



■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／インデックス型 (課税上は株式投資信託として取扱われます。)				
信託期間	無期限です。				
運用方針	信託財産の中長期的な成長を目標として運用を行います。				
主要投資対象	LPS4資産分散ファンド (慎重型) (安定重視型) (バランス型) (成長重視型) (積極型)	「TMA日本株TOPIXマザーファンド」、「TMA日本債券インデックスマザーファンド」、「TMA外国株式インデックスマザーファンド」、「TMA外国債券インデックスマザーファンド」を主要投資対象とします。			
	TMA日本株TOPIXマザーファンド	東京証券取引所第一部上場株式			
	TMA日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債			
	TMA外国株式インデックスマザーファンド	外国の株式			
投資制限	(慎重型)	株式への実質投資割合	30%以下	外貨建資産への実質投資割合	40%以下
	(安定重視型)		40%以下		60%以下
	(バランス型)		60%以下		60%以下
	(成長重視型)		70%以下		70%以下
	(積極型)		制限なし		75%以下
分配方針	毎決算時に、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。 収益の分配に充当せず、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。				

LPS4資産分散ファンド

(慎重型)
(安定重視型)
(バランス型)
(成長重視型)
(積極型)

愛称：未来海図

第2期 運用報告書
(決算日 2011年5月30日)

投資家のみなさまへ

毎々格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。
さて、ご投資いただいております「LPS4資産分散ファンド(慎重型)(安定重視型)(バランス型)(成長重視型)(積極型)愛称：未来海図」は、2011年5月30日に第2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。

東京海上アセットマネジメント投信

東京都千代田区丸の内1-3-1 東京銀行協会ビル

お問い合わせ窓口

東京海上アセットマネジメント投信 サービスデスク 0120-712-016

※土日祝日・年末年始を除く9時～17時

<http://www.tokiomarineam.co.jp/>

■設定以来の運用実績

LPS4資産分散ファンド(慎重型)

決算期	基準価額	税込 分配 金	期中 騰落 率	ベンチマーク		株式組入 比率	株式先物 比率	債券組入 比率	投資信託 証券組入 比率	純資産 総額
				(2009年9月1日)	期中 騰落 率					
(設定日) 2009年9月2日	円 10,000	円 —	% —	(2009年9月1日) 10,000	% —	% —	% —	% —	% —	百万円 1
1期(2010年5月28日)	9,939	0	△0.6	9,979	△0.2	11.4	0.6	82.6	0.1	1
2期(2011年5月30日)	10,016	0	0.8	10,106	1.3	12.2	0.3	84.2	0.1	1

(注1) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」および「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

(注4) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注5) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

LPS4資産分散ファンド(安定重視型)

決算期	基準価額	税込 分配 金	期中 騰落 率	ベンチマーク		株式組入 比率	株式先物 比率	債券組入 比率	投資信託 証券組入 比率	純資産 総額
				(2009年9月1日)	期中 騰落 率					
(設定日) 2009年9月2日	円 10,000	円 —	% —	(2009年9月1日) 10,000	% —	% —	% —	% —	% —	百万円 1
1期(2010年5月28日)	9,779	0	△2.2	9,802	△2.0	22.8	1.2	72.5	0.2	5
2期(2011年5月30日)	9,835	0	0.6	9,902	1.0	23.5	0.5	72.4	0.2	8

(注1) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」および「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

(注4) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注5) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

LPS4資産分散ファンド(バランス型)

決算期	基準価額	税込 分配 金	期中 騰落 率	ベンチマーク		株式組入 比率	株式先物 比率	債券組入 比率	投資信託 証券組入 比率	純資産 総額
				(2009年9月1日)	期中 騰落 率					
(設定日) 2009年9月2日	円 10,000	円 —	% —	(2009年9月1日) 10,000	% —	% —	% —	% —	% —	百万円 1
1期(2010年5月28日)	9,726	0	△2.7	9,731	△2.7	38.9	2.0	57.0	0.3	1
2期(2011年5月30日)	9,810	0	0.9	9,835	1.1	38.7	0.9	57.2	0.3	10

(注1) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」および「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

(注4) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注5) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

LPS4資産分散ファンド(成長重視型)

決算期	基準価額	税込み 分配金	期中 騰落率	ベンチマーク		株式組入 比率	株式先物 比率	債券組入 比率	投資信託 証券組入 比率	純資産 総額
				(2009年9月1日)	期中 騰落率					
(設定日) 2009年9月2日	円 10,000	円 —	% —	(2009年9月1日) 10,000	% —	% —	% —	% —	% —	百万円 1
1期(2010年5月28日)	9,689	0	△3.1	9,674	△3.3	53.7	2.8	43.0	0.4	4
2期(2011年5月30日)	9,782	0	1.0	9,797	1.3	53.2	1.2	42.9	0.3	6

(注1) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」および「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注4) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注5) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

LPS4資産分散ファンド(積極型)

決算期	基準価額	税込み 分配金	期中 騰落率	ベンチマーク		株式組入 比率	株式先物 比率	債券組入 比率	投資信託 証券組入 比率	純資産 総額
				(2009年9月1日)	期中 騰落率					
(設定日) 2009年9月2日	円 10,000	円 —	% —	(2009年9月1日) 10,000	% —	% —	% —	% —	% —	百万円 1
1期(2010年5月28日)	9,643	0	△3.6	9,617	△3.8	66.6	3.4	30.3	0.4	1
2期(2011年5月30日)	9,758	0	1.2	9,767	1.6	66.7	1.5	29.3	0.4	3

(注1) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」および「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注4) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注5) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

ベンチマークは、TOPIX、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)、シティグループ世界国債インデックス(除く日本/円ヘッジなし・円ベース)を基本資産配分で組み合わせた合成指数です。(ファンド設定日の前日を10,000としています。)基準価額は対顧客電信売買相場の仲値(TTM)を用いて計算しているため、MSCIコクサイ指数は、基準日前日のMSCIコクサイ指数(米ドルベース)を基準日のTTMで委託会社が円換算したもの、シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ世界国債インデックス(国内投信用)を使用しています。

■当期中の基準価額と市況等の推移 LPS4資産分散ファンド(慎重型)

年 月 日	基準価額	ベンチマーク		株式組入率 比	株式先物率 比	債券組入率 比	投資信託証券 組入比率	
		騰落率	騰落率					
(期首) 2010年5月28日	円 9,939	% —	9,979	% —	% 11.4	% 0.6	% 82.6	% 0.1
5月末	9,935	△0.0	9,977	△0.0	10.9	0.3	85.5	0.1
6月末	9,903	△0.4	9,947	△0.3	11.5	0.3	85.0	0.1
7月末	9,988	0.5	10,041	0.6	12.5	0.2	84.0	0.1
8月末	9,933	△0.1	9,988	0.1	11.6	0.2	84.6	0.1
9月末	10,049	1.1	10,108	1.3	13.0	0.3	85.6	0.1
10月末	9,954	0.2	10,016	0.4	12.2	0.3	84.7	0.1
11月末	9,924	△0.2	9,994	0.2	13.0	0.2	84.0	0.1
12月末	9,954	0.2	10,029	0.5	12.9	0.1	84.4	0.1
2011年1月末	9,964	0.3	10,047	0.7	12.7	0.1	84.4	0.1
2月末	10,001	0.6	10,089	1.1	12.9	0.1	84.0	0.1
3月末	9,997	0.6	10,083	1.0	12.0	0.2	85.1	0.1
4月末	10,053	1.1	10,135	1.6	15.6	0.3	82.1	0.1
(期末) 2011年5月30日	10,016	0.8	10,106	1.3	12.2	0.3	84.2	0.1

(注1) 騰落率は期首比です。

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

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

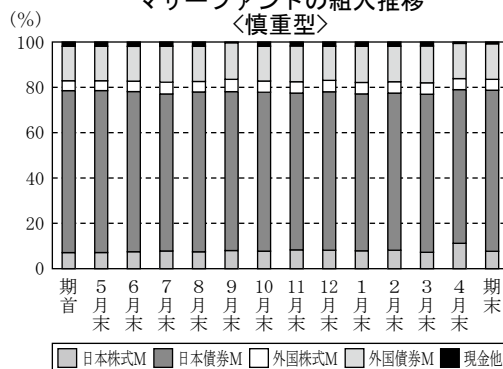
(注4) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

基準価額と合成ベンチマークの推移 〈慎重型〉



(注) 合成ベンチマークは、期首(2010年5月28日)の値が基準価額と同一になるように指数化したものです。

マザーファンドの組入推移 〈慎重型〉



LPS4資産分散ファンド(安定重視型)

年 月 日	基準価額 円	騰落率		ベンチマーク	騰落率		株式組入率 比	株式先物率 比	債券組入率 比	投資信託証券 組入比率
		%	%		%	%				
(期首) 2010年5月28日	9,779	—	%	9,802	—	%	22.8	1.2	72.5	0.2
5月末	9,774	△0.1	%	9,800	△0.0	%	21.7	0.7	74.4	0.1
6月末	9,626	△1.6	%	9,652	△1.5	%	22.8	0.6	73.6	0.2
7月末	9,761	△0.2	%	9,796	△0.1	%	24.3	0.3	72.3	0.2
8月末	9,609	△1.7	%	9,643	△1.6	%	22.8	0.5	73.5	0.2
9月末	9,815	0.4	%	9,851	0.5	%	24.5	0.6	72.2	0.2
10月末	9,682	△1.0	%	9,720	△0.8	%	23.8	0.6	72.8	0.2
11月末	9,725	△0.6	%	9,772	△0.3	%	24.9	0.4	71.8	0.2
12月末	9,747	△0.3	%	9,797	△0.0	%	24.8	0.3	72.2	0.2
2011年1月末	9,809	0.3	%	9,871	0.7	%	24.3	0.3	72.5	0.2
2月末	9,895	1.2	%	9,962	1.6	%	24.8	0.2	71.8	0.2
3月末	9,885	1.1	%	9,944	1.5	%	23.2	0.3	73.5	0.2
4月末	9,948	1.7	%	10,003	2.1	%	23.8	0.4	72.7	0.2
(期末) 2011年5月30日	9,835	0.6	%	9,902	1.0	%	23.5	0.5	72.4	0.2

(注1) 騰落率は期首比です。

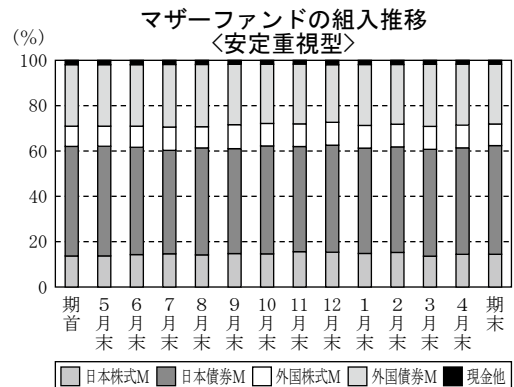
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」および「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。



(注) 合成ベンチマークは、期首(2010年5月28日)の値が基準価額と同一になるように指数化したものです。



LPS4資産分散ファンド(バランス型)

年 月 日	基準価額	騰落率		ベンチマーク	騰落率		株式組入率 比	株式先物率 比	債券組入率 比	投資信託証券 組入比率
		円	%		%	%				
(期首) 2010年5月28日	9,726	—	%	9,731	—	%	38.9	2.0	57.0	0.3
5月末	9,717	△0.1	%	9,728	△0.0	%	37.2	1.2	58.4	0.2
6月末	9,487	△2.5	%	9,497	△2.4	%	38.6	1.1	57.3	0.3
7月末	9,657	△0.7	%	9,675	△0.6	%	40.7	0.6	55.6	0.3
8月末	9,414	△3.2	%	9,429	△3.1	%	38.7	0.8	57.2	0.3
9月末	9,697	△0.3	%	9,704	△0.3	%	39.9	0.9	56.3	0.3
10月末	9,557	△1.7	%	9,567	△1.7	%	39.0	0.9	57.1	0.3
11月末	9,684	△0.4	%	9,704	△0.3	%	40.5	0.7	55.8	0.3
12月末	9,771	0.5	%	9,793	0.6	%	40.4	0.4	56.3	0.3
2011年1月末	9,860	1.4	%	9,897	1.7	%	40.0	0.4	57.2	0.2
2月末	10,009	2.9	%	10,051	3.3	%	41.2	0.4	57.1	0.2
3月末	9,931	2.1	%	9,952	2.3	%	38.2	0.5	58.1	0.3
4月末	9,982	2.6	%	9,993	2.7	%	39.1	0.6	57.2	0.3
(期末) 2011年5月30日	9,810	0.9	%	9,835	1.1	%	38.7	0.9	57.2	0.3

(注1) 騰落率は期首比です。

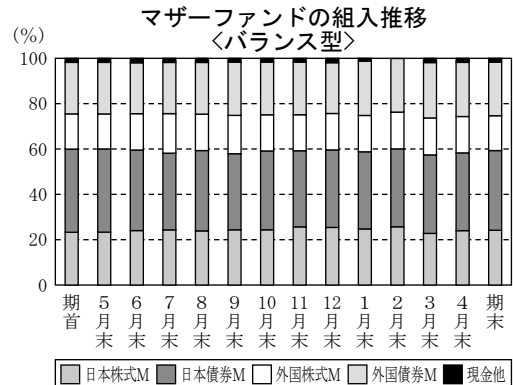
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」および「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。



(注) 合成ベンチマークは、期首(2010年5月28日)の値が基準価額と同一になるように指数化したものです。



LPS4資産分散ファンド(成長重視型)

年 月 日	基準価額	騰落率		ベンチマーク	騰落率		株式組入率 比	株式先物率 比	債券組入率 比	投資信託証券 組入比率
		円	%		円	%				
(期首) 2010年5月28日	9,689	—	%	9,674	—	%	53.7	2.8	43.0	0.4
5月末	9,678	△0.1		9,671	△0.0		51.3	1.6	44.1	0.3
6月末	9,383	△3.2		9,374	△3.1		52.7	1.5	42.8	0.4
7月末	9,579	△1.1		9,578	△1.0		55.1	0.8	41.2	0.4
8月末	9,260	△4.4		9,255	△4.3		52.9	1.1	42.9	0.4
9月末	9,607	△0.8		9,587	△0.9		54.2	1.2	41.8	0.4
10月末	9,470	△2.3		9,453	△2.3		53.3	1.2	42.6	0.4
11月末	9,669	△0.2		9,664	△0.1		54.9	1.0	41.3	0.4
12月末	9,830	1.5		9,825	1.6		54.8	0.6	41.6	0.4
2011年1月末	9,937	2.6		9,950	2.9		54.2	0.6	42.3	0.3
2月末	10,143	4.7		10,161	5.0		54.9	0.5	41.5	0.3
3月末	9,982	3.0		9,981	3.2		56.4	0.8	41.1	0.3
4月末	10,004	3.3		10,001	3.4		53.5	0.8	42.8	0.3
(期末) 2011年5月30日	9,782	1.0		9,797	1.3		53.2	1.2	42.9	0.3

(注1) 騰落率は期首比です。

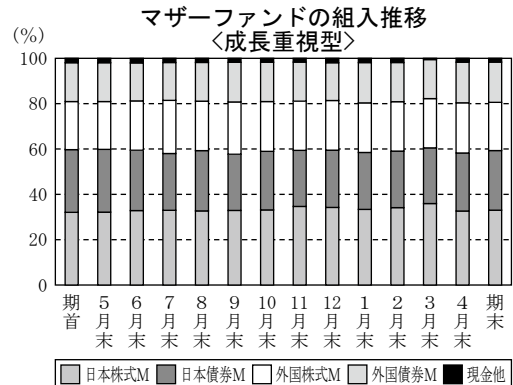
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」および「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。



(注) 合成ベンチマークは、期首(2010年5月28日)の値が基準価額と同一になるように指数化したものです。



LPS4資産分散ファンド(積極型)

年 月 日	基準価額 円	騰落率		ベンチマーク	騰落率		株式組入率 比	株式先物率 比	債券組入率 比	投資信託証券 組入比率
		%	%		%	%				
(期首) 2010年5月28日	9,643	—	%	9,617	—	%	66.6	3.4	30.3	0.4
5月末	9,629	△0.1	%	9,614	△0.0	%	63.8	2.0	30.9	0.4
6月末	9,278	△3.8	%	9,259	△3.7	%	65.2	1.8	29.9	0.4
7月末	9,496	△1.5	%	9,485	△1.4	%	67.4	0.9	28.3	0.5
8月末	9,111	△5.5	%	9,098	△5.4	%	66.1	1.4	30.2	0.5
9月末	9,515	△1.3	%	9,482	△1.4	%	67.3	1.5	28.2	0.5
10月末	9,380	△2.7	%	9,352	△2.8	%	66.7	1.5	28.8	0.5
11月末	9,645	0.0	%	9,629	0.1	%	67.9	1.2	27.9	0.4
12月末	9,874	2.4	%	9,859	2.5	%	68.0	0.7	28.1	0.4
2011年1月末	9,998	3.7	%	10,003	4.0	%	67.6	0.7	28.8	0.4
2月末	10,258	6.4	%	10,268	6.8	%	68.2	0.7	28.1	0.4
3月末	10,021	3.9	%	10,012	4.1	%	68.9	1.0	27.4	0.4
4月末	10,025	4.0	%	10,015	4.1	%	66.9	1.0	29.1	0.4
(期末) 2011年5月30日	9,758	1.2	%	9,767	1.6	%	66.7	1.5	29.3	0.4

(注1) 騰落率は期首比です。

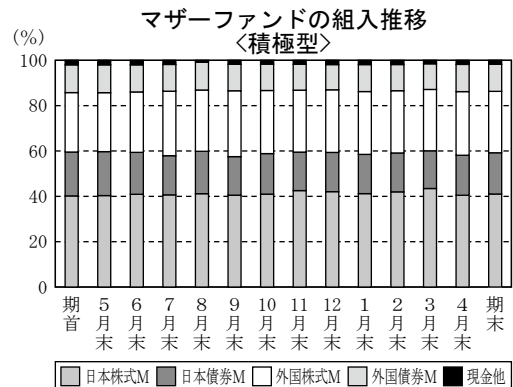
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」および「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。



(注) 合成ベンチマークは、期首(2010年5月28日)の値が基準価額と同一になるように指数化したものです。



■当期中の運用経過と今後の方針 (2010年5月29日から2011年5月30日まで)

1. 基準価額の推移と主な変動要因

「LPS4資産分散ファンド(慎重型)」、「同(安定重視型)」、「同(バランス型)」、「同(成長重視型)」、「同(積極型)」の当期末の基準価額は、それぞれ10,016円、9,835円、9,810円、9,782円、9,758円となり、前期末に比べてそれぞれ、+0.8%、+0.6%、+0.9%、+1.0%、+1.2%となりました。当ファンドは、マザーファンド(「TMA日本株TOPIXマザーファンド」、「TMA日本債券インデックスマザーファンド」、「TMA外国株式インデックスマザーファンド」、「TMA外国債券インデックスマザーファンド」)に投資しており、各マザーファンドの価額変動が、当ファンドの基準価額の主な変動要因となります。

2. 当期の投資環境

◆日本株式市況

期前半は、欧州財政危機の深刻化などから円高進行に歯止めがかからず、2010年11月初にはTOPIXが一時800ポイント割れまで下落しました。しかし、FRB(米連邦準備制度理事会)による追加金融緩和策の発表をきっかけに市場は一変し、株式市場は大きく反発しました。その後も米国において、経済指標の堅調な内容や大型減税の継続合意などから景気回復期待が強まり、上昇基調で推移しましたが、2011年2月下旬に産油国であるリビア情勢が緊迫化すると原油価格が高騰、世界経済への影響が意識され弱含みの展開になりました。3月11日、東日本大震災が発生し、被害規模に加え、原発事故による放射能漏れが発覚すると、パニック売りが加速し、TOPIXはリーマンショック後の安値水準に迫る下落となりました。しかし、円売り協調介入の実施や日銀による追加金融緩和などから上昇に転じ、その後は横ばいで推移しました。

TOPIXの推移

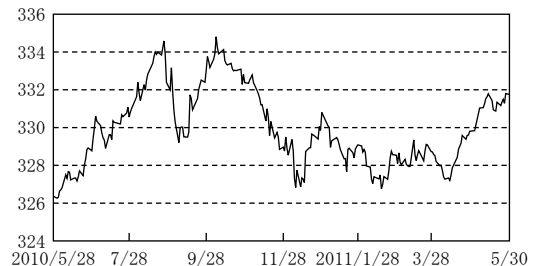


出所：Thomson Datastream

◆日本債券市況

日米とも金融当局による追加金融緩和策への思惑が高まったことから、10年国債利回りは2010年8月下旬に一時0.9%程度まで低下しました。その後、1.2%近くまで上昇しましたが、日米とも金融当局が追加金融緩和姿勢を強めたことで10年国債利回りは再び低下し、10月上旬には0.9%を下回る水準となりました。11月以降は、米国で追加金融緩和策(QE II)発表後、米国長期金利が上昇基調となったことや国内外で景況感改善を示す経済指標が発表されたことを材料に10年国債利回りも上昇基調となりました。年明け以降、東日本大震災や原発事故の影響を受け10年国債利回りが急低下する局面もありましたが、基本的には1.2-1.3%程度の狭いレンジ内で推移しました。2011年4月中旬以降は財政規律への懸念が薄らいだことや欧米長期金利が低下基調になったことなどから、10年国債利回りも低下傾向となり5月には1.1%台の水準で推移しました。

NOMURA-BPI(総合)の推移



出所：野村證券金融工学研究センター

◆外国株式市況

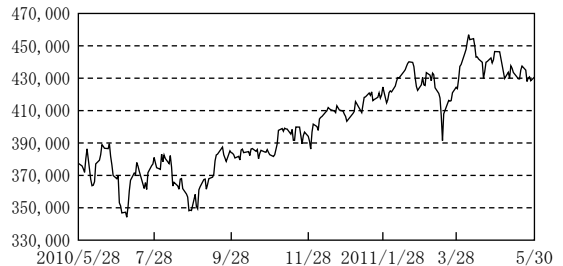
当期の米国株式市場は、景気対策としての追加金融緩和姿勢を背景に、流動性拡大期待に伴い期初から堅調な展開となりました。欧州株式市場においても北米同様、堅調なマクロ指標と企業業績が支援材料となり上昇しました。また、アジア株式市場も中国の経済成長減速懸念や不動産引き締め政策などが上値を抑えましたが、堅調な欧米市場やアジア企業業績が上昇の牽引となりました。ただし、2011年3月以降は産油国であるリビアやサウジアラビアなどの中東情勢が緊迫化したこと、東京電力福島第一原子力発電所の事故評価がレベル7（深刻な事故）に引き上げられたこと、米国の格付会社が米国債の格付け見直しを引き下げたことなどを受け横ばいで推移しました。

◆外国債券市況

期前半の米国長期金利は、欧州債務危機の深刻化や米国景気減速などを背景に低下基調で推移しました。欧州ではアイルランド、ポルトガルといった一部周辺国の金利が上昇した一方で、ドイツ、フランスなどの金利は相対的に低下しました。2010年10月以降は景気の改善期待や株式市場の上昇を背景に、世界的に長期金利は上昇しましたが、2011年4月以降は、東京電力福島第一原子力発電所の事故評価がレベル7（深刻な事故）に引き上げられたことや、ギリシャの債務再編に対する懸念などを受けて米国長期金利は再び低下しました。

為替市場では、期初から10月下旬にかけて景気減速懸念の高まりやFRBの金融緩和に対する積極スタンスなどを背景に、ドル円相場は1ドル＝80円台まで円高ドル安が進展しました。2011年3月の東日本大震災後、ドルは一時80円割れの水準となりましたが、G7（主要7カ国）による円売り協調介入もあり、4月には1ドル＝85円台まで円安ドル高が進みました。その後、ユーロ圏の財政不安による質への逃避や米国の格付会社による米国債の格付け見通しの引き下げなどを背景に再び円高ドル安が進行しました。

MSC I コクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）の推移



(注) グラフの値は基準日前日のMSC I コクサイ指数（米ドルベース）を基準日のT T Mで委託会社が円換算したものです。（出所：Fact Set）

シティグループ世界国債インデックス（除く日本／円ヘッジなし・円ベース）の推移



(注) グラフの値はシティグループ世界国債インデックス（国内投信用）です。

3. 当期の運用経過と基準価額

当ファンドの運用は主要4資産のインデックスマザーファンド受益証券を以下の「基本資産配分」を基準に、一定の範囲内で（±5%）変動幅を抑制するように運用しております。毎月初に基本資産配分からの乖離分を戻す方向のリバランスを行いました。

<基本資産配分>

	T M A 日 本 株 T O P I X マザーファンド	T M A 日 本 債 券 イ ン デ ッ ク ス マザーファンド	T M A 外 国 株 式 イ ン デ ッ ク ス マザーファンド	T M A 外 国 債 券 イ ン デ ッ ク ス マザーファンド
(慎重型)	8%	71%	5%	16%
(安定重視型)	15%	48%	10%	27%
(バランス型)	25%	35%	16%	24%
(成長重視型)	34%	26%	22%	18%
(積極型)	42%	18%	28%	12%

「LPS4資産分散ファンド(慎重型)」、「同(安定重視型)」、「同(バランス型)」、「同(成長重視型)」、「同(積極型)」の当期末の基準価額は、それぞれ10,016円、9,835円、9,810円、9,782円、9,758円となり、前期末に比べてそれぞれ、+0.8%、+0.6%、+0.9%、+1.0%、+1.2%となりました。合成ベンチマーク騰落率対比の基準価額騰落率は、それぞれ▲0.5%、▲0.4%、▲0.2%、▲0.3%、▲0.4%となりました。乖離の主たる要因は、「信託報酬などのファンド管理費用」、「各マザーファンドの組入比率と合成ベンチマークの資産配分比率とのズレ」などが考えられます。

◆TMA日本株TOPIXマザーファンド

当ファンドは、ベンチマークであるTOPIXに連動する収益率をあげることが目標として運用しています。当ファンドの基準価額は▲4.2%となり、ベンチマークは▲6.2%となりました。

◆TMA日本債券インデックスマザーファンド

当ファンドは、ベンチマークであるNOMURA-BPI（総合）に連動する収益率をあげることが目標として運用しています。当ファンドの基準価額は+1.6%となり、ベンチマークは+1.7%となりました。

◆TMA外国株式インデックスマザーファンド

当ファンドは、ベンチマークであるMSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）に連動する収益率をあげることが目標として運用しています。当ファンドの基準価額は+13.5%となり、ベンチマークは+14.1%となりました。

◆TMA外国債券インデックスマザーファンド

当ファンドは、ベンチマークであるシティグループ世界国債インデックス（除く日本/円ヘッジなし・円ベース）に連動する収益率をあげることが目標として運用しています。当ファンドの基準価額は▲1.4%となり、ベンチマークは▲1.4%となりました。

◆収益分配方針

当期については、「LPS4資産分散ファンド(慎重型)」を除きいずれも基準価額が10,000円を下回る水準であり、また金融市場の動向が依然として不透明であることを考慮し、収益分配は行わないことといたしました。留保益につきましては、引き続き当ファンドの運用方針に基づいて運用いたします。

(実際の運用は、「TMA日本株TOPIXマザーファンド」、「TMA日本債券インデックスマザーファンド」、「TMA外国株式インデックスマザーファンド」、「TMA外国債券インデックスマザーファンド」にて行っております。)

4. 今後の運用方針

主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の複数の資産に分散投資し、中長期的な信託財産の成長を目指します。資産配分は、「基本資産配分」を基準に、原則として一定の範囲(±5%)に変動幅を抑制します。各マザーファンドにおきましては、引き続き高い連動率を維持するよう運用を行う方針です。

2011年8月30日以降、基本資産配分を下記の通り変更する予定です。

- ・慎重型 外国債券のウェイトを引き下げ、日本債券、外国株式のウェイトを引き上げ。
- ・安定重視型 外国債券のウェイトを引き下げ、日本株式、日本債券、外国株式のウェイト引き上げ。
- ・バランス型 日本株式のウェイトを引き下げ、日本債券のウェイト引き上げ。
- ・成長重視型 日本株式のウェイトを引き下げ、日本債券のウェイト引き上げ。
- ・積極型 変更なし。

<基本資産配分>

	T M A 日 本 株 T O P I X マザーファンド	T M A 日 本 債 券 イ ン デ ッ ク ス マザーファンド	T M A 外 国 株 式 イ ン デ ッ ク ス マザーファンド	T M A 外 国 債 券 イ ン デ ッ ク ス マザーファンド
(慎重型)	8%	71%	5%	16%
(安定重視型)	15%	48%	10%	27%
(バランス型)	25%	35%	16%	24%
(成長重視型)	34%	26%	22%	18%
(積極型)	42%	18%	28%	12%



	T M A 日 本 株 T O P I X マザーファンド	T M A 日 本 債 券 イ ン デ ッ ク ス マザーファンド	T M A 外 国 株 式 イ ン デ ッ ク ス マザーファンド	T M A 外 国 債 券 イ ン デ ッ ク ス マザーファンド
(慎重型)	8%	72%	6%	14%
(安定重視型)	16%	51%	11%	22%
(バランス型)	24%	36%	16%	24%
(成長重視型)	33%	27%	22%	18%
(積極型)	42%	18%	28%	12%

■ 1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

LPS4資産分散ファンド(慎重型)

項 目	前 期	当 期
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行)	50円 (23) (24) (3)	68円 (31) (32) (5)
(b) 売買委託手数料 (株) (新株予約権証券) (投資信託証券) (先物・オプション)	0 (0) (0) (0) (0)	0 (0) (0) (0) (0)
(c) 有価証券取引税 (株) (新株予約権証券) (投資信託証券)	0 (0) (-) (0)	0 (0) (0) (0)
(d) 保管費用等	0	1
合 計	50	69

LPS4資産分散ファンド(成長重視型)

項 目	前 期	当 期
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行)	50円 (23) (24) (3)	66円 (30) (31) (5)
(b) 売買委託手数料 (株) (新株予約権証券) (投資信託証券) (先物・オプション)	0 (0) (0) (0) (0)	0 (0) (0) (0) (0)
(c) 有価証券取引税 (株) (新株予約権証券) (投資信託証券)	0 (0) (-) (0)	0 (0) (0) (0)
(d) 保管費用等	1	1
合 計	51	67

LPS4資産分散ファンド(安定重視型)

項 目	前 期	当 期
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行)	50円 (23) (24) (3)	67円 (31) (31) (5)
(b) 売買委託手数料 (株) (新株予約権証券) (投資信託証券) (先物・オプション)	0 (0) (0) (0) (0)	0 (0) (0) (0) (0)
(c) 有価証券取引税 (株) (新株予約権証券) (投資信託証券)	0 (0) (-) (0)	0 (0) (0) (0)
(d) 保管費用等	1	1
合 計	51	68

LPS4資産分散ファンド(積極型)

項 目	前 期	当 期
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行)	50円 (23) (24) (3)	66円 (30) (31) (5)
(b) 売買委託手数料 (株) (新株予約権証券) (投資信託証券) (先物・オプション)	0 (0) (0) (0) (0)	0 (0) (0) (0) (0)
(c) 有価証券取引税 (株) (新株予約権証券) (投資信託証券)	0 (0) (-) (0)	0 (0) (0) (0)
(d) 保管費用等	1	1
合 計	51	67

LPS4資産分散ファンド(バランス型)

項 目	前 期	当 期
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行)	50円 (23) (24) (3)	66円 (30) (31) (5)
(b) 売買委託手数料 (株) (新株予約権証券) (投資信託証券) (先物・オプション)	0 (0) (0) (0) (0)	0 (0) (0) (0) (0)
(c) 有価証券取引税 (株) (新株予約権証券) (投資信託証券)	0 (0) (-) (0)	0 (0) (0) (0)
(d) 保管費用等	1	1
合 計	51	67

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

(a) 信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 売買委託手数料、有価証券取引税および保管費用等は、このファンドが組み入れている親投資信託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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況(2010年5月29日から2011年5月30日まで)

LPS4資産分散ファンド(慎重型)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
TMA日本株TOPIXマザーファンド	1,361	799	1,222	723
TMA日本債券インデックスマザーファンド	5,698	6,332	5,124	5,621
TMA外国株式インデックスマザーファンド	563	479	518	493
TMA外国債券インデックスマザーファンド	1,514	1,511	1,362	1,369

(注) 単位未満は切り捨てています。

LPS4資産分散ファンド(安定重視型)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
TMA日本株TOPIXマザーファンド	901	532	242	150
TMA日本債券インデックスマザーファンド	1,064	1,173	232	255
TMA外国株式インデックスマザーファンド	384	324	211	184
TMA外国債券インデックスマザーファンド	727	712	195	193

(注) 単位未満は切り捨てています。

LPS4資産分散ファンド(バランス型)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
TMA日本株TOPIXマザーファンド	4,157	2,516	396	248
TMA日本債券インデックスマザーファンド	2,938	3,233	195	215
TMA外国株式インデックスマザーファンド	1,692	1,513	297	267
TMA外国債券インデックスマザーファンド	2,328	2,265	228	225

(注) 単位未満は切り捨てています。

LPS4資産分散ファンド(成長重視型)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
TMA日本株TOPIXマザーファンド	2,594	1,543	782	470
TMA日本債券インデックスマザーファンド	966	1,065	356	391
TMA外国株式インデックスマザーファンド	925	810	400	348
TMA外国債券インデックスマザーファンド	757	742	211	202

(注) 単位未満は切り捨てています。

LPS4資産分散ファンド(積極型)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
TMA日本株TOPIXマザーファンド	2,365	1,418	232	139
TMA日本債券インデックスマザーファンド	539	594	76	83
TMA外国株式インデックスマザーファンド	948	863	139	120
TMA外国債券インデックスマザーファンド	401	393	52	50

(注) 単位未満は切り捨てています。

■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	前 期		当 期	
	TMA日本株TOPIX マザーファンド	TMA外国株式インデックス マザーファンド	TMA日本株TOPIX マザーファンド	TMA外国株式インデックス マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	35,077,719千円	54,054,161千円	48,801,571千円	67,380,737千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	138,470,176千円	215,837,273千円	131,851,922千円	204,208,580千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.25	0.25	0.37	0.32

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2010年5月29日から2011年5月30日まで)

(1) 利害関係人との取引状況

期中における利害関係人との取引はありません。

(注) 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。

(2) TMA日本株TOPIXマザーファンドにおける利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期 末 保 有 額
	買 付 額	売 付 額	
株 式	百万円 200	百万円 187	百万円 958

(注) 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東京海上ホールディングス株式会社です。

■自社による当ファンドの設定・解約の状況 (2010年5月29日から2011年5月30日まで)

	期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取 引 の 理 由
(慎 重 型)	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
(安 定 重 視 型)	1	—	—	1	
(バ ラ ン ス 型)	1	—	—	1	
(成 長 重 視 型)	1	—	—	1	
(積 極 型)	1	—	—	1	

■組入資産の明細 (2011年5月30日現在)

親投資信託残高

LPS4資産分散ファンド(慎重型)

	期首(前期末)			当期末		
	口	数	評 価 額	口	数	評 価 額
		千口	千円		千口	千円
TMA日本株TOPIXマザーファンド		118	70		257	146
TMA日本債券インデックスマザーファンド		650	709		1,224	1,358
TMA外国株式インデックスマザーファンド		52	43		97	91
TMA外国債券インデックスマザーファンド		150	151		302	299

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨てています。

LPS4資産分散ファンド(安定重視型)

	期首(前期末)			当期末		
	口	数	評 価 額	口	数	評 価 額
		千口	千円		千口	千円
TMA日本株TOPIXマザーファンド		1,364	813		2,023	1,155
TMA日本債券インデックスマザーファンド		2,631	2,872		3,463	3,841
TMA外国株式インデックスマザーファンド		644	530		816	763
TMA外国債券インデックスマザーファンド		1,604	1,612		2,136	2,116

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨てています。

LPS4資産分散ファンド(バランス型)

	期首(前期末)			当期末		
	口	数	評 価 額	口	数	評 価 額
		千口	千円		千口	千円
TMA日本株TOPIXマザーファンド		683	407		4,445	2,537
TMA日本債券インデックスマザーファンド		588	642		3,331	3,694
TMA外国株式インデックスマザーファンド		330	272		1,724	1,612
TMA外国債券インデックスマザーファンド		396	398		2,496	2,474

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨てています。

LPS4資産分散ファンド(成長重視型)

	期首(前期末)			当期末		
	口	数	評 価 額	口	数	評 価 額
		千口	千円		千口	千円
TMA日本株TOPIXマザーファンド		2,166	1,291		3,977	2,270
TMA日本債券インデックスマザーファンド		1,020	1,113		1,630	1,808
TMA外国株式インデックスマザーファンド		1,037	854		1,562	1,460
TMA外国債券インデックスマザーファンド		685	688		1,231	1,220

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨てています。

LPS4資産分散ファンド(積極型)

	期首(前期末)			当期末		
	口	数	評 価 額	口	数	評 価 額
		千口	千円		千口	千円
TMA日本株TOPIXマザーファンド		716	426		2,849	1,626
TMA日本債券インデックスマザーファンド		188	205		651	722
TMA外国株式インデックスマザーファンド		337	278		1,147	1,072
TMA外国債券インデックスマザーファンド		129	130		477	473

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨てています。

LPS4資産分散ファンド(慎重型)

■投資信託財産の構成

(2011年5月30日現在)

項 目	期 首 (前期末)		当 期 末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
	千円	%	千円	%
TMA日本株TOPIXマザーファンド	70	7.1	146	7.6
TMA日本債券インデックスマザーファンド	709	71.3	1,358	70.2
TMA外国株式インデックスマザーファンド	43	4.4	91	4.7
TMA外国債券インデックスマザーファンド	151	15.2	299	15.5
コール・ローン等、その他	22	2.0	40	2.0
投資信託財産総額	995	100.0	1,934	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切り捨てています。

(注2) TMA外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(207,267,074千円)の投資信託財産総額(207,389,576千円)に対する比率は99.9%です。

(注3) TMA外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(314,195,688千円)の投資信託財産総額(314,993,856千円)に対する比率は99.7%です。

(注4) 外貨建資産は、期首、期末の時価をわが国の対顧客電売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=80.88円、1カナダドル=82.77円、1メキシコペソ=6.97円、1ユーロ=115.60円、1英ポンド=133.31円、1スイスフラン=95.03円、1スウェーデンクローネ=13.01円、1ノルウェークローネ=14.89円、1デンマーククローネ=15.50円、1ポーランドズロチ=29.16円、1豪ドル=86.57円、1ニュージーランドドル=66.36円、1香港ドル=10.40円、1シンガポールドル=65.52円、1マレーシアリンギット=26.79円、1イスラエルシェケル=23.35円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2010年5月28日)、(2011年5月30日)現在

項 目	期 首(前期末)	当 期 末
(A) 資 産	995,509円	1,934,262円
コール・ローン等	20,339	37,876
TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)	70,633	146,741
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	709,882	1,358,456
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	43,440	91,334
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	151,215	299,855
(B) 負 債	1,606	22,162
未払信託報酬	1,606	21,904
その他未払費用	—	258
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	993,903	1,912,100
元 本	1,000,000	1,908,956
次 期 繰 越 損 益 金	△ 6,097	3,144
(D) 受 益 権 総 口 数	1,000,000口	1,908,956口
1万円当たり基準価額(C/D)	9,939円	10,016円

(注1) 当ファンドの期首元本額は1,000,000円、期中追加設定元本額は8,804,375円、期中一部解約元本額は7,895,419円です。

(注2) 当期末の1口当たり純資産額は1.0016円です。

■損益の状況

前期(自2009年9月2日 至2010年5月28日)
当期(自2010年5月29日 至2011年5月30日)

項 目	前 期	当 期
(A) 配 当 等 収 益	—円	3円
受 取 利 息	—	3
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 1,201	29,214
売 買 益	14,551	84,839
売 買 損	△15,752	△55,625
(C) 信 託 報 酬 等	△ 4,896	△32,836
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 6,097	△ 3,619
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	—	△ 836
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	—	7,599
(配 当 等 相 当 額)	(—)	(14,295)
(売 買 損 益 相 当 額)	(—)	(△ 6,696)
(G) 計 (D+E+F)	△ 6,097	3,144
(H) 収 益 配 分 配 金	0	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△ 6,097	3,144
追 加 信 託 差 損 益 金	—	7,599
(配 当 等 相 当 額)	(—)	(30,241)
(売 買 損 益 相 当 額)	(—)	(△22,642)
分 配 準 備 積 立 金	8,066	5,148
繰 越 損 益 金	△14,163	△ 9,603

(注1) 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2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 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。

(注4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,041円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(30,241円)および分配準備積立金(1,107円)より分配対象収益は35,389円(1万円当たり185円)ですが、当期に分配した金額はありません。

LPS4資産分散ファンド(安定重視型)

■投資信託財産の構成

(2011年5月30日現在)

項 目	期 首 (前期末)		当 期 末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
	千円	%	千円	%
TMA日本株TOPIXマザーファンド	813	13.7	1,155	14.4
TMA日本債券インデックスマザーファンド	2,872	48.3	3,841	47.8
TMA外国株式インデックスマザーファンド	530	8.9	763	9.5
TMA外国債券インデックスマザーファンド	1,612	27.1	2,116	26.3
コール・ローン等、その他	124	2.0	160	2.0
投資信託財産総額	5,951	100.0	8,035	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切り捨てています。

(注2) TMA外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(207,267,074千円)の投資信託財産総額(207,389,576千円)に対する比率は99.9%です。

(注3) TMA外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(314,195,688千円)の投資信託財産総額(314,993,856千円)に対する比率は99.7%です。

(注4) 外貨建資産は、期首、期末の時価をわが国の対顧客電売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=80.88円、1カナダドル=82.77円、1メキシコペソ=6.97円、1ユーロ=115.60円、1英ポンド=133.31円、1スイスフラン=95.03円、1スウェーデンクローネ=13.01円、1ノルウェークローネ=14.89円、1デンマーククローネ=15.50円、1ポーランドズロチ=29.16円、1豪ドル=86.57円、1ニュージーランドドル=66.36円、1香港ドル=10.40円、1シンガポールドル=65.52円、1マレーシアリンギット=26.79円、1イスラエルシェケル=23.35円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2010年5月28日)、(2011年5月30日)現在

項 目	期 首 (前期末)	当 期 末
(A) 資 産	5,951,541円	8,035,550円
コール・ローン等	123,417	159,283
TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)	813,162	1,155,133
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	2,872,151	3,841,012
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	530,748	763,506
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	1,612,063	2,116,616
(B) 負 債	9,902	25,655
未払信託報酬	9,814	25,308
その他未払費用	88	347
(C) 純資産総額(A-B)	5,941,639	8,009,895
元 本	6,075,969	8,144,643
次期繰越損益金	△ 134,330	△ 134,748
(D) 受益権総口数	6,075,969口	8,144,643口
1万円当たり基準価額(C/D)	9,779円	9,835円

(注1) 当ファンドの期首元本額は6,075,969円、期中追加設定元本額は2,068,674円、期中一部解約元本額は0円です。

(注2) 当期末の1口当たり純資産額は0.9835円です。

(注3) 当期末の元本の欠損は134,748円です。

■損益の状況

前期(自2009年9月2日 至2010年5月28日)
当期(自2010年5月29日 至2011年5月30日)

項 目	前 期	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1円	-円
受 取 利 息	1	-
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 92,905	88,341
売 買 益	43,777	150,409
売 買 損	△ 136,682	△ 62,068
(C) 信 託 報 酬 等	△ 19,327	△ 47,511
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 112,231	40,830
(E) 前期繰越損益金	-	△ 112,231
(F) 追加信託差損益金	△ 22,099	△ 63,347
(配当等相当額)	(-)	(26,874)
(売買損益相当額)	(△ 22,099)	(△ 90,221)
(G) 計 (D+E+F)	△ 134,330	△ 134,748
(H) 収 益 分 配 金	0	0
次期繰越損益金(G+H)	△ 134,330	△ 134,748
追加信託差損益金	△ 22,099	△ 63,347
(配当等相当額)	(8,693)	(30,357)
(売買損益相当額)	(△ 30,792)	(△ 93,704)
分配準備積立金	44,698	150,158
繰 越 損 益 金	△ 156,929	△ 221,559

(注1) 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2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 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。

(注4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(105,460円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(30,357円)および分配準備積立金(44,698円)より分配対象収益は180,515円(1万円当たり221円)ですが、当期に分配した金額はありません。

LPS4資産分散ファンド(バランス型)

■投資信託財産の構成

(2011年5月30日現在)

項 目	期 首 (前期末)		当 期 末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
	千円	%	千円	%
TMA日本株TOPIXマザーファンド	407	23.2	2,537	24.1
TMA日本債券インデックスマザーファンド	642	36.6	3,694	35.1
TMA外国株式インデックスマザーファンド	272	15.5	1,612	15.3
TMA外国債券インデックスマザーファンド	398	22.7	2,474	23.5
コール・ローン等、その他	35	2.0	211	2.0
投資信託財産総額	1,754	100.0	10,528	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切り捨てています。

(注2) TMA外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(207,267,074千円)の投資信託財産総額(207,389,576千円)に対する比率は99.9%です。

(注3) TMA外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(314,195,688千円)の投資信託財産総額(314,993,856千円)に対する比率は99.7%です。

(注4) 外貨建資産は、期首、期末の時価をわが国の対顧客電売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=80.88円、1カナダドル=82.77円、1メキシコペソ=6.97円、1ユーロ=115.60円、1英ポンド=133.31円、1スイスフラン=95.03円、1スウェーデンクローネ=13.01円、1ノルウェークローネ=14.89円、1デンマーククローネ=15.50円、1ポーランドズロチ=29.16円、1豪ドル=86.57円、1ニュージーランドドル=66.36円、1香港ドル=10.40円、1シンガポールドル=65.52円、1マレーシアリンギット=26.79円、1イスラエルシェケル=23.35円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2010年5月28日)、(2011年5月30日)現在

項 目	期 首(前期末)	当 期 末
(A) 資 産	1,754,304円	10,528,101円
コール・ローン等	33,821	209,802
TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)	407,616	2,537,274
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	642,695	3,694,823
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	272,039	1,612,179
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	398,133	2,474,023
(B) 負 債	2,373	25,141
未払信託報酬	2,373	24,845
その他未払費用	—	296
(C) 純資産総額(A-B)	1,751,931	10,502,960
元 本	1,801,377	10,706,865
次期繰越損益金	△ 49,446	△ 203,905
(D) 受益権総口数	1,801,377口	10,706,865口
1万円当たり基準価額(C/D)	9,726円	9,810円

(注1) 当ファンドの期首元本額は1,801,377円、期中追加設定元本額は9,453,063円、期中一部解約元本額は547,575円です。

(注2) 当期末の1口当たり純資産額は0.9810円です。

(注3) 当期末の元本の欠損は203,905円です。

■損益の状況

前期(自2009年9月2日 至2010年5月28日)
当期(自2010年5月29日 至2011年5月30日)

項 目	前 期	当 期
(A) 配 当 等 収 益	—円	3円
受 取 利 息	—	3
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△45,497	20,108
売 買 益	11,814	175,602
売 買 損	△57,311	△155,494
(C) 信 託 報 酬 等	△ 5,723	△ 33,235
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△51,220	△ 13,124
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	—	△ 45,085
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,774	△145,696
(配 当 等 相 当 額)	(—)	(72,321)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,774)	(△218,017)
(G) 計 (D+E+F)	△49,446	△203,905
(H) 収 益 分 配 金	0	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△49,446	△203,905
追 加 信 託 差 損 益 金	1,774	△145,696
(配 当 等 相 当 額)	(1,253)	(89,345)
(売 買 損 益 相 当 額)	(521)	(△235,041)
分 配 準 備 積 立 金	12,812	88,895
繰 越 損 益 金	△64,032	△147,104

(注1) 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2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 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。

(注4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(77,619円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(89,345円)および分配準備積立金(11,276円)より分配対象収益は178,240円(1万円当たり166円)ですが、当期に分配した金額はありません。

LPS4資産分散ファンド(成長重視型)

■投資信託財産の構成

(2011年5月30日現在)

項 目	期 首 (前期末)		当 期 末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
	千円	%	千円	%
TMA日本株TOPIXマザーファンド	1,291	32.0	2,270	32.9
TMA日本債券インデックスマザーファンド	1,113	27.6	1,808	26.2
TMA外国株式インデックスマザーファンド	854	21.2	1,460	21.2
TMA外国債券インデックスマザーファンド	688	17.1	1,220	17.7
コール・ローン等、その他	86	2.1	138	2.0
投資信託財産総額	4,032	100.0	6,896	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切り捨てています。

(注2) TMA外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(207,267,074千円)の投資信託財産総額(207,389,576千円)に対する比率は99.9%です。

(注3) TMA外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(314,195,688千円)の投資信託財産総額(314,993,856千円)に対する比率は99.7%です。

(注4) 外貨建資産は、期首、期末の時価をわが国の対顧客電売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=80.88円、1カナダドル=82.77円、1メキシコペソ=6.97円、1ユーロ=115.60円、1英ポンド=133.31円、1スイスフラン=95.03円、1スウェーデンクローネ=13.01円、1ノルウェークローネ=14.89円、1デンマーククローネ=15.50円、1ポーランドズロチ=29.16円、1豪ドル=86.57円、1ニュージーランドドル=66.36円、1香港ドル=10.40円、1シンガポールドル=65.52円、1マレーシアリングット=26.79円、1イスラエルシェケル=23.35円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2010年5月28日)、(2011年5月30日)現在

項 目	期 首 (前期末)	当 期 末
(A) 資 産	4,032,640円	6,896,619円
コール・ローン等	83,929	136,603
TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)	1,291,566	2,270,636
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	1,113,767	1,808,724
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	854,531	1,460,543
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	688,847	1,220,113
(B) 負 債	5,399	21,018
未払信託報酬	5,336	20,835
その他未払費用	63	183
(C) 純資産総額(A-B)	4,027,241	6,875,601
元 本	4,156,362	7,028,643
次期繰越損益金	△ 129,121	△ 153,042
(D) 受益権総口数	4,156,362口	7,028,643口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,689円	9,782円

(注1) 当ファンドの期首元本額は4,156,362円、期中追加設定元本額は3,385,628円、期中一部解約元本額は513,347円です。

(注2) 当期末の1口当たり純資産額は0.9782円です。

(注3) 当期末の元本の欠損は153,042円です。

■損益の状況

前期(自2009年9月2日 至2010年5月28日)
当期(自2010年5月29日 至2011年5月30日)

項 目	前 期	当 期
(A) 有価証券売買損益	△159,353円	62,760円
売 買 益	20,078	172,500
売 買 損	△179,431	△109,740
(B) 信託報酬等	△ 8,805	△ 36,432
(C) 当期損益金(A+B)	△168,158	26,328
(D) 前期繰越損益金	—	△155,419
(E) 追加信託差損益金	39,037	△ 23,951
(配当等相当額)	(—)	(40,368)
(売買損益相当額)	(39,037)	(△ 64,319)
(F) 計(C+D+E)	△129,121	△153,042
(G) 収益分配金	0	0
次期繰越損益金(F+G)	△129,121	△153,042
追加信託差損益金	39,037	△ 23,951
(配当等相当額)	(12,579)	(46,480)
(売買損益相当額)	(26,458)	(△ 70,431)
分配準備積立金	24,912	105,056
繰越損益金	△193,070	△234,147

(注1) 損益の状況の中で(A)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(B)信託報酬等には消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 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4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(82,031円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(46,480円)および分配準備積立金(23,025円)より分配対象収益は151,536円(1万口当たり215円)ですが、当期に分配した金額はありません。

LPS4資産分散ファンド(積極型)

■投資信託財産の構成

(2011年5月30日現在)

項 目	期 首 (前期末)		当 期 末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
	千円	%	千円	%
TMA日本株TOPIXマザーファンド	426	40.1	1,626	40.9
TMA日本債券インデックスマザーファンド	205	19.3	722	18.2
TMA外国株式インデックスマザーファンド	278	26.1	1,072	27.0
TMA外国債券インデックスマザーファンド	130	12.2	473	11.9
コール・ローン等、その他	24	2.3	80	2.0
投資信託財産総額	1,063	100.0	3,973	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切り捨てています。

(注2) TMA外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(207,267,074千円)の投資信託財産総額(207,389,576千円)に対する比率は99.9%です。

(注3) TMA外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(314,195,688千円)の投資信託財産総額(314,993,856千円)に対する比率は99.7%です。

(注4) 外貨建資産は、期首、期末の時価をわが国の対顧客電売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=80.88円、1カナダドル=82.77円、1メキシコペソ=6.97円、1ユーロ=115.60円、1英ポンド=133.31円、1スイスフラン=95.03円、1スウェーデンクローネ=13.01円、1ノルウェークローネ=14.89円、1デンマーククローネ=15.50円、1ポーランドズロチ=29.16円、1豪ドル=86.57円、1ニュージーランドドル=66.36円、1香港ドル=10.40円、1シンガポールドル=65.52円、1マレーシアリンギット=26.79円、1イスラエルシェケル=23.35円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2010年5月28日)、(2011年5月30日)現在

項 目	期 首(前期末)	当 期 末
(A) 資 産	1,063,269円	3,973,338円
コール・ローン等	23,054	78,497
TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)	426,863	1,626,440
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	205,335	722,616
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	278,002	1,072,306
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	130,015	473,479
(B) 負 債	1,783	8,568
未払信託報酬	1,783	8,529
その他未払費用	-	39
(C) 純資産総額(A-B)	1,061,486	3,964,770
元 本	1,100,840	4,062,988
次期繰越損益金	△ 39,354	△ 98,218
(D) 受益権総口数	1,100,840口	4,062,988口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,643円	9,758円

(注1) 当ファンドの期首元本額は1,100,840円、期中追加設定元本額は3,095,209円、期中一部解約元本額は133,061円です。

(注2) 当期末の1口当たり純資産額は0.9758円です。

(注3) 当期末の元本の欠損は98,218円です。

■損益の状況

前期(自2009年9月2日 至2010年5月28日)
当期(自2010年5月29日 至2011年5月30日)

項 目	前 期	当 期
(A) 有価証券売買損益	△34,282円	△ 19,857円
売 買 益	6,403	64,070
売 買 損	△40,685	△ 83,927
(B) 信託報酬等	△ 5,115	△ 12,590
(C) 当期損益金(A+B)	△39,397	△ 32,447
(D) 前期繰越損益金	-	△ 37,657
(E) 追加信託差損益金	43	△ 28,114
(配当等相当額)	(-)	(30,705)
(売買損益相当額)	(43)	(△ 58,819)
(F) 計(C+D+E)	△39,354	△ 98,218
(G) 収益分配金	0	0
次期繰越損益金(F+G)	△39,354	△ 98,218
追加信託差損益金	43	△ 28,114
(配当等相当額)	(135)	(37,742)
(売買損益相当額)	(△ 92)	(△ 65,856)
分配準備積立金	11,045	40,757
繰越損益金	△50,442	△110,861

(注1) 損益の状況の中で(A)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(B)信託報酬等には消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 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4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(30,200円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(37,742円)および分配準備積立金(10,557円)より分配対象収益は78,499円(1万口当たり193円)ですが、当期に分配した金額はありません。

〈補足情報〉

■組入資産の明細 (2011年5月30日現在)

(1) 下記は、TMA日本株TOPIXマザーファンド全体(232,309,479千口)の内容です。

国内株式

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				
日本水産	138.7	37,171	138.7	32,594
マルハニチロホールディングス	228	31,008	228	26,676
サカタのタネ	26.6	30,590	26.6	30,324
ホクト	14.6	25,082	11.6	20,497
鉱業 (0.7%)				
日鉄鉱業	42	14,112	47	16,215
国際石油開発帝石	0.6	342,000	1.337	758,079
関東天然瓦斯開発	26	12,298	26	11,648
石油資源開発	20.2	84,133	20.4	76,398
建設業 (2.2%)				
ショーボンドホールディングス	13	23,621	13	24,999
ミライト・ホールディングス	—	—	55.3	33,677
東急建設	58.96	13,501	58.96	12,263
コムシスホールディングス	55.5	42,513	65.5	51,286
ミサワホーム	29.2	11,972	57.1	27,408
ヤマウラ	55	10,670	55	10,780
大成建設	588	102,900	639	115,659
大林組	328	117,424	396	135,036
清水建設	335	104,855	377	125,918
長谷工コーポレーション	701.5	62,433	845.5	47,348
鹿島建設	537	115,455	586	133,022
前田建設工業	114	28,842	84	21,000
奥村組	119	37,485	129	37,152
東鉄工業	35	18,410	35	24,150
戸田建設	137	41,374	149	43,806
大東建託	52.2	239,598	51.5	340,930
NIPPPO	42	28,812	42	24,108
前田道路	35	24,255	43	30,358
五洋建設	—	—	75	13,800
大林道路	20	3,880	50	8,600
住友林業	96.1	69,288	81.5	58,109
日本基礎技術	74.6	13,950	56.6	17,489
パナホーム	41	22,058	61	32,452
大和ハウス工業	303	265,731	328	321,112
積水ハウス	362	299,012	398	303,674
ユアテック	44	15,312	44	16,676
西部電気工業	56	17,976	56	18,368
中電工	20.2	21,088	28.2	25,549
関電工	49	26,656	69	24,150
大明	34	20,910	—	—
きんでん	83	64,491	87	56,724
東京エネシス	26	15,054	26	10,608
トーエネック	48	22,704	48	19,632
日本電設工業	30	23,940	30	24,150
協和エクシオ	46.2	33,171	49.2	37,244
新日本空調	29.5	17,139	29.5	11,593
東電通	89	12,994	—	—
九電工	—	—	33	14,850
三機工業	36	24,372	66	28,380

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
日揮	123	176,628	135	287,145
中外炉工業	53	11,872	53	14,469
ヤマト	90	25,110	90	27,900
太平電業	21	13,713	31	19,282
高砂熱学工業	37	28,823	46	28,336
N E C ネットズエスアイ	23.3	25,932	18.3	18,080
大気社	19.3	24,105	22.9	37,510
日比谷総合設備	23.5	18,236	23.5	17,766
東芝プラントシステム	20	22,300	20	16,080
東洋エンジニアリング	85	22,865	85	24,395
千代田化工建設	91	65,338	80	68,720
新興ブランテック	25.4	19,558	25.4	20,980
食料品 (3.1%)				
日本製粉	81	34,425	68	25,160
日清製粉グループ本社	120.5	121,584	121	118,943
ユニ・チャーム ペットケア	9.7	36,860	—	—
日本甜菜製糖	14	2,702	59	10,325
三井製糖	88	25,608	108	37,800
森永製菓	134	25,996	134	24,388
中村屋	60	25,620	60	21,240
江崎グリコ	45	43,920	48	42,720
山崎製パン	98	109,172	98	98,980
森永乳業	110	38,060	89	30,794
ヤクルト本社	71.1	158,695	70.4	155,865
明治ホールディングス	38.7	126,742	39.8	133,131
雪印メグミルク	23.7	36,616	20.2	28,724
日本ハム	89	99,057	92	102,580
伊藤ハム	81	24,867	101	30,805
丸大食品	—	—	35	8,750
米久	29	23,548	29	16,791
サッポロホールディングス	194	77,406	200	60,800
アサヒビール	228.4	346,939	245.6	381,662
キリンホールディングス	531	649,944	531	588,879
宝ホールディングス	102	47,328	102	40,698
コカ・コーラウエスト	34.7	50,280	43.7	66,904
コカ・コーラ セントラル ジャパン	27.4	29,455	19.9	20,934
ダイドードリンコ	5.7	17,499	5.7	17,242
伊藤園	34.3	43,904	39.3	53,841
キーコーヒー	17.4	26,100	17.4	24,638
ジャパンフーズ	16.4	12,792	16.4	12,677
日清オイリオグループ	60	26,520	60	22,200
不二製油	34.3	41,468	25.5	29,809
J-オイルミルズ	98	26,068	88	21,560
キッコーマン	99	92,565	109	88,726
味の素	326	251,346	360	328,680
キュービー	68.6	66,679	70.6	68,623
ハウス食品	49.7	63,417	48.2	63,479
カゴメ	47.7	71,359	49.8	70,267
アリアケジャパン	21.1	29,223	15.1	21,925
ニチレイ	134	46,632	135	45,765

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
東洋水産	56	111,608	59	110,271
日清食品ホールディングス	42.4	127,200	47.9	137,999
永谷園	34	28,526	34	27,472
フジッコ	24	24,000	24	22,896
ロック・フィールド	19.5	23,497	19.5	23,595
日本たばこ産業	2.692	773,411	2.734	853,008
繊維製品 (1.0%)				
片倉工業	20.7	16,725	20.7	16,663
グンゼ	85	24,650	106	28,938
東洋紡績	440	61,600	485	55,775
日清紡ホールディングス	79	67,071	84	62,664
倉敷紡績	173	24,912	173	25,604
日本毛織	42	25,704	40	25,440
帝国繊維	57	26,448	57	27,417
帝人	434	110,670	470	170,610
東レ	756	348,516	958	579,590
日本フェルト	28.1	11,183	28.1	10,453
日本バイロン	44	16,940	44	15,972
セーレン	27.7	13,683	37.7	19,151
小松精練	42	13,986	42	14,322
ワコールホールディングス	64	66,816	75	73,350
ホギメディカル	6	27,150	7.1	24,140
三陽商会	52	15,912	70	16,660
オンワードホールディングス	72	48,168	87	50,634
東京スタイル	40	28,080	50	27,850
デサント	37	18,574	37	12,284
パルプ・紙 (0.3%)				
特種東海製紙	74	15,910	74	11,396
王子製紙	506	217,580	529	187,266
三菱製紙	197	20,882	197	15,366
北越紀州製紙	75.5	32,767	75.5	35,711
大王製紙	56	37,352	56	31,136
日本製紙グループ本社	51.6	132,663	58.5	98,280
レンゴー	88	46,728	98	52,920
ザ・バック	14.3	20,692	14.3	18,375
化学 (6.1%)				
クラレ	163.5	183,447	178.2	211,701
旭化成	657	310,104	727	379,494
共和レザー	9.8	3,234	9.8	2,606
昭和電工	751	135,931	852	137,172
住友化学	764	288,792	853	337,788
住友精化	62	19,406	52	22,152
日産化学工業	79	84,846	85	69,785
クレハ	80	36,240	90	32,310
石原産業	279	19,251	259	25,123
片倉チッカリン	54	14,796	54	11,556
日本曹達	61	19,642	74	22,718
東ソー	296	72,224	319	102,080
トクヤマ	196	92,316	202	78,982
セントラル硝子	115	42,090	107	38,092
東亜合成	127	49,276	136	55,624
ダイソー	83	18,675	83	21,580
電気化学工業	247	103,740	267	110,271
信越化学工業	186.2	863,037	205.8	848,925
堺化学工業	51	18,819	56	21,392
エア・ウォーター	94	94,188	98	93,296

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
大陽日酸	165	118,635	160	98,720
日本パーカラライジング	24	27,000	30	33,150
四国化成工業	55	25,355	55	24,750
戸田工業	36	21,708	46	33,580
ステラ ケミファ	6.1	18,727	6.1	16,756
日本触媒	67	55,677	100	99,400
カネカ	154	85,624	159	85,065
三菱瓦斯化学	187	92,939	199	119,400
三井化学	441	123,480	552	145,176
J S R	111.4	184,589	102.5	160,822
東京応化工業	20.2	32,865	25.3	43,288
三菱ケミカルホールディングス	650.5	279,715	726	391,314
ダイセル化学工業	144	90,288	170	86,870
住友ベークライト	102	48,960	117	59,787
積水化学工業	229	128,927	258	163,056
日本ゼオン	98	51,450	120	83,400
アイカ工業	32.3	30,911	32.3	34,367
宇部興産	545	121,535	524	128,380
積水樹脂	16	12,912	16	12,848
旭有機材工業	43	9,116	43	9,288
日立化成工業	52.3	93,094	51.2	81,561
群栄化学工業	113	25,312	113	24,069
タイガースポリマー	22.6	6,915	22.6	8,452
日本化薬	90	66,240	94	71,064
A D E K A	47.5	39,995	48.5	37,102
日油	108	38,124	98	33,516
ハリマ化成	45	21,060	45	27,180
花王	308.4	600,146	338.6	690,405
三洋化成工業	40	21,200	40	24,480
日本ペイント	101	58,782	109	65,182
関西ペイント	138	101,568	139	99,107
中国塗料	35	21,875	35	22,540
太陽ホールディングス	8.6	19,573	11.1	26,162
D I C	369	56,088	486	93,798
東洋インキSCホールディングス	102	34,068	121	45,254
富士フィルムホールディングス	238.9	645,985	263.4	618,726
資生堂	205	357,725	202.7	277,090
ライオン	145	63,510	139	60,187
高砂香料工業	42	16,842	55	21,505
マンダム	12	29,352	14.3	29,872
ファンケル	22.1	27,271	28.1	29,392
コーセー	16.3	34,653	24.3	47,992
ドクターシーラボ	0.131	28,872	0.096	33,360
ポーラ・オルビスホールディングス	—	—	13	24,271
エステー	18.9	18,843	18.9	16,083
長谷川香料	17.8	23,193	17.8	21,128
小林製薬	17.5	63,962	16.6	63,329
荒川化学工業	25.6	25,011	25.6	17,638
メック	17.7	8,814	17.7	6,690
荏原ユージライト	9.1	13,941	3.4	8,744
アース製薬	9.6	25,027	9.6	26,256
イハラケミカル工業	70	15,960	50	12,300
大成ラミック	9.1	18,655	9.1	19,747
クミアイ化学工業	56	12,656	61	13,359
日本農薬	34	15,436	54	19,656
日東電工	93.3	303,691	102.5	431,525

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
レック	10.3	13,699	10.3	12,432
アロン化成	69	22,011	36	18,144
前澤化成工業	21.9	17,870	21.9	16,206
エフビコ	6.4	28,352	6.4	29,760
天馬	23.7	22,941	23.7	18,723
信越ポリマー	23.5	13,442	32.5	12,967
ニフコ	23.9	45,171	22.5	45,652
日本バルカー工業	53	10,123	63	14,553
ユニ・チャーム	22.6	203,626	68.1	227,454
医薬品 (4.8%)				
協和発酵キリン	150	131,550	150	117,750
武田薬品工業	425	1,593,750	463.6	1,761,680
アステラス製薬	239.9	692,111	275.5	855,427
大日本住友製薬	92	65,504	90.7	68,841
塩野義製薬	165.6	267,278	178.5	240,439
田辺三菱製薬	99	116,325	103	140,183
あすか製薬	24	15,072	31	18,507
日本新薬	30	29,040	25	25,450
中外製薬	120.5	190,269	123.6	162,904
科研製薬	56	42,672	57	64,923
エーザイ	139.9	416,902	150.6	462,342
ロート製薬	53	54,325	59	51,153
小野薬品工業	56.3	201,554	61.7	255,746
久光製薬	33.6	111,552	35.1	119,866
持田製薬	44	35,728	46	39,836
大正製薬	97	163,348	96	173,184
参天製薬	36.3	107,919	39.9	127,081
日本ケミファ	46	14,352	46	12,558
ツムラ	35.8	88,354	32.2	81,337
日医工	—	—	19	37,791
キッセイ薬品工業	22	38,280	26	40,508
生化学工業	23.6	20,602	30.6	27,234
鳥居薬品	11.1	15,295	7.3	11,840
東和薬品	5.2	28,184	6.4	29,248
沢井製薬	6.8	50,184	8.7	68,556
ゼリア新薬工業	15	13,290	20	19,580
第一三共	358.6	568,022	413.5	641,338
キョーリン製薬ホールディングス	29	35,554	36	55,584
大塚ホールディングス	—	—	287.1	608,652
石油・石炭製品 (0.9%)				
昭和シェル石油	124.4	79,989	116.6	89,782
コスモ石油	312	81,432	352	82,720
ニチレキ	32	13,664	32	11,360
東燃ゼネラル石油	164	127,920	189	183,897
AOCホールディングス	35.7	21,312	44.7	21,813
出光興産	12.6	84,420	14.7	128,037
JXホールディングス	1,167.6	569,788	1,379.7	710,545
ゴム製品 (0.7%)				
横浜ゴム	135	56,430	142	59,924
東洋ゴム工業	121	24,563	136	24,344
ブリヂストン	354.5	522,887	389.4	704,424
住友ゴム工業	85.7	69,674	85.7	78,758
オカモト	76	26,752	76	22,572
ニッタ	13.4	19,537	13.4	20,193
東海ゴム工業	23.5	26,061	28.5	26,733
三ツ星ベルト	41	16,031	29	10,962

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
バンドー化学	37	10,693	37	10,915
ガラス・土石製品 (1.4%)				
日東紡績	110	22,220	140	25,480
旭硝子	550	530,200	612	574,668
日本板硝子	344	82,560	538	140,956
日本山村硝子	33	7,821	108	21,816
日本電気硝子	201	237,783	259	291,893
住友大阪セメント	204	36,720	244	50,508
太平洋セメント	427	51,667	552	82,800
日本ヒューム	51	12,954	51	16,269
東海カーボン	106	49,184	120	52,320
日本カーボン	80	22,000	120	24,480
東洋炭素	5.5	22,715	5.6	25,200
ノリタケカンパニーリミテド	82	22,878	67	19,564
TOTO	174	99,180	178	103,240
日本碍子	136	224,672	147	205,212
日本特殊陶業	97	110,774	110	117,260
MARUWA	9.8	17,943	4.6	15,272
ニチアス	—	—	60	26,400
ニチハ	14.7	12,642	11.7	8,014
鉄鋼 (2.2%)				
新日本製鐵	3,182	1,008,694	3,225	761,100
住友金属工業	2,056	470,824	2,265	371,460
神戸製鋼所	1,568	290,080	1,698	295,452
日新製鋼	424	70,384	489	71,883
合同製鐵	112	22,960	167	32,899
ジェイ エフ イー ホールディングス	242.6	733,865	291	582,582
東京製鐵	53.7	54,398	66.7	51,225
共英製鋼	14.9	19,817	18.9	23,851
大和工業	29.7	72,378	30	76,380
大阪製鐵	17.1	20,485	17.1	25,906
淀川製鋼所	80	27,360	100	32,500
東洋鋼板	34	15,504	34	12,512
住友鋼管	15.6	7,675	15.6	8,252
丸一鋼管	33.7	54,627	42.7	84,759
大同特殊鋼	190	70,110	215	104,705
日本冶金工業	62.5	19,500	98.5	21,079
山陽特殊製鋼	57	23,997	77	37,268
愛知製鋼	69	25,737	54	28,350
日立金属	65	58,435	81	84,240
大太平洋金属	80	55,600	93	51,522
日本電工	50	30,550	75	37,200
三菱製鋼	65	11,830	92	23,460
シンニッタン	46.1	12,815	35.6	11,748
非鉄金属 (1.4%)				
日本軽金属	284	36,068	284	46,008
三井金属鉱業	318	83,634	372	96,720
東邦亜鉛	70	25,760	95	35,530
三菱マテリアル	666	163,170	764	187,944
住友金属鉱山	296	379,472	344	439,976
DOWAホールディングス	130	62,270	154	74,690
古河機械金属	259	25,641	371	30,793
大阪チタニウムテクノロジーズ	11.8	35,754	14.2	88,182
東邦チタニウム	18.5	33,485	21.8	54,347
古河電気工業	356	139,196	396	114,840
住友電気工業	371.5	402,334	434.2	496,290

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
フジクラ	167	74,148	181	63,893
タツタ電線	80	15,920	67	28,542
日立電線	93	23,064	118	23,718
リョービ	65	20,020	80	24,560
アサヒホールディングス	16.8	28,879	20.1	32,461
金属製品 (0.8%)				
トーカロ	9.7	16,664	5.2	8,418
SUMCO	65.4	108,302	76.8	110,668
東洋製罐	85.3	121,040	89	109,648
コロナ	15.8	14,457	15.8	12,355
横河ブリッジホールディングス	40	21,600	50	23,900
駒井ハルテック	44	9,328	44	8,888
三和ホールディングス	119	33,082	119	31,416
文化シヤッター	43	10,148	43	9,030
住生活グループ	147.8	259,389	150.5	296,485
ノーリツ	27.2	42,350	27.2	38,705
長府製作所	14.3	26,955	17.3	32,679
リンナイ	19.3	87,429	20.1	112,560
日東精工	45	12,285	45	9,585
三洋工業	64	8,192	—	—
東プレ	27.8	18,153	27.8	19,098
高周波熱錬	24.4	15,396	24.4	14,981
東京製綱	85	17,765	98	31,164
パイオラックス	5.4	9,093	5.4	9,374
日本発條	83	71,629	93	72,912
三益半導体工業	15.3	17,533	26.8	24,522
機械 (5.3%)				
日本製鋼所	180	154,980	198	112,860
日立ツール	21.5	21,672	21.5	18,511
三浦工業	18.3	38,905	20.8	45,968
タクマ	61	12,749	81	31,185
ツガミ	28	16,212	38	18,886
オークマ	74	40,848	86	60,372
東芝機械	59	21,830	84	33,348
アマダ	182	121,394	177	103,191
アイデンエンジニアリング	32.8	12,037	32.8	10,692
牧野フライス製作所	51	28,203	63	45,234
オーエスジー	48.5	46,026	51.5	52,993
旭ダイヤモンド工業	29	34,336	26	45,370
森精機製作所	50.6	46,956	68.6	70,658
ディスコ	11.3	69,495	13.5	70,065
日東工器	7	12,313	7	13,139
島精機製作所	12.3	26,887	18.3	40,022
日阪製作所	12	10,200	20	18,360
やまびこ	11.3	9,435	—	—
ナブテスコ	45	54,225	46.7	84,480
レオン自動機	73	17,812	73	12,848
SMC	35.9	421,466	37	476,190
新川	19	26,068	19	12,825
ユニオンツール	8.8	20,521	8.8	15,488
オイレス工業	18	23,940	18	26,892
サトー	13.5	13,594	13.5	13,986
小松製作所	501.8	860,085	587	1,416,431
住友重機械工業	236	122,248	324	178,200
日立建機	51.5	95,687	55	93,500
巴工業	11.5	12,546	11.5	19,688

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
井関農機	148	35,372	148	25,900
クボタ	467	351,184	521	366,784
月島機械	28	17,528	22	15,378
帝国電機製作所	9.6	15,379	9.6	13,804
新東工業	25.6	17,152	25.6	19,123
澁谷工業	27.8	19,599	27.8	22,740
小森コーポレーション	30.8	29,229	37.8	26,422
住友精密工業	57	17,100	35	23,905
荏原製作所	220	88,000	227	96,702
西島製作所	10.1	15,877	25.1	28,990
ダイキン工業	126.5	388,355	131.2	346,630
オルガノ	24	14,952	24	14,712
栗田工業	63.5	150,558	66.2	149,810
椿本チエイン	66	26,202	66	29,370
ダイフク	46.5	28,737	54	26,082
タダノ	53	22,154	68	29,308
フジテック	36	17,496	36	15,228
シーケーディ	33.1	24,129	33.1	23,865
平和	23.6	21,004	23.6	29,311
SANKYO	32.5	128,375	34.5	144,727
日本金銭機械	14	10,388	14	8,876
福島工業	17.3	11,452	17.3	16,348
アマノ	36	27,576	27	19,629
サンデン	58	15,312	113	40,567
マックス	20	18,080	20	20,360
グローリー	31.4	64,527	29.1	49,149
大和冷機工業	38	16,150	38	14,820
セガサミーホールディングス	125.2	144,981	117.8	182,354
リケン	62	18,848	62	21,080
ホシザキ電機	22.5	32,175	22.5	35,370
大豊工業	27.1	20,189	24.9	17,878
日本精工	217	143,220	268	201,804
NTN	256	99,072	284	118,144
ジェイテクト	108.3	103,426	128.3	133,432
不二越	115	28,175	123	52,890
日本トムソン	43	24,381	43	27,907
THK	71.1	132,601	78.3	152,841
ユーション精機	14	19,558	10	15,320
キッツ	48	19,536	63	26,208
日立工機	32.5	28,210	40	27,920
マキタ	70.5	177,166	77.6	258,408
日立造船	502	57,228	497	57,155
三菱重工業	1,803	602,202	1,988	747,488
IHI	799	125,443	818	160,328
電気機器 (14.7%)				
イビデン	77.2	213,844	72.4	188,602
コニカミルタホールディングス	247	248,235	310.5	209,898
ブラザー工業	151.2	151,804	152.5	173,392
ミネベア	153	78,948	168	68,040
日立製作所	2,460	910,200	2,659	1,209,845
東芝	2,439	1,148,769	2,339	984,719
三菱電機	998	745,506	1,181	1,051,090
富士電機	283	71,033	362	85,794
東洋電機製造	36	16,992	38	14,364
安川電機	126	90,090	129	111,972
シンフォニアテクノロジー	80	14,640	—	—

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
明電舎	109	40,112	128	45,056
東芝テック	85	27,710	81	29,889
マブチモーター	16.1	74,140	16.5	65,010
日本電産	51.7	431,178	58.7	422,053
高岳製作所	70	21,350	102	25,704
ダイヘン	60	22,140	80	24,000
オムロン	128.3	244,539	133.1	273,121
日東工業	17	15,079	17	14,246
エルピーダメモリ	111.8	183,687	106.8	116,732
ジェス・ユアサ コーポレーション	222	136,974	232	119,016
メルコホールディングス	7.6	18,658	8.6	18,653
日本電気	1,391	354,705	1,552	260,736
富士通	1,116	652,860	1,142	479,640
沖電気工業	362	30,770	362	24,254
サンケン電気	72	25,632	73	37,303
アイホン	16.2	21,918	16.2	21,060
ルネサスエレクトロニクス	24.1	23,087	35.7	25,632
セイコーエプソン	87.9	111,633	82.5	110,302
ワコム	0.254	34,239	0.334	31,997
アルバック	18.6	36,270	22.4	45,113
ナナオ	12.9	25,322	12.9	20,098
日本信号	40.2	27,657	47.2	28,556
能美防災	29	15,428	29	12,876
ホーチキ	34	15,946	34	13,124
マスプロ電工	30	24,480	30	19,080
パナソニック	1,058.5	1,238,445	1,377.8	1,290,998
シャープ	526	526,000	522	386,280
アンリツ	56	19,376	59	38,999
富士通ゼネラル	65	28,600	65	31,265
日立国際電気	28	23,632	48	30,096
ソニー	576.1	1,634,971	664.3	1,409,644
TDK	55.7	297,438	67.1	278,465
三洋電機	1,220	162,260	—	—
ミツミ電機	35	57,540	46	39,560
タムラ製作所	45	11,340	90	23,310
アルプス電気	89.4	72,414	98.1	79,755
パイオニア	50	16,750	165	57,255
日本電波工業	7.7	13,505	16.7	19,338
日本トリム	5.25	9,324	5.25	10,053
フォスター電機	11.1	26,595	20.1	32,803
SMK	45	18,585	60	19,680
ヨコオ	15.4	8,808	15.4	7,777
ホシデン	28.5	28,927	27.5	19,497
ヒロセ電機	18.5	160,580	18.7	152,218
日本航空電子工業	16	10,032	31	16,957
アルパイン	25	27,675	42	45,066
アイコム	6.7	15,966	6.7	14,224
船井電機	9.4	33,699	15.8	38,804
横河電機	119.3	76,113	123.5	77,064
山武	30.3	65,993	33.3	58,408
日本光電工業	18.3	32,885	24.3	45,781
堀場製作所	19.2	48,230	22.3	54,746
アドバンテスト	80.8	165,963	82	122,098
キーエンス	21.7	437,038	26.4	554,664
日置電機	13.2	23,205	13.2	21,384
シスメックス	19.7	101,652	42.3	119,751

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
メガチップス	20.4	26,050	16.4	22,336
日本電産コバル電子	20.4	14,300	20.4	10,546
ミヤチテクノス	15.6	9,796	10.1	6,221
コーセル	16.4	19,860	16.4	21,221
オブテックス	10.2	9,710	10.2	10,730
千代田インテグレ	6.4	7,673	6.4	6,553
スタンレー電気	73.8	124,648	78.2	104,397
岩崎電気	115	20,815	—	—
ウシオ電機	68.1	96,770	72.9	115,182
ヘリオス テクノ ホールディング	27.4	7,096	27.4	5,644
日本セラムック	16.3	20,049	9.3	15,103
日本デジタル研究所	—	—	10	9,090
双信電機	14.9	5,736	14.9	6,183
図研	31	20,584	31	16,895
日本電子	59	18,880	59	15,104
カシオ計算機	124.5	76,567	107.5	62,350
ファナック	111.4	1,075,010	123.2	1,511,664
日本シイエムケイ	21	11,382	31	8,401
エンプラス	10.3	17,231	10.3	10,609
ローム	53.3	310,739	58.2	268,011
浜松ホトニクス	41.2	101,063	46.7	151,074
三井ハイテック	18.6	12,164	18.6	6,882
新光電気工業	28.1	37,204	33.3	25,774
京セラ	88.9	709,422	98	823,200
太陽誘電	43	51,557	56	59,864
村田製作所	120.5	538,635	124.3	633,930
双葉電子工業	20.4	31,946	20.4	28,560
北陸電気工業	69	12,075	69	10,488
パナソニック電工	193	181,806	—	—
ニチコン	36.1	37,363	36.1	42,706
日本ケミコン	74	27,380	71	35,571
KOA	19.2	16,627	13.2	11,550
小糸製作所	54	78,570	61	75,213
スター精密	22.5	20,587	22.5	19,305
大日本スクリーン製造	117	50,193	138	94,530
キヤノン電子	11.4	25,068	14.4	28,137
キヤノン	669.9	2,505,426	733.8	2,806,785
リコー	318	416,262	351	311,337
日本電産サンキョー	26	18,876	26	14,170
東京エレクトロン	91.3	491,194	91.5	408,090
輸送用機器 (10.6%)				
トヨタ紡織	35.5	53,711	44.5	55,447
ユニプレス	18.2	26,062	18.2	33,251
豊田自動織機	96.6	226,237	106.4	256,530
モリタホールディングス	41	18,245	41	19,229
デンソー	255.1	626,015	259.2	734,832
東海理化電機製作所	27.6	50,066	27.1	40,216
三井造船	445	93,005	464	81,664
佐世保重工業	90	15,840	90	12,240
川崎重工業	847	221,914	927	266,976
日本車輛製造	54	22,950	66	21,714
近畿車輛	35	16,590	47	15,134
日産自動車	1,297.7	859,077	1,494.3	1,186,474
いすゞ自動車	737	209,308	696	256,128
トヨタ自動車	1,483.5	4,895,550	1,515.2	5,045,616
日野自動車	137	62,335	152	66,120

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
三菱自動車工業	2,385	279,045	2,488	231,384
武蔵精密工業	14.2	27,477	15.2	30,080
トヨタ車体	23.7	29,506	19.9	24,914
日産車体	49	30,380	41	24,149
関東自動車工業	24.2	17,690	32.4	17,074
新明和工業	53	17,808	71	21,797
極東開発工業	40	12,320	40	16,480
日信工業	17.6	25,168	25.6	34,355
トビー工業	114	21,432	144	28,800
ティラド	44	11,440	24	7,776
曙ブレーキ工業	52.5	22,575	67.5	26,392
NOK	57.3	83,944	59.3	80,410
フタバ産業	20	14,060	36	17,640
カヤバ工業	80	26,160	79	43,450
カルソニックカンセイ	101	27,876	91	35,399
ケーヒン	22.4	37,363	27.4	45,758
アイシン精機	95.9	245,312	97	287,023
マツダ	699	164,964	921	186,042
ダイハツ工業	115	94,990	126	168,588
今仙電機製作所	—	—	13	13,325
本田技研工業	921.9	2,561,038	996.3	3,018,789
スズキ	217.4	397,407	242.9	430,175
富士重工業	360	186,120	381	219,075
ヤマハ発動機	159.8	212,374	176.4	250,664
ショーワ	25	14,450	32.9	17,469
エクセディ	15.2	34,139	15.2	40,523
豊田合成	33.6	78,556	33.6	58,262
愛三工業	10.1	6,989	17.1	13,218
ヨロズ	15.1	19,614	13.1	22,322
エフ・シー・シー	12.8	22,246	17.8	33,036
シマノ	43.9	161,332	49.2	203,196
タカタ	17.9	36,480	20.4	47,430
テイ・エス テック	20.6	32,300	25.6	35,840
精密機器 (1.5%)				
テルモ	84.2	359,955	93.4	419,833
クリエートメディック	17.8	15,076	17.8	14,275
日機装	35	23,170	45	28,800
島津製作所	125	82,875	140	99,400
愛知時計電機	64	16,448	—	—
東京精密	21.5	30,250	25.5	41,310
ニコン	200.5	352,880	208.8	387,115
トプコン	36.4	17,253	36.4	14,632
オリンパス	128.2	301,270	138.2	339,695
理研計器	39.2	22,892	39.2	25,597
タムロン	12.1	15,947	16.1	29,141
H O Y A	250.3	544,652	270.6	446,760
ノーリツ鋼機	19.3	13,046	19.3	8,627
日本電産コバル	11	14,949	23	21,896
シチズンホールディングス	121.1	66,483	132	59,532
ニプロ	24.2	40,656	18.7	29,695
その他製品 (2.0%)				
パンダイナムホールディングス	132.5	108,252	136.7	124,397
トッパン・フォームズ	31.6	29,356	46.6	28,565
フジシルインターナショナル	17.1	32,438	17.1	26,847
タカラトミー	43	29,025	34	24,854
タカノ	20.5	11,664	20.5	9,471

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
大建工業	40	8,560	40	10,400
凸版印刷	324	246,888	334	203,072
大日本印刷	326	361,208	364	329,420
日本写真印刷	18.5	50,357	19.3	28,834
アシックス	99	79,497	112	138,992
ローランド	10.2	10,087	15.2	12,585
小松ウオール工業	15.1	13,439	15.1	11,038
ヤマハ	79	74,023	96.9	87,016
クリナップ	18.4	9,531	18.4	8,868
ビジョン	7.2	22,176	10.5	28,402
パラマウントベッド	20.9	35,467	15.9	35,504
キングジム	29.7	21,562	29.7	18,651
リンテック	26.8	43,576	26.8	62,015
イトーキ	47.1	12,811	79.1	14,000
任天堂	60.8	1,627,008	67.6	1,235,728
三菱鉛筆	10.7	13,514	12.2	18,312
タカラスタンダード	54	29,268	54	31,212
コクヨ	61.6	48,417	62.6	36,572
岡村製作所	47	25,239	36	16,920
美津濃	54	21,114	67	24,053
ユニハアー	20.4	20,298	20.4	14,973
電気・ガス業 (2.9%)				
東京電力	679.1	1,530,691	784.5	255,747
中部電力	364	764,400	362.1	456,608
関西電力	441.4	918,994	483	653,499
中国電力	161.9	277,496	160.4	182,535
北陸電力	113.5	209,294	117	158,301
東北電力	268.7	483,660	296.6	277,321
四国電力	117.6	281,534	115.5	192,076
九州電力	236.4	438,758	257.2	313,012
北海道電力	98.5	181,043	109.4	127,779
沖縄電力	8.1	38,232	8.1	26,284
電源開発	70.2	189,259	71	134,616
東京瓦斯	1,354	538,892	1,463	491,568
大阪瓦斯	1,174	362,766	1,144	320,320
東邦瓦斯	310	139,810	310	115,940
北海道瓦斯	86	20,726	86	22,360
西部瓦斯	134	32,428	134	23,316
静岡瓦斯	50.5	27,623	50.5	22,674
陸運業 (3.4%)				
東武鉄道	463	217,147	615	186,345
相鉄ホールディングス	169	64,727	169	37,856
東京急行電鉄	591	213,351	643	211,547
京浜急行電鉄	295	223,315	302	165,496
小田急電鉄	344	251,808	376	235,376
京王電鉄	299	167,141	311	136,840
京成電鉄	158	78,210	191	84,804
東日本旅客鉄道	200.9	1,165,220	205.8	959,028
西日本旅客鉄道	0.941	301,590	1.095	336,165
東海旅客鉄道	0.921	666,804	1.019	640,951
西日本鉄道	162	56,700	149	51,107
近畿日本鉄道	987	264,516	1,054	249,798
阪急阪神ホールディングス	738	295,938	781	248,358
南海電気鉄道	240	84,720	242	73,326
京阪電気鉄道	257	94,062	260	86,320
名糖運輸	20.2	15,109	20.2	11,392

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
名古屋鉄道	406	100,282	403	83,018
日本通運	459	184,518	464	142,448
ヤマトホールディングス	220	271,040	241.4	292,335
山九	128	49,152	143	49,192
丸運	29.3	6,358	29.3	5,742
センコー	—	—	60	16,260
トナミホールディングス	75	13,650	75	10,275
日本梱包運輸倉庫	29	28,797	32	24,992
日本石油輸送	65	12,155	65	13,260
福山通運	74	31,598	84	33,684
セイノーホールディングス	80	50,560	96	54,528
日立物流	18.9	24,116	24.9	29,880
海運業 (0.5%)				
日本郵船	796	261,088	998	296,406
商船三井	521	338,650	584	247,616
川崎汽船	316	117,236	372	98,952
NSユニテッド海運	40	10,720	90	14,130
飯野海運	53.4	26,005	65.4	22,563
第一中央汽船	68	18,428	158	22,910
空運業 (0.3%)				
全日本空輸	1,562	424,864	1,559	369,483
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
三菱倉庫	79	82,871	88	76,560
三井倉庫	69	23,736	49	14,357
住友倉庫	78	31,746	78	28,158
東陽倉庫	68	12,988	68	11,696
安田倉庫	16.5	8,580	16.5	7,392
上組	127	87,249	134	92,058
キムラユニティ	10	6,920	10	6,520
キューソー流通システム	14.3	11,482	14.3	12,054
郵船ロジスティクス	12.5	16,412	12.5	16,687
近鉄エクスプレス	9	19,575	12.7	33,070
情報・通信業 (6.1%)				
新日鉄ソリューションズ	13.7	25,071	8.4	12,079
ITホールディングス	38.5	41,734	38.5	26,834
グリー	—	—	53	92,167
コーエーテックホールディングス	29.7	18,265	29.7	18,651
ドワンゴ	0.155	23,606	0.083	15,222
マクロミル	0.151	19,267	32.6	24,547
ティーガイア	0.178	22,356	0.153	22,904
ザッパラス	—	—	0.07	7,679
インターネットイニシアティブ	0.088	18,163	0.088	25,036
パソナックエンジニアリングシステムズ	10.5	21,976	10.5	23,173
野村総合研究所	63.5	130,746	65.9	109,987
シンプレクス・ホールディングス	0.443	24,985	0.323	11,337
フジ・メディア・ホールディングス	1.216	159,174	1.201	130,188
オービック	3.61	63,211	3.66	54,753
ヤフー	6.131	195,885	8.351	223,890
トレンドマイクロ	47	125,490	53	128,048
日本オラクル	17.7	75,136	18.4	64,308
フューチャーアーキテクト	0.289	9,060	0.289	9,840
ソフトバンク・テクノロジー	14.6	10,366	14.6	8,657
伊藤忠テクノソリューションズ	16.4	53,546	16.4	44,804
大塚商会	8.9	52,599	9.5	44,650
サイボウズ	0.392	12,661	0.392	6,609
電通国際情報サービス	28.9	17,253	28.9	14,681

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
ウェザーニューズ	16.9	18,133	13.9	25,450
ネットワンシステムズ	0.287	33,435	0.287	42,619
エイベックス・グループ・ホールディングス	—	—	20	21,960
日本ユニシス	33.5	22,043	63.5	28,892
兼松エレクトロニクス	26.4	21,516	26.4	22,123
東京放送ホールディングス	64	83,584	67.4	63,693
日本テレビ放送網	10.26	126,711	10.15	115,202
テレビ朝日	0.276	37,122	0.273	31,449
テレビ東京	5	9,055	—	—
スカパーJ SATホールディングス	0.856	27,606	1.036	32,634
テレビ東京ホールディングス	—	—	5	4,860
イー・アクセス	0.596	37,488	0.676	24,741
NECモバイルリング	10.8	24,375	10.8	28,112
日本電信電話	449.6	1,672,512	437.1	1,663,165
KDDI	1.773	739,341	1.815	1,036,365
光通信	18.1	29,684	14.1	25,295
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	9.455	1,290,607	9.599	1,430,251
ゼンリン	28.2	28,482	34.2	25,410
角川グループホールディングス	11.1	21,844	11.1	27,639
松竹	65	49,075	76	45,372
東宝	86.7	123,547	74.2	95,495
東映	46	18,860	46	16,146
エヌ・ティ・ティ・データ	0.696	233,508	0.826	208,812
DTS	13.8	14,462	28.8	22,838
スクウェア・エニックス・ホールディングス	31.1	52,185	33.6	42,974
カブコン	22.6	35,730	26.6	42,506
住商情報システム	16.9	22,662	16.9	20,482
アイネス	26.4	16,843	26.4	12,962
T K C	12.6	19,857	8.6	14,172
富士ソフト	15	24,225	15	16,965
NSD	25.5	25,117	25.5	18,258
コナミ	44.6	67,524	56.7	92,647
ソフトバンク	466.2	1,029,369	516.6	1,567,881
卸売業 (5.4%)				
伊藤忠食品	7.8	21,668	7.8	21,340
エレマテック	14.3	15,200	14.3	14,471
JALUX	11.4	6,931	11.4	7,888
双日	778.3	117,523	811.8	116,899
アルフレッサ ホールディングス	27.6	117,024	31.4	90,808
横浜冷凍	48	30,432	48	25,200
あい ホールディングス	52.4	16,506	52.4	17,606
UKCホールディングス	14.7	16,419	15.2	12,220
JFE商事ホールディングス	69	29,187	116	40,368
エコートレーディング	9.3	8,556	9.3	6,556
ナガイレバン	11.4	23,655	11.4	24,601
菱食	12.7	25,412	15.2	26,144
松田産業	14.7	21,035	18.7	22,570
メディカルホールディングス	118.2	123,755	112.7	79,678
アドヴァン	10.2	5,701	10.2	7,058
ドウシシャ	6	12,006	13.5	25,434
黒田電気	26.9	34,136	26.9	23,564
ガリバーインターナショナル	3.84	10,560	4.52	13,921
進和	12.2	12,285	12.2	10,528
オーハシテクニカ	28.5	16,587	28.5	14,905
マクニカ	14.5	26,419	8	14,704
白銅	4.7	4,253	4.7	3,764

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
伊藤忠商事	735.5	557,509	815	669,115
丸紅	876	450,264	1,024	559,104
長瀬産業	61	59,719	60	54,960
豊田通商	101.9	129,514	134.5	172,025
兼松	475	35,150	417	32,109
三井物産	917.9	1,212,545	1,005.1	1,366,936
日本紙パルプ商事	104	31,408	104	28,600
日立ハイテクノロジーズ	34.7	60,898	37.9	63,027
山善	51.5	19,003	61.5	30,073
住友商事	582.4	580,652	645.1	680,580
内田洋行	39	9,360	39	9,204
三菱商事	852.6	1,768,292	934.4	1,887,488
キャノンマーケティングジャパン	40.7	54,334	40.7	35,327
西華産業	110	20,570	135	27,810
菱洋エレクトロ	—	—	17	13,923
東京産業	65.5	15,785	65.5	15,589
阪和興業	112	39,872	112	37,296
菱電商事	31	14,725	31	14,725
岩谷産業	125	31,500	125	34,500
すてきなイスグループ	57	11,115	57	9,576
イワキ	78	17,082	78	14,352
三菱石油	51	18,105	49	20,580
稲畑産業	38.5	16,670	52.5	24,885
東邦ホールディングス	26.5	37,020	40	31,200
サンゲツ	19.7	36,976	18.6	35,005
シナネン	36	13,068	51	16,371
伊藤忠エネクス	—	—	19	7,942
サンリオ	27.5	24,420	34	105,910
リョーサン	17.2	38,424	15.1	25,821
モスフードサービス	18.6	27,286	18.6	27,528
加賀電子	23.5	20,821	23.5	20,750
立花エレテック	29.1	18,536	29.1	21,330
トラスコ中山	21.4	28,954	16.9	24,251
オートバックスセブン	14.7	46,966	13.5	43,335
加藤産業	17.3	22,922	21.3	29,862
富士エレクトロニクス	14.5	14,398	10.5	13,083
杉本商事	18.6	13,708	18.6	13,466
因幡電機産業	12.7	27,368	10.2	20,869
ミスミグループ本社	36.7	62,500	41.1	78,788
スズケン	39.9	127,680	49.2	91,069
ジェコス	36.5	11,899	36.5	12,264
小売業 (3.7%)				
ローソン	32.1	123,264	40.6	162,197
エービーシー・マート	10.9	34,280	14.9	48,723
ハードオフコーポレーション	25	9,750	25	9,875
アスクル	17.6	29,990	17.6	20,521
ゲオ	0.333	34,365	0.333	34,698
ポイント	10.19	52,886	9.64	34,414
エディオン	46	35,972	45.5	31,258
パルス	0.114	11,240	0.114	8,265
あみやき亭	0.038	8,512	0.063	14,357
ハニーズ	11.42	11,933	20.42	17,050
D C Mホールディングス	59.5	30,761	71.5	36,322
J. フロント リテイリング	266	125,020	273	88,998
ドトール・日レスホールディングス	26.2	33,929	26.2	24,785
マツトキヨシホールディングス	21.7	39,776	24.7	43,620

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
三越伊勢丹ホールディングス	195.8	183,268	235.4	173,960
ブックオフコーポレーション	15.8	13,619	15.8	10,775
あさひ	—	—	15.5	24,397
サークルKサンクス	26.4	31,020	27.4	33,976
セブン&アイ・ホールディングス	453.4	953,046	486	1,025,460
ツルハホールディングス	9.7	29,245	11.7	43,290
サンマルクホールディングス	2	6,630	6	18,330
ライトオン	24.9	17,056	24.9	10,433
良品計画	11.8	43,896	13	47,515
三城ホールディングス	21.6	15,120	21.6	17,452
ワタミ	20.3	32,967	20.3	30,328
ドン・キホーテ	20	47,100	23.5	65,847
西松屋チェーン	30.3	27,391	44.3	29,370
ゼンショー	45.2	36,928	47.7	46,412
サイゼリヤ	17.3	30,015	17.3	24,566
ユナイテッドアローズ	21.3	22,578	21.3	32,141
京都きもの友禅	20.1	17,064	20.1	17,768
荳番屋	5.2	11,570	5.2	12,490
スギホールディングス	15.1	28,131	18.1	35,150
ファミリーマート	35.9	105,294	39.8	113,748
木曽路	18.4	32,476	18.4	29,587
千趣会	37	17,760	37	17,908
ケーヨー	43.1	19,093	43.1	18,274
上新電機	28	25,088	28	22,848
ベスト電器	35	8,155	35	7,175
マルエツ	36	12,564	48	13,680
島忠	25.6	43,750	22.1	42,321
チヨダ	23.6	26,856	23.6	26,290
ライフコーポレーション	1.9	2,585	1.9	2,323
カスミ	40	18,160	40	17,840
AOKIホールディングス	12.3	16,162	15.8	19,181
オークワ	25	21,975	25	21,650
コメリ	16.1	33,439	16.1	34,969
青山商事	24.9	38,619	28.9	37,974
しまむら	12.8	105,728	11.6	85,724
高島屋	141	112,518	157	81,012
松屋	22	18,964	52	21,216
エイチ・ツー・オー リテイリング	59	33,630	59	35,518
ニッセンホールディングス	34.3	11,387	45.3	22,378
パルコ	35.1	25,236	35.1	22,464
丸井グループ	119.7	76,847	158.6	88,340
ダイエー	52.45	20,927	79.85	22,597
イズミヤ	48	19,344	48	15,312
イオン	368.9	347,872	412.4	382,294
ユニエ	84.9	59,005	100.4	67,870
イズミ	31.2	37,377	31.2	34,944
平和堂	23.7	26,733	23.7	22,799
フジ	17.3	26,624	17.3	30,413
ヤオコー	7.9	19,544	7.9	18,928
ゼビオ	20.6	34,917	20.6	34,463
ケーズホールディングス	22	46,684	29	87,870
ヤマダ電機	52.19	332,450	52.47	330,036
ニトリホールディングス	21.1	152,553	23.35	164,150
吉野家ホールディングス	0.34	30,566	0.352	35,024
ブレナス	20.8	24,627	20.8	26,166
アークス	22.9	25,373	22.9	28,098

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
パロウ	29.4	20,344	37.4	39,606
ファーストリテイリング	26.6	343,406	26.9	310,695
サンドラッグ	22.4	47,465	22.9	54,616
ベルーナ	45.15	18,872	37.15	19,689
銀行業 (9.0%)				
新生銀行	496	46,128	806	66,898
あおぞら銀行	362	41,630	432	75,168
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,112.9	3,602,127	8,818.6	3,289,337
りそなホールディングス	305.6	351,440	728.5	254,975
三井住友トラスト・ホールディングス	593	190,946	2,214	606,636
三井住友フィナンシャルグループ	811.1	2,212,680	887.2	2,071,612
第四銀行	158	44,714	165	37,950
北越銀行	130	18,590	130	20,410
西日本シティ銀行	363	90,750	417	92,991
札幌北洋ホールディングス	156.7	52,494	178.1	59,485
千葉銀行	420	232,680	457	214,790
横浜銀行	725	316,825	794	304,896
常陽銀行	408	142,800	448	143,360
群馬銀行	260	121,420	269	111,097
武蔵野銀行	15.8	38,520	20.9	51,811
千葉興業銀行	23.8	15,422	23.8	9,996
東京都民銀行	23.7	24,150	23.1	22,661
七十七銀行	178	83,482	207	67,068
青森銀行	104	21,320	129	30,831
秋田銀行	80	24,160	80	17,600
山形銀行	63	24,507	63	22,617
岩手銀行	7.7	36,498	8.7	25,986
東邦銀行	105	28,035	140	25,340
東北銀行	79	10,507	79	9,480
ふくおかフィナンシャルグループ	429	162,591	474	148,362
静岡銀行	341	253,363	351	256,230
十六銀行	139	44,341	139	31,553
スルガ銀行	115	94,415	130	85,150
八十二銀行	228	111,264	212	93,916
山梨中央銀行	76	26,752	61	19,276
大垣共立銀行	156	43,212	161	38,479
福井銀行	97	25,899	97	22,407
北國銀行	129	39,603	129	35,217
滋賀銀行	107	52,430	119	49,504
南都銀行	109	47,197	96	32,640
百五銀行	112	41,664	87	27,057
京都銀行	189	136,836	209	147,554
三重銀行	66	15,774	66	12,738
ほくほくフィナンシャルグループ	737	121,605	821	122,329
広島銀行	311	111,027	356	119,972
山陰合同銀行	74	47,434	65	34,580
中国銀行	92	97,060	97	89,822
鳥取銀行	77	18,788	77	11,396
伊予銀行	128	101,888	128	90,880
百十四銀行	118	37,996	138	38,502
四国銀行	84	22,176	84	18,816
阿波銀行	89	46,102	95	44,175
鹿児島銀行	80	44,880	66	33,198
大分銀行	82	24,190	82	18,368
宮崎銀行	66	14,586	91	15,743
肥後銀行	91	41,405	102	44,574

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
佐賀銀行	82	20,582	82	15,088
十八銀行	73	18,177	96	19,872
沖縄銀行	9.3	29,574	7.3	24,017
琉球銀行	23.8	25,323	23.8	22,895
住友信託銀行	955	467,950	—	—
みずほ信託銀行	874	68,172	1,054	73,780
八千代銀行	9	16,695	7.5	15,637
みずほフィナンシャルグループ	9,364.8	1,554,556	14,396.1	1,813,908
紀陽ホールディングス	418	48,070	400	42,800
山口フィナンシャルグループ	104	89,856	117	83,772
長野銀行	80	13,360	80	13,040
名古屋銀行	96	29,184	116	26,912
愛知銀行	4.1	23,329	4.6	18,975
第三銀行	61	14,152	61	11,224
中央銀行	94	22,748	94	16,356
東日本銀行	92	15,088	52	7,904
愛媛銀行	85	19,380	85	18,360
トマト銀行	101	17,675	101	14,443
京葉銀行	93	40,641	85	32,725
関西アーバン銀行	122	15,982	157	22,451
栃木銀行	61	22,021	63	18,018
北日本銀行	4.5	9,918	4.5	7,987
トモニホールディングス	71	18,602	60	15,720
フィデアホールディングス	97	15,908	79	14,457
池田泉州ホールディングス	399.8	51,174	470.3	50,322
証券、商品先物取引業 (1.3%)				
SBIホールディングス	10.246	160,452	14.054	105,405
ジャフコ	16.7	41,967	16.7	31,663
大和証券グループ本社	1,009	414,699	1,163	382,627
野村ホールディングス	2,136.5	1,211,395	2,455.6	982,240
みずほ証券	295	66,375	323	60,401
みずほインベスターズ証券	334	29,726	334	23,380
岡三証券グループ	96	33,792	96	24,960
丸三証券	54.7	27,787	54.7	16,519
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	129	41,796	129	27,735
水戸証券	46	8,556	—	—
いちよし証券	39.5	23,226	39.5	17,933
松井証券	73.3	44,786	60.2	21,973
だいこう証券ビジネス	17.8	5,909	17.8	4,485
マネックスグループ	0.882	33,471	1.382	21,434
カブドットコム証券	57.4	24,969	87.4	20,713
保険業 (2.6%)				
NKS Jホールディングス	832	463,424	971	484,529
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	316.9	709,539	345.3	639,840
ソニーフィナンシャルホールディングス	0.464	142,448	110.8	158,222
第一生命保険	4.53	670,893	6.24	747,552
富士火災海上保険	135	17,550	—	—
東京海上ホールディングス	433.9	1,099,502	441.2	958,286
T&Dホールディングス	194.1	414,403	214.5	408,622
その他金融業 (0.7%)				
クレディセゾン	78	81,354	91.6	111,660
セディナ	122.3	17,611	—	—
芙蓉総合リース	12.2	28,767	12.8	32,307
興銀リース	15.3	24,403	15.3	28,381
東京センチュリーリース	28.4	32,546	30.9	41,684

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
日本証券金融	50.6	29,348	50.6	23,529
リコーリース	9.1	18,291	11.6	20,149
イオンクレジットサービス	50.5	44,793	56.5	56,952
アコム	30.81	37,464	25.31	31,713
プロミス	52.65	33,222	65.15	36,679
日立キャピタル	27.2	35,251	24.6	26,272
オリックス	55.35	387,450	61.03	457,114
三菱UFJリース	28.26	96,931	29.96	90,778
不動産業 (2.4%)				
日本駐車場開発	3.224	13,653	3.224	11,912
昭栄	34.2	22,298	34.2	25,650
野村不動産ホールディングス	55.1	69,977	47.6	59,071
ビューリック	25	16,875	33.5	23,249
パーク24	72	67,032	57	44,802
三井不動産	478	664,420	550	736,450
三菱地所	749	1,054,592	816	1,157,088
平和不動産	126	29,484	136	23,120
東京建物	203	68,614	253	72,864
ダイビル	38	27,930	38	22,192
東急不動産	212	71,020	237	86,742
京阪神不動産	29	11,658	29	10,643
住友不動産	260	424,840	282	482,220
東宝不動産	37.7	18,774	37.7	16,248
大京	183	32,757	292	39,712
テーオーシー	74.6	26,557	74.6	27,079
東京楽天地	60	20,580	60	15,720
レオパレス21	69.4	25,331	—	—
空港施設	28.3	10,980	42.3	12,732
住友不動産販売	4.31	17,908	10.31	36,600
ゴールドクレスト	—	—	12.5	22,450
日本エスリード	8.6	6,682	8.6	5,736
東急リバブル	11.9	9,686	11.9	8,615
サンヨーハウジング名古屋	0.127	9,867	0.127	9,601
イオンモール	53.3	99,138	55.1	104,690
エヌ・ティ・ティ都市開発	0.68	51,476	0.92	63,480
日本空港ビルデング	25.9	32,582	34.9	29,699
サービス業 (1.7%)				
日本M&Aセンター	0.015	4,747	0.045	17,325
アコードシア・ゴルフ	0.316	28,408	0.396	20,512
パソナグループ	0.421	24,628	0.421	29,596
スタジオアリス	10.6	8,045	10.6	9,603
シミック	0.63	15,510	13.6	18,237
NECフィールドディング	17.2	19,092	11.2	10,404
総合警備保障	42	39,564	42	35,868
カカココム	0.096	33,024	0.096	49,824
エムスリー	0.074	25,234	0.074	41,958
ディー・エヌ・エー	40.5	110,160	48.7	138,161
博報堂DYホールディングス	15.85	73,702	18.35	74,776
ぐるなび	0.025	3,547	2.5	2,077
PGMホールディングス	0.483	30,477	0.483	20,672
イービーエス	0.03	6,384	0.07	12,565
ドリームインキュベータ	0.11	6,259	0.11	8,173
ケネディクス	—	—	1.3	17,667
電通	109.1	254,203	111.8	240,481
みらかホールディングス	22.2	59,429	31.2	98,592
日本空調サービス	12	8,568	12	8,364

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	評価額	株数	評価額	
	千株	千円	千株	千円	
オリエンタルランド	29.9	206,908	33	226,050	
ダスキン	35.8	55,418	34.1	53,707	
秀英予備校	14.3	7,207	14.3	4,218	
ラウンドワン	23.1	14,345	28.3	14,178	
リゾートトラスト	19.9	24,616	19.9	18,905	
ビー・エム・エル	8.2	17,490	8.2	16,646	
もしもしホットライン	13.7	26,427	13.7	19,755	
東急コミュニティー	4.9	11,338	4.9	11,897	
ユー・エス・エス	14.79	88,296	16.79	103,594	
カルチュア・コンビニエンス・クラブ	63	25,830	—	—	
エイチ・アイ・エス	17.7	29,399	15.7	29,625	
共立メンテナンス	18.5	24,161	18.5	19,739	
建設技術研究所	28.5	11,599	28.5	13,851	
よみうりランド	55	16,390	55	14,850	
東京ドーム	129	29,928	129	19,866	
トランス・コスモス	17.8	14,685	17.8	14,756	
乃村工藝社	41	12,423	66	15,180	
日本管財	8.1	11,396	8.1	10,692	
白洋舎	80	21,440	80	15,280	
セコム	109.6	430,728	126.5	477,537	
メイテック	15.7	25,826	20.4	33,292	
アサツマ ディ・ケイ	22.4	46,838	18.9	38,196	
応用地質	30.2	21,713	30.2	22,287	
ベネッセホールディングス	39.4	162,328	39.6	135,036	
イオンディライト	18.2	27,682	17.2	25,249	
ニチイ学館	26.8	22,002	26.8	18,277	
ダイセキ	21.3	39,170	16.3	25,428	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	155,110 1,025	126,808,916 <98.6%>	173,326 1,028	130,879,312 <98.7%>

(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) 評価額欄の< >内は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

(注4) -印は組み入れなしです。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	期首(前期末)		当期末	
		買建額	売建額	買建額	売建額
国内	株式先物取引	7,531	—	2,496	—
	TOPIX				

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) -印は組み入れなしです。

(2) 下記は、TMA日本債券インデックスマザーファンド全体（192,033,176千口）の内容です。

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
国 債 証 券	千円 150,815,000	千円 156,584,206	% 73.5	% —	% 41.7	% 25.3	% 6.6
地 方 債 証 券	16,877,840 (16,877,840)	17,543,834 (17,543,834)	8.2 (8.2)	(—) (—)	3.4 (3.4)	3.1 (3.1)	1.8 (1.8)
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	10,869,000 (10,869,000)	11,343,100 (11,343,100)	5.3 (5.3)	(—) (—)	1.9 (1.9)	2.3 (2.3)	1.1 (1.1)
金 融 債 券	1,160,000 (1,160,000)	1,167,236 (1,167,236)	0.5 (0.5)	(—) (—)	(—) (—)	(—) (—)	0.5 (0.5)
普 通 社 債 券 (含 む 投 資 法 人 債 券)	19,542,809 (19,542,809)	19,984,801 (19,984,801)	9.4 (9.4)	(—) (—)	5.1 (5.1)	2.1 (2.1)	2.2 (2.2)
合 計	199,264,649 (48,449,649)	206,623,178 (50,038,972)	97.0 (23.5)	(—) (—)	52.0 (10.4)	32.8 (7.5)	12.2 (5.6)

(注1) ()内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 額面・評価額の単位未満は切り捨てています。

(注4) -印は組み入れなしです。

(注5) 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) 詳細開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘 柄 名	当 期			末 償還年月日
	利率	額 面 金 額	評 価 額	
国債証券	%	千円	千円	
第300回 利付国債(2年)	0.2	1,050,000	1,050,756	2013/1/15
第301回 利付国債(2年)	0.2	550,000	550,374	2013/2/15
第302回 利付国債(2年)	0.2	900,000	900,639	2013/3/15
第66回 利付国債(5年)	1.1	270,000	273,312	2012/9/20
第69回 利付国債(5年)	0.9	2,340,000	2,366,769	2012/12/20
第70回 利付国債(5年)	0.8	1,550,000	1,567,623	2013/3/20
第71回 利付国債(5年)	1.3	920,000	938,703	2013/3/20
第72回 利付国債(5年)	1.5	1,340,000	1,376,394	2013/6/20
第73回 利付国債(5年)	1.3	1,230,000	1,258,376	2013/6/20
第75回 利付国債(5年)	1.1	1,400,000	1,429,512	2013/9/20
第77回 利付国債(5年)	1.0	1,000,000	1,018,790	2013/9/20
第80回 利付国債(5年)	0.8	1,500,000	1,523,025	2013/12/20
第81回 利付国債(5年)	0.8	2,500,000	2,541,000	2014/3/20
第82回 利付国債(5年)	0.9	200,000	203,836	2014/3/20
第83回 利付国債(5年)	0.9	750,000	765,330	2014/6/20
第84回 利付国債(5年)	0.7	1,800,000	1,825,884	2014/6/20
第85回 利付国債(5年)	0.7	2,100,000	2,130,576	2014/9/20
第87回 利付国債(5年)	0.5	1,760,000	1,773,604	2014/12/20
第88回 利付国債(5年)	0.5	3,300,000	3,324,123	2015/3/20
第89回 利付国債(5年)	0.4	1,950,000	1,955,440	2015/6/20
第91回 利付国債(5年)	0.4	200,000	200,380	2015/9/20
第92回 利付国債(5年)	0.3	2,900,000	2,893,214	2015/9/20
第94回 利付国債(5年)	0.6	1,400,000	1,413,776	2015/12/20

銘 柄 名	当 期			末 償還年月日
	利率	額 面 金 額	評 価 額	
第95回 利付国債(5年)	0.6	500,000	504,705	2016/3/20
第93回 利付国債(5年)	0.5	1,900,000	1,910,184	2015/12/20
第241回 利付国債(10年)	1.3	680,000	690,111	2012/9/20
第242回 利付国債(10年)	1.2	510,000	516,920	2012/9/20
第243回 利付国債(10年)	1.1	860,000	870,552	2012/9/20
第244回 利付国債(10年)	1.0	800,000	810,392	2012/12/20
第245回 利付国債(10年)	0.9	940,000	950,753	2012/12/20
第246回 利付国債(10年)	0.8	900,000	908,901	2012/12/20
第247回 利付国債(10年)	0.8	830,000	839,437	2013/3/20
第248回 利付国債(10年)	0.7	370,000	373,544	2013/3/20
第249回 利付国債(10年)	0.6	340,000	342,648	2013/3/20
第250回 利付国債(10年)	0.5	1,000,000	1,006,630	2013/6/20
第251回 利付国債(10年)	0.9	750,000	761,100	2013/6/20
第252回 利付国債(10年)	1.0	170,000	172,862	2013/6/20
第254回 利付国債(10年)	1.4	860,000	883,942	2013/9/20
第255回 利付国債(10年)	1.5	1,030,000	1,061,033	2013/9/20
第256回 利付国債(10年)	1.4	3,580,000	3,689,476	2013/12/20
第258回 利付国債(10年)	1.3	820,000	844,731	2014/3/20
第259回 利付国債(10年)	1.5	1,530,000	1,584,651	2014/3/20
第260回 利付国債(10年)	1.6	410,000	427,072	2014/6/20
第261回 利付国債(10年)	1.8	330,000	345,737	2014/6/20
第262回 利付国債(10年)	1.9	1,920,000	2,017,382	2014/6/20
第263回 利付国債(10年)	1.6	850,000	887,425	2014/9/20
第264回 利付国債(10年)	1.5	1,030,000	1,071,972	2014/9/20

銘柄名	期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
国債証券				
第265回 利付国債(10年)	1.5	980,000	1,022,208	2014/12/20
第266回 利付国債(10年)	1.4	940,000	977,177	2014/12/20
第269回 利付国債(10年)	1.3	1,540,000	1,597,811	2015/3/20
第270回 利付国債(10年)	1.3	1,450,000	1,506,796	2015/6/20
第271回 利付国債(10年)	1.2	950,000	983,411	2015/6/20
第273回 利付国債(10年)	1.5	930,000	975,523	2015/9/20
第274回 利付国債(10年)	1.5	500,000	525,285	2015/12/20
第275回 利付国債(10年)	1.4	280,000	292,905	2015/12/20
第276回 利付国債(10年)	1.6	510,000	538,070	2015/12/20
第277回 利付国債(10年)	1.6	900,000	951,057	2016/3/20
第279回 利付国債(10年)	2.0	870,000	935,737	2016/3/20
第280回 利付国債(10年)	1.9	930,000	998,048	2016/6/20
第282回 利付国債(10年)	1.7	1,350,000	1,437,736	2016/9/20
第283回 利付国債(10年)	1.8	940,000	1,005,959	2016/9/20
第284回 利付国債(10年)	1.7	1,220,000	1,301,166	2016/12/20
第285回 利付国債(10年)	1.7	1,580,000	1,687,282	2017/3/20
第286回 利付国債(10年)	1.8	1,110,000	1,192,972	2017/6/20
第287回 利付国債(10年)	1.9	630,000	680,784	2017/6/20
第288回 利付国債(10年)	1.7	1,040,000	1,111,822	2017/9/20
第289回 利付国債(10年)	1.5	2,150,000	2,271,238	2017/12/20
第291回 利付国債(10年)	1.3	500,000	521,325	2018/3/20
第292回 利付国債(10年)	1.7	1,250,000	1,336,300	2018/3/20
第293回 利付国債(10年)	1.8	880,000	946,616	2018/6/20
第294回 利付国債(10年)	1.7	1,420,000	1,517,937	2018/6/20
第296回 利付国債(10年)	1.5	1,900,000	2,002,106	2018/9/20
第297回 利付国債(10年)	1.4	440,000	459,940	2018/12/20
第298回 利付国債(10年)	1.3	1,300,000	1,349,647	2018/12/20
第299回 利付国債(10年)	1.3	1,300,000	1,346,709	2019/3/20
第300回 利付国債(10年)	1.5	1,000,000	1,050,990	2019/3/20
第301回 利付国債(10年)	1.5	1,150,000	1,206,764	2019/6/20
第302回 利付国債(10年)	1.4	800,000	833,456	2019/6/20
第303回 利付国債(10年)	1.4	1,600,000	1,663,712	2019/9/20
第304回 利付国債(10年)	1.3	1,000,000	1,031,690	2019/9/20
第305回 利付国債(10年)	1.3	3,020,000	3,108,486	2019/12/20
第306回 利付国債(10年)	1.4	2,400,000	2,485,656	2020/3/20
第308回 利付国債(10年)	1.3	1,750,000	1,792,822	2020/6/20
第309回 利付国債(10年)	1.1	1,760,000	1,773,129	2020/6/20
第310回 利付国債(10年)	1.0	1,960,000	1,950,866	2020/9/20
第311回 利付国債(10年)	0.8	700,000	684,299	2020/9/20
第312回 利付国債(10年)	1.2	3,000,000	3,029,850	2020/12/20
第313回 利付国債(10年)	1.3	650,000	660,907	2021/3/20
第1回 利付国債(30年)	2.8	90,000	103,385	2029/9/20
第2回 利付国債(30年)	2.4	90,000	97,560	2030/2/20
第3回 利付国債(30年)	2.3	120,000	128,120	2030/5/20
第5回 利付国債(30年)	2.2	10,000	10,494	2031/5/20
第6回 利付国債(30年)	2.4	190,000	205,665	2031/11/20
第7回 利付国債(30年)	2.3	90,000	95,827	2032/5/20
第8回 利付国債(30年)	1.8	110,000	107,339	2032/11/22
第9回 利付国債(30年)	1.4	140,000	126,586	2032/12/20
第10回 利付国債(30年)	1.1	300,000	254,568	2033/3/20
第11回 利付国債(30年)	1.7	350,000	334,187	2033/6/20
第14回 利付国債(30年)	2.4	200,000	216,078	2034/3/20

銘柄名	期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第15回 利付国債(30年)	2.5	240,000	263,503	2034/6/20
第16回 利付国債(30年)	2.5	305,000	335,907	2034/9/20
第19回 利付国債(30年)	2.3	300,000	317,970	2035/6/20
第20回 利付国債(30年)	2.5	250,000	274,480	2035/9/20
第21回 利付国債(30年)	2.3	260,000	275,334	2035/12/20
第22回 利付国債(30年)	2.5	300,000	329,505	2036/3/20
第23回 利付国債(30年)	2.5	360,000	395,316	2036/6/20
第24回 利付国債(30年)	2.5	200,000	219,940	2036/9/20
第25回 利付国債(30年)	2.3	400,000	423,152	2036/12/20
第26回 利付国債(30年)	2.4	590,000	636,657	2037/3/20
第27回 利付国債(30年)	2.5	580,000	638,232	2037/9/20
第28回 利付国債(30年)	2.5	610,000	671,408	2038/3/20
第29回 利付国債(30年)	2.4	770,000	830,252	2038/9/20
第30回 利付国債(30年)	2.3	600,000	634,422	2039/3/20
第31回 利付国債(30年)	2.2	850,000	881,518	2039/9/20
第32回 利付国債(30年)	2.3	1,150,000	1,217,482	2040/3/20
第33回 利付国債(30年)	2.0	1,080,000	1,072,072	2040/9/20
第34回 利付国債(30年)	2.2	500,000	518,670	2041/3/20
第18回 利付国債(20年)	6.3	20,000	20,984	2012/3/20
第19回 利付国債(20年)	5.9	20,000	21,492	2012/9/20
第23回 利付国債(20年)	5.5	10,000	11,217	2013/9/20
第24回 利付国債(20年)	4.7	10,000	11,251	2014/3/20
第26回 利付国債(20年)	4.5	110,000	125,331	2014/9/22
第27回 利付国債(20年)	5.0	230,000	265,829	2014/9/22
第29回 利付国債(20年)	4.2	20,000	23,279	2015/9/21
第30回 利付国債(20年)	3.7	80,000	91,402	2015/9/21
第31回 利付国債(20年)	3.5	100,000	114,761	2016/3/21
第32回 利付国債(20年)	3.7	60,000	69,423	2016/3/21
第34回 利付国債(20年)	3.5	190,000	222,362	2017/3/20
第35回 利付国債(20年)	3.3	240,000	278,092	2017/3/20
第36回 利付国債(20年)	3.0	280,000	321,778	2017/9/20
第37回 利付国債(20年)	3.1	340,000	392,802	2017/9/20
第38回 利付国債(20年)	2.7	60,000	68,139	2018/3/20
第39回 利付国債(20年)	2.6	420,000	474,083	2018/3/20
第40回 利付国債(20年)	2.3	210,000	233,095	2018/9/20
第41回 利付国債(20年)	1.5	190,000	199,539	2019/3/20
第42回 利付国債(20年)	2.6	760,000	861,346	2019/3/20
第43回 利付国債(20年)	2.9	450,000	521,937	2019/9/20
第44回 利付国債(20年)	2.5	350,000	394,684	2020/3/20
第45回 利付国債(20年)	2.4	380,000	425,596	2020/3/20
第47回 利付国債(20年)	2.2	310,000	342,100	2020/9/21
第49回 利付国債(20年)	2.1	330,000	359,835	2021/3/22
第50回 利付国債(20年)	1.9	80,000	85,738	2021/3/22
第51回 利付国債(20年)	2.0	230,000	248,735	2021/6/21
第52回 利付国債(20年)	2.1	240,000	261,847	2021/9/21
第53回 利付国債(20年)	2.1	230,000	250,794	2021/12/20
第59回 利付国債(20年)	1.7	320,000	334,364	2022/12/20
第60回 利付国債(20年)	1.4	430,000	435,628	2022/12/20
第62回 利付国債(20年)	0.8	380,000	356,858	2023/6/20
第63回 利付国債(20年)	1.8	360,000	378,356	2023/6/20
第64回 利付国債(20年)	1.9	370,000	392,085	2023/9/20
第65回 利付国債(20年)	1.9	300,000	317,196	2023/12/20
第66回 利付国債(20年)	1.8	160,000	167,278	2023/12/20

銘柄名	期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
国債証券				
第67回 利付国債(20年)	1.9	150,000	158,224	2024/3/20
第68回 利付国債(20年)	2.2	190,000	207,170	2024/3/20
第69回 利付国債(20年)	2.1	410,000	442,107	2024/3/20
第70回 利付国債(20年)	2.4	490,000	545,267	2024/6/20
第71回 利付国債(20年)	2.2	160,000	174,217	2024/6/20
第72回 利付国債(20年)	2.1	580,000	623,772	2024/9/20
第73回 利付国債(20年)	2.0	450,000	477,486	2024/12/20
第74回 利付国債(20年)	2.1	320,000	343,360	2024/12/20
第75回 利付国債(20年)	2.1	230,000	246,336	2025/3/20
第76回 利付国債(20年)	1.9	360,000	376,675	2025/3/20
第77回 利付国債(20年)	2.0	340,000	360,049	2025/3/20
第78回 利付国債(20年)	1.9	410,000	428,035	2025/6/20
第80回 利付国債(20年)	2.1	290,000	310,189	2025/6/20
第81回 利付国債(20年)	2.0	200,000	210,906	2025/9/20
第82回 利付国債(20年)	2.1	630,000	672,525	2025/9/20
第83回 利付国債(20年)	2.1	240,000	255,823	2025/12/20
第84回 利付国債(20年)	2.0	630,000	663,264	2025/12/20
第85回 利付国債(20年)	2.1	270,000	287,352	2026/3/20
第86回 利付国債(20年)	2.3	280,000	305,275	2026/3/20
第87回 利付国債(20年)	2.2	300,000	323,082	2026/3/20
第88回 利付国債(20年)	2.3	450,000	489,987	2026/6/20
第89回 利付国債(20年)	2.2	190,000	204,322	2026/6/20
第90回 利付国債(20年)	2.2	700,000	751,625	2026/9/20
第91回 利付国債(20年)	2.3	430,000	467,285	2026/9/20
第93回 利付国債(20年)	2.0	360,000	375,084	2027/3/20
第94回 利付国債(20年)	2.1	700,000	739,004	2027/3/20
第95回 利付国債(20年)	2.3	700,000	757,253	2027/6/20
第96回 利付国債(20年)	2.1	440,000	463,650	2027/6/20
第98回 利付国債(20年)	2.1	480,000	504,825	2027/9/20
第99回 利付国債(20年)	2.1	930,000	975,523	2027/12/20
第100回 利付国債(20年)	2.2	660,000	701,283	2028/3/20
第103回 利付国債(20年)	2.3	500,000	537,875	2028/6/20
第104回 利付国債(20年)	2.1	430,000	449,758	2028/6/20
第105回 利付国債(20年)	2.1	810,000	845,964	2028/9/20
第107回 利付国債(20年)	2.1	350,000	364,731	2028/12/20
第108回 利付国債(20年)	1.9	610,000	617,307	2028/12/20
第109回 利付国債(20年)	1.9	300,000	303,021	2029/3/20
第110回 利付国債(20年)	2.1	850,000	884,365	2029/3/20
第111回 利付国債(20年)	2.2	400,000	421,796	2029/6/20
第112回 利付国債(20年)	2.1	850,000	882,929	2029/6/20
第113回 利付国債(20年)	2.1	1,200,000	1,245,264	2029/9/20
第114回 利付国債(20年)	2.1	900,000	933,003	2029/12/20
第115回 利付国債(20年)	2.2	450,000	473,710	2029/12/20
第116回 利付国債(20年)	2.2	300,000	315,522	2030/3/20
第117回 利付国債(20年)	2.1	850,000	880,251	2030/3/20
第118回 利付国債(20年)	2.0	300,000	305,475	2030/6/20
第121回 利付国債(20年)	1.9	760,000	761,071	2030/9/20
第122回 利付国債(20年)	1.8	300,000	295,554	2030/9/20
第123回 利付国債(20年)	2.1	680,000	702,385	2030/12/20
第124回 利付国債(20年)	2.0	750,000	762,315	2030/12/20
第125回 利付国債(20年)	2.2	250,000	262,297	2031/3/20
第126回 利付国債(20年)	2.0	300,000	304,752	2031/3/20
小計	—	150,815,000	156,584,206	—

銘柄名	期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
地方債証券				
第576回 東京都公募公債	1.4	240,000	240,717	2011/8/25
第582回 東京都公募公債	1.5	240,000	242,284	2012/2/24
第583回 東京都公募公債	1.5	100,000	101,059	2012/3/23
第588回 東京都公募公債	1.3	100,000	101,325	2012/8/24
第595回 東京都公募公債	0.8	100,000	101,022	2013/3/25
第599回 東京都公募公債	1.1	100,000	101,820	2013/7/25
第600回 東京都公募公債	0.9	100,000	101,432	2013/8/23
第606回 東京都公募公債	1.3	100,000	102,775	2014/2/25
第607回 東京都公募公債	1.4	100,000	103,133	2014/3/25
第611回 東京都公募公債	1.83	100,000	104,651	2014/6/20
第615回 東京都公募公債	1.53	100,000	103,942	2014/9/19
第618回 東京都公募公債	1.45	100,000	103,899	2014/12/19
第620回 東京都公募公債	1.35	100,000	103,681	2015/3/20
第621回 東京都公募公債	1.37	100,000	103,756	2015/3/20
第661回 東京都公募公債	1.6	150,000	158,341	2018/9/20
第662回 東京都公募公債	1.67	200,000	212,088	2018/9/20
第7回 東京都公募公債(30年)	2.51	100,000	106,368	2038/9/17
第1回 東京都公募公債(20年)	1.54	200,000	202,046	2023/6/20
第2回 東京都公募公債(20年)	1.97	100,000	105,594	2023/9/20
第10回 東京都公募公債(20年)	2.33	100,000	107,678	2026/9/18
第11回 東京都公募公債(20年)	2.22	300,000	317,241	2027/3/19
平成14年度第1回 北海道公募公債	1.4	100,000	101,009	2012/4/25
平成17年度第9回 北海道公募公債	1.5	180,000	187,864	2015/12/22
第120回 神奈川県公募公債	0.6	100,000	100,686	2013/5/30
第125回 神奈川県公募公債	1.4	205,000	211,373	2014/3/31
第139回 神奈川県公募公債	1.94	200,000	213,798	2016/3/18
第146回 神奈川県公募公債	1.76	200,000	213,312	2017/3/20
第155回 神奈川県公募公債	1.61	100,000	105,705	2018/6/20
第252回 大阪府公募公債(10年)	0.8	200,000	201,678	2013/1/30
第261回 大阪府公募公債(10年)	1.5	300,000	308,913	2013/12/25
第270回 大阪府公募公債(10年)	1.5	100,000	103,636	2014/9/29
第301回 大阪府公募公債(10年)	1.83	340,000	362,922	2017/4/26
平成22年度第3回 京都府公募公債	2.0	200,000	199,710	2030/11/22
平成13年度第6回 兵庫県公募公債	1.4	339,100	341,277	2011/12/19
平成15年度第1回 兵庫県公募公債	0.7	100,000	100,775	2013/4/25
平成19年度第11回 兵庫県公募公債	1.76	100,000	106,488	2017/11/15
第11回 兵庫県公募公債(20年)	1.84	100,000	96,833	2030/8/16
平成18年度第2回 静岡県公募公債	2.0	200,000	214,904	2016/6/27
平成20年度第5回 静岡県公募公債	1.59	200,000	210,786	2018/10/30
平成14年度第2回 愛知県公募公債(10年)	1.3	100,000	101,465	2012/10/18
平成13年度第2回 埼玉県公募公債	1.2	100,000	100,145	2011/7/19
平成14年度第4回 埼玉県公募公債	0.8	100,000	100,923	2013/1/30
平成16年度第1回 埼玉県公募公債	1.5	100,000	103,471	2014/4/28
平成17年度第5回 埼玉県公募公債	1.4	100,000	104,127	2015/9/29
平成19年度第2回 埼玉県公募公債	1.93	100,000	107,737	2017/6/28
平成22年度第10回 埼玉県公募公債	1.94	100,000	98,877	2030/11/12
平成17年度第5回 福岡県公募公債	1.5	200,000	209,494	2016/1/27
平成14年度第1回 千葉県公募公債	1.3	100,000	101,307	2012/8/20
平成17年度第5回 千葉県公募公債	1.6	200,000	210,058	2015/10/23
平成17年度第7回 千葉県公募公債	1.5	100,000	104,680	2015/12/25
平成20年度第3回 千葉県公募公債	1.78	100,000	106,819	2018/7/25
平成21年度第1回 千葉県公募公債	1.53	112,000	117,205	2019/4/25
平成17年度第1回 新潟県公募公債	1.3	376,100	389,639	2015/7/29

銘柄名	期末			
	利率	当 額面金額	期 評 価 額	末 償還年月日
	%	千円	千円	
地方債証券				
平成18年度第1回 新潟県公債	2.1	100,000	107,964	2016/7/27
平成19年度第1回 新潟県公債	1.99	100,000	108,059	2017/7/26
平成13年度第1回 茨城県公債	1.5	100,000	100,982	2012/3/15
平成14年度第1回 茨城県公債	0.8	110,000	111,015	2013/3/26
第4回 群馬県公債(10年)	1.76	100,000	106,677	2017/11/24
第5回 群馬県公債(10年)	1.71	100,000	106,137	2018/11/22
第1回 共同発行市場公募地方債	0.7	104,500	105,390	2013/4/25
第5回 共同発行市場公募地方債	0.9	100,000	101,409	2013/8/23
第14回 共同発行市場公募地方債	1.5	100,000	103,540	2014/5/23
第17回 共同発行市場公募地方債	1.8	100,000	104,714	2014/8/25
第18回 共同発行市場公募地方債	1.6	100,000	104,157	2014/9/25
第23回 共同発行市場公募地方債	1.3	100,000	103,416	2015/2/25
第30回 共同発行市場公募地方債	1.3	100,000	103,692	2015/9/25
第31回 共同発行市場公募地方債	1.5	200,000	209,194	2015/10/23
第33回 共同発行市場公募地方債	1.6	250,000	262,820	2015/12/25
第34回 共同発行市場公募地方債	1.4	100,000	104,262	2016/1/25
第35回 共同発行市場公募地方債	1.6	100,000	105,241	2016/2/25
第38回 共同発行市場公募地方債	2.0	150,000	161,023	2016/5/25
第48回 共同発行市場公募地方債	1.7	300,000	318,993	2017/3/24
第49回 共同発行市場公募地方債	1.8	116,300	124,363	2017/4/25
第51回 共同発行市場公募地方債	1.9	100,000	107,576	2017/6/23
第56回 共同発行市場公募地方債	1.72	100,000	106,494	2017/11/24
第57回 共同発行市場公募地方債	1.65	100,000	106,069	2017/12/25
第60回 共同発行市場公募地方債	1.49	200,000	209,932	2018/3/23
第67回 共同発行市場公募地方債	1.5	150,000	157,077	2018/10/25
第73回 共同発行市場公募地方債	1.59	300,000	315,273	2019/4/25
第75回 共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	105,370	2019/6/25
平成19年度第1回 新潟市公債(10年)	1.72	150,000	159,567	2017/12/26
平成17年度第8回 大阪市公債	1.6	300,000	314,172	2015/10/27
平成17年度第10回 大阪市公債	1.5	100,000	104,411	2016/1/26
平成19年度第10回 大阪市公債	1.74	100,000	106,186	2017/12/19
第12回 し号名古屋市公債	1.5	100,000	104,213	2015/3/23
平成17年度第1回 京都市公債	1.4	100,000	103,993	2015/8/25
平成17年度第13回 神戸市公債	1.6	300,000	315,267	2016/2/23
平成22年度第4回 神戸市公債(20年)	1.895	100,000	97,987	2030/9/13
平成14年度第2回 横浜市公債	1.3	131,540	133,369	2012/9/20
平成16年度第4回 横浜市公債	1.36	100,000	103,555	2014/12/22
平成22年度第3回 横浜市公債	1.168	100,000	100,322	2020/9/18
平成18年度第1回 札幌市公債(5年)	1.4	150,000	150,004	2011/5/31
平成20年度第2回 札幌市公債	1.93	100,000	107,812	2018/6/20
第1回 川崎市15年公債	1.78	100,000	106,269	2019/9/20
第2回 川崎市15年公債	1.63	100,000	104,474	2020/6/22
平成14年度第4回 福岡市公債	0.8	100,000	100,930	2013/2/27
平成18年度第6回 福岡市公債	1.8	100,000	106,646	2016/12/26
平成16年度第1回 広島市公債	1.4	200,000	207,220	2014/12/24
平成16年度第2回 千葉市公債	1.4	102,000	105,779	2015/1/27
第4回 さいたま市公債	1.8	240,000	256,087	2016/12/26
平成17年度第2回 鹿児島県公債(10年)	1.7	100,000	105,712	2016/3/30
平成18年度第1回 鹿児島県公債(10年)	1.9	361,300	387,078	2016/10/31
平成18年度第2回 鹿児島県公債(5年)	1.31	180,000	181,612	2012/3/30
第1回 公営企業債券(5年)	1.14	300,000	304,098	2012/12/20
第2回 公営企業債券(20年)	1.45	100,000	100,399	2022/12/20
第10回 公営企業債券(20年)	2.21	100,000	107,225	2024/9/24

銘柄名	期末			
	利率	当 額面金額	期 評 価 額	末 償還年月日
	%	千円	千円	
第1回 公営企業債券	1.42	200,000	201,356	2011/12/26
第2回 公営企業債券	1.49	500,000	506,565	2012/6/20
第12回 公営企業債券	1.53	300,000	311,565	2014/9/24
第14回 公営企業債券	1.45	100,000	103,950	2015/3/24
第20回 公営企業債券	2.05	300,000	322,695	2016/6/20
小計	—	16,877,840	17,543,834	—
特殊債券(除く金融債)				
第13回 政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	227,000	244,503	2016/8/25
第313回 政府保証道路債券	1.3	105,000	106,501	2012/9/20
第314回 政府保証道路債券	1.0	203,000	205,490	2012/12/20
第316回 政府保証道路債券	0.6	111,000	111,826	2013/5/29
第319回 政府保証道路債券	0.9	100,000	101,475	2013/8/22
第327回 政府保証道路債券	1.5	242,000	250,591	2014/4/25
第330回 政府保証道路債券	1.8	123,000	128,835	2014/7/29
第331回 政府保証道路債券	1.8	100,000	104,830	2014/8/29
第337回 政府保証道路債券	1.3	103,000	106,642	2015/2/27
第339回 政府保証道路債券	1.4	228,000	237,149	2015/4/28
第341回 政府保証道路債券	1.3	183,000	189,738	2015/5/29
第344回 政府保証道路債券	1.6	100,000	104,553	2020/7/15
第346回 政府保証道路債券	1.4	176,000	183,413	2015/8/26
第347回 政府保証道路債券	1.3	100,000	103,817	2015/9/22
第3回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	104,872	2016/1/29
第5回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	100,000	105,391	2016/2/26
第6回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	106,805	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	100,000	106,759	2021/3/26
第16回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	101,000	108,758	2016/7/28
第17回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	354,000	381,477	2016/8/31
第69回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	224,000	236,624	2018/11/28
第81回 政府保証公営企業債券	1.4	100,000	101,274	2012/6/21
第817回 政府保証公営企業債券	1.3	650,000	658,229	2012/7/25
第826回 政府保証公営企業債券	0.7	100,000	100,907	2013/4/23
第827回 政府保証公営企業債券	0.6	158,000	159,173	2013/5/27
第831回 政府保証公営企業債券	1.6	200,000	206,290	2013/9/26
第832回 政府保証公営企業債券	1.4	100,000	102,771	2013/10/24
第842回 政府保証公営企業債券	1.8	100,000	104,819	2014/8/26
第843回 政府保証公営企業債券	1.5	100,000	103,926	2014/9/29
第844回 政府保証公営企業債券	1.6	154,000	160,709	2014/10/28
第845回 政府保証公営企業債券	1.5	200,000	208,200	2014/11/28
第850回 政府保証公営企業債券	1.4	100,000	103,994	2015/4/21
第853回 政府保証公営企業債券	1.2	100,000	103,328	2015/7/24
第864回 政府保証公営企業債券	1.9	109,000	116,707	2016/6/22
第865回 政府保証公営企業債券	2.0	178,000	191,617	2016/7/20
第191回 政府保証首都高速道路債券	1.8	112,000	117,295	2014/7/29
第199回 政府保証首都高速道路債券	1.4	100,000	104,196	2015/8/28
第140回 政府保証阪神高速道路債券	1.5	102,000	105,978	2014/9/26
第144回 政府保証阪神高速道路債券	1.5	146,000	152,267	2015/3/17
第1回 政府保証阪神高速道路株式会社債券	1.6	110,000	115,958	2016/3/31
第24回 政府保証本州四国連絡橋債券	1.8	358,000	375,230	2014/8/29
第25回 政府保証本州四国連絡橋債券	1.4	102,000	105,909	2015/1/26

銘柄名	当 期 末			
	利率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	%	千 円	千 円	
特殊債券(除く金融債)				
第108回 政府保証預金保険機構債券	1.5	200,000	200,316	2011/7/13
第14回 政府保証国民生活債券	1.5	100,000	103,889	2014/9/17
第3回 政府保証新東京国際空港債券	0.6	141,000	142,033	2013/5/27
第1回 政府保証東日本高速道路債券	1.6	266,000	279,832	2015/11/25
第1回 政府保証中日本高速道路債券	1.6	100,000	105,200	2015/11/25
第7回 政府保証中日本高速道路債券	2.0	100,000	107,603	2016/7/15
第11回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	149,000	158,617	2016/4/26
第20回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	106,833	2016/10/31
第37回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	107,798	2017/7/31
第43回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	200,000	213,966	2027/10/29
第805回 政府保証公営企業債券	1.4	100,000	100,290	2011/8/24
第823回 政府保証公営企業債券	0.8	100,000	100,980	2013/1/29
第824回 政府保証公営企業債券	0.8	100,000	101,027	2013/2/27
第839回 政府保証公営企業債券	1.5	100,000	103,643	2014/5/26
第848回 政府保証公営企業債券	1.3	123,000	127,339	2015/2/24
第849回 政府保証公営企業債券	1.5	100,000	104,322	2015/3/20
第857回 政府保証公営企業債券	1.6	100,000	105,229	2015/11/27
第877回 政府保証公営企業債券	1.9	130,000	140,080	2017/7/18
第879回 政府保証公営企業債券	1.7	100,000	106,587	2017/9/19
第157回 政府保証中小企業債券	1.2	100,000	100,143	2011/7/19
第167回 政府保証中小企業債券	1.4	100,000	101,264	2012/6/18
第171回 政府保証中小企業債券	1.0	104,000	105,261	2012/12/17
第51回 政府保証関西国際空港債券	2.1	200,000	216,346	2022/8/31
第16回 政府保証日本政策投資銀行債券	1.8	107,000	114,486	2017/2/28
第19回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	102,000	108,888	2016/9/29
第21回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	311,000	332,387	2016/11/30
第23回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	113,000	120,198	2016/12/28
第27回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	105,000	112,378	2017/2/28
第56回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	200,000	209,050	2018/4/20
第78回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	103,887	2019/4/30
第87回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	104,408	2019/8/30
第870回 政府保証公営企業債券	1.7	159,000	169,139	2016/12/21
第143回 政府保証預金保険機構債券	0.9	100,000	100,839	2012/8/15
小 計	—	10,869,000	11,343,100	—
金融債券				
い第674号農林債	1.8	100,000	100,253	2011/7/27
い第678号農林債	1.45	200,000	201,126	2011/11/25
い第694号農林債	1.15	200,000	202,880	2013/3/27
第199回 しんきん中金債券	1.5	100,000	100,101	2011/6/27
第200回 しんきん中金債券	1.75	100,000	100,252	2011/7/27
第203回 信金中金債(5年)	1.45	200,000	201,010	2011/10/27
第204回 信金中金債(5年)	1.4	160,000	160,916	2011/11/25
第205回 信金中金債(5年)	1.45	100,000	100,698	2011/12/27
小 計	—	1,160,000	1,167,236	—

銘柄名	当 期 末			
	利率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	%	千 円	千 円	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第505回 東京電力株式会社社債	0.775	100,000	91,108	2013/4/25
第506回 東京電力株式会社社債	0.675	134,000	121,028	2013/5/30
第514回 東京電力株式会社社債	1.565	160,000	138,505	2014/10/29
第521回 東京電力株式会社社債	1.355	200,000	167,556	2015/6/15
第521回 東京電力株式会社社債	1.97	100,000	84,025	2016/6/27
第531回 東京電力株式会社社債	1.845	200,000	159,678	2017/9/25
第536回 東京電力株式会社社債	1.672	200,000	157,354	2018/1/29
第539回 東京電力株式会社社債	1.591	100,000	78,174	2018/3/28
第540回 東京電力株式会社社債	1.64	200,000	157,386	2018/4/25
第542回 東京電力株式会社社債	1.602	200,000	156,938	2018/4/25
第462回 中部電力株式会社社債	0.9	100,000	100,875	2013/3/25
第463回 中部電力株式会社社債	0.82	100,000	100,755	2013/4/25
第472回 関西電力株式会社社債	1.79	100,000	105,365	2018/11/22
第322回 中国電力株式会社社債	2.95	100,000	111,668	2029/11/22
第248回 北陸電力株式会社社債	3.95	100,000	115,937	2016/5/25
第411回 東北電力株式会社社債	1.23	100,000	100,949	2012/10/25
第540回 東北電力株式会社社債	0.93	170,000	170,656	2012/5/25
第427回 東北電力株式会社社債	1.43	200,000	205,738	2015/9/25
第445回 東北電力株式会社社債	1.792	300,000	313,305	2018/11/22
第393回 九州電力株式会社社債	2.01	100,000	107,061	2017/6/23
第404回 九州電力株式会社社債	1.884	200,000	209,610	2020/10/23
第7回 日本政策投資銀行債券	0.78	100,000	100,851	2013/3/19
第9回 日本政策投資銀行債券	1.58	100,000	102,876	2013/9/20
第16回 日本政策投資銀行債券	1.52	200,000	207,344	2014/9/19
第19回 日本政策投資銀行債券	1.4	200,000	207,192	2015/3/20
第39回 日本政策投資銀行債券	1.75	200,000	212,624	2017/9/20
第46回 日本政策投資銀行債券	1.69	100,000	105,880	2018/3/20
第2回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.7	100,000	105,244	2035/9/20
第30回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.37	200,000	210,736	2028/9/20
第47回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	200,000	211,084	2029/4/20
第7回 道路債券	2.7	100,000	112,885	2022/6/20
第21回 道路債券	2.75	100,000	107,051	2033/6/20
第26回 道路債券	1.68	200,000	206,824	2013/12/20
第33回 道路債券	2.91	100,000	109,435	2034/6/20
第36回 道路債券	1.08	100,000	100,446	2011/12/20
第41回 道路債券	1.52	100,000	104,045	2015/3/20
第4回 阪神高速道路・機構承継債	0.93	300,000	303,357	2013/3/19
第12回 国際協力銀行債券	1.6	100,000	103,501	2014/3/20
第15回 国際協力銀行債券	1.74	100,000	104,189	2014/6/20
第46回 都市再生債券	1.12	200,000	197,208	2020/11/20
第1回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	113,020	117,362	2037/11/10
第41回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	97,427	96,345	2045/10/10
第48回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	100,000	101,393	2046/5/10
第49回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	100,000	100,122	2046/6/10
第7回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	100,972	105,942	2037/5/10
第4回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	33,724	34,789	2036/12/10
第15回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	142,512	145,031	2039/2/10
第28回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	180,243	183,602	2040/3/10
第29回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.81	63,593	64,859	2040/4/10
第37回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	475,300	486,493	2040/12/10
第52回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.18	72,018	74,972	2042/3/10
第32回 国民生活債券	1.22	100,000	100,058	2011/6/20

銘柄名	期末			
	利率	当 額面金額	評 価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第8回 農林漁業金融公庫債券	1.46	100,000	103,860	2015/3/20
第28回 アサヒビール株式会社無担保社債	1.55	100,000	100,082	2011/6/22
第29回 アサヒビール株式会社無担保社債	1.88	100,000	104,465	2014/6/20
第4回 日本たばこ産業株式会社社債	1.68	100,000	101,582	2012/7/24
第34回 住友化学株式会社無担保社債	2.14	200,000	213,612	2016/4/28
第30回 住友化学株式会社無担保社債	1.95	200,000	212,568	2017/2/27
第31回 三菱化学株式会社無担保社債	2.02	100,000	104,884	2014/9/22
第10回 株式会社オリエ ンタルランド無担保社債	1.31	100,000	102,861	2015/1/30
第14回 住友ゴム工業株式会社無担保社債	0.74	100,000	100,045	2011/7/11
第16回 住友ゴム工業株式会社無担保社債	2.19	100,000	107,429	2017/6/28
第53回 新日本製鐵株式会社無担保社債	1.77	200,000	212,340	2017/9/20
第40回 株式会社神戸製鋼所無担保社債	1.97	200,000	212,764	2017/10/27
第12回 株式会社日立製作所無担保社債	0.72	100,000	100,542	2013/5/27
第14回 株式会社日立製作所無担保社債	1.56	100,000	103,800	2015/8/18
第39回 日本電気株式会社無担保社債	1.68	100,000	103,800	2015/9/4
第17回 富士通株式会社無担保社債	3.0	100,000	113,443	2018/5/8
第11回 パナソニック株式会社無担保社債	1.081	200,000	202,894	2018/3/20
第26回 ソニー株式会社無担保社債	2.068	200,000	213,538	2019/6/20
第22回 三菱重工株式会社無担保社債	2.03	200,000	214,022	2017/9/12
第46回 日産自動車株式会社無担保社債	1.76	200,000	202,740	2012/6/20
第64回 三井物産株式会社無担保社債	2.36	200,000	209,474	2027/5/21
第22回 住友商事株式会社無担保社債	1.51	100,000	102,789	2014/1/29
第36回 住友商事株式会社無担保社債	2.21	200,000	215,688	2019/7/25
第66回 三菱商事株式会社無担保社債	2.08	200,000	215,588	2017/7/28
第14回 株式会社クレディセゾン無担保社債	1.2	200,000	201,636	2013/6/14
第4回 株式会社みずほコー ポレート銀行無担保社債	1.4	300,000	302,124	2012/1/27
第5回 株式会社みずほコー ポレート銀行無担保社債	1.36	200,000	201,830	2012/4/27
第6回 株式会社みずほコー ポレート銀行無担保社債	1.605	100,000	101,433	2012/7/27
第11回 株式会社みずほコー ポレート銀行無担保社債	1.11	200,000	202,410	2013/1/25
第12回 株式会社みずほコー ポレート銀行無担保社債	1.295	200,000	203,452	2013/4/26
第2回 株式会社みずほコー ポレート銀行無担保社債	1.72	100,000	100,235	2011/7/27
第57回 株式会社東三三菱銀行無担保社債	2.22	100,000	107,434	2022/10/27
第100回 株式会社三三菱東 京UFJ銀行無担保社債	1.37	200,000	204,440	2013/7/16
第124回 株式会社三三菱東 京UFJ銀行無担保社債	1.51	200,000	203,498	2021/4/16
第3回 2号三菱東京UFJ 銀行無担保社債(劣後特約付)	1.3	100,000	101,548	2013/6/26
第7回 株式会社東三三菱銀 行無担保社債(劣後特約付)	2.11	100,000	106,075	2019/12/20
第9回 三菱UFJ信託銀行株 式社無担保社債(劣後特約付)	1.68	200,000	201,820	2021/4/28
第6回 住友信託銀行株式会 社無担保社債(劣後特約付)	2.78	200,000	213,428	2026/4/27
第1回 住友信託銀行株式会 社無担保社債(劣後特約付)	1.37	100,000	101,420	2013/5/22
第1回 みずほ信託銀行株式会 社無担保社債	1.91	100,000	104,375	2015/12/21
第44回 株式会社三井住友銀行無担保社債	1.36	100,000	102,201	2013/7/19

銘柄名	期末			
	利率	当 額面金額	評 価額	償還年月日
第1回 株式会社みずほ銀行 無担保社債(劣後特約付)	1.7	100,000	103,253	2015/2/3
第6回 株式会社みずほ銀行 無担保社債(劣後特約付)	2.25	200,000	212,980	2016/11/4
第7回 株式会社みずほ銀行 無担保社債(劣後特約付)	2.87	100,000	107,925	2026/11/6
第6回 イオンクレジット サービス株式会社無担保社債	1.08	200,000	200,424	2012/5/9
第9回 イオンクレジット サービス株式会社無担保社債	1.78	100,000	101,027	2012/7/10
第65回 三菱地所株式会社無担保社債	2.04	100,000	97,021	2032/12/20
第52回 住友不動産株式会社無担保社債	1.29	100,000	100,511	2012/2/7
第57回 住友不動産株式会社無担保社債	1.86	300,000	300,126	2011/6/8
第7回 東日本旅客鉄道株式会社社債	3.3	200,000	231,216	2017/8/25
第18回 東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.71	100,000	101,040	2012/2/24
第21回 東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.02	100,000	106,155	2022/9/20
第31回 東日本旅客鉄道 株式会社無担保普通社債	1.58	100,000	103,356	2014/3/19
第37回 東日本旅客鉄道 株式会社無担保普通社債	1.49	100,000	103,712	2014/12/19
第6回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.39	100,000	110,095	2022/2/15
第9回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.74	100,000	103,216	2022/9/20
第19回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.28	200,000	202,532	2012/9/20
第20回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.77	100,000	106,369	2017/9/20
第23回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.14	100,000	108,793	2018/4/25
第28回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.88	200,000	213,540	2016/12/20
第41回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.166	100,000	102,370	2029/1/29
第38回 西日本鉄道株式会社無担保社債	2.0	100,000	106,795	2017/4/17
第47回 日本電信電話株式会社電信電話債券	0.87	100,000	100,997	2013/3/21
第49回 日本電信電話株式会社電信電話債券	1.45	100,000	104,024	2015/9/18
第50回 日本電信電話株式会社電信電話債券	1.58	100,000	104,572	2015/9/18
第52回 日本電信電話株式会社電信電話債券	1.77	100,000	106,316	2017/3/17
第15回 株式会社エヌ・ティ・ ティ・ドコモ無担保社債	1.96	200,000	215,196	2018/6/20
第487回 東京電力株式会社社債	1.445	300,000	298,695	2011/10/26
第409回 中部電力株式会社社債	3.9	200,000	231,664	2016/6/24
第410回 中部電力株式会社社債	3.25	100,000	113,787	2017/2/24
第455回 中部電力株式会社社債	1.45	100,000	100,273	2011/8/25
第429回 関西電力株式会社社債	1.63	100,000	100,914	2012/2/24
第416回 東北電力株式会社社債	0.83	100,000	98,142	2018/6/25
第253回 四国電力株式会社社債	1.0	100,000	92,845	2023/6/23
第265回 北海道電力株式会社社債	2.0	200,000	213,738	2018/12/25
第285回 北海道電力株式会社社債	1.69	200,000	209,794	2016/6/24
第3回 電源開発株式会社無担保社債	2.01	100,000	103,063	2023/12/20
第7回 電源開発株式会社無担保社債	1.45	100,000	103,063	2014/12/19
第23回 東京瓦斯株式会社無担保社債	1.01	100,000	94,377	2023/6/9
第24回 東京瓦斯株式会社無担保社債	1.41	100,000	102,624	2013/12/2
第7回 大阪瓦斯株式会社無担保社債	3.4	100,000	115,383	2017/3/20
第24回 大阪瓦斯株式会社無担保社債	1.59	100,000	103,924	2014/10/24
第17回 東邦瓦斯株式会社無担保社債	3.175	200,000	230,460	2018/2/19
第5回 広島ガス株式会社無担保社債	1.53	200,000	206,908	2015/8/14
小計	—	19,542,809	19,984,801	—
合計	—	199,264,649	206,623,178	—

(注1) 額面・評価額の単位未満は切り捨てています。

(注2) 株式、新株予約権証券及び株式の性質を有するオプション証券等の組入れはありません。

(3) 下記は、TMA外国株式インデックスマザーファンド全体(221,886,817千口)の内容です。

外国株式

銘柄	期首(前期末)			当期末			業種等
	株数	評価額		株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	百株	千米ドル	千円	
AFLAC INC	639	2,932	267,463	560	2,688	217,413	保険
AGCO CORP	199	582	53,109	165	854	69,126	資本財
AES CORPORATION	1,081	1,105	100,879	738	941	76,163	公益事業
AT&T INC	7,322	18,036	1,645,271	6,387	19,987	1,616,623	電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	1,878	8,993	820,359	1,651	8,512	688,482	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	172	613	55,995	139	1,066	86,261	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	943	1,014	92,545	664	760	61,547	ソフトウェア・サービス
ADOBE SYSTEMS INC	694	2,236	204,036	549	1,884	152,449	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	187	963	87,877	140	872	70,575	小売
AETNA INC	517	1,510	137,793	448	1,955	158,142	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	510	1,672	152,584	425	2,108	170,543	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	227	1,611	146,988	227	2,133	172,591	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES	302	1,216	110,928	247	834	67,491	ソフトウェア・サービス
ALCOA INC	1,481	1,750	159,715	1,165	1,920	155,299	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	—	—	—	198	915	74,020	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	156	864	78,867	148	986	79,786	素材
ALLERGAN INC	419	2,500	228,108	343	2,841	229,844	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLSTATE CORP	713	2,196	200,338	574	1,793	145,054	保険
ALTERA CORPORATION	474	1,131	103,208	374	1,759	142,337	半導体・半導体製造装置
ALTRIA GROUP INC	2,586	5,313	484,670	2,311	6,459	522,460	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	461	5,844	533,150	397	7,719	624,390	小売
AMEREN CORPORATION	396	968	88,327	363	1,080	87,369	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	634	2,028	185,015	544	2,085	168,702	公益事業
AMERICAN EXPRESS COMPANY	1,400	5,647	515,193	1,241	6,347	513,388	各種金融
AMERICAN TOWER CORP-CL A	559	2,292	209,132	467	2,569	207,795	電気通信サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	430	1,358	123,886	320	1,317	106,558	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	380	1,556	141,994	296	1,792	144,977	各種金融
AMGEN INC	1,282	6,589	601,120	1,007	5,977	483,469	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	274	1,178	107,477	231	1,246	100,814	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	657	3,655	333,455	564	4,440	359,136	エネルギー
ANALOG DEVICES	454	1,349	123,090	331	1,345	108,787	半導体・半導体製造装置
AON CORP	257	1,020	93,051	265	1,361	110,110	保険
APACHE CORP	432	3,970	362,224	430	5,307	429,251	エネルギー
APOLLO GROUP INC CL A	159	848	77,442	174	702	56,836	消費者サービス
APPLE INC	1,136	28,801	2,627,280	1,007	33,997	2,749,684	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	1,859	2,430	221,695	1,412	1,896	153,387	半導体・半導体製造装置
ARCH COAL INC	319	689	62,853	278	824	66,659	エネルギー
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	653	1,662	151,647	713	2,299	185,952	食品・飲料・タバコ
AUTODESK INC	368	1,090	99,516	283	1,203	97,340	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	—	—	—	83	625	50,614	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING	567	2,335	213,033	520	2,818	227,999	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	210	422	38,506	—	—	—	小売
AUTOZONE INC	49	946	86,327	36	1,086	87,880	小売
AVERY DENNISON CORP	196	682	62,242	191	799	64,641	商業・専門サービス
AVON PRODUCTS INC	562	1,521	138,761	455	1,331	107,730	家庭用品・パーソナル用品
BB&T CORPORATION	937	2,913	265,752	779	2,128	172,119	銀行
BMC SOFTWARE INC	159	592	54,034	223	1,231	99,640	ソフトウェア・サービス
BAKER HUGHES INC	533	2,192	199,956	493	3,622	293,002	エネルギー
BALL CORP	160	799	72,901	277	1,082	87,585	素材
BANK OF AMERICA CORP	12,623	20,425	1,863,221	11,086	12,960	1,048,213	各種金融
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	1,473	4,129	376,679	1,354	3,753	303,581	各種金融
BARD (C. R.) INC	88	724	66,045	84	939	76,010	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTL INC	691	2,908	265,306	611	3,612	292,198	ヘルスケア機器・サービス
BECKMAN COULTER INC	133	781	71,328	117	978	79,138	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	259	1,871	170,741	226	1,972	159,507	ヘルスケア機器・サービス
BED BATH & BEYOND INC	370	1,676	152,944	281	1,502	121,547	小売

銘柄	期首(前期末)			当期末			業種等
	株数	評価額		株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	百株	千米ドル	千円	
WR BERKLEY CORP	294	806	73,613	252	828	67,011	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	742	5,448	497,013	959	7,491	605,933	保険
BEST BUY COMPANY INC	469	1,983	180,927	334	1,056	85,474	小売
BIOPEN IDEC INC	382	1,848	168,646	272	2,537	205,229	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	—	—	—	86	1,735	140,342	各種金融
H&R BLOCK INC	568	923	84,243	470	751	60,772	消費者サービス
BOEING CO	862	5,616	512,353	769	5,923	479,114	資本財
BORGWARNER INC	219	837	76,373	169	1,218	98,537	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,775	1,100	100,430	1,584	1,115	90,215	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,221	5,184	472,937	1,817	5,175	418,617	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM CORP CL A	619	2,127	194,086	508	1,856	150,120	半導体・半導体製造装置
CBS CORP CL-B	950	1,412	128,809	772	2,162	174,927	メディア
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	120	847	77,338	83	1,301	105,271	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	194	1,141	104,152	171	1,372	110,998	運輸
CIGNA CORP	414	1,394	127,235	294	1,456	117,829	ヘルスケア機器・サービス
CME GROUP INC	84	2,687	245,116	70	1,992	161,132	各種金融
CSX CORP	532	2,801	255,595	440	3,433	277,721	運輸
CVS CAREMARK CORP	1,657	5,733	522,978	1,469	5,699	460,996	食品・生活必需品小売り
CA INC	496	1,012	92,388	433	992	80,313	ソフトウェア・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	208	724	66,127	177	1,031	83,457	エネルギー
CAMERON INTERNATIONAL CORP	348	1,328	121,175	283	1,341	108,475	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	282	1,015	92,616	255	884	71,529	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	625	2,638	240,703	529	2,862	231,479	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	441	1,486	135,557	376	1,705	137,913	ヘルスケア機器・サービス
CAREFUSION CORP	345	884	80,658	347	998	80,737	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	387	863	78,804	299	881	71,288	小売
CARNIVAL CORP	646	2,377	216,865	533	2,046	165,538	消費者サービス
CATERPILLAR INC	807	5,009	456,999	721	7,552	610,807	資本財
CELANESE CORP-SERIES A	258	758	69,175	243	1,239	100,287	素材
CELGENE CORP	616	3,293	300,418	528	3,166	256,117	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTERPOINT ENERGY INC	672	908	82,903	637	1,216	98,424	公益事業
CENTURYLINK INC.	441	1,523	138,956	599	2,580	208,697	電気通信サービス
CEPHALON INC	133	781	71,276	123	985	79,702	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CERNER CORP	119	1,012	92,343	95	1,146	92,710	ヘルスケア機器・サービス
CHESAPEAKE ENERGY CORP	785	1,746	159,280	764	2,377	192,311	エネルギー
CHEVRONTXACO CORP	2,468	18,355	1,674,433	2,194	22,649	1,831,919	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A	—	—	—	33	971	78,613	消費者サービス
CHUBB CORP	395	2,012	183,580	331	2,150	173,946	保険
CIMAREX ENERGY CO	149	1,082	98,716	124	1,154	93,359	エネルギー
CINCINNATI FINANCIAL CORP	283	772	70,505	281	845	68,408	保険
CISCO SYSTEMS INC	7,219	17,073	1,557,488	6,094	10,031	811,343	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	283	742	67,763	256	831	67,284	商業・専門サービス
CITIGROUP INC	26,857	10,796	984,886	—	—	—	各種金融
CITIGROUP INC	—	—	—	3,160	12,950	1,047,416	各種金融
CITRIX SYSTEMS INC	259	1,142	104,261	212	1,855	150,105	ソフトウェア・サービス
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	214	1,238	112,974	152	1,367	110,571	素材
CLOROX COMPANY	142	899	82,096	134	932	75,437	家庭用品・パーソナル用品
COACH INC	422	1,770	161,539	293	1,873	151,504	耐久消費財・アパレル
COCA-COLA COMPANY	2,558	13,105	1,195,484	2,271	15,105	1,221,693	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA ENTERPRISES	466	1,239	113,089	472	1,351	109,323	食品・飲料・タバコ
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	418	2,126	193,987	350	2,623	212,154	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	582	4,591	418,829	503	4,312	348,800	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP-CL A	2,700	4,944	451,039	2,308	5,746	464,742	メディア
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	952	1,662	151,676	864	2,026	163,890	メディア
COMERICA INC	281	1,100	100,394	274	985	79,731	銀行
COMPUTER SCIENCES CORP	195	976	89,068	168	672	54,431	ソフトウェア・サービス
CONAGRA FOODS INC	635	1,543	140,787	401	1,004	81,254	食品・飲料・タバコ
CONOCOPHILLIPS	1,757	9,177	837,164	1,537	11,168	903,347	エネルギー

銘柄	期首(前期末)			当期末			業種等
	株数	評価額		株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	百株	千米ドル	千円	
CONSOL ENERGY INC	342	1,269	115,819	271	1,378	111,453	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	319	1,366	124,623	325	1,715	138,738	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	423	706	64,449	362	785	63,503	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION ENERGY GROUP	304	1,064	97,099	284	1,052	85,130	公益事業
SEAGATE TECHNOLOGY	775	1,216	111,004	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORNING INC	2,079	3,643	332,357	1,770	3,518	284,569	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTCO WHOLESALE CORP	503	2,956	269,718	469	3,828	309,621	食品・生活必需品小売り
COVENTRY HEALTH CARE INC	286	603	55,061	271	944	76,351	ヘルスケア機器・サービス
CREE INC	—	—	—	141	615	49,782	半導体・半導体製造装置
CROWN CASTLE INTL CORP	429	1,612	147,126	344	1,439	116,425	電気通信サービス
CUMMINS INC	274	1,912	174,474	214	2,253	182,271	資本財
DR HORTON INC	554	684	62,449	433	519	41,990	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	263	1,200	109,482	256	1,313	106,250	公益事業
DANAHER CORP	311	2,504	228,506	602	3,278	265,146	資本財
DARDEN RESTAURANTS INC	229	1,004	91,605	198	1,008	81,598	消費者サービス
DAVITA INC	170	1,078	98,380	139	1,163	94,082	ヘルスケア機器・サービス
DEAN FOODS CO	456	490	44,710	—	—	—	食品・飲料・タバコ
DEERE & CO	552	3,284	299,588	485	4,162	336,691	資本財
DELL INC	2,369	3,175	289,624	1,951	3,081	249,227	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DENBURY RESOURCES INC	617	1,020	93,095	559	1,211	97,957	エネルギー
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	247	810	73,938	247	969	78,444	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	491	3,114	284,115	470	3,923	317,304	エネルギー
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	121	824	75,249	118	866	70,051	エネルギー
THE WALT DISNEY CO	2,364	8,126	741,338	2,044	8,490	686,708	メディア
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	858	1,176	107,279	667	1,586	128,335	各種金融
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	234	906	82,706	196	858	69,443	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	278	912	83,212	248	955	77,247	メディア
DISH NETWORK CORPORATION	401	851	77,711	357	1,078	87,219	メディア
DIRECTV - CLASS A	1,199	4,558	415,862	988	4,936	399,226	メディア
MCDERMOTT INTL INC	380	888	81,077	—	—	—	資本財
EVEREST RE GROUP LTD	108	801	73,126	99	883	71,463	保険
DOLLAR TREE INC	—	—	—	93	590	47,772	小売
DOMINION RESOURCES INC/VA	807	3,159	288,223	661	3,126	252,835	公益事業
RR DONNELLEY & SONS CO	397	770	70,317	410	858	69,419	商業・専門サービス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	790	1,520	138,722	676	1,094	88,483	半導体・半導体製造装置
DOVER CORP	247	1,129	103,019	214	1,411	114,193	資本財
DOW CHEMICAL	1,519	4,265	389,095	1,313	4,674	378,078	素材
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	383	1,465	133,644	300	1,235	99,910	食品・飲料・タバコ
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	1,107	4,075	371,759	1,012	5,319	430,249	素材
DUKE ENERGY CORP	1,563	2,497	227,846	1,421	2,646	214,072	公益事業
DUN & BRADSTREET CORP	96	711	64,931	96	768	62,162	商業・専門サービス
EMC CORP/MASS	2,686	5,044	460,177	2,323	6,604	534,164	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EOG RESOURCES INC	338	3,603	328,716	290	3,139	253,956	エネルギー
EQT CORPORATION	235	914	83,452	206	1,100	89,039	エネルギー
GARMIN LTD	222	736	67,157	—	—	—	耐久消費財・アパレル
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	134	827	75,503	110	1,152	93,206	素材
EATON CORP	185	1,310	119,503	370	1,905	154,090	資本財
EBAY INC	1,563	3,424	312,391	1,317	4,042	326,929	ソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	241	1,149	104,871	208	1,123	90,884	素材
BUNGE LIMITED	193	958	87,390	164	1,218	98,544	食品・飲料・タバコ
EDISON INTERNATIONAL	386	1,247	113,840	387	1,522	123,108	公益事業
EL PASO CORPORATION	1,097	1,252	114,264	857	1,792	145,015	エネルギー
ELECTRONIC ARTS INC	554	926	84,549	491	1,175	95,076	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	882	4,178	381,182	816	4,416	357,216	資本財
ENERGEN CORP	—	—	—	43	264	21,414	公益事業
ENERGIZER HOLDINGS INC	137	780	71,231	123	937	75,862	家庭用品・パーソナル用品
ENERGY CORP	221	1,678	153,154	187	1,271	102,833	公益事業
EQUIFAX INC	249	763	69,641	226	843	68,191	商業・専門サービス
NABORS INDUSTRIES LTD	493	908	82,853	393	1,085	87,830	エネルギー

銘柄	期首(前期末)			当期末			業種等
	株数	評価額		株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	百株	千米ドル	千円	
EXELON CORP	757	2,946	268,815	676	2,822	228,260	公益事業
EXPEDIA INC	375	827	75,501	299	829	67,122	小売
EXPEDITORS INTL WASH INC	257	992	90,537	248	1,289	104,281	運輸
EXPRESS SCRIPTS INC	349	3,557	324,508	547	3,203	259,116	ヘルスケア機器・サービス
EXXON MOBIL CORPORATION	5,827	35,815	3,267,085	5,508	45,516	3,681,380	エネルギー
FMC TECHNOLOGIES INC	192	1,201	109,577	293	1,294	104,678	エネルギー
FPL GROUP INC	452	2,253	205,531	—	—	—	公益事業
FAMILY DOLLAR STORES	221	900	82,101	154	861	69,643	小売
FASTENAL CO	216	1,113	101,548	342	1,125	91,020	資本財
FEDEX CORP	399	3,360	306,560	329	3,024	244,660	運輸
F5 NETWORKS INC	—	—	—	92	1,047	84,683	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	438	1,224	111,723	305	972	78,621	ソフトウェア・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL-A	468	679	61,944	468	739	59,843	保険
FIFTH THIRD BANCORP	1,175	1,561	142,455	976	1,262	102,116	銀行
FIRST SOLAR INC	90	1,045	95,333	70	849	68,734	半導体・半導体製造装置
FISERV INC	195	937	85,562	175	1,116	90,303	ソフトウェア・サービス
FIRSTENERGY CORP	327	1,155	105,396	344	1,527	123,508	公益事業
FLUOR CORP	170	817	74,572	207	1,408	113,945	資本財
FLOWSERVE CORP	95	935	85,364	70	843	68,185	資本財
FORD MOTOR CO	3,907	4,684	427,321	3,522	5,143	416,004	自動車・自動車部品
FOREST LABORATORIES INC	435	1,134	103,459	322	1,153	93,296	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FORTUNE BRANDS INC	205	982	89,583	178	1,138	92,064	耐久消費財・アパレル
FRANKLIN RESOURCES INC	223	2,228	203,257	180	2,282	184,644	各種金融
FREEPORT-MCMORAN COPPER & GOLD INC	570	4,056	370,024	1,047	5,420	438,412	素材
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	—	—	—	1,337	1,178	95,312	電気通信サービス
GAMESTOP CORP-CLASS A	304	699	63,834	212	598	48,422	小売
GAP INC	648	1,425	129,996	444	853	68,995	小売
GENERAL DYNAMICS CORP	371	2,540	231,754	325	2,316	187,319	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	13,109	21,840	1,992,333	11,779	22,899	1,852,085	資本財
GENERAL MILS INC	409	2,925	266,900	667	2,622	212,113	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	—	—	—	479	1,498	121,186	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	216	885	80,744	187	1,008	81,591	小売
GENZYME CORP	327	1,645	150,096	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GILEAD SCIENCES INC	1,169	4,239	386,690	890	3,667	296,598	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	622	9,017	822,561	540	7,496	606,295	各種金融
GOODRICH CORP	162	1,148	104,793	139	1,209	97,841	資本財
GOOGLE INC-CL A	308	15,113	1,378,655	272	14,186	1,147,379	ソフトウェア・サービス
WW GRAINGER INC	91	949	86,602	73	1,096	88,650	資本財
HALLIBURTON CO	1,164	3,143	286,757	1,017	5,102	412,654	エネルギー
HARLEY-DAVIDSON INC	371	1,155	105,412	334	1,232	99,716	自動車・自動車部品
HARSCO CORP	190	529	48,308	—	—	—	資本財
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	609	1,555	141,922	528	1,400	113,303	保険
HASBRO INC	214	870	79,415	168	765	61,920	耐久消費財・アパレル
HJ HEINZ CO	436	1,956	178,447	355	1,945	157,348	食品・飲料・タバコ
HELMERICH & PAYNE	205	754	68,814	162	1,019	82,453	エネルギー
HERSHEY CO/THE	249	1,181	107,732	207	1,139	92,124	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	410	2,237	204,127	351	2,760	223,308	エネルギー
HEWLETT-PACKARD CO	2,978	13,980	1,275,272	2,464	9,108	736,710	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	469	702	64,061	442	930	75,280	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	2,180	7,533	687,211	1,805	6,501	525,802	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	845	3,669	334,701	829	4,909	397,091	資本財
HORMEL FOODS CORP	175	700	63,917	282	821	66,409	食品・飲料・タバコ
HOSPIRA INC	251	1,310	119,528	204	1,127	91,158	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUDSON CITY BANCORP INC	781	1,000	91,231	—	—	—	銀行
HUMANA INC	249	1,140	104,041	184	1,468	118,746	ヘルスケア機器・サービス
ITT CORP	188	924	84,322	149	851	68,899	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS INC	472	2,217	202,275	454	2,594	209,821	資本財
INTEL CORP	6,981	15,183	1,385,062	5,952	13,220	1,069,308	半導体・半導体製造装置
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	—	—	—	49	258	20,882	公益事業

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	評価額		株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	百株	千米ドル	千円	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	98	1,160	105,890	89	1,062	85,926	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,595	20,160	1,839,037	1,359	22,775	1,842,121	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	160	724	66,060	142	911	73,694	素材
INTL GAME TECHNOLOGY	491	980	89,428	524	902	72,973	消費者サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	623	1,481	135,106	483	1,493	120,785	素材
INTUIT INC	331	1,184	108,072	333	1,780	144,004	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	55	1,831	167,025	43	1,504	121,705	ヘルスケア機器・サービス
IRON MOUNTAIN INC	327	813	74,239	307	1,044	84,438	商業・専門サービス
JPMORGAN CHASE & CO	4,999	20,208	1,843,449	4,330	18,528	1,498,619	各種金融
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	214	908	82,878	205	934	75,564	資本財
JOHNSON & JOHNSON	3,389	20,006	1,824,988	2,970	19,831	1,604,008	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC	884	2,591	236,433	789	3,085	249,543	自動車・自動車部品
JOY GLOBAL INC	176	926	84,540	134	1,199	96,977	資本財
JUNIPER NETWORKS INC	739	2,015	183,895	637	2,361	191,003	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KBR INC	307	666	60,759	258	956	77,372	資本財
KLA-TENCOR CORPORATION	300	940	85,797	227	947	76,622	半導体・半導体製造装置
KELLOGG CO	346	1,859	169,591	262	1,482	119,877	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	1,401	1,149	104,811	1,207	1,020	82,537	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	477	2,922	266,546	408	2,761	223,375	家庭用品・パーソナル用品
KOHL'S CORP	351	1,774	161,889	277	1,486	120,254	小売
KRAFT FOODS INC-A	2,149	6,246	569,790	1,869	6,496	525,418	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	648	1,286	117,350	608	1,503	121,574	食品・生活必需品小売り
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	114	959	87,547	103	844	68,268	資本財
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	113	870	79,361	107	1,074	86,928	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	230	872	79,634	164	757	61,226	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	—	—	—	150	620	50,202	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	181	1,065	97,207	151	1,525	123,380	家庭用品・パーソナル用品
LEGGETT & PLATT INC	315	743	67,787	267	685	55,449	耐久消費財・アパレル
LEGG MASON INC	283	865	78,964	260	870	70,411	各種金融
LENDER PROCESSING SERVICES	189	654	59,681	189	493	39,948	ソフトウェア・サービス
LEUCADIA NATIONAL CORP	354	786	71,704	306	1,095	88,633	各種金融
LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A	900	1,211	110,533	727	1,313	106,224	小売
LIFE TECHNOLOGIES CORP	274	1,378	125,757	231	1,201	97,150	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELI LILLY & CO	1,216	3,991	364,134	1,057	4,001	323,653	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LIMITED BRANDS INC	441	1,121	102,334	357	1,413	114,296	小売
LINCOLN NATIONAL CORP	469	1,287	117,400	403	1,163	94,119	保険
LINEAR TECHNOLOGY CORP	365	1,040	94,909	293	998	80,791	半導体・半導体製造装置
LOCKHEED MARTIN CORP	366	2,953	269,432	293	2,271	183,708	資本財
LOEWS CORP	496	1,637	149,335	412	1,724	139,506	保険
LORILLARD INC	174	1,275	116,320	163	1,879	151,975	食品・飲料・タバコ
LOWE'S COMPANIES	1,829	4,594	419,133	1,493	3,621	292,890	小売
M & T BANK CORP	128	1,051	95,873	104	912	73,800	銀行
MDU RESOURCES GROUP INC	—	—	—	112	262	21,265	公益事業
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	499	577	52,724	420	425	34,444	半導体・半導体製造装置
MACY'S INC	636	1,402	127,977	499	1,444	116,830	小売
MANPOWERGROUP	159	753	68,688	140	845	68,358	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	894	2,831	258,297	804	4,295	347,431	エネルギー
MARSH & MCLENNAN COS	619	1,352	123,396	662	2,037	164,798	保険
MARSHALL & ILSLEY CORP	930	767	70,023	829	653	52,837	銀行
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	445	1,517	138,385	388	1,470	118,920	消費者サービス
MASCO CORP	625	849	77,529	636	909	73,537	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	135	2,809	256,240	121	3,479	281,387	ソフトウェア・サービス
MATTEL INC	397	861	78,612	292	762	61,682	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	516	928	84,677	457	1,250	101,160	半導体・半導体製造装置
MCAFEЕ INC	271	875	79,885	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MCCORMICK & CO-NON VGT SHRS	227	881	80,407	204	1,020	82,518	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	1,301	8,747	797,958	1,135	9,266	749,466	消費者サービス
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	478	1,363	124,383	361	1,524	123,279	メディア
MCKESSON CORP	353	2,478	226,058	274	2,335	188,884	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)			当期末			業種等
	株数	評価額		株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	百株	千米ドル	千円	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	—	—	—	245	1,677	135,639	食品・飲料・タバコ
MEADWESTVACO CORP	316	767	70,052	291	978	79,158	素材
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	603	3,507	319,976	464	2,722	220,226	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC INC	1,339	5,278	481,540	1,147	4,627	374,266	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	3,871	13,015	1,187,287	3,327	12,050	974,612	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	1,079	4,469	407,670	1,114	4,878	394,586	保険
MICROSOFT CORP	9,729	25,258	2,304,097	8,322	20,605	1,666,580	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	334	939	85,675	245	961	77,791	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	—	—	—	1,069	1,071	86,700	半導体・半導体製造装置
MOHAWK INDUSTRIES INC	112	644	58,771	103	685	55,424	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BREWING CO -B	—	—	—	174	813	65,758	食品・飲料・タバコ
MONSANTO CO	634	3,187	290,738	580	4,045	327,219	素材
MOODY'S CORP	348	726	66,282	283	1,100	89,012	各種金融
MORGAN STANLEY	1,604	4,438	404,881	1,479	3,561	288,028	各種金融
MOSAIC CO/THE	247	1,164	106,191	—	—	—	素材
MOSAIC CO/THE	—	—	—	187	1,315	106,419	素材
MOTOROLA INC	3,231	2,236	203,988	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOTOROLA SOLUTIONS INC	—	—	—	383	1,823	147,481	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS	—	—	—	362	903	73,091	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MURPHY OIL CORP	214	1,148	104,744	209	1,435	116,124	エネルギー
MYLAN INC	527	1,044	95,282	457	1,070	86,548	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NII HOLDINGS INC	280	1,055	96,248	250	1,089	88,132	電気通信サービス
NYSE Euronext	409	1,181	107,741	328	1,171	94,722	各種金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	492	1,975	180,167	484	3,532	285,688	エネルギー
NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	500	714	65,191	406	1,000	80,898	半導体・半導体製造装置
NETAPP INC	487	1,862	169,897	420	2,324	187,980	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	662	1,070	97,689	537	867	70,203	銀行
NEWELL RUBBERMAID INC	495	837	76,369	453	799	64,675	耐久消費財・アパレル
NEWFIELD EXPLORATION CO	216	1,103	100,660	191	1,419	114,829	エネルギー
NEWMONT MINING CORP	645	3,544	323,361	532	3,000	242,681	素材
NEWS CORP-CL A	2,452	3,301	301,120	1,988	3,574	289,137	メディア
NEWS CORP-CLASS B	700	1,089	99,386	670	1,247	100,885	メディア
NEXTERA ENERGY INC	—	—	—	421	2,419	195,715	公益事業
NIKE INC-CL B	436	3,223	294,069	340	2,883	233,245	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	532	793	72,412	486	985	79,701	公益事業
NOBLE ENERGY INC	257	1,590	145,111	205	1,899	153,619	エネルギー
NORDSTROM INC	—	—	—	220	1,021	82,629	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	503	2,857	260,660	410	2,978	240,888	運輸
NORTHERN TRUST CORP	246	1,281	116,858	210	1,019	82,495	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	317	1,939	176,952	267	1,736	140,439	資本財
NUCOR CORP	345	1,514	138,131	255	1,074	86,900	素材
NVIDIA CORP	879	1,186	108,232	659	1,286	104,075	半導体・半導体製造装置
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	—	—	—	163	973	78,745	小売
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,039	8,569	781,747	897	9,568	773,925	エネルギー
OLD REPUBLIC INTL CORP	535	762	69,579	506	630	50,985	保険
OMNICARE INC	250	630	57,489	240	760	61,530	ヘルスケア機器・サービス
OMNICOM GROUP	426	1,652	150,722	359	1,674	135,468	メディア
ORACLE CORPORATION	4,927	11,125	1,014,887	4,424	14,912	1,206,086	ソフトウェア・サービス
OWENS-ILLINOIS INC	293	894	81,555	292	926	74,951	素材
P G & E CORP	455	1,885	171,993	421	1,817	147,032	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	678	4,371	398,799	592	3,703	299,513	銀行
PPG INDUSTRIES INC	227	1,483	135,327	186	1,636	132,388	素材
PPL CORPORATION	432	1,103	100,696	476	1,327	107,390	公益事業
PACCAR INC	405	1,689	154,082	357	1,766	142,858	資本財
PACTIV CORPORATION	283	816	74,496	—	—	—	素材
PALL CORP	223	771	70,367	186	1,027	83,115	資本財
PARKER HANNIFIN CORP	191	1,203	109,826	180	1,615	130,657	資本財
PATTERSON COS INC	214	644	58,821	213	748	60,508	ヘルスケア機器・サービス
PAYCHEX INC	320	924	84,308	276	884	71,552	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)			当期末			業種等
	株数	評価額		株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	百株	千米ドル	千円	
PEABODY ENERGY CORP	398	1,594	145,455	322	1,985	160,578	エネルギー
J. C. PENNEY CO INC (HLDG CO)	352	979	89,390	254	915	74,081	小売
PENTAIR INC	200	693	63,220	198	789	63,823	資本財
PEPCO HOLDINGS INC	478	778	71,035	440	876	70,860	公益事業
PEPSICO INC	2,023	12,725	1,160,824	1,696	11,943	965,996	食品・飲料・タバコ
PERRIGO CO	142	861	78,610	129	1,104	89,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PETSMART INC	245	781	71,329	210	950	76,870	小売
PFIZER INC	9,870	15,170	1,383,852	8,738	18,290	1,479,318	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,392	10,696	975,696	2,015	14,210	1,149,332	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	220	773	70,540	204	919	74,395	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	187	1,188	108,417	150	1,375	111,212	エネルギー
PITNEY BOWES INC	366	828	75,560	358	852	68,920	商業・専門サービス
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	286	646	59,015	—	—	—	エネルギー
POLO RALPH LAUREN CORP	105	930	84,877	84	1,068	86,457	耐久消費財・アパレル
PRAXAIR INC	349	2,754	251,302	323	3,393	274,458	素材
PRECISION CASTPARTS CORP	196	2,380	217,174	154	2,423	196,028	資本財
T ROWE PRICE GROUP INC	370	1,905	173,831	289	1,809	146,317	各種金融
PRICELINE.COM INC	—	—	—	56	2,819	228,049	小売
PRIDE INTERNATIONAL INC	317	833	76,007	228	943	76,288	エネルギー
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	489	1,376	125,528	419	1,299	105,108	保険
PROCTER & GAMBLE CO	3,570	21,762	1,985,136	3,020	19,997	1,617,381	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESS ENERGY INC	307	1,189	108,498	337	1,599	129,365	公益事業
PROGRESSIVE CORP	916	1,819	165,972	704	1,520	122,969	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	618	3,659	333,778	551	3,486	281,955	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	549	1,680	153,288	557	1,858	150,318	公益事業
QEP RESOURCES INC-W/I	—	—	—	234	996	80,607	エネルギー
QUALCOMM INC	2,156	7,661	698,896	1,807	10,366	838,458	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUEST DIAGNOSTICS	178	945	86,255	178	1,030	83,364	ヘルスケア機器・サービス
QUESTAR CORP	271	1,221	111,401	—	—	—	公益事業
RANGE RESOURCES CORP	229	1,031	94,123	216	1,203	97,308	エネルギー
RAYTHEON COMPANY	425	2,237	204,101	324	1,622	131,241	資本財
RED HAT INC	311	933	85,166	265	1,151	93,102	ソフトウェア・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	1,725	1,359	123,996	1,481	1,034	83,657	銀行
REPUBLIC SERVICES INC	509	1,491	136,048	384	1,213	98,145	商業・専門サービス
REYNOLDS AMERICAN INC	234	1,234	112,580	408	1,614	130,619	食品・飲料・タバコ
ROBERT HALF INTL INC	276	708	64,620	261	720	58,261	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	223	1,215	110,846	184	1,533	124,010	資本財
ROCKWELL COLLINS INC.	182	1,083	98,853	159	959	77,606	資本財
ROPER INDUSTRIES INC	158	935	85,331	131	1,089	88,111	資本財
ROSS STORES INC	173	923	84,261	149	1,220	98,681	小売
ROWAN COMPANIES INC	242	633	57,799	220	876	70,922	エネルギー
SAIC INC	—	—	—	325	562	45,455	ソフトウェア・サービス
SPX CORP	109	657	60,022	96	789	63,867	資本財
SAFeway INC	461	1,026	93,604	396	972	78,631	食品・生活必需品小売り
ST JUDE MEDICAL INC	368	1,388	126,699	365	1,845	149,275	ヘルスケア機器・サービス
SALESFORCE.COM INC	170	1,481	135,112	138	2,102	170,071	ソフトウェア・サービス
SANDISK CORP	—	—	—	281	1,295	104,785	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SARA LEE CORP	976	1,387	126,608	747	1,452	117,509	食品・飲料・タバコ
SCANA CORP	228	833	76,032	217	878	71,064	公益事業
SCHLUMBERGER LTD	1,444	8,671	791,009	1,511	12,803	1,035,525	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,217	2,041	186,207	1,099	1,928	155,988	各種金融
SEALED AIR CORP	346	729	66,509	308	781	63,190	素材
SEARS HOLDINGS CORP	84	748	68,322	77	547	44,317	小売
SEMPRA ENERGY	312	1,427	130,232	255	1,397	112,999	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	136	1,053	96,099	115	988	79,958	素材
SIGMA-ALDRICH	169	912	83,219	199	1,045	84,553	素材
SMITH INTERNATIONAL INC	370	1,487	135,733	—	—	—	エネルギー
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	186	1,050	95,862	143	1,126	91,102	食品・飲料・タバコ
SOUTHERN CO	972	3,201	292,068	915	3,644	294,730	公益事業

銘柄	期首(前期末)			当期末			業種等
	株数	評価額		株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	百株	千米ドル	千円	
SOUTHWEST AIRLINES CO	469	593	54,170	477	565	45,707	運輸
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	475	1,779	162,357	395	1,716	138,802	エネルギー
SPECTRA ENERGY CORP	929	1,880	171,542	753	2,054	166,151	エネルギー
SPRINT NEXTEL CORP	—	—	—	3,057	1,788	144,673	電気通信サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	225	1,285	117,278	180	1,323	107,076	耐久消費財・アパレル
STAPLES INC	903	1,969	179,681	710	1,176	95,128	小売
STARBUCKS CORP	1,020	2,655	242,251	872	3,182	257,363	消費者サービス
STARWOOD HOTELS & RESORTS	282	1,340	122,288	251	1,521	123,097	消費者サービス
STATE STREET CORP	653	2,558	233,383	561	2,539	205,368	各種金融
STERICYCLE INC	154	896	81,805	100	887	71,799	商業・専門サービス
STRYKER CORP	395	2,116	193,047	320	1,991	161,045	ヘルスケア機器・サービス
SUNOCO INC	231	692	63,205	214	862	69,743	エネルギー
SUNTRUST BANKS INC	712	1,966	179,373	600	1,681	136,035	銀行
SUPERVALU INC	445	606	55,307	—	—	—	食品・生活必需品小売り
SYMANTEC CORP	889	1,300	118,601	811	1,560	126,195	ソフトウェア・サービス
SYNOPSYS INC	283	614	56,012	294	795	64,307	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	809	2,417	220,493	584	1,868	151,124	食品・生活必需品小売り
TJX COMPANIES INC	551	2,535	231,285	416	2,224	179,945	小売
TARGET CORP	873	4,833	440,905	711	3,514	284,232	小売
TELEPHONE AND DATA SYSTEMS	158	515	47,033	150	488	39,504	電気通信サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	978	5,447	496,957	1,071	5,412	437,758	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS	1,611	4,005	365,372	1,282	4,454	360,252	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	462	982	89,649	373	840	67,967	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	556	2,934	267,654	443	2,888	233,631	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	810	6,595	601,686	720	6,736	544,853	資本財
TIFFANY & CO	212	996	90,920	167	1,285	103,934	小売
TIME WARNER INC	1,510	4,673	426,301	1,274	4,604	372,415	メディア
TIME WARNER CABLE	484	2,669	243,534	428	3,309	267,652	メディア
TOLL BROTHERS INC	291	615	56,167	300	639	51,685	耐久消費財・アパレル
TORCHMARK CORP	159	839	76,580	139	921	74,553	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	377	556	50,762	386	713	57,683	ソフトウェア・サービス
TRAVELERS COS INC/THE	621	3,088	281,749	491	3,024	244,622	保険
TYSON FOODS INC-CL A	513	913	83,297	498	923	74,711	食品・飲料・タバコ
US BANCORP	2,444	5,971	544,717	2,172	5,523	446,751	銀行
URS CORP	167	760	69,411	167	731	59,196	資本財
ULTRA PETROLEUM CORP	213	965	88,086	213	1,032	83,530	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	657	4,704	429,129	558	5,778	467,333	運輸
UNITED PARCEL SERVICE CL B	874	5,557	506,947	794	5,799	469,059	運輸
UNITED STATES STEEL CORP	229	1,119	102,118	164	751	60,762	素材
UNITED TECHNOLOGIES CORP	1,070	7,290	665,020	947	8,176	661,335	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,485	4,354	397,229	1,214	5,863	474,269	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	520	1,225	111,771	479	1,251	101,233	保険
VF CORP	113	887	80,921	93	927	74,986	耐久消費財・アパレル
VALERO ENERGY CORP	746	1,402	127,958	669	1,800	145,662	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	203	1,028	93,785	160	1,074	86,884	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	308	857	78,248	260	921	74,516	ソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,561	9,823	896,109	3,088	11,323	915,866	電気通信サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	—	—	—	251	1,345	108,816	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIACOM INC CL B	764	2,622	239,215	661	3,310	267,763	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES	615	4,538	413,974	533	4,256	344,255	ソフトウェア・サービス
VULCAN MATERIALS CO	189	983	89,692	203	805	65,152	素材
WAL-MART STORES INC	2,793	14,162	1,291,878	2,088	11,422	923,870	食品・生活必需品小売り
WALGREEN CO	1,167	3,774	344,333	1,014	4,434	358,666	食品・生活必需品小売り
WASHINGTON POST -CL B	13	641	58,522	14	597	48,351	メディア
WASTE MANAGEMENT INC	497	1,625	148,278	424	1,651	133,567	商業・専門サービス
WATERS CORP	160	1,122	102,354	138	1,356	109,728	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WELLPOINT INC	580	3,004	274,024	429	3,332	269,534	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & COMPANY	6,200	18,234	1,663,396	5,539	15,588	1,260,769	銀行
WESTERN DIGITAL CORP	352	1,280	116,821	287	1,025	82,952	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	株数	期首(前期末)		株数	期末		業種等	
		評価額			評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千米ドル	千円	百株	千米ドル	千円		
WESTERN UNION CO	802	1,304	118,964	761	1,551	125,492	ソフトウェア・サービス	
WEYERHAEUSER CO	320	1,383	126,246	691	1,443	116,717	不動産	
WHIRLPOOL CORP	121	1,270	115,853	98	818	66,239	耐久消費財・アパレル	
WHOLE FOODS MARKET INC	235	955	87,172	193	1,173	94,935	食品・生活必需品小売り	
WILLIAMS COS INC	851	1,712	156,241	690	2,140	173,155	エネルギー	
WINDSTREAM CORP	825	897	81,913	805	1,079	87,323	電気通信サービス	
WISCONSIN ENERGY CORP	203	997	91,026	371	1,154	93,370	公益事業	
WYNN RESORTS LTD	—	—	—	105	1,549	125,311	消費者サービス	
XTO ENERGY INC	732	3,178	289,898	—	—	—	エネルギー	
XCEL ENERGY INC	631	1,296	118,299	546	1,344	108,721	公益事業	
XLINX INC	452	1,126	102,803	333	1,165	94,256	半導体・半導体製造装置	
XEROX CORP	1,905	1,802	164,450	1,703	1,703	137,774	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
YAHOO! INC	1,675	2,631	240,067	1,316	2,109	170,596	ソフトウェア・サービス	
YUM! BRANDS INC	632	2,620	239,022	548	3,040	245,896	消費者サービス	
ZIMMER HOLDINGS INC	234	1,298	118,476	203	1,388	112,300	ヘルスケア機器・サービス	
INVESCO LTD	666	1,266	115,561	601	1,462	118,308	各種金融	
ACE LTD	383	1,909	174,190	377	2,585	209,151	保険	
TRANSOCEAN LTD	357	2,135	194,764	—	—	—	エネルギー	
COVIDIEN PLC	638	2,715	247,707	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
GARMIN LTD	—	—	—	172	576	46,645	耐久消費財・アパレル	
COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	228	1,089	99,417	201	1,253	101,384	資本財	
ACCENTURE PLC-CL A	763	2,920	266,446	695	3,956	320,209	ソフトウェア・サービス	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	301	926	84,473	274	1,125	90,991	保険	
SEAGATE TECHNOLOGY	—	—	—	568	936	75,740	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WEATHERFORD INTL LTD	858	1,238	112,974	850	1,672	135,237	エネルギー	
TE CONNECTIVITY LTD	656	1,919	175,054	545	1,993	161,211	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
INGERSOLL-RAND PLC	397	1,497	136,582	365	1,811	146,551	資本財	
TYCO INTERNATIONAL LTD	525	1,927	175,835	518	2,519	203,790	資本財	
NOBLE CORP	283	853	77,818	258	1,072	86,769	エネルギー	
COVIDIEN PLC	—	—	—	531	2,899	234,517	ヘルスケア機器・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	393,291 465	1,276,533 —	116,445,373 <59.4%>	326,397 477	1,356,270 —	109,695,138 <52.9%>	
(カナダ)		千カナダドル			千カナダドル			
AGNICO-EAGLE MINES	239	1,483	128,795	212	1,347	111,552	素材	
AGRIUM INC	230	1,355	117,709	175	1,485	122,932	素材	
ATHABASCA OIL SANDS CORP	—	—	—	142	245	20,299	エネルギー	
BCE INC	364	1,120	97,321	302	1,180	97,700	電気通信サービス	
BANK OF MONTREAL	717	4,471	388,278	613	3,790	313,744	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	1,278	6,222	540,340	1,195	7,053	583,777	銀行	
BARRICK GOLD CORP	1,279	5,707	495,569	1,102	5,112	423,126	素材	
BIOVAIL CORPORATION	391	612	53,212	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BOMBARDIER INC 'B'	2,194	1,090	94,690	1,810	1,209	100,082	資本財	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	744	1,891	164,281	691	2,224	184,150	不動産	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	581	905	78,614	455	869	71,977	不動産	
CAE INC	679	649	56,369	564	703	58,244	資本財	
CAMECO CORP	547	1,411	122,531	483	1,368	113,278	エネルギー	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	515	3,709	322,092	434	3,494	289,224	銀行	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	564	3,430	297,901	508	3,836	317,536	運輸	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,391	5,075	440,740	1,240	5,156	426,797	エネルギー	
CANADIAN OIL SANDS LTD	—	—	—	316	940	77,859	エネルギー	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	215	1,241	107,797	200	1,224	101,366	運輸	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	155	893	77,544	141	902	74,700	小売	
CENOVUS ENERGY INC	1,033	2,877	249,847	871	3,095	256,242	エネルギー	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	—	—	—	286	1,310	108,438	エネルギー	
ELDORADO GOLD CORP	—	—	—	681	1,066	88,282	素材	
ENCANA CORP	877	2,846	247,125	831	2,764	228,798	エネルギー	
ENBRIDGE INC	453	2,130	185,004	832	2,676	221,516	エネルギー	
ENERPLUS CORP	—	—	—	307	961	79,554	エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	24	975	84,703	29	1,095	90,659	保険	

銘柄	期首(前期末)				当期末				業種等
	株数	評価額		株数	評価額		業種等		
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	千カナダドル	千円	百株	千カナダドル	千円			
FINNING INTERNATIONAL INC	382	673	58,478	313	893	73,976	資本財		
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	147	842	73,182	106	1,389	114,997	素材		
FRANCO-NEVADA CORP	—	—	—	82	306	25,365	素材		
GILDAN ACTIVEWEAR INC	222	676	58,767	183	656	54,313	耐久消費財・アパレル		
GOLDCORP INC	969	4,411	383,029	900	4,402	364,368	素材		
GREAT-WEST LIFECEO INC	457	1,174	101,955	439	1,172	97,037	保険		
CGI GROUP INC	548	903	78,452	423	923	76,434	ソフトウェア・サービス		
HUSKY ENERGY INC	296	787	68,338	303	886	73,383	エネルギー		
IGM FINANCIAL INC	219	879	76,363	196	976	80,847	各種金融		
IMPERIAL OIL LTD	336	1,375	119,438	270	1,294	107,156	エネルギー		
INMET MINING CORPORATION	—	—	—	31	209	17,346	素材		
IVANHOE MINES LTD	—	—	—	411	1,032	85,495	素材		
KINROSS GOLD CORP	1,000	1,821	158,130	1,111	1,752	145,029	素材		
LOBLAW COMPANIES LTD	221	862	74,892	205	852	70,564	食品・生活必需品小売り		
MEG ENERGY CORP	—	—	—	119	600	49,695	エネルギー		
MAGNA INTERNATIONAL INC	159	1,145	99,495	264	1,249	103,445	自動車・自動車部品		
MANULIFE FINANCIAL CORP	2,299	4,067	353,185	2,030	3,470	287,227	保険		
NATIONAL BANK OF CANADA	187	1,090	94,707	205	1,653	136,845	銀行		
NEXEN INC	696	1,615	140,238	630	1,411	116,834	エネルギー		
NIKO RESOURCES LTD	85	865	75,132	85	669	55,383	エネルギー		
ONEX CORPORATION	234	623	54,170	210	779	64,502	各種金融		
OPEN TEXT CORP	127	574	49,898	110	691	57,244	ソフトウェア・サービス		
OSISKO MINING CORP	—	—	—	267	376	31,186	素材		
PAN AMERICAN SILVER CORP	—	—	—	72	240	19,946	素材		
PENN WEST PETROLEUM LTD	—	—	—	576	1,437	118,958	エネルギー		
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	371	3,902	338,841	979	5,357	443,461	素材		
POWER CORP OF CANADA	530	1,463	127,116	498	1,397	115,642	保険		
POWER FINANCIAL CORP	399	1,169	101,579	380	1,176	97,368	保険		
RESEARCH IN MOTION	664	4,303	373,664	536	2,287	189,321	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	597	2,140	185,897	468	1,732	143,423	電気通信サービス		
ROYAL BANK OF CANADA	1,792	10,192	885,006	1,554	8,917	738,061	銀行		
SNC-LAVALIN GROUP INC	246	1,143	99,331	202	1,147	94,990	資本財		
SAPUTO INC	291	841	73,090	231	1,085	89,882	食品・飲料・タバコ		
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	584	1,128	97,989	512	1,053	87,180	メディア		
SHOPPERS DRUG MART CORP	213	762	66,230	247	1,008	83,464	食品・生活必需品小売り		
SILVER WHEATON CORP	—	—	—	296	1,060	87,792	素材		
SUN LIFE FINANCIAL INC	793	2,372	205,968	682	2,061	170,659	保険		
SUNCOR ENERGY INC	2,006	6,494	563,930	1,759	7,170	593,464	エネルギー		
TMX GROUP INC	184	505	43,883	172	765	63,319	各種金融		
TALISMAN ENERGY INC	1,313	2,312	200,779	1,197	2,442	202,146	エネルギー		
TECK RESOURCES LTD	688	2,532	219,930	649	3,266	270,407	素材		
TELUS CORP	88	341	29,611	88	467	38,704	電気通信サービス		
TELUS CORPORATION -NON VOTE	255	940	81,645	200	1,020	84,437	電気通信サービス		
THOMSON REUTERS CORP	466	1,726	149,892	431	1,636	135,487	メディア		
TIM HORTONS INC	297	1,049	91,129	248	1,134	93,896	消費者サービス		
TORONTO-DOMINION BANK	1,072	7,867	683,155	967	8,083	669,071	銀行		
TRANSALTA CORP	397	836	72,612	405	888	73,546	公益事業		
TRANSCANADA CORP	777	2,718	236,029	752	3,247	268,755	エネルギー		
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	—	—	—	294	1,505	124,624	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
VERMILION ENERGY INC	—	—	—	51	260	21,550	エネルギー		
WESTON (GEORGE) LTD	107	798	69,292	96	703	58,218	食品・生活必需品小売り		
YAMANA GOLD INC	1,208	1,372	119,135	966	1,208	100,040	素材		
小計	株数・ 銘柄数	金額 数<比率>							
	38,420 63	133,410 —	11,584,075 < 5.9%>	38,857 77	146,530 —	12,128,353 < 5.8%>			
(ユーロ…ドイツ)		千ユーロ			千ユーロ				
ADIDAS AG	244	984	110,734	195	1,003	116,003	耐久消費財・アパレル		
COMMERZBANK AG	1,227	716	80,601	1,061	338	39,147	銀行		
Fresenius SE & CO KG	—	—	—	130	926	107,158	ヘルスケア機器・サービス		
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	371	383	43,128	275	361	41,740	ソフトウェア・サービス		

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	評価額		株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	百株	千ユーロ	千円	
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	142	495	55,739	128	461	53,398	保険
GEA GROUP AG	331	533	60,036	278	642	74,293	資本財
CONTINENTAL AG	—	—	—	70	495	57,306	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG	960	1,150	129,352	888	1,146	132,563	運輸
MERCK KGAA	114	668	75,186	101	761	88,077	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG	524	3,059	344,082	404	1,658	191,687	公益事業
RWE AG-NON VTG PFD	89	485	54,647	91	353	40,921	公益事業
SAP AG	1,034	3,564	400,900	939	3,958	457,647	ソフトウェア・サービス
E.ON AG	2,271	5,575	627,186	1,949	3,902	451,136	公益事業
Henkel AG & Co KGaA	—	—	—	122	489	56,537	家庭用品・パーソナル用品
METRO AG	209	876	98,584	187	852	98,537	食品・生活必需品小売り
PUMA AG	16	374	42,174	16	354	40,969	耐久消費財・アパレル
BAYER AG	1,072	4,899	551,093	916	5,066	585,705	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG AND CO KGAA VORZUG	271	1,026	115,468	218	1,060	122,543	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	1,189	5,152	579,584	1,019	6,251	722,665	素材
BEIERSDORF AG	172	754	84,851	116	531	61,437	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	93	490	55,189	85	501	57,951	資本財
HEIDELBERGCEMENT AG	172	749	84,268	160	766	88,622	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	215	862	97,065	197	978	113,133	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE	589	4,806	540,642	503	4,800	554,934	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	490	532	59,867	417	628	72,641	運輸
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	228	2,376	267,284	199	2,106	243,557	保険
SALZGITTER AG	92	492	55,387	78	392	45,315	素材
VOLKSWAGEN AG	55	383	43,111	44	512	59,281	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG PFD	181	1,281	144,094	197	2,456	283,987	自動車・自動車部品
DAIMLER AG	1,112	4,443	499,825	1,012	4,868	562,835	自動車・自動車部品
MAN SE	135	931	104,748	127	1,226	141,818	資本財
THYSSENKRUPP AG	463	1,018	114,595	342	1,088	125,880	素材
SIEMENS AG	1,014	7,439	836,779	904	8,120	938,753	資本財
LINDE AG	200	1,679	188,961	190	2,192	253,423	素材
DEUTSCHE BANK AG -REG	813	4,059	456,627	988	4,045	467,652	各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	418	1,558	175,308	401	2,443	282,438	自動車・自動車部品
K+S AG	227	850	95,654	172	922	106,697	素材
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	3,657	3,321	373,629	3,056	3,089	357,191	電気通信サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	—	—	—	1,345	1,052	121,640	半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE BOERSE AG	232	1,229	138,341	214	1,166	134,809	各種金融
DEUTSCHE POSTBANK AG	202	499	56,219	—	—	—	銀行
LANXESS	—	—	—	76	446	51,603	素材
WACKER CHEMIE AG	42	430	48,441	31	475	54,958	素材
COMMERZBANK AG-RTS	—	—	—	1,061	96	11,204	銀行
小計	20,882	70,140	7,889,400	20,925	74,998	8,669,813	
株数・金額 銘柄数<比率>	38	—	<4.0%>	43	—	<4.2%>	
(ユーロ…イタリア)							
ASSICURAZIONI GENERALI	1,343	2,028	228,110	1,350	2,019	233,484	保険
BANCA POPOLARE DI MILANO	1,104	379	42,679	—	—	—	銀行
INTESA SANPAOLO	8,602	1,875	210,948	7,565	1,347	155,758	銀行
BANCA INTESA SPA-RNC	2,392	405	45,580	2,307	342	39,563	銀行
UNICREDIT SPA	19,043	3,311	372,487	15,053	2,337	270,258	銀行
MEDIOBANCA SPA	921	574	64,654	834	632	73,141	各種金融
PIRELLI & C.	8,292	347	39,127	614	420	48,581	自動車・自動車部品
SAIPEM	356	930	104,688	297	1,083	125,195	エネルギー
LUXOTTICA GROUP SPA	256	496	55,993	230	507	58,722	耐久消費財・アパレル
MEDIASET SPA	1,268	646	72,718	1,332	493	57,004	メディア
AUTOGRILL SPA	412	369	41,583	382	339	39,292	消費者サービス
FIAT SPA	894	789	88,807	—	—	—	自動車・自動車部品
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	5,056	458	51,614	5,056	434	50,210	銀行
ENEL SPA	7,623	2,864	322,191	7,449	3,517	406,643	公益事業
ENI SPA	3,101	4,794	539,245	2,814	4,599	531,707	エネルギー
SNAM RETE GAS S. P. A	2,385	784	88,276	1,539	621	71,884	公益事業

銘柄	期首(前期末)				期末				業種等
	株数	評価額		株数	評価額				
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	千ユーロ	千円	百株	千ユーロ	千円			
UBI BANCA SCPA	1,030	757	85,177	703	378	43,716	銀行		
TELECOM ITALIA SPA	9,982	957	107,683	8,115	783	90,535	電気通信サービス		
TELECOM ITALIA-RNC	10,189	766	86,187	9,170	777	89,843	電気通信サービス		
ATLANTIA S. P. A	421	633	71,267	362	583	67,419	運輸		
TERNA SPA	2,430	737	82,909	2,139	725	83,829	公益事業		
FINMECCANICA SPA	736	646	72,662	585	498	57,599	資本財		
BANCO POPOLARE SPA	1,272	568	63,954	1,272	226	26,173	銀行		
INTESA SANPAOLO-RTS	—	—	—	9,873	116	13,410	銀行		
FIAT INDUSTRIAL	—	—	—	905	835	96,616	資本財		
小計	89,117	26,124	2,938,451	79,957	23,621	2,730,594			
株数 銘柄数	23	—	< 1.5% >	23	—	< 1.3% >			
(ユーロ…フランス)									
BOUYGUES	244	841	94,673	209	666	77,042	資本財		
VEOLIA ENVIRONNEMENT	512	1,064	119,725	469	967	111,867	公益事業		
L'OREAL	270	2,057	231,375	258	2,219	256,592	家庭用品・パーソナル用品		
CHRISTIAN DIOR	103	809	91,063	91	952	110,131	耐久消費財・アパレル		
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	294	2,554	287,359	250	2,962	342,469	耐久消費財・アパレル		
THALES SA	185	507	57,136	157	455	52,694	資本財		
CAP GEMINI SA	216	795	89,473	165	649	75,072	ソフトウェア・サービス		
CASINO GUICHARD PERRACHON	101	622	70,051	95	697	80,625	食品・生活必需品小売り		
CIE GENERALE GEOPHYSIQUE-VERITAS	276	536	60,319	254	654	75,665	エネルギー		
PUBLICIS GROUPE	215	721	81,185	193	736	85,140	メディア		
LAFARGE SA	235	1,104	124,286	205	968	111,926	素材		
LAGARDERE S. C. A	224	589	66,342	204	577	66,742	メディア		
MICHELIN (CGDE)-B	169	917	103,171	188	1,198	138,583	自動車・自動車部品		
PERNOD-RICARD	279	1,703	191,587	229	1,581	182,824	食品・飲料・タバコ		
RENAULT SA	—	—	—	75	292	33,869	自動車・自動車部品		
SCHNEIDER ELECTRIC SA	278	2,293	257,970	270	2,985	345,160	資本財		
VIVENDI SA	1,407	2,487	279,810	1,336	2,555	295,464	メディア		
TECHNIP S. A.	162	881	99,121	111	823	95,197	エネルギー		
FRANCE TELECOM SA	2,174	3,395	381,916	1,914	3,023	349,502	電気通信サービス		
HERMES INTERNATIONAL	62	672	75,668	—	—	—	耐久消費財・アパレル		
BIC	72	410	46,143	69	445	51,525	商業・専門サービス		
DASSAULT SYSTEMES SA	130	606	68,165	107	626	72,437	ソフトウェア・サービス		
PINAULT-PRINTEMPS-REDOUTE	114	1,104	124,242	83	988	114,218	小売		
CNP ASSURANCES	78	446	50,223	318	445	51,479	保険		
NEOPOST SA	74	434	48,920	74	466	53,950	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
CARREFOUR SA	735	2,478	278,807	642	1,949	225,401	食品・生活必需品小売り		
ATOS ORIGIN	120	431	48,511	101	410	47,491	ソフトウェア・サービス		
SANOFI	1,288	6,317	710,590	1,132	6,116	707,069	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ACCOR SA	235	920	103,501	213	673	77,912	消費者サービス		
SOCIETE GENERALE-A	755	2,715	305,417	706	2,990	345,688	銀行		
ALCATEL-LICENT	—	—	—	800	316	36,594	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
TELEVISION FRANCAISE (T. F. 1)	323	378	42,616	303	375	43,399	メディア		
SODEXO	168	779	87,694	111	589	68,115	消費者サービス		
AXA	2,291	3,104	349,219	1,950	2,848	329,283	保険		
PEUGEOT SA	297	590	66,387	198	579	67,024	自動車・自動車部品		
ESSILOR INTERNATIONAL	228	1,048	117,971	206	1,148	132,770	ヘルスケア機器・サービス		
CREDIT AGRICOLE SA	1,114	995	111,991	1,171	1,242	143,603	銀行		
BNP PARIBAS	1,174	5,561	625,510	1,052	5,629	650,712	銀行		
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	464	1,468	165,148	454	2,047	236,747	資本財		
IMERYS SA	97	414	46,592	92	461	53,306	素材		
SAFRAN SA	357	771	86,737	284	790	91,388	資本財		
GDF SUEZ	1,464	3,743	421,107	1,379	3,507	405,488	公益事業		
ALSTOM RGPT	205	807	90,816	193	800	92,564	資本財		
ELECTRICITE DE FRANCE	364	1,305	146,872	286	812	93,962	公益事業		
TOTAL SA	2,573	9,859	1,109,043	2,272	8,984	1,038,602	エネルギー		
VALLOUREC	79	1,198	134,788	119	1,020	117,941	資本財		
Natixis	—	—	—	1,347	520	60,198	銀行		

銘柄	期首(前期末)			当期末			業種等
	株数	評価額		株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額	
SCOR SE	百株	千ユーロ	千円	百株	千ユーロ	千円	保険 資本財 食品・飲料・タバコ 素材 公益事業 商業・専門サービス
VINCI S.A.	335	524	58,944	308	596	68,920	
DANONE	494	1,831	206,007	475	2,084	240,970	
AIR LIQUIDE	682	2,843	319,845	626	3,115	360,099	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	303	2,614	294,030	307	2,891	334,247	
EDENRED	487	688	77,408	457	657	76,036	
	—	—	—	235	472	54,655	
小計	株数 銘柄数	金額 数	比率	株数 銘柄数	金額 数	比率	
	24,531	80,952	9,105,501	24,765	81,577	9,430,382	
	49	—	< 4.6%>	52	—	< 4.5%>	
(ユーロ…オランダ)							
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	517	829	93,326	461	1,035	119,692	資本財
REED ELSEVIER NV	661	558	62,780	912	850	98,325	メディア
RANDSTAD HOLDING NV	200	687	77,300	182	615	71,144	商業・専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD NV	1,286	1,314	147,800	1,125	1,109	128,248	食品・生活必需品小売り
AKZO NOBEL	252	1,062	119,535	240	1,182	136,713	素材
POSTNL	471	967	108,799	397	290	33,570	運輸
WOLTERS KLUWER	500	741	83,359	425	662	76,599	メディア
QIAGEN N.V.	—	—	—	425	577	66,800	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AEGON NV	2,326	1,088	122,382	2,043	993	114,885	保険
ASML HOLDING NV	625	1,457	163,969	486	1,297	149,981	半導体・半導体製造装置
KONIKLIJKE KPN NV	1,924	2,042	229,725	1,628	1,645	190,248	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV	1,184	765	86,159	846	664	76,843	半導体・半導体製造装置
PHILIPS ELECTRONICS NV	1,200	2,968	333,922	1,014	1,929	223,049	資本財
ING GROEP N.V.	4,821	3,138	353,060	4,399	3,674	424,724	各種金融
HEINEKEN NV	350	1,205	135,633	293	1,216	140,572	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	256	837	94,201	181	815	94,307	素材
UNILEVER NV-CVA	2,054	4,549	511,749	1,758	3,953	457,075	食品・飲料・タバコ
SBM OFFSHORE NV	364	483	54,368	302	544	62,959	エネルギー
TNT EXPRESS NV-W/I	—	—	—	397	397	45,986	運輸
小計	株数 銘柄数	金額 数	比率	株数 銘柄数	金額 数	比率	
	18,999	24,698	2,778,074	17,524	23,457	2,711,729	
	17	—	< 1.4%>	19	—	< 1.3%>	
(ユーロ…スペイン)							
IBERIA LINEAS AER DE ESPANA	1,611	369	41,601	—	—	—	運輸
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	532	617	69,462	473	745	86,217	運輸
INDRA SISTEMAS SA	259	366	41,271	259	374	43,257	ソフトウェア・サービス
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTIA	4,184	3,552	399,575	4,683	3,690	426,656	銀行
GAS NATURAL SDG SA	449	533	59,979	449	600	69,377	公益事業
REPSOL YPF SA	808	1,356	152,631	865	1,985	229,529	エネルギー
BANCO SANTANDER S.A	10,230	8,402	945,092	9,109	7,277	841,296	銀行
RED ELECTRICA CORPORACION SA	196	632	71,171	175	724	83,795	公益事業
TELEFONICA SA	5,145	8,027	902,957	4,473	7,413	856,975	電気通信サービス
INDITEX	258	1,150	129,449	244	1,529	176,825	小売
GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	500	401	45,135	—	—	—	資本財
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	239	721	81,106	154	503	58,169	資本財
ACERINOX SA	323	419	47,192	222	294	33,988	素材
BANCO POPULAR ESPANOL	1,307	540	60,851	1,550	619	71,654	銀行
MAPPRE S.A.	1,695	387	43,637	1,921	504	58,292	保険
IBERDROLA SA	4,826	2,631	295,993	4,390	2,659	307,438	公益事業
IBERDROLA RENOVABLES	1,761	444	50,004	1,711	521	60,258	公益事業
ABERTIS INFRAESTRUCTURA-RTS	391	22	2,529	—	—	—	運輸
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	—	—	—	1,392	378	43,771	運輸
小計	株数 銘柄数	金額 数	比率	株数 銘柄数	金額 数	比率	
	34,723	30,580	3,439,643	32,079	29,822	3,447,505	
	18	—	< 1.8%>	16	—	< 1.7%>	
(ユーロ…ベルギー)							
UMICORE	228	572	64,368	191	709	82,069	素材
DELHAIZE GROUP	102	668	75,209	114	660	76,300	食品・生活必需品小売り
KBC GROUPE	241	769	86,537	209	603	69,714	銀行
ANHEUSER-BUSCH INBEV	894	3,532	397,283	788	3,233	373,798	食品・飲料・タバコ
SOLVAY SA	102	731	82,290	72	727	84,111	素材
MOBISTAR SA	83	340	38,280	76	375	43,389	電気通信サービス

銘柄	株数	期首(前期末)		株数	期末		業種等	
		評価額			評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額		
UCB SA	199	533	60,061	188	620	71,755	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLRUYT SA	32	604	67,959	142	563	65,163	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	135	793	89,214	93	582	67,366	各種金融	
DEXIA	1,252	443	49,914	1,233	314	36,393	銀行	
BELGACOM SA	262	658	74,028	212	513	59,415	電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,534	9,647	1,085,148	3,321	8,905	1,029,477	
(ユーロ…オーストリア)		11	—	< 0.6%>	11	—	< 0.5%>	
TELEKOM AUSTRIA AG	608	626	70,462	597	539	62,338	電気通信サービス	
OMV AG	264	697	78,429	215	612	70,825	エネルギー	
VERBUND AG	173	447	50,315	162	491	56,769	公益事業	
VOESTALPINE AG	221	508	57,161	191	648	74,944	素材	
ERSTE GROUP BANK AG	305	903	101,635	276	942	108,987	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,573	3,182	358,004	1,444	3,234	373,864	
(ユーロ…ルクセンブルク)		5	—	< 0.2%>	5	—	< 0.2%>	
Tenaris SA	628	975	109,686	475	797	92,241	エネルギー	
SES SA	449	758	85,319	425	781	90,321	メディア	
ARCELORMITTAL	1,146	2,877	323,710	889	2,042	236,163	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,224	4,611	518,717	1,790	3,622	418,726	
(ユーロ…フィンランド)		3	—	< 0.3%>	3	—	< 0.2%>	
KESKO OYJ-B SHS	167	447	50,292	131	450	52,132	食品・生活必需品小売り	
WARTSILA	162	561	63,154	251	623	72,067	資本財	
OUTOKUMPU OYJ	317	422	47,508	207	215	24,867	素材	
RAUTARUUKKI OYJ	260	343	38,669	126	208	24,114	素材	
UPM-KYMMENE OYJ	622	653	73,465	576	746	86,318	素材	
STORA ENSO OYJ-R SHS	1,071	644	72,488	692	533	61,643	素材	
SAMPO OYJ-A SHS	420	721	81,199	401	908	105,008	保険	
FORTUM OYJ	444	811	91,293	429	967	111,825	公益事業	
ELISA OYJ-A SHARES	335	455	51,201	278	425	49,238	電気通信サービス	
METSO OYJ	243	625	70,302	165	657	75,985	資本財	
NOKIA OYJ	4,846	4,061	456,834	3,969	2,282	263,839	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NESTE OIL OYJ	328	410	46,165	328	387	44,746	エネルギー	
NOKIAN RENKAAT OYJ	244	465	52,354	190	636	73,583	自動車・自動車部品	
KONE OYJ-B	257	818	92,106	131	561	64,955	資本財	
ORION OYJ	264	373	41,983	227	408	47,268	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,988	11,815	1,329,022	8,107	10,013	1,157,594	
(ユーロ…アイルランド)		15	—	< 0.7%>	15	—	< 0.6%>	
CRH PLC	767	1,444	162,461	759	1,143	132,163	素材	
KERRY GROUP PLC-A	267	595	67,019	240	703	81,337	食品・飲料・タバコ	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,035	2,040	229,480	1,000	1,846	213,501	
(ユーロ…ギリシャ)		2	—	< 0.1%>	2	—	< 0.1%>	
PIRAEUS BANK S.A.	563	246	27,698	—	—	—	銀行	
ALPHA BANK A.E.	633	303	34,189	—	—	—	銀行	
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	292	546	61,417	326	551	63,725	食品・飲料・タバコ	
NATIONAL BANK OF GREECE	684	694	78,126	—	—	—	銀行	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	495	335	37,748	—	—	—	電気通信サービス	
EFG EUROBANK ERGASIAS	578	241	27,210	—	—	—	銀行	
OPAP SA	266	329	37,050	384	481	55,613	消費者サービス	
PUBLIC POWER CORP	201	250	28,127	318	306	35,381	公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,715	2,947	331,569	1,030	1,338	154,720	
(ユーロ…ポルトガル)		8	—	< 0.2%>	3	—	< 0.1%>	
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	1,305	411	46,248	1,305	352	40,741	銀行	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,960	751	84,570	2,467	640	74,020	公益事業	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	6,685	435	48,955	7,429	371	42,940	銀行	

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等	
		評価額		評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額	外貨建金額	邦貨換算金額		
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	百株	千ユーロ	千円	百株	千ユーロ	千円	電気通信サービス 素材 銀行
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	992	834	93,890	820	713	82,433	
BANCO COMERCIAL PORTUGU-RTS	741	314	35,338	741	393	45,533	
小計	12,685	2,747	309,003	20,193	2,482	286,958	
	株数・金 銘柄・額 数・比 率	—	< 0.2%>	6	—	< 0.1%>	
ユーロ計	223,011	269,488	30,312,019	212,140	264,921	30,624,867	
	株数・金 銘柄・額 数・比 率	—	< 15.5%>	198	—	< 14.8%>	
(イギリス)		千英ポンド		千英ポンド			
AMEC PLC	614	490	65,233	463	535	71,358	エネルギー
Antofagasta PLC	—	—	—	513	673	89,842	素材
BHP BILLITON PLC	2,838	5,502	731,161	2,368	5,660	754,559	素材
ARM HOLDINGS PLC	—	—	—	1,596	913	121,821	半導体・半導体製造装置
BALFOUR BEATTY PLC	1,543	392	52,117	1,360	432	57,715	資本財
Autonomy Corp PLC	—	—	—	309	556	74,166	ソフトウェア・サービス
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	1,400	806	107,142	1,309	1,093	145,722	メディア
AGGREKO PLC	—	—	—	339	615	82,101	商業・専門サービス
TULLOW OIL PLC	1,098	1,224	162,658	1,006	1,337	178,264	エネルギー
AVIVA PLC	3,382	1,086	144,444	3,403	1,466	195,439	保険
DIAGEO PLC	2,948	3,090	410,653	2,738	3,511	468,068	食品・飲料・タバコ
SCHROEDERS PLC	307	413	54,935	237	387	51,629	各種金融
BAE SYSTEMS PLC	3,856	1,227	163,110	2,884	953	127,160	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,437	4,945	657,235	2,162	5,882	784,256	食品・飲料・タバコ
FIRSTGROUP PLC	1,069	404	53,730	1,069	363	48,466	運輸
STANDARD CHARTERED PLC	2,623	4,412	586,438	2,581	4,143	552,376	銀行
REXAM PLC	1,655	511	67,950	1,388	545	72,692	素材
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	1,169	2,088	277,529	1,075	2,333	311,013	食品・飲料・タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	381	591	78,638	271	549	73,313	素材
SABMILLER PLC	1,269	2,483	330,031	1,050	2,337	311,672	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC	2,646	1,421	188,892	1,977	1,158	154,455	消費者サービス
HSBC HOLDINGS PLC	21,382	13,562	1,802,386	19,305	12,172	1,622,697	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	8,901	704	93,626	7,375	853	113,761	保険
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	2,129	558	74,157	1,257	384	51,291	食品・生活必需品小売り
INTERNATIONAL POWER PLC	2,363	680	90,442	2,149	681	90,799	公益事業
RSA INSURANCE GROUP PLC	5,718	671	89,214	3,320	451	60,249	保険
Associated British Foods PLC	—	—	—	379	404	53,875	食品・飲料・タバコ
PEARSON PLC	1,063	1,008	133,976	841	946	126,214	メディア
PRUDENTIAL PLC	3,391	1,856	246,720	2,918	2,140	285,394	保険
RIO TINTO PLC	1,848	5,894	783,318	1,570	6,701	893,353	素材
OLD MUTUAL PLC	8,330	949	126,199	6,553	847	113,043	保険
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	21,295	995	132,355	19,656	830	110,687	銀行
SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	980	1,018	135,295	939	1,283	171,106	公益事業
SERCO GROUP PLC	893	538	71,575	771	430	57,341	商業・専門サービス
BP PLC	22,980	11,968	1,590,485	20,351	9,354	1,247,070	エネルギー
SAGE GROUP PLC (THE)	2,377	562	74,744	2,090	599	79,880	ソフトウェア・サービス
LLOYDS BANKING GROUP PLC	49,698	2,827	375,790	45,069	2,377	316,990	銀行
BG GROUP PLC	4,024	4,271	567,697	3,707	5,229	697,097	エネルギー
TESCO PLC	9,493	3,863	513,455	8,362	3,478	463,780	食品・生活必需品小売り
TOMKINS PLC	1,958	477	63,494	—	—	—	資本財
SMITH & NEPHEW PLC	1,036	637	84,770	841	569	75,916	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	6,301	7,165	952,205	5,617	7,398	986,260	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Weir Group Plc/The	—	—	—	159	316	42,135	資本財
ASTRAZENECA PLC	1,745	4,991	663,331	1,485	4,677	623,605	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC	8,880	1,109	147,390	8,994	1,775	236,685	電気通信サービス
Lonmin Plc	299	516	68,657	291	458	61,066	素材
CARNIVAL PLC	280	732	97,343	234	571	76,174	消費者サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,706	588	78,235	1,445	572	76,306	小売
BARCLAYS PLC	14,260	4,404	585,376	12,750	3,509	467,864	銀行
XSTRATA PLC	2,739	2,769	368,084	2,312	3,292	438,869	素材
BURBERRY GROUP PLC	833	576	76,639	612	790	105,367	耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)			当期末			業種等	
	株数	評価額		株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千英ポンド	千円	百株	千英ポンド	千円		
NEXT PLC	317	651	86,556	226	510	67,995	小売	
ROLLS-ROYCE GROUP PLC	2,001	1,161	154,381	—	—	—	資本財	
KINGFISHER PLC	2,734	602	80,101	2,354	668	89,074	小売	
Vedanta Resources PLC	—	—	—	208	453	60,397	素材	
ICAP PLC	1,154	452	60,078	1,025	495	66,033	各種金融	
ITV PLC	—	—	—	5,575	388	51,728	メディア	
SAINSBURY (J) PLC	2,033	650	86,463	1,351	463	61,838	食品・生活必需品小売り	
Randgold Resources Ltd	141	851	113,205	110	546	72,890	素材	
G4S PLC	2,411	627	83,437	1,976	555	74,097	商業・専門サービス	
Admiral Group PLC	—	—	—	346	584	77,901	保険	
CENTRICA PLC	6,072	1,648	219,083	5,486	1,738	231,796	公益事業	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	4,311	7,827	1,040,212	3,739	7,979	1,063,726	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	3,251	5,670	753,493	3,036	6,516	868,680	エネルギー	
BUNZL PLC	683	489	65,068	595	450	60,026	資本財	
COBHAM PLC	2,102	483	64,233	1,893	427	57,004	資本財	
NATIONAL GRID PLC	2,850	1,420	188,780	3,865	2,394	319,196	公益事業	
KAZAKHMYS PLC	422	505	67,154	379	492	65,643	素材	
UNILEVER PLC	1,501	2,759	366,756	1,355	2,629	350,600	食品・飲料・タバコ	
VODAFONE GROUP PLC	64,098	8,755	1,163,556	56,143	9,510	1,267,881	電気通信サービス	
STANDARD LIFE PLC	3,737	681	90,550	2,942	614	81,980	保険	
HOME RETAIL GROUP-W/I	1,799	444	59,088	1,188	254	33,895	小売	
EXPERIAN PLC	1,166	706	93,905	1,010	783	104,500	商業・専門サービス	
SEVERN TRENT PLC	467	542	72,036	403	611	81,515	公益事業	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	505	549	73,033	478	610	81,386	消費者サービス	
SMITHS GROUP PLC	651	672	89,370	428	522	69,662	資本財	
ANGLO AMERICAN PLC	1,704	4,576	608,164	1,440	4,311	574,750	素材	
3I GROUP PLC	1,823	519	69,005	1,773	509	67,894	各種金融	
CAPITA GROUP PLC	619	480	63,793	461	333	44,502	商業・専門サービス	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	709	2,292	304,614	624	2,117	282,350	家庭用品・パーソナル用品	
MAN GROUP PLC	2,929	698	92,776	2,305	584	77,865	各種金融	
EURASIAN NATURAL RESOURCES	488	488	64,908	499	426	56,920	素材	
REED ELSEVIER PLC	1,189	564	75,064	1,180	647	86,376	メディア	
SHIRE PLC	825	1,148	152,675	628	1,185	158,093	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Fresnillo PLC	503	444	59,128	323	456	60,875	素材	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,165	611	81,207	878	548	73,100	公益事業	
WPP PLC	1,665	1,088	144,594	1,451	1,085	144,686	メディア	
WOLSELEY PLC	—	—	—	333	663	88,398	資本財	
NATIONAL GRID PLC-NPR	1,140	155	20,605	—	—	—	公益事業	
CAIRN ENERGY PLC	2,195	871	115,795	1,637	724	96,546	エネルギー	
CABLE & WIRELESS WORLDWIDE	5,439	433	57,613	5,126	255	34,073	電気通信サービス	
WOLSELEY PLC	390	643	85,509	—	—	—	資本財	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	—	—	—	1,895	1,194	159,200	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数比率	365,366 82	160,169 —	21,284,882 <10.9%>	328,158 89	163,799 —	21,836,073 <10.5%>	
(スイス)		千スイスフラン			千スイスフラン			
SYNGENTA AG	106	2,791	220,703	99	2,869	272,694	素材	
SGS SA	6	891	70,470	5	844	80,294	商業・専門サービス	
SWISSCOM AG-REG	27	1,004	79,435	23	906	86,123	電気通信サービス	
LINDT&SPRUENGLI AG-REG	0.27	735	58,168	0.22	684	65,019	食品・飲料・タバコ	
GIVAUDAN-REG	12	1,152	91,132	10	959	91,215	素材	
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	177	4,171	329,816	157	3,572	339,503	保険	
NOVARTIS AG-REG SHS	2,567	13,311	1,052,411	2,258	12,183	1,157,785	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABB LTD	2,594	5,173	408,991	2,343	5,289	502,663	資本財	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	855	13,499	1,067,305	763	11,311	1,074,897	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO SA-REG	205	1,160	91,743	151	857	81,530	商業・専門サービス	
HOLCIM LTD-REG	307	2,270	179,543	251	1,695	161,156	素材	
NESTLE SA-REGISTERED	4,294	22,458	1,775,540	3,750	20,421	1,940,626	食品・飲料・タバコ	
SONOVA HOLDING AG	83	1,077	85,211	75	672	63,882	ヘルスケア機器・サービス	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	23	586	46,330	19	446	42,418	ヘルスケア機器・サービス	

銘柄	期首(前期末)				当期末				業種等
	株数	評価額		株数	評価額		業種等		
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	千スイスフラン	千円	百株	千スイスフラン	千円			
CREDIT SUISSE GROUP AG	1,412	6,384	504,790	1,221	4,482	425,937	各種金融		
THE SWATCH GROUP AG-B	47	1,468	116,079	35	1,484	141,052	耐久消費財・アパレル		
SWISS REINSURANCE LTD	499	2,365	187,017	—	—	—	保険		
LONZA GROUP AG-REG	94	714	56,464	89	660	62,753	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
NOBEL BIOCARE HOLDING AG	291	644	50,921	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス		
SWISS LIFE HOLDING AG	63	785	62,094	52	743	70,687	保険		
SYNTHESES INC	97	1,168	92,376	51	765	72,759	ヘルスケア機器・サービス		
Schindler Holding AG	—	—	—	76	812	77,203	資本財		
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	94	1,010	79,920	74	976	92,794	運輸		
UBS AG-REG	4,535	7,084	560,086	4,036	6,571	624,511	各種金融		
GEBERIT AG-REG	64	1,157	91,490	46	954	90,714	資本財		
GAM HOLDING LTD	489	603	47,677	409	669	63,583	各種金融		
Actelion Ltd	196	821	64,973	164	755	71,830	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
CIE FINANC RICHEMONT-A	683	2,653	209,757	527	2,880	273,752	耐久消費財・アパレル		
JULIUS BAER GROUP LTD	291	996	78,778	277	1,026	97,508	各種金融		
SWISS RE LTD	—	—	—	440	2,182	207,412	保険		
TRANSOCEAN LTD	—	—	—	345	2,068	196,572	エネルギー		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	20,124 28	98,143 —	7,759,236 <4.0%>	17,759 29	89,749 —	8,528,887 <4.1%>		
(スウェーデン)		千スウェーデンクローネ		千スウェーデンクローネ					
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,845	7,537	87,282	1,815	10,105	131,476	銀行		
Swedbank AB	—	—	—	230	2,617	34,052	銀行		
HOLMEN AB-B SHARES	177	3,231	37,415	152	3,295	42,879	素材		
SWEDISH MATCH AB	441	7,183	83,181	339	7,529	97,961	食品・飲料・タバコ		
NORDEA BANK AB	3,694	23,924	277,043	2,988	21,247	276,425	銀行		
SECURITAS AB-B SHS	717	5,038	58,340	620	4,129	53,723	商業・専門サービス		
INVESTOR AB-B SHS	499	6,339	73,411	466	6,906	89,857	各種金融		
HENNES & MAURITZ AB-B	589	25,991	300,978	1,054	24,651	320,711	小売		
ASSA ABLOY AB-B	525	8,420	97,512	436	7,514	97,769	資本財		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	563	10,822	125,323	620	12,911	167,982	銀行		
ERICSSON LM-B SHS	3,990	31,866	369,013	3,400	31,184	405,716	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
TELIASONERA AB	2,665	12,502	144,783	2,468	11,791	153,411	電気通信サービス		
SKANSKA AB-B SHS	672	7,765	89,928	464	5,321	69,235	資本財		
ALFA LAVAL AB	621	6,203	71,833	474	6,266	81,521	資本財		
GETINGE AB-B SHS	383	5,955	68,962	350	6,033	78,496	ヘルスケア機器・サービス		
Millicom International Cellular SA	—	—	—	106	7,345	95,568	電気通信サービス		
TELE2 AB-B SHS	561	6,378	73,858	479	5,765	75,009	電気通信サービス		
SSAB AB-A	416	4,929	57,087	410	4,200	54,645	素材		
SKF AB-B SHARES	522	7,239	83,830	450	8,189	106,542	資本財		
ATLAS COPCO AB-A SHS	842	9,381	108,637	677	10,966	142,673	資本財		
ATLAS COPCO AB-B SHS	691	7,069	81,860	563	8,205	106,756	資本財		
VOLVO AB-B SHS	1,434	11,344	131,367	1,481	16,475	214,343	資本財		
SCANIA AB-B SHS	570	6,491	75,166	501	7,476	97,265	資本財		
SANDVIK AB	1,028	9,458	109,528	1,191	13,782	179,310	資本財		
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	492	4,447	51,504	632	6,090	79,242	素材		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23,948 23	229,520 —	2,657,853 <1.4%>	22,381 25	250,005 —	3,252,575 <1.6%>		
(ノルウェー)		千ノルウェークローネ		千ノルウェークローネ					
DNB NOR ASA	—	—	—	804	6,464	96,251	銀行		
TELENOR ASA	1,248	10,071	142,409	1,086	9,763	145,373	電気通信サービス		
STATOIL ASA	1,441	18,935	267,740	1,208	16,803	250,204	エネルギー		
YARA INTERNATIONAL ASA	320	6,305	89,162	253	8,114	120,827	素材		
SEADRILL LTD	453	6,258	88,492	361	7,052	105,017	エネルギー		
NORSK HYDRO ASA	1,246	4,965	70,209	1,366	5,758	85,740	素材		
ORKLA ASA	1,325	5,959	84,272	1,207	5,975	88,978	資本財		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,034 6	52,495 —	742,286 <0.4%>	6,286 7	59,932 —	892,393 <0.4%>		
(デンマーク)		千デンマーククローネ		千デンマーククローネ					
CARLSBERG AS-B	160	7,476	113,039	131	7,817	121,174	食品・飲料・タバコ		

銘柄	期首(前期末)			当期末			業種等	
	株数	評価額		株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千デンマーククローネ	千円	百株	千デンマーククローネ	千円		
A. P. MOLLER MAERSK	1	9,154	138,408	1	9,028	139,938	運輸	
DANSKE BANK A/S	641	8,016	121,203	579	6,288	97,473	銀行	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	80	5,434	82,176	61	5,286	81,940	素材	
WILLIAM DEMANT HOLDING	66	2,855	43,179	63	3,110	48,211	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	213	6,170	93,292	209	3,080	47,750	資本財	
NOVO NORDISK A/S-B	569	26,528	401,105	472	30,610	474,463	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DSV A/S	441	3,975	60,103	366	4,732	73,346	運輸	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,174 8	69,610 —	1,052,509 <0.5%>	1,885 8	69,954 —	1,084,298 <0.5%>	
(オーストラリア)		千豪ドル			千豪ドル			
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	3,167	6,997	542,609	2,839	6,244	540,601	銀行	
AMCOR LTD	1,200	716	55,567	1,279	913	79,064	素材	
WESTPAC BANKING CORPORATION	3,653	8,301	643,717	3,206	7,101	614,802	銀行	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	—	—	—	1,589	1,017	88,045	素材	
TELSTRA CORP LTD	4,733	1,386	107,531	3,995	1,210	104,797	電気通信サービス	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	973	1,043	80,909	825	973	84,315	食品・飲料・タバコ	
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	309	974	75,561	244	789	68,341	各種金融	
BHP BILLITON LTD	4,231	16,440	1,274,775	3,629	16,014	1,386,375	素材	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	456	488	37,912	379	526	45,620	エネルギー	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	1,606	536	41,602	1,201	301	26,107	小売	
COMPUTERSHARE LIMITED	832	904	70,155	832	768	66,508	ソフトウェア・サービス	
CSL LIMITED	786	2,403	186,395	591	2,012	174,242	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRANSURBAN GROUP	2,138	938	72,792	1,670	918	79,553	運輸	
COCHLEAR LIMITED	117	848	65,787	101	805	69,712	ヘルスケア機器・サービス	
ORIGIN ENERGY LIMITED	1,069	1,579	122,436	931	1,513	131,060	エネルギー	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	1,924	9,762	756,963	1,663	8,478	733,970	銀行	
RIO TINTO LIMITED	589	3,951	306,403	461	3,724	322,468	素材	
CSR LIMITED	3,720	617	47,884	1,240	360	31,239	資本財	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,240	491	38,088	—	—	—	消費者サービス	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	3,456	1,237	95,963	2,750	959	83,102	保険	
ONESTEEL LIMITED	2,674	842	65,326	2,150	408	35,372	素材	
FOSTER'S GROUP LTD	1,751	970	75,260	1,959	856	74,141	食品・飲料・タバコ	
INTOLL GROUP	5,696	583	45,278	—	—	—	運輸	
ORICA LTD	458	1,116	86,581	375	959	83,037	素材	
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	259	810	62,861	259	612	53,019	資本財	
LEND LEASE CORP LIMITED	1,072	812	62,981	948	832	72,061	不動産	
BLUESCOPE STEEL LTD	3,641	830	64,386	2,739	391	33,917	素材	
MAP GROUP	2,182	602	46,702	1,091	330	28,620	運輸	
WORLEYPARSONS LTD	365	894	69,378	312	922	79,838	エネルギー	
SUNCORP GROUP LTD	1,614	1,293	100,272	1,716	1,439	124,643	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,509	6,060	469,966	2,376	6,265	542,446	銀行	
NEWCREST MINING LIMITED	696	2,255	174,862	855	3,346	289,741	素材	
PALADIN ENERGY LIMITED	1,661	636	49,347	1,459	474	41,060	エネルギー	
INCITEC PIVOT LTD	3,091	924	71,669	2,198	846	73,285	素材	
TOLL HOLDINGS LIMITED	1,285	796	61,785	1,285	664	57,520	運輸	
AMP LIMITED	2,618	1,421	110,237	2,621	1,365	118,216	保険	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	2,697	652	50,624	2,697	561	48,579	運輸	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	1,198	2,320	179,936	1,109	1,941	168,083	保険	
SANTOS LTD	985	1,208	93,741	948	1,358	117,642	エネルギー	
SONIC HEALTHCARE LTD	749	746	57,847	617	762	66,032	ヘルスケア機器・サービス	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	1,201	780	60,556	1,167	912	79,011	消費者サービス	
WESFARMERS LIMITED	1,185	3,286	254,804	997	3,300	285,726	食品・生活必需品小売り	
ALUMINA LTD	4,959	838	64,996	3,994	898	77,811	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	635	2,709	210,079	665	3,059	264,840	エネルギー	
WOOLWORTHS LIMITED	1,428	3,790	293,935	1,237	3,374	292,140	食品・生活必需品小売り	
GOODMAN FIELDER LTD	3,931	538	41,763	3,931	401	34,715	食品・飲料・タバコ	
AGL ENERGY LTD	771	1,055	81,872	623	892	77,240	公益事業	
BRAMBLES LTD	1,581	1,026	79,575	1,426	1,033	89,506	商業・専門サービス	
MACQUARIE GROUP LTD	416	1,800	139,610	406	1,379	119,413	各種金融	

銘柄	株数	期首(前期末)		株数	期末		業種等	
		評価額			評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額		
WESFARMERS LTD-PPS	百株 307	千豪ドル 854	千円 66,239	百株 260	千豪ドル 873	千円 75,625	食品・生活必需品小売り 消費者サービス	
CROWN LTD	1,046	800	62,047	871	761	65,952		
小計	株数・金額 銘柄数比率	90,885	102,883	7,977,588	72,738	95,866	8,299,173	
(ニュージーランド)								
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	3,706	693	43,188	3,004	682	45,258	運輸	
CONTACT ENERGY LTD	1,161	687	42,862	1,094	647	42,997	公益事業	
FLETCHER BUILDING LTD	1,084	859	53,573	1,084	958	63,603	素材	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	2,883	550	34,312	2,883	683	45,344	電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数比率	8,835	2,791	173,937	8,066	2,971	197,203	
(香港)								
HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,090	8,420	98,601	3,020	9,573	99,563	不動産	
BANK OF EAST ASIA	2,262	6,289	73,649	2,232	7,355	76,499	銀行	
CLP HOLDINGS LIMITED	1,960	10,750	125,889	2,160	14,094	146,577	公益事業	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	1,560	13,650	159,841	1,660	19,820	206,132	不動産	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	1,360	3,814	44,671	1,220	4,471	46,501	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,231	14,624	171,250	1,175	19,951	207,495	各種金融	
LI & FUNG LTD	2,860	9,766	114,370	—	—	—	小売	
MTR CORPORATION	2,160	5,605	65,636	2,545	7,126	74,110	運輸	
ESPRIT HOLDINGS LIMITED	1,307	5,753	67,368	1,380	3,948	41,062	小売	
HANG SENG BANK	781	8,044	94,198	778	9,647	100,330	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,560	7,144	83,665	1,460	7,672	79,791	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	1,305	6,074	71,135	1,505	8,217	85,459	公益事業	
THE WHARF (HOLDINGS)	2,260	8,441	98,845	1,970	10,844	112,786	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	5,670	9,821	115,007	5,830	10,308	107,207	公益事業	
HUTCHISON WHAMPOA	2,100	10,101	118,282	2,570	22,076	229,593	資本財	
HYSAN DEVELOPMENT CO	1,910	3,896	45,626	1,440	5,522	57,432	不動産	
KERRY PROPERTIES LTD	1,530	4,911	57,511	1,445	5,584	58,083	不動産	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	4,640	7,813	91,499	4,620	10,833	112,672	銀行	
NWS HOLDINGS LTD	2,350	3,102	36,324	3,525	3,814	39,666	資本財	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	1,480	3,478	40,727	1,585	4,239	44,094	耐久消費財・アパレル	
NEW WORLD DEVELOPMENT	2,050	2,525	29,574	4,630	5,963	62,019	不動産	
SINO LAND CO	3,720	4,769	55,845	3,720	4,895	50,913	不動産	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,730	17,680	207,039	1,660	19,720	205,096	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD A	1,115	9,388	109,936	995	11,561	120,243	不動産	
TELEVISION BROADCASTS LTD	980	3,278	38,386	—	—	—	メディア	
WING HANG BANK LIMITED	480	3,172	37,153	435	3,745	38,951	銀行	
LI & FUNG LTD	—	—	—	5,200	8,424	87,609	小売	
AIA GROUP LTD	—	—	—	7,000	18,690	194,376	保険	
小計	株数・金額 銘柄数比率	53,452	192,317	2,252,041	65,761	258,103	2,684,272	
(シンガポール)								
SINGAPORE TECH ENGINEERING	3,160	982	64,056	3,160	938	61,491	資本財	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	—	—	—	10,990	769	50,404	食品・飲料・タバコ	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,950	2,687	175,145	1,720	2,531	165,886	銀行	
CITY DEVELOPMENTS	1,030	1,058	69,015	960	1,065	69,818	不動産	
SEMBCORP MARINE LTD	2,088	835	54,438	1,638	873	57,202	資本財	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	320	888	57,942	240	952	62,396	小売	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,600	1,180	76,964	1,470	1,103	72,332	各種金融	
CAPITALAND LIMITED	4,180	1,492	97,265	3,440	1,069	70,095	不動産	
GENTING SINGAPORE PLC	—	—	—	7,950	1,590	104,176	消費者サービス	
COMFORTDELGRO CORP LTD	5,170	749	48,862	4,410	635	41,607	運輸	
SINGAPORE AIRLINES LTD	910	1,292	84,225	760	1,074	70,410	運輸	
UNITED OVERSEAS BANK	1,450	2,633	171,631	1,280	2,490	163,202	銀行	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	3,020	1,129	73,619	2,720	1,047	68,612	メディア	
NOBLE GROUP LTD	—	—	—	5,200	1,071	70,185	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	10,007	2,872	187,197	7,417	2,351	154,049	電気通信サービス	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	2,110	844	55,011	1,860	937	61,421	資本財	

銘柄	株数	期首(前期末)		株数	期末		業種等	
		評価額			評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	3,010	千シンガポールドル	千円	百株	千シンガポールドル	千円	銀行 資本財 食品・飲料・タバコ 資本財	
COSCO CORP SINGAPORE LTD	3,890	2,516	164,016	2,630	2,461	161,289		
WILMAR INTERNATIONAL LTD	—	536	34,989	3,000	582	38,132		
KEPPEL CORP LTD	1,560	—	—	1,000	539	35,315		
小計	45,455	1,360	88,665	1,496	1,693	110,956		
(イスラエル)	株数・金額 銘柄数<比率>	45,455 16	23,059 —	1,503,048 <0.8%>	63,341 20	25,778 —	1,688,986 <0.8%>	
BANK HAPOALIM BM	1,642	千イスラエルシェケル	千円	百株	千イスラエルシェケル	千円	銀行 銀行 電気通信サービス 素材 ソフトウェア・サービス	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,818	2,395	56,762	1,642	2,776	64,823		
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	2,843	2,873	68,109	1,818	2,975	69,482		
ISRAEL CHEMICALS LTD	669	2,459	58,290	2,843	2,519	58,823		
NICE SYSTEMS LTD	132	2,831	67,096	669	3,728	87,063		
小計	7,107	1,520	36,035	132	1,634	38,172		
(イギリス)	株数・金額 銘柄数<比率>	7,107 5	12,079 —	286,295 <0.1%>	7,107 5	13,634 —	318,364 <0.2%>	
合計	1,278,107	—	204,031,147	1,170,881	—	201,230,589	<97.0%>	

(注1) 邦貨換算金額は、期首、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) 邦貨換算金額欄の<>内は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、株数が単位未満のみの場合は小数で記載しております。

(注4) 一印は組み入れなしです。

(注5) 銘柄I D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	口数	期首(前期末)		口数	期末		組入比率
		評価額			評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千ドル	千円	%		
AMB PROPERTY CORP	—	28	1,026	83,011	0.0		
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	54	70	1,273	102,993	0.0		
AVALONBAY COMMUNITIES INC	12	12	1,562	126,341	0.1		
BOSTON PROPERTIES INC	20	18	1,936	156,631	0.1		
DUKE REALTY CORP	51	50	751	60,756	0.0		
EQUITY RESIDENTIAL	40	37	2,252	182,216	0.1		
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11	10	921	74,555	0.0		
HCP INC	43	41	1,556	125,902	0.1		
HEALTH CARE REIT INC	21	17	896	72,494	0.0		
KIMCO REALTY CORP	69	61	1,179	95,389	0.0		
PLUM CREEK TIMBER CO INC (REIT)	27	25	1,016	82,199	0.0		
PUBLIC STORAGE	20	19	2,213	179,001	0.1		
REGENCY CENTERS CORP	16	16	771	62,373	0.0		
SIMON PROPERTY GROUP INC	38	35	4,093	331,111	0.2		
VENTAS INC	26	23	1,301	105,241	0.1		
VORNADO REALTY TRUST	23	21	2,100	169,852	0.1		
小計	478	489	24,852	2,010,070			
(カナダ)	口数・金額 銘柄数<比率>	478 15	489 16	24,852 —	2,010,070 <1.0%>		
CANADIAN OIL SANDS TRUST	39	—	—	—	—		
ENERPLUS RESOURCES FUND	34	—	—	—	—		
PENN WEST ENERGY TRUST	65	—	—	—	—		
PROVIDENT ENERGY TRUST	72	—	—	—	—		
小計	211	—	—	—	—		
(ユーロ圏・フランス)	口数・金額 銘柄数<比率>	211 4	—	—	<0.5%>		
UNIBAIL-RODAMCO SE	12	10	千ユーロ	1,638	189,423	0.1	
KLEPIERRE	20	19	578	66,905	0.0		
小計	32	30	2,217	256,329			
(その他)	口数・金額 銘柄数<比率>	32 2	30 2	2,217 —	256,329 <0.1%>		

	期首 (前期末)		当 期		期 末	
	口 数	口 数	評 価 額		組 入 比 率	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(ユーロ…オランダ)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
CORIO NV	12	11	529	61,230	0.0	
小 計	口 数 銘 柄	口 数 銘 柄	金 額 数<比 率>	金 額 数<比 率>		
	12 1	11 1	529 —	61,230 <0.0%>		
ユーロ計	口 数 銘 柄	口 数 銘 柄	金 額 数<比 率>	金 額 数<比 率>		
	45 3	41 3	2,747 —	317,559 <0.2%>		
(イギリス)			千英ポンド			
BRITISH LAND CO PLC	148	98	579	77,246	0.0	
HAMMERSON PLC	138	123	583	77,761	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	95	95	787	104,968	0.1	
SEGRE PLC	156	146	469	62,627	0.0	
小 計	口 数 銘 柄	口 数 銘 柄	金 額 数<比 率>	金 額 数<比 率>		
	537 4	463 4	2,419 —	322,604 <0.2%>		
(オーストラリア)			千豪ドル			
MIRVAC GROUP	614	614	774	67,055	0.0	
CFS RETAIL PROPERTY TRUST	403	380	706	61,190	0.0	
GPT GROUP	—	219	686	59,402	0.0	
STOCKLAND	351	316	1,118	96,860	0.0	
WESTFIELD GROUP	272	235	2,153	186,395	0.1	
GOODMAN GROUP	—	864	635	55,024	0.0	
WESTFIELD RETAIL TRUST	—	261	694	60,117	0.0	
小 計	口 数 銘 柄	口 数 銘 柄	金 額 数<比 率>	金 額 数<比 率>		
	1,642 4	2,891 7	6,769 —	586,046 <0.3%>		
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	337	299	7,848	81,627	0.0	
小 計	口 数 銘 柄	口 数 銘 柄	金 額 数<比 率>	金 額 数<比 率>		
	337 1	299 1	7,848 —	81,627 <0.0%>		
(シンガポール)			千シンガポールドル			
CAPITAMALL TRUST	466	484	938	61,520	0.0	
小 計	口 数 銘 柄	口 数 銘 柄	金 額 数<比 率>	金 額 数<比 率>		
	466 1	484 1	938 —	61,520 <0.0%>		
合 計	口 数 銘 柄	口 数 銘 柄	金 額 数<比 率>	金 額 数<比 率>		
	3,719 32	4,669 32	— —	3,379,429 <1.6%>		

(注1) 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。

(注2) <>内は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 口数・評価額の単位未満は切り捨てています。

(注4) ー印は組み入れなしです。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別	期 首 (前期末)		当 期	
	買 建 額	売 建 額	買 建 額	売 建 額
外 国 株 式 先 物 取 引	百万円	百万円	百万円	百万円
	4,921	—	3,388	—
	1,694	—	1,122	—
	1,651	—	1,129	—

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 邦貨換算金額は、期首・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3) ー印は組み入れなしです。

(4) 下記は、TMA外国債券インデックスマザーファンド全体(317,248,697千口)の内容です。

(A) 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

区分	当		期			末		
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千米ドル 1,336,920	千米ドル 1,470,138	千米ドル 118,904,817	% 37.8	% —	% 16.5	% 14.1	% 7.2
カナダ	千カナダドル 99,940	千カナダドル 111,033	9,190,227	2.9	—	1.4	1.0	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 416,000	千メキシコペソ 440,697	3,071,661	1.0	—	0.5	0.2	0.2
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	241,280	258,924	29,931,714	9.5	—	4.8	3.2	1.5
イタリア	278,410	279,015	32,254,141	10.3	—	6.5	2.7	1.0
フランス	244,910	259,782	30,030,854	9.6	—	5.1	3.2	1.2
オランダ	65,590	71,245	8,235,978	2.6	—	1.6	0.9	0.2
スペイン	129,500	125,349	14,490,394	4.6	—	2.4	1.3	0.9
ベルギー	70,480	72,773	8,412,643	2.7	—	1.5	0.8	0.3
オーストリア	45,720	49,064	5,671,837	1.8	—	1.2	0.5	0.1
フィンランド	17,220	18,280	2,113,270	0.7	—	0.4	0.3	0.0
アイルランド	25,800	18,922	2,187,437	0.7	—	0.4	0.2	0.1
ポルトガル	29,570	21,826	2,523,115	0.8	—	0.5	—	0.1
イギリス	千英ポンド 166,830	千英ポンド 184,669	24,618,273	7.8	—	5.5	1.9	0.4
スイス	千スイスフラン 16,720	千スイスフラン 18,559	1,763,715	0.6	—	0.3	0.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 157,770	千スウェーデンクローネ 170,723	2,221,112	0.7	—	0.5	0.2	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 53,900	千ノルウェークローネ 58,056	864,456	0.3	—	0.1	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 153,230	千デンマーククローネ 170,804	2,647,470	0.8	—	0.5	0.2	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 94,880	千ポーランドズロチ 93,780	2,734,638	0.9	—	0.3	0.4	0.2
オーストラリア	千豪ドル 39,470	千豪ドル 40,704	3,523,821	1.1	—	0.6	0.3	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 16,650	千シンガポールドル 17,884	1,171,798	0.4	—	0.2	0.1	—
マレーシア	千マレーシアリンギット 64,900	千マレーシアリンギット 65,991	1,767,922	0.6	—	0.3	0.2	0.1
合計	—	—	308,331,304	98.1	—	51.2	32.2	14.7

(注1) 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。

(注2) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 額面・評価額の単位未満は切り捨てています。

(注4) —印は組み入れなしです。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社よりデータを入手しています。

(B) 詳細開示

外国(外貨建) 公社債銘柄別

銘柄名	当期				期末	
	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		
(アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円		
国債証券	T 0 5/8 07/31/12	0.625	26,000	26,109	2,111,751	2012/7/31
	T 1 1/2 12/31/13	1.5	50,000	51,062	4,129,935	2013/12/31
	T 1 3/4 01/31/14	1.75	19,000	19,532	1,579,820	2014/1/31
	T 1 3/4 08/15/12	1.75	15,500	15,779	1,276,264	2012/8/15
	T 1 3/8 11/15/12	1.375	27,700	28,128	2,275,031	2012/11/15
	T 1 7/8 02/28/14	1.875	4,000	4,125	333,630	2014/2/28
	T 1 7/8 06/15/12	1.875	9,000	9,152	740,260	2012/6/15
	T 1 7/8 06/30/15	1.875	26,000	26,613	2,152,494	2015/6/30
	T 1 7/8 08/31/17	1.875	5,000	4,908	397,007	2017/8/31
	T 2 1/2 03/31/13	2.5	27,000	28,033	2,267,357	2013/3/31
	T 2 1/2 06/30/17	2.5	22,000	22,491	1,819,117	2017/6/30
	T 2 3/4 02/15/19	2.75	19,100	19,365	1,566,290	2019/2/15
	T 2 3/4 02/28/13	2.75	20,000	20,825	1,684,326	2013/2/28
	T 2 3/8 09/30/14	2.375	15,000	15,696	1,269,500	2014/9/30
	T 2 3/8 10/31/14	2.375	42,000	43,939	3,553,804	2014/10/31
	T 2 5/8 07/31/14	2.625	22,500	23,716	1,918,182	2014/7/31
	T 2 7/8 01/31/13	2.875	15,450	16,090	1,301,434	2013/1/31
	T 2.625 06/30/14	2.625	10,000	10,539	852,399	2014/6/30
	T 3 1/2 02/15/18	3.5	14,270	15,355	1,241,981	2018/2/15
	T 3 1/2 05/15/20	3.5	5,000	5,246	424,304	2020/5/15
	T 3 1/4 07/31/16	3.25	29,000	31,129	2,517,769	2016/7/31
	T 3 1/8 04/30/13	3.125	16,000	16,832	1,361,412	2013/4/30
	T 3 1/8 10/31/16	3.125	13,000	13,842	1,119,619	2016/10/31
	T 3 3/8 06/30/13	3.375	31,000	32,852	2,657,129	2013/6/30
	T 3 3/8 07/31/13	3.375	18,400	19,541	1,580,506	2013/7/31
	T 3 3/8 11/15/19	3.375	44,500	46,627	3,771,244	2019/11/15
	T 3 3/8 11/30/12	3.375	26,000	27,200	2,199,973	2012/11/30
	T 3 5/8 02/15/21	3.625	13,000	13,639	1,103,190	2021/2/15
	T 3 5/8 12/31/12	3.625	17,000	17,881	1,446,286	2012/12/31
	T 3 7/8 02/15/13	3.875	12,010	12,723	1,029,043	2013/2/15
	T 3 7/8 05/15/18	3.875	16,900	18,582	1,502,918	2018/5/15
	T 3 7/8 08/15/40	3.875	17,700	16,590	1,341,878	2040/8/15
	T 3 7/8 10/31/12	3.875	11,930	12,541	1,014,349	2012/10/31
	T 3.75 11/15/18	3.75	38,000	41,325	3,342,366	2018/11/15
	T 4 02/15/14	4.0	19,420	21,137	1,709,597	2014/2/15
	T 4 02/15/15	4.0	30,810	34,045	2,753,563	2015/2/15
	T 4 1/2 02/15/16	4.5	31,740	35,990	2,910,886	2016/2/15
	T 4 1/2 02/15/36	4.5	12,660	13,354	1,080,097	2036/2/15
	T 4 1/2 05/15/38	4.5	15,620	16,393	1,325,920	2038/5/15
	T 4 1/2 08/15/39	4.5	3,500	3,659	295,951	2039/8/15
T 4 1/2 11/15/15	4.5	20,860	23,620	1,910,441	2015/11/15	
T 4 1/4 05/15/39	4.25	28,000	28,100	2,272,778	2039/5/15	
T 4 1/4 08/15/13	4.25	20,730	22,427	1,813,917	2013/8/15	
T 4 1/4 08/15/14	4.25	16,260	17,990	1,455,044	2014/8/15	
T 4 1/4 08/15/15	4.25	19,930	22,306	1,804,111	2015/8/15	
T 4 1/4 09/30/12	4.25	17,000	17,907	1,448,327	2012/9/30	
T 4 1/4 11/15/13	4.25	22,500	24,507	1,982,160	2013/11/15	
T 4 1/4 11/15/14	4.25	20,740	23,050	1,864,329	2014/11/15	
T 4 1/4 11/15/17	4.25	13,000	14,620	1,182,541	2017/11/15	
T 4 1/8 05/15/15	4.125	17,500	19,474	1,575,074	2015/5/15	
T 4 11/15/12	4.0	11,880	12,522	1,012,800	2012/11/15	

銘柄名	当 期 末						
	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 米 ド ル	千 米 ド ル	千 円			
(アメリカ)	国債証券	T 4 3/4 02/15/41	4.75	8,500	9,239	747,312	2041/2/15
		T 4 3/4 05/15/14	4.75	23,500	26,220	2,120,743	2014/5/15
		T 4 3/4 08/15/17	4.75	11,660	13,452	1,088,056	2017/8/15
		T 4 3/8 08/15/12	4.375	18,800	19,740	1,596,571	2012/8/15
		T 4 3/8 11/15/39	4.375	29,100	29,763	2,407,299	2039/11/15
		T 4 5/8 02/15/17	4.625	20,000	22,903	1,852,404	2017/2/15
		T 4 5/8 11/15/16	4.625	19,800	22,655	1,832,379	2016/11/15
		T 5 05/15/37	5.0	11,350	12,878	1,041,629	2037/5/15
		T 5 1/2 08/15/28	5.5	6,700	8,097	654,932	2028/8/15
		T 5 1/4 02/15/29	5.25	10,190	11,971	968,267	2029/2/15
		T 5 3/8 02/15/31	5.375	1,480	1,767	142,969	2031/2/15
		T 6 1/2 11/15/26	6.5	2,050	2,720	220,001	2026/11/15
		T 6 1/4 05/15/30	6.25	4,310	5,667	458,399	2030/5/15
		T 6 1/4 08/15/23	6.25	13,600	17,459	1,412,083	2023/8/15
		T 6 1/8 11/15/27	6.125	4,790	6,158	498,131	2027/11/15
		T 7 1/2 11/15/16	7.5	8,670	11,224	907,873	2016/11/15
		T 7 1/4 05/15/16	7.25	23,020	29,177	2,359,904	2016/5/15
		T 7 1/8 02/15/23	7.125	8,530	11,676	944,417	2023/2/15
		T 8 1/8 08/15/19	8.125	22,060	31,077	2,513,509	2019/8/15
		T 8 11/15/21	8.0	10,700	15,387	1,244,576	2021/11/15
T 8 3/4 05/15/17	8.75	25,500	35,209	2,847,778	2017/5/15		
T 8 3/4 08/15/20	8.75	31,500	46,556	3,765,450	2020/8/15		
小 計	—	—	—	118,904,817	—		
(カナダ)	国債証券	CAN 1 3/4 03/01/13	1.75	6,600	6,627	548,549	2013/3/1
		CAN 2 03/01/14	2.0	6,500	6,529	540,447	2014/3/1
		CAN 2 09/01/12	2.0	8,000	8,066	667,655	2012/9/1
		CAN 2 12/01/14	2.0	5,300	5,297	438,487	2014/12/1
		CAN 3 3/4 06/01/19	3.75	7,500	7,983	660,752	2019/6/1
		CAN 4 06/01/16	4.0	5,300	5,719	473,411	2016/6/1
		CAN 4 06/01/17	4.0	3,400	3,677	304,426	2017/6/1
		CAN 4 06/01/41	4.0	2,600	2,844	235,452	2041/6/1
		CAN 4 1/2 06/01/15	4.5	7,980	8,707	720,722	2015/6/1
		CAN 4 1/4 06/01/18	4.25	7,250	7,968	659,550	2018/6/1
		CAN 5 06/01/14	5.0	8,850	9,651	798,858	2014/6/1
		CAN 5 06/01/37	5.0	7,410	9,234	764,314	2037/6/1
		CAN 5 1/4 06/01/12	5.25	3,700	3,846	318,407	2012/6/1
		CAN 5 1/4 06/01/13	5.25	7,200	7,717	638,756	2013/6/1
		CAN 5 3/4 06/01/33	5.75	3,800	5,097	421,883	2033/6/1
		CAN 5.75 06/01/29	5.75	5,910	7,730	639,859	2029/6/1
		CAN 9 06/01/25	9.0	2,640	4,333	358,690	2025/6/1
小 計	—	—	—	9,190,227	—		
(メキシコ)	国債証券	MBONO 10 11/20/36	10.0	2,000	2,472	17,231	2036/11/20
		MBONO 10 12/05/24	10.0	32,000	39,712	276,796	2024/12/5
		MBONO 6 06/18/15	6.0	70,000	69,674	485,633	2015/6/18
		MBONO 7 1/2 06/03/27	7.5	13,000	13,028	90,806	2027/6/3
		MBONO 7 1/2 06/21/12	7.5	97,000	99,699	694,906	2012/6/21
		MBONO 7 1/4 12/15/16	7.25	30,000	31,209	217,526	2016/12/15
		MBONO 8 06/11/20	8.0	50,000	53,865	375,441	2020/6/11
		MBONO 8 1/2 05/31/29	8.5	40,000	43,339	302,078	2029/5/31
		MBONO 8 1/2 11/18/38	8.5	35,000	37,288	259,899	2038/11/18
		MBONO 8 1/2 12/13/18	8.5	11,000	12,227	85,224	2018/12/13
MBONO 8 12/07/23	8.0	11,000	11,753	81,918	2023/12/7		

銘柄名	当 期 末				
	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	
	%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
(メキシコ)					
国債証券					
MBONO 8 12/19/13	8.0	25,000	26,427	184,197	2013/12/19
小 計	—	—	—	3,071,661	—
(ユーロ)		千ユーロ	千ユーロ		
(ドイツ)					
国債証券					
DBR 3 1/2 07/04/19	3.5	6,000	6,309	729,320	2019/7/4
DBR 3 1/4 01/04/20	3.25	23,000	23,713	2,741,222	2020/1/4
DBR 3 1/4 07/04/42	3.25	1,500	1,426	164,955	2042/7/4
DBR 3 3/4 01/04/15	3.75	18,460	19,586	2,264,148	2015/1/4
DBR 3 3/4 01/04/19	3.75	17,730	18,976	2,193,674	2019/1/4
DBR 3 3/4 07/04/13	3.75	4,000	4,178	482,976	2013/7/4
DBR 4 01/04/18	4.0	11,240	12,183	1,408,358	2018/1/4
DBR 4 01/04/37	4.0	8,230	8,829	1,020,744	2037/1/4
DBR 4 07/04/16	4.0	6,500	7,020	811,512	2016/7/4
DBR 4 1/2 01/04/13	4.5	10,500	11,001	1,271,819	2013/1/4
DBR 4 1/4 01/04/14	4.25	12,780	13,592	1,571,328	2014/1/4
DBR 4 1/4 07/04/14	4.25	9,170	9,827	1,136,057	2014/7/4
DBR 4 3/4 07/04/28	4.75	5,880	6,809	787,125	2028/7/4
DBR 4 3/4 07/04/34	4.75	5,600	6,610	764,208	2034/7/4
DBR 4 3/4 07/04/40	4.75	1,500	1,830	211,548	2040/7/4
DBR 4.25 07/04/17	4.25	8,800	9,665	1,117,278	2017/7/4
DBR 4.25 07/04/39	4.25	7,500	8,448	976,588	2039/7/4
DBR 5 07/04/12	5.0	15,440	16,045	1,854,830	2012/7/4
DBR 5 5/8 01/04/28	5.625	2,600	3,285	379,817	2028/1/4
DBR 5.5 01/04/31	5.5	3,950	5,013	579,542	2031/1/4
DBR 6 1/4 01/04/30	6.25	3,050	4,180	483,281	2030/1/4
DBR 6.25 01/04/24	6.25	3,000	3,928	454,099	2024/1/4
DBR 6.5 07/04/27	6.5	2,350	3,212	371,332	2027/7/4
OBL 1 3/4 10/09/15	1.75	19,000	18,695	2,161,147	2015/10/9
OBL 2 02/26/16	2.0	3,000	2,967	343,037	2016/2/26
OBL 2 1/4 04/10/15	2.25	7,000	7,059	816,118	2015/4/10
OBL 3 1/2 04/12/13	3.5	13,000	13,468	1,556,960	2013/4/12
OBL 4 10/13 #153	4.0	10,500	11,061	1,278,677	2013/10/11
(イタリア)					
国債証券					
BTPS 3 3/4 03/01/21	3.75	5,000	4,677	540,719	2021/3/1
BTPS 3 3/4 08/01/15	3.75	16,740	16,788	1,940,755	2015/8/1
BTPS 3 3/4 08/01/16	3.75	13,480	13,439	1,553,613	2016/8/1
BTPS 3 3/4 08/01/21	3.75	7,950	7,487	865,533	2021/8/1
BTPS 3 3/4 12/13	3.75	10,800	10,944	1,265,209	2013/12/15
BTPS 4 02/01/37	4.0	15,660	12,841	1,484,442	2037/2/1
BTPS 4 1/2 02/01/18	4.5	8,900	9,053	1,046,638	2018/2/1
BTPS 4 1/2 02/01/20	4.5	13,970	14,070	1,626,559	2020/2/1
BTPS 4 1/2 03/01/26	4.5	2,000	1,896	219,177	2026/3/1
BTPS 4 1/2 08/18	4.5	10,300	10,433	1,206,158	2018/8/1
BTPS 4 1/4 02/01/15	4.25	13,000	13,293	1,536,763	2015/2/1
BTPS 4 1/4 02/01/19	4.25	18,020	17,940	2,073,946	2019/2/1
BTPS 4 1/4 08/01/13	4.25	13,000	13,338	1,541,872	2013/8/1
BTPS 4 1/4 08/01/14	4.25	18,920	19,364	2,238,550	2014/8/1
BTPS 4 1/4 09/19	4.25	6,500	6,445	745,088	2019/9/1
BTPS 4 1/4 10/15/12	4.25	10,500	10,750	1,242,761	2012/10/15
BTPS 4 3/4 02/01/13	4.75	17,000	17,542	2,027,909	2013/2/1
BTPS 4 3/4 08/01/23	4.75	11,400	11,400	1,317,840	2023/8/1
BTPS 5 03/01/25	5.0	9,500	9,587	1,108,303	2025/3/1
BTPS 5 08/01/34	5.0	9,760	9,349	1,080,756	2034/8/1
BTPS 5 08/01/39	5.0	3,500	3,295	381,011	2039/8/1
BTPS 5 1/4 08/01/17	5.25	11,500	12,227	1,413,551	2017/8/1
BTPS 5.25 11/01/29	5.25	14,800	14,955	1,728,844	2029/11/1

銘柄名		当期末					
		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		
(ユーロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
(イタリア)	国債証券	BTPS 6 05/01/31	6.0	11,210	12,172	1,407,191	2031/5/1
		BTPS 6 1/2 11/01/27	6.5	5,000	5,717	660,943	2027/11/1
(フランス)	国債証券	BTNS 4 1/2 07/12/12	4.5	4,860	5,025	580,973	2012/7/12
		FRTR 3 1/2 04/25/15	3.5	7,800	8,134	940,362	2015/4/25
		FRTR 3 1/2 04/25/26	3.5	3,000	2,910	336,465	2026/4/25
		FRTR 3 1/4 04/25/16	3.25	15,500	15,966	1,845,733	2016/4/25
		FRTR 3 10/25/15	3.0	19,500	19,932	2,304,243	2015/10/25
		FRTR 3 3/4 01/13	3.75	7,200	7,449	861,118	2013/1/12
		FRTR 3 3/4 04/25/17	3.75	4,000	4,208	486,444	2017/4/25
		FRTR 3 3/4 04/25/21	3.75	7,500	7,742	895,004	2021/4/25
		FRTR 3 3/4 10/19	3.75	14,200	14,777	1,708,329	2019/10/25
		FRTR 4 04/25/13	4.0	10,980	11,455	1,324,248	2013/4/25
		FRTR 4 04/25/14	4.0	16,210	17,103	1,977,126	2014/4/25
		FRTR 4 04/25/18	4.0	7,350	7,818	903,783	2018/4/25
		FRTR 4 04/25/55	4.0	10,370	10,430	1,205,724	2055/4/25
		FRTR 4 1/4 04/25/19	4.25	13,960	15,055	1,740,457	2019/4/25
		FRTR 4 1/4 10/18	4.25	10,200	11,010	1,272,860	2018/10/25
		FRTR 4 10/25/13	4.0	12,570	13,204	1,526,473	2013/10/25
		FRTR 4 10/25/14	4.0	12,000	12,710	1,469,322	2014/10/25
		FRTR 4 10/25/38	4.0	9,400	9,507	1,099,027	2038/10/25
		FRTR 4 3/4 04/25/35	4.75	10,580	11,909	1,376,785	2035/4/25
		FRTR 4 3/4 10/25/12	4.75	8,700	9,086	1,050,373	2012/10/25
		FRTR 4.25 10/23	4.25	14,400	15,374	1,777,336	2023/10/25
		FRTR 5 1/2 04/25/29	5.5	6,810	8,257	954,523	2029/4/25
		FRTR 5 10/25/16	5.0	9,300	10,378	1,199,789	2016/10/25
FRTR 5 3/4 10/25/32	5.75	920	1,159	134,046	2032/10/25		
FRTR 6 10/25/25	6.0	5,100	6,434	743,788	2025/10/25		
FRTR4.5 04/25/41	4.5	2,500	2,738	316,512	2041/4/25		
(オランダ)	国債証券	NETHER 1 01/15/14	1.0	4,000	3,911	452,180	2014/1/15
		NETHER 3 1/4 07/15	3.25	3,000	3,113	359,909	2015/7/15
		NETHER 3 3/4 01/15/42	3.75	1,000	1,023	118,316	2042/1/15
		NETHER 3 3/4 07/15/14	3.75	9,060	9,534	1,102,216	2014/7/15
		NETHER 4 01/15/37	4.0	5,960	6,308	729,212	2037/1/15
		NETHER 4 07/15/16	4.0	7,640	8,170	944,565	2016/7/15
		NETHER 4 07/15/18	4.0	12,000	12,810	1,480,836	2018/7/15
		NETHER 4 07/15/19	4.0	4,500	4,798	554,741	2019/7/15
		NETHER 4 1/4 07/15/13	4.25	6,440	6,782	784,069	2013/7/15
		NETHER 5 07/15/12	5.0	4,030	4,187	484,130	2012/7/15
NETHER 5 1/2 01/15/28	5.5	3,190	3,939	455,423	2028/1/15		
NETHER 7 1/2 01/15/23	7.5	4,770	6,664	770,377	2023/1/15		
(スペイン)	国債証券	SPGB 2 1/2 10/31/13	2.5	11,500	11,137	1,287,523	2013/10/31
		SPGB 3 1/4 04/30/16	3.25	4,200	3,945	456,146	2016/4/30
		SPGB 3.8 01/31/17	3.8	7,000	6,660	769,953	2017/1/31
		SPGB 3.9 10/31/12	3.9	4,000	4,036	466,561	2012/10/31
		SPGB 4.1 07/30/18	4.1	12,200	11,585	1,339,239	2018/7/30
		SPGB 4.2 01/31/37	4.2	9,000	7,059	816,089	2037/1/31
		SPGB 4.3 10/31/19	4.3	10,000	9,439	1,091,148	2019/10/31
		SPGB 4.4 01/31/15	4.4	10,030	10,104	1,168,048	2015/1/31
		SPGB 4.65 07/30/25	4.65	6,000	5,458	631,037	2025/7/30
		SPGB 4.7 07/30/41	4.7	1,000	834	96,468	2041/7/30
		SPGB 4.75 07/30/14	4.75	9,620	9,806	1,133,646	2014/7/30
		SPGB 4.8 01/31/24	4.8	4,800	4,514	521,864	2024/1/31
		SPGB 4.85 10/31/20	4.85	4,000	3,888	449,452	2020/10/31
		SPGB 4.9 07/30/40	4.9	1,500	1,300	150,372	2040/7/30

銘柄名	当期末						
	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			
(ユーロ)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円			
(スペイン)	国債証券	SPGB 5 07/30/12	5.0	9,800	10,039	1,160,522	2012/7/30
		SPGB 5 1/2 07/30/17	5.5	5,750	5,953	688,230	2017/7/30
		SPGB 5 3/4 07/30/32	5.75	4,160	4,123	476,664	2032/7/30
		SPGB 6 01/31/29	6.0	5,550	5,657	653,962	2029/1/31
		SPGB 6.15 01/31/13	6.15	9,390	9,805	1,133,462	2013/1/31
(ベルギー)	国債証券	BGB 3 1/4 09/28/16	3.25	6,450	6,371	736,523	2016/9/28
		BGB 3 3/4 09/28/15	3.75	5,920	6,039	698,175	2015/9/28
		BGB 3 3/4 09/28/20	3.75	7,000	6,832	789,779	2020/9/28
		BGB 4 03/28/14	4.0	4,000	4,140	478,584	2014/3/28
		BGB 4 03/28/19	4.0	5,500	5,534	639,805	2019/3/28
		BGB 4 03/28/22	4.0	6,240	6,153	711,389	2022/3/28
		BGB 4 1/4 03/28/41	4.25	1,000	945	109,322	2041/3/28
		BGB 4 1/4 09/28/13	4.25	5,710	5,941	686,809	2013/9/28
		BGB 4 1/4 09/28/14	4.25	6,000	6,253	722,939	2014/9/28
		BGB 5 03/28/35	5.0	4,710	5,031	581,663	2035/3/28
		BGB 5 09/28/12	5.0	4,000	4,158	480,664	2012/9/28
		BGB 5 1/2 03/28/28	5.5	4,220	4,722	545,884	2028/3/28
		BGB 5 1/2 09/28/17	5.5	5,000	5,493	635,048	2017/9/28
		BGB 8 12/24/12	8.0	4,730	5,156	596,053	2012/12/24
(オーストリア)	国債証券	RAGB 3 1/2 07/15/15	3.5	5,500	5,703	659,324	2015/7/15
		RAGB 3 1/2 09/15/21	3.5	5,200	5,220	603,524	2021/9/15
		RAGB 3.9 07/15/20	3.9	4,500	4,702	543,556	2020/7/15
		RAGB 4 09/15/16	4.0	2,000	2,116	244,609	2016/9/15
		RAGB 4.15 03/37	4.15	3,030	3,113	359,935	2037/3/15
		RAGB 4.3 07/15/14	4.3	6,530	6,940	802,273	2014/7/15
		RAGB 4.35 03/19	4.35	3,000	3,238	374,370	2019/3/15
		RAGB 4.65 01/15/18	4.65	8,830	9,688	1,119,964	2018/1/15
		RAGB 5 07/15/12	5.0	3,570	3,709	428,869	2012/7/15
(フィンランド)	国債証券	RFIG 1 3/4 04/15/16	1.75	2,000	1,932	223,362	2016/4/15
		RFIG 3 7/8 09/15/17	3.875	2,000	2,126	245,765	2017/9/15
		RFIG 4 07/04/25	4.0	2,000	2,094	242,158	2025/7/4
		RFIG 4 1/4 07/04/15	4.25	3,310	3,562	411,869	2015/7/4
		RFIG 4 1/4 09/15/12	4.25	600	621	71,794	2012/9/15
		RFIG 4 3/8 07/04/19	4.375	5,000	5,460	631,176	2019/7/4
		RFIG 5 3/8 07/04/13	5.375	2,310	2,483	287,143	2013/7/4
(アイルランド)	国債証券	IRISH 4 01/15/14	4.0	5,500	4,420	511,056	2014/1/15
		IRISH 4 1/2 04/18/20	4.5	4,520	2,882	333,205	2020/4/18
		IRISH 4 1/2 10/18/18	4.5	5,900	3,955	457,239	2018/10/18
		IRISH 4.6 04/18/16	4.6	1,780	1,317	152,350	2016/4/18
		IRISH 5 04/18/13	5.0	4,100	3,628	419,407	2013/4/18
		IRISH 5.4 03/13/25	5.4	2,000	1,298	150,048	2025/3/13
(ポルトガル)	国債証券	PGB 3.35 10/15/15	3.35	3,300	2,518	291,145	2015/10/15
		PGB 3.85 04/15/21	3.85	5,020	3,246	375,287	2021/4/15
		PGB 4 3/8 06/16/14	4.375	2,000	1,667	192,809	2014/6/16
		PGB 4.1 04/15/37	4.1	2,160	1,299	150,192	2037/4/15
		PGB 4.2 10/15/16	4.2	3,050	2,237	258,617	2016/10/15
		PGB 4.45 06/15/18	4.45	9,350	6,484	749,576	2018/6/15
		PGB 5 06/15/12	5.0	2,450	2,367	273,732	2012/6/15
		PGB 5.45 09/23/13	5.45	2,240	2,004	231,754	2013/9/23
小計		—	—	—	135,851,387	—	
(イギリス)			千英ポンド	千英ポンド			
	国債証券	UKT 2 01/22/16	2.0	3,000	2,979	397,210	2016/1/22

銘柄名	当期末					
	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		
	%	千英ポンド	千英ポンド	千円		
(イギリス)						
国債証券	UKT 2 1/4 03/07/14	2.25	6,100	6,251	833,406	2014/3/7
	UKT 2 3/4 01/22/15	2.75	4,700	4,864	648,486	2015/1/22
	UKT 3 3/4 09/07/19	3.75	4,200	4,395	585,993	2019/9/7
	UKT 3 3/4 09/07/20	3.75	8,500	8,798	1,172,908	2020/9/7
	UKT 4 01/22/60	4.0	1,000	987	131,683	2060/1/22
	UKT 4 09/07/16	4.0	5,700	6,182	824,189	2016/9/7
	UKT 4 1/2 03/07/13	4.5	9,000	9,661	1,288,022	2013/3/7
	UKT 4 1/2 12/07/42	4.5	9,930	10,635	1,417,874	2042/12/7
	UKT 4 1/4 12/07/27	4.25	1,130	1,170	156,099	2027/12/7
	UKT 4 1/4 12/07/46	4.25	9,650	9,970	1,329,138	2046/12/7
	UKT 4 1/4 12/07/55	4.25	8,400	8,741	1,165,368	2055/12/7
	UKT 4 3/4 03/07/20	4.75	8,600	9,621	1,282,666	2020/3/7
	UKT 4 3/4 09/07/15	4.75	14,050	15,644	2,085,610	2015/9/7
	UKT 4 3/4 12/07/30	4.75	4,500	4,918	655,661	2030/12/7
	UKT 4 3/4 12/07/38	4.75	11,600	12,839	1,711,690	2038/12/7
	UKT 4.25 06/07/32	4.25	10,110	10,356	1,380,649	2032/6/7
	UKT 4.5 09/07/34	4.5	3,400	3,591	478,767	2034/9/7
	UKT 5 03/07/18	5.0	5,800	6,625	883,277	2018/3/7
	UKT 5 03/07/25	5.0	4,100	4,639	618,543	2025/3/7
	UKT 5 09/07/14	5.0	8,700	9,643	1,285,518	2014/9/7
UKT 6 12/07/28	6.0	7,410	9,326	1,243,377	2028/12/7	
UKT 8 06/07/21	8.0	8,250	11,556	1,540,610	2021/6/7	
UKT 8 09/27/13	8.0	5,000	5,805	773,991	2013/9/27	
UKT 8 3/4 08/25/17	8.75	4,000	5,457	727,525	2017/8/25	
小計	—	—	—	—	24,618,273	—
(スイス)			千スイスフラン	千スイスフラン		
国債証券	SWISS 2 1/2 03/12/16	2.5	2,000	2,128	202,280	2016/3/12
	SWISS 2 10/12/16	2.0	300	311	29,635	2016/10/12
	SWISS 2 3/4 06/10/12	2.75	2,100	2,150	204,372	2012/6/10
	SWISS 3 01/08/18	3.0	1,700	1,868	177,544	2018/1/8
	SWISS 3 05/12/19	3.0	3,300	3,643	346,244	2019/5/12
	SWISS 4 02/11/13	4.0	1,500	1,589	151,040	2013/2/11
	SWISS 4 02/11/23	4.0	1,420	1,727	164,171	2023/2/11
	SWISS 4 04/08/28	4.0	1,950	2,466	234,415	2028/4/8
SWISS 4 1/4 01/06/14	4.25	2,450	2,672	254,010	2014/1/6	
小計	—	—	—	—	1,763,715	—
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
国債証券	SGB 3 07/12/16	3.0	33,460	33,985	442,149	2016/7/12
	SGB 3 1/2 03/30/39	3.5	12,000	12,588	163,769	2039/3/30
	SGB 3 1/2 06/01/22	3.5	3,000	3,174	41,302	2022/6/1
	SGB 4 1/2 08/12/15	4.5	18,300	19,667	255,879	2015/8/12
	SGB 4 1/4 03/12/19	4.25	25,800	28,277	367,884	2019/3/12
	SGB 5 1/2 10/08/12	5.5	19,000	19,829	257,987	2012/10/8
	SGB 5 12/01/20	5.0	27,920	32,735	425,894	2020/12/1
	SGB 6.75 05/05/14	6.75	18,290	20,464	266,245	2014/5/5
小計	—	—	—	—	2,221,112	—
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
国債証券	NGB 4.25 05/19/17	4.25	22,000	23,515	350,150	2017/5/19
	NGB 5 05/15/15	5.0	16,000	17,424	259,443	2015/5/15
	NGB 6 1/2 05/15/13	6.5	15,900	17,116	254,862	2013/5/15
小計	—	—	—	—	864,456	—
(デンマーク)			千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
国債証券	DGB 4 1/2 11/15/39	4.5	30,000	35,280	546,840	2039/11/15
	DGB 4 11/15/12	4.0	6,500	6,730	104,326	2012/11/15

銘柄名	当 期 末					
	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		
(デンマーク)		%	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	千円	
国債証券	DGB 4 11/15/15	4.0	18,480	19,745	306,061	2015/11/15
	DGB 4 11/15/17	4.0	26,400	28,438	440,790	2017/11/15
	DGB 4 11/15/19	4.0	17,000	18,266	283,130	2019/11/15
	DGB 5 11/15/13	5.0	25,900	27,834	431,438	2013/11/15
	DGB 6 11/15/11	6.0	15,690	16,030	248,477	2011/11/15
	DGB 7 11/10/24	7.0	13,260	18,477	286,406	2024/11/10
小 計		—	—	—	2,647,470	—
(ポーランド)			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券	POLGB 0 07/25/12	—	6,000	5,702	166,281	2012/7/25
	POLGB 4.75 04/12	4.75	7,000	7,000	204,120	2012/4/25
	POLGB 5 1/2 04/25/15	5.5	5,000	5,005	145,945	2015/4/25
	POLGB 5 1/2 10/25/19	5.5	5,000	4,800	139,982	2019/10/25
	POLGB 5 1/4 04/25/13	5.25	7,700	7,737	225,632	2013/4/25
	POLGB 5 1/4 10/25/17	5.25	13,420	13,033	380,056	2017/10/25
	POLGB 5 1/4 10/25/20	5.25	5,000	4,695	136,906	2020/10/25
	POLGB 5 10/24/13	5.0	17,540	17,510	510,596	2013/10/24
	POLGB 5 3/4 04/25/14	5.75	2,500	2,545	74,212	2014/4/25
POLGB 5 3/4 09/23/22	5.75	10,800	10,432	304,220	2022/9/23	
POLGB 6 1/4 10/24/15	6.25	14,920	15,318	446,683	2015/10/24	
小 計		—	—	—	2,734,638	—
(オーストラリア)			千豪ドル	千豪ドル		
国債証券	ACGB 5 1/2 12/15/13	5.5	2,200	2,228	192,948	2013/12/15
	ACGB 5 1/4 03/15/19	5.25	8,160	8,197	709,632	2019/3/15
	ACGB 5 3/4 05/15/21	5.75	3,900	4,055	351,094	2021/5/15
	ACGB 5 3/4 07/15/22	5.75	2,500	2,601	225,170	2022/7/15
	ACGB 6 02/15/17	6.0	6,700	6,998	605,899	2017/2/15
	ACGB 6 1/2 05/15/13	6.5	6,320	6,511	563,700	2013/5/15
	ACGB 6 1/4 04/15/15	6.25	8,690	9,074	785,597	2015/4/15
	ACGB 6 1/4 06/15/14	6.25	1,000	1,037	89,778	2014/6/15
小 計		—	—	—	3,523,821	—
(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 2 1/2 06/01/19	2.5	3,000	3,102	203,266	2019/6/1
	SIGB 2 1/4 07/01/13	2.25	4,150	4,306	282,137	2013/7/1
	SIGB 3 1/2 03/01/27	3.5	1,300	1,419	93,022	2027/3/1
	SIGB 3 1/4 09/01/20	3.25	2,300	2,491	163,256	2020/9/1
	SIGB 3 3/4 09/01/16	3.75	3,500	3,942	258,322	2016/9/1
	SIGB 3 5/8 07/01/14	3.625	2,400	2,622	171,793	2014/7/1
小 計		—	—	—	1,171,798	—
(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	MGS 3.461 07/13	3.461	5,300	5,323	142,612	2013/7/31
	MGS 3.502 05/31/27	3.502	3,800	3,418	91,585	2027/5/31
	MGS 3.718 06/15/12	3.718	13,000	13,116	351,387	2012/6/15
	MGS 3.814 02/15/17	3.814	12,300	12,370	331,404	2017/2/15
	MGS 4.24 02/07/18	4.24	3,300	3,381	90,587	2018/2/7
	MGS 4.262 09/15/16	4.262	2,000	2,058	55,150	2016/9/15
	MGS 4.378 11/29/19	4.378	9,000	9,276	248,527	2019/11/29
	MGS 4.72 09/30/15	4.72	1,000	1,047	28,052	2015/9/30
	MGS 5.094 04/30/14	5.094	14,000	14,675	393,160	2014/4/30
MGS 5.248 09/28	5.248	1,200	1,323	35,454	2028/9/15	
小 計		—	—	—	1,767,922	—
合 計		—	—	—	308,331,304	—

(注1) 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。

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨てています。

(注3) 株式、新株予約権証券及び株式の性質を有するオプション証券等の組入れはありません。

TMA日本株TOPIXマザーファンド

運用報告書 第11期(決算日 2011年3月22日)

(計算期間 2010年3月24日~2011年3月22日)

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド(親投資信託)の直前の計算期間にかか
る運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント投信

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 騰 落 中 率	ベンチマーク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産
			期 騰 落	中 率			
7期(2007年3月20日)	円 10,862	% 2.5	1,708.29	% 1.2	% 98.4	% 1.9	百万円 92,810
8期(2008年3月21日)	7,868	△27.6	1,220.04	△28.6	98.2	1.9	115,261
9期(2009年3月23日)	5,221	△33.6	791.56	△35.1	97.2	2.8	124,790
10期(2010年3月23日)	6,369	22.0	947.37	19.7	98.2	1.8	145,973
11期(2011年3月22日)	5,949	△6.6	868.13	△8.4	98.8	1.2	125,898

(注) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	ベンチマーク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
			騰 落 率	騰 落 率		
(期 首)	円	%		%	%	%
2010年3月23日	6,369	—	947.37	—	98.2	1.8
3月末	6,636	4.2	978.81	3.3	98.3	1.5
4月末	6,694	5.1	987.04	4.2	98.0	1.9
5月末	5,971	△6.2	880.46	△7.1	97.2	2.7
6月末	5,715	△10.3	841.42	△11.2	96.9	2.9
7月末	5,771	△9.4	849.50	△10.3	98.6	1.3
8月末	5,470	△14.1	804.67	△15.1	98.5	1.2
9月末	5,683	△10.8	829.51	△12.4	97.4	2.6
10月末	5,560	△12.7	810.91	△14.4	96.8	3.1
11月末	5,896	△7.4	860.94	△9.1	97.8	2.1
12月末	6,162	△3.3	898.80	△5.1	98.9	1.0
2011年1月末	6,238	△2.1	910.08	△3.9	99.0	0.9
2月末	6,522	2.4	951.27	0.4	99.2	0.7
(期 末)						
2011年3月22日	5,949	△6.6	868.13	△8.4	98.8	1.2

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

ベンチマークはTOPIXです。

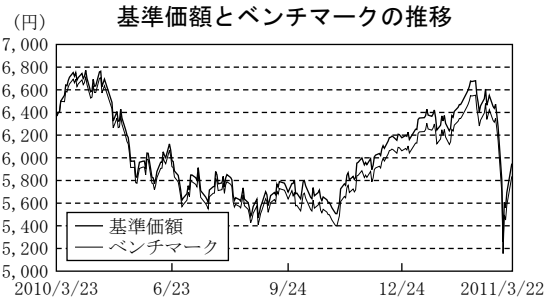
TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下(株)東京証券取引所という。)の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。

(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。(株)東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をすることはできません。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、当ファンドの基準価額とTOPIXの指数値が著しく乖離することがあります。当ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。(株)東京証券取引所は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。(株)東京証券取引所は、東京海上アセットマネジメント投信又は当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は当ファンドの発行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方針（2010年3月24日から2011年3月22日まで）

1. 基準価額の推移と主な変動要因

当ファンドの基準価額は、前期末（2010年3月23日）の6,369円から当期末（2011年3月22日）には5,949円となり6.6%の下落となりました。また、当ファンドがベンチマークとしているTOPIX（東証株価指数）は、同期間において8.4%の下落となりました。

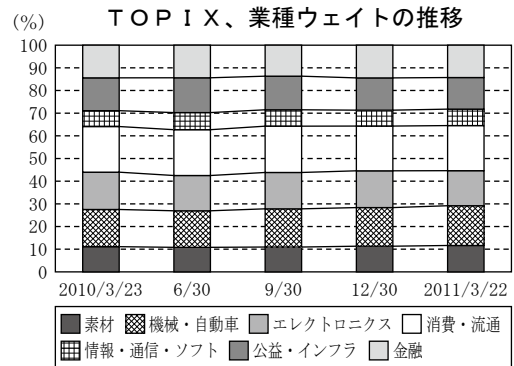


(注) ベンチマークは期首（2010年3月23日）の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

2. 当期の投資環境

当期の国内株式市場は欧州圏の債務懸念や為替市場での円高、東日本大震災などを受けて下落しました。2010年4月に欧州圏での国債価格下げを受けて各国財政や債券の償還に対する懸念が高まり、世界景気の回復に対する期待も幾分冷やされた形となりました。それと歩調を合わせるように為替市場では円高が進み、国内株式市場も半年程度調整しました。11月上旬にFRB（米連邦準備制度理事会）が追加量的金融緩和（QE II）に踏み切ったことで米国景気の回復期待が高まり、年末を挟んでグローバルに株価は上昇したものの、2011年3月に起きた東日本大震災の影響で国内株式市場は期末にかけて下落いたしました。このような市場環境の中、当期のTOPIXは8.4%の下落となりました。業種別には2月に産油国リビアで起こった騒乱で原油価格が大きく上昇したことを受け、石油・石炭関連の上昇率が目立った一方で、国内株式市場の低迷を受けた証券や福島第一原子力発電所で放射能漏れ問題のあった東京電力を筆頭に電気・ガス関連などが大きく下落しました。

その結果、業種別の時価総額は素材のセクターウェイトが上昇し、公益・インフラのセクターウェイトが減少しました。



3. 当期の運用経過と基準価額

当ファンドは、日本の株式市場全体への投資を目的とし、TOPIX（東証株価指数）に連動した投資成果を目標として運用を行っています。個別の銘柄選択は、市場でのウェイトが一定以上の銘柄についてはそのウェイト通り組み入れ、一定以下のものについては委託会社独自の業種分類と時価総額による規模分類に基づいて選定します。これにより、業種配分および企業規模などの特性がファンド全体でTOPIXとほぼ一致するよう調整しています。

当期におきましては、期首における保有銘柄数は1,032銘柄でしたが、期中では、設定・解約に応じたTOPIX先物と現物株式の売買を行い、その結果、期末における保有銘柄数も1,032銘柄となりました。期中の実質的な株式組入比率はほぼ100%に維持され、基準価額もTOPIXに連動いたしました。当期末現在では、基準価額は5,949円（前期末比▲6.6%、TOPIX対比+1.8%）となりTOPIXと同様に下落しました。

また、ベンチマークであるTOPIXからの乖離度合いを表すトラッキングエラー※は、過去1年で1.2%となりました。

※毎月の対ベンチマーク超過収益率（ファンドの収益率とベンチマークの収益率との差）の標準偏差（ばらつき度合い）を年率換算したものです。ベンチマークとの連動性が高いほどこの値は低くなります。

4. 今後の運用方針

引き続き、前記の当ファンドの基本方針に基づき、先物も使用しながら実質的な株式の組入比率をほぼ100%に維持し、TOPIXとの連動性を高位に保つことを目指して運用してまいります。

■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	0円 (0) (0)
合 計	0

(注1) (a) 売買委託手数料は、期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■ 期中の売買及び取引の状況（2010年3月24日から2011年3月22日まで）

(1) 株 式

国 内 上 場	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
	千株 23,706 (△ 209)	千円 17,648,097 (-)	千株 30,039	千円 26,059,434

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

(注3) () 内は株式分割、移転、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。

(2) 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
国 内 株 式 先 物 取 引	百万円 51,182	百万円 52,353	百万円 -	百万円 -

(注) 単位未満は切り捨てています。

■ 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	43,707,531千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	133,119,900千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.32

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

■ 利害関係人との取引状況等（2010年3月24日から2011年3月22日まで）

(1) 利害関係人との取引状況

期中における利害関係人との取引はありません。

(注) 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。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期 末 保 有 額
	買 付 額	売 付 額	
株 式	百万円 107	百万円 247	百万円 912

(注) 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東京海上ホールディングス株式会社です。

■組入資産の明細 (2011年3月22日現在)

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				
日本水産	138.7	37,587	138.7	33,010
マルハニチロホールディングス	273	35,763	228	28,500
サカタのタネ	26.6	33,117	26.6	30,563
ホクト	14.6	28,411	11.6	20,624
鉱業 (0.7%)				
日鉄鉱業	42	17,052	47	18,612
国際石油開発帝石	0.637	425,516	1.217	730,200
関東天然瓦斯開発	26	12,298	26	12,012
石油資源開発	21.7	99,386	20.4	82,008
建設業 (2.2%)				
ショーボンドホールディングス	13	23,426	13	29,718
ミライト・ホールディングス	—	—	55.3	34,286
東急建設	58.96	14,916	58.96	14,622
コムシスホールディングス	55.5	47,896	53.5	39,697
ミサワホーム	29.2	9,490	57.1	27,408
ヤマウラ	55	10,725	55	13,035
大成建設	588	114,072	554	124,096
大林組	375	148,875	356	138,840
清水建設	350	131,950	325	129,025
長谷工コーポレーション	701.5	60,329	845.5	55,803
鹿島建設	592	129,056	531	139,122
前田建設工業	114	32,262	84	24,360
奥村組	119	38,675	99	34,452
東鉄工業	35	19,110	35	25,165
戸田建設	152	50,464	124	40,424
大東建託	54.2	241,732	46	294,400
NIPPPO	42	29,862	42	28,770
前田道路	35	26,845	35	29,225
大林道路	65	14,950	50	12,300
住友林業	96.1	69,864	81.5	60,717
日本基礎技術	74.6	14,770	56.6	18,621
パナホーム	41	25,133	61	34,526
大和ハウス工業	323	334,628	300	326,400
積水ハウス	384	357,888	358	290,696
ユアテック	44	18,920	44	23,496
西部電気工業	56	20,272	56	21,000
中電工	20.2	24,058	20.2	21,331
関電工	49	28,665	49	25,235
大明	34	21,862	—	—
きんでん	83	65,985	73	52,049
東京エネシス	26	15,990	26	14,092
トーエネック	48	23,136	48	21,936
日本電設工業	30	21,150	30	23,880
協和エクシオ	46.2	34,234	37.2	28,346
新日本空調	29.5	18,201	29.5	11,947
東電通	89	13,795	—	—
九電工	—	—	18	8,388
三機工業	36	22,428	36	18,072
日揮	134	218,956	123	231,363
中外炉工業	53	14,469	23	8,234
ヤマト	90	27,810	90	27,630

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
太平電業	21	17,724	31	17,360
高砂熟字工業	37	27,528	37	26,418
N E C ネットエスアイ	23.3	24,767	18.3	18,647
大気社	19.3	27,792	22.9	38,930
日比谷総合設備	23.5	18,095	23.5	16,873
東芝プラントシステム	20	20,840	20	20,660
東洋エンジニアリング	85	27,795	85	24,990
千代田化工建設	99	86,823	80	57,360
新興ブランテック	25.4	20,929	25.4	24,206
食料品 (2.9%)				
日本製粉	81	37,584	68	24,956
日清製粉グループ本社	125.5	151,855	106	98,050
ユニ・チャーム ペットケア	9.7	28,857	—	—
日本甜菜製糖	14	3,276	59	11,092
三井製糖	88	26,928	88	28,688
森永製菓	134	28,676	134	26,130
中村屋	60	29,160	60	24,840
江崎グリコ	51	55,182	38	35,188
山崎製パン	98	111,328	86	80,238
森永乳業	124	46,004	89	27,145
ヤクルト本社	73.1	204,826	63.8	136,021
明治ホールディングス	42.9	156,585	35.8	123,689
雪印メグミルク	27.7	40,857	20.2	27,613
日本ハム	97	113,199	80	78,400
伊藤ハム	97	33,562	101	29,997
丸大食品	—	—	35	9,310
米久	29	22,301	29	18,618
サッポロホールディングス	194	93,702	175	56,175
アサヒビール	235.9	419,194	222.8	320,386
キリンホールディングス	560	733,600	479	518,278
宝ホールディングス	112	57,792	102	41,514
コカ・コーラウエスト	34.7	51,494	33.7	46,404
コカ・コーラ セントラル ジャパン	27.4	30,222	19.9	21,352
ダイドードリンコ	5.7	18,439	5.7	18,639
伊藤園	40.3	55,533	34.3	46,305
キーコーヒー	17.4	28,083	17.4	25,926
ジャパンフーズ	16.4	14,120	16.4	12,775
日清オイリオグループ	60	27,360	60	24,900
不二製油	34.3	46,853	25.5	28,254
J-オイルミルズ	98	28,224	88	20,768
キッコーマン	104	113,256	94	73,790
味の素	341	313,379	328	280,768
キュービー	68.6	68,462	56.6	56,090
ハウス食品	53.7	72,280	39.2	50,764
カゴメ	47.7	76,558	40.8	59,649
アリアケジャパン	21.1	28,885	15.1	21,487
ニチレイ	134	47,168	135	44,145
東洋水産	59	145,317	51	92,667
日清食品ホールディングス	49.9	159,929	42.9	122,951
永谷園	39	34,554	34	29,002
フジッコ	24	25,944	24	23,712
ロック・フィールド	25.5	32,436	19.5	24,609

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
日本たばこ産業	2.826	952,362	2.484	782,460
繊維製品 (0.9%)				
片倉工業	20.7	17,036	20.7	16,125
グンゼ	85	28,475	71	21,797
東洋紡績	440	66,000	405	47,385
日清紡ホールディングス	86	81,356	70	52,850
倉敷紡績	173	28,372	173	26,123
日本毛織	42	28,518	40	26,800
帝国繊維	57	25,764	57	28,899
帝人	434	127,162	422	151,076
東レ	796	408,348	872	509,248
日本フェルト	28.1	11,942	28.1	11,549
日本バイリーン	44	18,700	44	17,468
セーレン	27.7	15,595	37.7	20,395
小松精練	42	14,994	42	14,742
ワコールホールディングス	74	84,952	63	64,827
ホギメディカル	6	26,460	7.1	24,317
三陽商会	52	18,252	70	18,830
オンワードホールディングス	72	51,048	75	48,450
東京スタイル	40	26,280	50	28,850
デサント	64	32,704	37	12,839
パルプ・紙 (0.3%)				
特種東海製紙	74	17,020	74	11,914
王子製紙	518	213,934	487	176,294
三菱製紙	197	21,867	197	15,563
北越紀州製紙	90.5	42,535	75.5	31,181
大王製紙	56	41,944	56	32,648
日本製紙グループ本社	51.6	123,891	52.3	98,114
レンゾー	88	47,432	83	41,334
ザ・バック	14.3	20,191	14.3	18,532
化学 (5.9%)				
クラレ	174	207,930	164.2	169,290
旭化成	690	340,170	657	358,722
共和レザー	20.8	7,758	9.8	2,861
昭和電工	776	155,976	772	126,608
住友化学	816	354,960	778	308,088
住友精化	62	22,568	52	20,852
日産化学工業	79	103,885	85	71,400
クレハ	80	35,200	70	25,760
石原産業	279	19,530	259	23,828
片倉チッカルン	54	15,390	54	12,150
日本曹達	81	31,833	74	24,642
東ソー	296	68,080	281	74,465
トクヤマ	221	112,931	177	70,977
セントラル硝子	115	48,990	107	33,598
東亜合成	142	54,102	109	43,055
ダイソー	83	19,422	83	21,165
電気化学工業	247	92,131	237	88,401
信越化学工業	196.8	1,023,360	186.6	772,524
堺化学工業	51	21,318	36	14,004
エア・ウォーター	99	107,118	88	88,176
太陽日酸	179	148,928	142	93,578
日本バーカライジング	28	33,628	30	33,540
四国化成工業	55	27,775	55	28,545
戸田工業	36	25,632	46	33,672
ステラ ケミファ	6.1	21,655	6.1	18,513

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
日本触媒	67	54,270	88	78,408
カネカ	162	93,474	139	79,230
三菱瓦斯化学	198	103,950	174	100,920
三井化学	471	130,467	516	143,448
J S R	117.9	217,643	94.9	156,015
東京応化工業	23.3	38,095	18.7	30,275
三菱ケミカルホールディングス	685.5	309,160	659	341,362
ダイセル化学工業	155	95,635	150	72,900
住友ベークライト	102	51,102	97	48,500
積水化学工業	241	147,492	238	149,464
日本ゼオン	110	56,870	110	79,530
アイカ工業	32.3	32,235	32.3	34,787
宇部興産	545	129,165	470	119,380
積水樹脂	26	20,748	16	12,464
旭有機材工業	43	9,460	43	9,546
日立化成工業	55.3	108,388	51.2	86,988
群栄化学工業	113	24,069	113	24,069
タイガースポリマー	22.6	7,661	22.6	8,045
日本化薬	90	69,030	80	57,520
A D E K A	47.5	40,850	48.5	35,405
日油	108	38,880	98	35,378
ハリマ化成	45	22,680	45	23,670
花王	325.4	745,816	302.6	629,710
三洋化成工業	55	30,305	40	24,560
日本ペイント	109	64,637	89	48,950
関西ペイント	145	106,140	124	89,032
中国塗料	35	21,175	35	23,905
太陽ホールディングス	8.6	21,233	11.1	29,537
D I C	369	70,848	426	79,662
東洋インキ製造	102	42,636	101	40,905
富士フイルムホールディングス	251.7	790,338	237.4	603,470
資生堂	215	435,590	184.1	279,832
ライオン	158	73,154	119	49,861
高砂香料工業	42	20,118	55	23,650
マンダム	12	30,612	14.3	29,300
ファンケル	22.1	39,448	28.1	33,270
コーセー	20.8	45,843	19.3	41,012
ドクターシーラボ	0.131	27,627	0.066	20,592
エスター	18.9	20,223	18.9	16,839
長谷川香料	21.8	31,849	17.8	21,395
小林製薬	18.6	70,773	14.6	54,604
荒川化学工業	25.6	25,625	25.6	19,968
メック	17.7	9,044	17.7	6,814
荏原ユーージライト	9.1	14,887	3.4	8,170
アース製薬	9.6	26,793	9.6	25,699
イハラケミカル工業	70	18,830	50	13,600
大成ラミック	9.1	21,093	9.1	22,185
クミアイ化学工業	56	15,736	21	4,998
日本農薬	34	17,680	19	6,878
日東電工	98.8	344,318	93.1	417,088
レック	10.3	17,005	10.3	13,225
アロン化成	69	26,496	36	17,388
前澤化成工業	21.9	19,491	21.9	17,016
エフビコ	6.4	26,272	6.4	27,040
天馬	23.7	23,865	23.7	18,770
信越ポリマー	32.5	21,742	32.5	15,015

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
ニッポ	26.9	55,952	22.5	46,125
日本バルカー工業	53	9,964	33	7,425
ユニ・チャーム	23.2	203,232	62.1	188,784
医薬品 (4.4%)				
協和発酵キリン	163	156,806	135	100,710
武田薬品工業	447.3	1,889,842	418.1	1,630,590
アステラス製薬	252.4	853,112	247.5	744,975
大日本住友製薬	92	79,580	75.7	52,308
塩野義製薬	173.6	326,541	166.5	231,768
田辺三菱製薬	104	141,752	96	123,264
あすか製薬	24	15,312	24	16,368
日本新薬	30	30,180	25	24,950
中外製薬	131.5	232,360	111.1	157,206
科研製薬	56	44,240	50	48,900
エーザイ	145.4	520,532	136.6	414,581
ロート製薬	53	54,908	49	41,160
小野薬品工業	60.3	252,657	56.2	231,263
久光製薬	36.6	124,806	31.6	100,172
持田製薬	44	38,984	46	43,240
大正製薬	101	170,589	88	152,240
参天製薬	36.3	104,398	33.7	103,964
エスエス製薬	19	13,452	—	—
日本ケミファ	46	11,638	46	12,006
ツムラ	35.8	98,879	30	72,900
日医工	—	—	11	22,748
キッセイ薬品工業	25	48,050	20	30,000
生化学工業	23.6	23,057	23.6	19,918
鳥居薬品	11.1	19,658	7.3	11,650
東和薬品	5.2	24,856	6.4	26,720
沢井製薬	7.8	47,736	7.5	53,700
ゼリア新薬工業	21	20,769	20	19,440
第一三共	373.6	662,019	377.5	598,337
キョーリン製薬ホールディングス	33	45,441	29	40,803
大塚ホールディングス	—	—	194.1	388,200
石油・石炭製品 (1.0%)				
新日本石油	726	347,754	—	—
昭和シェル石油	124.4	75,510	94.9	72,218
コスモ石油	332	74,700	312	78,312
ニチレキ	64	26,176	32	12,352
東燃ゼネラル石油	171	127,908	168	165,984
新日鉱ホールディングス	458.5	204,032	—	—
AOCホールディングス	35.7	20,848	32.7	18,573
出光興産	14.3	99,242	13.7	129,465
JXホールディングス	—	—	1,250.7	720,403
ゴム製品 (0.7%)				
横浜ゴム	145	61,045	142	56,090
東洋ゴム工業	151	33,069	136	28,016
ブリヂストン	370	574,610	352.4	609,652
住友ゴム工業	92.4	72,164	85.7	71,730
オカモト	76	28,348	76	23,712
ニッタ	19.4	28,362	13.4	20,180
東海ゴム工業	33.5	41,707	28.5	28,186
三ツ星ベルト	62	26,102	29	12,847
バンドー化学	37	10,545	37	13,727
ガラス・土石製品 (1.4%)				
日東紡績	110	21,120	90	17,280

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
旭硝子	580	593,340	555	583,305
日本板硝子	389	102,307	494	112,138
日本山村硝子	33	10,164	108	23,976
日本電気硝子	207	274,275	237	280,608
住友大阪セメント	244	38,308	204	51,000
太平洋セメント	472	58,528	492	72,816
日本ヒューム	51	15,351	51	19,482
東海カーボン	126	65,772	120	48,000
日本カーボン	80	23,280	120	24,120
東洋炭素	5.5	28,545	5.6	22,680
ノリタケカンパニーリミテド	82	21,156	67	22,244
TOTO	187	113,883	160	107,680
日本碍子	141	268,887	135	185,355
日本特殊陶業	102	122,400	100	107,700
MARUWA	9.8	19,864	1.6	4,182
ニチアス	—	—	60	29,880
ニチハ	14.7	11,377	11.7	9,418
鉄鋼 (2.3%)				
新日本製鐵	3,354	1,167,192	2,921	791,591
住友金属工業	2,170	598,920	2,050	369,000
神戸製鋼所	1,633	308,637	1,583	337,179
日新製鋼	454	83,536	429	66,924
合同製鐵	112	23,744	167	29,058
ジェイ エフ イー ホールディングス	254.6	915,287	266	662,074
東京製鐵	62.7	69,408	66.7	60,630
共英製鋼	14.9	28,205	18.9	27,783
大和工業	29.7	87,971	26.4	69,722
大阪製鐵	17.1	25,342	17.1	24,470
淀川製鋼所	92	37,444	100	36,000
東洋鋼板	34	18,836	34	14,416
住友鋼管	24.6	13,431	15.6	9,640
丸一鋼管	33.7	63,086	34.7	68,671
大同特殊鋼	190	68,780	190	89,110
日本冶金工業	62.5	20,312	98.5	18,813
山陽特殊製鋼	57	21,774	57	24,795
愛知製鋼	69	28,566	54	27,000
日立金属	73	68,255	71	75,260
大平洋金属	90	65,340	81	51,111
日本電工	50	33,400	50	23,900
三菱製鋼	95	18,145	57	14,763
シンニッタン	46.1	11,248	35.6	12,638
非鉄金属 (1.4%)				
日本軽金属	284	38,908	284	41,748
三井金属鉱業	353	96,369	342	95,760
東邦亜鉛	70	31,430	75	28,575
三菱マテリアル	691	174,823	716	194,036
住友金属鉱山	314	426,726	311	427,314
DOWAホールディングス	142	77,106	141	68,667
古河機械金属	259	28,231	371	30,422
大阪チタニウムテクノロジーズ	11.8	39,530	13.2	72,996
東邦チタニウム	21.5	40,205	21.8	45,932
古河電気工業	371	178,511	352	114,400
住友電気工業	391.5	437,305	397.2	445,261
フジクラ	178	90,780	181	63,893
タツタ電線	80	18,080	37	12,839
日立電線	93	24,645	118	23,718

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
リョービ	85	26,520	55	17,490
アサヒホールディングス	16.8	25,284	16.1	25,405
金属製品 (0.7%)				
トーカロ	13.2	25,212	5.2	7,430
SUMCO	72.4	131,188	70.4	103,910
東洋製罐	95.3	152,670	80	100,720
コロナ	15.8	17,822	15.8	12,292
横河ブリッジホールディングス	40	27,680	50	30,250
駒井ハルテック	64	12,736	44	10,076
三和ホールディングス	119	33,915	119	33,558
文化シャッター	43	10,750	43	9,159
住生活グループ	152.8	283,444	136.5	286,923
ノーリツ	27.2	36,801	27.2	37,073
長府製作所	14.3	29,572	17.3	32,887
リンナイ	20.7	99,567	17.6	91,168
日東精工	45	12,645	45	10,665
三洋工業	64	8,256	—	—
東ブレ	27.8	19,960	27.8	17,347
高周波熱錬	32.4	20,476	15.4	10,225
東京製網	85	20,740	58	15,428
パイオラックス	10.7	20,972	5.4	10,287
日本発條	83	68,143	79	66,044
三益半導体工業	15.3	20,272	26.8	21,976
機械 (5.3%)				
日本製鋼所	180	193,320	171	109,440
日立ツール	21.5	20,145	21.5	18,167
三浦工業	18.3	43,444	15.6	37,221
タクマ	61	13,237	31	7,316
ツガミ	28	13,776	38	21,394
オークマ	82	51,742	71	50,055
東芝機械	59	22,892	59	26,668
アマダ	192	143,232	159	105,417
アイダエンジニアリング	32.8	11,316	32.8	11,873
牧野フライス製作所	59	33,158	53	36,782
オーエスジー	48.5	44,086	51.5	58,040
旭ダイヤモンド工業	29	22,678	26	37,648
森精機製作所	50.6	54,850	58.6	57,193
ディスコ	12.3	67,650	12.3	66,051
日東工器	7	14,462	7	14,238
島精機製作所	15.8	32,864	13.3	25,482
日阪製作所	12	10,128	12	11,016
やまびこ	11.3	11,119	—	—
ナブテスコ	45	52,920	40.7	80,179
レオン自動車	73	17,082	73	13,724
SMC	38.1	453,390	34	466,480
新川	19	26,524	19	15,998
ユニオンツール	8.8	22,510	8.8	16,016
オイレス工業	18	25,920	18	30,438
サトー	24.5	29,841	13.5	13,635
小松製作所	530.3	1,011,812	532.5	1,401,007
住友重機械工業	246	132,594	299	157,274
日立建機	54	112,860	49	100,499
巴工業	11.5	13,857	11.5	16,640
井関農機	148	40,700	148	29,008
クボタ	482	390,902	471	386,220
月島機械	28	17,416	22	16,280

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
帝国電機製作所	9.6	17,568	9.6	14,976
新東工業	25.6	17,996	25.6	19,840
澁谷工業	27.8	20,544	27.8	21,850
小森コーポレーション	34.8	38,941	37.8	27,972
住友精密工業	57	15,903	15	8,400
荏原製作所	246	115,128	205	86,715
西島製作所	10.1	18,594	17.1	20,537
ダイキン工業	132.3	482,895	116.6	288,701
オルガノ	24	14,280	24	12,840
栗田工業	65.5	166,370	61	140,483
椿本チエイン	66	28,050	66	29,172
ダイフク	46.5	32,875	54	32,238
タダノ	63	30,429	68	34,068
フジテック	36	18,972	36	15,084
シーケーディ	33.1	24,096	33.1	26,844
平和	23.6	23,340	23.6	31,576
SANKYO	33.7	155,357	31.7	139,480
日本金銭機械	14	11,438	14	9,786
福島工業	17.3	13,857	17.3	16,262
アマノ	36	30,528	27	19,683
サンデン	83	28,386	88	31,152
マックス	20	19,760	20	21,020
グローリー	34.4	77,124	29.1	50,197
大和冷機工業	38	16,720	38	15,010
セガサミーホールディングス	138.2	152,434	109.8	174,252
リケン	62	22,320	62	21,390
ホシザキ電機	22.5	30,577	22.5	33,210
大豊工業	27.1	17,858	24.9	17,728
日本精工	228	155,724	240	171,360
NTN	256	105,728	259	104,895
ジェイテクト	108.3	104,726	113.3	117,718
不二越	115	32,660	93	40,641
日本トムソン	43	24,983	43	26,875
THK	75.1	142,089	72.1	147,084
ユーション精機	14	19,474	10	14,560
キッツ	59	29,677	63	22,617
日立工機	32.5	31,915	40	28,800
マキタ	75.3	225,523	70.8	250,986
日立造船	502	68,272	412	46,144
三菱重工業	1,918	701,988	1,802	625,294
IHI	879	143,277	733	134,139
電気機器 (14.5%)				
イビデン	81.2	245,630	65	170,625
コニカミノルタホールディングス	261.5	274,052	292.5	193,927
ブラザー工業	159.2	167,956	140.5	168,319
ミネベア	168	92,904	168	73,416
日立製作所	2,565	833,625	2,411	1,056,018
東芝	2,574	1,199,484	2,111	857,066
三菱電機	1,058	862,270	1,075	1,013,725
富士電機ホールディングス	358	93,080	318	78,228
東洋電機製造	36	22,392	13	5,200
安川電機	135	107,730	114	107,616
シンフォニアテクノロジー	80	16,400	—	—
明電舎	129	53,277	108	34,992
東芝テック	85	29,835	81	27,864
マブチモーター	16.1	84,042	14.5	55,825

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
日本電産	54.5	536,280	52.5	378,000
高岳製作所	85	26,775	72	28,296
ダイヘン	60	24,840	60	20,340
オムロン	135.8	274,859	118.3	272,090
日東工業	17	15,844	17	14,161
エルピーダメモリ	116.8	204,283	94.8	98,876
ジーエス・ユアサ コーポレーション	233	146,091	212	110,664
メルコホールディングス	7.6	15,298	5.6	14,532
日本電気	1,511	395,882	1,388	267,884
富士通	1,178	669,104	1,036	519,036
沖電気工業	362	26,426	362	22,806
サンケン電気	84	28,476	58	28,478
アイホン	16.2	25,984	16.2	22,356
ルネサスエレクトロニクス	24.1	21,931	35.7	24,490
セイコムエプソン	91.4	138,471	73.5	94,668
ワコム	0.254	34,975	0.254	27,076
アルバック	18.6	43,003	18.4	32,052
ナナオ	12.9	29,037	12.9	24,626
日本信号	40.2	32,722	47.2	29,311
能美防災	29	16,675	29	14,848
ホーチキ	34	17,102	34	13,702
マスプロ電工	30	25,500	30	25,290
パナソニック	1,115	1,523,090	1,055	1,060,275
シャープ	543	591,870	474	372,564
アンリツ	68	23,460	49	30,331
富士通ゼネラル	78	32,292	65	26,325
日立国際電気	28	23,884	36	24,660
ソニー	606.8	2,211,786	600.3	1,560,780
TDK	58.2	339,888	61.2	296,208
三洋電機	1,250	181,250	819	94,185
ミツミ電機	40.5	79,623	38.5	40,540
タムラ製作所	45	14,670	45	9,765
アルプス電気	109.4	64,436	83.1	67,227
パイオニア	50	15,550	100	38,000
日本電波工業	7.7	14,476	7.7	9,748
日本トリム	5.25	9,654	5.25	8,720
フォスター電機	11.1	26,739	11.1	20,734
SMK	45	20,880	30	11,130
ヨコオ	24.4	13,542	15.4	9,224
ホシデン	28.5	33,487	27.5	21,340
ヒロセ電機	19.4	198,074	16.9	150,917
日本航空電子工業	16	10,848	31	17,732
アルパイン	25	27,400	30	27,570
アイコム	8.7	20,575	6.7	15,182
船井電機	9.4	37,929	10.8	25,628
横河電機	125.3	96,481	108.5	68,463
山武	30.3	65,963	27.3	53,180
日本光電工業	21.3	35,485	17.3	30,517
堀場製作所	21.2	54,378	18.3	44,103
アドバンテスト	83.8	182,265	74	107,226
キーエンス	22.8	476,748	24.2	507,474
日置電機	13.2	21,463	13.2	20,539
シスメックス	20.9	111,188	19.4	103,984
メガチップス	20.4	26,214	16.4	22,058
日本電産コバル電子	20.4	14,830	20.4	11,974
ミヤチテクノス	15.6	10,452	10.1	7,261

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
コーセル	16.4	21,910	16.4	19,532
オプテックス	15.2	15,686	10.2	10,710
千代田インテグレ	11.4	13,429	6.4	7,251
スタンレー電気	78.8	138,688	69.2	96,534
岩崎電気	115	18,055	—	—
ウシオ電機	68.1	104,737	64.9	101,763
ヘリオス テクノ ホールディング	27.4	8,685	27.4	6,110
日本セラミック	16.3	18,337	9.3	15,930
日本デジタル研究所	—	—	10	9,420
双信電機	14.9	5,766	14.9	6,302
図研	31	20,925	31	21,638
日本電子	59	20,178	59	13,983
カシオ計算機	124.5	90,013	107.5	69,122
ファナック	118.1	1,099,511	111.8	1,358,370
日本シイエムケイ	21	14,805	31	10,385
エンプラス	10.3	19,261	10.3	10,804
ローム	56.5	367,815	53.4	276,078
浜松ホトニクス	44.5	113,786	42.2	131,875
三井ハイテック	18.6	13,764	18.6	7,533
新光電気工業	35.1	45,068	33.3	28,238
京セラ	94.2	816,714	88.6	692,852
太陽誘電	46	66,240	48	50,064
村田製作所	127	659,130	112.8	636,192
双葉電子工業	20.4	35,842	20.4	30,804
北陸電気工業	69	12,006	69	11,799
パナソニック電工	203	226,751	98	89,964
ニチコン	36.1	38,699	36.1	42,309
日本ケミコン	74	25,678	71	28,897
KOA	19.2	17,337	13.2	11,840
小糸製作所	54	71,010	51	65,127
スター精密	22.5	21,825	22.5	20,070
大日本スクリーン製造	127	52,578	119	91,987
キャノン電子	11.4	22,526	11.4	25,661
キャノン	706.4	2,889,176	664.7	2,416,184
リコー	336	472,080	326	311,004
日本電産サンキョー	26	20,592	26	15,262
東京エレクトロン	97.4	572,712	84.5	394,615
輸送用機器 (10.1%)				
トヨタ紡織	35.5	60,598	35.5	42,458
ユニプレス	18.2	22,640	18.2	30,485
豊田自動織機	98.6	250,937	97	244,149
モリタホールディングス	41	18,573	41	21,607
デンソー	267.6	720,111	236.2	629,945
東海理化電機製作所	27.6	50,756	27.1	36,476
三井造船	480	108,480	410	82,000
佐世保重工業	90	17,820	90	15,210
川崎重工業	882	216,972	842	274,492
日本車輛製造	54	30,024	66	24,816
近畿車輛	35	21,525	47	17,437
日産自動車	1,363.2	1,045,574	1,356.3	981,961
いすゞ自動車	782	191,590	633	215,220
トヨタ自動車	1,564.8	5,727,168	1,372.2	4,590,009
日野自動車	153	59,364	132	52,404
三菱自動車工業	2,525	308,050	2,208	229,632
武蔵精密工業	14.2	27,122	11.2	21,268
トヨタ車体	23.7	36,924	19.9	27,879

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
日産車体	49	34,692	41	24,067
関東自動車工業	24.2	18,053	15.4	8,747
新明和工業	68	22,780	53	17,861
極東開発工業	40	13,120	40	15,800
日信工業	17.6	26,488	25.6	34,944
トビー工業	137	26,852	144	29,664
ティラド	64	15,808	24	8,832
曙ブレーキ工業	52.5	27,090	52.5	22,627
NOK	57.3	78,844	53.3	73,394
フタバ産業	20	15,860	36	17,388
カヤバ工業	80	26,640	64	42,496
カルソニックカンセイ	101	27,977	66	21,912
ケーヒン	22.4	39,670	22.4	34,787
アイシン精機	99.2	264,169	90	253,350
マツダ	734	178,362	843	161,013
ダイハツ工業	115	103,500	116	142,912
今仙電機製作所	—	—	7	8,050
本田技研工業	971.9	3,153,815	902.3	2,837,733
スズキ	226.4	463,667	220.9	394,085
富士重工業	378	171,234	342	198,702
ヤマハ発動機	138.3	182,970	165.2	226,654
ショーワ	48	32,784	32.9	19,871
エクセディ	15.2	34,002	15.2	36,252
豊田合成	33.6	83,193	33.6	55,339
愛三工業	10.1	8,544	17.1	15,253
ヨロズ	15.1	19,388	9.6	15,273
エフ・シー・シー	12.8	23,552	17.8	33,179
シマノ	48.1	192,640	42.2	164,580
タカタ	17.9	40,865	16.4	39,688
テイ・エス テック	20.6	34,690	20.1	28,220
精密機器 (1.4%)				
テルモ	87.2	435,564	85.4	365,512
クリエートメディック	17.8	15,272	17.8	14,186
日機装	35	22,890	35	22,155
島津製作所	136	93,024	125	86,750
愛知時計電機	64	17,152	—	—
東京精密	21.5	33,196	25.5	35,802
ニコン	210.5	419,526	189.1	313,906
トプコン	36.4	17,617	36.4	14,742
オリンパス	132.7	387,351	129	297,087
理研計器	39.2	23,951	39.2	24,735
タムロン	19.1	28,630	16.1	28,658
HOYA	261.8	636,697	245.4	461,352
ノーリツ鋼機	19.3	12,352	19.3	8,742
日本電産コパル	11	14,740	11	11,000
シチズンホールディングス	135.1	84,302	117	53,820
ニプロ	24.2	44,600	18.7	30,424
その他製品 (2.1%)				
パンダイナムホールディングス	132.5	115,540	123.7	113,432
トッパン・フォームズ	31.6	31,568	31.6	22,341
フジシルインターナショナル	17.1	32,524	17.1	27,052
タカラトミー	43	31,734	34	21,658
タカノ	20.5	10,065	20.5	9,758
大建工業	40	10,120	40	10,120
凸版印刷	345	281,175	304	195,472
大日本印刷	342	422,028	320	307,200

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
日本写真印刷	18.5	59,385	19.3	34,450
アシックス	104	89,648	98	108,388
ローランド	14.2	14,469	15.2	13,710
小松ウオール工業	15.1	15,356	15.1	12,366
ヤマハ	83	96,778	88.9	81,965
クリナップ	18.4	13,487	18.4	10,745
ビジョン	7.2	24,228	10.5	26,659
パラマウントベッド	20.9	37,013	15.9	34,169
キングジム	29.7	21,235	29.7	17,493
リンテック	26.8	47,972	22.8	50,844
イトーキ	47.1	10,079	79.1	15,029
任天堂	64.4	1,801,268	61.2	1,376,388
三菱鉛筆	10.7	13,235	5.7	6,971
タカラスタンダード	54	29,808	54	31,212
コクヨ	68.6	50,009	62.6	38,749
岡村製作所	47	25,615	36	16,236
美津濃	54	22,194	67	22,646
ユニバー	20.4	20,889	20.4	18,666
電気・ガス業 (4.3%)				
東京電力	714.9	1,760,798	784.5	861,381
中部電力	381.5	891,565	327.1	667,938
関西電力	467.9	995,223	434	869,302
中国電力	167.9	314,644	147.4	251,759
北陸電力	116	233,740	107.2	218,688
東北電力	285.2	559,847	266.6	434,558
四国電力	126.2	325,596	106.5	262,842
九州電力	249.4	503,788	235.2	417,244
北海道電力	106	190,376	98	167,776
沖縄電力	8.1	39,366	8.1	31,306
電源開発	76.9	234,545	65	170,235
東京瓦斯	1,439	575,600	1,331	480,491
大阪瓦斯	1,214	396,978	1,074	330,792
東邦瓦斯	310	157,170	270	114,750
北海道瓦斯	86	20,812	86	20,726
西部瓦斯	134	34,438	134	27,872
静岡瓦斯	50.5	26,058	50.5	22,725
陸運業 (3.5%)				
東武鉄道	484	244,904	545	182,030
相鉄ホールディングス	179	70,884	169	40,729
東京急行電鉄	631	244,828	575	198,950
京浜急行電鉄	318	236,592	272	162,112
小田急電鉄	360	272,880	341	239,382
京王電鉄	321	197,415	276	134,964
京成電鉄	173	94,804	166	80,012
東日本旅客鉄道	212.4	1,319,004	185.3	902,411
西日本旅客鉄道	0.986	312,562	0.996	317,226
東海旅客鉄道	0.971	666,106	0.923	620,256
西日本鉄道	162	58,968	129	45,795
近畿日本鉄道	1,037	302,804	948	260,700
阪急阪神ホールディングス	770	325,710	716	271,364
南海電気鉄道	240	89,040	212	71,020
京阪電気鉄道	257	99,202	230	79,120
名糖運輸	20.2	16,301	20.2	13,554
名古屋鉄道	406	109,214	373	81,687
日本通運	474	179,646	408	127,296
ヤマトホールディングス	238.5	298,602	219.5	273,716

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
山九	128	55,040	143	51,909
丸連	29.3	7,178	29.3	5,947
センコー	—	—	25	6,300
トナミホールディングス	75	14,400	75	10,725
日本梱包運輸倉庫	35	36,995	32	28,672
日本石油輸送	65	12,935	65	14,820
福山通運	89	41,029	59	23,364
セイノーホールディングス	90	58,860	76	44,460
日立物流	18.9	24,626	24.9	28,759
海運業 (0.6%)				
日本郵船	846	293,562	914	299,792
商船三井	552	342,240	530	260,760
川崎汽船	316	111,548	342	109,098
N Sユニテッド海運	40	11,320	90	16,110
飯野海運	62.4	35,006	65.4	28,056
第一中央汽船	143	39,325	78	13,260
空運業 (0.3%)				
全日本空輸	1,612	430,404	1,409	374,794
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
三菱倉庫	79	87,769	78	70,746
三井倉庫	69	23,529	49	14,945
住友倉庫	78	30,576	78	30,186
東陽倉庫	68	12,920	68	12,104
安田倉庫	16.5	9,388	16.5	7,755
上組	135	96,660	118	82,364
キムラユニティ	10	7,760	10	6,990
キューソー流通システム	14.3	12,140	14.3	11,711
郵船ロジスティクス	12.5	16,925	12.5	15,512
近鉄エクスプレス	9	21,312	10.7	26,108
情報・通信業 (5.7%)				
新日鉄ソリューションズ	13.7	19,933	8.4	13,364
I Tホールディングス	38.5	42,003	38.5	32,301
グリー	—	—	20	26,360
コーエーテックホールディングス	29.7	18,740	29.7	20,285
ドワンゴ	0.19	30,609	0.083	17,596
マクロミル	0.151	20,520	12.6	13,318
ティーガイア	0.178	24,421	0.153	21,404
ザッパラス	—	—	0.07	6,825
インターネットイニシアティブ	0.113	23,876	0.088	20,988
パナソニックエレクトロニクスシステムズ	10.5	24,664	10.5	20,863
野村総合研究所	68.5	140,425	60.9	108,645
シンプレクス・ホールディングス	0.613	29,362	0.323	11,337
J・メディア・ホールディングス	1.256	167,801	1.059	128,456
オービック	3.61	60,287	3.66	57,608
ヤフー	6.571	228,670	7.523	223,357
トレンドマイクロ	47	152,280	47	107,254
日本オラクル	18.9	78,151	15.4	54,593
フューチャーアーキテクト	0.289	10,013	0.289	9,782
ソフトバンク・テクノロジ	14.6	10,570	14.6	9,008
伊藤忠テクノソリューションズ	16.4	49,938	16.4	42,771
大塚商会	8.9	49,306	7.5	40,275
サイボウズ	0.392	14,288	0.392	7,310
電通国際情報サービス	28.9	14,478	28.9	16,444
ウェザーニューズ	16.9	18,454	13.9	23,296
ネットワンシステムズ	0.287	32,086	0.287	32,804
エイベックス・グループ・ホールディングス	—	—	20	20,520

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
日本ユニシス	33.5	20,736	33.5	18,190
兼松エレクトロニクス	26.4	21,832	26.4	21,885
東京放送ホールディングス	68	92,344	55.4	55,067
日本テレビ放送網	10.71	133,660	9.35	116,314
テレビ朝日	0.311	43,975	0.273	38,028
テレビ東京	5	9,220	—	—
スカパーJ SATホールディングス	1.016	41,706	1.036	29,961
テレビ東京ホールディングス	—	—	5	5,730
イー・アクセス	0.596	40,647	0.676	31,907
NECモバイルリング	10.8	23,932	10.8	26,805
日本電信電話	474.1	1,813,432	394.9	1,492,722
KDD I	1.876	887,348	1.627	829,770
光通信	18.1	27,186	14.1	23,955
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	9.99	1,409,589	8.689	1,279,020
ゼンリン	28.2	30,484	34.2	29,719
角川グループホールディングス	11.1	23,365	11.1	20,657
松竹	65	50,245	56	32,200
東宝	86.7	128,229	68.2	80,885
東映	46	21,758	46	17,342
エヌ・ティ・ティ・データ	0.735	217,780	0.726	184,912
D T S	13.8	12,958	13.8	11,923
スクウェア・エニックス・ホールディングス	34.1	62,948	33.6	47,376
カプコン	26.1	42,412	26.6	40,219
住商情報システム	16.9	21,226	16.9	20,111
アイネス	26.4	17,608	26.4	14,335
T K C	12.6	21,142	8.6	14,061
富士ソフト	15	22,740	15	18,825
N S D	29.5	31,152	25.5	21,624
コナミ	52.6	90,787	48.7	76,994
ソフトバンク	489.7	1,083,706	468.6	1,417,515
卸売業 (5.4%)				
伊藤忠食品	7.8	23,345	7.8	20,436
エレマテック	14.3	14,986	14.3	15,043
J A L U X	11.4	8,892	11.4	9,405
双日	806.3	138,683	706.2	115,816
アルフレッサ ホールディングス	28.9	110,253	28.9	88,578
横浜冷凍	48	30,480	48	26,880
あい ホールディングス	52.4	15,824	52.4	17,239
U K Cホールディングス	14.7	18,228	8.7	8,700
J F E商事ホールディングス	129	50,052	86	30,272
エコートレーディング	9.3	8,370	9.3	6,454
ナガイレーベン	11.4	22,993	11.4	22,857
菱食	12.7	27,406	15.2	26,113
松田産業	14.7	24,519	18.7	22,589
メディカルホールディングス	129.2	135,530	95.7	67,181
アドヴァン	10.2	6,344	10.2	6,456
ドウシシャ	8.2	19,827	13.5	22,126
黒田電気	26.9	32,091	26.9	26,873
ガリバーインターナショナル	3.84	13,094	4.52	13,338
進和	12.2	12,212	12.2	10,675
オーハシテクニカ	28.5	16,017	28.5	17,014
マクニカ	14.5	21,895	8	15,096
白銅	9.7	6,974	4.7	4,060
伊藤忠商事	775	623,100	741	611,325
丸紅	913	513,106	929	538,820
長瀬産業	66	74,382	60	56,400

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
豊田通商	105.4	149,035	119.5	158,457
兼松	475	34,675	347	27,413
三井物産	969.4	1,478,335	911.1	1,285,562
日本紙パルプ商事	104	34,112	104	31,304
日立ハイテクノロジーズ	34.7	71,239	32.9	54,679
山善	63.5	23,749	51.5	22,969
住友商事	611.9	625,973	583.1	665,900
内田洋行	39	10,491	39	9,984
三菱商事	897.1	2,090,243	845.4	1,860,725
キャノンマーケティングジャパン	40.7	50,793	30.7	29,963
西華産業	110	23,430	110	23,100
菱洋エレクトロ	—	—	17	14,348
東京産業	65.5	17,292	65.5	16,899
阪和興業	112	43,568	112	39,984
菱電商事	31	14,694	31	16,244
岩谷産業	125	34,625	125	32,250
すてきなイスグループ	57	11,001	57	10,488
イワキ	78	19,110	78	14,274
三菱石油	51	18,819	37	15,022
稲畑産業	38.5	16,285	28.5	14,307
東邦ホールディングス	31.5	37,737	30	26,760
サンゲツ	19.7	41,192	18.6	35,098
シナネン	36	14,364	51	19,227
伊藤忠エネクス	—	—	19	8,645
サンリオ	45.5	38,948	31	77,438
リョーサン	17.2	38,510	15.1	29,580
モスフードサービス	18.6	29,127	18.6	28,551
加賀電子	23.5	22,325	23.5	21,197
立花エレテック	29.1	19,002	29.1	19,904
トラスコ中山	25.4	34,975	16.9	23,778
オートバックスセブン	14.7	43,071	13.5	42,255
加藤産業	17.3	25,898	21.3	28,797
富士エレクトロニクス	14.5	12,586	10.5	12,684
杉本商事	18.6	14,880	18.6	13,801
因幡電機産業	12.7	27,825	10.2	24,082
ミスミグループ本社	42.7	78,226	35.7	68,793
スズケン	42.9	131,059	45.7	98,757
ジェコス	36.5	14,125	36.5	14,271
小売業 (3.3%)				
ローソン	32.1	125,832	36.1	139,346
エービーシー・マート	12.9	39,345	10.9	33,190
ハードオフコーポレーション	25	11,125	25	11,025
アスクル	17.6	28,881	17.6	21,753
ゲオ	0.333	30,769	0.333	30,536
ポイント	11.19	61,209	9.64	34,077
エディオン	46	44,528	45.5	32,714
パルス	0.214	15,600	0.114	9,439
あみやき亭	0.133	36,561	0.063	16,600
ハニーズ	17.42	12,716	6.42	5,957
D CMホールディングス	59.5	31,654	71.5	33,176
J. フロント リテイリング	291	153,939	237	79,632
ドトール・日レスホールディングス	26.2	32,095	26.2	25,702
マツモトキヨシホールディングス	21.7	44,593	16.7	26,219
三越伊勢丹ホールディングス	209.8	210,009	204.6	161,224
ブックオフコーポレーション	15.8	14,393	15.8	9,527
あさひ	—	—	10.5	14,290

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
サークルKサンクス	26.4	30,571	19.4	24,017
セブン&アイ・ホールディングス	481.4	1,019,123	439	899,072
ツルハホールディングス	9.7	32,010	9.2	32,844
サンマルクホールディングス	2	6,450	2	6,840
ライトオン	24.9	16,757	24.9	10,134
良品計画	14	53,620	13	44,330
三城ホールディングス	21.6	18,964	21.6	16,027
ワタミ	20.3	34,916	20.3	29,333
ドン・キホーテ	22.5	52,087	17.5	48,107
西松屋チェーン	40.3	35,786	44.3	28,883
ゼンショー	45.2	32,724	40.7	35,042
ユニマツトライフ	16.3	17,946	—	—
サイゼリヤ	20.3	33,413	17.3	23,026
ユナイテッドアローズ	41.3	42,167	21.3	25,432
京都きもの友禅	20.1	17,848	20.1	18,693
荳番屋	5.2	11,559	5.2	12,105
スギホールディングス	15.1	33,220	18.1	33,485
ファミリーマート	35.9	104,074	34.8	103,495
木曽路	18.4	35,916	18.4	31,960
千趣会	37	18,315	37	17,168
ケーヨー	53.1	23,151	43.1	17,240
上新電機	28	23,520	28	22,792
ベスト電器	35	8,050	35	7,490
マルエツ	36	13,752	48	14,304
島忠	28.6	55,312	22.1	38,940
チヨダ	23.6	27,258	23.6	25,511
ライフコーポレーション	1.9	2,874	1.9	2,052
カスミ	40	17,560	40	16,960
AOKIホールディングス	17.3	20,656	7.8	9,781
オークワ	25	21,800	25	19,650
コメリ	16.1	38,833	16.1	31,700
青山商事	29.4	45,981	28.9	34,391
しまむら	12.8	104,448	10.6	74,518
高島屋	147	108,339	135	74,385
松屋	22	17,424	22	10,516
エイチ・ツー・オー リテイリング	59	38,114	59	31,860
ニッセンホールディングス	52.3	19,141	20.3	9,744
パルコ	35.1	27,307	35.1	24,148
丸井グループ	129.7	86,899	136.6	78,135
ダイエー	52.45	17,885	79.85	22,517
イズミヤ	48	19,152	48	16,656
イオン	395.9	399,859	375.2	349,311
ユニー	91.9	66,535	92.4	60,891
イズミ	31.2	36,004	31.2	33,602
平和堂	23.7	26,686	23.7	22,491
フジ	17.3	30,482	17.3	27,749
ヤオコー	7.9	21,590	7.9	19,315
ゼビオ	20.6	39,057	20.6	31,250
ケーズホールディングス	20.9	57,475	25.5	61,200
ヤマダ電機	54.29	367,000	47.97	273,429
ニトリホールディングス	22.1	161,772	20.6	143,376
吉野家ホールディングス	0.34	33,558	0.252	24,645
プレナス	20.8	25,438	20.8	26,686
アークス	22.9	27,480	22.9	28,052
パロー	29.4	22,020	29.4	23,137
ファーストリテイリング	24.5	402,535	25.1	268,570

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
サンドラッグ	24.4	53,240	18.9	41,485
ペルーナ	45.15	17,473	37.15	19,540
銀行業 (9.5%)				
新生銀行	556	58,380	556	60,604
あおぞら銀行	362	47,784	362	66,608
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,567.4	4,052,380	7,973.6	3,229,308
りそなホールディングス	323.6	363,402	665.5	262,872
中央三井トラスト・ホールディングス	641	214,094	591	183,801
三井住友フィナンシャルグループ	856.1	2,538,336	797.9	2,166,298
第四銀行	158	49,454	125	33,375
北越銀行	130	19,630	130	24,700
西日本シティ銀行	393	100,608	365	87,235
札幌北洋ホールディングス	156.7	62,680	158.1	60,710
千葉銀行	448	240,128	417	199,743
横浜銀行	784	337,120	729	287,226
常陽銀行	443	172,327	408	137,496
群馬銀行	282	138,462	247	110,162
武蔵野銀行	19	48,393	18.4	49,753
千葉興業銀行	23.8	16,469	23.8	11,233
東京都市銀行	23.7	29,767	17.1	20,554
七十七銀行	190	93,670	177	71,508
青森銀行	104	23,504	104	26,520
秋田銀行	80	29,040	80	20,880
山形銀行	63	24,444	63	24,444
岩手銀行	8.7	44,892	8.7	28,666
東邦銀行	105	31,290	105	22,575
東北銀行	79	11,297	79	9,559
ふくおかフィナンシャルグループ	459	169,371	424	138,648
静岡銀行	363	291,126	323	220,609
十六銀行	139	49,762	139	36,140
スルガ銀行	115	93,725	113	84,524
八十二銀行	228	114,456	200	96,200
山梨中央銀行	76	28,880	61	24,400
大垣共立銀行	156	48,984	123	32,964
福井銀行	97	28,712	97	24,832
北國銀行	129	42,828	129	35,475
滋賀銀行	116	65,192	91	37,128
南都銀行	109	54,827	96	37,728
百五銀行	112	45,584	87	30,711
京都銀行	198	157,410	187	134,640
三重銀行	66	15,906	66	14,256
ほくほくフィナンシャルグループ	777	147,630	731	123,539
広島銀行	325	123,500	306	107,712
山陰合同銀行	74	54,020	65	37,310
中国銀行	98	116,816	87	80,562
鳥取銀行	77	19,250	77	13,475
伊予銀行	138	112,608	112	79,408
百十四銀行	133	46,018	108	32,400
四国銀行	84	25,536	84	22,680
阿波銀行	98	50,862	83	40,338
鹿児島銀行	80	50,480	66	36,564
大分銀行	82	26,240	82	22,222
宮崎銀行	66	18,018	91	17,472
肥後銀行	91	44,226	82	39,196
佐賀銀行	82	21,484	82	18,942

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
十八銀行	73	19,199	96	21,696
沖繩銀行	9.3	33,945	7.3	24,090
琉球銀行	23.8	23,966	23.8	20,587
住友信託銀行	1,015	529,830	952	443,632
みずほ信託銀行	954	86,814	1,054	83,266
八千代銀行	9	18,819	3.5	9,978
みずほフィナンシャルグループ	9,859.8	1,902,941	12,911.3	1,936,695
紀陽ホールディングス	418	51,414	400	46,800
山口フィナンシャルグループ	110	108,460	105	78,750
長野銀行	80	14,080	80	14,400
名古屋銀行	110	39,050	116	29,812
愛知銀行	4.1	29,438	3.1	15,035
第三銀行	76	19,304	61	11,651
中京銀行	94	25,944	94	17,108
東日本銀行	92	16,192	52	9,464
愛媛銀行	85	22,015	85	19,550
トマト銀行	101	18,685	101	15,453
京葉銀行	93	39,246	85	35,700
関西アーバン銀行	122	17,934	157	21,980
栃木銀行	61	22,875	43	14,620
北日本銀行	7.5	18,637	4.5	8,694
香川銀行	43	12,986	—	—
徳島銀行	28	8,428	—	—
トモニホールディングス	—	—	30	8,880
フィデアホールディングス	97	16,199	79	18,328
池田泉州ホールディングス	399.8	70,764	290.3	33,965
証券・商品先物取引業 (1.5%)				
SBIホールディングス	11.046	189,659	12.754	140,804
ジャフコ	16.7	38,259	16.7	38,393
大和証券グループ本社	1,059	498,789	1,053	424,359
野村ホールディングス	2,245.5	1,484,275	2,226.6	1,030,915
みずほ証券	332	91,632	283	64,807
みずほインベスターズ証券	334	31,730	334	26,386
岡三証券グループ	96	40,032	96	31,488
丸三証券	54.7	29,756	54.7	21,497
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	129	47,859	129	36,120
水戸証券	46	10,074	—	—
いちよし証券	39.5	24,806	39.5	21,646
松井証券	73.3	47,498	60.2	28,534
だいち証券ビジネス	17.8	7,155	17.8	5,251
マネックスグループ	0.882	39,116	0.882	17,684
カブドットコム証券	0.287	28,671	57.4	17,162
保険業 (2.5%)				
NKS Jホールディングス	—	—	888	475,968
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	253.3	614,759	312.3	578,379
ソニーフィナンシャルホールディングス	0.384	111,897	0.513	167,238
第一生命保険	—	—	4.256	574,560
日本興亜損害保険	401	229,773	—	—
損害保険ジャパン	525	341,250	—	—
ニッセイ同和損害保険	126	58,464	—	—
あいおい損害保険	282	130,566	—	—
富士火災海上保険	135	15,660	135	19,440
東京海上ホールディングス	456.6	1,166,613	399.8	912,343
T&Dホールディングス	212.1	426,321	193.9	407,190

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千円	千株	千円
その他金融業 (0.8%)				
クレディセゾン	84	113,400	83.6	114,950
セディナ	122.3	19,812	122.3	19,323
芙蓉総合リース	13.7	35,880	8.8	21,656
興銀リース	15.3	26,438	15.3	28,718
東京センチュリーリース	28.4	35,727	24.9	32,295
日本証券金融	50.6	32,738	50.6	28,032
武富士	37	15,022	—	—
リコーリース	11.6	24,708	11.6	22,330
イオンクレジットサービス	55	55,605	51.5	57,989
アコム	30.81	45,198	25.31	27,208
プロミス	52.65	40,540	52.65	33,590
日立キャピタル	27.2	33,673	24.6	26,986
オリックス	57.95	447,953	55.63	465,066
三菱UFJリース	29.96	94,973	26.46	88,244
不動産業 (2.4%)				
日本駐車場開発	3.224	13,250	3.224	11,461
昭栄	34.2	23,700	34.2	24,897
野村不動産ホールディングス	62.1	88,554	47.6	65,592
ヒューリック	25	16,400	33.5	23,148
パーク24	72	64,944	45	37,260
三井不動産	502	769,064	502	753,502
三菱地所	790	1,125,750	740	1,121,840
平和不動産	126	37,800	86	16,856
東京建物	203	65,772	228	75,696
ダイビル	47	32,477	38	25,308
東急不動産	228	79,344	212	80,348
京阪神不動産	29	12,151	29	11,310
住友不動産	274	461,690	254	456,692
東宝不動産	37.7	18,699	37.7	18,850
大京	183	31,659	172	22,532
テーオーシー	74.6	23,872	74.6	24,468
東京楽天地	60	21,360	60	15,360
レオパレス21	79.4	35,253	—	—
空港施設	28.3	13,951	42.3	14,551
住友不動産販売	4.31	16,140	4.31	15,149
ゴールドクレスト	—	—	4.5	7,776
日本エスリード	8.6	6,665	8.6	6,518
東急リパブル	11.9	8,948	11.9	9,412
サンヨーハウジング名古屋	0.127	9,753	0.127	9,753
イオンモール	57.3	101,191	50.1	96,342
エヌ・ティ・ティ都市開発	0.825	60,555	0.75	56,025
日本空港ビルデング	25.9	34,965	34.9	36,994
サービス業 (1.7%)				
日本M&Aセンター	0.015	4,702	0.015	6,570
アコーディア・ゴルフ	0.316	28,692	0.396	22,611
パソナグループ	0.421	25,975	0.421	28,164
スタジアオアリス	10.6	8,056	10.6	8,798
シミック	0.96	19,852	0.48	12,120
NECフィールディング	17.2	21,895	11.2	11,020
総合警備保障	42	43,932	42	38,178
カカコム	0.096	33,456	0.076	35,796
エムスリー	0.089	28,836	0.074	35,742
ディー・エヌ・エー	0.141	98,277	43.5	130,935
博報堂DYホールディングス	17.05	79,794	15.85	75,525
ぐるなび	0.025	4,730	0.025	2,632

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	評価額	株数	評価額	
	千株	千円	千株	千円	
PGMホールディングス	0.483	29,366	0.483	21,831	
イーピーエス	0.015	6,525	0.03	5,490	
ドリームインキュベータ	0.11	7,260	0.11	6,457	
ケネディクス	—	—	1.3	25,649	
電通	115.6	277,902	103.8	236,664	
みらかホールディングス	24.7	70,469	27.2	79,505	
日本空調サービス	12	9,156	12	8,460	
オリエンタルランド	31	203,980	30	205,800	
ダスキン	35.8	59,750	29.1	44,493	
秀英予備校	14.3	7,264	14.3	4,919	
ラウンドワン	23.1	15,015	28.3	10,952	
リゾートトラスト	19.9	26,387	19.9	22,885	
ビー・エム・エル	8.2	19,319	8.2	18,368	
もしもしホットライン	16.45	29,330	13.7	22,440	
東急コミュニティー	4.9	11,088	4.9	11,470	
ユー・エス・エス	15.79	97,266	14.79	92,437	
カルチャー・コンビニエンス・クラブ	63	28,476	62.2	35,391	
エイチ・アイ・エス	17.7	32,214	15.7	27,192	
共立メンテナンス	18.5	24,827	18.5	23,032	
建設技術研究所	28.5	13,423	28.5	13,509	
よみうりランド	55	17,655	55	15,785	
東京ドーム	129	33,669	129	19,995	
トランス・コスモス	17.8	12,780	17.8	13,296	
乃村工藝社	41	10,373	41	10,947	
日本管財	8.1	12,384	8.1	11,688	
白洋舎	80	20,560	80	15,760	
セコム	115.1	471,334	116	454,140	
メイテック	23.7	41,617	15.4	25,825	
アサツー ディ・ケイ	22.4	41,462	18.9	42,714	
応用地質	30.2	23,133	30.2	20,989	
ベネッセホールディングス	40.9	167,485	34.6	120,754	
イオンディライト	21.7	27,580	13.2	18,532	
ニチイ学館	26.8	21,949	26.8	17,286	
ダイセキ	21.3	38,148	16.3	23,749	
合計	株数	金額	株数	金額	
	163,435	143,304,912	156,893	124,424,564	
	銘柄数<比率>	1,032	<98.2%>	1,032	<98.8%>

(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) 評価額欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

(注4) 一印は組み入れなしです。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	期首(前期末)		当期末	
	買建額	売建額	買建額	売建額
	百万円	百万円	百万円	百万円
国内株式先物取引 TOPIX	2,574	—	1,466	—

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 一印は組み入れなしです。

■投資信託財産の構成

(2011年3月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	124,424,564 千円	98.7 %
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,624,599	1.3
投 資 信 託 財 産 総 額	126,049,163	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2011年3月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	126,835,654,409円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,285,857,834
株 式(評価額)	124,424,564,380
未 収 配 当 金	159,545,021
未 収 利 息	2,174
差 入 委 託 証 拠 金	965,685,000
(B) 負 債	937,410,266
未 払 金	107,210,500
未 払 解 約 金	40,199,766
差入委託証拠金代用有価証券	790,000,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	125,898,244,143
元 本	211,611,641,344
次 期 繰 越 損 益 金	△ 85,713,397,201
(D) 受 益 権 総 口 数	211,611,641,344口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	5,949円

(注1) 当親ファンドの期首元本額は229,176,813,757円、期中追加設定元本額は36,946,209,701円、期中一部解約元本額は54,511,382,114円です。

元本の内訳

東京海上日本株TOPIXファンド	2,011,007,832円
東京海上セレクション・日本株TOPIX	11,955,352,644円
LPS4資産分散ファンド(慎重型)	1,094,813円
LPS4資産分散ファンド(安定重視型)	1,748,415円
LPS4資産分散ファンド(バランス型)	3,220,313円
LPS4資産分散ファンド(成長重視型)	3,448,909円
LPS4資産分散ファンド(積極型)	1,668,880円
TMA日本株式インデックスVA<適格機関投資家限定>	122,590,273,133円
TMA世界バランスファンド55VA<適格機関投資家限定>	7,034,857,993円
TMA世界バランスファンド35VA<適格機関投資家限定>	68,008,968,412円

(注2) 当期末の1口当たり純資産額は0.5949円です。

(注3) 元本の欠損は85,713,397,201円です。

■損益の状況

当期(自2010年3月24日 至2011年3月22日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,713,850,655円
受 取 配 当 金	2,708,332,027
受 取 利 息	2,016,390
そ の 他 収 益 金	3,502,238
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△10,469,011,154
売 買 益	5,540,018,547
売 買 損	△16,009,029,701
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	62,508,450
取 引 益	773,728,500
取 引 損	△ 711,220,050
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 7,692,652,049
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△83,203,058,957
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△15,365,735,451
(G) 解 約 差 損 益 金	20,548,049,256
(H) 計 (D+E+F+G)	△85,713,397,201
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△85,713,397,201

(注1) 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。

(注2) 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。

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

TMA日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第5期(決算日 2010年11月10日)

(計算期間 2009年11月11日~2010年11月10日)

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド(親投資信託)の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント投信

■設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 騰 落 中 率		ベンチマーク	期 騰 落 中 率		債 組 入 比 率	純 資 産
		騰 落	中 率		騰 落	中 率		
(設 定 日) 2005年9月29日	円 10,000		% -	298.572		% -		百万円 5,000
1期(2006年11月10日)	10,004		0.0	299.086	0.2	100.0		80,154
2期(2007年11月12日)	10,261		2.6	306.833	2.6	99.7		170,831
3期(2008年11月10日)	10,412		1.5	311.116	1.4	99.5		187,747
4期(2009年11月10日)	10,671		2.5	319.065	2.6	99.5		224,359
5期(2010年11月10日)	11,087		3.9	331.567	3.9	99.4		209,543

(注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注2) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		ベンチマーク	騰 落 率		債 組 入 比 率
		騰 落	率		騰 落	率	
(期 首) 2009年11月10日	円 10,671		% -	319.065		% -	% 99.5
11月末	10,787		1.1	322.519	1.1		99.2
12月末	10,800		1.2	322.921	1.2		99.5
2010年1月末	10,798		1.2	322.908	1.2		99.3
2月末	10,811		1.3	323.280	1.3		99.3
3月末	10,790		1.1	322.689	1.1		99.4
4月末	10,882		2.0	325.437	2.0		99.5
5月末	10,912		2.3	326.266	2.3		99.2
6月末	11,036		3.4	329.973	3.4		99.5
7月末	11,071		3.7	331.018	3.7		99.4
8月末	11,143		4.4	333.165	4.4		99.1
9月末	11,152		4.5	333.511	4.5		99.6
10月末	11,115		4.2	332.378	4.2		99.4
(期 末) 2010年11月10日	11,087		3.9	331.567	3.9		99.4

(注) 騰落率は期首比です。

当ファンドのベンチマークはNOMURA-BPI(野村ボンド・パフォーマンス・インデックス)(総合)であり、NOMURA-BPI(野村ボンド・パフォーマンス・インデックス)(総合)とは、野村証券が公表する日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表す代表的な指標です。

■当期中の運用経過と今後の方針（2009年11月11日から2010年11月10日まで）

1. 基準価額の推移と主な変動要因

- 期首（2009年11月10日）基準価額：10,671円
- 期末（2010年11月10日）基準価額：11,087円
（基準価額の変動要因）
- 長期金利（10年国債利回り）は、期首1.4%台後半から期末1.0%程度へ低下しました。
- 非国債の対国債スプレッド（同一残存年限で比較した、国債以外の債券の国債に対する上乘せ利回り）は縮小しました。

結果として基準価額は前期末比+3.9%となりました。

2. 当期の投資環境

10年国債利回りは、2010年4月にかけて国債需給悪化懸念や株高などの金利上昇要因と、投資家の押し目買いなどの金利上昇抑制要因が拮抗する中、1.2%から1.4%程度を中心とする狭いレンジ内で推移しました。4月下旬以降、SEC（米国証券取引委員会）による米国大手金融機関の訴追、ギリシャ危機に端を発する欧州財政問題に対する懸念などから“質への逃避”の流れが世界的に強まったことや日米金融当局による追加緩和姿勢が明確化したことなどから10年国債利回りは低下基調となり、期末には1.0%程度の水準で終了しました。

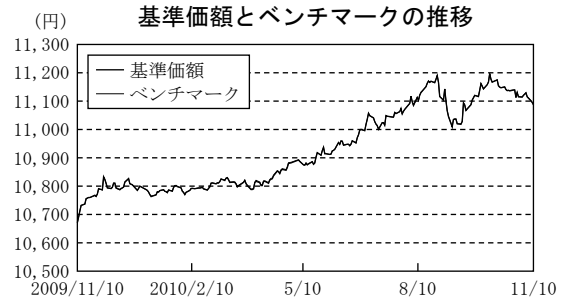
3. 当期の運用経過と基準価額

当ファンドは、ベンチマークであるNOMURA-BPI（総合）に連動することを目標として運用しています。

当ファンドの基準価額は期首の10,671円から11,087円となり、騰落率は+3.9%でベンチマークとほぼ同水準となりました。

4. 今後の運用方針

今後も引き続き、ベンチマークに対する高い連動率を維持するよう運用を行う方針です。



(注) ベンチマークは期首（2009年11月10日）の値が、基準価額と同一となるように指数化したものです。

■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用の明細

記載すべき事項はありません。

■ 期中の売買及び取引の状況（2009年11月11日から2010年11月10日まで）

公社債

国	債 証 券	買 付 額	売 付 額
		千円	千円
内	国 債 証 券	61,692,286	78,750,865
	地 方 債 証 券	604,661	(571,500)
	特 殊 債 証 券	—	(1,650,000)
	社 債 証 券 (投資法人債券を含む)	932,119	(2,655,485)

(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) 単位未満は切り捨てています。

(注3) () 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4) 社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等（2009年11月11日から2010年11月10日まで）

期中における利害関係人との取引はありません。

(注) 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項に規定する利害関係人です。

■ 組入資産の明細（2010年11月10日現在）

(A) 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
国 債 証 券	千円 146,025,000	千円 152,807,634	% 72.9	% —	% 41.1	% 25.2	% 6.6
地 方 債 証 券	17,188,840 (17,188,840)	17,965,815 (17,965,815)	8.6 (8.6)	— (—)	4.3 (4.3)	2.8 (2.8)	1.5 (1.5)
特 殊 債 証 券 (除く金融債)	11,571,000 (11,571,000)	12,126,255 (12,126,255)	5.8 (5.8)	— (—)	2.4 (2.4)	2.4 (2.4)	1.0 (1.0)
金 融 債 証 券	3,680,000 (3,680,000)	3,710,255 (3,710,255)	1.8 (1.8)	— (—)	— (—)	0.1 (0.1)	1.7 (1.7)
普 通 社 債 証 券 (含む投資法人債券)	20,612,923 (20,612,923)	21,624,903 (21,624,903)	10.3 (10.3)	— (—)	5.3 (5.3)	2.8 (2.8)	2.3 (2.3)
合 計	199,077,763 (53,052,763)	208,234,864 (55,427,230)	99.4 (26.5)	— (—)	53.0 (11.9)	33.2 (8.0)	13.2 (6.5)

(注1) () 内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 単位未満は切り捨てています。

(注4) —印は組み入れなしです。

(注5) 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) 詳細開示

国内(邦貨建) 公社債銘柄別

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
国債証券				
第64回 利付国債(5年)	1.5	2,480,000	2,534,262	2012/6/20
第292回 利付国債(2年)	0.2	400,000	400,444	2012/5/15
第293回 利付国債(2年)	0.2	700,000	700,826	2012/6/15
第294回 利付国債(2年)	0.2	1,000,000	1,001,160	2012/7/15
第295回 利付国債(2年)	0.2	2,050,000	2,052,501	2012/8/15
第296回 利付国債(2年)	0.1	800,000	799,560	2012/9/15
第66回 利付国債(5年)	1.1	1,420,000	1,445,361	2012/9/20
第67回 利付国債(5年)	1.3	980,000	1,001,119	2012/9/20
第69回 利付国債(5年)	0.9	2,340,000	2,377,393	2012/9/20
第70回 利付国債(5年)	0.8	1,550,000	1,573,699	2013/3/20
第71回 利付国債(5年)	1.3	920,000	944,803	2013/3/20
第72回 利付国債(5年)	1.5	1,340,000	1,386,565	2013/6/20
第73回 利付国債(5年)	1.3	1,230,000	1,266,383	2013/6/20
第75回 利付国債(5年)	1.1	1,400,000	1,436,876	2013/9/20
第77回 利付国債(5年)	1.0	1,000,000	1,023,510	2013/9/20
第80回 利付国債(5年)	0.8	1,500,000	1,528,620	2013/12/20
第81回 利付国債(5年)	0.8	2,000,000	2,039,500	2014/3/20
第82回 利付国債(5年)	0.9	200,000	204,614	2014/3/20
第83回 利付国債(5年)	0.9	750,000	767,775	2014/6/20
第84回 利付国債(5年)	0.7	1,800,000	1,829,826	2014/6/20
第85回 利付国債(5年)	0.7	2,100,000	2,135,175	2014/9/20
第87回 利付国債(5年)	0.5	2,600,000	2,622,100	2014/12/20
第88回 利付国債(5年)	0.5	2,800,000	2,822,792	2015/3/20
第89回 利付国債(5年)	0.4	2,950,000	2,958,673	2015/6/20
第91回 利付国債(5年)	0.4	200,000	200,476	2015/9/20
第239回 利付国債(10年)	1.4	400,000	408,112	2012/6/20
第240回 利付国債(10年)	1.3	1,350,000	1,375,231	2012/6/20
第241回 利付国債(10年)	1.3	680,000	694,654	2012/9/20
第242回 利付国債(10年)	1.2	510,000	520,052	2012/9/20
第243回 利付国債(10年)	1.1	860,000	875,359	2012/9/20
第244回 利付国債(10年)	1.0	800,000	814,456	2012/12/20
第245回 利付国債(10年)	0.9	940,000	955,021	2012/12/20
第246回 利付国債(10年)	0.8	900,000	912,501	2012/12/20
第247回 利付国債(10年)	0.8	830,000	842,690	2013/3/20
第248回 利付国債(10年)	0.7	370,000	374,791	2013/3/20
第249回 利付国債(10年)	0.6	340,000	343,610	2013/3/20
第250回 利付国債(10年)	0.5	1,000,000	1,008,910	2013/6/20
第251回 利付国債(10年)	0.9	750,000	764,437	2013/6/20
第252回 利付国債(10年)	1.0	170,000	173,711	2013/6/20
第254回 利付国債(10年)	1.4	860,000	889,962	2013/9/20
第255回 利付国債(10年)	1.5	1,030,000	1,068,800	2013/9/20
第256回 利付国債(10年)	1.4	2,580,000	2,676,904	2013/12/20
第258回 利付国債(10年)	1.3	820,000	849,807	2014/3/20
第259回 利付国債(10年)	1.5	1,530,000	1,595,774	2014/3/20
第260回 利付国債(10年)	1.6	410,000	429,946	2014/6/20
第261回 利付国債(10年)	1.8	330,000	348,407	2014/6/20
第262回 利付国債(10年)	1.9	1,920,000	2,033,932	2014/6/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第263回 利付国債(10年)	1.6	850,000	893,375	2014/9/20
第264回 利付国債(10年)	1.5	1,030,000	1,078,636	2014/9/20
第265回 利付国債(10年)	1.5	980,000	1,028,206	2014/12/20
第266回 利付国債(10年)	1.4	940,000	982,431	2014/12/20
第269回 利付国債(10年)	1.3	1,540,000	1,605,665	2015/3/20
第270回 利付国債(10年)	1.3	1,450,000	1,513,655	2015/6/20
第271回 利付国債(10年)	1.2	950,000	987,401	2015/6/20
第273回 利付国債(10年)	1.5	930,000	981,196	2015/9/20
第274回 利付国債(10年)	1.5	500,000	528,520	2015/12/20
第275回 利付国債(10年)	1.4	280,000	294,571	2015/12/20
第276回 利付国債(10年)	1.6	510,000	541,645	2015/12/20
第277回 利付国債(10年)	1.6	900,000	957,492	2016/3/20
第279回 利付国債(10年)	2.0	870,000	943,793	2016/3/20
第280回 利付国債(10年)	1.9	930,000	1,006,604	2016/6/20
第282回 利付国債(10年)	1.7	1,350,000	1,448,604	2016/9/20
第283回 利付国債(10年)	1.8	1,240,000	1,337,637	2016/9/20
第284回 利付国債(10年)	1.7	1,320,000	1,418,313	2016/12/20
第285回 利付国債(10年)	1.7	1,580,000	1,699,685	2017/3/20
第286回 利付国債(10年)	1.8	1,310,000	1,419,162	2017/6/20
第287回 利付国債(10年)	1.9	630,000	686,303	2017/6/20
第288回 利付国債(10年)	1.7	1,140,000	1,228,110	2017/9/20
第289回 利付国債(10年)	1.5	2,150,000	2,287,922	2017/12/20
第290回 利付国債(10年)	1.4	700,000	739,900	2018/3/20
第291回 利付国債(10年)	1.3	500,000	524,980	2018/3/20
第292回 利付国債(10年)	1.7	900,000	971,325	2018/3/20
第293回 利付国債(10年)	1.8	880,000	955,653	2018/6/20
第294回 利付国債(10年)	1.7	1,420,000	1,531,782	2018/6/20
第296回 利付国債(10年)	1.5	1,400,000	1,487,724	2018/9/20
第297回 利付国債(10年)	1.4	440,000	463,416	2018/12/20
第298回 利付国債(10年)	1.3	1,000,000	1,045,560	2018/12/20
第299回 利付国債(10年)	1.3	1,300,000	1,356,667	2019/3/20
第300回 利付国債(10年)	1.5	1,000,000	1,059,710	2019/3/20
第301回 利付国債(10年)	1.5	1,800,000	1,904,382	2019/6/20
第302回 利付国債(10年)	1.4	800,000	839,944	2019/6/20
第303回 利付国債(10年)	1.4	1,600,000	1,676,528	2019/9/20
第304回 利付国債(10年)	1.3	1,000,000	1,039,160	2019/9/20
第305回 利付国債(10年)	1.3	3,220,000	3,338,109	2019/12/20
第306回 利付国債(10年)	1.4	2,800,000	2,919,392	2020/3/20
第308回 利付国債(10年)	1.3	1,750,000	1,804,635	2020/6/20
第309回 利付国債(10年)	1.1	1,800,000	1,823,724	2020/6/20
第310回 利付国債(10年)	1.0	260,000	260,231	2020/9/20
第311回 利付国債(10年)	0.8	700,000	687,757	2020/9/20
第1回 利付国債(30年)	2.8	90,000	104,279	2029/9/20
第2回 利付国債(30年)	2.4	90,000	98,357	2030/2/20
第3回 利付国債(30年)	2.3	120,000	129,222	2030/5/20
第5回 利付国債(30年)	2.2	110,000	116,503	2031/5/20
第6回 利付国債(30年)	2.4	190,000	207,221	2031/11/20
第7回 利付国債(30年)	2.3	90,000	96,677	2032/5/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
国債証券				
第8回 利付国債(30年)	1.8	110,000	108,376	2032/11/22
第9回 利付国債(30年)	1.4	140,000	127,615	2032/12/20
第10回 利付国債(30年)	1.1	300,000	256,917	2033/3/20
第11回 利付国債(30年)	1.7	350,000	336,801	2033/6/20
第14回 利付国債(30年)	2.4	200,000	217,224	2034/3/20
第15回 利付国債(30年)	2.5	240,000	265,185	2034/6/20
第16回 利付国債(30年)	2.5	305,000	337,244	2034/9/20
第19回 利付国債(30年)	2.3	300,000	320,112	2035/6/20
第20回 利付国債(30年)	2.5	250,000	276,250	2035/9/20
第21回 利付国債(30年)	2.3	260,000	277,201	2035/12/20
第22回 利付国債(30年)	2.5	300,000	331,641	2036/3/20
第23回 利付国債(30年)	2.5	360,000	397,879	2036/6/20
第24回 利付国債(30年)	2.5	200,000	221,184	2036/9/20
第25回 利付国債(30年)	2.3	400,000	426,424	2036/12/20
第26回 利付国債(30年)	2.4	590,000	640,663	2037/3/20
第27回 利付国債(30年)	2.5	580,000	642,437	2037/9/20
第28回 利付国債(30年)	2.5	610,000	675,855	2038/3/20
第29回 利付国債(30年)	2.4	920,000	1,000,122	2038/9/20
第30回 利付国債(30年)	2.3	600,000	639,498	2039/3/20
第31回 利付国債(30年)	2.2	850,000	887,587	2039/9/20
第32回 利付国債(30年)	2.3	1,150,000	1,227,406	2040/3/20
第33回 利付国債(30年)	2.0	180,000	180,167	2040/9/20
第18回 利付国債(20年)	6.3	20,000	21,655	2012/3/20
第19回 利付国債(20年)	5.9	20,000	22,119	2012/9/20
第23回 利付国債(20年)	5.5	10,000	11,511	2013/9/20
第24回 利付国債(20年)	4.7	10,000	11,497	2014/3/20
第26回 利付国債(20年)	4.5	110,000	127,811	2014/9/22
第27回 利付国債(20年)	5.0	230,000	271,680	2014/9/22
第29回 利付国債(20年)	4.2	20,000	23,711	2015/9/21
第30回 利付国債(20年)	3.7	80,000	92,912	2015/9/21
第31回 利付国債(20年)	3.5	100,000	116,528	2016/3/21
第32回 利付国債(20年)	3.7	60,000	70,546	2016/3/21
第34回 利付国債(20年)	3.5	190,000	226,012	2017/3/20
第35回 利付国債(20年)	3.3	240,000	282,700	2017/3/20
第36回 利付国債(20年)	3.0	280,000	326,121	2017/9/20
第37回 利付国債(20年)	3.1	340,000	398,255	2017/9/20
第38回 利付国債(20年)	2.7	60,000	68,982	2018/3/20
第39回 利付国債(20年)	2.6	420,000	479,745	2018/3/20
第40回 利付国債(20年)	2.3	210,000	235,779	2018/9/20
第41回 利付国債(20年)	1.5	190,000	201,187	2019/3/20
第42回 利付国債(20年)	2.6	760,000	872,100	2019/3/20
第43回 利付国債(20年)	2.9	450,000	528,070	2019/9/20
第44回 利付国債(20年)	2.5	350,000	399,290	2020/3/20
第45回 利付国債(20年)	2.4	380,000	430,046	2020/3/20
第47回 利付国債(20年)	2.2	310,000	345,054	2020/9/21
第49回 利付国債(20年)	2.1	330,000	364,211	2021/3/22
第50回 利付国債(20年)	1.9	80,000	86,751	2021/3/22
第51回 利付国債(20年)	2.0	230,000	251,433	2021/6/21
第52回 利付国債(20年)	2.1	240,000	264,672	2021/9/21
第53回 利付国債(20年)	2.1	230,000	253,243	2021/12/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第59回 利付国債(20年)	1.7	320,000	336,544	2022/12/20
第60回 利付国債(20年)	1.4	430,000	437,924	2022/12/20
第62回 利付国債(20年)	0.8	380,000	357,694	2023/6/20
第63回 利付国債(20年)	1.8	360,000	380,509	2023/6/20
第64回 利付国債(20年)	1.9	370,000	394,434	2023/9/20
第65回 利付国債(20年)	1.9	300,000	319,248	2023/12/20
第66回 利付国債(20年)	1.8	160,000	168,387	2023/12/20
第67回 利付国債(20年)	1.9	150,000	159,327	2024/3/20
第68回 利付国債(20年)	2.2	190,000	208,730	2024/3/20
第69回 利付国債(20年)	2.1	410,000	445,518	2024/3/20
第70回 利付国債(20年)	2.4	490,000	549,412	2024/6/20
第71回 利付国債(20年)	2.2	160,000	175,520	2024/6/20
第72回 利付国債(20年)	2.1	580,000	627,815	2024/9/20
第73回 利付国債(20年)	2.0	450,000	480,933	2024/12/20
第74回 利付国債(20年)	2.1	320,000	345,961	2024/12/20
第75回 利付国債(20年)	2.1	230,000	248,340	2025/3/20
第76回 利付国債(20年)	1.9	360,000	379,231	2025/3/20
第77回 利付国債(20年)	2.0	340,000	362,630	2025/3/20
第78回 利付国債(20年)	1.9	410,000	430,922	2025/6/20
第80回 利付国債(20年)	2.1	290,000	312,515	2025/6/20
第81回 利付国債(20年)	2.0	200,000	212,400	2025/9/20
第82回 利付国債(20年)	2.1	630,000	677,539	2025/9/20
第83回 利付国債(20年)	2.1	40,000	42,954	2025/12/20
第84回 利付国債(20年)	2.0	330,000	349,875	2025/12/20
第85回 利付国債(20年)	2.1	270,000	289,121	2026/3/20
第86回 利付国債(20年)	2.3	330,000	362,472	2026/3/20
第87回 利付国債(20年)	2.2	300,000	325,581	2026/3/20
第88回 利付国債(20年)	2.3	750,000	822,187	2026/6/20
第89回 利付国債(20年)	2.2	340,000	367,985	2026/6/20
第90回 利付国債(20年)	2.2	700,000	755,958	2026/9/20
第91回 利付国債(20年)	2.3	430,000	470,428	2026/9/20
第93回 利付国債(20年)	2.0	360,000	377,186	2027/3/20
第94回 利付国債(20年)	2.1	700,000	743,414	2027/3/20
第95回 利付国債(20年)	2.3	700,000	762,748	2027/6/20
第96回 利付国債(20年)	2.1	440,000	466,703	2027/6/20
第98回 利付国債(20年)	2.1	480,000	508,473	2027/9/20
第99回 利付国債(20年)	2.1	930,000	983,828	2027/12/20
第100回 利付国債(20年)	2.2	660,000	707,038	2028/3/20
第103回 利付国債(20年)	2.3	500,000	542,465	2028/6/20
第104回 利付国債(20年)	2.1	430,000	453,598	2028/6/20
第105回 利付国債(20年)	2.1	810,000	853,189	2028/9/20
第107回 利付国債(20年)	2.1	350,000	367,846	2028/12/20
第108回 利付国債(20年)	1.9	610,000	622,572	2028/12/20
第109回 利付国債(20年)	1.9	300,000	305,610	2029/3/20
第110回 利付国債(20年)	2.1	1,050,000	1,101,786	2029/3/20
第111回 利付国債(20年)	2.2	400,000	425,252	2029/6/20
第112回 利付国債(20年)	2.1	850,000	890,485	2029/6/20
第113回 利付国債(20年)	2.1	1,200,000	1,255,068	2029/9/20
第114回 利付国債(20年)	2.1	900,000	940,374	2029/12/20
第115回 利付国債(20年)	2.2	450,000	477,274	2029/12/20
第116回 利付国債(20年)	2.2	300,000	317,670	2030/3/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
国債証券				
第117回 利付国債(20年)	2.1	850,000	886,584	2030/3/20
第118回 利付国債(20年)	2.0	800,000	820,200	2030/6/20
第121回 利付国債(20年)	1.9	260,000	262,267	2030/9/20
第122回 利付国債(20年)	1.8	300,000	297,606	2030/9/20
小計	—	146,025,000	152,807,634	—
地方債証券				
第569回 東京都公募公債	1.7	100,000	100,312	2011/1/25
第576回 東京都公募公債	1.4	240,000	242,316	2011/8/25
第582回 東京都公募公債	1.5	240,000	244,060	2012/2/24
第583回 東京都公募公債	1.5	100,000	101,795	2012/3/23
第588回 東京都公募公債	1.3	100,000	101,958	2012/8/24
第595回 東京都公募公債	0.8	100,000	101,367	2013/3/25
第599回 東京都公募公債	1.1	100,000	102,329	2013/7/25
第600回 東京都公募公債	0.9	100,000	101,827	2013/8/23
第606回 東京都公募公債	1.3	100,000	103,362	2014/2/25
第607回 東京都公募公債	1.4	100,000	103,738	2014/3/25
第611回 東京都公募公債	1.83	100,000	105,449	2014/6/20
第615回 東京都公募公債	1.53	100,000	104,571	2014/9/19
第618回 東京都公募公債	1.45	100,000	104,433	2014/12/19
第620回 東京都公募公債	1.35	100,000	104,179	2015/3/20
第621回 東京都公募公債	1.37	100,000	104,265	2015/3/20
第661回 東京都公募公債	1.6	150,000	159,702	2018/9/20
第662回 東京都公募公債	1.67	200,000	213,976	2018/9/20
第7回 東京都公募公債(30年)	2.51	100,000	107,299	2038/9/17
第1回 東京都公募公債(20年)	1.54	200,000	203,054	2023/6/20
第2回 東京都公募公債(20年)	1.97	100,000	106,218	2023/9/20
第10回 東京都公募公債(20年)	2.33	100,000	108,415	2026/9/18
第11回 東京都公募公債(20年)	2.22	300,000	319,338	2027/3/19
第21回 東京都公募公債(5年)	1.4	110,000	110,473	2011/3/18
平成14年度第1回 北海道公募公債	1.4	100,000	101,585	2012/4/25
平成17年度第9回 北海道公募公債	1.5	180,000	188,505	2015/12/22
第320回 神奈川県公募公債	0.6	100,000	100,918	2013/5/30
第125回 神奈川県公募公債	1.4	205,000	212,628	2014/3/31
第139回 神奈川県公募公債	1.94	200,000	215,454	2016/3/18
第146回 神奈川県公募公債	1.76	200,000	214,864	2017/3/20
第155回 神奈川県公募公債	1.61	100,000	106,574	2018/6/20
第252回 大阪府公募公債(10年)	0.8	200,000	202,194	2013/1/30
第261回 大阪府公募公債(10年)	1.5	300,000	310,662	2013/12/25
第270回 大阪府公募公債(10年)	1.5	100,000	104,087	2014/9/29
第301回 大阪府公募公債(10年)	1.83	340,000	364,840	2017/4/26
平成13年度第6回 兵庫県公募公債	1.4	339,100	343,365	2011/12/19
平成15年度第1回 兵庫県公募公債	0.7	100,000	100,989	2013/4/25
平成19年度第11回 兵庫県公募公債	1.76	100,000	107,116	2017/11/15
第11回 兵庫県公募公債(20年)	1.84	100,000	97,246	2030/8/16
平成18年度第2回 静岡県公募公債	2.0	200,000	216,710	2016/6/27
平成20年度第5回 静岡県公募公債	1.59	200,000	212,516	2018/10/30
平成14年度第2回 愛知県公募公債(10年)	1.3	100,000	102,093	2012/10/18
平成13年度第2回 埼玉県公募公債	1.2	100,000	100,697	2011/7/19
平成14年度第4回 埼玉県公募公債	0.8	100,000	101,276	2013/1/30
平成16年度第1回 埼玉県公募公債	1.5	100,000	104,125	2014/4/28

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
平成17年度第5回 埼玉県公募公債	1.4	100,000	104,641	2015/9/29
平成19年度第2回 埼玉県公募公債	1.93	100,000	108,634	2017/6/28
平成22年度第10回 埼玉県公募公債	1.94	100,000	99,630	2030/11/12
平成17年度第5回 福岡県公募公債	1.5	200,000	210,694	2016/1/27
平成14年度第1回 千葉県公募公債	1.3	100,000	101,928	2012/8/20
平成17年度第5回 千葉県公募公債	1.6	200,000	211,344	2015/10/23
平成17年度第7回 千葉県公募公債	1.5	100,000	105,310	2015/12/25
平成17年度第8回 千葉県公募公債	0.8	101,000	101,126	2011/1/25
平成20年度第3回 千葉県公募公債	1.78	100,000	107,817	2018/7/25
平成21年度第1回 千葉県公募公債	1.53	112,000	118,151	2019/4/25
平成17年度第1回 新潟県公募公債	1.3	376,100	391,132	2015/7/29
平成18年度第1回 新潟県公募公債	2.1	100,000	108,850	2016/7/27
平成19年度第1回 新潟県公募公債	1.99	100,000	108,900	2017/7/26
平成13年度第1回 茨城県公募公債	1.5	100,000	101,739	2012/3/15
平成14年度第1回 茨城県公募公債	0.8	110,000	111,439	2013/3/26
第4回 群馬県公募公債(10年)	1.76	100,000	107,538	2017/11/24
第5回 群馬県公募公債(10年)	1.71	100,000	107,040	2018/11/22
第1回 共同発行市場公募地方債	0.7	104,500	105,688	2013/4/25
第5回 共同発行市場公募地方債	0.9	100,000	101,799	2013/8/23
第14回 共同発行市場公募地方債	1.5	100,000	104,167	2014/5/23
第17回 共同発行市場公募地方債	1.8	100,000	105,483	2014/8/25
第18回 共同発行市場公募地方債	1.6	100,000	104,817	2014/9/25
第23回 共同発行市場公募地方債	1.3	100,000	103,886	2015/2/25
第30回 共同発行市場公募地方債	1.3	100,000	104,153	2015/9/25
第31回 共同発行市場公募地方債	1.5	200,000	210,374	2015/10/23
第33回 共同発行市場公募地方債	1.6	250,000	264,527	2015/12/25
第34回 共同発行市場公募地方債	1.4	100,000	104,832	2016/1/25
第35回 共同発行市場公募地方債	1.6	100,000	105,916	2016/2/25
第38回 共同発行市場公募地方債	2.0	150,000	162,379	2016/5/25
第48回 共同発行市場公募地方債	1.7	300,000	321,225	2017/3/24
第49回 共同発行市場公募地方債	1.8	116,300	125,276	2017/4/25
第51回 共同発行市場公募地方債	1.9	100,000	108,426	2017/6/23
第56回 共同発行市場公募地方債	1.72	100,000	107,340	2017/11/24
第57回 共同発行市場公募地方債	1.65	100,000	106,875	2017/12/25
第60回 共同発行市場公募地方債	1.49	200,000	211,580	2018/3/23
第67回 共同発行市場公募地方債	1.5	150,000	158,361	2018/10/25
第73回 共同発行市場公募地方債	1.59	300,000	317,901	2019/4/25
第75回 共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	106,303	2019/6/25
平成19年度第1回 新潟市公募公債(10年)	1.72	150,000	160,704	2017/12/26
平成17年度第8回 大阪市公募公債	1.6	300,000	315,366	2015/10/27
平成17年度第10回 大阪市公募公債	1.5	100,000	104,757	2016/1/26
平成19年度第10回 大阪市公募公債	1.74	100,000	106,709	2017/12/19
第12回 や号名古屋市公募公債	1.4	200,000	201,294	2011/5/23
第12回 し号名古屋市公募公債	1.5	100,000	104,786	2015/3/23
平成17年度第1回 京都市公募公債	1.4	100,000	104,503	2015/8/25
平成17年度第13回 神戸市公募公債	1.6	300,000	316,911	2016/2/23
平成22年度第4回 神戸市公募公債(20年)	1.895	100,000	98,289	2030/9/13
平成14年度第2回 横浜市公募公債	1.3	131,540	134,197	2012/9/20
平成16年度第4回 横浜市公募公債	1.36	100,000	104,034	2014/12/22
平成22年度第3回 横浜市公募公債	1.168	100,000	101,010	2020/9/18
平成18年度第1回 札幌市公募公債(5年)	1.4	150,000	151,003	2011/5/31

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
地方債証券				
平成20年度第2回 札幌市公募債	1.93	100,000	108,848	2018/6/20
第1回 川崎市15年公募債	1.78	100,000	107,229	2019/9/20
第2回 川崎市15年公募債	1.63	100,000	105,300	2020/6/22
平成14年度第4回 福岡市公募債	0.8	100,000	101,258	2013/2/27
平成18年度第6回 福岡市公募債	1.8	100,000	107,441	2016/12/26
平成16年度第1回 広島市公募債	1.4	200,000	208,150	2014/12/24
平成16年度第2回 千葉市公募債	1.4	102,000	106,249	2015/1/27
第4回 さいたま市公募債	1.8	240,000	258,012	2016/12/26
平成17年度第2回 鹿児島県公募債(10年)	1.7	100,000	106,316	2016/3/30
平成18年度第1回 鹿児島県公募債(10年)	1.9	361,300	389,734	2016/10/31
平成18年度第2回 鹿児島県公募債(5年)	1.31	180,000	182,665	2012/3/30
第1回 公営企業債券(5年)	1.14	300,000	305,694	2012/12/20
第2回 公営企業債券(20年)	1.45	100,000	101,009	2022/12/20
第10回 公営企業債券(20年)	2.21	100,000	108,084	2024/9/24
第1回 公営企業債券	1.42	200,000	202,694	2011/12/26
第2回 公営企業債券	1.49	500,000	510,135	2012/6/20
第12回 公営企業債券	1.53	300,000	313,398	2014/9/24
第14回 公営企業債券	1.45	100,000	104,485	2015/3/24
第20回 公営企業債券	2.05	300,000	325,443	2016/6/20
小計	—	17,188,840	17,965,815	—
特殊債券(除く金融債)				
第3回 政府保証日本政策投資銀行債券	1.8	102,000	102,185	2010/12/21
第19回 政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	227,000	246,712	2016/8/25
第313回 政府保証道路債	1.3	105,000	107,200	2012/9/20
第314回 政府保証道路債	1.0	203,000	206,493	2012/12/20
第316回 政府保証道路債	0.6	111,000	112,117	2013/5/29
第319回 政府保証道路債	0.9	100,000	101,895	2013/8/22
第327回 政府保証道路債	1.5	242,000	252,263	2014/4/25
第330回 政府保証道路債	1.8	123,000	129,831	2014/7/29
第331回 政府保証道路債	1.8	100,000	105,638	2014/8/29
第337回 政府保証道路債	1.3	103,000	107,166	2015/2/27
第339回 政府保証道路債	1.4	228,000	238,415	2015/4/28
第341回 政府保証道路債	1.3	183,000	190,654	2015/5/29
第344回 政府保証道路債	1.6	100,000	105,393	2020/7/15
第346回 政府保証道路債	1.4	176,000	184,405	2015/8/26
第347回 政府保証道路債	1.3	100,000	104,321	2015/9/22
第3回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	105,541	2016/1/29
第5回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	100,000	106,083	2016/2/26
第6回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	107,896	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	100,000	107,899	2021/3/26
第16回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	101,000	109,717	2016/7/28
第17回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	354,000	384,826	2016/8/31
第69回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	224,000	238,649	2018/11/28
第800回 政府保証公営企業債券	1.4	200,000	200,882	2011/3/18
第801回 政府保証公営企業債券	1.4	100,000	100,569	2011/4/26

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第816回 政府保証公営企業債券	1.4	100,000	101,976	2012/6/21
第817回 政府保証公営企業債券	1.3	650,000	662,480	2012/7/25
第826回 政府保証公営企業債券	0.7	100,000	101,221	2013/4/23
第827回 政府保証公営企業債券	0.6	158,000	159,587	2013/5/27
第831回 政府保証公営企業債券	1.6	200,000	207,888	2013/9/26
第832回 政府保証公営企業債券	1.4	100,000	103,462	2013/10/24
第842回 政府保証公営企業債券	1.8	100,000	105,626	2014/8/26
第843回 政府保証公営企業債券	1.5	100,000	104,566	2014/9/29
第844回 政府保証公営企業債券	1.6	154,000	161,735	2014/10/28
第845回 政府保証公営企業債券	1.5	200,000	209,402	2014/11/28
第850回 政府保証公営企業債券	1.4	100,000	104,549	2015/4/21
第853回 政府保証公営企業債券	1.2	100,000	103,788	2015/7/24
第864回 政府保証公営企業債券	1.9	109,000	117,681	2016/6/22
第865回 政府保証公営企業債券	2.0	178,000	193,304	2016/7/20
第191回 政府保証首都高速道路債券	1.8	112,000	118,198	2014/7/29
第199回 政府保証首都高速道路債券	1.4	100,000	104,757	2015/8/28
第140回 政府保証阪神高速道路債券	1.5	102,000	106,627	2014/9/26
第144回 政府保証阪神高速道路債券	1.5	146,000	153,158	2015/3/17
第1回 政府保証阪神高速道路株式会社債券	1.6	110,000	116,740	2016/3/31
第24回 政府保証本州四国連絡橋債券	1.8	358,000	378,112	2014/8/29
第25回 政府保証本州四国連絡橋債券	1.4	102,000	106,466	2015/1/26
第108回 政府保証預金保険機構債券	1.5	200,000	201,796	2011/7/13
第14回 政府保証国民生活債券	1.5	100,000	104,530	2014/9/17
第3回 政府保証新東京国際空港債券	0.6	141,000	142,398	2013/5/27
第1回 政府保証東日本高速道路債券	1.6	266,000	281,701	2015/11/25
第1回 政府保証中日本高速道路債券	1.6	100,000	105,903	2015/11/25
第7回 政府保証中日本高速道路債券	2.0	100,000	108,577	2016/7/15
第11回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	149,000	159,838	2016/4/26
第20回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	107,697	2016/10/31
第37回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	108,721	2017/7/31
第43回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	200,000	215,940	2027/10/29
第799回 政府保証公営企業債券	1.6	200,000	200,858	2011/2/25
第805回 政府保証公営企業債券	1.4	100,000	100,974	2011/8/24
第823回 政府保証公営企業債券	0.8	100,000	101,364	2013/1/29
第824回 政府保証公営企業債券	0.8	100,000	101,397	2013/2/27
第839回 政府保証公営企業債券	1.5	100,000	104,304	2014/5/26
第848回 政府保証公営企業債券	1.3	123,000	127,966	2015/2/24
第849回 政府保証公営企業債券	1.5	100,000	104,935	2015/3/20
第857回 政府保証公営企業債券	1.6	100,000	105,936	2015/11/27
第877回 政府保証公営企業債券	1.9	130,000	141,284	2017/7/18
第879回 政府保証公営企業債券	1.7	100,000	107,417	2017/9/19
第154回 政府保証中小企業債券	1.4	100,000	100,668	2011/5/25
第157回 政府保証中小企業債券	1.2	100,000	100,714	2011/7/19
第167回 政府保証中小企業債券	1.4	100,000	101,965	2012/6/18
第171回 政府保証中小企業債券	1.0	104,000	105,772	2012/12/17
第51回 政府保証関西国際空港債券	2.1	200,000	218,490	2022/8/31
第16回 政府保証日本政策投資銀行債券	1.8	107,000	115,393	2017/2/28

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
特殊債券(除く金融債)				
第19回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	102,000	109,770	2016/9/29
第21回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	311,000	335,058	2016/11/30
第23回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	113,000	121,104	2016/12/28
第27回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	105,000	113,270	2017/2/28
第56回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	200,000	210,718	2018/4/20
第78回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	104,720	2019/4/30
第87回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	105,285	2019/8/30
第870回 政府保証公営企業債券	1.7	159,000	170,419	2016/12/21
第143回 政府保証預金保険機構債券	0.9	100,000	101,282	2012/8/15
小計	—	11,571,000	12,126,255	—
金融債券				
い第671号農林債券	1.55	500,000	503,195	2011/4/27
い第672号農林債	1.6	400,000	403,108	2011/5/27
い第674号農林債	1.8	100,000	101,159	2011/7/27
い第678号農林債	1.45	200,000	202,650	2011/11/25
い第694号農林債	1.15	200,000	204,008	2013/3/27
第194回 しんきん中金債券	0.9	100,000	100,158	2011/1/27
第195回 しんきん中金債券	1.05	150,000	150,397	2011/2/25
第196回 しんきん中金債券	1.15	300,000	301,113	2011/3/25
第198回 しんきん中金債券	1.6	670,000	675,279	2011/5/27
第199回 しんきん中金債券	1.5	100,000	100,849	2011/6/27
第200回 しんきん中金債券	1.75	100,000	101,138	2011/7/27
第203回 信金中金債(5年)	1.45	200,000	202,496	2011/10/27
第204回 信金中金債(5年)	1.4	160,000	162,070	2011/11/25
第205回 信金中金債(5年)	1.45	100,000	101,430	2011/12/27
い第679号みずほコーポレート銀行債券	1.1	300,000	300,822	2011/2/25
い第680号みずほコーポレート銀行債券	1.2	100,000	100,382	2011/3/25
小計	—	3,680,000	3,710,255	—
普通社債券(含む投資法人債券)				
第501回 東京電力株式会社社債	0.92	200,000	202,976	2013/2/14
第505回 東京電力株式会社社債	0.775	100,000	101,246	2013/4/25
第506回 東京電力株式会社社債	0.675	134,000	135,382	2013/5/30
第514回 東京電力株式会社社債	1.565	160,000	167,396	2014/10/29
第517回 東京電力株式会社社債	1.355	200,000	208,288	2015/6/15
第521回 東京電力株式会社社債	1.97	100,000	108,012	2016/6/27
第531回 東京電力株式会社社債	1.845	200,000	215,858	2017/9/25
第536回 東京電力株式会社社債	1.672	200,000	213,644	2018/1/29
第539回 東京電力株式会社社債	1.591	100,000	106,287	2018/3/28
第540回 東京電力株式会社社債	1.64	200,000	213,242	2018/4/25
第542回 東京電力株式会社社債	1.602	200,000	212,628	2018/4/25
第462回 中部電力株式会社社債	0.9	100,000	101,507	2013/3/25
第463回 中部電力株式会社社債	0.82	100,000	101,356	2013/4/25
第472回 関西電力株式会社社債	1.79	100,000	107,523	2018/11/22
第322回 中国電力株式会社社債	2.95	100,000	115,981	2029/11/22
第248回 北陸電力株式会社社債	3.95	100,000	118,652	2016/5/25

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第411回 東北電力株式会社社債	1.23	100,000	101,917	2012/10/25
第424回 東北電力株式会社社債	0.93	170,000	171,808	2012/5/25
第427回 東北電力株式会社社債	1.43	200,000	209,298	2015/9/25
第445回 東北電力株式会社社債	1.792	300,000	322,617	2018/11/22
第393回 九州電力株式会社社債	2.01	100,000	108,919	2017/6/23
第404回 九州電力株式会社社債	1.884	200,000	214,658	2020/10/23
第7回 日本政策投資銀行債券	0.78	100,000	101,168	2013/3/19
第9回 日本政策投資銀行債券	1.58	100,000	103,629	2013/9/20
第16回 日本政策投資銀行債券	1.52	200,000	208,588	2014/9/19
第19回 日本政策投資銀行債券	1.4	200,000	208,252	2015/3/20
第39回 日本政策投資銀行債券	1.75	200,000	214,016	2017/9/20
第46回 日本政策投資銀行債券	1.69	100,000	106,700	2018/3/20
第2回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.7	100,000	108,471	2035/9/20
第30回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.37	200,000	213,262	2028/9/20
第47回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	200,000	213,914	2029/4/20
第7回 道路債券	2.7	100,000	114,525	2022/6/20
第21回 道路債券	2.75	100,000	110,133	2033/6/20
第24回 道路債券	1.2	170,000	170,173	2010/12/20
第26回 道路債券	1.68	200,000	208,378	2013/12/20
第33回 道路債券	2.91	100,000	112,784	2034/6/20
第36回 道路債券	1.08	100,000	100,907	2011/12/20
第41回 道路債券	1.52	100,000	104,594	2015/3/20
第4回 阪神高速道路・機構承継債	0.93	300,000	304,485	2013/3/19
第12回 国際協力銀行債券	1.6	100,000	104,233	2014/3/20
第15回 国際協力銀行債券	1.74	100,000	104,940	2014/6/20
第46回 都市再生債券	1.12	200,000	198,580	2020/11/20
第1回 貸付債担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	125,696	131,229	2037/11/10
第41回 貸付債担保住宅金融支援機構債券	1.51	99,774	99,977	2045/10/10
第7回 貸付債担保S種住宅金融公庫債券	2.25	113,588	119,704	2037/5/10
第4回 貸付債担保住宅金融公庫債券	1.82	37,540	38,993	2036/12/10
第15回 貸付債担保住宅金融公庫債券	1.69	155,565	159,102	2039/2/10
第28回 貸付債担保住宅金融公庫債券	1.79	191,817	196,706	2040/3/10
第29回 貸付債担保住宅金融公庫債券	1.81	68,150	70,028	2040/4/10
第37回 貸付債担保住宅金融公庫債券	1.88	508,508	525,059	2040/12/10
第52回 貸付債担保住宅金融公庫債券	2.18	78,285	82,310	2042/3/10
第32回 国民生活債券	1.22	100,000	100,598	2011/6/20
第8回 農林漁業金融公庫債券	1.46	100,000	104,427	2015/3/20
第28回 アサヒビール株式会社無担保社債	1.55	100,000	100,800	2011/6/22
第29回 アサヒビール株式会社無担保社債	1.88	100,000	105,318	2014/6/20
第4回 日本たばこ産業株式会社社債	1.68	100,000	102,353	2012/7/24
第34回 住友化学株式会社無担保社債	2.14	200,000	216,040	2016/4/28
第36回 住友化学株式会社無担保社債	1.95	200,000	214,886	2017/2/27
第31回 三菱化学株式会社無担保社債	2.02	100,000	105,779	2014/9/22
第8回 株式会社オリエンタルランド無担保社債	1.29	100,000	100,368	2011/3/23
第10回 株式会社オリエンタルランド無担保社債	1.31	100,000	103,466	2015/1/30
第14回 住友ゴム工業株式会社無担保社債	0.74	100,000	100,283	2011/7/11
第16回 住友ゴム工業株式会社無担保社債	2.19	100,000	108,641	2017/6/28
第53回 新日本製鐵株式会社無担保社債	1.77	200,000	213,838	2017/9/20
第46回 株式会社神戸製鋼所無担保社債	1.97	200,000	213,914	2017/10/27
第12回 株式会社日立製作所無担保社債	0.72	100,000	100,862	2013/5/27
第14回 株式会社日立製作所無担保社債	1.56	100,000	104,524	2015/8/18

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第39回 日本電気株式会社無担保社債	1.68	100,000	104,859	2015/9/4
第17回 富士通株式会社無担保社債	3.0	100,000	115,064	2018/5/8
第26回 ソニー株式会社無担保社債	2.068	200,000	216,930	2019/6/20
第22回 三菱重工株式会社無担保社債	2.03	200,000	216,504	2017/9/12
第46回 日産自動車株式会社無担保社債	1.76	200,000	204,288	2012/6/20
第64回 三井物産株式会社無担保社債	2.36	200,000	211,704	2027/5/21
第20回 住友商事株式会社無担保社債	0.815	100,000	100,179	2011/3/18
第22回 住友商事株式会社無担保社債	1.51	100,000	103,447	2014/1/29
第36回 住友商事株式会社無担保社債	2.21	200,000	218,746	2019/7/25
第66回 三菱商事株式会社無担保社債	2.08	200,000	217,744	2017/7/28
第1回 株式会社クレディセゾン無担保社債	1.2	200,000	201,838	2013/6/14
第12回 株式会社三菱UFJ フィナンシャル・グループ	1.21	100,000	100,373	2011/3/16
第4回 株式会社みずほ コーポレート銀行無担保社債	1.4	300,000	304,320	2012/1/27
第5回 株式会社みずほ コーポレート銀行無担保社債	1.36	200,000	203,238	2012/4/27
第6回 株式会社みずほ コーポレート銀行無担保社債	1.605	100,000	102,300	2012/7/27
第11回 株式会社みずほ コーポレート銀行無担保社債	1.11	200,000	203,528	2013/1/25
第12回 株式会社みずほ コーポレート銀行無担保社債	1.295	200,000	204,770	2013/4/26
第2回 株式会社みずほ コーポレート銀行無担保社債	1.72	100,000	101,110	2011/7/27
第57回 株式会社東京三菱銀行無担保社債	2.22	100,000	108,897	2022/10/27
第100回 株式会社三菱東京 UFJ銀行無担保社債	1.37	200,000	205,782	2013/7/16
第3回 2号三菱東京UFJ 銀行無担保劣後特約付社債	1.3	100,000	102,345	2013/6/26
第7回 株式会社東京三菱銀行 無担保社債(劣後特約付)	2.11	100,000	107,559	2019/12/20
第6回 住友信託銀行株式会 社無担保社債(劣後特約付)	2.78	200,000	215,074	2026/4/27
第1回 住友信託銀行株式会 社無担保社債(劣後特約付)	1.37	100,000	102,256	2013/5/22
第1回 みずほ信託銀行株式会 社無担保社債	1.91	100,000	105,628	2015/12/21
第44回 株式会社三井住友銀行無担保社債	1.36	100,000	102,860	2013/7/19
第1回 株式会社みずほ銀行 無担保社債(劣後特約付)	1.7	100,000	104,464	2015/2/3
第6回 株式会社みずほ銀行 無担保社債(劣後特約付)	2.25	200,000	216,510	2016/11/4
第7回 株式会社みずほ銀行 無担保社債(劣後特約付)	2.87	100,000	108,288	2026/11/6
第6回 イオンクレジット サービス株式会社無担保社債	1.08	200,000	199,202	2012/5/9
第9回 イオンクレジット サービス株式会社無担保社債	1.78	100,000	100,620	2012/7/10
第3回 野村ホールディ ング株式会社無担保社債	1.11	400,000	401,328	2011/3/29
第65回 三菱地所株式会社無担保社債	2.04	100,000	97,660	2032/12/20
第52回 住友不動産株式会社無担保社債	1.29	100,000	100,907	2012/2/7
第57回 住友不動産株式会社無担保社債	1.86	300,000	302,403	2011/6/8
第7回 東日本旅客鉄道株式会社社債	3.3	200,000	234,932	2017/8/25

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第18回 東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.71	100,000	101,897	2012/2/24
第21回 東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.02	100,000	107,574	2022/9/20
第31回 東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.58	100,000	104,198	2014/3/19
第37回 東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.49	100,000	104,426	2014/12/19
第6回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.39	100,000	111,809	2022/2/15
第9回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.74	100,000	104,530	2022/9/20
第19回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.28	200,000	203,834	2012/9/20
第20回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.77	100,000	107,421	2017/9/20
第23回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.14	100,000	110,243	2018/4/25
第28回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.88	200,000	215,662	2016/12/20
第41回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.166	100,000	104,085	2029/1/29
第38回 西日本鉄道株式会社無担保社債	2.0	100,000	107,700	2017/4/17
第47回 日本電信電話株式会社電信電話債券	0.87	100,000	101,405	2013/3/21
第49回 日本電信電話株式会社電信電話債券	1.45	100,000	104,726	2015/9/18
第50回 日本電信電話株式会社電信電話債券	1.58	100,000	105,344	2015/9/18
第52回 日本電信電話株式会社電信電話債券	1.77	100,000	107,254	2017/3/17
第7回 株式会社エヌ・ティ・ ティ・ドコモ無担保社債	1.49	100,000	100,465	2011/3/21
第8回 株式会社エヌ・ティ・ ティ・ドコモ無担保社債	1.43	100,000	100,444	2011/3/21
第15回 株式会社エヌ・ティ・ ティ・ドコモ無担保社債	1.96	200,000	217,204	2018/6/20
第482回 東京電力株式会社社債	1.45	200,000	201,352	2011/5/25
第487回 東京電力株式会社社債	1.445	300,000	303,516	2011/10/26
第493回 東京電力株式会社社債	1.49	100,000	101,822	2012/4/26
第496回 東京電力株式会社社債	1.49	200,000	203,980	2012/6/14
第409回 中部電力株式会社社債	3.9	200,000	237,230	2016/6/24
第410回 中部電力株式会社社債	3.25	100,000	116,315	2017/2/24
第455回 中部電力株式会社社債	1.45	100,000	100,989	2011/8/25
第429回 関西電力株式会社社債	1.63	100,000	101,794	2012/2/24
第416回 東北電力株式会社社債	0.83	100,000	100,573	2018/6/25
第253回 四国電力株式会社社債	1.0	100,000	95,171	2023/6/23
第265回 北海道電力株式会社社債	2.0	200,000	218,220	2018/12/25
第285回 北海道電力株式会社社債	1.69	200,000	212,882	2016/6/24
第3回 電源開発株式会社無担保社債	2.01	100,000	105,498	2023/12/20
第7回 電源開発株式会社無担保社債	1.45	100,000	104,191	2014/12/19
第23回 東京瓦斯株式会社無担保社債	1.01	100,000	95,390	2023/6/9
第24回 東京瓦斯株式会社無担保社債	1.41	100,000	103,367	2013/12/2
第7回 大阪瓦斯株式会社無担保社債	3.4	100,000	117,329	2017/3/20
第24回 大阪瓦斯株式会社無担保社債	1.59	100,000	104,665	2014/10/24
第17回 東邦瓦斯株式会社無担保社債	3.175	200,000	234,524	2018/2/19
第5回 広島ガス株式会社無担保社債	1.53	200,000	208,078	2015/8/14
小計	—	20,612,923	21,624,903	—
合計	—	199,077,763	208,234,864	—

(注1) 額面・評価額の単位未満は切り捨てています。

(注2) 株式、新株予約権証券及び株式の性質を有するオプション証券等の組入れはありません。

■投資信託財産の構成

(2010年11月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	208,234,864 千円	99.1 %
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,822,712	0.9
投 資 信 託 財 産 総 額	210,057,576	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2010年11月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	210,057,576,370円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	257,098,494
公 社 債(評価額)	208,234,864,624
未 収 入 金	812,764,000
未 収 利 息	726,402,128
前 払 費 用	26,447,124
(B) 負 債	513,737,438
未 払 金	299,980,000
未 払 解 約 金	213,757,438
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	209,543,838,932
元 本	189,004,990,927
次 期 繰 越 損 益 金	20,538,848,005
(D) 受 益 権 総 口 数	189,004,990,927口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	11.087円

(注1) 当親ファンドの期首元本額は210,255,799,686円、期中追加設定元本額は35,315,733,749円、期中一部解約元本額は56,566,542,508円です。

<元本の内訳>

L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド (慎 重 型)	4,648,902円
L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド (安 定 重 視 型)	2,823,608円
L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド (バ ラ ン ス 型)	882,654円
L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド (成 長 重 視 型)	1,119,106円
L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド (積 極 型)	209,538円
東 京 海 上 セ レ ク シ ョ ン ・ 日 本 債 券 イ ン デ ッ ク ス	33,262,487円
TMA 日 本 債 券 イ ン デ ッ ク ス V A < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	98,073,646,845円
TMA 世 界 バ ラ ン ス フ ァ ン ド 5 5 V A < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	11,918,104,043円
TMA 世 界 バ ラ ン ス フ ァ ン ド 3 5 V A < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	78,970,293,744円

(注2) 当期末の1口当たり純資産額は11.087円です。

■損益の状況

当期(自2009年11月11日 至2010年11月10日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,177,080,338円
受 取 利 息	3,177,080,338
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	5,284,009,454
売 買 益	5,639,399,642
売 買 損	△ 355,390,188
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	8,461,089,792
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	14,103,767,372
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,316,052,801
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 5,342,061,960
(G) 計 (C+D+E+F)	20,538,848,005
次 期 繰 越 損 益 金(G)	20,538,848,005

(注1) 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2) 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3) 損益の状況の中で(F)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。

TMA外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第5期(決算日 2010年11月10日)

(計算期間 2009年11月11日~2010年11月10日)

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド(親投資信託)の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント投信

■設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 騰 落 中 率	ベンチマーク	期 騰 落 中 率	株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 比 率	純 資 産
(設 定 日) 2005年9月26日	円 10,000	% -	449,197	% -	% -	% -	% -	百万円 5,000
1期(2006年11月10日)	12,655	26.6	575,858	28.2	97.3	1.9	1.2	58,630
2期(2007年11月12日)	13,627	7.7	625,165	8.6	94.0	4.8	1.3	126,968
3期(2008年11月10日)	7,374	△45.9	335,620	△46.3	94.2	4.6	1.3	179,552
4期(2009年11月10日)	8,588	16.5	393,382	17.2	97.5	1.1	1.4	226,319
5期(2010年11月10日)	8,639	0.6	399,124	1.5	96.9	1.3	1.6	218,183

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

(注3) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注4) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		ベンチマーク	騰 落 率		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 比 率
		%	%		%	%			
(期 首) 2009年11月10日	円 8,588	% -	% -	393,382	% -	% -	97.5	1.1	1.4
11月末	8,227	△4.2	△4.2	376,734	△4.2	△4.2	97.3	1.0	1.3
12月末	8,929	4.0	4.0	410,074	4.2	4.2	95.7	1.2	1.4
2010年1月末	8,285	△3.5	△3.5	380,511	△3.3	△3.3	96.9	1.5	1.4
2月末	8,272	△3.7	△3.7	379,027	△3.6	△3.6	96.6	1.7	1.5
3月末	9,222	7.4	7.4	423,160	7.6	7.6	96.5	1.5	1.5
4月末	9,431	9.8	9.8	432,655	10.0	10.0	97.0	1.5	1.6
5月末	8,172	△4.8	△4.8	375,803	△4.5	△4.5	94.8	3.5	1.6
6月末	7,675	△10.6	△10.6	353,038	△10.3	△10.3	95.9	2.3	1.6
7月末	8,146	△5.1	△5.1	374,748	△4.7	△4.7	96.5	1.5	1.7
8月末	7,614	△11.3	△11.3	350,760	△10.8	△10.8	95.1	3.2	1.7
9月末	8,328	△3.0	△3.0	382,808	△2.7	△2.7	96.3	1.7	1.7
10月末	8,321	△3.1	△3.1	382,766	△2.7	△2.7	97.1	1.0	1.7
(期 末) 2010年11月10日	円 8,639	0.6	0.6	399,124	1.5	1.5	96.9	1.3	1.6

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

ベンチマークは、MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)です。基準価額は対顧客電信売相場の仲値(TTM)を用いて計算しているため、基準日前日のMSCIコクサイ指数(米ドルベース)を基準日のTTMで委託会社が円換算したものを使用しています。MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)およびMSCIコクサイ指数(米ドルベース)とは、MSCI社が発表している日本を除く主要先進国の株式市場の動きを捉える代表的な株価指標です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社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。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用などすることは禁じられています。MSCI社は当ファンドとは関係なく、当ファンドから生じるいかなる責任も負いません。

■当期中の運用経過と今後の方針（2009年11月11日から2010年11月10日まで）

1. 基準価額の推移と主な変動要因

当ファンドは、外国株式への投資割合がほぼ100%であるため、基準価額の変動は海外の株式市場の影響を強く受けます。

当ファンドの基準価額は、当期末（2010年11月10日）8,639円となり0.6%と小幅な上昇となりました。なお、当ファンドがベンチマークとしているMSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）は、同期間において1.5%の上昇となりました。

2. 当期の投資環境

2009年11月から2010年4月においては、景気回復を示す経済指標の発表が相次ぎ、米欧の株式市場は上昇しました。ギリシャの財政破綻懸念から、一時弱含む局面もありましたが、IMF（国際通貨基金）とユーロ圏による支援要請国への緊急融資の枠組みが合意に至ったことで、米欧の株式市場には買い安心感が広がりました。

2010年5月から6月においては、米欧の株式市場は大幅に下落しました。スペイン貯蓄銀行の経営破綻を受けて、スペインやポルトガルにも財政破綻懸念が波及し、市場参加者のリスク回避姿勢が強まりました。また、メキシコ湾原油流出事故で、英国石油メジャーが巨額の賠償負担となることが嫌気され、株式市場は軟調な展開となりました。

2010年7月以降においては、米国の景気回復に膠着感が台頭し、米欧の株式市場は一進一退となりました。その後、9月のFOMC（米連邦公開市場委員会）で追加金融緩和について前向きな発言があったことを好感し、株式市場は上昇基調となりました。

3. 当期の運用経過と基準価額

当ファンドは、ベンチマークに連動した投資成果を目標として運用を行っています。個別の銘柄選択は、最適化手法を用いてファンドとベンチマークのリスク特性がほぼ一致するように調整しています。

当期におきましては、期中の設定・解約に応じた外国株式先物と現物株式の売買を行いました。その結果、前期末の保有銘柄数は1,010銘柄でしたが、期末における保有銘柄数は1,038銘柄となりました。

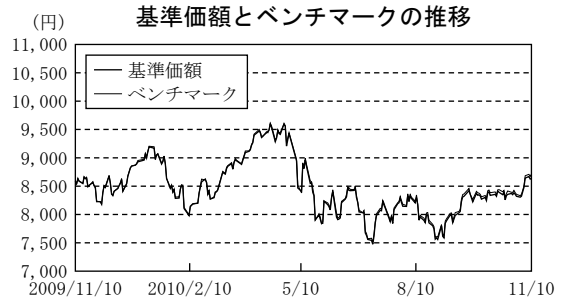
2010年11月10日現在では、基準価額はベンチマークの上昇（前期末比+1.5%）に連動させたことにより8,639円（同+0.6%、対ベンチマーク比、▲0.9%）となっております。

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー（※）は、過去1年で0.2%となりました。

※具体的には、毎月の対ベンチマーク超過収益率（ファンドの収益率とベンチマークの収益率との差）の標準偏差（ばらつき度合い）を年率換算したものです。ベンチマークとの連動性が高いほどこの値は低くなります。

4. 今後の運用方針

当ファンドの基本方針に基づき、先物も使用しながら実質的な株式の組入れ比率をほぼ100%に維持し、ベンチマークとの連動性を高位に保つことを目指して運用してまいります。



(注) 基準価額は、期首（2009年11月10日）の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	1円 (1) (0) (0) (0)
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券)	1 (1) (0) (0)
(c) 保 管 費 用 等	2
合 計	4

(注1) (a)売買委託手数料、(b)有価証券取引税、(c)保管費用等は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■ 期中の売買及び取引の状況（2009年11月11日から2010年11月10日まで）

(1) 株 式

		買		売		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外	ア メ リ カ	百株	千米ドル	百株	千米ドル	
		91,849 (7,087)	255,113 (12,387)	86,920 (4,458)	309,932 (13,329)	
	カ ナ ダ		千カナダドル		千カナダドル	
		7,815 (1,816)	27,075 (3,349)	6,824 (-)	26,982 (2,822)	
	ユ	ド イ ツ		千ユーロ		千ユーロ
			5,085 (1,225)	14,489 (429)	5,429 (-)	15,352 (429)
		イ タ リ ア	12,824 (12,716)	4,231 (238)	44,152 (-)	8,376 (247)
		フ ラ ン ス	5,555 (2,930)	15,292 (446)	8,898 (0.01)	17,501 (446)
		オ ラ ン ダ	5,541 (2,731)	6,517 (568)	5,955 (-)	5,524 (568)
		ス ペ イ ン	6,147 (24,029)	5,556 (417)	25,904 (-)	7,328 (419)
		ベ ル ギ ー	646 (184)	1,665 (-)	800	2,895
		オ ー ス ト リ ア	249	486	190	483
		ル ク セ ン ブ ル ク	1,262	2,175	399	1,073
		フ ィ ン ラ ン ド	1,945	1,959	2,262 (-)	3,052 (48)
ロ	ア イ ル ラ ン ド	236	406	257	453	
	ギ リ シ ャ	380 (2,051)	496 (322)	4,216 (-)	1,353 (375)	
	ポ ル ト ガ ル	3,135	749	1,551	416	
	イ ギ リ ス	97,750 (39,411)	千英ポンド 33,840 (1,942)	107,666 (5,790)	千英ポンド 38,147 (3,677)	
国	ス イ ス	4,385	千スイスフラン 20,016	4,553 (-)	千スイスフラン 24,196 (154)	
	ス ウ ェ ー デ ン	4,901 (1,381)	千スウェーデンクローネ 50,193 (805)	7,158 (-)	千スウェーデンクローネ 60,235 (805)	
	ノ ル ウ ェ ー	1,757 (600)	千ノルウェークローネ 15,302 (474)	2,140 (-)	千ノルウェークローネ 13,561 (474)	

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	デンマーク	百株 361	千デンマーククローネ 12,734	百株 535	千デンマーククローネ 17,517
	オーストラリア	16,896 (1,428)	千豪ドル 16,165 (163)	16,907 (-)	千豪ドル 20,797 (163)
	ニュージーランド	- (49)	千ニュージーランドドル -	818	千ニュージーランドドル 205
	香港	7,102 (547)	千香港ドル 22,680 (169)	9,075 (-)	千香港ドル 37,886 (48)
	シンガポール	32,970	千シンガポールドル 7,551	8,990 (-)	千シンガポールドル 5,253 (32)
	イスラエル	7,107	千イスラエルシケル 12,165	-	千イスラエルシケル -

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。ただし、株数が単位未満のみの場合は小数で記載しています。

(注3) () 内は株式分割、移転、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。

(2) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	ユーロ イタリヤ	証券 -	千ユーロ -	証券 81,174	千ユーロ 8
	香港	- (31,200)	千香港ドル -	31,200	千香港ドル 49

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

(注3) () 内は割当、権利行使および権利行使期間満了による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(3) 投資信託証券

		買 付		売 付		
		口 数	金 額	口 数	金 額	
外 国	アメリカ	AMB PROPERTY CORP	千口 33	千米ドル 843	千口 -	千米ドル -
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	78	1,350	7	142
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.554	49	2	241
		BOSTON PROPERTIES INC	9	672	1	131
		DUKE REALTY CORP	4	50	4	62
		EQUITY RESIDENTIAL	4	214	11	499
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	-	-	0.941	71
		HCP INC	1	56	3	130
		HEALTH CARE REIT INC	9	417	3	194
		KIMCO REALTY CORP	-	-	7	133
		PLUM CREEK TIMBER CO INC (REIT)	1	66	3	118
		PUBLIC STORAGE	4	376	3	353
		REGENCY CENTERS CORP	10	369	0.642	27
SIMON PROPERTY GROUP INC	13 (0.192)	1,026 (14)	5	457		

			買 付		売 付		
			口 数	金 額	口 数	金 額	
外 国	アメリカ	VENTAS INC	千口 —	千米ドル —	千口 1	千米ドル 71	
		VORNADO REALTY TRUST	4 (0.094)	323 (6)	6	525	
	小 計		176 (0.286)	5,816 (21)	65	3,162	
	カナダ	CANADIAN OIL SANDS TRUST	2	84	13	366	
		PENN WEST ENERGY TRUST	7	150	8	186	
		PROVIDENT ENERGY TRUST	—	—	(6)	(75)	
		小 計	10	234	28 (—)	609 (75)	
	ユーロ	フランス	UNIBAIL-RODAMCO SE	3	441	(4)	(312)
			KLEPIERRE	1	42	1	56
		小 計		4	484	6 (—)	673 (312)
		オランダ	CORIO NV	1	46	0.777	39
		小 計		1	46	0.777	39
	ユーロ 計		6	531	6 (—)	713 (312)	
	イギリス	BRITISH LAND CO PLC	16	73	50	240	
		HAMMERSON PLC	—	—	5	25	
		SEGRO PLC	55	172	—	—	
		小 計	71	245	55	265	
	オーストラリア	MIRVAC GROUP	131	162	—	—	
CFS RETAIL PROPERTY TRUST		—	—	52	101		
GPT GROUP		219	662	—	—		
STOCKLAND		47	173	35	135		
WESTFIELD GROUP		37	461	49	608		
GOODMAN GROUP		864	575	—	—		
小 計		1,300	2,035	137	845		
香港	LINK REIT	48	926	142	3,094		
	小 計	48	926	142	3,094		
シンガポール	CAPITAMALL TRUST	124	230	—	—		
	K-GREEN TRUST	(31)	(32)	31	34		
	小 計	124 (31)	230 (32)	31	34		

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。ただし、口数が単位未満のみの場合は小数で記載しています。

(注3) () 内は分割・償還による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(4) 先物取引の種類別取引状況

種 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 54,260	百万円 54,143	百万円 —	百万円 —

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 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	89,014,467千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	207,921,208千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.42

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

■ 利害関係人との取引状況等 (2009年11月11日から2010年11月10日まで)

期中における利害関係人との取引はありません。

(注) 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 (2010年11月10日現在)

(1) 外国株式

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	
AFLAC INC	657	634	3,586	293,275	保険
AGCO CORP	153	182	824	67,397	資本財
AES CORPORATION	737	588	687	56,235	公益事業
AT&T INC	7,671	7,242	21,132	1,728,242	電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	1,955	1,870	9,359	765,436	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	202	168	784	64,119	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	910	664	782	63,972	ソフトウェア・サービス
ADOBE SYSTEMS INC	775	656	1,934	158,238	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	185	140	927	75,829	小売
AETNA INC	659	521	1,640	134,177	ヘルスケア機器・サービス
AFFILIATED COMPUTER SVCS-A	152	—	—	—	ソフトウェア・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	581	477	1,695	138,682	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	257	257	2,201	180,007	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES	349	257	1,326	108,505	ソフトウェア・サービス
ALCOA INC	1,215	1,352	1,859	152,106	素材
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	195	171	887	72,602	素材
ALLERGAN INC	459	408	2,816	230,335	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLSTATE CORP	742	683	2,069	169,254	保険
ALTERA CORPORATION	206	403	1,352	110,628	半導体・半導体製造装置
ALTRIA GROUP INC	2,497	2,573	6,582	538,293	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	426	442	7,540	616,696	小売
AMEREN CORPORATION	328	363	1,074	87,895	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	587	616	2,275	186,070	公益事業
AMERICAN EXPRESS COMPANY	1,396	1,409	6,112	499,855	各種金融
AMERICAN TOWER CORP-CL A	607	553	2,886	236,042	電気通信サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	379	369	1,138	93,070	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	213	369	1,976	161,617	各種金融
AMGEN INC	1,369	1,171	6,433	526,114	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	295	255	1,332	108,961	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	663	629	3,987	326,108	エネルギー
ANALOG DEVICES	455	367	1,288	105,333	半導体・半導体製造装置

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	
			千株	千株			
AON CORP	359	319	1,323	108,270	108,270	108,270	保険
APACHE CORP	430	445	4,897	400,509	400,509	400,509	エネルギー
APOLLO GROUP INC CL A	188	174	643	52,639	52,639	52,639	消費者サービス
APPLE INC	1,161	1,123	35,525	2,905,300	2,905,300	2,905,300	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	1,963	1,505	1,929	157,829	157,829	157,829	半導体・半導体製造装置
AQUA AMERICA INC	336	—	—	—	—	—	公益事業
ARCH COAL INC	293	316	902	73,844	73,844	73,844	エネルギー
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	735	802	2,475	202,468	202,468	202,468	食品・飲料・タバコ
AUTODESK INC	373	332	1,174	96,044	96,044	96,044	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	588	585	2,654	217,124	217,124	217,124	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	134	210	553	45,248	45,248	45,248	小売
AUTOZONE INC	64	41	1,016	83,126	83,126	83,126	小売
AVERY DENNISON CORP	173	196	729	59,619	59,619	59,619	商業・専門サービス
AVON PRODUCTS INC	636	541	1,561	127,737	127,737	127,737	家庭用品・パーソナル用品
BB&T CORPORATION	907	898	2,231	182,529	182,529	182,529	銀行
BJ SERVICES CO	509	—	—	—	—	—	エネルギー
BMC SOFTWARE INC	160	223	1,027	83,990	83,990	83,990	ソフトウェア・サービス
BAKER HUGHES INC	355	534	2,648	216,601	216,601	216,601	エネルギー
BALL CORP	174	138	907	74,192	74,192	74,192	素材
BANK OF AMERICA CORP	11,328	12,467	15,297	1,251,007	1,251,007	1,251,007	各種金融
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	1,645	1,558	4,326	353,780	353,780	353,780	各種金融
BARD (C. R.) INC	96	98	848	69,367	69,367	69,367	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTL INC	721	701	3,623	296,364	296,364	296,364	ヘルスケア機器・サービス
BECKMAN COULTER INC	133	133	732	59,927	59,927	59,927	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	259	257	2,000	163,569	163,569	163,569	ヘルスケア機器・サービス
BED BATH & BEYOND INC	402	312	1,382	113,082	113,082	113,082	小売
WR BERKLEY CORP	262	294	814	66,646	66,646	66,646	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	13	—	—	—	—	—	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	—	1,028	8,313	679,903	679,903	679,903	保険
BEST BUY COMPANY INC	377	434	1,919	157,009	157,009	157,009	小売
BIOGEN IDEC INC	329	347	2,202	180,088	180,088	180,088	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACK & DECKER CORP	152	—	—	—	—	—	耐久消費財・アパレル
H&R BLOCK INC	531	568	696	56,969	56,969	56,969	消費者サービス
BOEING CO	920	854	5,916	483,875	483,875	483,875	資本財
BORGWARNER INC	231	181	1,049	85,838	85,838	85,838	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	2,096	1,892	1,266	103,545	103,545	103,545	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,587	2,129	5,589	457,078	457,078	457,078	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM CORP CL A	641	539	2,267	185,453	185,453	185,453	半導体・半導体製造装置
BURLINGTON NORTHERN SANTA FE	422	—	—	—	—	—	運輸
CBS CORP CL-B	990	929	1,520	124,316	124,316	124,316	メディア
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	96	95	1,200	98,154	98,154	98,154	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	233	198	1,416	115,838	115,838	115,838	運輸
CIGNA CORP	380	366	1,341	109,725	109,725	109,725	ヘルスケア機器・サービス
CME GROUP INC	68	83	2,449	200,352	200,352	200,352	各種金融
CSX CORP	518	490	2,999	245,276	245,276	245,276	運輸
CVS CAREMARK CORP	1,837	1,631	5,062	414,047	414,047	414,047	食品・生活必需品小売り
CA INC	580	489	1,154	94,434	94,434	94,434	ソフトウェア・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	208	208	704	57,631	57,631	57,631	エネルギー
CAMERON INTERNATIONAL CORP	306	301	1,369	112,018	112,018	112,018	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	282	267	963	78,798	78,798	78,798	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	637	595	2,306	188,611	188,611	188,611	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	488	432	1,539	125,888	125,888	125,888	ヘルスケア機器・サービス
CAREFUSION CORP	262	347	806	65,934	65,934	65,934	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	448	310	1,005	82,259	82,259	82,259	小売
CARNIVAL CORP	466	609	2,642	216,141	216,141	216,141	消費者サービス
CATERPILLAR INC	739	802	6,575	537,776	537,776	537,776	資本財
CELANESE CORP-SERIES A	302	280	1,036	84,750	84,750	84,750	素材
CELGENE CORP	661	593	3,601	294,522	294,522	294,522	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTERPOINT ENERGY INC	672	685	1,137	93,008	93,008	93,008	公益事業
CENTURYLINK INC.	339	349	1,478	120,900	120,900	120,900	電気通信サービス
CEPHALON INC	133	138	901	73,706	73,706	73,706	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

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	
			千 米 ド ル	千 円			
CERNER CORP	122	95	836	68,443			ヘルスケア機器・サービス
CHESAPEAKE ENERGY CORP	743	827	1,908	156,095			エネルギー
CHEVRONTXACO CORP	2,566	2,456	20,529	1,678,924			エネルギー
CHUBB CORP	402	421	2,472	202,191			保険
CIMAREX ENERGY CO	193	133	1,091	89,301			エネルギー
CINCINNATI FINANCIAL CORP	263	304	914	74,769			保険
CISCO SYSTEMS INC	7,574	7,095	17,276	1,412,911			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	267	283	781	63,945			商業・専門サービス
CITIGROUP INC	18,971	30,609	13,161	1,076,381			各種金融
CITRIX SYSTEMS INC	286	247	1,599	130,841			ソフトウェア・サービス
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	263	183	1,263	103,330			素材
CLOROX COMPANY	153	165	1,041	85,179			家庭用品・パーソナル用品
COACH INC	327	389	2,033	166,318			耐久消費財・アパレル
COCA-COLA COMPANY	2,664	2,533	15,871	1,297,984			食品・飲料・タバコ
COCA-COLA ENTERPRISES	542	—	—	—			食品・飲料・タバコ
COCA-COLA ENTERPRISES	—	472	1,173	95,935			食品・飲料・タバコ
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	381	403	2,559	209,295			ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	598	583	4,490	367,272			家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP-CL A	2,776	2,487	5,166	422,519			メディア
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	911	1,099	2,152	176,057			メディア
COMERICA INC	324	301	1,143	93,506			銀行
COMPUTER SCIENCES CORP	222	195	955	78,168			ソフトウェア・サービス
CONAGRA FOODS INC	595	519	1,148	93,911			食品・飲料・タバコ
CONOCOPHILLIPS	1,829	1,732	10,743	878,611			エネルギー
CONSOL ENERGY INC	279	307	1,272	104,100			エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	285	346	1,753	143,383			公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	475	402	800	65,454			食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION ENERGY GROUP	339	284	852	69,695			公益事業
SEAGATE TECHNOLOGY	863	—	—	—			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORNING INC	2,234	1,983	3,762	307,698			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTCO WHOLESALE CORP	514	529	3,397	277,857			食品・生活必需品小売り
COVENTRY HEALTH CARE INC	336	290	746	61,076			ヘルスケア機器・サービス
CREE INC	—	167	912	74,591			半導体・半導体製造装置
CROWN CASTLE INTL CORP	415	425	1,774	145,124			電気通信サービス
CUMMINS INC	208	255	2,379	194,582			資本財
DR HORTON INC	634	554	651	53,309			耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	263	274	1,272	104,039			公益事業
DANAHER CORP	254	637	2,766	226,254			資本財
DARDEN RESTAURANTS INC	229	210	997	81,592			消費者サービス
DAVITA INC	170	139	1,002	82,023			ヘルスケア機器・サービス
DEAN FOODS CO	369	424	360	29,499			食品・飲料・タバコ
DEERE & CO	572	548	4,270	349,270			資本財
DELL INC	2,430	2,184	3,148	257,470			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DENBURY RESOURCES INC	497	559	1,038	84,950			エネルギー
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	282	247	784	64,118			ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	527	512	3,631	296,991			エネルギー
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	105	123	903	73,896			エネルギー
DIRECTV GROUP INC/THE	789	—	—	—			メディア
THE WALT DISNEY CO	2,260	2,350	8,664	708,570			メディア
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	838	830	1,533	125,414			各種金融
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	301	196	796	65,107			メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	318	255	902	73,805			メディア
DISH NETWORK CORPORATION	401	418	833	68,166			メディア
DIRECTV - CLASS A	—	1,167	4,963	405,938			メディア
MCDERMOTT INTL INC	429	—	—	—			資本財
EVEREST RE GROUP LTD	77	108	950	77,708			保険
DOMINION RESOURCES INC/VA	686	765	3,297	269,632			公益事業
RR DONNELLEY & SONS CO	397	431	756	61,863			商業・専門サービス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	910	717	1,466	119,951			半導体・半導体製造装置
DOVER CORP	148	254	1,381	113,007			資本財
DOW CHEMICAL	1,300	1,461	4,650	380,314			素材

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	
			千 米 ド ル	千 円			
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	435	350	1,265	103,515	食品・飲料・タバコ		
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	1,184	1,148	5,465	446,982	素材		
DUKE ENERGY CORP	1,532	1,597	2,884	235,869	公益事業		
DUN & BRADSTREET CORP	98	96	731	59,782	商業・専門サービス		
EMC CORP/MASS	2,412	2,605	5,736	469,164	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
ENSCO INTERNATIONAL INC	208	—	—	—	エネルギー		
EOG RESOURCES INC	338	323	2,973	243,179	エネルギー		
EQT CORPORATION	216	252	1,022	83,637	エネルギー		
GARMIN LTD	250	—	—	—	耐久消費財・アパレル		
WILLIS GROUP HOLDINGS LTD	328	—	—	—	保険		
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	154	129	1,023	83,668	素材		
EATON CORP	154	195	1,819	148,791	資本財		
EBAY INC	1,276	1,460	4,458	364,601	ソフトウェア・サービス		
ECOLAB INC	328	264	1,292	105,701	素材		
BUNGE LIMITED	180	193	1,189	97,271	食品・飲料・タバコ		
EDISON INTERNATIONAL	335	401	1,506	123,210	公益事業		
EL PASO CORPORATION	663	1,122	1,539	125,917	エネルギー		
ELECTRONIC ARTS INC	478	491	803	65,725	ソフトウェア・サービス		
EMERSON ELECTRIC CO	926	926	5,203	425,551	資本財		
ENERGIZER HOLDINGS INC	107	123	857	70,099	家庭用品・パーソナル用品		
ENERGY CORP	261	229	1,694	138,610	公益事業		
EQUIFAX INC	260	249	856	70,083	商業・専門サービス		
NABORS INDUSTRIES LTD	282	454	980	80,217	エネルギー		
EXELON CORP	829	809	3,362	274,973	公益事業		
EXPEDIA INC	391	299	819	67,035	小売		
EXPEDITORS INTL WASH INC	310	281	1,420	116,170	運輸		
EXPRESS SCRIPTS INC	362	659	3,468	283,634	ヘルスケア機器・サービス		
EXXON MOBIL CORPORATION	6,272	6,210	43,865	3,587,323	エネルギー		
FMC TECHNOLOGIES INC	223	166	1,284	105,028	エネルギー		
FPL GROUP INC	548	—	—	—	公益事業		
FAMILY DOLLAR STORES	239	200	963	78,775	小売		
FASTENAL CO	216	184	979	80,124	資本財		
FEDEX CORP	422	365	3,224	263,720	運輸		
F5 NETWORKS INC	—	50	602	49,239	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	567	333	922	75,481	ソフトウェア・サービス		
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL-A	468	468	637	52,166	保険		
FIFTH THIRD BANCORP	1,175	1,087	1,399	114,429	銀行		
FIRST SOLAR INC	66	77	1,075	87,958	半導体・半導体製造装置		
FISERV INC	233	202	1,126	92,122	ソフトウェア・サービス		
FIRSTENERGY CORP	328	370	1,340	109,599	公益事業		
FLUOR CORP	170	229	1,258	102,955	資本財		
FLOWSERVE CORP	104	80	846	69,225	資本財		
FORD MOTOR CO	1,961	3,784	6,082	497,398	自動車・自動車部品		
FOREST LABORATORIES INC	470	380	1,255	102,667	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
FORTUNE BRANDS INC	214	205	1,110	90,834	耐久消費財・アパレル		
FRANKLIN RESOURCES INC	241	222	2,707	221,449	各種金融		
FREEPORT-MCMORAN COPPER & GOLD INC	575	548	5,626	460,148	素材		
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	—	1,421	1,301	106,402	電気通信サービス		
GAMESTOP CORP-CLASS A	317	266	538	44,027	小売		
GAP INC	471	546	1,104	90,297	小売		
GENERAL DYNAMICS CORP	369	368	2,548	208,387	資本財		
GENERAL ELECTRIC CO	13,781	13,182	21,909	1,791,747	資本財		
GENERAL MILS INC	404	784	2,838	232,139	食品・飲料・タバコ		
GENUINE PARTS CO	216	195	929	76,054	小売		
GENZYME CORP	291	346	2,446	200,072	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
GILEAD SCIENCES INC	1,161	1,097	4,228	345,792	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
GOLDMAN SACHS GROUP INC	635	619	10,311	843,297	各種金融		
GOODRICH CORP	192	164	1,408	115,197	資本財		
GOOGLE INC-CL A	316	302	18,882	1,544,174	ソフトウェア・サービス		
WW GRAINGER INC	105	76	963	78,807	資本財		
HALLIBURTON CO	1,202	1,131	3,758	307,387	エネルギー		

銘柄	柄	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
		株	株	外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千米ドル	千円	
HARLEY-DAVIDSON INC		443	361	1,148	93,928	自動車・自動車部品
HARSCO CORP		190	190		37,391	資本財
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP		521	560	1,424	116,484	保険
HASBRO INC		262	199	929	76,001	耐久消費財・アパレル
HJ HEINZ CO		393	383	1,863	152,392	食品・飲料・タバコ
HELMERICH & PAYNE		205	205	903	73,907	エネルギー
HERSHEY CO/THE		279	229	1,105	90,393	食品・飲料・タバコ
HESS CORP		412	370		210,866	エネルギー
HEWLETT-PACKARD CO		3,097	2,873	12,678	1,036,880	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC		530	469	784	64,184	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC		2,265	2,081	6,551	535,744	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC		896	899	4,408	360,544	資本財
HORMEL FOODS CORP		175	165	758	62,034	食品・飲料・タバコ
HOSPIRA INC		262	220	1,308	107,033	ヘルスケア機器・サービス
HUDSON CITY BANCORP INC		372	747		869	銀行
HUMANA INC		168	217	1,284	105,022	ヘルスケア機器・サービス
IMS HEALTH INC		442	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ITT CORP		198	206	985	80,574	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS INC		503	508	2,448	200,267	資本財
INTEL CORP		7,228	6,711	14,200	1,161,332	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC		91	98	1,138	93,136	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP		1,708	1,565	22,877	1,870,932	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES		189	160	847	69,317	素材
INTL GAME TECHNOLOGY		541	556	908	74,335	消費者サービス
INTERNATIONAL PAPER CO		437	532	1,369	112,026	素材
INTUIT INC		462	386	1,875	153,409	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC		60	51	1,420	116,203	ヘルスケア機器・サービス
IRON MOUNTAIN INC		335	327	750	61,391	商業・専門サービス
JPMORGAN CHASE & CO		4,919	4,954	19,768	1,616,700	各種金融
JACOBS ENGINEERING GROUP INC		205	236	1,008	82,467	資本財
JOHNSON & JOHNSON		3,501	3,355	21,580	1,764,817	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC		660	848	3,125	255,603	自動車・自動車部品
JOY GLOBAL INC		197	154	1,144	93,562	資本財
JUNIPER NETWORKS INC		817	724	2,478	202,678	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KBR INC		307	307	836	68,423	資本財
KLA-TENCOR CORPORATION		318	235	880	72,034	半導体・半導体製造装置
KELLOGG CO		343	316	1,548	126,665	食品・飲料・タバコ
KEYCORP		1,197	1,339	1,104	90,297	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP		473	468	2,913	238,271	家庭用品・パーソナル用品
KOHL'S CORP		436	346	1,811	148,108	小売
KRAFT FOODS INC-A		1,883	2,111	6,464	528,703	食品・飲料・タバコ
KROGER CO		704	701	1,592	130,261	食品・生活必需品小売り
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS		144	123	904	73,955	資本財
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS		143	118	982	80,355	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP		256	220	1,037	84,866	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP		—	150	781	63,923	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A		225	172	1,226	100,327	家庭用品・パーソナル用品
LEGGETT & PLATT INC		366	327	663	54,260	耐久消費財・アパレル
LEGG MASON INC		293	306	1,036	84,802	各種金融
LENDER PROCESSING SERVICES		122	189	580	47,453	ソフトウェア・サービス
LEUCADIA NATIONAL CORP		319	372	989	80,883	各種金融
LIBERTY GLOBAL INC-A		213	—	—	—	メディア
LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A		1,036	782	1,200	98,203	小売
LIBERTY MEDIA CORP-ENT SER A		536	—	—	—	メディア
LIFE TECHNOLOGIES CORP		288	252	1,288	105,398	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELI LILLY & CO		1,371	1,247	4,461	364,828	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LIMITED BRANDS INC		538	422	1,326	108,451	小売
LINCOLN NATIONAL CORP		450	436	1,066	87,229	保険
LINEAR TECHNOLOGY CORP		365	293	962	78,740	半導体・半導体製造装置
LOCKHEED MARTIN CORP		389	347	2,523	206,354	資本財
LOEWS CORP		450	479	1,882	153,940	保険

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			
LORILLARD INC		百株		百株		千米ドル		千円	食品・飲料・タバコ
LOWE'S COMPANIES		169		166		1,477		120,843	小売
M & T BANK CORP		2,041		1,773		3,840		314,056	銀行
MEMC ELECTRONIC MATERIALS		148		128		1,036		84,727	半導体・半導体製造装置
MACY'S INC		355		458		582		47,612	小売
MANPOWER INC		599		602		1,518		124,203	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP		161		159		903		73,852	エネルギー
MARSH & MCLENNAN COS		996		893		3,003		245,661	保険
MARSHALL & ILSLEY CORP		758		726		1,828		149,516	銀行
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A		692		930		520		42,536	消費者サービス
MASCO CORP		522		435		1,677		137,167	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A		720		685		786		64,335	ソフトウェア・サービス
MATTEL INC		103		125		3,157		258,185	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS		279		451		1,067		87,264	半導体・半導体製造装置
MCAFFEE INC		366		475		1,077		88,109	ソフトウェア・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS		256		217		1,028		84,144	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP		242		227		1,009		82,548	消費者サービス
MCGRAW-HILL COMPANIES INC		1,374		1,313		10,390		849,728	メディア
MCKESSON CORP		489		433		1,646		134,647	ヘルスケア機器・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO		385		322		2,098		171,644	食品・飲料・タバコ
MEADWESTVACO CORP		—		274		1,632		133,510	素材
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC		266		330		862		70,533	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC INC		636		557		3,305		270,287	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.		1,449		1,327		4,714		385,522	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC		4,067		3,838		13,454		1,100,303	保険
MICROSOFT CORP		1,100		1,183		4,798		392,385	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC		10,256		9,620		25,927		2,120,367	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC		334		322		1,090		89,140	半導体・半導体製造装置
MIRANT CORP		—		1,219		963		78,800	公益事業
MOHAWK INDUSTRIES INC		341		—		—		—	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BREWING CO -B		133		112		609		49,838	食品・飲料・タバコ
MONSANTO CO		—		200		994		81,292	素材
MOODY'S CORP		744		670		4,210		344,374	各種金融
MORGAN STANLEY		369		359		1,000		81,815	各種金融
MOSAIC CO/THE		1,469		1,608		4,233		346,210	素材
MOTOROLA INC		201		217		1,570		128,464	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MURPHY OIL CORP		2,536		2,973		2,441		199,636	エネルギー
MYLAN INC		193		224		1,502		122,836	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NII HOLDINGS INC		548		487		949		77,652	電気通信サービス
NYSE EURONEXT		342		259		1,086		88,828	各種金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC		356		409		1,203		98,400	エネルギー
NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP		598		520		3,035		248,218	半導体・半導体製造装置
NETAPP INC		500		500		684		55,949	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEW YORK COMMUNITY BANCORP		555		468		2,652		216,920	銀行
NEWELL RUBBERMAID INC		528		604		1,023		83,664	耐久消費財・アパレル
NEWFIELD EXPLORATION CO		539		453		786		64,358	エネルギー
NEWMONT MINING CORP		248		203		1,313		107,441	素材
NEWS CORP-CL A		700		646		3,914		320,158	メディア
NEWS CORP-CLASS B		2,246		2,246		3,208		262,369	メディア
NEXTERA ENERGY INC		835		735		1,181		96,662	公益事業
NIKE INC -CL B		—		507		2,764		226,085	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC		477		445		3,709		303,394	公益事業
NOBLE ENERGY INC		579		532		930		76,057	エネルギー
NORDSTROM INC		246		228		1,945		159,122	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP		—		254		1,064		87,042	運輸
NORTHERN TRUST CORP		416		462		2,849		233,056	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP		309		278		1,407		115,118	資本財
NUCOR CORP		328		329		2,148		175,725	素材
NVIDIA CORP		462		327		1,305		106,764	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP		854		747		941		77,013	エネルギー
OLD REPUBLIC INTL CORP		1,011		1,004		8,436		689,946	保険
		535		506		645		52,794	

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	
			千米ドル	千円			
OMNICARE INC	209	264	678	55,515			ヘルスケア機器・サービス
OMNICOM GROUP	388	404	1,874	153,292			メディア
ORACLE CORPORATION	4,985	4,925	14,155	1,157,656			ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	—	171	999	81,743			小売
OWENS-ILLINOIS INC	260	317	913	74,687			素材
P G & E CORP	422	460	2,192	179,272			公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	619	671	3,775	308,746			銀行
PPG INDUSTRIES INC	216	206	1,612	131,899			素材
PPL CORPORATION	544	571	1,537	125,707			公益事業
PACCAR INC	438	427	2,291	187,430			資本財
PACTIV CORPORATION	283	241	801	65,512			素材
PALL CORP	251	223	978	79,986			資本財
PARKER HANNIFIN CORP	191	196	1,570	128,415			資本財
PATTERSON COS INC	240	233	658	53,814			ヘルスケア機器・サービス
PATTERSON-UTI ENERGY INC	390	—	—	—			エネルギー
PAYCHEX INC	424	364	1,011	82,735			ソフトウェア・サービス
PEABODY ENERGY CORP	255	361	2,087	170,744			エネルギー
J. C. PENNEY CO INC (HLDG CO)	309	285	917	75,073			小売
PENTAIR INC	221	213	703	57,545			資本財
PEPCO HOLDINGS INC	478	440	833	68,190			公益事業
PEPSICO INC	1,981	1,957	12,780	1,045,185			食品・飲料・タバコ
PERRIGO CO	142	147	880	72,027			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PETSMART INC	282	245	947	77,457			小売
PFIZER INC	10,292	9,883	16,792	1,373,287			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,553	2,295	13,671	1,118,076			食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	220	213	886	72,478			公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	230	187	1,443	118,068			エネルギー
PITNEY BOWES INC	341	390	910	74,497			商業・専門サービス
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	183	—	—	—			エネルギー
POLO RALPH LAUREN CORP	119	103	1,043	85,346			耐久消費財・アパレル
PRAXAIR INC	392	378	3,480	284,663			素材
PRECISION CASTPARTS CORP	146	181	2,537	207,536			資本財
T ROWE PRICE GROUP INC	396	360	2,084	170,429			各種金融
PRICELINE.COM INC	—	58	2,444	199,937			小売
PRIDE INTERNATIONAL INC	307	278	907	74,180			エネルギー
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	468	455	1,316	107,646			保険
PROCTER & GAMBLE CO	3,685	3,486	22,594	1,847,790			家庭用品・パーソナル用品
PROGRESS ENERGY INC	321	356	1,596	130,580			公益事業
PROGRESSIVE CORP	1,033	930	1,996	163,293			保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	601	609	3,345	273,571			保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	689	627	2,036	166,532			公益事業
QEP RESOURCES INC-W/I	—	255	855	69,996			エネルギー
QUALCOMM INC	2,216	2,052	9,836	804,396			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUEST DIAGNOSTICS	210	178	928	75,969			ヘルスケア機器・サービス
QUESTAR CORP	290	—	—	—			公益事業
RANGE RESOURCES CORP	244	229	977	79,952			エネルギー
RAYTHEON COMPANY	427	385	1,852	151,510			資本財
RED HAT INC	311	277	1,190	97,381			ソフトウェア・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	1,613	1,725	1,069	87,464			銀行
REPUBLIC SERVICES INC	492	479	1,372	112,211			商業・専門サービス
REYNOLDS AMERICAN INC	244	204	1,350	110,468			食品・飲料・タバコ
ROBERT HALF INTL INC	309	297	820	67,114			商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	201	202	1,316	107,675			資本財
ROCKWELL COLLINS INC.	205	188	1,126	92,152			資本財
ROPER INDUSTRIES INC	183	131	937	76,628			資本財
ROSS STORES INC	218	149	939	76,797			小売
ROWAN COMPANIES INC	198	242	759	62,094			エネルギー
SAIC INC	—	325	513	41,969			ソフトウェア・サービス
SPX CORP	123	109	729	59,662			資本財
SAFEWAY INC	514	462	1,058	86,552			食品・生活必需品小売り
ST JUDE MEDICAL INC	387	399	1,563	127,900			ヘルスケア機器・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	
			千株	千株			
SALESFORCE.COM INC	184	171	1,972	161,334			ソフトウェア・サービス
SANDISK CORP	—	330	1,319	107,893			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SARA LEE CORP	1,012	888	1,351	110,549			食品・飲料・タバコ
SCANA CORP	228	228	943	77,129			公益事業
SCHLUMBERGER LTD	1,519	1,666	12,317	1,007,313			エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,483	1,295	2,012	164,562			各種金融
SEALED AIR CORP	346	335	779	63,780			素材
SEARS HOLDINGS CORP	116	87	625	51,138			小売
SEMPRA ENERGY	330	295	1,522	124,549			公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	162	115	843	68,968			素材
SIGMA-ALDRICH	212	169	1,094	89,498			素材
SMITH INTERNATIONAL INC	307	—	—	—			エネルギー
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	202	148	943	77,164			食品・飲料・タバコ
SOUTHERN CO	931	1,014	3,881	317,459			公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	638	477	665	54,420			運輸
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	509	458	1,734	141,809			エネルギー
SPECTRA ENERGY CORP	720	836	2,043	167,082			エネルギー
SPRINT NEXTEL CORP	—	3,057	1,232	100,773			電気通信サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	—	202	1,255	102,635			耐久消費財・アパレル
STANLEY WORKS/THE	165	—	—	—			資本財
STAPLES INC	992	878	1,796	146,893			小売
STARBUCKS CORP	1,099	979	2,954	241,622			消費者サービス
STARWOOD HOTELS & RESORTS	338	290	1,658	135,601			消費者サービス
STATE STREET CORP	677	658	2,897	236,931			各種金融
STERICYCLE INC	154	139	997	81,601			商業・専門サービス
STRYKER CORP	309	363	1,893	154,889			ヘルスケア機器・サービス
SUN MICROSYSTEMS INC	1,164	—	—	—			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUNOCO INC	245	231	886	72,461			エネルギー
SUNPOWER CORP-CLASS A	140	—	—	—			資本財
SUNTRUST BANKS INC	681	669	1,742	142,479			銀行
SUPERVALU INC	360	501	526	43,033			食品・生活必需品小売り
SYMANTEC CORP	1,084	957	1,681	137,480			ソフトウェア・サービス
SYNOPSIS INC	283	304	778	63,626			ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	807	732	2,107	172,380			食品・生活必需品小売り
TJX COMPANIES INC	593	482	2,196	179,596			小売
TARGET CORP	885	856	4,662	381,280			小売
TELEPHONE AND DATA SYSTEMS	158	158	566	46,332			電気通信サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	—	1,152	5,854	478,816			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS	1,582	1,437	4,504	368,388			半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	515	439	985	80,599			資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	616	526	2,706	221,313			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	820	804	6,860	561,038			資本財
TIFFANY & CO	242	167	954	78,083			小売
TIM HORTONS INC	150	—	—	—			消費者サービス
TIME WARNER INC	1,664	1,476	4,697	384,145			メディア
TIME WARNER CABLE	539	496	3,072	251,261			メディア
TOLL BROTHERS INC	242	335	644	52,682			耐久消費財・アパレル
TORCHMARK CORP	178	159	933	76,305			保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	343	406	638	52,191			ソフトウェア・サービス
TRAVELERS COS/THE	667	609	3,446	281,879			保険
TYSON FOODS INC-CL A	593	539	811	66,326			食品・飲料・タバコ
US BANCORP	2,540	2,395	6,038	493,867			銀行
URS CORP	104	167	688	56,300			資本財
ULTRA PETROLEUM CORP	264	213	1,006	82,292			エネルギー
UNION PACIFIC CORP	671	630	5,698	465,990			運輸
UNITED PARCEL SERVICE CL B	929	874	6,035	493,579			運輸
UNITED STATES STEEL CORP	200	192	908	74,282			素材
UNITED TECHNOLOGIES CORP	1,096	1,059	8,127	664,656			資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,595	1,411	5,219	426,814			ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	573	556	1,208	98,859			保険
VF CORP	130	113	946	77,394			耐久消費財・アパレル

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
VALERO ENERGY CORP	百株	百株	千米ドル	千円		エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	736	737	1,411	115,460		ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	213	173	1,126	92,160		ソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	308	271	954	78,023		電気通信サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,692	3,479	11,484	939,238		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIACOM INC CL B	—	300	1,030	84,277		メディア
VISA INC-CLASS A SHARES	769	750	2,854	233,468		ソフトウェア・サービス
VULCAN MATERIALS CO	584	607	4,757	389,053		素材
WAL-MART STORES INC	189	203	858	70,193		食品・生活必需品小売り
WALGREEN CO	2,946	2,453	13,506	1,104,531		食品・生活必需品小売り
WASHINGTON POST -CL B	1,187	1,193	4,205	343,900		メディア
WASTE MANAGEMENT INC	14	15	619	50,690		商業・専門サービス
WATERS CORP	488	517	1,818	148,695		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WELLPOINT INC	180	142	1,099	89,952		ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & COMPANY	654	539	3,115	254,755		銀行
WESTERN DIGITAL CORP	5,741	6,152	17,306	1,415,332		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO	378	308	1,065	87,098		ソフトウェア・サービス
WEYERHAEUSER CO	1,052	859	1,589	130,028		不動産
WHIRLPOOL CORP	309	691	1,198	97,998		耐久消費財・アパレル
WHOLE FOODS MARKET INC	135	102	782	64,015		食品・生活必需品小売り
WILLIAMS COS INC	290	263	1,226	100,272		エネルギー
WINDSTREAM CORP	777	800	1,836	150,164		電気通信サービス
WISCONSIN ENERGY CORP	913	831	1,082	88,528		公益事業
WYNN RESORTS LTD	220	185	1,093	89,462		消費者サービス
XTO ENERGY INC	—	123	1,407	115,099		エネルギー
XCEL ENERGY INC	720	—	—	—		公益事業
XLINX INC	687	572	1,381	112,996		半導体・半導体製造装置
XEROX CORP	452	333	913	74,699		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YAHOO! INC	1,335	1,818	2,140	175,015		ソフトウェア・サービス
YUM! BRANDS INC	1,860	1,629	2,765	226,199		消費者サービス
ZIMMER HOLDINGS INC	685	602	3,052	249,605		ヘルスケア機器・サービス
INVESCO LTD	210	234	1,219	99,767		各種金融
ACE LTD	660	676	1,569	128,361		保険
TRANSOCEAN LTD	422	432	2,604	212,964		エネルギー
COVIDIEN PLC	385	390	2,651	216,855		ヘルスケア機器・サービス
GARMIN LTD	586	602	2,619	214,207		耐久消費財・アパレル
COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	—	222	667	54,586		資本財
ACCENTURE PLC-CL A	234	220	1,175	96,115		ソフトウェア・サービス
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	700	764	3,461	283,074		保険
SEAGATE TECHNOLOGY	—	307	1,000	81,833		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WEATHERFORD INTL LTD	—	734	1,074	87,911		エネルギー
TYCO ELECTRONICS LTD	950	969	1,848	151,200		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INGERSOLL-RAND PLC	608	614	2,019	165,143		資本財
TYCO INTERNATIONAL LTD	339	406	1,655	135,361		資本財
NOBLE CORP	623	599	2,357	192,784		エネルギー
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	389,974	397,532	1,394,334	114,028,682	
(カナダ)		478	476	—	<52.3%>	
AGNICO-EAGLE MINES	146	228	1,838	149,381		素材
AGRIUM INC	241	207	1,765	143,393		素材
BCE INC	426	302	1,001	81,373		電気通信サービス
BANK OF MONTREAL	666	711	4,222	343,061		銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	1,254	1,295	7,071	574,476		銀行
BARRICK GOLD CORP	1,251	1,235	6,332	514,435		素材
BIOVAIL CORPORATION	391	—	—	—		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOMBARDIER INC 'B'	2,091	2,116	1,047	85,118		資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	789	750	2,335	189,723		不動産
BROOKFIELD PROPERTIES CORP	581	556	1,009	81,991		不動産
CAE INC	744	612	693	56,357		資本財
CAMECO CORP	547	538	2,000	162,528		エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	535	499	3,877	315,046		銀行

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		
	百株	百株	千カナダドル	千円		
CANADIAN NATL RAILWAY CO	593	571	3,686	299,463	運輸	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	729	1,369	5,434	441,485	エネルギー	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	218	213	1,397	113,498	運輸	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	155	155	920	74,784	小売	
CENOVUS ENERGY INC	—	967	2,898	235,480	エネルギー	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	—	286	1,164	94,639	エネルギー	
ELDORADO GOLD CORP	—	833	1,500	121,887	素材	
ENCANA CORP	943	929	2,799	227,402	エネルギー	
ENBRIDGE INC	381	449	2,532	205,701	エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	24	29	1,193	96,978	保険	
FINNING INTERNATIONAL INC	403	344	839	68,166	資本財	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	143	114	1,091	88,655	素材	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	317	233	651	52,916	耐久消費財・アパレル	
GOLDCORP INC	1,034	936	4,368	354,903	素材	
GREAT-WEST LIFECO INC	224	486	1,316	106,969	保険	
CGI GROUP INC	548	518	885	71,908	ソフトウェア・サービス	
HUSKY ENERGY INC	296	313	817	66,422	エネルギー	
IGM FINANCIAL INC	228	228	983	79,888	各種金融	
IMPERIAL OIL LTD	292	358	1,392	113,125	エネルギー	
IVANHOE MINES LTD	—	430	1,125	91,431	素材	
KINROSS GOLD CORP	1,071	1,111	2,071	168,271	素材	
LOBLAW COMPANIES LTD	232	213	871	70,760	食品・生活必需品小売り	
MAGNA INTERNATIONAL INC	175	141	1,409	114,499	自動車・自動車部品	
MANULIFE FINANCIAL CORP	2,205	2,279	3,473	282,188	保険	
NATIONAL BANK OF CANADA	185	208	1,388	112,813	銀行	
NEXEN INC	684	699	1,524	123,864	エネルギー	
NIKO RESOURCES LTD	98	85	844	68,578	エネルギー	
ONEX CORPORATION	266	234	686	55,749	各種金融	
OPEN TEXT CORP	116	139	615	50,035	ソフトウェア・サービス	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	413	372	5,298	430,464	素材	
POWER CORP OF CANADA	414	545	1,545	125,569	保険	
POWER FINANCIAL CORP	362	424	1,322	107,467	保険	
RESEARCH IN MOTION	623	621	3,447	280,102	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	762	584	2,121	172,345	電気通信サービス	
ROYAL BANK OF CANADA	1,847	1,749	9,516	773,099	銀行	
SNC-LAVALIN GROUP INC	266	215	1,173	95,337	資本財	
SAPUTO INC	278	268	986	80,111	食品・飲料・タバコ	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	614	512	1,105	89,818	メディア	
SHOPPERS DRUG MART CORP	224	247	949	77,153	食品・生活必需品小売り	
SILVER WHEATON CORP	—	200	650	52,854	素材	
SUN LIFE FINANCIAL INC	746	773	2,253	183,108	保険	
SUNCOR ENERGY INC	2,106	1,969	7,080	575,250	エネルギー	
TMX GROUP INC	184	193	681	55,382	各種金融	
TALISMAN ENERGY INC	1,400	1,299	2,591	210,509	エネルギー	
TECK RESOURCES LTD	774	649	3,144	255,493	素材	
TELUS CORP	88	88	397	32,274	電気通信サービス	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	255	255	1,104	89,695	電気通信サービス	
THOMSON REUTERS CORP	540	497	1,886	153,237	メディア	
TIM HORTONS INC	—	274	1,073	87,175	消費者サービス	
TORONTO-DOMINION BANK	1,106	1,080	7,961	646,767	銀行	
TRANSALTA CORP	412	426	879	71,448	公益事業	
TRANSCANADA CORP	799	821	3,062	248,832	エネルギー	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	—	294	768	62,415	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WESTON (GEORGE) LTD	105	96	745	60,526	食品・生活必需品小売り	
YAMANA GOLD INC	1,208	1,183	1,383	112,418	素材	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	36,778	39,586	146,211	11,878,222	<5.4%>
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG		228	257	1,247	140,431	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG		1,060	1,061	668	75,188	銀行

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			
	百株	百株	千ユーロ	千円			
Fresenius SE	—	73	474	53,375	ヘルスケア機器・サービス		
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	371	326	421	47,458	ソフトウェア・サービス		
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	151	142	525	59,098	保険		
GEA GROUP AG	370	331	646	72,792	資本財		
Fresenius SE	—	56	370	41,723	ヘルスケア機器・サービス		
CONTINENTAL AG	—	70	425	47,904	自動車・自動車部品		
DEUTSCHE POST AG	937	983	1,362	153,315	運輸		
MERCK KGAA	94	103	601	67,664	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
RWE AG	524	471	2,377	267,538	公益事業		
RWE AG-NON VTG PFD	89	95	453	51,082	公益事業		
SAP AG	1,047	1,044	3,899	438,797	ソフトウェア・サービス		
E.ON AG	2,536	2,202	4,885	549,760	公益事業		
Henkel AG & Co KGaA	—	122	433	48,798	家庭用品・パーソナル用品		
METRO AG	191	187	1,000	112,591	食品・生活必需品小売り		
PUMA AG	17	16	406	45,776	耐久消費財・アパレル		
BAYER AG	1,034	1,027	5,752	647,339	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
HENKEL AG AND CO KGAA	307	254	1,071	120,593	家庭用品・パーソナル用品		
BASF SE	1,169	1,141	6,551	737,287	素材		
BEIERSDORF AG	140	116	523	58,877	家庭用品・パーソナル用品		
HOCHTIEF AG	98	93	586	65,988	資本財		
HEIDELBERGCEMENT AG	—	179	770	86,648	素材		
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	187	223	976	109,934	ヘルスケア機器・サービス		
ALLIANZ SE	613	572	5,295	595,920	保険		
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	263	449	720	81,099	運輸		
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	251	225	2,555	287,619	保険		
SALZGITTER AG	74	78	436	49,114	素材		
VOLKSWAGEN AG	118	44	446	50,292	自動車・自動車部品		
VOLKSWAGEN AG PFD	153	205	2,290	257,764	自動車・自動車部品		
DAIMLER AG	1,143	1,127	5,643	635,114	自動車・自動車部品		
MAN SE	130	146	1,224	137,745	資本財		
THYSSENKRUPP AG	480	342	971	109,339	素材		
SIEMENS AG	1,096	1,012	8,604	968,226	資本財		
LINDE AG	163	208	2,205	248,197	素材		
DEUTSCHE BANK AG -REG	728	958	4,016	451,951	各種金融		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	476	454	2,488	279,996	自動車・自動車部品		
K+S AG	227	195	1,030	115,984	素材		
SOLARWORLD AG	194	—	—	—	資本財		
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	3,799	3,508	3,582	403,153	電気通信サービス		
INFINEON TECHNOLOGIES AG	—	1,480	921	103,716	半導体・半導体製造装置		
DEUTSCHE BOERSE AG	286	252	1,259	141,749	各種金融		
DEUTSCHE POSTBANK AG	202	—	—	—	銀行		
WACKER CHEMIE AG	42	36	513	57,737	素材		
小 計	株数・銘柄数	金額・比率	21,006	21,888	80,642	9,074,692	< 4.2% >
(ユーロ…イタリア)			38	42	—	—	
ASSICURAZIONI GENERALI	1,637	1,507	2,458	276,662	保険		
BANCA POPOLARE DI MILANO	937	1,104	358	40,367	銀行		
INTESA SANPAOLO	10,427	8,894	2,214	249,224	銀行		
BANCA INTESA SPA-RNC	2,093	2,307	468	52,717	銀行		
UNICREDIT SPA	19,330	16,939	3,084	347,128	銀行		
MEDIOBANCA SPA	852	921	705	79,414	各種金融		
PIRELLI & C.	9,530	678	414	46,648	自動車・自動車部品		
SAIPEM	407	303	1,010	113,696	エネルギー		
LUXOTTICA GROUP SPA	283	256	536	60,354	耐久消費財・アパレル		
MEDIASET SPA	1,414	1,332	720	81,061	メディア		
AUTOGRILL SPA	412	382	373	42,020	消費者サービス		
FIAT SPA	1,074	905	1,197	134,707	自動車・自動車部品		
ITALCEMENTI SPA	299	—	—	—	素材		
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	4,536	5,056	475	53,514	銀行		
ENEL SPA	7,607	7,881	3,229	363,396	公益事業		

銘柄	株数	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		
				千ユーロ	千円				
ENI SPA	3,252	3,053	5,080	571,713	エネルギー				
SNAM RETE GAS S. P. A	2,633	1,539	596	67,117	公益事業				
UBI BANCA SCPA	813	703	527	59,379	銀行				
TELECOM ITALIA SPA	14,555	9,963	1,036	116,601	電気通信サービス				
TELECOM ITALIA-RNC	9,475	9,615	814	91,704	電気通信サービス				
ATLANTIA S. P. A	481	362	595	67,054	運輸				
TERNA SPA	2,535	2,329	782	88,095	公益事業				
FINMECCANICA SPA	525	585	565	63,609	資本財				
LOTTOMATICA SPA	198	—	—	—	消費者サービス				
BANCO POPOLARE SPA	1,191	1,272	471	53,068	銀行				
小 計	96,508	77,897	27,719	3,119,262					
(ユーロ…フランス)	25	23	—	< 1.4% >					
BOUYGUES	359	281	932	104,906	資本財				
VEOLIA ENVIRONNEMENT	522	503	1,050	118,160	公益事業				
L'OREAL	284	287	2,474	278,482	家庭用品・パーソナル用品				
CHRISTIAN DIOR	103	93	1,031	116,130	耐久消費財・アパレル				
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	312	301	3,549	399,436	耐久消費財・アパレル				
THALES SA	132	185	544	61,317	資本財				
CAP GEMINI SA	216	202	704	79,327	ソフトウェア・サービス				
CASINO GUICHARD PERRACHON	94	101	694	78,203	食品・生活必需品小売り				
CIE GENERALE GEOPHYSIQUE-VERITAS	291	283	569	64,036	エネルギー				
PUBLICIS GROUPE	241	217	781	87,967	メディア				
LAFARGE SA	235	245	1,132	127,414	素材				
LAGARDERE S. C. A	184	224	698	78,633	メディア				
MICHELIN (CGDE)-B	189	188	1,080	121,573	自動車・自動車部品				
PERNOD-RICARD	224	258	1,637	184,254	食品・飲料・タバコ				
SCHNEIDER ELECTRIC SA	283	300	3,157	355,272	資本財				
VIVENDI SA	1,631	1,466	3,045	342,702	メディア				
TECHNIP S. A.	78	129	824	92,763	エネルギー				
FRANCE TELECOM SA	2,493	2,237	3,854	433,801	電気通信サービス				
HERMES INTERNATIONAL	62	63	1,057	118,989	耐久消費財・アパレル				
BIC	72	69	446	50,298	商業・専門サービス				
DASSAULT SYSTEMES SA	123	121	665	74,913	ソフトウェア・サービス				
PINAULT-PRINTEMPS-REDOUTE	105	97	1,120	126,127	小売				
CNP ASSURANCES	78	343	515	58,040	保険				
NEOPOST SA	74	79	489	55,116	テクノロジー・ハードウェアおよび機器				
CARREFOUR SA	873	751	2,856	321,463	食品・生活必需品小売り				
ATOS ORIGIN	129	121	389	43,834	ソフトウェア・サービス				
SANOFI-AVENTIS	1,325	1,281	6,557	737,937	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス				
ACCOR SA	254	247	790	88,936	消費者サービス				
SOCIETE GENERALE-A	1,654	794	3,508	394,852	銀行				
ALCATEL-LICENT	684	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器				
TELEVISION FRANCAISE (T. F. 1)	353	334	417	46,985	メディア				
SODEXO	168	151	730	82,231	消費者サービス				
AXA	2,153	2,246	3,092	348,019	保険				
PEUGEOT SA	265	212	643	72,366	自動車・自動車部品				
ESSILOR INTERNATIONAL	231	232	1,113	125,339	ヘルスケア機器・サービス				
CREDIT AGRICOLE SA	1,264	1,233	1,508	169,725	銀行				
BNP PARIBAS	1,137	1,181	6,474	728,586	銀行				
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	459	486	1,806	203,275	資本財				
IMERYS SA	97	97	467	52,627	素材				
SAFRAN SA	389	311	707	79,611	資本財				
GDF SUEZ	1,587	1,555	4,490	505,312	公益事業				
ALSTOM RGPT	215	228	774	87,190	資本財				
ELECTRICITE DE FRANCE	306	358	1,139	128,270	公益事業				
TOTAL SA	2,789	2,560	10,530	1,184,951	エネルギー				
VALLOUREC	49	139	1,125	126,697	資本財				
Natixis	—	1,347	603	67,908	銀行				
SCOR SE	350	335	620	69,855	保険				

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	
			千ユーロ	千円			
VINCI S.A.	609	518	2,064	232,341	資本財		
DANONE	694	703	3,316	373,238	食品・飲料・タバコ		
AIR LIQUIDE	289	345	3,294	370,756	素材		
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	487	509	706	79,526	公益事業		
EDENRED	—	235	396	44,621	商業・専門サービス		
小 計	27,220	26,807	92,191	10,374,334			
	株 数 比	株 数 比	金 額 比	金 額 比			
	50	51	—	< 4.8% >			
(ユーロ…オランダ)							
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	536	520	966	108,711	資本財		
REED ELSEVIER NV	583	912	859	96,761	メディア		
RANDSTAD HOLDING NV	215	205	753	84,800	商業・専門サービス		
KONINKLIJKE AHOLD NV	1,362	1,319	1,273	143,280	食品・生活必需品小売り		
AKZO NOBEL	315	282	1,250	140,772	素材		
TNT NV	515	468	861	96,900	運輸		
WOLTERS KLUWER	429	455	726	81,773	メディア		
QIAGEN N.V.	—	436	586	66,033	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
AEGON NV	2,112	2,263	1,062	119,518	保険		
ASML HOLDING NV	439	486	1,196	134,696	半導体・半導体製造装置		
KONIKLIJKE KPN NV	2,350	1,965	2,348	264,312	電気通信サービス		
STMICROELECTRONICS NV	1,245	968	646	72,709	半導体・半導体製造装置		
PHILIPS ELECTRONICS NV	1,124	1,222	2,788	313,810	資本財		
ING GROEP N.V.	2,731	4,893	3,898	438,683	各種金融		
HEINEKEN NV	399	333	1,201	135,151	食品・飲料・タバコ		
KONINKLIJKE DSM NV	235	196	763	85,909	素材		
UNILEVER NV-CVA	2,079	1,991	4,490	505,292	食品・飲料・タバコ		
SBM OFFSHORE NV	293	364	560	63,123	エネルギー		
小 計	16,969	19,287	26,235	2,952,242			
	株 数 比	株 数 比	金 額 比	金 額 比			
	17	18	—	< 1.4% >			
(ユーロ…スペイン)							
IBERIA LINEAS AER DE ESPANA	1,745	1,364	443	49,919	運輸		
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	391	529	734	82,645	運輸		
INDRA SISTEMAS SA	259	259	357	40,193	ソフトウェア・サービス		
BANCO BILVAO VIZCAYA ARGENTA	4,443	4,483	3,754	422,466	銀行		
GAS NATURAL SDG SA	449	449	480	54,119	公益事業		
REPSOL YPF SA	825	912	1,835	206,587	エネルギー		
BANCO SANTANDER S.A	10,708	10,230	8,848	995,773	銀行		
RED ELECTRICA CORPORACION SA	208	199	710	80,004	公益事業		
TELEFONICA SA	5,574	5,047	9,360	1,053,326	電気通信サービス		
INDITEX	221	269	1,537	172,978	小売		
GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	362	464	249	28,045	資本財		
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	246	154	573	64,515	資本財		
ACERINOX SA	323	222	268	30,255	素材		
BANCO POPULAR ESPANOL	1,307	1,550	663	74,619	銀行		
MAPFRE S.A.	1,695	1,921	444	49,975	保険		
IBERDROLA SA	4,974	5,175	3,072	345,726	公益事業		
IBERDROLA RENOVABLES	1,761	2,051	498	56,119	公益事業		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG-RTS	—	4,483	144	16,246	銀行		
小 計	35,499	39,771	33,977	3,823,517			
	株 数 比	株 数 比	金 額 比	金 額 比			
	17	18	—	< 1.8% >			
(ユーロ…ベルギー)							
UMICORE	264	208	778	87,571	素材		
DELHAIZE GROUP	146	118	602	67,820	食品・生活必需品小売り		
KBC GROUPE	283	224	698	78,554	銀行		
ANHEUSER-BUSCH INBEV	1,001	922	4,060	456,878	食品・飲料・タバコ		
SOLVAY SA	90	72	555	62,469	素材		
MOBISTAR SA	83	83	393	44,237	電気通信サービス		
UCB SA	210	199	577	62,781	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
COLRUYT SA	29	156	623	70,195	食品・生活必需品小売り		
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	114	102	665	74,869	各種金融		
DEXIA	1,015	1,233	407	45,810	銀行		

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	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
BELGACOM SA	百株 262	百株 212	千ユーロ 594	千円 66,859			電気通信サービス
小 計	株 数 3,502 銘柄 数 11	株 数 3,533 銘柄 数 11	金 額 9,935 金 額 -	金 額 1,118,047 金 額 -<0.5%>			
(ユーロ…オーストリア)							
TELEKOM AUSTRIA AG	556	616	698	78,614			電気通信サービス
OMV AG	269	266	739	83,217			エネルギー
VERBUND AG	153	182	506	56,970			公益事業
VOESTALPINE AG	252	221	684	76,980			素材
ERSTE GROUP BANK AG	306	310	1,020	114,831			銀行
小 計	株 数 1,538 銘柄 数 5	株 数 1,596 銘柄 数 5	金 額 3,648 金 額 -	金 額 410,613 金 額 -<0.2%>			
(ユーロ…ルクセンブルク)							
Tenaris SA	-	567	941	105,915			エネルギー
SES SA	-	481	875	98,566			メディア
ARCELORMITTAL	1,201	1,015	2,663	299,779			素材
小 計	株 数 1,201 銘柄 数 1	株 数 2,063 銘柄 数 3	金 額 4,481 金 額 -	金 額 504,261 金 額 -<0.2%>			
(ユーロ…フィンランド)							
KESKO OYJ-B SHS	179	149	548	61,743			食品・生活必需品小売り
WARTSILA	162	125	670	75,487			資本財
OUTOKUMPU OYJ	299	261	357	40,213			素材
RAUTARUUKKI OYJ	216	167	256	28,850			素材
UPM-KYMMENE OYJ	622	622	778	87,567			素材
STORA ENSO OYJ-R SHS	535	721	540	60,835			素材
SAMPO OYJ-A SHS	438	449	915	102,982			保険
FORTUM OYJ	444	508	1,033	116,267			公益事業
ELISA OYJ-A SHARES	335	323	507	57,164			電気通信サービス
METSO OYJ	181	190	717	80,755			資本財
NOKIA OYJ	4,886	4,545	3,536	397,964			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OIL OYJ	282	328	394	44,409			エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ	263	215	563	63,445			自動車・自動車部品
KONE OYJ-B	188	131	525	59,187			資本財
ORION OYJ	285	264	419	47,155			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	株 数 9,322 銘柄 数 15	株 数 9,006 銘柄 数 15	金 額 11,766 金 額 -	金 額 1,324,030 金 額 -<0.6%>			
(ユーロ…アイルランド)							
CRH PLC	965	918	1,336	150,391			素材
KERRY GROUP PLC-A	240	267	720	81,061			食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 1,205 銘柄 数 2	株 数 1,186 銘柄 数 2	金 額 2,056 金 額 -	金 額 231,452 金 額 -<0.1%>			
(ユーロ…ギリシャ)							
PIRAEUS BANK S.A.	613	-	-	-			銀行
ALPHA BANK A.E.	682	-	-	-			銀行
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	351	348	680	76,551			食品・飲料・タバコ
NATIONAL BANK OF GREECE	619	684	532	59,911			銀行
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	495	495	305	34,362			電気通信サービス
EFG EUROBANK ERGASIAS	648	-	-	-			銀行
OPAP SA	368	408	541	60,881			消費者サービス
PUBLIC POWER CORP	260	318	397	44,738			公益事業
小 計	株 数 4,040 銘柄 数 8	株 数 2,255 銘柄 数 5	金 額 2,456 金 額 -	金 額 276,444 金 額 -<0.1%>			
(ユーロ…ポルトガル)							
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	1,161	1,305	439	49,471			銀行
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	3,161	2,467	628	70,694			公益事業
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	5,580	7,116	447	50,368			銀行
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	492	855	846	95,216			電気通信サービス
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	505	741	386	43,473			素材
小 計	株 数 10,901 銘柄 数 5	株 数 12,485 銘柄 数 5	金 額 2,747 金 額 -	金 額 309,225 金 額 -<0.1%>			
ユーロ計	株 数 228,918 銘柄 数 194	株 数 217,778 銘柄 数 198	金 額 297,859 金 額 -	金 額 33,518,124 金 額 -<15.4%>			

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	
			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			
AMEC PLC	614	463	516	67,696			エネルギー
Antofagasta PLC	—	513	750	98,319			素材
BHP BILLITON PLC	2,963	2,694	6,653	871,647			素材
ARM HOLDINGS PLC	—	1,865	664	86,993			半導体・半導体製造装置
BALFOUR BEATTY PLC	1,118	1,360	387	50,712			資本財
Autonomy Corp PLC	—	309	445	58,317			ソフトウェア・サービス
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	1,664	1,567	1,140	149,464			メディア
AGGREKO PLC	—	339	541	70,988			商業・専門サービス
TULLOW OIL PLC	1,207	1,117	1,375	180,266			エネルギー
CABLE & WIRELESS PLC	4,214	—	—	—			電気通信サービス
AVIVA PLC	3,135	3,715	1,572	205,973			保険
DIAGEO PLC	3,266	3,034	3,505	459,227			食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC	344	256	427	55,976			各種金融
BAE SYSTEMS PLC	3,844	3,416	1,190	155,971			資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,581	2,453	5,970	782,197			食品・飲料・タバコ
FIRSTGROUP PLC	923	1,069	431	56,531			運輸
STANDARD CHARTERED PLC	2,629	2,589	4,954	649,080			銀行
REXAM PLC	322	1,655	525	68,853			素材
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	1,297	1,208	2,452	321,366			食品・飲料・タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	344	285	563	73,762			素材
SABMILLER PLC	1,343	1,197	2,422	317,374			食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC	2,751	2,369	1,285	168,406			消費者サービス
HSBC HOLDINGS PLC	22,498	21,497	14,927	1,955,694			銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	9,545	8,566	878	115,037			保険
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	3,338	2,224	606	79,425			食品・生活必需品小売り
INTERNATIONAL POWER PLC	2,363	2,250	977	128,041			公益事業
RSA INSURANCE GROUP PLC	5,109	4,217	549	71,939			保険
Associated British Foods PLC	—	379	420	55,033			食品・飲料・タバコ
PEARSON PLC	1,043	988	961	126,003			メディア
PRUDENTIAL PLC	3,156	3,278	2,066	270,797			保険
RIO TINTO PLC	1,838	1,782	7,940	1,040,291			素材
OLD MUTUAL PLC	7,866	7,600	1,006	131,830			保険
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	25,194	22,677	992	129,981			銀行
SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	1,050	1,059	1,184	155,189			公益事業
SERCO GROUP PLC	876	945	543	71,222			商業・専門サービス
BP PLC	24,135	22,961	10,434	1,367,050			エネルギー
SAGE GROUP PLC (THE)	1,774	2,090	565	74,148			ソフトウェア・サービス
LLOYDS BANKING GROUP PLC	22,077	51,759	3,544	464,363			銀行
BG GROUP PLC	4,522	4,135	5,302	694,659			エネルギー
TESCO PLC	10,006	9,535	3,941	516,316			食品・生活必需品小売り
TOMKINS PLC	2,142	—	—	—			資本財
SMITH & NEPHEW PLC	1,322	1,052	624	81,878			ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	6,613	6,337	7,830	1,025,843			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASTRAZENECA PLC	1,828	1,760	5,446	713,508			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC	9,578	9,549	1,520	199,177			電気通信サービス
Lonmin Plc	—	299	567	74,360			素材
CARNIVAL PLC	292	261	719	94,313			消費者サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	2,365	1,712	695	91,100			小売
BARCLAYS PLC	13,516	14,202	4,218	552,615			銀行
XSTRATA PLC	2,605	2,596	3,654	478,800			素材
BURBERRY GROUP PLC	951	632	649	85,125			耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	315	244	522	68,410			小売
ROLLS-ROYCE GROUP PLC	2,263	2,142	1,299	170,213			資本財
KINGFISHER PLC	3,347	2,573	611	80,053			小売
Vedanta Resources PLC	—	208	503	65,977			素材
ICAP PLC	1,070	1,154	563	73,849			各種金融
ITV PLC	—	5,575	398	52,187			メディア
SAINSBURY (J) PLC	1,672	1,534	578	75,846			食品・生活必需品小売り
Randgold Resources Ltd	—	133	834	109,393			素材
G4S PLC	1,689	1,976	501	65,671			商業・専門サービス

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	
			千英ポンド	千円			
Admiral Group PLC	百株	百株	578	75,830	保険		
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	295	346	—	—	耐久消費財・アパレル		
CENTRICA PLC	6,712	6,307	2,108	276,227	公益事業		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	4,442	4,258	8,784	1,150,892	エネルギー		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	3,391	3,332	6,739	882,925	エネルギー		
BUNZL PLC	675	683	501	65,716	資本財		
COBHAM PLC	2,102	2,102	439	57,623	資本財		
NATIONAL GRID PLC	3,318	4,258	2,450	321,054	公益事業		
KAZAKHMY S PLC	289	395	613	80,414	素材		
LADBROKES PLC	1,567	—	—	—	消費者サービス		
UNILEVER PLC	1,663	1,537	2,917	382,168	食品・飲料・タバコ		
VODAFONE GROUP PLC	66,835	64,116	11,156	1,461,587	電気通信サービス		
STANDARD LIFE PLC	3,510	3,323	773	101,320	保険		
HOME RETAIL GROUP-W/I	1,740	1,450	308	40,397	小売		
EXPERIAN PLC	1,402	1,122	825	108,131	商業・専門サービス		
SEVERN TRENT PLC	467	453	647	84,833	公益事業		
CAIRN ENERGY PLC	218	—	—	—	エネルギー		
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	604	492	561	73,519	消費者サービス		
SMITHS GROUP PLC	635	428	514	67,450	資本財		
ANGLO AMERICAN PLC	1,789	1,619	4,791	627,712	素材		
3I GROUP PLC	996	1,823	594	77,870	各種金融		
CAPITA GROUP PLC	865	573	424	55,632	商業・専門サービス		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	706	702	2,501	327,700	家庭用品・パーソナル用品		
MAN GROUP PLC	2,546	2,486	745	97,610	各種金融		
EURASIAN NATURAL RESOURCES	549	542	547	71,680	素材		
REED ELSEVIER PLC	1,189	1,424	766	100,409	メディア		
CADBURY PLC	1,831	—	—	—	食品・飲料・タバコ		
SHIRE PLC	941	724	1,075	140,952	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
Fresnillo PLC	—	377	547	71,686	素材		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,016	1,047	649	85,118	公益事業		
WPP PLC	1,370	1,593	1,194	156,501	メディア		
CAIRN ENERGY PLC	—	1,195	732	95,927	エネルギー		
CABLE & WIRELESS WORLDWIDE	—	5,126	363	47,683	電気通信サービス		
WOLSELEY PLC	390	383	697	91,356	資本財		
小 計	株 数 346,609	株 数 370,314	評 価 額 181,912	評 価 額 23,832,420	金 額 比 率 <10.9%>		
(スイス)			千スイスフラン				
SYNGENTA AG	115	112	3,214	271,348	素材		
SGS SA	6	5	971	82,038	商業・専門サービス		
SWISSCOM AG-REG	26	27	1,170	98,781	電気通信サービス		
LINDT&SPRUENGLI AG-REG	0.27	0.26	753	63,597	食品・飲料・タバコ		
GIVAUDAN-REG	11	10	1,096	92,541	素材		
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	194	188	4,407	372,042	保険		
NOVARTIS AG-REG SHS	2,686	2,567	14,210	1,199,688	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ABB LTD	3,014	2,705	5,602	472,955	資本財		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	926	859	12,252	1,034,326	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ADECCO SA-REG	189	159	970	81,897	商業・専門サービス		
HOLCIM LTD-REG	246	292	1,952	164,813	素材		
NESTLE SA-REGISTERED	4,649	4,222	23,391	1,974,751	食品・飲料・タバコ		
SONOVA HOLDING AG	94	78	936	79,082	ヘルスケア機器・サービス		
STRAUMANN HOLDING AG-REG	23	21	437	36,917	ヘルスケア機器・サービス		
CREDIT SUISSE GROUP AG	1,514	1,430	6,081	513,406	各種金融		
THE SWATCH GROUP AG-B	54	44	1,823	153,935	耐久消費財・アパレル		
SWISS REINSURANCE LTD	477	486	2,493	210,528	保険		
LONZA GROUP AG-REG	87	89	775	65,428	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
NOBEL BIOCARE HOLDING AG	262	256	413	34,915	ヘルスケア機器・サービス		
SWISS LIFE HOLDING AG	67	63	819	69,192	保険		
SYNTHES INC	51	61	757	63,910	ヘルスケア機器・サービス		
Schindler Holding AG	—	76	863	72,866	資本財		

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	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
	百株	百株	千スイスフラン	千円			
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	108	77	975	82,357			運輸
UBS AG-REG	4,193	4,595	7,987	674,265			各種金融
GEBERIT AG-REG	69	47	968	81,785			資本財
GAM HOLDING LTD	302	460	732	61,795			各種金融
Actelion Ltd	—	180	901	76,124			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIE FINANC RICHEMONT-A	556	636	3,332	281,347			耐久消費財・アパレル
JULIUS BAER GROUP LTD	302	306	1,236	104,388			各種金融
小 計	株 数 20,236	株 数 20,068	評 価 額 101,528	金 額 8,571,030			
	株 銘 柄 数 < 比 率 >	株 銘 柄 数 < 比 率 >	株 銘 柄 数 < 比 率 >	株 銘 柄 数 < 比 率 >			
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ				
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,597	1,999	10,628	128,497			銀行
HOLMEN AB-B SHARES	177	164	3,518	42,542			素材
SWEDISH MATCH AB	457	382	7,272	87,928			食品・飲料・タバコ
NORDEA BANK AB	3,977	4,118	29,799	360,270			銀行
SECURITAS AB-B SHS	717	674	4,989	60,325			商業・専門サービス
INVESTOR AB-B SHS	528	631	8,788	106,258			各種金融
HENNES & MAURITZ AB-B	606	1,239	28,795	348,142			小売
ASSA ABLOY AB-B	562	453	8,373	101,231			資本財
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	674	661	14,483	175,100			銀行
ERICSSON LM-B SHS	4,143	3,896	28,056	339,204			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIASONERA AB	3,144	2,922	16,497	199,460			電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	740	519	6,661	80,534			資本財
LUNDIN PETROLEUM AB	587	—	—	—			エネルギー
ALFA LAVAL AB	724	501	6,337	76,622			資本財
GETINGE AB-B SHS	448	372	5,537	66,949			ヘルスケア機器・サービス
Millicom International Cellular SA	—	123	7,694	93,024			電気通信サービス
TELE2 AB-B SHS	635	537	7,862	95,060			電気通信サービス
SSAB AB-A	444	410	4,056	49,045			素材
SKF AB-B SHARES	695	569	10,247	123,894			資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS	1,068	726	10,749	129,958			資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	399	661	8,895	107,542			資本財
VOLVO AB-A SHS	193	—	—	—			資本財
VOLVO AB-B SHS	1,670	1,481	14,475	175,004			資本財
SCANIA AB-B SHS	672	533	7,960	96,245			資本財
SANDVIK AB	1,015	1,282	14,567	176,123			資本財
SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	492	632	6,537	79,032			素材
小 計	株 数 26,374	株 数 25,498	評 価 額 272,787	金 額 3,297,998			
	株 銘 柄 数 < 比 率 >	株 銘 柄 数 < 比 率 >	株 銘 柄 数 < 比 率 >	株 銘 柄 数 < 比 率 >			
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ				
DNB NOR ASA	—	400	3,166	44,197			銀行
TELENOR ASA	1,186	1,126	10,871	151,766			電気通信サービス
STATOIL ASA	1,350	1,290	15,905	222,047			エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	159	265	8,474	118,300			素材
RENEEABLE ENERGY CORP AS	442	—	—	—			資本財
SEADRILL LTD	523	392	7,693	107,394			エネルギー
NORSK HYDRO ASA	1,324	1,604	6,173	86,186			素材
ORKLA ASA	1,161	1,285	7,285	101,711			資本財
小 計	株 数 6,146	株 数 6,362	評 価 額 59,570	金 額 831,603			
	株 銘 柄 数 < 比 率 >	株 銘 柄 数 < 比 率 >	株 銘 柄 数 < 比 率 >	株 銘 柄 数 < 比 率 >			
(デンマーク)			千デンマーククローネ				
CARLSBERG AS-B	138	144	8,165	123,305			食品・飲料・タバコ
A. P. MOLLER MAERSK	1	1	9,808	148,111			運輸
DANSKE BANK A/S	570	651	9,904	149,559			銀行
NOVOZYMES A/S-B SHARES	87	75	5,482	82,792			素材
TOPDANMARK A/S	34	—	—	—			保険
WILLIAM DEMANT HOLDING	77	66	2,686	40,569			ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	288	263	4,673	70,575			資本財
NOVO NORDISK A/S-B	572	557	31,335	473,173			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
H LUNDBECK A/S	133	—	—	—			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	株数	金額	期首(前期末)		当期		業種等
			株数	金額	株数	金額	
DSV A/S	441	412	千デンマーククローネ	千円	4,736	71,525	運輸
小計	2,346	2,172	76,795	1,159,612	—	<0.5%>	
(オーストラリア)	10	8	千豪ドル				
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	3,092	3,175	7,540	619,785			銀行
AMCOR LTD	425	1,279	868	71,384			素材
WESTPAC BANKING CORPORATION	3,871	3,662	8,112	666,732			銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	—	1,589	1,074	88,292			素材
TELSTRA CORP LTD	5,650	4,733	1,254	103,087			電気通信サービス
COCA-COLA AMATIL LIMITED	1,105	825	1,011	83,102			食品・飲料・タバコ
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	326	270	1,012	83,242			各種金融
BHP BILLITON LTD	4,360	4,097	18,293	1,503,533			素材
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	236	456	601	49,407			エネルギー
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	1,733	1,457	447	36,786			小売
COMPUTERSHARE LIMITED	950	832	864	71,078			ソフトウェア・サービス
CSL LIMITED	663	700	2,432	199,889			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRANSURBAN GROUP	1,907	1,670	895	73,605			運輸
COCHLEAR LIMITED	136	117	857	70,512			ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED	1,344	994	1,624	133,519			エネルギー
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	2,027	1,891	9,125	750,038			銀行
RIO TINTO LIMITED	608	519	4,519	371,490			素材
CSR LIMITED	3,596	3,720	665	54,731			資本財
ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,108	1,240	451	37,110			消費者サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	3,456	2,750	1,083	89,070			保険
ONESTEEL LIMITED	1,452	2,323	597	49,083			素材
FOSTER'S GROUP LTD	3,188	2,160	1,263	103,863			食品・飲料・タバコ
INTOLL GROUP	4,849	4,932	744	61,221			運輸
ORICA LTD	634	458	1,201	98,789			素材
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	294	259	859	70,667			資本財
LEND LEASE CORP LIMITED	967	1,072	760	62,525			不動産
BLUESCOPE STEEL LTD	1,987	3,058	585	48,132			素材
MAP GROUP	2,324	1,091	337	27,710			運輸
WORLEYPARSONS LTD	298	365	939	77,200			エネルギー
SUNCORP-METWAY LIMITED	1,614	1,762	1,676	137,785			保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,532	2,629	6,797	558,696			銀行
NEWCREST MINING LIMITED	505	995	4,319	355,013			素材
PALADIN ENERGY LIMITED	1,040	1,661	777	63,915			エネルギー
INCITEC PIVOT LTD	3,126	2,400	916	75,363			素材
TOLL HOLDINGS LIMITED	1,285	1,285	803	66,018			運輸
AMP LIMITED	2,412	2,778	1,453	119,433			保険
QANTAS AIRWAYS LIMITED	2,697	2,697	741	60,977			運輸
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	1,439	1,231	2,057	169,117			保険
SANTOS LTD	1,195	1,024	1,335	109,776			エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD	773	749	822	67,601			ヘルスケア機器・サービス
TABCORP HOLDINGS LIMITED	1,064	1,201	886	72,877			消費者サービス
WESFARMERS LIMITED	1,236	1,140	3,826	314,465			食品・生活必需品小売り
ALUMINA LTD	4,175	4,959	1,061	87,238			素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	703	665	2,862	235,243			エネルギー
WOOLWORTHS LIMITED	1,457	1,445	4,149	341,014			食品・生活必需品小売り
GOODMAN FIELDER LTD	2,492	3,931	613	50,407			食品・飲料・タバコ
AGL ENERGY LTD	835	623	991	81,480			公益事業
BRAMBLES LTD	1,581	1,581	1,043	85,777			商業・専門サービス
MACQUARIE GROUP LTD	461	462	1,672	137,460			各種金融
WESFARMERS LTD-PPS	331	276	940	77,311			食品・生活必需品小売り
CROWN LTD	1,101	871	767	63,045			消費者サービス
小計	86,663	88,081	110,544	9,085,619		<4.2%>	
(ニュージーランド)	50	51	千ニュージーランドドル				
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	3,706	3,004	642	40,769			運輸
CONTACT ENERGY LTD	1,141	1,074	639	40,530			公益事業

銘柄	期首(前期末)		当 期		末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		業 種 等		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
FLETCHER BUILDING LTD	1,084	1,084	883	56,032	素材		
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	2,883	2,883	611	38,757	電気通信サービス		
小 計	8,815	8,046	2,777	176,090			
	株 数 金 額	株 数 金 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	業 種 等		
(香港)	4	4	ニ	< 0.1% >			
HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,620	3,020	11,325	119,478	不動産		
BANK OF EAST ASIA	2,806	2,232	7,735	81,607	銀行		
CLP HOLDINGS LIMITED	2,375	2,280	14,535	153,344	公益事業		
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	1,700	1,660	21,231	223,991	不動産		
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	1,360	1,220	4,148	43,761	公益事業		
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,279	1,308	25,401	267,984	各種金融		
LI & FUNG LTD	3,100	2,760	11,702	123,460	小売		
MTR CORPORATION	2,590	2,630	8,074	85,181	運輸		
ESPRIT HOLDINGS LIMITED	1,276	1,380	5,991	63,209	小売		
HANG SENG BANK	964	778	9,514	100,382	銀行		
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,560	1,630	9,600	101,287	不動産		
HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	1,450	1,505	7,645	80,658	公益事業		
THE WHARF (HOLDINGS)	2,430	1,970	11,169	117,842	不動産		
HONG KONG & CHINA GAS	6,555	5,960	11,372	119,981	公益事業		
HUTCHISON WHAMPOA	2,570	2,670	22,281	235,066	資本財		
HYSAN DEVELOPMENT CO	1,910	1,610	5,449	57,495	不動産		
KERRY PROPERTIES LTD	1,530	1,445	6,618	69,820	不動産		
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	4,870	4,620	13,190	139,155	銀行		
NWS HOLDINGS LTD	2,350	2,350	4,469	47,155	資本財		
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	2,000	1,585	4,541	47,907	耐久消費財・アパレル		
NEW WORLD DEVELOPMENT	2,050	4,780	8,212	86,637	不動産		
SINO LAND CO	3,720	3,720	6,413	67,660	不動産		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,950	1,800	25,758	271,746	不動産		
SWIRE PACIFIC LTD A	1,185	1,015	12,454	131,390	不動産		
TELEVISION BROADCASTS LTD	980	880	3,564	37,600	メディア		
WING HANG BANK LIMITED	530	475	4,747	50,087	銀行		
小 計	58,710	57,284	277,146	2,923,895			
	株 数 金 額	株 数 金 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	業 種 等		
(シンガポール)	26	26	ニ	< 1.3% >			
SINGAPORE TECH ENGINEERING	2,880	3,160	1,096	69,563	資本財		
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	—	10,990	846	53,684	食品・飲料・タバコ		
DBS GROUP HOLDINGS LTD	2,290	2,000	2,824	179,154	銀行		
CITY DEVELOPMENTS	1,100	990	1,316	83,531	不動産		
SEMBCORP MARINE LTD	2,368	1,938	994	63,071	資本財		
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	350	240	931	59,075	小売		
SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,600	1,510	1,386	87,939	各種金融		
CAPITALAND LIMITED	4,180	3,440	1,355	85,984	不動産		
GENTING SINGAPORE PLC	—	9,280	2,180	138,349	消費サービス		
COMFORTDELGRO CORP LTD	5,170	4,410	657	41,685	運輸		
SINGAPORE AIRLINES LTD	430	760	1,240	78,685	運輸		
UNITED OVERSEAS BANK	1,390	1,520	2,821	178,971	銀行		
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	3,260	2,720	1,145	72,646	メディア		
NOBLE GROUP LTD	—	5,200	1,107	70,266	資本財		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	9,217	8,687	2,884	182,966	電気通信サービス		
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	140	2,140	1,050	66,658	資本財		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	3,340	2,900	2,868	181,952	銀行		
COSCO CORP SINGAPORE LTD	4,220	3,500	756	47,960	資本財		
WILMAR INTERNATIONAL LTD	—	1,000	688	43,646	食品・飲料・タバコ		
KEPPEL CORP LTD	1,830	1,360	1,466	93,008	資本財		
小 計	43,765	67,745	29,615	1,878,803			
	株 数 金 額	株 数 金 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	業 種 等		
(イスラエル)	16	20	ニ	< 0.9% >			
BANK HAPOLIM BM	—	1,642	2,843	63,779	銀行		
BANK LEUMI LE-ISRAEL	—	1,818	3,179	71,313	銀行		
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	—	2,843	2,721	61,034	電気通信サービス		

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	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
ISRAEL CHEMICALS LTD NICE SYSTEMS LTD	百株 —	百株 669 132	千イスラエルシェケル 3,761 1,593	千円 84,368 35,744	—	—	素材 ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	7,107 5	14,099 —	316,240 < 0.1% >	—	—	
合 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	1,255,338 979	1,307,578 1,003	211,498,344 < 96.9% >	—	—	

(注1) 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。

(注2) 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です。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、株数が単位未満の場合は小数で記載しております。

(注4) ー印は組み入れなしです。

(2) 外国投資信託証券

	期首(前期末)		当 期		末		組 入 比 率
	口 数	口 数	評 価 額		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円	—	—	%
AMB PROPERTY CORP	—	33	971	79,424	—	—	0.0
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	—	70	1,253	102,525	—	—	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	15	13	1,391	113,830	—	—	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	11	19	1,700	139,093	—	—	0.1
DUKE REALTY CORP	56	56	699	57,169	—	—	0.0
EQUITY RESIDENTIAL	47	40	1,946	159,167	—	—	0.1
FEDERAL REALTY INVS TRUST	12	11	924	75,567	—	—	0.0
HCP INC	43	41	1,425	116,597	—	—	0.1
HEALTH CARE REIT INC	11	17	823	67,358	—	—	0.0
KIMCO REALTY CORP	69	61	1,076	88,044	—	—	0.0
PLUM CREEK TIMBER CO INC (REIT)	30	28	1,114	91,110	—	—	0.0
PUBLIC STORAGE	20	21	2,142	175,192	—	—	0.1
REGENCY CENTERS CORP	8	17	761	62,255	—	—	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	31	39	3,983	325,808	—	—	0.1
VENTAS INC	26	25	1,363	111,532	—	—	0.1
VORNADO REALTY TRUST	26	23	1,985	162,397	—	—	0.1
小 計	証 券 数 銘 柄 数 < 比 率 >	411 14	522 16	23,564 —	1,927,075 < 0.9% >	—	—
(カナダ)	—	—	千カナダドル	—	—	—	—
CANADIAN OIL SANDS TRUST	41	31	845	68,660	—	—	0.0
ENERPLUS RESOURCES FUND	34	34	993	80,707	—	—	0.0
PENN WEST ENERGY TRUST	58	57	1,334	108,429	—	—	0.0
PROVIDENT ENERGY TRUST	79	72	572	46,533	—	—	0.0
小 計	証 券 数 銘 柄 数 < 比 率 >	213 4	196 4	3,746 —	304,331 < 0.1% >	—	—
(ユーロ…フランス)	—	—	千ユーロ	—	—	—	—
UNIBAIL-RODAMCO SE	12	11	1,681	189,274	—	—	0.1
KLEPTERRE	20	19	544	61,279	—	—	0.0
小 計	証 券 数 銘 柄 数 < 比 率 >	32 2	31 2	2,226 —	250,553 < 0.1% >	—	—
(ユーロ…オランダ)	—	—	—	—	—	—	—
CORIO NV	11	11	579	65,188	—	—	0.0
小 計	証 券 数 銘 柄 数 < 比 率 >	11 1	11 1	579 —	65,188 < 0.0% >	—	—
ユ ー ロ 計	証 券 数 銘 柄 数 < 比 率 >	43 3	42 3	2,805 —	315,741 < 0.1% >	—	—
(イギリス)	—	—	千英ポンド	—	—	—	—
BRITISH LAND CO PLC	131	98	501	65,637	—	—	0.0
HAMMERSON PLC	144	138	594	77,887	—	—	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	95	95	664	87,090	—	—	0.0

	期首 (前期末)		当 期		期 末	
	口 数	口 数	評 価 額		組 入 比 率	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
SEGRO PLC	千口	千口	千英ポンド	千円	%	
	100	156	472	61,930	0.0	
小 計	472	487	2,233	292,546		
	4	4	—	<0.1%>		
(オーストラリア)			千豪ドル			
MIRVAC GROUP	483	614	789	64,925	0.0	
CFS RETAIL PROPERTY TRUST	432	380	682	56,064	0.0	
GPT GROUP	—	219	611	50,270	0.0	
STOCKLAND	303	316	1,178	96,895	0.0	
WESTFIELD GROUP	272	261	3,145	258,558	0.1	
GOODMAN GROUP	—	864	553	45,488	0.0	
小 計	1,492	2,655	6,961	572,203		
	4	6	—	<0.3%>		
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	393	299	7,460	78,703	0.0	
小 計	393	299	7,460	78,703		
	1	1	—	<0.0%>		
(シンガポール)			千シンガポールドル			
CAPITAMALL TRUST	360	484	968	61,409	0.0	
小 計	360	484	968	61,409		
	1	1	—	<0.0%>		
合 計	3,386	4,687	—	3,552,011		
	31	35	—	<1.6%>		

(注1) 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。

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 単位未満は切り捨てています。

(注4) -印は組み入れなしです。

(注5) 銘柄ID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。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

			当 期		期 末	
			買 建 額	売 建 額	評 価 損 益	評 価 損 益
外 国 株 式 先 物 取 引		百万円	百万円	百万円	百万円	
	S&P 500 FUT	1,782	—	113		
	DJ EU STX 50	564	—	15		
	FTSE 100 IDX	576	—	27		

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 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。

(注3) -印は組み入れなしです。

■ 投資信託財産の構成

(2010年11月10日現在)

項 目	当 期		期 末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
株 式	千円	%		
投 資 証 券	211,498,344	96.9		
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,552,011	1.6		
投 資 信 託 財 産 総 額	3,317,688	1.5		
	218,368,043	100.0		

(注1) 評価額の単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末における外貨建純資産 (218,121,683千円) の投資信託財産総額 (218,368,043千円) に対する比率は99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、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。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=81.78円、1カナダドル=81.24円、1ユーロ=112.53円、1英ポンド=131.01円、1スイスフラン=84.42円、1スウェーデンクローネ=12.09円、1ノルウェークローネ=13.96円、1デンマーククローネ=15.10円、1豪ドル=82.19円、1ニュージーランドドル=63.41円、1香港ドル=10.55円、1シンガポールドル=63.44円、1イスラエルシェケル=22.43円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2010年11月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	218,368,043,329円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,308,063,222
株 式(評価額)	211,498,344,258
投 資 証 券(評価額)	3,552,011,931
未 収 入 金	158,876,585
未 収 配 当 金	275,097,489
未 収 利 息	493
差 入 委 託 証 拠 金	1,575,649,351
(B) 負 債	184,849,171
未 払 解 約 金	184,849,171
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	218,183,194,158
元 本	252,555,570,558
次 期 繰 越 損 益 金	△ 34,372,376,400
(D) 受 益 権 総 口 数	252,555,570,558口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	8,639円

(注1) 当親ファンドの期首元本額は263,533,677,492円、期中追加設定元本額は74,879,160,487円、期中一部解約元本額は85,857,267,421円です。

<元本の内訳>

L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド (慎 重 型)	437,191円
L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド (安 定 重 視 型)	786,439円
L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド (バ ラ ン ス 型)	539,670円
L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド (成 長 重 視 型)	1,266,243円
L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド (積 極 型)	435,744円
東 京 海 上 セ レ ク シ ョ ン ・ 外 国 株 式 イ ン デ ッ ク ス	77,493,554円
TMA 外 国 株 式 イ ン デ ッ ク ス V A (適 格 機 関 投 資 家 限 定)	97,404,708,260円
TMA 世 界 バ ラ ン ス フ ァ ン ド 5 5 V A (適 格 機 関 投 資 家 限 定)	23,771,303,917円
TMA 世 界 バ ラ ン ス フ ァ ン ド 3 5 V A (適 格 機 関 投 資 家 限 定)	131,298,599,540円

(注2) 当期末の1口当たり純資産額は0.8639円です。

(注3) 元本の欠損は34,372,376,400円です。

■損益の状況

当期(自2009年11月11日 至2010年11月10日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,923,842,884円
受 取 配 当 金	4,911,463,684
受 取 利 息	4,444,277
そ の 他 収 益 金	7,934,923
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 615,183,572
売 買 益	28,865,962,591
売 買 損	△29,481,146,163
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	785,260,902
取 引 益	1,299,278,614
取 引 損	△ 514,017,712
(D) 信 託 報 酬 等	△ 52,523,263
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	5,041,396,951
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	△37,214,544,250
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△13,858,148,897
(H) 解 約 差 損 益 金	11,658,919,796
(I) 計 (E+F+G+H)	△34,372,376,400
次 期 繰 越 損 益 金(I)	△34,372,376,400

(注1) 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。

(注2) 損益の状況の中で(D)信託報酬等には消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 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。

(注4) 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。

TMA外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第5期（決算日 2010年11月10日）

（計算期間 2009年11月11日～2010年11月10日）

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント投信

■設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 騰 落 中 率		ベンチマーク	期 騰 落 中 率		債 組 入 比	券 率	純 資 産
（設 定 日） 2005年7月29日	円 10,000		% —	170.812		% —	% —		百万円 5,000
1期（2006年11月10日）	11,156		11.6	191.213		11.9	98.4		82,530
2期（2007年11月12日）	11,846		6.2	203.188		6.3	98.3		164,681
3期（2008年11月10日）	10,152		△14.3	174.416		△14.2	98.1		267,276
4期（2009年11月10日）	10,757		6.0	185.112		6.1	98.1		336,145
5期（2010年11月10日）	9,858		△8.4	169.387		△8.5	98.3		318,547

（注1）設定日の基準価額は、設定時の価額です。

（注2）設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		ベンチマーク	騰 落 率		債 組 入 比	券 率
（期 首） 2009年11月10日	円 10,757		% —	185.112		% —	% 98.1	
11月末	10,477		△2.6	180.238		△2.6	98.0	
12月末	10,673		△0.8	183.652		△0.8	98.5	
2010年1月末	10,315		△4.1	177.443		△4.1	97.7	
2月末	10,169		△5.5	175.013		△5.5	97.9	
3月末	10,548		△1.9	181.535		△1.9	97.1	
4月末	10,610		△1.4	182.723		△1.3	97.2	
5月末	10,051		△6.6	173.010		△6.5	97.6	
6月末	9,788		△9.0	168.240		△9.1	97.9	
7月末	9,985		△7.2	171.747		△7.2	97.9	
8月末	9,841		△8.5	169.086		△8.7	97.5	
9月末	10,098		△6.1	173.648		△6.2	97.9	
10月末	9,789		△9.0	168.353		△9.1	97.6	
（期 末） 2010年11月10日	9,858		△8.4	169.387		△8.5	98.3	

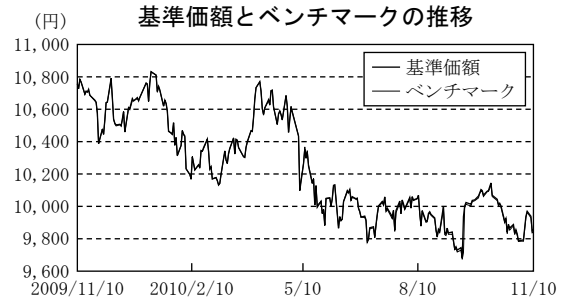
（注）騰落率は期首比です。

ベンチマークは、シティグループ世界国債インデックス（除く日本/円ヘッジなし・円ベース）です。基準価額は対顧客電信売買相場の仲値を用いて計算しているため、シティグループ世界国債インデックス（除く日本/円ヘッジなし・円ベース）（国内投信用）を使用しています。シティグループ世界国債インデックス（除く日本/円ヘッジなし・円ベース）および（除く日本/円ヘッジなし・円ベース）（国内投信用）とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが算出する、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回り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、シティグループ・グローバル・マーケット・インクの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが有しています。

■当期中の運用経過と今後の方針（2009年11月11日から2010年11月10日まで）

1. 基準価額の推移と主な変動要因

- 期首（2009/11/10）基準価額：10,757円
 - 期末（2010/11/10）基準価額：9,858円
 - 長期金利（10年固定利付国債の利回り）は米国、欧州（ドイツ）ともに低下しました。
 - 米国：期首3.5% 期末2.6%（▲0.9%）
 - 欧州：期首3.3% 期末2.4%（▲0.8%）
 - 為替は、ドル、ユーロ共に下落しました。
 - ドル：期首89.99円 期末81.78円（▲8.21円）
 - ユーロ：期首134.90円 期末112.53円（▲22.37円）
- 金利は低下（債券価格は上昇）したものの、為替市場でドル、ユーロが対円で下落したこと等を背景に、ファンドの基準価額は期首比8.4%下落しました。



（注）ベンチマークは、期首（2009年11月10日）の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

2. 当期の投資環境

【債券市場動向】

米国長期金利は、景気指標の一時的な不振や2009年11月のドバイ政府系持株会社ドバイワールドの債務繰り延べ報道をきっかけに3.2%近辺まで低下する局面もありましたが、12月以降、米国雇用関連指標の改善が続いたことや個人消費が予想以上に堅調だったこと、それらに伴いFRB（米連邦準備制度理事会）による利上げ観測が高まったこと等を背景に2010年4月初めには4.0%近辺まで上昇しました。しかし、その後ユーロ圏内の財政不安が深刻化し、投資家のリスク回避姿勢が強まったことにより金利は低下に転じました。6月以降は住宅や雇用等の経済指標が予想を下回ったため景気減速懸念が高まり金利はさらに低下し、一時2.5%を割り込みました。ドイツ長期金利は、欧州景気の相対的な遅れ感やECB（欧州中央銀行）による低金利政策の継続に加えて、ギリシャの財政懸念に伴う欧州周辺国債売り・ドイツ国債買いの動きから期初の3.3%程度から2.4%程度まで低下して期を終えました。

【為替市場動向】

為替市場では、ギリシャの財政危機や、ギリシャを含めたユーロ圏周辺国に多額の債権を保有する一部欧州金融機関の資金繰り懸念等を背景にリスク回避的な動きが強まり、円高ドル安・ユーロ安が進展しました。

2010年5月半ばのユーロ圏、IMF（国際通貨基金）によるギリシャ支援、7月下旬の欧州金融機関に対するストレステスト（資産査定）を経て金融市場のリスク回避的な動きが一旦は和らぐ局面もありましたが、8月以降は米国景気の減速懸念が高まったこと等を背景に円高の動きが再度進展、9月15日に日本の通貨当局による為替介入が実施されたことからドル円レートは若干反発しました。ユーロ円レートは、その後112円から115円前後の範囲で推移しましたが、対ドルでは円高ドル安が進み、一時1ドル＝80円台と15年ぶりの円高水準を記録しました。

3. 当期の運用経過と基準価額

当ファンドは、ベンチマークであるシティグループ世界国債インデックス（除く日本/円ヘッジなし・円ベース）に連動する収益率を上げることを目標として運用しています。

当ファンドの基準価額は、期首の10,757円から期末は9,858円となりました。ファンドの騰落率は▲8.4%となり、ベンチマークの騰落率（▲8.5%）とほぼ同水準となりました。

4. 今後の運用方針

今後も引き続き、ベンチマークに対する高い連動率を維持するよう運用を行う方針です。

■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 保 管 費 用 等	1円
合 計	1

(注1) (a)保管費用等は、期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■ 期中の売買及び取引の状況（2009年11月11日から2010年11月10日まで）

公社債

			買 付 額	売 付 額	
外	ア	メ	千米ドル	千米ドル	
		リ	642,814	308,799	
		カ	国債証券	国債証券	
	カ	ナ	千カナダドル	千カナダドル	
		ダ	30,336	29,867	
	メ	キ	千メキシコペソ	千メキシコペソ	
		シ	451,265	—	
	ユ	ド	イ	千ユーロ	千ユーロ
			ツ	83,277	100,899
		イ	国債証券	国債証券	
		タ	53,492	74,963	
		ラ	国債証券	国債証券	
		ン	51,570	50,576	
		ス	国債証券	国債証券	
		オ	7,101	11,302	
		ラ	国債証券	国債証券	
		ン	37,220	34,114	
	ロ	ベ	ル	国債証券	国債証券
			ギ	19,116	15,793
オ		国債証券	国債証券		
ー		8,783	6,973		
ス		国債証券	国債証券		
ト		—	(5,000)		
リ		2,172	—		
ン		—	(220)		
ド		国債証券	国債証券		
ア		7,666	3,083		
国	ギ	リ	国債証券	国債証券	
		シ	2,461	52,349	
	ポ	国債証券	国債証券		
	ル	1,883	5,238		
	イ	千英ポンド	千英ポンド		
	ギ	51,499	43,533		
	ス	イ	千スイスフラン	千スイスフラン	
		ス	—	4,181	
	ス	ウ	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ	
		エ	1,965	24,244	
ノ	ル	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	ウ	17,278	22,140		
デ	ン	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	マ	20,960	14,530		
ポ	ー	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	ラ	28,435	28,099		
オ	ー	千豪ドル	千豪ドル		
	ス	12,395	3,728		
シ	ン	千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	ガ	2,925	4,311		
マ	レ	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	ー	10,462	18,749		

(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) 単位未満は切り捨てています。

(注3) () 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。

■ 利害関係人との取引状況等（2009年11月11日から2010年11月10日まで）

期中における利害関係人との取引はありません。

(注) 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（2010年11月10日現在）

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期			末				
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千米ドル 1,381,720	千米ドル 1,537,941	千円 125,772,831	% 39.5	% —	% 17.8	% 15.2	% 6.5
カ ナ ダ	千カナダドル 94,940	千カナダドル 106,800	8,676,444	2.7	—	1.4	0.9	0.4
メ キ シ コ	千メキシコペソ 408,000	千メキシコペソ 450,847	2,998,135	0.9	—	0.5	0.2	0.3
ユ ー ロ	千ユーロ 240,900	千ユーロ 271,529	30,555,203	9.6	—	5.0	3.5	1.1
ド イ ツ	269,750	282,051	31,739,268	10.0	—	6.2	2.8	1.0
イ タ リ ア	239,730	266,308	29,967,672	9.4	—	5.4	3.0	1.1
フ ラ ン ス	60,890	69,261	7,793,973	2.4	—	1.4	0.7	0.3
オ ラ ン ダ	116,300	117,958	13,273,845	4.2	—	2.3	1.2	0.7
ス ペ イ ン	70,930	77,493	8,720,364	2.7	—	1.4	1.1	0.2
オ ー ス ト リ ア	46,220	51,749	5,823,352	1.8	—	1.2	0.5	0.1
フ ィ ン ラ ン ド	16,220	17,932	2,017,964	0.6	—	0.3	0.2	0.1
ア イ ル ラ ン ド	26,800	23,259	2,617,428	0.8	—	0.5	0.4	—
ポ ル ト ガ ル	28,070	24,775	2,788,025	0.9	—	0.6	0.2	0.1
イ ギ リ ス	千英ポンド 169,190	千英ポンド 188,683	24,719,415	7.8	—	5.2	1.9	0.7
ス イ ス	千スイスフラン 16,720	千スイスフラン 19,123	1,614,423	0.5	—	0.3	0.1	0.1
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローネ 149,270	千スウェーデンクローネ 164,900	1,993,644	0.6	—	0.4	0.1	0.1
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 50,900	千ノルウェークローネ 55,899	780,352	0.2	—	0.1	0.1	—
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 161,230	千デンマーククローネ 188,355	2,844,161	0.9	—	0.6	0.2	0.1
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 97,380	千ポーランドズロチ 97,398	2,804,090	0.9	—	0.3	0.4	0.1
オ ー ス ト ラ リ ア	千豪ドル 36,270	千豪ドル 37,235	3,060,378	1.0	—	0.4	0.4	0.2
シ ン ガ ポ ー ル	千シンガポールドル 16,650	千シンガポールドル 18,211	1,155,345	0.4	—	0.2	0.1	0.0
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 57,900	千マレーシアリンギット 59,164	1,561,938	0.5	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	313,278,261	98.3	—	51.7	33.3	13.4

(注1) 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。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 単位未満は切り捨てています。

(注4) —印は組み入れなしです。

(注5) 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) 詳細開示

外国(外貨建) 公社債銘柄別

銘柄	名	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	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	T 0 5/8 07/31/12	0.625	26,000	26,077	2,132,592	2012/7/31
	T 1 1/8 01/15/12	1.125	22,500	22,707	1,857,012	2012/1/15
	T 1 1/8 12/15/11	1.125	20,520	20,701	1,692,940	2011/12/15
	T 1 3/4 01/31/14	1.75	19,000	19,635	1,605,775	2014/1/31
	T 1 3/4 08/15/12	1.75	15,500	15,856	1,296,704	2012/8/15
	T 1 3/8 03/15/12	1.375	19,000	19,250	1,574,335	2012/3/15
	T 1 3/8 05/15/12	1.375	19,800	20,083	1,642,394	2012/5/15
	T 1 3/8 11/15/12	1.375	27,700	28,204	2,306,541	2012/11/15
	T 1 7/8 06/15/12	1.875	17,000	17,391	1,422,301	2012/6/15
	T 1 7/8 06/30/15	1.875	26,000	26,822	2,193,556	2015/6/30
	T 1 7/8 08/31/17	1.875	5,000	5,015	410,145	2017/8/31
	T 2 1/2 03/31/13	2.5	27,000	28,282	2,312,942	2013/3/31
	T 2 1/2 06/30/17	2.5	22,000	22,979	1,879,278	2017/6/30
	T 2 3/4 02/15/19	2.75	19,100	19,831	1,621,793	2019/2/15
	T 2 3/4 02/28/13	2.75	20,000	21,026	1,719,552	2013/2/28
	T 2 3/8 09/30/14	2.375	15,000	15,850	1,296,276	2014/9/30
	T 2 3/8 10/31/14	2.375	42,000	44,385	3,629,843	2014/10/31
	T 2 5/8 07/31/14	2.625	22,500	23,967	1,960,084	2014/7/31
	T 2 7/8 01/31/13	2.875	10,450	11,010	900,402	2013/1/31
	T 2.625 06/30/14	2.625	21,000	22,358	1,828,473	2014/6/30
	T 3 1/2 02/15/18	3.5	12,270	13,554	1,108,488	2018/2/15
	T 3 1/2 05/15/20	3.5	5,000	5,384	440,334	2020/5/15
	T 3 1/4 07/31/16	3.25	29,000	31,841	2,603,964	2016/7/31
	T 3 1/8 04/30/13	3.125	16,000	17,032	1,392,917	2013/4/30
	T 3 1/8 10/31/16	3.125	13,000	14,159	1,157,992	2016/10/31
	T 3 3/8 06/30/13	3.375	31,000	33,312	2,724,328	2013/6/30
	T 3 3/8 07/31/13	3.375	18,400	19,808	1,619,959	2013/7/31
	T 3 3/8 11/15/19	3.375	44,500	47,823	3,911,013	2019/11/15
	T 3 3/8 11/30/12	3.375	26,000	27,582	2,255,684	2012/11/30
	T 3 5/8 12/31/12	3.625	17,000	18,159	1,485,080	2012/12/31
	T 3 7/8 02/15/13	3.875	12,010	12,927	1,057,222	2013/2/15
	T 3 7/8 05/15/18	3.875	19,900	22,487	1,838,986	2018/5/15
	T 3 7/8 08/15/40	3.875	7,700	7,211	589,759	2040/8/15
	T 3 7/8 10/31/12	3.875	11,930	12,740	1,041,948	2012/10/31
	T 3.75 11/15/18	3.75	43,000	48,059	3,930,282	2018/11/15
	T 4 02/15/14	4.0	19,420	21,490	1,757,530	2014/2/15
	T 4 02/15/15	4.0	30,810	34,632	2,832,234	2015/2/15
	T 4 1/2 02/15/16	4.5	13,740	15,962	1,305,373	2016/2/15
	T 4 1/2 02/15/36	4.5	17,660	18,692	1,528,632	2036/2/15
	T 4 1/2 04/30/12	4.5	12,000	12,725	1,040,701	2012/4/30
T 4 1/2 05/15/38	4.5	15,620	16,425	1,343,269	2038/5/15	
T 4 1/2 11/15/15	4.5	20,860	24,207	1,979,679	2015/11/15	
T 4 1/4 05/15/39	4.25	28,000	28,074	2,295,922	2039/5/15	
T 4 1/4 08/15/13	4.25	20,730	22,822	1,866,418	2013/8/15	
T 4 1/4 08/15/14	4.25	21,260	23,940	1,957,874	2014/8/15	
T 4 1/4 08/15/15	4.25	19,930	22,807	1,865,188	2015/8/15	
T 4 1/4 09/30/12	4.25	17,000	18,237	1,491,488	2012/9/30	
T 4 1/4 11/15/13	4.25	22,500	24,936	2,039,292	2013/11/15	
T 4 1/4 11/15/14	4.25	20,740	23,471	1,919,527	2014/11/15	
T 4 1/4 11/15/17	4.25	7,000	8,688	661,459	2017/11/15	

銘柄	名	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	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	T 4 1/8 05/15/15	4.125	17,500	19,857	1,623,908	2015/5/15
	T 4 11/15/12	4.0	11,880	12,733	1,041,376	2012/11/15
	T 4 3/4 05/15/14	4.75	14,000	15,951	1,304,493	2014/5/15
	T 4 3/4 05/31/12	4.75	12,800	13,668	1,117,769	2012/5/31
	T 4 3/4 08/15/17	4.75	11,660	13,846	1,132,346	2017/8/15
	T 4 3/8 08/15/12	4.375	18,800	20,116	1,645,086	2012/8/15
	T 4 3/8 11/15/39	4.375	26,100	26,711	2,184,484	2039/11/15
	T 4 5/8 02/15/17	4.625	20,000	23,578	1,928,219	2017/2/15
	T 4 5/8 11/15/16	4.625	19,800	23,329	1,907,924	2016/11/15
	T 4 7/8 02/15/12	4.875	18,680	19,730	1,613,580	2012/2/15
	T 4.625 12/31/11	4.625	12,500	13,119	1,072,883	2011/12/31
	T 5 05/15/37	5.0	11,350	12,931	1,057,571	2037/5/15
	T 5 1/2 08/15/28	5.5	6,700	8,259	675,490	2028/8/15
	T 5 1/4 02/15/29	5.25	10,190	12,209	998,508	2029/2/15
	T 5 3/8 02/15/31	5.375	4,980	6,039	493,871	2031/2/15
	T 6 1/2 11/15/26	6.5	2,050	2,796	228,709	2026/11/15
	T 6 1/4 05/15/30	6.25	4,310	5,769	471,844	2030/5/15
	T 6 1/4 08/15/23	6.25	13,600	18,009	1,472,806	2023/8/15
	T 6 1/8 11/15/27	6.125	8,790	11,575	946,630	2027/11/15
	T 7 1/2 11/15/16	7.5	8,670	11,650	952,762	2016/11/15
T 7 1/4 05/15/16	7.25	31,020	40,662	3,325,408	2016/5/15	
T 7 1/8 02/15/23	7.125	8,530	12,065	986,753	2023/2/15	
T 8 1/8 08/15/19	8.125	22,060	32,248	2,637,320	2019/8/15	
T 8 11/15/21	8.0	10,700	15,948	1,304,228	2021/11/15	
T 8 3/4 05/15/17	8.75	25,500	36,664	2,998,399	2017/5/15	
T 8 3/4 08/15/20	8.75	18,500	28,429	2,324,947	2020/8/15	
小計		—	—	—	125,772,831	—
(カナダ)			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	CAN 1 3/4 03/01/13	1.75	6,600	6,615	537,417	2013/3/1
	CAN 2 09/01/12	2.0	8,000	8,068	655,444	2012/9/1
	CAN 2 12/01/14	2.0	5,300	5,300	430,597	2014/12/1
	CAN 3 3/4 06/01/19	3.75	7,500	8,043	653,413	2019/6/1
	CAN 4 06/01/16	4.0	5,300	5,767	468,544	2016/6/1
	CAN 4 06/01/17	4.0	3,400	3,710	301,462	2017/6/1
	CAN 4 06/01/41	4.0	600	660	53,676	2041/6/1
	CAN 4 1/2 06/01/15	4.5	3,980	4,397	357,217	2015/6/1
	CAN 4 1/4 06/01/18	4.25	7,250	8,067	655,369	2018/6/1
	CAN 5 06/01/14	5.0	10,850	11,999	974,844	2014/6/1
	CAN 5 06/01/37	5.0	8,410	10,470	850,619	2037/6/1
	CAN 5 1/4 06/01/12	5.25	8,200	8,673	704,605	2012/6/1
	CAN 5 1/4 06/01/13	5.25	7,200	7,843	637,185	2013/6/1
	CAN 5 3/4 06/01/33	5.75	3,800	5,096	414,072	2033/6/1
CAN 5.75 06/01/29	5.75	5,910	7,746	629,313	2029/6/1	
CAN 9 06/01/25	9.0	2,640	4,340	352,661	2025/6/1	
小計		—	—	—	8,676,444	—
(メキシコ)			千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券	MBONO 10 12/05/24	10.0	32,000	42,616	283,398	2024/12/5
	MBONO 6 06/18/15	6.0	70,000	71,927	478,319	2015/6/18
	MBONO 7 1/2 06/21/12	7.5	140,000	146,775	976,056	2012/6/21
	MBONO 7 1/4 12/15/16	7.25	30,000	32,652	217,139	2016/12/15
	MBONO 8 06/11/20	8.0	50,000	57,019	379,182	2020/6/11
	MBONO 8 1/2 05/31/29	8.5	40,000	46,673	310,379	2029/5/31
MBONO 8 1/2 11/18/38	8.5	35,000	40,343	268,281	2038/11/18	

銘柄	名	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	
(メキシコ)		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券					
	MBONO 8 1/2 12/13/18	8.5	11,000	12,838	85,376	2018/12/13
小計		—	—	—	2,998,135	—
(ユーロ)			千ユーロ	千ユーロ		
(ドイツ)						
	国債証券					
	DBR 3 1/2 07/04/19	3.5	4,000	4,387	493,691	2019/7/4
	DBR 3 1/4 01/04/20	3.25	14,000	15,059	1,694,679	2020/1/4
	DBR 3 1/4 07/04/42	3.25	3,000	3,228	363,246	2042/7/4
	DBR 3 3/4 01/04/15	3.75	18,460	20,234	2,277,036	2015/1/4
	DBR 3 3/4 01/04/17	3.75	9,750	10,843	1,220,214	2017/1/4
	DBR 3 3/4 01/04/19	3.75	17,730	19,756	2,223,203	2019/1/4
	DBR 3 3/4 07/04/13	3.75	4,000	4,284	482,101	2013/7/4
	DBR 4 01/04/18	4.0	11,240	12,713	1,430,657	2018/1/4
	DBR 4 01/04/37	4.0	8,230	9,762	1,098,565	2037/1/4
	DBR 4 07/04/16	4.0	6,500	7,297	821,156	2016/7/4
	DBR 4 1/2 01/04/13	4.5	10,500	11,293	1,270,832	2013/1/4
	DBR 4 1/4 01/04/14	4.25	12,780	14,007	1,576,266	2014/1/4
	DBR 4 1/4 07/04/14	4.25	14,170	15,676	1,764,130	2014/7/4
	DBR 4 3/4 07/04/28	4.75	5,880	7,302	821,735	2028/7/4
	DBR 4 3/4 07/04/34	4.75	9,100	11,809	1,328,874	2034/7/4
	DBR 4.25 07/04/17	4.25	10,800	12,368	1,391,789	2017/7/4
	DBR 4.25 07/04/39	4.25	7,500	9,436	1,061,889	2039/7/4
	DBR 5 07/04/12	5.0	15,440	16,468	1,853,178	2012/7/4
	DBR 5 5/8 01/04/28	5.625	2,600	3,529	397,203	2028/1/4
	DBR 5.5 01/04/31	5.5	1,950	2,672	300,777	2031/1/4
	DBR 6 1/4 01/04/30	6.25	3,050	4,514	507,960	2030/1/4
	DBR 6.25 01/04/24	6.25	3,000	4,182	470,667	2024/1/4
	DBR 6.5 07/04/27	6.5	2,350	3,451	388,417	2027/7/4
	OBL 1 3/4 10/09/15	1.75	7,000	7,078	796,532	2015/10/9
	OBL 3 1/2 04/12/13	3.5	13,000	13,791	1,551,906	2013/4/12
	OBL 4 04/13/12	4.0	14,370	14,992	1,687,139	2012/4/13
	OBL 4 10/13 #153	4.0	10,500	11,386	1,281,348	2013/10/11
(イタリア)						
	国債証券					
	BTPS 3 3/4 08/01/15	3.75	14,240	14,728	1,657,390	2015/8/1
	BTPS 3 3/4 08/01/16	3.75	13,480	13,897	1,563,928	2016/8/1
	BTPS 3 3/4 08/01/21	3.75	7,950	7,831	881,283	2021/8/1
	BTPS 3 3/4 12/13	3.75	10,800	11,183	1,258,468	2013/12/15
	BTPS 4 02/01/37	4.0	15,660	13,945	1,569,256	2037/2/1
	BTPS 4 04/15/12	4.0	6,000	6,163	693,585	2012/4/15
	BTPS 4 1/2 02/01/18	4.5	8,900	9,460	1,064,612	2018/2/1
	BTPS 4 1/2 02/01/20	4.5	10,970	11,494	1,293,461	2020/2/1
	BTPS 4 1/2 08/18	4.5	10,300	10,895	1,226,052	2018/8/1
	BTPS 4 1/4 02/01/15	4.25	5,000	5,275	593,652	2015/2/1
	BTPS 4 1/4 02/01/19	4.25	18,020	18,688	2,103,021	2019/2/1
	BTPS 4 1/4 08/01/13	4.25	13,000	13,624	1,533,108	2013/8/1
	BTPS 4 1/4 08/01/14	4.25	18,920	19,915	2,241,056	2014/8/1
	BTPS 4 1/4 09/19	4.25	6,500	6,698	753,827	2019/9/1
	BTPS 4 1/4 10/15/12	4.25	10,500	10,900	1,226,582	2012/10/15
	BTPS 4 3/4 02/01/13	4.75	13,000	13,687	1,540,276	2013/2/1
	BTPS 4 3/4 08/01/23	4.75	11,400	11,935	1,343,135	2023/8/1
	BTPS 5 02/01/12	5.0	9,000	9,326	1,049,533	2012/2/1
	BTPS 5 03/01/25	5.0	7,500	7,929	892,250	2025/3/1
	BTPS 5 08/01/34	5.0	9,760	10,043	1,130,143	2034/8/1
	BTPS 5 08/01/39	5.0	3,500	3,591	404,095	2039/8/1
	BTPS 5 1/4 08/01/11	5.25	2,340	2,401	270,187	2011/8/1
	BTPS 5 1/4 08/01/17	5.25	11,500	12,756	1,435,539	2017/8/1

銘柄名			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	
(ユーロ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(イタリア)	国債証券	BTPS 5.25 11/01/29	5.25	13,300	14,227	1,600,965	2029/11/1
		BTPS 6 05/01/31	6.0	11,210	12,968	1,459,384	2031/5/1
		BTPS 6 1/2 11/01/27	6.5	7,000	8,481	954,468	2027/11/1
(フランス)	国債証券	BTNS 3.75% 01/12	3.75	2,000	2,065	232,396	2012/1/12
		BTNS 4 1/2 07/12/12	4.5	7,860	8,304	934,547	2012/7/12
		FRTR 3 1/2 04/25/15	3.5	7,800	8,393	944,529	2015/4/25
		FRTR 3 1/4 04/25/16	3.25	15,500	16,515	1,858,461	2016/4/25
		FRTR 3 10/25/15	3.0	12,500	13,178	1,483,004	2015/10/25
		FRTR 3 3/4 01/13	3.75	7,200	7,603	855,588	2013/1/12
		FRTR 3 3/4 04/25/17	3.75	4,000	4,368	491,621	2017/4/25
		FRTR 3 3/4 04/25/21	3.75	4,500	4,853	546,186	2021/4/25
		FRTR 3 3/4 10/19	3.75	14,200	15,384	1,731,193	2019/10/25
		FRTR 4 04/25/13	4.0	10,980	11,723	1,319,228	2013/4/25
		FRTR 4 04/25/14	4.0	16,210	17,612	1,981,896	2014/4/25
		FRTR 4 04/25/18	4.0	7,350	8,137	915,760	2018/4/25
		FRTR 4 04/25/55	4.0	7,370	8,524	959,221	2055/4/25
		FRTR 4 1/4 04/25/19	4.25	12,960	14,569	1,639,520	2019/4/25
		FRTR 4 1/4 10/18	4.25	10,200	11,484	1,292,314	2018/10/25
		FRTR 4 10/25/13	4.0	10,070	10,856	1,221,678	2013/10/25
		FRTR 4 10/25/14	4.0	13,000	14,202	1,598,207	2014/10/25
		FRTR 4 10/25/38	4.0	10,400	11,718	1,318,707	2038/10/25
		FRTR 4 3/4 04/25/35	4.75	10,580	13,089	1,472,969	2035/4/25
		FRTR 4 3/4 10/25/12	4.75	8,700	9,307	1,047,345	2012/10/25
		FRTR 4 25 10/23	4.25	14,400	16,284	1,832,546	2023/10/25
		FRTR 5 04/25/12	5.0	9,820	10,384	1,168,584	2012/4/25
		FRTR 5 1/2 04/25/29	5.5	8,810	11,510	1,295,250	2029/4/25
FRTR 5 10/25/16	5.0	9,300	10,799	1,215,229	2016/10/25		
FRTR 5 3/4 10/25/32	5.75	920	1,270	142,940	2032/10/25		
FRTR 6 10/25/25	6.0	3,100	4,165	468,740	2025/10/25		
(オランダ)	国債証券	NETHER 2 1/2 01/12	2.5	3,400	3,461	389,488	2012/1/15
		NETHER 3 1/4 07/15	3.25	3,000	3,214	361,727	2015/7/15
		NETHER 3 3/4 07/15/14	3.75	9,060	9,832	1,106,487	2014/7/15
		NETHER 4 01/15/37	4.0	5,360	6,261	704,552	2037/1/15
		NETHER 4 07/15/16	4.0	7,640	8,488	955,245	2016/7/15
		NETHER 4 07/15/18	4.0	12,000	13,374	1,504,976	2018/7/15
		NETHER 4 1/4 07/15/13	4.25	6,440	6,968	784,118	2013/7/15
		NETHER 5 07/15/11	5.0	2,000	2,055	231,249	2011/7/15
		NETHER 5 07/15/12	5.0	4,030	4,295	483,426	2012/7/15
		NETHER 5 1/2 01/15/28	5.5	3,190	4,232	476,246	2028/1/15
NETHER 7 1/2 01/15/23	7.5	4,770	7,077	796,456	2023/1/15		
(スペイン)	国債証券	SPGB 2 1/2 10/31/13	2.5	3,500	3,437	386,765	2013/10/31
		SPGB 3.8 01/31/17	3.8	9,000	8,928	1,004,667	2017/1/31
		SPGB 3.9 10/31/12	3.9	4,000	4,078	458,897	2012/10/31
		SPGB 4.1 07/30/18	4.1	12,200	12,185	1,371,218	2018/7/30
		SPGB 4.2 01/31/37	4.2	11,000	9,377	1,055,250	2037/1/31
		SPGB 4.3 10/31/19	4.3	8,000	7,988	898,889	2019/10/31
		SPGB 4.4 01/31/15	4.4	10,030	10,467	1,177,886	2015/1/31
		SPGB 4.65 07/30/25	4.65	4,000	3,871	435,671	2025/7/30
		SPGB 4.75 07/30/14	4.75	9,620	10,177	1,145,325	2014/7/30
		SPGB 4.8 01/31/24	4.8	4,800	4,783	538,253	2024/1/31
		SPGB 4.9 07/30/40	4.9	1,500	1,426	160,490	2040/7/30
		SPGB 5 07/30/12	5.0	13,800	14,368	1,616,894	2012/7/30
		SPGB 5 1/2 07/30/17	5.5	5,750	6,275	706,187	2017/7/30

銘柄名			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	
(ユーロ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(スペイン)	国債証券	SPGB 5 3/4 07/30/32	5.75	4,160	4,448	500,612	2032/7/30
		SPGB 6 01/31/29	6.0	5,550	6,081	684,310	2029/1/31
		SPGB 6.15 01/31/13	6.15	9,390	10,064	1,132,524	2013/1/31
(ベルギー)	国債証券	BGB 3 1/2 03/28/15	3.5	2,000	2,104	236,763	2015/3/28
		BGB 3 1/4 09/28/16	3.25	6,450	6,655	748,972	2016/9/28
		BGB 3 3/4 09/28/15	3.75	5,920	6,287	707,547	2015/9/28
		BGB 3 3/4 09/28/20	3.75	5,000	5,177	582,624	2020/9/28
		BGB 4 03/28/14	4.0	4,000	4,263	479,715	2014/3/28
		BGB 4 03/28/19	4.0	5,500	5,854	658,773	2019/3/28
		BGB 4 03/28/22	4.0	4,240	4,470	503,035	2022/3/28
		BGB 4 1/4 03/28/41	4.25	1,000	1,089	122,646	2041/3/28
		BGB 4 1/4 09/28/13	4.25	5,710	6,111	687,717	2013/9/28
		BGB 4 1/4 09/28/14	4.25	6,000	6,486	729,869	2014/9/28
		BGB 5 03/28/35	5.0	4,710	5,700	641,531	2035/3/28
		BGB 5 09/28/12	5.0	6,450	6,874	773,577	2012/9/28
		BGB 5 1/2 03/28/28	5.5	4,220	5,229	588,467	2028/3/28
BGB 5 1/2 09/28/17	5.5	5,000	5,824	655,374	2017/9/28		
BGB 8 12/24/12	8.0	4,730	5,365	603,750	2012/12/24		
(オーストリア)	国債証券	RAGB 3 1/2 07/15/15	3.5	5,500	5,885	662,239	2015/7/15
		RAGB 3 1/2 09/15/21	3.5	5,200	5,444	612,658	2021/9/15
		RAGB 3.9 07/15/20	3.9	1,000	1,087	122,421	2020/7/15
		RAGB 4 09/15/16	4.0	6,000	6,591	741,685	2016/9/15
		RAGB 4.15 03/37	4.15	3,030	3,428	385,802	2037/3/15
		RAGB 4.3 07/15/14	4.3	6,530	7,156	805,290	2014/7/15
		RAGB 4.35 03/19	4.35	3,000	3,365	378,674	2019/3/15
		RAGB 4.65 01/15/18	4.65	8,830	10,078	1,134,140	2018/1/15
		RAGB 5 07/15/12	5.0	3,570	3,797	427,282	2012/7/15
RAGB 6 1/4 07/15/27	6.25	3,560	4,915	553,157	2027/7/15		
(フィンランド)	国債証券	RFGB 3 7/8 09/15/17	3.875	2,000	2,213	249,118	2017/9/15
		RFGB 4 07/04/25	4.0	2,000	2,228	250,716	2025/7/4
		RFGB 4 1/4 07/04/15	4.25	3,310	3,688	415,122	2015/7/4
		RFGB 4 1/4 09/15/12	4.25	3,600	3,810	428,766	2012/9/15
		RFGB 4 3/8 07/04/19	4.375	3,000	3,428	385,831	2019/7/4
RFGB 5 3/8 07/04/13	5.375	2,310	2,562	288,408	2013/7/4		
(アイルランド)	国債証券	IRISH 4 01/15/14	4.0	5,500	5,111	575,157	2014/1/15
		IRISH 4 1/2 04/18/20	4.5	4,520	3,525	396,735	2020/4/18
		IRISH 4 1/2 10/18/18	4.5	5,900	4,790	539,042	2018/10/18
		IRISH 4.6 04/18/16	4.6	1,780	1,566	176,246	2016/4/18
		IRISH 5 04/18/13	5.0	5,100	4,924	554,103	2013/4/18
		IRISH 5.4 03/13/25	5.4	2,000	1,557	175,254	2025/3/13
IRISH 5.9 10/18/19	5.9	2,000	1,785	200,888	2019/10/18		
(ポルトガル)	国債証券	PGB 3.35 10/15/15	3.35	1,800	1,620	182,359	2015/10/15
		PGB 3.85 04/15/21	3.85	5,020	3,950	444,576	2021/4/15
		PGB 4 3/8 06/16/14	4.375	2,000	1,939	218,296	2014/6/16
		PGB 4.1 04/15/37	4.1	2,160	1,464	164,846	2037/4/15
		PGB 4.2 10/15/16	4.2	3,050	2,790	314,043	2016/10/15
		PGB 4.45 06/15/18	4.45	9,350	8,263	929,895	2018/6/15
		PGB 5 06/15/12	5.0	2,450	2,480	279,117	2012/6/15
		PGB 5.45 09/23/13	5.45	2,240	2,265	254,890	2013/9/23
小計		-	-	-	135,297,098	-	
(イギリス)				千英ポンド	千英ポンド		
	国債証券	UKT 2 1/4 03/07/14	2.25	6,100	6,303	825,773	2014/3/7
		UKT 2 3/4 01/22/15	2.75	3,700	3,873	507,519	2015/1/22

銘柄	名	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	
(イギリス)		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
	UKT 3 3/4 09/07/19	3.75	4,200	4,460	584,412	2019/9/7
	UKT 3 3/4 09/07/20	3.75	3,500	3,683	482,603	2020/9/7
	UKT 3.25 12/07/11	3.25	3,000	3,084	404,054	2011/12/7
	UKT 4 09/07/16	4.0	7,700	8,505	1,114,295	2016/9/7
	UKT 4 1/2 03/07/13	4.5	9,000	9,733	1,275,185	2013/3/7
	UKT 4 1/2 12/07/42	4.5	10,430	11,054	1,448,283	2042/12/7
	UKT 4 1/4 12/07/27	4.25	1,130	1,182	154,904	2027/12/7
	UKT 4 1/4 12/07/46	4.25	11,650	11,853	1,552,976	2046/12/7
	UKT 4 1/4 12/07/55	4.25	9,400	9,543	1,250,335	2055/12/7
	UKT 4 3/4 03/07/20	4.75	8,600	9,791	1,282,844	2020/3/7
	UKT 4 3/4 09/07/15	4.75	10,050	11,426	1,497,031	2015/9/7
	UKT 4 3/4 12/07/38	4.75	7,600	8,327	1,090,962	2038/12/7
	UKT 4.25 06/07/32	4.25	12,110	12,443	1,630,271	2032/6/7
	UKT 4.5 09/07/34	4.5	1,700	1,789	234,387	2034/9/7
	UKT 5 03/07/12	5.0	12,060	12,741	1,669,265	2012/3/7
	UKT 5 03/07/18	5.0	10,800	12,589	1,649,358	2018/3/7
	UKT 5 03/07/25	5.0	4,100	4,724	618,893	2025/3/7
	UKT 5 09/07/14	5.0	8,700	9,859	1,291,720	2014/9/7
	UKT 6 12/07/28	6.0	6,410	8,201	1,074,440	2028/12/7
	UKT 8 06/07/21	8.0	8,250	11,885	1,557,155	2021/6/7
	UKT 8 09/27/13	8.0	5,000	5,995	785,404	2013/9/27
	UKT 8 3/4 08/25/17	8.75	4,000	5,628	737,334	2017/8/25
小計		—	—	—	24,719,415	—
(スイス)			千スイスフラン	千スイスフラン		
	SWISS 2 1/2 03/12/16	2.5	2,000	2,171	183,275	2016/3/12
	SWISS 2 10/12/16	2.0	300	318	26,873	2016/10/12
	SWISS 2 3/4 06/10/12	2.75	2,100	2,177	183,805	2012/6/10
	SWISS 3 01/08/18	3.0	1,700	1,917	161,840	2018/1/8
	SWISS 3 05/12/19	3.0	3,300	3,770	318,284	2019/5/12
	SWISS 4 02/11/13	4.0	1,500	1,619	136,722	2013/2/11
	SWISS 4 02/11/23	4.0	1,420	1,800	151,967	2023/2/11
	SWISS 4 04/08/28	4.0	1,950	2,624	221,577	2028/4/8
	SWISS 4 1/4 01/06/14	4.25	2,450	2,725	230,076	2014/1/6
小計		—	—	—	1,614,423	—
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	SGB 3 07/12/16	3.0	33,460	34,587	418,164	2016/7/12
	SGB 3 1/2 03/30/39	3.5	10,000	10,250	123,927	2039/3/30
	SGB 4 1/2 08/12/15	4.5	14,800	16,326	197,388	2015/8/12
	SGB 4 1/4 03/12/19	4.25	25,800	28,759	347,705	2019/3/12
	SGB 5 1/2 10/08/12	5.5	19,000	20,449	247,236	2012/10/8
	SGB 5 12/01/20	5.0	27,920	33,274	402,288	2020/12/1
	SGB 6.75 05/05/14	6.75	18,290	21,251	256,933	2014/5/5
小計		—	—	—	1,993,644	—
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	NGB 4.25 05/19/17	4.25	22,000	23,940	334,207	2017/5/19
	NGB 5 05/15/15	5.0	16,000	17,712	247,259	2015/5/15
	NGB 6 1/2 05/15/13	6.5	12,900	14,246	198,884	2013/5/15
小計		—	—	—	780,352	—
(デンマーク)			千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	DGB 4 1/2 11/15/39	4.5	30,000	39,318	593,701	2039/11/15
	DGB 4 11/15/12	4.0	6,500	6,866	103,685	2012/11/15
	DGB 4 11/15/15	4.0	18,480	20,449	308,780	2015/11/15
	DGB 4 11/15/17	4.0	26,400	29,544	446,118	2017/11/15

銘柄名	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		
(デンマーク)	%	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	千円		
国債証券	DGB 4 11/15/19	4.0	9,000	10,084	152,275	2019/11/15
	DGB 5 11/15/13	5.0	33,900	37,561	567,174	2013/11/15
	DGB 6 11/15/11	6.0	23,690	24,827	374,889	2011/11/15
	DGB 7 11/10/24	7.0	13,260	19,704	297,535	2024/11/10
小計	—	—	—	2,844,161	—	
(ポーランド)		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			
国債証券	POLGB 0 07/25/12	—	6,000	5,547	159,698	2012/7/25
	POLGB 4.75 04/12	4.75	10,000	10,040	289,051	2012/4/25
	POLGB 5 1/2 04/25/15	5.5	5,000	5,050	145,389	2015/4/25
	POLGB 5 1/2 10/25/19	5.5	5,000	4,955	142,654	2019/10/25
	POLGB 5 1/4 04/25/13	5.25	7,700	7,760	223,412	2013/4/25
	POLGB 5 1/4 10/25/17	5.25	13,420	13,248	381,416	2017/10/25
	POLGB 5 1/4 10/25/20	5.25	5,000	4,875	140,351	2020/10/25
	POLGB 5 10/24/13	5.0	17,540	17,545	505,128	2013/10/24
POLGB 5 3/4 09/23/22	5.75	10,800	10,789	310,621	2022/9/23	
POLGB 6 1/4 10/24/15	6.25	16,920	17,588	506,368	2015/10/24	
小計	—	—	—	2,804,090	—	
(オーストラリア)		千豪ドル	千豪ドル			
国債証券	ACGB 5 1/4 03/15/19	5.25	6,160	6,148	505,323	2019/3/15
	ACGB 5 3/4 04/15/12	5.75	6,200	6,261	514,668	2012/4/15
	ACGB 5 3/4 05/15/21	5.75	3,900	4,035	331,689	2021/5/15
	ACGB 6 02/15/17	6.0	6,700	6,971	572,991	2017/2/15
	ACGB 6 1/2 05/15/13	6.5	6,320	6,532	536,878	2013/5/15
	ACGB 6 1/4 04/15/15	6.25	5,990	6,249	513,630	2015/4/15
ACGB 6 1/4 06/15/14	6.25	1,000	1,036	85,196	2014/6/15	
小計	—	—	—	3,060,378	—	
(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 2 1/2 06/01/19	2.5	3,000	3,180	201,763	2019/6/1
	SIGB 2 1/4 07/01/13	2.25	1,850	1,936	122,861	2013/7/1
	SIGB 3 1/2 03/01/27	3.5	1,300	1,432	90,877	2027/3/1
	SIGB 3 1/2 07/01/12	3.5	2,300	2,418	153,404	2012/7/1
	SIGB 3 1/4 09/01/20	3.25	2,300	2,574	163,312	2020/9/1
	SIGB 3 3/4 09/01/16	3.75	3,500	4,009	254,344	2016/9/1
SIGB 3 5/8 07/01/14	3.625	2,400	2,660	168,781	2014/7/1	
小計	—	—	—	1,155,345	—	
(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	MGS 3.461 07/13	3.461	2,800	2,815	74,323	2013/7/31
	MGS 3.502 05/31/27	3.502	3,800	3,520	92,952	2027/5/31
	MGS 3.718 06/15/12	3.718	13,000	13,135	346,765	2012/6/15
	MGS 3.814 02/15/17	3.814	12,300	12,381	326,867	2017/2/15
	MGS 4.24 02/07/18	4.24	3,300	3,390	89,501	2018/2/7
	MGS 4.262 09/15/16	4.262	2,000	2,065	54,520	2016/9/15
	MGS 4.378 11/29/19	4.378	5,500	5,692	150,271	2019/11/29
	MGS 5.094 04/30/14	5.094	14,000	14,791	390,501	2014/4/30
MGS 5.248 09/28	5.248	1,200	1,372	36,233	2028/9/15	
小計	—	—	—	1,561,938	—	
合計				313,278,261		

(注1) 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。

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨てています。

(注3) 株式、新株予約権証券及び株式の性質を有するオプション証券等の組入れはありません。

■投資信託財産の構成

(2010年11月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	313,278,261	98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,541,264	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	318,819,525	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末における外貨建純資産(318,490,037千円)の投資信託財産総額(318,819,525千円)に対する比率は99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、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。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=81.78円、1カナダドル=81.24円、1メキシコペソ=6.65円、1ユーロ=112.53円、1英ポンド=131.01円、1スイスフラン=84.42円、1スウェーデンクローネ=12.09円、1ノルウェークローネ=13.96円、1デンマーククローネ=15.10円、1ポーランドズロチ=28.79円、1豪ドル=82.19円、1シンガポールドル=63.44円、1マレーシアリングギット=26.40円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2010年11月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	318,941,139,789円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	869,090,971
公 社 債(評価額)	313,278,261,060
未 収 入 金	352,543,996
未 収 利 息	4,111,583,251
前 払 費 用	329,660,511
(B) 負 債	393,144,062
未 払 金	121,614,226
未 払 解 約 金	271,529,836
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	318,547,995,727
元 本	323,144,154,168
次 期 繰 越 損 益 金	△ 4,596,158,441
(D) 受 益 権 総 口 数	323,144,154,168口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	9,858円

(注1) 当親ファンドの期首元本額は312,479,758,986円、期中追加設定元本額は40,099,559,995円、期中一部解約元本額は29,435,164,813円です。

<元本の内訳>

L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド (慎 重 型)	1,190,267円
L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド (安 定 重 視 型)	1,807,111円
L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド (バ ラ ン ス 型)	686,444円
L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド (成 長 重 視 型)	876,762円
L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド (積 極 型)	159,469円
東 京 海 上 セ レ ク シ ョ ン ・ 外 国 債 券 イ ン デ ッ ク ス	38,806,153円
TMA 外 国 債 券 イ ン デ ッ ク ス V A < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	114,963,467,403円
TMA 世 界 バ ラ ン ス フ ァ ン ド 5 5 V A < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	6,766,752,081円
TMA 世 界 バ ラ ン ス フ ァ ン ド 3 5 V A < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	201,370,408,478円

(注2) 当期末の1口当たり純資産額は9,858円です。

(注3) 元本の欠損は4,596,158,441円です。

■損益の状況

当期(自2009年11月11日 至2010年11月10日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	12,034,163,157円
受 取 利 息	12,034,163,157
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△40,669,728,951
売 買 益	10,656,567,202
売 買 損	△51,326,296,153
(C) 信 託 報 酬 等	△ 38,417,535
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△28,673,983,329
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	23,665,768,016
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	878,209,966
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 466,153,094
(H) 計 (D+E+F+G)	△ 4,596,158,441
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△ 4,596,158,441

(注1) 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2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 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。

(注4) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。