

JP 4 資産均等バランス

運用報告書（全体版）

第 1 期（決算日 2018年 7 月17日）

受 益 者 の み な さ ま へ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
「JP 4 資産均等バランス」は、2018年 7 月17日に第 1 期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。
今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商 品 分 類	追加型投信／内外／資産複合			
信 託 期 間	無期限（2017年10月18日設定）			
運 用 方 針	日本と海外の債券と株式に資産を分散することで、安定的な収益の確保と信託財産の着実な成長を目指します。海外債券は、信用力の高い先進国の債券に、海外株式は、より安定的な先進国の株式に投資します。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ＜基本組入比率＞			
	日 本 株 式	日 本 債 券	海 外 株 式	海 外 債 券
	25%	25%	25%	25%
主 な 投 資 対 象	J P 4 資 産 均 等 バ ラ ンス	FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）、FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）、野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）、FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）を主要投資対象とします。		
	FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適 格 機 関 投 資 家 専 用）	日本株式を主要投資対象とします。		
	FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適 格 機 関 投 資 家 専 用）	日本債券を主要投資対象とします。		
	野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）	海外株式を主要投資対象とします。		
	FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適 格 機 関 投 資 家 専 用）	海外債券を主要投資対象とします。		
主 な 投 資 制 限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。 デリバティブの直接利用は行いません。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。			
分 配 方 針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。			

JP 投信株式会社

<照会先>

ホームページ：http://www.jp-toushin.japanpost.jp

サポートダイヤル：0120-104-017

（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

目 次

J P 4 資産均等バランス	1
----------------	---

(ご参考) 投資対象先の直近の内容

FOfs用 国内株式インデックス・ファンドP (適格機関投資家専用)	10
------------------------------------	----

FOfs用 国内債券インデックス・ファンドP (適格機関投資家専用)	56
------------------------------------	----

野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAI インデックスファンド (適格機関投資家専用)	88
---	----

FOfs用 外国債券インデックス・ファンドP (適格機関投資家専用)	133
------------------------------------	-----

【運用報告書の表記について】

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

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			参 考 指 数 期 騰 落 率	投 資 信 託 証 入 比 率	純 資 産 額
		税 込 分	み 金	期 騰 落 率			
(設定日)	円	円		%	%	%	百万円
2017年10月18日	10,000	—	—	—	10,000	—	1
1期(2018年7月17日)	10,263	0	2.6	10,228	2.3	98.8	478

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) 参考指数は合成指数です。計算方法は9ページをご参照ください。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		参 考 指 数 期 騰 落 率	投 資 信 託 証 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(設定日)	円	%	%	%	%
2017年10月18日	10,000	—	10,000	—	—
10月末	10,058	0.6	10,101	1.0	99.5
11月末	10,105	1.1	10,149	1.5	99.5
12月末	10,261	2.6	10,306	3.1	99.5
2018年1月末	10,316	3.2	10,328	3.3	87.0
2月末	10,085	0.9	10,066	0.7	92.3
3月末	9,908	△0.9	9,853	△1.5	96.3
4月末	10,128	1.3	10,085	0.8	96.6
5月末	10,035	0.4	9,989	△0.1	94.7
6月末	10,074	0.7	10,031	0.3	96.9
(期 末)					
2018年7月17日	10,263	2.6	10,228	2.3	98.8

(注) 騰落率は設定日比です。

○運用経過

(2017年10月18日～2018年7月17日)

期中の基準価額等の推移



設定日：10,000円

期 末：10,263円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 2.6% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 参考指数は、設定時の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 参考指数は合成指数です。計算方法は9ページをご参照ください。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、設定時10,000円から当期末10,263円となり、値上がり額は263円となりました。

投資対象とする4本の組入投資信託証券の当期間の値動きは、日本債券、海外株式が上昇し、日本株式、海外債券が下落しました。日本債券、海外株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

投資環境

日本債券市場	2017年10月中旬以降、米長期金利上昇の影響を受けて利回りは上昇（価格は下落）しました。11月初旬には、日銀の国債買い入れで需給の引き締まりが意識され利回りが低下（価格は上昇）しましたが、その後は米長期金利上昇に連れて利回りは上昇（価格は下落）しました。12月下旬から2018年1月下旬にかけて、日銀の金融緩和の早期縮小が意識されたことなどから債券が売られたものの、2月に入ると、米国株式市場の大幅下落を受けて安全資産である債券が買われ、利回りは低下（価格は上昇）しました。3月初旬、金融政策の早期正常化が意識され債券が売られたものの、その後中旬までは方向感を欠く展開となりました。3月中旬から4月中旬までは貿易摩擦懸念などから一進一退の展開となりました。5月中旬にかけて米長期金利上昇の影響を受け債券が売られましたが、下旬には欧州政局不安などから利回りは低下（価格は上昇）しました。6月上旬は日銀の国債買入額の減額などから債券が売られましたが、下旬には貿易摩擦懸念が再燃し利回りは低下（価格は上昇）しました。7月に入ると、貿易摩擦への過度な懸念が後退し利回りは上昇（価格は下落）しました。
日本株式市場	2017年10月中旬に衆院選で与党が圧勝し安定した政権運営への期待感の高まりなどから日本株式市場は上昇しました。その後、下落する局面もありましたが、米国の税制改革法案の可決などを受け2018年の年初にかけて大幅に上昇しました。1月下旬にかけて、日銀が「経済・物価情勢の展望」（展望レポート）で物価の認識を上方修正したことなどによる為替の円高・ドル安推移を嫌気して、日本株式市場は下落しました。2月に入って、米国でインフレ懸念に端を発した長期金利の上昇を受け米国株式市場が大幅に下落すると、日本へも波及し2月中旬まで下落する流れが続きました。3月に米国トランプ政権が鉄鋼・アルミニウムに輸入制限を課す方針を表明すると、貿易摩擦懸念から日本株式市場は下落しました。4月上旬から5月中旬にかけて、貿易摩擦懸念の後退などから日本株式市場は上昇しましたが、下旬には欧州政局不安などから下落しました。6月上旬は為替の円安・ドル高推移などから日本株式市場は上昇しましたが、下旬には貿易摩擦懸念が再燃し日本株式市場は下落しました。7月に入ると、貿易摩擦への過度な懸念が後退し日本株式市場は上昇しました。
海外債券市場	2017年10月下旬は、FRB（米連邦準備制度理事会）の追加利上げ観測の高まり、ECB（欧州中央銀行）が資産買い入れ策を縮小するとの見方などを背景に、利回りは上昇（価格は下落）しました。11月から12月中旬までは概ね横ばいの推移となりましたが、12月中旬以降は米国で税制改革法案の議会通過、ECBによる金融政策の早期正常化を巡る思惑などを受け、利回りは上昇（価格は下落）しました。2018年2月上旬から5月中旬にかけて、米国の利上げ加速観測などから利回りは上昇（価格は下落）しましたが、5月下旬には貿易摩擦懸念、欧州政局不安などを受けて債券が買われ、利回りは低下（価格は上昇）しました。6月に入ると、ECBによる金融政策の正常化観測を背景に欧州国債相場が下落し、債券の売りが優勢となりましたが、6月中旬から下旬にかけて貿易摩擦懸念から債券が買われ、利回りは低下（価格は上昇）しました。7月上旬から中旬にかけて貿易摩擦懸念などを受け、方向感の定まらない展開となりました。期を通じて、米国国債の利回りは上昇（価格は下落）、ドイツ国債の利回りは、ほぼ横ばいの推移となりました。
海外株式市場	2017年10月下旬は米国で企業決算が好調なことなどを背景に海外株式市場は上昇しました。11月には英国のEU（欧州連合）離脱交渉を巡る先行き不透明感などから欧州を中心に一時下落しましたが、12月に入ると米国の税制改革法案の実現に向けた動きに対する期待などから海外株式市場は堅調な推移となり、2018年1月下旬にかけて海外株式市場は上昇しました。2月に入ると、米国の利上げ加速観測から米長期金利が上昇すると、海外株式市場が大幅に下落しました。その後、海外株式市場が上昇する局面もありましたが、3月下旬にかけて貿易摩擦懸念などを受け、海外株式市場は下落しました。4月上旬は貿易摩擦懸念の後退などを背景に上昇しましたが、5月下旬にかけて貿易摩擦懸念、欧州政局不安などを受けて、海外株式市場は下落しました。6月は初旬に海外株式市場が上昇する局面がありましたが、下旬にかけては貿易摩擦懸念から海外株式市場は下落しました。7月に入ると、貿易摩擦への過度な懸念が後退し海外株式市場は上昇しました。期を通じて、米国株式市場は上昇、ドイツ株式市場は下落しました。

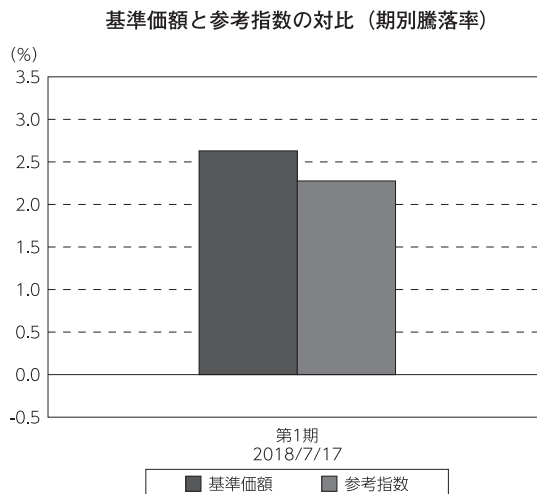
当ファンドのポートフォリオ

組入投資信託証券の日々の基準価額の動きなどにより基本組入比率からの乖離が生じますが、日々のリバランスや資金の追加解約に対応した売買により、できる限り当ファンドの基本組入比率を維持する運用を行いました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

グラフは、基準価額と参考指数の対比です。



（注）基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。

分配金

分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案した結果、見送らせていただきました。留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

項 目	第 1 期
	2017年10月18日～ 2018年 7 月17 日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	263

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

引き続き、組入投資信託証券を通じて、日本株式、日本債券、海外株式、海外債券に分散投資を行い、信託財産の着実な成長を目指します。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年10月18日～2018年7月17日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 8	% 0.079	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(3)	(0.031)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(3)	(0.031)	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
(受 託 会 社)	(2)	(0.016)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	0	0.003	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	8	0.082	
期中の平均基準価額は、10,107円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○ 売 買 及 び 取 引 の 状 況

(2017年10月18日～2018年7月17日)

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	野村FofS用・外国株式MSCI-JONUSAI インデックスファンド(適格機関投資家専用)	89,468,755	119,795	4,845,924	6,478
	FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	123,474,870	123,861	6,472,347	6,497
	FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	101,933,249	129,070	5,584,425	7,055
	FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	130,974,438	121,182	5,727,938	5,250
合 計		445,851,312	493,911	22,630,634	25,280

(注) 金額は受け渡し代金。

○利害関係人との取引状況等

(2017年10月18日～2018年7月17日)

該当事項はございません。

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。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2017年10月18日～2018年7月17日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2017年10月18日～2018年7月17日)

設定時残高 (元本)	当期設定 元本	当期解約 元本	当期末残高 (元本)	取 引 理 由
百万円 1	百万円 －	百万円 －	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2018年7月17日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘	柄	当 期 末		
		口 数	評 価 額	比 率
		口	千円	%
野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAI インデックスファンド (適格機関投資家専用)		84,622,831	118,167	24.7
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP (適格機関投資家専用)		117,002,523	117,599	24.6
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP (適格機関投資家専用)		96,348,824	119,520	25.0
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP (適格機関投資家専用)		125,246,500	117,694	24.6
合 計		423,220,678	472,981	98.8

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

○投資信託財産の構成

(2018年7月17日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	472,981	98.2
コール・ローン等、その他	8,518	1.8
投資信託財産総額	481,499	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する評価額の割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年7月17日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	481,499,319
コール・ローン等	8,517,911
投資信託受益証券(評価額)	472,981,408
(B) 負債	2,872,295
未払解約金	2,780,831
未払信託報酬	86,608
未払利息	23
その他未払費用	4,833
(C) 純資産総額(A－B)	478,627,024
元本	466,345,113
次期繰越損益金	12,281,911
(D) 受益権総口数	466,345,113口
1万口当たり基準価額(C／D)	10,263円

(注) 当ファンドの設定時元本額は1,000,000円、期中追加設定元本額は549,627,423円、期中一部解約元本額は84,282,310円です。

(注) 1口当たり純資産額は1.0263円です。

○損益の状況 (2017年10月18日～2018年7月17日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,111,320
受取配当金	2,115,402
支払利息	△ 4,082
(B) 有価証券売買損益	4,755,810
売買益	7,563,180
売買損	△ 2,807,370
(C) 信託報酬等	△ 124,279
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	6,742,851
(E) 追加信託差損益金	5,539,060
(配当等相当額)	(2,698,240)
(売買損益相当額)	(2,840,820)
(F) 計(D＋E)	12,281,911
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F＋G)	12,281,911
追加信託差損益金	5,539,060
(配当等相当額)	(2,698,240)
(売買損益相当額)	(2,840,820)
分配準備積立金	6,742,851

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

(注) 分配金の計算過程(2017年10月18日～2018年7月17日)は以下の通りです。

項 目	2017年10月18日～ 2018年7月17日
a. 配当等収益(経費控除後)	2,073,104円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	4,669,747円
c. 信託約款に定める収益調整金	5,539,060円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	0円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	12,281,911円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	263円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○分配金のお知らせ

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

○お知らせ

2017年10月18日から2018年7月17日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

合成指数について

合成指数は、下記の指数と基本組入比率をもとに J P 投信が計算したものです。

資 産	指 数	基 本 組 入 比 率
日 本 株 式	TOPIX（東証株価指数、配当なし）	25%
日 本 債 券	NOMURA-BPI総合	25%
海 外 株 式	MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・配当込み・為替ヘッジなし）	25%
海 外 債 券	FTSE世界国債インデックス*（除く日本、ヘッジなし・円ベース）	25%

*「TOPIX（東証株価指数、配当なし）」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国内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、ファンドの設定また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。

*「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、一定の組み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 J P 投信株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

*「MSCI-KOKUSAI 指数」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およ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および公表を停止する権利を有しています。

*「FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

※「シティ世界国債インデックス」は、「FTSE世界国債インデックス」に名称が変更されました。なお、インデックス名称のみの変更であり、その算出方法等について影響を及ぼすものではございません。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商 品 分 類	追加型投信／国内／株式／インデックス型	
信 託 期 間	信託期間は2016年2月3日から2026年3月9日までです。	
運 用 方 針	TOPIX(東証株価指数)と連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要運用対象	FOFs用 国内株式 インデックス・ファンドP (適格機関投資家専用)	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。
組 入 制 限	FOFs用 国内株式 インデックス・ファンドP (適格機関投資家専用)	株式への実質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。
	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。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 ①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。 ②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

FOFs用 国内株式インデックス・ ファンドP(適格機関投資家専用)

運 用 報 告 書 (全 体 版)

第11期 (決算日 2018年3月7日)
第12期 (決算日 2018年5月7日)
第13期 (決算日 2018年7月9日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
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/>
スマートフォンサイト <http://s.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

<610058>

【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。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・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。

設定以来の運用実績

作成期	決 算 期	基 準 価 額			ベンチマーク		株組比	式入率	株先比	式物率	純資産総額
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率		期中騰落率					
第1	設定日(2016年 2月 3日)	円 10,000	円 —	% —	10,000	% —	% —	% —	% —	百万円 0.5	
	第 1期(2016年 7月 7日)	8,756	59	△11.9	8,719	△12.8	99.6	1.0	4,035		
第2	第 2期(2016年 9月 7日)	9,636	3	10.1	9,597	10.1	99.0	0.9	4,393		
	第 3期(2016年11月 7日)	9,730	80	1.8	9,691	1.0	98.9	1.9	4,106		
	第 4期(2017年 1月10日)	11,009	15	13.3	10,967	13.2	99.1	0.9	4,535		
第3	第 5期(2017年 3月 7日)	11,100	6	0.9	11,058	0.8	99.1	0.9	5,398		
	第 6期(2017年 5月 8日)	11,336	86	2.9	11,277	2.0	98.8	2.0	6,917		
	第 7期(2017年 7月 7日)	11,489	16	1.5	11,428	1.3	99.0	1.2	8,769		
第4	第 8期(2017年 9月 7日)	11,429	1	△0.5	11,365	△0.5	98.9	1.1	12,875		
	第 9期(2017年11月 7日)	12,988	80	14.3	12,894	13.5	98.7	1.8	17,759		
	第10期(2018年 1月 9日)	13,531	15	4.3	13,435	4.2	98.8	0.9	25,629		
第5	第11期(2018年 3月 7日)	12,205	2	△9.8	12,117	△9.8	98.8	1.1	29,487		
	第12期(2018年 5月 7日)	12,711	107	5.0	12,609	4.1	98.8	2.0	34,079		
	第13期(2018年 7月 9日)	12,274	16	△3.3	12,173	△3.5	98.9	1.2	42,991		

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

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

設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当作成期中の基準価額と市況の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
			騰落率		騰落率		
第11期	(期 首)2018年1月9日	円 13,531	% —	13,435	% —	% 98.8	% 0.9
	1月末	13,154	△2.8	13,061	△2.8	99.0	1.0
	2月末	12,667	△6.4	12,574	△6.4	99.0	1.1
	(期 末)2018年3月7日	12,207	△9.8	12,117	△9.8	98.8	1.1
第12期	(期 首)2018年3月7日	12,205	—	12,117	—	98.8	1.1
	3月末	12,406	1.6	12,205	0.7	97.9	2.1
	4月末	12,848	5.3	12,638	4.3	97.8	2.1
	(期 末)2018年5月7日	12,818	5.0	12,609	4.1	98.8	2.0
第13期	(期 首)2018年5月7日	12,711	—	12,609	—	98.8	2.0
	5月末	12,532	△1.4	12,426	△1.5	98.0	1.9
	6月末	12,428	△2.2	12,308	△2.4	98.1	1.9
	(期 末)2018年7月9日	12,290	△3.3	12,173	△3.5	98.9	1.2

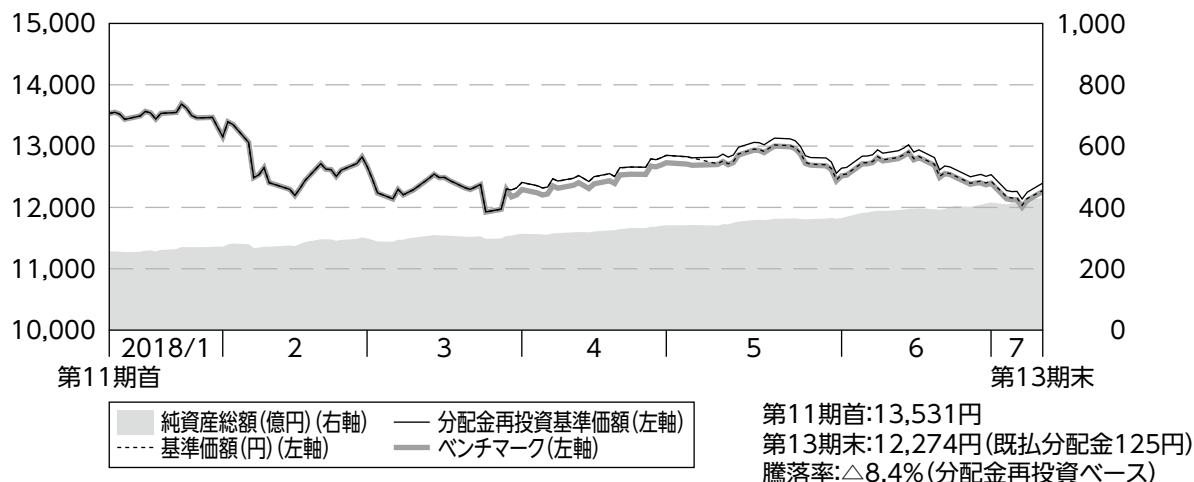
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

(注3) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当作成期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2018年1月9日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)の動きを反映して基準価額は変動し、当作成期末は当作成期首比で下落しました。

投資環境



国内株式市場は、当作成期初から米長期金利上昇による米国株式市場の急落や株価変動率の上昇に加えて、米トランプ政権の保護主義的な政策に対する警戒感などから、大幅に下落しました。その後は、貿易摩擦に対する過度な懸念が後退したことや円高が一服したことなどを好感し、反発する局面もありましたが、南欧の政治リスクや米中貿易摩擦への懸念が高まると、国内株式市場は再び下落しました。

当ファンドのポートフォリオ

株式への投資は「国内株式インデックス マザーファンド」受益証券の組み入れにより行いました。

【「国内株式インデックス マザーファンド」の運用経過】

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

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

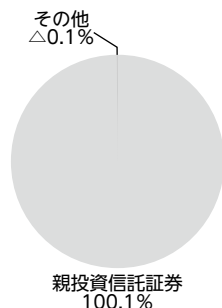
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

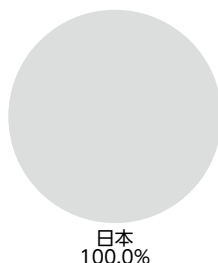
	当作成期末
	2018年7月9日
国内株式インデックス マザーファンド	100.1%
その他	△0.1%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

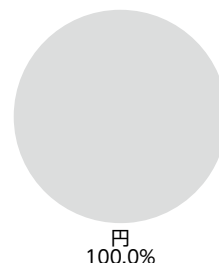
○資産別配分



○国別配分



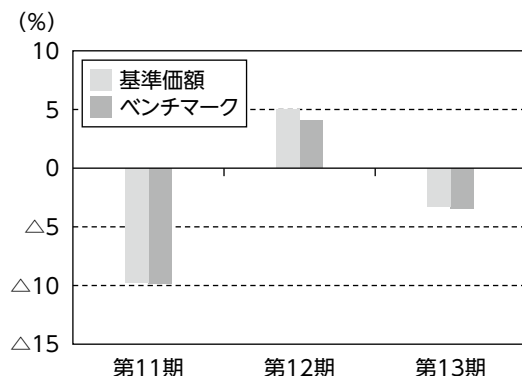
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当作成期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

差異の主な要因は、ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)が配当相当分を含まない指数であることによって生じる要因(プラス)および信託報酬要因(マイナス)です。

分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・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11期	第12期	第13期
	2018年1月10日～ 2018年3月7日	2018年3月8日～ 2018年5月7日	2018年5月8日～ 2018年7月9日
当期分配金 (円)	2	107	16
(対基準価額比率) (%)	(0.016)	(0.835)	(0.130)
当期の収益 (円)	2	106	16
当期の収益以外 (円)	—	0	—
翌期繰越分配対象額 (円)	3,924	3,926	3,927

(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

国内株式インデックス マザーファンド受益証券への投資を通じて、東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX(東証株価指数)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	当作成期		項目の概要
	(2018年1月10日～2018年7月9日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	7円	0.059%	(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12,672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)	(5)	(0.043)	
(販売会社)	(1)	(0.005)	
(受託会社)	(1)	(0.011)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{\text{〔期中の売買委託手数料〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(商品)	(－)	(－)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	－	－	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{\text{〔期中の有価証券取引税〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(－)	(－)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(公社債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(d) その他費用	0	0.002	(d) その他費用＝ $\frac{\text{〔期中のその他費用〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(－)	(－)	
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	7	0.061	

- (注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
- (注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
- (注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

< 親投資信託受益証券の設定、解約状況 >

	当 作 成 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内株式インデックス マザーファンド	13, 024, 913	20, 579, 447	351, 708	562, 169

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 作 成 期
	国内株式インデックス マザーファンド
(a) 当 作 成 期 中 の 株 式 売 買 金 額	27, 014, 114千円
(b) 当 作 成 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	199, 286, 838千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0. 13

(注1) (b) 当作成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

区 分	当 作 成 期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	売付額等C
		B A	うち利害関係人との取引状況D
		%	D C
金 銭 信 託	百万円 108	百万円 108 100. 0	百万円 108 100. 0
コ ー ル ・ ロ ー ン	2, 899	586 20. 2	2, 913 591 20. 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。

< 国内株式インデックス マザーファンド >

区 分	当 作 成 期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	売付額等C
		B A	うち利害関係人との取引状況D
		%	D C
金 銭 信 託	百万円 14, 955	百万円 14, 955 100. 0	百万円 14, 955 100. 0
コ ー ル ・ ロ ー ン	328, 724	64, 169 19. 5	327, 947 64, 051 19. 5

< 平均保有割合 17. 1% >

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 利害関係人とは、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。

■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 作 成 期		
	買 付 額	売 付 額	当作成期末保有額
株 式	86百万円	ー百万円	730百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当作成期末保有額は評価額です。
 (注2) 当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

組入資産の明細

<親投資信託残高>

	前作成期末	当 作 成 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
国内株式インデックス マザーファンド	15, 262, 164	27, 935, 369	43, 026, 056

(注) 親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、136, 525, 941千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式インデックス マザーファンド	43, 026, 056	99. 9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	63, 220	0. 1
投 資 信 託 財 産 総 額	43, 089, 276	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	第 11 期 末 2018年3月7日現在	第 12 期 末 2018年5月7日現在	第 13 期 末 2018年7月9日現在
(A) 資 産	29,497,984,991円	34,373,918,930円	43,089,276,500円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	20,212,861	24,274,753	28,814,670
国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	29,477,772,130	34,349,644,177	43,026,056,094
未 収 入 金	—	—	34,405,736
(B) 負 債	10,192,794	293,978,542	97,992,456
未 払 収 益 分 配 金	4,832,165	286,870,996	56,041,614
未 払 解 約 金	—	499,999	33,799,998
未 払 信 託 報 酬	5,127,564	6,334,960	7,863,112
未 払 利 息	44	66	73
そ の 他 未 払 費 用	233,021	272,521	287,659
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	29,487,792,197	34,079,940,388	42,991,284,044
元 本	24,160,829,511	26,810,373,468	35,026,008,868
次 期 繰 越 損 益 金	5,326,962,686	7,269,566,920	7,965,275,176
(D) 受 益 権 総 口 数	24,160,829,511口	26,810,373,468口	35,026,008,868口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	12,205円	12,711円	12,274円

■損益の状況

項 目	第 11 期 自 2018年1月10日 至 2018年 3月7日	第 12 期 自 2018年3月8日 至 2018年5月7日	第 13 期 自 2018年5月8日 至 2018年7月9日
(A) 配 当 等 収 益	△2,238円	△3,251円	△3,408円
受 取 利 息	—	1	4
支 払 利 息	△2,238	△3,252	△3,412
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△2,857,386,917	1,580,068,970	△1,346,291,994
売 買 益	11,751,388	1,586,059,005	2,288,636
売 買 損	△2,869,138,305	△5,990,035	△1,348,580,630
(C) 信 託 報 酬 等	△5,360,585	△6,607,497	△8,150,788
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△2,862,749,740	1,573,458,222	△1,354,446,190
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	3,612,417,795	742,425,108	2,024,513,583
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,582,126,796	5,240,554,586	7,351,249,397
(配 当 等 相 当 額)	(5,866,838,164)	(6,918,760,143)	(10,159,471,785)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,284,711,368)	(△1,684,205,557)	(△2,808,222,388)
(G) 計 (D+E+F)	5,331,794,851	7,556,437,916	8,021,316,790
(H) 収 益 分 配 金	△4,832,165	△286,870,996	△56,041,614
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	5,326,962,686	7,269,566,920	7,965,275,176
追 加 信 託 差 損 益 金	4,582,126,796	5,240,554,586	7,351,249,397
(配 当 等 相 当 額)	(5,867,276,556)	(6,925,356,833)	(10,161,335,027)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,285,149,760)	(△1,684,802,247)	(△2,810,085,630)
分 配 準 備 積 立 金	3,614,390,050	3,602,508,927	3,595,977,037
繰 越 損 益 金	△2,869,554,160	△1,573,496,593	△2,981,951,258

(注1) (B) 有価証券売買損益は各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＞

※当ファンドの第11期首元本額は18,941,607,788円、第11～13期中追加設定元本額は16,518,129,557円、第11～13期中一部解約元本額は433,728,477円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 11 期	第 12 期	第 13 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	6,804,420円	286,688,437円	57,497,253円
(B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円	－円	－円
(C) 収益調整金額	5,867,276,556円	6,925,356,833円	10,161,335,027円
(D) 分配準備積立金額	3,612,417,795円	3,602,691,486円	3,594,521,398円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	9,486,498,771円	10,814,736,756円	13,813,353,678円
(F) 期末残存口数	24,160,829,511口	26,810,373,468口	35,026,008,868口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	3,926円	4,033円	3,943円
(H) 分配金額(1万口当たり)	2円	107円	16円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	4,832,165円	286,870,996円	56,041,614円

分配金のお知らせ

	第11期	第12期	第13期
1万口当たり分配金	2円	107円	16円

(注) 分配金は各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。

お知らせ

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日 2018年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、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		ベンチマーク		株 式 先 物 率 比	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率		
第14期(2014年5月29日)	円 9,940	% 3.9	1,200.68	% 1.9	% 97.9	百万円 142,008
第15期(2015年5月29日)	14,114	42.0	1,673.65	39.4	97.9	157,438
第16期(2016年5月30日)	11,755	△16.7	1,366.01	△18.4	97.9	151,002
第17期(2017年5月29日)	13,812	17.5	1,570.21	14.9	98.2	162,440
第18期(2018年5月29日)	15,832	14.6	1,761.85	12.2	98.1	205,946

(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 比	株 式 先 物 率
	騰 落 率	率	騰 落 率	率		
(当 期 首) 2017年 5月29日	円 13,812	% －	1,570.21	% －	% 98.2	% 1.8
5月末	13,796	△0.1	1,568.37	△0.1	98.2	1.8
6月末	14,195	2.8	1,611.90	2.7	98.5	1.6
7月末	14,259	3.2	1,618.61	3.1	99.0	1.1
8月末	14,252	3.2	1,617.41	3.0	98.7	1.3
9月末	14,872	7.7	1,674.75	6.7	98.2	1.9
10月末	15,683	13.5	1,765.96	12.5	98.3	1.7
11月末	15,919	15.3	1,792.08	14.1	98.5	1.6
12月末	16,165	17.0	1,817.56	15.8	98.8	1.2
2018年 1月末	16,336	18.3	1,836.71	17.0	99.1	1.0
2月末	15,733	13.9	1,768.24	12.6	99.0	1.1
3月末	15,412	11.6	1,716.30	9.3	98.0	2.1
4月末	15,963	15.6	1,777.23	13.2	97.9	2.1
(当 期 末) 2018年 5月29日	15,832	14.6	1,761.85	12.2	98.1	1.8

(注1) 騰落率は期首比です。

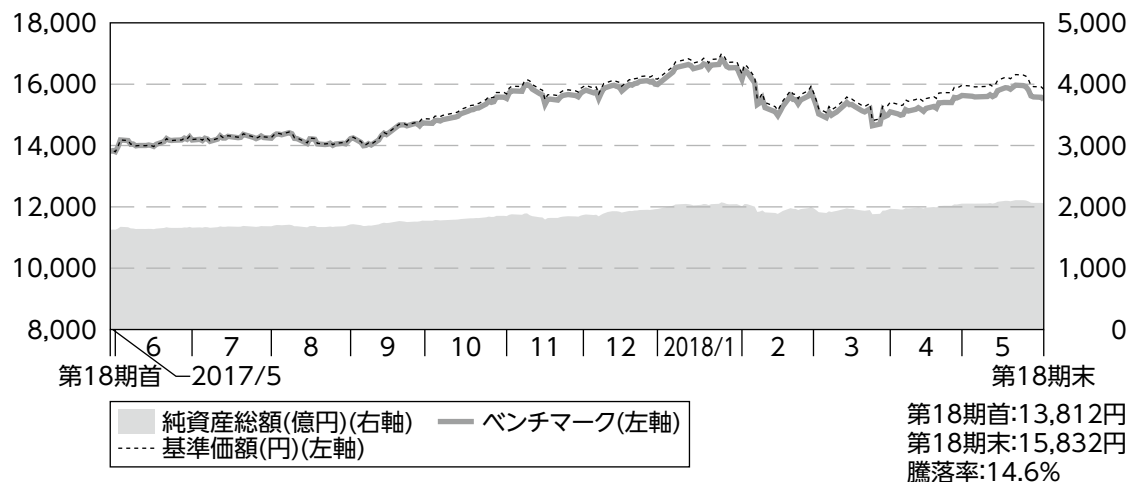
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

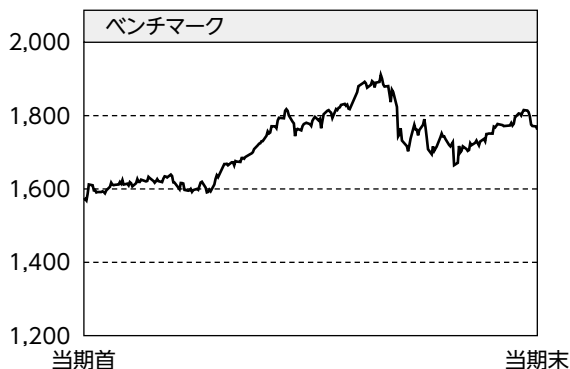


(注)ベンチマークは、2017年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



国内株式市場は、衆議院議員選挙における与党の圧勝を受け経済政策への期待が高まったことや、米税制改革法案が成立したことなどから、2018年1月にかけて堅調に推移しました。その後は、米長期金利上昇による米国株式市場の急落や株価変動率の上昇に加えて、米トランプ政権の保護主義的な政策に対する警戒感などから、国内株式市場は大幅に下落しました。期末にかけては、貿易摩擦に対する過度な懸念が後退したことや円高が一服したことなどを好感し、国内株式市場は反発しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

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

当ファンドの組入資産の内容

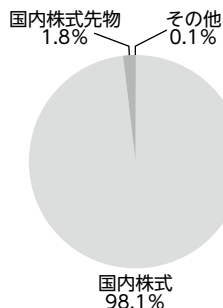
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	3.3%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	1.8%
3	東証株価指数先物 1806	日本	1.8%
4	日本電信電話	日本	1.4%
5	ソニー	日本	1.3%
6	ソフトバンクグループ	日本	1.3%

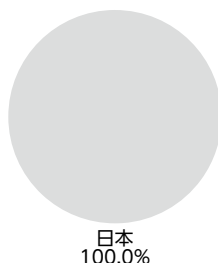
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.3%
8	キーエンス	日本	1.3%
9	本田技研工業	日本	1.2%
10	任天堂	日本	1.0%
組入銘柄数		2,037	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

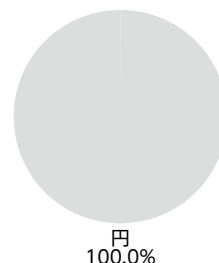
○資産別配分



○国別配分



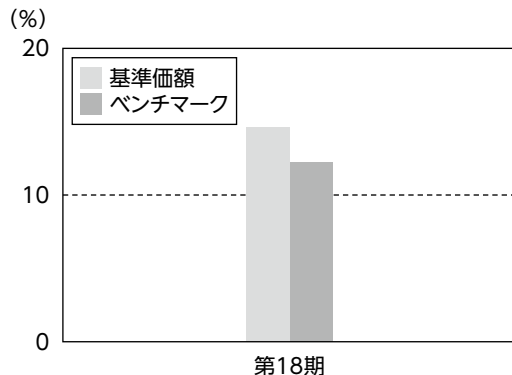
○通貨別配分



(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
 (注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで国内株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して1.8%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

差異の主な要因は、ベンチマークであるTOPIX (東証株価指数) が配当相当分を含まない指数であることによって生じる要因(プラス)です。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2017年5月30日～2018年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (0) (0) (－) (－) (－) (－) (0)	0.001% (0.000) (0.000) (－) (－) (－) (－) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝ $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	－ (－) (－) (－) (－) (－) (－)	－ (－) (－) (－) (－) (－) (－)	(b) 有価証券取引税＝ $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	0 (－) (－) (0)	0.000 (－) (－) (0.000)	(c) その他費用＝ $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.001	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(15,215円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜株 式＞

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株 19,148 (△18,131)	千円 37,964,654 (4,800)	千株 9,159	千円 15,188,665

(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 — (74,200)	千円 — (—)	証券 64,600 (9,600)	千円 903 (—)

(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。

＜先物取引の種類別取引状況＞

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国内	株 式 先 物 取 引	百万円 37,585	百万円 37,171	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	53, 153, 320千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	181, 799, 024千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0. 29

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
金 銭 信 託	百万円 6, 554	百万円 6, 554	% 100. 0	百万円 6, 554	百万円 6, 554	% 100. 0
コ ー ル ・ ロ ー ン	571, 031	135, 865	23. 8	570, 311	135, 707	23. 8

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	108百万円	58百万円	715百万円

(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	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
水産・農林業(0.1%)			
極洋	3.1	3.5	13,212
日本水産	101.3	101.1	54,189
マルハニチロ	14.8	17	69,955
カネコ種苗	2.7	3	4,908
サカタのタネ	11.5	13.3	54,330
ホクト	7.9	9.1	18,591
ホクリョウ	1.1	1.5	1,378
鉱業(0.3%)			
住石ホールディングス	21.7	29.8	4,738
日鉄鉱業	2.2	2.7	15,228
三井松島産業	4.8	5.2	7,664
国際石油開発帝石	410.9	437.8	530,175
日本海洋掘削	2.7	—	—
石油資源開発	12.4	14.6	39,011
K&Oエナジーグループ	5.2	5.9	10,360
建設業(3.2%)			
ヒノキヤグループ	—	2.3	6,656
ショーボンドホールディングス	7.5	8.5	62,560
ミライト・ホールディングス	24	27.6	48,962
タマホーム	5.9	6.6	7,708
サンヨーホームズ	1.6	1.5	1,794
日本アクア	—	2.6	1,089
ファーストコーポレーション	1.7	2.9	3,436
ベステラ	—	1.6	2,408
T A T E R U	1	8.5	16,235
ダイセキ環境ソリューション	2.2	2.1	2,278
第一カッター興業	—	1.2	3,115
安藤・間	56.1	70	65,590
東急建設	27.7	34.6	40,032
コムシスホールディングス	30.5	31.6	93,125
ミサワホーム	9.6	7.5	7,350
ビーアールホールディングス	7.7	8.7	3,532
高松コンストラクショングループ	5.9	5.8	17,748
東建コーポレーション	2.9	3.4	36,074
ソネック	1	1.1	916
ヤマウラ	3.8	4.2	3,708
大成建設	397	89.5	545,950
大林組	233.9	269.6	304,648
清水建設	239	275	298,375
飛島建設	76.8	82.1	14,860
長谷工コーポレーション	91	104.9	173,085
松井建設	8.6	10	9,420
銭高組	11	1.3	7,020
鹿島建設	343	395	359,055

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
不動テトラ	62.7	67.3	12,450
大末建設	2.8	2.9	3,801
鉄建建設	48	5.5	16,500
西松建設	90	20.8	63,856
三井住友建設	298.9	62.6	46,699
大豊建設	28	33	19,536
前田建設工業	51	64.1	77,240
佐田建設	5.7	5.8	2,824
ナカノフドー建設	6.1	6.8	4,195
奥村組	64	14.8	54,982
東鉄工業	9.4	10.8	38,286
イチケン	7	1.6	4,220
浅沼組	27	32	11,552
戸田建設	91	105	101,430
熊谷組	122	14.1	51,535
青木あすなろ建設	5.1	5.9	5,835
北野建設	16	19	7,239
植木組	11	1.1	2,898
三井ホーム	10	12	8,664
矢作建設工業	10.6	12	10,236
ビーエス三菱	8.7	10.5	6,153
日本ハウスホールディングス	15.9	16.9	9,683
大東建託	28.2	32	579,040
新日本建設	9.3	10.6	14,045
N I P P O	18	20.8	45,011
東亜道路工業	15	1.8	7,101
前田道路	24	28.1	62,044
日本道路	23	2.4	14,256
東亜建設工業	6.3	6.6	17,443
若築建設	45	4.8	7,982
東洋建設	22.5	28.1	13,797
五洋建設	86.5	106.8	75,187
大林道路	8.1	—	—
世紀東急工業	11.4	12.1	9,208
福田組	13	2.9	19,894
住友林業	53.7	57.5	97,980
日本基礎技術	8.7	9.7	3,666
日成ビルド工業	23	13.3	16,492
巴コーポレーション	10	11	5,467
パナホーム	29	—	—
大和ハウス工業	230.4	265.5	1,066,513
ライト工業	15	17.2	18,593
積水ハウス	244.2	292.4	579,536
日特建設	6.7	7.5	4,560
北陸電気工事	3.8	4.9	5,865

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
ユアテック	12	13.9	12,551	
西部電気工業	1.3	1.5	5,595	
四電工	6	1.4	3,862	
中電工	8.8	11.6	34,138	
関電工	31	35.8	44,069	
きんでん	51.9	59.8	109,374	
東京エネシス	8.1	10.2	13,198	
トーエネック	11	2.5	8,375	
住友電設	5.4	7.1	14,200	
日本電設工業	12.7	13.8	32,844	
協和エクシオ	30.6	32.3	94,703	
新日本空調	6	6.9	12,164	
N D S	1.2	1.4	8,428	
九電工	15.2	17.7	94,695	
三機工業	17.3	19	21,166	
日揮	72.8	77.4	176,317	
中外炉工業	24	2.7	8,113	
ヤマト	7.1	7.3	5,241	
太平電業	11	6.1	18,757	
高砂熱学工業	21.5	24.8	49,500	
三晃金属工業	0.7	1	3,525	
朝日工業社	1.8	1.9	6,374	
明星工業	14.1	16.2	13,818	
大気社	10.3	11.7	41,359	
ダイダン	10	6	14,166	
日比谷総合設備	8.7	10	22,200	
東芝ブラントシステム	12.7	19.5	48,009	
O S J Bホールディングス	23.9	39.7	11,711	
東洋エン지니어リング	47	10.1	8,776	
千代田化工建設	56	58.4	55,655	
新興ブランテック	16	17.2	16,460	
食料品 (4.4%)				
日本製粉	23.2	26.7	49,047	
日清製粉グループ本社	85.5	98.5	224,777	
日東富士製粉	0.5	0.6	3,150	
昭和産業	32	7.4	21,541	
鳥越製粉	6.2	7	6,741	
中部飼料	8.5	9.8	20,060	
フィード・ワン	47	54.1	14,011	
東洋精糖	12	1.3	1,608	
日本甜菜製糖	4	4.6	10,294	
三井製糖	5.5	6.4	23,360	
塩水港精糖	8.3	9.3	2,455	
日新製糖	3.3	3.8	8,090	
森永製菓	15.2	18.9	103,950	
中村屋	1.8	2.1	10,059	
江崎グリコ	19.5	22.5	125,325	
名糖産業	3.4	3.8	6,596	
井村屋グループ	—	3.2	10,784	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
不二家	45	5.1	13,601	
山崎製パン	57.1	65.8	151,800	
第一屋製パン	12	1.4	1,636	
モロゾフ	12	1.4	9,464	
亀田製菓	4.3	5	29,800	
寿スビリッツ	7.4	7.8	44,538	
カルビー	31.8	36.7	146,066	
森永乳業	70	16.1	70,196	
六甲バター	3.5	5.3	12,243	
ヤクルト本社	41.8	46.9	343,777	
明治ホールディングス	46.2	53.2	492,100	
雪印メグミルク	16.8	19.4	58,491	
プリマハム	49	57	37,848	
日本ハム	55	34.8	155,904	
林兼産業	2.5	2.8	2,276	
丸大食品	37	43	21,758	
S F o o d s	4.2	5.6	24,332	
伊藤ハム米久ホールディングス	45	51.8	52,473	
サッポロホールディングス	25.5	29.4	83,055	
アサヒグループホールディングス	146.3	168.6	959,502	
キリンホールディングス	335.8	386.9	1,205,193	
宝ホールディングス	56.5	60.3	78,390	
オエノンホールディングス	20	22.9	10,808	
養命酒製造	2.4	2.5	6,045	
コカ・コーラ ボトラーズ	49.2	56.5	261,595	
ジャパンホールディングス	53.4	61.6	305,844	
サントリー食品インターナショナル	3.6	4.1	25,502	
ダイドーグループホールディングス	23.1	26.7	118,414	
伊藤園	6.9	7.9	17,253	
キーコーヒー	2.1	2.4	2,697	
ユニカフェ	1	1.1	1,619	
ジャパンフーズ	45	9.5	29,972	
日清オイリオグループ	20.8	21.8	85,347	
不二製油グループ本社	0.8	0.9	5,535	
かどや製油	3.6	4.2	16,212	
J-オイルミルズ	54.6	62.9	313,871	
キッコーマン	160.7	185.1	383,619	
味の素	39.7	44.8	117,152	
キューピー	28.9	30.7	123,107	
ハウス食品グループ本社	28	32.2	121,394	
カゴメ	3.7	3.8	4,666	
焼津水産化学工業	6.4	7.4	69,264	
アリアケジャパン	0.9	1	1,654	
ピエトロ	1.9	1.8	4,120	
エバラ食品工業	38.4	38.3	113,138	
ニチレイ	38.3	44.2	172,822	
東洋水産	0.9	2.2	4,734	
イートアンド	0.8	0.9	1,793	
大冷				

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
ヨシムラ・フード・ホールディングス	0.1	1.6	1,531	
日清食品ホールディングス	30.5	35.1	285,012	
永谷園ホールディングス	7	9	13,626	
一正蒲鉾	2.7	3.1	4,380	
フジッコ	7.6	8.7	23,420	
ロック・フィールド	7.5	8.7	17,112	
日本たばこ産業	432.3	498.1	1,461,425	
ケンコーマヨネーズ	4.2	5.3	22,048	
わらべや日洋ホールディングス	4.6	5.3	14,866	
なとり	3.9	4.5	8,527	
イフジ産業	1.2	1.4	1,107	
ビックスコーポレーション	—	1.6	3,361	
北の達人コーポレーション	3.4	24.6	20,245	
ユウグレナ	26.9	32	28,768	
ミヨシ油脂	27	3	4,251	
理研ビタミン	2.3	3	12,765	
繊維製品(0.7%)				
片倉工業	9.2	9.7	13,124	
グンゼ	55	6.3	45,045	
東洋紡	289	31.1	57,877	
ユニチカ	199	24.5	15,459	
富士紡ホールディングス	3.6	4.7	18,635	
倉敷紡績	74	85	32,300	
シキボウ	39	4.2	5,464	
日本毛織	20.6	23.8	25,085	
トーア紡コーポレーション	3.1	3.5	1,995	
ダイドーリミテッド	8.3	9.3	4,222	
帝国繊維	7.6	8.8	21,401	
帝人	59.6	69.1	147,113	
東レ	529	609.5	553,426	
サカイオーベックス	1.7	2.2	5,561	
住江織物	20	2.2	6,228	
日本フェルト	4.3	4.5	2,349	
イチカワ	5	6	2,130	
日東製網	0.8	0.9	1,543	
アツギ	62	5.7	6,891	
ダイニツク	14	3.1	3,186	
セーレン	18.2	19.4	38,276	
ソトー	2.7	3.3	3,458	
東海染工	14	1.3	1,896	
小松精練	10.3	12.9	12,861	
ワコールホールディングス	43	23.2	75,516	
ホギメディカル	4.6	10.6	51,887	
レナウン	19.7	22.1	3,425	
クラウディアホールディングス	2.4	2.3	1,347	
T S I ホールディングス	30.1	30.7	24,007	
マツオカコーポレーション	—	2	8,590	
三陽商会	43	4.4	10,366	
ナイガイ	—	3.2	1,836	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
オンワードホールディングス	47	50.3	44,264	
ルックホールディングス	18	15	4,575	
ゴールドウイン	3.2	4.8	42,864	
デサント	16.7	19.2	40,358	
キング	3.6	4.4	2,274	
ヤマトインターナショナル	4.9	5.8	3,532	
パルプ・紙(0.3%)				
特種東海製紙	4.2	4.6	20,378	
王子ホールディングス	285	354	263,730	
日本製紙	32.7	37.6	70,763	
三菱製紙	10.4	11.9	7,913	
北越紀州製紙	40.7	46.9	28,280	
中越パルプ工業	29	3.3	6,121	
巴川製紙所	11	13	3,419	
大王製紙	29.1	33.5	52,193	
阿波製紙	1.8	2	1,248	
レンゴー	70.3	81	81,162	
トーモク	23	4.8	10,579	
ザ・バック	5.2	5.9	22,744	
化学(7.5%)				
クラレ	122.7	141.4	240,380	
旭化成	455	523.9	770,133	
共和レザー	4.3	4.8	4,867	
昭和電工	48.5	55.9	251,270	
住友化学	537	618	408,498	
住友精化	3	3.5	18,130	
日産化学工業	39.9	48.9	257,703	
ラサ工業	27	3	7,731	
クレハ	5.5	7.3	55,115	
多木化学	5	1.2	5,874	
テイカ	11	6.4	16,825	
石原産業	13.1	15	18,330	
片倉コープアグリ	10	2	2,476	
日東エフシー	4.3	4.9	3,675	
日本曹達	44	58	35,148	
東ソー	211	121.4	235,758	
トクヤマ	113	24.4	95,770	
セントラル硝子	74	17.1	41,724	
東亜合成	45.6	49.3	63,695	
大阪ソーダ	31	8.1	25,191	
関東電化工業	14.9	20	22,680	
デンカ	151	30.9	127,462	
信越化学工業	130.8	139.9	1,545,895	
日本カーバイド工業	25	2.7	5,332	
堺化学工業	27	5.7	16,467	
エア・ウォーター	60.1	69.3	150,935	
大陽日酸	56.2	64.7	106,884	
日本化学工業	27	3.1	15,112	
東邦アセチレン	—	1.2	1,854	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
日本バーカライジング	37.3	42.9	70,227	
高压ガス工業	10.8	12.5	11,800	
チタン工業	9	0.9	2,412	
四国化成工業	11	12.1	18,827	
戸田工業	15	1.7	5,038	
ステラ ケミファ	3.5	4.3	15,759	
保土谷化学工業	2.5	2.7	10,881	
日本触媒	11.5	13.2	111,936	
大日精化工業	30	6.5	24,927	
カネカ	98	113	126,447	
三菱瓦斯化学	67.9	69.3	195,495	
三井化学	331	76.4	245,244	
J S R	73.3	84.5	178,379	
東京応化工業	13.6	14.6	61,028	
大阪有機化学工業	4.7	7.2	10,425	
三菱ケミカルホールディングス	491.2	562.7	566,638	
KHネオケム	11.9	12.9	39,345	
ダイセル	98.3	113.3	139,132	
住友ベークライト	64	68	71,400	
積水化学工業	165.5	174.5	317,241	
日本ゼオン	61	70.8	100,111	
アイカ工業	23.4	23.6	97,114	
宇部興産	367	42.3	140,859	
積水樹脂	11.2	13	29,731	
タキロンシーアイ	15	17	11,900	
旭有機材	24	4.9	9,951	
日立化成	40.5	41.5	99,558	
ニチバン	7	4.1	11,771	
リケンテクノス	15.7	18.1	9,683	
大倉工業	17	20	11,080	
積水化成成品工業	10.2	10.4	13,343	
群栄化学工業	1.8	2	7,170	
タイガースポリマー	3.6	4.1	3,251	
ミライアル	2.7	2.8	4,544	
ダイキアクシス	1.2	2.8	3,931	
ダイキョーニシカワ	12.8	16.6	30,693	
竹本容器	—	1.3	4,413	
森六ホールディングス	—	4.2	12,600	
日本化薬	47	54.5	66,163	
カーリットホールディングス	6.8	7.7	8,516	
日本精化	6	7	8,225	
扶桑化学工業	5.2	8	22,680	
トリケミカル研究所	—	2	8,880	
A D E K A	31.4	36.1	71,514	
日油	56	32.5	108,550	
ハリマ化成グループ	6.2	6.4	5,657	
花王	181.9	197.2	1,663,579	
第一工業製薬	16	16	11,824	
石原ケミカル	—	2	4,044	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
日華化学	2.3	2.6	3,195	
ニイタカ	1.1	1.2	2,149	
三洋化成工業	4.6	5.3	28,779	
有機合成薬品工業	4.9	5.5	1,589	
大日本塗料	42	9.5	14,953	
日本ペイントホールディングス	56.3	64.8	300,672	
関西ペイント	76.6	88.3	205,209	
神東塗料	5	6.2	1,407	
中国塗料	20.9	24	25,872	
日本特殊塗料	5.1	5.3	11,098	
藤倉化成	9.9	10.6	7,420	
太陽ホールディングス	5.9	6.5	29,575	
D I C	28.8	33.2	119,686	
サカタインクス	14.9	17.1	27,154	
東洋インキSCホールディングス	72	83	51,709	
T & K T O K A	5.3	5.6	6,932	
富士フイルムホールディングス	144.6	166.6	697,221	
資生堂	138.3	149.4	1,244,800	
ライオン	90.5	111.8	226,730	
高砂香料工業	4.8	5	17,275	
マンダム	7.3	15.6	55,458	
ミルボン	3.9	10.7	56,817	
ファンケル	15.5	19.5	94,867	
コーセー	11.8	13.6	320,552	
コタ	3	3.8	5,783	
シーズ・ホールディングス	9.5	9.7	59,655	
シーボン	0.8	1	3,050	
ボーラ・オルビスホールディングス	29.7	34.2	179,892	
ノエビアホールディングス	4.6	5.1	41,106	
アジュパンコスメジャパン	1.4	1.8	1,767	
エステー	5	5.7	15,407	
アグロ カネショウ	2.8	3.3	8,771	
コニシ	11.4	13.2	24,802	
長谷川香料	9.2	10.5	23,310	
星光PMC	4	4.6	5,377	
小林製薬	19.5	22.5	217,350	
荒川化学工業	6.2	7.2	13,615	
メック	5.7	5.5	12,518	
日本高純度化学	2.1	2.2	5,460	
タカラバイオ	20.8	21	52,647	
J C U	4.6	9.7	24,822	
新田ゼラチン	4.4	5.5	4,620	
O A T アグリオ	0.9	1.3	4,803	
デクセリアルズ	19.2	20.6	21,403	
アース製薬	5.2	6	33,900	
北興化学工業	7	8	5,568	
大成ラミック	2.3	2.5	7,737	
クミアイ化学工業	30.9	36.3	25,010	
日本農薬	18.2	20.6	13,699	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
アキレス	6	6.1	13,920	
有沢製作所	12.4	13.4	15,932	
日東電工	52.6	60.6	531,280	
レック	4.5	4.8	19,848	
きもと	13.2	13.5	4,050	
藤森工業	5.4	6.7	25,694	
前澤化成工業	4.8	5.4	6,674	
J S P	3.4	4.7	16,144	
エフピコ	6.5	6.6	42,702	
天馬	4.8	6.3	12,039	
信越ポリマー	14.3	16.4	18,351	
東リ	17.4	19.8	7,108	
ニフコ	12.8	29.5	112,542	
日本バルカー工業	5.7	6.5	21,385	
ユニ・チャーム	147.6	170.1	579,530	
医薬品(4.6%)				
協和発酵キリン	87.2	100.5	224,416	
武田薬品工業	273.4	295.5	1,321,771	
アステラス製薬	744.8	824.3	1,381,938	
大日本住友製薬	51.6	59.5	134,410	
塩野義製薬	92.5	113	638,450	
田辺三菱製薬	84.9	97.9	190,807	
わかもと製薬	8	9.4	2,857	
あすか製薬	7.9	9	11,259	
日本新薬	16.7	21	162,750	
バイオフェルミン製薬	1.2	1.4	4,078	
中外製薬	72.6	83.6	502,436	
科研製薬	13.6	14.5	87,725	
エーザイ	89.7	96	746,688	
ロート製薬	35.7	44.1	160,083	
小野薬品工業	165.6	189.4	513,558	
久光製薬	20.6	23.7	214,485	
持田製薬	4.9	5.6	44,408	
参天製薬	131.7	152	283,024	
扶桑薬品工業	2.5	2.8	8,240	
日本ケミファ	1	1.1	5,192	
ツムラ	24.5	28.7	114,082	
日医工	17	21	34,209	
キッセイ薬品工業	12.9	14.7	44,320	
生化学工業	13.5	15.5	24,071	
栄研化学	6.1	13	31,460	
日水製薬	2.9	3.3	4,676	
鳥居薬品	5	5	14,030	
J C Rファーマ	5.6	5.7	36,765	
東和薬品	3.3	3.8	26,258	
富士製薬工業	2.4	2.7	10,638	
沢井製薬	12.4	16.1	77,924	
ゼリア新薬工業	14.9	17.2	39,250	
第一三共	214.5	229.5	824,364	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
キョーリン製薬ホールディングス	17.8	22.4	52,572	
大幸薬品	3.7	4.3	8,720	
ダイト	4.3	4.7	17,319	
大塚ホールディングス	156.7	166.7	910,015	
大正製薬ホールディングス	15.6	18	212,940	
ペプチドリーム	13.6	36.7	170,655	
石油・石炭製品(0.7%)				
日本コークス工業	58.9	67.8	7,729	
昭和シェル石油	65.2	75.1	109,946	
ニチレキ	8.9	10.3	13,204	
ユシロ化学工業	3.9	4.4	7,383	
ビービー・カストロール	3	3.4	5,688	
富士石油	16.9	19.5	7,644	
MORESCO	2.5	2.9	5,570	
出光興産	34.6	67.3	250,019	
J X T Gホールディングス	1,111.6	1,280.1	877,636	
コスモエネルギーホールディングス	22	23.2	88,276	
ゴム製品(0.8%)				
横浜ゴム	44	46.4	113,123	
東洋ゴム工業	38.5	47.5	80,560	
ブリヂストン	246	265.5	1,178,554	
住友ゴム工業	68.2	82.6	152,727	
藤倉ゴム工業	6.1	6.8	4,909	
オカモト	22	28	32,536	
フコク	3	3.4	3,287	
ニッタ	6.5	8.3	34,777	
住友理工	13.5	15.5	18,367	
三ツ星ベルト	17	19	24,415	
パンドー化学	13.3	15.2	19,638	
ガラス・土石製品(1.0%)				
日東紡績	59	11.9	30,154	
旭硝子	359	80.9	363,241	
日本板硝子	33.2	39.1	42,970	
石塚硝子	10	1.1	2,761	
日本山村硝子	29	33	5,907	
日本電気硝子	151	34.7	103,891	
オハラ	3	3.2	7,174	
住友大阪セメント	135	156	76,440	
太平洋セメント	440	50.7	208,377	
日本ヒューム	7	7.9	6,770	
日本コンクリート工業	16.5	16.9	6,269	
三谷セキサン	3.7	4.2	11,222	
アジアパイルホールディングス	9.4	10.4	7,207	
東海カーボン	68.2	72.8	154,190	
日本カーボン	37	4.1	25,051	
東洋炭素	4.1	5.2	19,344	
ノリタケカンパニーリミテド	4.1	4.7	25,568	
TOTO	53.6	61.7	359,711	
日本碍子	92	97.9	198,149	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
日本特殊陶業	62.8	68.8	211,560	
MARUWA	2.7	2.8	24,500	
品川リフトラクトリーズ	19	2.1	7,245	
黒崎播磨	16	1.6	9,056	
ヨータイ	4	6.3	4,365	
イソライト工業	4.1	4.1	3,062	
東京窯業	9.2	10	3,900	
ニッカトー	2.5	3.6	3,808	
フジミインコーポレーテッド	6.3	7.2	17,827	
クニミネ工業	—	2.2	2,237	
エーアンドエーマテリアル	—	1.7	2,186	
ニチアス	38	44	62,568	
ニチハ	9.7	12.1	52,816	
鉄鋼(1.1%)				
新日鐵住金	328.6	355	830,167	
神戸製鋼所	126	145.2	161,317	
中山製鋼所	8.2	11	7,942	
合同製鐵	4.1	4.3	9,928	
ジェイ エフ イー ホールディングス	199.2	214.2	494,802	
日新製鋼	23.7	21.9	35,937	
東京製鐵	36.9	42.5	38,080	
共英製鋼	7.8	8.9	18,787	
大和工業	14.6	16.9	58,896	
東京鐵鋼	15	3.2	5,222	
大阪製鐵	4.6	5.3	11,999	
淀川製鋼所	10.1	11.6	33,930	
東洋鋼板	17.5	19	13,604	
丸一鋼管	24.4	28.1	102,284	
モリ工業	2.3	2.6	8,892	
大同特殊鋼	122	14.1	74,871	
日本高周波鋼業	25	2.9	2,337	
日本冶金工業	60	65.3	22,071	
山陽特殊製鋼	43	9.2	25,980	
愛知製鋼	4.3	4.5	20,160	
日立金属	74.2	85.4	105,725	
日本金属	1.7	2	4,036	
大平洋金属	47	4.9	17,860	
新日本電工	41	47.3	15,798	
栗本鐵工所	3.5	4	7,944	
虹技	10	1.2	2,413	
日本鑄鉄管	7	8	1,312	
三菱製鋼	51	5.9	13,906	
日亜鋼業	10.1	11.3	3,898	
日本精線	5	1.3	5,804	
シンニッタン	6	12	5,628	
新家工業	16	1.8	3,882	
非鉄金属(0.9%)				
大紀アルミニウム工業所	12	13.2	9,609	
日本軽金属ホールディングス	187.6	232.1	60,113	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
三井金属鉱業	198	21.4	102,399	
東邦亜鉛	41	4.4	19,272	
三菱マテリアル	45.5	52.4	161,130	
住友金属鉱山	189	101.4	428,009	
DOWAホールディングス	80	20.1	71,556	
古河機械金属	114	13.2	21,674	
大阪チタニウムテクノロジーズ	8	8.3	16,467	
東邦チタニウム	12.4	14.3	16,816	
UAC J	103	12.1	31,399	
CKサンエツ	—	1.5	5,655	
古河電気工業	24.4	26.4	115,500	
住友電気工業	274.6	296.6	505,554	
フジクラ	95.9	96	73,152	
昭和電線ホールディングス	87	9.8	8,026	
東京特殊電線	1.2	1.1	3,059	
タツタ電線	14.1	15.7	9,891	
沖電線	9	—	—	
カナレ電気	1	1.4	3,486	
平河ヒューテック	3.6	4	5,444	
リョービ	44	9.8	33,271	
アーレスティ	8.4	9.9	9,603	
アサヒホールディングス	11	13.7	27,427	
金属製品(0.7%)				
稲葉製作所	3.9	4.4	6,274	
宮地エンジニアリンググループ	21	2.3	4,609	
トーカロ	4.8	22.1	30,056	
アルファC o	2.4	2.8	4,858	
SUMCO	76.1	73	199,728	
川田テクノロジーズ	1.4	1.6	10,144	
RS Technologies	0.4	1.2	7,884	
東洋製罐グループホールディングス	51.8	54.2	98,427	
ホッカンホールディングス	19	20	7,580	
コロナ	3.8	4.3	5,224	
横河ブリッジホールディングス	12.8	14.8	37,666	
駒井ハルテック	1.4	1.7	4,005	
高田機工	6	0.7	2,145	
三和ホールディングス	72.3	76.1	92,537	
文化シャッター	20.3	23.3	23,183	
三協立山	9.6	10.9	17,167	
アルインコ	5	5.7	6,127	
東洋シャッター	1.8	2	1,324	
L I X I L グループ	101.5	116.9	288,743	
日本ファイルコン	5.3	6	3,678	
ノーリツ	14.3	17.7	34,284	
長府製作所	7.8	9	22,527	
リンナイ	12.4	14.1	149,883	
ダイニチ工業	3.7	4.2	3,397	
日東精工	10.4	10.8	8,013	
三洋工業	9	1	2,141	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
岡部	15.1	16.1	15,906	
ジーテクト	7.6	8.8	17,485	
東ブレ	14	14.8	45,954	
高周波熱錬	13.3	15.2	15,960	
東京製綱	4.9	5.7	11,548	
サンコール	3.9	4.4	3,106	
モリテック スチール	3.7	6.2	4,185	
パイオラックス	11	11.7	34,339	
エイチワン	5.5	7.7	9,301	
日本発條	68.6	79	86,742	
中央発條	8	1	3,650	
アドバネクス	1.3	1.3	2,919	
立川ブラインド工業	3	3.5	4,707	
三益半導体工業	6.1	6.7	12,495	
機械(5.3%)				
日本ドライケミカル	0.9	1.1	2,504	
日本製鋼所	24.1	26	81,640	
三浦工業	29.8	34.4	105,092	
タクマ	23.3	27	33,939	
ツガミ	20	21	23,814	
オークマ	47	9.3	59,148	
東芝機械	43	45	27,855	
アマダホールディングス	98.1	122.6	148,959	
アイダエンジニアリング	20.7	20.4	26,683	
滝澤鉄工所	21	2.5	4,877	
F U J I	22.2	23.8	53,240	
牧野フライス製作所	36	41	39,770	
オーエスジー	33.2	36.7	85,804	
ダイジェット工業	13	1.1	2,013	
旭ダイヤモンド工業	20.5	23.7	20,903	
DMG森精機	42.2	44.1	84,010	
ソディック	18.5	17.2	19,418	
ディスコ	8.5	10.7	221,276	
日東工器	4.2	4.9	13,984	
日進工具	—	2.1	5,982	
パンチ工業	2.6	6.5	7,579	
富士ダイス	—	3.9	3,455	
豊和工業	5.2	4.5	4,936	
OKK	32	3.2	3,942	
東洋機械金属	4.9	6.1	4,514	
島精機製作所	9.5	10.1	62,418	
オプトラン	—	7.7	27,720	
N Cホールディングス	2.4	2.5	1,950	
フリュー	4.3	5.5	5,390	
ヤマシンフィルタ	1.9	12.1	14,556	
日阪製作所	9.9	11.4	12,403	
やまびこ	13.3	15.3	22,445	
平田機工	—	2.9	22,997	
ペガサスミシン製造	7	7.2	7,056	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ナブテスコ	37.9	43.7	159,942	
三井海洋開発	7.3	8.4	25,284	
レオン自動機	6.1	7.1	16,287	
SMC	21.8	25.2	1,080,828	
新川	6.1	5.9	5,451	
ホソカワミクロン	2.6	3	20,370	
ユニオンツール	3.1	3.6	14,508	
オイレス工業	8.9	10.3	24,699	
日精エー・エス・ビー機械	2.3	2.6	13,130	
サトーホールディングス	9.1	10.4	31,304	
技研製作所	—	5.5	14,184	
日本エアータック	2.4	2.7	2,443	
カワタ	—	1.6	2,507	
日精樹脂工業	6.1	6.9	9,114	
オカダアイオン	2	2.6	4,160	
ワイエイシイホールディングス	2.7	2.6	2,337	
小松製作所	336.1	387.4	1,404,325	
住友重機械工業	213	46	179,400	
日立建機	32.6	37.6	151,152	
日工	2.2	2.3	5,911	
巴工業	3	3.4	7,697	
井関農機	75	8.2	16,572	
T O W A	5.9	6.1	8,375	
丸山製作所	1.8	1.9	3,585	
北川鉄工所	3.3	3.9	10,931	
ローツェ	3.4	4	9,840	
タカキタ	2.4	2.7	2,149	
クボタ	348.7	430.4	803,987	
荏原実業	2	2.5	6,035	
三菱化工機	24	2.9	6,226	
月島機械	13.8	16.1	28,545	
帝国電機製作所	5.3	5.5	7,804	
新東工業	16.5	19.2	20,390	
澁谷工業	6.1	7.1	25,950	
アイチ コーポレーション	10.3	14.2	10,479	
小森コーポレーション	17.5	20.4	26,907	
鶴見製作所	5.4	6.9	13,475	
住友精密工業	11	13	4,992	
酒井重工業	16	1.6	6,712	
荏原製作所	33	33	124,410	
石井鐵工所	1.1	1.4	2,889	
西島製作所	7.3	8.5	8,636	
北越工業	7.8	8.9	9,567	
ダイキン工業	95	109.5	1,387,912	
オルガノ	14	3	9,630	
トーヨーカネツ	35	3.5	12,845	
栗田工業	41.2	43.5	141,810	
椿本チエイン	41	48	42,000	
大同工業	16	3.2	4,918	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
木村化工機	7.9	7.1	3,173	
アネスト岩田	12.6	13.5	14,769	
ダイフク	34.7	40.9	234,766	
サムコ	1.9	2.2	2,822	
加藤製作所	3.9	3.9	11,076	
油研工業	14	1.7	4,777	
タダノ	36.4	38.9	59,828	
フジテック	20.3	25.6	37,120	
CKD	20.9	22.3	49,550	
キトー	8.8	6.1	14,060	
平和	21.6	24.9	61,727	
理想科学工業	6.9	8	19,432	
SANKYO	19.4	20.1	88,339	
日本金銭機械	6.4	7.3	8,760	
マースエンジニアリング	3.9	5.1	13,693	
福島工業	4.3	4.9	23,863	
オーイズミ	2.9	3.3	1,907	
ダイコク電機	2.9	3.6	6,645	
竹内製作所	12.7	13.4	34,237	
アマノ	21.5	24.8	67,406	
JUKI	11	11.9	14,553	
サンデンホールディングス	42	9.8	15,141	
蛇の目ミシン工業	6.8	7.1	5,090	
マックス	11	12.3	17,773	
グローリー	22.3	23.9	78,153	
新晃工業	6.5	8.1	16,993	
大和冷機工業	11.2	12.9	16,705	
セガサミーホールディングス	69	79.6	148,613	
日本ビストンリング	2.7	2.9	6,423	
リケン	3.2	3.7	21,016	
TPR	7.8	9	25,983	
ツバキ・ナカシマ	7.8	8.1	22,266	
ホシザキ	20.3	25.2	277,956	
大豊工業	5.7	6.4	9,075	
日本精工	143	164.7	209,333	
NTN	161	185.6	89,644	
ジェイテクト	74.2	85.5	137,142	
不二越	70	7.4	39,146	
日本トムソン	22.1	25.5	22,822	
THK	49.2	50	196,500	
ユーシン精機	3.1	7	9,961	
前澤給装工業	2.6	3.1	6,010	
イーグル工業	7.5	9.9	18,374	
前澤工業	4.6	5.7	2,758	
日本ビラー工業	7	8	13,160	
キッツ	33.4	35.1	34,749	
マキタ	90.8	104.6	513,063	
日立造船	55.2	64.1	36,344	
三菱重工業	1,167	134.5	559,520	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
IHI	536	61.7	256,980	
スター精密	12.2	12.8	23,884	
電気機器(13.6%)				
日清紡ホールディングス	38.6	49	67,473	
イビデン	48.7	49.3	84,648	
コニカミノルタ	163	188.1	189,981	
ブラザー工業	90	98.1	222,490	
ミネベアミツミ	126.7	149.1	303,567	
日立製作所	1,671	1,926	1,568,149	
東芝	1,545	—	—	
三菱電機	742.5	802.1	1,268,922	
富士電機	210	242	193,358	
東洋電機製造	2.9	3.2	5,612	
安川電機	80.7	93	412,455	
シンフォニアテクノロジー	45	52	22,776	
明電舎	64	68	28,220	
オリジン電気	10	2.3	5,352	
山洋電気	18	3.9	35,685	
デンヨー	6.4	7.4	14,393	
東芝テック	44	57	38,019	
芝浦メカトロニクス	11	13	5,109	
マブチモーター	19.7	22.5	115,200	
日本電産	90.2	96.5	1,653,045	
ユ・エム・シー・エレクトロニクス	2.2	3	8,388	
トレックス・セミコンダクター	—	2.5	3,587	
東光高岳	3.5	4.3	8,230	
ダブル・スコープ	6.7	11.8	21,393	
ダイヘン	38	44	34,804	
田淵電機	10.6	—	—	
ヤーマン	0.9	11.8	32,367	
JVCケンウッド	51.2	59.6	22,230	
ミマキエンジニアリング	6.3	7.6	6,916	
第一精工	3.3	3.9	8,014	
日新電機	14	18.7	19,691	
大崎電気工業	14	17.2	14,671	
オムロン	74	85.3	500,711	
日東工業	10.2	12.8	25,728	
IDEC	9.1	9.9	26,730	
不二電機工業	0.8	1.2	1,684	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	134	145	75,110	
サクサホールディングス	18	2	4,738	
メルコホールディングス	3.9	4	16,480	
テクノメディカ	1.6	1.8	3,591	
日本電気	957	103.8	313,476	
富士通	671	825	555,637	
沖電気工業	30.2	32.6	41,304	
岩崎通信機	31	3.4	2,832	
電気興業	20	4.6	14,237	
サンケン電気	41	47	30,644	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
ナカヨ	7	1.6	3,030	
アイホン	3.9	4.5	8,460	
ルネサスエレクトロニクス	36.1	41.9	45,042	
セイコーエプソン	103.6	119.4	231,755	
ワコム	54.1	62.5	37,375	
アルバック	11.7	18.4	94,392	
アクセル	3	3.9	4,067	
E I Z O	6.9	7.4	35,705	
ジャパンディスプレイ	130.2	—	—	
日本信号	19.2	22	22,220	
京三製作所	16	18.8	14,588	
能美防災	7.9	10.7	28,130	
ホーチキ	5.1	6	12,654	
星和電機	—	3.2	1,977	
エレコム	6	7.1	19,816	
日本無線	4.3	—	—	
パナソニック	799.4	916.3	1,386,361	
シャープ	—	74.5	220,743	
アンリツ	50.7	58.5	85,410	
富士通ゼネラル	23.6	24.5	42,654	
日立国際電気	18.3	—	—	
ソニー	491.7	536.2	2,766,792	
TDK	39.2	42	418,740	
帝国通信工業	16	3.8	4,837	
タムラ製作所	27	30.8	23,931	
アルプス電気	64.3	69.2	179,920	
池上通信機	22	25	3,850	
パイオニア	104.6	133	21,413	
日本電波工業	6.8	7.8	4,890	
鈴木	2.7	3.8	3,826	
日本トリム	1.7	1.8	7,983	
ローランド ディー、ジー、	3.6	4.2	10,201	
フォスター電機	8.1	9.3	16,237	
クラリオン	37	42	12,138	
SMK	18	21	8,673	
ヨコオ	5	5.4	11,086	
ホシデン	21.1	20.6	21,032	
ヒロセ電機	11.2	13.6	194,616	
日本航空電子工業	20	21	39,207	
TOA	8.2	8.5	10,310	
マクセルホールディングス	10.4	16.1	28,513	
古野電気	9	10	9,430	
ユニデンホールディングス	20	22	7,678	
アルパイン	16.6	19.1	39,632	
スミダコーポレーション	6.3	8.4	10,508	
アイコム	3.9	4.4	12,029	
リオン	2.7	3.5	8,340	
本多通信工業	3	6.6	6,336	
船井電機	7.8	7.3	5,088	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
横河電機	75.5	80.3	157,709	
新電元工業	27	2.8	17,752	
アズビル	21.1	24	129,600	
東亜ディーケーケー	3.5	4.3	5,383	
日本光電工業	29.1	33.6	102,648	
チノー	2.5	2.7	4,446	
共和電業	7.9	8.9	4,040	
日本電子材料	2.8	3.1	2,945	
堀場製作所	13.8	15.9	144,372	
アドバンテスト	47.4	44.7	115,683	
小野測器	3.4	3.9	3,315	
エスベック	6.2	7.3	18,374	
キーエンス	31.5	39.4	2,615,766	
日置電機	3.7	4.3	17,630	
シスメックス	54.1	62.5	630,000	
日本マイクロニクス	12.1	14.1	16,327	
メガチップス	6.5	6.4	19,520	
OBARA GROUP	4.1	4.7	29,845	
澤藤電機	4	1.1	2,431	
コーセル	9.7	11.4	16,302	
イリソ電子工業	2.9	6.8	46,172	
新日本無線	5.9	4.7	4,168	
オブテックスグループ	5.3	13.2	40,062	
千代田インテグレ	3.7	4	9,360	
アイ・オー・データ機器	2.9	3.7	4,495	
レーザーテック	15.3	16.5	60,802	
スタンレー電気	49.7	61.5	226,320	
岩崎電気	26	3.3	5,346	
ウシオ電機	42.3	48.9	68,949	
岡谷電機産業	3.8	6.3	3,307	
ヘリオス テクノ ホールディング	6.5	7.2	5,392	
日本セラミック	5.7	8.3	21,521	
遠藤照明	3.5	4.4	4,250	
古河電池	5	6.1	5,575	
双信電機	3.5	4.2	2,469	
山一電機	6.6	6	10,902	
図研	4.5	5.4	9,336	
日本電子	25	30	34,860	
カシオ計算機	56	64.5	108,102	
ファナック	70.6	76.2	1,808,607	
日本シイエムケイ	15.1	14.4	10,209	
エンブラス	3.2	3.7	12,117	
大真空	2.6	3.2	4,505	
ローム	33.7	36	366,840	
浜松ホトニクス	50.7	58.5	273,195	
三井ハイテック	9.2	10.7	16,381	
新光電気工業	26.3	30.7	29,226	
京セラ	114.3	131.7	878,043	
太陽誘電	33.9	36.2	88,219	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
村田製作所	73	84.2	1,358,146	
ユーシン	9.7	12.1	9,050	
双葉電子工業	11.4	13.3	26,972	
北陸電気工業	28	3.5	4,536	
ニチコン	22	25.4	35,483	
日本ケミコン	60	6.5	26,682	
KOA	9.6	11.2	25,771	
市光工業	15	12.2	17,446	
小糸製作所	41.7	48.1	382,395	
ミツバ	12.8	15	17,265	
SCREENホールディングス	14.3	15.2	137,560	
キャノン電子	6.4	7.5	18,082	
キャノン	374.8	431.8	1,623,136	
リコー	209.3	241.2	232,516	
象印マホービン	—	15	24,600	
MUTOHホールディングス	10	1.3	3,131	
東京エレクトロン	46.4	53.5	1,132,862	
輸送用機器(8.6%)				
トヨタ紡織	24.4	23.4	49,303	
芦森工業	17	1.7	4,448	
ユニプレス	13.4	15.5	36,735	
豊田自動織機	63.4	64.9	425,095	
モリタホールディングス	12.2	12.9	28,689	
三櫻工業	8.9	10.2	7,415	
デンソー	171.6	178	957,996	
東海理化電機製作所	18.3	21.1	44,225	
三井E&Sホールディングス	259	28.9	43,928	
川崎重工工業	545	62.4	209,664	
名村造船所	20.8	24.1	12,797	
サノヤスホールディングス	11.9	9.5	2,356	
日本車輛製造	—	29	8,033	
三菱ロジスネクスト	10.4	10	11,290	
近畿車輛	1	1.1	2,745	
日産自動車	821	946	1,048,641	
いすゞ自動車	201.7	232.4	349,645	
トヨタ自動車	846.3	975.1	6,802,297	
日野自動車	99.4	114.5	141,522	
三菱自動車工業	256.4	296.9	247,020	
エフテック	4.3	5	6,815	
レシップホールディングス	2.3	2.8	2,430	
GMB	1.5	1.3	2,013	
ファルテック	1.2	1.4	1,723	
武蔵精密工業	8.1	8.6	34,744	
日産車体	30.6	31.3	30,329	
新明和工業	29	34.9	43,590	
極東開発工業	14.4	15	25,935	
日信工業	15.6	16.3	31,817	
トピー工業	5.7	6.6	21,021	
ティラド	27	2.9	10,585	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
曙ブレーキ工業	32.4	36.6	8,052	
タチエス	11.8	13.6	27,499	
NOK	33.7	43.1	91,415	
フタバ産業	22.2	24.4	19,471	
KYB	78	8.3	45,567	
大同メタル工業	8.7	10.1	12,726	
プレス工業	37	42.6	25,517	
ミクニ	9.5	10.2	6,201	
太平洋工業	15.7	16.7	25,333	
ケーヒン	16	18.4	39,707	
河西工業	9.5	9.7	14,482	
アイシン精機	63.7	66	361,680	
富士機工	6.9	—	—	
マツダ	220.8	251.7	352,380	
今仙電機製作所	6.4	7.3	9,285	
本田技研工業	626.4	721.8	2,551,563	
スズキ	138	159	1,005,675	
SUBARU	216.1	249	859,299	
安永	4.1	3.9	7,866	
ヤマハ発動機	98.4	113.3	364,259	
ショーワ	18.6	20.8	42,473	
TBK	9	9.3	4,994	
エクセディ	9.5	9.7	34,580	
豊田合成	22.5	29.1	81,159	
愛三工業	12.2	14.1	14,847	
盟和産業	1.1	1.2	1,562	
日本ブラスト	—	4.3	4,472	
ヨロズ	6.5	8	14,400	
エフ・シー・シー	11.4	13.1	40,741	
シマノ	28.1	32.3	504,849	
テイ・エス テック	16.2	18.6	89,559	
ジャムコ	4.3	4	8,816	
精密機器(1.7%)				
テルモ	106.7	122.9	777,957	
クリエートメディック	2.3	2.6	3,840	
日機装	24.1	27.8	32,998	
島津製作所	89.6	95.9	289,138	
JMS	13	7.3	4,818	
長野計器	5.5	6.2	8,537	
ブイ・テクノロジー	1.4	1.9	47,044	
東京計器	24	5	6,530	
愛知時計電機	0.9	1.1	4,422	
インターアクション	2.6	4.2	5,464	
オーバル	6.9	7.7	2,594	
東京精密	13.5	14.5	62,640	
マニー	8.5	9.8	49,392	
ニコン	121.3	139.8	251,500	
トプコン	35.1	43.1	84,562	
オリンパス	111.1	119.5	457,087	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
理研計器	6.2	7.7	20,212	
タムロン	6.2	6.5	14,124	
HOYA	143.2	161.5	1,035,699	
シード	0.9	1.1	7,832	
ノーリツ銅機	7.1	8.1	15,867	
エー・アンド・デイ	6.4	7.2	7,711	
シチズン時計	76.2	95.8	71,945	
リズム時計工業	28	3.1	7,526	
大研医器	6.2	7	5,271	
メニコン	4.8	11	31,944	
シンシア	—	0.7	459	
松風	3.7	3.9	5,588	
セイコーホールディングス	49	12.4	33,628	
ニプロ	48.2	55.5	74,314	
その他製品(2.2%)				
中本バックス	—	2	3,554	
スノーピーク	1.1	2.4	3,609	
パラマウントベッドホールディングス	6.7	8.5	43,180	
トランザクション	3.1	4.3	4,239	
SHO-BI	2.3	2.6	1,110	
ニホンフラッシュ	3.2	3.7	11,729	
前田工織	7	8.8	16,799	
永大産業	9	10.3	5,623	
アートネイチャー	7.4	8.6	6,243	
ダンロップスポーツ	4.4	—	—	
バンダイナムコホールディングス	76.8	82.9	367,661	
アイフィスジャパン	1.6	1.7	1,234	
共立印刷	11.6	13	4,888	
SHOEI	3.1	3.9	16,848	
フランスベッドホールディングス	8.7	9.5	9,433	
パイロットコーポレーション	12.1	14	81,060	
萩原工業	1.9	4.4	8,294	
トッパン・フォームズ	12.4	17.1	20,349	
フジールインターナショナル	15.6	18	76,590	
タカラトミー	27.1	33.6	33,566	
廣済堂	7	7.3	4,088	
Asomeエステール	1.9	2.3	1,840	
アーク	29.3	40.1	4,932	
タカノ	3.1	3.5	3,388	
プロネックス	6.5	7.4	9,716	
ホクシン	4.9	5.5	957	
ウッドワン	12	2.7	3,842	
大建工業	4.9	6.3	16,417	
凸版印刷	197	226	203,626	
大日本印刷	201	105	247,905	
図書印刷	9	5.3	5,580	
共同印刷	21	2.5	7,342	
NISSHA	12.1	16.5	37,339	
光村印刷	6	0.7	1,703	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
宝印刷	3.6	4.2	8,118	
アシックス	69.2	79.7	143,061	
ツツミ	2.6	2.5	4,477	
小松ウオール工業	2.4	2.7	6,056	
ヤマハ	46.9	54	309,420	
河合楽器製作所	2.7	2.7	14,526	
クリナップ	8.2	7.3	6,270	
ビジョン	42.1	48.5	259,475	
兼松サステック	7	0.6	1,215	
キングジム	5.8	6.6	7,425	
リンテック	16.5	19.1	59,878	
イトーキ	14.7	16.9	10,883	
任天堂	42.9	49.4	2,094,560	
三菱鉛筆	5.7	13.2	30,201	
タカラスタンダード	14.4	16.5	29,634	
コクヨ	36.2	38.5	81,543	
ナカバヤシ	12	7.7	5,305	
グローブライド	3.4	3.6	13,986	
オカムラ	24.3	27.9	46,844	
美津濃	37	7.9	32,469	
電気・ガス業(1.7%)				
東京電力ホールディングス	590.5	640.3	339,359	
中部電力	229.4	245.4	410,676	
関西電力	284	327.3	519,425	
中国電力	96.2	110.9	160,028	
北陸電力	68.2	78.6	86,695	
東北電力	173.9	187.8	263,483	
四国電力	62.7	72.2	103,968	
九州電力	153.7	177.1	227,219	
北海道電力	65.1	80.4	61,425	
沖縄電力	11.22	16.125	41,586	
電源開発	55.4	63.8	189,868	
エフオン	3.4	3.9	6,360	
イーレックス	8.7	12.7	13,538	
レノバ	—	4	4,920	
東京瓦斯	747	171.1	513,043	
大阪瓦斯	675	155.6	373,440	
東邦瓦斯	174	39.7	140,141	
北海道瓦斯	17	22	6,732	
広島ガス	14.4	16.1	6,101	
西部瓦斯	78	9.7	29,051	
静岡ガス	21.4	22.7	23,857	
メタウォーター	3.9	4.5	13,590	
陸運業(4.3%)				
SBSホールディングス	6.9	7.8	10,155	
東武鉄道	372	84.6	291,447	
相鉄ホールディングス	111	25.7	81,597	
東京急行電鉄	378	217.9	416,189	
京浜急行電鉄	191	109.9	200,347	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
小田急電鉄	111.5	119.3	283,695	
京王電鉄	194	44.8	225,344	
京成電鉄	52.2	55.8	207,576	
富士急行	19	10.9	35,207	
新京成電鉄	9	2.1	4,710	
東日本旅客鉄道	134.7	144.1	1,549,075	
西日本旅客鉄道	67	72.4	572,901	
東海旅客鉄道	57.9	71.8	1,620,885	
西武ホールディングス	96.1	102.2	184,675	
鴻池運輸	9.8	11.2	20,171	
西日本鉄道	84	22.2	64,202	
ハマキョウレックス	4.5	5.7	21,033	
サカイ引越センター	3.2	4.2	26,964	
近鉄グループホールディングス	701	76	338,580	
阪急阪神ホールディングス	87.9	101.3	451,798	
南海電気鉄道	147	36	110,880	
京阪ホールディングス	156	33.8	125,905	
神戸電鉄	17	1.8	7,209	
名古屋鉄道	253	60.5	170,005	
山陽電気鉄道	25	5.8	15,631	
日本通運	259	29.8	244,360	
ヤマトホールディングス	124.5	133.2	413,985	
山九	92	19.5	117,975	
丸運	3.8	4.2	1,457	
丸全昭和運輸	23	27	14,364	
センコーグループホールディングス	32.9	45.5	40,404	
トナミホールディングス	14	1.8	13,878	
ニッコンホールディングス	23.6	28.9	88,145	
日本石油輸送	0.8	0.9	2,893	
福山通運	42	11.1	61,494	
セイノーホールディングス	49.4	56.9	118,750	
エスライン	—	2	2,438	
神奈川中央交通	8	1.9	7,077	
日立物流	14.5	16.7	48,964	
丸和運輸機関	1.7	4	16,140	
C&F ロジホールディングス	7.2	8.2	11,709	
九州旅客鉄道	69.2	63.8	222,981	
S Gホールディングス	—	71.8	181,295	
海運業(0.2%)				
日本郵船	588	63.8	142,210	
商船三井	366	48.2	142,093	
川崎汽船	264	35.3	81,260	
N Sユナイテッド海運	33	3.8	8,067	
飯野海運	37.6	39.7	19,810	
共栄タンカー	10	0.9	1,759	
乾汽船	5.1	5.7	5,540	
空運業(0.6%)				
日本航空	122.3	140.9	610,378	
A N Aホールディングス	1,292	147.5	658,882	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
パスコ	6	7	2,275	
倉庫・運輸関連業(0.2%)				
トランコム	2	2.1	16,737	
日新	28	6.6	17,232	
三菱倉庫	46	26.3	62,541	
三井倉庫ホールディングス	40	43	14,749	
住友倉庫	51	53	37,312	
澁澤倉庫	18	4.1	7,646	
東陽倉庫	11.9	13.4	4,837	
日本トランスシティ	16	18.4	9,476	
ケイヒン	13	1.4	2,307	
中央倉庫	4	4.6	5,386	
川西倉庫	—	1.5	3,045	
安田倉庫	5.4	6.7	6,358	
東洋埠頭	20	2.3	3,953	
宇徳	5.6	6.3	3,162	
上組	83	46.9	110,824	
サンリツ	1.7	1.9	1,489	
キムラユニティ	1.8	2	2,338	
キューソー流通システム	2.2	2.2	6,003	
郵船ロジスティクス	6.4	—	—	
近鉄エクスプレス	12.4	14.3	31,803	
東海運	3.8	4.2	1,633	
エーアイティ	4.3	5.3	6,635	
内外トランスライン	2.1	2.6	4,290	
日本コンセプト	—	1.4	1,986	
情報・通信業(7.3%)				
NEC ネットエスアイ	7.5	8.7	21,863	
システナ	5.5	25.2	29,937	
デジタルアーツ	3.1	3.9	22,581	
新日鉄住金ソリューションズ	11.5	12.2	36,002	
キューブシステム	4	4.6	4,130	
エイジア	—	1.7	2,816	
コア	2.9	3.4	4,947	
ソリトンシステムズ	—	3.5	4,511	
ソフトクリエイトホールディングス	3.3	3.8	6,258	
T I S	22.8	26.3	134,656	
ネオス	2.1	2.6	1,086	
電算システム	2.4	2.8	5,751	
グリー	41.9	42.2	26,459	
コーエーテクモホールディングス	16.3	13.5	29,403	
三菱総合研究所	2.9	3.4	16,643	
ボルテージ	1.3	1.7	1,501	
電算	0.8	0.9	1,994	
AGS	1.7	4.5	3,856	
ファインデックス	5.1	6.5	5,486	
ヒト・コミュニケーションズ	1.6	1.8	3,735	
ブレインパッド	1.5	1.7	5,431	
K L a b	13.1	15	24,930	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ボールドウイン・ビット	5	5.8	11,913	
クルーホールディングス				
イーブクイニシアティブジャパン	1.1	1.3	1,550	
ネクソン	75.5	176.9	314,705	
アイスタイル	14.5	20.1	24,662	
エムアップ	2	2.7	4,444	
エイチーム	4.6	5.4	12,339	
テクノスジャパン	5.3	7.1	6,872	
コロブラ	22.1	25.4	20,269	
モバイルクリエイト	5.1	6.5	2,242	
ブロードリーフ	17	39.1	23,577	
クロス・マーケティンググループ	—	2.4	1,639	
ハーツユナイテッドグループ	3.6	4.2	6,921	
メディアドゥホールディングス	2	2.6	5,330	
ブイキューブ	3.8	—	—	
サイバーリンクス	1.1	1.3	1,452	
ディー・エル・イー	3.1	—	—	
フィックスターズ	1.2	7.5	12,412	
VOYAGE GROUP	3.4	4.2	5,073	
オブティム	1.5	1.4	3,508	
セレス	1.7	2.5	5,332	
ベリサープ	0.8	1.1	3,349	
ティーガイア	6.9	7.9	24,332	
セック	—	1.1	2,865	
日本アジアグループ	7.8	8.1	4,090	
豆蔵ホールディングス	5.1	6	6,426	
テクマトリックス	4.3	4.4	9,600	
プロシップ	—	1.2	3,375	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	144.2	213.8	62,002	
GMOペイメントゲートウェイ	4.8	6.5	76,375	
ザッパラス	3.6	4.1	1,574	
システムリサーチ	0.7	1.1	3,006	
インターネットイニシアティブ	10.1	12.9	28,896	
さくらインターネット	5.6	9.4	7,679	
ヴィンクス	—	2.3	3,054	
GMOクラウド	1.5	1.8	5,324	
SRAホールディングス	3.6	4.2	13,461	
Minoriソリューションズ	1.5	1.6	2,569	
朝日ネット	6.3	7.2	3,866	
eBASE	—	2.1	3,137	
アバント	—	2.2	2,083	
アドソル日進	1.8	3.1	4,783	
フリービット	5.1	5.6	6,165	
コムチュア	1.2	4	13,700	
サイバーコム	1.3	1.5	3,214	
インフォテリア	—	4	4,936	
メディカル・データ・ビジョン	3	6	8,460	
gumi	7.8	9.2	8,666	
ショークース・ティービー	1.1	1.6	2,176	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
モバイルファクトリー	—	2	3,196	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1	3.6	5,004	
PCIホールディングス	1.2	1.4	4,683	
パイブドHD	1.3	1.3	1,301	
アイビーシー	0.7	1.4	2,179	
ネオジャパン	—	1.9	2,812	
オーブントア	0.9	3.2	6,697	
マイネット	—	2.2	2,508	
アカツキ	—	2.1	9,996	
ベネフィットジャパン	—	0.5	639	
Ubicomホールディングス	—	1.3	1,348	
L I N E	15.4	23.8	94,010	
シンクロ・フード	—	2.7	2,435	
オークネット	2.2	3.4	4,579	
AOI TYO Holdings	5.6	6.4	8,428	
マクロミル	8.8	9.9	24,680	
ビーグリー	—	1.8	2,635	
オロ	—	0.8	2,468	
ソルクシーズ	2.7	3.1	4,436	
フェイス	1.8	2.8	3,684	
ハイマックス	0.9	1.1	1,977	
野村総合研究所	51.4	50	271,500	
サイバネットシステム	5.7	6.5	5,811	
C Eホールディングス	1	2.3	1,886	
日本システム技術	—	1.3	1,764	
インテージホールディングス	3.9	9.4	10,763	
東邦システムサイエンス	2.3	2.7	2,351	
ソースネクスト	4.2	11	8,734	
フォーカスシステムズ	3.6	4.5	3,919	
クレスコ	1.6	1.8	6,210	
フジ・メディア・ホールディングス	71.6	82.5	155,430	
オービック	23.7	24.8	232,872	
ジャストシステム	11.1	12.9	30,353	
TDCソフト	3	3.5	5,239	
ヤフー	492.5	567.8	223,145	
トレンドマイクロ	36.4	38.5	234,850	
インフォメーション・ディベロプメント	2	2.5	3,550	
日本オラクル	11	12.8	106,880	
アルファシステムズ	2.3	2.6	5,805	
フューチャー	9.3	10.8	15,141	
CAC Holdings	5.2	5.9	6,318	
ソフトバンク・テクノロジー	3.4	3.3	5,491	
トーセ	1.9	2.2	2,591	
オービックビジネスコンサルタント	3.5	4	32,360	
伊藤忠テクノソリューションズ	15.6	35.9	71,979	
アイティフォー	9	9.5	11,951	
東計電算	1.2	1.4	4,508	
エックスネット	1.3	1.4	1,243	
大塚商会	18.5	47.3	214,032	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
サイボウズ	9.2	10.5	5,817	
ソフトブレイン	9.4	6.3	3,635	
電通国際情報サービス	4.2	4.9	16,243	
デジタルガレージ	13.3	14.2	64,255	
EMシステムズ	2.4	5.4	5,626	
ウェザーニューズ	2.3	2.7	9,396	
C I J	5.8	6.4	4,460	
東洋ビジネスエンジニアリング	0.7	0.9	1,719	
日本エンタープライズ	7.1	8.4	1,864	
WOWOW	3.3	3.8	12,559	
スカラ	4.8	6.4	5,324	
日本コロムビア	2	—	—	
イマジカ・ロボット ホールディングス	5.8	6.8	6,868	
ネットワンシステムズ	29.8	32.2	58,346	
システムソフト	16.4	19	2,679	
アルゴグラフィックス	3.2	3.7	13,671	
マーベラス	11.6	13.3	12,422	
エイベックス	12.7	14.6	22,323	
日本ユニシス	19	21.9	58,823	
兼松エレクトロニクス	4.3	5	17,925	
東京放送ホールディングス	45.3	43.6	101,108	
日本テレビホールディングス	62.7	72.3	138,454	
朝日放送グループホールディングス	6.8	7.8	6,645	
テレビ朝日ホールディングス	18.8	21.7	50,647	
スカパーJ SATホールディングス	44.8	60	29,940	
テレビ東京ホールディングス	5.6	6.5	19,188	
日本BS放送	2.3	2.7	3,950	
ビジョン	1.1	2.1	8,221	
USEN-NEXT HOLDINGS	1.8	—	—	
ワイヤレスゲート	3.2	3.7	6,134	
コネクシオ	6.1	5.6	11,676	
日本通信	57.6	—	—	
クロップス	1.5	1.8	1,567	
日本電信電話	551.5	564.9	2,896,242	
KDDI	679.7	708.8	2,085,998	
光通信	8.3	9.5	185,250	
NTTドコモ	505.7	565.2	1,590,472	
エムティーアイ	9.3	10.5	6,814	
GMOインターネット	25.1	28.7	81,278	
アイドママーケティングコミュニケーション	0.9	1.9	1,352	
カドカワ	19.9	23.1	25,964	
学研ホールディングス	2.3	2.7	13,446	
ゼンリン	9.1	14.3	36,450	
昭文社	4	3.7	2,904	
インプレスホールディングス	5.7	6.4	1,196	
アイネット	3.9	4.5	7,668	
松竹	45	5.2	81,016	
東宝	44.9	51.8	195,286	
東映	26	3	35,550	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
エヌ・ティ・ティ・データ	42.4	244.6	299,879	
ビー・シー・エー	1	1.2	2,120	
ビジネスブレイン太田昭和	1.2	1.4	2,954	
D T S	7.1	8.2	35,670	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	26.5	36.6	189,954	
シーイーシー	4.1	4.7	17,578	
カプコン	16.1	33.8	87,812	
アイ・エス・ビー	1.3	1.6	3,334	
ジャステック	4.4	4.6	5,349	
S C S K	18.7	18.2	90,818	
日本システムウエア	2.3	2.6	6,523	
アイネス	8.7	10.1	11,291	
T K C	6.4	7.2	31,500	
富士ソフト	10.2	10.9	49,268	
N S D	14.6	13	30,979	
コナミホールディングス	31	32.2	165,508	
福井コンピュータホールディングス	2	2.4	4,620	
J B C Cホールディングス	5.8	6.2	6,944	
ミロク情報サービス	6.8	7	21,665	
ソフトバンクグループ	309.3	356.3	2,742,441	
卸売業(4.8%)				
ハウスイ	6	0.6	715	
高千穂交易	2.7	3	3,615	
伊藤忠食品	1.7	2	12,220	
エレマテック	2.8	3.7	9,490	
J A L U X	2.2	2.2	6,485	
あらた	3.1	3.9	26,403	
トーマンデバイス	1	1.2	3,466	
東京エレクトロン デバイス	2.5	2.9	5,834	
フィールズ	5.3	5.9	5,664	
双日	405.7	467.5	185,597	
アルフレッサ ホールディングス	81.3	87.8	244,698	
横浜冷凍	16.2	20.1	21,346	
神栄	9	1.1	1,592	
山下医科器械	0.6	—	—	
ラサ商事	3	3.4	3,260	
ラクーン	4.4	4.8	3,120	
アルコニックス	3.9	8.3	14,815	
神戸物産	3.7	5.1	26,826	
ペッパーフードサービス	—	5.7	29,070	
あい ホールディングス	9.8	12.7	33,299	
ディーブイエックス	2.5	2.8	3,894	
ダイワボウホールディングス	58	6.7	40,334	
マクニカ・富士エレホールディングス	12.7	15.1	28,221	
ラクト・ジャパン	—	1.5	8,235	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	12.9	14.8	16,250	
八洲電機	5.3	6	5,490	
メディアスホールディングス	1.1	4.3	4,618	
U K Cホールディングス	4.4	5.1	10,975	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ジューテックホールディングス	—	1.8	2,070	
大光	—	2	1,650	
OCHIホールディングス	2	2.3	3,486	
TOKAIホールディングス	30.1	41.8	48,697	
Cominix	1.1	1.2	1,101	
三洋貿易	3.8	4.3	9,090	
ビューティガレージ	0.9	1.1	2,614	
ウイン・パートナーズ	5	5.6	7,896	
ミタチ産業	1.6	1.8	1,904	
シップヘルスケアホールディングス	13.2	16.5	66,247	
明治電機工業	2.4	2.7	5,578	
デリカフーズホールディングス	1.5	1.5	2,350	
スターティアホールディングス	1.6	1.8	1,321	
コメダホールディングス	12.4	14.6	31,054	
富士興産	2.5	3	1,821	
協栄産業	8	1	2,100	
小野建	6	7	12,971	
佐島電機	5.1	5.7	5,871	
エコートレーディング	1.6	1.8	1,292	
伯東	4.7	4.8	8,409	
コンドーテック	5.5	6.2	6,051	
中山福	4	4.4	3,185	
ナガイレーバン	9.1	11.4	32,410	
三菱食品	7.5	8.7	25,934	
松田産業	5	5.7	9,918	
第一興商	11.2	11.8	61,478	
メディパルホールディングス	68.7	79.2	203,385	
SPK	1.5	1.7	4,775	
萩原電気ホールディングス	2.3	2.8	8,778	
アズワン	5.4	6.2	48,484	
スズデン	2.5	2.7	4,406	
尾家産業	2.2	2.3	3,259	
シモジマ	4.2	4.8	5,577	
ドウシシャ	8.1	8.4	20,798	
小津産業	1.5	1.7	3,808	
高速	4.1	4.6	6,136	
たけびし	2.4	2.7	4,614	
黒田電気	9.4	—	—	
リックス	1.6	1.8	3,879	
丸文	6.1	6.9	6,058	
ハビネット	5.7	5.3	7,658	
橋本総業ホールディングス	1.4	1.6	2,822	
日本ライフライン	7.8	22.5	60,705	
エクセル	2.9	2.9	6,826	
マルカキカイ	2.2	2.6	5,215	
IDOM	18.5	23.9	17,686	
日本エム・ディ・エム	5.2	5.2	5,948	
進和	4.1	4.7	11,576	
エスケイジャパン	1.4	1.9	1,001	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ダイトロン	3.1	3.6	9,046	
シークス	4.9	10.1	21,805	
田中商事	2.1	2.4	1,704	
オーハシテクニカ	3.9	4.4	7,858	
白銅	1.7	2.8	6,244	
伊藤忠商事	503.2	579.7	1,194,182	
丸紅	676.1	649.2	550,911	
高島	12	1.4	3,024	
長瀬産業	41.3	47.6	88,393	
蝶理	4.4	5.1	10,307	
豊田通商	76.5	88.2	333,837	
三共生興	10.4	13.2	5,900	
兼松	146	33.7	56,514	
ツカモトコーポレーション	12	1.4	1,790	
三井物産	621.3	671.1	1,275,425	
日本紙パルプ商事	36	4.1	19,434	
日立ハイテクロジーズ	23.8	27.4	136,452	
カメイ	9	10.3	16,366	
東都水産	1.1	1.2	2,274	
OUGホールディングス	11	1.3	3,598	
スターゼン	2.9	3.1	18,352	
山善	26.4	30.9	34,855	
椿本興業	8	1.8	6,939	
住友商事	432.5	498.3	923,599	
内田洋行	3.2	3.6	11,142	
三菱商事	515.5	554.4	1,680,386	
第一実業	16	3.6	12,114	
キャノンマーケティングジャパン	19.6	22.6	54,375	
西華産業	21	4.8	13,411	
佐藤商事	6.1	7	8,589	
菱洋エレクトロ	6.4	7.4	13,312	
東京産業	6.9	7.7	4,704	
ユアサ商事	6.5	7.5	27,712	
神鋼商事	1.7	1.8	5,652	
小林産業	5.1	5.2	1,835	
阪和興業	69	14.8	69,486	
正栄食品工業	—	4.4	20,130	
カナデン	6.6	7.6	10,883	
菱電商事	11	5.6	10,337	
フルサト工業	3.8	4.3	7,636	
岩谷産業	76	17.5	67,900	
すてきなスイスグループ	29	3.3	4,494	
昭光通商	24	28	2,996	
ニチモウ	10	1.2	2,038	
極東貿易	11	11	5,302	
イワキ	10	11	4,884	
三愛石油	18.4	21.1	34,266	
稲畑産業	16.5	18.9	30,353	
GSIクレオス	17	2.1	3,284	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
明和産業	6.4	7.1	3,542	
ワキタ	14.6	16.8	20,294	
東邦ホールディングス	22	23.4	63,718	
サンゲツ	23.5	26.3	59,701	
ミツウロコグループホールディングス	11.1	11.3	10,203	
シナネンホールディングス	3	3.6	9,518	
伊藤忠エネクス	15.2	17.4	19,609	
サンリオ	21.2	22.2	44,688	
サンワテクノス	4.1	5.1	8,103	
リョーサン	10.2	9.9	39,303	
新光商事	7.5	8.6	15,136	
トーホー	3.1	3.6	9,284	
三信電気	7.6	7.3	15,592	
東陽テクニカ	7.9	9	8,316	
モスフードサービス	9	10.4	34,424	
加賀電子	6.2	7.2	20,469	
ソーダニッカ	7.1	8	5,576	
立花エレテック	4.7	5.4	11,264	
フォーバル	3	3.4	3,015	
PAL TAC	11	11.1	70,929	
三谷産業	7.3	8.4	3,158	
西本Wismettacホールディングス	—	2.1	11,046	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	—	0.6	915	
ヤマタネ	3.4	4	8,328	
丸紅建材リース	7	8	1,912	
日鉄住金物産	6	6.2	36,456	
泉州電業	—	2.6	8,229	
トラスコ中山	15.7	16.4	44,755	
オートバックスセブン	25.4	31.4	62,957	
モリト	5.5	6.2	6,237	
加藤産業	10.7	12.4	47,864	
イノテック	5.9	6.7	9,507	
イエローハット	6.5	7.5	24,450	
J Kホールディングス	6.9	7.8	6,856	
日伝	2.8	6.6	14,031	
北沢産業	5.8	6.4	1,708	
杉本商事	4	4.3	8,557	
因幡電機産業	9.6	10.5	50,820	
バイテックホールディングス	2.8	3.6	8,265	
東テク	—	2.6	7,277	
ミスミグループ本社	77.5	91.8	300,645	
アルテック	5.9	6.6	2,323	
タキヒヨー	10	2.6	6,307	
蔵王産業	1.1	1.3	2,256	
スズケン	31.3	36	178,200	
ジェコス	4.7	5.4	5,805	
ルネサスイーストン	6.3	7.1	4,323	
小売業(5.0%)				
ローソン	21.7	20	143,800	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
サンエー	5.2	6	33,540	
カワチ薬品	5.3	6.2	15,543	
エービーシー・マート	12.5	14.4	99,648	
ハードオフコーポレーション	3.1	3.6	3,985	
アスクル	7.2	6.9	21,976	
ゲオホールディングス	11.6	14.5	23,055	
アダストリア	10.6	12.3	19,643	
ジーフット	4.3	4.9	3,831	
シー・ヴィ・エス・ペリエリア	0.9	—	—	
くらコーポレーション	4.5	4.7	39,151	
キャンドウ	3.6	3.8	6,771	
パルグループホールディングス	3.5	4.1	11,381	
エディオン	26.7	30.7	34,936	
サーラコーポレーション	8.6	13.8	9,177	
ワッツ	2.8	3.2	3,520	
ハローズ	2.3	3	7,677	
あみやき亭	1.3	1.7	8,619	
ひらまつ	9.5	10.9	6,060	
ゲンキー	2.8	—	—	
大黒天物産	1.6	1.9	10,754	
ハニーズホールディングス	6.7	7.7	7,700	
ファーマライズホールディングス	1.7	2	1,354	
アルペン	5.3	6.1	14,682	
ハブ	—	2.1	2,576	
クオール	7.9	8.8	21,084	
ジンズ	4.7	5.4	33,858	
ビックカメラ	39.5	42.1	73,422	
DCMホールディングス	41.7	42.7	46,841	
Monotaro	24.4	28.1	119,144	
東京一番フーズ	1.9	2.1	1,394	
DDホールディングス	1.5	1.8	5,454	
きちり	2	2.3	1,899	
アークランドサービスホールディングス	2.9	6.7	16,589	
J・フロント リテイリング	86.9	94.4	161,896	
ドトール・日レスホールディングス	12	13.9	31,900	
マツモトキヨシホールディングス	13	32.7	176,253	
ブロンコビリー	3.6	4.2	17,808	
スタートトゥデイ	62.7	77.7	296,037	
トレジャー・ファクトリー	2.1	2.5	1,895	
物語コーポレーション	2	2.3	26,496	
ココカラファイン	7.2	8.3	69,637	
三越伊勢丹ホールディングス	136.7	147.8	195,391	
Hamee	2.3	2.3	3,995	
ウエルシアホールディングス	18.1	20.9	123,728	
クリエイトSDホールディングス	10.1	11.7	37,089	
丸善CH Iホールディングス	8	9	3,240	
ミサワ	1.5	—	—	
ティーライフ	1	1.2	1,630	
エー・ピーカンパニー	1.3	1.7	1,224	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
チムニー	2.1	2.5	7,275	
シュッピン	2.7	4.8	7,089	
ネクステージ	2.8	8.5	10,421	
ジョイフル本田	11.2	11.6	44,080	
鳥貴族	2.5	2.9	8,149	
キリン堂ホールディングス	2.4	2.9	9,309	
ホットランド	3.3	4.6	6,320	
すかいらーく	29.5	49.2	79,900	
綿半ホールディングス	2.8	3	10,305	
ヨシックス	1	1.3	4,147	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	22.8	26.3	37,766	
ブックオフコーポレーション	3.9	4.4	3,590	
ゴルフダイジェスト・オンライン	3	3.3	4,395	
BEENOS	1.2	1.9	3,461	
あさひ	5.2	5.9	7,752	
日本調剤	2.5	2.8	8,484	
コスモス薬品	3.5	4	94,320	
トーエル	3.4	3.9	3,974	
一六堂	1.8	2	826	
オンリー	1.1	1.5	1,452	
セブン&アイ・ホールディングス	287.5	331.1	1,620,403	
薬王堂	3.5	3.5	14,140	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	18.5	21.2	30,082	
ツルハホールディングス	13.7	17.1	277,875	
サンマルクホールディングス	4.4	5.7	16,188	
フェリシモ	2	2.1	2,881	
トリドールホールディングス	8.5	9.8	32,487	
TOKYO BASE	0.9	7.1	7,256	
ウイルプラスホールディングス	—	0.9	1,011	
サツドラホールディングス	1	1.4	3,180	
ダイユー・リックホールディングス	2.3	3.8	4,427	
パロックジャパンリミテッド	5.6	6.4	7,142	
クスリのアオキホールディングス	5.5	6.3	49,518	
力の源ホールディングス	—	1.8	3,090	
スシローグローバルホールディングス	6.2	8.7	57,681	
LIXILビバ	—	10.1	19,462	
メディカルシステムネットワーク	8	9.2	4,379	
総合メディカル	3.3	6.9	17,070	
はるやまホールディングス	3.3	3.8	3,921	
ノジマ	10.8	14	37,870	
カップ・クリエイト	9.6	9.7	13,677	
ライトオン	5.8	6.7	6,907	
良品計画	9.1	10.5	390,075	
三城ホールディングス	8.6	9.8	4,909	
アドヴァン	7.1	8.1	8,124	
アルビス	1.8	2.6	9,100	
コナカ	8.9	10.1	5,656	
ハウス オブ ローゼ	0.9	1	1,784	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
G-7ホールディングス	2.1	2.4	6,480	
イオン北海道	7	7.9	6,375	
コジマ	12.1	13.7	6,644	
ヒマラヤ	1.9	2.6	3,023	
コーナン商事	9.8	11.3	30,261	
エコス	2.8	3.3	5,712	
マルシェ	1.6	2.2	1,806	
ドンキホーテホールディングス	44.5	51.2	290,816	
西松屋チェーン	12.1	17.4	20,810	
ゼンショーホールディングス	35.6	41.1	110,024	
幸楽苑ホールディングス	4.4	5	8,710	
ハークスレイ	1.7	2	2,162	
サイゼリヤ	10.2	13.1	33,208	
V Tホールディングス	23.4	27.1	14,254	
魚力	2.2	2.3	3,270	
ボブラ	1.7	2	1,780	
フジ・コーポレーション	1.1	1.4	3,596	
ユナイテッドアローズ	9.2	9.8	39,935	
ハイデイ日高	7.5	10.4	27,466	
京都市もの友禅	4.4	5.2	3,395	
コロワイド	22.8	26.3	80,478	
ピーシーデポコーポレーション	9.4	12	7,236	
壱番屋	4.8	5.6	25,900	
トップカルチャー	2.6	3.1	1,512	
P L A N T	1.6	1.9	2,519	
スギホールディングス	15.1	17.4	113,274	
ヴィア・ホールディングス	5.3	9.4	6,636	
スクロール	10.6	12.2	7,271	
ヨンドシーホールディングス	7	8.1	22,647	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	30.2	25.3	288,673	
木曽路	8.4	9.7	28,324	
S R Sホールディングス	8.1	9.5	9,367	
千趣会	12.5	—	—	
タカキュー	6	6.7	1,433	
ケーヨー	11.8	14.4	7,747	
上新電機	16	9.4	37,788	
日本瓦斯	12.6	14.5	82,940	
ベスト電器	22.7	—	—	
ロイヤルホールディングス	11.3	14.1	41,792	
いなげや	7.7	8.7	15,677	
島忠	17.8	17.9	60,681	
チヨダ	8.1	9.4	24,524	
ライフコーポレーション	5.4	6	17,016	
リンガーハット	7.7	9.8	25,676	
M r M a x H D	8.8	10.1	6,797	
テンアライド	6.3	7.1	3,351	
A O K Iホールディングス	13.7	15.9	27,904	
オークワ	10	11	11,913	
コメリ	10.6	12.2	34,757	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
青山商事	14.4	15.2	59,812	
しまむら	8	9.2	104,144	
はせがわ	3.8	4.4	2,138	
高島屋	115	124	112,592	
松屋	15.7	15.9	22,911	
エイチ・ツー・オー リテイリング	35.2	37.5	70,050	
近鉄百貨店	26	3.1	12,586	
パルコ	6.6	7.6	10,032	
丸井グループ	72.6	75.7	167,599	
アクシアル リテイリング	5.3	6.6	27,192	
イオン	282.7	304	663,328	
イズミ	13.7	14.3	96,668	
東武ストア	0.8	1	3,060	
平和堂	13.9	16.1	42,987	
フジ	7.6	9.5	21,470	
ヤオコー	7.8	9	52,740	
ゼビオホールディングス	9.3	10.7	19,345	
ケーズホールディングス	29.1	69.4	94,592	
O l y m p i c グループ	4.3	4.8	2,798	
日産東京販売ホールディングス	10.4	11.7	4,375	
Genky DrugStores	—	3.3	14,388	
アインホールディングス	9	10.6	81,832	
元気寿司	1.7	2	6,350	
ヤマダ電機	229.8	265	151,315	
アークランドサカモト	11.7	13.5	23,692	
ニトリホールディングス	29.7	31.4	596,129	
グルメ杵屋	5	6	7,122	
愛眼	5	6.1	2,793	
ケユーホールディングス	3.6	4.2	4,351	
吉野家ホールディングス	24	26	54,990	
松屋フーズ	3.3	3.8	14,269	
サガミチェーン	8.6	10.7	15,001	
関西スーパーマーケット	5.7	6	7,140	
王将フードサービス	5	5.8	34,278	
ブレナス	7.7	8.8	16,579	
ミニストップ	5.1	5.9	13,162	
アークス	12.9	14.9	44,476	
パローホールディングス	14.8	18.4	48,428	
藤久	0.6	0.7	1,115	
ベルク	3.1	3.5	20,055	
大庄	3.7	4.3	7,507	
ファーストリテイリング	11.5	10.6	507,952	
サンドラッグ	26.1	33.5	169,845	
サックスパー ホールディングス	6.6	7.5	7,965	
ヤマザワ	1.4	1.7	3,082	
やまや	1.5	1.7	6,137	
ペルーナ	14.8	19.4	28,033	
銀行業(6.9%)				
島根銀行	1.4	1.6	2,056	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
じもとホールディングス	49.4	52.5	9,712	
めぶきフィナンシャルグループ	331.3	411.1	165,262	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9.9	10.7	26,910	
九州フィナンシャルグループ	112.7	129.8	68,404	
ゆうちょ銀行	194.5	224.1	315,084	
富山第一銀行	17.5	19.8	9,820	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	445.3	472.4	290,998	
西日本フィナンシャルホールディングス	46.6	52.8	69,643	
関西みらいフィナンシャルグループ	—	34.4	29,205	
三十三フィナンシャルグループ	—	6.7	14,920	
新生銀行	654	68.5	120,971	
あおぞら銀行	435	47.1	205,120	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,206	5,538.4	3,789,927	
りそなホールディングス	803.7	868.2	533,682	
三井住友トラスト・ホールディングス	143.4	155.5	715,766	
三井住友フィナンシャルグループ	550.1	598.8	2,726,336	
第四銀行	84	9.7	44,911	
北越銀行	7.4	7.9	18,280	
千葉銀行	265	280.2	236,488	
群馬銀行	152.7	160.7	101,723	
武蔵野銀行	11	12.6	44,793	
千葉興業銀行	18.7	21.7	10,763	
筑波銀行	28.6	32.7	9,711	
七十七銀行	108	24.8	61,504	
青森銀行	53	6.1	20,099	
秋田銀行	44	5.1	15,453	
山形銀行	39	8.9	21,796	
岩手銀行	4.5	5.5	23,430	
東邦銀行	61	70.7	28,987	
東北銀行	35	4	5,596	
みちのく銀行	41	5	8,715	
ふくおかフィナンシャルグループ	279	321	184,575	
静岡銀行	181	208.9	220,598	
十六銀行	92	10.6	30,994	
スルガ銀行	70.2	80.9	99,587	
八十二銀行	132.6	143.2	70,597	
山梨中央銀行	43	49	22,393	
大垣共立銀行	106	12.5	35,562	
福井銀行	59	6.8	15,742	
北國銀行	73	9	39,555	
清水銀行	2.3	2.7	6,331	
富山銀行	1.3	1.5	6,195	
滋賀銀行	65	74	42,254	
南都銀行	6.6	9.3	26,904	
百五銀行	62	75.6	35,305	
京都銀行	123	30.2	174,254	
紀陽銀行	25.8	29.8	55,457	
三重銀行	3.1	—	—	
ほくほくフィナンシャルグループ	45.7	52.7	83,213	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
広島銀行	203	116.8	92,972	
山陰合同銀行	40.7	46.9	48,166	
中国銀行	48.7	54.7	68,922	
鳥取銀行	2.2	2.5	4,310	
伊予銀行	98	112.9	87,271	
百十四銀行	75	84	30,660	
四国銀行	53	12	17,448	
阿波銀行	59	63	44,226	
大分銀行	39	4.6	18,170	
宮崎銀行	46	5.3	18,179	
佐賀銀行	42	4.8	11,448	
十八銀行	42	49	14,700	
沖縄銀行	6.7	7.7	33,418	
琉球銀行	14.1	15.3	25,902	
セブン銀行	257.5	296.7	101,768	
みずほフィナンシャルグループ	9,327.7	10,748.6	2,078,779	
高知銀行	25	2.8	3,536	
山口フィナンシャルグループ	64	99	133,353	
長野銀行	2.3	2.6	4,739	
名古屋銀行	5.6	6.4	25,056	
北洋銀行	112.1	119.3	44,856	
愛知銀行	2.3	2.7	13,770	
第三銀行	3.9	—	—	
中京銀行	2.8	3.2	7,388	
大光銀行	24	2.7	6,085	
愛媛銀行	8.7	10.9	13,755	
トマト銀行	2.7	3	4,542	
みなと銀行	6.2	—	—	
京葉銀行	56	70	34,580	
関西アーバン銀行	9.6	—	—	
栃木銀行	37.9	40.7	16,402	
北日本銀行	2.1	2.5	7,075	
東和銀行	129	13.9	17,750	
福島銀行	75	7.3	5,095	
大東銀行	36	3.7	4,706	
トモニホールディングス	56.6	65.2	31,622	
フィデアホールディングス	66.3	76.8	14,054	
池田泉州ホールディングス	72.9	83.6	33,105	
証券・商品先物取引業(0.9%)				
F P G	25.2	27.2	39,059	
マーキュリアインベストメント	—	2.3	2,431	
S B I ホールディングス	77.7	89.5	265,636	
ジャフコ	11.5	11.4	52,611	
大和証券グループ本社	624	677	437,003	
野村ホールディングス	1,404.6	1,361.3	785,606	
岡三証券グループ	59	68	38,488	
丸三証券	21.9	25.2	25,628	
東洋証券	25	29	7,975	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	78.9	87.8	64,533	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
光世証券	20	2	2,770	
水戸証券	21.4	24.2	9,752	
いちよし証券	15.4	16.6	21,480	
松井証券	39.3	38.9	40,456	
だいの証券ビジネス	4.4	4	2,360	
マネックスグループ	74.8	82.7	52,266	
カブドットコム証券	51.1	50.7	19,975	
極東証券	9.2	10.7	15,964	
岩井コスモホールディングス	6.5	8.1	11,793	
藍澤證券	12.9	15	11,820	
マナーパートナーズグループ	9.6	10.2	5,202	
保険業(2.3%)				
かんぽ生命保険	25.9	29.9	74,690	
SOMPOホールディングス	143.6	155.2	737,665	
アニコム ホールディングス	4.7	5.4	22,437	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	205.3	206.8	732,072	
ソニーフィナンシャルホールディングス	65.8	65	133,640	
第一生命ホールディングス	414.3	447.5	933,261	
東京海上ホールディングス	276.7	298	1,571,652	
アドバンテッジリスクマネジメント	—	2.5	2,917	
T & Dホールディングス	250.4	244.7	436,177	
アドバンスクリエイト	1.6	1.8	3,879	
その他金融業(1.2%)				
全国保証	19.3	22.3	116,183	
ジェイリース	—	1.5	1,005	
イントラスト	—	1.6	1,251	
アルヒ	—	8.9	15,121	
クレディセゾン	52.1	60	110,280	
アクリーティブ	5.6	4.2	1,302	
芙蓉総合リース	7.9	9.1	71,253	
興銀リース	12.9	14.9	46,264	
東京センチュリー	13.8	15.9	106,689	
日本証券金融	30.3	32.2	20,704	
アイフル	115.2	132.8	48,073	
ポケットカード	5.2	—	—	
リコリース	5.4	6.2	22,320	
イオンフィナンシャルサービス	43.9	56.2	144,040	
アコム	138	159	74,094	
ジャックス	38	9.6	23,731	
オリエントコーポレーション	148.5	170.3	26,055	
日立キャピタル	16.2	21.8	63,808	
アプラスフィナンシャル	33	37	4,107	
オリックス	486.5	527.7	978,619	
三菱UFJリース	174.3	200.8	131,524	
九州リースサービス	—	3.3	2,537	
日本取引所グループ	213.6	227.1	477,364	
イー・ギャランティ	2	4.2	9,445	
アサックス	1.2	1.1	2,158	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
NECキャピタルソリューション	2.8	3.2	6,435	
不動産業(2.4%)				
いちご	65.3	113.2	55,241	
日本駐車場開発	82.4	95.2	17,326	
ヒューリック	143.3	165.2	189,484	
三栄建築設計	2.8	3.2	6,195	
スター・マイカ	—	3.8	8,895	
野村不動産ホールディングス	45.7	52.7	136,018	
三重交通グループホールディングス	12.2	16.1	8,066	
サムティ	5.5	6.8	13,912	
ディア・ライフ	6.1	8.8	4,540	
コーセーアールイー	—	1.8	1,645	
エー・ディー・ワークス	69.4	103.2	4,231	
日本商業開発	3.9	4.4	7,788	
プレサンスコーポレーション	10.7	10.9	18,769	
ユニゾホールディングス	5.7	10.9	23,456	
THEグローバル社	3.2	3.7	3,100	
日本管理センター	5.2	5.2	7,581	
サンセイランディック	1.7	2.3	2,810	
エストラスト	1.6	1.1	1,042	
フージャースホールディングス	8.9	19.3	15,459	
オープンハウス	11.2	12.9	84,495	
東急不動産ホールディングス	166.2	191.6	153,088	
飯田グループホールディングス	57.3	66	138,534	
イーグランド	—	1.3	1,537	
ムゲンエステート	3.2	4.8	5,505	
ビーロット	—	1.2	2,310	
ファーストブラザーズ	1	2.2	3,198	
ハウスドゥ	1.1	1.3	7,124	
シーアールイー	1.1	1.3	2,380	
ケイアイスター不動産	2.1	2.9	7,954	
パーク24	34.9	44.2	131,981	
バラカ	2.2	2.5	6,022	
三井不動産	364.3	395	1,097,705	
三菱地所	511	588.9	1,161,310	
平和不動産	13	14	31,374	
東京建物	79.7	86.5	130,615	
ダイビル	17.7	20.3	23,649	
京阪神ビルディング	11.4	13.2	11,827	
住友不動産	165	190	792,300	
大京	128	12.6	32,646	
テオオーシー	26.8	27.2	23,691	
東京楽天地	11	1.3	7,527	
レオパレス21	86.7	94.4	77,785	
スターツコーポレーション	9.3	10.8	30,423	
フジ住宅	8.8	10	9,810	
空港施設	8.3	8.1	5,151	
明和地所	3.8	4.3	3,091	
ゴールドクレスト	6.2	6.3	12,688	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
日本エスリード	2.7	3.1	6,457	
日神不動産	8.1	10.4	7,716	
日本エスコン	11.9	14.3	9,967	
タカラレーベン	29.5	37	15,429	
サンヨーハウジング名古屋	3.7	4.4	5,420	
イオンモール	44.2	51	106,029	
ファースト住建	2.6	2.9	4,379	
カチタス	—	10.8	41,742	
トーセイ	9.4	9.7	13,085	
穴吹興産	0.7	0.9	3,033	
エヌ・ティ・ティ都市開発	42.7	49.2	55,792	
サンフロンティア不動産	7.4	9.6	12,556	
エフ・ジェー・ネクスト	6.6	6	5,718	
インテリックス	2.1	2.3	2,421	
ランドビジネス	4.1	4.6	1,564	
グランディハウス	6	6.8	3,413	
日本空港ビルデング	21.9	23.1	120,120	
サービス業(4.5%)				
日本工営	4.9	5.2	15,730	
L I F U L L	17.9	26.6	20,987	
ジェイエイシーリクルートメント	4.5	6.2	13,057	
日本M&Aセンター	21	53.1	193,284	
メンバーズ	—	2.6	3,195	
中広	0.9	0.9	709	
タケエイ	6.5	7.9	9,495	
トラスト・テック	3	3.6	11,556	
コシダカホールディングス	3.5	20.4	33,129	
パソナグループ	5.5	7.2	12,045	
C D S	1.8	2.1	3,179	
リンクアンドモチベーション	17.3	14.1	20,078	
G C A	6.6	8.7	8,299	
エス・エム・エス	10.3	15.2	63,536	
パーソルホールディングス	56.3	70.8	167,088	
リニカル	4.3	5	9,875	
クックパッド	16.2	24.2	14,229	
エスクリ	3	2.8	2,455	
アイ・ケイ・ケイ	3.4	4.5	3,649	
学情	3.1	3.5	4,749	
スタジオアリス	3	3.9	9,870	
シミックホールディングス	3.8	4.3	9,404	
N J S	1.7	1.9	3,389	
総合警備保障	26.5	30.5	153,110	
カカコム	51.9	57.7	135,710	
アイロムグループ	2.2	2.6	5,114	
セントケア・ホールディング	1.1	3.3	2,296	
サイネックス	0.8	1.2	1,028	
ルネサンス	3.8	3.8	8,789	
ディップ	9.4	10.8	29,149	
オプトホールディング	5.4	5.3	9,269	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
ツクイ	17.5	18.2	15,524	
キャリアデザインセンター	1.6	2	4,458	
エムスリー	63	80.7	377,272	
ツカダ・グローバルホールディング	5.6	6.1	3,775	
プラス	—	0.5	424	
アウトソーシング	4.7	22.9	47,906	
ウェルネット	5.5	7.7	9,802	
ワールドホールディングス	2.3	2.6	9,464	
ディー・エヌ・エー	32.6	41.4	86,815	
博報堂DYホールディングス	100.8	106.6	180,260	
ぐるなび	10.5	12.2	11,236	
エスアールジータカミヤ	8.1	9	5,958	
ジャパンベストレスキューシステム	8.3	9.3	8,286	
ファンコミュニケーションズ	18.5	21.4	15,664	
ライク	1.4	3.1	6,584	
ビジネス・ブレイクスルー	3.6	3.7	1,687	
WDBホールディングス	2.6	3.5	10,832	
ティア	3.7	4.1	4,374	
CDG	0.6	0.7	1,299	
バリューコマース	6.8	6.8	10,213	
インフォマート	30.7	38.9	41,623	
J Pホールディングス	21.4	24.4	9,467	
E P Sホールディングス	10	11.6	26,007	
レッグス	1.8	2	1,962	
プレステージ・インターナショナル	13.8	15.9	25,567	
アミューズ	4.1	5.1	15,376	
ドリームインキュベータ	2.3	2.6	5,964	
クイック	3.8	4.7	7,985	
T A C	5.3	4.8	1,521	
ケネディクス	92.4	101.7	70,884	
電通	81	93.4	489,416	
テイクアンドギヴ・ニーズ	3.6	3.6	5,486	
びあ	2.2	2.6	15,496	
イオンファンタジー	2.2	2.5	17,525	
シーティーエス	4.1	7.6	6,946	
ネクシィーズグループ	2.7	3	4,821	
みらかホールディングス	18.6	22.9	81,066	
アルプス技研	2.9	6.8	15,572	
ダイオーズ	1.4	1.6	2,075	
日本空調サービス	7.2	8	6,448	
オリエンタルランド	78.6	90.6	1,012,908	
ダスキン	17.9	20.7	55,248	
明光ネットワークジャパン	8.4	9.8	12,475	
ファルコホールディングス	3.5	4	7,532	
ラウンドワン	22.8	23.8	45,838	
リゾートトラスト	28.2	32.5	66,137	
ビー・エム・エル	9.5	9.9	27,324	
ワタベウエディング	1.3	1.4	768	
りらいあコミュニケーションズ	12	12.2	18,800	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
リソー教育	12.5	12.9	10,926	
早稲田アカデミー	1	1.1	2,381	
ユー・エス・エス	88	93.7	195,833	
東京個別指導学院	2.4	2.8	3,270	
サイバーエージェント	43.7	47.2	276,592	
楽天	371.6	393.1	286,098	
クリーク・アンド・リバー社	3.5	4	4,628	
テー・オー・ダブリュー	5.9	7.3	6,577	
セントラルスポーツ	2.5	2.9	12,006	
フルキャストホールディングス	7.6	6.7	18,431	
リソルホールディングス	8	0.9	4,045	
テクノプロ・ホールディングス	11.9	14.5	101,645	
アトラ	1.4	1.4	1,204	
インターワークス	1.6	1.8	1,825	
Keepers 技研	1.1	2.5	3,325	
ファーストロジック	0.5	1.6	1,305	
三機サービス	—	1.2	2,169	
Gunosy	—	4.6	7,613	
デザインワン・ジャパン	1.3	1.6	2,020	
イー・ガーディアン	3.4	3.9	12,285	
リブセンス	5	5	2,675	
ジャパンマテリアル	5.3	20.9	35,780	
ベクトル	5.9	9.3	20,283	
ウチヤマホールディングス	3.6	3.9	2,215	
ライクキッズネクスト	0.9	1.4	1,568	
キャリアリンク	2	2.6	1,492	
I B J	5.8	6.2	3,992	
アサンテ	2.7	2.8	6,176	
N・フィールド	3.5	4.3	6,935	
バリューHR	0.8	1.8	3,547	
M&Aキャピタルパートナーズ	1.2	2	21,340	
ライドオンエクスプレスホールディングス	1.9	3.2	3,824	
ERIホールディングス	2.1	2.2	2,299	
アビスト	1	1.2	5,952	
シグマクシス	—	4.1	6,248	
ウィルグループ	3.1	3.3	3,656	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1.7	10.5	4,735	
日本ビューホテル	1.6	2.5	3,740	
リクルートホールディングス	158.8	591.3	1,760,891	
エラン	1	1.9	4,434	
土木管理総合試験所	1.2	2.5	1,485	
日本郵政	189.7	435	548,970	
ベルシステム24ホールディングス	11.4	12.9	23,813	
鎌倉新書	—	1.4	4,865	
一蔵	0.9	1.1	906	
L I T A L I C O	0.9	1.8	2,971	
グローバルグループ	—	0.9	1,435	
エボラブルアジア	1.4	2.2	4,809	
ストライク	—	2	7,940	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ソラスト	4.7	4.7	16,520	
セラク	—	1.8	1,452	
インソース	—	2.6	6,474	
キャリアインデックス	—	1.1	3,652	
MS-Japan	—	0.8	6,224	
船場	—	1.5	1,776	
フルテック	—	0.9	1,035	
グリーンズ	—	1.7	2,786	
日総工産	—	1.3	6,877	
キュービernetホールディングス	—	3.8	6,372	
リログループ	36.4	41.9	118,241	
東祥	2.1	4.8	19,248	
エイチ・アイ・エス	11.9	12	45,420	
ラックランド	1.4	1.5	4,069	
共立メンテナンス	11.8	13.7	77,268	
イチネンホールディングス	7.6	8.7	12,623	
建設技術研究所	4.7	5.3	7,647	
スペース	3.9	5	7,365	
長大	—	3.2	2,864	
燦ホールディングス	1.5	1.9	5,166	
スバル興業	5	0.5	3,415	
東京テアトル	28	3.2	4,630	
タナベ経営	1.5	1.5	3,189	
ナガワ	1.3	1.6	7,360	
よみうりランド	15	1.7	8,253	
東京都競馬	50	5.8	27,463	
カナモト	10.2	11.7	43,992	
東京ドーム	29.2	31	32,612	
西尾レントオール	5.9	7.8	27,963	
トランス・コスモス	8.4	8.5	22,763	
乃村工芸社	15.6	18	41,652	
藤田観光	24	3.1	10,726	
KNT-CTホールディングス	41	4.7	7,317	
日本管財	6.2	8.3	18,094	
トーカイ	3.2	7.5	17,182	
白洋舎	0.8	0.9	3,150	
セコム	75.6	81.3	667,147	
セントラル警備保障	3.3	3.7	15,965	
丹青社	12.6	15.7	20,990	
メイテック	8.4	9	46,530	
アサツー ディ・ケイ	11.8	—	—	
応用地質	6.9	8.5	12,384	
船井総研ホールディングス	9.2	16	42,672	
進学会ホールディングス	3.1	3.6	2,332	
オオバ	6	6.3	3,874	
いであ	1.4	1.6	1,796	
学究社	2	2.8	5,093	

銘柄	株 数 (千株)	当 期 末		
		株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ベネッセホールディングス	24.4	28.1	114,507	
イオンディライト	8.2	9.5	37,240	
ナック	4.6	5.2	4,763	
ニチイ学館	12.8	14.6	17,607	
ダイセキ	12.7	12.9	45,537	
ステップ	2.5	2.8	4,978	
合 計	株 数・金 額 銘柄数<比率>	104,942 1,967	96,800 2,036	202,081,921 <98.1%>

(注1)銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2)合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄 別	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内 T O P I X	3,728	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	202,081,921	97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,976,889	2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	207,058,810	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 2018年5月29日現在
(A)資 産	207,035,100,500円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,175,551,739
株 式(評価額)	202,081,921,965
未 収 入 金	51,723,180
未 収 配 当 金	1,712,209,616
差 入 委 託 証 拠 金	13,694,000
(B)負 債	1,088,120,042
未 払 金	1,010,251,520
未 払 解 約 金	77,842,573
未 払 利 息	8,446
そ の 他 未 払 費 用	17,503
(C)純 資 産 総 額(A-B)	205,946,980,458
元 本	130,081,844,048
次 期 繰 越 損 益 金	75,865,136,410
(D)受 益 権 総 口 数	130,081,844,048口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,832円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2017年5月30日 至 2018年5月29日
(A)配 当 等 収 益	3,845,600,463円
受 取 配 当 金	3,845,501,421
受 取 利 息	2,068
そ の 他 収 益 金	1,753,666
支 払 利 息	△1,656,692
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	19,811,036,421
売 買 益	25,288,428,768
売 買 損	△5,477,392,347
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	377,137,180
取 引 益	696,551,440
取 引 損	△319,414,260
(D)そ の 他 費 用	△45,492
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	24,033,728,572
(F)前 期 繰 越 損 益 金	44,831,635,370
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	17,484,151,373
(H)解 約 差 損 益 金	△10,484,378,905
(I)計 (E+F+G+H)	75,865,136,410
次 期 繰 越 損 益 金(I)	75,865,136,410

(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117,609,049,928円、期中追加設定元本額は32,218,633,180円、期中一部解約元本額は19,745,839,060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。

FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	23,101,164,394円
DCマイセクション50	16,533,462,034円
DCマイセクション75	15,590,958,858円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,051,654,129円
DCマイセクションS50	6,491,528,209円
日本株式インデックス・オープン	6,009,399,934円
DCマイセクション25	5,667,983,975円
DC日本株式インデックス・オープンS	5,228,558,829円
DC日本株式インデックス・オープン	5,120,582,586円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,831,996,941円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,446,165,110円
DCマイセクションS75	4,341,117,145円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,704,270,443円
DCマイセクションS25	2,185,901,026円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,063,412,711円
世界経済インデックスファンド	1,896,980,506円
DC世界経済インデックスファンド	1,458,402,232円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,425,279,471円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,064,266,863円
FOFs用 日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,015,769,836円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	876,071,255円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	781,153,449円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	665,252,251円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	657,443,694円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	644,420,447円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	637,789,988円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	556,921,840円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	509,249,118円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	486,053,319円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	373,327,248円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	372,662,220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)	360,509,882円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	347,726,576円
グローバル経済コア	308,133,129円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	228,922,898円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	196,049,678円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	158,870,768円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	136,772,816円
SMT インデックスバランス・オープン	85,365,604円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	76,747,493円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	75,211,851円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	71,637,151円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	59,871,027円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	44,608,609円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	41,419,107円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	33,817,058円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	24,210,316円
SBI資産設計オープン(分配型)	15,717,965円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	12,391,876円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	4,837,553円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	4,076,780円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,680,266円
SMT 世界経済インデックス・オープン	2,214,958円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	701,526円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	149,100円

お知らせ

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

(変更日:2017年10月2日)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商 品 分 類	追加型投信／国内／債券／インデックス型	
信 託 期 間	信託期間は2016年2月3日から2026年3月9日までです。	
運 用 方 針	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	FOFs用 国内債券 インデックス・ファンドP (適格機関投資家専用)	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。
組 入 制 限	FOFs用 国内債券 インデックス・ファンドP (適格機関投資家専用)	外貨建資産への投資は行いま 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。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配 を行います。 (1) 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。 (2) 分配金額については、委託者が基準価額水準、市 況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対 象額が少額の場合には分配を行わないことがあ ります。	

FOFs用 国内債券インデックス・ ファンドP(適格機関投資家専用)

運 用 報 告 書 (全 体 版)

第11期 (決算日 2018年3月7日)
第12期 (決算日 2018年5月7日)
第13期 (決算日 2018年7月9日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
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/>
スマートフォンサイト <http://s.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

<610057>

【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。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・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。

設定以来の運用実績

作成期	決 算 期	基 準 価 額			ベンチマーク		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
		(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率			
第1	設定日(2016年 2月 3日)	円 10,000	円 —	% —	10,000	% —	% —	% —	百万円 0.5
	第1期(2016年 7月 7日)	10,482	28	5.1	10,514	5.1	99.4	0.3	6,780
第2	第2期(2016年 9月 7日)	10,234	12	△2.3	10,277	△2.3	99.5	0.1	7,070
	第3期(2016年11月 7日)	10,208	11	△0.1	10,266	△0.1	99.4	—	6,882
	第4期(2017年 1月10日)	10,056	11	△1.4	10,125	△1.4	99.6	0.0	6,691
第3	第5期(2017年 3月 7日)	10,020	10	△0.3	10,101	△0.2	99.6	—	7,593
	第6期(2017年 5月 8日)	10,040	11	0.3	10,133	0.3	99.7	—	9,310
	第7期(2017年 7月 7日)	9,978	10	△0.5	10,084	△0.5	99.7	0.0	12,625
第4	第8期(2017年 9月 7日)	10,041	11	0.7	10,160	0.8	99.6	—	18,901
	第9期(2017年11月 7日)	10,025	9	△0.1	10,155	△0.0	99.6	—	26,005
	第10期(2018年 1月 9日)	9,999	9	△0.2	10,141	△0.1	99.8	—	35,200
第5	第11期(2018年 3月 7日)	10,034	10	0.5	10,187	0.5	99.6	—	41,876
	第12期(2018年 5月 7日)	10,036	9	0.1	10,200	0.1	99.6	0.0	48,104
	第13期(2018年 7月 9日)	10,056	10	0.3	10,234	0.3	99.7	—	60,225

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 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。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

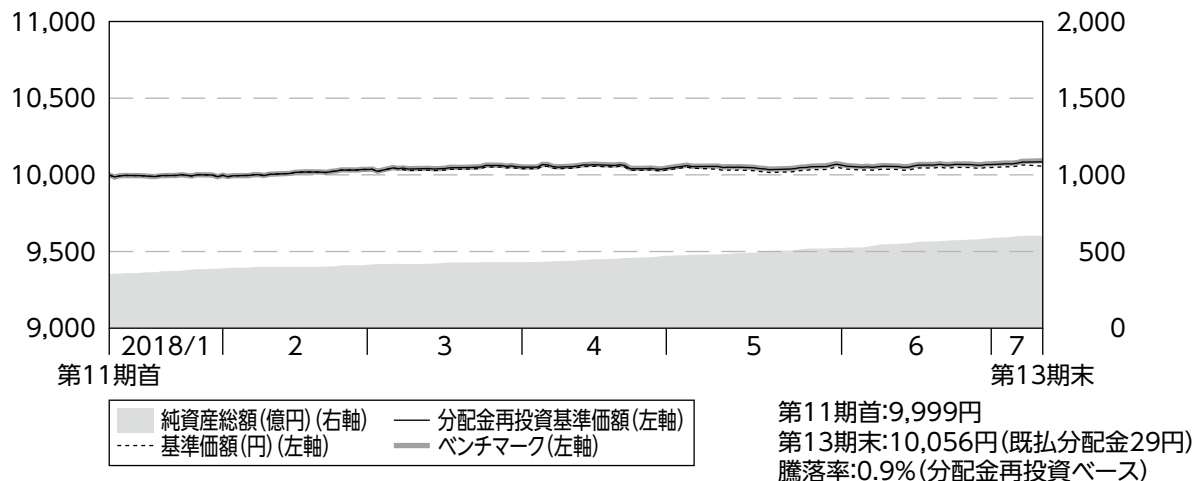
当作成期中の基準価額と市況の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		債 券 組入比率	債券先物 比 率
			騰 落 率		騰 落 率		
第11期	(期 首)2018年1月9日	円 9,999	% —	10,141	% —	% 99.8	% —
	1月末	9,997	△0.0	10,139	△0.0	99.6	—
	2月末	10,035	0.4	10,177	0.4	99.6	—
	(期 末)2018年3月7日	10,044	0.5	10,187	0.5	99.6	—
第12期	(期 首)2018年3月7日	10,034	—	10,187	—	99.6	—
	3月末	10,040	0.1	10,194	0.1	99.7	—
	4月末	10,031	△0.0	10,187	△0.0	99.7	—
	(期 末)2018年5月7日	10,045	0.1	10,200	0.1	99.6	0.0
第13期	(期 首)2018年5月7日	10,036	—	10,200	—	99.6	0.0
	5月末	10,044	0.1	10,210	0.1	99.6	—
	6月末	10,048	0.1	10,214	0.1	99.8	0.1
	(期 末)2018年7月9日	10,066	0.3	10,234	0.3	99.7	—

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当作成期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

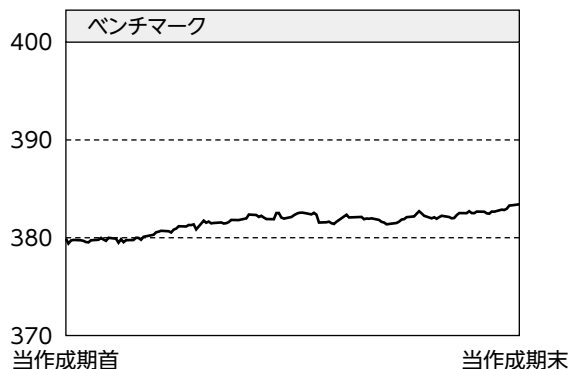


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2018年1月9日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当作成期の基準価額は、上昇しました。2018年4月中旬にかけて、国内株式が大幅に下落したことや日銀の黒田総裁が続投する見通しとなり大規模な金融緩和政策が当面続くとの見方から、金利が低下(債券価格は上昇)し、基準価額は上昇しました。4月中旬から5月中旬にかけては、日銀の金融緩和政策の長期化が意識され、金利が低下する局面もあったものの、海外情勢の落ち着きなどを背景に投資家のリスク回避姿勢が後退した他、20年国債入札結果が低調であったことや米国10年国債利回りが一時3%台に上昇した影響から、金利は上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。その後は、米中貿易摩擦の激化懸念が高まったことに加え、イタリア政局の混乱などから投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどを背景に金利は低下し、基準価額は上昇しました。

投資環境



2018年4月中旬にかけて、国内株式が大幅に下落したことや日銀の黒田総裁が続投する見通しとなり大規模な金融緩和政策が当面続くとの見方から、金利は低下しました。4月下旬から5月中旬にかけては、日銀の金融緩和政策の長期化が意識され、金利が低下する局面もあったものの、海外情勢の落ち着きなどを背景に投資家のリスク回避姿勢が後退した他、20年国債入札結果が低調であったことや米国10年国債利回りが一時3%台に上昇した影響から、金利は上昇しました。その後は、米中貿易摩擦の激化懸念が高まったことに加え、イタリア政局の混迷などから投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどを背景に、金利は低下しました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、主要投資対象である「国内債券インデックスマザーファンド」への投資を通じて、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。

【「国内債券インデックス マザーファンド」の運用経過】

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

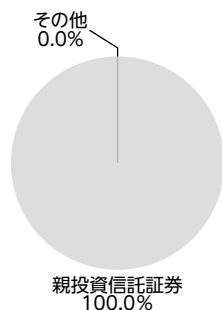
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

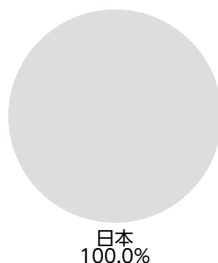
	当作成期末
	2018年7月9日
国内債券インデックス マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

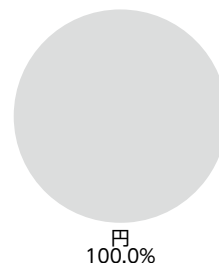
○資産別配分



○国別配分



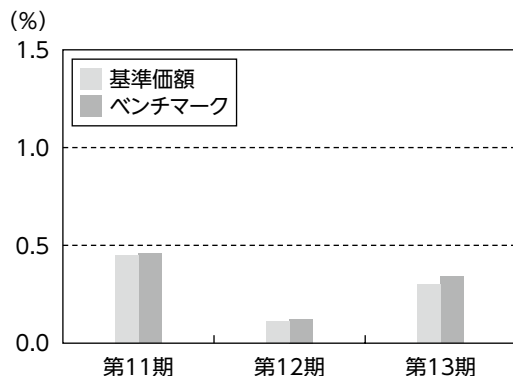
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額（分配金込み）とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。
ベンチマークとの乖離の主な要因は、信託報酬によるものです。

分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・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11期	第12期	第13期
	2018年1月10日～ 2018年3月7日	2018年3月8日～ 2018年5月7日	2018年5月8日～ 2018年7月9日
当期分配金 (円)	10	9	10
(対基準価額比率) (%)	(0.100)	(0.090)	(0.099)
当期の収益 (円)	10	9	10
当期の収益以外 (円)	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	269	272	276

(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

国内債券インデックス マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合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	当作成期		項目の概要
	(2018年1月10日～2018年7月9日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	5円	0.054%	(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10,032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)	(4)	(0.037)	
(販売会社)	(1)	(0.005)	
(受託会社)	(1)	(0.011)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(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)	(－)	(－)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(商品)	(－)	(－)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	－	－	(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)	(－)	(－)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(公社債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(d) その他費用	0	0.002	(d) その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(－)	(－)	
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	5	0.056	

- (注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
- (注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
- (注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 作 成 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内債券インデックス マザーファンド	千口	千円	千口	千円
	17, 916, 685	24, 908, 758	241, 020	335, 652

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 作 成 期					
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
金 銭 信 託	百万円 136	百万円 136	% 100. 0	百万円 136	百万円 136	% 100. 0
コ ー ル ・ ロ ー ン	3, 658	697	19. 1	3, 650	698	19. 1

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<国内債券インデックス マザーファンド>

区 分	当 作 成 期					
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
金 銭 信 託	百万円 8, 613	百万円 8, 613	% 100. 0	百万円 8, 613	百万円 8, 613	% 100. 0
コ ー ル ・ ロ ー ン	171, 312	31, 702	18. 5	171, 413	31, 759	18. 5

<平均保有割合 13. 0%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

< 親投資信託残高 >

	前 作 成 期 末	当 作 成 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
国内債券インデックス マザーファンド	千口 25, 419, 406	千口 43, 095, 070	千円 60, 195, 194

(注) 親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、280, 996, 460千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
国内債券インデックス マザーファンド	千円 60, 195, 194	% 99. 7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	182, 299	0. 3
投 資 信 託 財 産 総 額	60, 377, 493	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	第 11 期 末 2018年3月7日現在	第 12 期 末 2018年5月7日現在	第 13 期 末 2018年7月9日現在
(A) 資 産	41,925,125,454円	48,156,215,877円	60,377,493,236円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	27,998,759	75,986,619	98,034,329
国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	41,855,606,607	48,080,229,258	60,195,194,960
未 収 入 金	41,520,088	—	84,263,947
(B) 負 債	48,588,166	51,936,304	152,194,461
未 払 収 益 分 配 金	41,735,759	43,139,320	59,887,993
未 払 解 約 金	—	500,000	81,899,999
未 払 信 託 報 酬	6,591,733	8,012,695	10,103,701
未 払 利 息	61	209	250
そ の 他 未 払 費 用	260,613	284,080	302,518
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	41,876,537,288	48,104,279,573	60,225,298,775
元 本	41,735,759,994	47,932,578,856	59,887,993,256
次 期 繰 越 損 益 金	140,777,294	171,700,717	337,305,519
(D) 受 益 権 総 口 数	41,735,759,994口	47,932,578,856口	59,887,993,256口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	10,034円	10,036円	10,056円

■損益の状況

項 目	第 11 期 自 2018年1月10日 至 2018年3月 7日	第 12 期 自 2018年3月8日 至 2018年5月7日	第 13 期 自 2018年5月8日 至 2018年7月9日
(A) 配 当 等 収 益	△2,249円	△4,409円	△5,353円
受 取 利 息	—	2	2
支 払 利 息	△2,249	△4,411	△5,355
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	188,969,408	57,213,867	192,457,678
売 買 益	195,678,369	60,320,170	198,238,871
売 買 損	△6,708,961	△3,106,303	△5,781,193
(C) 信 託 報 酬 等	△6,852,346	△8,296,797	△10,406,242
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	182,114,813	48,912,661	182,046,083
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△200,963,957	△60,557,731	△54,537,332
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	201,362,197	226,485,107	269,684,761
(配 当 等 相 当 額)	(979,987,354)	(1,149,237,593)	(1,478,245,753)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△778,625,157)	(△922,752,486)	(△1,208,560,992)
(G) 計 (D+E+F)	182,513,053	214,840,037	397,193,512
(H) 収 益 分 配 金	△41,735,759	△43,139,320	△59,887,993
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	140,777,294	171,700,717	337,305,519
追 加 信 託 差 損 益 金	201,362,197	226,485,107	269,684,761
(配 当 等 相 当 額)	(982,168,526)	(1,151,266,709)	(1,482,062,449)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△780,806,329)	(△924,781,602)	(△1,212,377,688)
分 配 準 備 積 立 金	142,623,740	156,839,082	173,395,474
繰 越 損 益 金	△203,208,643	△211,623,472	△105,774,716

(注1) (B) 有価証券売買損益は各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＞

※当ファンドの第11期首元本額は35,203,168,237円、第11～13期中追加設定元本額は24,990,002,998円、第11～13期中一部解約元本額は305,177,979円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 11 期	第 12 期	第 13 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	52,258,040円	57,418,620円	77,151,669円
(B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円	－円	－円
(C) 収益調整金額	982,168,526円	1,151,266,709円	1,482,062,449円
(D) 分配準備積立金額	132,101,459円	142,559,782円	156,131,798円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	1,166,528,025円	1,351,245,111円	1,715,345,916円
(F) 期末残存口数	41,735,759,994口	47,932,578,856口	59,887,993,256口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	279円	281円	286円
(H) 分配金額(1万口当たり)	10円	9円	10円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	41,735,759円	43,139,320円	59,887,993円

分配金のお知らせ

	第11期	第12期	第13期
1万口当たり分配金	10円	9円	10円

(注) 分配金は各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。

お知らせ

該当事項はありません。

国内債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日 2018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		ベンチマーク		債 券 先 物 率 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率			
第14期(2014年5月29日)	円	%		%	%	%	百万円
	12,915	3.2	354,471	3.2	99.3	0.3	256,692
第15期(2015年5月29日)	13,215	2.3	362,770	2.3	99.6	—	319,978
第16期(2016年5月30日)	14,107	6.7	387,276	6.8	99.4	0.2	319,650
第17期(2017年5月29日)	13,829	△2.0	379,592	△2.0	99.7	—	300,760
第18期(2018年5月29日)	13,934	0.8	382,463	0.8	99.9	—	379,135

(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	率	騰 落 率	率		
(当 期 首) 2017年 5月29日	円	%		%	%	%
	13,829	—	379,592	—	99.7	—
5月末	13,829	0.0	379,549	△0.0	99.6	—
6月末	13,791	△0.3	378,570	△0.3	99.7	—
7月末	13,793	△0.3	378,545	△0.3	99.7	—
8月末	13,866	0.3	380,579	0.3	99.6	0.0
9月末	13,817	△0.1	379,266	△0.1	99.8	—
10月末	13,817	△0.1	379,268	△0.1	99.7	—
11月末	13,854	0.2	380,257	0.2	99.6	0.1
12月末	13,862	0.2	380,513	0.2	99.7	0.0
2018年 1月末	13,839	0.1	379,850	0.1	99.7	—
2月末	13,892	0.5	381,295	0.4	99.7	—
3月末	13,914	0.6	381,911	0.6	99.8	—
4月末	13,903	0.5	381,638	0.5	99.7	—
(当 期 末) 2018年 5月29日	13,934	0.8	382,463	0.8	99.9	—

(注1) 騰落率は期首比です。

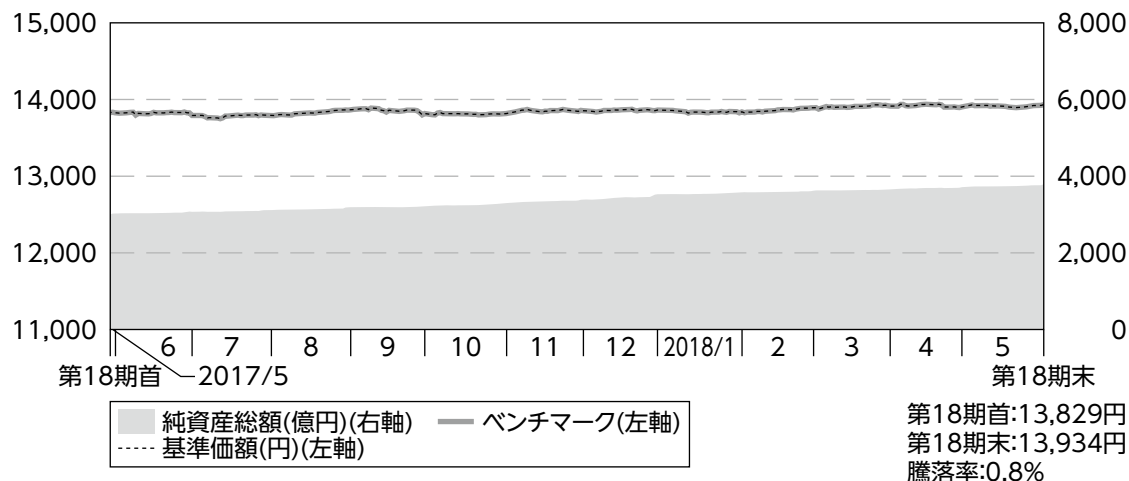
(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

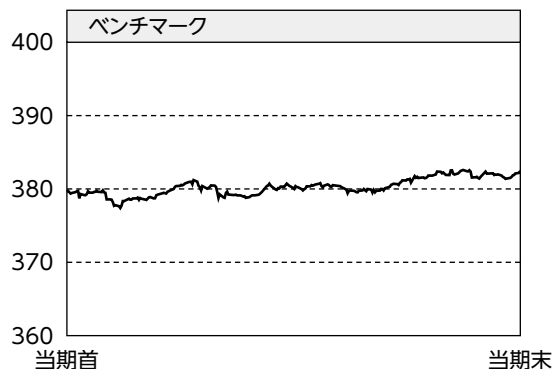


(注)ベンチマークは、2017年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

期初より2017年7月上旬にかけて、債券需給の悪化や欧米金利上昇の影響から金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。その後9月上旬にかけて、日銀の指し値オペ実施や北朝鮮情勢の緊迫化を受けて金利が低下(債券価格は上昇)し、基準価額は上昇しました。9月中旬以降は、基準価額はもみ合いで推移しましたが、2018年2月から4月中旬にかけて、国内株式が大幅に下落したことや、黒田総裁が続投する見通しとなり大規模な金融緩和政策が当面続くとの見方から金利が低下し、基準価額は上昇しました。その後期末にかけては、株式市場が堅調に推移したほか、米10年債金利が3%台に上昇したことで国内金利に影響する場面があった一方で、米朝首脳会談開催を巡る不透明感から投資家のリスク回避姿勢が強まり金利が低下する場面があるなど、金利はレンジ内推移となり、基準価額はもみ合いで推移しました。

投資環境



期初から2017年7月上旬にかけて、債券需給の悪化や欧米金利上昇の影響から金利は上昇し、その後9月上旬にかけて、日銀の指し値オペ実施や北朝鮮情勢の緊迫化を受けて、低下しました。9月中旬以降、金利はもみ合いで推移した後、2018年2月からは国内株式が大幅に下落したことや、黒田総裁が続投する見通しとなり大規模な金融緩和政策が当面続くとの見方から、低下しました。その後期末にかけては、株式市場が堅調に推移したほか、米金利の上昇が国内に影響する場面があった一方で、米朝首脳会谈開催を巡る不透明感による投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから、金利はレンジ内での推移となりました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

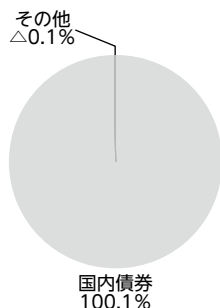
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	第131回利付国債(5年)	日本	1.5%
2	第133回利付国債(5年)	日本	1.3%
3	第135回利付国債(5年)	日本	1.3%
4	第127回利付国債(5年)	日本	1.2%
5	第312回利付国債(10年)	日本	1.0%
6	第339回利付国債(10年)	日本	1.0%

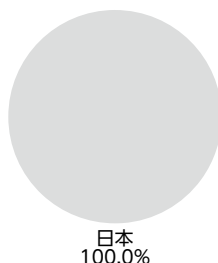
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	第132回利付国債(5年)	日本	1.0%
8	第125回利付国債(5年)	日本	1.0%
9	第332回利付国債(10年)	日本	0.9%
10	第122回利付国債(5年)	日本	0.9%
組入銘柄数		788	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

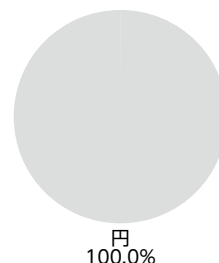
○資産別配分



○国別配分



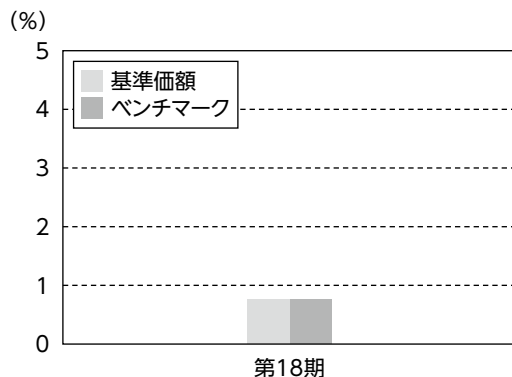
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期 (2017年5月30日~2018年5月29日)		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.000% (-) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	0 (-) (-) (0)	0.000 (-) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.000	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(13,848円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜公社債＞

		当		期	
		買	付 額	売	付 額
国 内	国 債 証 券	千円		千円	
		106,605,180		38,621,306	
	地 方 債 証 券	5,392,366		1,389,528	
	特 殊 債 券	5,763,139		1,271,841 (419,243)	
	社 債 券(投 資 法 人 債 券 を 含 む)	4,510,231		1,317,529 (200,000)	

(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 65,698	百万円 65,689	百万円 —	百万円 —

(注) 金額は受渡代金です。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
金 銭 信 託	百万円 5,198	百万円 5,198	% 100.0	百万円 5,198	百万円 5,198	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	368,819	87,512	23.7	368,032	87,336	23.7

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<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 B 格 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	291,015,000 (13,760,000)	316,269,133 (13,840,550)	83.4 (3.7)	— (—)	52.2 (—)	20.4 (1.3)	10.8 (2.4)
地 方 債 証 券	19,845,920 (19,845,920)	20,918,377 (20,918,377)	5.5 (5.5)	— (—)	3.7 (3.7)	1.7 (1.7)	0.1 (0.1)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	22,631,227 (22,631,227)	24,089,500 (24,089,500)	6.4 (6.4)	— (—)	4.1 (4.1)	2.1 (2.1)	0.1 (0.1)
金 融 債 証 券	2,200,000 (2,200,000)	2,201,641 (2,201,641)	0.6 (0.6)	— (—)	— (—)	0.3 (0.3)	0.3 (0.3)
普 通 社 債 証 券 (含む投資法人債券)	14,796,000 (14,796,000)	15,210,450 (15,210,450)	4.0 (4.0)	— (—)	2.3 (2.3)	1.0 (1.0)	0.7 (0.7)
合 計	350,488,147 (73,233,147)	378,689,101 (76,260,519)	99.9 (20.1)	— (—)	62.3 (10.1)	25.6 (6.4)	11.9 (3.6)

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) ()内は非上場債で内書きです。

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

(B) 個別銘柄開示

銘 柄 名	当 期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
国債証券				
第377回利付国債(2年)	0.1	2,650,000	2,656,916	2019/6/15
第378回利付国債(2年)	0.1	1,680,000	1,684,720	2019/7/15
第379回利付国債(2年)	0.1	2,200,000	2,206,666	2019/8/15
第380回利付国債(2年)	0.1	1,780,000	1,785,767	2019/9/15
第381回利付国債(2年)	0.1	2,580,000	2,588,901	2019/10/15
第382回利付国債(2年)	0.1	310,000	311,134	2019/11/15
第383回利付国債(2年)	0.1	1,300,000	1,305,031	2019/12/15
第384回利付国債(2年)	0.1	1,720,000	1,727,017	2020/1/15
第385回利付国債(2年)	0.1	420,000	421,801	2020/2/15
第386回利付国債(2年)	0.1	2,530,000	2,541,359	2020/3/15
第387回利付国債(2年)	0.1	1,710,000	1,718,037	2020/4/15
第118回利付国債(5年)	0.2	3,510,000	3,522,987	2019/6/20
第119回利付国債(5年)	0.1	1,000,000	1,002,640	2019/6/20
第120回利付国債(5年)	0.2	2,800,000	2,812,656	2019/9/20
第121回利付国債(5年)	0.1	890,000	892,856	2019/9/20
第122回利付国債(5年)	0.1	3,520,000	3,533,164	2019/12/20
第123回利付国債(5年)	0.1	3,140,000	3,153,345	2020/3/20
第124回利付国債(5年)	0.1	1,950,000	1,959,652	2020/6/20
第125回利付国債(5年)	0.1	3,610,000	3,630,071	2020/9/20

銘 柄 名	当 期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第126回利付国債(5年)	0.1	2,960,000	2,978,233	2020/12/20
第127回利付国債(5年)	0.1	4,390,000	4,419,017	2021/3/20
第128回利付国債(5年)	0.1	1,610,000	1,621,366	2021/6/20
第129回利付国債(5年)	0.1	3,200,000	3,224,448	2021/9/20
第130回利付国債(5年)	0.1	1,360,000	1,370,934	2021/12/20
第131回利付国債(5年)	0.1	5,540,000	5,586,591	2022/3/20
第132回利付国債(5年)	0.1	3,610,000	3,642,381	2022/6/20
第133回利付国債(5年)	0.1	4,740,000	4,785,172	2022/9/20
第134回利付国債(5年)	0.1	3,170,000	3,201,953	2022/12/20
第135回利付国債(5年)	0.1	4,720,000	4,770,173	2023/3/20
第1回利付国債(40年)	2.4	400,000	580,576	2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	420,000	590,112	2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	520,000	734,364	2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	700,000	992,033	2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	750,000	1,022,115	2052/3/20
第6回利付国債(40年)	1.9	390,000	521,706	2053/3/20
第7回利付国債(40年)	1.7	690,000	881,233	2054/3/20
第8回利付国債(40年)	1.4	750,000	888,045	2055/3/20
第9回利付国債(40年)	0.4	970,000	833,191	2056/3/20
第10回利付国債(40年)	0.9	1,820,000	1,851,941	2057/3/20

当		期		末		
銘	柄	名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第301	回利付国債	(10年)	1.5	340,000	345,939	2019/6/20
第302	回利付国債	(10年)	1.4	200,000	203,282	2019/6/20
第303	回利付国債	(10年)	1.4	1,390,000	1,418,175	2019/9/20
第304	回利付国債	(10年)	1.3	480,000	489,096	2019/9/20
第305	回利付国債	(10年)	1.3	1,910,000	1,953,108	2019/12/20
第306	回利付国債	(10年)	1.4	1,170,000	1,202,607	2020/3/20
第307	回利付国債	(10年)	1.3	700,000	718,242	2020/3/20
第308	回利付国債	(10年)	1.3	1,490,000	1,534,267	2020/6/20
第309	回利付国債	(10年)	1.1	2,450,000	2,512,671	2020/6/20
第310	回利付国債	(10年)	1.0	1,410,000	1,446,899	2020/9/20
第311	回利付国債	(10年)	0.8	1,080,000	1,103,392	2020/9/20
第312	回利付国債	(10年)	1.2	3,810,000	3,940,568	2020/12/20
第313	回利付国債	(10年)	1.3	1,250,000	1,300,512	2021/3/20
第314	回利付国債	(10年)	1.1	310,000	320,778	2021/3/20
第315	回利付国債	(10年)	1.2	2,180,000	2,269,336	2021/6/20
第316	回利付国債	(10年)	1.1	1,090,000	1,131,321	2021/6/20
第317	回利付国債	(10年)	1.1	710,000	739,145	2021/9/20
第318	回利付国債	(10年)	1.0	1,090,000	1,131,125	2021/9/20
第319	回利付国債	(10年)	1.1	1,710,000	1,785,188	2021/12/20
第320	回利付国債	(10年)	1.0	2,920,000	3,037,968	2021/12/20
第321	回利付国債	(10年)	1.0	1,340,000	1,397,365	2022/3/20
第322	回利付国債	(10年)	0.9	750,000	779,242	2022/3/20
第323	回利付国債	(10年)	0.9	970,000	1,010,128	2022/6/20
第324	回利付国債	(10年)	0.8	1,280,000	1,327,744	2022/6/20
第325	回利付国債	(10年)	0.8	2,290,000	2,380,226	2022/9/20
第326	回利付国債	(10年)	0.7	860,000	891,914	2022/12/20
第327	回利付国債	(10年)	0.8	740,000	770,850	2022/12/20
第328	回利付国債	(10年)	0.6	2,320,000	2,400,156	2023/3/20
第329	回利付国債	(10年)	0.8	2,250,000	2,354,130	2023/6/20
第330	回利付国債	(10年)	0.8	1,440,000	1,509,177	2023/9/20
第331	回利付国債	(10年)	0.6	1,380,000	1,431,556	2023/9/20
第332	回利付国債	(10年)	0.6	3,430,000	3,562,192	2023/12/20
第333	回利付国債	(10年)	0.6	2,330,000	2,423,106	2024/3/20
第334	回利付国債	(10年)	0.6	2,790,000	2,905,478	2024/6/20
第335	回利付国債	(10年)	0.5	2,710,000	2,808,779	2024/9/20
第336	回利付国債	(10年)	0.5	610,000	632,905	2024/12/20
第337	回利付国債	(10年)	0.3	1,980,000	2,028,252	2024/12/20
第338	回利付国債	(10年)	0.4	2,450,000	2,527,861	2025/3/20
第339	回利付国債	(10年)	0.4	3,740,000	3,861,924	2025/6/20
第340	回利付国債	(10年)	0.4	3,070,000	3,172,507	2025/9/20
第341	回利付国債	(10年)	0.3	3,030,000	3,110,446	2025/12/20
第342	回利付国債	(10年)	0.1	2,600,000	2,628,496	2026/3/20
第343	回利付国債	(10年)	0.1	3,150,000	3,183,075	2026/6/20
第344	回利付国債	(10年)	0.1	1,670,000	1,686,666	2026/9/20
第345	回利付国債	(10年)	0.1	1,910,000	1,927,992	2026/12/20
第346	回利付国債	(10年)	0.1	3,400,000	3,429,920	2027/3/20
第347	回利付国債	(10年)	0.1	2,430,000	2,449,780	2027/6/20
第348	回利付国債	(10年)	0.1	1,230,000	1,239,717	2027/9/20
第349	回利付国債	(10年)	0.1	3,210,000	3,234,492	2027/12/20

当		期		末		
銘	柄	名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第350	回利付国債	(10年)	0.1	2,530,000	2,547,305	2028/3/20
第1	回利付国債	(30年)	2.8	40,000	52,165	2029/9/20
第2	回利付国債	(30年)	2.4	160,000	202,425	2030/2/20
第3	回利付国債	(30年)	2.3	120,000	150,876	2030/5/20
第4	回利付国債	(30年)	2.9	110,000	147,318	2030/11/20
第5	回利付国債	(30年)	2.2	50,000	63,003	2031/5/20
第6	回利付国債	(30年)	2.4	190,000	245,820	2031/11/20
第7	回利付国債	(30年)	2.3	180,000	231,537	2032/5/20
第8	回利付国債	(30年)	1.8	50,000	61,044	2032/11/22
第9	回利付国債	(30年)	1.4	240,000	279,556	2032/12/20
第10	回利付国債	(30年)	1.1	160,000	179,544	2033/3/20
第11	回利付国債	(30年)	1.7	90,000	108,936	2033/6/20
第12	回利付国債	(30年)	2.1	190,000	241,649	2033/9/20
第13	回利付国債	(30年)	2.0	290,000	364,909	2033/12/20
第14	回利付国債	(30年)	2.4	300,000	396,561	2034/3/20
第15	回利付国債	(30年)	2.5	340,000	455,634	2034/6/20
第16	回利付国債	(30年)	2.5	370,000	496,950	2034/9/20
第17	回利付国債	(30年)	2.4	330,000	438,975	2034/12/20
第18	回利付国債	(30年)	2.3	345,000	454,299	2035/3/20
第19	回利付国債	(30年)	2.3	280,000	369,073	2035/6/20
第20	回利付国債	(30年)	2.5	420,000	568,768	2035/9/20
第21	回利付国債	(30年)	2.3	270,000	357,093	2035/12/20
第22	回利付国債	(30年)	2.5	400,000	543,688	2036/3/20
第23	回利付国債	(30年)	2.5	430,000	585,522	2036/6/20
第24	回利付国債	(30年)	2.5	260,000	354,660	2036/9/20
第25	回利付国債	(30年)	2.3	290,000	385,523	2036/12/20
第26	回利付国債	(30年)	2.4	410,000	552,930	2037/3/20
第27	回利付国債	(30年)	2.5	600,000	822,900	2037/9/20
第28	回利付国債	(30年)	2.5	930,000	1,280,182	2038/3/20
第29	回利付国債	(30年)	2.4	1,230,000	1,674,768	2038/9/20
第30	回利付国債	(30年)	2.3	750,000	1,010,115	2039/3/20
第31	回利付国債	(30年)	2.2	900,000	1,198,098	2039/9/20
第32	回利付国債	(30年)	2.3	1,190,000	1,612,735	2040/3/20
第33	回利付国債	(30年)	2.0	1,310,000	1,699,266	2040/9/20
第34	回利付国債	(30年)	2.2	955,000	1,282,097	2041/3/20
第35	回利付国債	(30年)	2.0	1,660,000	2,164,009	2041/9/20
第36	回利付国債	(30年)	2.0	1,140,000	1,489,512	2042/3/20
第37	回利付国債	(30年)	1.9	1,280,000	1,648,755	2042/9/20
第38	回利付国債	(30年)	1.8	760,000	964,204	2043/3/20
第39	回利付国債	(30年)	1.9	910,000	1,176,657	2043/6/20
第40	回利付国債	(30年)	1.8	600,000	762,390	2043/9/20
第41	回利付国債	(30年)	1.7	890,000	1,110,639	2043/12/20
第42	回利付国債	(30年)	1.7	800,000	998,872	2044/3/20
第43	回利付国債	(30年)	1.7	820,000	1,024,409	2044/6/20
第44	回利付国債	(30年)	1.7	810,000	1,013,609	2044/9/20
第45	回利付国債	(30年)	1.5	800,000	962,728	2044/12/20
第46	回利付国債	(30年)	1.5	840,000	1,011,066	2045/3/20
第47	回利付国債	(30年)	1.6	1,250,000	1,535,612	2045/6/20
第48	回利付国債	(30年)	1.4	1,100,000	1,297,351	2045/9/20

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第4 9 回利付国債 (3 0 年)	1.4	790,000	931,741	2045/12/20
第5 0 回利付国債 (3 0 年)	0.8	680,000	699,080	2046/3/20
第5 1 回利付国債 (3 0 年)	0.3	790,000	710,889	2046/6/20
第5 2 回利付国債 (3 0 年)	0.5	770,000	731,022	2046/9/20
第5 3 回利付国債 (3 0 年)	0.6	1,070,000	1,042,051	2046/12/20
第5 4 回利付国債 (3 0 年)	0.8	1,370,000	1,404,524	2047/3/20
第5 5 回利付国債 (3 0 年)	0.8	970,000	993,415	2047/6/20
第5 6 回利付国債 (3 0 年)	0.8	1,440,000	1,473,220	2047/9/20
第5 7 回利付国債 (3 0 年)	0.8	1,160,000	1,185,496	2047/12/20
第5 8 回利付国債 (3 0 年)	0.8	530,000	541,066	2048/3/20
第4 3 回利付国債 (2 0 年)	2.9	140,000	145,593	2019/9/20
第4 4 回利付国債 (2 0 年)	2.5	170,000	178,122	2020/3/20
第4 5 回利付国債 (2 0 年)	2.4	290,000	303,331	2020/3/20
第4 6 回利付国債 (2 0 年)	2.2	170,000	178,229	2020/6/22
第4 7 回利付国債 (2 0 年)	2.2	90,000	94,874	2020/9/21
第4 8 回利付国債 (2 0 年)	2.5	130,000	138,804	2020/12/21
第4 9 回利付国債 (2 0 年)	2.1	140,000	148,828	2021/3/22
第5 0 回利付国債 (2 0 年)	1.9	220,000	232,632	2021/3/22
第5 1 回利付国債 (2 0 年)	2.0	100,000	106,560	2021/6/21
第5 2 回利付国債 (2 0 年)	2.1	110,000	118,179	2021/9/21
第5 3 回利付国債 (2 0 年)	2.1	80,000	86,362	2021/12/20
第5 4 回利付国債 (2 0 年)	2.2	200,000	216,622	2021/12/20
第5 5 回利付国債 (2 0 年)	2.0	140,000	151,354	2022/3/21
第5 6 回利付国債 (2 0 年)	2.0	150,000	162,966	2022/6/20
第5 7 回利付国債 (2 0 年)	1.9	240,000	259,766	2022/6/20
第5 8 回利付国債 (2 0 年)	1.9	300,000	326,181	2022/9/20
第5 9 回利付国債 (2 0 年)	1.7	200,000	216,636	2022/12/20
第6 0 回利付国債 (2 0 年)	1.4	350,000	374,300	2022/12/20
第6 1 回利付国債 (2 0 年)	1.0	240,000	252,868	2023/3/20
第6 2 回利付国債 (2 0 年)	0.8	320,000	334,809	2023/6/20
第6 3 回利付国債 (2 0 年)	1.8	200,000	219,426	2023/6/20
第6 4 回利付国債 (2 0 年)	1.9	320,000	354,067	2023/9/20
第6 5 回利付国債 (2 0 年)	1.9	220,000	244,389	2023/12/20
第6 6 回利付国債 (2 0 年)	1.8	330,000	364,742	2023/12/20
第6 7 回利付国債 (2 0 年)	1.9	130,000	145,055	2024/3/20
第6 8 回利付国債 (2 0 年)	2.2	190,000	215,328	2024/3/20
第6 9 回利付国債 (2 0 年)	2.1	390,000	439,713	2024/3/20
第7 0 回利付国債 (2 0 年)	2.4	400,000	460,380	2024/6/20
第7 1 回利付国債 (2 0 年)	2.2	200,000	227,756	2024/6/20
第7 2 回利付国債 (2 0 年)	2.1	630,000	716,864	2024/9/20
第7 3 回利付国債 (2 0 年)	2.0	360,000	409,100	2024/12/20
第7 4 回利付国債 (2 0 年)	2.1	200,000	228,596	2024/12/20
第7 5 回利付国債 (2 0 年)	2.1	130,000	149,238	2025/3/20
第7 6 回利付国債 (2 0 年)	1.9	270,000	306,266	2025/3/20
第7 7 回利付国債 (2 0 年)	2.0	290,000	330,933	2025/3/20
第7 8 回利付国債 (2 0 年)	1.9	170,000	193,546	2025/6/20
第7 9 回利付国債 (2 0 年)	2.0	270,000	309,309	2025/6/20
第8 0 回利付国債 (2 0 年)	2.1	220,000	253,589	2025/6/20
第8 1 回利付国債 (2 0 年)	2.0	390,000	448,652	2025/9/20

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第8 2 回利付国債 (2 0 年)	2.1	600,000	694,638	2025/9/20
第8 3 回利付国債 (2 0 年)	2.1	290,000	337,180	2025/12/20
第8 4 回利付国債 (2 0 年)	2.0	470,000	542,897	2025/12/20
第8 5 回利付国債 (2 0 年)	2.1	290,000	338,592	2026/3/20
第8 6 回利付国債 (2 0 年)	2.3	210,000	248,476	2026/3/20
第8 7 回利付国債 (2 0 年)	2.2	550,000	646,464	2026/3/20
第8 8 回利付国債 (2 0 年)	2.3	420,000	499,039	2026/6/20
第8 9 回利付国債 (2 0 年)	2.2	350,000	413,038	2026/6/20
第9 0 回利付国債 (2 0 年)	2.2	630,000	746,405	2026/9/20
第9 1 回利付国債 (2 0 年)	2.3	450,000	536,895	2026/9/20
第9 2 回利付国債 (2 0 年)	2.1	880,000	1,039,051	2026/12/20
第9 3 回利付国債 (2 0 年)	2.0	410,000	482,201	2027/3/20
第9 4 回利付国債 (2 0 年)	2.1	610,000	722,795	2027/3/20
第9 5 回利付国債 (2 0 年)	2.3	610,000	736,404	2027/6/20
第9 6 回利付国債 (2 0 年)	2.1	320,000	380,521	2027/6/20
第9 7 回利付国債 (2 0 年)	2.2	400,000	481,252	2027/9/20
第9 8 回利付国債 (2 0 年)	2.1	440,000	525,285	2027/9/20
第9 9 回利付国債 (2 0 年)	2.1	1,150,000	1,378,206	2027/12/20
第1 0 0 回利付国債 (2 0 年)	2.2	480,000	581,832	2028/3/20
第1 0 1 回利付国債 (2 0 年)	2.4	715,000	880,665	2028/3/20
第1 0 2 回利付国債 (2 0 年)	2.4	410,000	506,924	2028/6/20
第1 0 3 回利付国債 (2 0 年)	2.3	400,000	490,552	2028/6/20
第1 0 4 回利付国債 (2 0 年)	2.1	360,000	434,286	2028/6/20
第1 0 5 回利付国債 (2 0 年)	2.1	680,000	822,555	2028/9/20
第1 0 6 回利付国債 (2 0 年)	2.2	380,000	463,558	2028/9/20
第1 0 7 回利付国債 (2 0 年)	2.1	150,000	182,010	2028/12/20
第1 0 8 回利付国債 (2 0 年)	1.9	660,000	787,003	2028/12/20
第1 0 9 回利付国債 (2 0 年)	1.9	230,000	274,990	2029/3/20
第1 1 0 回利付国債 (2 0 年)	2.1	950,000	1,156,197	2029/3/20
第1 1 1 回利付国債 (2 0 年)	2.2	490,000	603,523	2029/6/20
第1 1 2 回利付国債 (2 0 年)	2.1	790,000	964,376	2029/6/20
第1 1 3 回利付国債 (2 0 年)	2.1	1,350,000	1,652,859	2029/9/20
第1 1 4 回利付国債 (2 0 年)	2.1	850,000	1,043,655	2029/12/20
第1 1 5 回利付国債 (2 0 年)	2.2	800,000	991,400	2029/12/20
第1 1 6 回利付国債 (2 0 年)	2.2	760,000	944,558	2030/3/20
第1 1 7 回利付国債 (2 0 年)	2.1	850,000	1,046,511	2030/3/20
第1 1 8 回利付国債 (2 0 年)	2.0	690,000	843,676	2030/6/20
第1 1 9 回利付国債 (2 0 年)	1.8	270,000	323,719	2030/6/20
第1 2 0 回利付国債 (2 0 年)	1.6	790,000	928,408	2030/6/20
第1 2 1 回利付国債 (2 0 年)	1.9	1,590,000	1,930,959	2030/9/20
第1 2 2 回利付国債 (2 0 年)	1.8	200,000	240,466	2030/9/20
第1 2 3 回利付国債 (2 0 年)	2.1	1,000,000	1,241,900	2030/12/20
第1 2 4 回利付国債 (2 0 年)	2.0	460,000	565,593	2030/12/20
第1 2 5 回利付国債 (2 0 年)	2.2	480,000	603,628	2031/3/20
第1 2 6 回利付国債 (2 0 年)	2.0	610,000	751,782	2031/3/20
第1 2 7 回利付国債 (2 0 年)	1.9	580,000	707,524	2031/3/20
第1 2 8 回利付国債 (2 0 年)	1.9	1,050,000	1,283,677	2031/6/20
第1 2 9 回利付国債 (2 0 年)	1.8	220,000	266,147	2031/6/20
第1 3 0 回利付国債 (2 0 年)	1.8	935,000	1,133,350	2031/9/20

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第131回利付国債(20年)	1.7	380,000	455,669	2031/9/20
第132回利付国債(20年)	1.7	840,000	1,008,991	2031/12/20
第133回利付国債(20年)	1.8	820,000	995,824	2031/12/20
第134回利付国債(20年)	1.8	920,000	1,119,253	2032/3/20
第135回利付国債(20年)	1.7	510,000	613,596	2032/3/20
第136回利付国債(20年)	1.6	570,000	677,661	2032/3/20
第137回利付国債(20年)	1.7	450,000	541,921	2032/6/20
第138回利付国債(20年)	1.5	340,000	400,159	2032/6/20
第139回利付国債(20年)	1.6	510,000	607,206	2032/6/20
第140回利付国債(20年)	1.7	1,610,000	1,941,901	2032/9/20
第141回利付国債(20年)	1.7	950,000	1,146,726	2032/12/20
第142回利付国債(20年)	1.8	460,000	562,129	2032/12/20
第143回利付国債(20年)	1.6	890,000	1,063,051	2033/3/20
第144回利付国債(20年)	1.5	1,050,000	1,238,265	2033/3/20
第145回利付国債(20年)	1.7	1,760,000	2,130,321	2033/6/20
第146回利付国債(20年)	1.7	1,480,000	1,792,457	2033/9/20
第147回利付国債(20年)	1.6	1,860,000	2,227,703	2033/12/20
第148回利付国債(20年)	1.5	1,270,000	1,502,232	2034/3/20
第149回利付国債(20年)	1.5	1,840,000	2,178,247	2034/6/20
第150回利付国債(20年)	1.4	1,990,000	2,324,936	2034/9/20
第151回利付国債(20年)	1.2	1,555,000	1,768,796	2034/12/20
第152回利付国債(20年)	1.2	1,520,000	1,729,167	2035/3/20
第153回利付国債(20年)	1.3	1,700,000	1,959,947	2035/6/20
第154回利付国債(20年)	1.2	1,490,000	1,692,550	2035/9/20
第155回利付国債(20年)	1.0	1,840,000	2,029,446	2035/12/20
第156回利付国債(20年)	0.4	1,340,000	1,338,874	2036/3/20
第157回利付国債(20年)	0.2	1,670,000	1,605,638	2036/6/20
第158回利付国債(20年)	0.5	1,690,000	1,710,077	2036/9/20
第159回利付国債(20年)	0.6	1,600,000	1,643,920	2036/12/20
第160回利付国債(20年)	0.7	1,950,000	2,034,513	2037/3/20
第161回利付国債(20年)	0.6	1,240,000	1,269,301	2037/6/20
第162回利付国債(20年)	0.6	1,670,000	1,705,404	2037/9/20
第163回利付国債(20年)	0.6	1,220,000	1,243,948	2037/12/20
第164回利付国債(20年)	0.5	680,000	679,381	2038/3/20
小 計		291,015,000	316,269,133	
地方債証券				
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	100,000	112,825	2024/3/19
第6回東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	113,147	2025/3/19
第9回東京都公募公債(30年)	2.37	100,000	132,252	2039/3/18
第11回東京都公募公債(30年)	2.19	100,000	129,640	2040/9/20
第17回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	119,482	2028/12/20
第19回東京都公募公債(20年)	2.13	100,000	120,553	2029/6/20
第26回東京都公募公債(20年)	1.74	200,000	237,404	2032/6/18
第27回東京都公募公債(20年)	1.68	200,000	236,208	2032/12/20
第695回東京都公募公債	1.2	100,000	103,295	2021/3/19
第696回東京都公募公債	1.19	100,000	103,539	2021/6/18
第700回東京都公募公債	1.02	100,000	103,287	2021/9/17
第702回東京都公募公債	1.04	200,000	207,226	2021/12/20
第716回東京都公募公債	0.77	100,000	103,371	2022/12/20

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第717回東京都公募公債	0.63	100,000	102,880	2023/3/20
第720回東京都公募公債	0.87	100,000	104,270	2023/6/20
第728回東京都公募公債	0.65	100,000	103,385	2023/12/20
第770回東京都公募公債	0.18	100,000	100,402	2027/6/18
平成22年度第11回北海道公募公債	1.36	100,000	103,434	2020/12/28
平成23年度第6回北海道公募公債	1.11	200,000	207,058	2021/8/31
平成24年度第14回北海道公募公債	0.8	100,000	103,630	2023/2/28
平成27年度第15回北海道公募公債	0.22	100,000	100,806	2026/2/26
平成28年度第1回北海道公募公債	0.085	100,000	99,725	2026/4/28
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	136,099	2038/3/19
第20回神奈川県公募公債(20年)	1.706	100,000	118,088	2032/6/18
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	114,317	2034/9/20
第172回神奈川県公募公債	1.34	100,000	102,377	2020/3/20
第210回神奈川県公募公債	0.451	200,000	205,042	2024/12/20
第218回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,750	2025/12/19
第226回神奈川県公募公債	0.195	200,000	200,868	2027/3/19
第7回大阪府公募公債(20年)	1.84	200,000	237,960	2031/9/26
第345回大阪府公募公債(10年)	1.26	100,000	103,166	2020/12/25
第349回大阪府公募公債(10年)	1.38	100,000	103,937	2021/4/27
第361回大阪府公募公債(10年)	0.92	100,000	103,607	2022/6/28
第371回大阪府公募公債(10年)	0.58	100,000	102,681	2023/4/26
第375回大阪府公募公債(10年)	0.835	100,000	104,168	2023/8/29
第389回大阪府公募公債(10年)	0.53	100,000	102,911	2024/10/30
第395回大阪府公募公債(10年)	0.435	151,000	154,631	2025/4/28
第399回大阪府公募公債(10年)	0.529	100,000	103,050	2025/8/28
第402回大阪府公募公債(10年)	0.493	100,000	102,886	2025/11/27
第410回大阪府公募公債(10年)	0.001	200,000	197,908	2026/7/28
平成22年度第2回京都府公募公債	1.16	100,000	102,631	2020/9/24
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	1.79	100,000	118,799	2031/10/17
平成25年度第7回京都府公募公債	0.8	100,000	104,056	2023/9/19
平成27年度第4回京都府公募公債	0.553	100,000	103,318	2025/6/19
第1回兵庫県公募公債(12年)	1.1	100,000	106,264	2024/6/26
第3回兵庫県公募公債(12年)	0.56	100,000	103,249	2025/4/16
第4回兵庫県公募公債(12年)	0.73	100,000	104,856	2026/8/6
第7回兵庫県公募公債(15年)	1.12	100,000	108,906	2028/12/25
平成22年度第1回兵庫県公募公債	1.46	100,000	102,699	2020/4/16
平成25年度第4回兵庫県公募公債	0.82	100,000	104,065	2023/8/18
平成26年度第17回兵庫県公募公債	0.46	100,000	102,550	2025/2/26
第9回静岡県公募公債(30年)	1.539	100,000	116,730	2045/6/20
第12回静岡県公募公債(30年)	0.822	100,000	99,688	2048/3/19
平成23年度第3回静岡県公募公債	1.193	103,290	106,880	2021/5/25
平成23年度第8回静岡県公募公債	1.025	100,000	103,408	2021/10/25
平成24年度第10回静岡県公募公債	0.678	100,000	103,115	2023/3/22
平成29年度第5回静岡県公募公債	0.19	100,000	100,312	2027/6/18
平成29年度第8回静岡県公募公債	0.21	100,000	100,491	2027/6/18
平成29年度第11回静岡県公募公債	0.215	100,000	100,504	2027/9/17
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	2.28	100,000	122,040	2029/6/20
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	1.38	100,000	103,940	2021/4/28
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	1.212	100,000	103,539	2021/5/27

銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
平成23年度第14回愛知県公募債(10年)	1.006	100,000	103,439	2021/11/30
平成24年度第19回愛知県公募債(10年)	0.639	100,000	102,939	2023/3/28
平成26年度第3回愛知県公募債(10年)	0.665	100,000	103,613	2024/4/30
平成27年度第17回愛知県公募債(10年)	0.38	100,000	102,129	2026/1/27
平成28年度第5回愛知県公募債(10年)	0.07	200,000	199,198	2026/6/29
平成28年度第13回愛知県公募債(10年)	0.13	200,000	199,924	2026/11/30
平成20年度第1回広島県公募債(20年)	2.34	100,000	121,567	2028/9/21
平成22年度第1回広島県公募債	1.37	100,000	102,680	2020/5/27
平成24年度第4回広島県公募債	0.81	100,000	103,506	2022/11/28
平成27年度第4回広島県公募債	0.476	125,230	128,779	2025/11/25
平成29年度第1回広島県公募債	0.175	200,000	200,354	2027/5/25
平成22年度第10回埼玉県公募債	1.26	100,000	103,286	2021/1/28
平成22年度第11回埼玉県公募債	1.28	193,000	199,639	2021/2/25
平成24年度第1回埼玉県公募債	1.05	100,000	103,984	2022/4/26
平成24年度第9回埼玉県公募債	0.844	100,000	103,801	2023/1/31
平成25年度第11回埼玉県公募債	0.655	100,000	103,485	2024/3/26
平成27年度第7回埼玉県公募債	0.469	100,000	102,812	2025/12/25
平成28年度第6回埼玉県公募債	0.085	100,000	99,622	2026/9/29
平成28年度第9回埼玉県公募債	0.249	100,000	100,900	2027/2/24
平成29年度第4回埼玉県公募債	0.19	100,000	100,313	2027/6/22
平成20年度第2回福岡県公募債(20年)	2.05	100,000	118,946	2028/12/20
平成23年度第1回福岡県公募債(20年)	2.008	100,000	121,248	2031/5/23
平成23年度第1回福岡県公募債	1.18	200,000	207,082	2021/6/28
平成24年度第1回福岡県公募債(30年)	2.12	100,000	129,506	2042/9/19
平成27年度第7回福岡県公募債	0.464	100,000	102,774	2025/12/25
第13回千葉県公募債(20年)	1.701	100,000	118,171	2032/10/15
平成22年度第8回千葉県公募債	1.0	120,000	122,902	2020/11/25
平成25年度第5回千葉県公募債	0.84	100,000	104,240	2023/8/25
平成26年度第7回千葉県公募債	0.429	100,000	102,409	2025/2/25
平成27年度第1回千葉県公募債	0.549	100,000	103,292	2025/5/23
平成28年度第4回千葉県公募債	0.085	100,000	99,622	2026/9/25
平成28年度第6回千葉県公募債	0.18	220,000	220,763	2027/1/25
第91回共同発行市場公募地方債	0.9	100,000	102,094	2020/10/23
第93回共同発行市場公募地方債	1.25	100,000	103,140	2020/12/25
第94回共同発行市場公募地方債	1.24	100,000	103,222	2021/1/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	103,440	2021/2/25
第97回共同発行市場公募地方債	1.38	356,000	369,965	2021/4/23
第98回共同発行市場公募地方債	1.18	100,000	103,438	2021/5/25
第102回共同発行市場公募地方債	1.03	150,000	155,010	2021/9/24
第108回共同発行市場公募地方債	1.01	100,000	103,743	2022/3/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	103,981	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	103,427	2022/5/25
第112回共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	103,362	2022/7/25
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	103,147	2022/12/22
第119回共同発行市場公募地方債	0.8	200,000	207,292	2023/2/24
第125回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	104,135	2023/8/25

銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第127回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	103,444	2023/10/25
第128回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	103,348	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	200,000	207,956	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	310,536	2024/3/25
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	103,413	2024/7/25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	103,147	2024/8/23
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	102,846	2024/11/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	200,000	204,548	2025/4/25
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	206,640	2025/5/23
第148回共同発行市場公募地方債	0.553	125,400	129,526	2025/7/25
第159回共同発行市場公募地方債	0.07	300,000	298,797	2026/6/25
第160回共同発行市場公募地方債	0.05	200,000	198,864	2026/7/24
第161回共同発行市場公募地方債	0.06	300,000	298,392	2026/8/25
第164回共同発行市場公募地方債	0.05	100,000	99,290	2026/11/25
第166回共同発行市場公募地方債	0.18	100,000	100,347	2027/1/25
第171回共同発行市場公募地方債	0.185	200,000	200,446	2027/6/25
平成24年度第2回熊本県公募債(10年)	0.8	200,000	206,782	2022/10/26
平成22年度第1回静岡県公募債	1.008	100,000	102,438	2020/11/25
平成29年度第1回静岡県公募債	0.22	100,000	100,373	2027/11/24
第13回大阪市公募債(20年)	0.28	200,000	242,100	2030/6/14
平成22年度第5回大阪市公募債	1.2	100,000	102,702	2020/9/17
第5回名古屋市長公募債(30年)	2.49	100,000	134,461	2039/3/18
第9回名古屋市長公募債(20年)	2.07	100,000	119,399	2028/12/20
第11回名古屋市長公募債(30年)	1.774	100,000	121,459	2044/9/20
第481回名古屋市長公募債(10年)	0.744	100,000	103,252	2022/12/20
平成22年度第2回京都市公募債	1.11	102,000	104,481	2020/8/27
平成23年度第4回京都市公募債	1.067	100,000	103,714	2021/12/22
平成24年度第4回京都市公募債	0.801	100,000	103,385	2022/10/21
平成24年度第5回京都市公募債	0.854	100,000	103,848	2023/1/31
平成28年度第6回京都市公募債	0.18	100,000	100,347	2027/1/27
第5回横浜市公募債(20年)	2.17	100,000	114,711	2025/6/20
第20回横浜市公募債(20年)	2.1	100,000	120,488	2029/10/19
平成23年度第5回横浜市公募債	1.011	100,000	103,607	2022/1/28
平成28年度第4回横浜市公募債	0.175	100,000	100,304	2027/1/22
平成29年度第2回横浜市公募債	0.24	200,000	201,440	2027/7/16
平成30年度第1回横浜市公募債	0.195	100,000	100,099	2028/4/17
平成23年度第9回札幌市公募債(15年)	1.493	100,000	111,691	2027/2/12
平成24年度第10回札幌市公募債(10年)	0.8	100,000	103,507	2022/12/20
平成26年度第9回札幌市公募債(10年)	0.43	100,000	102,384	2024/12/20
第11回川崎市公募債(20年)	1.84	100,000	118,562	2030/10/18
第89回川崎市公募債	0.16	100,000	100,219	2026/12/18
平成26年度第2回北九州市公募債	0.451	100,000	102,525	2024/12/24
平成28年度第1回北九州市公募債	0.08	200,000	199,530	2026/4/15
平成28年度第4回北九州市公募債	0.165	145,000	145,378	2026/12/16
平成26年度第5回福岡市公募債	0.539	200,000	206,064	2024/10/28
平成22年度第6回広島市公募債	1.21	100,000	103,545	2021/5/31
平成25年度第3回広島市公募債	0.67	150,000	155,277	2024/2/23
平成26年度第2回広島市公募債	0.456	100,000	102,559	2024/12/25

当		期		末	
銘 柄 名		利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
平成28年度第4回広島市公募公債		0.165	105,000	105,231	2026/12/25
平成23年度第2回千葉市公募公債		1.06	200,000	207,228	2021/11/25
平成26年度第1回山梨県公募公債（10年）		0.33	200,000	203,452	2025/1/30
第113回福岡北九州高速道路債券		2.41	100,000	119,664	2027/12/20
小 計			19,845,920	20,918,377	
特殊債券（除く金融債）					
第3回政府保証公営企業債券（15年）		2.2	300,000	319,953	2021/5/2
第46回政府保証日本政策金融公庫債券		0.16	100,000	100,543	2027/7/20
第47回政府保証日本政策金融公庫債券		0.09	210,000	209,708	2027/9/24
第14回政府保証日本政策投資銀行債券		2.1	100,000	107,039	2021/9/13
第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債		0.668	100,000	103,351	2023/3/15
第22回政府保証日本政策投資銀行債券		2.2	100,000	111,293	2023/6/19
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	100,000	105,319	2021/2/26
第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	200,000	210,942	2021/3/26
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.4	100,000	141,663	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	242,106	2029/9/28
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	130,855	2040/5/31
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	102,335	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	100,000	102,418	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	204,670	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	206,362	2020/12/28
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	100,000	122,416	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	103,294	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	103,895	2021/4/30
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.1	100,000	103,592	2021/7/30
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	300,000	310,635	2021/10/29
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	301,000	311,336	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	207,466	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	103,785	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	103,542	2022/8/31
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.734	300,000	310,518	2022/12/28
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.66	100,000	118,261	2032/12/28
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.834	100,000	104,046	2023/1/31

当		期		末	
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.815	300,000	312,066	2023/2/28	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	200,000	206,708	2023/3/17	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.541	200,000	205,590	2023/4/28	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.605	300,000	309,531	2023/5/31	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.882	200,000	209,292	2023/6/30	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	148,000	154,489	2023/9/29	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.645	100,000	103,736	2024/3/29	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.475	200,000	231,844	2034/3/31	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.669	102,000	105,990	2024/4/30	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	100,000	103,886	2024/6/28	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.601	100,000	103,648	2024/7/31	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.539	100,000	103,366	2024/10/31	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.466	100,000	102,964	2024/12/27	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	300,000	306,000	2025/1/31	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.005	107,000	106,371	2026/11/30	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.085	316,000	316,158	2026/12/28	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	100,482	2027/3/31	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.14	300,000	301,326	2027/4/30	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.195	320,000	322,313	2028/2/29	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	101,000	103,326	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	103,133	2020/12/14	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	101,000	104,759	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	104,885	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	103,420	2022/1/25	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	103,996	2023/2/17	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.541	100,000	102,782	2023/4/21	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	100,000	103,146	2023/5/16	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	100,000	104,488	2023/8/14	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.66	200,000	207,492	2024/2/16	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.379	100,000	102,586	2025/12/12	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	100,000	99,805	2026/3/13	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.115	100,000	100,306	2027/1/19	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.14	251,000	252,104	2027/4/16	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.16	100,000	100,542	2027/7/16	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	100,501	2027/8/13	

当		期		末	
銘	柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第105	回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.195	110,000	110,792	2028/2/15
第44	回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.245	100,000	100,243	2019/6/20
第75	回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.2	100,000	100,261	2027/1/18
第5	回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.21	100,000	115,567	2025/12/19
第14	回道路債券	1.91	100,000	108,366	2022/12/20
第17	回道路債券	1.54	100,000	106,684	2022/12/20
第17	回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.35	400,000	471,956	2026/9/18
第21	回道路債券	2.75	100,000	133,388	2033/6/20
第28	回道路債券	2.83	200,000	270,420	2033/12/20
第33	回道路債券	2.91	200,000	274,286	2034/6/20
第34	回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	121,103	2028/3/17
第36	回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.84	100,000	149,876	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	121,656	2028/6/20
第47	回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	100,000	122,839	2029/4/20
第53	回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.38	100,000	101,771	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	103,541	2021/12/20
第82	回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.07	300,000	311,679	2022/3/18
第95	回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.773	100,000	118,653	2032/9/17
第104	回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.715	100,000	103,115	2023/3/20
第106	回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.038	100,000	104,638	2023/3/20
第115	回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.738	100,000	103,510	2023/9/20
第144	回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.476	100,000	102,417	2024/12/20
第153	回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.974	100,000	125,312	2055/3/19
第2	回公営企業債券（20年）	1.45	100,000	106,275	2022/12/20
第3	回公営企業債券（20年）	1.03	110,000	115,094	2023/3/22
第3	回地方公共団体金融機構債券（15年）	1.176	100,000	109,447	2029/1/26
第7	回公営企業債券（20年）	2.2	100,000	112,203	2024/3/22
第7	回公営企業債券（30年）	2.67	100,000	134,437	2035/6/20
第8	回公営企業債券（20年）	2.25	40,000	44,996	2024/3/22
第11	回地方公共団体金融機構債券	1.465	100,000	102,736	2020/4/28
第15	回地方公共団体金融機構債券	1.093	200,000	204,772	2020/8/28
第19	回公営企業債券（20年）	2.37	100,000	118,709	2026/12/18
第23	回地方公共団体金融機構債券	1.418	100,000	104,006	2021/4/28
第24	回地方公共団体金融機構債券（20年）	1.702	100,000	117,648	2032/9/28
第38	回地方公共団体金融機構債券	0.835	500,000	516,200	2022/7/28
第42	回地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	103,280	2022/11/28
第58	回地方公共団体金融機構債券	0.739	100,000	103,736	2024/3/28
第65	回地方公共団体金融機構債券	0.535	300,000	308,328	2024/10/28
第88	回地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	99,294	2026/9/28
F116	回地方公共団体金融機構債券	1.481	100,000	111,493	2027/4/23
F132	回地方公共団体金融機構債券	1.09	100,000	106,894	2025/7/30
F208	回地方公共団体金融機構債券	0.857	100,000	105,532	2026/2/4
F214	回地方公共団体金融機構債券	0.94	100,000	106,714	2027/4/28
第18	回株式会社日本政策金融公庫社債	2.157	100,000	122,648	2031/5/9
第43	回都市再生債券	1.29	100,000	102,901	2020/9/18

当		期		末	
銘	柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第5	回本州四国連絡橋債券	2.23	100,000	113,883	2024/12/20
第344	回東京交通債券	1.67	100,000	107,380	2023/2/17
第346	回東京交通債券	1.13	20,000	21,037	2023/6/20
第1	回貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.13	16,988	17,849	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	17,039	18,014	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	17,388	18,505	2037/11/10
第4	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	17,922	18,988	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	18,612	19,730	2038/5/10
第5	回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	14,955	15,520	2036/11/10
第6	回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	31,206	32,974	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	18,031	19,041	2038/11/10
第8	回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	16,487	17,419	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	19,165	20,308	2039/5/10
第9	回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	16,484	17,431	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	18,902	19,922	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	20,188	20,752	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	20,609	21,163	2032/5/10
第23	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.25	25,783	27,877	2044/4/10
第24	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	26,444	28,690	2044/5/10
第25	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	28,665	31,154	2044/6/10
第28	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	32,199	34,609	2044/9/10
第30	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	34,407	36,895	2044/11/10
第31	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	35,222	37,666	2044/12/10
第33	回一般担保住宅金融支援機構債券	1.47	100,000	101,548	2019/6/20
第34	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	74,338	79,481	2045/3/10
第36	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	17,039	17,790	2040/11/10
第36	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	38,138	40,456	2045/5/10
第39	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	17,064	17,798	2041/2/10
第41	回一般担保住宅金融支援機構債券	1.5	100,000	102,318	2019/12/20
第42	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	16,806	17,780	2041/5/10
第45	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	41,406	44,077	2046/2/10
第46	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	15,694	16,557	2041/9/10
第46	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	41,408	44,168	2046/3/10
第48	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	38,906	41,550	2046/5/10
第49	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	17,527	18,623	2041/12/10
第50	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	77,484	82,026	2046/7/10
第51	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	41,958	44,451	2046/8/10
第53	回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	17,991	19,026	2042/4/10
第55	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	53,581	56,484	2046/12/10
第56	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	51,286	54,062	2047/1/10
第57	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	51,011	53,810	2047/2/10
第58	回一般担保住宅金融支援機構債券	1.04	100,000	102,324	2020/9/18
第60	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	109,302	114,842	2047/5/10
第60	回一般担保住宅金融支援機構債券	1.33	100,000	103,320	2020/12/18
第63	回一般担保住宅金融支援機構債券	1.358	100,000	103,405	2020/12/18
第64	回一般担保住宅金融支援機構債券	1.838	100,000	112,783	2025/12/19
第66	回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	116,784	121,751	2047/11/10

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	58,957	61,382	2047/12/10
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	58,717	61,652	2048/1/10
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	60,053	63,142	2048/2/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	53,915	56,480	2048/3/10
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	54,792	56,964	2048/5/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	60,294	63,518	2048/6/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	182,440	2031/6/13
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	54,942	57,183	2048/12/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	62,071	64,481	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	63,387	65,893	2049/6/10
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	63,232	65,549	2049/8/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	119,396	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	135,012	139,906	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	67,854	70,019	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	140,002	143,455	2050/1/10
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8	77,867	80,061	2050/3/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	81,807	83,888	2050/5/10
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.83	80,730	83,233	2050/6/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	165,564	171,227	2050/8/10
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	81,846	84,440	2050/9/10
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	86,467	89,329	2051/1/10
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	93,554	93,742	2051/10/10
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	93,860	93,818	2051/11/10
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	1.473	100,000	111,676	2027/9/17
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	94,071	94,531	2051/12/10
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	94,716	95,640	2052/1/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	95,045	95,808	2052/2/10
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	96,826	97,501	2052/7/10
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	97,159	97,962	2052/8/10
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	97,406	97,899	2052/9/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	97,712	98,200	2052/10/10
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	98,098	98,678	2052/11/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	196,974	197,649	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	98,657	99,153	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	198,040	199,594	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	99,479	99,944	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	199,702	200,241	2053/4/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	100,000	100,377	2053/6/10
第134回一般担保住宅金融支援機構債券	2.105	100,000	128,621	2043/3/20
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	0.495	100,000	102,605	2025/9/19
第194回一般担保住宅金融支援機構債券	0.075	100,000	99,211	2026/10/20
第12回農林漁業金融公庫債券	2.24	100,000	118,006	2027/3/19
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	2.04	100,000	113,479	2025/6/20
第38回東日本高速道路株式会社債	0.03	100,000	99,903	2021/9/17
第33回中日本高速道路株式会社債	1.084	200,000	206,758	2021/9/17
第59回中日本高速道路株式会社債	0.309	100,000	100,904	2021/12/20
第27回西日本高速道路株式会社債	0.58	100,000	102,978	2025/9/2
第32回西日本高速道路株式会社債	0.2	100,000	99,997	2026/10/19
第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8	200,000	206,684	2022/12/20

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.685	100,000	103,229	2023/9/20
小 計		22,631,227	24,089,500	
金融債券				
い第779号商工債	0.22	100,000	100,238	2020/4/27
い第786号商工債	0.22	300,000	300,753	2020/11/27
い第795号商工債	0.03	200,000	199,186	2021/8/27
い第780号農林債	0.28	100,000	100,477	2020/5/27
い第795号農林債	0.03	100,000	99,851	2021/8/27
い第796号農林債	0.03	200,000	199,706	2021/9/27
第299回信金中金債(5年)	0.2	100,000	100,220	2019/10/25
第300回信金中金債(5年)	0.225	300,000	300,825	2019/11/27
第303回信金中金債(5年)	0.25	100,000	100,376	2020/2/27
第309回信金中金債(5年)	0.25	100,000	100,423	2020/8/27
第317回信金中金債(5年)	0.06	200,000	199,958	2021/4/27
第338回信金中金債(5年)	0.11	100,000	100,000	2023/1/27
第201号商工債(3年)	0.01	300,000	299,628	2019/10/25
小 計		2,200,000	2,201,641	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第455回東京電力株式会社社債	2.075	120,000	120,952	2018/10/23
第459回東京電力株式会社社債	2.7	10,000	10,175	2019/1/29
第528回東京電力株式会社社債	1.905	100,000	101,844	2019/6/13
第554回東京電力株式会社社債	1.976	100,000	100,140	2018/6/25
第554回東京電力株式会社社債	1.608	100,000	101,494	2019/5/29
第499回中部電力株式会社社債	1.194	100,000	105,145	2023/6/23
第503回中部電力株式会社社債	0.584	100,000	102,137	2025/3/25
第507回中部電力株式会社社債	0.605	100,000	102,358	2026/1/23
第496回関西電力株式会社社債	0.908	100,000	103,950	2025/2/25
第505回関西電力株式会社社債	0.24	100,000	100,079	2023/8/25
第508回関西電力株式会社社債	0.455	100,000	100,473	2027/4/23
第385回中国電力株式会社社債	0.728	100,000	103,142	2025/7/25
第402回中国電力株式会社社債	0.25	100,000	99,972	2024/10/25
第307回北陸電力株式会社社債	1.055	100,000	105,867	2026/6/25
第322回北陸電力株式会社社債	0.38	100,000	100,220	2027/6/25
第471回東北電力株式会社社債	1.168	126,000	132,322	2023/12/25
第481回東北電力株式会社社債	0.803	100,000	103,523	2025/7/25
第487回東北電力株式会社社債	0.17	100,000	99,659	2023/9/25
第253回四国電力株式会社社債	1.0	100,000	104,118	2023/6/23
第426回九州電力株式会社社債	1.064	100,000	104,428	2024/2/23
第449回九州電力株式会社社債	0.43	100,000	100,344	2027/4/23
第320回北海道電力株式会社社債	0.585	101,000	102,452	2021/12/24
第326回北海道電力株式会社社債	0.789	100,000	103,315	2025/12/25
第340回北海道電力株式会社社債	0.48	100,000	100,601	2027/4/23
第21回清水建設株式会社無担保社債	0.39	100,000	100,405	2021/12/3
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	100,000	100,084	2027/11/30
第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.22	100,000	99,992	2024/9/13
第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	0.23	100,000	100,200	2024/6/13
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	102,189	2019/11/5

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第10回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	0.603	100,000	102,473	2025/2/28
第10回日本たばこ産業株式会社債	0.358	100,000	100,915	2022/7/15
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	0.949	100,000	103,127	2024/4/24
第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.856	100,000	103,015	2024/7/29
第111回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.16	100,000	99,908	2022/5/31
第12回日本製紙株式会社無担保社債	0.97	100,000	103,362	2024/6/19
第57回住友化学株式会社無担保社債	0.24	200,000	199,736	2024/9/13
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	101,677	2020/6/4
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.37	100,000	100,274	2028/2/25
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.34	100,000	99,944	2028/3/23
第42回DIC株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,990	2023/4/17
第8回楽天株式会社無担保社債	0.32	100,000	99,962	2024/6/25
第7回東豊ゼネラル石油株式会社無担保社債	0.925	100,000	103,787	2024/10/23
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	0.82	100,000	103,064	2024/6/4
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.295	100,000	100,035	2027/4/21
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	0.703	100,000	102,614	2024/9/19
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	0.494	100,000	101,174	2022/2/25
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	0.15	100,000	99,730	2024/6/20
第5回日本電産株式会社無担保社債	0.001	100,000	99,875	2019/11/25
第36回富士通株式会社無担保社債	0.562	200,000	202,368	2021/6/11
第12回パナソニック株式会社無担保社債	0.387	100,000	100,527	2020/3/19
第13回パナソニック株式会社無担保社債	0.568	200,000	203,174	2022/3/18
第16回パナソニック株式会社無担保社債	0.3	100,000	100,437	2023/9/20
第12回株式会社デンソー無担保社債	0.01	100,000	99,722	2021/9/17
第18回株式会社デンソー無担保社債	0.315	100,000	100,048	2028/3/17
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	1.482	100,000	102,112	2019/12/9
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	0.662	100,000	102,578	2024/9/3
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	0.33	100,000	99,821	2027/8/27
第6回J3井リース株式会社無担保社債	0.2	100,000	99,988	2022/1/27
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	0.304	100,000	100,110	2021/8/2
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	0.35	100,000	100,340	2022/8/4
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	0.16	200,000	198,516	2026/9/25
第8回株式会社ドンキホーテホールディングス無担保社債	0.55	100,000	100,454	2020/3/12
第21回株式会社ニコン無担保社債	0.864	100,000	103,407	2024/3/14
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.65	100,000	102,646	2020/3/12
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.785	100,000	102,669	2024/5/30
第2回ユニー・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保	0.24	100,000	100,445	2024/2/22
第70回三井物産株式会社無担保社債	2.021	100,000	118,627	2033/3/4
第74回三菱商事株式会社無担保社債	1.657	100,000	101,815	2019/7/29
第76回三菱商事株式会社無担保社債	1.303	100,000	103,446	2021/5/24

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.904	100,000	102,838	2024/4/24
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債 (劣後特約付)	2.91	100,000	125,279	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	102,806	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	104,214	2021/6/9
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.34	100,000	118,076	2027/4/20
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	0.82	100,000	103,288	2023/1/23
第1回三井住友FG無担保社債 (実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.849	100,000	102,276	2024/9/12
第6回株式会社りそな銀行無担保社債 (劣後特約付)	2.084	100,000	103,395	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	103,116	2020/3/2
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	0.223	100,000	100,225	2019/9/3
第1回みずほFG無担保社債 (実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.95	100,000	102,852	2024/7/16
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債 (劣後特約付)	2.21	100,000	102,401	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	102,944	2020/9/28
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債 (劣後特約付)	2.04	100,000	104,085	2020/8/7
第39回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.001	100,000	99,854	2019/12/20
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.233	100,000	100,390	2021/9/17
第23回リコー株式会社無担保社債	0.05	100,000	99,673	2021/9/24
第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.572	100,000	100,577	2021/3/18
第67回アコム株式会社無担保社債	0.5	100,000	100,219	2019/6/6
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	100,000	104,602	2026/9/18
第193回オリックス株式会社無担保社債	0.26	100,000	99,560	2024/9/13
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,351	2023/10/25
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,915	2022/1/26
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.375	100,000	100,302	2027/7/13
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.455	100,000	100,362	2028/1/18
第19回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.412	100,000	100,396	2020/2/25
第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債	1.249	100,000	101,997	2020/2/26
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	200,000	199,278	2027/6/18
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	103,138	2024/4/26
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	1.12	100,000	103,125	2021/9/17
第133回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	1.168	100,000	104,174	2023/6/26
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	100,000	105,882	2026/6/17
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	100,000	105,072	2025/12/12
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	1.412	100,000	102,030	2019/12/9
第17回東日本旅客鉄道株式会社債	2.3	100,000	106,223	2021/2/25

当		期		末	
銘 柄 名		利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債		2.36	100,000	108,581	2022/2/25
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債		2.376	200,000	243,656	2028/12/12
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債		0.06	100,000	99,031	2026/7/28
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債		1.133	100,000	105,395	2047/7/26
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債		2.28	19,000	20,600	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	121,226	2028/3/17
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債		1.024	100,000	95,276	2056/12/13
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債		1.042	100,000	103,068	2047/8/30
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債		2.2	20,000	21,677	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	102,440	2019/9/20
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債		2.375	100,000	132,115	2039/12/16
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債		1.917	100,000	124,098	2044/10/28
第31回東京地下鉄株式会社社債		1.22	100,000	101,388	2058/5/24
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債		0.21	100,000	99,960	2024/12/6
第63回日本電信電話株式会社電信債券		0.69	200,000	205,008	2023/3/20
第20回KDDI株式会社無担保社債		0.803	100,000	102,686	2023/12/20
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債		0.73	100,000	102,857	2023/9/20
第13回電源開発株式会社無担保社債		2.04	100,000	112,138	2025/6/20
第38回電源開発株式会社無担保社債		0.978	100,000	104,040	2023/12/20
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	103,610	2023/6/20
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債		0.491	100,000	101,210	2022/12/16
第20回フランス相互信用連合銀行（BFCM）円貨社債		0.16	100,000	99,987	2021/10/14
第24回フランス相互信用連合銀行（BFCM）円貨社債		0.384	100,000	100,567	2024/10/11

当		期		末	
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日	
第2回B・P・C・E・S・A 円貨社債（ソーシャルボンド）	0.367	100,000	100,490	2024/6/28	
第11回ビー・ビー・シー・ イー・エス・エー円貨社債	0.437	100,000	100,782	2020/12/11	
第14回ビー・ビー・シー・ イー・エス・エー円貨社債	0.45	100,000	100,426	2026/6/17	
第15回ビー・ビー・シー・ イー・エス・エー円貨社債	0.38	100,000	100,651	2024/1/26	
第17回ビー・ビー・シー・ イー・エス・エー円貨社債	0.217	100,000	100,077	2023/1/25	
第13回クレディ・アグリ コル・エス・エー円貨社債	0.343	100,000	100,351	2024/6/7	
第4回スウェンスカ・ハンデ ルスバンケンAB円貨社債	0.325	100,000	100,251	2019/9/4	
第6回スウェンスカ・ハンデ ルスバンケンAB円貨社債	0.292	100,000	100,218	2020/9/3	
第1回HSBC・ホールディン グス・ビーエルシー円貨社債	0.45	100,000	100,852	2021/9/24	
第6回ビー・エス・ビー・パリバ円貨社債	0.439	100,000	100,312	2019/9/17	
第11回ナショナル・オー ストリア銀行円貨社債	0.284	100,000	100,214	2020/1/16	
第11回ウエストバック・バン キング・コーポレーション円貨社債	0.3	100,000	100,342	2021/1/22	
第9回オーストラリア・ニュ ージーランド銀行円貨社債	0.343	100,000	100,390	2020/7/24	
第27回ラボバンク・ネーダ ーランド円貨社債	0.38	200,000	200,912	2020/5/22	
第8回ソシエテ ジェネラ ル円貨社債	0.28	100,000	100,158	2023/6/2	
小 計		14,796,000	15,210,450		
合 計		350,488,147	378,689,101		

投資信託財産の構成

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	378,689,101	98.9	4,113,567	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	4,113,567	1.1	382,802,668	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 2018年5月29日現在
(A) 資 産	382,907,617,759円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,177,898,424
公 社 債(評価額)	378,689,101,857
未 収 入 金	348,984
未 収 利 息	908,651,934
前 払 費 用	26,657,560
差 入 委 託 証 拠 金	104,959,000
(B) 負 債	3,772,015,761
未 払 金	3,494,668,100
未 払 解 約 金	172,372,754
未 払 利 息	8,452
差入委託証拠金代用有価証券	104,949,000
そ の 他 未 払 費 用	17,455
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	379,135,601,998
元 本	272,091,024,387
次 期 繰 越 損 益 金	107,044,577,611
(D) 受 益 権 総 口 数	272,091,024,387口
1万口当たり基準価額(C/D)	13.934円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2017年5月30日 至 2018年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	2,986,732,628円
受 取 利 息	2,987,774,939
支 払 利 息	△1,042,311
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△269,233,310
売 買 益	1,322,929,864
売 買 損	△1,592,163,174
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△9,212,528
取 引 益	12,434,568
取 引 損	△21,647,096
(D) そ の 他 費 用	△39,163
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	2,708,247,627
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	83,280,945,476
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	26,497,935,451
(H) 解 約 差 損 益 金	△5,442,550,943
(I) 計 (E+F+G+H)	107,044,577,611
次 期 繰 越 損 益 金(I)	107,044,577,611

(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217,479,302,929円、期中追加設定元本額は68,721,169,318円、期中一部解約元本額は14,109,447,860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 103,427,000円

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DC日本債券インデックス・オープンS	76,056,410,096円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	37,387,106,517円
DC日本債券インデックス・オープンP	34,831,109,573円
DCマイセクション50	21,632,804,378円
DCマイセクション25	19,007,723,500円
SMT 国内債券インデックス・オープン	12,261,908,712円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,558,348,422円
DCマイセクションS50	8,408,444,084円
DCマイセクションS25	7,347,803,493円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,805,663,836円
DCマイセクション75	6,001,458,771円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	5,493,894,344円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,390,993,854円

SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,271,929,476円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,190,944,409円
DCマイセレクションS75	1,690,810,911円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,689,192,678円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,527,962,070円
世界経済インデックスファンド	1,508,902,433円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,255,434,438円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,142,719,584円
DC世界経済インデックスファンド	1,142,117,518円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	1,109,926,766円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	903,500,457円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	874,627,981円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	604,092,814円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	454,196,994円
DC日本債券インデックス・オープン	448,841,533円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	352,575,076円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	321,989,180円
グローバル経済コア	251,147,761円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	206,645,325円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	180,795,517円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	180,495,489円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	102,402,986円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	98,269,413円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	82,689,843円
SMT インデックスバランス・オープン	79,574,343円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	67,743,534円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	49,053,828円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	35,464,466円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	17,151,654円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	16,268,159円
SBI資産設計オープン(分配型)	16,168,336円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	15,228,405円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	8,704,364円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	4,143,525円
エマージング株式オープン	2,227,240円
SMT 世界経済インデックス・オープン	1,669,493円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	951,991円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	727,332円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	67,485円

お知らせ

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

(変更日:2017年10月2日)

野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）

第11期～第13期(2018年 1 月10日～2018年 7 月 9 日)

○当ファンドの仕組み

商品分類	—	
信託期間	2016年2月17日以降、無期限とします。	
運用方針	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とし、MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。実質組入外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主な投資対象	野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。
	マザーファンド	外国の株式を主要投資対象とします。
主な投資制限	野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド	株式への実質投資割合には制限を設けません。
	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。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配倍)	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産額
		税込分配	期中騰落率	期騰落	期中騰落率				
(設定日)	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2016年2月17日	10,000	—	—	100.00	—	—	—	—	1
1期(2016年7月7日)	9,600	75	△ 3.3	96.89	△ 3.1	94.9	2.1	2.9	2,295
2期(2016年9月7日)	10,220	30	6.8	103.62	6.9	95.8	1.3	2.8	2,493
3期(2016年11月7日)	9,932	20	△ 2.6	101.06	△ 2.5	95.9	1.3	2.6	2,392
4期(2017年1月10日)	11,924	40	20.5	121.67	20.4	95.5	1.8	2.6	2,553
5期(2017年3月7日)	12,189	30	2.5	124.89	2.6	95.3	2.1	2.6	3,139
6期(2017年5月8日)	12,425	40	2.3	127.86	2.4	95.8	1.5	2.5	4,028
7期(2017年7月7日)	12,551	55	1.5	129.78	1.5	96.6	0.7	2.6	5,110
8期(2017年9月7日)	12,405	45	△ 0.8	128.88	△ 0.7	96.0	1.4	2.6	7,513
9期(2017年11月7日)	13,482	25	8.9	140.22	8.8	96.3	1.1	2.5	10,157
10期(2018年1月9日)	14,116	40	5.0	147.57	5.2	96.1	1.4	2.4	14,743
11期(2018年3月7日)	12,950	30	△ 8.0	135.78	△ 8.0	96.2	1.4	2.3	17,575
12期(2018年5月7日)	13,176	50	2.1	138.73	2.2	96.3	1.3	2.4	20,000
13期(2018年7月9日)	13,591	65	3.6	144.03	3.8	96.1	1.4	2.4	25,407

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

* ベンチマーク（＝MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・為替ヘッジなし））は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のMSCI-KOKUSAI指数（米ドルベース）をもとに、営業日当日の米ドル為替レート（対顧客電信売買相場仲値）で当社が円換算しています。なお、設定時を100として再指数化しています。

* MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。

ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したのではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関してもいかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。

請求目論見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。

(出所) MSCI

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		円	騰 落 率		騰 落 率	%	%	%
第11期	(期 首) 2018年1月9日	14,116	—	147.57	—	96.1	1.4	2.4
	1月末	13,932	△1.3	145.65	△ 1.3	96.8	0.9	2.3
	2月末	13,303	△5.8	139.15	△ 5.7	96.6	1.1	2.2
	(期 末) 2018年3月7日	12,980	△8.0	135.78	△ 8.0	96.2	1.4	2.3
第12期	(期 首) 2018年3月7日	12,950	—	135.78	—	96.2	1.4	2.3
	3月末	12,708	△1.9	133.29	△ 1.8	95.6	1.9	2.4
	4月末	13,275	2.5	139.33	2.6	95.9	1.7	2.3
	(期 末) 2018年5月7日	13,226	2.1	138.73	2.2	96.3	1.3	2.4
第13期	(期 首) 2018年5月7日	13,176	—	138.73	—	96.3	1.3	2.4
	5月末	13,289	0.9	139.97	0.9	95.2	2.3	2.3
	6月末	13,393	1.6	141.27	1.8	96.4	1.1	2.4
	(期 末) 2018年7月9日	13,656	3.6	144.03	3.8	96.1	1.4	2.4

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○当作成期中の運用経過と今後の運用方針

【基準価額の推移】

基準価額は、当作成期首14,116円から当作成期末13,591円（分配落ち後）となりました。この間、合計145円の分配金をお支払いしましたので、分配金を考慮した値下がり額は380円となりました。当作成期の基準価額の騰落率は－2.7%（分配金再投資ベース）となり、ベンチマークの－2.4%を0.3%下回りました。当作成期首から、米国長期金利の上昇などをきっかけに株式の価格変動率が高まり投資家心理が悪化したことや、米中貿易摩擦への懸念、主要通貨が対円で下落したことなどから、基準価額は下落しました。その後、米中貿易摩擦や中東情勢に対する警戒感が緩和したこと、米国の経済指標の底固さが示されたことなどを背景に上昇しましたが、当作成期を通じては下落となりました。

【運用経過】

【外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド】 受益証券を主要な投資対象とし、当作成期を通じてほぼ全額を投資しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

【外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド】の運用につきましては、株式の実質組入比率（投資信託証券や先物を含む）は、当作成期を通じて高位に維持しました。MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指し、現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がMSCI-KOKUSAI指数の中で占める比率にほぼ一致させ、MSCI-KOKUSAI指数の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行い、また資金流入に対しても速やかに対応しました。なお為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

【分配金】

当作成期を通じて、配当等収益から、1万口当たり計145円の収益分配を行いました。尚、留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

【今後の運用方針】

主要投資対象である【外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド】 受益証券を高位に組み入れ、引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・為替ヘッジなし）*の中長期的な動きを捉える投資成果を目指します。

【外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド】の運用につきましては、引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）*の中長期的な動きを捉える投資成果を目指して運用を行います。

※野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）のベンチマークである「MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・為替ヘッジなし）」は、主要投資対象である外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドのベンチマークである「MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）」と同一の指数です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2018年 1 月10日～2018年 7 月 9 日)

項 目	第11期～第13期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 11	% 0.086	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(9)	(0.070)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
(販 売 会 社)	(1)	(0.005)	口座内でのファンドの管理および事務手続き等
(受 託 会 社)	(1)	(0.011)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※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)	(0)	(0.001)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.005	(c) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(1)	(0.005)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	3	0.022	(d) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.005)	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)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(2)	(0.015)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	15	0.114	
作成期間の平均基準価額は、13,316円です。			

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている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。

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

○売買及び取引の状況

(2018年1月10日～2018年7月9日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第11期～第13期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	千口 4,263,120	千円 11,097,992	千口 124,439	千円 328,594

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2018年1月10日～2018年7月9日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第11期～第13期
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド
(a) 当作成期中の株式売買金額	44,463,856千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	457,290,543千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.09

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2018年1月10日～2018年7月9日)

該当事項はございません。

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。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2018年1月10日～2018年7月9日)

第11期首残高 (元本)	設定元本	解約元本	第13期末残高 (元本)	取 引 の 理 由
百万円 1	百万円 —	百万円 —	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2018年7月9日現在)

親投資信託残高

銘柄	第10期末	第13期末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	千口 5,381,962	千口 9,520,643	千円 25,404,884

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2018年7月9日現在)

項 目	第13期末	
	評 価 額	比 率
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	千円 25,404,884	% 99.5
コール・ローン等、その他	130,892	0.5
投資信託財産総額	25,535,776	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、第13期末における外貨建て純資産（502,945,674千円）の投資信託財産総額（503,906,603千円）に対する比率は99.8%です。

*外貨建て資産は、第13期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル＝110.49円、1カナダドル＝84.37円、1英ポンド＝146.84円、1スイスフラン＝111.71円、1スウェーデンクローナ＝12.64円、1ノルウェークローネ＝13.74円、1デンマーククローネ＝17.43円、1ユーロ＝129.87円、1香港ドル＝14.08円、1シンガポールドル＝81.43円、1豪ドル＝82.27円、1ニュージーランドドル＝75.54円、1新シェケル＝30.49円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第11期末	第12期末	第13期末
	2018年3月7日現在	2018年5月7日現在	2018年7月9日現在
	円	円	円
(A) 資産	17,620,196,977	20,082,113,116	25,535,776,285
コール・ローン等	6,182,336	7,501,463	9,261,936
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	17,573,300,810	19,998,714,403	25,404,884,629
未収入金	40,713,831	75,897,250	121,629,720
(B) 負債	45,133,922	81,389,971	128,361,793
未払収益分配金	40,713,830	75,897,249	121,509,206
未払信託報酬	4,338,750	5,391,632	6,726,472
未払利息	9	15	18
その他未払費用	81,333	101,075	126,097
(C) 純資産総額(A－B)	17,575,063,055	20,000,723,145	25,407,414,492
元本	13,571,276,940	15,179,449,903	18,693,724,135
次期繰越損益金	4,003,786,115	4,821,273,242	6,713,690,357
(D) 受益権総口数	13,571,276,940口	15,179,449,903口	18,693,724,135口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,950円	13,176円	13,591円

(注) 第11期首元本額は10,444,057,376円、第11～13期中追加設定元本額は8,337,309,698円、第11～13期中一部解約元本額は87,642,939円、1口当たり純資産額は、第11期1.2950円、第12期1.3176円、第13期1.3591円です。

○損益の状況

項 目	第11期	第12期	第13期
	2018年1月10日～ 2018年3月7日	2018年3月8日～ 2018年5月7日	2018年5月8日～ 2018年7月9日
	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 263	△ 480	△ 794
支払利息	△ 263	△ 480	△ 794
(B) 有価証券売買損益	△1,357,613,705	434,591,167	816,168,914
売買益	1,785	438,064,099	819,214,776
売買損	△1,357,615,490	△ 3,472,932	△ 3,045,862
(C) 信託報酬等	△ 4,420,083	△ 5,492,707	△ 6,852,569
(D) 当期繰越損益金 (A + B + C)	△1,362,034,051	429,097,980	809,315,551
(E) 前期繰越損益金	1,688,370,892	285,589,050	638,171,781
(F) 追加信託差損益金	3,718,163,104	4,182,483,461	5,387,712,231
(配当等相当額)	(3,255,116,421)	(3,848,035,310)	(5,138,216,833)
(売買損益相当額)	(463,046,683)	(334,448,151)	(249,495,398)
(G) 計 (D + E + F)	4,044,499,945	4,897,170,491	6,835,199,563
(H) 収益分配金	△ 40,713,830	△ 75,897,249	△ 121,509,206
次期繰越損益金 (G + H)	4,003,786,115	4,821,273,242	6,713,690,357
追加信託差損益金	3,718,163,104	4,182,483,461	5,387,712,231
(配当等相当額)	(3,261,090,043)	(3,852,833,824)	(5,148,815,802)
(売買損益相当額)	(457,073,061)	(329,649,637)	(238,896,429)
分配準備積立金	1,690,377,176	1,692,131,767	1,685,818,960
繰越損益金	△1,404,754,165	△1,053,341,986	△ 359,840,834

* 損益の状況の中で (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

○お知らせ

該当事項はございません。

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

第16期(計算期間：2017年4月1日～2018年4月2日)

○当期中の運用経過と今後の運用方針

【運用経過】

- (1) 株式の実質組入比率（投資信託証券や先物を含む）は、期を通じて高位に維持しました。MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指し、現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がMSCI-KOKUSAI指数の中で占める比率にほぼ一致させました。MSCI-KOKUSAI指数の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行い、また資金流入出に対しても速やかに対応しました。なお為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。
- (2) 基準価額は、期首23,082円から期末24,752円となりました。ベンチマークとしているMSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）が7.4%の上昇となったのに対して、基準価額は7.2%の上昇となりました。

【今後の運用方針】

MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを捉える投資成果をめざして運用を行います。

*MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のMSCI-KOKUSAI指数（米ドルベース）をもとに、営業日当日の米ドル為替レート（対顧客電信売買相場仲値）で当社が円換算しています。

*MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。

ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したものではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。

請求目論見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。

(出所) MSCI

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年 4 月 1 日～2018年 4 月 2 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 1	% 0.003	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※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)	(0)	(0.002)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.001)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	3	0.012	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(3)	(0.011)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	3	0.011	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、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 信託事務の処理に要するその他の諸費用
(保 管 費 用)	(3)	(0.010)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	7	0.026	
期中の平均基準価額は、24,868円です。			

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2017年4月1日～2018年4月2日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 68,441 (1,630)	千米ドル 499,072 (1,896)	百株 16,567 (2,543)	千米ドル 84,528 (16,464)
	カナダ	9,835 (207)	千カナダドル 39,769 (3,689)	2,628	千カナダドル 5,173
	イギリス	79,226 (212,030)	千英ポンド 46,133 (592)	10,971 (214,110)	千英ポンド 6,337 (808)
	スイス	4,264 (2,133)	千スイスフラン 26,557 (△ 561)	2,692 (185)	千スイスフラン 3,567 (6,650)
	スウェーデン	5,139 (1,197)	千スウェーデンクローナ 72,545 (14,969)	1,314 (245)	千スウェーデンクローナ 11,219 (14,621)
	ノルウェー	1,261 (—)	千ノルウェークローネ 16,545 (△ 419)	128	千ノルウェークローネ 2,480
	デンマーク	1,319	千デンマーククローネ 41,861	216	千デンマーククローネ 6,958
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	5,942 (385)	29,920 (3,005)	638 (203)	2,693 (3,205)
	イタリア	14,161 (△ 2,958)	7,992 (4)	1,968 (2,290)	846 (1)
	フランス	7,206 (43)	32,500 (△ 123)	793	5,455
	イギリス	26	92	245	795
	オランダ	4,110 (△ 1,183)	10,210 (9)	609	1,485
	スペイン	11,793 (39,843)	9,615 (1,088)	5,428 (40,996)	1,644 (378)
	ベルギー	407 (107)	3,069 (—)	35	302
	オーストリア	223 (△ 456)	783 (△ 30)	85	137
	ルクセンブルグ	2	101	—	—
	フィンランド	1,919 (350)	2,506 (—)	262	233
	アイルランド	1,507 (△ 27,550)	1,743 (—)	95	154
	ボルトガル	420	324	—	—

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	香港	百株 26,792 (3,775)	千香港ドル 82,381 (5,744)	百株 3,772 (0.22)	千香港ドル 9,703 (5,744)
	シンガポール	11,714	千シンガポールドル 5,091	610 (3,020)	千シンガポールドル 551 (848)
	オーストラリア	16,090 (1,677)	千豪ドル 26,630 (905)	2,188 (3,855)	千豪ドル 3,032 (1,283)
	ニュージーランド	1,978	千ニュージーランドドル 1,383	760	千ニュージーランドドル 415
	イスラエル	894	千新シェケル 2,579	—	千新シェケル —

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

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

投資信託証券

銘	柄	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
	AGNC INVESTMENT CORP	9,900	205	—	—
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,400	408	—	—
	AMERICAN TOWER CORP	10,300	1,449	1,800	268
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	37,000	432	—	—
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,070	554	—	—
	BOSTON PROPERTIES	3,500	431	700	83
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7,000	126	—	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	2,300	207	—	—
	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	8,000	116	—	—
	CROWN CASTLE INTL CORP	13,000	1,342	1,200	135
	DIGITAL REALTY TRUST INC	9,000	1,059	—	—
	DUKE REALTY CORP	4,900	140	—	—
	EQUINIX INC	1,670	744	—	—
	EQUITY RESIDENTIAL	8,600	564	—	—
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	352	—	—
	EXTRA SPACE STORAGE INC	2,300	183	—	—
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	990	131	—	—
	GGP INC	11,700	252	—	—
	HCP INC	6,900	204	—	—
	HOST HOTELS & RESORTS INC	17,900	326	—	—
	INVITATION HOMES INC	34,000	789	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	6,900	260	—	—
	JBG SMITH PROPERTIES	— (8,700)	— (—)	8,700	298
	KIMCO REALTY CORP	11,000	201	—	—
	LIBERTY PROPERTY TRUST	2,600	107	—	—
	MACERICH CO /THE	1,900	126	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,500	241	—	—
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2,600	109	—	—
	PROLOGIS INC	10,000	619	—	—
	PUBLIC STORAGE	3,850	791	—	—
	REALTY INCOME CORP	7,400	407	—	—
	REGENCY CENTERS CORP	1,900	122	—	—
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,800	269	—	—
	SL GREEN REALTY CORP	1,200	122	—	—
	SIMON PROPERTY GROUP INC	6,180	985	800	130
	UDR INC	5,500	216	—	—
	VENTAS INC	5,400	354	—	—
	VEREIT INC	14,000	118	—	—
	VORNADO REALTY TRUST	4,000	304	—	—
	WELLTOWER INC	8,200	546	—	—
	WEYERHAEUSER CO	16,000	548	—	—
	小 計	309,760 (8,700)	16,478 (—)	13,200	917
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	BRITISH LAND	22,000	142	—	—
	HAMMERSON PLC	15,000	87	—	—
	INTU PROPERTIES PLC	—	—	88,000	172
	LAND SECURITIES GROUP PLC	8,500 (△ 86,000)	87 (△ 883)	—	—

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	イギリス	口	千英ポンド	口	千英ポンド
	SEGRO PLC	26,800	142	—	—
	LAND SECURITIES GROUP PLC	8,375	77	—	—
		(80,625)	(883)	(—)	(51)
	小 計	80,675	537	88,000	172
		(△ 5,375)	(—)	(—)	(51)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	KLEPIERRE	4,400	152	—	—
	GECINA SA	1,600	220	—	—
	GECINA SA - RTS	—	—	4,000	9
		(4,000)	(—)		
	FONCIERE DES REGIONS	900	79	—	—
		(—)	(△ 3)		
	UNIBAIL RODAMCO-NA	2,110	453	—	—
	小 計	9,010	905	4,000	9
		(4,000)	(△ 3)		
	ユ ー ロ 計	9,010	905	4,000	9
		(4,000)	(△ 3)		
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	37,000	2,303	—	—
	小 計	37,000	2,303	—	—
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	CAPITALAND MALL TRUST	60,100	123	—	—
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	43,000	115	—	—
		(—)	(△ 1)		
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	76,100	125	—	—
		(31,872)	(52)		
	CAPITACOMMERCIAL TRUST RIGHTS	—	—	—	—
		(31,872)	(43)	(31,872)	(8)
	SUNTEC REIT	57,000	106	—	—
		(—)	(△ 3)		
	小 計	236,200	471	—	—
		(63,744)	(91)	(31,872)	(8)
	オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
	MIRVAC GROUP	90,000	213	—	—
	GPT GROUP	24,000	116	—	—
	LENDLEASE GROUP	8,000	135	—	—
	STOCKLAND TRUST GROUP	47,000	209	—	—
	DEXUS	22,000	216	—	—
	GOODMAN GROUP	40,000	332	—	—
	SCENTRE GROUP	94,000	404	—	—
	WESTFIELD CORP	55,000	451	12,000	95
	VICINITY CENTRES	44,296	120	—	—
	小 計	424,296	2,199	12,000	95

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

* () 内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	株式先物取引	百万円 78,491	百万円 78,841	百万円 —	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

*外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○株式売買比率

(2017年4月1日～2018年4月2日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	101,031,067千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	410,066,616千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.24

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2017年4月1日～2018年4月2日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 95,526	百万円 2,260	% 2.4	百万円 31,171	百万円 425	% 1.4

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

○組入資産の明細

(2018年4月2日現在)

外国株式

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		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		
AFLAC INC	400	924	4,043	429,815	保険	
AGCO CORP	63	78	505	53,769	機械	
AES CORP	650	740	841	89,438	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
AT & T INC	5,980	7,144	25,468	2,707,286	各種電気通信サービス	
ABBOTT LABORATORIES	1,680	2,012	12,055	1,281,542	ヘルスケア機器・用品	
ABBVIE INC	1,585	1,858	17,585	1,869,388	バイオテクノロジー	
ACTIVISION BLIZZARD INC	577	840	5,666	602,363	ソフトウェア	
ACUITY BRANDS INC	43	50	695	73,979	電気設備	
ADOBE SYSTEMS INC.	486	574	12,418	1,320,045	ソフトウェア	
ADVANCE AUTO PARTS	71	83	983	104,595	専門小売り	
ADVANCED MICRO DEVICES	780	900	904	96,148	半導体・半導体製造装置	
AETNA INC	343	381	6,438	684,455	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	52	65	1,232	130,990	資本市場	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	312	365	2,441	259,568	ライフサイエンス・ツール/サービス	
AIR PRODUCTS	199	251	3,991	424,312	化学	
AKAMAI TECHNOLOGIES	166	191	1,355	144,112	インターネットソフトウェア・サービス	
ALBEMARLE CORP	111	122	1,131	120,270	化学	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	216	263	2,931	311,607	バイオテクノロジー	
ALIGN TECHNOLOGY INC	71	88	2,225	236,518	ヘルスケア機器・用品	
ALLEGHANY CORP	15	17	1,056	112,341	保険	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	49	59	1,268	134,857	情報技術サービス	
ALLIANT ENERGY CORP	229	253	1,033	109,888	電力	
ALLSTATE CORP	361	411	3,896	414,174	保険	
ALLY FINANCIAL INC	421	527	1,430	152,094	消費者金融	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	99	1,179	125,337	バイオテクノロジー	
ALPHABET INC-CL C	302	365	37,742	4,012,067	インターネットソフトウェア・サービス	
ALPHABET INC-CL A	288	346	35,978	3,824,502	インターネットソフトウェア・サービス	
ALTRIA GROUP INC	1,901	2,223	13,853	1,472,652	タバコ	
AMAZON.COM INC	393	476	68,907	7,324,905	インターネット販売・通信販売	
AMERCO	6	6	234	24,945	陸運・鉄道	
AMEREN CORPORATION	229	287	1,625	172,767	総合公益事業	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	125	146	758	80,640	旅客航空輸送業	
AMERICAN ELECTRIC POWER	482	573	3,930	417,781	電力	
AMERICAN EXPRESS CO	752	862	8,040	854,730	消費者金融	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	—	84	942	100,203	保険	
AMERICAN INTL GROUP	1,003	1,052	5,724	608,565	保険	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	168	208	1,708	181,592	水道	
AMERISOURCEBERGEN CORP	156	192	1,655	175,951	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	150	173	2,559	272,060	資本市場	
AMETEK INC	219	268	2,035	216,426	電気設備	
AMGEN INC	725	785	13,382	1,422,578	バイオテクノロジー	
AMPHENOL CORP-CL A	304	359	3,092	328,686	電子装置・機器・部品	
ANADARKO PETE	536	633	3,823	406,486	石油・ガス・消耗燃料	
ANALOG DEVICES INC	357	433	3,945	419,452	半導体・半導体製造装置	
ANDEAVOR	—	177	1,779	189,204	石油・ガス・消耗燃料	
ANSYS INC	83	99	1,551	164,895	ソフトウェア	
ANTERO RESOURCES CORP	147	270	535	56,971	石油・ガス・消耗燃料	
ANTHEM INC	257	297	6,531	694,317	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株数	評 価 額	外貨建金額		邦貨換算金額
			株数			
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
APACHE CORPORATION	366	439	1,689	179,569	石油・ガス・消耗燃料	
APPLE INC	5,189	5,967	100,114	10,642,152	コンピュータ・周辺機器	
APPLIED MATERIALS	1,058	1,236	6,873	730,641	半導体・半導体製造装置	
ARAMARK	232	286	1,131	120,269	ホテル・レストラン・レジャー	
ARCHER DANIELS MIDLAND	549	644	2,793	296,898	食品	
ARCONIC INC	436	516	1,188	126,376	航空宇宙・防衛	
ARISTA NETWORKS INC	—	56	1,439	153,060	通信機器	
ARROW ELECTRS INC	89	105	808	85,965	電子装置・機器・部品	
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	58	—	—	—	化学	
ASSURANT INC	52	63	575	61,216	保険	
ATMOS ENERGY CORP	105	117	985	104,770	ガス	
AUTODESK INC.	189	227	2,850	303,025	ソフトウェア	
AUTOLIV INC	84	97	1,415	150,480	自動車部品	
AUTOMATIC DATA PROCESS	436	514	5,832	620,034	情報技術サービス	
AUTONATION INC	71	71	332	35,306	専門小売り	
AUTOZONE	27	32	2,101	223,416	専門小売り	
AVERY DENNISON CORP	87	99	1,051	111,814	容器・包装	
AVNET	122	150	626	66,586	電子装置・機器・部品	
BB&T CORPORATION	795	913	4,751	505,058	銀行	
BAKER HUGHES	383	—	—	—	エネルギー設備・サービス	
BAKER HUGHES, A GE CO, LLC	—	473	1,313	139,627	エネルギー設備・サービス	
BALL CORP	158	397	1,576	167,580	容器・包装	
BANK OF AMERICA CORP	9,841	11,525	34,563	3,674,097	銀行	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	1,021	1,197	6,168	655,673	資本市場	
BARD (C R)	69	—	—	—	ヘルスケア機器・用品	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	471	571	3,713	394,775	ヘルスケア機器・用品	
B/E AEROSPACE INC	101	—	—	—	航空宇宙・防衛	
BECTON, DICKINSON	205	309	6,711	713,400	ヘルスケア機器・用品	
BED BATH & BEYOND	156	—	—	—	専門小売り	
WR BERKLEY CORP	99	115	836	88,872	保険	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	1,192	1,478	29,483	3,134,058	各種金融サービス	
BEST BUY COMPANY INC	284	319	2,232	237,333	専門小売り	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	168	202	1,637	174,078	バイオテクノロジー	
BIOGEN INC	212	247	6,768	719,526	バイオテクノロジー	
BLACKROCK INC	118	138	7,508	798,125	資本市場	
H & R BLOCK INC	224	235	597	63,475	各種消費者サービス	
BOEING CO	571	658	21,594	2,295,460	航空宇宙・防衛	
BOOKING HOLDINGS INC	—	56	11,837	1,258,317	インターネット販売・通信販売	
BORGWARNER INC	213	236	1,185	126,010	自動車部品	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,314	1,611	4,401	467,853	ヘルスケア機器・用品	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	—	102	524	55,730	保険	
BRISTOL MYERS SQUIBB	1,630	1,908	12,068	1,282,839	医薬品	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	114	130	1,425	151,580	情報技術サービス	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	200	285	1,550	164,807	飲料	
CBS CORP-CL B	374	400	2,055	218,510	メディア	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	—	122	1,392	147,971	資本市場	
CBRE GROUP INC	296	355	1,676	178,191	不動産管理・開発	
CDK GLOBAL INC	128	146	924	98,302	ソフトウェア	
CDW CORPORATION	140	182	1,279	136,025	電子装置・機器・部品	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	229	264	996	105,882	化学	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	136	155	1,452	154,401	航空貨物・物流サービス	
CIGNA CORP	251	284	4,763	506,393	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CIT GROUP INC	194	164	844	89,780	銀行	
CME GROUP INC	332	398	6,437	684,279	資本市場	

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等
		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	
CMS ENERGY CORP	273	330	1,494	158,872	総合公益事業
CSX CORP	903	978	5,448	579,168	陸運・鉄道
CVS HEALTH CORP	1,041	1,183	7,359	782,308	食品・生活必需品小売り
CA INC	309	348	1,179	125,404	ソフトウェア
CABOT OIL & GAS CORP	457	533	1,278	135,865	石油・ガス・消耗燃料
CADENCE DESIGN SYS INC	268	321	1,180	125,467	ソフトウェア
CALPINE CORP	347	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CAMPBELL SOUP CO	191	216	935	99,443	食品
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	472	557	5,337	567,341	消費者金融
CARDINAL HEALTH INC	310	363	2,275	241,862	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARMAX INC	183	204	1,263	134,318	専門小売り
CARNIVAL CORP	332	411	2,695	286,514	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC DEL	572	688	10,139	1,077,854	機械
CELANESE CORP-SERIES A	135	155	1,553	165,111	化学
CELGENE CORP	756	911	8,127	863,903	バイオテクノロジー
CENTENE CORP	168	198	2,116	224,933	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	384	452	1,238	131,650	総合公益事業
CENTURYLINK INC	522	1,080	1,775	188,773	各種電気通信サービス
CERNER CORP	301	342	1,983	210,856	ヘルスケア・テクノロジー
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	211	217	6,765	719,217	メディア
CHEMOURS CO/THE	—	206	1,003	106,664	化学
CHENIERE ENERGY INC	195	243	1,298	138,066	石油・ガス・消耗燃料
CHEVRON CORP	1,839	2,210	25,202	2,679,061	石油・ガス・消耗燃料
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	27	28	933	99,261	ホテル・レストラン・レジャー
CHURCH & DWIGHT CO INC	257	287	1,445	153,638	家庭用品
CIMAREX ENERGY CO	90	106	991	105,353	石油・ガス・消耗燃料
CINCINNATI FINANCIAL CORP	155	184	1,366	145,246	保険
CISCO SYSTEMS	4,890	5,753	24,674	2,622,911	通信機器
CINTAS CORP	78	107	1,825	194,019	商業サービス・用品
CITIGROUP	2,776	3,077	20,769	2,207,824	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	504	578	2,426	257,930	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	149	173	1,605	170,658	ソフトウェア
CLOROX CO	124	150	1,996	212,243	家庭用品
COACH INC	279	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
COCA COLA CO	3,992	4,712	20,464	2,175,346	飲料
COGNEX CORP	—	192	998	106,109	電子装置・機器・部品
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	587	680	5,474	581,886	情報技術サービス
COLGATE PALMOLIVE CO.	825	967	6,931	736,813	家庭用品
COMCAST CORP-CL A	4,644	5,431	18,557	1,972,686	メディア
COMERICA INC	162	204	1,956	208,026	銀行
COMMSCOPE HOLDING CO INC	—	228	911	96,872	通信機器
COMPUTER SCIENCES CORP	138	—	—	—	情報技術サービス
CONAGRA BRANDS INC	400	472	1,740	185,040	食品
CONCHO RESOURCES INC	142	172	2,585	274,857	石油・ガス・消耗燃料
CONOCOPHILLIPS	1,211	1,377	8,164	867,857	石油・ガス・消耗燃料
CONSOLIDATED EDISON INC	293	359	2,798	297,432	総合公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	171	198	4,519	480,439	飲料
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	94	114	672	71,436	石油・ガス・消耗燃料
THE COOPER COMPANIES, INC.	47	56	1,288	136,935	ヘルスケア機器・用品
CORNING INC	907	1,001	2,790	296,660	電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	426	510	9,609	1,021,535	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	32	41	1,490	158,452	専門サービス
COTY INC-CL A	476	550	1,006	106,990	パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC	131	145	735	78,223	容器・包装

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等
		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	
CUMMINS INC	156	180	2,917	310,143	機械
DR HORTON INC	336	420	1,841	195,728	家庭用耐久財
DTE ENERGY COMPANY	170	206	2,150	228,613	総合公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	—	333	3,347	355,855	情報技術サービス
DANAHER CORP	609	732	7,167	761,853	ヘルスケア機器・用品
DARDEN RESTAURANTS INC	118	143	1,219	129,587	ホテル・レストラン・レジャー
DAVITA INC	157	175	1,153	122,664	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DEERE & COMPANY	258	314	4,877	518,430	機械
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	217	233	1,705	181,325	ソフトウェア
DELTA AIR LINES INC	177	201	1,101	117,108	旅客航空輸送業
DENTSPLY SIRONA INC	220	272	1,368	145,464	ヘルスケア機器・用品
DEVON ENERGY CORP	458	573	1,821	193,632	石油・ガス・消耗燃料
DEXCOM INC	83	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
DIAMONDBACK ENERGY INC	85	104	1,315	139,870	石油・ガス・消耗燃料
DICK S SPORTING GOODS INC	82	—	—	—	専門小売り
DISNEY (WALT) CO	1,473	1,759	17,667	1,878,044	メディア
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	385	428	3,078	327,255	消費者金融
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	143	193	413	43,965	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	212	353	689	73,310	メディア
DISH NETWORK CORP-A	218	251	951	101,095	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	271	312	2,918	310,264	複合小売り
DOLLAR TREE INC	227	280	2,657	282,460	複合小売り
DOMINION ENERGY INC	613	747	5,037	535,435	総合公益事業
DOMINOS PIZZA INC	46	52	1,230	130,840	ホテル・レストラン・レジャー
DOVER CORP	153	181	1,777	188,978	機械
DOW CHEM CO	1,095	—	—	—	化学
DOWDUPONT INC	—	2,725	17,360	1,845,471	化学
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	178	211	2,497	265,518	飲料
DU PONT E I DE NEMOURS	849	—	—	—	化学
DUKE ENERGY CORP	673	819	6,344	674,451	電力
DUN & BRADSTREET CORP	36	—	—	—	専門サービス
EOG RESOURCES INC	563	676	7,116	756,457	石油・ガス・消耗燃料
EQT CORP	165	282	1,339	142,418	石油・ガス・消耗燃料
E*TRADE FINANCIAL CORP	256	307	1,701	180,825	資本市場
EAST WEST BANCORP INC	—	162	1,013	107,697	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO.	141	171	1,805	191,915	化学
EATON VANCE CORP	117	138	768	81,664	資本市場
EBAY INC	1,023	1,157	4,655	494,908	インターネットソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	257	303	4,153	441,487	化学
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	58	—	—	—	パーソナル用品
EDISON INTERNATIONAL	317	368	2,342	249,027	電力
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	211	249	3,474	369,291	ヘルスケア機器・用品
ELECTRONIC ARTS	290	361	4,376	465,250	ソフトウェア
EMERSON ELEC	630	745	5,088	540,891	電気設備
ENBRIDGE INC	666	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ENTERGY CORP	171	210	1,654	175,860	電力
ENVISION HEALTHCARE CORP	116	149	572	60,868	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EQUIFAX INC	117	139	1,637	174,072	専門サービス
EVERSOURCE ENERGY	307	363	2,138	227,354	電力
EXELON CORPORATION	905	1,107	4,318	459,046	電力
EXPEDIA GROUP INC	117	144	1,589	169,006	インターネット販売・通信販売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	177	213	1,348	143,323	航空貨物・物流サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	604	661	4,566	485,385	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EXXON MOBIL CORP	4,037	4,928	36,767	3,908,417	石油・ガス・消耗燃料

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株数	評 価 額	外貨建金額		邦貨換算金額
			株数			
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
FLIR SYSTEMS INC	127	156	780	82,930	電子装置・機器・部品	
FMC CORP	132	148	1,133	120,462	化学	
FACEBOOK INC-A	2,279	2,773	44,309	4,710,128	インターネットソフトウェア・サービス	
FASTENAL CO	276	341	1,861	197,879	商社・流通業	
FEDEX CORPORATION	246	297	7,148	759,840	航空貨物・物流サービス	
F5 NETWORKS INC	62	73	1,055	112,215	通信機器	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	303	384	3,697	393,088	情報技術サービス	
FNF GROUP	244	299	1,196	127,198	保険	
FIFTH THIRD BANCORP	737	813	2,581	274,389	銀行	
FIRST DATA CORP- CLASS A	302	490	784	83,339	情報技術サービス	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	145	185	1,713	182,122	銀行	
FISERV INC	207	480	3,422	363,852	情報技術サービス	
FIRSTENERGY CORP	418	520	1,768	187,993	電力	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	88	102	2,065	219,562	情報技術サービス	
FLUOR CORP	139	164	938	99,752	建設・土木	
FLOWSERVE CORP	122	150	649	69,089	機械	
FOOT LOCKER INC	134	—	—	—	専門小売り	
FORD MOTOR COMPANY	3,630	4,310	4,775	507,633	自動車	
FORTINET INC	139	170	910	96,824	ソフトウェア	
FORTIVE CORP	295	369	2,860	304,069	機械	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	153	171	1,007	107,046	建設関連製品	
FRANKLIN RESOURCES INC	359	397	1,376	146,353	資本市場	
FREEPORT-MCMORAN INC	1,241	1,570	2,758	293,227	金属・鉱業	
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	1,140	—	—	—	各種電気通信サービス	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	166	214	1,470	156,348	保険	
GAP INC	229	271	845	89,878	専門小売り	
GARTNER INC	81	100	1,176	125,030	情報技術サービス	
GENERAL DYNAMICS	253	292	6,463	687,073	航空宇宙・防衛	
GENERAL ELEC CO	8,614	10,100	13,614	1,447,253	コングロマリット	
GENERAL MILLS	580	650	2,928	311,342	食品	
GENERAL MOTORS CO	1,344	1,498	5,443	578,668	自動車	
GENUINE PARTS CO	144	172	1,545	164,259	販売	
GILEAD SCIENCES INC	1,285	1,510	11,383	1,210,107	バイオテクノロジー	
GLOBAL PAYMENTS INC	146	189	2,107	224,051	情報技術サービス	
GOLDMAN SACHS GROUP	349	415	10,462	1,112,138	資本市場	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	248	283	752	79,960	自動車部品	
WR GRACE & CO	67	83	508	54,022	化学	
GRAINGER (W.W.) INC	55	62	1,750	186,032	商社・流通業	
HCA HEALTHCARE INC	286	333	3,230	343,359	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	—	229	868	92,356	商社・流通業	
HP INC	1,670	1,942	4,256	452,504	コンピュータ・周辺機器	
HALLIBURTON CO	846	1,023	4,801	510,448	エネルギー設備・サービス	
HANESBRANDS INC	377	433	797	84,783	繊維・アパレル・贅沢品	
HARLEY-DAVIDSON INC	168	194	831	88,427	自動車	
HARRIS CORP	119	135	2,177	231,444	航空宇宙・防衛	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	359	424	2,184	232,206	保険	
HASBRO INC	107	126	1,062	112,909	レジャー用品	
HELMERICH & PAYNE	106	128	851	90,564	エネルギー設備・サービス	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	—	88	1,064	113,141	情報技術サービス	
HERSHEY CO/THE	137	166	1,642	174,622	食品	
HESS CORP	274	319	1,614	171,650	石油・ガス・消耗燃料	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,632	1,860	3,262	346,797	コンピュータ・周辺機器	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	189	220	1,732	184,188	ホテル・レストラン・レジャー	
HOLLYFRONTIER CORP	166	197	962	102,318	石油・ガス・消耗燃料	

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額	外貨建金額		邦貨換算金額
			株 数			
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
HOLOGIC INC	247	311	1,161	123,509	ヘルスケア機器・用品	
HOME DEPOT	1,187	1,359	24,222	2,574,885	専門小売り	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	706	844	12,196	1,296,503	コングロマリット	
HORMEL FOODS CORP	273	328	1,125	119,661	食品	
HUMANA INC	146	166	4,478	476,086	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	87	98	1,148	122,039	陸運・鉄道	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,070	1,260	1,902	202,246	銀行	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	46	51	1,319	140,287	航空宇宙・防衛	
IAC/INTERACTIVE CORP	—	91	1,423	151,271	インターネットソフトウェア・サービス	
IPG PHOTONICS CORP	—	42	980	104,194	電子装置・機器・部品	
IDEX CORP	—	85	1,211	128,764	機械	
IDEXX LABORATORIES INC	86	102	1,952	207,516	ヘルスケア機器・用品	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	305	358	5,608	596,175	機械	
ILLUMINA INC	142	170	4,019	427,234	ライフサイエンス・ツール/サービス	
INCYTE CORP	167	212	1,766	187,789	バイオテクノロジー	
INGREDION INC	68	84	1,082	115,115	食品	
INTEL CORP	4,617	5,445	28,357	3,014,408	半導体・半導体製造装置	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	584	685	4,967	528,058	資本市場	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	880	1,024	15,711	1,670,103	情報技術サービス	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	76	87	1,191	126,615	化学	
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	376	445	2,377	252,742	容器・包装	
INTERPUBLIC GROUP	392	443	1,020	108,450	メディア	
INTUIT INC	235	280	4,853	515,958	ソフトウェア	
INTUITIVE SURGICAL INC	37	131	5,416	575,755	ヘルスケア機器・用品	
IQVIA HOLDINGS INC	—	155	1,520	161,650	ライフサイエンス・ツール/サービス	
JPMORGAN CHASE & CO	3,484	4,035	44,372	4,716,838	銀行	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	123	141	834	88,655	建設・土木	
JOHNSON & JOHNSON	2,648	3,124	40,034	4,255,620	医薬品	
JONES LANG LASALLE INC	47	54	943	100,246	不動産管理・開発	
JUNIPER NETWORKS INC	335	424	1,031	109,658	通信機器	
KLA TENCOR CORP	150	183	1,994	212,056	半導体・半導体製造装置	
KANSAS CITY SOUTHERN	106	118	1,296	137,789	陸運・鉄道	
KELLOGG CO	255	302	1,963	208,699	食品	
KEYCORP	1,028	1,240	2,424	257,692	銀行	
KIMBERLY-CLARK CORP	350	409	4,504	478,808	家庭用品	
KINDER MORGAN INC	1,858	2,330	3,508	373,004	石油・ガス・消耗燃料	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	—	143	657	69,939	陸運・鉄道	
KOHL'S CORP	172	196	1,283	136,488	複合小売り	
KRAFT HEINZ CO/THE	595	702	4,372	464,824	食品	
KROGER CO	860	1,009	2,415	256,772	食品・生活必需品小売り	
L BRANDS, INC	240	270	1,031	109,666	専門小売り	
LKQ CORP	300	363	1,377	146,437	販売	
L3 TECHNOLOGIES INC	72	90	1,872	198,993	航空宇宙・防衛	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	98	118	1,908	202,889	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
LAM RESEARCH	160	188	3,819	406,003	半導体・半導体製造装置	
LAS VEGAS SANDS CORP	421	465	3,343	355,398	ホテル・レストラン・レジャー	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	214	262	3,922	416,979	パーソナル用品	
LEAR CORP	69	77	1,432	152,316	自動車部品	
LEGGETT & PLATT INC	134	159	705	74,975	家庭用耐久財	
LEIDOS HOLDINGS INC	—	161	1,052	111,927	情報技術サービス	
LENNAR CORP-A	201	326	1,921	204,249	家庭用耐久財	
LENNOX INTERNATIONAL INC	—	45	919	97,760	建設関連製品	
LEUCADIA NATIONAL CORP	322	366	831	88,432	各種金融サービス	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	301	—	—	—	各種電気通信サービス	

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株数	評 価 額	外貨建金額		邦貨換算金額
			株数			
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
LIBERTY BROADBAND CORP-C	101	124	1,062	112,949	メディア	
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	423	532	1,339	142,340	インターネット販売・通信販売	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	98	98	405	43,121	メディア	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	193	197	804	85,544	メディア	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	—	224	691	73,457	メディア	
ELI LILLY & CO.	969	1,157	8,951	951,566	医薬品	
LINCOLN NATIONAL CORP	223	258	1,884	200,369	保険	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	—	161	678	72,119	メディア	
LOCKHEED MARTIN	257	301	10,175	1,081,610	航空宇宙・防衛	
LOEWS CORP	277	333	1,656	176,033	保険	
LOWES COS INC	849	960	8,424	895,471	専門小売り	
LULULEMON ATHLETICA INC	106	121	1,078	114,628	繊維・アパレル・贅沢品	
M & T BANK CORP	137	157	2,894	307,680	銀行	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	449	535	1,873	199,160	ホテル・レストラン・レジャー	
MSCI INC	85	104	1,554	165,242	資本市場	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION	76	95	350	37,293	運送インフラ	
MACYS INC	304	359	1,067	113,492	複合小売り	
MANPOWERGROUP INC	62	80	920	97,881	専門サービス	
MARATHON OIL CORP	812	990	1,596	169,747	石油・ガス・消耗燃料	
MARATHON PETROLEUM CORP	510	563	4,116	437,540	石油・ガス・消耗燃料	
MARKEL CORP	13	16	1,907	202,768	保険	
MARSH & MCLENNAN COS	495	593	4,897	520,613	保険	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	322	362	4,922	523,259	ホテル・レストラン・レジャー	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	59	75	1,554	165,269	建設資材	
MASCO CORP	329	357	1,443	153,466	建設関連製品	
MASTERCARD INC	939	1,094	19,162	2,036,974	情報技術サービス	
MATTEL INC	334	400	526	55,913	レジャー用品	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	270	329	1,981	210,605	半導体・半導体製造装置	
MCCORMICK & CO INC.	113	139	1,478	157,198	食品	
MCDONALD'S CORP	810	929	14,527	1,544,294	ホテル・レストラン・レジャー	
MCKESSON CORP	218	238	3,352	356,392	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	178	—	—	—	食品	
MEDNAX INC	91	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	184	283	820	87,180	ホテル・レストラン・レジャー	
MERCADOLIBRE INC	39	49	1,774	188,663	インターネットソフトウェア・サービス	
MERCK & CO INC	2,686	3,173	17,283	1,837,218	医薬品	
METLIFE INC	914	1,025	4,703	500,005	保険	
METTLER-TOLEDO INTL	26	30	1,730	183,988	ライフサイエンス・ツール/サービス	
MICROSOFT CORP	7,189	8,519	77,752	8,265,134	ソフトウェア	
MICROCHIP TECHNOLOGY	206	267	2,439	259,298	半導体・半導体製造装置	
MICRON TECHNOLOGY	1,009	1,337	6,971	741,029	半導体・半導体製造装置	
MIDDLEBY CORP	57	65	804	85,532	機械	
MOHAWK INDUSTRIES	59	72	1,685	179,212	家庭用耐久財	
MOLSON COORS BREWING CO-B	179	220	1,657	176,166	飲料	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,508	1,731	7,223	767,854	食品	
MONSANTO CO	428	515	6,009	638,813	化学	
MONSTER BEVERAGE CORP	384	454	2,597	276,096	飲料	
MOODYS CORP	168	202	3,258	346,353	資本市場	
MORGAN STANLEY	1,372	1,580	8,525	906,279	資本市場	
MOSAIC CO/THE	312	394	956	101,689	化学	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	145	190	2,000	212,674	通信機器	
MURPHY OIL CORP	167	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
NVR INC	—	3	1,108	117,865	家庭用耐久財	
NASDAQ INC	111	140	1,207	128,312	資本市場	

銘柄	株数	株数	当 期 末		業 種 等
			評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	365	442	1,627	172,950	エネルギー設備・サービス
NAVIENT CORP	299	—	—	—	消費者金融
NETAPP INC	267	300	1,850	196,729	コンピュータ・周辺機器
NETFLIX INC	419	504	14,888	1,582,657	インターネット販売・通信販売
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,140	1,430	985	104,734	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	241	255	1,571	167,030	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	220	266	1,019	108,409	コングロマリット
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	471	560	729	77,564	貯蓄・抵当・不動産金融
NEWELL BRANDS INC	422	565	1,439	153,031	家庭用耐久財
NEWFIELD EXPLORATION CO	188	229	559	59,444	石油・ガス・消耗燃料
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	510	612	2,391	254,172	金属・鉱業
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	374	460	726	77,258	メディア
NEXTERA ENERGY INC	452	549	8,966	953,172	電力
NIKE INC-B	1,292	1,531	10,171	1,081,279	繊維・アパレル・贅沢品
NISOURCE INC	303	382	913	97,090	総合公益事業
NOBLE ENERGY INC	407	518	1,569	166,842	石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC	127	150	726	77,189	複合小売り
NORFOLK SOUTHERN CORP	280	335	4,548	483,519	陸運・鉄道
NORTHERN TRUST CORP	207	247	2,547	270,779	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	162	193	6,751	717,735	航空宇宙・防衛
NUANCE COMMUNICATIONS INC	250	—	—	—	ソフトウェア
NUCOR CORP	306	366	2,235	237,675	金属・鉱業
NVIDIA CORP	521	705	16,345	1,737,539	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	196	225	737	78,377	電力
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	92	98	2,444	259,809	専門小売り
OCCIDENTAL PETE CORP	747	896	5,820	618,710	石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	—	69	1,014	107,798	陸運・鉄道
OMNICOM GROUP	230	268	1,947	207,025	メディア
ONEOK INC	198	436	2,481	263,805	石油・ガス・消耗燃料
ORACLE CORPORATION	3,001	3,645	16,675	1,772,645	ソフトウェア
OWENS CORNING INC	—	124	996	105,976	建設関連製品
PG&E CORP	496	585	2,569	273,180	電力
PNC FINANCIAL	470	550	8,318	884,224	銀行
PPG INDUSTRIES	257	299	3,336	354,706	化学
PPL CORPORATION	668	815	2,305	245,089	電力
PVH CORP	80	90	1,362	144,873	繊維・アパレル・贅沢品
PACCAR	341	415	2,746	291,905	機械
PACKAGING CORP OP AMERICA	88	109	1,228	130,582	容器・包装
PALO ALTO NETWORKS INC	90	107	1,942	206,462	通信機器
PARKER HANNIFIN CORP	127	157	2,685	285,433	機械
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	217	261	756	80,430	石油・ガス・消耗燃料
PATTERSON COS INC	87	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PAYCHEX INC	315	374	2,303	244,858	情報技術サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	1,062	1,332	10,105	1,074,255	情報技術サービス
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	305	410	765	81,325	銀行
PEPSICO INC	1,397	1,656	18,075	1,921,398	飲料
PFIZER INC	5,910	6,937	24,619	2,617,043	医薬品
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,511	1,808	17,971	1,910,372	タバコ
PHILLIPS 66	450	505	4,843	514,912	石油・ガス・消耗燃料
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	111	124	989	105,185	電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	166	198	3,401	361,552	石油・ガス・消耗燃料
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	140	190	413	43,928	石油・ガス・消耗燃料
POLARIS INDUSTRIES INC	62	71	813	86,431	レジャー用品
PRAXAIR INC	280	329	4,747	504,656	化学

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		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	
T ROWE PRICE GROUP INC	239	285	3,077	327,100	資本市場
PRICELINE GROUP INC/THE	48	—	—	—	インターネット販売・通信販売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	279	334	2,034	216,256	保険
PROCTER & GAMBLE CO	2,490	2,953	23,411	2,488,630	家庭用品
PROGRESSIVE CO	565	677	4,124	438,483	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	418	497	5,146	547,066	保険
PUBLIC SVC ENTERPRISE	487	597	2,999	318,828	総合公益事業
PULTEGROUP INC	289	293	864	91,849	家庭用耐久財
QORVO INC	127	142	1,000	106,341	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	1,441	1,720	9,530	1,013,094	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS INC	133	153	1,534	163,126	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	142	—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス
RALPH LAUREN CORPORATION	58	68	760	80,813	繊維・アパレル・贅沢品
RANGE RESOURCES CORP	190	310	450	47,913	石油・ガス・消耗燃料
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	121	149	1,332	141,613	資本市場
RAYTHEON COMPANY	287	334	7,227	768,316	航空宇宙・防衛
RED HAT INC	178	203	3,035	322,626	ソフトウェア
REGENERON PHARMACEUTICALS	76	92	3,185	338,600	バイオテクノロジー
REGIONS FINANCIAL CORP	1,210	1,370	2,545	270,582	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	63	72	1,108	117,865	保険
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	229	276	1,827	194,310	商業サービス・用品
RESMED INC	141	169	1,664	176,898	ヘルスケア機器・用品
REYNOLDS AMERICAN INC	836	—	—	—	タバコ
RITE AID CORP	990	—	—	—	食品・生活必需品小売り
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	133	151	874	92,920	専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	124	146	2,543	270,354	電気設備
ROCKWELL COLLINS INC	128	192	2,589	275,223	航空宇宙・防衛
ROLLINS INC	—	120	612	65,093	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	99	119	3,351	356,257	コングロマリット
ROSS STORES INC	390	443	3,454	367,214	専門小売り
S&P GLOBAL INC	254	296	5,655	601,166	資本市場
SEI INVESTMENTS COMPANY	127	150	1,123	119,443	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	—	198	1,062	112,898	ソフトウェア
SVB FINANCIAL GROUP	—	59	1,416	150,527	銀行
SABRE CORP	200	260	557	59,283	情報技術サービス
SALESFORCE.COM INC	624	794	9,234	981,597	ソフトウェア
SCANA CORP	129	141	529	56,281	総合公益事業
HENRY SCHEIN INC	76	174	1,169	124,312	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	1,357	1,616	10,468	1,112,796	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,167	1,409	7,357	782,133	資本市場
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	78	—	—	—	メディア
SEALED AIR CORP	192	219	937	99,613	容器・包装
SEATTLE GENETICS INC	97	134	701	74,554	バイオテクノロジー
SEMPRA ENERGY	229	279	3,103	329,852	総合公益事業
SERVICENOW INC	157	202	3,342	355,264	ソフトウェア
SHERWIN-WILLIAMS	75	97	3,819	405,986	化学
SIGNATURE BANK	50	65	922	98,080	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,630	1,820	1,135	120,722	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC	181	211	2,115	224,876	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	144	165	1,049	111,533	建設関連製品
JM SMUCKER CO/THE-NEW	113	135	1,674	177,960	食品
SNAP-ON INC	54	67	988	105,079	機械
SOUTHERN CO.	948	1,151	5,140	546,420	電力
SOUTHWEST AIRLINES	153	176	1,008	107,164	旅客航空輸送業

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		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	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	468	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	26	26	269	28,660	家庭用品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	—	132	1,104	117,444	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	128	162	1,593	169,433	ソフトウェア
SPRINT CORP	750	900	439	46,686	無線通信サービス
SQUARE INC - A	—	319	1,569	166,835	情報技術サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	144	181	2,772	294,761	機械
STAPLES INC	620	—	—	—	専門小売り
STARBUCKS CORP	1,420	1,656	9,586	1,019,053	ホテル・レストラン・レジャー
STATE STREET CORP	372	435	4,338	461,156	資本市場
STEEL DYNAMICS	—	271	1,198	127,385	金属・鉱業
STERICYCLE INC	79	89	520	55,373	商業サービス・用品
STRYKER CORP	330	394	6,340	673,968	ヘルスケア機器・用品
SUNTRUST BKS INC.	469	547	3,721	395,626	銀行
SYMANTEC CORP	608	713	1,843	195,922	ソフトウェア
SYNOPSYS INC	149	180	1,498	159,271	ソフトウェア
SYNCHRONY FINANCIAL	805	920	3,084	327,909	消費者金融
SYSCO CORP	496	574	3,441	365,853	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	253	334	1,978	210,291	資本市場
TJX COS INC	628	740	6,035	641,567	専門小売り
T-MOBILE US INC	283	334	2,038	216,717	無線通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	—	135	1,320	140,319	ソフトウェア
TAPESTRY INC	—	330	1,736	184,550	繊維・アパレル・贅沢品
TARGET CORP	510	591	4,103	436,182	複合小売り
TARGA RESOURCES CORP	178	249	1,095	116,462	石油・ガス・消耗燃料
TEGNA INC	206	—	—	—	メディア
TELEFLEX INC	43	53	1,366	145,279	ヘルスケア機器・用品
TESARO INC	—	37	211	22,473	バイオテクノロジー
TESORO CORP	113	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
TESLA INC	124	156	4,154	441,600	自動車
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	888	1,050	1,794	190,750	医薬品
TEXAS INSTRUMENTS INC	975	1,149	11,936	1,268,898	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	264	313	1,845	196,204	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	382	468	9,662	1,027,105	ライフサイエンス・ツール/サービス
3M CORP	586	693	15,230	1,618,980	コングロマリット
TIFFANY & CO	119	139	1,357	144,299	専門小売り
TIME WARNER INC	745	909	8,597	913,895	メディア
TOLL BROTHERS INC	142	185	800	85,053	家庭用耐久財
TORCHMARK CORP	112	125	1,052	111,840	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	163	195	1,682	178,804	情報技術サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	130	149	938	99,815	専門小売り
TRANSIGM GROUP INC	52	60	1,869	198,702	航空宇宙・防衛
TRUNSONION	—	218	1,237	131,578	専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	275	316	4,387	466,441	保険
TRIMBLE INC	232	284	1,018	108,318	電子装置・機器・部品
TRIPADVISOR INC	123	123	502	53,463	インターネット販売・通信販売
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	1,015	1,225	4,494	477,768	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	428	510	1,854	197,172	メディア
TWITTER INC	539	741	2,149	228,506	インターネットソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	276	349	2,554	271,525	食品
UGI CORP	163	204	906	96,325	ガス
US BANCORP	1,658	1,918	9,685	1,029,611	銀行
ULTA BEAUTY INC	56	65	1,329	141,357	専門小売り
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	184	184	300	31,979	繊維・アパレル・贅沢品

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C		187	187	268	28,525	繊維・アパレル・贅沢品
UNION PAC CORP		804	918	12,340	1,311,813	陸運・鉄道
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC		76	92	639	67,938	旅客航空輸送業
UNITED PARCEL SERVICE-CL B		673	802	8,393	892,253	航空貨物・物流サービス
UNITED RENTALS INC		79	101	1,744	185,448	商社・流通業
UNITED TECHNOLOGIES		763	885	11,135	1,183,657	航空宇宙・防衛
UNITED THERAPEUTICS CORP		43	52	584	62,108	バイオテク ノロジー
UNITEDHEALTH GROUP INC		938	1,127	24,132	2,565,314	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B		86	98	1,160	123,352	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNUM GROUP		225	250	1,190	126,523	保険
V F CORP		319	393	2,912	309,642	繊維・アパレル・贅沢品
VAIL RESORTS INC		—	44	990	105,343	ホテル・レストラン・レジャー
VALERO ENERGY CORP		440	504	4,675	497,017	石油・ガス・消耗燃料
VALSPAR CORP		73	—	—	—	化学
VANTIV INC - CL A		161	—	—	—	情報技術サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC		87	107	1,312	139,503	ヘルスケア機器・用品
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A		—	126	920	97,801	ヘルスケア・テク ノロジー
VERISIGN INC		88	101	1,197	127,289	インターネットソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS		3,971	4,801	22,958	2,440,476	各種電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC		150	184	1,913	203,415	専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS		238	296	4,824	512,813	バイオテク ノロジー
VIACOM INC-CLASS B		341	413	1,282	136,359	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES		1,820	2,110	25,239	2,682,992	情報技術サービス
VISTRA ENERGY CORP		—	290	604	64,212	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
VMWARE INC - CLASS A		62	84	1,018	108,284	ソフトウェア
VOYA FINANCIAL INC		187	217	1,095	116,488	各種金融サービス
VULCAN MATERIALS CO		128	153	1,746	185,684	建設資材
WABCO HOLDINGS INC		52	60	803	85,382	機械
WEC ENERGY GROUP INC		306	358	2,244	238,607	総合公益事業
WABTEC CORP		90	103	838	89,124	機械
WALMART INC		1,508	1,740	15,480	1,645,606	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC		899	970	6,350	675,067	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC		165	303	2,173	231,066	商業サービス・用品
WASTE MANAGEMENT INC		433	500	4,206	447,097	商業サービス・用品
WATERS CORP		80	93	1,847	196,383	ライフサイエンス・ツール/サービス
WELLS FARGO CO		4,646	5,442	28,521	3,031,837	銀行
WESTAR ENERGY INC		134	158	830	88,327	電力
WESTERN DIGITAL CORP		278	342	3,155	335,443	コンピュータ・周辺機器
WESTERN UNION CO		458	528	1,015	107,931	情報技術サービス
WESTROCK CO		243	292	1,873	199,181	容器・包装
WHIRLPOOL CORP		71	82	1,255	133,459	家庭用耐久財
WHITEWAVE FOODS CO - CL A		175	—	—	—	食品
WHOLE FOODS MARKET INC		316	—	—	—	食品・生活必需品小売り
WILLIAMS COS		785	976	2,426	257,919	石油・ガス・消耗燃料
WORKDAY INC-CLASS A		120	155	1,970	209,432	ソフトウェア
WORLDPAY INC - CL A		—	350	2,878	305,973	情報技術サービス
WYNDHAM WORLDWIDE CORP		109	119	1,361	144,750	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN RESORTS LTD		77	98	1,787	189,971	ホテル・レストラン・レジャー
XCEL ENERGY INC		494	600	2,728	290,071	電力
XILINX INC		250	286	2,066	219,622	半導体・半導体製造装置
XEROX CORP		840	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
XEROX CORP		—	244	702	74,647	コンピュータ・周辺機器
XYLEM INC		170	206	1,584	168,437	機械
YAHOO! INC		887	—	—	—	インターネットソフトウェア・サービス

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株数	評 価 額	外貨建金額		邦貨換算金額
			株数			
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
YUM BRANDS INC	332	377	3,209	341,159	ホテル・レストラン・レジャー	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	155	222	758	80,612	各種電気通信サービス	
ZILLOW GROUP INC - C	109	133	715	76,061	インターネットソフトウェア・サービス	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	197	239	2,606	277,023	ヘルスケア機器・用品	
ZIONS BANCORPORATION	—	226	1,191	126,677	銀行	
ZOETIS INC	458	567	4,735	503,332	医薬品	
ALKERMES PLC	152	174	1,008	107,203	バイオテクノロジー	
ALLEGION PLC	—	108	921	97,916	建設関連製品	
ALLERGAN PLC	365	386	6,495	690,524	医薬品	
AON PLC	257	288	4,041	429,611	保険	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	121	145	1,241	131,924	保険	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	—	189	903	96,053	保険	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	85	85	489	52,017	保険	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	212	249	751	79,909	化学	
ACCENTURE PLC-CL A	605	717	11,005	1,169,932	情報技術サービス	
BUNGE LIMITED	138	156	1,153	122,613	食品	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	—	243	1,012	107,611	飲料	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	259	—	—	—	自動車部品	
EATON CORP PLC	434	504	4,027	428,119	電気設備	
EVEREST RE GROUP LTD	40	45	1,171	124,487	保険	
IHS MARKIT LTD	353	469	2,262	240,499	専門サービス	
INGERSOLL-RAND PLC	251	293	2,505	266,328	機械	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	850	—	—	—	エネルギー設備・サービス	
INVESCO LTD	396	469	1,501	159,584	資本市場	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	56	70	1,056	112,351	医薬品	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	917	1,086	3,827	406,816	建設関連製品	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	240	240	751	79,878	メディア	
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	595	646	1,965	208,962	メディア	
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	112	—	—	—	メディア	
MALLINCKRODT PLC	97	—	—	—	医薬品	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	410	465	976	103,801	半導体・半導体製造装置	
MEDTRONIC PLC	1,359	1,578	12,658	1,345,621	ヘルスケア機器・用品	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	161	179	1,111	118,123	繊維・アパレル・贅沢品	
APTIV PLC	—	303	2,574	273,679	自動車部品	
NIELSEN HOLDINGS PLC	342	427	1,357	144,295	専門サービス	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	161	245	1,297	137,952	ホテル・レストラン・レジャー	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	42	42	581	61,839	保険	
SEAGATE TECHNOLOGY	286	343	2,007	213,369	コンピュータ・周辺機器	
PENTAIR PLC	167	205	1,396	148,465	機械	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	—	194	1,005	106,884	電気設備	
SIGNET JEWELERS LTD	54	—	—	—	専門小売り	
TECHNIPFMC PLC	433	516	1,519	161,535	エネルギー設備・サービス	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	126	148	2,252	239,431	保険	
PERRIGO CO PLC	138	142	1,183	125,798	医薬品	
XL GROUP LTD	264	290	1,602	170,350	保険	
CHUBB LTD	454	542	7,412	787,994	保険	
GARMIN LTD	114	133	783	83,314	家庭用耐久財	
TE CONNECTIVITY LTD	343	413	4,125	438,579	電子装置・機器・部品	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	126	153	1,519	161,565	ソフトウェア	
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	15	—	—	—	医薬品	
AERCAP HOLDINGS NV	150	149	755	80,333	商社・流通業	
CORE LABORATORIES N.V.	43	—	—	—	エネルギー設備・サービス	
MOBILEYE NV	170	—	—	—	ソフトウェア	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	337	386	4,079	433,624	化学	

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
MYLAN NV		431	524	2,157	229,321	医薬品
NXP SEMICONDUCTORS NV		280	386	4,516	480,072	半導体・半導体製造装置
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		169	—	—	—	電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD		169	195	2,295	244,057	ホテル・レストラン・レジャー
BROADCOM LTD		392	471	11,113	1,181,338	半導体・半導体製造装置
FLEX LTD		505	620	1,012	107,624	電子装置・機器・部品
小 計		株 数 ・ 金 額	303,712	354,673	2,679,143	284,792,908
銘 柄 数 < 比 率 >		599	600	—	< 62.6% >	
(カナダ)				千カナダドル		
ARC RESOURCES LTD		329	400	561	46,309	石油・ガス・消耗燃料
AGNICO EAGLE MINES LTD		216	281	1,523	125,588	金属・鉱業
AGRIUM INC		124	—	—	—	化学
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B		404	506	2,918	240,626	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD		166	208	495	40,889	石油・ガス・消耗燃料
ATCO LTD CL1		68	96	397	32,757	総合公益事業
BCE INC		154	174	964	79,545	各種電気通信サービス
BANK OF MONTREAL		632	753	7,328	604,283	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX		1,179	1,400	11,110	916,163	銀行
BARRICK GOLD		1,120	1,340	2,150	177,346	金属・鉱業
BLACKBERRY LTD		509	600	888	73,273	ソフトウェア
BOMBARDIER B SHEARS		1,890	2,320	870	71,740	航空宇宙・防衛
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		856	969	4,866	401,276	資本市場
CAE INC		260	310	743	61,299	航空宇宙・防衛
CCL INDUSTRIES INC - CL B		26	155	1,008	83,129	容器・包装
CI FINANCIAL CORP		242	336	927	76,470	資本市場
CAMECO CORP		386	480	562	46,349	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE		389	507	5,765	475,431	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO		750	865	8,144	671,623	陸運・鉄道
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD		1,083	1,262	5,111	421,461	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		136	166	3,771	310,999	陸運・鉄道
CANADIAN TIRE CORP LTD A		64	77	1,304	107,559	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD A		124	157	539	44,522	総合公益事業
CENOVUS ENERGY INC		785	1,170	1,283	105,836	石油・ガス・消耗燃料
CONSTELLATION SOFTWARE INC		19	24	2,097	172,997	ソフトウェア
CRESCENT POINT ENERGY CORP		537	650	569	46,952	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC		107	120	1,878	154,939	複合小売り
ELDORADO GOLD CORPORATION		708	—	—	—	金属・鉱業
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP		360	490	203	16,768	各種金融サービス
EMERA INC		49	76	309	25,544	電力
EMPIRE CO LTD A		162	210	543	44,780	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP		950	1,170	1,657	136,709	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC		918	1,934	7,836	646,203	石油・ガス・消耗燃料
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		21	32	2,115	174,480	保険
FINNING INTERNATIONAL INC		152	196	608	50,215	商社・流通業
FIRST CAPITAL REALTY INC		113	180	366	30,205	不動産管理・開発
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		650	800	1,447	119,336	金属・鉱業
FORTIS INC		384	490	2,131	175,723	電力
FRANCO-NEVADA CORP		169	222	1,951	160,910	金属・鉱業
GILDAN ACTIVEWEAR INC		208	241	896	73,946	繊維・アパレル・贅沢品
GOLDCORP INC		829	1,010	1,796	148,163	金属・鉱業
GREAT-WEST LIFE CO INC		300	332	1,091	90,014	保険
CGI GROUP INC - CLASS A		214	300	2,229	183,803	情報技術サービス
HUSKY ENERGY INC		357	430	792	65,384	石油・ガス・消耗燃料
HYDRO ONE LTD		173	350	732	60,377	電力

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円	
IGM FINANCIAL INC		103	103	388	31,994	資本市場
IMPERIAL OIL		285	344	1,173	96,785	石油・ガス・消耗燃料
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC		99	121	641	52,881	保険
INTACT FINANCIAL CORP		126	163	1,578	130,122	保険
INTER PIPELINE LTD		362	460	1,028	84,815	石油・ガス・消耗燃料
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A		94	94	230	19,037	食品・生活必需品小売り
KEYERA CORP		178	245	820	67,699	石油・ガス・消耗燃料
KINROSS GOLD CORP		1,186	1,400	712	58,760	金属・鉱業
LINAMAR CORP		48	65	457	37,722	自動車部品
LOBLAW COMPANIES		210	240	1,562	128,815	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP		—	730	616	50,865	金属・鉱業
MAGNA INTERNATIONAL INC		377	393	2,852	235,176	自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP		1,934	2,280	5,453	449,717	保険
METHANEX CORP		82	103	803	66,290	化学
METRO INC		232	267	1,097	90,489	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA		334	392	2,377	196,014	銀行
NUTRIEN LTD		—	744	4,530	373,561	化学
ONEX CORPORATION		80	92	854	70,492	各種金融サービス
OPEN TEXT CORP		262	295	1,322	109,027	ソフトウェア
PEMBINA PIPELINE CORP		374	571	2,295	189,280	石油・ガス・消耗燃料
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP		172	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC		812	—	—	—	化学
POWER CORPORATION OF CANADA		348	409	1,202	99,154	保険
POWER FINANCIAL CORP		243	278	896	73,952	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD		207	246	692	57,143	石油・ガス・消耗燃料
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC		213	259	1,898	156,590	ホテル・レストラン・レジャー
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B		347	412	2,370	195,483	無線通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA		1,448	1,699	16,908	1,394,270	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC		145	197	1,114	91,895	建設・土木
SAPUTO INC		239	239	988	81,492	食品
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A		226	290	464	38,261	石油・ガス・消耗燃料
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		404	520	1,290	106,426	メディア
SHOPIFY INC - CLASS A		—	104	1,667	137,487	インターネットソフトウェア・サービス
SILVER WHEATON CORP		416	—	—	—	金属・鉱業
SUN LIFE FINANCIAL INC		591	721	3,814	314,569	保険
SUNCOR ENERGY INC		1,628	1,919	8,537	704,013	石油・ガス・消耗燃料
TECK RESOURCES LTD-CLS B		549	665	2,206	181,945	金属・鉱業
TELUS CORP		193	193	873	71,998	各種電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP		324	341	1,697	140,003	資本市場
TORONTO DOMINION BANK		1,812	2,155	15,755	1,299,174	銀行
TOURMALINE OIL CORP		216	265	579	47,746	石油・ガス・消耗燃料
TRANSCANADA CORP		846	1,004	5,349	441,104	石油・ガス・消耗燃料
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD		980	1,260	496	40,936	金属・鉱業
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL		313	380	779	64,267	医薬品
VERESEN INC		290	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
VERMILION ENERGY INC		120	120	498	41,104	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER		68	84	719	59,298	紙製品・林産品
WESTON(GEORGE) LTD		48	59	611	50,461	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		—	512	1,344	110,826	金属・鉱業
YAMANA GOLD INC		970	—	—	—	金属・鉱業
小 計	株 数 ・ 金 額	39,808	47,222	198,048	16,331,098	
	銘 柄 数 < 比 率 >	91	88	—	< 3.6% >	
(イギリス)				千英ポンド		
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC		940	—	—	—	資本市場

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
ANTOFAGASTA PLC	410	480	442	65,989	金属・鉱業
ASHTED GROUP PLC	476	590	1,144	170,854	商社・流通業
BHP BILLITON PLC	2,071	2,430	3,410	509,122	金属・鉱業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	980	1,130	599	89,465	家庭用耐久財
SKY PLC	990	1,210	1,569	234,350	メディア
AVIVA PLC	3,950	4,590	2,276	339,765	保険
DIAGEO PLC	2,456	2,889	6,968	1,040,153	飲料
SCHRODERS PLC	133	133	424	63,370	資本市場
DCC PLC	86	98	642	95,962	コングロマリット
BAE SYSTEMS PLC	3,060	3,720	2,162	322,842	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,817	2,672	11,038	1,647,647	タバコ
STANDARD CHARTERED PLC	3,220	3,830	2,729	407,453	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	938	1,111	2,695	402,325	タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	19,290	23,270	15,483	2,311,275	銀行
LEGAL & GENERAL	5,770	7,040	1,814	270,911	保険
MEGGITT PLC	780	950	410	61,232	航空宇宙・防衛
MORRISON SUPERMARKETS	2,130	2,460	525	78,398	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	340	422	1,051	156,912	食品
PEARSON	780	910	681	101,740	メディア
PERSIMMON PLC	295	355	898	134,066	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	2,521	3,021	5,372	802,005	保険
RIO TINTO PLC-REG	1,210	1,417	5,116	763,782	金属・鉱業
ST JAMES S PLACE PLC	490	620	673	100,552	資本市場
TRAVIS PERKINS PLC	247	302	372	55,628	商社・流通業
SSE PLC	990	1,160	1,480	220,943	電力
BP PLC	18,450	23,050	11,046	1,648,942	石油・ガス・消耗燃料
LLOYDS BANKING GROUP PLC	62,800	84,100	5,437	811,716	銀行
TATE & LYLE ORD.	480	—	—	—	食品
TAYLOR WIMPEY PLC	3,190	3,660	675	100,852	家庭用耐久財
TESCO PLC	7,870	11,210	2,308	344,535	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	840	1,020	1,357	202,651	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	4,755	5,740	8,001	1,194,392	医薬品
WEIR GROUP PLC	220	266	530	79,193	機械
BABCOCK INTL GROUP PLC	259	259	173	25,856	商業サービス・用品
ASTRAZENECA PLC	1,235	1,477	7,230	1,079,319	医薬品
GKN PLC	1,690	1,930	893	133,386	自動車部品
BT GROUP PLC	8,160	9,930	2,259	337,212	各種電気通信サービス
CARNIVAL PLC	187	220	1,007	150,404	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER PLC	1,530	1,810	489	73,002	複合小売り
BARCLAYS PLC	16,400	19,600	4,047	604,155	銀行
INTERTEK GROUP PLC	163	179	834	124,512	専門サービス
WILLIAM HILL PLC	850	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
BURBERRY GROUP PLC	419	504	854	127,593	繊維・アパレル・贅沢品
NEXT PLC	140	162	770	115,080	複合小売り
KINGFISHER PLC	2,140	2,460	719	107,407	専門小売り
ITV PLC	3,530	4,000	576	86,069	メディア
SAINSBURY	1,500	1,990	475	70,934	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD	88	109	641	95,702	金属・鉱業
G4S PLC	1,520	1,790	444	66,290	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	219	229	422	63,033	保険
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	124	148	560	83,706	家庭用耐久財
CENTRICA PLC	5,240	6,500	924	137,970	総合公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	4,261	5,294	11,824	1,764,990	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	3,653	4,365	9,939	1,483,610	石油・ガス・消耗燃料

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
BUNZLE	331	405	848	126,651	商社・流通業
COBHAM PLC	1,695	2,540	312	46,597	航空宇宙・防衛
NATIONAL GRID PLC	3,680	—	—	—	総合公益事業
INMARSAT PLC	425	—	—	—	各種電気通信サービス
PETROFAC LTD	260	—	—	—	エネルギー設備・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	139	—	—	—	医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	300	363	1,497	223,567	資本市場
UNILEVER PLC	1,254	1,429	5,652	843,735	パーソナル用品
TUI AG-DI	490	490	748	111,761	ホテル・レストラン・レジャー
INVESTEC PLC	610	750	412	61,529	資本市場
EXPERIAN PLC	909	1,067	1,640	244,879	専門サービス
MONDI PLC	343	408	781	116,627	紙製品・林産品
SEVERN TRENT PLC	237	277	510	76,245	水道
WHITBREAD PLC	173	206	762	113,773	ホテル・レストラン・レジャー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	250	303	494	73,858	資本市場
SMITHS GROUP PLC	371	470	711	106,182	コングロマリット
ANGLO AMERICAN PLC	1,364	1,554	2,581	385,294	金属・鉱業
3I GROUP PLC	970	1,140	979	146,174	資本市場
PROVIDENT FINANCIAL PLC	143	—	—	—	消費者金融
CAPITA PLC	640	760	109	16,341	専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	616	782	4,718	704,343	家庭用品
RELX PLC	1,058	1,212	1,775	265,040	専門サービス
SHIRE PLC	874	1,047	3,738	558,018	バイオテクノロジー
FRESNILLO PLC	209	260	329	49,230	金属・鉱業
UNITED UTILITIES GROUP PLC	670	760	543	81,158	水道
GLENCORE PLC	11,970	14,300	5,059	755,207	金属・鉱業
DIXONS CARPHONE PLC	920	—	—	—	専門小売り
WOOD GROUP (JOHN) PLC	—	730	394	58,842	エネルギー設備・サービス
GVC HOLDINGS PLC	—	630	578	86,422	ホテル・レストラン・レジャー
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,740	1,880	1,638	244,595	航空宇宙・防衛
OLD MUTUAL PLC	4,880	5,740	1,373	205,034	保険
EASYJET PLC	163	163	261	39,039	旅客航空輸送業
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	3,410	4,250	1,099	164,182	銀行
SAGE GROUP PLC (THE)	1,050	1,290	824	123,083	ソフトウェア
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	375	375	225	33,641	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WPP PLC	1,234	1,440	1,630	243,429	メディア
COCA-COLA HBC AG-CDI	167	223	587	87,678	飲料
CONVATEC GROUP PLC-WI	—	1,570	312	46,659	ヘルスケア機器・用品
COMPASS GROUP PLC	—	1,843	2,682	400,414	ホテル・レストラン・レジャー
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	—	213	909	135,698	ホテル・レストラン・レジャー
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	—	516	509	76,006	ソフトウェア
NATIONAL GRID PLC	—	3,970	3,184	475,385	総合公益事業
ROYAL MAIL PLC	880	1,080	584	87,183	航空貨物・物流サービス
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	690	890	308	46,045	ホテル・レストラン・レジャー
FERGUSON PLC	242	291	1,558	232,564	商社・流通業
IMI PLC	259	320	345	51,587	機械
VODAFONE GROUP PLC	25,990	31,140	6,048	902,786	無線通信サービス
RSA INSURANCE GROUP PLC	987	1,240	781	116,609	保険
COMPASS GROUP PLC	1,611	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,870	3,110	1,118	166,983	各種金融サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	950	1,190	417	62,277	インターネットソフトウェア・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,360	1,570	598	89,359	保険
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	181	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
WORLDPAY GROUP PLC	1,660	—	—	—	情報技術サービス

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)		百株	百株	千英ポンド	千円	
CRODA INTERNATIONAL PLC		120	155	708	105,689	化学
JOHNSON MATTHEY PLC		191	218	663	98,989	化学
小 計	株 数 ・ 金 額	289,196	355,372	207,983	31,045,685	
	銘 柄 数 < 比 率 >	104	99	—	<6.8%>	
(スイス)				千スイスフラン		
SYNGENTA AG-REG		89	—	—	—	化学
SIKA AG-BR		2	2	1,863	207,586	化学
SGS SA-REG		5	6	1,420	158,219	専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG		2	2	429	47,853	食品
SWISSCOM AG-REG		25	29	1,416	157,721	各種電気通信サービス
LINDT & SPRUENGLI AG-PC		1	1	740	82,490	食品
LINDT&SPRUENGLI AG-REG		0.1	0.12	834	92,890	食品
GIVAUDAN-REG		8	10	2,374	264,417	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG		147	177	5,553	618,543	保険
NOVARTIS-REG		2,175	2,589	20,002	2,227,891	医薬品
ABB LTD		1,841	2,159	4,905	546,346	電気設備
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)		684	818	17,922	1,996,194	医薬品
ADECCO GROUP AG-REG		153	193	1,312	146,175	専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD		439	537	2,808	312,811	建設資材
CLARIANT AG-REG		—	259	590	65,800	化学
NESTLE SA-REG		3,030	3,621	27,382	3,049,807	食品
BALOISE HOLDING AG		50	58	847	94,381	保険
SONOVA HOLDING AG-REG		50	58	880	98,063	ヘルスケア機器・用品
STRAUMANN HOLDING AG-REG		—	11	674	75,096	ヘルスケア機器・用品
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		1,950	2,800	4,477	498,670	資本市場
THE SWATCH GROUP AG-B		29	35	1,491	166,151	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG		46	60	480	53,495	繊維・アパレル・贅沢品
LONZA AG-REG		57	85	1,923	214,206	ライフサイエンス・ツール/サービス
SWISS LIFE HOLDING AG		31	38	1,313	146,304	保険
GALENICA AG-REG		3	—	—	—	医薬品
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		8	9	590	65,818	化学
SWISS PRIME SITE-REG		68	81	748	83,406	不動産管理・開発
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES		32	43	364	40,565	各種金融サービス
DUFREY AG-REG		45	44	550	61,332	専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG		16	20	1,462	162,904	資本市場
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		38	44	922	102,790	機械
SCHINDLER HOLDING AG-REG		19	24	490	54,576	機械
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		52	65	976	108,812	海運業
GEBERIT AG-REG		35	43	1,841	205,124	建設関連製品
ARYZTA AG		85	—	—	—	食品
JULIUS BAER GROUP LTD		220	259	1,521	169,449	資本市場
SWISS RE LTD		309	361	3,511	391,145	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A		511	601	5,154	574,072	繊維・アパレル・贅沢品
ACTELION LTD-NEW LINE		93	—	—	—	バイオテクノロジー
UBS GROUP AG		3,570	4,240	7,121	793,145	資本市場
VIFOR PHARMA AG		—	57	839	93,484	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額	15,927	19,447	127,740	14,227,749	
	銘 柄 数 < 比 率 >	38	37	—	<3.1%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS		34	46	2,750	34,962	各種金融サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB		1,500	1,750	15,302	194,488	銀行
SWEDBANK AB		881	1,069	19,990	254,076	銀行
SWEDISH MATCH AB		189	215	8,116	103,157	タバコ
NORDEA BANK AB		2,950	3,510	31,274	397,493	銀行

銘 柄	株 数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円	
SECURITAS AB-B SHS	290	333	4,720	59,994	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	441	539	19,899	252,927	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B	917	1,075	13,456	171,036	専門小売り
ERICSSON LM-B	2,970	3,490	18,469	234,742	通信機器
TELIA CO AB	2,470	3,300	12,939	164,458	各種電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	341	382	6,518	82,854	建設・土木
LUNDIN PETROLEUM AB	171	217	4,548	57,809	石油・ガス・消耗燃料
ALFA LAVAL AB	277	350	6,900	87,702	機械
GETINGE AB-B SHS	191	268	2,544	32,339	ヘルスケア機器・用品
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	68	82	4,669	59,354	無線通信サービス
ICA GRUPPEN AB	78	105	3,101	39,422	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	380	450	3,621	46,030	家庭用耐久財
ELECTROLUX AB-B	233	265	6,956	88,413	家庭用耐久財
SKF AB-B SHARES	388	427	7,280	92,533	機械
VOLVO AB-B SHS	1,520	1,820	27,709	352,187	機械
SANDVIK AB	1,030	1,310	19,970	253,830	機械
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	168	206	3,995	50,781	各種金融サービス
SVENSKA CELLULOSA AB-B	600	—	—	—	紙製品・林産品
BOLIDEN AB	263	327	9,564	121,567	金属・鉱業
HEXAGON AB-B SHS	258	302	14,979	190,385	電子装置・機器・部品
TELE 2 AB-B SHS	340	420	4,206	53,462	無線通信サービス
KINNEVIK AB - B	236	266	7,990	101,561	各種金融サービス
ESSITY AKTIEBOLAG-B	—	696	16,049	203,992	家庭用品
ATLAS COPCO AB-A	660	783	28,281	359,463	機械
ATLAS COPCO AB-B	382	450	14,602	185,597	機械
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	1,480	1,810	18,860	239,713	銀行
ASSA ABLOY AB-B	963	1,184	21,353	271,402	建設関連製品
小 計	株 数 ・ 金 額	22,669	27,447	380,624	4,837,743
	銘 柄 数 < 比 率 >	31	31	—	<1.1%>
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	940	1,120	17,040	230,732	銀行
TELENOR ASA	719	856	15,151	205,147	各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA	78	—	—	—	メディア
STATOIL ASA	1,113	1,363	25,167	340,771	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	168	206	6,820	92,351	化学
MARINE HARVEST ASA	372	467	7,341	99,400	食品
NORSK HYDRO	1,300	1,610	7,397	100,168	金属・鉱業
ORKLA ASA	800	910	7,656	103,672	食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	197	250	3,590	48,608	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS	91	129	2,561	34,688	メディア
小 計	株 数 ・ 金 額	5,778	6,911	92,728	1,255,541
	銘 柄 数 < 比 率 >	10	9	—	<0.3%>
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
CARLSBERG B	105	126	9,082	159,572	飲料
A P MOLLER-MAERSK A/S	6	7	6,821	119,847	海運業
A P MOLLER - MAERSK A/S-A	3	4	3,896	68,456	海運業
DANSKE BANK AS	669	881	19,857	348,900	銀行
GENMAB A/S	54	69	8,956	157,360	バイオテクノロジー
TDC A/S	768	970	4,861	85,419	各種電気通信サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	212	252	10,830	190,299	電気設備
H LUNDBECK A/S	—	82	2,769	48,668	医薬品
DSV A/S	190	221	10,482	184,169	陸運・鉄道
PANDORA A/S	108	124	8,057	141,570	繊維・アパレル・贅沢品
CHR HANSEN HOLDING A/S	91	114	5,939	104,355	化学

銘柄		期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)		百株	百株	千デンマーククローネ	千円	
NOVOZYMES A/S-B SHARES		225	271	8,466	148,748	化学
COLOPLAST-B		117	142	7,250	127,391	ヘルスケア機器・用品
NOVO NORDISK A/S-B		1,867	2,155	64,111	1,126,434	医薬品
ISS A/S		161	186	4,158	73,072	商業サービス・用品
TRYG A/S		118	118	1,657	29,129	保険
ORSTED A/S		141	218	8,545	150,146	電力
WILLIAM DEMANT HOLDING		130	130	2,914	51,209	ヘルスケア機器・用品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,966 17	6,070 18	188,659 —	3,314,751 <0.7%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG		184	216	4,265	558,546	繊維・アパレル・贅沢品
FRESENIUS SE & CO KGAA		396	484	3,003	393,335	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		112	144	735	96,358	インターネットソフトウェア・サービス
FUCHS PETROLUB SE -PFD		64	82	361	47,354	化学
HANNOVER RUECK SE		56	71	787	103,108	保険
GEA GROUP AG		170	207	715	93,653	機械
CONTINENTAL AG		104	128	2,875	376,550	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG		926	1,138	4,042	529,322	航空貨物・物流サービス
AXEL SPRINGER SE		44	59	401	52,537	メディア
MERCK KGAA		125	151	1,176	154,035	医薬品
RWE AG		496	579	1,161	152,095	総合公益事業
SAP SE		959	1,146	9,737	1,275,133	ソフトウェア
E.ON SE		2,150	2,600	2,345	307,103	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA		99	123	1,258	164,773	家庭用品
CECONOMY AG		182	—	—	—	専門小売り
BAYER AG-REG		807	964	8,848	1,158,718	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		173	208	2,222	291,033	家庭用品
BASF SE		896	1,071	8,832	1,156,620	化学
BEIERSDORF AG		100	118	1,085	142,190	パーソナル用品
HOCHTIEF AG		20	20	303	39,730	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG		143	173	1,380	180,736	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE		208	255	2,115	277,088	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE-REG		445	520	9,540	1,249,324	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		226	267	692	90,695	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		155	179	3,384	443,159	保険
VOLKSWAGEN AG		32	38	619	81,124	自動車
VOLKSWAGEN AG-PREF		179	216	3,485	456,466	自動車
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		940	1,124	7,752	1,015,154	自動車
MAN SE		37	37	350	45,907	機械
THYSSENKRUPP AG		363	518	1,097	143,736	金属・鉱業
SIEMENS AG		746	892	9,233	1,209,190	コングロマリット
1&1 DRILLISCH AG		—	59	323	42,300	無線通信サービス
LINDE AG		182	—	—	—	化学
DEUTSCHE BANK AG-REG		2,026	2,410	2,729	357,436	資本市場
BAYER MOTOREN WERK		316	385	3,393	444,414	自動車
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD		53	64	487	63,819	自動車
DEUTSCHE TELEKOM-REG		3,199	3,900	5,167	676,684	各種電気通信サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		1,089	1,324	2,878	376,923	半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE BOERSE AG		—	221	2,444	320,075	資本市場
PORSCHЕ AUTOMOBIL HOLDING SE		152	171	1,154	151,149	自動車
FRAPORT AG		38	49	392	51,396	運送インフラ
WIRECARD AG		—	140	1,342	175,850	情報技術サービス
LANXESS		89	103	640	83,894	化学
MTU AERO ENGINES AG		—	58	793	103,900	航空宇宙・防衛

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE WOHNEN SE		342	413	1,565	204,972	不動産管理・開発
SYMRISE AG		121	136	888	116,400	化学
BRENNTAG AG		151	186	898	117,642	商社・流通業
K+S AG		188	234	548	71,825	化学
EVONIK INDUSTRIES AG		169	195	558	73,132	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG		746	746	284	37,278	各種電気通信サービス
HUGO BOSS AG		63	76	537	70,421	繊維・アパレル・贅沢品
COMMERZBANK AG		1,020	1,240	1,307	171,211	銀行
OSRAM LICHT AG		88	116	693	90,776	電気設備
KION GROUP AG		—	80	605	79,345	機械
VONOVIA SE		446	555	2,233	292,525	不動産管理・開発
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE		223	256	721	94,468	メディア
SIEMENS HEALTHINEERS AG		—	174	581	76,102	ヘルスケア機器・用品
METRO AG		—	182	261	34,295	食品・生活必需品小売り
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER		189	—	—	—	資本市場
INNOGY SE		127	171	657	86,143	総合公益事業
LINDE AG - TENDER		—	214	3,661	479,478	化学
ZALANDO SE		81	134	593	77,699	インターネット販売・通信販売
COVESTRO AG		88	188	1,501	196,604	化学
QIAGEN NV		214	245	643	84,217	ライフサイエンス・ツール/サービス
SCHAEFFLER AG		160	210	263	34,470	自動車部品
UNIPER SE		—	224	554	72,598	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小 計	株 数 ・ 金 額	23,102	28,588	135,122	17,694,243	
	銘 柄 数 < 比 率 >	57	63	—	<3.9%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI		1,120	1,470	2,296	300,775	保険
INTESA SANPAOLO		12,340	15,780	4,660	610,308	銀行
INTESA SANPAOLO-RSP		920	1,180	363	47,561	銀行
MEDIOBANCA S. P. A.		530	680	649	85,021	銀行
SAIPEM SPA		5,897	—	—	—	エネルギー設備・サービス
LUXOTTICA GROUP SPA		165	203	1,025	134,243	繊維・アパレル・贅沢品
ENEL SPA		7,470	9,360	4,651	609,168	電力
ENI SPA		2,490	2,960	4,229	553,820	石油・ガス・消耗燃料
SNAM SPA		2,330	2,740	1,022	133,941	石油・ガス・消耗燃料
TENARIS SA		460	530	739	96,817	エネルギー設備・サービス
TELECOM ITALIA SPA		11,300	13,600	1,048	137,308	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC		5,700	6,800	459	60,230	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA		387	532	1,337	175,208	運送インフラ
TERNA SPA		1,520	1,630	774	101,366	電力
RECORDATI SPA		—	112	335	43,969	医薬品
LEONARDO SPA		410	470	440	57,718	航空宇宙・防衛
PRYSMIAN SPA		194	230	586	76,802	電気設備
UNIPOLSAI SPA		1,070	1,070	206	27,084	保険
FERRARI NV		116	143	1,394	182,651	自動車
CNH INDUSTRIAL NV		990	1,210	1,213	158,924	機械
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		890	1,230	2,029	265,795	自動車
UNICREDIT SPA		1,843	2,350	3,992	522,775	銀行
EXOR NV		104	121	698	91,457	各種金融サービス
POSTE ITALIANE SPA		500	640	474	62,185	保険
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		—	650	399	52,347	飲料
小 計	株 数 ・ 金 額	58,746	65,691	35,032	4,587,485	
	銘 柄 数 < 比 率 >	23	24	—	<1.0%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES		201	257	1,046	137,006	建設・土木

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIRBUS SE	567	679	6,369	834,023	航空宇宙・防衛
VEOLIA ENVIRONNEMENT	461	569	1,095	143,395	総合公益事業
LOREAL-ORD	246	294	5,403	707,565	パーソナル用品
CHRISTIAN DIOR SE	53	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	272	325	8,141	1,066,130	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT AVIATION SA	2	2	418	54,837	航空宇宙・防衛
THALES SA	105	124	1,226	160,656	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	158	190	1,922	251,790	情報技術サービス
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	59	59	234	30,757	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP	55	67	441	57,800	電子装置・機器・部品
PUBLICIS GROUPE	181	239	1,352	177,078	メディア
FAURECIA	—	85	558	73,151	自動車部品
LAGARDERE S. C. A	116	148	343	44,962	メディア
BOLLORE	870	1,060	458	60,103	航空貨物・物流サービス
MICHELIN (CGDE)	175	200	2,398	314,018	自動車部品
PERNOD RICARD SA	207	247	3,340	437,461	飲料
RENAULT SA	186	227	2,235	292,797	自動車
REMY COINTREAU	23	23	266	34,877	飲料
SEB SA	20	24	380	49,792	家庭用耐久財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	544	663	4,729	619,372	電気設備
VIVENDI SA	1,000	1,209	2,538	332,468	メディア
ORANGE SA	1,940	2,340	3,225	422,404	各種電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	26	36	1,752	229,510	繊維・アパレル・贅沢品
SOCIETE BIC SA	28	28	227	29,750	商業サービス・用品
DASSAULT SYSTEMES SA	128	150	1,656	216,853	ソフトウェア
KERING SA	74	88	3,429	449,055	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	165	212	434	56,910	保険
CARREFOUR SUPERMARCHE	552	674	1,135	148,718	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	86	112	1,244	162,943	情報技術サービス
SANOFI	1,132	1,326	8,662	1,134,388	医薬品
ACCOR SA	164	214	938	122,882	ホテル・レストラン・レジャー
STMICROELECTRONICS NV	600	753	1,354	177,341	半導体・半導体製造装置
SOCIETE GENERALE	742	884	3,903	511,195	銀行
TELEPERFORMANCE	—	64	806	105,598	専門サービス
EURAZEO SE	40	54	403	52,857	各種金融サービス
SODEXO	89	101	827	108,320	ホテル・レストラン・レジャー
AXA	1,897	2,249	4,857	636,134	保険
PEUGEOT CITROEN	473	674	1,317	172,548	自動車
JC DECAUX SA	68	93	262	34,416	メディア
ESSILOR INTERNATIONAL	204	242	2,652	347,321	ヘルスケア機器・用品
CREDIT AGRICOLE SA	1,080	1,290	1,703	223,066	銀行
ZODIAC AEROSPACE	195	—	—	—	航空宇宙・防衛
BNP PARIBAS	1,034	1,311	7,888	1,032,971	銀行
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	481	583	2,498	327,209	建設関連製品
WENDEL	29	34	430	56,410	各種金融サービス
ILIAD SA	27	31	529	69,298	各種電気通信サービス
SES FDR	344	430	472	61,854	メディア
IMERYS	38	38	299	39,261	建設資材
SAFRAN SA	304	385	3,310	433,474	航空宇宙・防衛
ENGIE	1,520	2,130	2,887	378,080	総合公益事業
ALSTOM	155	181	662	86,772	機械
EUTELSAT COMMUNICATIONS	163	200	322	42,165	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE	370	670	787	103,178	電力
IPSEN	—	40	504	66,077	医薬品

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ARKEMA		67	77	816	106,881	化学
LEGRAND SA		264	302	1,923	251,913	電気設備
EIFFAGE SA		61	87	804	105,359	建設・土木
TOTAL SA		2,219	2,798	12,907	1,690,194	石油・ガス・消耗燃料
ADP		28	34	601	78,805	運送インフラ
NATIXIS		870	1,110	739	96,777	資本市場
UBISOFT ENTERTAINMENT		—	70	479	62,808	ソフトウェア
SCOR SE		154	206	685	89,721	保険
REXEL SA		286	350	481	63,019	商社・流通業
VINCI		489	594	4,746	621,496	建設・土木
DANONE		578	695	4,568	598,210	食品
AIR LIQUIDE		376	501	4,983	652,647	化学
BUREAU VERITAS SA		255	301	635	83,207	専門サービス
GETLINK		450	530	614	80,508	運送インフラ
SUEZ		333	450	529	69,357	総合公益事業
EDENRED		214	253	714	93,560	商業サービス・用品
VALEO SA		228	276	1,480	193,866	自動車部品
BIOMERIEUX		—	46	308	40,358	ヘルスケア機器・用品
SFR GROUP SA		77	—	—	—	各種電気通信サービス
AMUNDI SA		—	67	437	57,256	資本市場
小 計	株 数 ・ 金 額	26,601	33,058	144,749	18,954,974	
	銘柄 数 < 比 率 >	69	72	—	<4.2%>	
(ユーロ…イギリス)						
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		219	—	—	—	飲料
小 計	株 数 ・ 金 額	219	—	—	—	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	—	—	<—%>	
(ユーロ…オランダ)						
RELX NV		954	1,095	1,842	241,325	専門サービス
RANDSTAD HOLDING NV		116	135	721	94,437	専門サービス
AKZO NOBEL		248	297	2,279	298,458	化学
WOLTERS KLUWER		299	351	1,515	198,516	専門サービス
VOPAK		71	90	358	46,965	石油・ガス・消耗燃料
AEGON NV		1,700	2,080	1,139	149,153	保険
KONINKLIJKE KPN NV		3,410	4,000	974	127,650	各種電気通信サービス
KONINKLIJKE PHILIPS NV		916	1,085	3,381	442,794	ヘルスケア機器・用品
HEINEKEN NV		223	303	2,645	346,387	飲料
ARCELORMITTAL		1,780	—	—	—	金属・鉱業
HEINEKEN HOLDING NV		97	135	1,129	147,966	飲料
KONINKLIJKE DSM NV		180	209	1,685	220,699	化学
UNILEVER NV-CVA		1,589	1,901	8,719	1,141,869	パーソナル用品
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA		93	96	228	29,925	建設・土木
ASML HOLDING NV		362	453	7,254	950,015	半導体・半導体製造装置
GEMALTO		76	—	—	—	ソフトウェア
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		1,232	1,495	2,876	376,701	食品・生活必需品小売り
NN GROUP NV		300	346	1,246	163,292	保険
ARCELORMITTAL		—	761	1,955	256,108	金属・鉱業
ABN AMRO GROUP NV-CVA		279	489	1,196	156,692	銀行
ALTICE NV - B		100	—	—	—	メディア
ALTICE NV - A		368	640	428	56,134	メディア
ING GROEP NV		3,790	4,540	6,219	814,482	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	18,183	20,501	47,801	6,259,577	
	銘柄 数 < 比 率 >	22	20	—	<1.4%>	
(ユーロ…スペイン)						
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		630	809	1,473	193,020	運送インフラ

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ENDESA S. A.		317	356	636	83,376	電力
BANKINTER S. A.		650	750	626	82,066	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S. A.		6,420	7,660	4,924	644,878	銀行
GAS NATURAL SDG		328	412	798	104,611	ガス
REPSOL SA		1,087	1,435	2,069	271,044	石油・ガス・消耗燃料
BANCO SANTANDER SA		14,220	18,810	9,959	1,304,248	銀行
TELEFONICA SA		4,430	5,430	4,359	570,837	各種電気通信サービス
ZARDOYA OTIS S. A		175	—	—	—	機械
ENAGAS		228	267	593	77,724	石油・ガス・消耗燃料
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA		—	300	390	51,168	電気設備
ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV		190	282	894	117,175	建設・土木
FERROVIAL SA		464	540	917	120,131	建設・土木
MAPFRE SA		980	1,260	340	44,565	保険
BANCO DE SABADELL SA		5,300	6,250	1,038	135,942	銀行
CAIXABANK		3,450	4,130	1,599	209,406	銀行
IBERDROLA SA		5,410	6,810	4,066	532,564	電力
AMADEUS IT GROUP SA		426	511	3,064	401,358	情報技術サービス
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP		800	750	526	68,945	旅客航空輸送業
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		560	—	—	—	食品・生活必需品小売り
BANKIA SA		4,300	—	—	—	銀行
BCO POPULAR ESPANOL		3,002	—	—	—	銀行
RED ELECTRICA CORPORACION SA		432	482	806	105,596	電力
INDITEX SA		1,068	1,270	3,229	422,917	専門小売り
AENA SME SA		65	80	1,309	171,439	運送インフラ
GRIFOLS SA		288	329	757	99,132	バイオテクノロジー
BANKIA SA		—	1,510	549	71,955	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	55,222 25	60,435 23	44,934 —	5,884,109 <1.3%>	
(ユーロ…ベルギー)						
UMICORE		94	—	—	—	化学
KBC GROEP NV		244	285	2,015	263,932	銀行
SOLVAY SA		73	87	981	128,566	化学
UCB SA		121	151	999	130,860	医薬品
COLRUYT SA		60	73	327	42,940	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAM		78	89	825	108,154	各種金融サービス
PROXIMUS		151	184	464	60,791	各種電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		52	67	363	47,597	メディア
AGEAS		190	213	893	117,036	保険
UMICORE		—	247	1,060	138,855	化学
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		743	889	7,936	1,039,349	飲料
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,806 10	2,285 10	15,869 —	2,078,083 <0.5%>	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG		150	171	808	105,871	石油・ガス・消耗燃料
VOESTALPINE AG		110	128	544	71,354	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG		289	353	1,440	188,599	銀行
IMMOEAST AG-RIGHTS		500	—	—	—	不動産管理・開発
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		110	169	533	69,910	銀行
ANDRITZ AG		72	92	417	54,695	機械
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,231 6	913 5	3,745 —	490,430 <0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルグ)						
EUROFINS SCIENTIFIC SE		10	12	531	69,660	ライフサイエンス・ツール/サービス

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ルクセンブルグ)		百株	百株	千ユーロ	千円		
RTL GROUP		39	39	263	34,447	メディア	
小	計	株 数 ・ 金 額	49	51	795	104,107	
		銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.0%>	
(ユーロ…フィンランド)							
WARTSILA OYJ		147	525	942	123,404	機械	
UPM-KYMMENE OYJ		529	615	1,851	242,408	紙製品・林産品	
STORA ENSO OYJ-R		540	620	925	121,174	紙製品・林産品	
SAMPO OYJ-A SHS		430	527	2,385	312,342	保険	
FORTUM OYJ		440	500	872	114,253	電力	
ELISA OYJ		145	172	632	82,818	各種電気通信サービス	
METSO OYJ		103	124	317	41,585	機械	
NOKIA OYJ		5,680	6,800	3,049	399,371	通信機器	
NESTE OYJ		125	146	826	108,211	石油・ガス・消耗燃料	
NOKIAN RENKAAT OYJ		113	134	494	64,749	自動車部品	
KONE OYJ		323	384	1,556	203,804	機械	
ORION OYJ		95	130	323	42,337	医薬品	
小	計	株 数 ・ 金 額	8,670	10,677	14,176	1,856,460	
		銘柄 数 < 比 率 >	12	12	—	<0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)							
BANK OF IRELAND		28,500	—	—	—	銀行	
CRH PLC		823	996	2,745	359,585	建設資材	
KERRY GROUP PLC-A		158	193	1,590	208,252	食品	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD		1,398	1,398	—	—	銀行	
BANK OF IRELAND GROUP PLC		—	1,090	774	101,484	銀行	
AIB GROUP PLC		—	1,050	513	67,263	銀行	
PADDY POWER PLC		87	101	842	110,370	ホテル・レストラン・レジャー	
小	計	株 数 ・ 金 額	30,966	4,828	6,467	846,956	
		銘柄 数 < 比 率 >	5	6	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)							
ENERGIAS DE PORTUGAL		2,350	2,620	809	105,945	電力	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS		500	570	872	114,238	石油・ガス・消耗燃料	
JERONIMO MARTINS		230	310	458	60,100	食品・生活必需品小売り	
小	計	株 数 ・ 金 額	3,080	3,500	2,140	280,284	
		銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
ユ ー ロ 計		株 数 ・ 金 額	227,877	230,528	450,834	59,036,713	
		銘柄 数 < 比 率 >	235	240	—	<13.0%>	
(香港)				千香港ドル			
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		219	380	4,164	56,391	半導体・半導体製造装置	
HANG LUNG PROPERTIES LTD		2,130	2,510	4,588	62,125	不動産管理・開発	
BANK OF EAST ASIA		1,208	1,400	4,383	59,357	銀行	
CLP HLDGS		1,590	1,870	14,941	202,305	電力	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS		1,070	—	—	—	旅客航空輸送業	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD		650	—	—	—	電力	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD		1,120	1,380	35,217	476,846	資本市場	
LI & FUNG LTD		5,636	7,496	2,878	38,974	繊維・アパレル・贅沢品	
MTR CORP		1,480	1,810	7,638	103,421	陸運・鉄道	
FIRST PACIFIC CO		2,260	2,260	965	13,066	各種金融サービス	
HANG LUNG GROUP LTD		810	1,030	2,641	35,772	不動産管理・開発	
HANG SENG BANK		756	870	15,799	213,921	銀行	
HENDERSON LAND		1,078	1,325	6,775	91,744	不動産管理・開発	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		1,320	1,630	11,401	154,381	電力	
WHARF(HOLDING)		1,330	1,340	3,611	48,897	不動産管理・開発	
HONG KONG & CHINA GAS		7,548	9,602	15,479	209,597	ガス	
HYSAN DEVELOPMENT		650	650	2,697	36,524	不動産管理・開発	

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		2,230	2,710	19,308	261,440	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES		570	790	2,792	37,812	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		3,635	4,210	16,082	217,752	銀行
NWS HOLDINGS LTD		1,595	1,595	2,271	30,753	コングロマリット
PCCW LTD		3,860	5,500	2,497	33,809	各種電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		750	970	3,021	40,911	繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT		5,496	6,796	7,530	101,965	不動産管理・開発
SHANGRI-LA ASIA LTD		1,083	1,603	2,533	34,300	ホテル・レストラン・レジャー
SINO LAND CO.LTD		3,140	3,600	4,572	61,904	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES		1,390	1,660	20,584	278,707	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC-A		535	535	4,234	57,335	不動産管理・開発
WHEELLOCK & COMPANY LTD		750	980	5,620	76,098	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		1,400	1,560	7,137	96,634	家庭用耐久財
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD		—	4,500	1,579	21,386	資本市場
MINTH GROUP LTD		—	820	2,931	39,692	自動車部品
SJM HOLDINGS LIMITED		1,660	2,700	1,841	24,932	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD		1,484	1,840	5,234	70,879	ホテル・レストラン・レジャー
MGM CHINA HOLDINGS LTD		940	1,240	2,511	33,998	ホテル・レストラン・レジャー
AIA GROUP LTD		11,760	14,080	93,491	1,265,870	保険
HKT TRUST AND HKT LTD		3,796	4,496	4,437	60,084	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD		2,336	2,864	12,086	163,645	ホテル・レストラン・レジャー
SWIRE PROPERTIES LTD		1,168	1,460	4,015	54,363	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		—	1,470	7,511	101,708	不動産管理・開発
WH GROUP LIMITED		8,100	10,200	8,527	115,458	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		2,645	3,120	29,300	396,729	コングロマリット
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING		2,610	—	—	—	不動産管理・開発
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD		—	750	4,811	65,144	電力
CK ASSET HOLDINGS LTD		—	2,980	19,625	265,735	不動産管理・開発
小 計		株 数 ・ 金 額	93,790	120,586	429,274	5,812,382
銘 柄 数 < 比 率 >			40	42	—	<1.3%>
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING		1,610	1,980	710	57,704	航空宇宙・防衛
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		6,203	9,400	329	26,708	食品
DBS GROUP HLDGS		1,720	2,067	5,684	461,447	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD		410	510	663	53,822	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD		100	100	345	28,007	販売
SATS LTD		590	770	395	32,066	運送インフラ
SINGAPORE EXCHANGE LTD		770	930	685	55,641	資本市場
CAPITALAND LIMITED		2,460	2,850	1,017	82,596	不動産管理・開発
GENTING SINGAPORE PLC		6,146	7,200	777	63,125	ホテル・レストラン・レジャー
COMFORTDELGRO CORP LTD		2,070	2,500	512	41,604	陸運・鉄道
SINGAPORE AIRLINES LTD		520	630	683	55,474	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK		1,300	1,550	4,262	346,029	銀行
UOL GROUP LIMITED		487	650	555	45,115	不動産管理・開発
SINGAPORE PRESS HOLDINGS		1,480	1,870	471	38,255	メディア
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED		7,860	9,650	3,252	264,001	各種電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES		990	990	308	25,004	コングロマリット
OCBC-ORD		3,030	3,670	4,704	381,947	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD		1,840	1,750	556	45,176	食品
STARHUB LTD		690	690	158	12,883	無線通信サービス
KEPPEL CORP.		1,427	1,620	1,258	102,184	コングロマリット
YANGZIJANG SHIPBUILDING		1,630	2,700	326	26,521	機械

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L		2,660	—	—	—	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額	45,994	54,078	27,658	2,245,319	
	銘柄 数 < 比 率 >	22	21	—	<0.5%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD		141	158	984	80,505	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK		2,857	3,432	9,218	753,692	銀行
AMCOR		1,120	1,340	1,898	155,244	容器・包装
WESTPAC BANKING CORP		3,263	3,962	11,339	927,096	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD		351	420	460	37,635	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD		1,480	1,870	809	66,201	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD		4,140	4,870	1,529	125,025	各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD		443	540	531	43,443	銀行
COCA-COLA AMATIL LTD		600	600	520	42,531	飲料
ASX LTD		196	219	1,227	100,377	資本市場
BHP BILLITON LIMITED		3,137	3,750	10,578	864,918	金属・鉱業
CALTEX AUSTRALIA LIMITED		255	291	913	74,707	石油・ガス・消耗燃料
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		530	530	195	15,989	複合小売り
COMPUTERSHARE LTD		470	560	969	79,254	情報技術サービス
CSL LIMITED		446	524	8,146	666,025	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD		54	54	427	34,971	インターネットソフトウェア・サービス
TRANSURBAN GROUP		1,980	2,570	2,934	239,960	運送インフラ
COCHLEAR LTD		58	67	1,216	99,489	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD		1,750	2,050	1,783	145,818	石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		1,680	2,043	14,772	1,207,835	銀行
BORAL LTD		1,150	1,330	989	80,903	建設資材
RIO TINTO LTD		408	480	3,489	285,309	金属・鉱業
APA GROUP		1,110	1,440	1,134	92,774	ガス
ARISTOCRAT LEISURE LTD		520	630	1,515	123,930	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD		2,280	2,770	2,071	169,403	保険
TPG TELECOM LTD		330	359	197	16,142	各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD		52	73	416	34,014	ホテル・レストラン・レジャー
ORICA LTD		366	420	745	60,986	化学
BLUESCOPE STEEL LTD		—	670	1,011	82,661	金属・鉱業
SUNCORP GROUP LTD		1,260	1,490	1,987	162,511	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK		2,594	3,138	8,940	730,947	銀行
NEWCREST MINING		750	890	1,740	142,331	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD		1,290	1,620	1,158	94,702	石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD		1,610	1,960	687	56,247	化学
AMP LIMITED		2,810	3,440	1,716	140,345	各種金融サービス
QANTAS AIRWAYS LIMITED		441	—	—	—	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE		1,320	1,520	1,463	119,677	保険
CHALLENGER LIMITED		560	660	761	62,271	各種金融サービス
SANTOS LTD.		1,760	2,120	1,074	87,878	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE LTD		380	490	1,121	91,662	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TABCORP HOLDINGS		780	2,184	958	78,389	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LIMITED		1,107	1,308	5,436	444,451	食品・生活必需品小売り
ALUMINA LTD		2,330	2,900	684	55,956	金属・鉱業
WOODSIDE PETROLEUM		735	1,107	3,236	264,646	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD		1,236	1,522	4,001	327,149	食品・生活必需品小売り
DUET GROUP		2,290	—	—	—	総合公益事業
SEEK LTD		328	400	744	60,829	専門サービス
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L		59	59	246	20,129	ホテル・レストラン・レジャー
TATTS GROUP LTD		1,470	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
BRAMBLES LTD		1,530	1,890	1,886	154,217	商業サービス・用品

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)		百株	百株	千豪ドル	千円	
MACQUARIE GROUP LIMITED		295	378	3,889	318,015	資本市場
CROWN RESORTS LTD		360	430	545	44,613	ホテル・レストラン・レジャー
VOCUS GROUP LTD		540	—	—	—	各種電気通信サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC		440	520	1,189	97,232	建設資材
TREASURY WINE ESTATES LTD		720	820	1,382	113,034	飲料
SYDNEY AIRPORT		1,079	1,250	838	68,576	運送インフラ
AURIZON HOLDINGS LTD		1,910	2,390	1,010	82,656	陸運・鉄道
HEALTHSCOPE LTD		1,760	1,760	340	27,844	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUSNET SERVICES		1,634	2,300	385	31,498	電力
MEDIBANK PRIVATE LTD		2,610	3,080	893	73,028	保険
AGL ENERGY LTD		657	790	1,712	140,031	総合公益事業
SOUTH32 LTD		5,070	6,140	1,977	161,646	金属・鉱業
CIMIC GROUP LTD		89	117	520	42,539	建設・土木
小 計	株 数 ・ 金 額	74,971	86,695	134,563	11,001,918	
	銘 柄 数 < 比 率 >	62	59	—	<2.4%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
CONTACT ENERGY LTD		760	—	—	—	電力
RYMAN HEALTHCARE LTD		350	450	476	36,651	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L		—	640	844	64,973	ヘルスケア機器・用品
FLETCHER BUILDING LTD		690	690	416	31,999	建設資材
SPARK NEW ZEALAND LTD		1,890	2,290	764	58,825	各種電気通信サービス
MERCURY NZ LTD		600	880	283	21,793	電力
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		911	1,080	660	50,834	運送インフラ
MERIDIAN ENERGY LTD		1,200	1,590	453	34,912	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小 計	株 数 ・ 金 額	6,401	7,620	3,900	299,990	
	銘 柄 数 < 比 率 >	7	7	—	<0.1%>	
(イスラエル)				千新シェケル		
BANK HAPOLIM BM		1,020	1,250	3,003	91,404	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		1,420	1,610	3,379	102,834	銀行
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP		2,040	2,040	903	27,500	各種電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD		23	28	1,211	36,876	航空宇宙・防衛
FRUTAROM		38	48	1,560	47,500	化学
ISRAEL CHEMICALS LIMITED		500	910	1,374	41,813	化学
NICE LTD		59	68	2,214	67,374	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		130	170	1,134	34,525	銀行
AZRIELI GROUP		41	41	684	20,835	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額	5,271	6,165	15,467	470,664	
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	1,136,364	1,322,817	—	434,672,468	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1,265	1,260	—	<95.6%>	

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

* 邦貨換算金額欄の＜＞内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
AGNC INVESTMENT CORP	32,900	42,800	809	86,079	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,600	11,000	1,373	146,033	0.0
AMERICAN TOWER CORP	41,600	50,100	7,281	774,027	0.2
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	95,000	132,000	1,376	146,349	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,230	16,300	2,680	284,958	0.1
BOSTON PROPERTIES	14,900	17,700	2,180	231,839	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	30,000	37,000	564	59,979	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	8,200	10,500	883	93,957	0.0
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	51,000	59,000	331	35,246	0.0
CROWN CASTLE INTL CORP	35,000	46,800	5,129	545,292	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	15,300	24,300	2,560	272,206	0.1
DUKE REALTY CORP	34,000	38,900	1,030	109,496	0.0
EQUINIX INC	7,450	9,120	3,813	405,368	0.1
EQUITY RESIDENTIAL	34,800	43,400	2,674	284,278	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,190	7,590	1,826	194,184	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	11,800	14,100	1,231	130,937	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,910	7,900	917	97,505	0.0
GGP INC	56,500	68,200	1,395	148,328	0.0
HCP INC	44,700	51,600	1,198	127,418	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	70,100	88,000	1,640	174,366	0.0
INVITATION HOMES INC	—	34,000	776	82,512	0.0
IRON MOUNTAIN INC	24,400	31,300	1,028	109,331	0.0
KIMCO REALTY CORP	40,000	51,000	734	78,066	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	14,300	16,900	671	71,373	0.0
MACERICH CO /THE	12,300	14,200	795	84,559	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,200	13,700	1,249	132,873	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	14,500	17,100	671	71,364	0.0
PROLOGIS INC	51,400	61,400	3,867	411,124	0.1
PUBLIC STORAGE	14,450	18,300	3,667	389,816	0.1
REALTY INCOME CORP	24,700	32,100	1,660	176,514	0.0
REGENCY CENTERS CORP	15,100	17,000	1,002	106,582	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	12,000	13,800	2,358	250,729	0.1
SL GREEN REALTY CORP	9,800	11,000	1,065	113,223	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	30,720	36,100	5,572	592,307	0.1
UDR INC	25,300	30,800	1,097	116,621	0.0
VENTAS INC	34,800	40,200	1,991	211,654	0.0
VEREIT INC	95,000	109,000	758	80,643	0.0
VORNADO REALTY TRUST	16,500	20,500	1,379	146,656	0.0
WELLTOWER INC	35,300	43,500	2,367	251,687	0.1
WEYERHAEUSER CO	72,200	88,200	3,087	328,148	0.1
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	509,000	509,000	150	15,961	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,680,150	1,985,410	76,854	8,169,607
	銘柄 数 < 比 率 >	40	41	—	<1.8%>
(カナダ)			千カナダドル		
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	13,600	13,600	286	23,584	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,900	16,900	399	32,944	0.0

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額	比 率	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		口	口	千カナダドル	千円	%
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		6,900	6,900	200	16,562	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	37,400	37,400	886	73,091	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.0%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND		92,000	114,000	731	109,247	0.0
HAMMERSON PLC		74,000	89,000	477	71,287	0.0
INTU PROPERTIES PLC		88,000	—	—	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC		77,500	—	—	—	—
SEGRO PLC		91,200	118,000	709	105,894	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		—	89,000	834	124,494	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	422,700	410,000	2,752	410,923	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	4	—	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
ICADE		3,700	3,700	291	38,228	0.0
KLEPIERRE		20,500	24,900	815	106,786	0.0
GECINA SA		4,000	5,600	790	103,471	0.0
FONCIERE DES REGIONS		3,100	4,000	358	46,958	0.0
UNIBAIL RODAMCO-NA		9,570	11,680	2,168	283,950	0.1
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	40,870	49,880	4,424	579,395	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		215,000	252,000	16,884	228,609	0.1
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		260,000	260,000	1,976	26,755	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	475,000	512,000	18,860	255,364	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.1%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST		249,900	310,000	644	52,344	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		239,000	282,000	741	60,207	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		192,000	299,972	548	44,563	0.0
SUNTEC REIT		243,000	300,000	567	46,029	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	923,900	1,191,972	2,502	203,145	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.0%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
MIRVAC GROUP		340,000	430,000	924	75,587	0.0
GPT GROUP		179,000	203,000	962	78,671	0.0
LENDLEASE GROUP		53,000	61,000	1,055	86,331	0.0
STOCKLAND TRUST GROUP		227,000	274,000	1,104	90,281	0.0
DEXUS		91,000	113,000	1,053	86,106	0.0
GOODMAN GROUP		174,000	214,000	1,804	147,496	0.0
SCENTRE GROUP		518,000	612,000	2,343	191,642	0.0
WESTFIELD CORP		191,000	234,000	1,993	163,003	0.0
VICINITY CENTRES		328,704	373,000	898	73,496	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	2,101,704	2,514,000	12,140	992,615	
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.2%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	5,681,724	6,700,662	—	10,684,143	
	銘 柄 数 < 比 率 >	68	68	—	<2.3%>	

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

* 比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期		末
			買建額	売建額	額
外国	株式先物取引	CAN60	百万円 328		百万円 —
		EUR050	1,241		—
		FT100	657		—
		SPI200	222		—
		SPEMINI	6,068		—
		SWISSMKT	296		—

*単位未満は切り捨て。

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

○投資信託財産の構成

(2018年4月2日現在)

項目	当期		末
	評価額	比率	
株式	千円 434,672,468	% 95.5	
投資信託受益証券	15,961	0.0	
投資証券	10,668,182	2.3	
コール・ローン等、その他	9,743,380	2.2	
投資信託財産総額	455,099,991	100.0	

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産（452,461,712千円）の投資信託財産総額（455,099,991千円）に対する比率は99.4%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル＝106.30円、1カナダドル＝82.46円、1英ポンド＝149.27円、1スイスフラン＝111.38円、1スウェーデンクローナ＝12.71円、1ノルウェークローネ＝13.54円、1デンマーククローネ＝17.57円、1ユーロ＝130.95円、1香港ドル＝13.54円、1シンガポールドル＝81.18円、1豪ドル＝81.76円、1ニュージーランドドル＝76.91円、1新シェケル＝30.43円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2018年4月2日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	457,256,523,637
コール・ローン等	7,358,421,996
株式(評価額)	434,672,468,713
投資信託受益証券(評価額)	15,961,476
投資証券(評価額)	10,668,182,276
未収入金	2,201,590,739
未収配当金	601,632,756
差入委託証拠金	1,738,265,681
(B) 負債	2,512,984,202
未払金	2,437,774,376
未払解約金	71,844,770
未払利息	4,356
その他未払費用	3,360,700
(C) 純資産総額(A-B)	454,743,539,435
元本	183,716,815,590
次期繰越損益金	271,026,723,845
(D) 受益権総口数	183,716,815,590口
1万円当たり基準価額(C/D)	24,752円

(注) 期首元本額は157,848,148,117円、期中追加設定元本額は49,564,279,714円、期中一部解約元本額は23,695,612,241円、1口当たり純資産額は2.4752円です。

○損益の状況（2017年4月1日～2018年4月2日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	8,852,206,372
受取配当金	8,815,882,981
受取利息	9,956,529
その他収益金	28,639,530
支払利息	△ 2,272,668
(B) 有価証券売買損益	16,526,454,707
売買益	53,419,330,649
売買損	△ 36,892,875,942
(C) 先物取引等取引損益	609,061,281
取引益	1,104,865,376
取引損	△ 495,804,095
(D) 保管費用等	△ 44,982,203
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	25,942,740,157
(F) 前期繰越損益金	206,504,332,201
(G) 追加信託差損益金	74,480,399,073
(H) 解約差損益金	△ 35,900,747,586
(I) 計(E+F+G+H)	271,026,723,845
次期繰越損益金(I)	271,026,723,845

* 損益の状況の中で(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。

* 損益の状況の中で(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。

* 損益の状況の中で(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。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け)	60,403,768,252
野村外国株インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	32,999,732,915
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	16,480,377,326
野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	7,336,473,597
野村世界6資産分散投信(分配コース)	6,764,091,334
マイバランス70(確定拠出年金向け)	6,393,383,900
のむらっぴ・ファンド(普通型)	6,120,073,528
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,714,523,059
野村世界6資産分散投信(成長コース)	4,505,795,387
のむらっぴ・ファンド(積極型)	4,440,763,495
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	3,688,400,811
野村インデックスファンド・外国株式	3,572,487,698
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,741,108,774
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,630,926,716
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	2,450,799,019
野村外国株(含む新興国)インデックス B コース(野村投資一任口座向け)	1,793,990,076
マイバランスDC50	1,653,268,237
マイ・ロード	1,508,044,775

ファンド名	当期末 元本額
	円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,391,884,417
マイバランスDC70	1,319,877,016
のむらっぴ・ファンド(保守型)	1,035,730,143
マイバランスDC30	917,433,468
野村外国株インデックス Bコース(野村SMA・EW向け)	870,877,154
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	847,762,993
野村外国株式インデックスファンド	544,047,701
ノムラFoFs用インデックスファンド・外国株式(適格機関投資家専用)	447,212,561
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	434,532,788
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	430,932,416
野村つみたて外国株投信	429,657,264
野村外国株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	406,260,726
野村DC運用戦略ファンド	380,742,340
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	334,803,381
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	305,837,359
ファンドラップ(ウェルス・スクエア)外国株式	296,500,306
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	227,904,805
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	208,794,545

ファンド名	当期末
	元本額
	円
バランスセレクト70	167,453,388
バランスセレクト50	163,700,590
のむらップ・ファンド（やや保守型）	160,286,079
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	153,098,374
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数（為替ヘッジなし）連動型上場投信	149,113,545
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	124,532,124
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	93,264,601
野村資産設計ファンド2040	73,981,479
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）	63,495,349
ネクストコア	62,177,227
バランスセレクト30	52,044,705
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	51,307,837
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	39,600,162
野村資産設計ファンド2030	38,709,082
野村資産設計ファンド2025	36,685,426
野村資産設計ファンド2035	29,161,830
野村資産設計ファンド2020	25,166,947
野村6資産均等バランス	24,434,244
野村資産設計ファンド2015	21,344,295
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	21,271,180
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	14,482,390
野村資産設計ファンド2050	14,270,581
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	13,331,256
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	12,704,484
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	11,607,280

ファンド名	当期末
	元本額
	円
インデックス・ブレンド（タイプV）	11,286,298
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	11,120,311
インデックス・ブレンド（タイプIII）	10,184,136
野村資産設計ファンド2045	9,688,465
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	4,959,357
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	3,863,569
インデックス・ブレンド（タイプII）	2,650,615
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	2,515,467
インデックス・ブレンド（タイプIV）	2,470,942
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	2,329,518
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	1,775,486
インデックス・ブレンド（タイプI）	1,636,844
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	1,502,693
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	1,038,609
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	1,034,444
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	1,012,765
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	585,268
野村資産設計ファンド（DC）2050	435,783
野村資産設計ファンド（DC）2040	174,321
野村資産設計ファンド（DC）2030	150,108
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	99,541
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	98,050
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	92,540
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	85,723

○お知らせ

該当事項はございません。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	信託期間は2016年2月3日から2026年3月9日までです。	
運用方針	FTSE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	FOFs用 外国債券 インデックス・ファンドP (適格機関投資家専用)	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。
	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。
組入制限	FOFs用 外国債券 インデックス・ファンドP (適格機関投資家専用)	外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	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。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 (1) 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。 (2) 分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

FOFs用 外国債券インデックス・ ファンドP(適格機関投資家専用)

運用報告書(全体版)

第11期(決算日 2018年3月7日)
第12期(決算日 2018年5月7日)
第13期(決算日 2018年7月9日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
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/>
スマートフォンサイト <http://s.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。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・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。

設定以来の運用実績

作成期	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	純資産総額
		(分配落)	税 込 分配金	期 中 騰落率		期 中 騰落率					
第1	設定日(2016年 2月 3日)	円 10,000	円 —	% —	10,000	% —	% —	% —	% —	% —	百万円 0.5
	第1期(2016年 7月 7日)	8,754	49	△12.0	8,759	△12.4	98.3	0.6	0.6	1,865	
第2	第2期(2016年 9月 7日)	8,857	30	1.5	8,989	2.6	98.4	0.6	0.6	1,967	
	第3期(2016年11月 7日)	8,772	27	△0.7	8,789	△2.2	98.2	0.7	0.7	1,951	
	第4期(2017年 1月10日)	9,315	30	6.5	9,466	7.7	97.9	0.8	0.8	1,867	
第3	第5期(2017年 3月 7日)	9,109	25	△1.9	9,258	△2.2	98.2	0.5	0.5	2,174	
	第6期(2017年 5月 8日)	9,234	24	1.6	9,412	1.7	97.9	0.9	0.9	2,701	
	第7期(2017年 7月 7日)	9,407	28	2.2	9,613	2.1	98.6	0.3	0.3	3,599	
第4	第8期(2017年 9月 7日)	9,408	28	0.3	9,632	0.2	98.3	0.6	0.6	5,332	
	第9期(2017年11月 7日)	9,618	28	2.5	9,926	3.0	98.3	0.6	0.6	7,194	
	第10期(2018年 1月 9日)	9,670	26	0.8	9,976	0.5	97.3	1.3	1.3	10,003	
第5	第11期(2018年 3月 7日)	9,059	25	△6.1	9,424	△5.5	98.1	0.7	0.7	11,921	
	第12期(2018年 5月 7日)	9,200	27	1.9	9,565	1.5	97.9	0.9	0.9	13,565	
	第13期(2018年 7月 9日)	9,255	27	0.9	9,643	0.8	98.3	0.5	0.5	17,290	

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 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、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。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。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当作成期中の基準価額と市況の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		債 券 組 入 率	債 券 先 物 率
			騰落率		騰落率		
第11期	(期 首)2018年1月9日	円 9,670	% —	9,976	% —	% 97.3	% 1.3
	1月末	9,407	△2.7	9,718	△2.6	96.9	1.5
	2月末	9,165	△5.2	9,491	△4.9	97.6	1.0
	(期 末)2018年3月7日	9,084	△6.1	9,424	△5.5	98.1	0.7
第12期	(期 首)2018年3月7日	9,059	—	9,424	—	98.1	0.7
	3月末	9,199	1.5	9,548	1.3	97.3	1.2
	4月末	9,311	2.8	9,653	2.4	98.2	0.7
	(期 末)2018年5月7日	9,227	1.9	9,565	1.5	97.9	0.9
第13期	(期 首)2018年5月7日	9,200	—	9,565	—	97.9	0.9
	5月末	9,049	△1.6	9,401	△1.7	97.7	1.1
	6月末	9,177	△0.3	9,528	△0.4	97.8	0.9
	(期 末)2018年7月9日	9,282	0.9	9,643	0.8	98.3	0.5

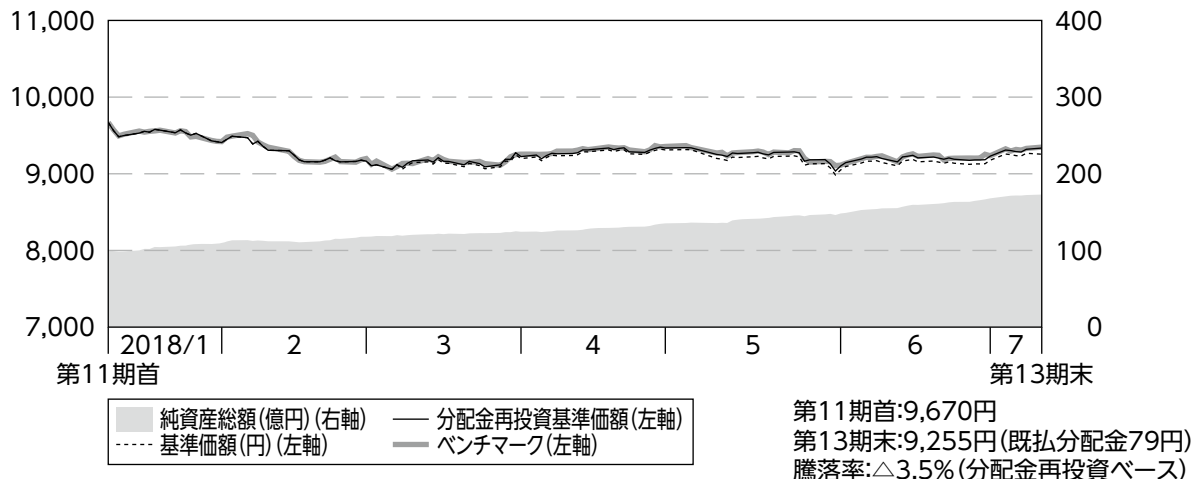
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当作成期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

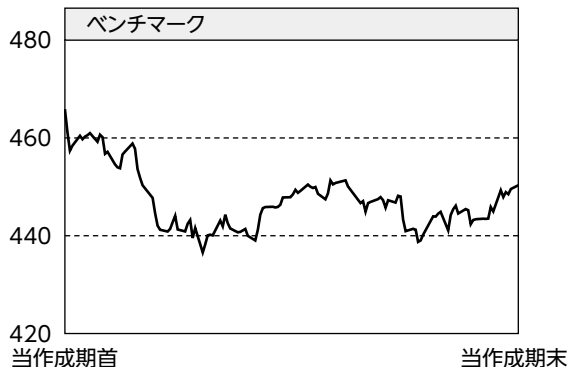


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2018年1月9日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

基準価額は、2018年3月上旬にかけて、米景気拡大やFRB(米連邦準備理事会)による先行きの利上げペース加速が意識されたことなどから長期金利が上昇(債券価格は下落)し、また株式の急落を背景にリスク回避姿勢が強まり外国為替市場で円高も進んだことから、下落しました。その後基準価額は4月下旬にかけて、米トランプ政権の政策に対する不透明感の高まりなどから4月上旬にかけて長期金利が低下(債券価格は上昇)したことや、4月中旬以降は長期金利が上昇したもののリスク選好姿勢の強まりにより円安が進んだことから、緩やかに上昇しました。5月には、原油価格の上昇による先行きのインフレ加速観測の高まりにより月中旬にかけて長期金利が上昇したことや、月下旬には長期金利が低下した一方で不透明な北朝鮮半島情勢やイタリア政局の混迷などを受けて円高となったことから、基準価額は下落しました。6月以降当作成期末にかけては、米国の堅調な経済指標などを受けて円安となったことから、基準価額は上昇しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、FRBによる先行きの利上げペース加速が意識されたことなどから2018年2月中旬にかけて上昇した後、米トランプ政権の外交・通商政策に対する不透明感の高まりを受けて、4月上旬にかけて低下しました。その後は、5月中旬にかけて米景気指標の改善などを背景に、長期金利は上昇した後、5月下旬以降は北朝鮮情勢を巡る警戒感の高まりなどを受けて、低下しました。

外国為替市場では、2018年3月下旬にかけて、主要先進国の株価急落や米中貿易摩擦激化への警戒感の高まりを背景に、円高となりました。その後は、リスク選好の動きが強まったことなどから、対米ドルを中心に円安となりました。

当ファンドのポートフォリオ

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動することを目的とする「外国債券インデックス マザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れ、運用しました。

【「外国債券インデックス マザーファンド」の運用経過】

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)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

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。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と為替予約取引を利用しました。

(2) ポートフォリオ構成

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ることでベンチマークとの連動を目指しました。

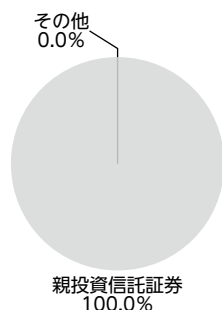
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

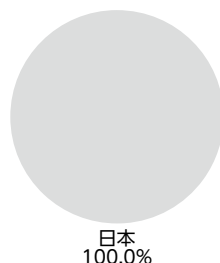
	当作成期末
	2018年7月9日
外国債券インデックス マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

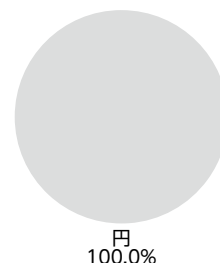
○資産別配分



○国別配分



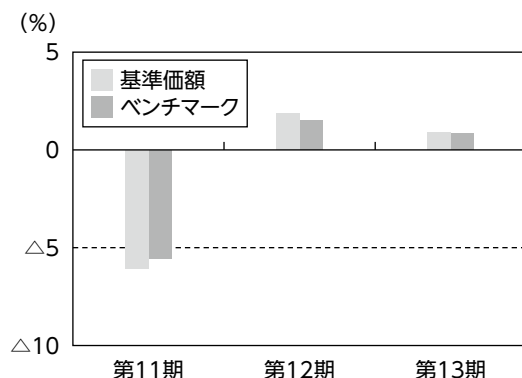
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、信託報酬および為替評価差要因*です。

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

分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・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11期	第12期	第13期
	2018年1月10日～ 2018年3月7日	2018年3月8日～ 2018年5月7日	2018年5月8日～ 2018年7月9日
当期分配金 (円)	25	27	27
(対基準価額比率) (%)	(0.275)	(0.293)	(0.291)
当期の収益 (円)	25	27	27
当期の収益以外 (円)	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	447	455	463

(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

外国債券インデックス マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当作成期		項目の概要
	(2018年1月10日～2018年7月9日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	6円	0.064%	(a) 信託報酬＝〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,218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)	(4)	(0.048)	
(販売会社)	(0)	(0.005)	
(受託会社)	(1)	(0.011)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(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)	(－)	(－)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(商品)	(－)	(－)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	－	－	(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)	(－)	(－)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(公社債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(d) その他費用	1	0.016	(d) その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(1)	(0.013)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	7	0.080	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 作 成 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券インデックス マザーファンド	千口 2, 823, 505	千円 7, 638, 675	千口 23, 015	千円 62, 682

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 作 成 期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D C
金 銭 信 託	百万円 40	百万円 40	% 100. 0	百万円 40	百万円 40	% 100. 0
コ ー ル ・ ロ ー ン	1, 132	209	18. 5	1, 154	215	18. 6

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<外国債券インデックス マザーファンド>

区 分	当 作 成 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 23, 297	百万円 32	% 0. 1	百万円 22, 100	百万円 476	% 2. 2
金 銭 信 託	13, 939	13, 939	100. 0	13, 939	13, 939	100. 0
コ ー ル ・ ロ ー ン	415, 251	85, 461	20. 6	417, 840	86, 245	20. 6

<平均保有割合 5. 6%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<親投資信託残高>

	前 作 成 期 末	当 作 成 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券インデックス マザーファンド	千口 3,547,649	千口 6,348,139	千円 17,282,175

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、93,070,796千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックス マザーファンド	千円 17,282,175	% 99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	62,667	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	17,344,842	100.0

(注1)外国債券インデックス マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産(251,531,917千円)の投資信託財産総額(253,540,866千円)に対する比率は99.2%です。

(注2)外貨建資産は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=110.49円

1ユーロ=129.87円

1スウェーデンクローナ=12.64円

1ポーランドズロチ=29.83円

1マレーシアリングット=27.37円

1カナダドル=84.37円

1イギリスポンド=146.84円

1ノルウェークローネ=13.74円

1オーストラリアドル=82.27円

1南アフリカランド=8.21円

1メキシコペソ=5.80円

1スイスフラン=111.71円

1デンマーククローネ=17.43円

1シンガポールドル=81.43円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	第 11 期 末 2018年3月7日現在	第 12 期 末 2018年5月7日現在	第 13 期 末 2018年7月9日現在
(A) 資 産	11,956,610,861円	13,608,203,700円	17,344,842,306円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	41,203,034	51,000,012	12,444,039
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	11,915,407,827	13,557,203,688	17,282,175,538
未 収 入 金	—	—	50,222,729
(B) 負 債	35,219,708	42,680,232	54,035,367
未 払 収 益 分 配 金	32,898,917	39,813,814	50,444,348
未 払 信 託 報 酬	2,227,889	2,751,534	3,447,266
未 払 利 息	91	140	31
そ の 他 未 払 費 用	92,811	114,744	143,722
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	11,921,391,153	13,565,523,468	17,290,806,939
元 本	13,159,566,889	14,745,857,294	18,683,092,063
次 期 繰 越 損 益 金	△1,238,175,736	△1,180,333,826	△1,392,285,124
(D) 受 益 権 総 口 数	13,159,566,889口	14,745,857,294口	18,683,092,063口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	9,059円	9,200円	9,255円

■損益の状況

項 目	第 11 期 自 2018年1月10日 至 2018年3月 7日	第 12 期 自 2018年3月8日 至 2018年5月7日	第 13 期 自 2018年5月8日 至 2018年7月9日
(A) 配 当 等 収 益	△788円	△1,626円	△1,350円
支 払 利 息	△788	△1,626	△1,350
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△682,778,496	218,632,327	172,082,938
売 買 損 益	104,501	219,039,966	173,845,762
買 入 損 益	△682,882,997	△407,639	△1,762,824
(C) 信 託 報 酬 等	△2,320,700	△2,866,284	△3,590,994
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△685,099,984	215,764,417	168,490,594
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	246,854,986	△471,061,869	△295,062,250
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△767,031,821	△885,222,560	△1,215,269,120
(配 当 等 相 当 額)	(334,823,021)	(407,082,740)	(587,097,155)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,101,854,842)	(△1,292,305,300)	(△1,802,366,275)
(G) 計 (D+E+F)	△1,205,276,819	△1,140,520,012	△1,341,840,776
(H) 収 益 分 配 金	△32,898,917	△39,813,814	△50,444,348
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△1,238,175,736	△1,180,333,826	△1,392,285,124
追 加 信 託 差 損 益 金	△767,031,821	△885,222,560	△1,215,269,120
(配 当 等 相 当 額)	(335,984,877)	(407,694,667)	(588,535,998)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,103,016,698)	(△1,292,917,227)	(△1,803,805,118)
分 配 準 備 積 立 金	253,464,972	264,044,624	276,629,101
繰 越 損 益 金	△724,608,887	△559,155,890	△453,645,105

(注1) (B) 有価証券売買損益は各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＞

※当ファンドの第11期首元本額は10,344,996,352円、第11～13期中追加設定元本額は8,369,038,346円、第11～13期中一部解約元本額は30,942,635円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 11 期	第 12 期	第 13 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	39,508,903円	50,437,606円	63,072,681円
(B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円	－円	－円
(C) 収益調整金額	335,984,877円	407,694,667円	588,535,998円
(D) 分配準備積立金額	246,854,986円	253,420,832円	264,000,768円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	622,348,766円	711,553,105円	915,609,447円
(F) 期末残存口数	13,159,566,889口	14,745,857,294口	18,683,092,063口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	472円	482円	490円
(H) 分配金額(1万口当たり)	25円	27円	27円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	32,898,917円	39,813,814円	50,444,348円

分配金のお知らせ

	第11期	第12期	第13期
1万口当たり分配金	25円	27円	27円

(注) 分配金は各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。

お知らせ

当ファンドの約款に記載されている指数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:2018年4月14日)

外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日 2018年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、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		ベンチマーク		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額
	円	騰 落 率	円	騰 落 率			
第14期(2014年5月29日)	25,092	6.2	414,505	6.0	97.2	1.3	222,288
第15期(2015年5月29日)	28,802	14.8	477,014	15.1	98.2	0.7	217,598
第16期(2016年5月30日)	26,579	△7.7	436,679	△8.5	97.9	0.9	212,962
第17期(2017年5月29日)	26,633	0.2	440,540	0.9	97.3	1.4	219,477
第18期(2018年5月29日)	26,619	△0.1	441,246	0.2	98.0	0.8	243,756

(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 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比
	円	騰 落 率	円	騰 落 率		
(当 期 首) 2017年 5月29日	26,633	—	440,540	—	97.3	1.4
5月末	26,567	△0.2	439,833	△0.2	97.0	1.5
6月末	27,060	1.6	450,151	2.2	97.3	1.2
7月末	27,053	1.6	450,098	2.2	98.0	0.7
8月末	27,438	3.0	453,506	2.9	97.1	1.3
9月末	27,744	4.2	459,050	4.2	97.9	1.0
10月末	27,746	4.2	459,216	4.2	97.6	1.1
11月末	27,768	4.3	458,970	4.2	97.6	1.1
12月末	28,107	5.5	464,615	5.5	97.9	1.1
2018年 1月末	27,420	3.0	453,806	3.0	97.0	1.5
2月末	26,716	0.3	443,211	0.6	97.7	1.0
3月末	26,892	1.0	445,875	1.2	97.4	1.2
4月末	27,223	2.2	450,787	2.3	98.2	0.7
(当 期 末) 2018年 5月29日	26,619	△0.1	441,246	0.2	98.0	0.8

(注1) 騰落率は期首比です。

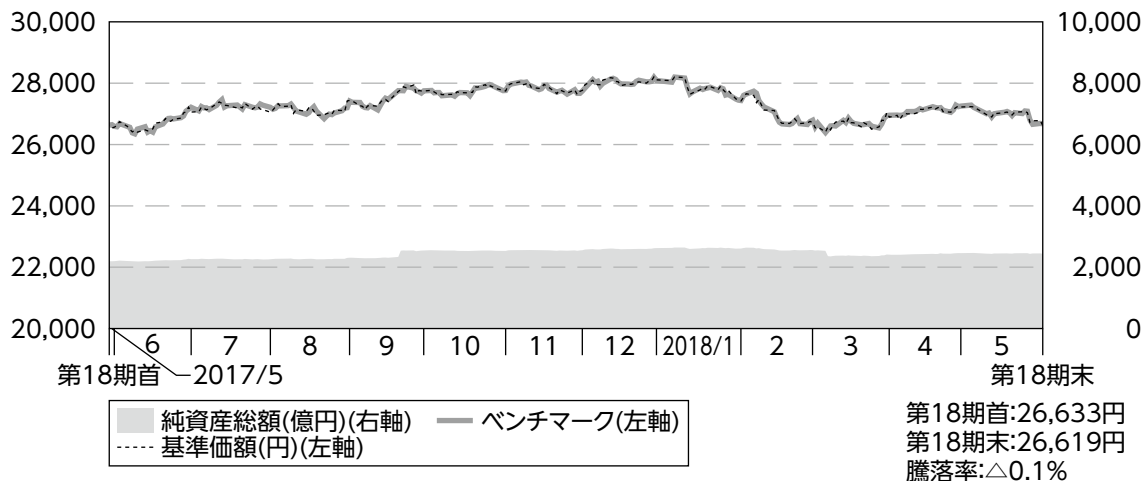
(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

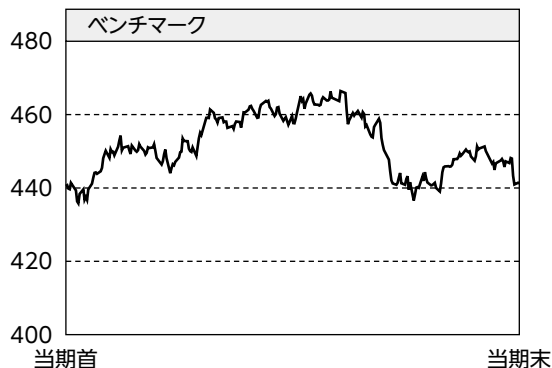


(注) ベンチマークは、2017年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

基準価額は、2017年12月下旬にかけて、ECB(欧州中央銀行)とBOE(英中央銀行)の金融緩和縮小観測や米国の利上げ継続を背景に主要国の金利が上昇(債券価格は下落)したものの、外国為替市場では対ユーロや対英ポンドを中心に円安が進行したことから、上昇しました。2018年1月以降3月上旬にかけては、ECBが早期に量的金融緩和を縮小するとの観測やFRB(米連邦準備理事会)による利上げペースの加速が意識されたことなどから長期金利が上昇し、また株式の急落を背景にリスク回避姿勢の強まりにより円高も進んだことから、基準価額は下落しました。その後4月下旬にかけて、朝鮮半島情勢への警戒感の後退によるリスク選好姿勢の強まりなどを受けて長期金利が上昇したものの、円安が進行したことから、基準価額は上昇しましたが、期末には米朝首脳会談の中止発表などを背景に長期金利が低下したものの、円高となったことが大きく影響し、下落しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2017年7月上旬以降9月中旬にかけて、地政学リスクの高まりなどから低下しました。その後は、ECBが早期に量的金融緩和を縮小するとの観測やFRBによる利上げペースの加速が意識されたことなどから上昇した後、期末には米朝首脳会談の中止発表などを受けて、低下しました。

外国為替市場では、2017年7月上旬にかけてECBの金融緩和縮小観測を背景に円安が進行した後、株式の下落からリスク回避姿勢が強まり、2018年3月末にかけて円高となりました。その後は、リスク選好姿勢の強まりから対米ドルを中心に円安となった後、期末には米朝首脳会談の中止発表から円高に転じました。

当ファンドのポートフォリオ

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

当ファンドの組入資産の内容

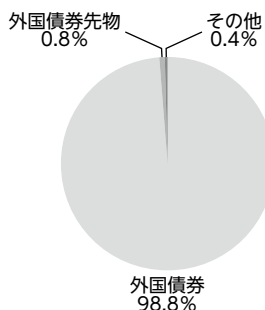
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 1.75% 05/15/23	アメリカ	0.7%
2	T 2.875% 05/15/43	アメリカ	0.7%
3	T 2.5% 02/15/46	アメリカ	0.7%
4	T 1.875% 10/31/22	アメリカ	0.6%
5	FRTR 3.5% 04/25/20	フランス	0.6%
6	T 1.875% 12/15/20	アメリカ	0.6%

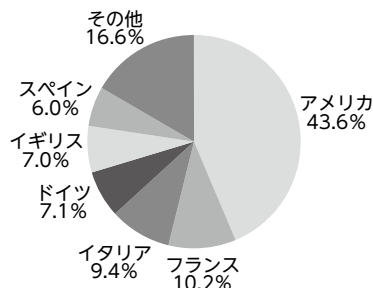
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 2.375% 08/15/24	アメリカ	0.5%
8	T 1.5% 08/15/26	アメリカ	0.5%
9	T 2% 08/15/25	アメリカ	0.5%
10	T 2.25% 08/15/27	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		679	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

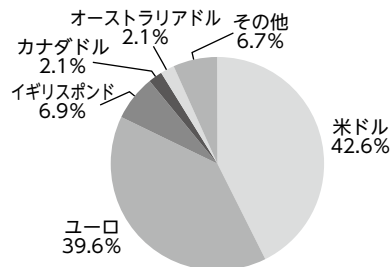
○資産別配分



○国別配分



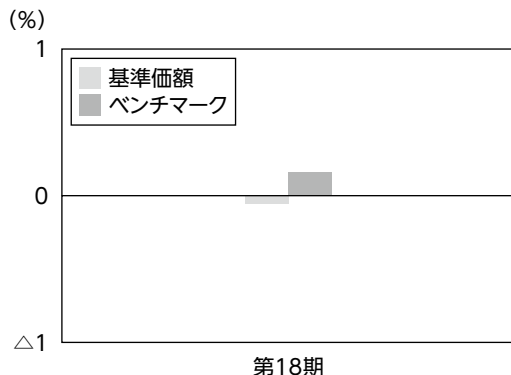
○通貨別配分



(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
 (注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して0.8%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差要因※(マイナス要因)です。

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2017年5月30日～2018年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (－) (－) (－) (－) (－) (－) (0)	0.001% (－) (－) (－) (－) (－) (－) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝ $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	－ (－) (－) (－) (－) (－) (－)	－ (－) (－) (－) (－) (－) (－)	(b) 有価証券取引税＝ $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	7 (7) (－) (0)	0.025 (0.025) (－) (0.000)	(c) その他費用＝ $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	7	0.026	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(27,311円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜公社債＞

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外 国	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 382,962	千米ドル 235,081
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 27,841	千カナダドル 18,393
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 114,598	千メキシコペソ 83,539
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 53,487	千ユーロ 41,937
	イ タ リ ア	国 債 証 券	59,741	40,839
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	60,107	36,800
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	11,970	8,732
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	39,072	22,563
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	12,706	7,866
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	9,445	5,362
	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	3,149	1,698
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	4,543	2,200
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 34,841	千イギリスポンド 24,842
	ス イ ス	国 債 証 券	千スイスフラン 359	千スイスフラン 195
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 23,261	千スウェーデンクローナ 21,997
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 14,839	千ノルウェークローネ 5,062
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 22,860	千デンマーククローネ 16,475
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 24,249	千ポーランドズロチ 21,139
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 18,908	千オーストラリアドル 9,622
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 4,290	千シンガポールドル 2,065
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 16,209	千マレーシアリンギット 7,306
	南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカランド 43,679	千南アフリカランド 9,078

(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 29,833	百万円 30,886	百万円 ー	百万円 ー

(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 53,945	百万円 18	% 0.0	百万円 27,079	百万円 559	% 2.1
金 銭 信 託	7,043	7,043	100.0	7,043	7,043	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	846,376	205,900	24.3	844,385	205,434	24.3

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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							
	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 978,670	千米ドル 956,727	千円 104,522,461	% 42.9	% —	% 17.3	% 17.5	% 8.2
カ ナ ダ	千カナダドル 58,680	千カナダドル 61,332	5,166,062	2.1	—	0.9	0.6	0.6
メ キ シ コ	千メキシコペソ 337,850	千メキシコペソ 341,747	1,906,951	0.8	—	0.5	0.2	0.1
ド イ ツ	千ユーロ 113,190	千ユーロ 133,029	16,892,024	6.9	—	3.9	2.2	0.7
イ タ リ ア	163,910	176,568	22,420,653	9.2	—	5.2	2.9	1.1
フ ラ ン ス	166,270	192,592	24,455,391	10.0	—	6.2	2.7	1.2
オ ラ ン ダ	35,130	40,921	5,196,184	2.1	—	1.4	0.6	0.2
ス ペ イ ン	97,620	112,250	14,253,529	5.8	—	3.8	1.3	0.8
ベ ル ギ ー	40,330	47,558	6,038,959	2.5	—	1.9	0.5	0.1
オーストリア	25,730	29,625	3,761,892	1.5	—	1.0	0.4	0.1
フィンランド	10,910	11,957	1,518,308	0.6	—	0.4	0.2	0.1
アイルランド	14,460	16,091	2,043,291	0.8	—	0.5	0.2	0.2
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 94,130	千イギリスポンド 115,572	16,806,548	6.9	—	5.1	1.3	0.5
ス イ ス	千スイスフラン 3,130	千スイスフラン 3,637	400,076	0.2	—	0.0	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 66,620	千スウェーデンクローナ 75,887	938,724	0.4	—	0.2	0.2	—
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 52,260	千ノルウェークローネ 54,344	724,405	0.3	—	0.1	0.1	0.1
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 68,280	千デンマーククローネ 84,834	1,446,425	0.6	—	0.4	0.1	0.1
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 49,850	千ポーランドズロチ 51,002	1,505,601	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 59,280	千オーストラリアドル 62,618	5,163,506	2.1	—	1.3	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 11,950	千シンガポールドル 12,127	986,841	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 43,780	千マレーシアリンギット 43,079	1,181,663	0.5	—	0.3	0.1	0.1
南 ア フ リ カ	千南アフリカランド 186,330	千南アフリカランド 177,046	1,552,694	0.6	—	0.6	0.1	0.0
合 計	—	—	238,882,199	98.0	—	51.2	32.3	14.5

(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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(B) 個別銘柄開示

当		期		末		
銘柄	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)	
(アメリカ)			千米ドル	千米ドル		
国債証券						
T 0.875% 07/31/19	0.875	5,500	5,407	590,779	2019/7/31	
T 1% 06/30/19	1.0	9,000	8,872	969,352	2019/6/30	
T 1% 08/31/19	1.0	7,500	7,373	805,577	2019/8/31	
T 1% 09/30/19	1.0	4,000	3,927	429,127	2019/9/30	
T 1% 11/30/19	1.0	6,300	6,169	674,005	2019/11/30	
T 1.125% 02/28/21	1.125	6,500	6,247	682,508	2021/2/28	
T 1.125% 04/30/20	1.125	4,000	3,899	425,984	2020/4/30	
T 1.125% 06/30/21	1.125	9,800	9,363	1,022,971	2021/6/30	
T 1.125% 07/31/21	1.125	5,000	4,769	521,061	2021/7/31	
T 1.125% 12/31/19	1.125	7,050	6,908	754,758	2019/12/31	
T 1.25% 01/31/20	1.25	9,620	9,434	1,030,715	2020/1/31	
T 1.25% 02/29/20	1.25	3,400	3,330	363,827	2020/2/29	
T 1.25% 03/31/21	1.25	3,500	3,370	368,261	2021/3/31	
T 1.25% 06/30/19	1.25	11,500	11,369	1,242,115	2019/6/30	
T 1.25% 07/31/23	1.25	4,550	4,215	460,495	2023/7/31	
T 1.25% 10/31/19	1.25	5,500	5,412	591,332	2019/10/31	
T 1.25% 10/31/21	1.25	10,000	9,538	1,042,030	2021/10/31	
T 1.375% 01/15/20	1.375	5,000	4,916	537,105	2020/1/15	
T 1.375% 01/31/20	1.375	5,000	4,914	536,865	2020/1/31	
T 1.375% 01/31/21	1.375	4,800	4,650	508,080	2021/1/31	
T 1.375% 02/29/20	1.375	5,000	4,907	536,162	2020/2/29	
T 1.375% 03/31/20	1.375	8,280	8,120	887,162	2020/3/31	
T 1.375% 04/30/20	1.375	1,000	979	107,006	2020/4/30	
T 1.375% 04/30/21	1.375	9,500	9,170	1,001,896	2021/4/30	
T 1.375% 05/31/20	1.375	1,550	1,516	165,665	2020/5/31	
T 1.375% 05/31/21	1.375	7,700	7,422	810,949	2021/5/31	
T 1.375% 06/30/23	1.375	5,000	4,668	510,043	2023/6/30	
T 1.375% 08/31/23	1.375	2,500	2,327	254,284	2023/8/31	
T 1.375% 09/30/20	1.375	4,000	3,894	425,525	2020/9/30	
T 1.375% 09/30/23	1.375	8,000	7,438	812,673	2023/9/30	
T 1.375% 10/31/20	1.375	6,000	5,834	637,449	2020/10/31	
T 1.375% 12/15/19	1.375	7,650	7,529	822,629	2019/12/15	
T 1.5% 01/31/22	1.5	4,500	4,313	471,196	2022/1/31	
T 1.5% 02/28/23	1.5	7,800	7,365	804,713	2023/2/28	
T 1.5% 03/31/23	1.5	4,000	3,772	412,147	2023/3/31	
T 1.5% 04/15/20	1.5	5,750	5,648	617,074	2020/4/15	
T 1.5% 05/31/19	1.5	3,250	3,224	352,298	2019/5/31	
T 1.5% 07/15/20	1.5	7,200	7,050	770,305	2020/7/15	
T 1.5% 08/15/20	1.5	10,000	9,782	1,068,750	2020/8/15	
T 1.5% 08/15/26	1.5	13,200	11,828	1,292,273	2026/8/15	
T 1.5% 10/31/19	1.5	7,000	6,912	755,226	2019/10/31	
T 1.5% 11/30/19	1.5	5,000	4,932	538,896	2019/11/30	
T 1.625% 02/15/26	1.625	8,100	7,380	806,290	2026/2/15	
T 1.625% 03/15/20	1.625	4,500	4,434	484,489	2020/3/15	
T 1.625% 04/30/19	1.625	5,000	4,971	543,096	2019/4/30	
T 1.625% 05/15/26	1.625	8,270	7,510	820,565	2026/5/15	
T 1.625% 05/31/23	1.625	5,000	4,733	517,107	2023/5/31	
T 1.625% 06/30/19	1.625	10,000	9,925	1,084,401	2019/6/30	
T 1.625% 06/30/20	1.625	3,000	2,947	321,974	2020/6/30	
T 1.625% 07/31/20	1.625	5,000	4,906	536,035	2020/7/31	
T 1.625% 08/15/22	1.625	2,500	2,390	261,190	2022/8/15	
T 1.625% 08/31/19	1.625	7,500	7,431	811,919	2019/8/31	
T 1.625% 10/31/23	1.625	9,000	8,472	925,647	2023/10/31	
T 1.625% 11/15/22	1.625	7,150	6,817	744,766	2022/11/15	
T 1.625% 11/30/20	1.625	3,050	2,980	325,636	2020/11/30	
T 1.75% 01/31/23	1.75	7,550	7,220	788,869	2023/1/31	
T 1.75% 02/28/22	1.75	2,500	2,415	263,886	2022/2/28	
T 1.75% 03/31/22	1.75	9,550	9,218	1,007,103	2022/3/31	
T 1.75% 04/30/22	1.75	11,200	10,800	1,179,967	2022/4/30	

銘柄	利 率 (%)	期		末	
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
T 1.75% 05/15/22	1.75	3,800	3,663	400,209	2022/5/15
T 1.75% 05/15/23	1.75	17,500	16,677	1,822,039	2023/5/15
T 1.75% 05/31/22	1.75	9,550	9,202	1,005,352	2022/5/31
T 1.75% 06/30/22	1.75	7,000	6,740	736,348	2022/6/30
T 1.75% 09/30/19	1.75	5,000	4,958	541,757	2019/9/30
T 1.75% 09/30/22	1.75	10,150	9,743	1,064,484	2022/9/30
T 1.75% 10/31/20	1.75	4,000	3,924	428,747	2020/10/31
T 1.75% 12/31/20	1.75	8,200	8,031	877,443	2020/12/31
T 1.875% 02/28/22	1.875	2,500	2,426	265,133	2022/2/28
T 1.875% 06/30/20	1.875	3,750	3,702	404,523	2020/6/30
T 1.875% 07/31/22	1.875	9,000	8,700	950,507	2022/7/31
T 1.875% 08/31/22	1.875	4,000	3,862	422,029	2022/8/31
T 1.875% 10/31/22	1.875	14,650	14,126	1,543,364	2022/10/31
T 1.875% 11/30/21	1.875	5,400	5,255	574,208	2021/11/30
T 1.875% 12/15/20	1.875	12,500	12,289	1,342,597	2020/12/15
T 2% 02/15/22	2.0	2,500	2,439	266,476	2022/2/15
T 2% 02/15/23	2.0	2,600	2,514	274,667	2023/2/15
T 2% 02/15/25	2.0	8,400	7,951	868,664	2025/2/15
T 2% 02/28/21	2.0	4,000	3,937	430,145	2021/2/28
T 2% 05/31/21	2.0	3,800	3,731	407,644	2021/5/31
T 2% 06/30/24	2.0	10,500	10,004	1,093,022	2024/6/30
T 2% 07/31/20	2.0	5,200	5,144	561,985	2020/7/31
T 2% 07/31/22	2.0	3,000	2,914	318,390	2022/7/31
T 2% 08/15/25	2.0	12,300	11,586	1,265,788	2025/8/15
T 2% 08/31/21	2.0	6,800	6,660	727,675	2021/8/31
T 2% 09/30/20	2.0	5,000	4,938	539,571	2020/9/30
T 2% 10/31/21	2.0	5,650	5,525	603,704	2021/10/31
T 2% 11/15/21	2.0	2,400	2,346	256,404	2021/11/15
T 2% 11/15/26	2.0	3,350	3,115	340,394	2026/11/15
T 2% 11/30/20	2.0	5,500	5,424	592,647	2020/11/30
T 2% 11/30/22	2.0	2,000	1,937	211,717	2022/11/30
T 2% 12/31/21	2.0	2,200	2,148	234,711	2021/12/31
T 2.125% 01/31/21	2.125	3,000	2,964	323,832	2021/1/31
T 2.125% 03/31/24	2.125	7,400	7,119	777,806	2024/3/31
T 2.125% 05/15/25	2.125	8,700	8,283	904,937	2025/5/15
T 2.125% 06/30/21	2.125	7,500	7,387	807,063	2021/6/30
T 2.125% 06/30/22	2.125	2,100	2,051	224,167	2022/6/30
T 2.125% 07/31/24	2.125	4,800	4,603	502,945	2024/7/31
T 2.125% 08/15/21	2.125	6,100	6,000	655,604	2021/8/15
T 2.125% 08/31/20	2.125	6,500	6,442	703,866	2020/8/31
T 2.125% 09/30/21	2.125	2,000	1,965	214,733	2021/9/30
T 2.125% 11/30/23	2.125	2,000	1,930	210,959	2023/11/30
T 2.125% 12/31/21	2.125	4,500	4,413	482,195	2021/12/31
T 2.25% 02/15/27	2.25	8,950	8,476	926,043	2027/2/15
T 2.25% 03/31/21	2.25	3,050	3,020	330,014	2021/3/31
T 2.25% 04/30/21	2.25	3,500	3,464	378,493	2021/4/30
T 2.25% 07/31/21	2.25	3,000	2,963	323,797	2021/7/31
T 2.25% 08/15/27	2.25	12,150	11,472	1,253,332	2027/8/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	11,900	10,020	1,094,763	2046/8/15
T 2.25% 10/31/24	2.25	6,300	6,073	663,561	2024/10/31
T 2.25% 11/15/24	2.25	10,150	9,781	1,068,681	2024/11/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	2,900	2,773	302,982	2025/11/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	6,700	6,318	690,271	2027/11/15
T 2.25% 12/31/23	2.25	2,000	1,942	212,180	2023/12/31
T 2.25% 12/31/24	2.25	8,400	8,088	883,714	2024/12/31
T 2.375% 05/15/27	2.375	11,950	11,422	1,247,891	2027/5/15
T 2.375% 08/15/24	2.375	12,500	12,161	1,328,644	2024/8/15
T 2.375% 12/31/20	2.375	2,300	2,288	250,025	2020/12/31
T 2.5% 01/31/25	2.5	5,000	4,888	534,031	2025/1/31
T 2.5% 02/15/45	2.5	6,300	5,627	614,827	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	16,500	14,690	1,604,899	2046/2/15

銘柄	利 率 (%)	期 額面金額	末 評 価 額			償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	債還年月日	
T 2.5% 03/31/23	2.5	4,050	4,002	437,273	2023/3/31	
T 2.5% 05/15/24	2.5	2,900	2,846	310,963	2024/5/15	
T 2.5% 05/15/46	2.5	2,550	2,268	247,821	2046/5/15	
T 2.5% 08/15/23	2.5	4,550	4,487	490,240	2023/8/15	
T 2.625% 02/28/23	2.625	1,400	1,392	152,097	2023/2/28	
T 2.625% 03/31/25	2.625	3,000	2,952	322,557	2025/3/31	
T 2.625% 08/15/20	2.625	5,500	5,512	602,251	2020/8/15	
T 2.625% 11/15/20	2.625	11,000	11,017	1,203,674	2020/11/15	
T 2.75% 02/15/24	2.75	3,000	2,989	326,600	2024/2/15	
T 2.75% 02/15/28	2.75	3,600	3,542	386,985	2028/2/15	
T 2.75% 08/15/42	2.75	3,000	2,834	309,640	2042/8/15	
T 2.75% 08/15/47	2.75	8,250	7,704	841,755	2047/8/15	
T 2.75% 11/15/23	2.75	6,900	6,883	752,074	2023/11/15	
T 2.75% 11/15/42	2.75	4,200	3,964	433,174	2042/11/15	
T 2.75% 11/15/47	2.75	750	700	76,499	2047/11/15	
T 2.875% 05/15/43	2.875	17,150	16,537	1,806,678	2043/5/15	
T 2.875% 08/15/45	2.875	10,900	10,472	1,144,094	2045/8/15	
T 3% 05/15/42	3.0	1,950	1,927	210,533	2042/5/15	
T 3% 05/15/45	3.0	3,500	3,445	376,402	2045/5/15	
T 3% 05/15/47	3.0	6,700	6,581	719,039	2047/5/15	
T 3% 11/15/44	3.0	2,300	2,264	247,387	2044/11/15	
T 3.125% 02/15/42	3.125	2,350	2,371	259,133	2042/2/15	
T 3.125% 02/15/43	3.125	5,000	5,040	550,646	2043/2/15	
T 3.125% 05/15/19	3.125	5,000	5,039	550,600	2019/5/15	
T 3.125% 05/15/21	3.125	5,300	5,375	587,302	2021/5/15	
T 3.125% 08/15/44	3.125	6,000	6,042	660,144	2044/8/15	
T 3.125% 11/15/41	3.125	2,400	2,423	264,770	2041/11/15	
T 3.375% 05/15/44	3.375	5,610	5,900	644,672	2044/5/15	
T 3.375% 11/15/19	3.375	8,750	8,870	969,117	2019/11/15	
T 3.5% 02/15/39	3.5	3,000	3,219	351,732	2039/2/15	
T 3.625% 02/15/20	3.625	7,000	7,137	779,782	2020/2/15	
T 3.625% 02/15/21	3.625	11,100	11,401	1,245,566	2021/2/15	
T 3.625% 02/15/44	3.625	5,000	5,478	598,564	2044/2/15	
T 3.625% 08/15/19	3.625	2,700	2,741	299,480	2019/8/15	
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,000	2,189	239,187	2043/8/15	
T 3.75% 11/15/43	3.75	2,300	2,568	280,660	2043/11/15	
T 3.875% 08/15/40	3.875	3,150	3,567	389,710	2040/8/15	
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	1,069	116,895	2039/5/15	
T 4.25% 11/15/40	4.25	1,150	1,372	149,965	2040/11/15	
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	1,202	131,334	2038/2/15	
T 4.375% 05/15/40	4.375	1,900	2,302	251,582	2040/5/15	
T 4.375% 05/15/41	4.375	4,150	5,046	551,374	2041/5/15	
T 4.375% 11/15/39	4.375	2,700	3,268	357,076	2039/11/15	
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,840	2,222	242,774	2036/2/15	
T 4.5% 05/15/38	4.5	1,000	1,222	133,575	2038/5/15	
T 4.5% 08/15/39	4.5	250	307	33,564	2039/8/15	
T 4.625% 02/15/40	4.625	3,900	4,879	533,040	2040/2/15	
T 5.0% 05/15/37	5.0	1,100	1,417	154,885	2037/5/15	
T 5.25% 02/15/29	5.25	1,250	1,513	165,377	2029/2/15	
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,568	171,413	2028/11/15	
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,600	2,008	219,392	2031/2/15	
T 5.5% 08/15/28	5.5	1,200	1,469	160,538	2028/8/15	
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	2,064	225,558	2026/2/15	
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,450	1,831	200,060	2027/11/15	
T 6.25% 05/15/30	6.25	400	532	58,148	2030/5/15	
T 6.25% 08/15/23	6.25	1,650	1,927	210,613	2023/8/15	
T 8.0% 11/15/21	8.0	1,700	1,998	218,356	2021/11/15	
T 8.125% 08/15/19	8.125	2,100	2,244	245,245	2019/8/15	
小 計				104,522,461		
(カナダ)		千カナダドル	千カナダドル			
国債証券						
CAN 0.5% 03/01/22	0.5	3,100	2,921	246,117	2022/3/1	
CAN 0.75% 03/01/21	0.75	2,850	2,752	231,863	2021/3/1	

銘柄	利 率 (%)	期 額面金額	末 評 価 額			償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	債還年月日	
CAN 0.75% 08/01/19	0.75	2,770	2,738	230,647	2019/8/1	
CAN 0.75% 09/01/20	0.75	2,470	2,404	202,489	2020/9/1	
CAN 0.75% 09/01/21	0.75	1,630	1,562	131,632	2021/9/1	
CAN 1% 06/01/27	1.0	1,890	1,693	142,606	2027/6/1	
CAN 1% 09/01/22	1.0	1,500	1,431	120,608	2022/9/1	
CAN 1.25% 02/01/20	1.25	2,500	2,473	208,361	2020/2/1	
CAN 1.5% 03/01/20	1.5	6,100	6,056	510,167	2020/3/1	
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	2,400	2,324	195,794	2023/6/1	
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	2,300	2,172	182,965	2026/6/1	
CAN 1.75% 03/01/23	1.75	1,050	1,031	86,853	2023/3/1	
CAN 1.75% 09/01/19	1.75	2,600	2,599	218,916	2019/9/1	
CAN 2% 06/01/28	2.0	1,000	973	82,004	2028/6/1	
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,550	1,550	130,640	2025/6/1	
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	2,000	2,031	171,135	2024/6/1	
CAN 2.75% 06/01/22	2.75	2,550	2,613	220,104	2022/6/1	
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,550	1,689	142,275	2048/12/1	
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	620	699	58,884	2064/12/1	
CAN 3.25% 06/01/21	3.25	1,590	1,645	138,561	2021/6/1	
CAN 3.5% 06/01/20	3.5	1,800	1,854	156,226	2020/6/1	
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	2,500	3,077	259,246	2045/12/1	
CAN 3.75% 06/01/19	3.75	3,200	3,265	275,039	2019/6/1	
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	2,000	2,577	217,084	2041/6/1	
CAN 5% 06/01/37	5.0	1,600	2,245	189,101	2037/6/1	
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,600	2,131	179,552	2029/6/1	
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	1,600	2,289	192,807	2033/6/1	
CAN 8.0% 06/01/27	8.0	360	526	44,371	2027/6/1	
小 計				5,166,062		
(メキシコ)		千メキシコペソ	千メキシコペソ			
国債証券						
MBONO 10% 11/20/36	10.0	17,350	21,022	117,308	2036/11/20	
MBONO 10% 12/05/24	10.0	40,000	44,880	250,434	2024/12/5	
MBONO 5% 12/11/19	5.0	44,050	42,490	237,096	2019/12/11	
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	21,750	19,334	107,883	2026/3/5	
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	46,700	44,941	250,773	2022/6/9	
MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	25,300	24,581	137,167	2021/6/10	
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	22,150	21,930	122,373	2027/6/3	
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	17,100	17,148	95,691	2031/5/29	
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	24,450	24,145	134,733	2042/11/13	
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	5,950	5,931	33,095	2034/11/23	
MBONO 8% 06/11/20	8.0	30,750	31,059	173,314	2020/6/11	
MBONO 8% 11/07/47	8.0	7,650	7,768	43,350	2047/11/7	
MBONO 8% 12/07/23	8.0	6,400	6,508	36,316	2023/12/7	
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	15,600	16,520	92,183	2029/5/31	
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	12,650	13,481	75,229	2038/11/18	
小 計				1,906,951		
(ドイツ)		千ユーロ	千ユーロ			
国債証券						
BKO 0% 12/13/19	—	800	809	102,733	2019/12/13	
DBR 0% 08/15/26	—	2,100	2,073	263,244	2026/8/15	
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	4,450	4,464	566,931	2027/2/15	
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	3,200	3,313	420,736	2025/2/15	
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,400	3,506	445,314	2026/2/15	
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	2,050	2,081	264,263	2028/2/15	
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	3,050	3,112	395,203	2027/8/15	
DBR 1% 08/15/24	1.0	3,000	3,205	406,994	2024/8/15	
DBR 1% 08/15/25	1.0	3,050	3,264	414,484	2025/8/15	
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	800	840	106,725	2048/8/15	
DBR 1.5% 02/15/23	1.5	2,550	2,774	352,307	2023/2/15	
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	2,050	2,234	283,714	2023/5/15	
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	1,690	1,855	235,563	2024/5/15	
DBR 1.5% 09/04/22	1.5	1,450	1,569	199,283	2022/9/4	
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,350	1,498	190,326	2024/2/15	
DBR 1.75% 07/04/22	1.75	4,000	4,362	553,980	2022/7/4	

当		期		末		
銘	柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
DBR 2%	01/04/22	2.0	3,300	3,600	457,170	2022/1/4
DBR 2%	08/15/23	2.0	2,100	2,347	298,130	2023/8/15
DBR 2.25%	09/04/20	2.25	2,500	2,668	338,792	2020/9/4
DBR 2.25%	09/04/21	2.25	2,000	2,184	277,439	2021/9/4
DBR 2.5%	01/04/21	2.5	4,250	4,602	584,400	2021/1/4
DBR 2.5%	07/04/44	2.5	3,200	4,320	548,634	2044/7/4
DBR 2.5%	08/15/46	2.5	3,110	4,249	539,556	2046/8/15
DBR 3%	07/04/20	3.0	3,500	3,773	479,135	2020/7/4
DBR 3.25%	01/04/20	3.25	2,450	2,608	331,246	2020/1/4
DBR 3.25%	07/04/21	3.25	3,400	3,808	483,591	2021/7/4
DBR 3.25%	07/04/42	3.25	1,900	2,857	362,812	2042/7/4
DBR 3.5%	07/04/19	3.5	5,800	6,070	770,859	2019/7/4
DBR 4.0%	01/04/37	4.0	3,050	4,748	602,979	2037/1/4
DBR 4.25%	07/04/39	4.25	1,850	3,067	389,492	2039/7/4
DBR 4.75%	07/04/28	4.75	940	1,354	171,985	2028/7/4
DBR 4.75%	07/04/34	4.75	2,600	4,210	534,654	2034/7/4
DBR 4.75%	07/04/40	4.75	2,100	3,742	475,229	2040/7/4
DBR 5.5%	01/04/31	5.5	2,300	3,703	470,259	2031/1/4
DBR 5.625%	01/04/28	5.625	2,000	3,015	382,931	2028/1/4
DBR 6.25%	01/04/24	6.25	2,600	3,544	450,082	2024/1/4
DBR 6.25%	01/04/30	6.25	1,650	2,740	347,933	2030/1/4
DBR 6.5%	07/04/27	6.5	1,700	2,664	338,331	2027/7/4
OBL 0%	04/17/20	—	2,300	2,330	295,973	2020/4/17
OBL 0%	10/07/22	—	3,600	3,660	464,805	2022/10/7
OBL 0%	10/08/21	—	3,050	3,105	394,353	2021/10/8
OBL 0.25%	10/11/19	0.25	2,350	2,381	302,385	2019/10/11
OBL 0.25%	10/16/20	0.25	4,600	4,701	597,048	2020/10/16
(イタリヤ)						
国債証券						
BTPS 0.05%	04/15/21	0.05	1,550	1,500	190,593	2021/4/15
BTPS 0.35%	06/15/20	0.35	4,350	4,305	546,670	2020/6/15
BTPS 0.35%	11/01/21	0.35	3,800	3,681	467,507	2021/11/1
BTPS 0.45%	06/01/21	0.45	1,400	1,369	173,935	2021/6/1
BTPS 0.65%	10/15/23	0.65	1,300	1,224	155,431	2023/10/15
BTPS 0.65%	11/01/20	0.65	900	892	113,292	2020/11/1
BTPS 0.7%	05/01/20	0.7	2,000	1,994	253,223	2020/5/1
BTPS 0.9%	08/01/22	0.9	2,100	2,042	259,395	2022/8/1
BTPS 0.95%	03/01/23	0.95	1,300	1,254	159,298	2023/3/1
BTPS 0.95%	03/15/23	0.95	2,000	1,930	245,156	2023/3/15
BTPS 1.05%	12/01/19	1.05	4,350	4,370	554,978	2019/12/1
BTPS 1.25%	12/01/26	1.25	2,600	2,368	300,786	2026/12/1
BTPS 1.35%	04/15/22	1.35	1,550	1,540	195,638	2022/4/15
BTPS 1.45%	05/15/25	1.45	700	665	84,567	2025/5/15
BTPS 1.45%	09/15/22	1.45	1,050	1,042	132,349	2022/9/15
BTPS 1.5%	06/01/25	1.5	3,200	3,056	388,170	2025/6/1
BTPS 1.5%	08/01/19	1.5	2,400	2,425	307,970	2019/8/1
BTPS 1.6%	06/01/26	1.6	1,600	1,510	191,865	2026/6/1
BTPS 1.65%	03/01/32	1.65	3,100	2,677	339,965	2032/3/1
BTPS 1.85%	05/15/24	1.85	2,000	1,981	251,614	2024/5/15
BTPS 2%	02/01/28	2.0	1,650	1,558	197,909	2028/2/1
BTPS 2%	12/01/25	2.0	1,300	1,274	161,883	2025/12/1
BTPS 2.05%	08/01/27	2.05	3,200	3,058	388,361	2027/8/1
BTPS 2.15%	12/15/21	2.15	2,500	2,568	326,106	2021/12/15
BTPS 2.2%	06/01/27	2.2	1,800	1,749	222,107	2027/6/1
BTPS 2.25%	09/01/36	2.25	2,100	1,858	235,934	2036/9/1
BTPS 2.45%	09/01/33	2.45	1,300	1,213	154,140	2033/9/1
BTPS 2.5%	05/01/19	2.5	2,500	2,546	323,400	2019/5/1
BTPS 2.5%	12/01/24	2.5	4,200	4,304	546,534	2024/12/1
BTPS 2.7%	03/01/47	2.7	2,600	2,321	294,837	2047/3/1
BTPS 2.8%	03/01/67	2.8	800	683	86,851	2067/3/1
BTPS 2.95%	09/01/38	2.95	1,450	1,388	176,347	2038/9/1
BTPS 3.25%	09/01/46	3.25	1,550	1,536	195,076	2046/9/1
BTPS 3.45%	03/01/48	3.45	1,450	1,462	185,737	2048/3/1

当		期		末		
銘	柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 額	償還年月日	
				外貨建金額		邦貨換算金額 (千円)
BTPS 3.5%	03/01/30	3.5	3,210	3,406	432,551	2030/3/1
BTPS 3.75%	03/01/21	3.75	3,700	3,962	503,188	2021/3/1
BTPS 3.75%	05/01/21	3.75	2,500	2,684	340,857	2021/5/1
BTPS 3.75%	08/01/21	3.75	4,000	4,308	547,146	2021/8/1
BTPS 3.75%	09/01/24	3.75	2,150	2,362	299,985	2024/9/1
BTPS 4%	02/01/37	4.0	3,500	3,913	496,892	2037/2/1
BTPS 4%	09/01/20	4.0	2,300	2,455	311,849	2020/9/1
BTPS 4.25%	03/01/20	4.25	4,500	4,769	605,577	2020/3/1
BTPS 4.25%	09/01/19	4.25	2,650	2,769	351,610	2019/9/1
BTPS 4.5%	02/01/20	4.5	1,650	1,751	222,411	2020/2/1
BTPS 4.5%	03/01/24	4.5	3,650	4,147	526,660	2024/3/1
BTPS 4.5%	03/01/26	4.5	4,250	4,896	621,802	2026/3/1
BTPS 4.5%	05/01/23	4.5	3,900	4,402	559,023	2023/5/1
BTPS 4.75%	08/01/23	4.75	4,200	4,811	610,958	2023/8/1
BTPS 4.75%	09/01/21	4.75	3,950	4,386	556,987	2021/9/1
BTPS 4.75%	09/01/28	4.75	2,400	2,826	358,953	2028/9/1
BTPS 4.75%	09/01/44	4.75	2,400	2,945	374,005	2044/9/1
BTPS 5%	03/01/22	5.0	3,000	3,384	429,723	2022/3/1
BTPS 5%	03/01/25	5.0	2,650	3,122	396,469	2025/3/1
BTPS 5%	08/01/34	5.0	3,500	4,351	552,490	2034/8/1
BTPS 5%	09/01/40	5.0	2,900	3,625	460,359	2040/9/1
BTPS 5.0%	08/01/39	5.0	2,850	3,570	453,346	2039/8/1
BTPS 5.25%	11/01/29	5.25	3,650	4,505	572,169	2029/11/1
BTPS 5.5%	09/01/22	5.5	3,400	3,943	500,731	2022/9/1
BTPS 5.5%	11/01/22	5.5	3,450	4,012	509,560	2022/11/1
BTPS 5.75%	02/01/33	5.75	2,700	3,562	452,375	2033/2/1
BTPS 6%	05/01/31	6.0	3,900	5,165	655,963	2031/5/1
BTPS 6.5%	11/01/27	6.5	3,150	4,157	527,944	2027/11/1
BTPS 7.25%	11/01/26	7.25	1,400	1,909	242,449	2026/11/1
BTPS 9%	11/01/23	9.0	800	1,094	138,966	2023/11/1
(フランス)						
国債証券						
FRTR 0%	03/25/23	—	750	753	95,693	2023/3/25
FRTR 0%	05/25/21	—	3,000	3,038	385,776	2021/5/25
FRTR 0%	05/25/22	—	5,550	5,606	711,906	2022/5/25
FRTR 0.25%	11/25/20	0.25	4,600	4,687	595,208	2020/11/25
FRTR 0.25%	11/25/26	0.25	4,850	4,757	604,047	2026/11/25
FRTR 0.5%	05/25/25	0.5	5,550	5,645	716,909	2025/5/25
FRTR 0.5%	05/25/26	0.5	5,580	5,621	713,873	2026/5/25
FRTR 0.5%	11/25/19	0.5	2,750	2,795	354,927	2019/11/25
FRTR 0.75%	05/25/28	0.75	3,600	3,619	459,649	2028/5/25
FRTR 1%	05/25/19	1.0	2,300	2,336	296,649	2019/5/25
FRTR 1%	05/25/27	1.0	3,650	3,790	481,325	2027/5/25
FRTR 1%	11/25/25	1.0	5,000	5,250	666,718	2025/11/25
FRTR 1.25%	05/25/34	1.25	950	965	122,543	2034/5/25
FRTR 1.25%	05/25/36	1.25	3,350	3,345	424,770	2036/5/25
FRTR 1.5%	05/25/31	1.5	4,800	5,116	649,749	2031/5/25
FRTR 1.75%	05/25/23	1.75	4,800	5,243	665,797	2023/5/25
FRTR 1.75%	05/25/66	1.75	1,050	1,032	131,113	2066/5/25
FRTR 1.75%	06/25/39	1.75	2,150	2,301	292,198	2039/6/25
FRTR 1.75%	11/25/24	1.75	5,750	6,338	804,805	2024/11/25
FRTR 2%	05/25/48	2.0	2,400	2,602	330,422	2048/5/25
FRTR 2.25%	05/25/24	2.25	3,100	3,502	444,694	2024/5/25
FRTR 2.25%	10/25/22	2.25	7,100	7,872	999,597	2022/10/25
FRTR 2.5%	05/25/30	2.5	4,400	5,218	662,688	2030/5/25
FRTR 2.5%	10/25/20	2.5	5,450	5,849	742,753	2020/10/25
FRTR 2.75%	10/25/27	2.75	5,700	6,834	867,790	2027/10/25
FRTR 3%	04/25/22	3.0	2,800	3,163	401,674	2022/4/25
FRTR 3.25%	05/25/45	3.25	3,350	4,613	585,858	2045/5/25
FRTR 3.25%	10/25/21	3.25	6,850	7,704	978,313	2021/10/25
FRTR 3.5%	04/25/20	3.5	11,000	11,855	1,505,358	2020/4/25
FRTR 3.5%	04/25/26	3.5	1,880	2,343	297,593	2026/4/25
FRTR 3.75%	04/25/21	3.75	5,550	6,233	791,495	2021/4/25

銘柄	利 率 (%)	期 額面金額	末 評 価 額			償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	債還年月日	
FRTR 3.75% 10/25/19	3.75	4,080	4,330	549,849	2019/10/25	
FRTR 4% 04/25/55	4.0	2,050	3,333	423,284	2055/4/25	
FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,650	2,752	349,500	2060/4/25	
FRTR 4% 10/25/38	4.0	3,800	5,652	717,766	2038/10/25	
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	6,250	7,706	978,535	2023/10/25	
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	3,660	5,896	748,739	2041/4/25	
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	3,000	4,681	594,454	2035/4/25	
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	4,050	6,077	771,732	2029/4/25	
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	4,100	6,730	854,581	2032/10/25	
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,900	2,705	343,502	2025/10/25	
FRTR 8.5% 04/25/23	8.5	1,000	1,425	181,009	2023/4/25	
FRTR 8.5% 10/25/19	8.5	1,120	1,264	160,529	2019/10/25	
(オランダ)						
国債証券						
NETHER 0% 01/15/22	—	1,800	1,826	231,931	2022/1/15	
NETHER 0% 01/15/24	—	900	902	114,580	2024/1/15	
NETHER 0.25% 01/15/20	0.25	1,950	1,980	251,473	2020/1/15	
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	1,690	1,700	215,991	2025/7/15	
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	3,400	3,458	439,123	2026/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	1,650	1,700	215,866	2027/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	850	869	110,350	2028/7/15	
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	1,950	2,143	272,131	2023/7/15	
NETHER 2% 07/15/24	2.0	2,450	2,748	348,999	2024/7/15	
NETHER 2.25% 07/15/22	2.25	1,600	1,773	225,224	2022/7/15	
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	1,850	2,292	291,070	2033/1/15	
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	1,630	2,309	293,316	2047/1/15	
NETHER 3.25% 07/15/21	3.25	2,050	2,294	291,417	2021/7/15	
NETHER 3.5% 07/15/20	3.5	2,800	3,049	387,258	2020/7/15	
NETHER 3.75% 01/15/23	3.75	2,200	2,613	331,828	2023/1/15	
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	1,980	3,147	399,683	2042/1/15	
NETHER 4% 01/15/37	4.0	1,940	2,989	379,654	2037/1/15	
NETHER 4% 07/15/19	4.0	1,100	1,158	147,096	2019/7/15	
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,140	1,689	214,561	2028/1/15	
NETHER 7.5% 01/15/23	7.5	200	272	34,624	2023/1/15	
(スペイン)						
国債証券						
SPGB 0.05% 01/31/21	0.05	1,100	1,099	139,583	2021/1/31	
SPGB 0.4% 04/30/22	0.4	2,050	2,056	261,181	2022/4/30	
SPGB 0.45% 10/31/22	0.45	2,350	2,351	298,537	2022/10/31	
SPGB 0.75% 07/30/21	0.75	750	764	97,094	2021/7/30	
SPGB 1.15% 07/30/20	1.15	3,000	3,079	391,063	2020/7/30	
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	3,100	3,105	394,356	2026/10/31	
SPGB 1.4% 01/31/20	1.4	2,360	2,421	307,537	2020/1/31	
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	2,700	2,672	339,366	2028/4/30	
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	2,300	2,301	292,305	2027/10/31	
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	3,050	3,085	391,820	2027/4/30	
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	1,950	2,032	258,025	2025/4/30	
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	2,950	3,114	395,440	2026/4/30	
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	2,250	2,294	291,333	2030/7/30	
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	3,550	3,812	484,125	2025/10/31	
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	1,500	1,559	197,969	2033/7/30	
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	1,286	955	121,286	2048/10/31	
SPGB 2.75% 04/30/19	2.75	2,250	2,313	293,781	2019/4/30	
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	3,200	3,574	453,909	2024/10/31	
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	2,100	2,220	281,925	2046/10/31	
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	1,000	1,133	143,914	2066/7/30	
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	3,100	3,634	461,520	2024/4/30	
SPGB 4% 04/30/20	4.0	3,000	3,236	410,908	2020/4/30	
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	2,500	3,272	415,500	2037/1/31	
SPGB 4.3% 10/31/19	4.3	3,900	4,154	527,483	2019/10/31	
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	1,750	2,097	266,298	2023/10/31	
SPGB 4.6% 07/30/19	4.6	3,030	3,204	406,912	2019/7/30	
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,600	3,249	412,579	2025/7/30	

銘柄	利 率 (%)	期 額面金額	末 評 価 額			償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	債還年月日	
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	2,550	3,577	454,293	2041/7/30	
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	3,050	3,736	474,520	2024/1/31	
SPGB 4.85% 10/31/20	4.85	2,100	2,345	297,798	2020/10/31	
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	2,200	3,153	400,462	2040/7/30	
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	4,300	5,780	734,014	2028/10/31	
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,750	2,627	333,691	2044/10/31	
SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	3,400	4,173	529,894	2023/1/31	
SPGB 5.5% 04/30/21	5.5	3,300	3,818	484,834	2021/4/30	
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,950	4,373	555,377	2032/7/30	
SPGB 5.85% 01/31/22	5.85	4,250	5,120	650,147	2022/1/31	
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	2,380	3,241	411,577	2026/7/30	
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,050	1,505	191,154	2029/1/31	
(ベルギー)						
国債証券						
BGB 0.2% 10/22/23	0.2	1,700	1,718	218,157	2023/10/22	
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	2,100	2,169	275,531	2025/6/22	
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	2,110	2,142	272,083	2027/6/22	
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	850	853	108,407	2028/6/22	
BGB 1% 06/22/26	1.0	2,100	2,186	277,600	2026/6/22	
BGB 1% 06/22/31	1.0	1,300	1,296	164,661	2031/6/22	
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	850	860	109,322	2033/4/22	
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	800	811	103,074	2037/6/22	
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	1,100	1,087	138,093	2047/6/22	
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	1,100	1,194	151,681	2038/6/22	
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	450	485	61,591	2066/6/22	
BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,500	1,679	213,236	2023/6/22	
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	400	447	56,802	2057/6/22	
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	2,400	2,759	350,374	2024/6/22	
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,850	2,337	296,778	2034/6/22	
BGB 3% 09/28/19	3.0	2,000	2,095	266,103	2019/9/28	
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	1,260	1,862	236,461	2045/6/22	
BGB 3.75% 09/28/20	3.75	2,750	3,027	384,453	2020/9/28	
BGB 4% 03/28/22	4.0	2,250	2,626	333,567	2022/3/28	
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,030	1,427	181,211	2032/3/28	
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	2,130	3,293	418,248	2041/3/28	
BGB 4.25% 09/28/21	4.25	2,100	2,429	308,537	2021/9/28	
BGB 4.25% 09/28/22	4.25	1,350	1,614	205,072	2022/9/28	
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	980	1,292	164,079	2026/3/28	
BGB 5% 03/28/35	5.0	1,610	2,544	323,041	2035/3/28	
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,260	3,313	420,783	2028/3/28	
(オーストリア)						
国債証券						
RAGB 0% 07/15/23	—	500	501	63,711	2023/7/15	
RAGB 0% 09/20/22	—	640	645	82,024	2022/9/20	
RAGB 0.25% 10/18/19	0.25	1,050	1,061	134,844	2019/10/18	
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	1,100	1,099	139,567	2027/4/20	
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	3,420	3,508	445,458	2026/10/20	
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,850	1,970	250,252	2025/10/20	
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	470	479	60,949	2047/2/20	
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	280	255	32,484	2086/11/2	
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	1,750	1,920	243,803	2024/10/21	
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	1,400	1,536	195,101	2023/10/20	
RAGB 1.95% 06/18/19	1.95	950	975	123,826	2019/6/18	
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	500	564	71,659	2017/9/20	
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	940	1,129	143,382	2034/5/23	
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	1,030	1,449	184,111	2044/6/20	
RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	1,300	1,512	192,003	2022/11/22	
RAGB 3.5% 09/15/21	3.5	2,170	2,452	311,480	2021/9/15	
RAGB 3.65% 04/20/22	3.65	1,100	1,269	161,227	2022/4/20	
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	470	808	102,632	2062/1/26	
RAGB 3.9% 07/15/20	3.9	1,750	1,917	243,510	2020/7/15	
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,710	2,598	329,974	2037/3/15	
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	500	677	85,990	2026/3/15	

当		期		末	
銘柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 外貨建金額	額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	850	1,290	163,894	2027/7/15
(フィンランド)					
国債証券					
RFGB 0% 04/15/22	—	540	545	69,285	2022/4/15
RFGB 0% 09/15/23	—	600	600	76,275	2023/9/15
RFGB 0.375% 09/15/20	0.375	650	664	84,323	2020/9/15
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	550	556	70,621	2026/4/15
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	350	349	44,328	2027/9/15
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	540	534	67,884	2031/4/15
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	650	678	86,129	2025/9/15
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	420	427	54,344	2034/4/15
RFGB 1.5% 04/15/23	1.5	650	701	89,014	2023/4/15
RFGB 1.625% 09/15/22	1.625	770	831	105,579	2022/9/15
RFGB 2% 04/15/24	2.0	600	668	84,846	2024/4/15
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	550	727	92,420	2042/7/4
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	720	873	110,894	2028/7/4
RFGB 3.375% 04/15/20	3.375	700	752	95,952	2020/4/15
RFGB 3.5% 04/15/21	3.5	740	824	104,728	2021/4/15
RFGB 4% 07/04/25	4.0	1,130	1,429	181,507	2025/7/4
RFGB 4.375% 07/04/19	4.375	750	791	100,530	2019/7/4
(アイルランド)					
国債証券					
IRISH 0.8% 03/15/22	0.8	970	1,006	127,791	2022/3/15
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	320	318	40,406	2028/5/15
IRISH 1% 05/15/26	1.0	1,650	1,692	214,869	2026/5/15
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	520	509	64,672	2033/5/15
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	750	762	96,796	2037/5/15
IRISH 2% 02/18/45	2.0	980	1,024	130,091	2045/2/18
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	1,450	1,647	209,209	2030/5/15
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	1,150	1,360	172,709	2024/3/18
IRISH 3.9% 03/20/23	3.9	1,050	1,246	158,307	2023/3/20
IRISH 4.4% 06/18/19	4.4	400	420	53,415	2019/6/18
IRISH 4.5% 04/18/20	4.5	2,080	2,278	289,337	2020/4/18
IRISH 5% 10/18/20	5.0	790	894	113,539	2020/10/18
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,550	2,059	261,573	2025/3/13
IRISH 5.9% 10/18/19	5.9	800	870	110,572	2019/10/18
ユ ー ロ 計				96,580,235	
(イギリス)					
国債証券					
UKT 0.5% 07/22/22	0.5	3,500	3,443	500,683	2022/7/22
UKT 0.75% 07/22/23	0.75	1,900	1,873	272,453	2023/7/22
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	3,950	3,913	569,061	2027/7/22
UKT 1.5% 01/22/21	1.5	5,730	5,845	850,121	2021/1/22
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	2,600	2,650	385,425	2026/7/22
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	2,520	2,368	344,392	2047/7/22
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	700	711	103,420	2028/10/22
UKT 1.75% 07/22/19	1.75	5,470	5,543	806,102	2019/7/22
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	1,590	1,646	239,464	2057/7/22
UKT 1.75% 09/07/22	1.75	3,150	3,261	474,339	2022/9/7
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	1,400	1,398	203,384	2037/9/7
UKT 2% 07/22/20	2.0	2,600	2,672	388,684	2020/7/22
UKT 2% 09/07/25	2.0	2,250	2,384	346,733	2025/9/7
UKT 2.25% 09/07/23	2.25	2,750	2,923	425,200	2023/9/7
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	2,250	2,943	427,989	2065/7/22
UKT 2.75% 09/07/24	2.75	2,200	2,421	352,097	2024/9/7
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	3,350	4,351	632,833	2044/1/22
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	3,300	4,492	653,300	2045/1/22
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	2,350	3,918	569,865	2068/7/22
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	2,050	3,140	456,667	2052/7/22
UKT 3.75% 09/07/19	3.75	550	572	83,212	2019/9/7
UKT 3.75% 09/07/20	3.75	750	802	116,657	2020/9/7
UKT 3.75% 09/07/21	3.75	2,000	2,192	318,826	2021/9/7
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,950	3,366	489,515	2060/1/22

当		期		末	
銘柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 外貨建金額	額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
UKT 4% 03/07/22	4.0	1,450	1,622	235,921	2022/3/7
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	2,800	3,890	565,716	2036/3/7
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	2,050	2,727	396,618	2032/6/7
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,950	2,811	408,839	2039/9/7
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	670	845	122,915	2027/12/7
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	2,080	3,039	441,981	2040/12/7
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	2,100	3,259	474,004	2046/12/7
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,770	2,848	414,205	2049/12/7
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	2,370	4,091	594,987	2055/12/7
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	2,430	3,402	494,791	2034/9/7
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,550	3,927	571,160	2042/12/7
UKT 4.75% 03/07/20	4.75	2,650	2,843	413,538	2020/3/7
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,800	2,458	357,554	2030/12/7
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,900	2,887	419,847	2038/12/7
UKT 5% 03/07/25	5.0	1,900	2,380	346,158	2025/3/7
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,250	1,811	263,423	2028/12/7
UKT 8% 06/07/21	8.0	1,550	1,887	274,451	2021/6/7
小 計				16,806,548	
(スイス)					
国債証券					
SWISS 2% 04/28/21	2.0	1,000	1,081	118,960	2021/4/28
SWISS 2.25% 07/06/20	2.25	400	426	46,866	2020/7/6
SWISS 3% 05/12/19	3.0	540	559	61,571	2019/5/12
SWISS 4% 02/11/23	4.0	550	670	73,735	2023/2/11
SWISS 4% 04/08/28	4.0	640	899	98,942	2028/4/8
小 計				400,076	
(スウェーデン)					
国債証券					
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	7,650	7,850	97,116	2028/5/12
SGB 1% 11/12/26	1.0	8,350	8,832	109,253	2026/11/12
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	11,500	12,508	154,727	2023/11/13
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	7,350	8,565	105,950	2025/5/12
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	5,700	8,212	101,584	2039/3/30
SGB 3.5% 06/01/22	3.5	14,070	16,225	200,714	2022/6/1
SGB 5% 12/01/20	5.0	12,000	13,692	169,738	2020/12/1
小 計				938,724	
(ノルウェー)					
国債証券					
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	4,610	4,564	60,842	2026/2/19
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	4,250	4,253	56,704	2027/2/17
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	6,900	6,984	93,103	2025/3/13
NGB 2% 05/24/23	2.0	8,650	8,906	118,719	2023/5/24
NGB 3% 03/14/24	3.0	5,550	6,012	80,149	2024/3/14
NGB 3.75% 05/25/21	3.75	12,400	13,362	178,117	2021/5/25
NGB 4.5% 05/22/19	4.5	9,900	10,260	136,767	2019/5/22
小 計				724,405	
(デンマーク)					
国債証券					
DGB 0.25% 11/15/20	0.25	1,600	1,633	27,848	2020/11/15
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	6,800	6,875	117,230	2027/11/15
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	6,600	7,192	122,625	2023/11/15
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	13,090	14,682	250,334	2025/11/15
DGB 3% 11/15/21	3.0	10,700	11,992	204,465	2021/11/15
DGB 4% 11/15/19	4.0	12,590	13,452	229,370	2019/11/15
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	16,900	29,005	494,549	2039/11/15
小 計				1,446,425	
(ポーランド)					
国債証券					
POLGB 1.5% 04/25/20	1.5	2,200	2,197	64,877	2020/4/25
POLGB 1.75% 07/25/21	1.75	5,100	5,063	149,489	2021/7/25
POLGB 2% 04/25/21	2.0	3,500	3,511	103,645	2021/4/25

当		期		末	
銘	柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
POLGB 2.25% 04/25/22		2.25	2,000	2,002	59,106 2022/4/25
POLGB 2.5% 01/25/23		2.5	3,200	3,210	94,760 2023/1/25
POLGB 2.5% 07/25/26		2.5	4,650	4,458	131,615 2026/7/25
POLGB 2.5% 07/25/27		2.5	4,100	3,889	114,816 2027/7/25
POLGB 2.75% 04/25/28		2.75	2,000	1,926	56,862 2028/4/25
POLGB 3.25% 07/25/19		3.25	4,570	4,667	137,794 2019/7/25
POLGB 3.25% 07/25/25		3.25	3,680	3,752	110,781 2025/7/25
POLGB 4% 10/25/23		4.0	3,750	4,017	118,591 2023/10/25
POLGB 5.25% 10/25/20		5.25	3,150	3,414	100,790 2020/10/25
POLGB 5.5% 10/25/19		5.5	2,600	2,747	81,100 2019/10/25
POLGB 5.75% 04/25/29		5.75	600	743	21,943 2029/4/25
POLGB 5.75% 09/23/22		5.75	3,600	4,109	121,299 2022/9/23
POLGB 5.75% 10/25/21		5.75	1,150	1,291	38,127 2021/10/25
小 計				1,505,601	
(オーストラリア)			千オーストラリア ドル	千オーストラリア ドル	
国債証券					
ACGB 1.75% 11/21/20		1.75	2,850	2,829	233,298 2020/11/21
ACGB 2% 12/21/21		2.0	3,400	3,377	278,523 2021/12/21
ACGB 2.25% 05/21/28		2.25	3,380	3,247	267,769 2028/5/21
ACGB 2.25% 11/21/22		2.25	400	399	32,908 2022/11/21
ACGB 2.75% 04/21/24		2.75	3,510	3,563	293,886 2024/4/21
ACGB 2.75% 06/21/35		2.75	820	790	65,212 2035/6/21
ACGB 2.75% 10/21/19		2.75	2,450	2,478	204,339 2019/10/21
ACGB 2.75% 11/21/27		2.75	3,550	3,566	294,124 2027/11/21
ACGB 2.75% 11/21/28		2.75	3,050	3,059	252,311 2028/11/21
ACGB 2.75% 11/21/29		2.75	1,550	1,550	127,832 2029/11/21
ACGB 3% 03/21/47		3.0	1,600	1,527	125,975 2047/3/21
ACGB 3.25% 04/21/25		3.25	3,350	3,501	288,702 2025/4/21
ACGB 3.25% 04/21/29		3.25	2,150	2,257	186,172 2029/4/21
ACGB 3.25% 06/21/39		3.25	750	764	63,003 2039/6/21
ACGB 3.75% 04/21/37		3.75	1,500	1,647	135,833 2037/4/21
ACGB 4.25% 04/21/26		4.25	4,460	4,982	410,874 2026/4/21
ACGB 4.5% 04/15/20		4.5	4,090	4,279	352,913 2020/4/15
ACGB 4.5% 04/21/33		4.5	2,100	2,505	206,606 2033/4/21
ACGB 4.75% 04/21/27		4.75	3,850	4,485	369,869 2027/4/21
ACGB 5.5% 04/21/23		5.5	3,450	3,951	325,832 2023/4/21
ACGB 5.75% 05/15/21		5.75	3,950	4,359	359,503 2021/5/15
ACGB 5.75% 07/15/22		5.75	3,070	3,492	288,011 2022/7/15
小 計				5,163,506	
(シンガポール)			千シンガポール ドル	千シンガポール ドル	
国債証券					
SIGB 1.25% 10/01/21		1.25	250	243	19,783 2021/10/1
SIGB 1.625% 10/01/19		1.625	410	409	33,283 2019/10/1
SIGB 1.75% 04/01/22		1.75	360	354	28,844 2022/4/1
SIGB 2% 07/01/20		2.0	760	761	61,924 2020/7/1
SIGB 2.125% 06/01/26		2.125	250	243	19,781 2026/6/1
SIGB 2.25% 06/01/21		2.25	870	873	71,107 2021/6/1
SIGB 2.375% 06/01/25		2.375	700	695	56,589 2025/6/1
SIGB 2.5% 06/01/19		2.5	1,300	1,309	106,590 2019/6/1
SIGB 2.75% 03/01/46		2.75	650	623	50,756 2046/3/1
SIGB 2.75% 04/01/42		2.75	620	598	48,700 2042/4/1
SIGB 2.75% 07/01/23		2.75	810	825	67,210 2023/7/1
SIGB 2.875% 07/01/29		2.875	280	285	23,242 2029/7/1
SIGB 2.875% 09/01/30		2.875	470	475	38,715 2030/9/1
SIGB 3% 09/01/24		3.0	800	826	67,271 2024/9/1
SIGB 3.125% 09/01/22		3.125	1,100	1,145	93,225 2022/9/1
SIGB 3.25% 09/01/20		3.25	590	606	49,353 2020/9/1
SIGB 3.375% 09/01/33		3.375	780	827	67,352 2033/9/1
SIGB 3.5% 03/01/27		3.5	950	1,021	83,107 2027/3/1
小 計				986,841	
(マレーシア)			千マレーシア リンギット	千マレーシア リンギット	
国債証券					
MCS 3.418% 08/15/22		3.418	2,500	2,452	67,260 2022/8/15

当		期		末	
銘	柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
MGS 3.48% 03/15/23		3.48	2,700	2,639	72,395 2023/3/15
MGS 3.492% 03/31/20		3.492	2,000	1,997	54,785 2020/3/31
MGS 3.502% 05/31/27		3.502	2,400	2,240	61,448 2027/5/31
MGS 3.654% 10/31/19		3.654	1,600	1,604	44,009 2019/10/31
MGS 3.659% 10/15/20		3.659	1,150	1,149	31,540 2020/10/15
MGS 3.733% 06/15/28		3.733	1,300	1,248	34,254 2028/6/15
MGS 3.795% 09/30/22		3.795	1,100	1,095	30,049 2022/9/30
MGS 3.844% 04/15/33		3.844	1,150	1,041	28,580 2033/4/15
MGS 3.882% 03/10/22		3.882	750	749	20,566 2022/3/10
MGS 3.889% 07/31/20		3.889	1,500	1,507	41,339 2020/7/31
MGS 3.892% 03/15/27		3.892	1,130	1,088	29,869 2027/3/15
MGS 3.955% 09/15/25		3.955	2,700	2,648	72,650 2025/9/15
MGS 4.048% 09/30/21		4.048	2,050	2,065	56,665 2021/9/30
MGS 4.059% 09/30/24		4.059	1,900	1,889	51,837 2024/9/30
MGS 4.127% 04/15/32		4.127	1,450	1,353	37,126 2032/4/15
MGS 4.16% 07/15/21		4.16	1,650	1,665	45,683 2021/7/15
MGS 4.181% 07/15/24		4.181	2,950	2,959	81,180 2024/7/15
MGS 4.232% 06/30/31		4.232	650	617	16,942 2031/6/30
MGS 4.254% 05/31/35		4.254	1,400	1,293	35,473 2035/5/31
MGS 4.378% 11/29/19		4.378	2,200	2,228	61,129 2019/11/29
MGS 4.392% 04/15/26		4.392	1,800	1,808	49,614 2026/4/15
MGS 4.498% 04/15/30		4.498	1,250	1,229	33,732 2030/4/15
MGS 4.736% 03/15/46		4.736	400	387	10,624 2046/3/15
MGS 4.762% 04/07/37		4.762	1,650	1,622	44,500 2037/4/7
MGS 4.935% 09/30/43		4.935	1,850	1,857	50,945 2043/9/30
MGS 5.248% 09/15/28		5.248	600	636	17,454 2028/9/15
小 計				1,181,663	
(南アフリカ)			千南アフリカ ランド	千南アフリカ ランド	
国債証券					
SAGB 10.5% 12/21/26		10.5	26,400	29,682	260,311 2026/12/21
SAGB 6.25% 03/31/36		6.25	11,020	8,244	72,308 2036/3/31
SAGB 6.5% 02/28/41		6.5	8,200	6,052	53,083 2041/2/28
SAGB 6.75% 03/31/21		6.75	7,300	7,163	62,820 2021/3/31
SAGB 7% 02/28/31		7.0	12,900	11,016	96,611 2031/2/28
SAGB 7.25% 01/15/20		7.25	4,200	4,200	36,840 2020/1/15
SAGB 7.75% 02/28/23		7.75	9,700	9,668	84,790 2023/2/28
SAGB 8% 01/31/30		8.0	15,700	14,734	129,221 2030/1/31
SAGB 8.25% 03/31/32		8.25	14,160	13,293	116,588 2032/3/31
SAGB 8.5% 01/31/37		8.5	16,550	15,510	136,031 2037/1/31
SAGB 8.75% 01/31/44		8.75	25,650	24,206	212,291 2044/1/31
SAGB 8.75% 02/28/48		8.75	13,850	13,076	114,684 2048/2/28
SAGB 8.875% 02/28/35		8.875	8,900	8,707	76,365 2035/2/28
SAGB 9% 01/31/40		9.0	11,800	11,487	100,744 2040/1/31
小 計				1,552,694	
合 計				238,882,199	

(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>

		当 期	末
銘 柄 別		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外 国	EURO-SCHATZ	227	—
	US 5YR NOTE	409	—
	EURO-BOBL FU	302	—
	EURO-BUND	616	—
	US 10YR NOTE	248	—
	US LONG BOND	204	—

(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	%
公 社 債	238,882,199	96.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,345,637	3.4
投 資 信 託 財 産 総 額	247,227,836	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(238,121,765千円)の投資信託財産総額(247,227,836千円)に対する比率は96.3%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=109.25円

1カナダドル=84.23円

1メキシコペソ=5.58円

1ユーロ=126.98円

1イギリスポンド=145.42円

1スイスフラン=109.99円

1スウェーデンクローナ=12.37円

1ノルウェークローネ=13.33円

1デンマーククローネ=17.05円

1ポーランドズロチ=29.52円

1オーストラリアドル=82.46円

1シンガポールドル=81.37円

1マレーシアリンギット=27.43円

1南アフリカランド=8.77円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2018年5月29日現在
(A) 資 産	252,974,527,999円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,378,339,501
公 社 債(評価額)	238,882,199,856
未 収 入 金	5,769,582,022
未 収 利 息	1,756,084,363
前 払 費 用	84,083,451
差 入 委 託 証 拠 金	104,238,806
(B) 負 債	9,217,865,543
未 払 金	9,112,842,505
未 払 解 約 金	104,992,985
未 払 利 息	15,484
そ の 他 未 払 費 用	14,569
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	243,756,662,456
元 本	91,572,244,683
次 期 繰 越 損 益 金	152,184,417,773
(D) 受 益 権 総 口 数	91,572,244,683口
1万口当たり基準価額(C/D)	26,619円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2017年5月30日 至 2018年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	5,698,142,461円
受 取 利 息	5,701,147,862
そ の 他 収 益 金	138,739
支 払 利 息	△3,144,140
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△7,356,053,909
売 買 益	2,697,433,215
売 買 損	△10,053,487,124
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△20,605,443
取 引 益	97,565,781
取 引 損	△118,171,224
(D) そ の 他 費 用	△60,462,900
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△1,738,979,791
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	137,069,151,223
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	47,386,265,897
(H) 解 約 差 損 益 金	△30,532,019,556
(I) 計 (E+F+G+H)	152,184,417,773
次 期 繰 越 損 益 金(I)	152,184,417,773

(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82,408,164,040円、期中追加設定元本額は27,149,549,608円、期中一部解約元本額は17,985,468,965円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

外国債券SMTBセクション(SMA専用)	23,814,130,596円
世界経済インデックスファンド	6,037,876,537円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	5,946,797,107円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	5,546,711,161円
コア投資戦略ファンド(成長型)	4,922,358,771円
DC世界経済インデックスファンド	4,697,809,947円
分散投資コア戦略ファンドS	2,728,113,990円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,703,603,322円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,636,232,173円
外国債券オープン(毎月決算型)	2,081,069,570円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,981,778,147円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,891,969,467円
DC外国債券インデックス・オープン	1,717,184,609円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,562,931,400円
DCマイセクション25	1,555,694,765円
DCマイセクション50	1,355,599,943円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,191,380,657円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	1,186,635,716円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,128,914,008円
グローバル経済コア	1,095,699,711円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,013,840,684円
分散投資コア戦略ファンドA	979,489,730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)	978,874,913円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	959,648,924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)	916,208,509円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	912,264,322円
DCマイセクション75	895,083,870円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	887,209,156円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	740,539,162円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	714,337,842円
外国債券ファンド・シリーズ1	642,596,895円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	602,061,084円
DCマイセクションS25	595,144,959円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	575,575,609円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	572,553,708円
DCマイセクションS50	528,379,672円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	359,454,806円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	356,172,057円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	291,033,791円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	272,251,603円
SMT インデックスバランス・オープン	249,501,086円
DCマイセクションS75	249,278,268円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	229,866,847円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	210,793,446円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	190,447,909円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	176,029,305円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	146,389,478円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	115,267,806円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	74,741,445円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	69,839,236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)	61,246,861円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	59,194,235円

DCターゲット・イヤー ファンド2025	54,396,262円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり (SMA専用)	50,410,376円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	27,150,386円
SMT 世界経済インデックス・オープン	11,772,640円
SBI資産設計オープン(分配型)	9,348,221円
マイセクション50VA1 (適格機関投資家専用)	6,057,964円
マイセクション75VA1 (適格機関投資家専用)	2,493,234円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	2,399,881円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	397,559円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	9,345円

お知らせ

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

(変更日:2017年10月2日)

当ファンドの約款に記載されている指数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:2018年1月31日)