

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＞

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	2009年9月2日から2021年5月28日				
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			
	TMA外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債			
投資制限	(慎重型)	株式へ 実質割 投資割合	30%以下	外貨建 へ 実質割 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。				

第9期 運用報告書(全体版)

(決算日 2018年5月28日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「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、このたび、第9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

東京都千代田区丸の内1-8-2 鉄鋼ビルディング

お問い合わせ窓口

東京海上アセットマネジメント 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/>

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

＜LPS4資産分散ファンド(慎重型)＞

決算期	基準価額			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
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
5期(2014年5月28日)	11,741	0	3.9	12,043	4.5	13.7	0.4	85.2	0.1	8
6期(2015年5月28日)	12,648	0	7.7	13,044	8.3	12.7	0.4	86.0	0.1	39
7期(2016年5月30日)	12,729	0	0.6	13,198	1.2	12.7	0.4	85.9	0.1	49
8期(2017年5月29日)	12,771	0	0.3	13,304	0.8	12.6	0.5	86.4	0.1	65
9期(2018年5月28日)	13,026	0	2.0	13,626	2.4	13.8	1.1	83.9	0.1	72

(注) 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」は実質比率を記載しています。

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

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

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

＜LPS4資産分散ファンド(安定重視型)＞

決算期	基準価額			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
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
5期(2014年5月28日)	12,474	0	5.1	12,721	5.6	25.5	0.7	72.9	0.2	7
6期(2015年5月28日)	14,041	0	12.6	14,384	13.1	22.2	0.8	75.6	0.2	20
7期(2016年5月30日)	13,587	0	△ 3.2	13,977	△ 2.8	23.3	0.7	75.0	0.3	48
8期(2017年5月29日)	13,928	0	2.5	14,377	2.9	22.1	0.8	76.0	0.2	40
9期(2018年5月28日)	14,423	0	3.6	14,924	3.8	24.8	2.0	71.5	0.2	83

(注) 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」は実質比率を記載しています。

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

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

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 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(東証株価指数)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)を基本資産配分で組み合わせ合わせた合成指数です。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、FTSE世界国債インデックスは、FTSE世界国債インデックス(国内投信用)を使用しています。
各ファンドの決算日時点の基本資産配分は10ページをご参照ください。

＜LPS4資産分散ファンド(バランス型)＞

決算期	基準価額			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
	(分配落)	税込分配	みん中期騰落率	期騰落率	中期騰落率					
5期(2014年5月28日)	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
	13,182	0	6.2	13,298	6.4	39.1	1.0	58.9	0.4	27
6期(2015年5月28日)	15,499	0	17.6	15,676	17.9	38.3	1.3	58.5	0.4	78
7期(2016年5月30日)	14,536	0	△6.2	14,744	△5.9	38.8	1.1	59.1	0.4	118
8期(2017年5月29日)	15,354	0	5.6	15,593	5.8	38.4	1.5	59.1	0.4	130
9期(2018年5月28日)	16,134	0	5.1	16,404	5.2	36.7	2.9	58.4	0.4	161

(注) 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」は実質比率を記載しています。

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

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

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

＜LPS4資産分散ファンド(成長重視型)＞

決算期	基準価額			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
	(分配落)	税込分配	みん中期騰落率	期騰落率	中期騰落率					
5期(2014年5月28日)	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
	13,782	0	7.1	13,810	7.1	53.6	1.4	44.0	0.5	15
6期(2015年5月28日)	16,814	0	22.0	16,868	22.1	52.4	1.8	43.6	0.5	66
7期(2016年5月30日)	15,351	0	△8.7	15,421	△8.6	53.3	1.5	44.2	0.6	118
8期(2017年5月29日)	16,639	0	8.4	16,705	8.3	52.6	2.0	44.2	0.5	117
9期(2018年5月28日)	17,799	0	7.0	17,858	6.9	50.5	4.0	43.8	0.5	161

(注) 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」は実質比率を記載しています。

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

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

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

＜LPS4資産分散ファンド(積極型)＞

決算期	基準価額			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
	(分配落)	税込分配	みん中期騰落率	期騰落率	中期騰落率					
5期(2014年5月28日)	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
	14,366	0	7.9	14,324	7.7	66.1	1.7	31.2	0.6	24
6期(2015年5月28日)	18,101	0	26.0	18,044	26.0	64.4	2.2	30.8	0.6	85
7期(2016年5月30日)	16,135	0	△10.9	16,080	△10.9	66.7	1.9	30.4	0.7	121
8期(2017年5月29日)	17,878	0	10.8	17,777	10.6	64.9	2.5	31.3	0.6	131
9期(2018年5月28日)	19,419	0	8.6	19,268	8.4	62.3	5.0	31.1	0.6	184

(注) 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」は実質比率を記載しています。

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

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

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

(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

＜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 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
(期 首) 2017年5月29日	円	%		%	%	%	%	%
5月末	12,771	—	13,304	—	12.6	0.5	86.4	0.1
6月末	12,760	△0.1	13,293	△0.1	12.4	0.6	85.4	0.1
7月末	12,812	0.3	13,354	0.4	12.6	0.5	85.6	0.1
8月末	12,814	0.3	13,362	0.4	12.3	0.6	86.0	0.1
9月末	12,883	0.9	13,442	1.0	12.4	0.4	83.4	0.1
10月末	12,953	1.4	13,513	1.6	15.0	0.5	83.6	0.2
11月末	13,030	2.0	13,598	2.2	14.6	0.8	83.7	0.1
12月末	13,072	2.4	13,649	2.6	14.1	0.9	83.8	0.1
2018年1月末	13,139	2.9	13,724	3.2	14.4	0.6	83.3	0.1
2月末	13,090	2.5	13,679	2.8	14.7	0.4	83.8	0.1
3月末	12,990	1.7	13,580	2.1	13.6	0.7	83.8	0.1
4月末	12,954	1.4	13,539	1.8	13.3	1.0	83.4	0.1
4月末	13,045	2.1	13,637	2.5	14.0	1.2	79.2	0.1
(期 末) 2018年5月28日	13,026	2.0	13,626	2.4	13.8	1.1	83.9	0.1

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 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」は実質比率を記載しています。

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

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

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

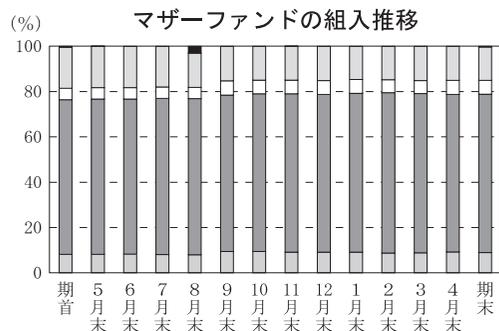


— 基準価額(左軸) — 分配金再投資基準価額(左軸) — ベンチマーク(左軸) ■ 純資産総額(右軸)

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

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

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2017年5月29日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。



■ 日本株式M ■ 日本債券M □ 外国株式M □ 外国債券M ■ 現金他

※比率は、純資産総額(一部の未払金の計上を除く)に占める割合です。

＜LPS4資産分散ファンド(安定重視型)＞

年 月 日	基 準 価 額		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 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
(期 首) 2017年5月29日	円	%		%	%	%	%	%
	13,928	—	14,377	—	22.1	0.8	76.0	0.2
5 月 末	13,909	△0.1	14,356	△0.1	21.9	1.1	75.3	0.2
6 月 末	14,038	0.8	14,495	0.8	22.1	1.0	75.6	0.2
7 月 末	14,046	0.8	14,513	0.9	21.7	1.1	76.0	0.2
8 月 末	14,127	1.4	14,601	1.6	22.0	0.6	69.5	0.2
9 月 末	14,302	2.7	14,772	2.7	26.7	0.9	71.4	0.3
10 月 末	14,458	3.8	14,939	3.9	26.1	1.4	71.4	0.3
11 月 末	14,519	4.2	15,009	4.4	25.4	1.6	71.9	0.3
12 月 末	14,643	5.1	15,142	5.3	25.8	1.1	71.4	0.3
2018年1 月 末	14,584	4.7	15,088	4.9	26.5	0.8	71.6	0.3
2 月 末	14,361	3.1	14,864	3.4	24.7	1.3	72.1	0.2
3 月 末	14,274	2.5	14,760	2.7	24.1	1.8	71.8	0.2
4 月 末	14,459	3.8	14,953	4.0	25.0	2.2	67.9	0.2
(期 末) 2018年5月28日								
	14,423	3.6	14,924	3.8	24.8	2.0	71.5	0.2

(注) 騰落率は期首比です。

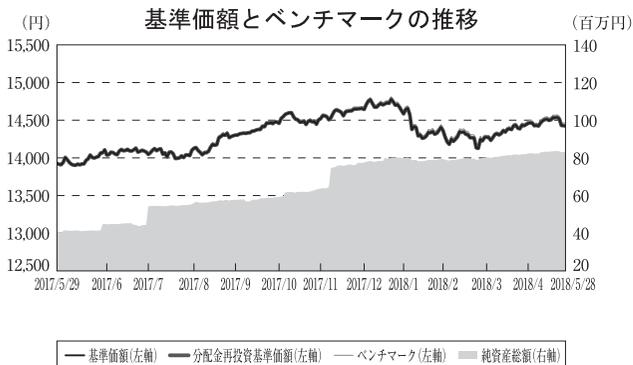
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

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

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

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

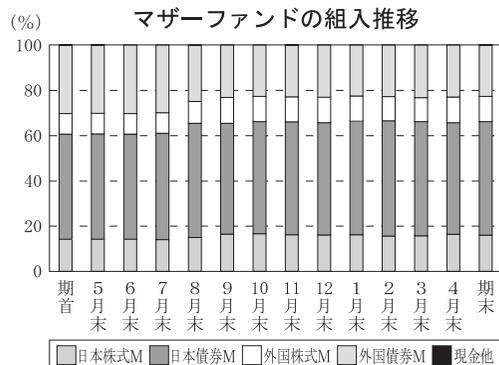
(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。



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

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

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2017年5月29日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。



※比率は、純資産総額(一部の未払金の計上を除く)に占める割合です。

<LPS4資産分散ファンド(バランス型)>

年 月 日	基 準 価 額		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 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
(期 首) 2017年5月29日	円	%		%	%	%	%	%
	15,354	—	15,593	—	38.4	1.5	59.1	0.4
5月末	15,327	△0.2	15,567	△0.2	37.9	1.9	58.6	0.4
6月末	15,519	1.1	15,765	1.1	38.3	1.7	58.7	0.4
7月末	15,541	1.2	15,799	1.3	37.8	1.9	59.2	0.4
8月末	15,603	1.6	15,873	1.8	38.2	1.1	59.2	0.4
9月末	15,900	3.6	16,150	3.6	39.3	1.4	58.3	0.4
10月末	16,161	5.3	16,421	5.3	38.5	2.1	58.4	0.4
11月末	16,249	5.8	16,518	5.9	37.5	2.3	59.0	0.4
12月末	16,434	7.0	16,710	7.2	38.2	1.6	58.5	0.4
2018年1月末	16,389	6.7	16,673	6.9	39.3	1.1	58.6	0.4
2月末	16,041	4.5	16,326	4.7	36.8	2.0	59.4	0.3
3月末	15,881	3.4	16,137	3.5	35.8	2.7	59.2	0.3
4月末	16,172	5.3	16,434	5.4	36.9	3.2	55.6	0.4
(期 末) 2018年5月28日	16,134	5.1	16,404	5.2	36.7	2.9	58.4	0.4

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 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」は実質比率を記載しています。

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

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

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

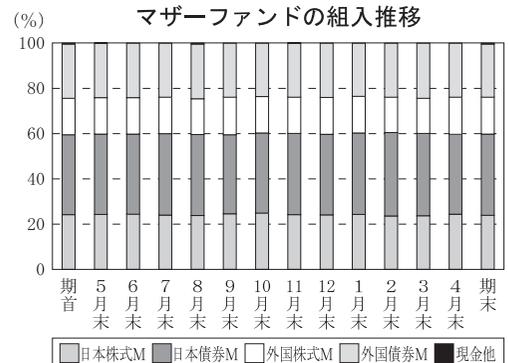
(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。



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

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

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2017年5月29日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。



※比率は、純資産総額(一部の未払金の計上を除く)に占める割合です。

＜LPS4資産分散ファンド（成長重視型）＞

年 月 日	基 準 価 額		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 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
(期 首) 2017年5月29日	円 16,639	% —	円 16,705	% —	% 52.6	% 2.0	% 44.2	% 0.5
5月末	16,607	△0.2	16,672	△0.2	52.0	2.6	43.8	0.5
6月末	16,859	1.3	16,926	1.3	52.5	2.3	43.9	0.5
7月末	16,896	1.5	16,978	1.6	51.9	2.7	44.4	0.5
8月末	16,935	1.8	17,031	2.0	52.6	1.5	44.4	0.6
9月末	17,365	4.4	17,423	4.3	53.7	1.9	43.4	0.6
10月末	17,762	6.7	17,825	6.7	52.6	2.9	43.5	0.5
11月末	17,884	7.5	17,957	7.5	51.5	3.2	44.2	0.5
12月末	18,130	9.0	18,207	9.0	52.4	2.2	43.8	0.5
2018年1月末	18,139	9.0	18,227	9.1	53.8	1.6	43.8	0.5
2月末	17,667	6.2	17,759	6.3	50.8	2.7	44.8	0.5
3月末	17,403	4.6	17,452	4.5	49.5	3.8	44.6	0.5
4月末	17,815	7.1	17,865	6.9	50.4	4.4	41.5	0.5
(期 末) 2018年5月28日	円 17,799	% 7.0	円 17,858	% 6.9	% 50.5	% 4.0	% 43.8	% 0.5

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 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」は実質比率を記載しています。

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

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

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

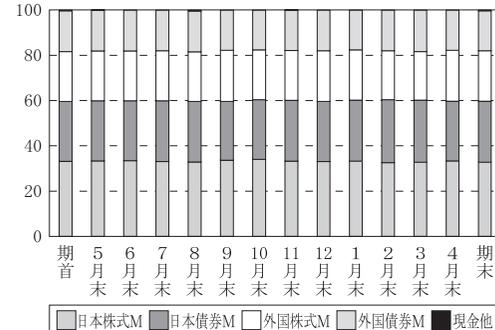


(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

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

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2017年5月29日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

マザーファンドの組入推移 (%)



※比率は、純資産総額(一部の未払金の計上を除く)に占める割合です。

＜LPS4資産分散ファンド(積極型)＞

年 月 日	基 準 価 額		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 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
(期 首) 2017年5月29日	円	%		%	%	%	%	%
	17,878	—	17,777	—	64.9	2.5	31.3	0.6
5月末	17,840	△ 0.2	17,739	△ 0.2	64.1	3.2	31.1	0.7
6月末	18,153	1.5	18,049	1.5	64.8	2.8	31.2	0.7
7月末	18,206	1.8	18,119	1.9	64.1	3.3	31.5	0.7
8月末	18,222	1.9	18,150	2.1	65.1	1.9	31.5	0.7
9月末	18,785	5.1	18,656	4.9	65.9	2.4	30.7	0.7
10月末	19,319	8.1	19,189	7.9	64.6	3.6	30.8	0.7
11月末	19,477	8.9	19,355	8.9	63.6	3.9	31.4	0.7
12月末	19,785	10.7	19,664	10.6	64.7	2.7	31.1	0.6
2018年1月末	19,848	11.0	19,741	11.0	66.3	1.9	31.1	0.6
2月末	19,249	7.7	19,150	7.7	63.1	3.3	32.0	0.6
3月末	18,879	5.6	18,724	5.3	61.5	4.7	31.9	0.6
4月末	19,413	8.6	19,253	8.3	62.1	5.4	29.4	0.6
(期 末) 2018年5月28日	19,419	8.6	19,268	8.4	62.3	5.0	31.1	0.6

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 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」は実質比率を記載しています。

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

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

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

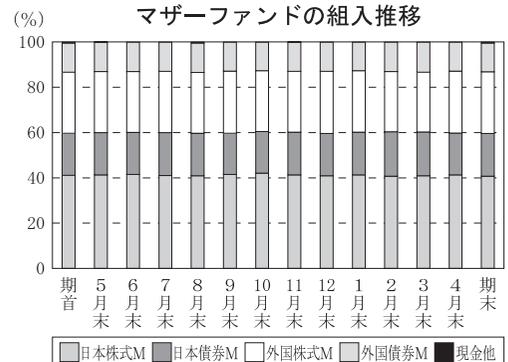
(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。



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

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

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2017年5月29日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。



※比率は、純資産総額(一部の未払金の計上を除く)に占める割合です。

○運用経過

(2017年5月30日～2018年5月28日)

■期中の基準価額等の推移

	LPS4資産 分散ファンド (慎重型)	LPS4資産 分散ファンド (安定重視型)	LPS4資産 分散ファンド (バランス型)	LPS4資産 分散ファンド (成長重視型)	LPS4資産 分散ファンド (積極型)
前期末(2017年5月29日)	12,771円	13,928円	15,354円	16,639円	17,878円
当期末(2018年5月28日)	13,026円	14,423円	16,134円	17,799円	19,419円
基準価額の騰落率	2.0%	3.6%	5.1%	7.0%	8.6%
ベンチマークの騰落率	2.4%	3.8%	5.2%	6.9%	8.4%

◇基準価額の主な変動要因

【各マザーファンドのベンチマークの騰落率】

	日本株式 TOPIX	日本債券 NOMURA - BPI (総合)	外国株式 MSCIコクサイ指数 (円ヘッジなし・円ベース)	外国債券 FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)
騰落率	12.8%	0.7%	10.9%	0.6%

プラス要因

- ・世界的に良好な経済指標や米国の税制改革法案が成立したことなどを背景に、米国景気や企業業績の拡大期待から国内外の株式市場が上昇したこと
- ・朝鮮半島を巡る地政学的リスクの緩和による国内株式市場の上昇

マイナス要因

- ・米国におけるインフレ加速懸念や原油価格の上昇に伴い、世界的に金利が上昇(債券価格が下落)したこと
- ・米中貿易摩擦への懸念を背景とした円高、株安の進行

■投資環境

【日本株式市況】

- ・期初は、朝鮮半島の地政学的リスクへの警戒感から、上値の重い展開が続きましたが、2017年9月以降は、北朝鮮情勢の緊張緩和や10月の衆議院総選挙における与党の勝利、国内企業の好業績期待などを背景に国内株式市場は上昇しました。
- ・2018年に入り、好調な海外景気と好業績期待から国内株式市場は一旦は上昇しましたが、円高や米国金利の急上昇に伴う米国株式市場の混乱から急落し、その後しばらくは、米国の通商政策に対する懸念を受けて揉みあう展開が続きました。
- ・期末にかけては、米国の通商政策への懸念の後退や国内企業の好調な決算を背景に国内株式市場は堅調に推移し、期初から上昇した水準で期を終えました。

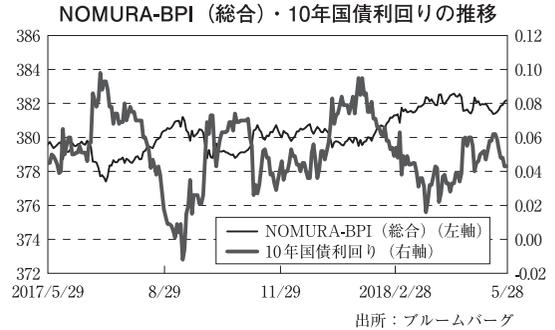
TOPIX(東証株価指数)の推移



出所：ブルームバーグ

【日本債券市況】

- ・期初、10年国債利回りは0.04%程度から始まりましたが、欧米主要国の中央銀行が金融引き締め姿勢を強めたことを背景に、2017年7月には0.1%付近まで上昇しました。その後、日銀の指値オペをきっかけに10年国債利回りは低下し、一時マイナス利回りとなりましたが、9月以降はFOMC(米連邦公開市場委員会)で利上げ継続の見通しが維持されたことや地政学的リスクの後退から上昇に転じました。
- ・10月以降、10年国債利回りは狭い範囲内で推移しましたが、日銀による金融緩和政策の解除の思惑が台頭し、2018年2月初めには0.1%程度まで上昇しました。
- ・期末にかけては、黒田日銀総裁の続投が決まり、日銀が金利上昇を牽制する姿勢を示したことや、株安、円高を受けて10年国債利回りは低下し、期初からはほぼ横ばいの水準で期を終えました。



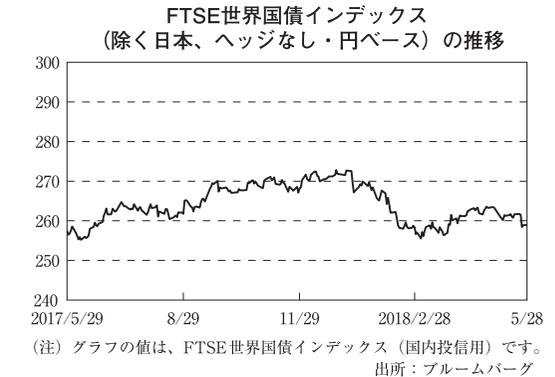
【外国株式市況】

- ・期初、外国株式市場は、朝鮮半島の地政学的リスクや米国の大型ハリケーンの影響を受けて一時的に軟調に推移する場面もありましたが、良好な企業業績や経済指標から底堅く推移しました。2017年9月以降は、米国の税制改革による業績拡大期待から外国株式市場は上昇基調で推移しました。
- ・2018年2月に入ると、賃金上昇によるインフレ懸念の高まりや米中の貿易摩擦に対する懸念から外国株式市場は急落しましたが、4月以降は米中貿易摩擦への懸念の後退から下げ幅をやや戻す展開となりました。期末にかけては、イタリアの政局混乱から軟調に推移しましたが、期初からは上昇した水準で期を終えました。



【外国債券市況】

- ・期初は、ドラギECB(欧州中央銀行)総裁のインフレの先行きを楽観する発言から、外国債券市場では国債利回りは一旦上昇する場面もありましたが、その後、北朝鮮情勢の緊迫化などを背景に、国債利回りは低下しました。
- ・2017年9月以降は、地政学的リスクの後退や米国の税制・財政改革の進展による経済成長期待の高まりを背景に、外国債券市場で国債利回りは上昇し、2018年に入ってから賃金上昇によるインフレ懸念が高まったことから、国債利回りは引き続き上昇基調となりました。
- ・期末にかけては、米中貿易摩擦への懸念やイタリアの政局混乱から世界的に国債利回りが低下する場面もありましたが、期を通じてみると上昇しました。



(為替市況について)

- ・米ドル円為替レートは、期初1米ドル＝111円程度でスタートした後、FRB（米連邦準備制度理事会）高官の発言で早期利上げが意識されたことなどを背景に円安米ドル高となり、一時1米ドル＝114円台に達しました。その後、北朝鮮情勢の緊迫化や米国の大型ハリケーンにより一時1米ドル＝107円台後半まで円高米ドル安が進みました。
- ・2017年9月以降は、トランプ米大統領の税制改革が好感され、円安米ドル高基調となりましたが、2018年に入り、米財務長官の米ドル安を容認する発言や米中貿易摩擦に対する懸念から1米ドル＝104円台後半まで円高米ドル安が進みました。
- ・期末にかけては、米中貿易摩擦への懸念が後退し円安米ドル高基調となりましたが、期を通じてみると円高米ドル安になりました。

■ポートフォリオについて

＜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)＞

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を以下の「基本資産配分」を基準に、一定の範囲(±5%)に変動幅を抑制するように運用しました。具体的には、毎月初に基本資産配分からの乖離分を戻すリバランスを行いました。

【基本資産配分】

	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
(慎重型)	9%	70%	6%	15%
(安定重視型)	16%	50%	11%	23%
(バランス型)	24%	36%	16%	24%
(成長重視型)	33%	27%	22%	18%
(積極型)	41%	19%	27%	13%

＜TMA日本株TOPIXマザーファンド＞

ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は、世界景気の拡大期待や好調な企業業績などを受けて15.1%上昇し、株式の受取配当金などの要因を除くとベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

＜TMA日本債券インデックスマザーファンド＞

ベンチマークであるNOMURA-BPI（総合）に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は、国債利回りがほぼ横ばいとなったことから0.8%と小幅に上昇し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

＜TMA外国株式インデックスマザーファンド＞

ベンチマークであるMSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は、世界景気の拡大期待や好調な企業業績などを背景に10.9%上昇し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

＜TMA外国債券インデックスマザーファンド＞

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は、世界的に金利は上昇したものの、外国為替市場で小幅に円安が進む局面もあったことから0.6%と小幅に上昇し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、各マザーファンドのベンチマークを基本資産配分で組み合わせた指数を合成ベンチマークとし、当該ベンチマークに連動する投資成果を目指します。

グラフは期中の基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

各ファンドの騰落率は、次表の通りベンチマークにおおむね連動しました。

【各ファンドとベンチマークの騰落率】

	LPS4資産分散ファンド (慎重型)	LPS4資産分散ファンド (安定重視型)	LPS4資産分散ファンド (バランス型)	LPS4資産分散ファンド (成長重視型)	LPS4資産分散ファンド (積極型)
ファンド	2.0%	3.6%	5.1%	7.0%	8.6%
ベンチマーク	2.4%	3.8%	5.2%	6.9%	8.4%

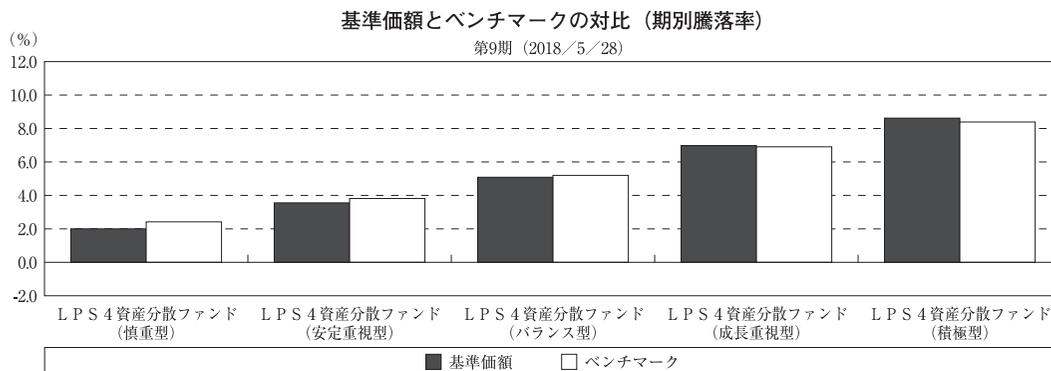
(主な差異要因)

プラス要因

- ・マザーファンドにおける配当金収入

マイナス要因

- ・信託報酬などのコスト
- ・マザーファンドにおける取引コストや配当課税の影響



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

■分配金

当期においては、市況動向や運用の効率性などを勘案して、収益分配を行わないこととしました。収益分配に充てなかった収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

◇分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第9期				
	2017年5月30日～2018年5月28日				
	LPS4資産 分散ファンド (慎重型)	LPS4資産 分散ファンド (安定重視型)	LPS4資産 分散ファンド (バランス型)	LPS4資産 分散ファンド (成長重視型)	LPS4資産 分散ファンド (積極型)
当期分配金	—	—	—	—	—
(対基準価額比率)	—%	—%	—%	—%	—%
当期の収益	—	—	—	—	—
当期の収益以外	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	3,026	4,422	6,134	7,799	9,418

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

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨で算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

<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)>

主として、各マザーファンドへの投資を通じて、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。

なお、各市場の今後の見通しは以下の通りです。

【日本株式市場見通し】

- ・米国長期金利の上昇や原油価格の高止まり、米国の通商政策に対する懸念、朝鮮半島の地政学的リスク、イタリアの政局混乱などの不安材料はあるものの、国内株式市場は良好な経済指標を背景に投資環境の改善や企業業績への信頼回復から底堅く推移する展開を予想します。

【日本債券市場見通し】

- ・物価上昇圧力が限定的なものに留まるなか、日銀の金融緩和政策は当面維持される可能性が高いと考えます。また、国債の市中発行量が前年度対比で減少する一方、国内債券に対する投資家の需要が底堅いことなどを考慮すると、国内長期金利は当面狭い範囲内で推移すると予想します。

【外国株式市場見通し】

- ・外国株式市場は、足元で企業業績への不透明感やイタリアの政局混乱などの不安材料が出てきているものの、米国経済は堅調であり、企業業績は引き続き底堅く推移すると予想していることから、外国株式市場は徐々に上昇していく展開に戻ると予想します。
- ・中長期的にも、世界経済の拡大基調が継続するなか、企業業績は堅調に推移すると予想しており、加えてインフラ投資や金融規制緩和などトランプ米政権の政策による景気拡大期待も株価の下支え要因となり、外国株式市場は緩やかに上昇すると想定しています。

【外国債券市場見通し】

＜金利動向＞

- ・米国債利回りは、米国の経済成長の加速と物価上昇期待から緩やかに上昇することを想定します。
- ・ドイツ国債利回りは、ユーロ圏の経済成長を背景に緩やかに上昇することを想定します。

＜為替＞

- ・米ドル円相場は、米国の経済成長を背景に米国の利上げが意識され、円安米ドル高基調で推移すると予想します。また、ユーロ円相場も、円安ユーロ高を想定しています。

2018年8月29日以降、上記の見通しなどを踏まえて基本資産配分を以下の通り変更する予定です。

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

【基本資産配分】

	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
(慎重型)	9%	70%	6%	15%
(安定重視型)	16%	50%	11%	23%
(バランス型)	24%	36%	16%	24%
(成長重視型)	33%	27%	22%	18%
(積極型)	41%	19%	27%	13%



2018年8月29日以降の基本資産配分 (予定)

	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
(慎重型)	9%	70%	6%	15%
(安定重視型)	16%	50%	11%	23%
(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%

＜TMA日本株TOPIXマザーファンド＞

引き続き、ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

＜TMA日本債券インデックスマザーファンド＞

引き続き、ベンチマークであるNOMURA-BPI（総合）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

＜TMA外国株式インデックスマザーファンド＞

引き続き、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）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

＜TMA外国債券インデックスマザーファンド＞

引き続き、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年5月30日～2018年5月28日)

項目	第9期										項目の概要
	LPS4資産分散ファンド(慎重型)		LPS4資産分散ファンド(安定重視型)		LPS4資産分散ファンド(バランス型)		LPS4資産分散ファンド(成長重視型)		LPS4資産分散ファンド(積極型)		
	金額	比率	金額	比率	金額	比率	金額	比率	金額	比率	
(a) 信託報酬	90	0.695	99	0.695	111	0.695	121	0.695	132	0.695	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 *委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価 *購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価 *運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(42)	(0.323)	(46)	(0.323)	(51)	(0.323)	(56)	(0.323)	(61)	(0.323)	
(販売会社)	(42)	(0.323)	(46)	(0.323)	(51)	(0.323)	(56)	(0.323)	(61)	(0.323)	
(受託会社)	(6)	(0.048)	(7)	(0.048)	(8)	(0.048)	(8)	(0.048)	(9)	(0.048)	
(b) 売買委託手数料	1	0.005	1	0.010	2	0.014	3	0.020	5	0.024	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 *売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.003)	(1)	(0.005)	(1)	(0.007)	(2)	(0.010)	(2)	(0.013)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	(1)	(0.004)	(1)	(0.007)	(2)	(0.009)	(2)	(0.011)	
(c) 有価証券取引税	0	0.000	0	0.001	0	0.001	0	0.001	0	0.001	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 *有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.000)	(0)	(0.001)	(0)	(0.001)	(0)	(0.001)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	2	0.018	4	0.025	5	0.030	6	0.035	7	0.039	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 *保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 *監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 *その他は、信託事務等に要する諸費用
(保管費用)	(1)	(0.008)	(2)	(0.014)	(3)	(0.018)	(4)	(0.024)	(5)	(0.027)	
(監査費用)	(1)	(0.011)	(2)	(0.011)	(2)	(0.011)	(2)	(0.011)	(2)	(0.011)	
(その他)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.001)	
合計	93	0.718	104	0.731	118	0.740	130	0.751	144	0.759	
期中の平均基準価額	LPS4資産分散ファンド(慎重型)		LPS4資産分散ファンド(安定重視型)		LPS4資産分散ファンド(バランス型)		LPS4資産分散ファンド(成長重視型)		LPS4資産分散ファンド(積極型)		
	12,961円		14,310円		15,934円		17,455円		18,931円		

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当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。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2017年5月30日～2018年5月28日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

<LPS4資産分散ファンド(慎重型)>

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 2,056	千円 2,782	千口 1,810	千円 2,448
TMA日本債券インデックスマザーファンド	13,192	16,800	8,825	11,201
TMA外国株式インデックスマザーファンド	964	2,187	659	1,516
TMA外国債券インデックスマザーファンド	2,359	3,609	3,229	4,972

<LPS4資産分散ファンド(安定重視型)>

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 6,681	千円 8,992	千口 1,965	千円 2,697
TMA日本債券インデックスマザーファンド	21,473	27,274	3,604	4,580
TMA外国株式インデックスマザーファンド	2,956	6,726	754	1,762
TMA外国債券インデックスマザーファンド	8,452	13,038	4,070	6,269

<LPS4資産分散ファンド(バランス型)>

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 15,981	千円 21,597	千口 14,355	千円 19,364
TMA日本債券インデックスマザーファンド	28,345	36,003	19,114	24,301
TMA外国株式インデックスマザーファンド	6,684	15,265	5,416	12,410
TMA外国債券インデックスマザーファンド	14,571	22,423	10,170	15,647

<LPS4資産分散ファンド(成長重視型)>

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 16,278	千円 22,405	千口 10,436	千円 14,255
TMA日本債券インデックスマザーファンド	17,640	22,424	7,928	10,093
TMA外国株式インデックスマザーファンド	6,995	16,144	3,876	8,961
TMA外国債券インデックスマザーファンド	8,872	13,681	3,964	6,078

<LPS4資産分散ファンド(積極型)>

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 28,043	千円 38,849	千口 19,029	千円 26,108
TMA日本債券インデックスマザーファンド	17,498	22,237	9,386	11,931
TMA外国株式インデックスマザーファンド	11,827	27,476	7,187	16,677
TMA外国債券インデックスマザーファンド	9,131	14,114	4,898	7,565

○株式売買比率

(2017年5月30日～2018年5月28日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	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	129,091,942千円	34,901,469千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	55,892,282千円	26,083,185千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.30	1.33

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2017年5月30日～2018年5月28日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

<TMA日本株TOPIXマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 381	百万円 576	百万円 391

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

(2017年5月30日～2018年5月28日)

	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
	百万円	百万円	百万円	百万円	
(慎重型)	1	—	—	1	当初設定における取得
(安定重視型)	1	—	—	1	
(バランス型)	1	—	—	1	
(成長重視型)	1	—	—	1	
(積極型)	—	—	—	—	—

○組入資産の明細

(2018年5月28日現在)

親投資信託残高

＜LPS4資産分散ファンド(慎重型)＞

銘柄	期首(前期末) 口数	当期末	
		口数	評価額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 4,327	千口 4,573	千円 6,491
TMA日本債券インデックスマザーファンド	35,308	39,675	50,728
TMA外国株式インデックスマザーファンド	1,546	1,852	4,407
TMA外国債券インデックスマザーファンド	7,961	7,091	10,682

＜LPS4資産分散ファンド(安定重視型)＞

銘柄	期首(前期末) 口数	当期末	
		口数	評価額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 4,636	千口 9,352	千円 13,272
TMA日本債券インデックスマザーファンド	14,726	32,594	41,675
TMA外国株式インデックスマザーファンド	1,704	3,906	9,294
TMA外国債券インデックスマザーファンド	8,124	12,506	18,839

＜LPS4資産分散ファンド(バランス型)＞

銘柄	期首(前期末) 口数	当期末	
		口数	評価額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 25,659	千口 27,285	千円 38,723
TMA日本債券インデックスマザーファンド	36,414	45,644	58,361
TMA外国株式インデックスマザーファンド	9,783	11,051	26,292
TMA外国債券インデックスマザーファンド	20,982	25,383	38,237

＜LPS4資産分散ファンド(成長重視型)＞

銘柄	期首(前期末) 口数	当期末	
		口数	評価額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 31,660	千口 37,502	千円 53,223
TMA日本債券インデックスマザーファンド	24,507	34,219	43,752
TMA外国株式インデックスマザーファンド	12,070	15,189	36,137
TMA外国債券インデックスマザーファンド	14,121	19,030	28,667

＜LPS4資産分散ファンド(積極型)＞

銘柄	期首(前期末) 口数	当期末	
		口数	評価額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 44,077	千口 53,091	千円 75,347
TMA日本債券インデックスマザーファンド	19,325	27,437	35,081
TMA外国株式インデックスマザーファンド	16,600	21,240	50,534
TMA外国債券インデックスマザーファンド	11,428	15,661	23,592

＜LPS4資産分散ファンド（慎重型）＞

○投資信託財産の構成

(2018年5月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TMA日本株TOPIXマザーファンド	6,491	8.9
TMA日本債券インデックスマザーファンド	50,728	69.8
TMA外国株式インデックスマザーファンド	4,407	6.1
TMA外国債券インデックスマザーファンド	10,682	14.7
コール・ローン等、その他	321	0.5
投資信託財産総額	72,629	100.0

(注) 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（12,111,152千円）の投資信託財産総額（12,163,684千円）に対する比率は99.6%です。

(注) 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（13,883,857千円）の投資信託財産総額（13,925,373千円）に対する比率は99.7%です。

(注) 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で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=109.53円、1カナダドル=84.36円、1メキシコペソ=5.62円、1ユーロ=128.14円、1英ポンド=145.86円、1スイスフラン=110.38円、1スウェーデンクローネ=12.54円、1ノルウェークローネ=13.44円、1デンマーククローネ=17.20円、1ポーランドズロチ=29.76円、1豪ドル=82.80円、1ニュージーランドドル=75.92円、1香港ドル=13.96円、1シンガポールドル=81.74円、1マレーシアリングgit=27.52円、1イスラエルシェケル=30.76円、1南アフリカランド=8.76円です。

<LPS4資産分散ファンド(慎重型)>

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	72,629,961
TMA日本株TOP1Xマザーファンド(評価額)	6,491,109
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	50,728,828
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	4,407,563
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	10,682,189
未収入金	320,272
(B) 負債	309,215
未払解約金	84,852
未払信託報酬	221,051
その他未払費用	3,312
(C) 純資産総額(A-B)	72,320,746
元本	55,520,142
次期繰越損益金	16,800,604
(D) 受益権総口数	55,520,142口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,026円

(注) 当ファンドの期首元本額は51,195,438円、期中追加設定元本額は15,621,106円、期中一部解約元本額は11,296,402円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2017年5月30日~2018年5月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	1,522,069
売買益	1,770,144
売買損	△ 248,075
(B) 信託報酬等	△ 451,674
(C) 当期損益金(A+B)	1,070,395
(D) 前期繰越損益金	886,526
(E) 追加信託差損益金	14,843,683
(配当等相当額)	(10,400,267)
(売買損益相当額)	(4,443,416)
(F) 計(C+D+E)	16,800,604
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	16,800,604
追加信託差損益金	14,843,683
(配当等相当額)	(10,430,330)
(売買損益相当額)	(4,413,353)
分配準備積立金	1,956,921

(注) (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) (B) 信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E) 追加信託差損益金は、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です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	861,611円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	42,806円
c. 信託約款に規定する収益調整金	14,843,683円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	1,052,504円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	16,800,604円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,026円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

<LPS4資産分散ファンド(安定重視型)>

○投資信託財産の構成

(2018年5月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TMA日本株TOPIXマザーファンド	13,272	15.9
TMA日本債券インデックスマザーファンド	41,675	50.0
TMA外国株式インデックスマザーファンド	9,294	11.1
TMA外国債券インデックスマザーファンド	18,839	22.6
コール・ローン等、その他	325	0.4
投資信託財産総額	83,405	100.0

(注) 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(12,111,152千円)の投資信託財産総額(12,163,684千円)に対する比率は99.6%です。

(注) 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(13,883,857千円)の投資信託財産総額(13,925,373千円)に対する比率は99.7%です。

(注) 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で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=109.53円、1カナダドル=84.36円、1メキシコペソ=5.62円、1ユーロ=128.14円、1英ポンド=145.86円、1スイスフラン=110.38円、1スウェーデンクローネ=12.54円、1ノルウェークローネ=13.44円、1デンマーククローネ=17.20円、1ポーランドズロチ=29.76円、1豪ドル=82.80円、1ニュージーランドドル=75.92円、1香港ドル=13.96円、1シンガポールドル=81.74円、1マレーシアリンギット=27.52円、1イスラエルシェケル=30.76円、1南アフリカランド=8.76円です。

<LPS4資産分散ファンド(安定重視型)>

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	83,405,348
TMA日本株TOP1Xマザーファンド(評価額)	13,272,859
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	41,675,850
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	9,294,008
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	18,839,671
未収入金	322,960
(B) 負債	309,191
未払解約金	33,892
未払信託報酬	271,179
その他未払費用	4,120
(C) 純資産総額(A-B)	83,096,157
元本	57,614,799
次期繰越損益金	25,481,358
(D) 受益権総口数	57,614,799口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,423円

(注) 当ファンドの期首元本額は28,881,333円、期中追加設定元本額は33,353,972円、期中一部解約元本額は4,620,506円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2017年5月30日～2018年5月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	1,999,012
売買益	2,413,934
売買損	△ 414,922
(B) 信託報酬等	△ 463,205
(C) 当期損益金(A+B)	1,535,807
(D) 前期繰越損益金	1,076,520
(E) 追加信託差損益金	22,869,031
(配当等相当額)	(19,144,452)
(売買損益相当額)	(3,724,579)
(F) 計(C+D+E)	25,481,358
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	25,481,358
追加信託差損益金	22,869,031
(配当等相当額)	(19,215,372)
(売買損益相当額)	(3,653,659)
分配準備積立金	2,612,327

(注) (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) (B) 信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E) 追加信託差損益金は、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です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	1,114,632円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	25,304円
c. 信託約款に規定する収益調整金	22,869,031円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	1,472,391円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	25,481,358円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	4,422円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

＜LPS4資産分散ファンド（バランス型）＞

○投資信託財産の構成

(2018年5月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TMA日本株TOPIXマザーファンド	38,723	23.9
TMA日本債券インデックスマザーファンド	58,361	36.0
TMA外国株式インデックスマザーファンド	26,292	16.2
TMA外国債券インデックスマザーファンド	38,237	23.6
コール・ローン等、その他	591	0.3
投資信託財産総額	162,204	100.0

(注) 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（12,111,152千円）の投資信託財産総額（12,163,684千円）に対する比率は99.6%です。

(注) 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（13,883,857千円）の投資信託財産総額（13,925,373千円）に対する比率は99.7%です。

(注) 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で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=109.53円、1カナダドル=84.36円、1メキシコペソ=5.62円、1ユーロ=128.14円、1英ポンド=145.86円、1スイスフラン=110.38円、1スウェーデンクローネ=12.54円、1ノルウェークローネ=13.44円、1デンマーククローネ=17.20円、1ポーランドズロチ=29.76円、1豪ドル=82.80円、1ニュージーランドドル=75.92円、1香港ドル=13.96円、1シンガポールドル=81.74円、1マレーシアリングギット=27.52円、1イスラエルシェケル=30.76円、1南アフリカランド=8.76円です。

<LPS4資産分散ファンド(バランス型)>

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	162,204,619
TMA日本株TOP1Xマザーファンド(評価額)	38,723,689
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	58,361,611
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	26,292,728
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	38,237,760
未収入金	588,831
(B) 負債	562,077
未払解約金	27,923
未払信託報酬	526,085
その他未払費用	8,069
(C) 純資産総額(A-B)	161,642,542
元本	100,185,917
次期繰越損益金	61,456,625
(D) 受益権総口数	100,185,917口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,134円

(注) 当ファンドの期首元本額は84,842,647円、期中追加設定元本額は52,908,557円、期中一部解約元本額は37,565,287円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2017年5月30日～2018年5月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	6,093,968
売買益	8,112,188
売買損	△ 2,018,220
(B) 信託報酬等	△ 1,040,121
(C) 当期損益金(A+B)	5,053,847
(D) 前期繰越損益金	4,752,474
(E) 追加信託差損益金	51,650,304
(配当等相当額)	(43,018,540)
(売買損益相当額)	(8,631,764)
(F) 計(C+D+E)	61,456,625
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	61,456,625
追加信託差損益金	51,650,304
(配当等相当額)	(43,141,457)
(売買損益相当額)	(8,508,847)
分配準備積立金	9,806,321

(注) (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) (B) 信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E) 追加信託差損益金は、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です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	2,729,733円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	1,794,257円
c. 信託約款に規定する収益調整金	51,650,304円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	5,282,331円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	61,456,625円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	6,134円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

＜LPS4資産分散ファンド（成長重視型）＞

○投資信託財産の構成

(2018年5月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TMA日本株TOPIXマザーファンド	53,223	32.8
TMA日本債券インデックスマザーファンド	43,752	26.9
TMA外国株式インデックスマザーファンド	36,137	22.2
TMA外国債券インデックスマザーファンド	28,667	17.6
コール・ローン等、その他	677	0.5
投資信託財産総額	162,456	100.0

(注) 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（12,111,152千円）の投資信託財産総額（12,163,684千円）に対する比率は99.6%です。

(注) 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（13,883,857千円）の投資信託財産総額（13,925,373千円）に対する比率は99.7%です。

(注) 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で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=109.53円、1カナダドル=84.36円、1メキシコペソ=5.62円、1ユーロ=128.14円、1英ポンド=145.86円、1スイスフラン=110.38円、1スウェーデンクローネ=12.54円、1ノルウェークローネ=13.44円、1デンマーククローネ=17.20円、1ポーランドズロチ=29.76円、1豪ドル=82.80円、1ニュージーランドドル=75.92円、1香港ドル=13.96円、1シンガポールドル=81.74円、1マレーシアリングgit=27.52円、1イスラエルシェケル=30.76円、1南アフリカランド=8.76円です。

<LPS4資産分散ファンド(成長重視型)>

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	162,456,042
TMA日本株TOP1Xマザーファンド(評価額)	53,223,792
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	43,752,863
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	36,137,125
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	28,667,822
未収入金	674,440
(B) 負債	647,095
未払解約金	100,354
未払信託報酬	538,489
その他未払費用	8,252
(C) 純資産総額(A-B)	161,808,947
元本	90,908,414
次期繰越損益金	70,900,533
(D) 受益権総口数	90,908,414口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,799円

(注) 当ファンドの期首元本額は70,433,609円、期中追加設定元本額は36,482,971円、期中一部解約元本額は16,008,166円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2017年5月30日～2018年5月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	8,244,453
売買益	9,700,801
売買損	△ 1,456,348
(B) 信託報酬等	△ 991,820
(C) 当期損益金(A+B)	7,252,633
(D) 前期繰越損益金	6,582,736
(E) 追加信託差損益金	57,065,164
(配当等相当額)	(45,249,755)
(売買損益相当額)	(11,815,409)
(F) 計(C+D+E)	70,900,533
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	70,900,533
追加信託差損益金	57,065,164
(配当等相当額)	(45,333,324)
(売買損益相当額)	(11,731,840)
分配準備積立金	13,835,369

(注) (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) (B) 信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E) 追加信託差損益金は、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です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	2,844,149円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	4,408,484円
c. 信託約款に規定する収益調整金	57,065,164円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	6,582,736円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	70,900,533円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	7,799円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

＜LPS4資産分散ファンド（積極型）＞

○投資信託財産の構成

(2018年5月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TMA日本株TOPIXマザーファンド	75,347	40.7
TMA日本債券インデックスマザーファンド	35,081	18.9
TMA外国株式インデックスマザーファンド	50,534	27.3
TMA外国債券インデックスマザーファンド	23,592	12.7
コール・ローン等、その他	653	0.4
投資信託財産総額	185,207	100.0

(注) 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（12,111,152千円）の投資信託財産総額（12,163,684千円）に対する比率は99.6%です。

(注) 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（13,883,857千円）の投資信託財産総額（13,925,373千円）に対する比率は99.7%です。

(注) 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で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=109.53円、1カナダドル=84.36円、1メキシコペソ=5.62円、1ユーロ=128.14円、1英ポンド=145.86円、1スイスフラン=110.38円、1スウェーデンクローネ=12.54円、1ノルウェークローネ=13.44円、1デンマーククローネ=17.20円、1ポーランドズロチ=29.76円、1豪ドル=82.80円、1ニュージーランドドル=75.92円、1香港ドル=13.96円、1シンガポールドル=81.74円、1マレーシアリングgit=27.52円、1イスラエルシェケル=30.76円、1南アフリカランド=8.76円です。

<LPS4資産分散ファンド(積極型)>

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	185,207,989
TMA日本株TOP1Xマザーファンド(評価額)	75,347,707
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	35,081,896
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	50,534,360
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	23,592,445
未収入金	651,581
(B) 負債	621,219
未払解約金	15,309
未払信託報酬	596,741
その他未払費用	9,169
(C) 純資産総額(A-B)	184,586,770
元本	95,055,628
次期繰越損益金	89,531,142
(D) 受益権総口数	95,055,628口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,419円

(注) 当ファンドの期首元本額は73,622,498円、期中追加設定元本額は47,877,906円、期中一部解約元本額は26,444,776円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況

(2017年5月30日~2018年5月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	9,851,459
売買益	13,018,885
売買損	△ 3,167,426
(B) 信託報酬等	△ 1,109,150
(C) 当期損益金(A+B)	8,742,309
(D) 前期繰越損益金	4,557,848
(E) 追加信託差損益金	76,230,985
(配当等相当額)	(52,114,501)
(売買損益相当額)	(24,116,484)
(F) 計(C+D+E)	89,531,142
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	89,531,142
追加信託差損益金	76,230,985
(配当等相当額)	(52,230,022)
(売買損益相当額)	(24,000,963)
分配準備積立金	13,300,157

(注) (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) (B) 信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E) 追加信託差損益金は、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です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	3,283,017円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	5,218,635円
c. 信託約款に規定する収益調整金	76,230,985円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	4,798,505円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	89,531,142円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	9,418円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○ (参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2018年5月28日現在)

＜TMA日本株TOPIXマザーファンド＞

下記は、TMA日本株TOPIXマザーファンド全体(37,314,542千口)の内容です。

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
日本水産	43.2	26.3	14,175
マルハニチロ	6.3	4.1	16,769
サカタのタネ	5	3.1	12,849
ホクト	7.1	4.6	9,522
鉱業 (0.3%)			
国際石油開発帝石	177.3	108.4	131,760
石油資源開発	5	3.7	10,193
K&Oエナジーグループ	11	4.9	8,687
建設業 (3.1%)			
ショーボンドホールディングス	3.3	2.1	15,750
ミライト・ホールディングス	13.3	7.3	13,052
ベストテラ	—	3	4,584
安藤・間	23.5	16.8	15,808
東急建設	11.3	9.1	10,574
コムシスホールディングス	14.1	8	23,440
ミサワホーム	12.8	8.8	8,729
東建コーポレーション	0.7	1.1	11,825
ヤマウラ	24.5	6.1	5,398
大成建設	169	22.2	136,086
大林組	101.8	67.4	76,903
清水建設	102	66.9	72,987
長谷工コーポレーション	38.9	26	43,030
鹿島建設	147	98	89,572
西松建設	36	4.8	14,640
三井住友建設	144.9	17.1	12,773
前田建設工業	21	15.9	19,032
奥村組	25	3.7	13,671
東鉄工業	3.3	2.9	10,309
戸田建設	37	25	24,425
熊谷組	47	3.5	12,932
大東建託	12.1	7.9	143,424

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
NIPPO	7	4.8	10,540
前田道路	10	7.2	16,041
東亜建設工業	7.9	3.1	8,298
五洋建設	39.7	27.6	19,540
大林道路	15.3	—	—
住友林業	22.4	14.4	24,782
日本基礎技術	33.1	16.3	6,177
パナホーム	10	—	—
大和ハウス工業	99	65.6	264,761
積水ハウス	105.2	72.4	143,279
北陸電気工事	1.9	5.3	6,248
西部電気工業	2.8	1.8	6,633
中電工	5.9	3.3	9,735
関電工	11	9.4	11,251
きんでん	22.5	14.8	27,128
日本電設工業	5.1	4.2	10,122
協和エクシオ	14.1	8.1	23,417
新日本空調	13.4	5.6	9,945
九電工	6.3	4.3	23,091
三機工業	17.9	7.8	8,837
日揮	31.1	19.3	44,447
中外炉工業	45	2.9	8,816
ヤマト	24.9	8.4	6,014
高砂熱学工業	10	6.3	12,713
三晃金属工業	1.7	1.3	4,634
大気社	4.8	2.8	10,010
日比谷総合設備	11.6	4.3	9,649
東芝プラントシステム	5.4	5	12,155
OSJBホールディングス	—	18	5,382
東洋エンジニアリング	30	9	7,992
千代田化工建設	22	15.1	14,299
新興ブランテック	19.6	10	9,580

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
食料品 (4.4%)			
日本製粉	9.7	6.7	12,328
日清製粉グループ本社	37.5	24.4	55,534
鳥越製粉	20.4	9.9	9,612
日本甜菜製糖	7.9	4	9,060
三井製糖	4.8	2.8	10,206
森永製菓	6.7	4.5	25,200
江崎グリコ	8.4	5.4	30,294
山崎製パン	24.7	16.2	37,292
亀田製菓	1.1	1.8	10,566
寿スピリッツ	—	1.8	10,512
カルビー	13.6	9.2	36,524
森永乳業	29	4.1	18,429
ヤクルト本社	18.1	11.7	87,282
明治ホールディングス	19.8	13.1	120,782
雪印メグミルク	6.9	4.6	13,938
ブリマハム	14	16	10,624
日本ハム	23	8.6	38,614
丸大食品	10	18	9,108
S F o o d s	4.5	2.4	10,428
伊藤ハム米久ホールディングス	21.3	13.4	13,614
サッポロホールディングス	11	7.4	20,779
アサヒグループホールディングス	62.9	41.8	240,768
キリンホールディングス	144.1	95.7	296,000
宝ホールディングス	24.9	15.3	19,966
オエノンホールディングス	40	16.4	7,773
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	20.9	14.1	64,084
サントリー食品インターナショナル	23.2	15.3	75,658
ダイドーグループホールディングス	0.6	1.7	10,370
伊藤園	9.8	6.6	29,370
キーコーヒー	8.6	4.5	9,774
ユニカフェ	0.4	5	5,615
ジャパンフーズ	11.8	6.3	9,273
日清オイリオグループ	14	3.2	10,224
不二製油グループ本社	8.9	5.5	20,872
J-オイルミルズ	1	2.5	9,662
キッコーマン	23.5	15.7	77,950
味の素	69.7	46.2	94,686

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キユービー	17.2	11.2	29,321
ハウス食品グループ本社	12.2	7.6	30,552
カゴメ	12	7.8	29,718
アリアケジャパン	2.8	1.8	16,956
ニチレイ	16.9	9.6	28,300
東洋水産	16.5	10.8	41,742
日清食品ホールディングス	13.3	8.6	70,004
フジッコ	7.2	4.1	11,000
ロック・フィールド	9.4	5.1	10,118
日本たばこ産業	186.3	123.5	362,596
ユーグレナ	11	9.5	8,569
繊維製品 (0.7%)			
片倉工業	8.8	6.4	8,870
グンゼ	40	1.5	10,785
東洋紡	120	7.9	14,923
倉敷紡績	78	39	15,054
日本毛織	10.2	10.1	10,796
帝国繊維	4.6	3.9	9,430
帝人	25.3	17.3	37,765
東レ	227.3	150.9	138,526
日本フェルト	24	19.3	10,248
セーレン	7.7	4.4	8,580
小松精練	21.9	8	8,080
ワコールホールディングス	18	5.7	18,781
ホギメディカル	1.9	2.3	11,224
T S I ホールディングス	26.1	13.5	10,651
三陽商会	56	2.8	6,633
オンワードホールディングス	18	12	10,740
ゴールドウイン	—	1.1	9,691
デサント	10.6	5.2	11,445
パルプ・紙 (0.3%)			
特種東海製紙	2.5	2.3	10,269
王子ホールディングス	121	87	66,294
日本製紙	13.4	9.1	18,764
三菱製紙	25.4	12.1	8,155
北越紀州製紙	19.5	14.7	8,996
大王製紙	13.6	8.3	12,948
レンゴー	28.5	19.5	19,500

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ザ・バック	4.4	2.5	9,650
化学 (7.5%)			
クラレ	52.3	35.4	60,534
旭化成	196	129.9	192,316
共和レザー	16.7	8.1	8,221
昭和電工	20.9	13.8	60,996
住友化学	232	153	101,133
住友精化	0.2	—	—
日産化学工業	17.6	12.2	64,660
クレハ	1.6	1.7	12,750
石原産業	9.2	6.3	7,730
片倉コープアグリ	33	3.7	4,558
日本曹達	13	17	10,268
東ソー	92	30.4	59,401
トクヤマ	48	6	24,030
セントラル硝子	29	4.2	10,315
東亜合成	20.2	12.5	16,125
大阪ソーダ	13	3.5	10,867
デンカ	66	7.6	31,654
信越化学工業	56.3	34.6	390,980
堺化学工業	9	3.5	10,195
エア・ウォーター	26.4	17.3	37,662
大陽日酸	24.6	16.2	27,183
日本パーカライジング	16.1	10.8	17,679
ステラ ケミファ	0.4	2.7	9,828
日本触媒	5	3.2	26,976
カネカ	43	27	29,889
三菱瓦斯化学	29.8	17.4	49,294
三井化学	142	19.1	61,693
J S R	32.1	20.9	44,140
東京応化工業	6.2	3.5	14,752
三菱ケミカルホールディングス	210.4	139.5	142,080
KHネオケム	—	3.1	9,486
ダイセル	42.9	28	35,056
住友パークライト	26	16	16,592
積水化学工業	71.8	43.3	78,459
日本ゼオン	25	17.7	25,275
アイカ工業	9.9	5.7	23,455

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
宇部興産	159	10.7	36,808
旭有機材	41	3.8	7,793
日立化成	18	10.5	25,504
タイガースポリマー	17.4	10.5	8,515
ミライアル	7.7	3.5	5,554
日本化薬	19	13.3	16,319
ADEKA	13.4	9.2	18,335
日油	25	8.1	27,256
ハリマ化成グループ	22.9	6.8	6,031
花王	78.1	48.9	406,750
ニイタカ	0.4	2.9	5,286
三洋化成工業	1.1	1.9	10,260
日本ペイントホールディングス	24.4	16.2	75,087
関西ペイント	33.4	22.1	51,912
中国塗料	7.2	9.9	10,692
太陽ホールディングス	2.5	2.3	10,465
D I C	12.8	8.3	29,963
サカタインクス	7.8	6	9,690
東洋インキSCホールディングス	32	20	12,560
富士フイルムホールディングス	62	41.1	174,017
資生堂	59.7	37	308,247
ライオン	38.9	27.8	56,739
高砂香料工業	4.1	3	10,350
マンダム	2.9	3.8	13,680
ミルボン	—	2.6	13,780
ファンケル	7.2	4.6	22,402
コーセー	5	3.4	79,220
コタ	1	4.7	7,317
シーズ・ホールディングス	3.5	2.4	14,640
ポーラ・オルビスホールディングス	12.5	8.5	44,200
ノエビアホールディングス	—	1.3	10,569
エステー	11.2	3.6	9,644
長谷川香料	10.1	3.9	8,669
小林製薬	8.7	5.6	54,712
荒川化学工業	6.9	4.3	8,157
メック	8.3	4	8,912
タカラバイオ	9.3	5.5	13,893
アース製薬	1.8	2.7	15,282

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大成ラミック	1.5	2.5	7,762
クミアイ化学工業	35.9	16.3	11,279
日本農薬	11.6	12.8	8,537
日東電工	22.7	15	133,005
レック	6.5	2.1	8,872
前澤化成工業	9.5	6.1	7,618
エフビコ	2.8	1.7	11,186
天馬	9.3	4	7,552
信越ポリマー	13.2	7.9	9,045
ニフコ	5.5	7.2	27,936
日本バルカー工業	9	2.8	9,324
ユニ・チャーム	63.8	42.1	140,866
医薬品 (4.6%)			
協和発酵キリン	37.8	24.9	55,601
武田薬品工業	117.7	73	324,704
アステラス製薬	319.6	204.4	341,143
大日本住友製薬	22.5	14.7	32,942
塩野義製薬	39.9	28	157,808
田辺三菱製薬	36.7	24.6	47,404
あすか製薬	6.3	4.4	5,728
日本新薬	6.9	5.1	39,831
中外製薬	31.6	20.7	124,821
科研製薬	5.8	3.7	22,311
エーザイ	38.6	23.8	184,592
ロート製薬	15.8	10.8	39,258
小野薬品工業	71	47	126,547
久光製薬	8.9	5.9	52,392
持田製薬	2.2	1.3	10,374
参天製薬	57.5	38	70,680
ツムラ	10.9	7.2	28,584
日医工	7.3	5.4	8,710
キッセイ薬品工業	5.8	3.5	10,535
生化学工業	7.5	7	11,025
鳥居薬品	5.9	3.3	9,401
JCRファーマ	1.7	1.8	12,042
東和薬品	0.6	1.2	8,460
沢井製薬	5.6	4	19,560
ゼリア新薬工業	7.7	4.7	10,692

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
第一三共	92.6	56.8	206,184
キョーリン製薬ホールディングス	7.9	5.2	12,277
大幸薬品	0.5	3.9	7,881
大塚ホールディングス	67.5	41.2	222,768
大正製薬ホールディングス	6.6	4.5	53,415
パプチドリーム	5.9	9	42,075
石油・石炭製品 (0.7%)			
昭和シェル石油	27.5	18.7	27,993
ニチレキ	16.8	7.3	9,504
出光興産	14.7	16.8	62,244
JXTGホールディングス	478.6	317.3	217,826
コスモエネルギーホールディングス	10.7	5.7	21,774
ゴム製品 (0.8%)			
横浜ゴム	19.2	11.5	28,669
東洋ゴム工業	16.5	11.6	19,812
ブリヂストン	105.9	65.8	293,994
住友ゴム工業	29.8	20.2	37,753
オカモト	5	8	9,272
ニッタ	4.5	2.6	11,024
住友理工	8.1	8.1	9,744
バンドー化学	11.2	8.8	11,413
ガラス・土石製品 (1.0%)			
日東紡績	25	3.9	10,214
旭硝子	154	20.2	92,516
日本山村硝子	45	31	5,642
日本電気硝子	63	8.5	25,797
住友大阪セメント	55	38	18,810
太平洋セメント	188	12.6	52,290
日本ヒューム	13.7	10.2	8,904
東海カーボン	28.7	17.6	34,144
東洋炭素	3.4	2.5	9,062
ノリタケカンパニーリミテド	0.4	—	—
TOTO	22.9	15.4	90,552
日本碍子	39.3	24.5	49,539
日本特殊陶業	26.8	17.2	53,062
ニチアス	15	10	14,030
ニチハ	4.3	2.9	12,745

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
鉄鋼 (1.1%)			
新日鐵住金	141.7	87.8	207,251
神戸製鋼所	55.8	36.4	41,095
合同製鐵	1.5	3.1	7,260
ジェイ エフ イー ホールディングス	86.4	53.1	124,519
日新製鋼	11.3	6.5	10,764
東京製鐵	16.2	11	9,911
共英製鋼	3.6	2.7	5,859
大和工業	5.8	4	14,020
大阪製鐵	6.8	4.1	9,278
淀川製鋼所	4	3.5	10,433
東洋鋼鈑	38.4	13.3	9,522
丸一鋼管	10.1	7	25,865
モリ工業	0.3	—	—
大同特殊鋼	50	3.5	18,865
山陽特殊製鋼	11	3.8	10,647
愛知製鋼	0.9	1.8	8,163
日立金属	31.5	21.4	27,028
大平洋金属	23	1	3,710
新日本電工	33.5	26.1	8,874
三菱製鋼	41	3.7	8,820
シンニッタン	24.5	22	10,450
非鉄金属 (0.9%)			
日本軽金属ホールディングス	75.1	56.3	14,694
三井金属鉱業	83	5.2	25,402
東邦亜鉛	14	1.7	7,599
三菱マテリアル	19.9	12.9	39,861
住友金属鉱山	81	25.2	109,191
DOWAホールディングス	32	4.9	17,689
古河機械金属	37	5.8	9,726
UACJ	37	4.3	11,167
古河電気工業	10.1	6.5	29,185
住友電気工業	118.2	73.4	126,284
フジクラ	41.1	23	17,664
タツタ電線	26.5	12.7	7,962
リョービ	22	3.2	10,976
アサヒホールディングス	11.2	4.6	9,241

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
金属製品 (0.7%)			
トーカロ	3.7	7.8	10,732
SUMCO	33	18.3	51,148
東洋製鐵グループホールディングス	22.3	13.9	25,325
コロナ	13.3	5.1	6,232
横河ブリッジホールディングス	11.3	4.2	10,953
駒井ハルテック	4.5	2.1	4,995
三和ホールディングス	30.1	19	23,256
文化シャッター	9.8	10.2	10,169
三協立山	8.2	5.8	9,059
LIXILグループ	44.1	29.3	73,250
ノーリツ	5.5	5.3	10,297
長府製作所	5.2	4.2	10,550
リンナイ	5.2	3.5	37,240
日東精工	31.5	12.7	9,613
東プレ	6	3.4	10,710
高周波熱練	18.2	8.7	9,161
パイオラックス	3.4	3.7	10,826
日本発條	31.3	20	22,480
三益半導体工業	9.5	4.4	8,456
機械 (5.2%)			
日本製鋼所	10.1	6.6	20,922
三浦工業	13.6	8.7	26,839
タクマ	6.7	8	10,096
オークマ	19	2.2	14,146
東芝機械	30	14	8,890
アマダホールディングス	42.4	30.2	36,572
アイダエンジニアリング	8.1	6.6	8,817
F U J I	11	5.7	12,733
牧野フライス製作所	14	8	7,736
オーエスジー	14	9	21,321
旭ダイヤモンド工業	8.5	5.5	4,917
DMG森精機	18.7	10.6	20,553
ディスコ	3.7	2.7	55,188
日東工器	6.1	3.2	9,270
島精機製作所	3.9	2.3	14,122
NCホールディングス	0.8	5.7	4,463
日阪製作所	21.1	9.5	10,459

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ナブテスコ	16.2	10.7	39,269
SMC	9.4	6.2	269,266
新川	18.1	6.4	6,041
ユニオンツール	3.3	2.4	9,588
オイレス工業	3.5	4.2	10,281
サトーホールディングス	5	3.1	9,346
小松製作所	144.8	96.1	348,650
住友重機械工業	92	11.3	44,691
日立建機	13.6	9.2	37,030
巴工業	5.4	3.2	7,120
井関農機	53	4.8	9,739
タカキタ	0.8	6.1	4,880
クボタ	150	106.7	200,862
月島機械	11.8	6	10,536
帝国電機製作所	13.8	3.7	5,453
新東工業	13.7	8.8	9,504
小森コーポレーション	6.5	6.6	8,817
鶴見製作所	0.5	4.5	8,802
住友精密工業	6	—	—
荏原製作所	13.9	8.2	31,365
西島製作所	15.4	10	10,190
ダイキン工業	40.9	27.1	342,679
栗田工業	18	10.7	34,614
椿本チエイン	17	11	9,790
ダイフク	15.3	10.1	58,883
タダノ	15.4	10	15,440
フジテック	8.9	6.8	9,826
CKD	9.5	5.3	12,036
平和	8.9	6.1	15,164
SANKYO	8.1	4.8	21,120
日本金銭機械	8.8	6.7	8,247
福島工業	4.9	2.1	10,426
竹内製作所	5.9	4	10,292
アマノ	9.1	6.2	16,957
サンデンホールディングス	21	—	—
グローリー	9.5	5.9	19,588
大和冷機工業	17.6	7.7	9,971
セガサミーホールディングス	30.3	19.6	36,593

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リケン	1.1	1.4	8,078
ホシザキ	8.8	6.2	66,836
大豊工業	12	5.1	7,257
日本精工	62.3	41.4	53,861
NTN	68	47.4	23,178
ジェイテクト	32.7	21.2	34,619
不二越	29	17	9,333
日本トムソン	26.9	13.1	11,947
THK	21.3	12.4	49,042
ユーシン精機	1.5	5.1	7,206
キッツ	16.5	10.2	10,230
マキタ	39.1	25.9	129,759
日立造船	26	16.2	9,250
三菱重工業	501	33.3	138,960
I H I	228	15.4	63,833
スター精密	5	5.6	10,651
電気機器 (13.6%)			
日清紡ホールディングス	16.4	11.9	16,683
イビデン	20.2	12.1	21,054
コニカミノルタ	71.3	46.1	47,436
ブラザー工業	38.6	24.5	57,158
ミネベアミツミ	55.2	37.2	79,756
日立製作所	717	477	393,858
東芝	668	—	—
三菱電機	319.8	198.8	315,595
富士電機	91	59	47,023
安川電機	34.2	23.1	104,412
明電舎	18	23	9,706
東芝テック	18	16	10,736
マブチモーター	8.4	5.4	27,864
日本電産	38.8	23.9	413,470
東光高岳	4.9	3.1	5,998
ダブル・スコープ	3.4	4.8	8,817
ダイヘン	11	12	9,528
日新電機	8.5	7.8	8,158
オムロン	32	21.1	125,123
日東工業	4.3	5.2	10,452
ジーエス・ユアサ コーポレーション	58	35	18,515

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
メルコホールディングス	3.2	2.4	10,116
テクノメディカ	0.5	2.8	5,602
日本電気	411	25.3	75,798
富士通	289	204	140,515
沖電気工業	12.6	8.4	10,752
サンケン電気	7	14	9,198
アイホン	6.9	3.7	7,018
ルネサスエレクトロニクス	16.3	10.4	11,346
セイコーエプソン	44.5	29.4	58,270
ワコム	49.9	18.6	11,401
アルバック	4.7	4.5	23,355
E I Z O	5.7	2	9,700
ジャパンディスプレイ	61.5	—	—
日本信号	18.3	10.1	10,201
能美防災	7	4.3	11,369
ホーチキ	6.2	4.3	9,326
パナソニック	343.9	227.2	344,776
シャープ	—	18.5	56,517
アンリツ	23.8	14.6	21,564
富士通ゼネラル	9.7	6.1	10,772
日立国際電気	7.2	—	—
ソニー	211.9	132.6	687,265
TDK	16.8	10.4	106,184
アルプス電気	27.4	17.3	45,499
バイオニア	51.7	44.4	7,148
日本電波工業	4.9	—	—
日本トリム	0.8	1.4	6,293
フォスター電機	7.5	5.3	9,386
ヨコオ	12.9	4	8,180
ホシデン	9.5	8.9	9,567
ヒロセ電機	4.8	3.4	48,790
日本航空電子工業	5	5	9,470
アルバイン	7.2	4.2	8,723
アイコム	4.5	3.1	8,490
船井電機	12.4	7.6	5,434
横河電機	32	19.9	39,780
アズビル	9.5	6	32,160
日本光電工業	12.5	8.2	24,436

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
堀場製作所	5.8	4	35,960
アドバンテスト	19.8	11.3	29,572
キーエンス	13.6	9.7	647,572
日置電機	7.1	1.8	7,461
シスメックス	23.2	15.4	155,540
OBARA GROUP	1.3	1.4	9,086
コーセル	9.3	6.5	9,366
イリソ電子工業	—	1.6	10,912
オプテックスグループ	3.6	3.5	10,640
千代田インテグレ	4.7	3.9	9,161
レーザーテック	—	4	14,760
スタンレー電気	21	15.3	57,451
ウシオ電機	17.5	12.3	17,564
日本セラミック	2.1	3.2	8,368
双信電機	35.9	—	—
図研	7.6	5.9	10,201
カシオ計算機	24.5	15.9	26,934
ファナック	30.4	18.9	451,332
ローム	14.4	8.9	92,115
浜松トホニクス	22.2	14.4	67,176
三井ハイテック	18.1	5.9	9,168
新光電気工業	11.4	10.2	9,853
京セラ	49.1	32.6	217,213
太陽誘電	14.9	8.8	21,797
村田製作所	31.5	20.8	336,544
双葉電子工業	8	4.1	8,425
ニチコン	9.6	7.5	10,222
日本ケミコン	44	3	12,540
KOA	10.3	4.2	9,912
小糸製作所	18.1	11.9	94,843
ミツバ	6.9	6	7,200
S C R E E Nホールディングス	6.2	3.8	34,504
キヤノン電子	9.7	3.8	9,245
キヤノン	161.4	107	402,213
リコー	89.4	60.5	60,802
東京エレクトロン	20.1	13.2	282,546
輸送用機器 (8.6%)			
トヨタ紡織	10.5	5.6	12,000

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ユニプレス	6.5	4.3	10,427
豊田自動織機	27.4	16.1	106,099
モリタホールディングス	7.3	4.8	10,694
デンソー	73.9	44.1	239,904
東海理化電機製作所	7.9	5.2	10,909
三井E&Sホールディングス	111	7.2	11,145
川崎重工業	230	15.4	52,899
近畿車輛	3.2	—	—
日産自動車	353.3	234.5	259,826
いすゞ自動車	87.5	58	89,117
トヨタ自動車	364.3	241.4	1,702,352
日野自動車	43.4	28.2	35,503
三菱自動車工業	111.4	74.4	62,719
武蔵精密工業	4.1	2.4	9,564
日産車体	14.5	9.2	8,997
新明和工業	11	9.1	11,320
極東開発工業	11.6	6.1	10,528
日信工業	7	5.1	9,980
トピー工業	3.7	3.2	10,336
ティラド	53	2.2	8,107
曙ブレーキ工業	23.2	—	—
NOK	14	10.9	23,511
フタバ産業	14.5	11.4	9,074
KYB	32	1.9	10,393
プレス工業	33.3	21.5	12,771
ケーヒン	7.6	4.8	10,444
アイシン精機	27.5	16.4	91,184
マツダ	94.9	62.9	88,689
今仙電機製作所	11.9	7.4	9,412
本田技研工業	269.6	178.4	631,000
スズキ	59.3	39.4	247,629
S U B A R U	93.1	61.5	212,113
ヤマハ発動機	42	28.2	91,368
ショーワ	10.2	5.2	10,717
エクセディ	4.1	2.5	9,050
豊田合成	9.6	7.1	20,022
愛三工業	15.3	8.3	8,930
ヨロズ	5.2	4.7	8,732

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エフ・シー・シー	4.4	3.5	11,042
シマノ	12.1	8	124,640
テイ・エス テック	6.9	4.5	21,802
精密機器 (1.7%)			
テルモ	46.1	30.3	193,011
クリエートメディック	16.6	7.5	10,702
日機装	11.1	—	—
島津製作所	38.9	24	73,080
クボテック	1.9	7	3,661
ブイ・テクノロジー	—	0.5	12,470
東京精密	5.4	3.6	15,768
マニー	—	2.4	12,240
ニコン	51.9	34.8	63,405
トプコン	14.6	10.4	20,488
オリンパス	47.7	29.5	113,870
理研計器	11.6	3.1	8,335
タムロン	3.5	4.2	9,240
HOYA	61.7	40	257,520
シチズン時計	35	23.9	18,211
セイコーホールディングス	14	3.8	10,427
ニプロ	22.1	14	18,900
その他製品 (2.2%)			
パラマウントベッドホールディングス	2.9	2	10,380
バンダイナムコホールディングス	32.8	20.7	91,494
アイフイスジャパン	4.6	7	5,173
パイロットコーポレーション	5	3.5	20,545
トッパン・フォームズ	16.5	8	9,424
フジシールインターナショナル	6.9	4.4	19,096
タカラトミー	10.9	9.7	9,651
タカノ	18.5	5.7	5,477
大建工業	4.1	3.7	9,601
凸版印刷	84	56	50,456
大日本印刷	87	25.6	60,492
N I S S H A	4.6	4.1	9,356
アシックス	30.3	19.7	35,597
小松ウオール工業	4.5	2.9	6,504
ヤマハ	20.1	13.5	77,220
クリナップ	14.7	10.3	8,806

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ビジョン	18	11.9	64,141
キングジム	19	8.4	9,382
リンテック	7.3	4.7	14,828
イトーキ	18.7	11.6	7,540
任天堂	18.5	12.2	507,520
三菱鉛筆	2.1	4.2	9,668
タカラスタンダード	4.2	5.3	9,550
コクヨ	15.8	9.4	19,674
オカムラ	11.1	7.4	12,587
美津濃	9	3	12,300
電気・ガス業 (1.8%)			
東京電力ホールディングス	257	159.2	85,808
中部電力	99	61.1	102,434
関西電力	122.7	81.2	127,240
中国電力	41.4	27.8	40,171
北陸電力	28.3	20.1	22,290
東北電力	75.3	47.1	65,469
四国電力	26.3	18.5	26,732
九州電力	65.9	44.5	57,360
北海道電力	27.1	19.7	15,149
沖縄電力	6.05	3.4	10,880
電源開発	23.5	15.8	47,178
東京瓦斯	322	42.3	127,280
大阪瓦斯	290	37.8	91,022
東邦瓦斯	73	9.7	34,629
北海道瓦斯	33	17	5,219
西部瓦斯	59	4.4	13,288
静岡ガス	14.1	11.8	12,437
陸運業 (4.2%)			
東武鉄道	162	21.2	73,034
相鉄ホールディングス	47	6.3	20,097
東京急行電鉄	163	54.2	102,817
京浜急行電鉄	83	27.7	50,414
小田急電鉄	48.5	29.9	71,012
京王電鉄	84	11.2	56,000
京成電鉄	22.9	13.8	50,991
富士急行	2	—	—
東日本旅客鉄道	58	35.7	383,418

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
西日本旅客鉄道	28.8	17.9	141,481
東海旅客鉄道	24.9	17.8	399,788
西武ホールディングス	41.9	25.5	46,588
西日本鉄道	33	5.5	15,779
近鉄グループホールディングス	304	18.9	83,916
阪急阪神ホールディングス	38.1	25.2	111,762
南海電気鉄道	63	8.7	26,752
京阪ホールディングス	68	8.5	32,045
名古屋鉄道	109	14.8	41,366
日本通運	113	7.3	59,495
ヤマトホールディングス	54	33.2	103,152
山九	39	4.8	28,224
丸運	28.9	23	8,119
センコーグループホールディングス	26.1	14.3	12,912
トナミホールディングス	20	1.3	10,218
ニッコンホールディングス	10.1	7.1	21,761
日本石油輸送	1.7	1.6	5,208
福山通運	13	2.6	14,248
セイノーホールディングス	21.4	14.1	29,497
日立物流	6.2	4	11,732
C&Fロジホールディングス	11.9	6	8,490
九州旅客鉄道	29.9	15.8	55,063
S Gホールディングス	—	17.8	46,404
海運業 (0.2%)			
日本郵船	254	15.9	35,616
商船三井	159	11.9	35,438
川崎汽船	114	8.4	19,572
飯野海運	23.3	17.3	8,684
空運業 (0.6%)			
日本航空	52.7	35	152,810
A N Aホールディングス	554	36.6	163,126
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	19	6.5	15,645
三井倉庫ホールディングス	28	27	9,234
住友倉庫	21	14	9,898
東陽倉庫	58.6	25.2	9,223
安田倉庫	10.3	7.3	6,920
上組	35	11.9	28,155

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キムラユニティー	7.7	4.1	4,772
キューソー流通システム	2.2	1.9	5,264
郵船ロジスティクス	9	—	—
近鉄エクスプレス	7.3	4.4	9,807
エーアイティー	1.5	6.2	7,725
情報・通信業 (7.3%)			
NECネットエスアイ	7.2	4.2	10,638
新日鉄住金ソリューションズ	6.9	3.3	9,880
T I S	9.6	6.5	33,605
ネオス	10.6	11.7	4,925
電算システム	1.1	3.8	7,809
グリー	19.9	13.6	8,622
コーエーテクモホールディングス	6.4	5.2	11,377
ヒト・コミュニケーションズ	2.4	3	6,450
ブレインパッド	7.5	2	6,690
K L a b	6.1	6.4	10,905
ネクソン	32.1	43.8	77,657
エムアップ	5.3	—	—
エイチーム	4	3.6	8,380
e n i s h	7.5	—	—
コロブラ	7.9	8.7	6,942
サイバーリンクス	4.3	2.4	2,692
VOYAGE GROUP	4.8	4.3	5,336
ベリサーブ	1.4	—	—
ティーガイア	8.9	3.4	10,540
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	66.8	53.7	15,734
GMOペイメントゲートウェイ	2.3	1.5	17,955
ザップラス	26.6	14.1	5,414
インターネットイニシアティブ	8.4	4.2	9,597
L I N E	5.3	5.8	23,113
フェイス	0.5	4.1	5,342
野村総合研究所	22	12.4	67,456
CEホールディングス	0.5	8.3	6,806
インタージホールディングス	1.1	7.7	8,908
フジ・メディア・ホールディングス	30.9	20.1	37,466
オービック	9.9	6.2	58,342
ヤフー	211.9	140.6	55,537
トレンドマイクロ	15.8	9.5	59,185

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本オラクル	4.8	3	26,700
アルファシステムズ	0.8	—	—
フューチャー	22.3	9.4	13,554
CAC Holdings	11.1	9.2	9,880
ソフトバンク・テクノロジー	3.4	5.2	8,668
伊藤忠テクノソリューションズ	6.2	8.7	17,634
大塚商会	7.7	11.8	53,454
サイボウズ	39.3	9.3	5,291
電通国際情報サービス	7.5	2.9	9,700
デジタルガレージ	5.9	3.6	16,182
ウエザーニューズ	0.7	2	7,030
日本エンタープライズ	21.2	23.1	5,220
ネットワンシステムズ	15.5	7.9	14,441
アルゴグラフィックス	6	1.9	7,087
エイベックス	12	6.8	10,424
日本ユニシス	8.9	5.5	14,487
兼松エレクトロニクス	5.7	2.7	9,679
東京放送ホールディングス	19.2	11	25,795
日本テレビホールディングス	26.8	18.1	34,480
テレビ朝日ホールディングス	7.6	5.1	11,969
スカパーJ S A Tホールディングス	29	22.1	11,116
テレビ東京ホールディングス	6.9	3.3	9,804
日本通信	47.5	—	—
日本電信電話	237.4	139.5	715,914
KDD I	292.7	175.5	513,864
光通信	3.5	2.3	45,195
NTTドコモ	217.8	140.2	392,630
GMOインターネット	10.1	7.1	20,945
カドカワ	8.9	9.8	11,172
ゼンリン	8.2	4	10,188
松竹	19	1.3	20,397
東宝	19.2	12.9	49,342
東映	5	0.7	8,197
エヌ・ティ・ティ・データ	18.5	61.2	75,949
ビジネスブレイン太田昭和	1.9	2.3	5,131
D T S	7.2	2.5	10,950
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11.1	9.1	46,865
カブコン	6.4	8.1	21,060

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
SCSK	7.7	4.5	22,320
アイネス	13.8	7.7	8,778
TKC	4.7	2.8	12,250
富士ソフト	4.4	2.8	12,628
NSD	6.5	5	11,895
コナミホールディングス	13.4	7.9	40,685
ソフトバンクグループ	133.2	88.1	695,020
卸売業 (4.8%)			
伊藤忠食品	0.6	1.5	9,225
エレマテック	2.3	3.4	8,823
JALUX	1.5	1.7	5,001
双日	179.7	115.3	45,774
アルフレッサ ホールディングス	35.3	21.5	60,286
横浜冷凍	17.4	9.5	10,079
あい ホールディングス	5.1	3.3	8,754
マクニカ・富士エレホールディングス	14.5	5.1	9,496
バイタルケーエスケー・ホールディングス	12.5	8.6	9,468
UKCホールディングス	6.4	3.2	7,100
OCHIホールディングス	0.8	2.9	4,379
TOKAIホールディングス	14.7	10.8	12,679
シップヘルスケアホールディングス	5.9	4.2	16,821
明治電機工業	0.3	3.2	6,704
エコートレーディング	14.1	11.7	8,388
ナガイレーベン	6.2	3.5	10,027
三菱食品	4.5	2.9	8,647
松田産業	12.2	3.9	6,774
第一興商	4.6	2.8	14,644
メディアバルホールディングス	30.2	19.4	49,896
アズワン	1.4	1.4	10,906
尾家産業	0.4	2.7	3,890
ドウシシャ	6	3.5	8,743
黒田電気	9.3	—	—
丸文	19	8.1	7,128
橋本総業ホールディングス	1	2.8	4,880
日本ライフライン	—	5.6	14,733
IDOM	21.6	12	9,072
進和	6.8	3.5	8,690
オーハシテクニカ	10.5	4.8	8,640

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
白銅	8.3	2.6	5,860
伊藤忠商事	216.6	143.5	297,475
丸紅	291.1	161.1	136,306
長瀬産業	18.3	11.8	22,054
豊田通商	33.2	21.9	83,001
兼松	94	8.7	14,502
三井物産	266.9	165.9	316,620
日本紙パルプ商事	26	2.1	10,048
日立ハイテクノロジーズ	9.9	6.7	33,634
山善	18.8	11.3	12,825
住友商事	185.7	123.3	229,707
内田洋行	1.7	2.8	8,596
三菱商事	221.2	137.5	418,412
キヤノンマーケティングジャパン	8	5.6	13,708
西華産業	33	3.1	8,698
菱洋エレクトロ	12.3	5.3	9,471
東京産業	38.3	12.5	7,750
阪和興業	28	3.6	17,190
岩谷産業	32	4.2	16,464
イワキ	53	13.8	6,292
三愛石油	15.7	6.5	10,478
稲畑産業	14.1	5.9	9,499
ワキタ	6.5	7.6	9,066
東邦ホールディングス	9.2	5.6	15,355
サンゲツ	10.7	6.8	15,456
シナネンホールディングス	1.8	3.1	8,180
伊藤忠エネクス	16.8	8.2	9,200
サンリオ	8.9	5.8	11,919
リョーサン	4.1	2.5	9,950
三信電気	1.5	4.4	9,446
モスフードサービス	3.5	3.1	10,214
加賀電子	8.2	3.5	9,919
立花エレテック	10.7	3.8	8,025
フォーバル	1.4	6.6	6,019
PALTAC	4.1	2.7	17,388
日鉄住金物産	1.8	1.7	10,149
トラスコ中山	6.2	4	10,840
オートボックスセブン	11.1	7.7	15,592

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
加藤産業	4.7	2.9	11,237
イノテック	26.8	5.1	7,272
杉本商事	7.5	5.4	10,918
因幡電機産業	4	2.4	11,664
ミスミグループ本社	33.8	22.4	74,144
スズケン	13.5	9	45,180
ジェコス	7.9	8.1	8,837
小売業 (5.0%)			
ローソン	9.2	4.9	35,133
サンエー	1.5	1.9	10,716
エービーシー・マート	5.6	3.6	25,236
ハードオフコーポレーション	4.2	4.3	4,816
アスクル	3.4	3	9,555
ゲオホールディングス	8.5	6.1	9,766
アダストリア	3.9	4.4	7,101
ジーフット	1.4	9.9	7,771
エディオン	23	8.7	10,144
ハローズ	0.5	—	—
あみやき亭	1.1	1.5	7,665
ハニーズホールディングス	10.5	6.6	6,745
ジーンズ	1.7	1.6	9,920
ビックカメラ	17.1	10.8	18,630
DCMホールディングス	18.1	11	11,935
Monotaro	10.9	7	29,575
J. フロント リテイリング	36.8	23.4	40,528
ドトール・日レスホールディングス	9.3	4	9,184
マツモトキヨシホールディングス	5.5	7.9	42,976
スタートトゥデイ	27.2	19.1	72,675
トレジャー・ファクトリー	—	3.9	2,960
ココカラファイン	3.2	2	17,060
三越伊勢丹ホールディングス	58.5	36.9	48,929
ウエルシアホールディングス	6.4	5.2	30,940
クリエイトSDホールディングス	3.7	3.4	11,135
シュッピン	1.4	5.2	8,018
ジョイフル本田	5	2.7	10,341
すかいらーく	12.8	12.1	19,565
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	16.8	10.2	14,637
ブックオフコーポレーション	9.8	6.5	5,310

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ゴルフダイジェスト・オンライン	4.9	5.7	7,883
あさひ	6.9	4.5	5,976
コスモス薬品	1.4	1	23,840
トーエル	1.8	5.8	5,991
セブン&アイ・ホールディングス	124.1	82.1	399,909
薬王堂	—	1.7	6,868
ツルハホールディングス	5.9	4.2	68,754
サンマルクホールディングス	4.1	3.4	9,703
トリドールホールディングス	3.2	2.9	9,352
クスリのアオキホールディングス	2.5	1.5	11,925
スシローグローバルホールディングス	—	2.2	14,256
総合メディカル	0.3	—	—
カッパ・クリエイト	6.9	6.3	8,883
ライトオン	10.5	8.3	8,573
良品計画	3.9	2.6	96,070
三城ホールディングス	27.7	15.7	7,912
アドヴァン	14.9	7.2	7,185
G-7ホールディングス	0.7	2.6	7,173
エコス	0.1	3.8	6,425
マルシェ	2.2	6.3	5,191
ドンキホーテホールディングス	19.4	12.7	72,898
西松屋チェーン	7.8	7.2	8,640
ゼンショーホールディングス	15.1	10.3	27,470
サイゼリヤ	4.6	4.2	10,600
魚力	0.3	3.9	5,569
ユナイテッドアローズ	3.7	2.3	9,487
ハイデイ日高	2.6	3.1	8,252
京都きもの友禅	12.4	6.5	4,238
コロワイド	9.8	6.4	19,648
巻番屋	3.3	2.4	11,076
スギホールディングス	6.6	4.3	28,079
スクロール	26.5	15	9,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	13.1	6.2	69,130
木曾路	7	3.4	9,924
千趣会	23.5	13.3	7,022
ケーヨー	22.6	13	7,098
上新電機	—	1.4	5,677
日本瓦斯	5.2	3.5	20,335

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ロイヤルホールディングス	7	3.6	10,670
いなげや	0.5	5.5	9,801
島忠	7.9	4.3	14,641
チヨダ	5.4	3.9	10,206
ライフコーポレーション	2.5	3.5	9,912
AOKIホールディングス	13.2	6.6	11,820
コメリ	4.6	3.2	9,171
青山商事	6.2	3.8	15,143
しまむら	3.3	2.2	25,058
高島屋	51	31	28,179
松屋	13.4	7.2	10,058
エイチ・ツー・オー リテイリング	15.8	9.5	17,850
パルコ	11.5	6.1	8,137
丸井グループ	31.1	18.8	42,243
アクシアル リテイリング	1	2.7	11,205
イオン	122.1	75.3	163,476
イズミ	5.8	3.5	23,765
平和堂	6.2	4.2	11,088
フジ	5.6	3.8	8,698
ヤオコー	3.2	2	11,780
ゼビオホールディングス	7.5	4	7,332
ケーズホールディングス	13.5	16.7	22,979
Genky Drug Stores	—	1.5	6,622
アインホールディングス	3.9	2.6	20,280
ヤマダ電機	99.4	66.3	37,857
ニトリホールディングス	12.8	7.8	146,094
吉野家ホールディングス	10.7	6.8	14,273
王将フードサービス	2.6	1.9	11,001
ブレナス	4.7	5.2	9,687
ミニストップ	—	3	6,753
アークス	5.8	3.7	11,192
パローホールディングス	6.9	4.5	11,943
ファーストリテイリング	5	2.6	125,658
サンドラッグ	11.4	8.2	42,148
ヤマザワ	4.9	4.2	7,585
ペルーナ	22.4	6.8	9,717
銀行業 (7.0%)			
めぶきフィナンシャルグループ	146.4	102.8	41,428

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京きらぼしフィナンシャルグループ	4.1	2.2	5,555
九州フィナンシャルグループ	49.3	32.5	17,257
ゆうちょ銀行	83.7	56.1	79,269
コンソルディア・フィナンシャルグループ	194.5	116.7	72,470
西日本フィナンシャルホールディングス	20.1	12.6	16,997
関西みらいフィナンシャルグループ	—	7.7	6,545
三十三フィナンシャルグループ	—	4.6	10,258
新生銀行	280	17.2	30,839
あおぞら銀行	184	11.6	50,518
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,240.9	1,371.7	950,588
りそなホールディングス	347.1	215.7	133,647
三井住友トラスト・ホールディングス	61.6	38.5	178,678
三井住友フィナンシャルグループ	236.8	147.9	678,417
第四銀行	39	2.1	9,817
北越銀行	3	3.2	7,510
千葉銀行	115	69.1	58,735
群馬銀行	65.8	39.1	24,828
武蔵野銀行	4.4	2.8	9,982
千葉興業銀行	24.6	7.8	3,915
七十七銀行	43	5.9	14,820
青森銀行	14	2	6,600
秋田銀行	18	2.8	8,442
山形銀行	7	3.4	8,245
岩手銀行	1	1.8	7,722
東邦銀行	18	15.3	6,318
東北銀行	52	3.7	5,168
ふくおかフィナンシャルグループ	121	79	45,662
静岡銀行	79	51.6	55,005
十六銀行	37	2.4	7,044
スルガ銀行	30.7	20.2	25,492
八十二銀行	57.8	35.5	17,501
山梨中央銀行	10	18	8,334
大垣共立銀行	44	3.5	10,059
福井銀行	28	3.7	8,628
北國銀行	26	2.1	9,240
滋賀銀行	26	17	9,775
南都銀行	2.6	2	5,814
百五銀行	25	17.5	8,260

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
京都銀行	52	7.4	43,216
紀陽銀行	11	6.9	12,930
三重銀行	4.9	—	—
ほくほくフィナンシャルグループ	19.9	13	20,670
広島銀行	88	28.6	22,965
山陰合同銀行	18.4	11	11,462
中国銀行	20.9	13.4	17,071
鳥取銀行	5.7	3.4	5,854
伊予銀行	35.1	27.8	21,739
百十四銀行	29	21	7,707
四国銀行	48	6	8,772
阿波銀行	25	14	9,912
大分銀行	7	2.3	9,004
宮崎銀行	21	1.6	5,520
佐賀銀行	33	1.1	2,640
十八銀行	33	31	9,362
沖縄銀行	2.5	1.9	8,303
琉球銀行	5.6	3.9	6,688
セブン銀行	113.2	73.2	25,107
みずほフィナンシャルグループ	4,017.3	2,663.5	517,518
山口フィナンシャルグループ	28	24	32,448
長野銀行	3.4	3	5,436
名古屋銀行	1.4	2.7	10,786
北洋銀行	48.2	30	11,430
第三銀行	2.4	—	—
中京銀行	4.6	2.9	6,748
愛媛銀行	10.4	5.9	7,445
トマト銀行	5.7	4.4	6,714
京葉銀行	22	17	8,432
関西アーバン銀行	6.6	—	—
栃木銀行	14	19	7,752
トモニホールディングス	26.8	18.3	8,967
フィデアホールディングス	42.3	42.4	7,844
池田泉州ホールディングス	34.3	19.9	7,880
証券、商品先物取引業 (1.0%)			
F P G	10.6	7.3	10,621
S B Iホールディングス	34.4	22.4	68,208
ジャフコ	4.7	2.8	13,104

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大和証券グループ本社	268	168	109,586
野村ホールディングス	605.2	337.5	196,897
岡三証券グループ	22	15	8,640
丸三証券	6.5	10.1	10,302
東洋証券	3	—	—
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	36	22.3	16,635
水戸証券	13.4	15.2	6,171
いちよし証券	14.1	8.8	11,404
松井証券	15.3	10.4	10,961
だいこう証券ビジネス	4.2	7.1	4,196
マネックスグループ	64.3	22	14,630
カブドットコム証券	43.7	31.1	12,408
極東証券	6.9	6.3	9,405
藍澤證券	2.2	11.1	8,791
保険業 (2.3%)			
かんぽ生命保険	11.1	7.1	17,714
S O M P Oホールディングス	61.6	38.5	182,836
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	88.5	51	180,591
ソニーフィナンシャルホールディングス	28.2	16	33,088
第一生命ホールディングス	177.8	110.7	232,802
東京海上ホールディングス	118.8	73.9	391,300
T & Dホールディングス	108.2	61	109,800
その他金融業 (1.3%)			
全国保証	8.3	5.6	29,344
クレディセゾン	22.8	15.1	28,237
芙蓉総合リース	3.1	2.1	16,674
興銀リース	5.9	3.5	10,762
東京センチュリー	5.9	4	27,720
日本証券金融	31.5	13.8	8,873
アイフル	49.4	34.2	12,551
リコーリース	2.5	2.7	9,760
イオンフィナンシャルサービス	19.1	13.8	35,893
アコム	60.6	40.1	19,007
オリエントコーポレーション	68.9	53.7	8,269
日立キャピタル	6.6	5.4	15,876
オリックス	209.2	130.6	246,115
三菱UFJリース	76.1	50.2	33,433
日本取引所グループ	92.7	56.6	120,614

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アサックス	0.3	2.3	4,462
NECキャピタルソリューション	6.7	4.5	9,072
不動産業 (2.4%)			
いちご	34.2	26.5	13,011
ヒューリック	61.8	40.9	46,666
野村不動産ホールディングス	19.5	12.8	33,267
オープンハウス	3.9	3.1	20,336
東急不動産ホールディングス	71.2	47.3	37,272
飯田グループホールディングス	24.6	16.6	35,441
パーク24	14.9	10.8	32,508
三井不動産	157	97.7	271,703
三菱地所	219.9	145.9	289,246
平和不動産	9.2	4.4	9,913
東京建物	34.5	21.6	33,112
ダイビル	9.8	9.1	10,829
京阪神ビルディング	25.2	8.3	7,511
住友不動産	71	47	196,601
大京	56	4.5	11,767
テーオーシー	15.8	10.7	9,373
レオパレス21	35.2	24.1	20,629
スターツコーポレーション	5.6	3.5	9,884
空港施設	21.7	10.1	6,494
ゴールドクレスト	3.9	3.6	7,365
日本エスリード	10.1	3.5	7,448
サンヨーハウジング名古屋	12.5	4.9	6,041
イオンモール	18.3	12.9	27,051
カチタス	—	2.6	10,036
エヌ・ティ・ティ都市開発	17.7	12.5	14,225
日本空港ビルデング	9.3	5.6	29,400
サービス業 (4.4%)			
日本M&Aセンター	9.1	13.2	48,576
バソナグループ	15.8	4.9	8,374
GCA	12.2	8.7	8,369
エス・エム・エス	3.5	3.7	15,244
パーソルホールディングス	24.2	17.5	41,930
クックパッド	7.6	14.9	8,954
学情	5.6	4.1	5,637
スタジアオアリス	4	3.3	8,401

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
シミックホールディングス	8.2	3.3	7,121
NJS	5.4	5.7	10,128
総合警備保障	11.6	7.6	37,810
カカコム	22	14.4	32,558
アイロムグループ	4.2	2.3	4,604
ディップ	2.7	3.7	9,975
キャリアデザインセンター	6.1	2.7	6,002
エムスリー	27.4	20.1	93,063
アウトソーシング	—	5.6	11,580
ディー・エヌ・エー	13.5	10.4	21,923
博報堂DYホールディングス	43.3	26.4	44,589
ぐるなび	3.9	7	6,979
ファンコミュニケーションズ	21.2	12.7	9,461
WDBホールディングス	6.5	2.6	8,203
インフォマート	—	9.7	10,592
EPSホールディングス	11.8	5.1	11,179
ドリームインキュベータ	4.7	—	—
クイック	6.4	5	8,445
ケネディクス	43	26.3	18,883
電通	35	23.2	122,960
みらかホールディングス	8.3	5.6	19,712
ダイオーズ	2.6	4.9	6,360
日本空調サービス	24.6	11.9	9,555
オリエンタルランド	33.7	22.4	251,440
ダスキン	7.6	4.9	13,087
ラウンドワン	—	5.5	10,769
リゾートトラスト	12.6	8.4	17,438
ビー・エム・エル	5.1	3.3	9,157
りらいあコミュニケーションズ	17	6.1	9,430
リソー教育	—	7	5,929
早稲田アカデミー	2.2	4.4	9,354
ユー・エス・エス	37.9	23.6	49,701
サイバーエージェント	18.2	11.8	69,030
楽天	160	97.9	70,732
テー・オー・ダブリュー	11.1	9.8	8,780
テクノプロ・ホールディングス	5	3.7	26,011
インターワークス	—	3.8	3,898
ファーストロジック	1.3	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キャリアリンク	5.2	9.1	5,205
ライドオンエクスプレスホールディングス	6.1	4.9	5,835
リクルートホールディングス	68.3	146.4	441,981
エラン	0.7	2.6	6,050
日本郵政	82.3	107.7	136,240
MS-Japan	—	0.8	6,232
リログループ	12.8	10.4	29,307
エイチ・アイ・エス	4.8	2.9	11,005
共立メンテナンス	4.8	3.4	19,346
建設技術研究所	10.1	5.8	8,439
燦ホールディングス	2.2	—	—
よみうりランド	7	1.9	9,148
東京都競馬	64	2.2	10,274
カナモト	3.9	3.1	11,563
東京ドーム	13.5	9.2	9,788
トランス・コスモス	2	3.8	10,146
乃村工藝社	7	4.8	11,140
日本管財	8.5	4.2	9,156

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
白洋舎	3.4	1.7	5,916	
セコム	32.5	20.1	163,694	
セントラル警備保障	5.2	2.1	9,093	
メイテック	3.5	2.1	10,962	
アサツー ディ・ケイ	4.7	—	—	
応用地質	12.8	5.5	8,090	
船井総研ホールディングス	4.1	4	10,740	
ベネッセホールディングス	10.5	7	28,490	
イオンディライト	2.3	2.7	10,570	
ニチイ学館	19.5	5.6	6,798	
ダイセキ	5.5	3.1	11,020	
ステップ	4.3	4.2	7,551	
合 計	株 数・金 額	44,799	24,088	50,269,924
	銘柄数<比率>	1,094	1,090	<94.9%>

(注) 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) 合計欄の<>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。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	
		百万円	百万円
		3,636	—

＜TMA日本債券インデックスマザーファンド＞

下記は、TMA日本債券インデックスマザーファンド全体(5,386,453千口)の内容です。

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
国債証券	4,700,000	5,259,203	76.4	—	56.3	16.6	3.5	
地方債証券	412,000	447,789	6.5	—	1.9	1.5	3.1	
	(412,000)	(447,789)	(6.5)	(—)	(1.9)	(1.5)	(3.1)	
特殊債券 (除く金融債)	304,000	332,907	4.8	—	1.7	3.0	0.1	
	(304,000)	(332,907)	(4.8)	(—)	(1.7)	(3.0)	(0.1)	
普通社債券 (含む投資法人債券)	760,932	815,121	11.8	—	6.0	—	5.9	
	(760,932)	(815,121)	(11.8)	(—)	(6.0)	(—)	(5.9)	
合 計	6,176,932	6,855,022	99.5	—	65.8	21.1	12.6	
	(1,476,932)	(1,595,819)	(23.2)	(—)	(9.6)	(4.5)	(9.1)	

(注) () 内は非上場債で内書きです。

(注) 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) 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)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期 末				銘 柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円		国債証券	%	千円	千円	
第132回利付国債(5年)	0.1	50,000	50,448	2022/6/20	第35回利付国債(30年)	2.0	10,000	13,009	2041/9/20
第135回利付国債(5年)	0.1	180,000	181,913	2023/3/20	第38回利付国債(30年)	1.8	20,000	25,291	2043/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	40,000	54,215	2052/3/20	第39回利付国債(30年)	1.9	20,000	25,776	2043/6/20
第6回利付国債(40年)	1.9	25,000	33,210	2053/3/20	第42回利付国債(30年)	1.7	10,000	12,444	2044/3/20
第7回利付国債(40年)	1.7	45,000	57,067	2054/3/20	第44回利付国債(30年)	1.7	30,000	37,413	2044/9/20
第9回利付国債(40年)	0.4	10,000	8,505	2056/3/20	第45回利付国債(30年)	1.5	30,000	35,979	2044/12/20
第308回利付国債(10年)	1.3	10,000	10,296	2020/6/20	第47回利付国債(30年)	1.6	50,000	61,212	2045/6/20
第320回利付国債(10年)	1.0	50,000	52,012	2021/12/20	第48回利付国債(30年)	1.4	30,000	35,259	2045/9/20
第324回利付国債(10年)	0.8	50,000	51,866	2022/6/20	第49回利付国債(30年)	1.4	70,000	82,271	2045/12/20
第327回利付国債(10年)	0.8	150,000	156,258	2022/12/20	第50回利付国債(30年)	0.8	20,000	20,489	2046/3/20
第336回利付国債(10年)	0.5	40,000	41,489	2024/12/20	第51回利付国債(30年)	0.3	80,000	71,654	2046/6/20
第339回利付国債(10年)	0.4	100,000	103,224	2025/6/20	第56回利付国債(30年)	0.8	40,000	40,725	2047/9/20
第340回利付国債(10年)	0.4	40,000	41,320	2025/9/20	第44回利付国債(20年)	2.5	150,000	157,164	2020/3/20
第345回利付国債(10年)	0.1	100,000	100,899	2026/12/20	第45回利付国債(20年)	2.4	80,000	83,676	2020/3/20
第346回利付国債(10年)	0.1	100,000	100,836	2027/3/20	第47回利付国債(20年)	2.2	20,000	21,084	2020/9/21
第347回利付国債(10年)	0.1	60,000	60,461	2027/6/20	第49回利付国債(20年)	2.1	30,000	31,889	2021/3/22
第3回利付国債(30年)	2.3	20,000	25,132	2030/5/20	第50回利付国債(20年)	1.9	80,000	86,352	2021/3/22
第5回利付国債(30年)	2.2	10,000	12,593	2031/5/20	第51回利付国債(20年)	2.0	230,000	245,101	2021/6/21
第22回利付国債(30年)	2.5	10,000	13,570	2036/3/20	第52回利付国債(20年)	2.1	140,000	150,393	2021/9/21
第26回利付国債(30年)	2.4	30,000	40,424	2037/3/20	第53回利付国債(20年)	2.1	80,000	86,352	2021/12/20
第28回利付国債(30年)	2.5	20,000	27,481	2038/3/20	第60回利付国債(20年)	1.4	20,000	21,384	2022/12/20
第29回利付国債(30年)	2.4	60,000	81,547	2038/9/20	第64回利付国債(20年)	1.9	40,000	44,248	2023/9/20
第33回利付国債(30年)	2.0	40,000	51,783	2040/9/20	第66回利付国債(20年)	1.8	160,000	176,852	2023/12/20

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第67回利付国債 (20年)	1.9	150,000	167,329	2024/3/20
第69回利付国債 (20年)	2.1	10,000	11,272	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	40,000	46,026	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	60,000	68,310	2024/6/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	120,000	137,119	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	30,000	34,429	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	10,000	11,339	2025/3/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	40,000	46,093	2025/6/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	80,000	92,588	2025/9/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	80,000	92,377	2025/12/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	100,000	118,434	2026/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	50,000	59,896	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	110,000	133,278	2028/3/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	60,000	72,544	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	50,000	60,641	2028/12/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	20,000	24,474	2029/9/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	50,000	62,108	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	50,000	61,102	2030/6/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	40,000	49,647	2030/12/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	70,000	85,340	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	40,000	48,841	2031/6/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	50,000	60,642	2031/12/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	80,000	96,428	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	40,000	48,250	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	30,000	35,808	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	50,000	60,478	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	50,000	60,513	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	20,000	23,936	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	20,000	23,640	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	40,000	47,318	2034/6/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	20,000	22,732	2034/12/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	60,000	69,120	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	50,000	56,752	2035/9/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	30,000	29,925	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	70,000	67,188	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	70,000	70,711	2036/9/20

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第161回利付国債 (20年)	0.6	80,000	81,747	2037/6/20
小 計		4,700,000	5,259,203	
地方債証券				
平成24年度第12回愛知県公募債 (30年)	2.12	100,000	128,967	2042/9/19
平成21年度第1回千葉県公募債	1.53	12,000	12,163	2019/4/25
第75回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	101,733	2019/6/25
平成22年度第3回横浜市公募債	1.168	100,000	102,626	2020/9/18
第1回川崎市15年公募債	1.78	100,000	102,300	2019/9/20
小 計		412,000	447,789	
特殊債券(除く金融債)				
第344回政府保証道路債債券	1.6	100,000	103,477	2020/7/15
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	105,312	2021/2/26
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	4,000	4,032	2018/11/28
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	120,086	2027/10/29
小 計		304,000	332,907	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第333回道路債債券	2.91	100,000	136,954	2034/6/20
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	49,814	52,555	2046/11/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	53,581	56,469	2046/12/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	51,286	54,048	2047/1/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	52,254	55,133	2047/4/10
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	10,293	10,346	2036/12/10
第15回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	43,704	45,086	2039/2/10
第3回ヒューリック株式会社無担保社債	0.8	100,000	101,095	2020/4/24
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	0.87	100,000	100,142	2018/8/3
第5回住友生命基金流動化特定目的会社第1回特定社債	1.12	100,000	100,185	2018/8/8
第7回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.11	100,000	103,107	2019/12/20
小 計		760,932	815,121	
合 計		6,176,932	6,855,022	

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

(注) 永久債は、実質的な償還日を記載しています。

〈TMA外国株式インデックスマザーファンド〉

下記は、TMA外国株式インデックスマザーファンド全体(5,018,570千口)の内容です。

外国株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	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	39	20	92	10,115	保険	
AGCO CORP	13	5	34	3,753	資本財	
AT&T INC	699	143	466	51,119	電気通信サービス	
ABBOTT LABORATORIES	197	44	274	30,099	ヘルスケア機器・サービス	
ABBVIE INC	184	38	392	42,978	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACTIVISION BLIZZARD INC	77	24	177	19,410	ソフトウェア・サービス	
ACUITY BRANDS INC	8	2	33	3,615	資本財	
ADOBE SYSTEMS INC	61	12	302	33,079	ソフトウェア・サービス	
ADVANCE AUTO PARTS	11	3	39	4,282	小売	
AETNA INC	43	8	143	15,703	ヘルスケア機器・サービス	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	10	2	37	4,150	各種金融	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	46	14	89	9,849	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	22	7	126	13,861	素材	
AKAMAI TECHNOLOGIES	31	6	47	5,178	ソフトウェア・サービス	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	29	7	92	10,084	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALLEGHANY CORP	2	0.99	56	6,239	保険	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	7	1	41	4,598	ソフトウェア・サービス	
ALLSTATE CORP	48	10	96	10,517	保険	
ALPHABET INC-CL C	36	7	820	89,894	ソフトウェア・サービス	
ALPHABET INC-CL A	34	7	853	93,447	ソフトウェア・サービス	
ALTRIA GROUP INC	215	44	246	27,017	食品・飲料・タバコ	
AMAZON.COM INC	46	10	1,724	188,881	小売	
AMEREN CORPORATION	37	11	64	7,118	公益事業	
AMERICAN ELECTRIC POWER	55	12	86	9,453	公益事業	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	95	18	191	20,973	各種金融	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	122	27	145	15,966	保険	
AMERISOURCEBERGEN CORP	24	7	62	6,798	ヘルスケア機器・サービス	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	23	3	55	6,075	各種金融	
AMGEN INC	85	20	366	40,177	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMPHENOL CORP-CL A	42	9	79	8,727	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ANADARKO PETROLEUM CORP	69	14	97	10,690	エネルギー	
ANALOG DEVICES	46	8	77	8,478	半導体・半導体製造装置	
ANSYS INC	13	2	48	5,280	ソフトウェア・サービス	
ANTHEM INC	33	6	158	17,333	ヘルスケア機器・サービス	
APACHE CORP	49	13	51	5,605	エネルギー	
APPLE INC	618	129	2,442	267,525	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
APPLIED MATERIALS INC	136	28	144	15,789	半導体・半導体製造装置	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	72	12	56	6,172	食品・飲料・タバコ	
ARCONIC INC	73	—	—	—	資本財	
AUTODESK INC	27	7	100	10,992	ソフトウェア・サービス	
AUTOLIV INC	16	3	47	5,196	自動車・自動車部品	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	56	14	190	20,907	ソフトウェア・サービス	
AUTOZONE INC	3	0.9	57	6,246	小売	
AVERY DENNISON CORP	16	3	39	4,301	素材	
BB&T CORPORATTON	105	21	119	13,051	銀行	
BAKER HUGHES INC	50	—	—	—	エネルギー	

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			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		
BAKER HUGHES A GE CO	—	14	49	5,423	エネルギー	
BALL CORP	51	12	46	5,118	素材	
BANK OF AMERICA CORP	1,188	262	791	86,675	銀行	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	130	32	182	19,997	各種金融	
BARD (C. R.) INC	10	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
BAXTER INTL INC	65	13	101	11,074	ヘルスケア機器・サービス	
BECTON DICKINSON & CO	28	7	156	17,153	ヘルスケア機器・サービス	
BED BATH & BEYOND INC	27	—	—	—	小売	
WR BERKLEY CORP	16	4	34	3,747	保険	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	142	35	693	75,980	各種金融	
BEST BUY COMPANY INC	43	—	—	—	小売	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	27	6	55	6,118	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BIOGEN INC	26	6	195	21,442	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BLACKROCK INC	13	3	169	18,617	各種金融	
H&R BLOCK INC	39	10	30	3,328	消費者サービス	
BOEING CO	69	15	568	62,276	資本財	
BOOKING HOLDINGS INC	—	1	320	35,138	小売	
BORGWARNER INC	39	8	42	4,661	自動車・自動車部品	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	176	35	107	11,795	ヘルスケア機器・サービス	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	—	5	26	2,866	保険	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	196	51	272	29,795	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BROADCOM INC	—	11	299	32,780	半導体・半導体製造装置	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	28	11	65	7,184	食品・飲料・タバコ	
CBS CORP CL-B	53	11	57	6,325	メディア	
CDK GLOBAL INC	23	5	35	3,840	ソフトウェア・サービス	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	39	—	—	—	素材	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	18	6	56	6,223	運輸	
CIGNA CORP	32	6	110	12,060	ヘルスケア機器・サービス	
CIT GROUP INC	31	—	—	—	銀行	
CME GROUP INC	39	8	142	15,593	各種金融	
CMS ENERGY CORP	40	10	47	5,161	公益事業	
CSX CORP	118	22	143	15,769	運輸	
CVS HEALTH CORPORATION	124	24	165	18,073	ヘルスケア機器・サービス	
CA INC	46	12	43	4,720	ソフトウェア・サービス	
CABOT OIL & GAS CORP	79	15	34	3,795	エネルギー	
CAMPBELL SOUP CO	31	12	42	4,638	食品・飲料・タバコ	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	62	11	108	11,848	各種金融	
CARDINAL HEALTH INC	40	12	65	7,202	ヘルスケア機器・サービス	
CARMAX INC	28	8	60	6,573	小売	
CARNIVAL CORP	48	13	87	9,627	消費者サービス	
CATERPILLAR INC	72	19	300	32,928	資本財	
CELANESE CORP-SERIES A	24	5	68	7,469	素材	
CELGENE CORP	93	19	156	17,095	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CENTERPOINT ENERGY INC	60	15	41	4,527	公益事業	
CENTURYLINK INC.	83	—	—	—	電気通信サービス	
CERNER CORP	43	14	85	9,388	ヘルスケア機器・サービス	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	26	5	136	14,915	メディア	
CHEVRONTXACO CORP	211	50	615	67,412	エネルギー	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A	4	0.99	42	4,651	消費者サービス	
CIMAREX ENERGY CO	16	3	36	3,973	エネルギー	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	23	7	52	5,769	保険	
CISCO SYSTEMS INC	587	137	594	65,099	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		千円	
			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		
CINTAS CORP	14	3	54	6,021	商業・専門サービス	
CITIGROUP INC	337	73	505	55,374	銀行	
CITRIX SYSTEMS INC	25	5	54	5,963	ソフトウェア・サービス	
CLOROX COMPANY	19	4	54	5,947	家庭用品・パーソナル用品	
COACH INC	41	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
COCA-COLA COMPANY	440	88	375	41,086	食品・飲料・タバコ	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	76	16	122	13,421	ソフトウェア・サービス	
COLGATE-PALMOLIVE CO	104	19	122	13,427	家庭用品・パーソナル用品	
COMCAST CORP-CL A	563	130	413	45,281	メディア	
COMERICA INC	29	5	56	6,231	銀行	
CONAGRA BRANDS INC	59	14	52	5,761	食品・飲料・タバコ	
CONCHO RESOURCES INC	21	4	57	6,328	エネルギー	
CONOCOPHILLIPS	142	29	191	20,931	エネルギー	
CONSOLIDATED EDISON INC	38	6	51	5,612	公益事業	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	23	4	99	10,899	食品・飲料・タバコ	
COOPER COS INC/THE	7	1	42	4,664	ヘルスケア機器・サービス	
CORE LABORATORIES N. V.	8	—	—	—	エネルギー	
CORNING INC	127	25	68	7,519	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
COSTCO WHOLESALE CORP	49	10	212	23,225	食品・生活必需品小売り	
COTY INC-CL A	60	21	30	3,288	家庭用品・パーソナル用品	
CUMMINS INC	19	4	65	7,174	資本財	
DR HORTON INC	55	15	66	7,293	耐久消費財・アパレル	
DTE ENERGY COMPANY	23	6	61	6,737	公益事業	
DXC TECHNOLOGY CO	21	10	100	10,958	ソフトウェア・サービス	
DANAHER CORP	73	19	198	21,779	ヘルスケア機器・サービス	
DARDEN RESTAURANTS INC	17	4	41	4,581	消費者サービス	
DAVITA INC	284	7	52	5,733	ヘルスケア機器・サービス	
DEERE & CO	36	9	153	16,805	資本財	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	33	9	73	8,094	ソフトウェア・サービス	
DENTSPLY SIRONA INC	34	8	41	4,575	ヘルスケア機器・サービス	
DEVON ENERGY CORPORATION	67	14	59	6,471	エネルギー	
THE WALT DISNEY CO	177	41	424	46,533	メディア	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	54	10	79	8,657	各種金融	
DISCOVERY INC-A	31	13	30	3,352	メディア	
DISCOVERY INC-C	45	16	34	3,744	メディア	
DISH NETWORK CORPORATION	34	—	—	—	メディア	
EVEREST RE GROUP LTD	6	2	47	5,206	保険	
Dollar General Corp	35	7	75	8,296	小売	
DOLLAR TREE INC	32	9	88	9,684	小売	
DOMINION ENERGY INC	76	14	96	10,528	公益事業	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	88	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
DOVER CORP	22	6	54	5,963	資本財	
DOW CHEMICAL	131	—	—	—	素材	
DOWDUPONT INC	—	65	430	47,184	素材	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	23	4	55	6,077	食品・飲料・タバコ	
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	102	—	—	—	素材	
DUKE ENERGY CORP	76	12	96	10,562	公益事業	
EOG RESOURCES INC	67	16	198	21,759	エネルギー	
EQT CORPORATION	29	—	—	—	エネルギー	
E*TRADE FINANCIAL CORP	46	11	74	8,107	各種金融	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	18	—	—	—	保険	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	24	4	52	5,772	素材	

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			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		
EBAY INC	137	27	105	11,589	ソフトウェア・サービス	
ECOLAB INC	29	7	105	11,570	素材	
BUNGE LIMITED	21	5	39	4,335	食品・飲料・タバコ	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	12	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
EDISON INTERNATIONAL	41	9	57	6,311	公益事業	
Edwards Lifesciences Corp	29	6	84	9,261	ヘルスケア機器・サービス	
ELECTRONIC ARTS INC	39	8	112	12,361	ソフトウェア・サービス	
EMERSON ELECTRIC CO	70	16	118	12,973	資本財	
ENTERGY CORP	27	6	50	5,562	公益事業	
EQUIFAX INC	16	6	69	7,571	商業・専門サービス	
EVERSOURCE ENERGY	40	9	55	6,125	公益事業	
EXELON CORP	117	30	122	13,377	公益事業	
EXPEDIA GROUP INC	15	6	71	7,859	小売	
EXPEDITORS INTL WASH INC	24	6	47	5,254	運輸	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	77	18	140	15,416	ヘルスケア機器・サービス	
EXXON MOBIL CORPORATION	475	98	776	84,995	エネルギー	
FACEBOOK INC-A	273	61	1,136	124,462	ソフトウェア・サービス	
FASTENAL CO	48	12	67	7,366	資本財	
FEDEX CORP	31	6	168	18,483	運輸	
F5 NETWORKS INC	12	2	42	4,690	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	42	9	98	10,776	ソフトウェア・サービス	
FNF GROUP	40	13	50	5,572	保険	
FIFTH THIRD BANCORP	108	21	67	7,426	銀行	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	25	7	70	7,671	銀行	
FISERV INC	29	12	87	9,566	ソフトウェア・サービス	
FIRSTENERGY CORP	72	19	66	7,279	公益事業	
FLUOR CORP	24	—	—	—	資本財	
FLOWSERVE CORP	27	—	—	—	資本財	
FOOT LOCKER INC	21	—	—	—	小売	
FORD MOTOR CO	418	89	103	11,315	自動車・自動車部品	
FORTIVE CORP	41	9	72	7,948	資本財	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	27	9	56	6,241	資本財	
FRANKLIN RESOURCES INC	58	15	52	5,721	各種金融	
FREEMPORT-MCMORAN INC	193	—	—	—	素材	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	28	6	45	4,954	保険	
GAP INC	40	—	—	—	小売	
GARTNER INC	14	3	44	4,822	ソフトウェア・サービス	
GENERAL DYNAMICS CORP	31	6	137	15,044	資本財	
GENERAL ELECTRIC CO	996	211	309	33,910	資本財	
GENERAL MILS INC	59	14	63	6,926	食品・飲料・タバコ	
GENERAL MOTORS CO	165	33	127	13,927	自動車・自動車部品	
GENUINE PARTS CO	17	5	48	5,300	小売	
GILEAD SCIENCES INC	146	31	211	23,188	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	43	9	214	23,501	各種金融	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	50	12	30	3,393	自動車・自動車部品	
WR GRACE & CO	12	5	37	4,063	素材	
WW GRAINGER INC	8	1	57	6,243	資本財	
HCA HEALTHCARE INC	40	8	86	9,483	ヘルスケア機器・サービス	
HP INC	224	46	102	11,269	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HALLIBURTON CO	110	19	96	10,527	エネルギー	
HARLEY-DAVIDSON INC	29	10	43	4,717	自動車・自動車部品	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	49	11	58	6,439	保険	

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			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		
HASBRO INC	15	4	37	4,070	耐久消費財・アパレル	
HELMERICH & PAYNE	19	6	41	4,498	エネルギー	
HERSHEY CO/THE	21	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
HESS CORP	44	9	55	6,103	エネルギー	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	205	47	73	8,028	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HOLLYFRONTIER CORP	38	6	46	5,127	エネルギー	
HOME DEPOT INC	136	27	522	57,262	小売	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	78	16	249	27,359	資本財	
HORMEL FOODS CORP	39	11	41	4,493	食品・飲料・タバコ	
HUMANA INC	19	4	136	14,930	ヘルスケア機器・サービス	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	16	3	43	4,795	運輸	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	177	46	70	7,738	銀行	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	39	7	117	12,869	資本財	
ILLUMINA INC	19	4	108	11,926	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INCYTE CORP	23	6	46	5,051	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INTEL CORP	526	132	731	80,154	半導体・半導体製造装置	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	74	16	113	12,456	各種金融	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	103	26	387	42,463	ソフトウェア・サービス	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	12	3	48	5,301	素材	
INTERNATIONAL PAPER CO	52	11	62	6,818	素材	
INTERPUBLIC GROUP COS INC	68	16	36	4,041	メディア	
INTUIT INC	32	6	130	14,290	ソフトウェア・サービス	
INTUITIVE SURGICAL INC	5	3	137	15,102	ヘルスケア機器・サービス	
JPMORGAN CHASE & CO	418	89	990	108,515	銀行	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	25	5	35	3,891	資本財	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC.	—	18	42	4,681	各種金融	
JOHNSON & JOHNSON	308	68	834	91,402	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JUNIPER NETWORKS INC	60	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KLA-TENCOR CORPORATION	23	5	59	6,523	半導体・半導体製造装置	
KELLOGG CO	30	8	57	6,315	食品・飲料・タバコ	
KEYCORP	153	42	86	9,429	銀行	
KIMBERLY-CLARK CORP	43	7	77	8,501	家庭用品・パーソナル用品	
KINDER MORGAN INC	233	63	100	10,987	エネルギー	
KOHL'S CORP	31	—	—	—	小売	
KRAFT HEINZ CO/THE	68	13	76	8,409	食品・飲料・タバコ	
KROGER CO	120	25	62	6,792	食品・生活必需品小売り	
L BRANDS INC	37	—	—	—	小売	
LKQ CORP	52	14	45	4,982	小売	
L3 TECHNOLOGIES INC	11	—	—	—	資本財	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	16	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
LAM RESEARCH CORP	22	5	120	13,210	半導体・半導体製造装置	
LAS VEGAS SANDS CORP	58	11	91	9,994	消費者サービス	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	29	6	98	10,770	家庭用品・パーソナル用品	
LEAR CORP	11	—	—	—	自動車・自動車部品	
LEGGETT & PLATT INC	26	7	29	3,223	耐久消費財・アパレル	
LENNAR CORP-CL A	35	9	52	5,742	耐久消費財・アパレル	
LEUCADIA NATIONAL CORP	62	—	—	—	各種金融	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A	64	—	—	—	小売	
ELI LILLY & CO	119	28	235	25,783	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LINCOLN NATIONAL CORP	36	7	52	5,748	保険	
LOCKHEED MARTIN CORP	31	6	213	23,331	資本財	
LOEWS CORP	44	12	63	6,912	保険	

銘柄	株数	期末			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
LOWE'S COMPANIES	99	20	199	21,879	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	22	5	55	6,094	耐久消費財・アパレル
M & T BANK CORP	19	4	73	8,061	銀行
MACY'S INC	54	—	—	—	小売
MANPOWERGROUP	12	3	30	3,330	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	125	37	77	8,447	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	70	17	133	14,624	エネルギー
MARSH & MCLENNAN COS	58	13	106	11,691	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	43	8	117	12,905	消費者サービス
MASCO CORP	55	14	56	6,152	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	115	26	503	55,131	ソフトウェア・サービス
MATTEL INC	54	—	—	—	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	41	9	56	6,190	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	19	5	58	6,389	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	99	19	325	35,663	消費者サービス
MCKESSON CORP	27	5	80	8,767	ヘルスケア機器・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	26	—	—	—	食品・飲料・タバコ
MERCK & CO. INC.	311	64	382	41,926	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	116	20	96	10,515	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	3	1	62	6,867	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP	857	191	1,884	206,396	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	31	9	95	10,441	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	138	38	238	26,126	半導体・半導体製造装置
MOHAWK INDUSTRIES INC	9	2	61	6,730	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BREWING CO -B	22	8	53	5,833	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	178	32	129	14,236	食品・飲料・タバコ
MONSANTO CO	50	10	127	14,007	素材
MONSTER BEVERAGE CORP	51	12	63	6,924	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	24	5	87	9,587	各種金融
MORGAN STANLEY	174	44	236	25,953	各種金融
MOSAIC CO/THE	60	18	51	5,593	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	25	5	59	6,503	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MURPHY OIL CORP	34	—	—	—	エネルギー
NATIONAL OILWELL VARCO INC	60	13	54	5,915	エネルギー
NETAPP INC	48	8	57	6,339	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	51	12	429	47,057	小売
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	100	31	37	4,080	銀行
NEWELL BRANDS INC	51	17	44	4,908	耐久消費財・アパレル
NEWMONT MINING CORP	52	8	31	3,460	素材
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	69	19	31	3,404	メディア
NEXTERA ENERGY INC	57	15	248	27,236	公益事業
NIKE INC -CL B	148	30	218	23,962	耐久消費財・アパレル
NOBLE ENERGY INC	75	15	55	6,081	エネルギー
NORDSTROM INC	26	—	—	—	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	38	9	142	15,603	運輸
NORTHERN TRUST CORP	31	8	90	9,867	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	19	4	147	16,142	資本財
NUCOR CORP	47	12	82	9,024	素材
NVIDIA CORP	66	17	426	46,716	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	42	9	32	3,601	公益事業
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	11	2	64	7,023	小売
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	87	20	165	18,167	エネルギー

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			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		
OMNICOM GROUP	29	—	—	—	メディア	
ORACLE CORPORATION	355	77	364	39,906	ソフトウェア・サービス	
P G & E CORP	64	15	69	7,572	公益事業	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	60	12	183	20,121	銀行	
PPG INDUSTRIES INC	31	7	73	8,075	素材	
PPL CORPORATION	78	15	41	4,594	公益事業	
PVH CORP	14	2	46	5,047	耐久消費財・アパレル	
PACCAR INC	49	10	65	7,122	資本財	
PACKAGING CORP OF AMERICA	14	3	43	4,805	素材	
PARKER HANNIFIN CORP	18	4	72	7,973	資本財	
PATTERSON COS INC	18	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
PAYCHEX INC	39	14	95	10,495	ソフトウェア・サービス	
PAYPAL HOLDINGS INC	134	29	236	25,910	ソフトウェア・サービス	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	61	21	41	4,510	銀行	
PEPSICO INC	156	31	314	34,422	食品・飲料・タバコ	
PFIZER INC	667	139	496	54,360	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	181	36	290	31,863	食品・飲料・タバコ	
PHILLIPS 66	48	11	135	14,852	エネルギー	
PINNACLE WEST CAPITAL	17	4	37	4,086	公益事業	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	21	4	87	9,542	エネルギー	
POLARIS INDUSTRIES INC	12	2	31	3,397	耐久消費財・アパレル	
PRAXAIR INC	31	7	123	13,505	素材	
T ROWE PRICE GROUP INC	31	7	86	9,505	各種金融	
PRICELINE GROUP INC	5	—	—	—	小売	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	41	9	56	6,154	保険	
PROCTER & GAMBLE CO	285	55	415	45,465	家庭用品・パーソナル用品	
PROGRESSIVE CORP	79	16	102	11,240	保険	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	54	10	101	11,119	保険	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	61	12	63	6,967	公益事業	
PULTE HOMES INC	57	15	46	5,112	耐久消費財・アパレル	
QUALCOMM INC	166	42	253	27,714	半導体・半導体製造装置	
QUEST DIAGNOSTICS	22	4	51	5,620	ヘルスケア機器・サービス	
QURATE RETAIL INC QVC GROUP	—	22	46	5,089	小売	
RALPH LAUREN CORP	11	3	49	5,398	耐久消費財・アパレル	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	21	4	48	5,284	各種金融	
RAYTHEON COMPANY	34	7	161	17,679	資本財	
RED HAT INC	28	5	85	9,331	ソフトウェア・サービス	
Regeneron Pharmaceuticals Inc	9	2	79	8,751	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REGIONS FINANCIAL CORP	178	36	68	7,516	銀行	
REPUBLIC SERVICES INC	38	10	69	7,601	商業・専門サービス	
RESMED INC	23	6	65	7,228	ヘルスケア機器・サービス	
REYNOLDS AMERICAN INC	93	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
RITE AID CORP	260	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
ROBERT HALF INTL INC	23	5	35	3,895	商業・専門サービス	
ROCKWELL AUTOMATION INC	17	3	68	7,486	資本財	
ROCKWELL COLLINS INC.	22	4	57	6,247	資本財	
ROPER TECHNOLOGIES INC	14	3	106	11,717	資本財	
ROSS STORES INC	47	12	100	10,978	小売	
S&P GLOBAL INC	33	6	138	15,120	各種金融	
SEI INVESTMENTS COMPANY	22	5	37	4,092	各種金融	
SALESFORCE.COM INC	80	17	224	24,625	ソフトウェア・サービス	
SCANA CORP	25	7	28	3,094	公益事業	

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			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		
SCHLUMBERGER LTD	151	28	198	21,714	エネルギー	
SCHWAB (CHARLES) CORP	151	40	230	25,204	各種金融	
SEALED AIR CORP	34	8	36	4,010	素材	
SEMPRA ENERGY	30	5	60	6,670	公益事業	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10	2	95	10,440	素材	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	24	7	78	8,607	半導体・半導体製造装置	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	17	4	45	5,000	食品・飲料・タバコ	
SOUTHERN CO	106	23	102	11,230	公益事業	
SOUTHWEST AIRLINES CO	28	8	43	4,805	運輸	
SPLUNK INC	25	4	52	5,736	ソフトウェア・サービス	
STANLEY BLACK & DECKER INC	19	4	66	7,324	資本財	
STAPLES INC	87	—	—	—	小売	
STARBUCKS CORP	176	46	269	29,486	消費者サービス	
STATE STREET CORP	50	13	133	14,613	各種金融	
STERICYCLE INC	17	4	29	3,182	商業・専門サービス	
STRYKER CORP	40	10	180	19,795	ヘルスケア機器・サービス	
SUNTRUST BANKS INC	66	13	94	10,340	銀行	
SYMANTEC CORP	89	26	55	6,055	ソフトウェア・サービス	
SYNOPSIS INC	23	5	47	5,214	ソフトウェア・サービス	
SYNCHRONY FINANCIAL	117	21	76	8,432	各種金融	
SYSCO CORP	60	16	106	11,700	食品・生活必需品小売り	
TJX COMPANIES INC	66	17	154	16,898	小売	
TAPESTRY INC	—	12	55	6,073	耐久消費財・アパレル	
TARGET CORP	57	13	98	10,747	小売	
TESLA INC	16	3	103	11,300	自動車・自動車部品	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	123	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TEXAS INSTRUMENTS	109	23	266	29,228	半導体・半導体製造装置	
TEXTRON INC	41	11	74	8,114	資本財	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	46	13	278	30,538	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
3M CO	64	14	280	30,737	資本財	
TIFFANY & CO	19	4	58	6,425	小売	
TIME WARNER INC	91	18	176	19,360	メディア	
TOLL BROTHERS INC	29	9	39	4,286	耐久消費財・アパレル	
TORCHMARK CORP	21	4	38	4,252	保険	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	25	7	63	6,970	ソフトウェア・サービス	
TRAVELERS COS INC/THE	28	7	94	10,361	保険	
TRIPADVISOR INC-W/I	21	8	39	4,373	小売	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX IN	139	29	114	12,565	メディア	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	66	—	—	—	メディア	
TWITTER INC	93	20	67	7,381	ソフトウェア・サービス	
TYSON FOODS INC-CL A	39	11	78	8,643	食品・飲料・タバコ	
US BANCORP	203	40	204	22,435	銀行	
UNION PACIFIC CORP	97	25	366	40,134	運輸	
UNITED PARCEL SERVICE CL B	76	16	185	20,340	運輸	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	84	18	233	25,559	資本財	
UNITED THERAPEUTICS CORP	9	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UNITEDHEALTH GROUP INC	113	23	581	63,639	ヘルスケア機器・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	14	4	51	5,598	ヘルスケア機器・サービス	
UNUM GROUP	40	11	42	4,682	保険	
VF CORP	36	7	64	7,089	耐久消費財・アパレル	
VALERO ENERGY CORP	60	11	140	15,397	エネルギー	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	16	3	42	4,635	ヘルスケア機器・サービス	

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			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		
VERISIGN INC	18	4	55	6,122	ソフトウェア・サービス	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	474	110	535	58,670	電気通信サービス	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	33	8	136	14,939	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VIACOM INC CL B	51	13	38	4,168	メディア	
VISA INC-CLASS A SHARES	221	48	634	69,508	ソフトウェア・サービス	
VMWARE INC-CLASS A	12	3	50	5,499	ソフトウェア・サービス	
VOYA FINANCIAL INC	33	7	39	4,299	各種金融	
VULCAN MATERIALS CO	20	5	74	8,131	素材	
WABCO HOLDINGS INC	9	3	39	4,275	資本財	
WEC ENERGY GROUP INC	41	6	37	4,122	公益事業	
WABTEC CORP/DE	16	5	48	5,330	資本財	
WALMART INC	172	44	370	40,625	食品・生活必需品小売り	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	101	19	122	13,443	食品・生活必需品小売り	
WASTE MANAGEMENT INC	50	10	86	9,495	商業・専門サービス	
WATERS CORP	13	2	52	5,700	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WELLS FARGO & COMPANY	560	123	676	74,076	銀行	
WESTERN DIGITAL CORP	40	11	97	10,640	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WESTERN UNION CO	83	24	49	5,439	ソフトウェア・サービス	
WESTROCK CO	38	10	64	7,119	素材	
WHIRLPOOL CORP	11	2	37	4,070	耐久消費財・アパレル	
WHOLE FOODS MARKET INC	46	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	16	3	41	4,587	消費者サービス	
XCEL ENERGY INC	67	11	50	5,484	公益事業	
XLINX INC	37	8	58	6,365	半導体・半導体製造装置	
XEROX CORP	173	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
XEROX CORP	—	13	36	4,026	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
XYLEM INC	33	6	46	5,091	資本財	
YAHOO! INC	114	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
YUM! BRANDS INC	47	9	78	8,641	消費者サービス	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	26	5	56	6,144	ヘルスケア機器・サービス	
ZOETIS INC	62	17	143	15,698	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INVESCO LTD	60	15	43	4,802	各種金融	
CHUBB LTD	51	9	127	13,962	保険	
SIGNET JEWELERS LTD	13	—	—	—	小売	
LyondellBasell Industries NV	42	9	107	11,749	素材	
GARMIN LTD	16	5	34	3,760	耐久消費財・アパレル	
ACCENTURE PLC-CL A	72	15	244	26,756	ソフトウェア・サービス	
NXP SEMICONDUCTORS NV	35	8	102	11,193	半導体・半導体製造装置	
SEAGATE TECHNOLOGY	46	12	70	7,698	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AON PLC	34	6	97	10,670	保険	
TE CONNECTIVITY LTD	48	12	119	13,082	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	35	—	—	—	資本財	
INGERSOLL-RAND PLC	35	7	63	6,944	資本財	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	26	7	53	5,871	耐久消費財・アパレル	
APTIV PLC	37	10	101	11,166	自動車・自動車部品	
EATON CORP PLC	50	10	85	9,361	資本財	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	87	—	—	—	メディア	
IHS MARKIT LTD	53	12	63	6,909	商業・専門サービス	
BROADCOM LTD	48	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	17	3	53	5,832	保険	
TECHNIPFMC PLC	60	15	49	5,370	エネルギー	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	—	9	47	5,156	資本財	

銘柄	株数	期首(前期末)			業種等	
		当		期 末		
		株数	株数	評価額		額
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
PERRIGO CO PLC	23	5	38	4,235	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PENTAIR PLC	29	8	36	4,029	資本財	
MEDTRONIC PLC	158	31	268	29,406	ヘルスケア機器・サービス	
MYLAN NV	63	15	59	6,526	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NIELSEN HOLDINGS PLC	55	13	41	4,577	商業・専門サービス	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	109	21	75	8,316	資本財	
ALLERGAN PLC	44	10	168	18,436	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	—	11	44	4,851	食品・飲料・タバコ	
小計	株数	金額	株数	金額		
	銘柄数	<比率>	459	418	— <56.4%>	
(カナダ)			千カナダドル			
ARC RESOURCES LTD	67	19	25	2,160	エネルギー	
AGNICO EAGLE MINES LTD	28	—	—	—	素材	
AGRIUM INC	18	—	—	—	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	45	12	68	5,751	食品・生活必需品小売り	
BCE INC	31	5	32	2,726	電気通信サービス	
BANK OF MONTREAL	54	11	114	9,664	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	120	29	235	19,882	銀行	
BARRICK GOLD CORP	114	38	66	5,594	素材	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	114	13	73	6,161	各種金融	
CAE INC	51	18	50	4,229	資本財	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	5	8	54	4,637	素材	
CAMECO CORP	98	38	53	4,512	エネルギー	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	27	8	100	8,508	銀行	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	85	17	186	15,759	運輸	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	130	25	114	9,647	エネルギー	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	16	3	73	6,171	運輸	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	9	3	53	4,499	小売	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	27	14	44	3,763	公益事業	
CENOVUS ENERGY INC	171	59	79	6,719	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
DOLLARAMA INC	16	3	59	5,028	小売	
ENCANA CORP	152	45	75	6,327	エネルギー	
ENBRIDGE INC	190	38	154	13,013	エネルギー	
FINNING INTERNATIONAL INC	48	10	32	2,766	資本財	
FIRST CAPITAL REALTY INC	51	16	33	2,856	不動産	
FORTIS INC	64	14	62	5,299	公益事業	
FRANCO-NEVADA CORP	18	8	81	6,893	素材	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	34	11	42	3,570	耐久消費財・アパレル	
GOLDCORP INC	108	40	74	6,263	素材	
GREAT-WEST LIFE CO INC	56	10	35	2,956	保険	
CGI GROUP INC	33	11	88	7,493	ソフトウェア・サービス	
HUSKY ENERGY INC	73	24	44	3,789	エネルギー	
IGM FINANCIAL INC	28	2	11	955	各種金融	
IMPERIAL OIL LTD	52	12	49	4,165	エネルギー	
INTACT FINANCIAL CORP	19	5	53	4,508	保険	
INTER PIPELINE LTD	67	22	53	4,527	エネルギー	
JEAN COUTU GROUP INC A	31	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
KEYERA CORP	32	13	46	3,926	エネルギー	
KINROSS GOLD CORP	199	—	—	—	素材	
LOBLAW COMPANIES LTD	22	9	63	5,364	食品・生活必需品小売り	
MAGNA INTERNATIONAL INC	43	10	89	7,586	自動車・自動車部品	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
MANULIFE FINANCIAL CORP	225	40	101	8,595	保険
METRO INC	47	16	70	5,918	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	45	11	71	6,014	銀行
NUTRIEN LTD	—	20	135	11,446	素材
ONEX CORPORATION	18	6	63	5,365	各種金融
OPEN TEXT CORP	49	13	62	5,292	ソフトウェア・サービス
PEMBINA PIPELINE CORP	58	16	72	6,091	エネルギー
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	118	—	—	—	素材
POWER CORP OF CANADA	71	15	46	3,949	保険
POWER FINANCIAL CORP	42	8	27	2,328	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	47	7	20	1,736	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	48	12	74	6,282	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	150	30	300	25,372	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	25	10	55	4,685	資本財
SAPUTO INC	45	9	44	3,716	食品・飲料・タバコ
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	78	22	60	5,120	メディア
SUN LIFE FINANCIAL INC	68	14	78	6,630	保険
SUNCOR ENERGY INC	197	42	213	18,002	エネルギー
TELUS CORP	25	3	13	1,158	電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	41	9	48	4,064	各種金融
TORONTO-DOMINION BANK	191	39	298	25,181	銀行
TRANSCANADA CORP	104	18	97	8,257	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	25	8	39	3,329	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	7	3	32	2,709	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	61	27	76	6,481	素材
YAMANA GOLD INC	183	—	—	—	素材
小 計	株 数	金 額			
	銘柄 数 < 比 率 >				
	66	1,050	4,687	395,415	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	22	5	106	13,587	耐久消費財・アパレル
Fresenius SE & CO KG	51	11	81	10,387	ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	23	5	29	3,748	ソフトウェア・サービス
HANNOVER RUECK SE	11	—	—	—	保険
GEA GROUP AG	36	8	27	3,535	資本財
CONTINENTAL AG	13	3	72	9,271	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG	99	27	90	11,637	運輸
AXEL SPRINGER SE	13	4	25	3,282	メディア
MERCK KGAA	20	5	51	6,540	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG	80	23	46	5,950	公益事業
SAP SE	114	24	242	31,064	ソフトウェア・サービス
E. ON SE	253	67	61	7,879	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	17	3	38	4,944	家庭用品・パーソナル用品
METRO AG	25	—	—	—	食品・生活必需品小売り
PUMA AG	—	0.19	9	1,199	耐久消費財・アパレル
BAYER AG	95	19	204	26,238	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	17	2	22	2,931	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	102	21	188	24,178	素材
BEIERSDORF AG	15	4	48	6,218	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	22	—	—	—	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	28	7	67	8,706	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE	49	10	195	25,088	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	48	11	27	3,473	運輸

銘柄	株数	期末			業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	12	3	71	9,217	保険	
VOLKSWAGEN AG	5	1	33	4,239	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG PFD	22	6	102	13,146	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG	102	28	186	23,938	自動車・自動車部品	
THYSSENKRUPP AG	57	—	—	—	素材	
SIEMENS AG	89	18	208	26,679	資本財	
LINDE AG	22	—	—	—	素材	
DEUTSCHE BANK AG -REG	220	52	54	6,940	各種金融	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	40	9	80	10,286	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	393	78	105	13,529	電気通信サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	141	34	81	10,471	半導体・半導体製造装置	
DEUTSCHE BOERSE AG	25	7	82	10,515	各種金融	
LANXESS	16	4	29	3,722	素材	
BRENNTAG AG	28	8	41	5,268	資本財	
K+S AG	39	—	—	—	素材	
EVONIK INDUSTRIES AG	29	10	32	4,149	素材	
HUGO BOSS AG -ORD	11	3	30	3,958	耐久消費財・アパレル	
COMMERZBANK AG	167	38	36	4,666	銀行	
VONOVIA SE	61	15	59	7,578	不動産	
PROSIEBENSAT1 MEDIA SE	37	12	34	4,375	メディア	
METRO AG	—	18	22	2,875	食品・生活必需品小売り	
LINDE AG - TENDER	—	5	99	12,728	素材	
小計	株数・金額	2,692	626	3,029	388,153	
	銘柄数<比率>	42	39	—	<3.3%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	166	47	71	9,122	保険	
INTESA SANPAOLO	1,636	460	121	15,569	銀行	
MEDIOBANCA SPA	99	35	30	3,869	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	26	6	36	4,697	耐久消費財・アパレル	
ENEL SPA	976	220	104	13,417	公益事業	
ENI SPA	324	68	105	13,576	エネルギー	
SNAM SPA	424	—	—	—	エネルギー	
TELECOM ITALIA SPA	1,714	—	—	—	電気通信サービス	
TELECOM ITALIA-RNC	1,381	407	25	3,302	電気通信サービス	
ATLANTIA S.P.A	61	15	40	5,150	運輸	
TERNA SPA	264	77	35	4,599	公益事業	
UNICREDIT SPA	105	55	85	10,905	銀行	
小計	株数・金額	7,182	1,395	657	84,210	
	銘柄数<比率>	12	10	—	<0.7%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES	39	10	42	5,438	資本財	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	75	18	35	4,602	公益事業	
L'OREAL	23	5	115	14,781	家庭用品・パーソナル用品	
CHRISTIAN DIOR SE	7	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	32	6	199	25,552	耐久消費財・アパレル	
THALES SA	15	3	41	5,268	資本財	
CAPGEMINI	21	6	75	9,617	ソフトウェア・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	11	5	22	2,832	食品・生活必需品小売り	
PUBLICIS GROUPE	30	—	—	—	メディア	
LAGARDERE S.C.A	24	10	24	3,181	メディア	
MICHELIN (CGDE)-B	20	4	51	6,620	自動車・自動車部品	
PERNOD-RICARD	23	5	73	9,440	食品・飲料・タバコ	

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
RENAULT SA	23	7	67	8,602	自動車・自動車部品	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	61	14	108	13,866	資本財	
VIVENDI SA	134	30	69	8,882	メディア	
ORANGE	228	41	61	7,848	電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	3	0.56	34	4,362	耐久消費財・アパレル	
BIC	4	—	—	—	商業・専門サービス	
DASSAULT SYSTEMES SA	21	4	50	6,479	ソフトウェア・サービス	
KERING	10	1	94	12,118	耐久消費財・アパレル	
CNP ASSURANCES	34	10	21	2,808	保険	
CARREFOUR SA	71	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
ATOS SE	15	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
SANOFI	131	32	211	27,158	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACCOR SA	30	7	36	4,620	消費者サービス	
SOCIETE GENERALE-A	95	18	76	9,759	銀行	
SODEXO	13	—	—	—	消費者サービス	
AXA	213	54	122	15,645	保険	
ESSILOR INTERNATIONAL	24	4	57	7,402	ヘルスケア機器・サービス	
CREDIT AGRICOLE SA	161	37	47	6,051	銀行	
ZODIAC AEROSPACE	37	—	—	—	資本財	
BNP PARIBAS	136	27	166	21,372	銀行	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	58	14	65	8,348	資本財	
Wendel	5	1	20	2,591	各種金融	
Iliad SA	4	1	20	2,684	電気通信サービス	
IMERYS SA	9	2	20	2,592	素材	
SAFRAN SA	36	9	94	12,121	資本財	
ENGIE	160	62	87	11,172	公益事業	
ALSTOM	27	9	37	4,812	資本財	
Eutelsat Communications	32	11	19	2,498	メディア	
ELECTRICITE DE FRANCE	58	24	28	3,703	公益事業	
Arkema SA	12	—	—	—	素材	
Legrand SA	24	9	64	8,260	資本財	
TOTAL SA	241	72	368	47,180	エネルギー	
Natixis	198	42	29	3,761	各種金融	
SCOR SE	31	10	32	4,188	保険	
REXEL SA	55	—	—	—	資本財	
VINCI S. A.	60	13	111	14,320	資本財	
DANONE	65	11	74	9,556	食品・飲料・タバコ	
AIR LIQUIDE	43	10	119	15,274	素材	
Bureau Veritas SA	56	15	34	4,381	商業・専門サービス	
GETLINK SE	83	28	33	4,279	運輸	
SUEZ	58	25	30	3,957	公益事業	
EDENRED	36	—	—	—	商業・専門サービス	
VALEO SA	35	8	45	5,840	自動車・自動車部品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,172 55	756 45	3,245 —	415,841 <3.5%>	
(ユーロ…オランダ)						
AIRBUS SE	74	19	189	24,300	資本財	
RELX NV	109	29	54	6,963	商業・専門サービス	
RANDSTAD NV	22	5	28	3,677	商業・専門サービス	
AKZO NOBEL	30	6	48	6,273	素材	
WOLTERS KLUWER	45	12	59	7,598	商業・専門サービス	
Koninklijke Vopak NV	14	8	34	4,470	エネルギー	

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株 数	評 価 額		外 貨 換 算 金 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
AEGON NV	338	82	46	5,908	保険	
KONINKLIJKE KPN NV	511	134	31	4,045	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV	96	21	45	5,779	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	115	21	79	10,185	ヘルスケア機器・サービス	
HEINEKEN NV	23	6	57	7,389	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	18	4	37	4,784	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	29	7	64	8,303	素材	
UNILEVER NV-CVA	187	36	173	22,243	家庭用品・パーソナル用品	
Koninklijke Boskalis Westminster NV	14	—	—	—	資本財	
ASML HOLDING NV	43	9	165	21,221	半導体・半導体製造装置	
GEMALTO	18	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	126	31	62	7,951	食品・生活必需品小売り	
CNH INDUSTRIAL NV	152	—	—	—	資本財	
QIAGEN N V	41	9	30	3,944	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ING GROEP NV-CVA	478	99	131	16,847	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,493	546	1,341	171,890	
	銘柄 数 < 比 率 >	21	18	—	< 1.4% >	
(ユーロ…スペイン)						
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	95	—	—	—	運輸	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	833	226	140	18,044	銀行	
GAS NATURAL SDG SA	61	14	30	3,970	公益事業	
REPSOL SA	161	48	76	9,818	エネルギー	
BANCO SANTANDER S. A	1,762	408	203	26,124	銀行	
TELEFONICA SA	569	126	98	12,602	電気通信サービス	
ENAGAS SA	38	—	—	—	エネルギー	
FERROVIAL SA	76	24	42	5,427	資本財	
MAPPFE S. A.	232	93	25	3,312	保険	
IBERDROLA SA	703	136	85	10,990	公益事業	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	59	16	107	13,814	ソフトウェア・サービス	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	136	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	81	18	30	3,919	公益事業	
FERROVIAL SA-RTS	—	24	0.76788	98	資本財	
INDITEX	139	24	70	9,016	小売	
GRIFOLS SA	53	12	31	4,013	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	5,004	1,174	945	121,151	
	銘柄 数 < 比 率 >	15	13	—	< 1.0% >	
(ユーロ…ベルギー)						
UMICORE	16	—	—	—	素材	
KBC GROEP NV	34	9	68	8,793	銀行	
SOLVAY SA	10	—	—	—	素材	
UCB SA	19	5	34	4,405	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLRUYT SA	3	3	17	2,223	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11	4	38	4,967	各種金融	
PROXIMUS	28	—	—	—	電気通信サービス	
AGEAS	34	7	34	4,428	保険	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	87	22	184	23,605	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額	248	53	377	48,423	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	6	—	< 0.4% >	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG	26	7	38	4,968	エネルギー	
VOESTALPINE AG	20	—	—	—	素材	

銘柄	株数	金額	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
			株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オーストリア)	百株		百株		千ユーロ	千円	
ERSTE GROUP BANK AG	45		13		48	6,258	銀行
小 計	株 数	金 額	92	21	87	11,226	
	銘柄 数	< 比 率 >	3	2	—	< 0.1% >	
(ユーロ…ルクセンブルク)							
TENARIS SA	87		19		31	3,997	エネルギー
SES SA	68		19		25	3,325	メディア
小 計	株 数	金 額	155	38	57	7,322	
	銘柄 数	< 比 率 >	2	2	—	< 0.1% >	
(ユーロ…フィンランド)							
WARTSILA	28		22		41	5,351	資本財
UPM-KYMMENE OYJ	60		21		66	8,579	素材
STORA ENSO OYJ-R SHS	104		26		45	5,888	素材
SAMPO OYJ-A SHS	27		4		18	2,424	保険
FORTUM OYJ	34		—		—	—	公益事業
ELISA OYJ	25		9		34	4,403	電気通信サービス
METSO OYJ	22		—		—	—	資本財
NOKIA OYJ	722		158		82	10,520	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OYJ	26		6		46	6,001	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ	19		6		21	2,767	自動車・自動車部品
KONE OYJ-B	31		11		48	6,178	資本財
ORION OYJ	17		—		—	—	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	1,121	267	406	52,115	
	銘柄 数	< 比 率 >	12	9	—	< 0.4% >	
(ユーロ…アイルランド)							
CRH PLC(DUBLIN)	109		20		64	8,309	素材
KERRY GROUP PLC-A	25		6		61	7,856	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数	金 額	135	27	126	16,165	
	銘柄 数	< 比 率 >	2	2	—	< 0.1% >	
(ユーロ…ポルトガル)							
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	464		100		34	4,419	公益事業
Galp Energia SGPS SA	90		25		41	5,342	エネルギー
JERONIMO MARTINS	48		13		19	2,490	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数	金 額	602	140	95	12,252	
	銘柄 数	< 比 率 >	3	3	—	< 0.1% >	
(ユーロ…その他)							
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	40		—		—	—	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数	金 額	40	—	—	—	
	銘柄 数	< 比 率 >	1	—	—	< — >	
ユ ー ロ 計	株 数	金 額	22,942	5,048	10,369	1,328,752	
	銘柄 数	< 比 率 >	177	149	—	< 11.1% >	
(イギリス)					千英ポンド		
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	164		—		—	—	各種金融
Antofagasta PLC	83		—		—	—	素材
ASHTED GROUP PLC	75		17		40	5,892	資本財
BHP BILLITON PLC	269		73		124	18,141	素材
SKY PLC	162		30		40	5,964	メディア
AVIVA PLC	420		73		38	5,631	保険
DIAGEO PLC	270		50		139	20,283	食品・飲料・タバコ
SCHROEDERS PLC	26		6		20	3,032	各種金融
BAE SYSTEMS PLC	343		71		46	6,714	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	211		53		207	30,214	食品・飲料・タバコ
STANDARD CHARTERED PLC	426		90		68	9,967	銀行

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			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		
IMPERIAL BRANDS PLC	101	22	60	8,896	食品・飲料・タバコ	
HSBC HOLDINGS PLC	2,266	525	384	56,129	銀行	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	585	55	15	2,251	保険	
MEGGITT PLC	151	43	21	3,167	資本財	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	428	101	24	3,630	食品・生活必需品小売り	
Associated British Foods PLC	51	12	35	5,162	食品・飲料・タバコ	
PEARSON PLC	140	—	—	—	メディア	
PERSIMMON PLC	41	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
PRUDENTIAL PLC	302	55	104	15,188	保険	
RIO TINTO PLC	145	31	135	19,713	素材	
TRAVIS PERKINS PLC	51	15	20	3,041	資本財	
SSE PLC	79	16	23	3,470	公益事業	
BP PLC	2,173	561	311	45,487	エネルギー	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,596	2,048	134	19,619	銀行	
TATE & LYLE PLC	90	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
TESCO PLC	1,069	252	62	9,065	食品・生活必需品小売り	
SMITH & NEPHEW PLC	102	42	57	8,426	ヘルスケア機器・サービス	
GLAXOSMITHKLINE PLC	520	116	174	25,381	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WEIR GROUP PLC/THE	41	13	29	4,294	資本財	
ASTRAZENECA PLC	142	29	161	23,595	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GKN PLC	313	—	—	—	自動車・自動車部品	
BT GROUP PLC	947	202	42	6,189	電気通信サービス	
CARNIVAL PLC	29	6	34	4,973	消費者サービス	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	246	60	18	2,732	小売	
BARCLAYS PLC	2,142	565	116	17,000	銀行	
INTERTEK GROUP PLC	30	7	42	6,261	商業・専門サービス	
BURBERRY GROUP PLC	67	13	26	3,930	耐久消費財・アパレル	
NEXT PLC	20	5	30	4,377	小売	
KINGFISHER PLC	227	79	24	3,547	小売	
ITV PLC	545	156	26	3,840	メディア	
SAINSBURY (J) PLC	274	78	25	3,649	食品・生活必需品小売り	
RANDGOLD RESOURCES LTD	14	3	20	3,031	素材	
G4S PLC	296	105	29	4,313	商業・専門サービス	
ADMIRAL GROUP PLC	41	11	21	3,184	保険	
CENTRICA PLC	770	215	31	4,550	公益事業	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	470	129	330	48,164	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	450	90	239	34,919	エネルギー	
BUNZL PLC	42	13	30	4,500	資本財	
London Stock Exchange Group PLC	48	8	37	5,540	各種金融	
UNILEVER PLC	145	24	103	15,074	家庭用品・パーソナル用品	
EXPERIAN PLC	101	17	32	4,777	商業・専門サービス	
SEVERN TRENT PLC	43	15	31	4,589	公益事業	
Whitbread PLC	31	7	30	4,488	消費者サービス	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	50	12	24	3,628	各種金融	
SMITHS GROUP PLC	75	21	36	5,311	資本財	
3I GROUP PLC	144	—	—	—	各種金融	
CAPITA PLC	151	—	—	—	商業・専門サービス	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	68	14	89	13,021	家庭用品・パーソナル用品	
RELX PLC	113	20	34	5,036	商業・専門サービス	
SHIRE PLC	104	22	94	13,734	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Fresnillo PLC	40	18	24	3,518	素材	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	127	—	—	—	公益事業	

銘柄	株数	期末			業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円		
GLENCORE PLC	1,549	322	121	17,747	素材	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	248	53	44	6,556	資本財	
OLD MUTUAL PLC	694	210	51	7,562	保険	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROU	575	162	47	6,873	銀行	
SAGE GROUP PLC/THE	173	43	29	4,328	ソフトウェア・サービス	
WPP PLC	139	33	42	6,218	メディア	
COMPASS GROUP PLC	—	40	66	9,643	消費者サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	27	6	33	4,875	消費者サービス	
NATIONAL GRID PLC	358	67	59	8,720	公益事業	
ROYAL MAIL PLC	104	40	21	3,144	運輸	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-	131	81	30	4,448	消費者サービス	
FERGUSON PLC	36	7	44	6,455	資本財	
IMI PLC	64	—	—	—	資本財	
VODAFONE GROUP PLC	2,927	555	108	15,802	電気通信サービス	
RSA INSURANCE GROUP PLC	182	42	28	4,153	保険	
COMPASS GROUP PLC	214	—	—	—	消費者サービス	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	270	96	34	5,064	各種金融	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	173	65	24	3,558	保険	
CRODA INTERNATIONAL PLC	23	—	—	—	素材	
MELROSE INDUSTRIES PLC	—	165	39	5,797	資本財	
JOHNSON MATTHEY PLC	36	11	40	5,866	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	34,652 82	8,346 72	4,984 —	727,075 <6.1%>	
(スイス)			千スイスフラン			
SIKA AG-BR	0.35	0.09	71	7,912	素材	
SGS SA	0.75	0.19	48	5,387	商業・専門サービス	
SWISSCOM AG-REG	4	0.97	43	4,772	電気通信サービス	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	0.01	75	8,377	食品・飲料・タバコ	
GIVAUDAN-REG	1	0.29	64	7,138	素材	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	17	4	143	15,864	保険	
NOVARTIS AG-REG SHS	258	58	440	48,632	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABB LTD	228	51	119	13,201	資本財	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	82	18	399	44,050	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG(REG)	27	—	—	—	商業・専門サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD	61	11	60	6,641	素材	
NESTLE SA-REGISTERED	363	79	603	66,572	食品・飲料・タバコ	
SONOVA HOLDING AG	9	2	38	4,292	ヘルスケア機器・サービス	
CREDIT SUISSE GROUP AG	257	81	132	14,583	各種金融	
THE SWATCH GROUP AG-B	5	1	52	5,741	耐久消費財・アパレル	
LONZA GROUP AG-REG	10	2	64	7,099	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SWISS LIFE HOLDING AG	5	1	43	4,806	保険	
Schindler Holding AG	7	2	46	5,185	資本財	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	7	2	35	3,918	運輸	
GEBERIT AG-REG	4	1	54	6,012	資本財	
JULIUS BAER GROUP LTD	38	10	62	6,872	各種金融	
SWISS RE AG	29	7	64	7,113	保険	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	64	11	108	11,961	耐久消費財・アパレル	
ACTELION LTD-NEW LINE	15	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UBS GROUP AG	453	85	135	14,911	各種金融	
Credit Suisse Group AG - RTS	257	—	—	—	各種金融	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,212 26	434 23	2,908 —	321,049 <2.7%>	

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		
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	155	59	491	6,166	銀行	
Swedbank AB	88	15	289	3,635	銀行	
SWEDISH MATCH AB	38	7	329	4,134	食品・飲料・タバコ	
NORDEA BANK AB	365	52	460	5,769	銀行	
SECURITAS AB-B SHS	60	21	302	3,791	商業・専門サービス	
INVESTOR AB-B SHS	33	3	129	1,626	各種金融	
HENNES & MAURITZ AB-B	87	28	391	4,911	小売	
ERICSSON LM-B SHS	399	86	561	7,041	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIA COMPANY AB	138	99	418	5,243	電気通信サービス	
SKANSKA AB-B SHS	58	23	385	4,836	資本財	
LUNDIN PETROLEUM AB	40	15	406	5,094	エネルギー	
ALFA LAVAL AB	50	13	294	3,695	資本財	
GETINGE AB-B SHS	39	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
Millicom International Cellular SA	14	5	286	3,596	電気通信サービス	
SKF AB-B SHARES	77	16	301	3,786	資本財	
VOLVO AB-B SHS	205	35	563	7,066	資本財	
SANDVIK AB	160	27	431	5,411	資本財	
Industrivarden AB	34	2	54	682	各種金融	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	74	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
Boliden AB	49	—	—	—	素材	
TELE2 AB-B SHS	74	20	229	2,881	電気通信サービス	
KINNEVIK AB-B	28	9	305	3,828	各種金融	
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	—	15	12	157	資本財	
ATLAS COPCO AB-B REDEMPTION	—	17	13	171	資本財	
ATLAS COPCO AB-A SHS	—	8	320	4,021	資本財	
ATLAS COPCO AB-B SHS	—	13	442	5,553	資本財	
BOLIDEN AB-REDEMPTION	—	14	8	100	素材	
BOLIDEN AB	—	10	339	4,260	素材	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	—	20	479	6,016	家庭用品・パーソナル用品	
ATLAS COPCO AB-A SHS	72	—	—	—	資本財	
ATLAS COPCO AB-B SHS	64	—	—	—	資本財	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	204	40	400	5,026	銀行	
ASSA ABLOY AB-B	115	15	293	3,679	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,732	700	8,946	112,187	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	28	—	< 0.9% >	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	140	37	583	7,845	銀行	
TELENOR ASA	96	25	419	5,638	電気通信サービス	
EQUINOR ASA	129	33	690	9,274	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	35	8	278	3,741	素材	
NORSK HYDRO ASA	246	71	352	4,738	素材	
ORKLA ASA	135	36	273	3,671	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額	784	213	2,597	34,910	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	6	—	< 0.3% >	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
CARLSBERG AS-B	17	3	287	4,946	食品・飲料・タバコ	
A. P. MOLLER MAERSK	0.89	0.33	313	5,400	運輸	
A P Moller - Maersk A/S	0.77	0.1	89	1,546	運輸	
DANSKE BANK A/S	100	19	405	6,966	銀行	
TDC A/S	226	—	—	—	電気通信サービス	
DSV A/S	33	8	445	7,665	運輸	
PANDORA A/S	19	4	199	3,429	耐久消費財・アパレル	

銘柄	株数	期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円		
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	22	5	317	5,469	素材	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	41	8	282	4,864	素材	
COLOPLAST-B	22	7	444	7,643	ヘルスケア機器・サービス	
NOVO NORDISK A/S-B	240	56	1,714	29,485	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WILLIAM DEMANT HOLDING	39	11	268	4,620	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	766	124	4,769	82,038	
		12	11	—	<0.7%>	
(オーストラリア)			千豪ドル			
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	356	77	216	17,934	銀行	
AMCOR LTD	182	64	88	7,292	素材	
WESTPAC BANKING CORPORATION	390	88	250	20,737	銀行	
TELSTRA CORP LTD	607	213	61	5,071	電気通信サービス	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	130	48	42	3,482	食品・飲料・タバコ	
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	33	7	44	3,654	各種金融	
BHP BILLITON LTD	399	105	349	28,918	素材	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	41	16	48	4,008	エネルギー	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	132	—	—	—	小売	
COMPUTERSHARE LIMITED	101	30	52	4,370	ソフトウェア・サービス	
CSL LIMITED	53	14	261	21,684	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRANSURBAN GROUP	276	77	91	7,579	運輸	
COCHLEAR LIMITED	11	3	62	5,164	ヘルスケア機器・サービス	
ORIGIN ENERGY LIMITED	301	—	—	—	エネルギー	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	200	48	336	27,902	銀行	
RIO TINTO LIMITED	53	15	131	10,894	素材	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	327	107	87	7,208	保険	
ORICA LTD	77	26	46	3,875	素材	
LENDELEASE GROUP	96	36	67	5,573	不動産	
SUNCORP GROUP LTD	198	59	79	6,601	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	313	67	182	15,086	銀行	
NEWCREST MINING LIMITED	112	39	81	6,739	素材	
INCITEC PIVOT LTD	413	162	55	4,596	素材	
AMP LIMITED	419	162	63	5,276	各種金融	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	224	68	66	5,544	保険	
SANTOS LTD	386	102	60	4,976	エネルギー	
SONIC HEALTHCARE LTD	44	27	65	5,398	ヘルスケア機器・サービス	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	263	102	46	3,841	消費者サービス	
WESFARMERS LIMITED	99	21	97	8,103	食品・生活必需品小売り	
ALUMINA LTD	599	170	43	3,638	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	82	14	48	4,037	エネルギー	
WOOLWORTHS GROUP LTD	131	19	56	4,710	食品・生活必需品小売り	
BRAMBLES LTD	254	86	78	6,529	商業・専門サービス	
MACQUARIE GROUP LTD	40	8	99	8,245	各種金融	
CROWN RESORTS LIMITED	91	39	52	4,332	消費者サービス	
SYDNEY AIRPORT	208	74	54	4,496	運輸	
AGL ENERGY LTD	103	33	72	5,991	公益事業	
SOUTH32 LTD	850	225	84	7,013	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	8,612	2,467	3,629	300,513	
		38	36	—	<2.5%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
CONTACT ENERGY LTD	86	—	—	—	公益事業	
FLETCHER BUILDING LTD	111	—	—	—	素材	
SPARK NEW ZEALAND LTD	384	138	49	3,737	電気通信サービス	

銘柄	株数	金額	期首(前期末)		当期		業種等
			株数	金額	期末		
					株数	金額	
			株数	金額	外貨建金額	邦貨換算金額	
(ニュージーランド)			百株	百株	千ニュージーランドドル	千円	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	177		59		38	2,947	運輸
小計	株数・金額	760	198		88	6,684	
	銘柄数<比率>	4	2		—	<0.1%>	
(香港)					千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	54		23		237	3,313	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	390		—		—	—	不動産
BANK OF EAST ASIA	218		66		218	3,045	銀行
CLP HOLDINGS LIMITED	130		45		373	5,220	公益事業
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	110		—		—	—	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	133		40		1,040	14,518	各種金融
LI & FUNG LTD	1,520		360		120	1,678	耐久消費財・アパレル
MTR CORPORATION	255		45		199	2,782	運輸
HANG SENG BANK	94		20		391	5,458	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	210		81		420	5,870	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	145		40		219	3,065	公益事業
THE WHARF (HOLDINGS)	230		—		—	—	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,197		277		473	6,606	公益事業
HYSAN DEVELOPMENT CO	210		60		268	3,744	不動産
Galaxy Entertainment Group Limited	350		100		684	9,548	消費者サービス
KERRY PROPERTIES LTD	220		65		256	3,579	不動産
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	545		115		461	6,445	銀行
NWS HOLDINGS LTD	445		165		235	3,289	資本財
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	215		30		67	948	耐久消費財・アパレル
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,070		—		—	—	不動産
SINO LAND CO	578		178		240	3,354	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	180		30		375	5,235	不動産
SWIRE PACIFIC LTD A	75		30		237	3,314	不動産
AIA GROUP LTD	1,466		304		2,143	29,919	保険
Sands China Ltd	424		84		394	5,511	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	232		70		205	2,863	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	268		48		432	6,032	資本財
Cheung Kong Property Holdings Ltd	358		—		—	—	不動産
CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI)	—		35		209	2,919	公益事業
CK ASSET HOLDINGS LIMITED	—		58		389	5,442	不動産
小計	株数・金額	11,323	2,370		10,294	143,707	
	銘柄数<比率>	28	25		—	<1.2%>	
(シンガポール)					千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING	280		50		17	1,418	資本財
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	2,480		860		26	2,144	食品・飲料・タバコ
DBS GROUP HOLDINGS LTD	200		50		144	11,827	銀行
CITY DEVELOPMENTS	120		30		34	2,844	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	20		—		—	—	小売
SINGAPORE EXCHANGE LTD	50		—		—	—	各種金融
CAPITALAND LIMITED	460		120		42	3,482	不動産
GENTING SINGAPORE PLC	1,190		320		40	3,321	消費者サービス
COMFORTDELGRO CORP LTD	340		160		38	3,151	運輸
SINGAPORE AIRLINES LTD	110		30		35	2,866	運輸
UNITED OVERSEAS BANK	120		40		117	9,589	銀行
UNITED OVERSEAS LAND LTD	160		40		33	2,743	不動産
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	200		120		33	2,697	メディア
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	547		97		32	2,640	電気通信サービス
SEBMCORP INDUSTRIES LTD	340		120		36	2,972	資本財

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	240	100	129	10,601	銀行	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	340	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
KEPPEL CORP LTD	286	76	61	5,062	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	7,483	2,213	824	67,364	
	銘柄 数 < 比 率 >	18	15	—	<0.6%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
BANK HAPOALIM BM	125	56	145	4,483	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	341	77	177	5,466	銀行	
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	656	208	92	2,851	電気通信サービス	
ISRAEL CHEMICALS LTD	145	35	57	1,774	素材	
NICE LTD	20	4	157	4,837	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,288	382	631	19,414	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.2%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	133,909	31,281	—	10,278,689	
	銘柄 数 < 比 率 >	947	850	—	<86.1%>	

(注) 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で邦貨換算したものです。

(注) 小計、合計欄の〈 〉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) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円	%	
AMERICAN TOWER CORP	5	1	196	21,547	0.2	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1	0.361	58	6,396	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	2	0.395	47	5,173	0.0	
CROWN CASTLE INTL CORP	4	1	103	11,388	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	2	0.658	70	7,679	0.1	
DUKE REALTY CORP	5	1	39	4,345	0.0	
EQUINIX INC	1	0.271	105	11,518	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	4	0.828	51	5,601	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1	0.472	44	4,919	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	0.311	36	3,983	0.0	
HCP INC	7	1	42	4,634	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	11	2	55	6,031	0.1	
IRON MOUNTAIN INC	4	1	47	5,185	0.0	
KIMCO REALTY CORP	8	2	32	3,534	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	2	0.729	31	3,430	0.0	
PROLOGIS INC	6	1	91	10,067	0.1	
PUBLIC STORAGE	1	0.418	87	9,545	0.1	
REALTY INCOME CORP	3	1	67	7,361	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	2	0.645	37	4,083	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	1	0.398	38	4,178	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	3	0.743	118	12,979	0.1	
UDR INC	4	1	38	4,241	0.0	
VENTAS INC	4	0.813	43	4,774	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	2	0.642	43	4,761	0.0	
WELLTOWER INC	4	0.841	47	5,238	0.0	
WEYERHAEUSER CO	8	1	65	7,228	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	109	25	1,641	179,829	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	26	—	< 1.5% >	
(カナダ)			千カナダドル			
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3	0.252	5	504	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	3	0.252	5	504	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)			千ユーロ			
KLEPIERRE	4	0.928	31	4,016	0.0	
GECINA SA	0.621	0.211	30	3,866	0.0	
FONCIERE DES REGIONS	1	0.224	20	2,606	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO SE	0.901	0.212	40	5,249	0.0	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	6	1	122	15,739	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.1% >	
(イギリス)			千英ポンド			
BRITISH LAND CO PLC	15	4	27	4,020	0.0	
HAMMERSON PLC	12	5	28	4,216	0.0	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数		口 数	評 価 額		比 率
	口 数			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		千口	千口	千英ポンド	千円	%
INTU PROPERTIES PLC		17	—	—	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC		10	—	—	—	—
SEGRO PLC		20	4	27	4,018	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		—	3	28	4,172	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	77	16	112	16,428	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	4	—	<0.1%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
MIRVAC GROUP		65	23	55	4,598	0.0
GPT GROUP		38	14	72	5,999	0.1
STOCKLAND		48	11	50	4,152	0.0
GOODMAN GROUP		27	8	79	6,586	0.1
SCENTRE GROUP		58	24	101	8,398	0.1
WESTFIELD CORP		29	10	90	7,525	0.1
VICINITY CENTRES		70	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	338	92	450	37,260	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	6	—	<0.3%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		32	6	418	5,842	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	32	6	418	5,842	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST		38	13	27	2,231	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		25	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	63	13	27	2,231	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	1	—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	631	156	—	257,835	
	銘柄 数 < 比 率 >	46	43	—	<2.2%>	

(注) 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で邦貨換算したものです。

(注) 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) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引	S&P 500 EMIN	百万円 580	百万円 —
		DJ EU STX 50	183	—
		FTSE 100 IDX	180	—

(注) 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で邦貨換算したものです。

＜TMA外国債券インデックスマザーファンド＞

下記は、TMA外国債券インデックスマザーファンド全体(9,006,999千口)の内容です。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末								
	額面金額	評 価 額		組入比率	残存期間別組入比率				
		外貨建金額	邦貨換算金額		うちBB格以下 組入比率	5年以上	2年以上	2年未満	
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%	%
アメリカ	52,340	51,421	5,632,185	41.5	—	16.8	17.8	6.9	
カナダ	千カナダドル 3,000	千カナダドル 3,239	273,255	2.0	—	0.7	1.0	0.3	
メキシコ	千メキシコペソ 18,200	千メキシコペソ 18,693	105,059	0.8	—	0.5	0.3	—	
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ							
ドイツ	5,900	7,093	908,924	6.7	—	3.7	2.2	0.8	
イタリア	8,500	9,631	1,234,214	9.1	—	5.0	3.3	0.8	
フランス	8,770	10,390	1,331,489	9.8	—	5.9	3.1	0.8	
オランダ	1,700	2,089	267,719	2.0	—	1.0	1.0	—	
スペイン	5,100	6,064	777,113	5.7	—	3.8	1.4	0.5	
ベルギー	2,060	2,546	326,253	2.4	—	1.7	0.7	—	
オーストリア	1,260	1,555	199,336	1.5	—	1.0	0.4	—	
フィンランド	500	579	74,215	0.5	—	0.2	0.1	0.2	
アイルランド	700	793	101,739	0.7	—	0.3	0.4	—	
イギリス	千英ポンド 4,990	千英ポンド 6,233	909,179	6.7	—	4.8	1.6	0.2	
スイス	千スイスフラン 200	千スイスフラン 212	23,504	0.2	—	—	0.2	—	
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 3,500	千スウェーデンクローネ 3,979	49,899	0.4	—	0.3	0.1	—	
ノルウェー	千ノルウェークローネ 3,000	千ノルウェークローネ 3,062	41,153	0.3	—	0.1	0.1	0.1	
デンマーク	千デンマーククローネ 3,500	千デンマーククローネ 4,773	82,106	0.6	—	0.3	0.3	—	
ポーランド	千ポーランドズロチ 2,700	千ポーランドズロチ 2,903	86,417	0.6	—	0.1	0.4	0.1	
オーストラリア	千豪ドル 3,200	千豪ドル 3,403	281,835	2.1	—	1.1	0.7	0.3	
シンガポール	千シンガポールドル 600	千シンガポールドル 635	51,915	0.4	—	0.2	0.2	—	
マレーシア	千マレーシアリンギット 2,300	千マレーシアリンギット 2,336	64,301	0.5	—	0.3	0.1	—	
南アフリカ	千南アフリカランド 11,500	千南アフリカランド 10,123	88,683	0.7	—	0.5	0.1	—	
合 計	—	—	12,910,502	95.2	—	48.5	35.6	11.1	

(注) 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で邦貨換算したものです。

(注) 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) 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) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額	債 額	
	%	千米ドル	千米ドル	千円	
(アメリカ)					
国債証券					
T 1 1/2 07/15/20	1.5	1,400	1,370	150,143	2020/7/15
T 1 1/8 08/31/21	1.125	1,000	952	104,310	2021/8/31
T 1 1/8 12/31/19	1.125	2,000	1,959	214,644	2019/12/31
T 1 11/30/19	1.0	700	685	75,071	2019/11/30
T 1 3/4 02/28/22	1.75	1,500	1,448	158,673	2022/2/28
T 1 3/4 05/15/22	1.75	1,800	1,735	190,037	2022/5/15
T 1 3/4 05/15/23	1.75	1,000	952	104,378	2023/5/15
T 1 3/4 09/30/22	1.75	1,800	1,727	189,206	2022/9/30
T 1 3/4 12/31/20	1.75	500	489	53,618	2020/12/31
T 1 3/8 02/29/20	1.375	1,500	1,471	161,227	2020/2/29
T 1 3/8 03/31/20	1.375	800	784	85,912	2020/3/31
T 1 3/8 09/30/20	1.375	500	486	53,301	2020/9/30
T 1 5/8 02/15/26	1.625	800	728	79,785	2026/2/15
T 1 5/8 05/15/26	1.625	900	817	89,497	2026/5/15
T 1 5/8 08/15/22	1.625	1,300	1,243	136,148	2022/8/15
T 1 5/8 11/30/20	1.625	700	683	74,909	2020/11/30
T 1 7/8 11/30/21	1.875	1,100	1,070	117,254	2021/11/30
T 2 02/15/22	2.0	1,500	1,463	160,251	2022/2/15
T 2 02/15/23	2.0	1,200	1,159	127,051	2023/2/15
T 2 02/15/25	2.0	1,300	1,229	134,713	2025/2/15
T 2 08/15/25	2.0	600	565	61,893	2025/8/15
T 2 1/2 02/15/45	2.5	800	714	78,259	2045/2/15
T 2 1/2 02/15/46	2.5	700	622	68,213	2046/2/15
T 2 1/2 05/15/24	2.5	500	490	53,746	2024/5/15
T 2 1/2 08/15/23	2.5	1,700	1,675	183,568	2023/8/15
T 2 1/4 02/15/27	2.25	700	662	72,603	2027/2/15
T 2 1/4 03/31/21	2.25	300	297	32,535	2021/3/31
T 2 1/4 04/30/21	2.25	700	692	75,886	2021/4/30
T 2 1/4 07/31/21	2.25	1,000	987	108,177	2021/7/31
T 2 1/4 08/15/46	2.25	300	252	27,658	2046/8/15
T 2 1/4 11/15/24	2.25	1,300	1,252	137,194	2024/11/15
T 2 1/4 11/15/27	2.25	900	848	92,924	2027/11/15
T 2 1/8 05/15/25	2.125	800	761	83,379	2025/5/15
T 2 1/8 08/15/21	2.125	500	491	53,862	2021/8/15
T 2 11/15/21	2.0	1,700	1,662	182,055	2021/11/15
T 2 3/4 02/15/24	2.75	1,000	996	109,144	2024/2/15
T 2 3/4 11/15/23	2.75	1,100	1,097	120,191	2023/11/15
T 2 3/4 11/15/42	2.75	300	282	30,995	2042/11/15
T 2 3/8 08/15/24	2.375	1,300	1,263	138,428	2024/8/15
T 2 5/8 11/15/20	2.625	500	500	54,846	2020/11/15
T 3 02/15/47	3.0	1,000	982	107,613	2047/2/15
T 3 05/15/42	3.0	400	395	43,288	2042/5/15
T 3 1/2 02/15/39	3.5	200	214	23,497	2039/2/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額	債 額	
	%	千米ドル	千米ドル	千円	
(アメリカ)					
国債証券					
T 3 1/2 05/15/20	3.5	1,500	1,528	167,439	2020/5/15
T 3 1/8 02/15/43	3.125	500	503	55,188	2043/2/15
T 3 1/8 05/15/21	3.125	900	912	99,970	2021/5/15
T 3 1/8 08/15/44	3.125	1,400	1,409	154,348	2044/8/15
T 3 1/8 11/15/41	3.125	100	100	11,057	2041/11/15
T 3 11/15/45	3.0	600	589	64,603	2045/11/15
T 3 3/8 11/15/19	3.375	600	608	66,601	2019/11/15
T 3 5/8 02/15/20	3.625	1,500	1,529	167,529	2020/2/15
T 3 5/8 02/15/21	3.625	1,700	1,745	191,219	2021/2/15
T 3 5/8 08/15/43	3.625	300	328	35,957	2043/8/15
T 3 7/8 08/15/40	3.875	200	226	24,799	2040/8/15
T 4 1/2 02/15/36	4.5	300	362	39,659	2036/2/15
T 4 1/4 05/15/39	4.25	100	118	13,019	2039/5/15
T 4 1/4 11/15/40	4.25	200	238	26,138	2040/11/15
T 4 3/4 02/15/41	4.75	200	255	27,950	2041/2/15
T 4 3/8 11/15/39	4.375	100	121	13,254	2039/11/15
T 4 5/8 02/15/40	4.625	300	375	41,096	2040/2/15
T 5 05/15/37	5.0	50	64	7,054	2037/5/15
T 5 1/4 02/15/29	5.25	190	230	25,193	2029/2/15
小 計				5,632,185	
(カナダ)					
国債証券					
CAN 1 1/2 06/01/23	1.5	100	96	8,153	2023/6/1
CAN 2 1/2 06/01/24	2.5	200	202	17,095	2024/6/1
CAN 2 3/4 06/01/22	2.75	400	408	34,496	2022/6/1
CAN 2 3/4 12/01/48	2.75	200	215	18,204	2048/12/1
CAN 3 1/2 06/01/20	3.5	900	926	78,187	2020/6/1
CAN 3 1/2 12/01/45	3.5	200	244	20,585	2045/12/1
CAN 3 1/4 06/01/21	3.25	200	206	17,439	2021/6/1
CAN 3 3/4 06/01/19	3.75	500	510	43,023	2019/6/1
CAN 5 06/01/37	5.0	100	139	11,767	2037/6/1
CAN 5 3/4 06/01/33	5.75	100	142	11,997	2033/6/1
CAN 8 06/01/27	8.0	100	145	12,304	2027/6/1
小 計				273,255	
(メキシコ)					
国債証券					
MBONO 10 11/20/36	10.0	1,000	1,208	6,789	2036/11/20
MBONO 10 12/05/24	10.0	2,000	2,240	12,589	2024/12/5
MBONO 7 1/2 06/03/27	7.5	2,000	1,974	11,093	2027/6/3
MBONO 7 3/4 05/29/31	7.75	3,000	3,007	16,902	2031/5/29
MBONO 7 3/4 11/13/42	7.75	2,200	2,180	12,255	2042/11/13
MBONO 8 06/11/20	8.0	7,000	7,068	39,725	2020/6/11

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額	外貨建金額	償還年月日
	%	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 12/07/23	8.0	1,000	1,014	5,703	2023/12/7
小 計				105,059	
(ユーロ…ドイツ) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
DBR 0 1/2 02/15/25	0.5	200	206	26,414	2025/2/15
DBR 0 1/2 02/15/26	0.5	200	205	26,302	2026/2/15
DBR 0 1/4 02/15/27	0.25	100	99	12,784	2027/2/15
DBR 1 08/15/24	1.0	300	319	40,899	2024/8/15
DBR 1 08/15/25	1.0	100	106	13,650	2025/8/15
DBR 1 1/2 02/15/23	1.5	100	108	13,867	2023/2/15
DBR 1 1/2 09/04/22	1.5	300	323	41,413	2022/9/4
DBR 1 1/4 08/15/48	1.25	100	103	13,211	2048/8/15
DBR 1 3/4 07/04/22	1.75	500	543	69,580	2022/7/4
DBR 2 01/04/22	2.0	400	434	55,730	2022/1/4
DBR 2 1/2 07/04/44	2.5	100	133	17,043	2044/7/4
DBR 2 1/2 08/15/46	2.5	200	268	34,462	2046/8/15
DBR 3 07/04/20	3.0	300	322	41,386	2020/7/4
DBR 3 1/2 07/04/19	3.5	300	313	40,222	2019/7/4
DBR 3 1/4 01/04/20	3.25	500	532	68,186	2020/1/4
DBR 3 1/4 07/04/42	3.25	200	296	38,024	2042/7/4
DBR 4 01/04/37	4.0	100	154	19,749	2037/1/4
DBR 4 3/4 07/04/34	4.75	200	321	41,136	2034/7/4
DBR 4 3/4 07/04/40	4.75	100	176	22,569	2040/7/4
DBR 4.25 07/04/39	4.25	100	163	21,005	2039/7/4
DBR 5 5/8 01/04/28	5.625	300	450	57,665	2028/1/4
DBR 5.5 01/04/31	5.5	100	160	20,503	2031/1/4
DBR 6.25 01/04/24	6.25	200	271	34,780	2024/1/4
DBR 6.5 07/04/27	6.5	300	467	59,957	2027/7/4
OBL 0 04/09/21	—	100	101	13,008	2021/4/9
OBL 0 1/4 10/16/20	0.25	500	510	65,364	2020/10/16
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BTPS 0.65 11/01/20	0.65	500	499	64,005	2020/11/1
BTPS 1 1/2 06/01/25	1.5	100	97	12,473	2025/6/1
BTPS 1.35 04/15/22	1.35	100	100	12,928	2022/4/15
BTPS 1.65 03/01/32	1.65	300	265	34,001	2032/3/1
BTPS 2 12/01/25	2.0	200	199	25,579	2025/12/1
BTPS 2.15 12/15/21	2.15	700	727	93,223	2021/12/15
BTPS 2.7 03/01/47	2.7	200	181	23,193	2047/3/1
BTPS 2.8 03/01/67	2.8	100	86	11,084	2067/3/1
BTPS 3 1/4 09/01/46	3.25	200	201	25,779	2046/9/1
BTPS 3 3/4 08/01/21	3.75	300	327	41,901	2021/8/1
BTPS 3 3/4 09/01/24	3.75	300	334	42,908	2024/9/1
BTPS 4 02/01/37	4.0	100	114	14,646	2037/2/1

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額	外貨建金額	償還年月日
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BTPS 4 1/2 02/01/20	4.5	400	427	54,721	2020/2/1
BTPS 4 1/2 03/01/24	4.5	300	346	44,427	2024/3/1
BTPS 4 1/2 05/01/23	4.5	400	458	58,749	2023/5/1
BTPS 4 1/4 09/19	4.25	400	419	53,767	2019/9/1
BTPS 4 3/4 08/01/23	4.75	300	348	44,704	2023/8/1
BTPS 4 3/4 09/01/21	4.75	400	450	57,688	2021/9/1
BTPS 4 3/4 09/01/28	4.75	200	239	30,751	2028/9/1
BTPS 4 3/4 09/01/44	4.75	200	250	32,155	2044/9/1
BTPS 5 03/01/22	5.0	300	342	43,939	2022/3/1
BTPS 5 03/01/25	5.0	200	239	30,663	2025/3/1
BTPS 5 08/01/39	5.0	200	256	32,803	2039/8/1
BTPS 5 09/01/40	5.0	200	254	32,642	2040/9/1
BTPS 5 1/2 11/01/22	5.5	500	590	75,711	2022/11/1
BTPS 5 3/4 02/01/33	5.75	300	403	51,692	2033/2/1
BTPS 5.25 11/01/29	5.25	300	376	48,248	2029/11/1
BTPS 6 05/01/31	6.0	100	134	17,266	2031/5/1
BTPS 6 1/2 11/01/27	6.5	300	402	51,616	2027/11/1
BTPS 7 1/4 11/01/26	7.25	400	553	70,938	2026/11/1
(ユーロ…フランス) 国債証券					
FRTR 0 1/2 05/25/25	0.5	300	304	39,022	2025/5/25
FRTR 0 1/2 11/25/19	0.5	100	101	13,018	2019/11/25
FRTR 1 1/2 05/25/31	1.5	300	318	40,856	2031/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/36	1.25	300	297	38,134	2036/5/25
FRTR 1 11/25/25	1.0	600	628	80,559	2025/11/25
FRTR 1 3/4 05/25/23	1.75	600	653	83,749	2023/5/25
FRTR 1 3/4 11/25/24	1.75	400	440	56,396	2024/11/25
FRTR 2 1/2 05/25/30	2.5	400	473	60,635	2030/5/25
FRTR 2 1/2 10/25/20	2.5	400	428	54,966	2020/10/25
FRTR 2 1/4 10/25/22	2.25	600	664	85,129	2022/10/25
FRTR 2 3/4 10/25/27	2.75	300	359	46,030	2027/10/25
FRTR 3 04/25/22	3.0	400	451	57,837	2022/4/25
FRTR 3 1/2 04/25/20	3.5	700	754	96,631	2020/4/25
FRTR 3 1/2 04/25/26	3.5	400	496	63,659	2026/4/25
FRTR 3 1/4 05/25/45	3.25	200	274	35,120	2045/5/25
FRTR 3 1/4 10/25/21	3.25	500	561	71,928	2021/10/25
FRTR 3 3/4 04/25/21	3.75	500	561	71,892	2021/4/25
FRTR 4 04/25/55	4.0	200	323	41,494	2055/4/25
FRTR 4 04/25/60	4.0	200	331	42,534	2060/4/25
FRTR 4 3/4 04/25/35	4.75	280	435	55,853	2035/4/25
FRTR 4.25 10/23	4.25	490	603	77,292	2023/10/25
FRTR 5 1/2 04/25/29	5.5	200	299	38,383	2029/4/25
FRTR 5 3/4 10/25/32	5.75	100	163	20,982	2032/10/25
FRTR 6 10/25/25	6.0	100	142	18,213	2025/10/25

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(ユーロ…フランス) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRTR4.5 04/25/41	4.5	200	321	41,163	2041/4/25
(ユーロ…オランダ) 国債証券					
NETHER 0 1/2 07/15/26	0.5	100	101	12,967	2026/7/15
NETHER 2 07/15/24	2.0	200	223	28,652	2024/7/15
NETHER 2 1/2 01/15/33	2.5	100	122	15,747	2033/1/15
NETHER 2 3/4 01/15/47	2.75	100	139	17,899	2047/1/15
NETHER 3 1/2 07/15/20	3.5	300	326	41,832	2020/7/15
NETHER 3 1/4 07/15/21	3.25	400	447	57,283	2021/7/15
NETHER 3 3/4 01/15/42	3.75	100	156	20,041	2042/1/15
NETHER 4 01/15/37	4.0	100	152	19,554	2037/1/15
NETHER 5 1/2 01/15/28	5.5	100	147	18,896	2028/1/15
NETHER 7 1/2 01/15/23	7.5	200	271	34,843	2023/1/15
(ユーロ…スペイン) 国債証券					
SPGB 1.45 10/31/27	1.45	300	300	38,488	2027/10/31
SPGB 1.95 04/30/26	1.95	400	423	54,239	2026/4/30
SPGB 1.95 07/30/30	1.95	200	204	26,194	2030/7/30
SPGB 2 3/4 10/31/24	2.75	400	450	57,765	2024/10/31
SPGB 2.9 10/31/46	2.9	100	108	13,868	2046/10/31
SPGB 3.45 07/30/66	3.45	100	114	14,614	2066/7/30
SPGB 3.8 04/30/24	3.8	100	118	15,154	2024/4/30
SPGB 4 04/30/20	4.0	200	215	27,675	2020/4/30
SPGB 4.2 01/31/37	4.2	200	263	33,770	2037/1/31
SPGB 4.3 10/31/19	4.3	300	319	40,943	2019/10/31
SPGB 4.4 10/31/23	4.4	200	241	30,963	2023/10/31
SPGB 4.65 07/30/25	4.65	400	499	64,023	2025/7/30
SPGB 4.7 07/30/41	4.7	200	281	36,040	2041/7/30
SPGB 4.85 10/31/20	4.85	400	447	57,278	2020/10/31
SPGB 5 1/2 04/30/21	5.5	400	463	59,349	2021/4/30
SPGB 5 3/4 07/30/32	5.75	200	298	38,201	2032/7/30
SPGB 5.15 10/31/28	5.15	200	271	34,792	2028/10/31
SPGB 5.15 10/31/44	5.15	100	153	19,614	2044/10/31
SPGB 5.85 01/31/22	5.85	500	603	77,380	2022/1/31
SPGB 6 01/31/29	6.0	200	286	36,755	2029/1/31
(ユーロ…ベルギー) 国債証券					
BGB 0.8 06/22/25	0.8	200	206	26,399	2025/6/22
BGB 1.6 06/22/47	1.6	100	98	12,606	2047/6/22
BGB 2 1/4 06/22/23	2.25	200	223	28,646	2023/6/22
BGB 2.15 06/22/66	2.15	100	107	13,714	2066/6/22
BGB 2.6 06/22/24	2.6	200	229	29,395	2024/6/22
BGB 3 3/4 06/22/45	3.75	100	147	18,899	2045/6/22
BGB 3 3/4 09/28/20	3.75	100	109	14,088	2020/9/28
BGB 4 03/28/22	4.0	40	46	5,971	2022/3/28

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(ユーロ…ベルギー) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BGB 4 1/4 03/28/41	4.25	200	308	39,564	2041/3/28
BGB 4 1/4 09/28/21	4.25	200	231	29,614	2021/9/28
BGB 4 1/4 09/28/22	4.25	300	358	45,888	2022/9/28
BGB 5 03/28/35	5.0	100	157	20,194	2035/3/28
BGB 5 1/2 03/28/28	5.5	220	322	41,268	2028/3/28
(ユーロ…オーストリア) 国債証券					
RAGB 1 3/4 10/20/23	1.75	300	328	42,036	2023/10/20
RAGB 2.1 09/20/17	2.1	100	108	13,882	2117/9/20
RAGB 3.4 11/22/22	3.4	300	347	44,573	2022/11/22
RAGB 3.9 07/15/20	3.9	100	109	14,028	2020/7/15
RAGB 4.15 03/37	4.15	100	150	19,281	2037/3/15
RAGB 4.85 03/26	4.85	200	269	34,549	2026/3/15
RAGB 6 1/4 07/15/27	6.25	160	241	30,985	2027/7/15
(ユーロ…フィンランド) 国債証券					
RFBG 2 5/8 07/04/42	2.625	100	130	16,732	2042/7/4
RFBG 3 1/2 04/15/21	3.5	100	111	14,269	2021/4/15
RFBG 4 07/04/25	4.0	100	126	16,166	2025/7/4
RFBG 4 3/8 07/04/19	4.375	200	211	27,047	2019/7/4
(ユーロ…アイルランド) 国債証券					
IRISH 2 02/18/45	2.0	200	208	26,735	2045/2/18
IRISH 5 10/18/20	5.0	400	452	57,978	2020/10/18
IRISH 5.4 03/13/25	5.4	100	132	17,025	2025/3/13
ユ ー ロ 計				5,221,006	
(イギリス) 国債証券		千英ポンド	千英ポンド		
UKT 0 1/2 07/22/22	0.5	300	294	42,937	2022/7/22
UKT 1 1/2 07/22/26	1.5	300	304	44,348	2026/7/22
UKT 1 1/2 07/22/47	1.5	100	93	13,640	2047/7/22
UKT 1 3/4 09/07/22	1.75	300	310	45,241	2022/9/7
UKT 2 07/22/20	2.0	400	410	59,895	2020/7/22
UKT 2 09/07/25	2.0	300	315	46,055	2025/9/7
UKT 2 1/4 09/07/23	2.25	400	422	61,552	2023/9/7
UKT 2 3/4 09/07/24	2.75	100	109	16,028	2024/9/7
UKT 3 1/2 01/22/45	3.5	200	270	39,382	2045/1/22
UKT 3 1/2 07/22/68	3.5	300	499	72,857	2068/7/22
UKT 3 3/4 07/22/52	3.75	200	304	44,481	2052/7/22
UKT 3 3/4 09/07/20	3.75	100	106	15,579	2020/9/7
UKT 4 01/22/60	4.0	100	171	25,076	2060/1/22
UKT 4 03/07/22	4.0	200	223	32,593	2022/3/7
UKT 4 1/2 12/07/42	4.5	200	306	44,706	2042/12/7
UKT 4 1/4 03/07/36	4.25	200	276	40,330	2036/3/7
UKT 4 1/4 09/07/39	4.25	100	143	20,930	2039/9/7

銘柄	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		
(イギリス) 国債証券	%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
UKT 4 1/4 12/07/27	4.25	30	37	5,469	2027/12/7
UKT 4 1/4 12/07/46	4.25	200	309	45,134	2046/12/7
UKT 4 1/4 12/07/49	4.25	100	160	23,337	2049/12/7
UKT 4 1/4 12/07/55	4.25	200	343	50,029	2055/12/7
UKT 4 3/4 03/07/20	4.75	200	214	31,260	2020/3/7
UKT 4 3/4 12/07/38	4.75	100	151	22,068	2038/12/7
UKT 4.25 06/07/32	4.25	100	132	19,304	2032/6/7
UKT 5 03/07/25	5.0	100	125	18,250	2025/3/7
UKT 6 12/07/28	6.0	10	14	2,104	2028/12/7
UKT 8 06/07/21	8.0	150	182	26,580	2021/6/7
小 計				909,179	
(スイス) 国債証券		千スイスフラン	千スイスフラン		
SWISS 2 1/4 07/20	2.25	200	212	23,504	2020/7/6
小 計				23,504	
(スウェーデン) 国債証券		千クローナ	千クローナ		
SGB 1 1/2 11/13/23	1.5	1,000	1,085	13,606	2023/11/13
SGB 2 1/2 05/12/25 #1058	2.5	2,000	2,323	29,142	2025/5/12
SGB 5 12/01/20	5.0	500	570	7,150	2020/12/1
小 計				49,899	
(ノルウェー) 国債証券		千クローナ	千クローナ		
NGB 1 3/4 02/17/27	1.75	1,000	997	13,409	2027/2/17
NGB 2 05/24/23	2.0	1,000	1,028	13,816	2023/5/24
NGB 4 1/2 05/22/19	4.5	1,000	1,036	13,927	2019/5/22
小 計				41,153	
(デンマーク) 国債証券		千デンマーク	千デンマーク		
DGB 3 11/15/21	3.0	2,000	2,237	38,476	2021/11/15
DGB 4 1/2 11/15/39	4.5	1,500	2,536	43,630	2039/11/15
小 計				82,106	
(ポーランド) 国債証券		千ポランドズロチ	千ポランドズロチ		
POLGB 2 1/2 07/25/27	2.5	700	665	19,811	2027/7/25
POLGB 5 1/2 10/25/19	5.5	500	528	15,716	2019/10/25
POLGB 5 3/4 09/23/22	5.75	1,500	1,710	50,889	2022/9/23
小 計				86,417	

銘柄	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		
(オーストラリア) 国債証券	%	千豪ドル	千豪ドル	千円	
ACGB 2 3/4 04/21/24	2.75	100	101	8,384	2024/4/21
ACGB 2 3/4 11/21/27	2.75	500	499	41,391	2027/11/21
ACGB 3 03/21/47	3.0	200	189	15,695	2047/3/21
ACGB 3 1/4 04/21/25	3.25	200	208	17,247	2025/4/21
ACGB 3 1/4 04/21/29	3.25	300	312	25,883	2029/4/21
ACGB 3 3/4 04/21/37	3.75	200	218	18,095	2037/4/21
ACGB 4 1/2 04/20	4.5	500	522	43,303	2020/4/15
ACGB 4 1/4 04/21/26	4.25	200	222	18,429	2026/4/21
ACGB 5 1/2 04/21/23	5.5	300	342	28,398	2023/4/21
ACGB 5 3/4 05/15/21	5.75	300	330	27,394	2021/5/15
ACGB 5 3/4 07/15/22	5.75	400	454	37,612	2022/7/15
小 計				281,835	
(シンガポール) 国債証券		千シンガポールドル	千シンガポールドル		
SIGB 3 1/2 03/01/27	3.5	300	322	26,373	2027/3/1
SIGB 3 1/8 09/01/22	3.125	300	312	25,542	2022/9/1
小 計				51,915	
(マレーシア) 国債証券		千リンギット	千リンギット		
MGS 3.502 05/31/27	3.502	400	376	10,371	2027/5/31
MGS 4.16 07/15/21	4.16	700	705	19,424	2021/7/15
MGS 4.392 04/15/26	4.392	500	501	13,808	2026/4/15
MGS 5.248 09/28	5.248	700	752	20,696	2028/9/15
小 計				64,301	
(南アフリカ) 国債証券		千ラン	千ラン		
SAGB 10 1/2 12/21/26	10.5	1,500	1,682	14,741	2026/12/21
SAGB 6 1/2 02/28/41	6.5	2,000	1,471	12,889	2041/2/28
SAGB 6 1/4 03/31/36	6.25	3,000	2,239	19,620	2036/3/31
SAGB 7 02/28/31	7.0	1,000	851	7,461	2031/2/28
SAGB 7 3/4 02/28/23	7.75	2,000	1,993	17,460	2023/2/28
SAGB 8 3/4 02/28/48	8.75	2,000	1,884	16,509	2048/2/28
小 計				88,683	
合 計				12,910,502	

(注) 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で邦貨換算したものです。

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

TMA日本株TOPIXマザーファンド

運用報告書 第18期（決算日 2018年3月20日）

（計算期間 2017年3月22日～2018年3月20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

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチマーク		株組入比率	株先物比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
14期(2014年3月20日)	8,387	10.5	1,145.97	8.3	99.4	0.6	138,907
15期(2015年3月20日)	11,801	40.7	1,580.51	37.9	97.2	2.3	161,556
16期(2016年3月22日)	10,430	△11.6	1,369.93	△13.3	98.5	1.6	131,902
17期(2017年3月21日)	12,166	16.6	1,563.42	14.1	97.2	2.1	79,920
18期(2018年3月20日)	13,619	11.9	1,716.29	9.8	93.8	6.2	68,511

(注) 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（東証株価指数）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、利用等TOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び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の指数値及びTOPIXの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。(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、(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負いません。(株)東京証券取引所は、委託会社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設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2017年3月21日	円 12,166	% -	1,563.42	% -	% 97.2	% 2.1
3月末	11,875	△ 2.4	1,512.60	△ 3.3	96.3	3.6
4月末	12,027	△ 1.1	1,531.80	△ 2.0	96.6	2.8
5月末	12,317	1.2	1,568.37	0.3	95.6	4.2
6月末	12,677	4.2	1,611.90	3.1	95.9	3.9
7月末	12,726	4.6	1,618.61	3.5	96.9	3.0
8月末	12,715	4.5	1,617.41	3.5	96.3	3.5
9月末	13,263	9.0	1,674.75	7.1	95.2	4.6
10月末	13,988	15.0	1,765.96	13.0	92.5	7.4
11月末	14,200	16.7	1,792.08	14.6	93.7	6.4
12月末	14,414	18.5	1,817.56	16.3	98.0	1.8
2018年1月末	14,562	19.7	1,836.71	17.5	98.1	3.4
2月末	14,029	15.3	1,768.24	13.1	95.8	4.1
(期 末) 2018年3月20日	13,619	11.9	1,716.29	9.8	93.8	6.2

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

○運用経過

(2017年3月22日～2018年3月20日)

■期中の基準価額等の推移

期首：12,166円

期末：13,619円

騰落率：11.9%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・米国など主要国の経済成長の加速
- ・好調な日本の企業業績
- ・日銀による金融緩和政策の継続

マイナス要因

- ・朝鮮半島や中東などの地政学的リスク
- ・米国や欧州における金融政策の転換
- ・トランプ米大統領の通商政策

■投資環境

当期の国内株式市場は、主要国の経済成長が持続していることや好調な企業業績を背景に上昇しました。

期初は、朝鮮半島の地政学的リスクやフランス大統領選などが意識されて一時的に下落しましたが、企業業績への期待感や日銀のETF（指数連動型上場投資信託）買い入れなどにより良好な需給環境が継続したことから、国内株式市場は値を戻し、2017年9月まで株価は横ばいで推移しました。

9月中旬からは衆議院総選挙での与党優勢の観測や好景気・好業績を背景とした米国株高などに加え、9月末決算の結果が市場で好感されたことから11月上旬まで国内株式市場の上昇が続きましたが、年末にかけては企業業績の改善を期待する買いと利益確定の売りが交錯して、方向感のない値動きとなりました。

2018年1月以降は、海外投資家の買いにより急上昇して始まりましたが、海外投資家が売り越しに転じると株価は頭打ちとなり、2月は米国の好調な雇用統計から長期金利が急上昇したことを背景に米国株式市場が下落するとリスク回避的な動きから為替市場で円高米ドル安が進んだこともあり、国内株式市場も下落して値動きの荒い展開が続きました。

期末にかけては、トランプ米大統領の通商政策への懸念のほか、国内では安倍政権の支持率低下などが懸念材料となり、株価の戻りが鈍くなりました。

■ポートフォリオについて

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、一定以下の銘柄については当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。

期首の保有銘柄数は1,118銘柄でしたが、期中は設定・解約に応じたTOPIX先物と現物株式の売買を行い、期末における保有銘柄数は1,076銘柄となりました。なお、実質的な株式の組入比率はほぼ100%に維持しました。

以上の運用の結果、基準価額は11.9%上昇しました。

基準価額とベンチマークの推移



(注) ベンチマークは、期首(2017年3月21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。

(注) ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

■当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+11.9%となり、ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）の騰落率+9.8%にほぼ連動しました。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1.1%となりました。

（主な差異要因）

プラス要因

- ・配当金収入

※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。

○今後の運用方針

引き続き、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ます。

○1万口当たりの費用明細

（2017年3月22日～2018年3月20日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 2 (0) (2)	% 0.018 (0.001) (0.018)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 * 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.002 (0.002)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 *その他は、信託事務等に要する諸費用
合 計	2	0.020	
期中の平均基準価額は、13,232円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2017年3月22日～2018年3月20日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		37,007 (△ 4,906)	68,782,543 ()	51,125	84,926,474

(注) 金額は受渡代金です。

(注) () 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いません。

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	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
内		93,713	91,325	13,081	13,113

○株式売買比率

(2017年3月22日～2018年3月20日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	153,709,018千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	58,427,640千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.63

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2017年3月22日～2018年3月20日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株式	百万円 519	百万円 677	百万円 483

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

(2018年3月20日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
日本水産	49	34.6	18,511
マルハニチロ	7.3	5.1	16,753
サカタのタネ	5.4	3.9	14,274
ホクト	7.7	6.9	13,841
鉱業 (0.3%)			
日鉄鉱業	0.1	—	—
国際石油開発帝石	201.2	143	181,395
石油資源開発	5.4	5.2	12,433
K&Oエナジーグループ	12.2	6.3	10,243
建設業 (3.1%)			
ショーボンドホールディングス	3.9	2.7	20,358
ミライト・ホールディングス	14.7	9.7	16,111
安藤・間	27	20.8	16,598
東急建設	12.8	12	13,944
コムシスホールディングス	15.8	10.6	29,351
ミサワホーム	12.3	11.6	10,242
東建コーポレーション	0.9	1.3	13,546
ヤマウラ	24.6	8	7,904
大成建設	195	29.3	154,118
大林組	115.4	88.9	104,279
清水建設	118	90.9	86,445
長谷工コーポレーション	44.3	34	54,094
鹿島建設	168	129	127,839
西松建設	42	6.4	17,299
三井住友建設	160.8	22.5	14,265
前田建設工業	24	21.1	26,016
奥村組	31	4.6	20,447
東鉄工業	4	3.9	13,240
戸田建設	43	34	26,418
熊谷組	57	4.3	13,803
大東建託	14.1	10.6	189,528
N I P P O	8	6.3	15,145
前田道路	12	9	20,205

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東亜建設工業	7.8	4.1	8,769
五洋建設	44.8	36.2	27,258
大林道路	16.6	—	—
福田組	1	—	—
住友林業	25.8	19	32,566
日本基礎技術	30.4	20.5	8,282
パナホーム	10	—	—
大和ハウス工業	112.9	86.1	351,374
積水ハウス	120.2	95.5	178,203
北陸電気工事	1.7	6.2	7,148
西部電気工業	2.7	2.4	6,984
中電工	6.5	4.5	13,027
関電工	13	12.9	15,299
きんでん	25.7	19.5	33,540
日本電設工業	6	5.9	12,926
協和エクシオ	16	10.7	28,654
新日本空調	15.5	8.8	14,273
九電工	7.3	5.8	27,869
三機工業	18.1	10.8	12,646
日揮	35.5	25.5	57,681
中外炉工業	54	4	11,740
ヤマト	25.2	11	8,448
高砂熱学工業	11.5	8.4	16,010
三晃金属工業	2	1.7	6,876
大気社	5.5	3.8	13,015
日比谷総合設備	11.6	5.9	11,404
東芝プラントシステム	6.2	6.7	15,436
東洋エンジニアリング	34	7.1	7,121
千代田化工建設	26	20	19,840
新興ブランテック	19.8	14.2	13,703
食料品 (4.3%)			
日本製粉	11	8.8	14,291
日清製粉グループ本社	42.6	32.1	65,708
鳥越製粉	21.6	9.9	9,573

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本甜菜製糖	7.7	5.6	12,796
三井製糖	5.2	3.1	12,973
森永製菓	7.4	6	28,050
中村屋	0.5	—	—
江崎グリコ	9.5	7.3	39,858
山崎製パン	28	21.3	46,008
亀田製菓	1.2	2.5	12,500
寿スピリッツ	—	2.4	13,392
カルビー	15.4	12.3	44,526
森永乳業	34	5.2	22,204
ヤクルト本社	20.4	15.8	124,030
明治ホールディングス	22.6	17.4	136,416
雪印メグミルク	8.2	6.2	17,527
ブリマハム	15	22	13,310
日本ハム	26	22	48,532
丸大食品	15	20	10,360
S F o o d s	4.8	3.3	14,140
伊藤ハム米久ホールディングス	23.8	18.1	16,670
サッポロホールディングス	12.5	9.3	27,881
アサヒグループホールディングス	71.6	55.1	302,223
キリンホールディングス	164.4	126.2	365,538
宝ホールディングス	28.2	20.7	25,212
オエノンホールディングス	39	29.7	13,365
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	12.7	18	77,490
コカ・コーライーストジャパン	14.9	—	—
サントリー食品インターナショナル	26.4	20.3	101,398
ダイドーグループホールディングス	1.2	2	13,140
伊藤園	11.4	8.7	35,713
キーコーヒー	9.8	6.6	14,117
ユニカフェ	0.3	5.6	5,936
ジャパンフーズ	12.1	7.5	11,715
日清オイリオグループ	16	4.4	12,777
不二製油グループ本社	10	7.4	23,976
J-オイルミルズ	1.6	3.6	13,266
キッコーマン	27	20.8	87,984
味の素	78.7	61	118,523
キュービー	19.5	14.8	44,030
ハウス食品グループ本社	13.9	10.2	35,037

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カゴメ	13.7	10.3	36,925
アリアケジャパン	3	2.4	19,800
ニチレイ	19.2	12.8	35,059
東洋水産	18.8	14.7	60,564
日清食品ホールディングス	14.9	11.6	83,288
フジッコ	7.5	4.6	10,938
ロック・フィールド	9.5	7	14,854
日本たばこ産業	211.6	162.9	483,487
ユーグレナ	11.9	11.5	11,385
繊維製品 (0.7%)			
片倉工業	9	8.4	11,818
グンゼ	44	2.2	12,980
東洋紡	138	10.5	22,827
倉敷紡績	80	54	18,630
日本毛織	11.1	12	12,552
帝国繊維	7.6	6	11,640
帝人	28.9	22.8	46,603
東レ	259	199.2	202,686
日本フェルト	32.1	20.5	10,701
セーレン	9.1	6.3	11,995
小松精練	23.5	15	17,340
ワコールホールディングス	20	7.7	24,293
ホギメディカル	2.2	1.5	12,525
T S I ホールディングス	26.6	19.7	14,893
三陽商会	58	5.1	12,515
オンワードホールディングス	22	15	13,140
デサント	11.6	8.4	14,212
パルプ・紙 (0.3%)			
特種東海製紙	2.9	3.1	12,911
王子ホールディングス	138	117	80,262
日本製紙	15.7	12.1	24,635
三菱製紙	23.3	15.9	10,971
北越紀州製紙	23.3	18.3	12,700
大王製紙	15.3	11	16,148
レンゴー	33	25.6	24,371
ザ・バック	5.9	3.6	14,256
化学 (7.1%)			
クラレ	59.7	46.6	83,414

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
旭化成	223	171.5	240,614
共和レザー	18.3	9.2	8,712
昭和電工	24	18.1	82,264
住友化学	263	202	124,028
住友精化	0.5	—	—
日産化学工業	19.6	16.2	67,716
クレハ	2.1	2.2	15,092
石原産業	9.5	7.6	10,389
片倉コープアグリ	41	4.7	5,828
日本曹達	14	22	13,596
東ソー	105	40.1	84,450
トクヤマ	55	8	25,720
セントラル硝子	34	5.7	13,702
東亜合成	22.2	16.6	20,384
大阪ソーダ	17	4.3	12,104
デンカ	73	10.2	38,250
信越化学工業	64	45.7	499,272
堺化学工業	13	4.6	13,409
エア・ウォーター	29.3	22.7	46,126
大陽日酸	28	21.3	33,568
日本パーカライジング	18.3	14.3	25,425
ステラ ケミファ	0.9	3.7	12,080
日本触媒	5.7	4.2	31,626
カネカ	48	37	37,851
三菱瓦斯化学	33.4	22.2	56,787
三井化学	165	25.3	84,881
J S R	35.8	27.5	66,550
東京応化工業	7	4.8	19,584
三菱ケミカルホールディングス	240.4	184.3	187,340
ダイセル	48.6	37.9	46,427
住友ベークライト	31	21	19,530
積水化学工業	81.6	56.7	103,874
日本ゼオン	30	23.4	35,778
アイカ工業	11.3	7.7	29,568
宇部興産	182	14.1	44,274
旭有機材	46	7.6	13,923
日立化成	19.9	13.8	33,120
群衆化学工業	0.3	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タイガースポリマー	18.9	12.6	11,037
ミライアル	9.3	3.6	5,778
日本化薬	23	17.5	23,397
ADEKA	15.4	12.3	23,283
日油	28	11	32,461
ハリマ化成グループ	28.6	8.9	7,422
花王	90.7	64.5	476,977
ニイタカ	0.3	3	5,355
三洋化成工業	1.3	2.6	12,909
日本ペイントホールディングス	27.6	21.4	83,032
関西ペイント	37.4	29.2	74,080
中国塗料	8.1	14.3	15,315
太陽ホールディングス	3	2.5	11,062
D I C	14	11	40,260
サカタインクス	8.5	8.2	12,742
東洋インキS Cホールディングス	35	26	16,978
富士フィルムホールディングス	70.8	54.5	233,587
資生堂	67.7	48.7	301,745
ライオン	44	37.1	73,532
高砂香料工業	4.4	4	12,640
マンダム	3.5	5.2	18,044
ミルボン	—	3.3	14,751
ファンケル	8.3	6.2	22,010
コーセー	5.7	4.4	86,152
コタ	0.8	5.7	10,664
シーズ・ホールディングス	4.1	3.3	16,500
ポーラ・オルビスホールディングス	3.6	11.2	48,272
ノエビアホールディングス	—	1.9	13,566
エステー	13.2	4.8	10,800
長谷川香料	10.4	5.7	11,166
小林製薬	9.7	7.3	50,808
荒川化学工業	10.1	5.9	11,239
メック	11.4	6.5	11,830
タカラバイオ	—	7.5	15,457
アース製薬	1.7	2.3	12,328
イハラケミカル工業	15.5	—	—
大成ラミック	2	2.1	6,835
クミアイ化学工業	11	23.2	14,244

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本農業	12.1	17.3	10,414
日東電工	25.8	19.8	160,142
レック	6.2	3.5	12,390
前澤化成工業	10.4	6.1	7,246
エフビコ	3.1	2.3	14,950
天馬	8.8	5.1	10,771
信越ポリマー	14	10.8	12,333
ニフコ	6.2	4.8	35,952
日本バルカー工業	10	4.6	13,846
ユニ・チャーム	72.4	55.6	160,989
医薬品 (4.8%)			
協和発酵キリン	42.4	32.8	73,209
武田薬品工業	133.8	96.5	530,074
アステラス製薬	364.4	269.3	428,052
大日本住友製薬	25	19.4	33,018
塩野義製薬	45.3	37.2	200,917
田辺三菱製薬	41.7	32.5	71,337
あすか製薬	6.8	5.8	10,544
日本新薬	8.2	6.8	47,396
中外製薬	35.3	27.4	147,960
科研製薬	6.6	4.6	27,324
エーザイ	44	31.3	213,090
ロート製薬	17.4	14.3	41,655
小野薬品工業	81	62	196,168
久光製薬	10	7.5	60,750
持田製薬	2.4	1.8	13,248
参天製薬	65.3	50.2	85,942
ツムラ	11.8	9.3	34,363
日医工	8.3	7.6	12,502
キッセイ薬品工業	6.1	4.4	12,262
生化学工業	8.1	6.8	13,171
鳥居薬品	6.7	4.1	11,127
JCRファーマ	2.2	2.5	12,750
東和薬品	1.1	2.5	16,600
沢井製薬	6	5	23,175
ゼリア新薬工業	8.4	6.6	13,338
第一三共	105.1	74.8	286,484
キョーリン製薬ホールディングス	9.1	6.5	13,318

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大幸薬品	1.2	5.2	10,878
大塚ホールディングス	76.8	54.2	284,062
大正製薬ホールディングス	7.7	5.8	60,552
ベプチドリーム	6.5	11.9	60,452
石油・石炭製品 (0.7%)			
昭和シェル石油	31.6	24.6	33,677
ニチレキ	15.9	9.9	12,355
東燃ゼネラル石油	58	—	—
出光興産	16.9	22.2	87,468
JXTGホールディングス	395.6	418.2	265,640
コスモエネルギーホールディングス	12.1	7.2	25,560
ゴム製品 (0.9%)			
横浜ゴム	21.7	15.2	37,148
東洋ゴム工業	19	15.3	27,234
ブリヂストン	120.4	87.2	400,073
住友ゴム工業	33.6	26.6	52,215
オカモト	7	11	12,122
ニッタ	4.9	3	11,865
住友理工	13.6	11.2	11,928
三ツ星ベルト	4	—	—
パンドー化学	11.4	10	12,160
ガラス・土石製品 (0.9%)			
日東紡績	30	5.4	12,641
旭硝子	175	27	115,830
日本山村硝子	48	41	7,544
日本電気硝子	73	11.3	35,482
住友大阪セメント	64	52	24,596
太平洋セメント	215	16.8	63,672
日本ヒューム	14.4	10.2	7,843
東海カーボン	32.8	23.2	37,143
東洋炭素	4.3	3.9	13,747
ノリタケカンパニーリミテド	1.1	—	—
TOTO	26.1	20.3	111,853
日本碍子	44.6	32.1	59,673
日本特殊陶業	30.7	22	56,738
ニチアス	19	13	17,719
ニチハ	6.9	3.7	14,781

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
鉄鋼 (1.2%)			
新日鐵住金	161	115.8	274,735
神戸製鋼所	63.2	47.6	49,694
合同製鐵	3.1	5.5	11,467
ジェイ エフ イー ホールディングス	97.6	70.2	154,615
日新製鋼	15.5	8.4	11,071
東京製鐵	18.5	15.1	12,850
共英製鋼	5	6.6	11,688
大和工業	6.8	5	14,870
大阪製鐵	6.6	4	8,300
淀川製鋼所	4.8	4.9	14,067
東洋鋼鋳	40.3	20.3	14,473
丸一鋼管	11.7	9	28,260
モリ工業	0.6	—	—
大同特殊鋼	59	4.4	24,684
山陽特殊製鋼	14	4.6	12,567
愛知製鋼	1.2	3.1	13,655
日立金属	35.8	28.2	36,152
大平洋金属	28	3.7	11,174
新日本電工	33.8	31.9	10,973
三菱製鋼	51	4.9	11,931
シンニッタン	25.6	12.5	11,250
非鉄金属 (0.9%)			
日本軽金属ホールディングス	86.6	73.9	21,061
三井金属鉱業	94	7	34,650
東邦亜鉛	19	2.3	11,753
三菱マテリアル	22.5	17	56,525
住友金属鉱山	92	33.2	147,009
DOWAホールディングス	38	6.2	24,738
古河機械金属	45	6.4	13,280
UACJ	45	4.3	11,459
古河電気工業	11.7	8.6	50,826
住友電気工業	134.4	97	159,274
フジクラ	46.7	30.2	22,317
タツタ電線	28	16.2	10,999
リョービ	27	4.4	12,205
アサヒホールディングス	11.7	6.3	12,348

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
金属製品 (0.7%)			
トーカロ	4	10.8	14,536
SUMCO	37.5	24.2	73,326
東洋製鐵グループホールディングス	25.2	18.3	28,914
ホッカンホールディングス	2	—	—
コロナ	14.2	5.2	6,515
横河ブリッジホールディングス	11.6	5.8	13,067
駒井ハルテック	4.3	2.9	7,363
三和ホールディングス	34.6	25.7	34,874
文化シャッター	11.9	13.5	14,391
三協立山	8.5	8.5	13,064
LIXILグループ	49.4	38.6	92,369
ノーリツ	6.5	7	13,195
長府製作所	5.8	4.5	11,052
リンナイ	6.1	4.7	46,530
日東精工	32.3	16.6	12,466
東プレ	6.9	4.6	14,168
高周波熱練	19.7	11.2	12,320
パイオラックス	1.2	4.3	11,872
日本発條	35.2	26.3	29,350
三益半導体工業	10.5	5.5	10,659
機械 (5.4%)			
日本製鋼所	11.7	8.7	30,232
三浦工業	15.3	11.5	37,490
タクマ	7	9.3	11,039
ツガミ	2	—	—
オークマ	23	3.1	19,623
東芝機械	34	17	12,767
アマダホールディングス	48.2	39.7	51,610
アイダエンジニアリング	9.3	9	12,150
富士機械製造	12.4	7.7	16,177
牧野フライス製作所	17	11	11,231
オーエスジー	16.3	12	28,572
旭ダイヤモンド工業	9.6	7.7	8,916
DMG森精機	21.3	14	27,244
ディスコ	4.1	3.5	83,720
日東工器	6.9	3.1	9,393
島精機製作所	4.7	3	22,860

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
NCホールディングス	0.7	4.8	3,624
日阪製作所	20.4	14.7	15,038
ナブテスコ	18.6	14.1	60,700
SMC	10.7	8.2	363,424
新川	20.6	7.6	9,773
ユニオンツール	3.5	3.3	12,738
オイレス工業	4.1	5.8	13,131
サトーホールディングス	5.7	3.8	12,825
小松製作所	164.7	126.2	448,767
住友重機械工業	104	14.8	59,200
日立建機	15.9	12.3	51,106
巴工業	6.5	4.3	8,806
井関農機	57	5.6	12,006
タカキタ	0.7	7.7	5,982
クボタ	171	140.7	256,003
月島機械	11.8	8.3	12,599
帝国電機製作所	15.1	11.5	18,641
新東工業	14.2	12.1	13,902
小森コーポレーション	7.9	9	12,294
鶴見製作所	0.9	5.5	10,934
住友精密工業	10	16	6,272
荏原製作所	16.2	10.9	42,292
西島製作所	18.3	10	9,680
ダイキン工業	46.6	35.8	420,292
栗田工業	20.6	14.2	47,783
椿本チエイン	20	14	12,264
ダイフク	17.4	13.3	86,716
タダノ	17.7	13.3	20,681
フジテック	10.3	9.6	13,516
CKD	12.3	7.1	16,898
平和	10.5	7.7	16,732
SANKYO	9.5	6.5	24,537
日本金銭機械	8.6	7	7,728
福島工業	5.8	3.1	14,074
竹内製作所	6.6	5.5	12,617
アマノ	10.6	8.3	23,323
サンデンホールディングス	25	—	—
グローリー	10.8	7.9	29,625

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大和冷機工業	18.6	10.1	12,625
セガサミーホールディングス	34.3	25.8	43,137
リケン	1.6	2	12,280
ホシザキ	7.5	8.2	77,818
大豊工業	11.4	6.2	9,907
日本精工	71.5	54.4	78,825
NTN	79	62.2	28,114
ジェイテクト	36.9	27.9	43,803
不二越	34	22	14,124
日本トムソン	26.5	17.9	15,465
THK	24.4	16.2	74,034
ユースイン精機	1.9	2.9	9,874
キッツ	18.6	14.2	12,950
マキタ	22.2	34.2	179,208
日立造船	30.7	21.6	11,556
三菱重工業	571	43.9	176,697
I H I	262	20.4	67,422
スター精密	5.8	6.3	12,814
電気機器 (13.9%)			
日清紡ホールディングス	18.8	15.7	22,969
イビデン	23.4	16.1	27,031
コニカミノルタ	80.7	62.2	57,410
ブラザー工業	43.9	32.5	81,607
ミネベアミツミ	62.9	49	116,473
日立製作所	818	629	493,010
東芝	760	—	—
三菱電機	363.5	262.4	449,097
富士電機	101	79	59,408
東洋電機製造	4.4	—	—
安川電機	39.2	30.5	147,467
明電舎	20	31	12,617
山洋電気	2	—	—
東芝テック	23	19	12,027
マブチモーター	9.4	7.3	38,690
日本電産	44.2	31.5	517,072
東光高岳	6.4	4.1	6,974
ダブル・スコープ	3.6	6.3	9,235
ダイヘン	14	17	14,178

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日新電機	9	9.6	9,945
オムロン	36.3	27.9	171,585
日東工業	4.9	6.8	11,165
ジーエス・ユアサ コーポレーション	65	48	27,648
メルコホールディングス	3.5	3.2	11,328
テクノメディカ	0.5	2.4	4,795
日本電気	465	34.2	109,098
富士通	328	269	170,250
沖電気工業	14.1	11.1	15,972
サンケン電気	11	16	12,976
アイホン	7.9	4.3	7,529
ルネサスエレクトロニクス	18.6	13.6	15,354
セイコーエプソン	50.7	38.6	74,652
ワコム	50.7	24.5	12,568
アルバック	5.7	6.1	37,515
E I Z O	6.1	2.9	14,558
ジャパンディスプレイ	68.6	—	—
日本信号	18.6	14.1	14,001
能美防災	9.3	6.5	14,885
ホーチキ	6.8	5.6	10,612
パナソニック	389.6	299.6	493,441
シャープ	—	18.3	63,043
アンリツ	26.8	19.3	26,112
富士通ゼネラル	11	8.3	16,176
日立国際電気	8.3	—	—
ソニー	240.8	175	899,150
TDK	19.1	13.7	135,219
タムラ製作所	5	—	—
アルプス電気	31.4	22.1	59,117
バイオニア	56.5	61.3	11,034
日本電波工業	7.5	—	—
日本トリム	1.2	2	11,160
フォスター電機	7.9	5.4	14,671
ヨコオ	18.7	9.3	18,860
ホシデン	10.7	8	11,176
ヒロセ電機	5.5	4.2	64,680
日本航空電子工業	8	8	12,672
アルバイ	8.5	5.8	12,093

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アイコム	4.8	3.7	10,049
船井電機	13.4	9	7,047
横河電機	36.6	26.2	55,989
アズビル	10.8	7.6	37,278
日本光電工業	14.4	10.8	32,562
堀場製作所	6.6	5.2	40,768
アドバンテスト	22.9	14	32,424
キーエンス	15.5	12.8	825,472
日置電機	7	4.8	16,176
シスメックス	26.4	20.4	186,048
OBARA GROUP	1.8	2	13,360
コーセル	9.5	8.2	12,004
イリソ電子工業	—	2.2	14,366
オプテックスグループ	3.9	2.5	13,525
千代田インテグレ	4.7	4	9,720
レーザーテック	—	5.4	21,708
スタンレー電気	24.2	20.3	79,880
ウシオ電機	20	16.2	24,105
日本セラミック	2.7	4.5	12,906
双信電機	33	—	—
図研	10.5	5.9	9,605
日本電子	3	—	—
カシオ計算機	27.9	21.1	34,371
ファナック	34.6	24.9	645,408
エンプラス	0.6	—	—
ローム	16.6	11.8	125,316
浜松ホトニクス	26.8	18.9	78,813
三井ハイテック	18.6	5.5	8,618
新光電気工業	12.8	14.2	11,246
京セラ	56	42.7	256,797
太陽誘電	17.1	11.7	21,329
村田製作所	35.8	27.5	407,550
双葉電子工業	8.5	5.7	12,876
ニチコン	10.9	8.9	10,760
日本ケミコン	48	4	10,468
KO A	10.4	5.8	13,102
小糸製作所	20.6	15.7	116,180
ミツバ	7.5	7.8	10,959

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
SCREENホールディングス	6.9	4.9	48,510
キャノン電子	9.6	5.7	13,406
キャノン	183.7	141.1	544,504
リコー	101.6	79.7	89,981
東京エレクトロン	22.7	17.4	372,186
輸送用機器 (8.8%)			
トヨタ紡織	12.1	7.5	16,365
ユニプレス	7.1	5.8	13,891
豊田自動織機	31.2	21.3	134,829
モリタホールディングス	7.9	6.4	12,806
デンソー	84.1	58.2	345,417
東海理化電機製作所	9.3	6.5	14,007
三井造船	129	9	16,146
川崎重工業	262	20.2	70,397
日本車輛製造	35	—	—
近畿車輛	3.5	—	—
日産自動車	402.2	309.4	346,373
いすゞ自動車	97.7	75	122,475
トヨタ自動車	414.7	318.2	2,180,624
日野自動車	47.8	37.1	50,975
三菱自動車工業	126.3	98.3	75,985
武蔵精密工業	4.9	3.4	12,410
日産車体	16.4	11.3	11,853
新明和工業	14	13.3	11,823
極東開発工業	11.9	7.9	12,426
日信工業	8.2	5.8	10,376
トビー工業	6.7	3.5	11,007
ティラド	54	2.8	11,340
曙ブレーキ工業	24.1	—	—
NOK	16.3	13.5	28,728
フタバ産業	31.3	12.5	11,025
KYB	38	2.7	13,743
プレス工業	33.8	29.1	18,245
ケーヒン	8.4	6.5	13,572
アイシン精機	31.2	21.7	125,209
マツダ	107.7	83	117,901
今仙電機製作所	12.9	5.8	7,006
本田技研工業	306.7	235.6	858,055

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スズキ	67.5	51.7	292,622
SUBARU	105.9	81.2	293,619
ヤマハ発動機	47.9	37.3	119,360
ショーワ	12.6	9	16,524
エクセディ	4.7	3.5	11,690
豊田合成	11.1	8.9	21,680
愛三工業	15.2	10.6	12,539
ヨロズ	5.4	4.9	8,756
エフ・シー・シー	5.4	5.5	15,559
シマノ	13.7	10.5	160,440
テイ・エス テック	7.9	6.1	25,559
精密機器 (1.6%)			
テルモ	52.3	40.2	217,884
クリエートメディック	16.7	8.5	9,435
日機装	12.7	—	—
島津製作所	44.2	31.7	90,947
クボテック	1.7	5.9	3,156
プイ・テクノロジー	—	0.6	18,030
東京精密	6.3	4.9	21,266
ニコン	59	45	88,425
トプコン	16.8	13.8	29,725
オリンパス	54.7	38.9	157,350
理研計器	13.3	4.3	9,563
タムロン	3.8	5.3	12,412
HOYA	70.2	53.4	296,850
シチズン時計	39.3	31.3	24,288
松風	0.4	—	—
セイコーホールディングス	18	5.2	13,499
ニプロ	25.2	18.4	28,777
その他製品 (2.3%)			
スノーピーク	0.3	—	—
パラマウントベッドホールディングス	3.1	2.9	15,747
バンダイナムコホールディングス	37.4	27.3	97,461
アイフィスジャパン	4.2	8.1	5,726
パイロットコーポレーション	5.7	4.4	26,356
トッパン・フォームズ	16.2	10.9	12,905
フジシールインターナショナル	7.4	5.5	19,772
タカラトミー	12.7	11.9	13,423

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タカノ	20.7	6.8	6,188
ブロネクス	0.5	—	—
大建工業	4.1	4.7	12,107
凸版印刷	96	75	66,300
大日本印刷	99	34.8	76,629
N I S S H A	5.3	5.5	15,323
アシックス	34.3	26.6	52,269
小松ウオール工業	4.5	4.8	13,123
ヤマハ	23.1	17.8	82,147
クリナップ	16.1	11.1	8,946
ビジョン	20.5	15.6	67,938
キングジム	21	8.4	8,374
リンテック	8	5.9	17,906
T A S A K I	4.8	—	—
イトーキ	22.7	12.7	8,763
任天堂	21	16.1	776,503
三菱鉛筆	2.6	4.6	10,731
タカラスタンダード	4.8	7.3	13,059
コクヨ	18.1	12.6	25,729
岡村製作所	12.5	10	14,600
美津濃	11	4.2	13,545
電気・ガス業 (1.6%)			
東京電力ホールディングス	290.8	208.3	82,903
中部電力	111.4	80.7	119,557
関西電力	139.5	107	141,454
中国電力	47.3	36.5	47,340
北陸電力	32.5	26.5	23,797
東北電力	84.4	62.2	88,697
四国電力	30.2	24.5	30,894
九州電力	74.9	58.8	72,970
北海道電力	31.2	25.9	17,534
沖縄電力	6.1	4.8	14,035
電源開発	27	20.9	58,331
東京瓦斯	366	56	153,020
大阪瓦斯	330	51.2	106,316
東邦瓦斯	86	12.8	41,472
北海道瓦斯	35	22	6,732
西部瓦斯	65	4.6	12,604

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
静岡ガス	14.7	15.7	14,475
陸運業 (3.9%)			
東武鉄道	183	28.3	91,126
相鉄ホールディングス	54	7.9	22,254
東京急行電鉄	185	71.8	121,126
京浜急行電鉄	93	36.4	66,976
小田急電鉄	54.4	39.5	84,925
京王電鉄	95	14.8	67,710
京成電鉄	25.5	18.1	58,734
富士急行	5	—	—
東日本旅客鉄道	66	47	460,694
西日本旅客鉄道	32.9	23.7	175,522
東海旅客鉄道	28.3	23.4	460,980
西武ホールディングス	46.9	33.6	61,555
西日本鉄道	40	6.9	19,044
近鉄グループホールディングス	343	25	103,875
阪急阪神ホールディングス	43.1	33.3	130,702
南海電気鉄道	72	11.6	31,122
京阪ホールディングス	77	11.2	36,736
名古屋鉄道	124	19.5	52,318
日本通運	132	9.7	68,579
ヤマトホールディングス	60.7	43.9	116,247
山九	45	6.4	33,472
丸運	27.8	24.1	8,194
センコーグループホールディングス	27.4	23.1	18,803
トナミホールディングス	24	1.8	10,602
ニッコンホールディングス	11.5	8.9	25,035
日本石油輸送	2	2.1	6,646
福山通運	14	3.3	15,411
セイノーホールディングス	24.5	18.6	36,307
日立物流	7	5	14,370
C&Fロジホールディングス	11.7	7.2	10,843
九州旅客鉄道	25.5	20.9	68,970
S Gホールディングス	—	17.6	38,790
海運業 (0.2%)			
日本郵船	290	21	45,717
商船三井	178	15.7	48,905
川崎汽船	128	11.2	27,966

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
飯野海運	24.1	23.6	12,106
空運業 (0.6%)			
日本航空	61.5	46.1	202,425
ANAホールディングス	632	48.5	203,506
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	22	8.1	18,638
三井倉庫ホールディングス	32	36	12,312
住友倉庫	23	20	14,700
東陽倉庫	58.8	30.4	11,248
安田倉庫	10.2	8.3	8,515
上組	41	15.7	36,989
キムラユニティ	7.7	5.6	6,372
キューソー流通システム	2.7	2.6	6,861
郵船ロジスティクス	12.2	—	—
近鉄エクスプレス	7.9	6.2	12,381
エーアイティー	1.3	4.5	5,184
情報・通信業 (7.5%)			
NECネットエスアイ	7.4	4.5	12,469
新日鉄住金ソリューションズ	7.6	4.6	13,772
T I S	11.1	8.3	35,897
ネオス	9.7	11.8	4,708
電算システム	1.2	3.9	7,620
グリー	22.3	18.8	11,693
コーエーテックモホールディングス	7.4	6	12,864
ヒト・コミュニケーションズ	2.2	3.6	6,480
ブレインパッド	6.8	5.4	14,202
K L a b	6.7	7.4	12,439
ネクソン	36.7	28.9	105,485
エムアップ	4.8	—	—
エイチーム	4.3	4.3	10,823
e n i s h	6.8	—	—
コロブラ	9.1	12	11,592
サイバーリンクス	3.9	4.2	5,308
VOYAGE GROUP	4.8	5.5	6,886
ベリサーブ	1.8	—	—
ティーガイア	8.8	5.4	15,190
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	75	70.4	25,414
GMOペイメントゲートウェイ	2.8	1.6	16,480

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ザッパラス	27.2	14.1	5,456
インターネットイニシアティブ	8.7	5.8	12,841
L I N E	5.4	7.3	30,185
フェイス	0.4	5	6,000
野村総合研究所	24.9	17.3	85,029
C Eホールディングス	0.4	7.4	6,445
インテージホールディングス	1.3	10.3	12,009
フジ・メディア・ホールディングス	35.3	26.5	48,468
オービック	11.6	8	72,640
ヤフー	240.4	184.1	92,786
トレンドマイクロ	17.6	12.7	77,597
日本オラクル	5.3	4.1	35,055
アルファシステムズ	0.7	—	—
フューチャー	21.2	10.3	14,553
C A C H o l d i n g s	12.6	9.5	9,908
ソフトバンク・テクノロジー	3.6	4.8	8,884
伊藤忠テクノソリューションズ	7.4	5.5	24,090
大塚商会	8.8	7.8	81,510
サイボウズ	43.3	16.8	9,206
電通国際情報サービス	9.2	3.5	10,181
デジタルガレージ	—	4.9	17,664
ウェザーニューズ	1.2	2.7	8,950
日本エンタープライズ	19.5	25.3	5,793
ネットワンシステムズ	16.8	10.5	15,739
アルゴグラフィックス	5.8	4	12,920
エイベックス	12.3	9.3	14,703
日本ユニシス	10.3	7.4	17,005
兼松エレクトロニクス	7.2	4.2	12,768
東京放送ホールディングス	21.9	15.8	36,340
日本テレビホールディングス	30.7	23.9	45,410
テレビ朝日ホールディングス	9	6.4	14,060
スカパーJ S A Tホールディングス	30.5	29.6	14,119
テレビ東京ホールディングス	7.2	5.2	14,497
日本通信	45.8	—	—
日本電信電話	270.1	184.3	929,424
K D D I	332.7	231.7	625,705
光通信	4.1	3.1	46,934
N T T ドコモ	251.5	190.5	527,494

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
GMOインターネット	11.9	8.9	19,535
カドカワ	10.3	10.5	12,127
ゼンリン	8.7	3.5	11,777
松竹	21	1.7	24,633
東宝	21.9	16.9	56,953
東映	8	1	11,290
エヌ・ティ・ティ・データ	20.5	80.9	89,799
ビジネスブレイン太田昭和	1.7	4.2	8,689
D T S	7.4	3.5	13,230
スクウェア・エニックス・ホールディングス	12.9	11.8	56,994
カプコン	7.8	5.4	27,486
S C S K	9.1	6	27,030
アイネス	13.2	12.9	14,383
TKC	5.1	2.7	11,637
富士ソフト	5.1	3.8	15,580
NSD	7.3	6.8	14,858
コナミホールディングス	15.4	10.5	58,380
ソフトバンクグループ	151.6	116.1	993,119
卸売業 (4.7%)			
伊藤忠食品	1	1.6	9,712
エレマテック	3.4	5	12,990
J A L U X	2	2.4	7,764
双日	202.7	155.5	52,714
アルフレッサ ホールディングス	39.5	28.1	64,995
横浜冷凍	17.9	13.5	13,770
あい ホールディングス	5.8	5	14,220
マクニカ・富士エレホールディングス	14.5	5.9	11,575
バイタルケーエスケー・ホールディングス	12.6	13.4	13,668
UKCホールディングス	6.2	5.6	12,314
O C H I ホールディングス	0.7	2.2	3,262
T O K A I ホールディングス	16.1	14.5	15,225
シップヘルスケアホールディングス	6.3	5.7	21,603
明治電機工業	0.4	3.3	6,114
エコートレーディング	13.6	12.8	9,036
ナガイレーベン	6.8	4.9	14,749
三菱食品	5.1	4.1	12,177
松田産業	13.4	7.8	14,211
第一興商	5.4	3.8	21,546

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
メディバルホールディングス	34.2	26.3	57,202
アズワン	1.6	1.9	13,300
尾家産業	0.3	2.3	3,045
ドウシシャ	6.7	4.9	11,456
黒田電気	9.7	—	—
丸文	18.5	7.6	7,470
橋本総業ホールディングス	0.8	2.3	4,006
日本ライフライン	—	7	21,945
I D O M	20.9	16.2	11,793
進和	6.5	3.6	7,761
オーハシテクニカ	12	5	8,515
白銅	8.9	3.5	8,193
伊藤忠商事	246.3	189.1	387,371
丸紅	331	212.7	165,289
長瀬産業	20.8	15.6	28,251
豊田通商	37.8	29	106,575
兼松	104	11.8	16,461
三井物産	304.2	219.1	405,882
日本紙パルプ商事	30	3.5	14,857
日立ハイテクノロジーズ	11.6	8.8	43,076
山善	19.6	15	16,545
住友商事	211.7	162.9	290,776
内田洋行	2	3.4	9,550
三菱商事	252.3	181.1	521,930
キャノンマーケティングジャパン	9.4	7.5	20,745
西華産業	36	3.4	8,901
菱洋エレクトロ	13.2	4.8	8,203
東京産業	37.5	14.7	8,687
阪和興業	33	4.9	21,976
フルサト工業	0.2	—	—
岩谷産業	38	5.7	22,771
イワキ	65	15	6,360
三菱石油	16.2	9.1	13,977
稲畑産業	14.9	6.8	10,546
ワキタ	7.1	10.4	12,334
東邦ホールディングス	10.7	7.5	18,247
サンゲツ	12.4	9	19,575
シナネンホールディングス	2.5	4	10,940

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
伊藤忠エネクス	16.7	9.1	9,090
サンリオ	10.2	7.8	15,038
リョーサン	4.7	3.6	13,842
新光商事	0.5	—	—
三信電気	1.9	6.5	13,546
モスフードサービス	3.9	3.7	11,562
加賀電子	9.4	3.9	10,436
立花エレテック	12	6.9	14,993
フォーバル	1.2	6.5	5,941
PAL TAC	5.1	3.4	17,748
日鉄住金物産	2	2.6	14,716
トラスコ中山	7.5	5	12,425
オートバックスセブン	12.9	9.6	19,248
加藤産業	5.6	3.7	13,505
イノテック	26.9	7.9	10,246
杉本商事	8.5	5.4	10,173
因幡電機産業	4.8	3.3	15,708
ミスミグループ本社	38.4	29.5	85,963
スズケン	15.3	12	51,660
ジェコス	9.9	10.2	11,679
小売業 (4.8%)			
ローソン	10.8	6.5	45,435
サンエー	2	2.5	14,950
エービーシー・マート	6	4.5	30,870
ハードオフコーポレーション	5.5	5.6	6,468
アスクル	4	4.2	14,700
ゲオホールディングス	9.1	6.3	11,232
アダストリア	4.7	6	14,196
ジーフット	1.2	8	6,016
エディオン	23.7	15.6	19,203
ハローズ	0.8	—	—
あみやき亭	1.6	2.1	12,264
ハニーズホールディングス	10.4	8.6	9,038
ジンズ	2.2	3.2	17,696
ビックカメラ	19.1	14.8	24,434
DCMホールディングス	20.1	14.9	15,779
MonotaRO	11.9	9.4	34,216
J. フロント リテイリング	42.2	30.7	55,966

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ドトール・日レスホールディングス	9.9	5.3	13,324
マツモトキヨシホールディングス	6.4	10.5	45,307
スタートトゥデイ	30.5	24.7	65,677
ココカラファイン	3.4	2.6	17,862
三越伊勢丹ホールディングス	66.5	48.4	57,692
ウエルシアホールディングス	6.6	6.9	30,601
クリエイトSDホールディングス	4.5	4.6	12,240
シュッピン	1.7	5.8	7,250
ジョイフル本田	5.2	4.1	14,883
すかいらくらく	14.6	16.1	24,198
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	17.8	13.9	15,387
ブックオフコーポレーション	11.6	8.5	7,233
ゴルフダイジェスト・オンライン	4.5	5.9	5,705
あさひ	7.1	5.9	7,711
コスモス薬品	1.7	1.2	25,716
トーエル	1.6	5.9	6,012
セブン&アイ・ホールディングス	140.8	108.3	484,317
ツルハホールディングス	7.8	5.5	81,180
サンマルクホールディングス	4.4	4.6	14,973
トリドールホールディングス	4	3.7	14,411
クスリのアオキホールディングス	3	2.3	16,882
総合メディカル	0.8	—	—
カッパ・クリエイト	7.3	9.1	11,902
ライトオン	9.9	8.3	7,735
良品計画	4.4	3.4	125,970
三城ホールディングス	29.7	18.9	9,998
アドヴァン	16.4	10.9	10,910
G-7ホールディングス	0.8	2.7	6,355
エコス	0.1	5.6	6,972
マルシェ	2	7.4	6,023
ドンキホーテホールディングス	22.1	16.9	101,569
西松屋チェーン	8.2	9.1	10,774
ゼンショーホールディングス	17.3	13.6	32,531
サイゼリヤ	5.3	4.7	14,311
魚力	0.2	5.1	6,823
ユナイテッドアローズ	4.1	3.3	13,629
ハイデイ日高	3.2	4.3	11,554
京都きもの友禅	14.3	8.6	6,518

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コロワイド	11.2	8.5	21,020
老番屋	3.7	2.9	12,441
スギホールディングス	7.3	5.8	33,524
スクロール	27.8	14.7	6,218
ユニ・ファミリーマートホールディングス	14.7	8.2	69,782
木曽路	7.5	4.7	12,896
千趣会	22.1	17.4	9,465
ケーヨー	24.2	17.1	9,661
上新電機	4	—	—
日本瓦斯	6.2	4.3	19,457
ロイヤルホールディングス	7.8	4.9	13,754
いなげや	0.8	6.9	12,516
島忠	8.5	6.2	21,080
チヨダ	6	4.7	12,008
ライフコーポレーション	2.9	4.7	13,474
AOKIホールディングス	13.4	9	14,760
コメリ	5.3	4.5	13,153
青山商事	7.1	4.8	20,664
しまむら	3.9	2.9	38,454
高島屋	55	40	40,360
松屋	13.5	11.2	16,587
エイチ・ツー・オー リテイリング	18	12.7	24,396
バルコ	10.6	9.6	13,180
丸井グループ	35.4	24.7	49,523
アクシアル リテイリング	1.2	3.7	15,225
イオン	138.3	99.5	181,139
イズミ	6.6	4.8	33,072
平和堂	7	5.8	14,389
フジ	6	4.5	9,972
ヤオコー	3.6	2.6	15,028
ゼビオホールディングス	7.9	5.5	11,825
ケーズホールディングス	15.3	10.3	30,745
アインホールディングス	4.2	3.6	27,576
ヤマダ電機	112.2	84.5	55,939
ニトリホールディングス	14.5	10.2	190,587
吉野家ホールディングス	12.4	9	18,369
王将フードサービス	3.1	2.6	13,728
ブレナス	5.2	5.1	10,393

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アークス	6.1	5.9	14,667
パローホールディングス	7.1	5.7	16,074
ファーストリテイリング	5.6	4.3	179,697
サンドラッグ	6.4	10.9	52,374
ヤマザワ	5.2	4.7	8,253
ペルーナ	22	9.4	11,787
銀行業 (7.3%)			
めぶきフィナンシャルグループ	165.2	135.6	56,680
東京TYフィナンシャルグループ	4.9	4	10,048
九州フィナンシャルグループ	55	43.3	23,338
ゆうちょ銀行	94.9	74	106,708
コンコルディア・フィナンシャルグループ	219.9	154.8	90,403
西日本フィナンシャルホールディングス	22.5	17.4	22,115
新生銀行	315	22.6	37,787
あおぞら銀行	212	15.2	65,056
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,549.9	1,811	1,285,991
りそなホールディングス	393.2	284.8	165,297
三井住友トラスト・ホールディングス	70.3	50.7	228,048
三井住友フィナンシャルグループ	269.5	194.9	885,235
第四銀行	41	2.8	12,936
北越銀行	3.3	4.8	11,155
千葉銀行	132	93	78,957
群馬銀行	74.6	51.2	31,334
武蔵野銀行	5.3	3.8	12,882
千葉興業銀行	24.2	17.2	8,170
七十七銀行	52	7.4	18,840
青森銀行	18	2.9	9,613
秋田銀行	23	3.9	11,037
山形銀行	9	5.1	11,801
岩手銀行	1.5	2.8	11,942
東邦銀行	23	21	8,400
東北銀行	54	4.6	6,651
ふくおかフィナンシャルグループ	136	103	58,401
静岡銀行	93	68	69,428
十六銀行	44	4.5	12,856
スルガ銀行	35.1	25.7	39,243
八十二銀行	65.5	47.6	27,798
山梨中央銀行	14	22	9,504

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大垣共立銀行	45	5.2	14,461
福井銀行	33	4.1	10,057
北國銀行	33	3.3	13,546
滋賀銀行	31	22	12,166
南都銀行	3.2	3.3	9,636
百五銀行	30	24.1	11,977
京都銀行	60	9.9	57,519
紀陽銀行	12.7	9.3	15,577
三重銀行	5.7	3.4	7,820
ほくほくフィナンシャルグループ	22.6	17.1	25,034
広島銀行	101	37.4	30,181
山陰合同銀行	20.9	14.6	14,059
中国銀行	24	18.1	22,643
鳥取銀行	5.2	4.2	7,190
伊予銀行	36.4	37.3	30,287
百十四銀行	35	31	11,067
四国銀行	50	6.7	9,882
阿波銀行	29	18	12,492
大分銀行	13	2.7	10,678
宮崎銀行	26	2.6	8,671
佐賀銀行	37	3.5	8,704
十八銀行	34	37	9,879
沖縄銀行	3.1	2.7	11,920
琉球銀行	6.4	8.1	13,292
セブン銀行	128	96	32,832
みずほフィナンシャルグループ	4,566.4	3,515.4	680,229
山口フィナンシャルグループ	32	23	29,762
長野銀行	3.4	3.9	7,246
名古屋銀行	1.9	3	11,790
北洋銀行	55	40.5	14,580
愛知銀行	0.4	—	—
第三銀行	2.6	3.8	6,201
中京銀行	4.9	3.2	7,446
愛媛銀行	10.5	8.2	10,479
トマト銀行	5.7	4.9	7,467
京葉銀行	28	24	11,496
関西アーバン銀行	7	8.6	12,246
栃木銀行	16.2	22.3	9,232

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トモニホールディングス	30	25.6	12,032
フィデアホールディングス	42.8	56.8	11,076
池田泉州ホールディングス	38.4	29.9	12,378
証券、商品先物取引業 (1.1%)			
F P G	12	10.3	13,863
S B Iホールディングス	39	29.6	76,249
ジャフコ	5.5	3.8	19,418
大和証券グループ本社	314	220	154,506
野村ホールディングス	687.7	445.2	280,787
岡三証券グループ	27	20	13,400
丸三証券	7.7	13.6	14,348
東洋証券	8	—	—
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	40.7	30.1	23,387
水戸証券	14.5	33.6	13,944
いちよし証券	14.2	11.9	15,458
松井証券	18.1	14.7	14,949
だいこう証券ビジネス	3.8	9.2	6,035
マネックスグループ	65.4	52	18,512
カブドットコム証券	44.7	42.9	16,430
極東証券	7.3	8.2	12,800
藍澤證券	2.5	10.7	8,121
保険業 (2.2%)			
かんぽ生命保険	12.9	9.5	24,928
S O M P Oホールディングス	70.5	50.5	210,534
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	100.6	67.6	227,947
ソニーフィナンシャルホールディングス	32.2	21.1	40,786
第一生命ホールディングス	202.8	146.3	297,354
東京海上ホールディングス	136.4	97.5	483,600
T & Dホールディングス	122.7	80.5	138,500
その他金融業 (1.3%)			
全国保証	9.4	7	32,235
クレディセゾン	25.4	19.9	35,740
芙蓉総合リース	3.8	3	21,330
興銀リース	6.8	4.3	12,474
東京センチュリー	6.8	5.2	33,904
日本証券金融	31.2	18.9	12,379
アイフル	56.2	44.8	15,635
リコーリース	3.1	3.2	11,472

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
イオンフィナンシャルサービス	21.8	18.3	44,542
アコム	68.5	53.6	25,781
オリエントコーポレーション	75.9	73.8	12,546
日立キャピタル	7.8	7.3	19,753
オリックス	238.3	172.2	323,649
三菱UFJリース	86.1	65.7	42,376
日本取引所グループ	104	75.9	142,084
アサックス	0.2	1.5	2,790
NECキャピタルソリューション	6.9	6	12,762
不動産業 (2.3%)			
いちご	37.1	34.9	15,739
ヒューリック	70.2	53.7	61,110
野村不動産ホールディングス	22.2	16.8	42,856
オープンハウス	4.6	4	26,120
東急不動産ホールディングス	80.9	63.9	49,330
飯田グループホールディングス	28.1	21.8	45,213
パーク24	17.1	14.3	41,284
三井不動産	178	129.1	321,329
三菱地所	250	192.8	343,280
平和不動産	9.7	6.2	12,765
東京建物	39.3	28.4	45,298
ダイビル	10.6	9.7	12,280
京阪神ビルディング	27.8	16.7	14,963
住友不動産	81	62	238,700
大京	65	6.1	13,523
テーオーシー	16.9	13.1	10,912
レオパレス21	40.7	31.6	25,848
スターツコーポレーション	6	4.9	13,871
空港施設	23.1	10.3	6,272
住友不動産販売	2.7	—	—
ゴールドクレスト	4.2	4.7	10,457
日本エスリード	11.3	3.8	8,329
サンヨーハウジング名古屋	13	6	7,380
イオンモール	21.1	17.2	38,803
エス・ティ・ティ都市開発	20.4	16.7	21,810
日本空港ビルデング	10.9	7.6	30,172
サービス業 (4.3%)			
日本M&Aセンター	10.4	8.7	61,944

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
パソナグループ	17.6	6.4	14,560
GCA	12.4	11.1	10,134
エス・エム・エス	4.1	5	21,275
パーソルホールディングス	27.6	23.1	68,029
クックパッド	8.8	19.3	11,097
学情	5.3	5.4	8,256
スタジオアリス	5.8	4.4	11,092
シミックホールディングス	9.4	6.9	19,782
NJS	5	7.7	11,996
総合警備保障	13.2	10.1	50,399
カカココム	25.1	19.5	35,529
アイロムグループ	3.8	5.1	14,988
ディップ	3.3	4.2	13,062
キャリアデザインセンター	5.6	3.3	6,741
エムスリー	30.7	26.5	120,575
アウトソーシング	—	7.5	13,387
ディー・エヌ・エー	15.8	12.9	25,400
博報堂DYホールディングス	49.3	34.7	51,251
ぐるなび	4.5	9.6	13,881
ファンコミュニケーションズ	20.9	16.7	11,873
WDBホールディングス	6.4	3.3	12,870
EPSホールディングス	13	6.1	13,072
ドリームインキュベータ	5.8	—	—
クイック	5.8	6.5	11,947
ケネディクス	48.2	34.6	23,562
電通	39.7	30.6	141,372
みらかホールディングス	9	7.5	31,050
アルプス技研	0.5	—	—
ダイオーズ	2.3	4.9	6,017
日本空調サービス	26.9	11.9	8,770
オリエンタルランド	38.5	29.6	307,100
ダスキン	9	6.2	16,516
ラウンドワン	—	7	11,865
リゾートトラスト	14.3	11.1	25,652
ビー・エム・エル	5.8	4.6	12,107
りらいあコミュニケーションズ	18	10	12,980
早稲田アカデミー	2	3.3	5,481
ユー・エス・エス	43.2	31	67,208

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サイバーエージェント	18.9	16.7	87,675
楽天	181.7	128.1	116,904
テー・オー・ダブリュー	10.2	6.8	6,045
テクノプロ・ホールディングス	5.8	4.4	29,392
ファーストロジック	1.6	—	—
キャリアリンク	4.7	11.2	6,193
ライドオンエクスプレスホールディングス	5.6	6	6,480
リクルートホールディングス	77.9	193.3	482,573
エラン	0.7	6.4	14,649
日本郵政	93.3	142.2	187,277
リログループ	1.3	13.6	38,896
エイチ・アイ・エス	5.8	4	14,800
共立メンテナンス	2.9	4.5	21,442
建設技術研究所	12	7.6	10,564
燦ホールディングス	1.9	—	—
よみうりランド	11	1.6	7,248
東京都競馬	65	3.7	14,004
カナモト	4.7	4.3	15,587
東京ドーム	15.2	12.4	12,028
トランス・コスモス	2.7	4.6	12,604

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
乃村工藝社	8.2	6.8	15,320	
日本管財	8.4	6.8	14,184	
白洋舎	5.1	1.7	5,134	
セコム	37.1	26.5	203,997	
セントラル警備保障	6.6	6.1	17,098	
メイテック	4.3	3	18,180	
アサツー ディ・ケイ	5.6	—	—	
応用地質	12.2	8.8	13,094	
船井総研ホールディングス	4.9	6.3	13,072	
ベネッセホールディングス	12.1	9.4	35,814	
イオンディライト	2.8	3.4	13,430	
ニチイ学館	19.1	7.7	8,639	
ダイセキ	6.9	4.5	13,405	
ステップ	4.5	5.3	8,893	
合 計	株 数 ・ 金 額	50,627	31,602	64,231,024
	銘柄数<比率>	1,118	1,076	<93.8%>

(注) 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) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	
		百万円	百万円
		4,221	—

○投資信託財産の構成

(2018年3月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	64,231,024	93.0
コール・ローン等、その他	4,833,390	7.0
投資信託財産総額	69,064,414	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年3月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	69,686,289,340
コール・ローン等	4,726,722,035
株式(評価額)	64,231,024,980
未収入金	124,600
未収配当金	100,216,725
差入委託証拠金	628,201,000
(B) 負債	1,174,539,023
未払金	17,613,600
未払解約金	534,788,150
未払利息	12,273
差入委託証拠金代用有価証券	622,125,000
(C) 純資産総額(A-B)	68,511,750,317
元本	50,305,675,669
次期繰越損益金	18,206,074,648
(D) 受益権総口数	50,305,675,669口
1万円当たり基準価額(C/D)	13,619円

(注) 当親ファンドの期首元本額は65,689,541,274円、期中追加設定元本額は72,081,276,952円、期中一部解約元本額は87,465,142,557円です。

(元本の内訳)

東京海上・TOPIXインデックスファンド<適格機関投資家限定>	30,308,956,936円
東京海上セレクション・日本株TOPIX	16,001,528,785円
TMA世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	3,207,399,681円
東京海上日本株TOPIXファンド	319,365,204円
TMA日本株式インデックスVA<適格機関投資家限定>	298,382,979円
LPS4資産分散ファンド(積極型)	52,493,654円
LPS4資産分散ファンド(成長重視型)	38,358,389円
東京海上・世界インデックス・バランス60<適格機関投資家限定>	29,465,020円
LPS4資産分散ファンド(バランス型)	26,275,958円
LPS4資産分散ファンド(安定重視型)	9,158,590円
TMA世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	6,655,821円
LPS4資産分散ファンド(慎重型)	4,092,515円
東京海上・世界インデックス・バランス40<適格機関投資家限定>	3,399,131円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	143,006円

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万円当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

(注) 2018年3月20日現在、先物取引などに係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は以下の通りです。
・株式 869,245,000円

○損益の状況 (2017年3月22日~2018年3月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,334,103,310
受取配当金	1,335,471,238
受取利息	30,612
その他収益金	734,858
支払利息	△ 2,133,398
(B) 有価証券売買損益	2,669,271,265
売買益	7,548,447,942
売買損	△ 4,879,176,677
(C) 先物取引等取引損益	128,787,140
取引益	773,009,900
取引損	△ 644,222,760
(D) 保管費用等	△ 1,120,646
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	4,131,041,069
(F) 前期繰越損益金	14,230,703,511
(G) 追加信託差損益金	24,576,664,697
(H) 解約差損益金	△24,732,334,629
(I) 計(E+F+G+H)	18,206,074,648
次期繰越損益金(I)	18,206,074,648

(注) (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) (G)追加信託差損益金は、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です。

(注) (H)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。

○お知らせ

2017年9月22日付で、ヘッジ目的の場合等を除き、デリバティブ取引による運用を行っていないことを明確にするため、所要の約款変更を行いました。

TMA日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第12期 (決算日 2017年11月10日)

(計算期間 2016年11月11日～2017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

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	純資産額
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
8期(2013年11月11日)	11,754	2.2	351.893	2.3	99.6	215,413
9期(2014年11月10日)	12,015	2.2	359.767	2.2	99.0	198,569
10期(2015年11月10日)	12,233	1.8	366.242	1.8	99.0	113,534
11期(2016年11月10日)	12,834	4.9	384.198	4.9	99.5	71,744
12期(2017年11月10日)	12,715	△0.9	380.302	△1.0	99.2	21,910

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率
	円	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2016年11月10日	12,834	—	384.198	—	99.5
11月末	12,763	△0.6	381.967	△0.6	99.4
12月末	12,693	△1.1	379.825	△1.1	99.2
2017年1月末	12,624	△1.6	377.739	△1.7	98.9
2月末	12,664	△1.3	378.896	△1.4	98.9
3月末	12,648	△1.4	378.492	△1.5	99.4
4月末	12,711	△1.0	380.333	△1.0	99.5
5月末	12,688	△1.1	379.549	△1.2	98.7
6月末	12,652	△1.4	378.570	△1.5	98.6
7月末	12,656	△1.4	378.545	△1.5	98.9
8月末	12,723	△0.9	380.579	△0.9	99.1
9月末	12,679	△1.2	379.266	△1.3	98.9
10月末	12,681	△1.2	379.268	△1.3	99.0
(期末) 2017年11月10日	12,715	△0.9	380.302	△1.0	99.2

(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（総合）とは、野村證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。

○運用経過

(2016年11月11日～2017年11月10日)

■期中の基準価額等の推移

期首：12,834円
 期末：12,715円
 騰落率：△0.9%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

・保有する債券の利息収入

マイナス要因

・米国債利回りの上昇などを背景に国内長期金利（10年国債利回り）が上昇したこと

■投資環境

期初、米大統領選でトランプ候補が勝利すると、大型減税や財政拡大などの政策期待が高まり、市場では円安米ドル高、株高、金利上昇（債券価格は下落）が進行しました。特に財政赤字の拡大懸念を背景とした米国長期金利の大幅な上昇に連動して、国内長期金利（10年国債利回り）は、マイナス圏から脱し一時0.1%まで上昇しました。その後、トランプ米政権の政策実行力に対する懸念やフランス大統領選を巡る欧州の政治情勢の不透明感が高まるなか、10年国債利回りは2017年4月にかけて0%程度まで低下しました。5月のフランス大統領選でEU（欧州連合）推進派のマクロン候補が勝利すると、10年国債利回りは上昇基調となり、さらに、6月下旬以降、世界の主要中央銀行の金融引き締め姿勢などにより、0.1%近くの水準まで上昇しました。しかし、7月上旬の日銀による長期国債買い入れオペレーションの増額をきっかけに10年国債利回りは低下基調に転じ、9月初旬には北朝鮮による地下核実験の実施や米国のハリケーン被害の拡大などを背景にマイナス圏まで低下しました。その後は、北朝鮮情勢の落ち着きやFOMC（米連邦公開市場委員会）で強気の利上げ見通しが維持されたことなどを背景に米国債利回りが一段と上昇するなか、10年国債利回りも上昇に転じて、前期末対比上昇した水準となる0.04%程度で期を終えました。

■ポートフォリオについて

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に、ファンドとベンチマークのリスク特性が近似するよう調整して運用を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は0.9%下落しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、ベンチマークの騰落率△1.0%に対して、基準価額の騰落率は△0.9%となり、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

（主な変動要因）

プラス要因

・特にありません。

マイナス要因

・保有債券の時価評価の違いなどのテクニカル要因

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、10月末現在、推定値で0.025%となっています。

※2017年10月末のポートフォリオのデータを基にベンチマークとの乖離を推計しています。ベンチマークとの連動が高いほどこの値は低くなります。

○今後の運用方針

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(2016年11月10日)の値が基準価額と同じとなるように指数化したものです。

(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI（総合）です。

○1万口当たりの費用明細

(2016年11月11日～2017年11月10日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2016年11月11日～2017年11月10日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	7,516,838	41,904,203
	地方債証券	—	5,524,813
	特殊債券	—	1,172,495
内	社債券(投資法人債券を含む)	—	(25,000)
			6,332,653
			(803,010)

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれていません)

(注) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

(注) 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)は含まれていません。

○利害関係人との取引状況等

(2016年11月11日～2017年11月10日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2017年11月10日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区分	当 期 末			残存期間別組入比率			
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下 組入比率	5年以上	2年以上	2年未満
					%	%	%
国債証券	千円 15,475,000	千円 17,315,382	% 79.0	% —	% 51.6	% 23.2	% 4.3
地方債証券	1,212,000	1,358,536	6.2	—	4.3	0.9	1.0
特殊債券	(1,212,000)	(1,358,536)	(6.2)	(—)	(4.3)	(0.9)	(1.0)
(除く金融債)	804,000	872,127	4.0	—	1.1	1.9	1.0
普通社債券	(804,000)	(872,127)	(4.0)	(—)	(1.1)	(1.9)	(1.0)
(含む投資法人債券)	1,978,092	2,184,780	10.0	—	5.2	2.9	1.9
	(1,978,092)	(2,184,780)	(10.0)	(—)	(5.2)	(2.9)	(1.9)
合 計	19,469,092	21,730,826	99.2	—	62.2	28.9	8.1
	(3,994,092)	(4,415,444)	(20.2)	(—)	(10.6)	(5.7)	(3.8)

(注) ()内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 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) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円		国債証券	%	千円	千円	
第126回利付国債(5年)	0.1	150,000	151,119	2020/12/20	第44回利付国債(30年)	1.7	60,000	73,810	2044/9/20
第132回利付国債(5年)	0.1	200,000	202,034	2022/6/20	第45回利付国債(30年)	1.5	30,000	35,466	2044/12/20
第133回利付国債(5年)	0.1	500,000	505,240	2022/9/20	第46回利付国債(30年)	1.5	50,000	59,112	2045/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	85,000	118,190	2051/3/20	第47回利付国債(30年)	1.6	100,000	120,816	2045/6/20
第5回利付国債(40年)	2.0	90,000	120,231	2052/3/20	第48回利付国債(30年)	1.4	60,000	69,544	2045/9/20
第6回利付国債(40年)	1.9	65,000	85,052	2053/3/20	第49回利付国債(30年)	1.4	140,000	162,247	2045/12/20
第7回利付国債(40年)	1.7	65,000	81,129	2054/3/20	第50回利付国債(30年)	0.8	20,000	20,139	2046/3/20
第8回利付国債(40年)	1.4	80,000	92,080	2055/3/20	第51回利付国債(30年)	0.3	270,000	236,925	2046/6/20
第9回利付国債(40年)	0.4	10,000	8,279	2056/3/20	第41回利付国債(20年)	1.5	190,000	194,330	2019/3/20
第305回利付国債(10年)	1.3	400,000	412,384	2019/12/20	第42回利付国債(20年)	2.6	260,000	269,763	2019/3/20
第307回利付国債(10年)	1.3	300,000	310,347	2020/3/20	第43回利付国債(20年)	2.9	450,000	475,758	2019/9/20
第308回利付国債(10年)	1.3	70,000	72,664	2020/6/20	第44回利付国債(20年)	2.5	350,000	371,913	2020/3/20
第310回利付国債(10年)	1.0	160,000	165,264	2020/9/20	第45回利付国債(20年)	2.4	80,000	84,820	2020/3/20
第311回利付国債(10年)	0.8	200,000	205,436	2020/9/20	第47回利付国債(20年)	2.2	310,000	330,866	2020/9/21
第312回利付国債(10年)	1.2	330,000	343,708	2020/12/20	第49回利付国債(20年)	2.1	30,000	32,245	2021/3/22
第313回利付国債(10年)	1.3	150,000	157,206	2021/3/20	第50回利付国債(20年)	1.9	80,000	85,464	2021/3/22
第316回利付国債(10年)	1.1	100,000	104,426	2021/6/20	第51回利付国債(20年)	2.0	230,000	247,673	2021/6/21
第317回利付国債(10年)	1.1	250,000	261,792	2021/9/20	第52回利付国債(20年)	2.1	140,000	152,027	2021/9/21
第319回利付国債(10年)	1.1	350,000	367,510	2021/12/20	第53回利付国債(20年)	2.1	230,000	250,978	2021/12/20
第320回利付国債(10年)	1.0	50,000	52,295	2021/12/20	第60回利付国債(20年)	1.4	20,000	21,531	2022/12/20
第322回利付国債(10年)	0.9	150,000	156,648	2022/3/20	第62回利付国債(20年)	0.8	130,000	136,507	2023/6/20
第324回利付国債(10年)	0.8	50,000	52,090	2022/6/20	第64回利付国債(20年)	1.9	170,000	189,781	2023/9/20
第327回利付国債(10年)	0.8	400,000	418,340	2022/12/20	第66回利付国債(20年)	1.8	160,000	178,379	2023/12/20
第336回利付国債(10年)	0.5	90,000	93,659	2024/12/20	第67回利付国債(20年)	1.9	150,000	168,886	2024/3/20
第338回利付国債(10年)	0.4	100,000	103,393	2025/3/20	第69回利付国債(20年)	2.1	210,000	239,118	2024/3/20
第340回利付国債(10年)	0.4	150,000	155,196	2025/9/20	第70回利付国債(20年)	2.4	140,000	162,864	2024/6/20
第345回利付国債(10年)	0.1	200,000	201,636	2026/12/20	第71回利付国債(20年)	2.2	160,000	184,011	2024/6/20
第346回利付国債(10年)	0.1	200,000	201,492	2027/3/20	第72回利付国債(20年)	2.1	100,000	114,855	2024/9/20
第347回利付国債(10年)	0.1	250,000	251,672	2027/6/20	第74回利付国債(20年)	2.1	120,000	138,477	2024/12/20
第348回利付国債(10年)	0.1	100,000	100,638	2027/9/20	第75回利付国債(20年)	2.1	230,000	266,356	2025/3/20
第3回利付国債(30年)	2.3	20,000	25,265	2030/5/20	第76回利付国債(20年)	1.9	10,000	11,433	2025/3/20
第5回利付国債(30年)	2.2	10,000	12,639	2031/5/20	第80回利付国債(20年)	2.1	290,000	337,290	2025/6/20
第8回利付国債(30年)	1.8	60,000	73,146	2032/11/22	第82回利付国債(20年)	2.1	150,000	175,206	2025/9/20
第9回利付国債(30年)	1.4	40,000	46,422	2032/12/20	第83回利付国債(20年)	2.1	100,000	117,244	2025/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	100,000	131,898	2034/3/20	第84回利付国債(20年)	2.0	180,000	209,577	2025/12/20
第15回利付国債(30年)	2.5	110,000	147,097	2034/6/20	第90回利付国債(20年)	2.2	250,000	298,670	2026/9/20
第18回利付国債(30年)	2.3	120,000	157,363	2035/3/20	第98回利付国債(20年)	2.1	50,000	60,134	2027/9/20
第19回利付国債(30年)	2.3	60,000	78,741	2035/6/20	第99回利付国債(20年)	2.1	50,000	60,329	2027/12/20
第21回利付国債(30年)	2.3	110,000	144,662	2035/12/20	第100回利付国債(20年)	2.2	110,000	134,270	2028/3/20
第22回利付国債(30年)	2.5	90,000	121,678	2036/3/20	第105回利付国債(20年)	2.1	60,000	73,075	2028/9/20
第23回利付国債(30年)	2.5	80,000	108,236	2036/6/20	第107回利付国債(20年)	2.1	50,000	61,077	2028/12/20
第25回利付国債(30年)	2.3	50,000	65,977	2036/12/20	第110回利付国債(20年)	2.1	100,000	122,504	2029/3/20
第26回利付国債(30年)	2.4	80,000	107,094	2037/3/20	第112回利付国債(20年)	2.1	100,000	122,787	2029/6/20
第27回利付国債(30年)	2.5	70,000	95,279	2037/9/20	第113回利付国債(20年)	2.1	20,000	24,626	2029/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	70,000	95,588	2038/3/20	第115回利付国債(20年)	2.2	60,000	74,793	2029/12/20
第29回利付国債(30年)	2.4	60,000	80,988	2038/9/20	第116回利付国債(20年)	2.2	50,000	62,499	2030/3/20
第30回利付国債(30年)	2.3	110,000	146,771	2039/3/20	第118回利付国債(20年)	2.0	50,000	61,398	2030/6/20
第33回利付国債(30年)	2.0	150,000	192,198	2040/9/20	第120回利付国債(20年)	1.6	50,000	58,890	2030/6/20
第35回利付国債(30年)	2.0	100,000	128,672	2041/9/20	第123回利付国債(20年)	2.1	40,000	49,828	2030/12/20
第36回利付国債(30年)	2.0	140,000	180,483	2042/3/20	第124回利付国債(20年)	2.0	80,000	98,632	2030/12/20
第37回利付国債(30年)	1.9	70,000	88,813	2042/9/20	第127回利付国債(20年)	1.9	70,000	85,523	2031/3/20
第38回利付国債(30年)	1.8	70,000	87,421	2043/3/20	第128回利付国債(20年)	1.9	140,000	171,390	2031/6/20
第39回利付国債(30年)	1.9	20,000	25,486	2043/6/20	第131回利付国債(20年)	1.7	100,000	119,890	2031/9/20
第42回利付国債(30年)	1.7	70,000	86,048	2044/3/20	第133回利付国債(20年)	1.8	50,000	60,678	2031/12/20
第43回利付国債(30年)	1.7	50,000	61,487	2044/6/20	第135回利付国債(20年)	1.7	90,000	108,146	2032/3/20

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日		利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円		特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第136回利付国債(20年)	1.6	130,000	154,410	2032/3/20	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	106,480	2021/3/26
第141回利付国債(20年)	1.7	100,000	120,483	2032/12/20	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	4,000	4,068	2018/11/28
第143回利付国債(20年)	1.6	30,000	35,721	2033/3/20	第49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	241,998	2027/10/29
第145回利付国債(20年)	1.7	50,000	60,340	2033/6/20	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	102,077	2019/4/30
第146回利付国債(20年)	1.7	50,000	60,362	2033/9/20	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	102,732	2019/8/30
第148回利付国債(20年)	1.5	20,000	23,537	2034/3/20	第173回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.819	100,000	104,101	2022/9/30
第149回利付国債(20年)	1.5	90,000	105,984	2034/6/20	小 計		804,000	872,127	
第150回利付国債(20年)	1.4	70,000	81,306	2034/9/20	普通社債券(含む投資法人債券)				
第151回利付国債(20年)	1.2	90,000	101,522	2034/12/20	第322回中国電力株式会社社債	2.95	100,000	128,759	2029/11/22
第152回利付国債(20年)	1.2	90,000	101,512	2035/3/20	第333回道路債券	2.91	100,000	136,957	2034/6/20
第153回利付国債(20年)	1.3	90,000	102,977	2035/6/20	第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	53,271	56,304	2046/11/10
第154回利付国債(20年)	1.2	50,000	56,288	2035/9/20	第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	57,240	60,381	2046/12/10
第156回利付国債(20年)	0.4	30,000	29,520	2036/3/20	第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	54,973	57,994	2047/1/10
第157回利付国債(20年)	0.2	100,000	94,573	2036/6/20	第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	56,076	59,224	2047/4/10
第158回利付国債(20年)	0.5	70,000	69,759	2036/9/20	第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	10,986	11,129	2036/12/10
第159回利付国債(20年)	0.6	70,000	70,849	2036/12/20	第15回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	45,546	47,235	2039/2/10
第161回利付国債(20年)	0.6	80,000	80,564	2037/6/20	第3回ヒューリック株式会社無担保社債	0.8	100,000	101,529	2020/4/24
第162回利付国債(20年)	0.6	90,000	90,480	2037/9/20	第3回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	0.87	100,000	100,530	2018/8/3
小 計		15,475,000	17,315,382		第5回住友生命基金流動化特定目的会社第1回特定社債	1.12	100,000	100,680	2018/8/8
地方債証券					第36回住友商事株式会社無担保社債	2.21	200,000	207,922	2019/7/25
第2回東京都公募公債(20年)	1.97	100,000	111,349	2023/9/20	第127回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	1.275	100,000	104,321	2021/7/14
第10回東京都公募公債(20年)	2.33	100,000	119,327	2026/9/18	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	103,990	2019/12/20
第11回東京都公募公債(20年)	2.22	100,000	118,772	2027/3/19	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	237,502	2026/4/27
平成24年度第12回愛知県公募公債(30年)	2.12	100,000	126,971	2042/9/19	第15回住友信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	1.62	100,000	105,615	2022/3/22
平成25年度第4回愛知県公募公債(10年)	0.856	100,000	104,516	2023/5/30	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	120,599	2026/11/6
平成21年度第1回千葉県公募公債	1.53	12,000	12,259	2019/4/25	第44回三井不動産株式会社無担保社債	1.173	100,000	103,790	2021/9/6
平成75回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	102,593	2019/6/25	第6回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.39	100,000	109,846	2022/2/15
平成22年度第4回神戸市公募公債(20年)	1.895	100,000	119,057	2030/9/13	第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.166	100,000	120,441	2029/1/29
平成22年度第3回横浜市公募公債	1.168	100,000	103,230	2020/9/18	第3回電源開発株式会社無担保社債	2.01	100,000	110,659	2023/12/20
平成24年度第1回札幌市公募公債	1.79	100,000	118,621	2032/4/23	小 計		1,978,092	2,184,780	
第1回川崎市15年公募公債	1.78	100,000	103,234	2019/9/20	合 計		19,469,092	21,730,826	
第2回川崎市15年公募公債	1.63	100,000	104,165	2020/6/22					
第10回公営企業債券(20年)	2.21	100,000	114,442	2024/9/24					
小 計		1,212,000	1,358,536						
特殊債券(除く金融債)									
第344回政府保証道路債券	1.6	100,000	104,338	2020/7/15					
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	106,333	2021/2/26					

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

(注) 永久債は、実質的な償還日を記載しています。

○投資信託財産の構成

(2017年11月10日現在)

項目	当 期 末	
	評価額	比率
公社債	千円	%
コール・ローン等、その他	21,730,826	98.3
投資信託財産総額	368,452	1.7
	22,099,278	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年11月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	22,099,278,066
コール・ローン等	178,676,567
公社債(評価額)	21,730,826,334
未収入金	116,312,500
未収利息	71,542,947
前払費用	1,919,718
(B) 負債	188,947,550
未払解約金	188,947,230
未払利息	320
(C) 純資産総額(A-B)	21,910,330,516
元本	17,231,428,891
次期繰越損益金	4,678,901,625
(D) 受益権総口数	17,231,428,891口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,715円

(注) 当親ファンドの期首元本額は55,902,471,242円、期中追加設定元本額は6,507,253,355円、期中一部解約元本額は45,178,295,706円です。

<元本の内訳>

TMA世界バランスファンド35VA<適格機関投資家限定>	14,782,592,930円
TMA日本債券インデックスVA<適格機関投資家限定>	1,025,371,874円
東京海上セレクトション・日本債券インデックス	864,226,442円
TMA世界バランスファンド55VA<適格機関投資家限定>	318,880,243円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	75,878,424円
LPS4資産分散ファンド(バランス型)	39,268,020円
LPS4資産分散ファンド(慎重型)	33,907,686円
LPS4資産分散ファンド(成長重視型)	29,776,990円
LPS4資産分散ファンド(安定重視型)	24,250,299円
LPS4資産分散ファンド(積極型)	22,483,555円
東京海上・世界インデックス・バランス60<適格機関投資家限定>	11,890,289円
東京海上・世界インデックス・バランス40<適格機関投資家限定>	2,346,863円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	555,276円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.2715円です。

○損益の状況 (2016年11月11日～2017年11月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	589,903,974
受取利息	590,007,590
支払利息	△ 103,616
(B) 有価証券売買損益	△ 1,435,196,430
売買益	12,328,500
売買損	△ 1,447,524,930
(C) 当期損益金(A+B)	△ 845,292,456
(D) 前期繰越損益金	15,841,572,505
(E) 追加信託差損益金	1,751,458,592
(F) 解約差損益金	△ 12,068,837,016
(G) 計(C+D+E+F)	4,678,901,625
次期繰越損益金(G)	4,678,901,625

(注) (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) (E)追加信託差損益金は、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です。

(注) (F)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。

○お知らせ

2017年9月22日付で、ヘッジ目的の場合等を除き、デリバティブ取引による運用を行っていないことを明確にするため、所要の約款変更を行いました。

TMA外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第12期（決算日 2017年11月10日）

（計算期間 2016年11月11日～2017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

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチ マ ー ク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
8期(2013年11月11日)	14,558	59.1	674,723	59.5	96.7	1.3	2.0	208,732
9期(2014年11月10日)	18,533	27.3	860,159	27.5	95.6	1.7	2.3	197,889
10期(2015年11月10日)	20,086	8.4	934,426	8.6	95.2	2.4	2.4	114,601
11期(2016年11月10日)	17,807	△11.3	829,736	△11.2	93.4	3.8	2.5	77,257
12期(2017年11月10日)	23,462	31.8	1,093,435	31.8	89.0	8.2	2.4	29,547

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券が含まれています。

(注) 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買相場の仲値（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（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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチ マ ー ク		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率			
(期 首) 2016年11月10日	17,807	—	829,736	—	93.4	3.8	2.5
11月末	19,137	7.5	891,132	7.4	94.2	3.0	2.5
12月末	20,361	14.3	946,909	14.1	90.5	6.6	2.4
2017年1月末	20,289	13.9	945,066	13.9	93.4	4.1	2.4
2月末	20,677	16.1	965,055	16.3	90.1	7.4	2.4
3月末	20,881	17.3	974,739	17.5	92.3	4.9	2.4
4月末	21,028	18.1	980,526	18.2	91.9	5.3	2.4
5月末	21,353	19.9	996,448	20.1	91.2	5.5	2.4
6月末	21,685	21.8	1,011,834	21.9	92.9	4.4	2.5
7月末	21,840	22.6	1,020,074	22.9	89.8	7.6	2.4
8月末	21,756	22.2	1,016,769	22.5	95.5	1.6	2.5
9月末	22,794	28.0	1,063,690	28.2	95.3	1.6	2.5
10月末	23,340	31.1	1,088,211	31.2	95.2	1.7	2.4
(期 末) 2017年11月10日	23,462	31.8	1,093,435	31.8	89.0	8.2	2.4

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

○運用経過

(2016年11月11日～2017年11月10日)

■期中の基準価額等の推移

期首：17,807円

期末：23,462円

騰落率：31.8%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・トランプ米政権の経済政策に対する期待が高まったこと
- ・米国の雇用統計などの経済指標が堅調に推移したこと
- ・フランスでEU（欧州連合）離脱派の政権誕生が回避されたこと

マイナス要因

- ・朝鮮半島情勢などの地政学的リスクの高まりを背景に円高が進行したこと

■投資環境

(2016年11月から2017年2月)

米大統領選でトランプ候補が勝利したことで、同氏の景気を刺激する経済政策への期待が広がり、外国株式市場は上昇しました。同時にこれらの政策実現のためには大規模な財政出動が必要との思惑から米国金利が上昇して日米金利差が拡大したことにより、為替市場では円安米ドル高が進行しました。

(2017年3月から2017年4月)

オバマケア（米国医療保険制度改革法）代替法案の採決が見送られるなど、トランプ米政権の政策実現性に対する懸念が広がり、外国株式市場は弱含みの展開となりました。その後、米国のシリア攻撃や北朝鮮の核開発問題など地政学的リスクが高まったことから、外国株式市場は上値が重くなり、為替市場では円高が進行しました。

(2017年5月から2017年11月)

フランス大統領選でEU推進派のマクロン候補が勝利したことで、外国株式市場には安堵感が広がり上昇基調となりました。その後も米国の税制改革への期待感が外国株式市場を下支える動きとなり、株価変動性の低下を伴いながら堅調に推移しました。

基準価額とベンチマークの推移



(注) ベンチマークは、期首(2016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。

(注) 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。

■ポートフォリオについて

当ファンドは、ベンチマークに連動する投資成果の達成を目標として運用を行いました。

個別銘柄の選択は、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ました。その結果、保有銘柄数は前期末の1,012銘柄に対して、当期末には912銘柄となりました。また、期中の設定・解約に応じて外国株式指数先物と現物株式の売買を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は31.8%上昇しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、ベンチマークの騰落率+31.8%に対して基準価額の騰落率は+31.8%となり、ベンチマークにほぼ連動しました。

(主な差異要因)

プラス要因

- ・ベンチマークとポートフォリオ構成銘柄との差異

マイナス要因

- ・配当課税の影響

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。

※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。ファンドとベンチマークで外貨建資産を円換算する際の為替レートが異なる点を考慮して、トラッキングエラーを算出しています。

○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ます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年11月11日～2017年11月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 10	% 0.048	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 * 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(8)	(0.036)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(2)	(0.011)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.005	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 * 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(1)	(0.004)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	12	0.058	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 * 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 * その他は、信託事務等に要する諸費用
(保 管 費 用)	(12)	(0.059)	
(そ の 他)	(△ 0)	(△0.001)	
合 計	23	0.111	
期中の平均基準価額は、21,261円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ニュージーランド	百株 —	千ニュージーランドドル —	百株 1,181	千ニュージーランドドル 654
	香港	345 (140)	千香港ドル 798 (—)	15,489	千香港ドル 57,134
	シンガポール	130	千シンガポールドル 92	10,748	千シンガポールドル 3,769
	イスラエル	—	千イスラエルシェケル —	1,141	千イスラエルシェケル 1,719

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ()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いません。

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
	AMERICAN TOWER CORP	—	—	7	909
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.178	29	2	442
	BOSTON PROPERTIES INC	—	—	2	342
	CROWN CASTLE INTL CORP	—	—	5	499
	DIGITAL REALTY TRUST INC	—	—	3	318
	DUKE REALTY CORP	—	—	7	213
	EQUINIX INC	—	—	1	513
	EQUITY RESIDENTIAL	—	—	6	407
	EXTRA SPACE STORAGE INC	—	—	3	229
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	—	—	1	209
	HCP INC	—	—	7	229
	HOST HOTELS & RESORTS INC	—	—	11	219
	IRON MOUNTAIN INC	—	—	5	205
	JBG SMITH PROPERTIES	— (1)	— (37)	1	37
	KIMCO REALTY CORP	—	—	6	154
	LIBERTY PROPERTY TRUST	—	—	3	156
	PROLOGIS INC	—	—	9	530
	PUBLIC STORAGE	—	—	2	558
	REALTY INCOME CORP	—	—	4	285
REGENCY CENTERS CORP	—	—	2	135	
SL GREEN REALTY CORP	—	—	2	222	
SIMON PROPERTY GROUP INC	—	—	5	938	
UDR INC	—	—	5	210	
VENTAS INC	—	—	6	438	

銘	柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
	アメリカ		千口		千米ドル
	VORNADO REALTY TRUST	—	—	2	272
				(—)	(37)
	WELLTOWER INC	—	—	6	462
	WEYERHAEUSER CO	—	—	12	409
	小計	0.178	29	139	9,553
		(1)	(37)	(—)	(37)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	—	8	213
	小計	—	—	8	213
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	KLEPIERRE	0.826	28	3	134
	GECINA SA	—	—	1	130
				(—)	(1)
	FONCIERE DES REGIONS	—	—	1	95
				(—)	(1)
	UNIBAIL-RODAMCO SE	—	—	1	278
	GECINA SA-RTS	—	—	0.621	1
		(0.621)	(1)		
	小計	0.826	28	7	640
		(0.621)	(1)	(—)	(2)
	ユーロ計	0.826	28	7	640
		(0.621)	(1)	(—)	(2)
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	BRITISH LAND CO PLC	3	18	17	110
	HAMMERSON PLC	—	—	12	66
	INTU PROPERTIES PLC	—	—	17	48
	LAND SECURITIES GROUP PLC	—	—	12	126
		(△ 7)	(△74)		
	SEGRO PLC	—	—	16	82
				(—)	(4)
	LAND SECURITIES GROUP PLC	—	—	—	—
		(7)	(74)	(—)	(4)
	小計	3	18	77	435
		(△0.471)	(—)	(—)	(8)
	オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
	MIRVAC GROUP	—	—	106	231
	GPT GROUP	—	—	50	248
	STOCKLAND	—	—	53	248
	GOODMAN GROUP	—	—	42	317
	SCENTRE GROUP	—	—	77	327
	WESTFIELD CORP	—	—	38	334
	VICINITY CENTRES	—	—	126	356
	小計	—	—	495	2,064

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	—	—	41	2,413
	小 計	—	—	41	2,413
国	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	CAPITALAND MALL TRUST	—	—	96	187
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	—	100	247
	小 計	—	—	(—)	(0.25689)
	小 計	—	—	196	434
				(—)	(0.25689)

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ()内は分割・償還による増減分で、上段の数字には含まれていません。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	株式先物取引	百万円 52,594	百万円 53,673	百万円 —	百万円 —

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

○株式売買比率

(2016年11月11日～2017年11月10日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	60,617,518千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	45,582,973千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.32

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2016年11月11日～2017年11月10日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2017年11月10日現在)

外国株式

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価額		業種等	
			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	88	24	203	23,081	保険	
AGCO CORP	32	10	72	8,194	資本財	
AES CORPORATION	238	—	—	—	公益事業	
AT&T INC	1,455	407	1,386	157,205	電気通信サービス	
ABBOTT LABORATORIES	340	120	666	75,531	ヘルスケア機器・サービス	
ABBVIE INC	379	109	1,052	119,341	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACTIVISION BLIZZARD INC	160	54	343	38,944	ソフトウェア・サービス	
ACUITY BRANDS INC	14	5	93	10,636	資本財	
ADOBE SYSTEMS INC	125	35	639	72,527	ソフトウェア・サービス	
ADVANCE AUTO PARTS	21	9	79	9,040	小売	
AETNA INC	83	24	421	47,753	ヘルスケア機器・サービス	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	19	6	119	13,538	各種金融	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	88	26	176	20,021	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	44	14	240	27,288	素材	
AKAMAI TECHNOLOGIES	50	21	116	13,170	ソフトウェア・サービス	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	57	17	202	22,999	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALLEGHANY CORP	5	1	113	12,814	保険	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	18	5	128	14,601	ソフトウェア・サービス	
ALLSTATE CORP	83	28	282	32,021	保険	
ALPHABET INC-CL C	71	21	2,169	246,030	ソフトウェア・サービス	
ALPHABET INC-CL A	70	20	2,111	239,383	ソフトウェア・サービス	
ALTRIA GROUP INC	460	124	804	91,215	食品・飲料・タバコ	
AMAZON.COM INC	95	27	3,068	347,991	小売	
AMEREN CORPORATION	75	22	144	16,347	公益事業	
AMERICAN ELECTRIC POWER	119	27	209	23,762	公益事業	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	197	53	505	57,371	各種金融	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	265	63	392	44,539	保険	
AMERISOURCEBERGEN CORP	47	16	124	14,142	ヘルスケア機器・サービス	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	49	12	203	23,066	各種金融	
AMGEN INC	173	49	855	96,991	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMPHENOL CORP-CL A	86	24	215	24,455	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ANADARKO PETROLEUM CORP	143	43	222	25,242	エネルギー	
ANALOG DEVICES	55	26	234	26,597	半導体・半導体製造装置	
ANSYS INC	31	8	128	14,553	ソフトウェア・サービス	
ANTHEM INC	63	19	414	46,947	ヘルスケア機器・サービス	
APACHE CORP	94	37	169	19,175	エネルギー	
APPLE INC	1,292	348	6,125	694,575	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
APPLIED MATERIALS INC	269	78	437	49,590	半導体・半導体製造装置	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	140	36	144	16,384	食品・飲料・タバコ	
ARCONIC INC	130	—	—	—	資本財	
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	23	—	—	—	素材	
AUTODESK INC	62	16	202	22,997	ソフトウェア・サービス	
AUTOLIV INC	28	9	114	12,942	自動車・自動車部品	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	105	32	360	40,869	ソフトウェア・サービス	
AUTOZONE INC	7	2	155	17,658	小売	
AVERY DENNISON CORP	33	9	103	11,776	素材	

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価額		業種等	
			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		
BB&T CORPORATION	202	62	291	33,099	銀行	
BAKER HUGHES INC	103	—	—	—	エネルギー	
BAKER HUGHES A GE CO	—	40	131	14,938	エネルギー	
BALL CORP	51	35	141	16,029	素材	
BANK OF AMERICA CORP	2,463	675	1,789	202,915	銀行	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	270	69	350	39,766	各種金融	
BARD (C. R.) INC	20	4	154	17,564	ヘルスケア機器・サービス	
BAXTER INTL INC	124	35	232	26,373	ヘルスケア機器・サービス	
BECTON DICKINSON & CO	54	16	361	41,006	ヘルスケア機器・サービス	
BED BATH & BEYOND INC	62	—	—	—	小売	
WR BERKLEY CORP	39	13	94	10,714	保険	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	281	80	1,483	168,212	各種金融	
BEST BUY COMPANY INC	80	—	—	—	小売	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	49	16	137	15,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BIOGEN INC	52	15	477	54,090	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BLACKROCK INC	28	8	376	42,696	各種金融	
H&R BLOCK INC	94	33	84	9,570	消費者サービス	
BOEING CO	141	39	1,042	118,167	資本財	
BORGWARNER INC	77	22	115	13,073	自動車・自動車部品	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	356	100	286	32,521	ヘルスケア機器・サービス	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	—	8	47	5,330	保険	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	397	112	698	79,175	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	63	21	120	13,685	食品・飲料・タバコ	
CBS CORP CL-B	113	32	186	21,166	メディア	
CDK GLOBAL INC	48	15	97	11,003	ソフトウェア・サービス	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	85	—	—	—	素材	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	42	16	129	14,683	運輸	
CIGNA CORP	64	18	370	41,993	ヘルスケア機器・サービス	
CIT GROUP INC	73	—	—	—	銀行	
CME GROUP INC	85	21	298	33,809	各種金融	
CMS ENERGY CORP	88	27	135	15,349	公益事業	
CSX CORP	233	68	341	38,764	運輸	
CVS HEALTH CORPORATION	252	67	469	53,194	食品・生活必需品小売り	
CA INC	97	36	116	13,212	ソフトウェア・サービス	
CABOT OIL & GAS CORP	153	45	129	14,650	エネルギー	
CAMPBELL SOUP CO	64	21	97	11,017	食品・飲料・タバコ	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	128	35	312	35,467	各種金融	
CARDINAL HEALTH INC	72	24	149	16,968	ヘルスケア機器・サービス	
CARMAX INC	65	19	139	15,796	小売	
CARNIVAL CORP	104	29	196	22,227	消費者サービス	
CATERPILLAR INC	142	42	571	64,760	資本財	
CELANESE CORP-SERIES A	43	13	139	15,788	素材	
CELGENE CORP	187	55	565	64,131	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CENTERPOINT ENERGY INC	135	41	123	14,051	公益事業	
CENTURYLINK INC.	138	—	—	—	電気通信サービス	
CERNER CORP	77	26	173	19,668	ヘルスケア機器・サービス	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	53	15	531	60,276	メディア	
CHEVRONTEXACO CORP	444	127	1,491	169,110	エネルギー	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A	9	3	92	10,508	消費者サービス	
CIMAREX ENERGY CO	29	9	123	13,960	エネルギー	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	51	17	125	14,223	保険	

銘柄	株数	期 末			業 種 等
		株数	評 価 額		
			株数	外貨建金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CISCO SYSTEMS INC	1,209	344	1,171	132,846	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	29	8	128	14,527	商業・専門サービス
CITIGROUP INC	707	188	1,364	154,738	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	48	15	126	14,339	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	35	12	162	18,448	家庭用品・パーソナル用品
COACH INC	78	—	—	—	耐久消費財・アパレル
COCA-COLA COMPANY	906	249	1,153	130,751	食品・飲料・タバコ
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	152	44	328	37,216	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	199	55	404	45,841	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP-CL A	577	325	1,191	135,136	メディア
COMERICA INC	60	17	128	14,588	銀行
CONAGRA BRANDS INC	94	40	138	15,710	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	38	10	148	16,884	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	292	78	420	47,684	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	79	15	137	15,565	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	44	12	273	31,016	食品・飲料・タバコ
COOPER COS INC/THE	16	5	125	14,255	ヘルスケア機器・サービス
CORE LABORATORIES N. V.	17	7	74	8,453	エネルギー
CORNING INC	293	74	236	26,861	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTCO WHOLESALE CORP	99	29	502	56,970	食品・生活必需品小売り
COTY INC-CL A	60	60	102	11,582	家庭用品・パーソナル用品
CUMMINS INC	40	12	204	23,139	資本財
DR HORTON INC	111	33	153	17,360	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	48	13	155	17,639	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	—	21	205	23,305	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	142	38	360	40,843	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	43	13	110	12,508	消費者サービス
DAVITA INC	55	18	103	11,741	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	63	20	275	31,245	資本財
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	57	18	154	17,491	ソフトウェア・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	70	21	142	16,198	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	131	43	179	20,356	エネルギー
THE WALT DISNEY CO	362	108	1,110	125,871	メディア
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	109	32	214	24,319	各種金融
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	72	31	54	6,126	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	78	37	60	6,878	メディア
DISH NETWORK CORPORATION	70	—	—	—	メディア
EVEREST RE GROUP LTD	14	4	106	12,037	保険
Dollar General Corp	71	20	165	18,798	小売
DOLLAR TREE INC	61	19	188	21,317	小売
DOMINION ENERGY INC	147	37	301	34,231	公益事業
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	150	—	—	—	半導体・半導体製造装置
DOVER CORP	51	14	138	15,744	資本財
DOW CHEMICAL	257	—	—	—	素材
DOWDUPONT INC	—	160	1,129	128,035	素材
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	41	17	147	16,692	食品・飲料・タバコ
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	205	—	—	—	素材
DUKE ENERGY CORP	163	36	331	37,573	公益事業
DUN & BRADSTREET CORP	16	—	—	—	商業・専門サービス
EOG RESOURCES INC	132	35	366	41,607	エネルギー
EQT CORPORATION	50	—	—	—	エネルギー

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価額		業種等	
			株数	外貨建金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
E*TRADE FINANCIAL CORP	102	30	130	14,781	各種金融	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	41	—	—	—	保険	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	47	15	139	15,834	素材	
EBAY INC	273	79	284	32,209	ソフトウェア・サービス	
ECOLAB INC	56	16	208	23,630	素材	
BUNGE LIMITED	39	16	110	12,501	食品・飲料・タバコ	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	27	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
EDISON INTERNATIONAL	85	18	147	16,670	公益事業	
Edwards Lifesciences Corp	56	16	167	19,045	ヘルスケア機器・サービス	
ELECTRONIC ARTS INC	78	24	272	30,867	ソフトウェア・サービス	
EMERSON ELECTRIC CO	142	45	282	31,997	資本財	
ENTERGY CORP	55	16	145	16,472	公益事業	
EQUIFAX INC	31	12	137	15,578	商業・専門サービス	
EVERSOURCE ENERGY	78	23	149	16,941	公益事業	
EXELON CORP	225	64	263	29,887	公益事業	
EXPEDIA INC	32	11	137	15,644	小売	
EXPEDITORS INTL WASH INC	55	20	122	13,943	運輸	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	153	44	269	30,577	ヘルスケア機器・サービス	
EXXON MOBIL CORPORATION	970	275	2,312	262,256	エネルギー	
FMC TECHNOLOGIES INC	77	—	—	—	エネルギー	
FACEBOOK INC-A	548	159	2,855	323,809	ソフトウェア・サービス	
FASTENAL CO	82	28	133	15,142	資本財	
FEDEX CORP	60	17	388	44,034	運輸	
F5 NETWORKS INC	22	8	101	11,452	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	84	24	226	25,660	ソフトウェア・サービス	
FNF GROUP	84	29	115	13,053	保険	
FIFTH THIRD BANCORP	223	64	180	20,460	銀行	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	46	15	142	16,167	銀行	
FISERV INC	61	17	224	25,500	ソフトウェア・サービス	
FIRSTENERGY CORP	126	42	142	16,176	公益事業	
FLUOR CORP	51	—	—	—	資本財	
FLOWSERVE CORP	52	—	—	—	資本財	
FOOT LOCKER INC	39	—	—	—	小売	
FORD MOTOR CO	844	268	323	36,653	自動車・自動車部品	
FORTIVE CORP	65	24	180	20,473	資本財	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	53	16	107	12,227	資本財	
FRANKLIN RESOURCES INC	118	34	142	16,149	各種金融	
FREEMPORT-MCMORAN INC	354	—	—	—	素材	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	62	20	129	14,665	保険	
GAP INC	76	—	—	—	小売	
GARTNER INC	30	9	112	12,759	ソフトウェア・サービス	
GENERAL DYNAMICS CORP	55	17	344	39,011	資本財	
GENERAL ELECTRIC CO	2,128	584	1,168	132,520	資本財	
GENERAL MILS INC	132	37	193	21,964	食品・飲料・タバコ	
GENERAL MOTORS CO	317	100	421	47,829	自動車・自動車部品	
GENUINE PARTS CO	37	15	131	14,892	小売	
GILEAD SCIENCES INC	308	86	633	71,835	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	92	25	607	68,940	各種金融	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	95	31	92	10,484	自動車・自動車部品	
WR GRACE & CO	31	11	80	9,103	素材	
WW GRAINGER INC	18	5	119	13,575	資本財	

銘柄	株数	当期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			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		
HCA HEALTHCARE INC	83	25	198	22,555	ヘルスケア機器・サービス	
HP INC	469	128	273	31,067	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HALLIBURTON CO	214	56	253	28,733	エネルギー	
HARLEY-DAVIDSON INC	55	22	100	11,437	自動車・自動車部品	
HARMAN INTERNATIONAL	28	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	97	30	169	19,195	保険	
HASBRO INC	31	12	107	12,238	耐久消費財・アパレル	
HELMERICH & PAYNE	35	16	99	11,279	エネルギー	
HERSHEY CO/THE	35	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
HESS CORP	81	30	144	16,421	エネルギー	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	440	124	170	19,331	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HOLLYFRONTIER CORP	75	21	91	10,431	エネルギー	
HOME DEPOT INC	287	79	1,297	147,142	小売	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	163	44	651	73,848	資本財	
HORMEL FOODS CORP	94	34	110	12,480	食品・飲料・タバコ	
HUMANA INC	36	10	252	28,620	ヘルスケア機器・サービス	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	33	10	107	12,167	運輸	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	326	110	146	16,596	銀行	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	79	22	350	39,747	資本財	
ILLUMINA INC	39	10	222	25,217	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INCYTE CORP	47	15	154	17,552	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INTEL CORP	1,085	307	1,424	161,556	半導体・半導体製造装置	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	152	42	284	32,240	各種金融	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	212	59	888	100,772	ソフトウェア・サービス	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	25	8	119	13,494	素材	
INTERNATIONAL PAPER CO	98	32	180	20,479	素材	
INTERPUBLIC GROUP COS INC	135	49	93	10,636	メディア	
INTUIT INC	58	18	275	31,210	ソフトウェア・サービス	
INTUITIVE SURGICAL INC	9	8	329	37,323	ヘルスケア機器・サービス	
JPMORGAN CHASE & CO	858	239	2,342	265,575	銀行	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	47	16	99	11,230	資本財	
JOHNSON & JOHNSON	638	176	2,480	281,253	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JUNIPER NETWORKS INC	117	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KLA-TENCOR CORPORATION	42	14	147	16,731	半導体・半導体製造装置	
KELLOGG CO	61	20	130	14,795	食品・飲料・タバコ	
KEYCORP	314	95	170	19,381	銀行	
KIMBERLY-CLARK CORP	85	22	256	29,031	家庭用品・パーソナル用品	
KINDER MORGAN INC	473	151	270	30,714	エネルギー	
KOHL'S CORP	53	—	—	—	小売	
KRAFT HEINZ CO/THE	148	36	288	32,766	食品・飲料・タバコ	
KROGER CO	233	74	164	18,659	食品・生活必需品小売り	
L BRANDS INC	59	—	—	—	小売	
LKQ CORP	103	34	128	14,568	小売	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	24	—	—	—	資本財	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	31	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
LAM RESEARCH CORP	42	12	263	29,847	半導体・半導体製造装置	
LAS VEGAS SANDS CORP	117	29	199	22,613	消費者サービス	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	52	17	214	24,337	家庭用品・パーソナル用品	
LEAR CORP	24	—	—	—	自動車・自動車部品	
LEGGETT & PLATT INC	54	18	84	9,587	耐久消費財・アパレル	
LENNAR CORP-CL A	66	23	137	15,549	耐久消費財・アパレル	

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		
LENNAR CORP-B SHS	—	0.46	2	260	耐久消費財・アパレル	
LEUCADIA NATIONAL CORP	130	41	107	12,192	各種金融	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A	147	49	114	13,031	小売	
ELI LILLY & CO	232	66	554	62,884	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LINCOLN NATIONAL CORP	74	20	152	17,294	保険	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	58	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
LinkedIn Corp	29	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
LOCKHEED MARTIN CORP	63	17	539	61,128	資本財	
LOEWS CORP	91	27	136	15,430	保険	
LOWE'S COMPANIES	206	58	457	51,872	小売	
LULULEMON ATHLETICA INC	41	14	92	10,524	耐久消費財・アパレル	
M & T BANK CORP	35	11	185	21,060	銀行	
MACY'S INC	81	—	—	—	小売	
MANPOWERGROUP	26	7	96	10,976	商業・専門サービス	
MARATHON OIL CORP	247	83	132	14,987	エネルギー	
MARATHON PETROLEUM CORP	133	41	254	28,854	エネルギー	
MARSH & MCLENNAN COS	131	36	306	34,764	保険	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	90	24	295	33,504	消費者サービス	
MASCO CORP	107	32	124	14,083	資本財	
MASTERCARD INC-CLASS A	235	65	982	111,352	ソフトウェア・サービス	
MATTEL INC	90	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	72	26	143	16,303	半導体・半導体製造装置	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	37	12	121	13,786	食品・飲料・タバコ	
MCDONALD'S CORP	214	56	945	107,178	消費者サービス	
MCKESSON CORP	54	15	215	24,450	ヘルスケア機器・サービス	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	46	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
MERCK & CO. INC.	648	178	1,001	113,559	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
METLIFE INC	228	66	353	40,108	保険	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	8	2	148	16,844	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MICROSOFT CORP	1,750	490	4,120	467,260	ソフトウェア・サービス	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	65	19	179	20,357	半導体・半導体製造装置	
MICRON TECHNOLOGY INC	274	79	345	39,203	半導体・半導体製造装置	
MOHAWK INDUSTRIES INC	19	5	154	17,552	耐久消費財・アパレル	
MOLSON COORS BREWING CO -B	46	17	143	16,326	食品・飲料・タバコ	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	367	101	421	47,758	食品・飲料・タバコ	
MONSANTO CO	103	25	299	33,928	素材	
MONSTER BEVERAGE CORP	34	27	160	18,171	食品・飲料・タバコ	
MOODY'S CORP	50	13	198	22,471	各種金融	
MORGAN STANLEY	368	100	490	55,666	各種金融	
MOSAIC CO/THE	103	41	92	10,506	素材	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	48	15	140	15,965	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MURPHY OIL CORP	72	28	86	9,782	エネルギー	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	104	40	139	15,780	エネルギー	
NETAPP INC	98	29	138	15,686	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NETFLIX INC	104	30	586	66,530	小売	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	186	66	79	9,024	銀行	
NEWELL BRANDS INC	111	32	96	10,996	耐久消費財・アパレル	
NEWMONT MINING CORP	125	31	111	12,677	素材	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	162	56	80	9,134	メディア	
NEXTERA ENERGY INC	115	31	486	55,135	公益事業	
NIKE INC -CL B	312	84	472	53,596	耐久消費財・アパレル	

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	期末		額	
			株数	評価		
			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		
NOBLE ENERGY INC	110	49	141	16,055	エネルギー	
NORDSTROM INC	44	—	—	—	小売	
NORFOLK SOUTHERN CORP	70	21	279	31,710	運輸	
NORTHERN TRUST CORP	55	17	158	18,015	各種金融	
NORTHROP GRUMMAN CORP	42	11	338	38,430	資本財	
NUCOR CORP	92	28	161	18,277	素材	
NVIDIA CORP	137	41	848	96,267	半導体・半導体製造装置	
OGE ENERGY CORP	79	25	89	10,160	公益事業	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	24	8	169	19,196	小売	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	175	52	359	40,772	エネルギー	
OMNICOM GROUP	58	—	—	—	メディア	
ORACLE CORPORATION	718	209	1,030	116,808	ソフトウェア・サービス	
P G & E CORP	122	31	178	20,218	公益事業	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	120	35	466	52,874	銀行	
PPG INDUSTRIES INC	59	18	217	24,660	素材	
PPL CORPORATION	149	38	141	16,030	公益事業	
PVH CORP	26	9	115	13,040	耐久消費財・アパレル	
PACCAR INC	86	30	208	23,630	資本財	
PACKAGING CORP OF AMERICA	35	9	108	12,298	素材	
PARKER HANNIFIN CORP	33	11	203	23,032	資本財	
PATTERSON COS INC	41	18	63	7,246	ヘルスケア機器・サービス	
PAYCHEX INC	71	24	156	17,763	ソフトウェア・サービス	
PAYPAL HOLDINGS INC	267	81	604	68,494	ソフトウェア・サービス	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	129	49	88	10,028	銀行	
PEPSICO INC	319	86	964	109,329	食品・飲料・タバコ	
PFIZER INC	1,400	380	1,337	151,714	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	358	102	1,049	119,049	食品・飲料・タバコ	
PHILLIPS 66	105	30	291	33,007	エネルギー	
PINNACLE WEST CAPITAL	39	12	108	12,355	公益事業	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	40	12	204	23,168	エネルギー	
POLARIS INDUSTRIES INC	21	7	86	9,849	耐久消費財・アパレル	
PRAXAIR INC	61	21	323	36,630	素材	
T ROWE PRICE GROUP INC	35	19	177	20,164	各種金融	
PRICELINE GROUP INC	11	3	572	64,887	小売	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	82	25	173	19,674	保険	
PROCTER & GAMBLE CO	596	161	1,415	160,488	家庭用品・パーソナル用品	
PROGRESSIVE CORP	135	47	238	27,010	保険	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	113	32	361	40,963	保険	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	114	31	158	17,966	公益事業	
PULTE HOMES INC	121	32	102	11,594	耐久消費財・アパレル	
QUALCOMM INC	347	97	628	71,250	半導体・半導体製造装置	
QUEST DIAGNOSTICS	44	13	126	14,355	ヘルスケア機器・サービス	
RALPH LAUREN CORP	19	7	66	7,515	耐久消費財・アパレル	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	46	14	123	13,964	各種金融	
RAYTHEON COMPANY	69	19	367	41,647	資本財	
RED HAT INC	55	15	188	21,425	ソフトウェア・サービス	
Regeneron Pharmaceuticals Inc	20	5	234	26,622	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REGIONS FINANCIAL CORP	384	106	163	18,490	銀行	
REPUBLIC SERVICES INC	74	23	152	17,281	商業・専門サービス	
RESMED INC	49	14	120	13,637	ヘルスケア機器・サービス	
REYNOLDS AMERICAN INC	200	—	—	—	食品・飲料・タバコ	

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		
RITE AID CORP	377	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
ROBERT HALF INTL INC	56	16	87	9,885	商業・専門サービス	
ROCKWELL AUTOMATION INC	31	10	203	23,029	資本財	
ROCKWELL COLLINS INC.	32	13	179	20,343	資本財	
ROPER TECHNOLOGIES INC	24	8	212	24,148	資本財	
ROSS STORES INC	97	28	183	20,815	小売	
S&P GLOBAL INC	69	19	312	35,434	各種金融	
SEI INVESTMENTS COMPANY	54	17	110	12,580	各種金融	
ST JUDE MEDICAL INC	65	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
SALESFORCE.COM INC	163	49	508	57,608	ソフトウェア・サービス	
SCANA CORP	44	20	91	10,362	公益事業	
SCHLUMBERGER LTD	312	83	558	63,301	エネルギー	
SCHWAB (CHARLES) CORP	308	89	393	44,578	各種金融	
SEALED AIR CORP	66	24	110	12,543	素材	
SEMPRA ENERGY	57	15	186	21,154	公益事業	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	20	6	256	29,095	素材	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	56	14	159	18,068	半導体・半導体製造装置	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	28	12	127	14,449	食品・飲料・タバコ	
SOUTHERN CO	217	62	323	36,681	公益事業	
SOUTHWEST AIRLINES CO	60	19	101	11,535	運輸	
SPECTRA ENERGY CORP	179	—	—	—	エネルギー	
SPLUNK INC	46	15	109	12,423	ソフトウェア・サービス	
STANLEY BLACK & DECKER INC	37	12	207	23,580	資本財	
STAPLES INC	184	—	—	—	小売	
STARBUCKS CORP	360	102	589	66,874	消費者サービス	
STATE STREET CORP	99	27	250	28,448	各種金融	
STERICYCLE INC	33	12	79	9,021	商業・専門サービス	
STRYKER CORP	83	23	364	41,325	ヘルスケア機器・サービス	
SUNTRUST BANKS INC	133	39	222	25,201	銀行	
SYMANTEC CORP	185	54	156	17,710	ソフトウェア・サービス	
SYNOPSIS INC	52	14	129	14,662	ソフトウェア・サービス	
SYNCHRONY FINANCIAL	211	63	202	23,007	各種金融	
SYSCO CORP	121	29	161	18,339	食品・生活必需品小売り	
TJX COMPANIES INC	143	37	260	29,540	小売	
TAPESTRY INC	—	31	126	14,330	耐久消費財・アパレル	
TARGET CORP	121	35	214	24,295	小売	
TESLA INC	30	10	306	34,733	自動車・自動車部品	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	236	77	91	10,359	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TEXAS INSTRUMENTS	226	63	618	70,109	半導体・半導体製造装置	
TEXTRON INC	86	27	150	17,049	資本財	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	95	26	516	58,595	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
3M CO	138	40	916	103,873	資本財	
TIFFANY & CO	36	12	117	13,290	小売	
TIME WARNER INC	192	53	464	52,639	メディア	
TOLL BROTHERS INC	71	19	91	10,365	耐久消費財・アパレル	
TORCHMARK CORP	42	12	104	11,852	保険	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	58	16	121	13,833	ソフトウェア・サービス	
TRAVELERS COS INC/THE	65	19	258	29,303	保険	
TRIPADVISOR INC-W/I	39	17	55	6,344	小売	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX IN	247	86	249	28,276	メディア	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	137	—	—	—	メディア	

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株 数	評 価 額		業 種 等	
			株 数	外貨建金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
TWITTER INC	175	62	124	14,134	ソフトウェア・サービス	
TYSON FOODS INC-CL A	82	21	155	17,636	食品・飲料・タバコ	
US BANCORP	389	116	609	69,102	銀行	
UNION PACIFIC CORP	198	54	643	72,996	運輸	
UNITED PARCEL SERVICE CL B	149	43	487	55,285	運輸	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	180	49	588	66,720	資本財	
UNITED THERAPEUTICS CORP	18	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UNITEDHEALTH GROUP INC	224	64	1,369	155,327	ヘルスケア機器・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	29	10	104	11,880	ヘルスケア機器・サービス	
UNUM GROUP	82	25	132	15,057	保険	
VF CORP	70	20	141	16,067	耐久消費財・アパレル	
VALERO ENERGY CORP	112	34	283	32,201	エネルギー	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	32	10	108	12,357	ヘルスケア機器・サービス	
VERISIGN INC	34	10	118	13,474	ソフトウェア・サービス	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	971	272	1,228	139,306	電気通信サービス	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	67	18	271	30,729	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VIACOM INC CL B	100	44	110	12,523	メディア	
VISA INC-CLASS A SHARES	450	126	1,416	160,610	ソフトウェア・サービス	
VMWARE INC-CLASS A	28	9	111	12,646	ソフトウェア・サービス	
VOYA FINANCIAL INC	79	24	102	11,622	各種金融	
VULCAN MATERIALS CO	39	12	151	17,162	素材	
WABCO HOLDINGS INC	22	6	98	11,189	資本財	
WEC ENERGY GROUP INC	89	17	122	13,863	公益事業	
WABTEC CORP/DE	33	11	84	9,632	資本財	
WAL-MART STORES INC	359	99	898	101,858	食品・生活必需品小売り	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	213	63	443	50,252	食品・生活必需品小売り	
WASTE MANAGEMENT INC	103	26	217	24,616	商業・専門サービス	
WATERS CORP	25	7	145	16,492	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WELLS FARGO & COMPANY	1,128	322	1,741	197,480	銀行	
WESTERN DIGITAL CORP	75	24	212	24,065	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WESTERN UNION CO	154	53	106	12,097	ソフトウェア・サービス	
WESTROCK CO	80	23	140	15,910	素材	
WHIRLPOOL CORP	21	7	127	14,411	耐久消費財・アパレル	
WHITEWAVE FOODS CO	57	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
WHOLE FOODS MARKET INC	86	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	41	11	126	14,332	消費者サービス	
XCEL ENERGY INC	140	31	161	18,258	公益事業	
XLINX INC	76	18	131	14,931	半導体・半導体製造装置	
XEROX CORP	296	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
XEROX CORP	—	29	85	9,687	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
XYLEM INC	61	18	121	13,775	資本財	
YAHOO! INC	229	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
YUM! BRANDS INC	109	27	217	24,663	消費者サービス	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	53	17	190	21,647	ヘルスケア機器・サービス	
ZOETIS INC	128	37	262	29,718	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INVESCO LTD	132	38	137	15,626	各種金融	
CHUBB LTD	107	30	462	52,460	保険	
SIGNET JEWELERS LTD	24	10	77	8,820	小売	
LyondellBasell Industries NV	81	26	278	31,602	素材	
GARMIN LTD	37	12	73	8,376	耐久消費財・アパレル	
ACCENTURE PLC-CL A	150	41	590	66,964	ソフトウェア・サービス	

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価額		業種等	
			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		
NXP SEMICONDUCTORS NV	73	19	222	25,247	半導体・半導体製造装置	
SEAGATE TECHNOLOGY	89	31	117	13,336	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AON PLC	68	19	275	31,265	保険	
TE CONNECTIVITY LTD	98	28	261	29,659	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	66	21	104	11,821	資本財	
INGERSOLL-RAND PLC	68	20	176	19,965	資本財	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	48	20	113	12,854	耐久消費財・アパレル	
Delphi Automotive PLC	74	20	199	22,596	自動車・自動車部品	
EATON CORP PLC	110	33	257	29,240	資本財	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	175	—	—	—	メディア	
IHS MARKIT LTD	111	36	158	18,026	商業・専門サービス	
BROADCOM LTD	93	27	742	84,157	半導体・半導体製造装置	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	39	9	154	17,561	保険	
TECHNIPFMC PLC	—	44	130	14,758	エネルギー	
PERRIGO CO PLC	45	14	128	14,556	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PENTAIR PLC	57	17	120	13,627	資本財	
MEDTRONIC PLC	319	89	723	81,990	ヘルスケア機器・サービス	
MYLAN NV	120	42	160	18,204	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NIELSEN HOLDINGS PLC	81	35	130	14,841	商業・専門サービス	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	226	64	248	28,208	資本財	
ALLERGAN PLC	96	24	417	47,354	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>	71,978 467	20,105 424	150,584 —	17,074,752 <57.8%>	
(カナダ)			千カナダドル			
ARC RESOURCES LTD	126	58	104	9,316	エネルギー	
AGNICO EAGLE MINES LTD	55	—	—	—	素材	
AGRIUM INC	35	13	178	15,953	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	99	27	175	15,717	食品・生活必需品小売り	
BCE INC	55	15	95	8,513	電気通信サービス	
BANK OF MONTREAL	115	31	310	27,817	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	261	65	550	49,225	銀行	
BARRICK GOLD CORP	284	57	102	9,161	素材	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	228	49	262	23,510	各種金融	
CAE INC	134	41	94	8,470	資本財	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	11	19	110	9,856	素材	
CAMECO CORP	145	79	94	8,442	エネルギー	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	68	18	209	18,725	銀行	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	176	40	412	36,904	運輸	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	272	62	289	25,903	エネルギー	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	35	8	182	16,313	運輸	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	23	7	129	11,610	小売	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	64	23	92	8,274	公益事業	
CENOVUS ENERGY INC	261	109	158	14,137	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	6	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
DOLLARAMA INC	37	10	158	14,177	小売	
ENCANA CORP	314	99	159	14,280	エネルギー	
ENBRIDGE INC	231	108	505	45,203	エネルギー	
FINNING INTERNATIONAL INC	93	31	99	8,882	資本財	
FIRST CAPITAL REALTY INC	86	39	82	7,377	不動産	
FORTIS INC	103	39	187	16,819	公益事業	
FRANCO-NEVADA CORP	36	15	170	15,269	素材	

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
GILDAN ACTIVEWEAR INC	76	30	116	10,435	耐久消費財・アパレル	
GOLDCORP INC	188	85	144	12,969	素材	
GREAT-WEST LIFE CO INC	99	26	93	8,333	保険	
CGI GROUP INC	69	24	160	14,389	ソフトウェア・サービス	
HUSKY ENERGY INC	164	61	104	9,379	エネルギー	
IGM FINANCIAL INC	57	17	79	7,130	各種金融	
IMPERIAL OIL LTD	99	33	135	12,111	エネルギー	
INTACT FINANCIAL CORP	41	15	155	13,908	保険	
INTER PIPELINE LTD	128	48	132	11,849	エネルギー	
JEAN COUTU GROUP INC A	60	24	60	5,418	食品・生活必需品小売り	
KEYERA CORP	70	28	107	9,651	エネルギー	
KINROSS GOLD CORP	376	—	—	—	素材	
LOBLAW COMPANIES LTD	50	22	153	13,735	食品・生活必需品小売り	
MAGNA INTERNATIONAL INC	100	28	190	17,037	自動車・自動車部品	
MANULIFE FINANCIAL CORP	454	128	352	31,567	保険	
METRO INC	86	28	120	10,770	食品・生活必需品小売り	
NATIONAL BANK OF CANADA	85	31	195	17,519	銀行	
ONEX CORPORATION	33	11	110	9,928	各種金融	
OPEN TEXT CORP	44	29	124	11,124	ソフトウェア・サービス	
PEMBINA PIPELINE CORP	120	41	191	17,167	エネルギー	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	223	77	188	16,907	素材	
POWER CORP OF CANADA	124	43	142	12,789	保険	
POWER FINANCIAL CORP	76	32	118	10,564	保険	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	76	26	91	8,211	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	109	24	164	14,736	電気通信サービス	
ROYAL BANK OF CANADA	315	85	857	76,727	銀行	
SNC-LAVALIN GROUP INC	58	20	119	10,648	資本財	
SAPUTO INC	87	28	124	11,134	食品・飲料・タバコ	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	138	46	134	12,032	メディア	
SILVER WHEATON CORP	102	—	—	—	素材	
SUN LIFE FINANCIAL INC	118	29	144	12,908	保険	
SUNCOR ENERGY INC	406	107	494	44,254	エネルギー	
TELUS CORP	75	3	14	1,275	電気通信サービス	
THOMSON REUTERS CORP	101	30	170	15,214	各種金融	
TORONTO-DOMINION BANK	382	106	776	69,474	銀行	
TRANSCANADA CORP	198	50	310	27,800	エネルギー	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	511	—	—	—	素材	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	33	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VERMILION ENERGY INC	48	19	93	8,397	エネルギー	
WESTON (GEORGE) LTD	24	7	78	6,988	食品・生活必需品小売り	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	—	45	120	10,812	素材	
YAMANA GOLD INC	296	—	—	—	素材	
小計	株数・金額	9,285	2,579	11,793	1,055,174	
	銘柄数<比率>	68	62	—	<3.6%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG	48	12	211	27,982	耐久消費財・アパレル	
Fresenius SE & CO KG	104	28	200	26,426	ヘルスケア機器・サービス	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	54	16	84	11,225	ソフトウェア・サービス	
HANNOVER RUECK SE	23	—	—	—	保険	
GEA GROUP AG	63	20	84	11,154	資本財	
CONTINENTAL AG	24	7	151	20,078	自動車・自動車部品	

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	期末		額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE POST AG	212	62	246	32,621	運輸	
AXEL SPRINGER SE	25	10	63	8,344	メディア	
MERCK KGAA	39	13	122	16,162	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RWE AG	164	50	117	15,489	公益事業	
SAP SE	229	65	637	84,199	ソフトウェア・サービス	
E.ON SE	461	181	188	24,950	公益事業	
HENKEL AG & CO KGAA	33	10	111	14,783	家庭用品・パーソナル用品	
METRO AG	55	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
BAYER AG	191	56	624	82,520	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	36	8	101	13,437	家庭用品・パーソナル用品	
BASF SE	206	60	575	76,061	素材	
BEIERSDORF AG	33	10	102	13,490	家庭用品・パーソナル用品	
HEIDELBERGCEMENT AG	43	—	—	—	素材	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	48	14	119	15,737	ヘルスケア機器・サービス	
ALLIANZ SE	99	30	611	80,728	保険	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	125	28	75	10,018	運輸	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	31	8	168	22,258	保険	
VOLKSWAGEN AG	14	4	70	9,326	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG PFD	40	12	199	26,348	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG	224	62	440	58,157	自動車・自動車部品	
THYSSENKRUPP AG	126	—	—	—	素材	
SIEMENS AG	174	51	606	80,063	資本財	
LINDE AG	44	13	257	34,023	素材	
DEUTSCHE BANK AG -REG	395	158	237	31,318	各種金融	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	87	25	223	29,569	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	749	227	342	45,261	電気通信サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	280	83	194	25,694	半導体・半導体製造装置	
DEUTSCHE BOERSE AG	—	15	142	18,851	各種金融	
LANXESS	36	11	76	10,096	素材	
BRENTAG AG	53	17	90	11,984	資本財	
K+S AG	59	—	—	—	素材	
EVONIK INDUSTRIES AG	51	24	79	10,440	素材	
HUGO BOSS AG -ORD	17	9	61	8,163	耐久消費財・アパレル	
COMMERZBANK AG	400	101	122	16,132	銀行	
VONOVIA SE	125	31	124	16,436	不動産	
PROSIEBENSAT1 MEDIA SE	74	28	72	9,578	メディア	
METRO AG	—	25	42	5,566	食品・生活必需品小売り	
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	44	—	—	—	各種金融	
小計	株数・金額	5,360	1,601	7,983	1,054,685	
	銘柄数<比率>	42	38	—	<3.6%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	332	106	164	21,787	保険	
INTESA SANPAOLO	3,385	1,044	297	39,280	銀行	
MEDIOBANCA SPA	267	83	82	10,938	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	57	20	97	12,857	耐久消費財・アパレル	
ENEL SPA	1,724	607	324	42,839	公益事業	
ENI SPA	573	194	281	37,240	エネルギー	
SNAM SPA	764	—	—	—	エネルギー	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA	598	—	—	—	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	3,247	—	—	—	電気通信サービス	
TELECOM ITALIA-RNC	2,131	1,139	67	8,918	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	
(ユーロ…イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ATLANTIA S. P. A		117	43	119	15,798	運輸
TERNA SPA		550	163	86	11,368	公益事業
UNICREDIT SPA		1,649	—	—	—	銀行
ITALGAS SPA		152	—	—	—	公益事業
UNICREDIT SPA		—	105	174	23,114	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	15,552	3,508	1,696	224,145	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES		59	24	101	13,437	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT		140	54	114	15,074	公益事業
L'OREAL		55	13	258	34,141	家庭用品・パーソナル用品
CHRISTIAN DIOR SE		14	—	—	—	耐久消費財・アパレル
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE		62	17	440	58,232	耐久消費財・アパレル
THALES SA		32	11	104	13,847	資本財
CAPGEMINI		43	14	142	18,823	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON		22	11	54	7,190	食品・生活必需品小売り
PUBLICIS GROUPE		58	—	—	—	メディア
LAGARDERE S. C. A		55	24	68	9,061	メディア
MICHELIN (CGDE)-B		35	11	142	18,781	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD		40	11	144	19,091	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA		45	14	121	16,055	自動車・自動車部品
SCHNEIDER ELECTRIC SE		121	37	267	35,397	資本財
VIVENDI SA		231	85	178	23,576	メディア
TECHNIP S. A.		30	—	—	—	エネルギー
ORANGE		454	134	192	25,430	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL		7	3	139	18,425	耐久消費財・アパレル
BIC		9	—	—	—	商業・専門サービス
DASSAULT SYSTEMES SA		40	12	113	14,933	ソフトウェア・サービス
KERING		18	5	201	26,676	耐久消費財・アパレル
CNP ASSURANCES		93	34	68	9,012	保険
CARREFOUR SA		104	—	—	—	食品・生活必需品小売り
ATOS SE		29	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SANOFI		265	72	563	74,388	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR SA		66	22	93	12,402	消費者サービス
SOCIETE GENERALE-A		193	57	252	33,351	銀行
SODEXO		30	—	—	—	消費者サービス
AXA		445	127	323	42,673	保険
ESSILOR INTERNATIONAL		43	13	144	19,083	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT AGRICOLE SA		330	100	142	18,786	銀行
ZODIAC AEROSPACE		75	26	65	8,656	資本財
BNP PARIBAS		264	79	515	68,102	銀行
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN		87	32	158	20,997	資本財
Wendel		15	4	61	8,093	各種金融
Iliad SA		10	3	79	10,438	電気通信サービス
IMERYS SA		21	7	61	8,076	素材
SAFRAN SA		70	22	197	26,084	資本財
ENGIE		224	123	183	24,271	公益事業
ALSTOM		73	21	75	9,952	資本財
Eutelsat Communications		77	28	60	7,939	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE		107	58	72	9,522	公益事業
Arkema SA		26	—	—	—	素材

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
Legrand SA	50	19	121	16,004	資本財	
TOTAL SA	487	148	721	95,294	エネルギー	
Natixis	408	125	82	10,960	各種金融	
SCOR SE	55	23	83	10,994	保険	
REXEL SA	143	—	—	—	資本財	
VINCI S.A.	103	35	301	39,888	資本財	
DANONE	117	39	271	35,836	食品・飲料・タバコ	
AIR LIQUIDE	74	29	317	41,975	素材	
Bureau Veritas SA	105	36	81	10,806	商業・専門サービス	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	204	71	78	10,389	運輸	
SUEZ	139	51	79	10,562	公益事業	
EDENRED	80	—	—	—	商業・専門サービス	
VALEO SA	73	23	138	18,355	自動車・自動車部品	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	6,281	1,929	8,183	1,081,080	
		56	46	—	<3.7%>	
(ユーロ…オランダ)						
AIRBUS SE	141	42	359	47,476	資本財	
RELX NV	187	61	118	15,672	商業・専門サービス	
RANDSTAD HOLDING NV	42	15	80	10,697	商業・専門サービス	
AKZO NOBEL	49	14	115	15,278	素材	
WOLTERS KLUWER	97	28	121	16,069	商業・専門サービス	
QIAGEN N.V.	88	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Koninklijke Vopak NV	34	14	52	6,947	エネルギー	
AEGON NV	644	206	109	14,494	保険	
KONINKLIJKE KPN NV	1,128	350	103	13,648	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV	236	59	119	15,778	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	219	65	222	29,433	ヘルスケア機器・サービス	
HEINEKEN NV	43	10	88	11,720	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	36	13	106	14,127	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	57	16	127	16,861	素材	
UNILEVER NV-CVA	364	104	513	67,894	家庭用品・パーソナル用品	
Koninklijke Boskalis Westminster NV	42	14	45	6,019	資本財	
ASML HOLDING NV	83	25	388	51,325	半導体・半導体製造装置	
GEMALTO	32	15	51	6,776	ソフトウェア・サービス	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	275	86	148	19,592	食品・生活必需品小売り	
CNH INDUSTRIAL NV	367	—	—	—	資本財	
QIAGEN N V	—	29	80	10,607	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ING GROEP NV-CVA	970	278	434	57,390	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	5,147	1,454	3,389	447,811	
		21	20	—	<1.5%>	
(ユーロ…スペイン)						
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	214	65	121	16,039	運輸	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,675	492	353	46,673	銀行	
GAS NATURAL SDG SA	131	46	83	11,066	公益事業	
REPSOL SA	287	104	166	21,940	エネルギー	
BANCO SANTANDER S.A	3,614	1,135	631	83,400	銀行	
TELEFONICA SA	1,142	342	296	39,183	電気通信サービス	
ENAGAS SA	85	—	—	—	エネルギー	
FERROVIAL SA	166	55	101	13,463	資本財	
MAPPRE S.A.	583	232	63	8,372	保険	
IBERDROLA SA	1,163	434	289	38,213	公益事業	

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株		千ユーロ	千円	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	122	35		212	28,082	ソフトウェア・サービス
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	282	136		56	7,508	食品・生活必需品小売り
RED ELECTRICA CORPORACION SA	148	53		97	12,863	公益事業
INDITEX	256	72		214	28,300	小売
GRIPOLS SA	115	33		86	11,377	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	9,990	3,240	2,774	366,485	
	銘柄数<比率>	15	14	—	<1.2%>	
(ユーロ…ベルギー)						
UMICORE	37	—		—	—	素材
KBC GROEP NV	70	21		153	20,295	銀行
SOLVAY SA	25	—		—	—	素材
UCB SA	41	15		94	12,473	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT SA	16	3		17	2,246	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	23	10		93	12,338	各種金融
PROXIMUS	48	—		—	—	電気通信サービス
AGEAS	67	23		94	12,462	保険
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	183	51		521	68,877	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	515	125	974	128,694	
	銘柄数<比率>	9	6	—	<0.4%>	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG	53	18		97	12,855	エネルギー
VOESTALPINE AG	55	—		—	—	素材
ERSTE GROUP BANK AG	104	30		109	14,483	銀行
小計	株数・金額	212	48	206	27,338	
	銘柄数<比率>	3	2	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
TENARIS SA	160	59		76	10,136	エネルギー
SES SA	103	45		58	7,755	メディア
小計	株数・金額	264	104	135	17,892	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
WARTSILA	43	17		94	12,487	資本財
UPM-KYMMENE OYJ	130	49		126	16,721	素材
STORA ENSO OYJ-R SHS	173	63		84	11,104	素材
SAMPO OYJ-A SHS	66	14		64	8,477	保険
FORTUM OYJ	105	—		—	—	公益事業
ELISA OYJ	61	20		71	9,417	電気通信サービス
METSO OYJ	60	—		—	—	資本財
NOKIA OYJ	1,460	470		200	26,506	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OYJ	48	16		77	10,265	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ	34	19		73	9,731	自動車・自動車部品
KONE OYJ-B	56	18		83	11,020	資本財
ORION OYJ	28	—		—	—	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	2,270	689	876	115,732	
	銘柄数<比率>	12	9	—	<0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)						
CRH PLC(DUBLIN)	217	58		180	23,842	素材
KERRY GROUP PLC-A	49	14		128	16,930	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	266	73	308	40,773	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.1%>	

銘柄	株数	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		
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円			
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	635	303	90	11,964		公益事業	
Galp Energia SGPS SA	168	62	101	13,438		エネルギー	
JERONIMO MARTINS	93	41	66	8,779		食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額	897	407	258	34,182		
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>		
(ユーロ…その他)							
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	74	25	85	11,341		食品・飲料・タバコ	
小計	株数・金額	74	25	85	11,341		
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>		
ユーロ計	株数・金額	46,835	13,208	26,874	3,550,162		
	銘柄数<比率>	180	153	—	<12.0%>		
(イギリス)				千英ポンド			
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	363	—	—	—		各種金融	
Antofagasta PLC	213	—	—	—		素材	
ASHTAD GROUP PLC	183	49	95	14,245		資本財	
BHP BILLITON PLC	539	162	232	34,720		素材	
SKY PLC	288	95	87	13,048		メディア	
AVIVA PLC	831	171	84	12,637		保険	
DIAGEO PLC	568	154	396	59,032		食品・飲料・タバコ	
SCHRODERS PLC	59	19	65	9,787		各種金融	
BAE SYSTEMS PLC	641	183	103	15,443		資本財	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	439	149	738	110,097		食品・飲料・タバコ	
STANDARD CHARTERED PLC	824	248	182	27,173		銀行	
IMPERIAL BRANDS PLC	214	57	181	26,994		食品・飲料・タバコ	
HSBC HOLDINGS PLC	4,608	1,308	971	144,782		銀行	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,245	227	60	9,023		保険	
MEGGITT PLC	253	121	60	8,976		資本財	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	713	305	66	9,884		食品・生活必需品小売り	
Associated British Foods PLC	93	33	104	15,504		食品・飲料・タバコ	
PEARSON PLC	239	—	—	—		メディア	
PERSIMMON PLC	94	—	—	—		耐久消費財・アパレル	
PRUDENTIAL PLC	598	173	319	47,592		保険	
RIO TINTO PLC	301	90	333	49,677		素材	
TRAVIS PERKINS PLC	80	35	54	8,083		資本財	
SSE PLC	139	42	59	8,820		公益事業	
BP PLC	4,380	1,276	656	97,896		エネルギー	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	15,389	4,850	323	48,201		銀行	
TATE & LYLE PLC	195	70	49	7,411		食品・飲料・タバコ	
TESCO PLC	2,071	630	111	16,620		食品・生活必需品小売り	
SMITH & NEPHEW PLC	246	81	110	16,449		ヘルスケア機器・サービス	
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,135	296	399	59,526		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WEIR GROUP PLC/THE	89	33	65	9,775		資本財	
ASTRAZENECA PLC	291	82	411	61,251		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GKN PLC	644	222	71	10,654		自動車・自動車部品	
BT GROUP PLC	1,926	495	123	18,397		電気通信サービス	
CARNIVAL PLC	65	20	102	15,240		消費者サービス	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	448	161	52	7,824		小売	
BARCLAYS PLC	4,201	1,245	223	33,301		銀行	
INTERTEK GROUP PLC	59	16	89	13,378		商業・専門サービス	
WILLIAM HILL PLC	407	—	—	—		消費者サービス	
BURBERRY GROUP PLC	127	40	71	10,729		耐久消費財・アパレル	

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価額		業種等	
			株数	外貨建金額		
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円		
NEXT PLC	39	14	61	9,239	小売	
KINGFISHER PLC	461	227	70	10,518	小売	
ICAP PLC	215	—	—	—	各種金融	
ITV PLC	1,114	431	67	10,064	メディア	
SAINSBURY (J) PLC	172	213	48	7,293	食品・生活必需品小売り	
RANDGOLD RESOURCES LTD	23	10	73	10,927	素材	
G4S PLC	528	216	56	8,399	商業・専門サービス	
ADMIRAL GROUP PLC	74	33	61	9,236	保険	
CENTRICA PLC	1,252	559	93	14,004	公益事業	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	968	275	676	100,817	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	913	261	651	97,105	エネルギー	
BUNZL PLC	99	37	86	12,843	資本財	
COBHAM PLC	544	—	—	—	資本財	
NATIONAL GRID PLC	839	—	—	—	公益事業	
London Stock Exchange Group PLC	95	29	110	16,422	各種金融	
UNILEVER PLC	299	80	344	51,403	家庭用品・パーソナル用品	
EXPERIAN PLC	198	52	84	12,636	商業・専門サービス	
SEVERN TRENT PLC	90	30	67	10,041	公益事業	
Whitbread PLC	65	20	75	11,243	消費者サービス	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	125	42	66	9,927	各種金融	
SMITHS GROUP PLC	151	52	79	11,842	資本財	
3I GROUP PLC	321	—	—	—	各種金融	
CAPITA PLC	188	—	—	—	商業・専門サービス	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	142	39	260	38,808	家庭用品・パーソナル用品	
RELX PLC	239	52	89	13,406	商業・専門サービス	
SHIRE PLC	212	61	217	32,467	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Fresnillo PLC	64	40	54	8,077	素材	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	247	92	77	11,578	公益事業	
GLENCORE PLC	3,039	897	325	48,572	素材	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	447	116	109	16,340	資本財	
OLD MUTUAL PLC	1,249	533	102	15,237	保険	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROU	1,240	353	96	14,419	銀行	
SAGE GROUP PLC/THE	368	114	85	12,808	ソフトウェア・サービス	
WPP PLC	304	86	112	16,751	メディア	
COMPASS GROUP PLC	—	100	164	24,569	消費者サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	—	19	83	12,458	消費者サービス	
NATIONAL GRID PLC	—	156	141	21,121	公益事業	
ROYAL MAIL PLC	174	54	20	3,104	運輸	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-	346	131	49	7,429	消費者サービス	
FERGUSON PLC	71	22	121	18,123	資本財	
IMI PLC	133	43	55	8,215	資本財	
VODAFONE GROUP PLC	6,089	1,537	341	50,822	電気通信サービス	
AGGREKO PLC	89	—	—	—	商業・専門サービス	
RSA INSURANCE GROUP PLC	387	134	82	12,249	保険	
COMPASS GROUP PLC	437	—	—	—	消費者サービス	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	599	271	112	16,719	各種金融	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	278	124	44	6,621	保険	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	68	—	—	—	消費者サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC	39	—	—	—	素材	

銘柄	株数	金額	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	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円			
JOHNSON MATTHEY PLC	64	23	81	12,170	素材		
小計	株数・金額	70,336	20,756	12,670	1,888,229		
	銘柄数<比率>	86	75	—	<6.4%>		
(スイス)			千スイスフラン				
SIKA AG-BR	0.7	0.2	145	16,634	素材		
SGS SA	1	0.54	130	14,940	商業・専門サービス		
SWISSCOM AG-REG	8	2	139	15,917	電気通信サービス		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.04	0.01	66	7,592	食品・飲料・タバコ		
GIVAUDAN-REG	2	0.69	154	17,633	素材		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	34	8	267	30,564	保険		
NOVARTIS AG-REG SHS	511	143	1,174	134,006	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ABB LTD	466	135	347	39,657	資本財		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	159	44	1,019	116,317	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ADECCO GROUP AG(REG)	48	—	—	—	商業・専門サービス		
LAFARGEHOLCIM LTD	123	33	189	21,650	素材		
NESTLE SA-REGISTERED	725	198	1,657	189,137	食品・飲料・タバコ		
SONOVA HOLDING AG	20	6	111	12,754	ヘルスケア機器・サービス		
CREDIT SUISSE GROUP AG	508	174	279	31,841	各種金融		
THE SWATCH GROUP AG-B	10	3	123	14,109	耐久消費財・アパレル		
LONZA GROUP AG-REG	17	6	168	19,250	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
SWISS LIFE HOLDING AG	11	3	125	14,344	保険		
Schindler Holding AG	15	4	101	11,548	資本財		
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	17	6	108	12,359	運輸		
GEBERIT AG-REG	10	3	141	16,167	資本財		
Actelion Ltd	26	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
Aryzta AG	36	—	—	—	食品・飲料・タバコ		
JULIUS BAER GROUP LTD	77	23	139	15,924	各種金融		
SWISS RE AG	65	16	151	17,244	保険		
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	128	32	291	33,299	耐久消費財・アパレル		
UBS GROUP AG	918	258	434	49,627	各種金融		
SYNGENTA AG-2ND LINE	22	—	—	—	素材		
小計	株数・金額	3,969	1,107	7,472	852,524		
	銘柄数<比率>	27	23	—	<2.9%>		
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ				
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	320	80	827	11,215	銀行		
Swedbank AB	220	39	805	10,911	銀行		
SWEDISH MATCH AB	72	23	748	10,142	食品・飲料・タバコ		
NORDEA BANK AB	617	193	1,918	25,991	銀行		
SECURITAS AB-B SHS	118	50	716	9,701	商業・専門サービス		
INVESTOR AB-B SHS	76	13	562	7,623	各種金融		
HENNES & MAURITZ AB-B	194	54	1,111	15,054	小売		
ERICSSON LM-B SHS	698	260	1,319	17,873	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
TELIA COMPANY AB	408	138	524	7,105	電気通信サービス		
SKANSKA AB-B SHS	114	41	761	10,323	資本財		
LUNDIN PETROLEUM AB	93	29	629	8,536	エネルギー		
ALFA LAVAL AB	106	36	741	10,041	資本財		
GETINGE AB-B SHS	90	39	620	8,403	ヘルスケア機器・サービス		
Millicom International Cellular SA	29	11	636	8,631	電気通信サービス		
SKF AB-B SHARES	133	48	885	11,992	資本財		
VOLVO AB-B SHS	353	113	1,848	25,043	資本財		
SANDVIK AB	333	85	1,266	17,165	資本財		

銘柄	株数	当期末			業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円		
Industrivarden AB	96	25	528	7,156	各種金融	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	129	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
Boliden AB	104	30	889	12,047	素材	
TELE2 AB-B SHS	125	57	609	8,258	電気通信サービス	
KINNEVIK AB-B	94	22	616	8,348	各種金融	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	—	51	1,253	16,990	家庭用品・パーソナル用品	
ATLAS COPCO AB-A SHS	136	30	1,125	15,255	資本財	
ATLAS COPCO AB-B SHS	127	36	1,198	16,245	資本財	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	362	77	925	12,539	銀行	
ASSA ABLOY AB-B	226	47	817	11,078	資本財	
小計	株数・金額	5,387	1,637	23,887	323,676	
	銘柄数<比率>	26	26	—	<1.1%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	293	76	1,215	16,963	銀行	
TELENOR ASA	237	69	1,213	16,932	電気通信サービス	
STATOIL ASA	276	79	1,343	18,748	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	44	20	773	10,796	素材	
NORSK HYDRO ASA	381	143	875	12,211	素材	
ORKLA ASA	268	82	662	9,247	食品・飲料・タバコ	
小計	株数・金額	1,501	472	6,085	84,899	
	銘柄数<比率>	6	6	—	<0.3%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
CARLSBERG AS-B	33	10	802	14,236	食品・飲料・タバコ	
A. P. MOLLER MAERSK	1	0.66	739	13,120	運輸	
A P Moller - Maersk A/S	1	0.38	413	7,331	運輸	
DANSKE BANK A/S	185	56	1,373	24,372	銀行	
TDC A/S	358	147	540	9,596	電気通信サービス	
DSV A/S	65	18	893	15,860	運輸	
PANDORA A/S	33	12	728	12,923	耐久消費財・アパレル	
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	39	11	644	11,442	素材	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	69	22	780	13,846	素材	
COLOPLAST-B	40	14	713	12,671	ヘルスケア機器・サービス	
NOVO NORDISK A/S-B	456	122	3,853	68,394	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WILLIAM DEMANT HOLDING	74	25	455	8,083	ヘルスケア機器・サービス	
小計	株数・金額	1,360	441	11,936	211,880	
	銘柄数<比率>	12	12	—	<0.7%>	
(オーストラリア)			千豪ドル			
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	687	195	593	51,710	銀行	
AMCOR LTD	345	120	180	15,719	素材	
WESTPAC BANKING CORPORATION	775	219	729	63,509	銀行	
TELSTRA CORP LTD	847	413	143	12,498	電気通信サービス	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	268	75	61	5,325	食品・飲料・タバコ	
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	67	22	121	10,577	各種金融	
BHP BILLITON LTD	826	233	667	58,145	素材	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	103	28	99	8,674	エネルギー	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	377	—	—	—	小売	
COMPUTERSHARE LIMITED	224	59	93	8,102	ソフトウェア・サービス	
CSL LIMITED	111	29	428	37,275	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRANSURBAN GROUP	589	152	195	17,017	運輸	
COCHLEAR LIMITED	23	6	110	9,632	ヘルスケア機器・サービス	
ORIGIN ENERGY LIMITED	580	—	—	—	エネルギー	

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株 数	評 価 額		業 種 等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	百株	百株	千豪ドル	千円		
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	398	113	915	79,717	銀行	
RIO TINTO LIMITED	98	35	266	23,251	素材	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	748	247	173	15,113	保険	
ORICA LTD	145	46	87	7,611	素材	
LENLEASE GROUP	191	63	106	9,264	不動産	
SUNCORP GROUP LTD	406	124	176	15,412	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	613	176	539	46,979	銀行	
NEWCREST MINING LIMITED	198	79	184	16,095	素材	
INCITEC PIVOT LTD	729	230	86	7,519	素材	
AMP LIMITED	865	293	151	13,210	各種金融	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	439	141	157	13,691	保険	
SANTOS LTD	506	234	108	9,479	エネルギー	
SONIC HEALTHCARE LTD	139	44	98	8,567	ヘルスケア機器・サービス	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	413	102	47	4,103	消費者サービス	
WESFARMERS LIMITED	237	47	203	17,690	食品・生活必需品小売り	
ALUMINA LTD	1,422	333	77	6,774	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	168	29	95	8,317	エネルギー	
WOOLWORTHS LIMITED	284	53	140	12,235	食品・生活必需品小売り	
BRAMBLES LTD	461	158	153	13,343	商業・専門サービス	
MACQUARIE GROUP LTD	85	19	195	16,992	各種金融	
CROWN RESORTS LIMITED	182	52	63	5,566	消費者サービス	
SYDNEY AIRPORT	459	131	97	8,452	運輸	
AGL ENERGY LTD	209	66	169	14,736	公益事業	
SOUTH32 LTD	1,676	532	184	16,106	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	16,912	4,917	7,904	688,422	
	銘柄 数 < 比 率 >	38	36	—	< 2.3% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
CONTACT ENERGY LTD	182	86	49	3,934	公益事業	
FLETCHER BUILDING LTD	289	111	78	6,201	素材	
SPARK NEW ZEALAND LTD	805	250	92	7,296	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	434	81	50	3,963	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,711	530	271	21,395	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.1% >	
(香港)			千香港ドル			
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	134	46	543	7,899	半導体・半導体製造装置	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	990	—	—	—	不動産	
BANK OF EAST ASIA	512	178	604	8,793	銀行	
CLP HOLDINGS LIMITED	345	45	358	5,211	公益事業	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	200	—	—	—	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	265	75	1,728	25,125	各種金融	
LI & FUNG LTD	2,280	600	220	3,201	耐久消費財・アパレル	
MTR CORPORATION	520	185	836	12,158	運輸	
HANG SENG BANK	206	39	725	10,547	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	420	141	750	10,908	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	340	130	876	12,739	公益事業	
THE WHARF (HOLDINGS)	440	—	—	—	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	1,587	777	1,151	16,744	公益事業	
HYSAN DEVELOPMENT CO	360	130	527	7,664	不動産	
Galaxy Entertainment Group Limited	770	220	1,243	18,073	消費者サービス	
KERRY PROPERTIES LTD	465	135	473	6,889	不動産	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,130	315	1,173	17,060	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	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
NWS HOLDINGS LTD		905	345	555	8,076	資本財
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		405	165	532	7,749	耐久消費財・アパレル
NEW WORLD DEVLEOPMENT		2,050	740	867	12,610	不動産
SINO LAND CO		1,278	478	668	9,716	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES		330	90	1,163	16,920	不動産
SWIRE PACIFIC LTD A		165	75	578	8,407	不動産
AIA GROUP LTD		2,970	808	4,949	71,958	保険
Sands China Ltd		776	248	937	13,630	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LTD		542	232	628	9,141	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		588	148	1,463	21,279	資本財
Cheung Kong Property Holdings Ltd		648	—	—	—	不動産
CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI)		—	80	543	7,903	公益事業
CK ASSET HOLDINGS LIMITED		—	193	1,281	18,632	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	21,622	6,619	25,381	369,044	
	銘 柄 数 < 比 率 >	28	26	—	<1.2%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING		630	230	77	6,470	資本財
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		4,160	1,960	79	6,626	食品・飲料・タバコ
DBS GROUP HOLDINGS LTD		310	100	243	20,285	銀行
CITY DEVELOPMENTS		220	70	84	7,094	不動産
SEBPCORP MARINE LTD		568	—	—	—	資本財
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		40	10	39	3,262	小売
SINGAPORE EXCHANGE LTD		190	—	—	—	各種金融
CAPITALAND LIMITED		1,000	330	118	9,889	不動産
GENTING SINGAPORE PLC		2,910	960	126	10,578	消費者サービス
COMFORTDELGRO CORP LTD		690	240	48	4,027	運輸
SINGAPORE AIRLINES LTD		260	90	97	8,136	運輸
UNITED OVERSEAS BANK		200	70	177	14,831	銀行
UNITED OVERSEAS LAND LTD		150	100	88	7,346	不動産
SINGAPORE PRESS HOLDINGS		510	200	53	4,491	メディア
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		1,767	227	85	7,125	電気通信サービス
SEBPCORP INDUSTRIES LTD		630	280	89	7,479	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		400	140	165	13,837	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD		720	—	—	—	食品・飲料・タバコ
KEPPEL CORP LTD		446	176	133	11,166	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	15,801	5,183	1,708	142,649	
	銘 柄 数 < 比 率 >	19	16	—	<0.5%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
BANK HAPOLIM BM		125	125	298	9,574	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		579	174	325	10,446	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP		1,029	364	193	6,224	電気通信サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD		145	94	136	4,372	素材
NICE LTD		28	8	234	7,531	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	1,908	767	1,188	38,150	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	268,612	78,327	—	26,300,961	
	銘 柄 数 < 比 率 >	966	868	—	<89.0%>	

(注) 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で邦貨換算したものです。

(注) 小計、合計欄の<>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) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

外国投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価		比 率	
			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	%	
AMERICAN TOWER CORP	10	3	473	53,710	0.2	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3	0.807	151	17,154	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	3	1	151	17,160	0.1	
CROWN CASTLE INTL CORP	8	2	310	35,224	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	4	1	210	23,826	0.1	
DUKE REALTY CORP	11	4	119	13,567	0.0	
EQUINIX INC	1	0.605	293	33,261	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	8	2	140	15,942	0.1	
EXTRA SPACE STORAGE INC	4	1	114	12,954	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2	0.816	107	12,161	0.0	
HCP INC	12	4	126	14,338	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	18	7	141	16,056	0.1	
IRON MOUNTAIN INC	8	2	120	13,678	0.0	
KIMCO REALTY CORP	12	5	108	12,288	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	5	1	86	9,862	0.0	
PROLOGIS INC	13	3	262	29,820	0.1	
PUBLIC STORAGE	3	0.956	202	22,912	0.1	
REALTY INCOME CORP	7	2	155	17,645	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	3	1	111	12,641	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	3	1	116	13,212	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	7	2	367	41,635	0.1	
UDR INC	8	3	124	14,122	0.0	
VENTAS INC	8	2	139	15,866	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	4	1	136	15,531	0.1	
WELLTOWER INC	8	2	144	16,328	0.1	
WEYERHAEUSER CO	17	4	167	19,004	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	205	67	4,585	519,909	
	銘 柄 数 < 比 率 >	26	26	—	< 1.8% >	
(カナダ)				千カナダドル		
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		8	0.252	6	574	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	8	0.252	6	574	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
KLEPIERRE		5	2	88	11,640	0.0
GECINA SA		1	0.621	85	11,357	0.0
FONCIERE DES REGIONS		1	0.684	59	7,909	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		1	0.52	114	15,108	0.1
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	10	4	348	46,016	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.2% >	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND CO PLC		27	12	76	11,344	0.0
HAMMERSON PLC		24	12	66	9,946	0.0

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数		評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	千口	千口	千英ポンド	千円	%	
INTU PROPERTIES PLC	35	17	37	5,601	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	19	—	—	—	—	
SEGRO PLC	29	12	68	10,282	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	—	7	66	9,976	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	137	62	316	47,151	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.2%>	
(オーストラリア)			千豪ドル			
MIRVAC GROUP	149	43	108	9,421	0.0	
GPT GROUP	70	19	105	9,194	0.0	
STOCKLAND	79	25	119	10,390	0.0	
GOODMAN GROUP	61	19	170	14,856	0.1	
SCENTRE GROUP	128	51	211	18,458	0.1	
WESTFIELD CORP	57	19	155	13,502	0.0	
VICINITY CENTRES	126	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	674	178	870	75,823	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	6	—	<0.3%>	
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	55	14	967	14,065	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	55	14	967	14,065	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
CAPITALAND MALL TRUST	109	13	26	2,203	0.0	
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	100	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	209	13	26	2,203	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	1	—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	1,301	340	—	705,743	
	銘柄 数 < 比 率 >	46	44	—	<2.4%>	

(注) 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で邦貨換算したものです。

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引	S&P 500 EMIN	百万円 1,464	百万円 —
		DJ EU STX 50	472	—
		FTSE 100 IDX	489	—

(注) 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で邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

(2017年11月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	26,300,961	88.3
投資証券	705,743	2.4
コール・ローン等、その他	2,764,016	9.3
投資信託財産総額	29,770,720	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産(29,542,194千円)の投資信託財産総額(29,770,720千円)に対する比率は99.2%です。

(注) 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で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=113.39円、1カナダドル=89.47円、1ユーロ=132.10円、1英ポンド=149.03円、1スイスフラン=114.09円、1スウェーデンクローネ=13.55円、1ノルウェークローネ=13.95円、1デンマーククローネ=17.75円、1豪ドル=87.09円、1ニュージーランドドル=78.85円、1香港ドル=14.54円、1シンガポールドル=83.48円、1イスラエルシェケル=32.11円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年11月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	29,906,896,754
コール・ローン等	2,199,775,659
株式(評価額)	26,300,961,626
投資証券(評価額)	705,743,881
未収入金	270,512,566
未収配当金	27,268,715
差入委託証拠金	402,634,307
(B) 負債	359,024,538
未払金	143,780,683
未払解約金	215,243,459
未払利息	396
(C) 純資産総額(A-B)	29,547,872,216
元本	12,593,720,222
次期繰越損益金	16,954,151,994
(D) 受益権総口数	12,593,720,222口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,462円

(注) 当親ファンドの期首元本額は43,385,534,877円、期中追加設定元本額は1,710,155,205円、期中一部解約元本額は32,501,969,860円です。

<元本の内訳>

TMA世界バランスファンド35VA<適格機関投資家限定>	10,214,016,743円
東京海上セレクション・外国株式インデックス	1,518,180,031円
TMA外国株式インデックスVA<適格機関投資家限定>	509,308,582円
TMA世界バランスファンド55VA<適格機関投資家限定>	264,285,926円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	29,453,970円
LPS4資産分散ファンド(積極型)	17,359,714円
LPS4資産分散ファンド(成長重視型)	13,183,376円
東京海上・世界インデックス・バランス60<適格機関投資家限定>	12,908,281円
LPS4資産分散ファンド(バランス型)	9,483,482円
LPS4資産分散ファンド(安定重視型)	2,899,112円
LPS4資産分散ファンド(慎重型)	1,579,429円
東京海上・世界インデックス・バランス40<適格機関投資家限定>	1,061,576円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は2,346.2円です。

○損益の状況 (2016年11月11日~2017年11月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,145,808,917
受取配当金	1,115,626,284
受取利息	1,213,791
その他収益金	29,218,889
支払利息	△ 250,047
(B) 有価証券売買損益	14,902,927,614
売買益	16,262,522,910
売買損	△ 1,359,595,296
(C) 先物取引等取引損益	395,234,904
取引益	516,206,453
取引損	△ 120,971,549
(D) 保管費用等	△ 29,381,986
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	16,414,589,449
(F) 前期繰越損益金	33,872,397,502
(G) 追加信託差損益金	1,977,985,821
(H) 解約差損益金	△35,310,820,778
(I) 計(E+F+G+H)	16,954,151,994
次期繰越損益金(I)	16,954,151,994

(注) (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) (G)追加信託差損益金は、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です。

(注) (H)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。

TMA外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第12期 (決算日 2017年11月10日)

(計算期間 2016年11月11日～2017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

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準	価額		ベンチマーク		債組入比率	純資産総額
		騰落	率	騰落	率		
	円		%		%		百万円
8期(2013年11月11日)	13,021		27.2	223,804	27.1	98.6	297,515
9期(2014年11月10日)	15,505		19.1	266,839	19.2	98.2	273,589
10期(2015年11月10日)	15,790		1.8	271,842	1.9	98.3	153,885
11期(2016年11月10日)	14,050	△	11.0	243,067	△	98.6	103,516
12期(2017年11月10日)	15,662		11.5	269,321	10.8	98.6	46,126

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準	価額		ベンチマーク		債組入比率
		騰落	率	騰落	率	
(期首)	円		%		%	
2016年11月10日	14,050		—	243,067	—	98.6
11月末	14,592		3.9	251,018	3.3	98.5
12月末	15,051		7.1	258,968	6.5	98.1
2017年1月末	14,691		4.6	252,707	4.0	98.2
2月末	14,615		4.0	251,409	3.4	98.2
3月末	14,618		4.0	251,453	3.5	98.4
4月末	14,706		4.7	253,022	4.1	98.6
5月末	14,930		6.3	256,774	5.6	97.5
6月末	15,210		8.3	261,602	7.6	98.4
7月末	15,200		8.2	261,507	7.6	98.5
8月末	15,421		9.8	265,200	9.1	98.4
9月末	15,595		11.0	268,209	10.3	98.6
10月末	15,593		11.0	268,237	10.4	98.0
(期末)						
2017年11月10日	15,662		11.5	269,321	10.8	98.6

(注) 騰落率は期首比です。

ベンチマークは、シティ世界国債インデックス（除く日本/円ヘッジなし・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、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、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す。

○運用経過

(2016年11月11日～2017年11月10日)

■期中の基準価額等の推移

期首：14,050円

期末：15,662円

騰落率：11.5%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・欧州の景気回復期待の高まりなどを背景にユーロが対円で大幅に上昇したこと

マイナス要因

- ・経済成長への期待を背景とした世界的な債券利回りの上昇（債券価格は下落）

■投資環境

2016年11月に米大統領選でトランプ候補が勝利し、同氏が公約に掲げていた財政政策への期待が高まったことに加え、12月にFOMC（米連邦公開市場委員会）で米国の利上げが決定したことにより、米国債利回りは上昇する展開となりました。2017年3月には、トランプ米政権の政策期待に加え、堅調な米国ISM（供給管理協会）製造業景況感指数やFRB（米連邦準備制度理事会）要人らの利上げに前向きな発言、その後の堅調な米国雇用統計などから、米国債利回りは2.6%程度まで上昇しました。9月に入り、北朝鮮の核実験による地政学的リスクや米国の大型ハリケーンによる被害への懸念から米国債利回りは2.0%程度まで低下しましたが、懸念の後退と共に利回りは上昇に転じ、期初からは上昇した水準で期を終えました。

ドイツ国債利回りは、期初から米大統領選の結果を受けた世界的な利回りの上昇に連動して上昇しました。その後、フランス大統領選を巡る欧州の政治情勢の不透明感や、米軍によるシリアへのミサイル攻撃などの地政学的リスクの台頭の影響を受けて、2017年4月には0.1%台半ばまで低下しました。6月に入り債券市場ではECB（欧州中央銀行）が2018年初めに量的金融緩和策を段階的に縮小していくとの見方が強まった一方、欧州での政治的なリスクの後退や景気回復への期待が高まったことにより、ドイツ国債利回りは0.6%程度まで上昇しました。その後は軟調な経済指標や北朝鮮情勢の緊張の高まりなどを背景にドイツ国債利回りは低下しましたが、期初から上昇した水準で期を終えました。

【外国為替市場動向】

米ドル円相場は円安米ドル高、ユーロ円相場は円安ユーロ高で期を終えました。

期初、米大統領選を受けてトランプ新政権の政策への期待が高まると、米国債利回りが急激に上昇したことにより円安米ドル高が進み、ユーロについても投資家のリスク選好の高まりから円安ユーロ高が進行しました。その後、米ドル円相場では、シリアや北朝鮮などの地政学的リスクの台頭やトランプ米大統領の米ドル高を懸念する発言、米国に上陸した大型ハリケーンの被害に対する懸念などを背景に円高米ドル安となる局面がありましたが、前期末対比では、円安米ドル高で期を終えました。ユーロ円相場は、欧州の景気回復期待の高まりから、大幅な円安ユーロ高で期を終えました。



(注) ベンチマークは、期首（2016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。

(注) ベンチマークは、シティ世界国債インデックス（除く日本/円ヘッジなし・円ベース）です。

■ポートフォリオについて

当ファンドは、ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本／円ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は11.5%上昇しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、ベンチマークの騰落率+10.8%に対して、基準価額の騰落率は+11.5%となり、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

(主な変動要因)

プラス要因

・保有債券の時価評価の違いなどのテクニカル要因

マイナス要因

・取引などのコスト

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、10月末現在、推定値で0.038%となっています。

※2017年10月末のポートフォリオのデータを基にベンチマークとの乖離を推計しています。ベンチマークとの連動が高いほどこの値は低くなります。

○今後の運用方針

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。

○1万口当たりの費用明細

(2016年11月11日～2017年11月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 2	% 0.012	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.012)	*保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	*その他は、信託事務等に要する諸費用
合 計	2	0.012	
期中の平均基準価額は、15,018円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○組入資産の明細

(2017年11月10日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期		期 末		残存期間別組入比率			
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額		5年以上	2年以上	2年未満	
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	171,250	175,162	19,861,690	43.1	—	18.1	17.5	7.5
カナダ	千カナダドル	千カナダドル						
	9,960	11,088	992,090	2.2	—	1.0	0.8	0.4
メキシコ	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
	56,910	60,648	361,464	0.8	—	0.5	0.3	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	21,260	25,079	3,312,990	7.2	—	4.1	2.2	0.9
イタリア	28,920	33,875	4,474,979	9.7	—	5.7	2.5	1.5
フランス	28,930	35,002	4,623,790	10.0	—	6.3	3.0	0.7
オランダ	6,320	7,600	1,004,059	2.2	—	1.4	0.5	0.3
スペイン	17,185	20,130	2,659,257	5.8	—	3.6	1.2	0.9
ベルギー	6,970	8,712	1,150,874	2.5	—	1.9	0.3	0.3
オーストリア	4,510	5,695	752,402	1.6	—	1.1	0.5	—
フィンランド	2,200	2,440	322,370	0.7	—	0.4	0.2	0.2
アイルランド	2,420	2,888	381,553	0.8	—	0.5	0.3	—
イギリス	千英ポンド	千英ポンド						
	16,290	20,896	3,114,171	6.8	—	4.9	1.8	0.1
スイス	千スイスフラン	千スイスフラン						
	300	324	37,054	0.1	—	—	0.1	—
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						
	14,420	16,894	228,924	0.5	—	0.3	0.2	—
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						
	6,000	6,216	86,720	0.2	—	0.1	—	0.1
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						
	11,760	16,356	290,326	0.6	—	0.4	0.2	—
ポーランド	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
	8,800	9,196	287,121	0.6	—	0.1	0.4	0.1
オーストラリア	千豪ドル	千豪ドル						
	10,060	11,027	960,419	2.1	—	1.3	0.7	0.1
シンガポール	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
	1,700	1,808	150,965	0.3	—	0.1	0.3	—
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						
	7,400	7,510	203,147	0.4	—	0.2	0.2	—
南アフリカ	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
	37,000	30,256	240,838	0.5	—	0.5	0.0	—
合 計	—	—	45,497,212	98.6	—	52.4	33.2	13.0

(注) 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で邦貨換算したものです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 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) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末				償還年月日	銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額	外貨換算金額			利率	額面金額	評 価 額	外貨換算金額	
	%	千米ドル	千米ドル	千円		%	千米ドル	千米ドル	千円		
(アメリカ) 国債証券					(アメリカ) 国債証券						
T 1 06/30/19	1.0	2,000	1,980	224,574	2019/6/30	T 2 11/15/21	2.0	3,000	3,012	341,631	2021/11/15
T 1 08/31/19	1.0	2,000	1,978	224,299	2019/8/31	T 2 3/4 02/15/24	2.75	3,500	3,622	410,786	2024/2/15
T 1 1/2 02/28/19	1.5	4,500	4,493	509,537	2019/2/28	T 2 3/4 11/15/23	2.75	4,500	4,663	528,751	2023/11/15
T 1 1/2 07/15/20	1.5	3,000	2,982	338,150	2020/7/15	T 2 3/4 11/15/42	2.75	300	299	33,931	2042/11/15
T 1 1/8 05/31/19	1.125	5,000	4,964	562,919	2019/5/31	T 2 3/8 08/15/24	2.375	2,000	2,023	229,437	2024/8/15
T 1 1/8 08/31/21	1.125	5,000	4,859	551,048	2021/8/31	T 2 3/8 12/31/20	2.375	3,000	3,052	346,176	2020/12/31
T 1 1/8 12/31/19	1.125	2,000	1,977	224,246	2019/12/31	T 2 5/8 11/15/20	2.625	4,000	4,100	465,005	2020/11/15
T 1 11/30/19	1.0	2,000	1,973	223,821	2019/11/30	T 2 7/8 08/15/45	2.875	2,400	2,436	276,218	2045/8/15
T 1 3/4 02/28/22	1.75	1,500	1,488	168,782	2022/2/28	T 3 02/15/47	3.0	1,000	1,038	117,792	2047/2/15
T 1 3/4 05/15/22	1.75	3,000	2,974	337,246	2022/5/15	T 3 05/15/42	3.0	900	940	106,683	2042/5/15
T 1 3/4 05/15/23	1.75	4,000	3,931	445,764	2023/5/15	T 3 1/2 02/15/39	3.5	400	455	51,613	2039/2/15
T 1 3/4 09/30/22	1.75	3,500	3,457	391,997	2022/9/30	T 3 1/2 05/15/20	3.5	1,500	1,567	177,698	2020/5/15
T 1 3/8 02/28/19	1.375	2,700	2,692	305,315	2019/2/28	T 3 1/8 02/15/42	3.125	700	747	84,774	2042/2/15
T 1 3/8 02/29/20	1.375	1,500	1,489	168,849	2020/2/29	T 3 1/8 02/15/43	3.125	1,300	1,385	157,115	2043/2/15
T 1 3/8 03/31/20	1.375	4,000	3,969	450,051	2020/3/31	T 3 1/8 05/15/19	3.125	5,000	5,112	579,750	2019/5/15
T 1 3/8 04/30/21	1.375	1,000	984	111,618	2021/4/30	T 3 1/8 05/15/21	3.125	900	939	106,539	2021/5/15
T 1 3/8 05/31/20	1.375	2,300	2,280	258,596	2020/5/31	T 3 1/8 08/15/44	3.125	2,000	2,131	241,644	2044/8/15
T 1 3/8 09/30/20	1.375	500	494	56,101	2020/9/30	T 3 1/8 11/15/41	3.125	100	106	12,109	2041/11/15
T 1 5/8 02/15/26	1.625	2,900	2,755	312,440	2026/2/15	T 3 11/15/45	3.0	1,700	1,767	200,413	2045/11/15
T 1 5/8 03/31/19	1.625	7,000	7,002	793,978	2019/3/31	T 3 3/4 08/15/41	3.75	600	707	80,195	2041/8/15
T 1 5/8 05/15/26	1.625	4,000	3,790	429,783	2026/5/15	T 3 3/8 11/15/19	3.375	3,500	3,618	410,352	2019/11/15
T 1 5/8 08/15/22	1.625	1,300	1,279	145,103	2022/8/15	T 3 5/8 02/15/20	3.625	3,900	4,068	461,326	2020/2/15
T 1 7/8 11/30/21	1.875	3,500	3,498	396,647	2021/11/30	T 3 5/8 02/15/21	3.625	2,000	2,116	239,961	2021/2/15
T 2 02/15/22	2.0	3,000	3,010	341,392	2022/2/15	T 3 5/8 02/15/44	3.625	1,900	2,203	249,894	2044/2/15
T 2 02/15/23	2.0	2,700	2,692	305,315	2023/2/15	T 3 5/8 08/15/43	3.625	1,200	1,390	157,615	2043/8/15
T 2 02/15/25	2.0	1,700	1,674	189,826	2025/2/15	T 3 7/8 08/15/40	3.875	800	958	108,726	2040/8/15
T 2 02/28/21	2.0	500	503	57,040	2021/2/28	T 4 1/2 02/15/36	4.5	600	774	87,864	2036/2/15
T 2 07/31/22	2.0	1,900	1,900	215,525	2022/7/31	T 4 1/2 08/15/39	4.5	400	520	59,069	2039/8/15
T 2 08/15/25	2.0	1,800	1,767	200,402	2025/8/15	T 4 1/4 05/15/39	4.25	100	126	14,297	2039/5/15
T 2 1/2 02/15/45	2.5	2,000	1,886	213,864	2045/2/15	T 4 1/4 11/15/40	4.25	200	252	28,677	2040/11/15
T 2 1/2 02/15/46	2.5	3,100	2,914	330,418	2046/2/15	T 4 3/4 02/15/41	4.75	700	947	107,413	2041/2/15
T 2 1/2 05/15/24	2.5	4,000	4,080	462,631	2024/5/15	T 4 3/8 02/15/38	4.375	200	255	28,988	2038/2/15
T 2 1/2 08/15/23	2.5	3,200	3,270	370,870	2023/8/15	T 4 3/8 05/15/41	4.375	600	773	87,700	2041/5/15
T 2 1/4 02/15/27	2.25	1,500	1,489	168,889	2027/2/15	T 4 3/8 11/15/39	4.375	400	512	58,151	2039/11/15
T 2 1/4 03/31/21	2.25	300	304	34,471	2021/3/31	T 4 5/8 02/15/40	4.625	300	397	45,088	2040/2/15
T 2 1/4 04/30/21	2.25	700	709	80,451	2021/4/30	T 5 05/15/37	5.0	50	68	7,788	2037/5/15
T 2 1/4 07/31/21	2.25	2,000	2,026	229,809	2021/7/31	T 5 1/4 02/15/29	5.25	690	887	100,610	2029/2/15
T 2 1/4 08/15/27	2.25	1,100	1,090	123,676	2027/8/15	T 5 3/8 02/15/31	5.375	500	669	75,940	2031/2/15
T 2 1/4 08/15/46	2.25	1,800	1,600	181,507	2046/8/15	T 6 02/15/26	6.0	1,000	1,283	145,555	2026/2/15
T 2 1/4 11/15/24	2.25	1,500	1,504	170,563	2024/11/15	T 6 1/2 11/15/26	6.5	1,950	2,621	297,307	2026/11/15
T 2 1/8 05/15/25	2.125	1,300	1,289	146,243	2025/5/15	T 6 1/4 08/15/23	6.25	600	736	83,458	2023/8/15
T 2 1/8 06/30/21	2.125	3,500	3,532	400,523	2021/6/30	T 8 1/8 08/15/19	8.125	2,060	2,293	260,025	2019/8/15
T 2 1/8 08/15/21	2.125	3,000	3,027	343,305	2021/8/15	小 計				19,861,690	

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額	評 価 額	償還年月日
	%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
(カナダ) 国債証券					
CAN 0 3/4 03/01/21	0.75	1,000	975	87,255	2021/3/1
CAN 1 1/2 06/01/23	1.5	600	593	53,082	2023/6/1
CAN 1 1/2 06/01/26	1.5	400	387	34,689	2026/6/1
CAN 2 1/2 06/01/24	2.5	400	417	37,387	2024/6/1
CAN 2 3/4 06/01/22	2.75	600	628	56,247	2022/6/1
CAN 2 3/4 12/01/48	2.75	600	663	59,399	2048/12/1
CAN 3 1/2 06/01/20	3.5	1,200	1,260	112,741	2020/6/1
CAN 3 1/2 12/01/45	3.5	400	499	44,728	2045/12/1
CAN 3 1/4 06/01/21	3.25	1,200	1,269	113,553	2021/6/1
CAN 3 3/4 06/01/19	3.75	1,800	1,865	166,875	2019/6/1
CAN 4 06/01/41	4.0	300	394	35,266	2041/6/1
CAN 5 06/01/37	5.0	310	446	39,930	2037/6/1
CAN 5 3/4 06/01/33	5.75	300	443	39,677	2033/6/1
CAN 5.75 06/01/29	5.75	310	428	38,350	2029/6/1
CAN 8 06/01/27	8.0	100	152	13,665	2027/6/1
CAN 9 06/01/25	9.0	440	662	59,238	2025/6/1
小 計				992,090	
(メキシコ) 国債証券					
		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MBONO 10 11/20/36	10.0	3,000	3,744	22,317	2036/11/20
MBONO 10 12/05/24	10.0	10,000	11,598	69,126	2024/12/5
MBONO 7 1/2 06/03/27	7.5	2,000	2,033	12,117	2027/6/3
MBONO 7 3/4 05/29/31	7.75	6,000	6,176	36,813	2031/5/29
MBONO 7 3/4 11/13/42	7.75	5,000	5,094	30,360	2042/11/13
MBONO 8 06/11/20	8.0	23,000	23,524	140,205	2020/6/11
MBONO 8 1/2 11/18/38	8.5	3,910	4,298	25,621	2038/11/18
MBONO 8 12/07/23	8.0	4,000	4,178	24,900	2023/12/7
小 計				361,464	
(ユーロ…ドイツ) 国債証券					
		千ユーロ	千ユーロ		
DBR 0 1/2 02/15/25	0.5	500	518	68,443	2025/2/15
DBR 0 1/2 02/15/26	0.5	800	823	108,806	2026/2/15
DBR 0 1/4 02/15/27	0.25	1,000	995	131,469	2027/2/15
DBR 1 08/15/24	1.0	500	536	70,851	2024/8/15
DBR 1 08/15/25	1.0	700	750	99,191	2025/8/15
DBR 1 1/2 02/15/23	1.5	600	657	86,845	2023/2/15
DBR 1 1/2 05/15/23	1.5	500	548	72,503	2023/5/15
DBR 1 1/2 09/04/22	1.5	300	327	43,269	2022/9/4
DBR 1 3/4 02/15/24	1.75	800	895	118,312	2024/2/15
DBR 1 3/4 07/04/22	1.75	700	771	101,874	2022/7/4
DBR 2 01/04/22	2.0	1,300	1,435	189,643	2022/1/4
DBR 2 08/15/23	2.0	500	564	74,552	2023/8/15
DBR 2 1/2 07/04/44	2.5	600	780	103,086	2044/7/4
DBR 2 1/2 08/15/46	2.5	500	655	86,536	2046/8/15

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額	評 価 額	償還年月日
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(ユーロ…ドイツ) 国債証券					
DBR 2 1/4 09/04/21	2.25	1,500	1,661	219,500	2021/9/4
DBR 3 07/04/20	3.0	1,200	1,318	174,180	2020/7/4
DBR 3 1/2 07/04/19	3.5	1,500	1,606	212,260	2019/7/4
DBR 3 1/4 01/04/20	3.25	500	543	71,780	2020/1/4
DBR 3 1/4 07/04/42	3.25	300	437	57,824	2042/7/4
DBR 4 01/04/37	4.0	530	813	107,480	2037/1/4
DBR 4 3/4 07/04/28	4.75	580	840	111,012	2028/7/4
DBR 4 3/4 07/04/34	4.75	500	805	106,350	2034/7/4
DBR 4 3/4 07/04/40	4.75	400	699	92,461	2040/7/4
DBR 4.25 07/04/39	4.25	400	651	86,052	2039/7/4
DBR 5 5/8 01/04/28	5.625	300	457	60,400	2028/1/4
DBR 5.5 01/04/31	5.5	250	403	53,286	2031/1/4
DBR 6 1/4 01/04/30	6.25	250	417	55,124	2030/1/4
DBR 6.25 01/04/24	6.25	200	279	36,874	2024/1/4
DBR 6.5 07/04/27	6.5	450	715	94,478	2027/7/4
OBL 0 04/09/21	—	1,100	1,122	148,249	2021/4/9
OBL 0 1/2 04/12/19	0.5	500	509	67,279	2019/4/12
OBL 0 1/4 10/16/20	0.25	500	513	67,826	2020/10/16
OBL 1 02/22/19	1.0	1,000	1,023	135,180	2019/2/22
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BTPS 1 1/2 06/01/25	1.5	1,000	1,007	133,130	2025/6/1
BTPS 1.35 04/15/22	1.35	700	726	95,919	2022/4/15
BTPS 1.65 03/01/32	1.65	500	464	61,367	2032/3/1
BTPS 2 12/01/25	2.0	2,000	2,077	274,371	2025/12/1
BTPS 2.15 12/15/21	2.15	1,200	1,286	169,949	2021/12/15
BTPS 2.7 03/01/47	2.7	400	378	49,933	2047/3/1
BTPS 2.8 03/01/67	2.8	300	267	35,369	2067/3/1
BTPS 3 1/2 03/01/30	3.5	500	574	75,898	2030/3/1
BTPS 3 1/4 09/01/46	3.25	500	528	69,775	2046/9/1
BTPS 3 3/4 08/01/21	3.75	450	508	67,190	2021/8/1
BTPS 3 3/4 09/01/24	3.75	700	816	107,893	2024/9/1
BTPS 4 02/01/37	4.0	1,160	1,409	186,166	2037/2/1
BTPS 4 1/2 02/01/20	4.5	970	1,070	141,424	2020/2/1
BTPS 4 1/2 03/01/24	4.5	800	967	127,819	2024/3/1
BTPS 4 1/2 03/19	4.5	2,000	2,124	280,704	2019/3/1
BTPS 4 1/2 05/01/23	4.5	900	1,078	142,418	2023/5/1
BTPS 4 1/4 02/01/19	4.25	1,520	1,604	211,950	2019/2/1
BTPS 4 1/4 03/01/20	4.25	610	671	88,751	2020/3/1
BTPS 4 1/4 09/19	4.25	1,500	1,621	214,142	2019/9/1
BTPS 4 3/4 08/01/23	4.75	600	731	96,633	2023/8/1
BTPS 4 3/4 09/01/21	4.75	1,500	1,753	231,696	2021/9/1
BTPS 4 3/4 09/01/28	4.75	200	254	33,579	2028/9/1
BTPS 4 3/4 09/01/44	4.75	400	533	70,477	2044/9/1

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(ユーロ…イタリア) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BTPS 5 03/01/22	5.0	1,000	1,194	157,767	2022/3/1
BTPS 5 03/01/25	5.0	800	1,005	132,850	2025/3/1
BTPS 5 08/01/34	5.0	900	1,215	160,596	2034/8/1
BTPS 5 08/01/39	5.0	600	822	108,602	2039/8/1
BTPS 5 09/01/40	5.0	400	543	71,835	2040/9/1
BTPS 5 1/2 09/01/22	5.5	700	862	113,950	2022/9/1
BTPS 5 1/2 11/01/22	5.5	500	618	81,651	2022/11/1
BTPS 5 3/4 02/01/33	5.75	300	430	56,912	2033/2/1
BTPS 5.25 11/01/29	5.25	700	938	123,974	2029/11/1
BTPS 6 05/01/31	6.0	810	1,168	154,402	2031/5/1
BTPS 6 1/2 11/01/27	6.5	700	1,001	132,278	2027/11/1
BTPS 7 1/4 11/01/26	7.25	600	882	116,623	2026/11/1
BTPS 9 11/01/23	9.0	500	734	96,968	2023/11/1
(ユーロ…フランス) 国債証券					
FRTR 0 1/2 05/25/25	0.5	600	611	80,805	2025/5/25
FRTR 0 1/2 11/25/19	0.5	500	511	67,582	2019/11/25
FRTR 0 1/4 11/25/26	0.25	1,000	976	129,008	2026/11/25
FRTR 1 05/25/19	1.0	1,000	1,025	135,508	2019/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/31	1.5	700	742	98,055	2031/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/36	1.25	500	492	64,999	2036/5/25
FRTR 1 11/25/25	1.0	1,100	1,160	153,287	2025/11/25
FRTR 1 3/4 05/25/23	1.75	600	661	87,435	2023/5/25
FRTR 1 3/4 11/25/24	1.75	1,200	1,333	176,210	2024/11/25
FRTR 2 1/2 05/25/30	2.5	800	952	125,790	2030/5/25
FRTR 2 1/2 10/25/20	2.5	1,635	216,082	2020/10/25	
FRTR 2 1/4 05/25/24	2.25	400	457	60,396	2024/5/25
FRTR 2 1/4 10/25/22	2.25	600	673	88,937	2022/10/25
FRTR 2 3/4 10/25/27	2.75	1,300	1,566	206,986	2027/10/25
FRTR 3 04/25/22	3.0	1,700	1,953	258,075	2022/4/25
FRTR 3 1/2 04/25/20	3.5	2,700	2,973	392,836	2020/4/25
FRTR 3 1/2 04/25/26	3.5	1,200	1,513	199,988	2026/4/25
FRTR 3 1/4 05/25/45	3.25	600	816	107,793	2045/5/25
FRTR 3 1/4 10/25/21	3.25	1,200	1,373	181,481	2021/10/25
FRTR 3 3/4 04/25/21	3.75	1,300	1,491	196,991	2021/4/25
FRTR 3 3/4 10/19	3.75	1,400	1,522	201,066	2019/10/25
FRTR 4 04/25/55	4.0	470	749	99,003	2055/4/25
FRTR 4 04/25/60	4.0	500	817	108,004	2060/4/25
FRTR 4 10/25/38	4.0	660	979	129,349	2038/10/25
FRTR 4 3/4 04/25/35	4.75	780	1,219	161,151	2035/4/25
FRTR 4.25 10/23	4.25	1,490	1,875	247,748	2023/10/25
FRTR 5 1/2 04/25/29	5.5	710	1,080	142,712	2029/4/25
FRTR 5 3/4 10/25/32	5.75	920	1,519	200,661	2032/10/25
FRTR 6 10/25/25	6.0	600	874	115,553	2025/10/25

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(ユーロ…フランス) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRTR4.5 04/25/41	4.5	900	1,440	190,283	2041/4/25
(ユーロ…オランダ) 国債証券					
NETHER 0 1/2 07/15/26	0.5	500	508	67,146	2026/7/15
NETHER 0 1/4 07/15/25	0.25	500	502	66,406	2025/7/15
NETHER 2 07/15/24	2.0	800	906	119,724	2024/7/15
NETHER 2 1/2 01/15/33	2.5	300	370	49,006	2033/1/15
NETHER 2 1/4 07/15/22	2.25	500	561	74,127	2022/7/15
NETHER 2 3/4 01/15/47	2.75	200	274	36,242	2047/1/15
NETHER 3 1/2 07/15/20	3.5	400	444	58,779	2020/7/15
NETHER 3 1/4 07/15/21	3.25	600	684	90,356	2021/7/15
NETHER 3 3/4 01/15/42	3.75	400	619	81,870	2042/1/15
NETHER 4 01/15/37	4.0	460	702	92,820	2037/1/15
NETHER 4 07/15/19	4.0	1,000	1,080	142,668	2019/7/15
NETHER 5 1/2 01/15/28	5.5	190	285	37,721	2028/1/15
NETHER 7 1/2 01/15/23	7.5	470	660	87,188	2023/1/15
(ユーロ…スペイン) 国債証券					
SPGB 1.3 10/31/26	1.3	700	697	92,146	2026/10/31
SPGB 1.6 04/30/25	1.6	900	939	124,097	2025/4/30
SPGB 1.95 04/30/26	1.95	1,500	1,582	209,107	2026/4/30
SPGB 1.95 07/30/30	1.95	500	502	66,340	2030/7/30
SPGB 2 3/4 10/31/24	2.75	600	675	89,254	2024/10/31
SPGB 2.9 10/31/46	2.9	400	405	53,516	2046/10/31
SPGB 3.45 07/30/66	3.45	100	107	14,173	2066/7/30
SPGB 3.8 04/30/24	3.8	600	714	94,394	2024/4/30
SPGB 4 04/30/20	4.0	1,200	1,322	174,696	2020/4/30
SPGB 4.2 01/31/37	4.2	600	771	101,857	2037/1/31
SPGB 4.3 10/31/19	4.3	1,500	1,635	215,985	2019/10/31
SPGB 4.4 10/31/23	4.4	400	489	64,707	2023/10/31
SPGB 4.6 07/30/19	4.6	1,500	1,626	214,794	2019/7/30
SPGB 4.65 07/30/25	4.65	1,000	1,267	167,383	2025/7/30
SPGB 4.7 07/30/41	4.7	400	548	72,470	2041/7/30
SPGB 4.8 01/31/24	4.8	500	624	82,463	2024/1/31
SPGB 4.85 10/31/20	4.85	500	572	75,660	2020/10/31
SPGB 4.9 07/30/40	4.9	400	561	74,145	2040/7/30
SPGB 5 1/2 04/30/21	5.5	1,000	1,189	157,073	2021/4/30
SPGB 5 3/4 07/30/32	5.75	460	678	89,666	2032/7/30
SPGB 5.15 10/31/28	5.15	200	270	35,775	2028/10/31
SPGB 5.15 10/31/44	5.15	200	290	38,372	2044/10/31
SPGB 5.4 01/31/23	5.4	300	376	49,715	2023/1/31
SPGB 5.85 01/31/22	5.85	1,000	1,238	163,546	2022/1/31
SPGB 6 01/31/29	6.0	725	1,044	137,912	2029/1/31

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(ユーロ…ベルギー) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BGB 0.8 06/22/25	0.8	500	519	68,592	2025/6/22
BGB 1 06/22/26	1.0	500	523	69,121	2026/6/22
BGB 1.6 06/22/47	1.6	300	290	38,342	2047/6/22
BGB 2 1/4 06/22/23	2.25	500	566	74,854	2023/6/22
BGB 2.15 06/22/66	2.15	200	209	27,701	2066/6/22
BGB 2.6 06/22/24	2.6	300	349	46,168	2024/6/22
BGB 3 3/4 06/22/45	3.75	200	294	38,853	2045/6/22
BGB 4 03/28/19	4.0	1,000	1,064	140,600	2019/3/28
BGB 4 03/28/22	4.0	40	47	6,298	2022/3/28
BGB 4 03/28/32	4.0	400	560	74,012	2032/3/28
BGB 4 1/2 03/28/26	4.5	500	672	88,837	2026/3/28
BGB 4 1/4 03/28/41	4.25	600	929	122,845	2041/3/28
BGB 4 1/4 09/28/21	4.25	500	591	78,166	2021/9/28
BGB 4 1/4 09/28/22	4.25	400	488	64,559	2022/9/28
BGB 5 03/28/35	5.0	610	976	129,050	2035/3/28
BGB 5.5 1/2 03/28/28	5.5	420	627	82,867	2028/3/28
(ユーロ…オーストリア) 国債証券					
RAGB 1 3/4 10/20/23	1.75	500	554	73,206	2023/10/20
RAGB 2.1 09/20/17	2.1	100	104	13,811	2117/9/20
RAGB 3 1/2 09/15/21	3.5	500	576	76,155	2021/9/15
RAGB 3.15 06/20/44	3.15	300	416	55,050	2044/6/20
RAGB 3.4 11/22/22	3.4	500	592	78,203	2022/11/22
RAGB 3.8 01/26/62	3.8	100	167	22,120	2062/1/26
RAGB 3.9 07/15/20	3.9	1,000	1,120	148,044	2020/7/15
RAGB 4.15 03/37	4.15	350	532	70,369	2037/3/15
RAGB 4.85 03/26	4.85	1,000	1,382	182,562	2026/3/15
RAGB 6 1/4 07/15/27	6.25	160	248	32,879	2027/7/15
(ユーロ…フィンランド) 国債証券					
RFGB 0 3/4 04/15/31	0.75	400	398	52,665	2031/4/15
RFGB 1 1/2 04/15/23	1.5	500	544	71,902	2023/4/15
RFGB 3 1/2 04/15/21	3.5	500	568	75,105	2021/4/15
RFGB 4 07/04/25	4.0	300	386	51,079	2025/7/4
RFGB 4 3/8 07/04/19	4.375	500	542	71,618	2019/7/4
(ユーロ…アイルランド) 国債証券					
IRISH 2 02/18/45	2.0	200	208	27,553	2045/2/18
IRISH 2.4 05/15/30	2.4	300	348	46,069	2030/5/15
IRISH 3.4 03/18/24	3.4	500	601	79,392	2024/3/18
IRISH 4 1/2 04/18/20	4.5	520	584	77,165	2020/4/18
IRISH 5 10/18/20	5.0	400	465	61,452	2020/10/18
IRISH 5.4 03/13/25	5.4	500	680	89,920	2025/3/13
ユーロ計				18,682,277	

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(イギリス) 国債証券	%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
UKT 0 1/2 07/22/22	0.5	800	791	117,942	2022/7/22
UKT 1 1/2 07/22/26	1.5	500	509	75,997	2026/7/22
UKT 1 3/4 09/07/22	1.75	700	731	109,015	2022/9/7
UKT 2 07/22/20	2.0	800	829	123,551	2020/7/22
UKT 2 09/07/25	2.0	1,000	1,065	158,746	2025/9/7
UKT 2 1/4 09/07/23	2.25	400	428	63,862	2023/9/7
UKT 2 3/4 09/07/24	2.75	400	445	66,360	2024/9/7
UKT 3 1/2 01/22/45	3.5	400	535	79,731	2045/1/22
UKT 3 1/2 07/22/68	3.5	700	1,141	170,105	2068/7/22
UKT 3 1/4 01/22/44	3.25	700	904	134,834	2044/1/22
UKT 3 3/4 07/22/52	3.75	300	452	67,461	2052/7/22
UKT 3 3/4 09/07/19	3.75	300	317	47,244	2019/9/7
UKT 3 3/4 09/07/20	3.75	700	761	113,449	2020/9/7
UKT 3 3/4 09/07/21	3.75	500	558	83,166	2021/9/7
UKT 4 01/22/60	4.0	600	1,016	151,465	2060/1/22
UKT 4 03/07/22	4.0	500	570	84,954	2022/3/7
UKT 4 1/2 12/07/42	4.5	440	669	99,795	2042/12/7
UKT 4 1/4 03/07/36	4.25	500	691	103,039	2036/3/7
UKT 4 1/4 09/07/39	4.25	400	570	84,976	2039/9/7
UKT 4 1/4 12/07/27	4.25	230	292	43,655	2027/12/7
UKT 4 1/4 12/07/40	4.25	500	721	107,540	2040/12/7
UKT 4 1/4 12/07/46	4.25	750	1,147	171,011	2046/12/7
UKT 4 1/4 12/07/49	4.25	200	317	47,364	2049/12/7
UKT 4 1/4 12/07/55	4.25	600	1,020	152,064	2055/12/7
UKT 4 3/4 03/07/20	4.75	900	986	147,030	2020/3/7
UKT 4 3/4 12/07/30	4.75	400	551	82,169	2030/12/7
UKT 4 3/4 12/07/38	4.75	300	452	67,371	2038/12/7
UKT 4.25 06/07/32	4.25	410	547	81,626	2032/6/7
UKT 4.5 09/07/34	4.5	600	840	125,310	2034/9/7
UKT 5 03/07/25	5.0	300	382	57,075	2025/3/7
UKT 6 12/07/28	6.0	310	456	68,083	2028/12/7
UKT 8 06/07/21	8.0	150	189	28,166	2021/6/7
小 計				3,114,171	
(スイス) 国債証券		千スイスフラン	千スイスフラン		
SWISS 2 1/4 07/20	2.25	300	324	37,054	2020/7/6
小 計				37,054	
(スウェーデン) 国債証券		千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
SGB 1 1/2 11/13/23	1.5	2,000	2,159	29,266	2023/11/13
SGB 2 1/2 05/12/25 #1058	2.5	4,000	4,629	62,733	2025/5/12
SGB 3 1/2 03/30/39	3.5	1,500	2,028	27,489	2039/3/30
SGB 3 1/2 06/01/22	3.5	1,000	1,166	15,803	2022/6/1

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額 外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SGB 5 12/01/20	5.0	5,920	6,910	93,631	2020/12/1
小 計				228,924	
(ノルウェー) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
NGB 1 3/4 02/17/27	1.75	3,000	3,050	42,557	2027/2/17
NGB 2 05/24/23	2.0	1,000	1,046	14,592	2023/5/24
NGB 4 1/2 05/22/19	4.5	2,000	2,119	29,571	2019/5/22
小 計				86,720	
(デンマーク) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
DGB 3 11/15/21	3.0	2,000	2,275	40,387	2021/11/15
DGB 4 1/2 11/15/39	4.5	3,500	5,943	105,488	2039/11/15
DGB 4 11/15/19	4.0	3,000	3,279	58,202	2019/11/15
DGB 7 11/10/24	7.0	3,260	4,859	86,248	2024/11/10
小 計				290,326	
(ポーランド) 国債証券		千ランド	千ランド		
POLGB 1 3/4 07/25/21	1.75	2,000	1,959	61,178	2021/7/25
POLGB 2 1/2 07/25/27	2.5	2,000	1,859	58,062	2027/7/25
POLGB 5 1/2 10/25/19	5.5	1,000	1,074	33,533	2019/10/25
POLGB 5 3/4 09/23/22	5.75	1,800	2,053	64,114	2022/9/23
POLGB 5 3/4 10/25/21	5.75	2,000	2,249	70,232	2021/10/25
小 計				287,121	
(オーストラリア) 国債証券		千豪ドル	千豪ドル		
ACGB 2 3/4 04/21/24	2.75	700	717	62,462	2024/4/21
ACGB 2 3/4 11/21/27	2.75	800	808	70,403	2027/11/21
ACGB 3 03/21/47	3.0	200	184	16,109	2047/3/21
ACGB 3 1/4 04/21/25	3.25	600	631	55,018	2025/4/21
ACGB 3 1/4 04/21/29	3.25	1,100	1,161	101,125	2029/4/21
ACGB 3 3/4 04/21/37	3.75	300	327	28,525	2037/4/21
ACGB 4 1/2 04/20	4.5	1,000	1,061	92,450	2020/4/15
ACGB 4 1/2 04/21/33	4.5	600	717	62,469	2033/4/21
ACGB 4 1/4 04/21/26	4.25	900	1,016	88,507	2026/4/21
ACGB 4 3/4 04/21/27	4.75	700	828	72,161	2027/4/21
ACGB 5 1/2 04/21/23	5.5	500	582	50,714	2023/4/21

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額 外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア) 国債証券	%	千豪ドル	千豪ドル	千円	
ACGB 5 1/4 03/15/19	5.25	360	376	32,775	2019/3/15
ACGB 5 3/4 05/15/21	5.75	1,500	1,688	147,010	2021/5/15
ACGB 5 3/4 07/15/22	5.75	800	926	80,683	2022/7/15
小 計				960,419	
(シンガポール) 国債証券		シンガポールドル	シンガポールドル		
SIGB 3 1/2 03/01/27	3.5	300	334	27,916	2027/3/1
SIGB 3 1/4 09/01/20	3.25	900	941	78,595	2020/9/1
SIGB 3 1/8 09/01/22	3.125	500	532	44,453	2022/9/1
小 計				150,965	
(マレーシア) 国債証券		マレーシアリングギット	マレーシアリングギット		
MGS 3.502 05/31/27	3.502	1,000	939	25,408	2027/5/31
MGS 4.16 07/15/21	4.16	1,000	1,016	27,496	2021/7/15
MGS 4.181 07/15/24	4.181	1,000	1,008	27,266	2024/7/15
MGS 4.378 11/29/19	4.378	2,700	2,750	74,394	2019/11/29
MGS 4.392 04/15/26	4.392	500	506	13,698	2026/4/15
MGS 5.248 09/28	5.248	1,200	1,289	34,884	2028/9/15
小 計				203,147	
(南アフリカ) 国債証券		南アフリカランド	南アフリカランド		
SAGB 10 1/2 12/21/26	10.5	5,000	5,362	42,681	2026/12/21
SAGB 6 1/2 02/28/41	6.5	5,000	3,377	26,880	2041/2/28
SAGB 6 1/4 03/31/36	6.25	9,000	6,147	48,930	2036/3/31
SAGB 7 02/28/31	7.0	8,000	6,319	50,300	2031/2/28
SAGB 7 1/4 01/15/20	7.25	1,000	984	7,836	2020/1/15
SAGB 7 3/4 02/28/23	7.75	3,000	2,898	23,072	2023/2/28
SAGB 8 3/4 02/28/48	8.75	6,000	5,167	41,135	2048/2/28
小 計				240,838	
合 計				45,497,212	

(注) 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で邦貨換算したものです。

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

○投資信託財産の構成

(2017年11月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	45,497,212	98.0
コール・ローン等、その他	921,730	2.0
投資信託財産総額	46,418,942	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産(46,390,623千円)の投資信託財産総額(46,418,942千円)に対する比率は99.9%です。

(注) 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で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=113.39円、1カナダドル=89.47円、1メキシコペソ=5.96円、1ユーロ=132.10円、1英ポンド=149.03円、1スイスフラン=114.09円、1スウェーデンクローネ=13.55円、1ノルウェークローネ=13.95円、1デンマーククローネ=17.75円、1ポーランドズロチ=31.22円、1豪ドル=87.09円、1シンガポールドル=83.48円、1マレーシアリンギット=27.05円、1南アフリカランド=7.96円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年11月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	46,682,731,068
コール・ローン等	267,215,468
公社債(評価額)	45,497,212,570
未収入金	493,094,791
未収利息	412,068,453
前払費用	13,139,786
(B) 負債	556,381,362
未払金	263,887,293
未払解約金	292,494,020
未払利息	49
(C) 純資産総額(A-B)	46,126,349,706
元本	29,451,990,787
次期繰越損益金	16,674,358,919
(D) 受益権総口数	29,451,990,787口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,662円

(注) 当親ファンドの期首元本額は73,680,002,614円、期中追加設定元本額は2,227,827,185円、期中一部解約元本額は46,455,839,012円です。

<元本の内訳>

TMA世界バランスファンド35VA<適格機関投資家限定>	27,282,354,341円
TMA外国債券インデックスVA<適格機関投資家限定>	1,032,453,487円
東京海上セレクション・外国債券インデックス	904,888,016円
TMA世界バランスファンド55VA<適格機関投資家限定>	129,394,619円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	26,445,913円
LPS4資産分散ファンド(バランス型)	21,288,218円
LPS4資産分散ファンド(成長重視型)	16,142,594円
LPS4資産分散ファンド(積極型)	12,509,115円
東京海上・世界インデックス・バランス60<適格機関投資家限定>	9,632,752円
LPS4資産分散ファンド(安定重視型)	9,071,330円
LPS4資産分散ファンド(慎重型)	5,908,840円
東京海上・世界インデックス・バランス40<適格機関投資家限定>	1,901,562円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は15,662円です。

○損益の状況 (2016年11月11日~2017年11月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,015,204,807
受取利息	2,015,267,945
支払利息	△ 63,138
(B) 有価証券売買損益	6,570,340,735
売買益	9,082,031,617
売買損	△ 2,511,690,882
(C) 保管費用等	△ 8,428,665
(D) 当期損益金(A+B+C)	8,577,116,877
(E) 前期繰越損益金	29,836,857,747
(F) 追加信託差損益金	1,092,009,590
(G) 解約差損益金	△22,831,625,295
(H) 計(D+E+F+G)	16,674,358,919
次期繰越損益金(H)	16,674,358,919

(注) (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) (F)追加信託差損益金は、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です。

(注) (G)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。