	131,810	エネルギー
BANCO SANTANDER SA	6,572	6,390	4,810	665,572	銀行
RED ELECTRICA CORPORACION SA	69	59	367	50,860	公益事業
TELEFONICA	2,624	2,169	2,660	368,019	電気通信サービス
ZARDOYA OTIS SA	102	102	135	18,699	資本財
INDITEX	140	117	1,252	173,224	小売
ENAGAS	123	104	223	30,933	公益事業
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	91	94	301	41,653	資本財
GRIFOLS SA	96	86	346	47,927	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FERROVIAL SA	260	220	349	48,352	資本財
MAPFRE SA	550	650	195	27,004	保険
BANCO DE SABADELL SA	1,460	1,877	448	62,013	銀行
CAIXABANK	544	927	413	57,226	銀行
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	202	208	667	92,320	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	643	568	275	38,119	運輸
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	399	333	223	30,945	食品・生活必需品小売り
国 小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	外 貨 建 金 額 —	邦 貨 換 算 金 額 2,601,022	
	21,438 <比率>	20,702 <比率>	18,800	<1.5%>	
(ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UMICORE	73	53	189	26,153	素材
DELHAIZE GROUP	65	52	275	38,139	食品・生活必需品小売り
KBC GROEP NV	148	133	585	81,024	銀行
ANHEUSER-BUSCH INBEV	500	420	3,403	470,940	食品・飲料・タバコ
SOLVAY SA	37	31	376	52,117	素材
UCB (GROUPE)	70	58	340	47,094	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT SA	48	44	185	25,599	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	52	42	322	44,621	各種金融

銘柄	株数	当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
AGEAS	149	119	370	51,209	保険	
BELGACOM	97	77	188	26,093	電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	32	32	139	19,311	メディア	
国 小 計	1,274	1,066	6,377	882,307		
	銘柄数 <比率>	11銘柄	11銘柄	—	<0.5%>	
(オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
TELEKOM AUSTRIA AG	159	138	98	13,680	電気通信サービス	
OMV AG	94	81	246	34,057	エネルギー	
VERBUND AG	45	—	—	—	公益事業	
VOESTALPINE AG	69	54	188	26,129	素材	
ERSTE GROUP BANK AG	140	143	361	49,959	銀行	
IMMOFINANZ AG	588	551	141	19,518	不動産	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	34	57	140	19,432	銀行	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	28	22	88	12,254	保険	
ANDRITZ AG	46	34	151	20,930	資本財	
国 小 計	1,205	1,084	1,416	195,965		
	銘柄数 <比率>	9銘柄	8銘柄	—	<0.1%>	
(ルクセンブルク)	百株	百株	千ユーロ	千円		
TENARIS SA	302	256	416	57,643	エネルギー	
SES	194	155	409	56,658	メディア	
ARCELORMITTAL	637	519	589	81,592	素材	
RTL GROUP	—	20	172	23,898	メディア	
ALTICE SA	—	31	160	22,177	メディア	
国 小 計	1,134	982	1,748	241,970		
	銘柄数 <比率>	3銘柄	5銘柄	—	<0.1%>	
(フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
KESKO OYJ-B SHS	44	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
WARTSILA OYJ	107	69	273	37,804	資本財	
UPM KYMMENE CORP	330	275	360	49,938	素材	
STORA ENSO OYJ R	352	312	240	33,232	素材	
SAMPO OYJ-A SHS	270	231	845	116,971	保険	
FORTUM OYJ	284	236	413	57,162	公益事業	
POHJOLA BANK-A SHS	96	—	—	—	各種金融	
ELISA A	90	70	155	21,550	電気通信サービス	
METSO OYJ	87	65	186	25,861	資本財	
NOKIA CORP	2,398	1,970	1,142	158,126	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NESTE OIL OYJ	86	63	95	13,179	エネルギー	
NOKIAN RENKAAT OYJ	71	61	191	26,496	自動車・自動車部品	
KONE OYJ-B	99	167	513	71,106	資本財	
ORION OYJ-CLASS B	68	58	136	18,878	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
国 小 計	4,389	3,584	4,555	630,308		
	銘柄数 <比率>	14銘柄	12銘柄	—	<0.4%>	
(アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
CRH	462	417	859	118,944	素材	
ELAN CORPORATION PLC	343	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KERRY GROUP PLC-A	95	90	501	69,416	食品・飲料・タバコ	
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION	450	—	—	—	銀行	
国 小 計	1,351	508	1,361	188,360		
	銘柄数 <比率>	4銘柄	2銘柄	—	<0.1%>	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ギリシャ) OPAP SA	百株 149	百株 —	千ユーロ —	千円 —	消費者サービス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	— —	— —	— <—%>	
(ポルトガル) ENERGIAS DE PORTUGAL SA PORTUGAL TELECOM GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS JERONIMO MARTINS	百株 1,246 415 160 152	百株 1,146 — 210 152	千ユーロ 393 — 269 191	千円 54,400 — 37,345 26,435	公益事業 電気通信サービス エネルギー 食品・生活必需品小売り
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	1,974 4銘柄	1,508 3銘柄	854 — <0.1%>	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	101,091 227銘柄	92,622 225銘柄	162,632 — <13.4%>	
(イギリス) ABERDEEN ASSET MGMT PLC AMEC PLC ANTOFAGASTA PLC SEVERN TRENT PLC BHP BILLITON PLC ARM HOLDINGS PLC BALFOUR BEATTY PLC BRITISH SKY BROADCASTING AGGREKO PLC TULLOW OIL PLC BUNZL PLC CAPITA GROUP PLC AVIVA PIC CRODA INTERNATIONAL PLC DIAGEO SCHRODERS PLC BAE SYSTEMS PLC BRITISH AMERICAN TOBACCO STANDARD CHARTERED PLC REXAM IMPERIAL-TOBACCO GROUP IMI PLC JOHNSON MATTHEY PLC SABMILLER PLC ANGLO AMERICAN PLC COMPASS GROUP PLC HSBC HOLDINGS PLC (GB) LEGAL & GENERAL GROUP UNILEVER PLC MEGGITT PLC MORRISON SUPERMARKETS UNITED UTILITIES GROUP PLC RSA INSURANCE GROUP PLC GRP ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC PEARSON PERSIMMON PLC PRUDENTIAL	百株 556 200 252 152 1,313 867 440 679 171 580 208 418 1,883 86 1,560 75 2,080 1,205 1,514 505 623 205 131 601 874 1,170 11,590 3,812 807 491 1,472 436 2,291 228 513 — 1,618	百株 502 152 193 123 1,096 734 — 534 123 474 171 353 1,565 66 1,312 59 1,694 984 1,285 407 510 147 109 506 732 950 10,102 3,143 676 406 1,187 362 548 184 416 155 1,356	千イギリスポンド 223 178 154 238 2,106 679 — 472 216 399 288 389 825 173 2,467 154 711 3,481 1,733 216 1,356 229 367 1,662 1,119 952 6,356 720 1,806 195 236 311 262 556 477 211 1,907	千円 37,962 30,441 26,250 40,517 358,374 115,616 — 80,395 36,806 67,937 49,152 66,256 140,371 29,539 419,714 26,261 120,970 592,202 294,823 36,865 230,821 39,037 62,522 282,871 190,423 161,944 1,081,349 122,601 307,387 33,336 40,175 53,025 44,728 94,711 81,273 35,982 324,447	各種金融 エネルギー 素材 公益事業 素材 半導体・半導体製造装置 資本財 メディア 商業・専門サービス エネルギー 資本財 商業・専門サービス 保険 素材 食品・飲料・タバコ 各種金融 資本財 食品・飲料・タバコ 銀行 素材 食品・飲料・タバコ 消費者サービス 銀行 保険 食品・飲料・タバコ 資本財 食品・生活必需品小売り 公益事業 保険 食品・飲料・タバコ メディア 耐久消費財・アパレル 保険

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
RIO TINTO PLC REG	830	657	2,089	355,373	素材
VODAFONE GROUP PLC	30,630	13,891	2,913	495,659	電気通信サービス
RECKITT BENCKISER PLC	403	340	1,720	292,748	家庭用品・パーソナル用品
REED ELSEVIER PLC	766	616	581	98,917	メディア
OLD MUTUAL PLC	3,153	2,595	528	89,933	保険
ROYAL BANK OF SCOTLAND	1,348	1,310	449	76,469	銀行
TRAVIS PERKINS PLC	—	120	207	35,329	資本財
SSE PLC	594	505	780	132,743	公益事業
SERCO GROUP PLC	319	—	—	—	商業・専門サービス
BP PLC	11,853	9,679	4,899	833,371	エネルギー
SAGE GROUP PLC	792	583	241	41,078	ソフトウェア・サービス
SMITHS GROUP PLC	251	210	276	47,054	資本財
LLOYDS BANKING GROUP PLC	26,714	30,650	2,388	406,224	銀行
TATE & LYLE	317	239	161	27,498	食品・飲料・タバコ
BG GROUP	2,118	1,768	2,141	364,345	エネルギー
TESCO	5,056	4,256	1,282	218,159	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	626	490	211	35,921	各種金融
SMITH & NEPHEW PLC	575	483	480	81,793	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE	3,062	2,552	4,105	698,362	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE	136	113	292	49,807	資本財
BABCOCK INTL GROUP PLC	226	265	323	55,085	商業・専門サービス
WPP PLC	794	701	901	153,396	メディア
WOLSELEY LTD	175	135	451	76,809	資本財
ASTRAZENECA	775	662	2,819	479,572	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEW GKN	1,043	878	346	58,906	自動車・自動車部品
BT GROUP PLC	4,950	4,103	1,635	278,134	電気通信サービス
ASOS PLC	—	30	138	23,609	小売
CARNIVAL PLC	116	94	226	38,509	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	2,287	1,924	1,717	292,230	公益事業
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,029	872	386	65,819	小売
BARCLAYS	7,358	8,778	2,153	366,378	銀行
INTERTEK GROUP PLC	102	86	249	42,430	商業・専門サービス
WILLIAM HILL	—	444	153	26,157	消費者サービス
BURBERRY GROUP PLC	282	238	362	61,595	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	105	79	528	89,941	小売
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,177	970	986	167,755	資本財
KINGFISHER PLC	1,517	1,239	517	88,013	小売
VEDANTA RESOURCES PLC	66	—	—	—	素材
ICAP PLC	383	323	129	22,058	各種金融
ITV PLC	2,375	2,009	370	63,097	メディア
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	113	94	184	31,454	各種金融
SAINSBURY (J) PLC	771	639	214	36,504	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD	55	45	199	33,972	素材
G4S PLC	887	766	193	32,998	商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC	131	115	162	27,613	保険
CENTRICA PLC	3,267	2,584	854	145,440	公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,336	2,047	4,796	815,873	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,634	1,288	3,147	535,396	エネルギー
INTERCONTINENTAL HOTELS	174	139	321	54,771	消費者サービス
WHITBREAD PLC	114	96	402	68,524	消費者サービス

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
COBHAM PLC	678	560	175	29,931	資本財	
INMARSAT PLC	281	233	165	28,236	電気通信サービス	
PETROFAC LTD	166	127	160	27,240	エネルギー	
KAZAKHMY S PLC	147	—	—	—	素材	
SHIRE PLC	349	302	1,046	178,086	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
STANDARD LIFE PLC	1,521	1,257	506	86,115	保険	
INVESTEC PLC	344	308	160	27,312	各種金融	
INVENSYS PLC	521	—	—	—	資本財	
EXPERIAN PLC	646	516	534	90,965	商業・専門サービス	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	—	144	115	19,618	小売	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	167	105	128	21,876	各種金融	
TUI TRAVEL PLC	304	204	84	14,324	消費者サービス	
EURASIAN NATURAL RESOURCES	172	—	—	—	素材	
FRESNILLO PLC	114	94	77	13,252	素材	
FRIENDS LIFE GROUP LTD	897	743	233	39,728	保険	
MELROSE INDUSTRIES PLC	770	565	159	27,133	資本財	
GLENCORE PLC	6,425	5,591	1,834	311,992	素材	
EVRAZ PLC	236	—	—	—	素材	
EASYJET PLC	—	76	119	20,411	運輸	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	—	734	181	30,811	保険	
COCA-COLA HBC AG-CDI	126	112	154	26,207	食品・飲料・タバコ	
ROYAL MAIL PLC	—	369	190	32,431	運輸	
小 計	株 数 銘柄数	金 額 <比率>	179,306 101銘柄	148,109 102銘柄	90,503 —	15,395,620 <9.2%>
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円		
SULZER AG-REG	—	11	161	18,330	資本財	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	157	17,858	食品・飲料・タバコ	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	0.56	0.49	217	24,618	食品・飲料・タバコ	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	0.06	0.05	262	29,743	食品・飲料・タバコ	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	27	23	228	25,895	耐久消費財・アパレル	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2	—	—	—	銀行	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	5	4	158	17,944	素材	
PARGESA HOLDING SA-BR	18	12	104	11,804	各種金融	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	10	9	222	25,263	各種金融	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	13	10	140	15,927	資本財	
ARYZTA AG	55	44	366	41,487	食品・飲料・タバコ	
SYNGENTA AG	58	48	1,701	192,773	素材	
SIKA AG-BR	1	1	396	44,908	素材	
SGS SA	3	2	666	75,497	商業・専門サービス	
SULZER AG-REG	15	—	—	—	資本財	
SWISSCOM	14	11	623	70,667	電気通信サービス	
GEBERIT AG-REG	23	20	613	69,483	資本財	
GIVAUDAN-REG	5	4	726	82,335	素材	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	93	79	2,115	239,733	保険	
NOVARTIS	1,432	1,206	9,746	1,104,330	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABB LTD	1,382	1,150	2,460	278,846	資本財	
ROCHE HOLDING GENUSS	437	368	9,767	1,106,731	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO	84	86	648	73,530	商業・専門サービス	
HOLCIM LTD	146	115	917	104,001	素材	
NESTLE SA - REGISTERED	2,014	1,688	11,813	1,338,635	食品・飲料・タバコ	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千スイスフラン	千円		
BALOISE HOLDING AG	30	25	274	31,134	保険	
UBS AG-REG	2,282	1,945	3,550	402,323	各種金融	
SONOVA HOLDING AG-REG	30	26	363	41,222	ヘルスケア機器・サービス	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	34	27	338	38,375	運輸	
CREDIT SUISSE GROUP AG	813	799	2,161	244,934	各種金融	
SWATCH GROUP AG(BEARER)	19	16	850	96,319	耐久消費財・アパレル	
LONZA GROUP AG-REG	33	27	265	30,130	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	19	16	357	40,489	保険	
SWISS PRIME SITE-REG	34	29	215	24,368	不動産	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	31	24	340	38,603	資本財	
ACTELION LTD-REG	68	55	488	55,347	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	326	271	2,558	289,868	耐久消費財・アパレル	
JULIUS BAER GROUP LTD	139	123	499	56,611	各種金融	
SWISS RE LTD	222	187	1,494	169,386	保険	
TRANSOCEAN LTD	227	188	701	79,494	エネルギー	
小 計	株 数 銘 柄 数	・ 金 額 < 比 率 >	10,166 39銘柄	8,669 38銘柄	58,679 —	6,648,960 <4.0%>
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円		
ATLAS COPCO A	422	348	6,810	104,331	資本財	
SKF AB-B	251	210	3,550	54,386	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	910	799	7,118	109,052	銀行	
SWEDBANK AB-A	507	478	8,392	128,571	銀行	
SCA SV CELLULOSA B	370	299	5,559	85,168	家庭用品・パーソナル用品	
VOLVO B	877	790	7,709	118,109	資本財	
SCANIA AB-B SHS	204	—	—	—	資本財	
SWEDISH MATCH AB	131	105	2,390	36,627	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	203	159	1,261	19,325	電気通信サービス	
NORDEA BANK AB	1,666	1,601	15,717	240,786	銀行	
ELECTROLUX AB-SER B	151	136	2,272	34,822	耐久消費財・アパレル	
SECURITAS B	196	151	1,174	18,000	商業・専門サービス	
INVESTOR AB-B SHS	293	251	6,537	100,152	各種金融	
HENNES & MAURITZ B	595	490	13,844	212,101	小売	
ASSA ABLOY B	213	169	5,789	88,698	資本財	
SVENSKA HANDELSBK A	313	260	8,767	134,311	銀行	
ERICSSON (LM) B	1,913	1,595	13,072	200,265	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SANDVIK AB	631	551	5,301	81,225	資本財	
TELIASONERA AB	1,386	1,238	6,107	93,568	電気通信サービス	
SKANSKA B	238	192	2,958	45,327	資本財	
LUNDIN PETROLEUM AB	139	113	1,489	22,813	エネルギー	
BOLIDEN AB	171	132	1,264	19,365	素材	
ALFA LAVAL AB	214	164	2,869	43,967	資本財	
GETINGE AB-B SHS	128	108	1,892	28,986	ヘルスケア機器・サービス	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	132	125	3,356	51,427	各種金融	
MILICOM INTL CELLULAR-SDR	39	33	2,041	31,278	電気通信サービス	
ELEKTA AB-B SHS	236	211	1,776	27,221	ヘルスケア機器・サービス	
HUSQVARNA AB-B SHS	258	198	1,026	15,726	耐久消費財・アパレル	
RATOS AB-B SHS	121	—	—	—	各種金融	
ATLAS COPCO B	249	207	3,787	58,022	資本財	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	74	74	1,017	15,585	各種金融	
HEXAGON AB-B SHS	151	135	2,808	43,024	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
TELE2 AB-B -REDEMPTION SHS	百株 203	百株 —	千スウェーデンクローナ —	千円 —	電気通信サービス
小 計	株 数 13,603 銘柄 数 <比 率> 33銘柄	株 数 11,335 銘柄 数 30銘柄	147,666 —	2,262,252 <1.3%>	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェークローネ	千円	
DNB ASA	630	530	5,969	101,839	銀行
NORSK HYDRO	585	695	2,272	38,775	素材
TELENOR ASA	449	417	5,933	101,227	電気通信サービス
SUBSEA 7 SA	180	133	1,599	27,287	エネルギー
ORKLA	494	389	2,029	34,617	食品・飲料・タバコ
STATOIL ASA	701	585	10,801	184,273	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	119	95	2,608	44,493	素材
SEADRILL LTD	225	202	4,527	77,241	エネルギー
AKER SOLUTIONS ASA	105	80	847	14,450	エネルギー
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	126	101	1,114	19,016	保険
小 計	株 数 3,618 銘柄 数 <比 率> 10銘柄	株 数 3,231 銘柄 数 10銘柄	37,703 —	643,224 <0.4%>	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円	
CARLSBERG AS-B	68	54	3,124	57,936	食品・飲料・タバコ
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	0.84	3	4,848	89,889	運輸
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	0.35	1	2,097	38,881	運輸
DANSKE BANK A/S	423	358	5,511	102,179	銀行
NOVOZYMES A/S	156	126	3,388	62,824	素材
TDC A/S	311	411	2,185	40,525	電気通信サービス
DSV A/S	118	93	1,702	31,557	運輸
WILLIAM DEMANT HOLDING	18	14	729	13,522	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSYEMS	—	118	3,472	64,371	資本財
NOVO NORDISK A/S-B	253	1,038	24,064	446,161	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLOPLAST-B	70	56	2,643	49,013	ヘルスケア機器・サービス
TRYG A/S	16	12	673	12,486	保険
PANDORA A/S	—	61	2,473	45,862	耐久消費財・アパレル
小 計	株 数 1,438 銘柄 数 <比 率> 11銘柄	株 数 2,350 銘柄 数 13銘柄	56,915 —	1,055,213 <0.6%>	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	84	65	311	29,276	ヘルスケア機器・サービス
AGL ENERGY LTD	349	294	463	43,554	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,697	1,446	4,873	457,921	銀行
AMCOR	772	650	689	64,755	素材
WESTPAC BANKING	1,918	1,637	5,648	530,745	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD	—	181	221	20,774	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	897	773	362	34,024	素材
TELSTRA CORP	2,738	2,241	1,196	112,455	電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	254	193	225	21,228	銀行
BRAMBLES LTD	996	794	765	71,945	商業・専門サービス
COCA-COLA AMATIL LIMITED	365	280	267	25,183	食品・飲料・タバコ
ASX LTD	112	104	379	35,643	各種金融
BHP BILLITON LTD	1,998	1,691	6,424	603,691	素材
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	84	84	190	17,908	エネルギー
ALS LTD	218	218	187	17,623	商業・専門サービス
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	308	308	98	9,236	小売
COMPUTERSHARE LIMITED	284	224	286	26,945	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	株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
CSL LIMITED	312	251	1,777	167,052	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REA GROUP LTD	—	25	111	10,473	メディア	
TRANSURBAN GROUP	842	930	679	63,894	運輸	
COCHLEAR LIMITED	35	27	162	15,291	ヘルスケア機器・サービス	
ORIGIN ENERGY LIMITED	698	560	852	80,095	エネルギー	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	1,001	850	6,970	655,046	銀行	
BORAL LIMITED	485	351	185	17,453	素材	
RIO TINTO LTD	274	231	1,424	133,817	素材	
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	1,331	1,218	724	68,123	保険	
TPG TELECOM LTD	—	200	121	11,426	電気通信サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	32	32	165	15,530	消費者サービス	
OZ MINERALS LTD	190	—	—	—	素材	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	280	226	332	31,250	素材	
ORICA LTD	234	196	398	37,412	素材	
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	94	53	108	10,188	資本財	
MACQUARIE GROUP LIMITED	206	147	893	83,946	各種金融	
WORLEYPARSONS LTD	131	105	172	16,254	エネルギー	
SUNCORP GROUP LIMITED	823	659	883	82,991	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	1,429	1,241	4,158	390,792	銀行	
NEWCREST MINING LIMITED	481	404	397	37,353	素材	
INCITEC PIVOT LTD	1,024	836	230	21,690	素材	
TOLL HOLDINGS LIMITED	417	417	219	20,654	運輸	
AMP LTD	1,854	1,586	837	78,739	保険	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	771	771	107	10,077	運輸	
QBE INSURANCE GROUP	756	627	710	66,790	保険	
SANTOS	611	522	758	71,322	エネルギー	
SONIC HEALTHCARE LTD	234	216	381	35,884	ヘルスケア機器・サービス	
TABCORP HOLDINGS	457	457	159	14,965	消費者サービス	
WESFARMERS LIMITED	632	592	2,563	240,920	食品・生活必需品小売り	
ALUMINA LIMITED	1,631	1,195	176	16,622	素材	
ILUKA RESOURCES LTD	268	213	193	18,204	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	414	350	1,476	138,743	エネルギー	
WOOLWORTHS LTD	774	649	2,434	228,739	食品・生活必需品小売り	
METCASH LTD	553	553	160	15,039	食品・生活必需品小売り	
SEEK LTD	—	158	269	25,336	商業・専門サービス	
TATTS GROUP LTD	872	652	199	18,755	消費者サービス	
SIMS METAL MANAGEMENT LIMITED	110	—	—	—	素材	
SP AUSNET	1,174	874	120	11,297	公益事業	
WHITEHAVEN COAL LTD	331	—	—	—	エネルギー	
ASCIANO GROUP	613	510	291	27,357	運輸	
CROWN RESORTS LTD	251	212	347	32,637	消費者サービス	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	475	—	—	—	消費者サービス	
AURIZON HOLDINGS LTD	1,163	1,164	575	54,056	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	454	385	198	18,620	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額	37,820	31,852	55,525	5,217,767	
	銘柄 数 < 比 率 >	57銘柄	57銘柄	—	< 3.1% >	
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランドドル	千円		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	676	477	187	16,190	運輸	
CONTACT ENERGY LTD	255	255	137	11,926	公益事業	
RYMAN HEALTHCARE LTD	—	150	126	10,904	ヘルスケア機器・サービス	

銘	柄	当	期		業	種
		首(前期末)	末			
		株 数	株 数	評 価		
		外貨建金額	邦貨換算金額			
FLETCHER BUILDING LTD		百株 471	百株 351	千ニューージーランドドル 322	千円 27,906	素材
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP		421	—	—	—	消費者サービス
TELECOM CORP NEW ZEALAND		1,333	1,080	294	25,446	電気通信サービス
XERO LTD		—	30	97	8,457	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,158 5銘柄	2,344 6銘柄	1,166 —	100,832 <0.1%>	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		138	138	1,193	15,661	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD		1,430	1,200	2,868	37,628	不動産
BANK EAST ASIA		769	659	2,110	27,692	銀行
CLP HOLDINGS		1,110	945	6,033	79,163	公益事業
HOPEWELL HOLDINGS		355	—	—	—	資本財
CATHAY PACIFIC AIRWAYS		820	570	839	11,008	運輸
CHEUNG KONG HOLDINGS		870	720	9,655	126,676	不動産
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE		310	310	1,607	21,088	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		687	566	8,156	107,007	各種金融
LI & FUNG		3,748	3,148	3,626	47,579	耐久消費財・アパレル
MTR CORP		925	710	2,073	27,200	運輸
FIRST PACIFIC CO		1,280	1,280	1,137	14,929	各種金融
HANG SENG BANK		490	414	5,270	69,145	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMEN		600	560	2,794	36,662	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED		890	750	4,987	65,436	公益事業
WHARF HOLDINGS		970	770	4,123	54,098	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		3,340	2,919	5,512	72,321	公益事業
HUTCHISON WHAMPOA		1,340	1,120	11,502	150,911	資本財
HYSAN DEVELOPMENT CO		400	400	1,434	18,814	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		1,340	1,220	7,442	97,639	消費者サービス
KERRY PROPERTIES LTD		460	385	966	12,678	不動産
BOC HONG KONG HOLDINGS -R		2,370	2,005	4,651	61,028	銀行
NWS HOLDINGS LTD		1,010	780	1,120	14,695	資本財
PCCW LTD		2,920	2,320	995	13,058	電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		465	465	1,132	14,855	耐久消費財・アパレル
NEW WORLD DEVELOPMENT		2,365	2,705	2,364	31,017	不動産
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD		145	—	—	—	運輸
SHANGRI-LA ASIA LTD		980	980	1,213	15,917	消費者サービス
SINO LAND CO		1,834	1,394	1,678	22,020	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES		990	850	8,840	115,980	不動産
SWIRE PACIFIC A		435	365	3,372	44,248	不動産
WING HANG BANK LIMITED		125	—	—	—	銀行
WHEELLOCK & CO LTD		590	530	1,696	22,251	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		—	720	1,702	22,340	耐久消費財・アパレル
SJM HOLDINGS LTD		1,240	950	2,066	27,109	消費者サービス
WYNN MACAU LTD		980	828	2,674	35,088	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD		596	436	1,172	15,387	消費者サービス
AIA GROUP LTD		7,376	6,248	23,961	314,369	保険
SANDS CHINA LTD		1,548	1,240	7,074	92,813	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LTD		750	518	1,248	16,378	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	48,992 39銘柄	42,119 37銘柄	150,297 —	1,971,905 <1.2%>	

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	980	760	288	23,342	資本財
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	4,440	2,840	161	13,118	食品・飲料・タバコ
DBS GROUP	1,150	910	1,534	124,336	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	310	240	251	20,383	不動産
SEMBCORP MARINE LTD	540	410	166	13,489	資本財
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	60	60	269	21,832	小売
SINGAPORE EXCHANGE LTD	540	420	289	23,485	各種金融
CAPITALAND LTD	1,645	1,305	414	33,630	不動産
GENTING SINGAPORE PLC	3,910	3,130	414	33,609	消費者サービス
KEPPEL CORP LTD	923	743	792	64,186	資本財
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,310	990	233	18,934	運輸
OCBC BANK	1,620	1,350	1,300	105,356	銀行
SINGAPORE AIRLINES	335	245	253	20,557	運輸
KEPPEL LAND LTD	500	400	140	11,345	不動産
UNITED OVERSEAS BANK	810	670	1,477	119,724	銀行
UOL GROUP LIMITED	313	223	150	12,216	不動産
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	1,030	930	390	31,654	メディア
NOBLE GROUP LTD	2,273	2,273	310	25,150	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	5,012	4,252	1,628	131,988	電気通信サービス
STARHUB LTD	380	380	158	12,841	電気通信サービス
OLAM INTERNATIONAL LTD	1,120	870	187	15,229	食品・生活必需品小売り
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	630	450	242	19,656	資本財
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,230	1,110	359	29,145	食品・飲料・タバコ
YANGZJIANG SHIPBUILDING	1,330	1,330	151	12,287	資本財
CAPITAMALLS ASIA LTD	790	790	185	15,045	不動産
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	1,320	1,580	445	36,108	不動産
小 計	株 数 銘柄数 <比率>	株 数 銘柄数	12,199 26銘柄	988,655 <0.6%>	
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエルシェケル	千円	
BANK HAPOLIM BM	735	585	1,185	34,629	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL	808	708	973	28,433	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	1,341	1,116	708	20,713	電気通信サービス
DELEK GROUP LTD	2	2	290	8,498	エネルギー
ISRAEL CHEMICALS LTD	285	205	634	18,547	素材
NICE SYSTEMS LTD	41	33	461	13,471	ソフトウェア・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	558	444	7,941	232,054	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISRAEL CORP LIMITED/THE	1	1	332	9,724	素材
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	82	82	380	11,120	銀行
MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	25	—	—	—	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 銘柄数 <比率>	株 数 銘柄数	12,908 9銘柄	377,192 <0.2%>	
合 計	株 数 銘柄数 <比率>	株 数 銘柄数	— 1,228銘柄	157,882,295 <94.0%>	

(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) < >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		評 価 額	
	口	数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)		千口	千米ドル	千円
BOSTON PROPERTIES		9	946	96,321
SL GREEN REALTY CORP		5	502	51,109
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC		62	599	60,962
PROLOGIS INC		29	1,049	106,742
AVALONBAY COMMUNITIES INC		6	952	96,924
CAMDEN PROPERTY TRUST		5	312	31,829
DUKE REALTY CORP		18	332	33,781
CROWN CASTLE INTL CORP		—	1,315	133,888
ESSEX PROPERTY TRUST		—	590	60,080
EQUITY RESIDENTIAL PPTY		20	1,093	111,222
FEDERAL REALTY INVS TRUST		4	399	40,635
HCP INC		28	985	100,229
HEALTH CARE REIT INC		16	930	94,660
RAYONIER INC		7	329	33,488
KIMCO REALTY CORP		25	467	47,525
LIBERTY PROPERTY TRUST		7	321	32,694
MACERICH CO/THE		8	493	50,198
HOST HOTELS AND RESORTS INC		46	881	89,680
PLUM CREEK TIMBER COMMON		10	412	41,933
REALTY INCOME CORP		10	497	50,590
REGENCY CENTERS CORP		5	237	24,190
UDR INC		16	384	39,089
SIMON PROPERTY GROUP		19	2,902	295,291
PUBLIC STORAGE		9	1,303	132,668
VENTAS INC		18	1,012	103,017
VORNADO REALTY TRUST		10	930	94,632
DIGITAL REALTY TRUST INC		7	392	39,945
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP		21	439	44,708
AMERICAN REALTY CAPITAL PRO		—	579	58,956
GENERAL GROWTH PROPERTIES		27	656	66,825
HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U		335	190	19,350
AMERICAN TOWER CORPORATION		24	1,848	188,099
小 計	口 数	820	24,287	2,471,274
	銘柄数 <比率>	29銘柄	—	<1.5%>
(カナダ)		千口	千カナダドル	千円
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT		6	175	16,420
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		9	208	19,552
小 計	口 数	15	384	35,972
	銘柄数 <比率>	2銘柄	—	<0.0%>
(フランス)		千口	千ユーロ	千円
ICADE		1	149	20,633
UNIBAIL-RODAMCO SE		5	1,045	144,581
KLEPIERRE		6	182	25,311
GECINA SA		1	142	19,726
FONCIERE DES REGIONS		1	119	16,494
国小計	口 数	16	1,638	226,746
	銘柄数 <比率>	5銘柄	—	<0.1%>
(オランダ)		千口	千ユーロ	千円
CORIO NV		4	125	17,330
国小計	口 数	4	125	17,330
	銘柄数 <比率>	1銘柄	—	<0.0%>
ユーロ計	口 数	21	1,764	244,076
	銘柄数 <比率>	6銘柄	—	<0.1%>

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(イギリス)	千口	千口	千イギリスポンド	千円
BRITISH LAND CO PLC	54	49	357	60,841
HAMMERSON PLC	45	38	233	39,654
INTU PROPERTIES PLC	35	40	126	21,536
SEGRO PLC	46	38	139	23,697
LAND SECURITIES GROUP PLC	50	42	457	77,819
小 計	口 数	口 数	1,314	223,550
	銘柄 数 <比率>	銘柄 数	—	<0.1%>
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリアドル	千円
MIRVAC GROUP	215	182	325	30,564
APA GROUP	52	40	284	26,690
CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	126	126	263	24,784
GPT GROUP	88	90	353	33,256
SYDNEY AIRPORT	13	58	256	24,075
STOCKLAND	141	116	450	42,357
WESTFIELD GROUP	135	104	1,138	106,982
DEXUS PROPERTY GROUP	289	290	327	30,743
GOODMAN GROUP	108	91	465	43,716
FEDERATION CENTRES	89	67	168	15,846
LEND LEASE GROUP	34	28	384	36,100
WESTFIELD RETAIL TRUST	185	165	537	50,517
小 計	口 数	口 数	4,955	465,637
	銘柄 数 <比率>	銘柄 数	—	<0.3%>
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円
LINK REIT	146	125	5,131	67,322
HKT TRUST AND HKT LTD	158	130	1,094	14,361
小 計	口 数	口 数	6,225	81,683
	銘柄 数 <比率>	銘柄 数	—	<0.0%>
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポールドル	千円
CAPITAMALL TRUST	149	109	222	18,020
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	104	111	270	21,948
CAPITACOMMERCIAL TRUST	110	110	183	14,887
小 計	口 数	口 数	676	54,855
	銘柄 数 <比率>	銘柄 数	—	<0.0%>
合 計	口 数	口 数	—	3,577,050
	銘柄 数 <比率>	銘柄 数	—	<2.1%>

(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	売 建 額
		百万円	百万円
外 国	S&P/TSE 60	328	—
	SWISS MKT IX	345	—
	S&P 500 FUTU	4,127	—
	DJ EURO STOXX	841	—
	SPI 200 FUTU	351	—
	FTSE 100	778	—

(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	157,882,295	92.8
投 資 信 託 受 益 証 券	120,578	0.1
投 資 証 券	3,456,472	2.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,707,994	5.1
投 資 信 託 財 産 総 額	170,167,339	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(167,710,795千円)の投資信託財産総額(170,167,339千円)に対する比率は98.6%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=101.75円、1カナダドル=93.57円、1ユーロ=138.35円、1イギリスポンド=170.11円、1スイスフラン=113.31円、1スウェーデンクローナ=15.32円、1ノルウェークローネ=17.06円、1デンマーククローネ=18.54円、1オーストラリアドル=93.97円、1ニュージーランドドル=86.44円、1香港ドル=13.12円、1シンガポールドル=81.04円、1イスラエルシェケル=29.22円です。

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2014年5月29日現在
(A) 資 産	170,673,610,589円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,707,235,519
株 式(評価額)	157,882,295,732
投資信託受益証券(評価額)	120,578,621
投資証券(評価額)	3,456,472,294
未 収 入 金	1,167,945,867
未 収 配 当 金	398,695,092
未 収 利 息	664
差 入 委 託 証 拠 金	940,386,800
(B) 負 債	2,637,075,886
未 払 金	2,454,445,719
未 払 解 約 金	182,630,167
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	168,036,534,703
元 本	99,099,801,608
次 期 繰 越 損 益 金	68,936,733,095
(D) 受 益 権 総 口 数	99,099,801,608口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,956円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2013年5月30日 至 2014年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	3,901,884,667円
受 取 配 当 金	3,894,871,672
受 取 利 息	1,508,544
そ の 他 収 益 金	5,504,451
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	21,274,569,851
売 買 益	26,404,755,468
売 買 損	△5,130,185,617
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	923,566,020
取 引 益	1,239,791,245
取 引 損	△316,225,225
(D) 保 管 費 用 等	△66,293,463
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	26,033,727,075
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	52,599,584,126
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,332,739,076
(H) 解 約 差 損 益 金	△20,029,317,182
(I) 計 (E+F+G+H)	68,936,733,095
次 期 繰 越 損 益 金(I)	68,936,733,095

(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118, 211, 342, 839円、期中追加設定元本額は19, 123, 687, 639円、期中一部解約元本額は38, 235, 228, 870円です。

※1口当たり純資産額は1. 6956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 グローバル株式インデックス・オープン	18, 884, 410, 629円
外国株式インデックス・オープン (SMA専用)	13, 523, 667, 193円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	7, 790, 470, 552円
バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	5, 949, 359, 188円
DC外国株式インデックス・オープン	5, 688, 183, 042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)	4, 664, 245, 007円
DCマイセレクション75	4, 662, 162, 370円
DCマイセレクション50	4, 460, 447, 623円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	4, 331, 306, 808円
バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	3, 851, 979, 715円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	3, 352, 489, 862円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2, 035, 447, 290円
バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	1, 815, 833, 979円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1, 690, 953, 929円
DCマイセレクションS50	1, 494, 328, 548円
バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	1, 473, 086, 475円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1, 168, 115, 213円
外国株式インデックス・オープン	1, 056, 815, 146円
DCマイセレクションS75	1, 049, 097, 262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, 015, 589, 479円
世界経済インデックスファンド	1, 013, 297, 944円
コア投資戦略ファンド(安定型)	974, 910, 921円
バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	945, 432, 630円
バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	943, 975, 486円
DC世界経済インデックスファンド	922, 877, 856円
DCマイセレクション25	863, 357, 490円
外国株式ファンド・シリーズ1	802, 772, 819円
バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	516, 743, 767円
バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	327, 785, 090円
DCマイセレクションS25	323, 805, 175円
コア投資戦略ファンド(切替型)	264, 957, 995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)	255, 630, 546円
分散投資コア戦略ファンドS	217, 689, 273円
DCターゲット・イヤール ファンド2035	144, 827, 453円
DCターゲット・イヤール ファンド2025	140, 476, 330円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	112, 730, 720円
マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	79, 169, 716円
DCターゲット・イヤール ファンド2045	69, 231, 092円
分散投資コア戦略ファンドA	65, 229, 958円
マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	51, 360, 653円
マイセレクション75	32, 382, 592円
マイセレクション50	27, 195, 591円
SBI資産設計オープン(分配型)	13, 455, 530円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	12, 694, 366円
マイセレクション25	10, 784, 383円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4, 520, 645円
DCターゲット・イヤール ファンド2015	4, 054, 054円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	462, 223円

新興国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第6期（決算日 2014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
	円	騰落率	円	騰落率					
第2期(2010年11月10日)	12,971	6.3	23,345.25	7.5	96.0	—	—	百万円 2,089	
第3期(2011年11月10日)	12,072	△6.9	21,942.18	△6.0	96.1	—	—	3,771	
第4期(2012年11月12日)	13,432	11.3	24,482.00	11.6	96.8	—	—	16,160	
第5期(2013年11月11日)	15,769	17.4	29,055.22	18.7	97.8	—	—	25,030	
第6期(2014年11月10日)	17,749	12.6	33,027.74	13.7	93.3	—	—	22,962	

(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	券先物率
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2013年11月11日	15,769	—	29,055.22	—	97.8	—
11月末	16,182	2.6	29,916.68	3.0	97.5	—
12月末	16,509	4.7	30,611.58	5.4	97.2	—
2014年 1月末	15,460	△2.0	28,655.66	△1.4	97.3	—
2月末	15,804	0.2	29,183.89	0.4	98.2	—
3月末	16,326	3.5	30,194.98	3.9	97.7	—
4月末	16,471	4.5	30,546.59	5.1	96.9	—
5月末	16,768	6.3	31,102.47	7.0	97.3	—
6月末	16,824	6.7	31,166.27	7.3	96.5	—
7月末	16,973	7.6	31,537.51	8.5	96.2	—
8月末	17,059	8.2	31,658.34	9.0	97.1	—
9月末	17,089	8.4	31,764.25	9.3	95.4	—
10月末	17,456	10.7	32,480.21	11.8	94.6	—
(当期末) 2014年11月10日	17,749	12.6	33,027.74	13.7	93.3	—

(注1)騰落率は期首比です。

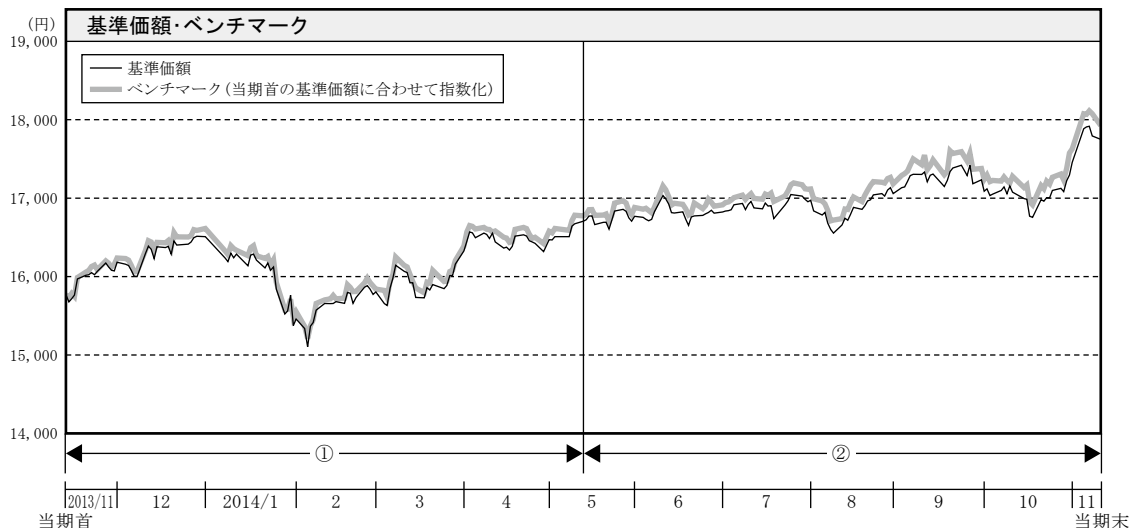
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・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・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイドとは、新興国の現地通貨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

■ 基準価額の推移と変動要因



	①の期間	②の期間
基準価額の動き	上昇	上昇
新興国債券市場	FOMC(米連邦公開市場委員会)で量的金融緩和縮小開始が決定され、新興国資産からの資金流出懸念が高まったことなどから、新興国債券の利回りは上昇(価格は下落)しました。しかし、その後はイエレンFRB(米連邦準備理事会)議長が議会証言で超低金利政策の長期化を示したことなどから新興国資産からの資金流出懸念が後退し、新興国債券の利回りは概ね低下(価格は上昇)しました。国別では、政策金利を引き下げたハンガリーなどが低下する一方で、ウクライナ情勢への懸念からロシアの利回りなどは上昇しました。	FRBによる超低金利政策の長期化観測を背景にリスク選好姿勢が高まったことなどから、新興国債券の利回りは概ね低下しました。国別では、政策金利を引き下げたハンガリーやポーランド、トルコなどの利回りは低下しました。一方で、ウクライナ情勢の緊張が高まったことから資金逃避が強まったロシアなどの利回りは上昇しました。
基準価額への影響	プラス要因	プラス要因

	①の期間	②の期間
外国為替市場	FRB議長が議会証言で超低金利政策の長期化を示したことや堅調な米国株式などを受けてリスク回避姿勢が後退したことから、新興国通貨は円に対して概ね上昇しました。 通貨別では、中央銀行によるインフレ見通し引き上げを受けて利上げ継続観測が高まったブラジルレアル、エネルギー改革の進展が評価されて国債価格が引き上げられたメキシコペソなどが上昇しました。一方、ウクライナ情勢への先行き不透明感から資金流出が強まったロシアルーブルなどが下落しました。	FRBによる超低金利政策の長期化観測に加え、日本の公的年金が株式や海外資産の比率を高めるとの報道や日銀による追加金融緩和策の決定を受けて円安圧力が強まったことから、新興国通貨は円に対して概ね上昇しました。 通貨別では、エネルギー改革の細則法案成立が好感されたメキシコペソ、大統領選挙で改革派のジョコ・ウィド氏が当選したことが好感されたインドネシアルピアなどは上昇しました。一方で、国債価格の引き下げや主要輸出品である原油価格の下落などを受けてロシアルーブルなどは下落しました。
基準価額への影響	プラス要因	プラス要因

◆パフォーマンス

当期の基準価額の騰落率は以下の通りです。

①当期首 (前期末) 基準価額	②当期末 基準価額	③差引 (②-①)	④騰落率 (③/①)	⑤ベンチマーク 騰落率	④-⑤
15,769円	17,749円	+1,980円	+12.56%	+13.67%	△1.11%

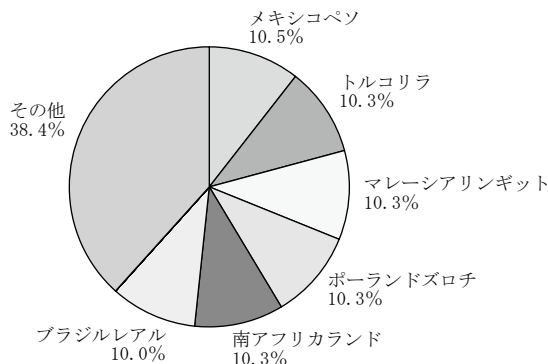
ベンチマーク騰落率との差異は、△1.11%となりました。これは、債券のポートフォリオ要因、取引コスト、キャッシュ要因、カストディコストのマイナスが主な要因です。

■運用状況

◆投資対象通貨の状況

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・ディバーシファイド(円換算ベース)との連動を目標に、投資対象通貨の配分や残存期間構成を意識した銘柄分散を行いました。当期末時点では、投資障壁等により、ベンチマーク投資対象通貨の中からルーマニアレウを除く15通貨に分散投資するとともに、164銘柄を組み入れています。

通貨別組入比率※1(当期末)



◆デュレーション※2

ポートフォリオのデュレーションは、ベンチマークとの連動を目標とし、期を通じ、約4.5年～4.9年の間で運用しました。

■今後の運用方針

今後の運用につきましても、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・ディバーシファイド(円換算ベース)に連動する運用成果を目指した運用を行います。

※1 比率は、債券評価総額に対する評価額(含む経過利息)の比率です。

※2 デュレーションとは、債券価格の金利変動に対する感応度で、この値が大きいほど金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。

1万口当たりの費用明細

項 目	当 期
(a) 保 管 費 用 等	24円
合 計	24

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 保管費用等は、期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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 311,003	千メキシコペソ 382,194
	ブ ラ ジ ル	国 債 証 券	千ブラジルリアル 52,905	千ブラジルリアル 63,835
	チ リ	国 債 証 券	千チリペソ 52,377	千チリペソ 157,971
	コ ロ ン ビ ア	国 債 証 券	千コロンビアペソ 57,616,931	千コロンビアペソ 40,875,714
	ペ ル ー	国 債 証 券	千ペルーヌエボソル 8,736	千ペルーヌエボソル 12,328
	ト ル コ	国 債 証 券	千トルコリラ 69,276	千トルコリラ 77,447
	ハ ン ガ リ ー	国 債 証 券	千ハンガリーフォリント 2,298,941	千ハンガリーフォリント 3,351,359
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 67,205	千ポーランドズロチ 86,744
	ロ シ ア	国 債 証 券	千ロシアルーブル 689,733	千ロシアルーブル 889,778
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 70,057	千マレーシアリンギット 87,119
国	タ イ	国 債 証 券	千タイバーツ 484,877	千タイバーツ 665,441
	フ ィ リ ピ ン	国 債 証 券	千フィリピンペソ 26,034	千フィリピンペソ 50,387
	イ ン ド ネ シ ア	国 債 証 券	千インドネシアルピア 216,626,050	千インドネシアルピア 253,531,250
	南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカランド 315,294	千南アフリカランド 358,875
	ナ イ ジ ェ リ ア	国 債 証 券	千ナイジェリアナイラ 451,319	千ナイジェリアナイラ 636,414

(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。)

主要な売買銘柄

<公社債>

当			期		
買	付		売	付	
銘	柄	金額	銘	柄	金額
		千円			千円
COLOM 4.375%	03/21/23(コロンビア)	1,185,945	COLOM 12%	10/22/15(コロンビア)	860,900
COLOM 12%	10/22/15(コロンビア)	833,528	RFLB 7%	06/03/15(ロシア)	683,649
INDOGB 9%	03/15/29(インドネシア)	722,023	SAGB 10.5%	12/21/26(南アフリカ)	638,007
COLOM 9.85%	06/28/27(コロンビア)	593,541	BLTN 0%	01/01/16(ブラジル)	605,154
SAGB 10.5%	12/21/26(南アフリカ)	539,085	RFLB 7.6%	04/14/21(ロシア)	587,541
RUSSIA 7.85%	03/10/18(ロシア)	536,469	RUSSIA 7.85%	03/10/18(ロシア)	575,891
TURKGB 8.8%	11/14/18(トルコ)	500,295	INDOGB 9%	03/15/29(インドネシア)	564,826
TURKGB 8.8%	09/27/23(トルコ)	499,263	COLOM 4.375%	03/21/23(コロンビア)	542,274
THAIGB 3.875%	06/13/19(タイ)	481,888	THAIGB 3.875%	06/13/19(タイ)	484,739
COLOM 7.75%	04/14/21(コロンビア)	479,197	THAIGB 3.25%	06/16/17(タイ)	467,710

(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[※]との取引状況等

当期中における利害関係人との取引等はありません。

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

組入資産の明細

<外国(外貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
メ キ シ コ	千メキシコペソ 235,200	千メキシコペソ 262,833	千円 2,220,943	% 9.7	% —	% 5.6	% 2.9	% 1.1
ブ ラ ジ ル	千ブラジルレアル 52,200	千ブラジルレアル 47,300	2,114,314	9.2	—	2.1	4.2	2.9
チ リ	千チリペソ 100,000	千チリペソ 105,595	20,548	0.1	—	0.1	—	—
コ ロ ン ビ ア	千コロンビアペソ 31,000,000	千コロンビアペソ 31,625,002	1,723,562	7.5	—	5.5	—	2.0
ペ ル ー	千ペルーヌエボソル 7,600	千ペルーヌエボソル 8,391	327,839	1.4	—	1.3	0.1	—
ト ル コ	千トルコリラ 42,850	千トルコリラ 43,235	2,196,812	9.6	—	4.2	4.0	1.4
ハ ン ガ リ ー	千ハンガリーフォリント 2,069,000	千ハンガリーフォリント 2,339,438	1,079,650	4.7	—	1.8	2.6	0.3
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 61,000	千ポーランドズロチ 66,401	2,235,740	9.7	—	3.3	3.9	2.6
ロ シ ア	千ロシアルーブル 580,000	千ロシアルーブル 525,197	1,286,733	5.6	—	2.6	2.4	0.5
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 64,880	千マレーシアリンギット 65,287	2,240,652	9.8	—	5.2	3.4	1.1
タ イ	千タイバーツ 423,612	千タイバーツ 445,590	1,555,109	6.8	—	2.8	3.4	0.5
フ ィ リ ピ ン	千フィリピンペソ 27,000	千フィリピンペソ 34,329	87,198	0.4	—	0.4	—	—
イ ン ド ネ シ ア	千インドネシアルピア 185,350,000	千インドネシアルピア 182,448,080	1,715,011	7.5	—	6.3	1.0	0.2
南 ア フ リ カ	千南アフリカランド 219,900	千南アフリカランド 215,214	2,190,881	9.5	—	7.6	1.9	—
ナ イ ジ ェ リ ア	千ナイジェリアナイラ 706,000	千ナイジェリアナイラ 611,091	422,019	1.8	1.8	—	1.8	—
合 計	—	—	21,417,020	93.3	1.8	48.8	31.8	12.6

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

(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		償還年月日
		額面金額	評価額	額	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
(メキシコ)						
国債証券						
MEXBONO 10% 11/20/36	10.0	7,500	10,337	87,351		2036/11/20
MEXBONO 10% 12/05/24	10.0	17,500	22,945	193,890		2024/12/5
MEXBONO 4.75% 06/14/18	4.75	22,000	22,111	186,843		2018/6/14
MEXBONO 5% 06/15/17	5.0	14,000	14,365	121,384		2017/6/15
MEXBONO 6.25% 06/16/16	6.25	18,100	18,875	159,494		2016/6/16
MEXBONO 6.5% 06/09/22	6.5	12,000	12,594	106,424		2022/6/9
MEXBONO 6.5% 06/10/21	6.5	11,500	12,140	102,590		2021/6/10
MEXBONO 7.25% 12/15/16	7.25	10,000	10,722	90,601		2016/12/15
MEXBONO 7.5% 06/03/27	7.5	9,500	10,525	88,942		2027/6/3
MEXBONO 7.75% 05/29/31	7.75	15,100	16,979	143,476		2031/5/29
MEXBONO 7.75% 11/13/42	7.75	12,000	13,452	113,677		2042/11/13
MEXBONO 7.75% 11/23/34	7.75	3,000	3,379	28,555		2034/11/23
MEXBONO 7.75% 12/14/17	7.75	17,000	18,687	157,912		2017/12/14
MEXBONO 8% 06/11/20	8.0	11,000	12,470	105,378		2020/6/11
MEXBONO 8% 12/07/23	8.0	10,000	11,500	97,176		2023/12/7
MEXBONO 8% 12/17/15	8.0	11,500	12,100	102,247		2015/12/17
MEXBONO 8.5% 05/31/29	8.5	11,000	13,183	111,402		2029/5/31
MEXBONO 8.5% 11/18/38	8.5	11,500	13,908	117,526		2038/11/18
MEXBONO 8.5% 12/13/18	8.5	11,000	12,552	106,066		2018/12/13
小計				2,220,943		
(ブラジル)						
国債証券						
BLTN 0% 01/01/16	—	500	437	19,555		2016/1/1
BLTN 0% 01/01/17	—	6,550	5,072	226,756		2017/1/1
BLTN 0% 04/01/16	—	2,800	2,376	106,236		2016/4/1
BLTN 0% 07/01/16	—	6,000	4,939	220,788		2016/7/1
BNTNF 10% 01/01/17	10.0	9,500	9,056	404,844		2017/1/1
BNTNF 10% 01/01/18	10.0	3,500	3,274	146,373		2018/1/1
BNTNF 10% 01/01/19	10.0	4,600	4,239	189,513		2019/1/1
BNTNF 10% 01/01/21	10.0	4,700	4,220	188,649		2021/1/1
BNTNF 10% 01/01/23	10.0	4,600	4,028	180,054		2023/1/1
BRAZIL 10.25% 01/10/28	10.25	1,950	1,980	88,514		2028/1/10
BRAZIL 12.5% 01/05/16	12.5	7,000	7,169	320,481		2016/1/5
BRAZIL 12.5% 01/05/22	12.5	200	224	10,033		2022/1/5
BRAZIL 8.5% 01/05/24	8.5	300	279	12,512		2024/1/5
小計				2,114,314		
(チリ)						
国債証券						
CHILE 5.5% 08/05/20	5.5	100,000	105,595	20,548		2020/8/5
小計						
(コロンビア)						
国債証券						
COLOM 12% 10/22/15	12.0	8,000,000	8,499,400	463,217		2015/10/22
COLOM 4.375% 03/21/23	4.375	14,000,000	12,549,600	683,953		2023/3/21
COLOM 7.75% 04/14/21	7.75	5,500,000	6,047,195	329,572		2021/4/14
COLOM 9.85% 06/28/27	9.85	3,500,000	4,528,807	246,820		2027/6/28
小計				1,723,562		
(ペルー)						
国債証券						
PERUGB 5.2% 09/12/23	5.2	1,000	979	38,263		2023/9/12
PERUGB 6.9% 08/12/37	6.9	1,350	1,413	55,235		2037/8/12
PERUGB 6.95% 08/12/31	6.95	1,050	1,111	43,441		2031/8/12
PERUGB 7.84% 08/12/20	7.84	2,400	2,759	107,809		2020/8/12
PERUGB 8.2% 08/12/26	8.2	1,200	1,450	56,565		2026/8/12
PERUGB 8.6% 08/12/17	8.6	600	676	26,435		2017/8/12
小計				327,839		
(トルコ)						
国債証券						
TURKGB 10.4% 03/20/24	10.4	2,250	2,489	126,468		2024/3/20
TURKGB 10.4% 03/27/19	10.4	4,050	4,324	219,738		2019/3/27
TURKGB 10.5% 01/15/20	10.5	2,800	3,030	154,004		2020/1/15
TURKGB 10.7% 02/24/16	10.7	4,000	4,105	208,623		2016/2/24
TURKGB 6.3% 02/14/18	6.3	1,250	1,176	59,756		2018/2/14
TURKGB 7.1% 03/08/23	7.1	6,300	5,711	290,216		2023/3/8

銘柄	利率 (%)	期		末		償還年月日
		額面金額	評価額	額	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
(ハンガリー)						
国債証券						
TURKGB 8.3% 06/20/18	8.3	1,900	1,888	95,969		2018/6/20
TURKGB 8.5% 09/14/22	8.5	2,700	2,668	135,586		2022/9/14
TURKGB 8.8% 09/27/23	8.8	2,300	2,305	117,143		2023/9/27
TURKGB 8.8% 11/14/18	8.8	6,500	6,566	333,668		2018/11/14
TURKGB 9% 01/27/16	9.0	2,400	2,413	122,652		2016/1/27
TURKGB 9% 03/08/17	9.0	3,900	3,946	200,337		2017/3/8
TURKGB 9.5% 01/12/22	9.5	2,500	2,606	132,445		2022/1/12
小計				2,196,812		
(ハンガリー)						
国債証券						
HGB 4% 04/25/18	4.0	175,000	181,517	83,770		2018/4/25
HGB 5.5% 02/12/16	5.5	145,000	151,807	70,599		2016/2/12
HGB 5.5% 06/24/25	5.5	115,000	131,719	60,788		2025/6/24
HGB 5.5% 12/20/18	5.5	135,000	148,066	68,332		2018/12/20
HGB 5.5% 12/22/16	5.5	135,000	144,405	66,643		2016/12/22
HGB 6.0% 11/24/23	6.0	250,000	293,027	135,232		2023/11/24
HGB 6.5% 06/24/19	6.5	310,000	355,783	164,194		2019/6/24
HGB 6.75% 02/24/17	6.75	200,000	219,213	101,166		2017/2/24
HGB 6.75% 11/24/17	6.75	236,000	264,183	121,920		2017/11/24
HGB 7% 06/24/22	7.0	168,000	204,963	94,590		2022/6/24
HGB 7.5% 11/12/20	7.5	200,000	244,750	112,952		2020/11/12
小計				1,079,650		
(ポーランド)						
国債証券						
POLGB 0% 01/25/16	—	5,250	5,137	172,977		2016/1/25
POLGB 0% 07/25/16	—	1,500	1,454	48,976		2016/7/25
POLGB 2.5% 07/25/18	2.5	5,300	5,388	181,426		2018/7/25
POLGB 3.25% 07/25/19	3.25	3,150	3,309	111,429		2019/7/25
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	1,700	1,794	60,434		2025/7/25
POLGB 3.75% 04/25/18	3.75	4,100	4,337	146,044		2018/4/25
POLGB 4% 10/25/23	4.0	5,500	6,140	206,765		2023/10/25
POLGB 4.75% 04/25/17	4.75	3,900	4,165	140,256		2017/4/25
POLGB 4.75% 10/25/16	4.75	6,200	6,545	220,387		2016/10/25
POLGB 5% 04/25/16	5.0	4,250	4,442	149,569		2016/4/25
POLGB 5.25% 10/25/17	5.25	4,200	4,598	154,827		2017/10/25
POLGB 5.25% 10/25/20	5.25	3,600	4,204	141,567		2020/10/25
POLGB 5.5% 10/25/19	5.5	4,100	4,747	159,838		2019/10/25
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	4,700	5,809	195,614		2022/9/23
POLGB 5.75% 10/25/21	5.75	3,550	4,325	145,625		2021/10/25
小計				2,235,740		
(ロシア)						
国債証券						
RFLB 6.8% 12/11/19	6.8	20,000	17,431	42,707		2019/12/11
RFLB 6.9% 08/03/16	6.9	51,000	48,796	119,550		2016/8/3
RFLB 7% 08/16/23	7.0	61,000	50,997	124,943		2023/8/16
RFLB 7.05% 01/19/28	7.05	1,000	797	1,953		2028/1/19
RFLB 7.4% 06/14/17	7.4	54,000	50,931	124,782		2017/6/14
RFLB 7.5% 03/15/18	7.5	10,000	9,295	22,773		2018/3/15
RFLB 7.6% 04/14/21	7.6	60,000	53,194	130,325		2021/4/14
RFLB 7.6% 07/20/22	7.6	60,000	52,508	128,646		2022/7/20
RFLB 8.15% 02/03/27	8.15	83,000	72,983	178,810		2027/2/3
RUSSIA 7.85% 03/10/18	7.85	180,000	168,260	412,237		2018/3/10
小計				1,286,733		
(マレーシア)						
国債証券						
MGS 3.172% 07/15/16	3.172	3,150	3,135	107,596		2016/7/15
MGS 3.26% 03/01/18	3.26	2,900	2,872	98,569		2018/3/1
MGS 3.314% 10/31/17	3.314	3,000	2,978	102,228		2017/10/31
MGS 3.394% 03/15/17	3.394	2,550	2,542	87,253		2017/3/15
MGS 3.418% 08/15/22	3.418	1,100	1,074	36,866		2022/8/15
MGS 3.48% 03/15/23	3.48	4,900	4,789	164,386		2023/3/15
MGS 3.492% 03/31/20	3.492	3,000	2,977	102,170		2020/3/31
MGS 3.58% 09/28/18	3.58	2,500	2,498	85,757		2018/9/28

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 3.654% 10/31/19	3.654	2,200	2,202	75,596	2019/10/31
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	700	675	23,177	2028/6/15
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	2,350	2,234	76,702	2033/4/15
MGS 3.889% 07/31/20	3.889	2,100	2,122	72,855	2020/7/31
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	2,750	2,709	92,986	2027/3/15
MGS 4.012% 09/15/17	4.012	3,700	3,746	128,567	2017/9/15
MGS 4.048% 09/30/21	4.048	2,300	2,343	80,443	2021/9/30
MGS 4.127% 04/15/32	4.127	1,950	1,919	65,887	2032/4/15
MGS 4.16% 07/15/21	4.16	3,600	3,690	126,640	2021/7/15
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	1,800	1,858	63,775	2024/7/15
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	780	783	26,875	2031/6/30
MGS 4.24% 02/07/18	4.24	4,000	4,082	140,103	2018/2/7
MGS 4.262% 09/15/16	4.262	4,100	4,157	142,700	2016/9/15
MGS 4.378% 11/29/19	4.378	4,750	4,912	168,592	2019/11/29
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	2,800	2,907	99,802	2026/4/15
MGS 5.734% 07/30/19	5.734	1,900	2,072	71,114	2019/7/30
小 計				2,240,652	
(タイ)					
国債証券		千タイバーツ	千タイバーツ		
THAIGB 2.8% 10/10/17	2.8	20,000	20,203	70,508	2017/10/10
THAIGB 3.125% 12/11/15	3.125	32,000	32,339	112,864	2015/12/11
THAIGB 3.25% 06/16/17	3.25	58,000	59,408	207,336	2017/6/16
THAIGB 3.45% 03/08/19	3.45	19,900	20,518	71,610	2019/3/8
THAIGB 3.58% 12/17/27	3.58	30,100	30,868	107,731	2027/12/17
THAIGB 3.625% 06/16/23	3.625	52,150	54,751	191,082	2023/6/16
THAIGB 3.65% 12/17/21	3.65	53,000	55,686	194,346	2021/12/17
THAIGB 3.875% 06/13/19	3.875	80,000	84,540	295,045	2019/6/13
THAIGB 4.125% 11/18/16	4.125	15,700	16,273	56,795	2016/11/18
THAIGB 4.75% 12/20/24	4.75	12,262	13,959	48,717	2024/12/20
THAIGB 4.875% 06/22/29	4.875	27,000	31,521	110,011	2029/6/22
THAIGB 5.125% 03/13/18	5.125	23,500	25,518	89,058	2018/3/13
小 計				1,555,109	
(フィリピン)					
国債証券		千フィリピンペソ	千フィリピンペソ		
RPGB 7.375% 03/03/21	7.375	9,500	11,067	28,110	2021/3/3
RPGB 8% 07/19/31	8.0	17,500	23,262	59,087	2031/7/19
小 計				87,198	
(インドネシア)					
国債証券		千インドネシア ルピア	千インドネシア ルピア		
INDOGB 10% 07/15/17	10.0	3,600,000	3,801,420	35,733	2017/7/15
INDOGB 10.5% 08/15/30	10.5	7,000,000	8,293,600	77,959	2030/8/15
INDOGB 11% 09/15/25	11.0	5,850,000	7,042,113	66,195	2025/9/15
INDOGB 11% 11/15/20	11.0	5,900,000	6,769,955	63,637	2020/11/15

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)	
INDOGB 12.8% 06/15/21	12.8	3,000,000	3,742,620	35,180	2021/6/15
INDOGB 5.25% 05/15/18	5.25	5,000,000	4,623,800	43,463	2018/5/15
INDOGB 5.625% 05/15/23	5.625	9,500,000	8,135,325	76,472	2023/5/15
INDOGB 6.125% 05/15/28	6.125	8,000,000	6,588,320	61,930	2028/5/15
INDOGB 6.25% 04/15/17	6.25	2,750,000	2,669,150	25,090	2017/4/15
INDOGB 6.625% 05/15/33	6.625	28,500,000	23,725,680	223,021	2033/5/15
INDOGB 7% 05/15/22	7.0	8,100,000	7,661,304	72,016	2022/5/15
INDOGB 7% 05/15/27	7.0	7,200,000	6,483,024	60,940	2027/5/15
INDOGB 7.375% 09/15/16	7.375	3,850,000	3,852,310	36,211	2016/9/15
INDOGB 7.875% 04/15/19	7.875	13,300,000	13,335,511	125,353	2019/4/15
INDOGB 8.25% 06/15/32	8.25	14,700,000	14,489,055	136,197	2032/6/15
INDOGB 8.25% 07/15/21	8.25	5,500,000	5,587,175	52,519	2021/7/15
INDOGB 8.375% 03/15/24	8.375	22,500,000	23,086,800	217,015	2024/3/15
INDOGB 8.375% 03/15/34	8.375	3,000,000	2,991,420	28,119	2034/3/15
INDOGB 8.375% 09/15/26	8.375	6,000,000	6,055,020	56,917	2026/9/15
INDOGB 9% 03/15/29	9.0	17,700,000	18,683,058	175,620	2029/3/15
INDOGB 9.5% 07/15/31	9.5	4,400,000	4,831,420	45,415	2031/7/15
小 計				1,715,011	
(南アフリカ)					
国債証券		千南アフリカ ランド	千南アフリカ ランド		
SAGB 10.5% 12/21/26	10.5	35,700	42,396	431,597	2026/12/21
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	21,500	16,526	168,235	2036/3/31
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	18,000	13,920	141,713	2041/2/28
SAGB 6.75% 03/31/21	6.75	22,000	21,179	215,610	2021/3/31
SAGB 7% 02/28/31	7.0	20,500	17,836	181,570	2031/2/28
SAGB 7.25% 01/15/20	7.25	22,500	22,453	228,579	2020/1/15
SAGB 7.75% 02/28/23	7.75	13,400	13,443	136,854	2023/2/28
SAGB 8% 01/31/30	8.0	8,500	8,196	83,438	2030/1/31
SAGB 8% 12/21/18	8.0	20,700	21,366	217,509	2018/12/21
SAGB 8.25% 09/15/17	8.25	21,700	22,513	229,185	2017/9/15
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	15,400	15,381	156,587	2048/2/28
小 計				2,190,881	
(ナイジェリア)					
国債証券		千ナイジェリア ナイラ	千ナイジェリア ナイラ		
NIGB 15.1% 04/27/17	15.1	186,000	196,664	135,816	2017/4/27
NIGB 7% 10/23/19	7.0	520,000	414,427	286,203	2019/10/23
小 計				422,019	
小 計				21,417,020	

(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	率
公 社 債	千円 21,417,020	% 67.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	10,294,302	32.5
投 資 信 託 財 産 総 額	31,711,322	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(31,577,457千円)の投資信託財産総額(31,711,322千円)に対する比率は99.6%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=114.36円、1メキシコペソ=8.45円、1ブラジルレアル=44.70円、1チリペソ=0.1946円、1コロンビアペソ=0.0545円、1ペルーヌエボソル=39.07円、1トルコリラ=50.81円、1ハンガリーフォリント=0.4615円、1ポーランドズロチ=33.67円、1ロシアルーブル=2.45円、1マレーシアリンギット=34.32円、1タイバーツ=3.49円、1フィリピンペソ=2.54円、1インドネシアルピア=0.0094円、1南アフリカランド=10.18円、1ナイジェリアナイラ=0.6906円です。

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2014年11月10日現在
(A) 資 産	41,360,215,012円
コール・ローン等	1,355,614,255
公社債(評価額)	21,417,020,523
未 収 入 金	18,002,916,307
未 収 利 息	492,698,887
前 払 費 用	91,965,040
(B) 負 債	18,397,650,241
未 払 金	9,673,379,207
未 払 解 約 金	8,724,271,034
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	22,962,564,771
元 本	12,937,139,680
次 期 繰 越 損 益 金	10,025,425,091
(D) 受 益 権 総 口 数	12,937,139,680口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,749円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2013年11月12日 至 2014年11月10日
(A) 配 当 等 収 益	2,355,843,752円
受 取 利 息	2,355,843,752
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,520,814,106
売 買 益	2,863,858,999
売 買 損	△1,343,044,893
(C) 保 管 費 用 等	△50,893,083
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	3,825,764,775
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	9,157,691,991
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,791,170,154
(G) 解 約 差 損 益 金	△13,749,201,829
(H) 計 (D+E+F+G)	10,025,425,091
次 期 繰 越 損 益 金(H)	10,025,425,091

- (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。

新興国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第6期（決算日 2014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	株式等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		株式組入比率	株式先物率	投資信託証券組入比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率				
第2期(2010年11月10日)	18,936	10.6	18,781	9.3	93.5	6.3	0.2	7,417
第3期(2011年11月10日)	15,511	△18.1	15,175	△19.2	99.0	0.7	0.3	10,663
第4期(2012年11月12日)	16,516	6.5	15,672	3.3	96.0	3.6	0.4	14,622
第5期(2013年11月11日)	21,178	28.2	19,592	25.0	97.4	2.1	0.4	21,878
第6期(2014年11月10日)	24,850	17.3	22,465	14.7	89.6	9.4	0.5	21,821

(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		株式組入比率	株式先物率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	円	騰落率			
(当期首) 2013年11月11日	21,178	—	19,592	—	97.4	2.1	0.4
11月末	22,278	5.2	20,616	5.2	95.9	3.6	0.4
12月末	22,589	6.7	20,911	6.7	98.0	2.7	0.4
2014年1月末	20,689	△2.3	19,157	△2.2	96.4	3.4	0.4
2月末	21,215	0.2	19,530	△0.3	95.8	4.2	0.4
3月末	21,886	3.3	20,161	2.9	95.7	4.1	0.4
4月末	22,184	4.8	20,407	4.2	96.9	3.3	0.5
5月末	22,907	8.2	21,001	7.2	95.6	3.3	1.5
6月末	23,131	9.2	21,091	7.7	94.6	4.9	1.4
7月末	24,290	14.7	22,067	12.6	93.6	6.1	0.5
8月末	24,742	16.8	22,428	14.5	97.1	2.5	0.6
9月末	24,261	14.6	21,974	12.2	96.3	4.0	0.6
10月末	24,216	14.3	21,911	11.8	92.1	7.3	0.6
(当期末) 2014年11月10日	24,850	17.3	22,465	14.7	89.6	9.4	0.5

(注1)騰落率は期首比です。

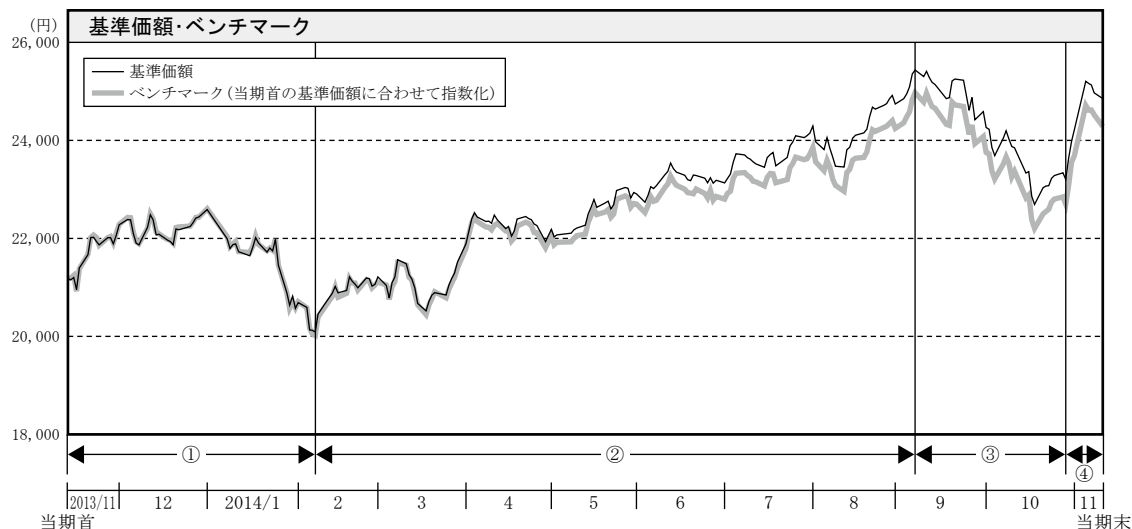
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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。なお、本報告書においては、設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

■ 基準価額の推移と変動要因



	①の期間	②の期間	③の期間	④の期間
基準価額の動き	下落	上昇	下落	上昇
基準価額変動をもたらした主な要因	<p>【プラス要因】</p> <ul style="list-style-type: none"> 中国の3中全会(中国共産党中央委員会第3回全体会議)を受けた構造改革への期待 <p>【マイナス要因】</p> <ul style="list-style-type: none"> 中国のマクロ景気指標の悪化 ブラジルのインフレ加速と連続利上げ トルコの汚職による政情不安 タイの政治的混乱 新興国各国の通貨安進行 	<p>【プラス要因】</p> <ul style="list-style-type: none"> 香港、上海株式市場相互注文取り次ぎによる資本市場開放の方針を好感 インド人民党、モディ新政権への改革期待 トルコ地方選挙でのAKP(公正発展党)の勝利 円安の進行 <p>【マイナス要因】</p> <ul style="list-style-type: none"> ウクライナ情勢の緊迫化 イラクの過激派武装組織「イスラム国」の勢力拡大 	<p>【プラス要因】</p> <ul style="list-style-type: none"> 特になし <p>【マイナス要因】</p> <ul style="list-style-type: none"> IMF(国際通貨基金)による2015年の世界経済の成長率予想の引き下げ 香港の民主化を求めるデモ活動がさらに拡大することへの懸念 ブラジル大統領選挙でルセフ大統領が再選したことを受けた、政権交代による構造改革への期待の剥落 原油や鉄鋼石など商品価格の大幅下落 エボラ出血熱の感染拡大への懸念 	<p>【プラス要因】</p> <ul style="list-style-type: none"> 香港、上海株式市場相互注文取り次ぎの開始による資金流入への期待 日銀の追加緩和策を受けた円安の進行 <p>【マイナス要因】</p> <ul style="list-style-type: none"> 特になし

◆パフォーマンス

当期の基準価額の騰落率は以下の通りです。

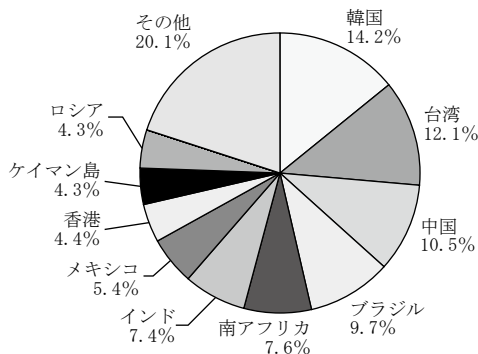
①当期首 (前期末) 基準価額	②当期末 基準価額	③差引 (②-①)	④騰落率 (③/①)	⑤ベンチマーク 騰落率	④-⑤
21,178円	24,850円	+3,672円	+17.3%	+14.7%	+2.6%

ベンチマーク騰落率との差異の主な要因は、配当金要因^{※1}+2.7%です。

■運用状況

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)と連動することを目標として運用を行っております。当期の運用につきましては、同インデックスとの連動性を図るべく、約800銘柄(DR(預託証券)を含みます。)に分散投資しました。また、資金の流出入等に対応するため、一部海外の株価指数先物取引を行っており、DRおよび先物を含む株式の組入比率は、期を通じて概ね100%程度を維持しました。当期末における国・地域^{※2}別の組入比率は下記の通りです。

国・地域別組入比率^{※3}(当期末)



■今後の運用方針

今後につきましても、MSCIエマージング・マーケット・インデックスを構成している国・地域の株式(DR(預託証券)を含みます。)を中心に組み入れ、取引コストを極力抑制しつつ、ベンチマークとの連動を目指した運用を行ってまいります。

※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 投資対象銘柄の法人登記国・地域名を記載しています。

※3 比率は、株式等評価総額に対する各国・地域の評価額の比率です。

1万口当たりの費用明細

項 目	当 期
(a) 売買委託手数料 (株 式) (新株予約権証券) (投資信託証券) (先物・オプション)	20円 (11) (0) (5) (4)
(b) 有価証券取引税 (株 式) (新株予約権証券) (投資信託証券)	21 (21) (0) (0)
(c) 保管費用等	54
合 計	95

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 売買委託手数料、(b) 有価証券取引税、(c) 保管費用等は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 5,344 (230)	千米ドル 7,516 (-)	百株 7,917	千米ドル 9,344
	メ キ シ コ	14,865 (281)	千メキシコペソ 53,029	27,374	千メキシコペソ 93,908 (50)
	ブ ラ ジ ル	10,578 (4,450)	千ブラジルリアル 20,136 (49)	15,618 (1,445)	千ブラジルリアル 31,505 (372)
	チ リ	20,780 (470)	千チリペソ 734,361 (6,463)	38,577 (44)	千チリペソ 1,155,336 (1,587)
	ユ ー ロ	1,067 (6)	千ユーロ 1,437	420	千ユーロ 531 (5)
	そ の 他	-	-	120	99
	ト ル コ	3,750 (56)	千トルコリラ 2,672 (-)	5,527	千トルコリラ 4,395
	チ ェ コ	66	千チェココルナ 5,199	152	千チェココルナ 9,582
	ハ ン ガ リ ー	181	千ハンガリーフォリント 79,579	448	千ハンガリーフォリント 71,920
	ポ ー ラ ン ド	2,817	千ポーランドズロチ 5,381	2,734	千ポーランドズロチ 7,168

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	香 港	百株 149,567 (7,308)	千香港ドル 128,630 (1,382)	百株 224,854 (970)	千香港ドル 197,860 (1,158)
	マレーシア	14,049 (2,610)	千マレーシアリングギット 12,002 (623)	22,614 (-)	千マレーシアリングギット 16,426 (190)
	タイ	22,856 (3,761)	千タイバーツ 57,982 (1,135)	25,138 (-)	千タイバーツ 113,998 (52)
	フィリピン	14,957 (2,813)	千フィリピンペソ 63,615 (333)	8,872	千フィリピンペソ 64,368
	インドネシア	45,917	千インドネシアルピア 24,267,138	72,143	千インドネシアルピア 40,965,120
	韓国	1,815 (26)	千韓国ウォン 12,785,347 (85,871)	2,940 (26)	千韓国ウォン 20,087,694 (49,830)
	台湾	60,830 (6,442)	千新台幣ドル 285,321 (5,227)	101,516 (110)	千新台幣ドル 469,989 (3,610)
	インド	7,400 (152)	千インドルピー 361,430 (615)	12,107 (76)	千インドルピー 674,723 (158)
	カタール	816	千カタールリアル 6,035	-	千カタールリアル -
	南アフリカ	6,827 (860)	千南アフリカランド 67,215 (1,284)	10,970 (175)	千南アフリカランド 107,771 (274)
	アラブ首長国連邦	8,061	千アラブ首長国連邦ディルハム 4,638	-	千アラブ首長国連邦ディルハム -

(注1)金額は受渡代金です。

(注2) ()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

<新株予約権証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	タイ	証券 -	千タイバーツ -	証券 20,240	千タイバーツ 82
		(20,240)	(52)		

(注1)金額は受渡代金です。

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

<投資信託受益証券、投資証券>

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国				
アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
ISHARES MSCI QATAR CP ETF	50,000	1,346	50,000	1,085
ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	50,000	1,331	50,000	1,035
小 計	100,000	2,678	100,000	2,120
メキシコ	口	千メキシコペソ	口	千メキシコペソ
CONTROLADORA COML MEXIC-UB	14,500	715	26,100	1,397
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	93,600 (-)	4,260	67,800 (-)	3,122 (83)
小 計	108,100 (-)	4,975	93,900 (-)	4,520 (83)
ブラジル	口	千ブラジルリアル	口	千ブラジルリアル
SUL AMERICA SA-UNITS	14,000	212	19,600	257
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	17,000	227	24,000 (-)	332 (78)
VIA VAREJO SA	6,400	154	-	-
KLABIN SA-UNIT	5,900 (28,900)	66 (323)	15,800	194
KLABIN SA-RTS	- (876)	- (-)	876	0.07843
小 計	43,300 (29,776)	661 (323)	60,276 (-)	783 (78)
南アフリカ	口	千南アフリカランド	口	千南アフリカランド
REDEFINE PROPERTIES LTD	37,288 (6,525)	337 (63)	85,806	854
小 計	37,288 (6,525)	337 (63)	85,806	854

(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	18,634	17,219	-	-

(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	23,847,511千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	24,698,993千円
(c) 売 買 高 比 率(a) / (b)	0.96

(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。

主要な売買銘柄

<株 式>

当 付				期 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD(韓国)	2	273,281	129,089	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD(韓国)	3	458,864	125,099
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC(台湾)	462	192,242	416	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC(台湾)	801	368,472	460
TENCENT HOLDINGS LTD(香港)	66	152,993	2,304	TENCENT HOLDINGS LTD(香港)	147	278,309	1,885
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR(アメリカ)	32	136,659	4,205	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R(香港)	196	260,775	1,330
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R(香港)	114	125,623	1,101	CHINA CONSTRUCTION BANK-H(香港)	2,204	182,004	82
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR(アメリカ)	20	111,789	5,369	NASPERS LTD-N SHS(南アフリカ)	12	166,161	13,209
CHINA CONSTRUCTION BANK-H(香港)	1,264	95,277	75	IND&COMM BK OF CHINA-H(香港)	2,254	164,677	73
NASPERS LTD-N SHS(南アフリカ)	7	92,033	12,401	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L(メキシコ)	1,171	154,770	132
GAZPROM OAO-SPON ADR(アメリカ)	111	89,707	805	GAZPROM OAO-SPON ADR(アメリカ)	192	144,475	749
IND&COMM BK OF CHINA-H(香港)	1,315	88,091	66	HON HAI PRECISION INDUSTRY(台湾)	390	134,055	343

(注) 金額は受渡代金です。

<新株予約権証券>

当 付			期 付		
銘 柄	柄	金 額	銘 柄	柄	金 額
		千円			千円
		—	INDORAMA VENTURES PCL(W1) -CW99(タイ)		175
			INDORAMA VENTURES PCL(W2) -CW99(タイ)		103

(注) 金額は受渡代金です。

<投資信託受益証券、投資証券>

当 付				期 付			
銘 柄	口 数	金 額	銘 柄	口 数	金 額		
		千円			千円		
ISHARES MSCI QATAR CP ETF(アメリカ)	50,000	136,849	ISHARES MSCI QATAR CP ETF(アメリカ)	50,000	111,615		
ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF(アメリカ)	50,000	135,403	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF(アメリカ)	50,000	106,478		
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA(メキシコ)	93,600	33,553	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA(メキシコ)	67,800	25,941		
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT(ブラジル)	17,000	10,290	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT(ブラジル)	24,000	14,859		
SUL AMERICA SA-UNITS(ブラジル)	14,000	9,836	SUL AMERICA SA-UNITS(ブラジル)	19,600	11,691		
VIA VAREJO SA(ブラジル)	6,400	7,134	CONTROLADORA COML MEXIC-UB(メキシコ)	26,100	11,646		
CONTROLADORA COML MEXIC-UB(メキシコ)	14,500	5,673	REDEFINE PROPERTIES LTD(南アフリカ)	85,806	8,697		
REDEFINE PROPERTIES LTD(南アフリカ)	37,288	3,280	KLABIN SA-UNIT(ブラジル)	15,800	8,695		
KLABIN SA-UNIT(ブラジル)	5,900	3,087	KLABIN SA-RTS(ブラジル)	876	3		

(注) 金額は受渡代金です。(償還分は含まれておりません。)

利害関係人^{*}との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為替直物取引	百万円 25,125	百万円 —	% —	百万円 29,353	百万円 380	% 1.3

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

<外国株式(上場、登録株式)>

銘柄	当期首(前期末)		当		期		業	種
	株数 (百株)	株数 (百株)	株数 (百株)	株数 (百株)	評価額 外貨建金額	期末 額 邦貨換算金額 (千円)		
(アメリカ)					千米ドル			
BANCOLOMBIA S. A. -SPONS ADR	156	132			746	85,416	銀行	
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	169	169			165	18,954	素材	
CREDICORP LTD	24	28			457	52,357	銀行	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	308	244			335	38,373	電気通信サービス	
SOUTHERN COPPER CORP	64	69			210	24,023	素材	
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	249	245			633	72,447	エネルギー	
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	584	584			87	9,964	エネルギー	
LUKOIL-SPON ADR	302	231			1,057	120,890	エネルギー	
GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR REG S	551	387			124	14,227	電気通信サービス	
GAZPROM OAO-SPON ADR	3,463	2,648			1,654	189,186	エネルギー	
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	664	444			301	34,502	銀行	
SURGUTNEFTGAZ-SP ADR	611	509			305	34,970	エネルギー	
SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	67	50			34	3,908	電気通信サービス	
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	54	41			407	46,629	エネルギー	
MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	329	262			447	51,140	素材	
ROSTELECOM-SPONSORED ADR	121	58			81	9,268	電気通信サービス	
ROSNEFT OJSC-GDR	732	564			290	33,223	エネルギー	
URALKALI-SPON GDR-REG S	158	132			235	26,913	素材	
TMK-GDR REG S	60	—			—	—	エネルギー	
SEVERSTAL - GDR REG S	168	94			102	11,675	素材	
TATNEFT-SPONSORED REGS GDR	143	111			367	42,063	エネルギー	
VTB BANK OJSC-GDR-REG S	992	1,337			237	27,128	銀行	
LSR GROUP OJSC-GDR REGS	157	—			—	—	不動産	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	153	117			693	79,325	食品・生活必需品小売り	
FEDERAL HYDROGENERATING-ADR	722	489			73	8,375	公益事業	
SBERBANK-SPONSORED ADR	1,657	1,262			862	98,616	銀行	
MEGAFON-GDR	57	57			128	14,687	電気通信サービス	
DP WORLD LTD	—	109			218	24,950	運輸	
小計	12,727	10,384			10,259	1,173,221		
銘柄数 <比率>	27	26			—	<5.4%>		
(メキシコ)					千メキシコペソ			
ALFA S. A. B. -A	1,719	1,216			4,915	41,532	資本財	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER	234	210			2,974	25,130	食品・飲料・タバコ	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	1,107	828			10,884	91,972	食品・飲料・タバコ	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	141	109			1,727	14,596	小売	
GRUPO FIN SANTANDER-B	993	779			2,499	21,116	銀行	
GRUPO TELEVISIVA SAB-SER CPO	1,478	1,101			10,472	88,492	メディア	
GRUPO MODELO S. A. B. -SER C	315	—			—	—	食品・飲料・タバコ	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,019	811			3,153	26,644	食品・飲料・タバコ	

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

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
GRUMA S. A. B. -B	—	98	1,476	12,479	食品・飲料・タバコ
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	—	112	2,048	17,306	資本財
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	317	223	1,717	14,517	資本財
CEMEX SAB-SPONS	6,490	5,351	8,888	75,104	素材
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	1,393	1,077	9,078	76,709	銀行
MEXICHEM SAB DE CV-*	647	394	2,115	17,875	素材
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	84	59	1,689	14,275	素材
INDUSTRIAS CH S. A. B. -SER B	86	—	—	—	素材
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	885	641	2,053	17,354	家庭用品・パーソナル用品
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	134	99	1,822	15,400	運輸
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	2,248	1,645	7,650	64,644	素材
AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	21,143	14,719	24,022	202,986	電気通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	1,460	969	3,774	31,892	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	212	140	1,230	10,399	食品・飲料・タバコ
WALMART DE MEXICO-SER V	3,075	2,203	6,796	57,430	食品・生活必需品小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	174	174	1,658	14,017	運輸
GENOMMA LAB INTERNACIONAL-B	555	478	1,550	13,098	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OHL MEXICO SAB DE CV	462	376	1,371	11,587	運輸
MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	317	482	1,088	9,196	素材
COMPARTAMOS SAB DE CV	599	408	1,232	10,411	各種金融
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	196	196	905	7,654	食品・生活必需品小売り
GRUPO LALA SAB DE CV	—	358	1,075	9,087	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数	金 額	株 数	金 額	
	47,489	35,262	119,871	1,012,917	
	27	28	—	<4.6%>	
(ブラジル)			千ブラジルレアル		
BRF SA	370	291	1,893	84,628	食品・飲料・タバコ
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	192	161	179	8,024	耐久消費財・アパレル
VALE SA	725	569	1,366	61,093	素材
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	55	33	109	4,875	公益事業
VALE SA-PREF A	1,105	871	1,803	80,606	素材
TJM PARTICIPACOES SA	489	298	395	17,676	電気通信サービス
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	90	177	157	7,041	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	163	163	95	4,269	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	309	392	1,018	45,540	銀行
CIA DE BEBIDAS DAS AMERICAS	77	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	395	—	—	—	食品・飲料・タバコ
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	177	280	160	7,179	素材
AES TIETE SA-PREF	61	61	117	5,262	公益事業
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	1,672	1,468	1,431	64,000	銀行
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	218	193	287	12,842	小売
LOJAS AMERICANAS SA	72	90	111	4,964	小売
MARCOPOLO SA-PREF	314	—	—	—	資本財
GERDAU SA-PREF	484	432	500	22,380	素材
METALURGICA GERDAU SA-PREF	182	87	120	5,397	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	1,713	1,311	1,805	80,694	エネルギー
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	2,402	1,847	2,636	117,839	エネルギー
ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTI	201	—	—	—	消費者サービス
KLABIN SA-PREF	344	—	—	—	素材
SOUZA CRUZ SA	240	154	306	13,698	食品・飲料・タバコ
KROTON EDUCACIONAL SA	132	609	1,079	48,249	消費者サービス
CCR SA	492	415	722	32,277	運輸
WEG SA	124	108	323	14,480	資本財
BANCO BRADESCO SA-PREF	1,232	938	3,386	151,362	銀行
BANCO BRADESCO S. A.	349	278	973	43,493	銀行
CIA HERING	92	—	—	—	小売
ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	247	247	159	7,132	運輸
NATURA COSMETICOS SA	106	60	218	9,749	家庭用品・パーソナル用品
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	435	234	184	8,231	素材
BRADESPAR SA -PREF	148	66	98	4,395	素材
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	240	185	202	9,055	素材
CPFL ENERGIA SA	127	71	132	5,917	公益事業
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1,424	1,226	4,432	198,124	銀行
PORTO SEGURO SA	59	20	57	2,581	保険
FIBRIA CELULOSE SA	146	94	292	13,088	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)	
BRASKEM SA-PREF A	89	89	168	7,538	素材
TRACTEBEL ENERGIA SA	106	57	193	8,650	公益事業
LOCALIZA RENT A CAR	88	35	124	5,570	運輸
LOJAS RENNEN S.A.	85	59	433	19,384	小売
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	129	47	43	1,953	公益事業
ARTERIS SA	91	—	—	—	運輸
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	193	165	847	37,902	エネルギー
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	66	43	135	6,064	エネルギー
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS	34	34	82	3,708	公益事業
TOTVS SA	58	27	92	4,130	ソフトウェア・サービス
EMBRAER SA	332	268	650	29,086	資本財
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	121	46	120	5,366	公益事業
BR PROPERTIES SA	165	130	145	6,508	不動産
M DIAS BRANCO SA	29	21	198	8,889	食品・飲料・タバコ
ODONTOPREV S.A.	124	124	111	4,999	ヘルスケア機器・サービス
B2W CIA DIGITAL	—	67	227	10,152	小売
BR MALLS PARTICIPACOES SA	273	224	380	17,021	不動産
JBS SA	447	306	339	15,182	食品・飲料・タバコ
OI SA-PREFERENCE	454	1,870	224	10,032	電気通信サービス
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	319	358	503	22,509	公益事業
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	212	131	257	11,506	公益事業
MRV ENGENHARIA	153	—	—	—	耐久消費財・アパレル
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	39	18	86	3,850	不動産
BANCO ESTADO RIO GRANDE SUL	77	15	21	972	銀行
ESTACIO PARTICIPACOES SA	129	138	399	17,851	消費者サービス
DURATEX SA	190	16	13	614	素材
ENEVA SA	51	—	—	—	公益事業
HYPERMARCAS SA	198	122	204	9,161	家庭用品・パーソナル用品
BM&FBOVESPA SA	1,118	857	859	38,422	各種金融
MULTIPLUS SA	17	—	—	—	メディア
TELEFONICA BRASIL S.A.	172	110	539	24,093	電気通信サービス
QUALICORP SA	133	83	205	9,175	ヘルスケア機器・サービス
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	115	114	363	16,255	各種金融
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	79	135	130	5,853	運輸
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	76	66	684	30,578	食品・生活必需品小売り
CIELO SA	196	317	1,225	54,801	ソフトウェア・サービス
RAIA DROGASIL SA	145	72	180	8,062	食品・生活必需品小売り
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	321	321	1,014	45,356	保険
AMBEV SA	—	2,077	3,414	152,632	食品・飲料・タバコ
小 計	24,033	21,998	41,386	1,849,996	
株 数 比 率 <	76	68	—	<8.5%	
(チリ)			千チリペソ		
BANCO SANTANDER CHILE	39,578	29,096	95,696	18,622	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSION	16	8	27,010	5,256	銀行
BANCO DE CHILE	9,826	10,901	80,422	15,650	銀行
CAP SA	38	38	17,976	3,498	素材
AES GENER SA	1,778	1,417	45,293	8,814	公益事業
EMPRESAS CMPC SA	786	569	83,105	16,172	素材
EMPRESAS COPEC SA	262	187	133,878	26,052	エネルギー
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	60	41	25,723	5,005	食品・飲料・タバコ
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	60	60	38,139	7,422	電気通信サービス
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	2,105	1,581	140,129	27,269	公益事業
ENERSIS SA	10,758	7,600	139,462	27,139	公益事業
COLBUN SA	4,100	2,652	41,274	8,032	公益事業
AGUAS ANDINAS SA-A	1,720	424	14,829	2,885	公益事業
E. CL SA	485	—	—	—	公益事業
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	152	152	27,632	5,377	食品・飲料・タバコ
LATAM AIRLINES GROUP SA	165	141	100,208	19,500	運輸
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	63	41	57,104	11,112	素材
S. A. C. I. FALABELLA	409	430	183,467	35,702	小売
CORPBANCA	84,199	84,199	65,221	12,692	銀行
VINA CONCHA Y TORO SA	541	367	41,931	8,159	食品・飲料・タバコ
CENCOSUD SA	624	451	74,521	14,501	食品・生活必需品小売り
小 計	157,734	140,363	1,433,029	278,867	
株 数 比 率 <	21	20	—	<1.3%	

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)	
(ギリシャ)			千ユーロ		
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	—	233	211	30,132	電気通信サービス
OPAP SA	—	184	177	25,285	消費者サービス
JUMBO SA	—	137	128	18,234	小売
TITAN CEMENT CO. S. A.	—	54	101	14,490	素材
FF GROUP	—	42	108	15,424	小売
国 小 計	株 数 銘柄 数	株 数 銘柄 数	金 額 <比 率>	金 額 <比 率>	
(ユーロ・・・その他)					
MAROC TELECOM	—	120	—	—	電気通信サービス
国 小 計	株 数 銘柄 数	株 数 銘柄 数	金 額 <比 率>	金 額 <比 率>	
ユーロ計	株 数 銘柄 数	株 数 銘柄 数	金 額 <比 率>	金 額 <比 率>	
(トルコ)			千トルコリラ		
AKBANK T. A. S.	1,024	806	611	31,085	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	146	61	150	7,640	食品・飲料・タバコ
ARCELIK AS	153	153	201	10,261	耐久消費財・アパレル
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	253	284	150	7,629	資本財
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	1,216	613	264	13,460	素材
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	32	32	91	4,659	自動車・自動車部品
KOC HOLDING AS	313	248	280	14,249	資本財
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	301	326	106	5,402	資本財
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	99	67	96	4,904	自動車・自動車部品
TURK HAVA YOLLARI AO	381	323	242	12,329	運輸
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	492	377	478	24,328	電気通信サービス
TURKIYE GARANTI BANKASI	1,359	1,030	853	43,369	銀行
TURKIYE IS BANKASI-C	856	727	381	19,378	銀行
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	64	44	216	10,979	エネルギー
ULKER BISKUVI SANAYI	—	96	158	8,070	食品・飲料・タバコ
YAPI VE KREDI BANKASI	412	259	120	6,133	銀行
HACI OMER SABANCI HOLDING	504	427	424	21,588	各種金融
COCA-COLA ICECEK AS	29	44	212	10,772	食品・飲料・タバコ
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	135	103	501	25,493	食品・生活必需品小売り
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	359	169	76	3,885	銀行
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	127	98	183	9,320	運輸
TURKIYE HALK BANKASI	349	220	304	15,446	銀行
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	265	177	112	5,732	電気通信サービス
KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	16	31	42	2,165	素材
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	218	668	159	8,084	不動産
小 計	株 数 銘柄 数	株 数 銘柄 数	金 額 <比 率>	金 額 <比 率>	
(チェコ)			千チェココルナ		
KOMERCNI BANKA AS	9	6	3,326	17,097	銀行
02 CZECH REPUBLIC AS	61	—	—	—	電気通信サービス
CEZ AS	99	78	4,735	24,342	公益事業
小 計	株 数 銘柄 数	株 数 銘柄 数	金 額 <比 率>	金 額 <比 率>	
(ハンガリー)			千ハンガリーフォリント		
RICHTER GEDEON NYRT	—	41	15,381	7,098	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MAGYAR TELEKOM TELECOMMUNICA	285	—	—	—	電気通信サービス
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	22	22	26,953	12,439	エネルギー
OTP BANK NYRT	115	93	36,322	16,762	銀行
小 計	株 数 銘柄 数	株 数 銘柄 数	金 額 <比 率>	金 額 <比 率>	
(ポーランド)			千ポーランドズロチ		
BANK MILLENNIUM SA	224	330	263	8,860	銀行
M BANK SA	7	4	198	6,684	銀行
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	20	20	221	7,457	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA	83	59	744	25,063	素材
BANK PEKAO SA	76	54	983	33,104	銀行
ORANGE POLSKA SA	364	257	254	8,560	電気通信サービス
POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	178	132	567	19,104	エネルギー
LPP SA	—	0.38	351	11,822	耐久消費財・アパレル

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)	
BANK ZACHODNI WBK SA	14	11	453	15,262	銀行
PKO BANK POLSKI SA	516	369	1,343	45,236	銀行
SYNTHOS SA	337	337	138	4,659	素材
EUROCASH SA	50	50	159	5,363	食品・生活必需品小売り
GRUPA LOTOS SA	22	55	147	4,979	エネルギー
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	923	660	322	10,856	エネルギー
KERNEL HOLDING SA	31	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CYFROWY POLSAT SA	118	118	302	10,199	メディア
GRUPA AZOTY SA	33	27	165	5,585	素材
ENEA SA	46	129	211	7,112	公益事業
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	488	330	722	24,314	公益事業
TAURON POLSKA ENERGIA SA	749	570	299	10,081	公益事業
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	34	22	1,117	37,638	保険
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	22	55	131	4,442	素材
GETIN NOBLE BANK SA	—	698	163	5,501	銀行
ALIOR BANK SA	26	29	227	7,645	銀行
ENERGA SA	—	128	318	10,712	公益事業
小 計	4,373	4,456	9,808	330,248	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	22	24	—	<1.5%>	
(香港)			千香港ドル		
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	930	380	516	7,622	素材
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	820	680	571	8,425	運輸
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1,400	—	—	—	運輸
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	3,495	2,675	25,813	380,752	電気通信サービス
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	705	580	1,481	21,858	素材
DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD. -H	1,580	1,580	641	9,461	公益事業
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	320	235	1,437	21,196	資本財
HUANENG POWER INTL INC-H	1,880	1,500	1,338	19,735	公益事業
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	—	1,400	683	10,077	電気通信サービス
YANZHOU COAL MINING CO-H	960	520	327	4,824	エネルギー
HENGAN INTL GROUP CO LTD	415	345	2,751	40,582	家庭用品・パーソナル用品
NEW WORLD CHINA LAND LTD	—	1,700	800	11,810	不動産
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	1,840	1,500	1,830	26,992	自動車・自動車部品
CHINA INTL MARINE CO-H	182	356	674	9,955	資本財
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	—	740	516	7,618	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	2,270	1,910	4,174	61,569	不動産
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	1,160	760	1,369	20,200	不動産
CITIC LTD	710	900	1,200	17,708	資本財
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	1,080	1,080	642	9,478	運輸
LENOVO GROUP LTD	3,880	2,820	2,893	42,676	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
POLY PRORERTY GROUP CO LIMITED	1,370	1,370	424	6,264	不動産
PETROCHINA CO LTD-H	12,340	9,320	8,555	126,197	エネルギー
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	2,740	2,140	2,435	35,920	電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	544	658	1,045	15,417	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	14,374	11,254	7,236	106,735	エネルギー
CHAODA MODERN AGRICULTURE	680	680	—	—	食品・飲料・タバコ
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	440	340	1,640	24,197	公益事業
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	1,800	1,120	1,117	16,486	エネルギー
COSCO PACIFIC LIMITED-R	1,000	560	602	8,887	運輸
SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GROUP LIMITED	1,820	—	—	—	素材
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	4,200	3,440	498	7,357	不動産
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL-R	695	395	995	14,686	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,800	1,560	535	7,892	素材
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	500	360	557	8,219	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,480	840	1,140	16,825	公益事業
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	318	93	141	2,087	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	2,650	1,700	613	9,052	自動車・自動車部品
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	460	300	628	9,270	公益事業
BYD CO LTD-H	340	260	1,231	18,158	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD-H	7,720	6,240	3,007	44,363	電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	800	720	1,065	15,717	エネルギー
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	—	3,200	515	7,599	メディア
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	1,390	1,070	1,138	16,792	商業・専門サービス
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	1,100	830	365	5,386	素材

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)	
DAPHNE INTERNATIONAL HOLDING	640	—	—	—	耐久消費財・アパレル
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2,074	1,494	2,058	30,368	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	960	520	310	4,586	資本財
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	1,074	894	1,868	27,559	公益事業
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	587	497	1,791	26,417	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	4,400	3,350	7,621	112,413	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2,730	3,790	739	10,900	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1,200	1,080	840	12,393	ヘルスケア機器・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	252	142	416	6,136	資本財
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	3,270	310	75	1,111	素材
CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS	280	—	—	—	不動産
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	230	150	357	5,265	資本財
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	1,120	900	1,663	24,532	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	240	200	1,081	15,944	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	1,860	1,040	1,067	15,738	公益事業
CHINA RESOURCES ENTERPRISE-R	700	400	716	10,561	食品・生活必需品小売り
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	1,100	880	702	10,358	運輸
CNOOC LTD-R	10,200	7,840	9,235	136,223	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,360	1,080	821	12,122	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	2,200	2,200	486	7,171	運輸
CHINA MENGNIU DAIRY CO-R	760	630	1,981	29,224	食品・飲料・タバコ
TENCENT HOLDINGS LTD	586	2,254	27,746	409,264	ソフトウェア・サービス
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,070	925	5,688	83,909	保険
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	—	1,420	776	11,456	公益事業
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	6,980	5,939	718	10,600	小売
AIR CHINA LIMITED-H	920	640	341	5,031	運輸
ZTE CORP-H	496	404	733	10,816	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	631	9,317	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	1,975	1,530	3,243	47,843	エネルギー
CHINA COSCO HOLDINGS-H	1,425	755	276	4,075	運輸
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	5,104	4,174	2,400	35,407	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	920	600	706	10,425	資本財
PARKSON RETAIL GROUP LTD	835	—	—	—	小売
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	41,356	31,956	18,055	266,314	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	380	320	854	12,602	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,480	1,220	1,361	20,082	自動車・自動車部品
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	720	—	—	—	不動産
WUMART STORES INC-H	290	—	—	—	食品・生活必需品小売り
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	870	320	195	2,879	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	1,600	1,340	975	14,388	素材
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	370	370	359	5,299	小売
BANK OF CHINA LTD-H	42,842	35,312	12,959	191,152	銀行
SHUI ON LAND LTD	2,092	2,092	385	5,679	不動産
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	770	655	1,092	16,114	不動産
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	295	—	—	—	不動産
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	456	688	585	8,635	不動産
CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	840	840	236	3,493	素材
CHINA MERCHANTS BANK-H	2,539	2,144	3,083	45,480	銀行
IND&COMM BK OF CHINA-H	42,135	32,745	16,372	241,495	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	245	—	—	—	素材
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	1,140	160	58	866	電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	2,220	1,640	1,121	16,545	資本財
CHINA COAL ENERGY CO - H	2,080	1,440	676	9,982	エネルギー
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	—	90	144	2,129	資本財
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	210	395	1,317	19,430	資本財
INTIME RETAIL GROUP CO LTD	700	700	472	6,969	小売
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	610	470	954	14,072	耐久消費財・アパレル
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	923	163	48	711	食品・飲料・タバコ
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2,732	1,152	348	5,135	不動産
CHINA CITIC BANK-H	5,172	4,102	2,059	30,373	銀行
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	2,580	1,730	1,686	24,879	小売
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	610	420	630	9,304	耐久消費財・アパレル
FOSUN INTERNATIONAL	1,355	670	604	8,914	素材
FRANSHION PROPERTIES	2,800	2,200	424	6,262	不動産
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	1,601	930	423	6,247	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)	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	2,060	—	—	—	耐久消費財・アパレル
SOHO CHINA LTD	1,350	1,130	649	9,583	不動産
KINGSOFT CORP LTD	—	170	308	4,543	ソフトウェア・サービス
DAH CHONG HONG	810	—	—	—	小売
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	5,030	3,570	899	13,269	半導体・半導体製造装置
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	2,570	2,000	970	14,307	資本財
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	1,010	936	674	9,954	食品・飲料・タバコ
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	1,025	655	525	7,748	資本財
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	3,560	2,690	2,727	40,232	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	1,562	1,222	3,476	51,279	保険
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	3,480	1,470	436	6,439	不動産
CSR CORP LTD-H	1,000	1,400	1,104	16,292	資本財
CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	960	—	—	—	素材
SUN ART RETAIL GROUP LTD	1,445	875	729	10,763	食品・生活必需品小売り
BBMG CORPORATION - H	570	105	59	875	素材
SINOPHARM GROUP CO-H	604	468	1,506	22,227	ヘルスケア機器・サービス
CHINA RESOURCES CEMENT	1,640	1,340	702	10,356	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	1,402	622	439	6,481	自動車・自動車部品
YINGDE GASES GROUP COMPANY	795	610	362	5,344	素材
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	1,780	1,390	574	8,467	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	1,370	1,230	1,007	14,858	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	613	430	815	12,025	ヘルスケア機器・サービス
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	1,000	1,770	1,037	15,298	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOSTIME INTERNATIONAL HLDGI	—	120	208	3,072	食品・飲料・タバコ
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	643	1,093	464	6,856	資本財
LONGFOR PROPERTIES	685	240	218	3,228	不動産
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	426	347	985	14,535	保険
CHINA MINSHENG BANKING-H	3,025	2,870	2,189	32,299	銀行
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	—	550	206	3,042	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	12,110	10,010	3,533	52,119	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	470	330	237	3,509	小売
FAR EAST HORIZON LTD	760	760	535	7,903	各種金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H	615	455	888	13,100	各種金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	924	528	717	10,576	各種金融
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	—	320	1,478	21,806	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	2,790	2,560	867	12,800	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	—	260	679	10,028	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	472	6,970	資本財
HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	—	4,100	729	10,764	半導体・半導体製造装置
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	—	1,030	174	2,567	食品・飲料・タバコ
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	—	2,210	806	11,898	各種金融
CHINA VANKE CO LTD-H	—	443	644	9,500	不動産
YANTAI CHANGYU PIONEER-B	108	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILI-B	—	251	413	6,105	自動車・自動車部品
CHINA VANKE CO LTD-B	662	—	—	—	不動産
小 計	株 数	金 額	株 数	金 額	
銘 柄 数 < 比 率 >	366,289	297,340	137	265,202	<17.9%>
(マレーシア)				千マレーシアンギット	
PARKSON HOLDINGS BHD	502	—	—	—	小売
AMMB HOLDINGS BHD	1,095	899	585	20,085	銀行
GENTING PLANTATIONS BHD	140	140	148	5,112	食品・飲料・タバコ
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	2,654	2,197	1,393	47,815	銀行
DIGI.COM BERHAD	2,115	1,153	706	24,256	電気通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	304	446	316	10,852	運輸
RHB CAPITAL BHD	331	336	292	10,025	銀行
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	306	313	109	3,751	消費者サービス
GAMUDA BHD	889	747	384	13,203	資本財
YTL CORPORATION BERHAD	3,205	1,250	207	7,122	公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	91	17	30	1,030	銀行
HONG LEONG BANK BERHAD	326	225	324	11,143	銀行
IJM CORP BHD	652	275	187	6,446	資本財
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	327	190	433	14,893	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	2,447	1,908	1,844	63,288	銀行
LAFARGE MALAYAN BHD	261	261	267	9,172	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)	
MMC CORP BHD	538	538	135	4,652	資本財
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	833	706	335	11,509	銀行
MISC BHD	565	565	417	14,320	運輸
PPB GROUP BERHAD	301	205	319	10,975	食品・飲料・タバコ
PETRONAS DAGANGAN BHD	139	153	300	10,302	エネルギー
PETRONAS GAS BHD	337	319	701	24,085	公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	79	51	346	11,902	食品・飲料・タバコ
TELECOM MALAYSIA BHD	663	339	245	8,424	電気通信サービス
TENAGA NATIONAL BHD	1,641	1,202	1,563	53,661	公益事業
UMW HOLDINGS BHD	200	340	384	13,185	自動車・自動車部品
DIALOG GROUP BHD	—	2,229	336	11,554	資本財
PUBLIC BANK BHD-LOCAL MKT	—	1,182	2,156	74,005	銀行
PUBLIC BANK BHD-FOREIGN MKT	648	—	—	—	銀行
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	1,165	1,223	195	6,717	公益事業
AIRASIA BHD	648	648	167	5,759	運輸
GENTING BHD	1,164	893	844	28,992	消費者サービス
GENTING MALAYSIA BERHAD	1,737	982	409	14,053	消費者サービス
IOI CORPORATION BHD	1,583	1,212	588	20,180	食品・飲料・タバコ
SIME DARBY BERHAD	1,504	1,323	1,270	43,602	資本財
AXIATA GROUP BERHAD	1,489	1,014	706	24,239	電気通信サービス
UEM SUNRISE BHD	689	1,194	223	7,662	不動産
BUMI ARMADA BERHAD	438	657	93	3,201	エネルギー
MAXIS BHD	1,284	900	611	20,972	電気通信サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	1,405	1,344	791	27,168	素材
SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	2,172	1,612	496	17,039	エネルギー
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	752	424	143	4,933	メディア
IHH HEALTHCARE BHD	1,226	1,154	561	19,287	ヘルスケア機器・サービス
FELDA GLOBAL VENTURES	803	803	280	9,618	食品・飲料・タバコ
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	—	121	33	1,157	不動産
小 計	39,653	33,699	21,893	751,370	
株 数 金 額	42	43	—	<3.4%>	
銘 柄 数 <比 率>					
(タイ)			千タイパーツ		
BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	711	162	3,288	11,477	銀行
BANK OF AYUDHYA PUBLIC-NVDR	1,463	—	—	—	銀行
KRUNG THAI BANK - NVDR	1,997	1,299	3,014	10,521	銀行
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,057	709	13,116	45,776	銀行
TRUE CORP PCL-NVDR	3,687	3,780	4,044	14,116	電気通信サービス
KASIKORN BANK PCL-NVDR	246	244	5,734	20,011	銀行
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	—	4,306	1,317	4,598	銀行
IRPC PCL - NVDR	5,728	5,728	1,913	6,676	エネルギー
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	790	790	2,172	7,582	エネルギー
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	—	202	4,029	14,064	銀行
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,688	870	2,501	8,729	食品・飲料・タバコ
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	607	463	10,787	37,649	電気通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	2,296	2,171	1,986	6,934	小売
PTT PCL-NVDR	511	367	14,349	50,080	エネルギー
SIAM CEMENT PUBLIC CO-FOR REG	218	126	5,619	19,612	素材
SIAM CEMENT PCL-NVDR	—	65	2,899	10,117	素材
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	561	561	2,748	9,593	メディア
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	272	167	4,074	14,221	運輸
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	803	565	13,334	46,535	銀行
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	794	748	3,571	12,465	不動産
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	177	958	1,753	6,118	ヘルスケア機器・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	—	74	1,010	3,525	ヘルスケア機器・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,132	397	1,280	4,468	消費者サービス
THAI OIL PCL-NVDR	582	480	2,172	7,580	エネルギー
GLOW ENERGY PCL - NVDR	356	98	980	3,420	公益事業
CP ALL PCL-NVDR	2,754	1,922	8,168	28,508	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	—	3,675	3,785	13,210	運輸
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	780	579	8,511	29,704	エネルギー
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	640	83	186	651	素材
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	927	667	4,137	14,439	素材
小 計	30,777	32,257	132,490	462,392	
株 数 金 額	25	29	—	<2.1%>	
銘 柄 数 <比 率>					

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)	
(フィリピン)			千フィリピンペソ		
AYALA LAND INC	3,424	3,013	10,455	26,555	不動産
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	810	639	3,325	8,446	資本財
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	474	524	4,979	12,648	銀行
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	1,796	1,391	3,512	8,921	資本財
DMCI HOLDINGS INC	217	3,454	5,485	13,933	資本財
GLOBE TELECOM INC	17	17	2,955	7,506	電気通信サービス
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	390	85	960	2,440	運輸
JG SUMMIT HOLDINGS INC	—	947	5,879	14,933	資本財
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	254	254	4,962	12,605	消費者サービス
METROPOLITAN BANK & TRUST	58	355	3,001	7,623	銀行
BDO UNIBANK INC	673	567	5,774	14,666	銀行
MEGAWORLD CORP	—	6,380	3,081	7,827	不動産
PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	24	38	11,414	28,993	電気通信サービス
SM PRIME HOLDINGS INC	3,097	2,665	4,712	11,970	不動産
UNIVERSAL ROBINA CORP	447	340	6,353	16,138	食品・飲料・タバコ
SM INVESTMENTS CORP	155	57	4,559	11,582	資本財
AYALA CORPORATION	99	107	7,637	19,399	各種金融
ENERGY DEVELOPMENT CORP	6,063	6,063	4,723	11,996	公益事業
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	7,357	7,357	3,693	9,380	各種金融
ABOITIZ POWER CORP	895	895	3,647	9,263	公益事業
小 計	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	26,256	35,154	101,115	256,834	<1.2%>
	銘柄数 <比率>	18	20	—	
(インドネシア)			千インドネシアルピア		
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	200	200	458,500	4,309	食品・飲料・タバコ
UNITED TRACTORS TBK PT	1,060	679	1,279,915	12,031	資本財
INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	2,345	1,458	940,410	8,839	食品・飲料・タバコ
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	12,020	9,033	6,277,935	59,012	自動車・自動車部品
CHAROEN KOPPHAND INDONESIA PT	4,560	2,497	931,381	8,754	食品・飲料・タバコ
GUDANG GARAM TBK PT	340	169	1,035,970	9,738	食品・飲料・タバコ
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	820	571	1,306,162	12,277	素材
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	375	436	547,180	5,143	エネルギー
BANK DANAMON INDONESIA TBK	1,965	1,965	786,982	7,397	銀行
BANK MANDIRI	5,696	4,147	4,220,569	39,673	銀行
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	735	794	1,127,480	10,598	小売
UNILEVER INDONESIA TBK PT	955	676	2,014,480	18,936	家庭用品・パーソナル用品
PT BANK RAKYAT INDONESIA	6,695	4,940	5,261,100	49,454	銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	6,735	4,916	2,900,440	27,264	公益事業
BANK NEGARA INDONESIA PT	5,460	3,014	1,725,515	16,219	銀行
KALBE FARMA TBK PT	13,565	8,045	1,331,447	12,515	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	1,905	1,347	2,060,910	19,372	素材
INDOSAT TBK PT	395	—	—	—	電気通信サービス
BANK CENTRAL ASIA PT	6,925	5,477	6,955,790	65,384	銀行
TELEKOMUNIKASI INDONESIA	24,475	22,021	5,758,491	54,129	電気通信サービス
XL AXIATA TBK PT	1,725	1,725	892,687	8,391	電気通信サービス
LIPPO KARAWACI TBK PT	12,130	12,130	1,219,065	11,459	不動産
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	3,220	4,730	851,400	8,003	メディア
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	2,240	1,757	454,184	4,269	メディア
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	1,235	1,235	790,400	7,429	運輸
INDO TAMBANGRAYA MEGAH PT	170	206	409,940	3,853	エネルギー
BUMI SERPONG DAMAI PT	5,140	1,607	247,478	2,326	不動産
ADARO ENERGY PT	8,005	8,005	876,547	8,239	エネルギー
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	805	805	885,500	8,323	食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	—	313	283,265	2,662	電気通信サービス
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	—	772	241,636	2,271	メディア
小 計	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	131,896	105,670	54,072,763	508,283	<2.3%>
	銘柄数 <比率>	29	30	—	
(韓国)			千韓国ウォン		
CHEIL COMMUNICATIONS INC	59	50	85,429	9,004	メディア
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	17	15	198,792	20,952	自動車・自動車部品
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	20	14	413,130	43,543	保険
DONGBU INSURANCE CO LTD	21	16	93,024	9,804	保険
COWAY CO.,LTD.	31	22	192,612	20,301	耐久消費財・アパレル

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)	
KT&G CORP	66	46	442,551	46,644	食品・飲料・タバコ
S-1 CORPORATION	12	9	66,240	6,981	商業・専門サービス
KOREA GAS CORPORATION	12	2	15,699	1,654	公益事業
CJ CORP	8	4	71,280	7,512	資本財
CHEIL INDUSTRIES INC	28	—	—	—	素材
DOOSAN INFRACORE CO LTD	73	32	32,120	3,385	資本財
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	58	43	87,193	9,190	資本財
SK TELECOM	9	9	259,875	27,390	電気通信サービス
DGB FINANCIAL GROUP INC	60	47	71,201	7,504	銀行
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	14	7	53,342	5,622	資本財
DAEWOO SECURITIES CO LTD	121	69	80,035	8,435	各種金融
NCSOFT CORPORATION	9	4	77,035	8,119	ソフトウェア・サービス
LG UPLUS CORP	146	125	138,898	14,639	電気通信サービス
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	23	7	16,845	1,775	資本財
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	42	82	54,333	5,726	資本財
DAEWOO INTERNATIONAL CORP	29	15	53,251	5,612	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	5	4	261,580	27,570	家庭用品・パーソナル用品
LG CHEM LTD	26	19	367,952	38,782	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	4	4	74,005	7,800	素材
LS CORP	10	10	65,590	6,913	資本財
LS INDUSTRIAL SYSTEMS	6	11	75,521	7,959	資本財
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	245	185	918,099	96,767	銀行
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	30	26	98,876	10,421	資本財
HYUNDAI MERCHANT MARINE	41	—	—	—	運輸
S-OIL CORPORATION	22	8	34,277	3,612	エネルギー
HANWHA CHEMICAL CORP	57	63	74,751	7,878	素材
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	42	29	141,959	14,962	各種金融
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	9	4	68,856	7,257	素材
HOTEL SHILLA CO LTD	—	15	148,955	15,699	消費者サービス
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	24	19	198,667	20,939	資本財
HYUNDAI MOBIS	38	29	703,890	74,190	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	303	249	1,180,497	124,424	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	43	28	131,601	13,870	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	12	12	155,625	16,402	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	89	66	1,077,462	113,564	自動車・自動車部品
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	8	7	60,839	6,412	資本財
HYUNDAI HYSO	14	—	—	—	素材
HYUNDAI STEEL CO	34	33	216,441	22,812	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	77	108	178,448	18,808	銀行
KCC CORP	2	2	124,146	13,084	資本財
KIA MOTORS CORPORATION	146	114	611,077	64,407	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	5	3	135,912	14,325	素材
KOREA ELECTRIC POWER CORP	154	110	517,576	54,552	公益事業
HANWHA CORPORATION	18	28	75,710	7,979	素材
KOREAN AIR LINES CO LTD	16	16	62,016	6,536	運輸
OCI COMPANY LTD	10	11	99,626	10,500	素材
HYUNDAI SECURITIES CO	110	—	—	—	各種金融
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	5	10	80,716	8,507	素材
KT CORP	23	38	121,410	12,796	電気通信サービス
LG ELECTRONICS INC	60	43	279,640	29,474	耐久消費財・アパレル
WOORI FINANCE HOLDINGS CO	209	135	161,304	17,001	銀行
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	0.45	0.45	86,220	9,087	食品・飲料・タバコ
LG CORP	52	35	227,154	23,942	資本財
WOORI INVESTMENT & SECURITIE	82	48	59,206	6,240	各種金融
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	18	33	95,483	10,063	資本財
NAVER CORP	16	12	913,147	96,245	ソフトウェア・サービス
HYUNDAI DEPT STORE CO	8	5	77,290	8,146	小売
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	18	12	70,231	7,402	各種金融
DOOSAN CORP	7	4	46,953	4,948	資本財
PACIFIC CORP	1	1	142,857	15,057	家庭用品・パーソナル用品
KANGWON LAND INC	51	49	165,119	17,403	消費者サービス
POSCO	36	28	869,156	91,609	素材
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	16	6	42,829	4,514	資本財
SAMSUNG C&T CORP	75	54	404,137	42,596	資本財
SAMSUNG SDI CO LTD	19	24	312,630	32,951	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	34	28	151,987	16,019	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	63	48	5,832,216	614,715	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	97	74	196,497	20,710	資本財
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	23	23	83,062	8,754	資本財
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	11	8	827,776	87,247	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINSEGAE CO LTD	4	4	77,562	8,175	小売
HYOSUNG CORPORATION	14	14	86,230	9,088	素材
ORION CORP	2	1	121,248	12,779	食品・飲料・タバコ
YUHAN CORPORATION	3	5	94,830	9,995	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SK HOLDINGS CO LTD	14	9	151,833	16,003	資本財
HALLA VISTEON CLIMATE CONTRO	22	8	38,604	4,068	自動車・自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	31	21	54,178	5,710	保険
GS HOLDINGS CORP	27	25	101,757	10,725	エネルギー
LG DISPLAY CO LTD	129	99	330,269	34,810	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK NETWORKS CO LTD	47	24	27,696	2,919	資本財
HITE JINRO CO LTD	26	17	45,913	4,839	食品・飲料・タバコ
HANA FINANCIAL GROUP	157	127	446,791	47,091	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	8	5	152,344	16,057	運輸
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	15	15	71,856	7,573	各種金融
LOTTE SHOPPING CO	6	4	128,986	13,595	小売
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	33	25	296,143	31,213	保険
AMOREPACIFIC CORP	1	1	313,812	33,075	家庭用品・パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	18	6	29,940	3,155	各種金融
SK INNOVATION CO LTD	32	26	228,171	24,049	エネルギー
CJ CHEILJEDANG CORP	4	3	114,372	12,054	食品・飲料・タバコ
LG INNOTEK CO LTD	8	8	75,587	7,966	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK C&C CO LTD	12	8	194,656	20,516	ソフトウェア・サービス
KB FINANCIAL GROUP INC	222	168	684,970	72,195	銀行
HYUNDAI WIA CORP	9	6	120,560	12,707	自動車・自動車部品
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	33	25	110,767	11,674	資本財
BS FINANCIAL GROUP INC	107	84	145,423	15,327	銀行
HANWHA LIFE INSURANCE	154	122	103,014	10,857	保険
EMART	12	8	186,127	19,617	食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE CO LTD	44	33	180,540	19,028	自動車・自動車部品
NHN ENTERTAINMENT CORP	7	—	—	—	ソフトウェア・サービス
PARADISE CO LTD	—	18	53,278	5,615	消費者サービス
CELLTRION INC	30	19	82,277	8,672	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	4,662	3,537	26,459,621	2,788,844	
株 数 < 比 率 >	105	102	—	< 2.8% >	
(台湾)			千新台幣ドル		
ACER INC	1,463	863	1,766	6,588	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASUSTEK COMPUTER INC	370	320	9,820	36,629	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	239	109	1,046	3,902	半導体・半導体製造装置
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	3,627	2,777	9,943	37,087	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	1,349	791	3,068	11,443	素材
TAIWAN BUSINESS BANK	1,778	302	274	1,024	銀行
FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS	29	32	1,009	3,765	消費者サービス
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	340	340	1,853	6,911	素材
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	590	300	672	2,506	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	280	282	2,455	9,159	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUANTA COMPUTER INC	1,422	1,212	9,131	34,060	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	216	324	1,697	6,332	不動産
CHENG UEI PRECISION INDUSTRY	173	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EVA AIRWAYS CORP	950	1,160	2,134	7,961	運輸
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	417	287	7,548	28,154	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	2,521	2,160	3,963	14,784	銀行
CHINA AIRLINES LTD	1,332	292	351	1,312	運輸
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,020	600	4,396	16,398	自動車・自動車部品
CHINA STEEL	6,944	5,432	14,043	52,381	素材
CHINA MOTOR CORP	510	510	1,422	5,307	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	1,296	1,181	3,054	11,392	保険
ADVANTECH CO LTD	156	105	2,083	7,770	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	100	100	325	1,214	不動産
CLEVO COMPANY	210	380	2,056	7,669	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CHINA PETROCHEMICAL DEV CORP	827	—	—	—	素材
COMPAL ELECTRONICS	2,247	1,667	3,501	13,062	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CTCI CORP	330	170	853	3,183	資本財
DELTA ELECTRONICS INC	1,015	805	13,889	51,808	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	2,233	1,573	14,504	54,101	電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	5,200	3,960	5,901	22,013	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN MOBILE CO LTD	912	702	6,823	25,451	電気通信サービス
TRIPOD TECHNOLOGY CORP	191	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EVERGREEN MARINE	1,064	1,064	1,986	7,408	運輸
FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	496	506	1,387	5,173	小売
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	1,597	1,225	3,812	14,219	資本財
FENG HSIN IRON & STEEL CO	250	—	—	—	素材
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	70	114	3,146	11,734	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	400	230	3,790	14,140	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	2,398	1,808	12,531	46,741	素材
FORMOSA TAFPETA CO.	400	400	1,208	4,505	耐久消費財・アパレル
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	1,880	1,410	9,676	36,094	素材
TRANSCEND INFORMATION INC	94	94	944	3,522	半導体・半導体製造装置
EPSTAR CORP	570	570	3,021	11,268	半導体・半導体製造装置
GIANT MANUFACTURING	174	134	3,312	12,354	耐久消費財・アパレル
MEDIATEK INC	700	628	26,817	100,028	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	3,880	2,970	14,972	55,849	各種金融
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	3,612	2,627	4,638	17,300	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	120	100	4,480	16,710	小売
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	810	670	4,455	16,619	電気通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	4,799	4,120	6,222	23,208	各種金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	4,492	3,539	17,361	64,757	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	7,757	6,077	5,950	22,194	銀行
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	3,174	2,858	5,545	20,685	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	6,393	5,473	52,706	196,594	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	4,858	4,355	10,780	40,209	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	60	50	10,810	40,324	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	3,873	3,435	4,964	18,517	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	3,333	3,600	3,305	12,329	保険
INVENTEC CO LTD	1,645	1,365	2,948	10,998	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LCY CHEMICAL CORP	217	—	—	—	素材
HTC CORPORATION	424	254	3,483	12,994	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,395	1,002	4,208	15,697	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	321	261	2,759	10,293	半導体・半導体製造装置
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	2,823	4,113	5,346	19,944	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	7,735	5,990	12,549	46,808	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	4,058	3,287	6,015	22,437	銀行
MERIDA INDUSTRY CO LTD	150	115	2,460	9,176	耐久消費財・アパレル
POWERTECH TECHNOLOGY INC	377	117	576	2,151	半導体・半導体製造装置
NAN KANG RUBBER TIRE CO LTD	433	—	—	—	自動車・自動車部品
NAN YA PLASTICS CORP	2,827	2,087	12,859	47,964	素材
WISTRON CORP	1,641	1,149	3,332	12,430	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINSUS INTERCONNECT TECH	120	30	330	1,230	半導体・半導体製造装置
POU CHEN	1,177	1,087	3,638	13,572	耐久消費財・アパレル
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	2,468	1,990	10,192	38,018	食品・飲料・タバコ
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	325	245	5,546	20,690	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	652	412	2,816	10,506	エネルギー
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	424	84	371	1,385	不動産
RUENTEX INDUSTRIES LTD	217	368	2,332	8,699	耐久消費財・アパレル
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	664	488	3,977	14,837	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SILICONWARE PRECISION INDS	1,610	1,200	5,154	19,224	半導体・半導体製造装置
STANDARD FOODS CORP	128	281	1,931	7,205	食品・飲料・タバコ
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	693	343	1,495	5,578	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN CEMENT	2,039	1,499	6,844	25,529	素材
TAIWAN GLASS IND CORP	654	654	1,548	5,776	資本財
TSRC CORP	278	680	2,464	9,191	素材
TECO ELECTRIC & MACHINERY	830	500	1,637	6,107	資本財
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	14,183	10,793	141,399	527,421	半導体・半導体製造装置
U-MING MARINE TRANSPORT CORP	440	320	1,489	5,556	運輸
UNITED MICROELECTRONICS CORP	7,360	5,510	7,300	27,231	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)	
WAN HAI LINES LIMITED	283	—	—	—	運輸
WALSIN LIHWA CORP	1,990	1,990	2,039	7,608	資本財
YANG MING MARINE TRANSPORT	1,439	1,439	2,043	7,621	運輸
YULON MOTOR COMPANY	560	120	523	1,951	自動車・自動車部品
INOTERA MEMORIES INC	—	930	4,389	16,373	半導体・半導体製造装置
WPG HOLDINGS CO LTD	811	811	2,833	10,568	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	137	121	2,812	10,491	資本財
MSTAR SEMICONDUCTOR INC	110	—	—	—	半導体・半導体製造装置
PEGATRON CORP	1,114	734	4,026	15,018	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHATELASE HOLDING CO LTD	589	359	2,684	10,014	各種金融
SCINOPHARM TAIWAN LTD	280	125	771	2,877	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TPK HOLDING CO LTD	109	169	3,105	11,582	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	—	230	414	1,544	電気通信サービス
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	99	219	1,812	6,762	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	3,845	2,430	3,924	14,640	銀行
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	320	540	2,419	9,023	半導体・半導体製造装置
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	133	43	670	2,501	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PHISON ELECTRONICS CORP	65	115	2,418	9,020	半導体・半導体製造装置
HERMES MICROVISION INC	30	20	3,030	11,301	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 167,804	株 数 133,450	外 貨 建 金 額 644,353	邦 貨 換 算 金 額 2,403,436	<11.0%>
(インド)	株 柄 数 106	株 柄 数 100	千インドルピー		
RELIANCE INDUSTRIES LTD	742	564	55,351	103,506	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	56	60	4,618	8,636	エネルギー
ASIAN PAINTS LTD	178	128	8,296	15,514	素材
BANK OF BARODA	65	—	—	—	銀行
BANK OF INDIA	47	—	—	—	銀行
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	74	74	4,671	8,736	公益事業
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	189	151	18,710	34,988	自動車・自動車部品
ICICI BANK LTD	205	99	16,688	31,207	銀行
ADITYA BIRLA NUVO LTD	23	23	4,009	7,497	資本財
STATE BANK OF INDIA	81	61	16,827	31,468	銀行
LIC HOUSING FINANCE LTD	195	57	2,183	4,083	銀行
RELIANCE CAPITAL LTD	47	53	2,497	4,670	各種金融
TATA STEEL LTD	144	110	5,228	9,777	素材
JSW STEEL LTD	37	15	1,935	3,620	素材
NESTLE INDIA LIMITED	—	12	8,293	15,509	食品・飲料・タバコ
GAIL INDIA LTD	253	178	8,649	16,175	公益事業
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	176	—	—	—	銀行
SESA STERILITE LTD	541	532	13,098	24,494	素材
TITAN INDUSTRIES LTD	73	—	—	—	耐久消費財・アパレル
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	432	332	13,628	25,485	エネルギー
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	8	5	3,003	5,616	食品・飲料・タバコ
LUPIN LTD	68	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACC LTD	30	17	2,667	4,988	素材
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	841	652	71,769	134,209	銀行
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	265	—	—	—	メディア
INFOSYS LTD	259	201	83,973	157,030	ソフトウェア・サービス
WIPRO LTD	374	272	15,076	28,193	ソフトウェア・サービス
HINDUSTAN UNILEVER LTD	383	330	25,154	47,039	家庭用品・パーソナル用品
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	26	11	1,319	2,467	ヘルスケア機器・サービス
HCL TECHNOLOGIES LTD	124	107	17,471	32,672	ソフトウェア・サービス
DABUR INDIA LTD	194	156	3,573	6,682	家庭用品・パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	44	13	3,791	7,089	自動車・自動車部品
DR. REDDY'S LABORATORIES	60	51	17,447	32,627	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BHARTI AIRTEL LTD	336	264	10,352	19,359	電気通信サービス
UNITED SPIRITS LTD	56	11	3,094	5,786	食品・飲料・タバコ
CANARA BANK	36	—	—	—	銀行
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	354	315	28,174	52,687	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DIVI'S LABORATORIES LTD	26	26	4,718	8,824	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUROBINDO PHARMA LTD	—	66	6,823	12,760	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JINDAL STEEL & POWER LTD	198	250	4,049	7,573	素材
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	73	76	7,430	13,895	各種金融
CIPLA LTD	221	141	9,176	17,160	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
LARSEN & TOUBRO LTD	159	141	23,432	43,819	資本財
JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	373	—	—	—	資本財
ULTRATECH CEMENT LTD	14	23	6,084	11,378	素材
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	266	205	52,980	99,072	ソフトウェア・サービス
ADANI ENTERPRISES LTD	75	75	3,587	6,709	資本財
NTPC LTD	483	713	10,309	19,278	公益事業
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	35	35	2,860	5,349	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMBUJA CEMENTS LTD	327	219	4,874	9,115	素材
RANBAXY LABORATORIES LTD	63	73	4,891	9,146	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HINDALCO INDUSTRIES LTD	494	444	6,934	12,967	素材
ITC LTD	1,278	974	34,663	64,821	食品・飲料・タバコ
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	323	534	5,812	10,870	電気通信サービス
SIEMENS INDIA LTD	78	53	4,724	8,835	資本財
UNITED BREWERIES LTD	41	41	2,928	5,477	食品・飲料・タバコ
UNITECH LTD	527	—	—	—	不動産
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	66	57	5,369	10,040	家庭用品・パーソナル用品
TECH MAHINDRA LTD	—	23	6,361	11,895	ソフトウェア・サービス
CAIRN INDIA LTD	221	221	6,096	11,400	エネルギー
IDEA CELLULAR LTD	297	367	6,182	11,560	電気通信サービス
POWER FINANCE CORPORATION	95	192	5,445	10,183	各種金融
DLF LTD	242	—	—	—	不動産
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	563	301	4,367	8,167	公益事業
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	300	143	4,189	7,835	運輸
RELIANCE POWER LTD	269	558	4,189	7,834	公益事業
RURAL ELECTRIFICATION CORP	137	64	1,938	3,624	各種金融
BAJAJ AUTO LTD	50	38	9,851	18,422	自動車・自動車部品
OIL INDIA LTD	74	74	4,503	8,421	エネルギー
COAL INDIA LTD	314	180	6,209	11,611	エネルギー
HDFC BANK LTD	858	172	15,538	29,057	銀行
TATA MOTORS LTD	456	302	16,127	30,158	自動車・自動車部品
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	322	202	5,051	9,447	資本財
TATA POWER CO LTD	544	382	3,491	6,528	公益事業
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	131	162	5,027	9,401	各種金融
小 計	17,046	12,415	777,791	1,454,470	
株 数 < 比 率 >	72	65	—	< 6.7% >	
(カタール)			千カタールリアル		
QATAR NATIONAL BANK	—	64	1,423	44,768	銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	—	26	193	6,098	銀行
OOREDOO QSC	—	72	873	27,483	電気通信サービス
DOHA BANK QSC	—	20	119	3,774	銀行
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	—	15	295	9,309	公益事業
INDUSTRIES QATAR	—	55	1,090	34,306	資本財
QATAR ISLAMIC BANK	—	58	646	20,354	銀行
MASRAF AL RAYAN	—	269	1,355	42,643	銀行
BARWA REAL ESTATE CO	—	38	185	5,825	不動産
VODAFONE QATAR	—	195	374	11,796	電気通信サービス
小 計	—	816	6,559	206,361	
株 数 < 比 率 >	—	10	—	< 0.9% >	
(南アフリカ)			千南アフリカランド		
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	415	—	—	—	各種金融
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	70	58	809	8,237	素材
BARLOWORLD LTD	130	123	1,233	12,560	資本財
BIDVEST GROUP LTD	161	144	4,310	43,879	資本財
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	260	149	1,030	10,487	小売
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	737	917	5,056	51,476	耐久消費財・アパレル
ASSORE LTD	18	18	403	4,110	素材
DISCOVERY LIMITED	180	129	1,298	13,220	保険
MASSMART HOLDINGS LTD	56	83	1,069	10,891	食品・生活必需品小売り
GOLD FIELDS LTD	416	319	1,266	12,893	素材
REMGRO LTD	288	218	5,560	56,605	各種金融
THE FOSCHINI GROUP LIMITED	102	62	763	7,775	小売
NORTHAM PLATINUM LTD	138	140	463	4,720	素材
HARMONY GOLD MINING CO LTD	200	242	417	4,252	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)	
EXXARO RESOURCES LTD	78	46	550	5,607	エネルギー
LIBERTY HOLDINGS LTD	62	62	784	7,989	保険
MTN GROUP LTD	970	734	16,610	169,099	電気通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	239	182	1,918	19,527	素材
FIRSTSTRAND LTD	1,811	1,381	6,407	65,231	各種金融
NASPERS LTD-N SHS	224	173	24,080	245,143	メディア
CORONATION FUND MANAGERS LTD	—	101	959	9,771	各種金融
NEDBANK GROUP LTD	115	93	2,168	22,070	銀行
NETCARE LTD	567	387	1,299	13,230	ヘルスケア機器・サービス
PICK N PAY STORES LTD	105	181	940	9,575	食品・生活必需品小売り
REUNERT LTD	143	—	—	—	資本財
RMB HOLDINGS LTD	484	317	1,893	19,270	各種金融
ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	38	14	550	5,602	素材
SAPPI LIMITED	265	165	726	7,395	素材
SASOL LTD	314	237	12,953	131,870	エネルギー
SHOPRITE HOLDINGS LTD	241	203	3,298	33,581	食品・生活必需品小売り
MR PRICE GROUP LTD	163	102	2,336	23,782	小売
BRAIT SE	—	203	1,612	16,413	各種金融
STANDARD BANK GROUP LTD	698	533	7,099	72,267	銀行
SPAR GROUP LIMITED/THE	100	78	1,016	10,350	食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	458	409	3,154	32,114	小売
IMPERIAL HOLDINGS LTD	121	80	1,483	15,099	小売
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	175	139	5,437	55,349	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BARCLAYS AFRICA GROUP	186	151	2,559	26,054	銀行
TIGER BRANDS LTD	98	71	2,525	25,707	食品・飲料・タバコ
NAMPAK LTD	463	361	1,573	16,022	素材
SANLAM LTD	1,044	815	5,783	58,876	保険
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	240	162	1,548	15,763	ヘルスケア機器・サービス
INVESTEC LTD	159	70	719	7,326	各種金融
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	299	202	1,654	16,839	素材
KUMBA IRON ORE LTD	47	12	349	3,555	素材
PPC LIMITED	306	182	502	5,113	素材
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	492	443	1,876	19,107	ヘルスケア機器・サービス
MMI HOLDINGS LTD	766	370	1,064	10,838	保険
RMI HOLDINGS	404	404	1,590	16,186	保険
VODACOM GROUP	204	160	2,133	21,717	電気通信サービス
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	1,056	1,023	2,685	27,333	不動産
小 計	株 数 銘 柄 数 <比 率>	株 数 銘 柄 数 <比 率>	外 貨 建 金 額 147,534	邦 貨 換 算 金 額 1,501,900	<6.9%>
(アラブ首長国連邦)					
DUBAI ISLAMIC BANK	—	312	234	7,318	銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC	—	1,272	1,279	39,892	不動産
ARABTEC HOLDING CO	—	661	255	7,982	資本財
DUBAI FINANCIAL MARKET	—	1,279	348	10,858	各種金融
FIRST GULF BANK	—	277	520	16,228	銀行
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	—	1,132	873	27,243	銀行
NATIONAL BANK OF ABU DHABI	—	409	545	17,001	銀行
ALDAR PROPERTIES PJSC	—	2,714	860	26,842	不動産
小 計	株 数 銘 柄 数 <比 率>	株 数 銘 柄 数 <比 率>	外 貨 建 金 額 4,917	邦 貨 換 算 金 額 153,367	<0.7%>
合 計	株 数 銘 柄 数 <比 率>	株 数 銘 柄 数 <比 率>	外 貨 建 金 額 —	邦 貨 換 算 金 額 19,551,926	<89.6%>

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(メキシコ)			千メキシコペソ		
CONTROLADORA COML MEXIC-UB	29,000	17,400	909		7,688
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	72,600	98,400	4,712		39,819
小 計	口 数 ・ 金 額	101,600	115,800	5,622	47,507
	銘 柄 数 <比 率>	2	2	—	<0.2%>
(ブラジル)			千ブラジルリアル		
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	7,500	7,500	135		6,078
SUL AMERICA SA-UNITS	8,518	2,918	36		1,617
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	52,500	45,500	648		28,982
VIA VAREJO SA	—	6,400	152		6,823
KLABIN SA-UNIT	—	19,000	237		10,607
小 計	口 数 ・ 金 額	68,518	81,318	1,210	54,108
	銘 柄 数 <比 率>	3	5	—	<0.2%>
(南アフリカ)			千南アフリカランド		
REDEFINE PROPERTIES LTD	166,445	124,452	1,238		12,605
小 計	口 数 ・ 金 額	166,445	124,452	1,238	12,605
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	—	<0.1%>
合 計	口 数 ・ 金 額	336,563	321,570	—	114,222
	銘 柄 数 <比 率>	6	8	—	<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	2,041	—

(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	19,551,926	64.5
投 資 信 託 受 益 証 券	74,402	0.2
投 資 証 券	39,819	0.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	10,640,251	35.2
投 資 信 託 財 産 総 額	30,306,398	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(25,823,721千円)の投資信託財産総額(30,306,398千円)に対する比率は85.2%です。

(注2) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=114.36円、1メキシコペソ=8.45円、1ブラジルリアル=44.70円、1チリペソ=0.1946円、1ユーロ=142.41円、1トルコリラ=50.81円、1チェココルナ=5.14円、1ハンガリーフォリント=0.4615円、1ポーランドズロチ=33.67円、1香港ドル=14.75円、1マレーシアリングギット=34.32円、1タイバーツ=3.49円、1フィリピンペソ=2.54円、1インドネシアルピア=0.0094円、1韓国ウォン=0.1054円、1新台幣ドル=3.73円、1インドルピー=1.87円、1カタールリアル=31.46円、1南アフリカランド=10.18円、1アラブ首長国連邦ディルハム=31.19円です。

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2014年11月10日現在
(A) 資 産	34,410,893,268円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,806,187,607
株 式(評価額)	19,551,926,899
投資信託受益証券(評価額)	74,402,664
投 資 証 券(評価額)	39,819,577
未 収 入 金	7,709,087,715
未 収 配 当 金	17,283,517
未 収 利 息	4,802
差 入 委 託 証 拠 金	212,180,487
(B) 負 債	12,589,779,367
未 払 金	4,117,795,669
未 払 株 式 払 込 金	2,003,513
未 払 解 約 金	8,469,980,185
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	21,821,113,901
元 本	8,781,040,458
次 期 繰 越 損 益 金	13,040,073,443
(D) 受 益 権 総 口 数	8,781,040,458口
1万円当たり基準価額(C/D)	24.850円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2013年11月12日 至 2014年11月10日
(A) 配 当 等 収 益	653,980,529円
受 取 配 当 金	653,159,147
受 取 利 息	457,173
そ の 他 収 益 金	364,209
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,514,002,834
売 買 益	5,982,623,669
売 買 損	△2,468,620,835
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△10,253,961
取 引 益	217,721,389
取 引 損	△227,975,350
(D) 保 管 費 用 等	△66,414,110
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	4,091,315,292
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	11,547,709,607
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,628,801,600
(H) 解 約 差 損 益 金	△9,227,753,056
(I) 計 (E+F+G+H)	13,040,073,443
次 期 繰 越 損 益 金(I)	13,040,073,443

(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。